

# 鹏华沪深 300 指数证券投资基金（LOF） 2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 08 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 2022 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	9
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>14</b>
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	20
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>47</b>
7.1 期末基金资产组合情况	47
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	57
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	58

7.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	59
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	59
7.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	59
7.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	59
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	59
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	59
7.12	投资组合报告附注	59
<b>§ 8</b>	<b>基金份额持有人信息</b>	<b>60</b>
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	60
8.2	期末上市基金前十名持有人	61
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	61
8.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	61
<b>§ 9</b>	<b>开放式基金份额变动</b>	<b>61</b>
<b>§ 10</b>	<b>重大事件揭示</b>	<b>62</b>
10.1	基金份额持有人大会决议	62
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	62
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	62
10.4	基金投资策略的改变	62
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	62
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	62
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	63
10.8	其他重大事件	64
<b>§ 11</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息</b>	<b>68</b>
11.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	68
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	68
<b>§ 12</b>	<b>备查文件目录</b>	<b>68</b>
12.1	备查文件目录	68
12.2	存放地点	69
12.3	查阅方式	69

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF)	
基金简称	鹏华沪深 300 指数 (LOF)	
场内简称	鹏华 300LOF	
基金主代码	160615	
基金运作方式	上市契约型开放式 (LOF)	
基金合同生效日	2009 年 4 月 3 日	
基金管理人	鹏华基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	1,645,303,418.94 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的 证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2009 年 5 月 8 日	
下属分级基金的基 金简称	鹏华沪深 300 指数 A 类 (LOF)	鹏华沪深 300 指数 C 类 (LOF)
下属分级基金的场 内简称	鹏华 300LOF	-
下属分级基金的交 易代码	160615	006939
报告期末下属分级 基金的份额总额	1,556,403,334.24 份	88,900,084.70 份

注：无。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	采用指数化投资方式，追求基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间的跟踪误差最小化，力争将日平均跟踪误差控制在 0.35% 以内，以实现沪深 300 指数的有效跟踪。
投资策略	本基金采用被动式指数投资方法，按照成份股在沪深 300 指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的

	变化进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或因某些特殊情况导致流动性不足时,或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整,并辅之以金融衍生产品投资管理,使跟踪误差控制在限定的范围之内。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%
风险收益特征	本基金属于采用指数化操作的股票型基金,其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金,为证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。

注:无。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		鹏华基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	高永杰	郭明
	联系电话	0755-81395402	010-66105799
	电子邮箱	xxpl@phfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4006788999	95588
传真		0755-82021126	010-66105798
注册地址		深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		518048	100140
法定代表人		何如	陈四清

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.phfund.com.cn">http://www.phfund.com.cn</a>
基金中期报告备置地点	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层鹏华基金管理有限公司

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据	报告期(2022 年 01 月 01 日-2022 年 06 月 30 日)
------------	--

和指标	鹏华沪深 300 指数 A 类 (LOF)	鹏华沪深 300 指数 C 类 (LOF)
本期已实现收益	-15,143,119.14	-596,152.15
本期利润	-18,909,185.31	6,708,643.70
加权平均基金份额本期利润	-0.0163	0.1462
本期加权平均净值利润率	-0.94%	10.34%
本期基金份额净值增长率	-7.80%	-7.90%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2022 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	897,873,681.52	23,164,750.27
期末可供分配基金份额利润	0.5769	0.2606
期末基金资产净值	2,454,277,015.76	115,293,636.83
期末基金份额净值	1.5769	1.2969
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2022 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	135.65%	70.99%

注：(1) 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益等未实现收益。

(2) 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(3) 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润期末余额和未分配利润中已实现部分的期末余额的孰低数。表中的“期末”均指报告期最后一日，即 6 月 30 日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

鹏华沪深 300 指数 A 类 (LOF)

第 7 页 共 69 页

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	9.89%	1.00%	9.13%	1.02%	0.76%	-0.02%
过去三个月	6.87%	1.33%	5.93%	1.36%	0.94%	-0.03%
过去六个月	-7.80%	1.36%	-8.71%	1.38%	0.91%	-0.02%
过去一年	-10.24%	1.17%	-13.38%	1.18%	3.14%	-0.01%
过去三年	41.06%	1.20%	16.76%	1.20%	24.30%	0.00%
自基金合同生效起至今	135.65%	1.41%	72.98%	1.39%	62.67%	0.02%

## 鹏华沪深 300 指数 C 类 (LOF)

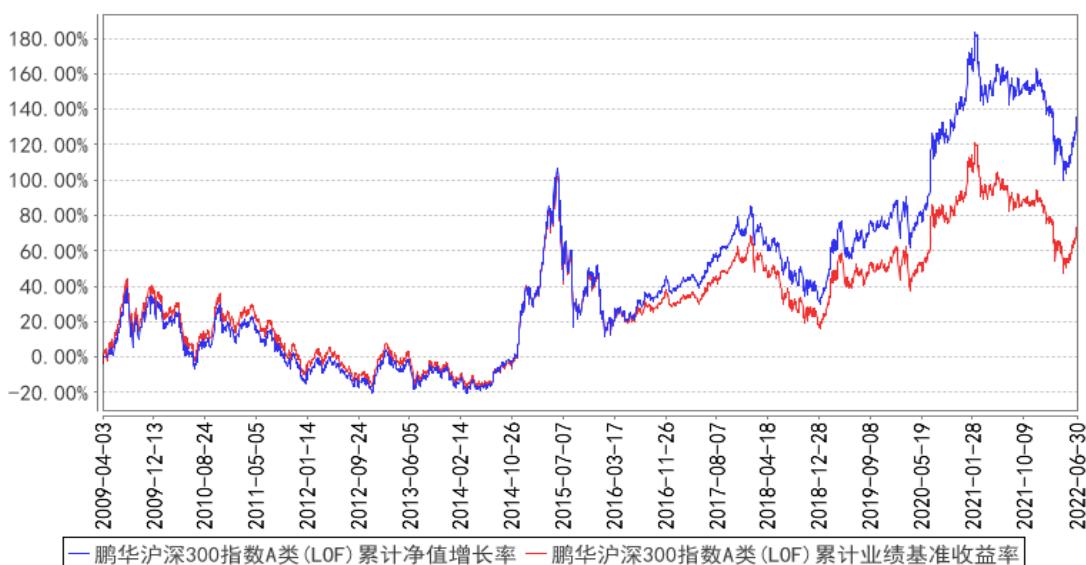
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	9.87%	1.00%	9.13%	1.02%	0.74%	-0.02%
过去三个月	6.80%	1.32%	5.93%	1.36%	0.87%	-0.04%
过去六个月	-7.90%	1.35%	-8.71%	1.38%	0.81%	-0.03%
过去一年	-10.48%	1.16%	-13.38%	1.18%	2.90%	-0.02%
过去三年	40.16%	1.20%	16.76%	1.20%	23.40%	0.00%
自基金合同生效起至今	70.99%	1.24%	39.05%	1.25%	31.94%	-0.01%

注：业绩比较基准=沪深 300 指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%

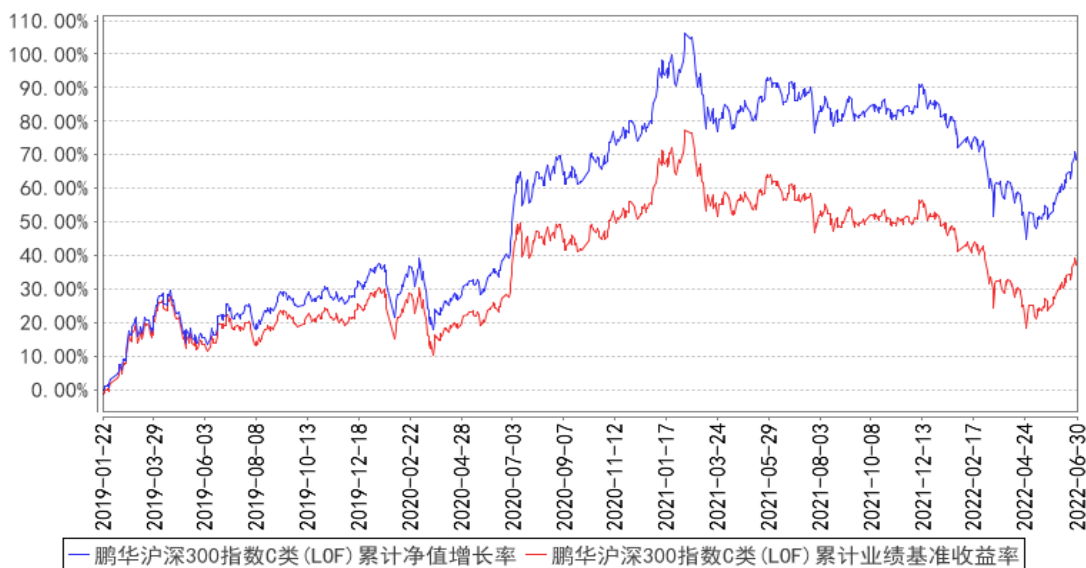


### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

鹏华沪深300指数A类 (LOF) 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



鹏华沪深300指数C类 (LOF) 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2009 年 04 月 03 日生效。2、截至建仓期结束，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

### 3.3 其他指标

注：无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

鹏华基金管理有限公司成立于 1998 年 12 月 22 日, 业务范围包括基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。截至本报告期末, 公司股东由国信证券股份有限公司、意大利欧利盛资本资产管理股份公司 (Eurizon Capital SGR S.p.A.)、深圳市北融信投资发展有限公司组成, 公司性质为中外合资企业, 公司注册资本 15,000 万元人民币。截至本报告期末, 公司管理资产总规模达到 11946.65 亿元, 267 只公募基金、13 只全国社保投资组合、4 只基本养老保险投资组合。经过 20 多年投资管理基金, 在基金投资、风险控制等方面积累了丰富经验。

#### 4.1.2 基金经理 (或基金经理小组) 及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张羽翔	基金经理	2016-09-24	-	15 年	张羽翔先生, 国籍中国, 工学硕士, 15 年证券从业经验。曾任招商银行软件中心 (原深圳市融博技术公司) 数据分析师; 2011 年 3 月加盟鹏华基金管理有限公司, 历任监察稽核部资深金融工程师、量化及衍生品投资部资深量化研究员, 先后从事金融工程、量化研究等工作; 现任量化及衍生品投资部基金经理。2015 年 09 月至 2020 年 06 月担任鹏华上证民营企业 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理, 2015 年 09 月至 2020 年 06 月担任上证民营企业 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2016 年 06 月至 2018 年 05 月担任鹏华新丝路指数分级证券投资基金基金经理, 2016 年 07 月至 2020 年 12 月担任鹏华中证高铁产业指数分级证券投资基金基金经理, 2016 年 09 月至今担任鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2016 年 09 月至今担任鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2016 年 11 月至 2020 年 12 月担任鹏华中证一带一路主题指数分级证券投资基金基金经理, 2016 年 11 月至 2020 年 07 月担任鹏华中证新能源指数分级证券投资基金基金经理, 2018 年 04 月至 2020 年 12 月担任鹏华中证移动互联网指数分级证券投资基金基

				<p>金经理, 2018 年 04 月至 2020 年 12 月担任鹏华创业板指数分级证券投资基金基金经理, 2018 年 05 月至 2018 年 08 月担任鹏华沪深 300 指数增强型证券投资基金基金经理, 2018 年 05 月至 2021 年 10 月担任鹏华港股通中证香港中小企业投资主题指数证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2018 年 05 月至 2020 年 12 月担任鹏华国证钢铁行业指数分级证券投资基金基金经理, 2019 年 04 月至今担任鹏华中证酒交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2019 年 07 月至今担任鹏华中证国防交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2019 年 11 月至今担任鹏华港股通中证香港银行投资指数证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2019 年 12 月至今担任鹏华中证银行交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2020 年 02 月至今担任鹏华中证 800 证券保险交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2020 年 03 月至今担任鹏华中证传媒交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2021 年 01 月至 2021 年 01 月担任鹏华国证钢铁行业指数型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2021 年 01 月至今担任鹏华中证传媒指数型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2021 年 01 月至今担任鹏华中证银行指数型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2021 年 01 月至今担任鹏华中证酒指数型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2021 年 01 月至今担任鹏华创业板指数型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2021 年 01 月至 2021 年 01 月担任鹏华中证高铁产业指数型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2021 年 01 月至 2021 年 01 月担任鹏华中证一带一路主题指数型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2021 年 01 月至 2021 年 01 月担任鹏华中证移动互联网指数型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2021 年 07 月至今担任鹏华中证港股通医药卫生综合交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2021 年 08 月至今担任鹏华中证港股通消费主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2021 年 08 月至今担任鹏华中证医药卫生指数证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2021 年 12 月至今担任鹏华中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金基金经理,</p>
--	--	--	--	---

					张羽翔先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理未发生变动。
--	--	--	--	--	----------------------------------

注：1. 任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日；担任新成立基金基金经理的，任职日期为基金合同生效日。

2. 证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

3. 苏俊杰 2022 年 08 月 03 日新任本基金基金经理，张羽翔 2022 年 08 月 03 日离任本基金基金经理。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规、中国证监会的有关规定以及基金合同的约定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合规，因市场波动等被动原因存在本基金投资比例不符合基金合同要求的情形，本基金管理人严格按照基金合同的约定及时进行了调整，不存在违反基金合同和损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行公平交易制度，确保不同投资组合在研究、交易、分配等各环节得到公平对待。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未发生违法违规且对基金财产造成损失的异常交易行为。本报告期内未发生基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金秉承指数基金的投资策略，在应对基金申购赎回的基础上，力争跟踪指数的收益，并将基金跟踪误差控制在合理范围内。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期 A 类份额净值增长率为-7.80%，同期业绩比较基准增长率为-8.71%，C 类份额净值增长率为-7.90%，同期业绩比较基准增长率为-8.71%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2022 年上半年，特别是一季度 A 股市场经历了较大幅度的调整，3 月以来受俄乌局势紧张、美联储加息、中概股暴跌及国内疫情多地扩散等利空叠加的影响，市场出现非理性下杀。4 月新冠疫情致使市场悲观情绪再起，A 股市场继续下行，5 月虽然海外美股继续下跌，但 A 股却走出独立行情。随着稳增长政策不断加码、疫情本身和复工复产边际向好，市场信心逐步恢复。6 月疫情已经得到有效控制，助企纾困措施不断出台，市场信心和情绪不断回升，沪深三大指数震荡上行。

下半年宏观经济环境和货币政策依旧是影响 A 股走势的重要因素。宏观经济方面，国内稳增长政策持续发力下，经济增速较二季度将显著改善。估值方面，整体仍处于历史偏低水平。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术。

本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本基金管理人设有估值委员会，由登记结算部、监察稽核部、各投资部门、研究部门负责人、基金经理等成员组成，估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规和基金估值运作等方面的专业能力。基金经理可与估值委员会成员共同商定估值原则和政策，但不参与日常估值的执行。

基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值发生重大变化的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

本基金管理人已与第三方定价服务机构签署服务协议，由其按约定提供相关参考数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1、截止本报告期末，本基金鹏华沪深 300 指数 A 类 (LOF) 期末可供分配利润为 897,873,681.52 元，期末基金份额净值 1.5769 元；鹏华沪深 300 指数 C 类 (LOF) 期末可供分配利润为 23,164,750.27 元，期末基金份额净值 1.2969 元。

2、本基金于 2022 年 06 月 27 日进行利润分配，鹏华沪深 300 指数 A 类 (LOF) 分配金额为 403,638,371.98 元，鹏华沪深 300 指数 C 类 (LOF) 分配金额为 16,977,700.06 元。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本基金的管理人——鹏华基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对鹏华基金管理有限公司编制和披露的本基金 2022 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

### § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：鹏华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	191,888,402.97	99,707,375.50
结算备付金		15,373,172.20	11,987,845.85
存出保证金		400,227.64	310,329.59
交易性金融资产	6.4.7.2	2,411,095,452.47	1,588,531,819.15
其中：股票投资		2,411,095,452.47	1,588,531,819.15
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-

衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		3,026,763.85	791,095.78
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	19,404.72
资产总计		2,621,784,019.13	1,701,347,870.59
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年6月30日</b>	<b>上年度末 2021年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		47,570,197.25	-
应付赎回款		705,481.66	2,228,719.08
应付管理人报酬		1,710,361.01	1,280,501.46
应付托管费		342,072.19	256,100.28
应付销售服务费		18,385.66	8,278.15
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	1,866,868.77	2,293,124.49
负债合计		52,213,366.54	6,066,723.46
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	1,645,303,418.94	850,448,810.69
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	924,267,233.65	844,832,336.44
净资产合计		2,569,570,652.59	1,695,281,147.13
负债和净资产总计		2,621,784,019.13	1,701,347,870.59

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额总额为 1,645,303,418.94 份，其中鹏华沪深 300 指数 A 类 (LOF) 基金份额总额为 1,556,403,334.24 份，基金份额净值 1.5769 元；鹏华沪深 300 指数 C 类 (LOF) 基金份额总额为 88,900,084.70 份，基金份额净值 1.2969 元。

## 6.2 利润表

会计主体：鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF)

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-2,753,693.83	25,246,655.60
1. 利息收入		373,238.85	63,200.09
其中：存款利息收入	6.4.7.13	373,238.85	63,200.09
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-6,932,535.31	49,170,755.67
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-32,037,028.86	45,227,030.22
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	25,104,493.55	3,943,725.45
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	3,538,729.68	-24,149,564.41
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	266,872.95	162,264.25
<b>减：二、营业总支出</b>		9,446,847.78	3,099,991.31
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	7,735,830.41	1,958,261.77
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,547,166.13	391,652.30
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	64,150.13	68,414.30
4. 投资顾问费	6.4.10.2.1.1	-	-
5. 利息支出		-	-



其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6. 4. 7. 22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	99, 701. 11	681, 662. 94
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-12, 200, 541. 61	22, 146, 664. 29
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-12, 200, 541. 61	22, 146, 664. 29
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-12, 200, 541. 61	22, 146, 664. 29

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：鹏华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	850, 448, 810. 69	-	844, 832, 336. 44	1, 695, 281, 147. 13
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	850, 448, 810. 69	-	844, 832, 336. 44	1, 695, 281, 147. 13
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	794, 854, 608. 25	-	79, 434, 897. 21	874, 289, 505. 46
（一）、综合收	-	-	-12, 200, 541. 61	-12, 200, 541. 61

益总额				
(二)、 本期基金份额 交易产生的基金 净值变动数 (净值减少以 “-”号 填列)	794,854,608.25	-	512,251,510.86	1,307,106,119.11
其中:1. 基金申购款	1,009,838,059.62	-	656,468,474.53	1,666,306,534.15
2 .基金赎回款	-214,983,451.37	-	-144,216,963.67	-359,200,415.04
(三)、 本期向基金份 额持有人分配 利润产生的基金 净值变动(净值 减少以“-” 号填列)	-	-	-420,616,072.04	-420,616,072.04
(四)、 其他综合收益 结转留存收益	-	-	-	-
四、本期 期末净资产(基 金净值)	1,645,303,418.94	-	924,267,233.65	2,569,570,652.59
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期 期末净资产(基	241,288,987.57	-	317,131,998.48	558,420,986.05

金净值)				
加:会计 政策变 更	-	-	-	-
前 期差 错 更 正	-	-	-	-
其 他	-	-	-	-
二、本 期 初 净 资 产 (基 金 净 值)	241,288,987.57	-	317,131,998.48	558,420,986.05
三、本 期 增 减 变 动 额 (减 少 以 “-” 号 填 列)	6,778,736.78	-	26,122,752.62	32,901,489.40
(一)、 综 合 收 益 总 额	-	-	22,146,664.29	22,146,664.29
(二)、 本 期 基 金 份 额 交 易 产 生 的 基 金 净 值 变 动 数 (净 值 减 少 以 “-” 号 填 列)	6,778,736.78	-	3,976,088.33	10,754,825.11
其中:1. 基 金 申 购 款	154,930,210.94	-	163,942,588.72	318,872,799.66
2 .基 金 赎 回 款	-148,151,474.16	-	-159,966,500.39	-308,117,974.55
(三)、 本 期 向 基 金 份 额 持 有 人 分 配 利 润 产 生 的 基	-	-	-	-

金净值变动(净值减少以“-”号填列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	248,067,724.35	-	343,254,751.10	591,322,475.45

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

邓召明

邢彪

郝文高

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) (以下简称“本基金”), 系经中国证券监督管理委员会 (以下简称“中国证监会”) 证监许可[2009]41 号文《关于核准鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 募集的批复》的核准, 由基金管理人鹏华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》的约定募集设立。本基金为上市契约型开放式, 存续期限为不定期, 首次设立募集不包括认购资金利息共募集 1,994,133,345.09 元, 业经普华永道中天会计师事务所有限公司验证并出具普华永道中天验字(2009)第 051 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华沪深 300 指数证券投资基金(LOF) 基金合同》于 2009 年 4 月 3 日正式生效, 基金合同生效日的基金份额总额为 1,994,428,997.48 份基金份额, 其中认购资金利息折合 295,652.39 份基金份额。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司, 基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2009]第 32 号文审核同意, 本基金 394,502,086.00 份基金份额于 2009 年 5 月 8 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外, 基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。 根

据鹏华基金管理有限公司《关于鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 和鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 新增 C 类基金份额并修改基金合同的公告》，本基金根据所收取费用的差异，将基金份额分为不同的类别，自 2019 年 1 月 22 日起增设 C 类基金份额，原有的基金份额转为 A 类基金份额。其中，在投资人申购基金时收取前端申购费用，且不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费，且不收取申购费用的基金份额，称为 C 类基金份额。C 类基金份额通过场外方式申购，不在交易所上市交易，亦不开通场内申购赎回方式。除经基金管理人另行公告，C 类基金份额持有人不能进行跨系统转登记。由于基金费用收取方式的不同，A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算并公告基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及其备选成份股（均含存托凭证），为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、存托凭证、债券（含国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券等）、债券回购、银行存款、货币市场工具、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可依据法律法规的规定，参与融资及转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：投资于标的指数成份股和备选成份股（均含存托凭证）的比例不低于基金资产净值的 90% 且不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率  $\times$  95% + 银行同业存款利率  $\times$  5%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2022 年上半年财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2022 年 06 月 30 日的财务状况以及 2022 年上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

除 6.4.5.1 会计政策变更的说明所声明的变更外，本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”），财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

#### (a) 金融工具

新金融工具准则改变了金融工具的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融工具的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、交易性金融资产-债券投资、交易性金融资产-资产支持证券投资、债权投资和卖出回购金融资产款等项目中，不单独列示应收利息或应付利息项目。

信用减值损失项目反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在利息收入项目中。其他项目的利息收入从利息收入项目调整至投资收益项目列示。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具，其投资收益包含期间交易费用的抵减。

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初

留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息、应付交易费用和其他负债，对其账面价值的影响金额分别为 13,870.62 元、5,394.50 元、139.60 元、-19,404.72 元、-2,092,850.55 元和 2,092,850.55 元。

(b) 修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	191,888,402.97
等于：本金	191,869,480.14
加：应计利息	18,922.83
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-



减：坏账准备	-
合计	191,888,402.97

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	2,365,045,922.97	-	2,411,095,452.47	46,049,529.50
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2,365,045,922.97	-	2,411,095,452.47	46,049,529.50

注：股票投资的成本、公允价值及公允价值变动均包含中国存托凭证的成本、公允价值及公允价值变动。

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

##### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

## 6.4.7.5 债权投资

## 6.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

## 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

## 6.4.7.6 其他债权投资

## 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

## 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

## 6.4.7.7 其他权益工具投资

## 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

## 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

## 6.4.7.8 其他资产

注：无。

## 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	923.81
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,766,766.01
其中：交易所市场	1,766,766.01
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	99,178.95
合计	1,866,868.77

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

鹏华沪深 300 指数 A 类 (LOF)

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	826,699,106.57	826,699,106.57
本期申购	894,312,142.78	894,312,142.78
本期赎回 (以“-”号填列)	-164,607,915.11	-164,607,915.11
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	1,556,403,334.24	1,556,403,334.24

## 鹏华沪深 300 指数 C 类 (LOF)

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	23,749,704.12	23,749,704.12
本期申购	115,525,916.84	115,525,916.84
本期赎回 (以“-”号填列)	-50,375,536.26	-50,375,536.26
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	88,900,084.70	88,900,084.70

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

## 6.4.7.11 其他综合收益

注：无。

## 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

## 鹏华沪深 300 指数 A 类 (LOF)

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	1,105,647,712.87	-276,232,301.57	829,415,411.30
本期利润	-15,143,119.14	-3,766,066.17	-18,909,185.31
本期基金份额交易产生的变动数	966,214,355.55	-475,208,528.04	491,005,827.51
其中：基金申购款	1,185,279,058.77	-574,490,598.56	610,788,460.21
基金赎回款	-219,064,703.22	99,282,070.52	-119,782,632.70
本期已分配利润	-403,638,371.98	-	-403,638,371.98
本期末	1,653,080,577.30	-755,206,895.78	897,873,681.52

## 鹏华沪深 300 指数 C 类 (LOF)

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	11,599,667.91	3,817,257.23	15,416,925.14
本期利润	-596,152.15	7,304,795.85	6,708,643.70
本期基金份额交易产	29,138,934.57	-7,893,251.22	21,245,683.35

生的变动数			
其中：基金申购款	53,329,253.22	-7,649,238.90	45,680,014.32
基金赎回款	-24,190,318.65	-244,012.32	-24,434,330.97
本期已分配利润	-16,977,700.06	-	-16,977,700.06
本期末	23,164,750.27	3,228,801.86	26,393,552.13

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
活期存款利息收入	222,240.01
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	30,992.64
其他	120,006.20
合计	373,238.85

注：其他包含认/申购款利息收入、结算保证金利息收入、风控金利息收入等

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-32,037,028.86
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-32,037,028.86

##### 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	787,572,190.25
减：卖出股票成本总额	816,455,195.37
减：交易费用	3,154,023.74
买卖股票差价收入	-32,037,028.86

##### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：无。

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

##### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

##### 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

##### 6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

##### 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

##### 6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 6.4.7.17 贵金属投资收益

##### 6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

##### 6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

##### 6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

##### 6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 6.4.7.18 衍生工具收益

##### 6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

## 6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

## 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	25,104,493.55
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	25,104,493.55

## 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	3,538,729.68
股票投资	3,538,729.68
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	3,538,729.68

## 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	266,510.78
基金转换费收入	362.17
合计	266,872.95

## 6.4.7.22 信用减值损失

注：无。

## 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

审计费用	39,671.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费用	522.16
合计	99,701.11

#### 6.4.7.24 分部报告

无。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
鹏华基金管理有限公司(“鹏华基金公司”)	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人、基金代销机构
国信证券股份有限公司(“国信证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
国信证券	282,699,650.89	11.76	152,722,260.95	41.02

##### 6.4.10.1.2 债券交易

注：无。

### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

### 6.4.10.1.4 权证交易

注：无。

### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
国信证券	263,281.36	12.43	253,678.24	14.36
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
国信证券	141,695.83	43.51	104,969.30	49.57

注：（1）佣金的计算公式

上海/深圳证券交易所的交易佣金=股票买（卖）成交金额×佣金比率-买（卖）经手费-买（卖）证管费等由券商承担的费用

（佣金比率按照与一般证券公司签订的协议条款订立。）

（2）本基金与关联方已按同业统一的基金佣金计算方式和约定的佣金比例签订了《证券交易席位租用协议》。根据协议规定，上述单位定期或不定期地为鹏华基金公司提供研究服务以及其他研究支持。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6 月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	7,735,830.41	1,958,261.77
其中：支付销售机构的客户维护费	313,949.96	485,113.19

注：1、支付基金管理人鹏华基金公司的管理人报酬年费率为0.75%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×0.75%÷当年天数。

2、根据《开放式证券投资基金销售费用管理规定》，基金管理人依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，客户维护费从基金管理费中列支。



## 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,547,166.13	391,652.30

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

## 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鹏华沪深 300 指数 A 类 (LOF)	鹏华沪深 300 指数 C 类 (LOF)	合计
国信证券	-	3.95	3.95
鹏华基金公司	-	33,642.84	33,642.84
合计	-	33,646.79	33,646.79
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鹏华沪深 300 指数 A 类 (LOF)	鹏华沪深 300 指数 C 类 (LOF)	合计
国信证券	-	-	-
鹏华基金公司	-	19,005.46	19,005.46
合计	-	19,005.46	19,005.46

注：鹏华沪深 300 指数 A 类 (LOF) 基金份额不支付销售服务费；支付基金销售机构的鹏华沪深 300 指数 C 类 (LOF) 基金份额的销售服务费年费率为 0.20%，逐日计提，按月支付，日销售服务费=前一日分类基金资产净值×0.20%÷当年天数。

## 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

## 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

## 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：无。

#### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：无。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：无。

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

鹏华沪深 300 指数 A 类 (LOF)

关联方名称	本期末 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例 (%)
国信证券	-	-	12,421,946.17	1.46

注：除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的费率标准与其他相同条件的投资者适用的费率标准相一致。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	191,888,402.97	222,240.01	35,789,893.01	54,658.10

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量 (单位： 张)	总金额
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量 (单位： 张)	总金额
国信证券	300957	贝泰妮	网下申购	3,021	142,983.93

国信证券	688323	瑞华泰	网下申购	4,513	26,942.61
国信证券	300986	志特新材	网下申购	2,632	38,927.28

注：无。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

于 2022 年 6 月 30 日，本基金持有 3,977,300.00 股基金托管人中国工商银行发行的 A 股普通股，成本总额为人民币 18,883,755.33 元，估值总额为人民币 18,971,721.00 元，占基金资产净值的比例为 0.74%；本基金持有 327,600.00 股国信证券发行的 A 股普通股，成本总额为人民币 3,455,001.21 元，估值总额为人民币 3,135,132.00 元，占基金资产净值的比例为 0.12%。（于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有 915,100.00 股基金托管人中国工商银行发行的 A 股普通股，成本总额为人民币 4,787,548.77 元，估值总额为人民币 4,731,067.00 元，占基金资产净值的比例为 0.80%；本基金持有 75,600.00 股国信证券发行的 A 股普通股，成本总额为人民币 912,280.03 元，估值总额为人民币 812,700.00 元，占基金资产净值的比例为 0.14%。）

#### 6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

鹏华沪深 300 指数 A 类 (LOF)								
序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2022 年 6 月 27 日	2022 年 6 月 28 日	2022 年 6 月 27 日	2.640	363,353,278.48	40,285,093.50	403,638,371.98	-
合计	-	-	-	2.640	363,353,278.48	40,285,093.50	403,638,371.98	-
鹏华沪深 300 指数 C 类 (LOF)								
序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2022 年 6 月 27 日	-	2022 年 6 月 27 日	2.170	3,728,624.08	13,249,075.98	16,977,700.06	-
合计	-	-	-	2.170	3,728,624.08	13,249,075.98	16,977,700.06	-

#### 6.4.12 期末 (2022 年 6 月 30 日) 本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注

301110	青木股份	2022年 3月4日	6个月	新股流 通受限	63.10	39.85	202	12,746.20	8,049.70	-
301112	信邦智能	2022年 6月20日	6个月	新股流 通受限	27.53	45.04	399	10,984.47	17,970.96	-
301116	益客食品	2022年 1月10日	6个月	新股流 通受限	11.40	20.46	577	6,577.80	11,805.42	-
301117	佳缘科技	2022年 1月7日	6个月	新股流 通受限	46.80	54.44	262	12,261.60	14,263.28	-
301120	新特电气	2022年 4月11日	6个月	新股流 通受限	13.73	15.49	1,032	14,169.36	15,985.68	-
301125	腾亚精工	2022年 5月27日	6个月	新股流 通受限	22.49	27.42	327	7,354.23	8,966.34	-
301135	瑞德智能	2022年 4月1日	6个月	新股流 通受限	31.98	26.26	338	10,809.24	8,875.88	-
301151	冠龙节能	2022年 3月30日	6个月	新股流 通受限	30.82	21.46	703	21,666.46	15,086.38	-
301153	中科江南	2022年 5月10日	6个月	新股流 通受限	33.68	43.98	398	13,404.64	17,504.04	-
301158	德石股份	2022年 1月7日	6个月	新股流 通受限	15.64	20.38	379	5,927.56	7,724.02	-
301160	翔楼新材	2022年 5月25日	6个月	新股流 通受限	31.56	37.66	392	12,371.52	14,762.72	-
301162	国能日新	2022年 4月19日	6个月	新股流 通受限	45.13	54.11	334	15,073.42	18,072.74	-
301163	宏德股份	2022年 4月11日	6个月	新股流 通受限	26.27	32.33	277	7,276.79	8,955.41	-
301175	中科环保	2022年 6月30日	1个月 内(含)	新股未 上市	3.82	3.82	57,324	218,977.68	218,977.68	-
301175	中科环保	2022年 6月30日	6个月	新股流 通受限	3.82	3.82	6,370	24,333.40	24,333.40	-

		日								
301187	欧圣电气	2022年4月13日	6个月	新股流通受限	21.33	22.54	876	18,685.08	19,745.04	-
301200	大族数控	2022年2月18日	6个月	新股流通受限	76.56	51.92	857	65,611.92	44,495.44	-
301206	三元生物	2022年1月26日	6个月	新股流通受限	109.30	45.69	945	68,859.00	43,177.05	三元生物于2022年6月17日实施权益分派方案,每10股派人民币10元,并转增5股。
301207	华兰疫苗	2022年2月10日	6个月	新股流通受限	56.88	56.42	569	32,364.72	32,102.98	-
301217	铜冠铜箔	2022年1月20日	6个月	新股流通受限	17.27	14.83	4,284	73,984.68	63,531.72	-
301219	腾远钴业	2022年3月10日	6个月	新股流通受限	173.98	87.82	556	53,759.82	48,827.92	腾远钴业于2022年5月24日实施权益分派方案,每10股派人民币39.9元,并转增8股。
301220	亚香股份	2022年6月15日	6个月	新股流通受限	35.98	39.15	285	10,254.30	11,157.75	-
301222	浙江恒威	2022年3月2日	6个月	新股流通受限	33.98	28.96	332	11,281.36	9,614.72	-
301228	实朴	2022年	6个月	新股流	20.08	20.34	373	7,489.84	7,586.82	-

	检测	1月21日		通受限							
301233	盛帮股份	2022年6月24日	1个月内(含)	新股未上市	41.52	41.52	1,418	58,875.36	58,875.36		-
301233	盛帮股份	2022年6月24日	6个月	新股流通受限	41.52	41.52	158	6,560.16	6,560.16		-
301238	瑞泰新材	2022年6月10日	6个月	新股流通受限	19.18	32.07	3,497	67,072.46	112,148.79		-
301239	普瑞眼科	2022年6月22日	1个月内(含)	新股未上市	33.65	33.65	5,172	174,037.80	174,037.80		-
301239	普瑞眼科	2022年6月22日	6个月	新股流通受限	33.65	33.65	575	19,348.75	19,348.75		-
301259	艾布鲁	2022年4月18日	6个月	新股流通受限	18.39	24.94	483	8,882.37	12,046.02		-
301266	宇邦新材	2022年5月30日	6个月	新股流通受限	26.86	47.07	517	13,886.62	24,335.19		-
301268	铭利达	2022年3月29日	6个月	新股流通受限	28.50	34.87	641	18,268.50	22,351.67		-
301286	侨源股份	2022年6月6日	6个月	新股流通受限	16.91	19.79	784	13,257.44	15,515.36		-
301288	清研环境	2022年4月14日	6个月	新股流通受限	19.09	19.98	452	8,628.68	9,030.96		-
301298	东利机械	2022年5月27日	6个月	新股流通受限	12.68	20.83	634	8,039.12	13,206.22		-
301302	华如科技	2022年6月16日	6个月	新股流通受限	52.03	56.42	466	24,245.98	26,291.72		-
688237	超卓航科	2022年6月24日	1个月内(含)	新股未上市	41.27	41.27	2,891	119,311.57	119,311.57		-
688262	国芯科技	2021年12月28日	6个月	新股流通受限	41.98	47.75	7,129	299,275.42	340,409.75		-

688281	华秦科技	2022年 2月28日	6个月	新股流 通受限	189.50	246.22	4,386	593,703.50	1,079,920.92	华秦科 技于 2022年6 月6日实 施权益 分派方 案,每10 股派人 民币3.5 元,并转 增4股。
688320	禾川科技	2022年 4月21日	6个月	新股流 通受限	23.66	46.21	6,048	143,095.68	279,478.08	-
688348	昱能科技	2022年 5月31日	6个月	新股流 通受限	163.00	416.57	5,644	919,972.00	2,351,121.08	-
688349	三一重能	2022年 6月15日	6个月	新股流 通受限	29.80	36.94	32,650	972,970.00	1,206,091.00	-
688400	凌云光	2022年 6月27日	1个月 内(含)	新股未 上市	21.93	21.93	13,111	287,524.23	287,524.23	-

注：1、根据中国证监会《关于修改〈上市公司证券发行管理办法〉的决定》、《关于修改〈创业板上市公司证券发行管理暂行办法〉的决定》以及《关于修改〈上市公司非公开发行股票实施细则〉的决定》，本基金所认购的2020年2月14日(含)后发行完毕的非公开发行股票，自发行结束之日起6个月内不得转让。此外，本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后6个月内，不得转让所受让的股份。

2、基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起约定限售期内不得转让。

3、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期为自发行人股票上市之日起6个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的科创板股票，在受让后6个月内不得转让。

4、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，本基金参与摇号配售或比例配售方式获配的创业板股票自发行人股票上市之日起在发行人约定的限售期内不得转让。

5、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为被动式指数基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股。

本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，力争实现基金净值增长率与标的指数增长率间的高度正相关，并保持跟踪误差在合同约定的范围内。

本基金的基金管理人致力于全面内部控制体系的建设，建立了从董事会层面到各业务部门的风险管理组织架构。本基金的基金管理人在董事会下设风险控制和合规审计委员会，主要负责制定基金管理人风险控制战略和控制政策、协调突发重大风险等事项；督察长负责对基金管理人各业务环节合法合规运作进行监督检查，组织、指导基金管理人内部监察稽核工作，并可向董事会和中国证监会直接报告；在公司内部设立独立的监察稽核部，专职负责对基金管理人各部门、各业务的风险控制情况进行督促和检查，并适时提出整改建议。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，



及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行股份有限公司及其他具有基金托管资格的银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。

本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券（2021 年 12 月 31 日：未持有）。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

##### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

##### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：无。

##### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

##### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时或于约定开放日要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理职能部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短期内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大部分证券均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，因此除附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2022 年 6 月 30 日，本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

#### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注“期末本基金持有的流通受限证券”。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流

动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金持有的利率敏感性资产为银行存款、结算备付金，其余金融资产和金融负债均不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	191,888,402.97	-	-	-	191,888,402.97
结算备付金	15,373,172.20	-	-	-	15,373,172.20
存出保证金	400,227.64	-	-	-	400,227.64
交易性金融资产	-	-	-2,411,095,452.47	-	2,411,095,452.47
应收申购款	-	-	-	3,026,763.85	3,026,763.85
资产总计	207,661,802.81	-	-2,414,122,216.32	-	2,621,784,019.13
负债					
应付赎回款	-	-	-	705,481.66	705,481.66
应付管理人报酬	-	-	-	1,710,361.01	1,710,361.01
应付托管费	-	-	-	342,072.19	342,072.19
应付清算款	-	-	-	47,570,197.25	47,570,197.25
应付销售服务费	-	-	-	18,385.66	18,385.66
其他负债	-	-	-	1,866,868.77	1,866,868.77
负债总计	-	-	-	52,213,366.54	52,213,366.54
利率敏感度缺口	207,661,802.81	-	-2,361,908,849.78	-	2,569,570,652.59
上年度末 2021年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					

银行存款	99,707,375.50	-	-	-	99,707,375.50
结算备付金	11,987,845.85	-	-	-	11,987,845.85
存出保证金	310,329.59	-	-	-	310,329.59
交易性金融资产	-	-	-	-1,588,531,819.15	1,588,531,819.15
应收申购款	-	-	-	791,095.78	791,095.78
其他资产	-	-	-	19,404.72	19,404.72
资产总计	112,005,550.94	-	-	-1,589,342,319.65	1,701,347,870.59
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	2,228,719.08	2,228,719.08
应付管理人报酬	-	-	-	1,280,501.46	1,280,501.46
应付托管费	-	-	-	256,100.28	256,100.28
应付销售服务费	-	-	-	8,278.15	8,278.15
其他负债	-	-	-	2,293,124.49	2,293,124.49
负债总计	-	-	-	6,066,723.46	6,066,723.46
利率敏感度缺口	112,005,550.94	-	-	-1,583,275,596.19	1,695,281,147.13

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2022 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资和资产支持证券公允价值占基金资产净值的比例为 0.00%。因此当利率发生合理、可能的变动时，对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无。

##### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于标的指数成份券和备选成份券，所面临的其他价格风险来源于标的指数成份券和备选成份券证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金为被动式指数基金，原则上采用完全复制的方法，按照个券在标的指数中的基准权重构建投资组合。基金所构建的指数化投资组合将根据标的指数成份券及其权重的变动而进行相应

调整。同时，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、新股增发等变化，对基金投资组合进行相应调整，以保证基金份额净值增长率与标的指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。

本基金主要投资于指数的成份股及其备选成份股，其投资比例不低于基金资产净值的 90%。

此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日		上年度末 2021年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	2,411,095,452.47	93.83	1,588,531,819.15	93.70
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	2,411,095,452.47	93.83	1,588,531,819.15	93.70

注：债券投资为可转换债券、可交换债券投资。

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准外的其他市场变量保持不变		
相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）		
	本期末（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）	
分析	业绩比较基准上升 5%	120,371,537.22	80,305,467.94

	业绩比较基准下降 5%	-120,371,537.22	-80,305,467.94
--	----------------	-----------------	----------------

注：无。

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年6月30日
第一层次	2,404,246,274.75
第二层次	908,968.95
第三层次	5,940,208.77
合计	2,411,095,452.47

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票、债券和基金的公允价值应属第二层次还是第三层次。

## 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

## 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

## 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 7 投资组合报告

## 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	2,411,095,452.47	91.96
	其中：股票	2,411,095,452.47	91.96
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	207,261,575.17	7.91
8	其他各项资产	3,426,991.49	0.13
9	合计	2,621,784,019.13	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

## 7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	28,983,333.66	1.13
B	采矿业	67,127,446.34	2.61
C	制造业	1,433,583,711.70	55.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	59,872,773.73	2.33
E	建筑业	46,543,588.63	1.81
F	批发和零售业	6,148,633.84	0.24
G	交通运输、仓储和邮政业	63,185,294.62	2.46

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	73,207,320.70	2.85
J	金融业	485,737,933.85	18.90
K	房地产业	44,673,329.08	1.74
L	租赁和商务服务业	33,538,834.82	1.31
M	科学研究和技术服务业	36,348,699.15	1.41
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,215,321.00	0.05
Q	卫生和社会工作	20,829,519.28	0.81
R	文化、体育和娱乐业	2,835,600.00	0.11
S	综合	-	-
	合计	2,403,831,340.40	93.55

### 7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	6,126,482.47	0.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	681,299.13	0.03
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	7,586.82	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	255,357.10	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-



Q	卫生和社会工作	193,386.55	0.01
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	7,264,112.07	0.28

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

#### 7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	77,347	158,174,615.00	6.16
2	300750	宁德时代	159,155	84,988,770.00	3.31
3	600036	招商银行	1,522,955	64,268,701.00	2.50
4	601318	中国平安	1,231,585	57,502,703.65	2.24
5	601012	隆基绿能	687,139	45,784,071.57	1.78
6	000858	五粮液	220,297	44,484,573.21	1.73
7	002594	比亚迪	102,773	34,273,767.77	1.33
8	000333	美的集团	555,836	33,566,936.04	1.31
9	601166	兴业银行	1,650,352	32,842,004.80	1.28
10	300059	东方财富	1,199,663	30,471,440.20	1.19
11	600900	长江电力	1,290,630	29,839,365.60	1.16
12	601888	中国中免	110,834	25,816,563.62	1.00
13	603259	药明康德	232,485	24,176,115.15	0.94
14	600030	中信证券	1,108,036	24,000,059.76	0.93
15	600887	伊利股份	580,587	22,613,863.65	0.88
16	000568	泸州老窖	83,540	20,595,951.60	0.80
17	002415	海康威视	536,186	19,409,933.20	0.76
18	002475	立讯精密	562,509	19,007,179.11	0.74
19	601398	工商银行	3,977,300	18,971,721.00	0.74
20	600276	恒瑞医药	506,398	18,782,301.82	0.73
21	600438	通威股份	306,400	18,341,104.00	0.71
22	000651	格力电器	536,979	18,106,931.88	0.70
23	600809	山西汾酒	55,320	17,967,936.00	0.70
24	600309	万华化学	178,297	17,293,026.03	0.67
25	300760	迈瑞医疗	55,200	17,288,640.00	0.67
26	000725	京东方 A	4,312,605	16,991,663.70	0.66
27	002714	牧原股份	302,058	16,694,745.66	0.65
28	000001	平安银行	1,103,410	16,529,081.80	0.64
29	002142	宁波银行	449,384	16,092,441.04	0.63

30	000002	万科 A	772,632	15,838,956.00	0.62
31	601328	交通银行	3,118,200	15,528,636.00	0.60
32	002812	恩捷股份	61,000	15,277,450.00	0.59
33	601899	紫金矿业	1,634,906	15,253,672.98	0.59
34	002129	TCL 中环	255,600	15,052,284.00	0.59
35	000792	盐湖股份	492,900	14,767,284.00	0.57
36	002466	天齐锂业	117,500	14,664,000.00	0.57
37	603288	海天味业	157,812	14,259,892.32	0.55
38	600048	保利发展	815,581	14,240,044.26	0.55
39	603799	华友钴业	144,281	13,796,149.22	0.54
40	300124	汇川技术	209,435	13,795,483.45	0.54
41	300015	爱尔眼科	307,264	13,756,209.28	0.54
42	002460	赣锋锂业	91,400	13,591,180.00	0.53
43	600031	三一重工	674,607	12,858,009.42	0.50
44	601668	中国建筑	2,394,247	12,737,394.04	0.50
45	002304	洋河股份	68,650	12,573,247.50	0.49
46	300014	亿纬锂能	128,700	12,548,250.00	0.49
47	601088	中国神华	374,292	12,463,923.60	0.49
48	002352	顺丰控股	222,200	12,400,982.00	0.48
49	300498	温氏股份	577,200	12,288,588.00	0.48
50	600436	片仔癀	34,200	12,200,166.00	0.47
51	600690	海尔智家	429,546	11,795,333.16	0.46
52	600089	特变电工	430,000	11,777,700.00	0.46
53	002271	东方雨虹	228,800	11,776,336.00	0.46
54	300274	阳光电源	118,000	11,593,500.00	0.45
55	601816	京沪高铁	2,228,300	11,186,066.00	0.44
56	601288	农业银行	3,622,343	10,939,475.86	0.43
57	603986	兆易创新	75,784	10,777,242.64	0.42
58	600837	海通证券	1,096,113	10,752,868.53	0.42
59	600000	浦发银行	1,332,900	10,676,529.00	0.42
60	600016	民生银行	2,816,634	10,477,878.48	0.41
61	603501	韦尔股份	59,800	10,347,194.00	0.40
62	600406	国电南瑞	379,589	10,248,903.00	0.40
63	300122	智飞生物	90,800	10,079,708.00	0.39
64	601919	中远海控	718,840	9,991,876.00	0.39
65	688981	中芯国际	217,718	9,834,322.06	0.38
66	000625	长安汽车	564,792	9,782,197.44	0.38
67	600585	海螺水泥	272,331	9,607,837.68	0.37
68	600919	江苏银行	1,342,600	9,559,312.00	0.37
69	002709	天赐材料	153,000	9,495,180.00	0.37
70	601688	华泰证券	668,515	9,492,913.00	0.37
71	600104	上汽集团	531,407	9,464,358.67	0.37

72	601225	陕西煤业	440,149	9,322,355.82	0.36
73	000063	中兴通讯	361,400	9,226,542.00	0.36
74	601601	中国太保	389,079	9,155,028.87	0.36
75	002049	紫光国微	48,200	9,144,504.00	0.36
76	002241	歌尔股份	271,236	9,113,529.60	0.35
77	300142	沃森生物	181,900	8,802,141.00	0.34
78	002230	科大讯飞	211,078	8,700,635.16	0.34
79	600111	北方稀土	247,403	8,698,689.48	0.34
80	000661	长春高新	36,700	8,566,514.00	0.33
81	002459	晶澳科技	106,740	8,421,786.00	0.33
82	002371	北方华创	30,100	8,341,312.00	0.32
83	002179	中航光电	126,492	8,009,473.44	0.31
84	688599	天合光能	121,890	7,953,322.50	0.31
85	300450	先导智能	124,200	7,846,956.00	0.31
86	601988	中国银行	2,391,308	7,795,664.08	0.30
87	601211	国泰君安	512,000	7,782,400.00	0.30
88	002027	分众传媒	1,147,440	7,722,271.20	0.30
89	000100	TCL 科技	1,612,133	7,722,117.07	0.30
90	000338	潍柴动力	615,892	7,680,173.24	0.30
91	601169	北京银行	1,679,517	7,625,007.18	0.30
92	600660	福耀玻璃	182,325	7,623,008.25	0.30
93	601229	上海银行	1,128,758	7,393,364.90	0.29
94	601985	中国核电	1,069,200	7,334,712.00	0.29
95	600050	中国联通	2,119,302	7,332,784.92	0.29
96	600745	闻泰科技	85,000	7,234,350.00	0.28
97	601766	中国中车	1,380,776	7,180,035.20	0.28
98	601390	中国中铁	1,165,647	7,157,072.58	0.28
99	600893	航发动力	151,500	6,894,765.00	0.27
100	601669	中国电建	869,153	6,840,234.11	0.27
101	300347	泰格医药	59,600	6,821,220.00	0.27
102	603659	璞泰来	78,900	6,659,160.00	0.26
103	601658	邮储银行	1,234,700	6,655,033.00	0.26
104	000776	广发证券	336,040	6,283,948.00	0.24
105	600009	上海机场	109,647	6,216,984.90	0.24
106	600028	中国石化	1,518,095	6,193,827.60	0.24
107	600905	三峡能源	974,000	6,126,460.00	0.24
108	601009	南京银行	587,711	6,123,948.62	0.24
109	600019	宝钢股份	1,010,855	6,085,347.10	0.24
110	600010	包钢股份	2,585,114	6,075,017.90	0.24
111	600999	招商证券	421,474	6,073,440.34	0.24
112	600958	东方证券	593,936	6,064,086.56	0.24
113	600196	复星医药	136,891	6,035,524.19	0.23

114	601628	中国人寿	191,649	5,956,450.92	0.23
115	300896	爱美客	9,900	5,940,099.00	0.23
116	002410	广联达	108,400	5,901,296.00	0.23
117	601857	中国石油	1,103,573	5,848,936.90	0.23
118	002050	三花智控	211,717	5,817,983.16	0.23
119	600570	恒生电子	132,760	5,780,370.40	0.22
120	000895	双汇发展	196,668	5,762,372.40	0.22
121	002311	海大集团	94,200	5,652,942.00	0.22
122	601818	光大银行	1,877,124	5,650,143.24	0.22
123	600760	中航沈飞	89,160	5,389,722.00	0.21
124	300759	康龙化成	56,200	5,351,364.00	0.21
125	600346	恒力石化	239,760	5,332,262.40	0.21
126	002493	荣盛石化	345,250	5,313,397.50	0.21
127	300661	圣邦股份	28,600	5,205,772.00	0.20
128	601633	长城汽车	140,027	5,186,600.08	0.20
129	002074	国轩高科	113,300	5,166,480.00	0.20
130	600926	杭州银行	336,560	5,041,668.80	0.20
131	300496	中科创达	38,600	5,036,528.00	0.20
132	600460	士兰微	96,600	5,023,200.00	0.20
133	300316	晶盛机电	73,200	4,947,588.00	0.19
134	300782	卓胜微	36,600	4,941,000.00	0.19
135	600426	华鲁恒升	168,800	4,928,960.00	0.19
136	000538	云南白药	81,571	4,926,072.69	0.19
137	688012	中微公司	41,750	4,874,312.50	0.19
138	002821	凯莱英	16,800	4,855,200.00	0.19
139	001979	招商蛇口	359,645	4,830,032.35	0.19
140	002001	新和成	210,672	4,805,428.32	0.19
141	601989	中国重工	1,293,800	4,799,998.00	0.19
142	000768	中航西飞	157,359	4,766,404.11	0.19
143	600176	中国巨石	272,694	4,747,602.54	0.18
144	002920	德赛西威	31,500	4,662,000.00	0.18
145	000596	古井贡酒	18,600	4,643,676.00	0.18
146	002202	金风科技	313,156	4,634,708.80	0.18
147	601939	建设银行	762,253	4,619,253.18	0.18
148	603993	洛阳钼业	802,200	4,596,606.00	0.18
149	000963	华东医药	99,174	4,478,697.84	0.17
150	600763	通策医疗	25,500	4,448,220.00	0.17
151	601006	大秦铁路	674,831	4,447,136.29	0.17
152	601138	工业富联	450,900	4,436,856.00	0.17
153	000166	申万宏源	1,023,100	4,389,099.00	0.17
154	600584	长电科技	161,800	4,368,600.00	0.17
155	601877	正泰电器	121,900	4,361,582.00	0.17

156	601066	中信建投	149,400	4,319,154.00	0.17
157	300207	欣旺达	136,500	4,313,400.00	0.17
158	601377	兴业证券	608,310	4,288,585.50	0.17
159	600588	用友网络	195,245	4,238,768.95	0.16
160	601600	中国铝业	890,417	4,229,480.75	0.16
161	600029	南方航空	574,954	4,202,913.74	0.16
162	600600	青岛啤酒	40,200	4,177,584.00	0.16
163	600383	金地集团	307,459	4,132,248.96	0.16
164	601186	中国铁建	522,193	4,125,324.70	0.16
165	600085	同仁堂	77,919	4,120,356.72	0.16
166	600741	华域汽车	179,112	4,119,576.00	0.16
167	688111	金山办公	20,889	4,117,639.68	0.16
168	600188	兖矿能源	103,800	4,098,024.00	0.16
169	601838	成都银行	246,100	4,080,338.00	0.16
170	600132	重庆啤酒	27,600	4,046,160.00	0.16
171	000786	北新建材	115,300	3,991,686.00	0.16
172	603806	福斯特	60,560	3,967,891.20	0.15
173	600795	国电电力	1,011,343	3,954,351.13	0.15
174	601111	中国国航	339,051	3,936,382.11	0.15
175	300408	三环集团	130,500	3,928,050.00	0.15
176	601117	中国化学	416,700	3,921,147.00	0.15
177	000876	新希望	255,700	3,912,210.00	0.15
178	688005	容百科技	30,180	3,906,499.20	0.15
179	600150	中国船舶	203,200	3,856,736.00	0.15
180	603019	中科曙光	132,820	3,854,436.40	0.15
181	300751	迈为股份	7,800	3,829,020.00	0.15
182	601238	广汽集团	250,900	3,823,716.00	0.15
183	600547	山东黄金	205,224	3,808,957.44	0.15
184	003816	中国广核	1,338,800	3,748,640.00	0.15
185	601800	中国交建	400,230	3,714,134.40	0.14
186	300999	金龙鱼	67,800	3,662,556.00	0.14
187	600989	宝丰能源	249,600	3,656,640.00	0.14
188	601100	恒立液压	59,236	3,656,045.92	0.14
189	603369	今世缘	71,400	3,641,400.00	0.14
190	600015	华夏银行	698,597	3,639,690.37	0.14
191	300763	锦浪科技	16,900	3,599,700.00	0.14
192	600886	国投电力	338,540	3,554,670.00	0.14
193	601788	光大证券	225,000	3,546,000.00	0.14
194	002648	卫星化学	136,600	3,531,110.00	0.14
195	600011	华能国际	498,700	3,510,848.00	0.14
196	688396	华润微	59,303	3,503,028.21	0.14
197	601868	中国能建	1,471,800	3,488,166.00	0.14

198	000157	中联重科	563,738	3,472,626.08	0.14
199	300601	康泰生物	76,300	3,447,234.00	0.13
200	000301	东方盛虹	202,400	3,422,584.00	0.13
201	600115	中国东航	621,383	3,411,392.67	0.13
202	603185	上机数控	21,700	3,384,983.00	0.13
203	000425	徐工机械	622,140	3,353,334.60	0.13
204	002236	大华股份	203,925	3,348,448.50	0.13
205	300595	欧普康视	58,100	3,322,739.00	0.13
206	002601	龙佰集团	162,500	3,258,125.00	0.13
207	002555	三七互娱	151,200	3,209,976.00	0.12
208	603486	科沃斯	26,100	3,181,329.00	0.12
209	000938	紫光股份	163,359	3,169,164.60	0.12
210	002008	大族激光	95,586	3,166,764.18	0.12
211	601916	浙商银行	948,600	3,149,352.00	0.12
212	603833	欧派家居	20,840	3,140,171.20	0.12
213	601901	方正证券	467,538	3,137,179.98	0.12
214	002736	国信证券	327,600	3,135,132.00	0.12
215	603392	万泰生物	20,121	3,124,791.30	0.12
216	300628	亿联网络	41,000	3,122,150.00	0.12
217	600941	中国移动	51,200	3,097,600.00	0.12
218	688008	澜起科技	50,783	3,076,434.14	0.12
219	000977	浪潮信息	115,800	3,066,384.00	0.12
220	601336	新华保险	94,800	3,051,612.00	0.12
221	000069	华侨城 A	464,999	3,017,843.51	0.12
222	600352	浙江龙盛	295,534	3,008,536.12	0.12
223	600219	南山铝业	815,000	3,007,350.00	0.12
224	603290	斯达半导	7,700	2,971,430.00	0.12
225	601995	中金公司	66,600	2,963,034.00	0.12
226	300454	深信服	28,300	2,936,974.00	0.11
227	603260	合盛硅业	24,600	2,901,816.00	0.11
228	002841	视源股份	37,700	2,839,564.00	0.11
229	601618	中国中冶	810,600	2,837,100.00	0.11
230	002007	华兰生物	124,373	2,835,704.40	0.11
231	300413	芒果超媒	85,000	2,835,600.00	0.11
232	600845	宝信软件	51,610	2,817,906.00	0.11
233	688126	沪硅产业-U	122,564	2,816,520.72	0.11
234	002120	韵达股份	164,617	2,808,366.02	0.11
235	300529	健帆生物	55,000	2,798,950.00	0.11
236	601799	星宇股份	16,200	2,770,200.00	0.11
237	601360	三六零	324,377	2,763,692.04	0.11
238	002252	上海莱士	459,100	2,722,463.00	0.11
239	300003	乐普医疗	143,500	2,664,795.00	0.10

240	000703	恒逸石化	249,790	2,625,292.90	0.10
241	603882	金域医学	31,800	2,625,090.00	0.10
242	601155	新城控股	102,800	2,614,204.00	0.10
243	300919	中伟股份	20,900	2,589,510.00	0.10
244	600332	白云山	79,535	2,512,510.65	0.10
245	601878	浙商证券	220,300	2,507,014.00	0.10
246	300433	蓝思科技	225,899	2,500,701.93	0.10
247	002602	世纪华通	507,826	2,447,721.32	0.10
248	600489	中金黄金	330,100	2,439,439.00	0.09
249	601021	春秋航空	41,600	2,427,360.00	0.09
250	600918	中泰证券	316,600	2,421,990.00	0.09
251	688036	传音控股	27,030	2,411,886.90	0.09
252	002938	鹏鼎控股	78,900	2,383,569.00	0.09
253	000066	中国长城	219,500	2,374,990.00	0.09
254	603899	晨光股份	42,098	2,360,855.84	0.09
255	300033	同花顺	24,400	2,346,060.00	0.09
256	688169	石头科技	3,787	2,335,442.90	0.09
257	300223	北京君正	21,900	2,326,875.00	0.09
258	000708	中信特钢	114,700	2,311,205.00	0.09
259	601728	中国电信	616,611	2,299,959.03	0.09
260	600183	生益科技	131,300	2,230,787.00	0.09
261	601865	福莱特	57,900	2,205,990.00	0.09
262	002916	深南电路	23,260	2,179,694.60	0.08
263	601898	中煤能源	208,100	2,160,078.00	0.08
264	600018	上港集团	369,783	2,155,834.89	0.08
265	600362	江西铜业	117,877	2,101,746.91	0.08
266	300957	贝泰妮	9,600	2,088,288.00	0.08
267	002414	高德红外	149,312	1,921,645.44	0.07
268	002791	坚朗五金	14,700	1,906,884.00	0.07
269	600161	天坛生物	78,100	1,896,268.00	0.07
270	601216	君正集团	383,126	1,869,654.88	0.07
271	600061	国投资本	291,824	1,856,000.64	0.07
272	601319	中国人保	362,600	1,834,756.00	0.07
273	002568	百润股份	59,720	1,793,988.80	0.07
274	000408	藏格矿业	54,000	1,778,760.00	0.07
275	600606	绿地控股	435,105	1,723,015.80	0.07
276	601966	玲珑轮胎	67,700	1,717,549.00	0.07
277	688561	奇安信-U	30,644	1,709,935.20	0.07
278	600655	豫园股份	176,900	1,669,936.00	0.06
279	601998	中信银行	348,051	1,653,242.25	0.06
280	603160	汇顶科技	26,100	1,616,373.00	0.06
281	002600	领益智造	320,900	1,610,918.00	0.06

282	688363	华熙生物	11,145	1,584,596.10	0.06
283	688065	凯赛生物	14,035	1,569,113.00	0.06
284	600025	华能水电	204,500	1,429,455.00	0.06
285	002064	华峰化学	168,900	1,425,516.00	0.06
286	601881	中国银河	146,300	1,414,721.00	0.06
287	603195	公牛集团	8,800	1,345,608.00	0.05
288	300866	安克创新	18,500	1,226,920.00	0.05
289	603087	甘李药业	25,500	1,223,235.00	0.05
290	002607	中公教育	209,900	1,215,321.00	0.05
291	002032	苏泊尔	18,400	1,036,656.00	0.04
292	000800	一汽解放	106,800	997,512.00	0.04
293	601236	红塔证券	108,510	990,696.30	0.04
294	605499	东鹏饮料	5,700	973,902.00	0.04
295	601808	中海油服	67,500	941,625.00	0.04
296	000877	天山股份	68,900	847,470.00	0.03
297	300979	华利集团	10,800	789,264.00	0.03
298	601825	沪农商行	109,900	689,073.00	0.03
299	601698	中国卫通	50,100	566,631.00	0.02
300	001289	龙源电力	17,200	374,272.00	0.01

### 7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	688348	昱能科技	5,644	2,351,121.08	0.09
2	688349	三一重能	32,650	1,206,091.00	0.05
3	688281	华秦科技	4,386	1,079,920.92	0.04
4	688262	国芯科技	7,129	340,409.75	0.01
5	688400	凌云光	13,111	287,524.23	0.01
6	301302	华如科技	4,651	282,999.62	0.01
7	688320	禾川科技	6,048	279,478.08	0.01
8	301175	中科环保	63,694	243,311.08	0.01
9	301239	普瑞眼科	5,747	193,386.55	0.01
10	301220	亚香股份	2,849	121,230.27	0.00
11	688237	超卓航科	2,891	119,311.57	0.00
12	301238	瑞泰新材	3,497	112,148.79	0.00
13	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.00
14	301217	铜冠铜箔	4,284	63,531.72	0.00
15	301219	腾远钴业	556	48,827.92	0.00
16	301200	大族数控	857	44,495.44	0.00
17	301206	三元生物	945	43,177.05	0.00
18	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.00
19	301207	华兰疫苗	569	32,102.98	0.00



20	301266	宇邦新材	517	24,335.19	0.00
21	301268	铭利达	641	22,351.67	0.00
22	301187	欧圣电气	876	19,745.04	0.00
23	301162	国能日新	334	18,072.74	0.00
24	301112	信邦智能	399	17,970.96	0.00
25	301153	中科江南	398	17,504.04	0.00
26	301120	新特电气	1,032	15,985.68	0.00
27	301286	侨源股份	784	15,515.36	0.00
28	301151	冠龙节能	703	15,086.38	0.00
29	301160	翔楼新材	392	14,762.72	0.00
30	301117	佳缘科技	262	14,263.28	0.00
31	301298	东利机械	634	13,206.22	0.00
32	301259	艾布鲁	483	12,046.02	0.00
33	301116	益客食品	577	11,805.42	0.00
34	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
35	301222	浙江恒威	332	9,614.72	0.00
36	301288	清研环境	452	9,030.96	0.00
37	301125	腾亚精工	327	8,966.34	0.00
38	301163	宏德股份	277	8,955.41	0.00
39	301135	瑞德智能	338	8,875.88	0.00
40	301110	青木股份	202	8,049.70	0.00
41	301158	德石股份	379	7,724.02	0.00
42	301228	实朴检测	373	7,586.82	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	89,562,948.17	5.28
2	300750	宁德时代	44,914,816.30	2.65
3	600036	招商银行	41,521,273.16	2.45
4	601318	中国平安	39,866,647.83	2.35
5	000858	五粮液	26,613,269.04	1.57
6	601166	兴业银行	24,487,013.98	1.44
7	601012	隆基绿能	23,294,857.87	1.37
8	000333	美的集团	22,636,603.08	1.34
9	600900	长江电力	20,997,319.77	1.24
10	300059	东方财富	19,477,540.20	1.15
11	000792	盐湖股份	18,908,882.00	1.12
12	002594	比亚迪	17,276,864.95	1.02
13	603259	药明康德	16,861,057.76	0.99
14	600030	中信证券	16,834,756.10	0.99

15	600887	伊利股份	16,579,303.28	0.98
16	002415	海康威视	15,788,146.00	0.93
17	601888	中国中免	13,954,382.72	0.82
18	300760	迈瑞医疗	13,755,046.00	0.81
19	601398	工商银行	13,383,943.00	0.79
20	600089	特变电工	12,849,062.25	0.76

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	31,462,207.47	1.86
2	300750	宁德时代	22,846,941.00	1.35
3	601318	中国平安	18,962,136.79	1.12
4	600036	招商银行	14,456,133.01	0.85
5	601012	隆基绿能	13,871,860.36	0.82
6	000858	五粮液	13,364,950.00	0.79
7	002594	比亚迪	11,050,276.66	0.65
8	601166	兴业银行	11,010,043.00	0.65
9	600887	伊利股份	10,925,618.00	0.64
10	000333	美的集团	10,553,162.00	0.62
11	600900	长江电力	10,188,524.04	0.60
12	300059	东方财富	9,872,585.92	0.58
13	603259	药明康德	7,896,893.60	0.47
14	600030	中信证券	7,862,603.91	0.46
15	601888	中国中免	6,718,695.06	0.40
16	601398	工商银行	6,326,990.00	0.37
17	002415	海康威视	6,194,725.00	0.37
18	002475	立讯精密	6,005,251.00	0.35
19	000651	格力电器	5,933,982.00	0.35
20	000568	泸州老窖	5,911,534.88	0.35

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,635,480,099.01
卖出股票收入（成交）总额	787,572,190.25

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：无。

**7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细**

注：无。

**7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细**

注：无。

**7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

注：无。

**7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

注：无。

**7.10 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目标，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，充分考虑股指期货的风险收益特征，通过多头或空头的套期保值策略，以改善投资组合的投资效果。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****7.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

**7.11.2 本期国债期货投资评价**

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

**7.12 投资组合报告附注****7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形**

招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。

兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到国家外汇管理局福建省分局、中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会的处罚。

以上证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

**7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库**

本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券备选库。

**7.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	400,227.64
2	应收清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	-
5	应收申购款	3,026,763.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,426,991.49

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

##### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688348	昱能科技	2,351,121.08	0.09	新股流通受限
2	688349	三一重能	1,206,091.00	0.05	新股流通受限
3	688281	华秦科技	1,079,920.92	0.04	新股流通受限
4	688262	国芯科技	340,409.75	0.01	新股流通受限
5	688400	凌云光	287,524.23	0.01	新股未上市

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
鹏华沪深 300 指数 A 类 (LOF)	24,182	64,362.06	1,399,101,126.01	89.89	157,302,208.23	10.11
鹏华沪深	3,351	26,529.42	66,984,488.70	75.35	21,915,596.00	24.65

300 指数 C 类 (LOF)						
合计	27,533	59,757.51	1,466,085,614.71	89.11	179,217,804.23	10.89

## 8.2 期末上市基金前十名持有人

鹏华沪深 300 指数 A 类 (LOF)

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	宁波航发贸易有限公司	869,380.00	17.42
2	欧静虹	208,300.00	4.17
3	李宏英	198,013.00	3.97
4	尹石菘	145,515.00	2.92
5	朱洪宏	116,200.00	2.33
6	屈丹耘	110,008.00	2.20
7	洪恒敏	101,916.00	2.04
8	彭世华	100,000.00	2.00
8	袁忠东	100,000.00	2.00
10	韩瑛	92,004.00	1.84

注：持有人为场内持有人。

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	鹏华沪深 300 指数 A 类 (LOF)	34,818.18	0.0022
	鹏华沪深 300 指数 C 类 (LOF)	50,126.66	0.0564
	合计	84,944.84	0.0052

注：截至本报告期末，本基金管理人从业人员投资、持有本基金符合相关法律法规、中国证监会规定及相关管理制度的规定。

## 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

注：截止本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人及本基金的基金经理未持有本基金份额。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	鹏华沪深 300 指数 A 类 (LOF)	鹏华沪深 300 指数 C 类 (LOF)
基金合同生效日 (2009 年 4 月 3 日)	1,994,428,997.48	-

基金份额总额		
本报告期期初基金份额总额	826,699,106.57	23,749,704.12
本报告期基金总申购份额	894,312,142.78	115,525,916.84
减：本报告期基金总赎回份额	164,607,915.11	50,375,536.26
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,556,403,334.24	88,900,084.70

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金基金份额持有人大会已通过通讯方式召开，大会投票表决时间自 2022 年 4 月 22 日起，至 2022 年 5 月 29 日 17:00 止。本基金基金份额持有人大会于 2022 年 5 月 31 日表决通过了《关于鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 修改基金合同等相关事项的议案》，本次大会决议自该日起生效。详情请见本基金管理人于 2022 年 6 月 1 日在中国证监会规定媒介发布的《鹏华基金管理有限公司关于鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的，与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

无

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未改聘为本基金审计的会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、基金托管人涉及托管业务机构及其高级管理人员在报告期内未受到任何稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

## 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中泰证券	1	525,005,748.28	21.84	479,635.10	22.65	-
中金公司	1	348,392,512.72	14.49	318,175.11	15.03	-
申万宏源证券	2	299,851,488.82	12.47	243,838.59	11.51	-
国元证券	1	290,495,358.36	12.09	238,179.08	11.25	-
国信证券	2	282,699,650.89	11.76	263,281.36	12.43	-
国盛证券	1	279,796,062.21	11.64	228,895.62	10.81	-
国泰君安	1	245,077,738.21	10.20	225,019.32	10.63	-
兴业证券	1	131,418,533.68	5.47	119,761.57	5.66	-
华西证券	1	637,615.74	0.03	517.30	0.02	-
招商证券	1	321,385.02	0.01	292.88	0.01	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-

注：交易单元选择的标准和程序：

1) 基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其交易单元作为基金的专用交易单元，选择的标准是：

- (1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，最近二年未发生因重大违规行为而受到中国证监会处罚；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；
- (6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨

询服务。

2) 选择交易单元的程序:

我公司根据上述标准, 选定符合条件的证券公司作为租用交易单元的对象。我公司投研部门定期对所选定证券公司的服务进行综合评比, 评比内容包括: 提供研究报告质量、数量、及时性 & 提供研究服务主动性和质量等情况, 并依据评比结果确定交易单元交易的具体情况。我公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后, 向券商租用交易单元作为基金专用交易单元。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位: 人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	鹏华基金管理有限公司关于暂停客服电话服务的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 01 月 01 日
2	鹏华基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 01 月 01 日
3	鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 恢复大额申购、转换转入和定期	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会	2022 年 01 月 06 日



	定额投资业务的公告	基金电子披露网站	
4	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与浙商银行股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 01 月 17 日
5	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与平安银行股份有限公司行 E 通平台申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 01 月 19 日
6	鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 2021 年第 4 季度报告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 01 月 21 日
7	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 01 月 21 日
8	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与民生证券股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 01 月 24 日
9	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与第一创业证券股份有限公司申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 02 月 10 日
10	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与北京雪球基金销售有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 02 月 21 日
11	鹏华基金管理有限公司关于鹏华沪深 300 指数证券投资基金 A 类 (LOF) 在直销渠道开展赎回费率优惠活动的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 02 月 23 日
12	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与财通证券股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 03 月 01 日
13	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中信建投证券股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 03 月 08 日
14	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与光大证券股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 03 月 14 日
15	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与宁波银行股份有限公司易管	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会	2022 年 03 月 15 日

	家平台申购（不含定期定额申购）费率优惠活动的公告	基金电子披露网站	
16	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国光大银行股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 03 月 22 日
17	鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 2021 年年度报告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 03 月 30 日
18	鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 更新的招募说明书	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 04 月 13 日
19	鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (A 类基金份额) (LOF) 基金产品资料概要 (更新)	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 04 月 13 日
20	鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (C 类基金份额) (LOF) 基金产品资料概要 (更新)	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 04 月 13 日
21	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与广发证券股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 04 月 19 日
22	鹏华基金管理有限公司关于以通讯方式召开鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金份额持有人大会的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 04 月 20 日
23	鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 2022 年第 1 季度报告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 04 月 21 日
24	鹏华基金管理有限公司关于以通讯方式召开鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金份额持有人大会的第一次提示性公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 04 月 21 日
25	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与宁波银行股份有限公司易管家平台申购（不含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 04 月 21 日
26	鹏华基金管理有限公司关于以通讯方式召开鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金份额持有人大会的第二次提示性公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 04 月 22 日
27	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与西部证券股份有限公司定期定额申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 04 月 25 日
28	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金	《上海证券报》、基金管	2022 年 04 月 27 日

	持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	理人网站及中国证监会基金电子披露网站	
29	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与江苏张家港农村商业银行股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 04 月 28 日
30	鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 暂停大额申购、转换转入和定期定额投资业务的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 04 月 29 日
31	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 04 月 30 日
32	鹏华基金管理有限公司关于终止北京植信基金销售有限公司办理本公司旗下基金相关销售业务的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 05 月 06 日
33	鹏华基金管理有限公司关于终止北京唐鼎耀华基金销售有限公司办理本公司旗下基金相关销售业务的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 05 月 13 日
34	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与北京度小满基金销售有限公司相关费率优惠活动的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 05 月 30 日
35	鹏华基金管理有限公司关于鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 停牌提示性公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 05 月 31 日
36	鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 06 月 01 日
37	鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 托管协议	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 06 月 01 日
38	鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 招募说明书	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 06 月 01 日
39	鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (A 类基金份额) (LOF) 基金产品资料概要 (更新)	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 06 月 01 日
40	鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (C 类基金份额) (LOF) 基金产品资料概要 (更新)	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 06 月 01 日
41	鹏华基金管理有限公司关于鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 06 月 01 日
42	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分	《上海证券报》、基金管	2022 年 06 月 06 日

	基金参与上海好买基金销售有限公司申购(含定期定额申购)费率优惠活动的公告	理人网站及中国证监会基金电子披露网站	
43	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中航证券有限公司申购(含定期定额申购)费率优惠活动的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 06 月 18 日
44	鹏华基金管理有限公司关于鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 2022 年第 1 次分红公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 06 月 23 日
45	鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 恢复大额申购、转换转入和定期定额投资业务的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 06 月 27 日

注：无。

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20220101~20220630	372,139,018.56	0.00	0.00	372,139,018.56	22.62
产品特有风险							
基金份额持有人持有的基金份额所占比例过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引起基金净值剧烈波动，甚至可能引发基金流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。							

注：1、申购份额包含基金申购份额、基金转换入份额、强制调增份额、场内买入份额和红利再投；  
2、赎回份额包含基金赎回份额、基金转换出份额、强制调减份额、场内卖出份额。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

(一)《鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》；

(二)《鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 托管协议》;

(三)《鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 2022 年中期报告》(原文)。

## 12.2 存放地点

深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层鹏华基金管理有限公司。

## 12.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件,或通过本基金管理人网站 (<http://www.phfund.com.cn>) 查阅。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人鹏华基金管理有限公司,本公司已开通客户服务系统,咨询电话:4006788999。

鹏华基金管理有限公司

2022 年 8 月 30 日