

鹏华国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资 资基金 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：华泰证券股份有限公司

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。

基金托管人华泰证券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

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
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	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
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	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48

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	48
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	48
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	49
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	49
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	49
7.12 投资组合报告附注	49
§ 8 基金份额持有人信息.....	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
8.2 期末上市基金前十名持有人	50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51
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	51
§ 9 开放式基金份额变动.....	51
§ 10 重大事件揭示	51
10.1 基金份额持有人大会决议	51
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	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	51
10.4 基金投资策略的改变	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	51
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	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	52
10.8 其他重大事件	53
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	54
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	54
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	54
§ 12 备查文件目录	54
12.1 备查文件目录	54
12.2 存放地点	54
12.3 查阅方式	54

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	ESGETF
场内简称	ESGETF
基金主代码	159717
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 9 月 15 日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	华泰证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	57,873,183.00 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	2021 年 9 月 29 日

注：无。

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争将日均跟踪偏离度控制在 0.2% 以内，年跟踪误差控制在 2% 以内。
投资策略	<p>本基金采用被动式指数化投资方法，按照成份股在标的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。</p> <p>当预期成份股发生调整或成份股发生配股、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，力求降低跟踪误差。</p> <p>本基金力争将日均跟踪偏离度控制在 0.2% 以内，年跟踪误差控制在 2% 以内。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。</p> <p>1、股票投资策略</p> <p>(1) 股票投资组合的构建</p> <p>本基金在建仓期内，将按照标的指数各成份股的基准权重对其逐步买入，在力求跟踪误差最小化的前提下，本基金可采取适当方法，以降低买入成本。当遇到成份股停牌、流动性不足等其他市场因素而无法依指数权重购买某成份股及预期标的指数的成份股即将调整或其他影响指数复制的因素时，本基金可以根据市场情况，结合研究分析，对基金财产进行适当调整，以期在规定的风险承受限度之</p>

内，尽量缩小跟踪误差。

(2) 股票投资组合的调整

本基金所构建的股票投资组合将根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，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，对其进行适时调整，以保证基金份额净值增长率与标的指数收益率间的高度正相关和跟踪误差最小化。基金管理人将对成份股的流动性进行分析，如发现流动性欠佳的个股将可能采用合理方法寻求替代。由于受到各项持股比例限制，基金可能不能按照成份股权重持有成份股，基金将会采用合理方法寻求替代。

1) 定期调整

根据标的指数的调整规则和备选股票的预期，对股票投资组合及时进行调整。

2) 不定期调整

根据指数编制规则，当标的指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重新调整时，本基金将根据各成份股的权重变化进行相应调整；

根据本基金的申购和赎回情况，对股票投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数；

根据法律、法规规定，成份股在标的指数中的权重因其它特殊原因发生相应变化的，本基金可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。

2、债券投资策略

本基金债券投资组合将采用自上而下的投资策略，根据宏观经济分析、资金面动向分析等判断未来利率变化，并利用债券定价技术，进行个券选择。

3、股指期货投资策略

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数，实现投资目标。同时，本基金将力争利用股指期货的杠杆作用，降低申购赎回时现金资产对投资组合的影响及仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，从而达到稳定投资组合资产净值的目的。基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项，同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。

4、资产支持证券的投资策略

本基金将综合运用战略资产配置和战术资产配置进行资产支持证券的投资组合管理，并根据信用风险、利率风险和流动性风险变化积极调整投资策略，严格遵守法律法规和基金合同的约定，在保证本金安全和基金资产流动性的基础上获得稳定收益。

5、融资及转融通投资策略

本基金可在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素基础上，参与融资业务。

为更好地实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎经营原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与转融通证券出借业务。本

	基金将在分析市场环境、投资者类型与结构、基金历史申赎情况、出借证券流动性情况等因素的基础上，合理确定出借证券的范围、期限和比例。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为国证 ESG300 指数收益率。
风险收益特征	本基金属于股票型基金，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。同时本基金为交易型开放式指数基金，具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。

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	华泰证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	高永杰	李欣然
	联系电话	0755-81395402	025-83388339
	电子邮箱	xxpl@phfund.com.cn	lixinran@htsc.com
客户服务电话		4006788999	95597
传真		0755-82021126	025-83387215
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	江苏省南京市江东中路 228 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	江苏省南京市江东中路 228 号
邮政编码		518048	210009
法定代表人		何如	张伟

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.phfund.com.cn
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 期间数据和指标	报告期(2022 年 1 月 1 日-2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-1,858,527.38
本期利润	-3,528,428.60
加权平均基金份额本期利润	-0.0631
本期加权平均净值利润率	-6.83%

本期基金份额净值增长率	-6.83%
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	-1,699,677.35
期末可供分配基金份额利润	-0.0294
期末基金资产净值	56,173,505.65
期末基金份额净值	0.9706
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	-2.94%

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

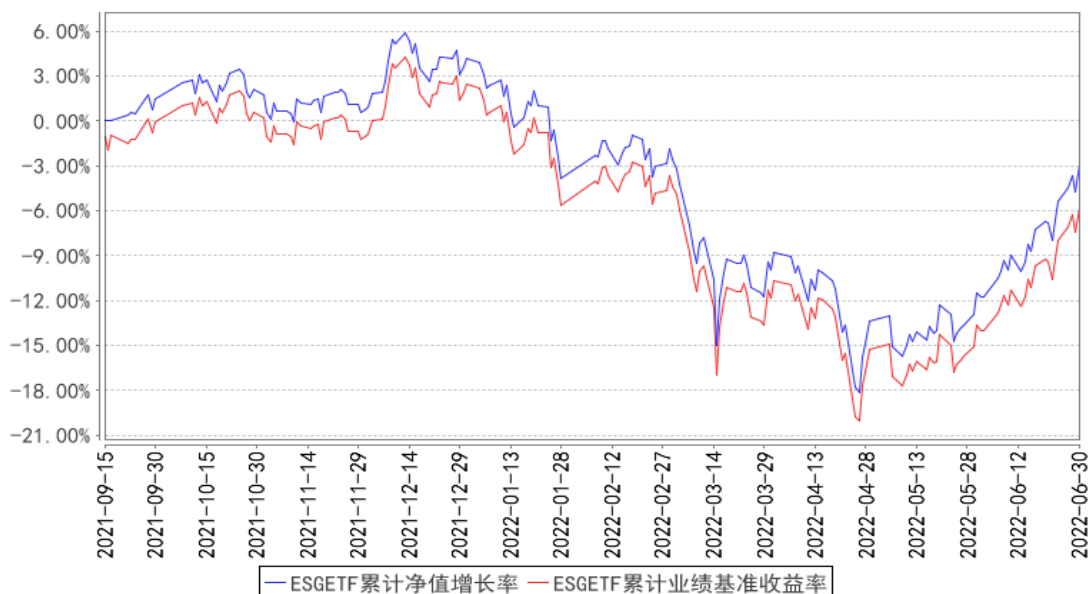
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	9.68%	0.99%	9.13%	1.02%	0.55%	-0.03%
过去三个月	7.75%	1.34%	6.83%	1.37%	0.92%	-0.03%
过去六个月	-6.83%	1.38%	-8.06%	1.42%	1.23%	-0.04%
自基金合同生效起至今	-2.94%	1.17%	-5.79%	1.21%	2.85%	-0.04%

注：业绩比较基准=本基金业绩比较基准为国证 ESG300 指数收益率。

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

ESGETF 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 2021 年 09 月 15 日生效，截至本报告期末本基金基金合同生效未满一年。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		
罗英宇	基金经理	2021-09-15	-	15 年	罗英宇先生，国籍中国，管理学硕士，15 年证券从业经验。曾任招商银行股份有限公司

				<p>公司高级程序员，博时基金管理有限公司信息技术部高级程序员。2008年6月加盟鹏华基金管理有限公司，历任信息技术部系统分析员、总经理助理、副总经理、量化及衍生品投资部金融科技副总监，现担任量化及衍生品投资部基金经理。2020年12月至2022年01月担任鹏华中证高股息龙头交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2020年12月至2022年03月担任鹏华中证高股息龙头交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2020年12月至今担任鹏华国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2021年01月至今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月至今担任鹏华中证信息技术指数型证券投资基金(LOF)基金经理，2021年01月至今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移动互联网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高铁产业指数型证券投资基金(LOF)基金经理，2021年08月至今担任鹏华国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2021年09月至今担任鹏华国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2021年11月至今担任鹏华中证云计算与大数据主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2022年01月至今担任鹏华中证工业互联网主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，罗英宇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。</p>
--	--	--	--	---

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。

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合规守信情况的说明

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，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

报告期内，本产品采用完全复制的方法跟踪国证 ESG300 指数，努力将跟踪误差控制在合理范围。在此基础上，认真应对投资者日常申购、赎回和成份股调整等工作，并通过遵从严格的风险、合规管理流程，确保了本基金的安全运作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期份额净值增长率为-6.83%，同期业绩比较基准增长率为-8.06%。

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 年上半年市场整体下行，上证指数累计下跌 6.63%，深证成指下跌 13.20%，创业板指下跌 15.41%。受海外流动性超预期收紧、俄乌冲突加剧通胀风险、国内疫情扰动等多重因素影响，全球风险资产宽幅震荡，二季度经济数据二次探底预期下，市场风险偏好情绪降至冰点。4 月底召开的政治局会议对国内经济形势释放出积极的政策信号，维护了资本市场的平稳运行，5 月份在消化了前期不利因素后，政策加码的必要性和紧迫性都在提升，市场开启修复行情，其中新能源产业链相关股持续上攻，带动 A 股三大股指走出独立行情，上半年的反弹程度均达两位数，尤其是创业板指的最大反弹达 34.93%。

展望下半年，海外来看，市场开始交易衰退。美国 PMI 指数由前月的 56.1 下行至 53，多数西方国家同样延续下行趋势，显示出经济衰退可能渐行渐近。预计四季度主要欧洲国家 PMI 可能降至荣枯线以下，经济衰退可能早于美国。国内维度上，政策宽松环境对资本市场“频送暖风”，海外流动性冲击对国内市场的影响将渐渐弱化，A 股节奏将更加凸显“以我为主”的特征。应择优布局鼓励发展的产业中的重点企业，比如在能源革命、新兴消费、数字经济等领域中的优质企

业。行业配置方面从周期转向消费与科技，重点关注硬科技、扩大内需战略下的大消费、双碳产业链、新老基建等行业。

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，本基金期末可供分配利润为-1,699,677.35元，期末基金份额净值0.9706元，不符合利润分配条件。

2、本基金本报告期内未进行利润分配。

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

本基金自2022年03月07日至2022年04月13日期间出现连续二十个（或以上）工作日基金资产净值低于五千万的情形。

§ 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

在本报告期内，本基金托管人—华泰证券股份有限公司严格遵守了基金合同和各项法律法规的相关规定，履行了基金托管人应尽的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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，华泰证券对基金管理人的投资运作行为依基金合同约定进行了监督，对本基金

资产净值计算、利润分配、费用开支等方面进行了复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

华泰证券作为基金托管人，复核了本基金 2022 年中期报告中的有关财务数据、收益分配、投资组合报告等内容，相关内容真实、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：鹏华国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金

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
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,778,448.44	2,200,046.71
结算备付金		46,108.07	70,248.76
存出保证金		67,365.26	497,734.75
交易性金融资产	6.4.7.2	54,485,506.41	57,622,921.10
其中：股票投资		54,485,506.41	57,622,921.10
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		-	288,910.93
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	1,446.82
资产总计		56,377,428.18	60,681,309.07
负债和净资产	附注号	本期末	上年度末

		2022年6月30日	2021年12月31日
负债：			
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		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		21,966.70	30,243.47
应付托管费		4,393.33	6,048.70
应付销售服务费		-	-
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	177,562.50	357,691.90
负债合计		203,922.53	393,984.07
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	57,873,183.00	57,873,183.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-1,699,677.35	2,414,142.00
净资产合计		56,173,505.65	60,287,325.00
负债和净资产总计		56,377,428.18	60,681,309.07

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.9706 元，基金份额总额 57,873,183.00 份。

6.2 利润表

会计主体：鹏华国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金

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 2022年1月1日至2022年6 月30日
一、营业总收入		-3,228,169.22
1. 利息收入		14,815.68
其中：存款利息收入	6.4.7.13	14,815.68
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）		-1,574,935.01

其中：股票投资收益	6.4.7.14	-2,226,369.27
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-
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	651,434.26
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	-1,669,901.22
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	1,851.33
减：二、营业总支出		300,259.38
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	128,309.64
2. 托管费	6.4.10.2.2	25,661.92
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
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	146,287.82
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-3,528,428.60
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-3,528,428.60
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-3,528,428.60

注：本基金合同于 2021 年 09 月 15 日生效，无上年度可比较期间及可比较数据。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：鹏华国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金

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)	57,873,183.00	-	2,414,142.00	60,287,325.00

加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期末期初净资产(基金净值)	57,873,183.00	-	2,414,142.00	60,287,325.00
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-	-	-4,113,819.35	-4,113,819.35
(一)、综合收益总额	-	-	-3,528,428.60	-3,528,428.60
(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)	-	-	-585,390.75	-585,390.75
其中:1.基金申购款	27,500,000.00	-	-2,939,511.29	24,560,488.71
2.基金赎回款	-27,500,000.00	-	2,354,120.54	-25,145,879.46
(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)	57,873,183.00	-	-1,699,677.35	56,173,505.65

注：本基金合同于 2021 年 09 月 15 日生效，无上年度可比较期间及可比较数据。

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

鹏华国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)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[2021]1106 号《关于准予鹏华国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》核准，由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《鹏华国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 360,358,000.00 元(含募集股票市值)，经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2021)第 0924 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《鹏华国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2021 年 9 月 15 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 360,373,183.00 份基金份额，其中利息折合的基金份额总额为 15,183.00 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，基金托管人为华泰证券股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2021]928 号文审核同意，本基金 360,373,183.00 份基金份额于 2021 年 9 月 29 日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基

金基金合同》的有关规定，本基金的标的指数为国证 ESG300 指数及其未来可能发生的变更，投资目标是紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化；主要投资范围为标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、债券（含国债、地方政府债、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）、货币市场工具、同业存单、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。本基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股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%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。本基金力争将日均跟踪偏离度控制在 0.2% 以内，年跟踪误差控制在 2% 以内。本基金的业绩比较基准为：国证 ESG300 指数。

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》、《鹏华国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》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相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 1,165.66 元、34.76 元、246.40 元、-1,446.82 元、-151,618.92 元和 151,618.92 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	1,778,448.44
等于：本金	1,777,677.23
加：应计利息	771.21
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	1,778,448.44

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	54,268,971.83	-	54,485,506.41	216,534.58
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	54,268,971.83	-	54,485,506.41	216,534.58	

注：股票投资的公允价值和股票投资的公允价值变动均含可退替代款估值增值。

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	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	26,124.00
其中：交易所市场	26,124.00
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	151,438.50
合计	177,562.50

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	57,873,183.00	57,873,183.00
本期申购	27,500,000.00	27,500,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-27,500,000.00	-27,500,000.00
- 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	57,873,183.00	57,873,183.00

注：投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购、赎回单位的整数倍。

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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	2,942,184.72	-528,042.72	2,414,142.00
本期利润	-1,858,527.38	-1,669,901.22	-3,528,428.60
本期基金份额交易产生的变动数	-44,290.49	-541,100.26	-585,390.75
其中：基金申购款	941,426.68	-3,880,937.97	-2,939,511.29
基金赎回款	-985,717.17	3,339,837.71	2,354,120.54
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,039,366.85	-2,739,044.20	-1,699,677.35

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	12,036.45
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	292.02
其他	2,487.21
合计	14,815.68

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	-1,295,596.66
股票投资收益——赎回差价收入	-930,772.61
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	-2,226,369.27

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	23,061,041.08
减：卖出股票成本总额	24,291,276.66
减：交易费用	65,361.08
买卖股票差价收入	-1,295,596.66

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
赎回基金份额对价总额	25,145,879.46
减：现金支付赎回款总额	17,183,641.46
减：赎回股票成本总额	8,893,010.61
减：交易费用	-
赎回差价收入	-930,772.61

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.14.5 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	651,434.26
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	651,434.26

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	-1,669,901.22
股票投资	-1,669,901.22
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	-1,669,901.22

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	-
替代损益	1,851.33
合计	1,851.33

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购(赎回)本基金时，补入(卖出)被替代成分证券的实际买入成本(实际卖出金额)与申购(赎回)确认日估值的差额或强制退款的被替代成分证券在强制退款计算日与申购(赎回)确认日估值的差额。

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	22,315.49
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
登记结算费	74,383.76
IOPV 计算和发布费	9,916.99
合计	146,287.82

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
华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）	基金托管人、基金的一级交易商
国信证券股份有限公司（“国信证券”）	基金管理人的股东、基金的一级交易商

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

本基金基金合同于 2021 年 09 月 15 日生效，截至本报告期末不满一年，无上年度可比期间数据。

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	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
华泰证券	38,264,874.52	81.42

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 (%)
华泰证券	31,209.15	81.35	19,909.29	76.21

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
当期发生的基金应支付的管理费	128,309.64
其中：支付销售机构的客户维护费	-

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0.50%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×0.50%÷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
	2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	25,661.92

注：支付基金托管人华泰证券的托管费按前一日基金资产净值0.10%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×0.10%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

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固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

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（%）
华泰证券	3,517,140.00	6.08	3,413,143.00	5.90

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	
	期末余额	当期利息收入
华泰证券	1,778,448.44	12,036.45

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。本基金在上年度可比期间未成立。

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20,500.00股华泰证券发行的A股普通股，成本总额为人民币333,344.42元，估值总额为人民币291,100.00元，占基金资产净值的比例为0.52%。（本基金基金合同于2021年9月15日生效，截至本报告期末不满一年，无上年度可比期间数据。）

6.4.11 利润分配情况

注：无。

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

注：无。

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

本基金为指数型基金。本基金主要投资于标的指数成份股，备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股(包含中小板，创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)，债券(含国债，地方政府债，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)，货币市场工具，同业存单，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。

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华泰证券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，本基金以非约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券；以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类，因此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%。

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	1,778,448.44	-	-	-	1,778,448.44
结算备付金	46,108.07	-	-	-	46,108.07
存出保证金	67,365.26	-	-	-	67,365.26
交易性金融资产	-	-	-	54,485,506.41	54,485,506.41
资产总计	1,891,921.77	-	-	54,485,506.41	56,377,428.18
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	21,966.70	21,966.70
应付托管费	-	-	-	4,393.33	4,393.33
其他负债	-	-	-	177,562.50	177,562.50
负债总计	-	-	-	203,922.53	203,922.53
利率敏感度缺口	1,891,921.77	-	-	54,281,583.88	56,173,505.65
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	2,200,046.71	-	-	-	2,200,046.71
结算备付金	70,248.76	-	-	-	70,248.76
存出保证金	497,734.75	-	-	-	497,734.75
交易性金融资产	-	-	-	57,622,921.10	57,622,921.10
应收清算款	-	-	-	288,910.93	288,910.93
其他资产	-	-	-	1,446.82	1,446.82
资产总计	2,768,030.22	-	-	57,913,278.85	60,681,309.07
负债					

应付管理人报酬	-	-	30,243.47	30,243.47
应付托管费	-	-	6,048.70	6,048.70
其他负债	-	-	357,691.90	357,691.90
负债总计	-	-	393,984.07	393,984.07
利率敏感度缺口	2,768,030.22	-	57,519,294.78	60,287,325.00

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。

基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股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%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

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	54,485,506.41	97.00	57,622,921.10	95.58
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	54,485,506.41	97.00	57,622,921.10	95.58

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%	2,676,386.68	2,567,637.17
	业绩比较基准下降5%	-2,676,386.68	-2,567,637.17

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	54,485,506.41
第二层次	—
第三层次	—
合计	54,485,506.41

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	54,485,506.41	96.64
	其中：股票	54,485,506.41	96.64
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	1,824,556.51	3.24
8	其他各项资产	67,365.26	0.12
9	合计	56,377,428.18	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而 7.2.1 的合计项不含可退替代款估值增值。

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	42,196.00	0.08
B	采矿业	1,969,546.00	3.51
C	制造业	34,760,481.80	61.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,488,631.00	2.65
E	建筑业	888,890.00	1.58
F	批发和零售业	454,035.00	0.81
G	交通运输、仓储和邮政业	850,096.00	1.51
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,299,387.00	2.31
J	金融业	9,041,858.00	16.10
K	房地产业	1,206,111.00	2.15
L	租赁和商务服务业	1,130,739.00	2.01
M	科学研究和技术服务业	420,460.00	0.75

N	水利、环境和公共设施管理业	121,772.00	0.22
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	663,104.00	1.18
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	106,571.00	0.19
	合计	54,443,877.80	96.92

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	41,628.61	0.07
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	-	-
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	-	-
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	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	41,628.61	0.07

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	2,100	4,294,500.00	7.65
2	300750	宁德时代	4,600	2,456,400.00	4.37
3	600036	招商银行	45,800	1,932,760.00	3.44
4	601318	中国平安	36,500	1,704,185.00	3.03
5	601012	隆基绿能	21,614	1,440,140.82	2.56
6	000858	五粮液	6,900	1,393,317.00	2.48
7	601166	兴业银行	59,900	1,192,010.00	2.12
8	000333	美的集团	18,300	1,105,137.00	1.97
9	600900	长江电力	36,700	848,504.00	1.51
10	601888	中国中免	3,600	838,548.00	1.49
11	600887	伊利股份	21,200	825,740.00	1.47
12	000568	泸州老窖	2,800	690,312.00	1.23
13	601398	工商银行	132,600	632,502.00	1.13
14	600438	通威股份	9,900	592,614.00	1.05
15	002475	立讯精密	17,000	574,430.00	1.02
16	600276	恒瑞医药	15,200	563,768.00	1.00
17	600309	万华化学	5,800	562,542.00	1.00
18	300760	迈瑞医疗	1,700	532,440.00	0.95
19	601899	紫金矿业	56,400	526,212.00	0.94
20	002415	海康威视	14,535	526,167.00	0.94
21	002129	TCL 中环	8,900	524,121.00	0.93
22	600809	山西汾酒	1,500	487,200.00	0.87
23	000001	平安银行	31,900	477,862.00	0.85
24	000002	万科 A	23,100	473,550.00	0.84
25	000725	京东方 A	118,600	467,284.00	0.83
26	300124	汇川技术	7,000	461,090.00	0.82
27	601328	交通银行	89,800	447,204.00	0.80
28	600048	保利发展	24,900	434,754.00	0.77
29	600031	三一重工	22,400	426,944.00	0.76
30	002304	洋河股份	2,300	421,245.00	0.75
31	603288	海天味业	4,660	421,077.60	0.75
32	600690	海尔智家	14,400	395,424.00	0.70
33	300015	爱尔眼科	8,600	385,022.00	0.69
34	300274	阳光电源	3,800	373,350.00	0.66
35	002271	东方雨虹	7,200	370,584.00	0.66
36	601288	农业银行	120,700	364,514.00	0.65
37	603501	韦尔股份	2,100	363,363.00	0.65

38	601668	中国建筑	67,300	358,036.00	0.64
39	600436	片仔癀	1,000	356,730.00	0.64
40	601088	中国神华	10,500	349,650.00	0.62
41	600089	特变电工	12,100	331,419.00	0.59
42	601857	中国石油	58,800	311,640.00	0.55
43	300122	智飞生物	2,800	310,828.00	0.55
44	600000	浦发银行	37,300	298,773.00	0.53
45	600406	国电南瑞	11,040	298,080.00	0.53
46	601688	华泰证券	20,500	291,100.00	0.52
47	601919	中远海控	20,900	290,510.00	0.52
48	000063	中兴通讯	11,300	288,489.00	0.51
49	600111	北方稀土	8,200	288,312.00	0.51
50	600585	海螺水泥	8,100	285,768.00	0.51
51	601225	陕西煤业	13,200	279,576.00	0.50
52	002709	天赐材料	4,500	279,270.00	0.50
53	601601	中国太保	11,700	275,301.00	0.49
54	600104	上汽集团	14,700	261,807.00	0.47
55	601988	中国银行	80,200	261,452.00	0.47
56	002027	分众传媒	38,100	256,413.00	0.46
57	601211	国泰君安	16,600	252,320.00	0.45
58	000338	潍柴动力	19,500	243,165.00	0.43
59	600660	福耀玻璃	5,500	229,955.00	0.41
60	601658	邮储银行	40,500	218,295.00	0.39
61	601390	中国中铁	34,900	214,286.00	0.38
62	600028	中国石化	50,300	205,224.00	0.37
63	601985	中国核电	29,700	203,742.00	0.36
64	601615	明阳智能	6,000	202,800.00	0.36
65	603659	璞泰来	2,400	202,560.00	0.36
66	002410	广联达	3,700	201,428.00	0.36
67	600019	宝钢股份	32,600	196,252.00	0.35
68	600570	恒生电子	4,500	195,930.00	0.35
69	601818	光大银行	64,200	193,242.00	0.34
70	002050	三花智控	6,800	186,864.00	0.33
71	002179	中航光电	2,840	179,828.80	0.32
72	002493	荣盛石化	11,600	178,524.00	0.32
73	002311	海大集团	2,900	174,029.00	0.31
74	002821	凯莱英	600	173,400.00	0.31
75	000799	酒鬼酒	900	167,229.00	0.30
76	600426	华鲁恒升	5,600	163,520.00	0.29
77	601939	建设银行	26,200	158,772.00	0.28
78	000538	云南白药	2,600	157,014.00	0.28
79	600176	中国巨石	9,000	156,690.00	0.28

80	600346	恒力石化	7,000	155,680.00	0.28
81	300316	晶盛机电	2,200	148,698.00	0.26
82	300759	康龙化成	1,550	147,591.00	0.26
83	002202	金风科技	9,900	146,520.00	0.26
84	601877	正泰电器	4,000	143,120.00	0.25
85	601006	大秦铁路	21,400	141,026.00	0.25
86	601186	中国铁建	17,800	140,620.00	0.25
87	600763	通策医疗	800	139,552.00	0.25
88	600085	同仁堂	2,600	137,488.00	0.24
89	002001	新和成	6,020	137,316.20	0.24
90	600383	金地集团	10,100	135,744.00	0.24
91	601138	工业富联	13,400	131,856.00	0.23
92	300390	天华超净	1,500	131,100.00	0.23
93	603806	福斯特	2,000	131,040.00	0.23
94	000963	华东医药	2,900	130,964.00	0.23
95	300408	三环集团	4,300	129,430.00	0.23
96	000786	北新建材	3,700	128,094.00	0.23
97	000596	古井贡酒	500	124,830.00	0.22
98	600885	宏发股份	2,940	123,039.00	0.22
99	300012	华测检测	5,300	123,013.00	0.22
100	600233	圆通速递	6,000	122,340.00	0.22
101	000876	新希望	7,900	120,870.00	0.22
102	600011	华能国际	17,100	120,384.00	0.21
103	601066	中信建投	4,100	118,531.00	0.21
104	600741	华域汽车	5,100	117,300.00	0.21
105	600132	重庆啤酒	800	117,280.00	0.21
106	000895	双汇发展	4,000	117,200.00	0.21
107	603606	东方电缆	1,500	114,900.00	0.20
108	600600	青岛啤酒	1,100	114,312.00	0.20
109	600989	宝丰能源	7,800	114,270.00	0.20
110	603613	国联股份	1,250	110,750.00	0.20
111	600188	兖矿能源	2,800	110,544.00	0.20
112	002601	龙佰集团	5,500	110,275.00	0.20
113	000009	中国宝安	7,900	106,571.00	0.19
114	002236	大华股份	6,438	105,711.96	0.19
115	002555	三七互娱	4,900	104,027.00	0.19
116	603185	上机数控	660	102,953.40	0.18
117	600563	法拉电子	500	102,580.00	0.18
118	300285	国瓷材料	2,851	102,407.92	0.18
119	000425	徐工机械	18,900	101,871.00	0.18
120	601100	恒立液压	1,600	98,752.00	0.18
121	300595	欧普康视	1,700	97,223.00	0.17

122	600486	扬农化工	700	93,296.00	0.17
123	600298	安琪酵母	1,900	92,625.00	0.16
124	603605	珀莱雅	560	92,500.80	0.16
125	601233	桐昆股份	5,800	92,104.00	0.16
126	002841	视源股份	1,200	90,384.00	0.16
127	601058	赛轮轮胎	7,900	89,033.00	0.16
128	601865	福莱特	2,300	87,630.00	0.16
129	300957	贝泰妮	400	87,012.00	0.15
130	601336	新华保险	2,700	86,913.00	0.15
131	600499	科达制造	4,200	86,688.00	0.15
132	002007	华兰生物	3,800	86,640.00	0.15
133	601799	星宇股份	500	85,500.00	0.15
134	603486	科沃斯	700	85,323.00	0.15
135	605117	德业股份	300	83,967.00	0.15
136	603260	合盛硅业	700	82,572.00	0.15
137	603882	金域医学	1,000	82,550.00	0.15
138	603589	口子窖	1,400	82,054.00	0.15
139	002120	韵达股份	4,800	81,888.00	0.15
140	300529	健帆生物	1,600	81,424.00	0.14
141	603816	顾家家居	1,430	80,980.90	0.14
142	002353	杰瑞股份	2,000	80,600.00	0.14
143	603267	鸿远电子	600	80,598.00	0.14
144	601636	旗滨集团	6,300	80,325.00	0.14
145	002056	横店东磁	3,000	79,860.00	0.14
146	002850	科达利	500	79,500.00	0.14
147	603444	吉比特	200	77,600.00	0.14
148	000932	华菱钢铁	15,200	77,368.00	0.14
149	300033	同花顺	800	76,920.00	0.14
150	600845	宝信软件	1,400	76,440.00	0.14
151	002507	涪陵榨菜	2,200	75,944.00	0.14
152	600183	生益科技	4,400	74,756.00	0.13
153	601155	新城控股	2,900	73,747.00	0.13
154	603899	晨光股份	1,300	72,904.00	0.13
155	600332	白云山	2,300	72,657.00	0.13
156	002463	沪电股份	4,900	72,324.00	0.13
157	002080	中材科技	2,600	71,500.00	0.13
158	600018	上港集团	12,200	71,126.00	0.13
159	601607	上海医药	3,900	70,512.00	0.13
160	002603	以岭药业	2,900	70,470.00	0.13
161	002025	航天电器	1,000	69,820.00	0.12
162	003816	中国广核	24,700	69,160.00	0.12
163	603127	昭衍新药	600	68,280.00	0.12

164	000807	云铝股份	6,700	66,196.00	0.12
165	000830	鲁西化工	3,800	65,702.00	0.12
166	600161	天坛生物	2,700	65,556.00	0.12
167	600549	厦门钨业	3,000	64,860.00	0.12
168	600779	水井坊	700	64,778.00	0.12
169	300699	光威复材	1,100	64,757.00	0.12
170	002624	完美世界	4,500	64,665.00	0.12
171	300676	华大基因	900	64,530.00	0.11
172	000708	中信特钢	3,200	64,480.00	0.11
173	601898	中煤能源	6,000	62,280.00	0.11
174	000960	锡业股份	3,700	62,049.00	0.11
175	603160	汇顶科技	1,000	61,930.00	0.11
176	002030	达安基因	3,600	61,884.00	0.11
177	600803	新奥股份	3,300	61,347.00	0.11
178	002508	老板电器	1,700	61,251.00	0.11
179	002414	高德红外	4,680	60,231.60	0.11
180	300725	药石科技	600	59,394.00	0.11
181	601319	中国人保	11,700	59,202.00	0.11
182	600674	川投能源	4,900	58,408.00	0.10
183	002402	和而泰	3,000	57,180.00	0.10
184	601666	平煤股份	4,200	57,078.00	0.10
185	600704	物产中大	11,100	56,943.00	0.10
186	002916	深南电路	600	56,226.00	0.10
187	300244	迪安诊断	1,800	55,980.00	0.10
188	600170	上海建工	17,700	53,631.00	0.10
189	603568	伟明环保	1,600	53,392.00	0.10
190	600177	雅戈尔	8,000	53,040.00	0.09
191	002372	伟星新材	2,200	52,888.00	0.09
192	600606	绿地控股	13,200	52,272.00	0.09
193	300357	我武生物	1,000	52,030.00	0.09
194	002597	金禾实业	1,200	51,996.00	0.09
195	002791	坚朗五金	400	51,888.00	0.09
196	300776	帝尔激光	300	51,840.00	0.09
197	002439	启明星辰	2,600	51,818.00	0.09
198	000513	丽珠集团	1,400	50,694.00	0.09
199	300136	信维通信	3,000	50,550.00	0.09
200	601717	郑煤机	3,500	50,435.00	0.09
201	600529	山东药玻	1,800	50,310.00	0.09
202	600867	通化东宝	4,800	49,632.00	0.09
203	600025	华能水电	7,000	48,930.00	0.09
204	600985	淮北矿业	3,300	48,048.00	0.09
205	300748	金力永磁	1,300	47,840.00	0.09

206	000739	普洛药业	2,300	47,472.00	0.08
207	002430	杭氧股份	1,500	46,890.00	0.08
208	603678	火炬电子	1,000	46,810.00	0.08
209	000400	许继电气	2,400	46,080.00	0.08
210	603195	公牛集团	300	45,873.00	0.08
211	603233	大参林	1,440	45,072.00	0.08
212	002064	华峰化学	5,300	44,732.00	0.08
213	600580	卧龙电驱	3,100	44,702.00	0.08
214	600066	宇通客车	5,100	44,115.00	0.08
215	002643	万润股份	2,100	43,806.00	0.08
216	002706	良信股份	2,600	42,978.00	0.08
217	600801	华新水泥	2,200	42,922.00	0.08
218	002299	圣农发展	2,200	42,196.00	0.08
219	600271	航天信息	3,800	41,572.00	0.07
220	603713	密尔克卫	300	41,010.00	0.07
221	601866	中远海发	13,600	40,800.00	0.07
222	603218	日月股份	1,600	40,640.00	0.07
223	603338	浙江鼎力	800	40,560.00	0.07
224	002985	北摩高科	680	39,834.40	0.07
225	600970	中材国际	4,100	39,729.00	0.07
226	600755	厦门国贸	5,200	39,000.00	0.07
227	600297	广汇汽车	14,900	38,889.00	0.07
228	002396	星网锐捷	1,700	38,488.00	0.07
229	603087	甘李药业	800	38,376.00	0.07
230	600273	嘉化能源	3,500	38,010.00	0.07
231	600409	三友化工	4,500	36,855.00	0.07
232	300482	万孚生物	900	36,639.00	0.07
233	000581	威孚高科	1,900	36,575.00	0.07
234	002091	江苏国泰	3,400	36,550.00	0.07
235	002127	南极电商	6,700	35,778.00	0.06
236	600566	济川药业	1,300	35,308.00	0.06
237	600064	南京高科	3,200	35,200.00	0.06
238	300630	普利制药	1,000	35,150.00	0.06
239	600323	瀚蓝环境	1,700	34,850.00	0.06
240	600782	新钢股份	6,900	34,776.00	0.06
241	000401	冀东水泥	3,300	34,716.00	0.06
242	603129	春风动力	300	34,116.00	0.06
243	002701	奥瑞金	6,500	33,800.00	0.06
244	002266	浙富控股	7,000	33,530.00	0.06
245	002595	豪迈科技	1,500	33,510.00	0.06
246	603927	中科软	1,400	32,648.00	0.06
247	601568	北元集团	5,140	32,587.60	0.06

248	600535	天士力	3,000	31,530.00	0.06
249	603866	桃李面包	1,900	31,445.00	0.06
250	300685	艾德生物	980	31,360.00	0.06
251	600282	南钢股份	9,900	31,185.00	0.06
252	300747	锐科激光	800	31,120.00	0.06
253	600507	方大特钢	4,400	30,756.00	0.05
254	000090	天健集团	4,400	30,316.00	0.05
255	601311	骆驼股份	2,700	30,051.00	0.05
256	000930	中粮科技	3,200	28,928.00	0.05
257	000951	中国重汽	2,220	28,837.80	0.05
258	300463	迈克生物	1,400	28,686.00	0.05
259	002032	苏泊尔	500	28,170.00	0.05
260	601000	唐山港	10,900	28,122.00	0.05
261	600236	桂冠电力	4,600	28,014.00	0.05
262	002727	一心堂	1,200	27,516.00	0.05
263	000877	天山股份	2,200	27,060.00	0.05
264	600663	陆家嘴	2,600	26,936.00	0.05
265	002705	新宝股份	1,200	26,388.00	0.05
266	002626	金达威	1,100	26,224.00	0.05
267	000402	金融街	4,400	26,180.00	0.05
268	002690	美亚光电	1,200	26,016.00	0.05
269	002262	恩华药业	1,900	25,840.00	0.05
270	000598	兴蓉环境	5,000	25,550.00	0.05
271	000672	上峰水泥	1,600	25,248.00	0.04
272	300674	宇信科技	1,600	25,088.00	0.04
273	002110	三钢闽光	4,100	24,969.00	0.04
274	002233	塔牌集团	2,800	24,780.00	0.04
275	300726	宏达电子	400	24,468.00	0.04
276	002216	三全食品	1,200	23,508.00	0.04
277	603228	景旺电子	1,000	23,330.00	0.04
278	002867	周大生	1,500	23,295.00	0.04
279	300188	美亚柏科	1,700	22,916.00	0.04
280	600131	国网信通	1,700	22,865.00	0.04
281	600329	达仁堂	900	22,122.00	0.04
282	300973	立高食品	200	20,790.00	0.04
283	603489	八方股份	100	19,449.00	0.03
284	002925	盈趣科技	900	19,368.00	0.03
285	600395	盘江股份	2,200	19,294.00	0.03
286	603298	杭叉集团	1,200	18,516.00	0.03
287	603638	艾迪精密	900	18,450.00	0.03
288	000685	中山公用	2,400	18,432.00	0.03
289	002242	九阳股份	1,000	18,360.00	0.03

290	601598	中国外运	4,600	17,848.00	0.03
291	002967	广电计量	900	17,046.00	0.03
292	600612	老凤祥	400	16,712.00	0.03
293	600377	宁沪高速	1,800	15,426.00	0.03
294	300770	新媒股份	400	15,132.00	0.03
295	603025	大豪科技	600	13,104.00	0.02
296	002653	海思科	600	9,666.00	0.02
297	603719	良品铺子	300	8,589.00	0.02
298	002901	大博医疗	200	7,828.00	0.01
299	601003	柳钢股份	1,800	7,290.00	0.01
300	600956	新天绿能	500	6,160.00	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	601089	福元医药	1,493	31,427.65	0.06
2	001268	联合精密	368	10,200.96	0.02

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	2,306,293.00	3.83
2	300750	宁德时代	2,086,032.00	3.46
3	600036	招商银行	1,050,051.00	1.74
4	601318	中国平安	889,671.00	1.48
5	601166	兴业银行	646,553.00	1.07
6	601012	隆基绿能	581,153.00	0.96
7	000725	京东方 A	439,089.00	0.73
8	600887	伊利股份	436,089.00	0.72
9	600900	长江电力	434,849.00	0.72
10	601888	中国中免	407,194.00	0.68
11	002129	TCL 中环	406,418.00	0.67
12	600809	山西汾酒	345,171.00	0.57
13	601398	工商银行	330,290.00	0.55
14	601899	紫金矿业	327,922.00	0.54
15	600111	北方稀土	326,655.00	0.54
16	600309	万华化学	297,573.00	0.49
17	600276	恒瑞医药	257,217.00	0.43
18	601328	交通银行	234,903.00	0.39
19	600048	保利发展	220,098.00	0.37
20	600031	三一重工	208,964.00	0.35

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	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	2,520,560.00	4.18
2	600036	招商银行	1,103,572.00	1.83
3	601318	中国平安	940,162.00	1.56
4	601166	兴业银行	660,049.00	1.09
5	601012	隆基绿能	658,821.00	1.09
6	002714	牧原股份	482,959.00	0.80
7	600887	伊利股份	458,564.00	0.76
8	600900	长江电力	448,970.00	0.74
9	601888	中国中免	432,042.00	0.72
10	600809	山西汾酒	377,675.00	0.63
11	300498	温氏股份	355,630.38	0.59
12	601398	工商银行	346,138.00	0.57
13	601899	紫金矿业	320,262.00	0.53
14	600522	中天科技	296,111.00	0.49
15	600309	万华化学	291,393.00	0.48
16	600276	恒瑞医药	244,718.00	0.41
17	601328	交通银行	244,375.00	0.41
18	300450	先导智能	230,085.00	0.38
19	600031	三一重工	230,048.00	0.38
20	601288	农业银行	226,008.00	0.37

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	24,146,362.79
卖出股票收入（成交）总额	23,061,041.08

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

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数，实现投资目标。同时，本基金将力争利用股指期货的杠杆作用，降低申购赎回时现金资产对投资组合的影响及仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，从而达到稳定投资组合资产净值的目的。

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	67,365.26
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	67,365.26

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

注：无。

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

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 (%)
1,908	30,331.86	17,068,544.00	29.49	40,804,639.00	70.51

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例(%)
1	中信建投证券—中信建投期货有限公司—中信建投聚智多策略2号单一资产管理计划	11,200,000.00	19.35
2	萧祥玲	4,000,076.00	6.91
3	华泰证券股份有限公司	3,517,140.00	6.08
4	中信证券股份有限公司	1,901,394.00	3.29
5	杨晓盈	1,000,048.00	1.73
6	娄承健	1,000,000.00	1.73
7	徐建芬	680,058.00	1.18
8	杨丽燕	600,029.00	1.04
9	曹庆华	518,709.00	0.90

10	姜长海	500,029.00	0.86
----	-----	------------	------

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

注：截止本报告期末，本基金管理人所有从业人员未持有本基金份额。

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

基金合同生效日（2021年9月15日） 基金份额总额	360,373,183.00
本报告期期初基金份额总额	57,873,183.00
本报告期基金总申购份额	27,500,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	27,500,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	57,873,183.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

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 (%)	
华泰证券	5	38,264,874.52	81.42	31,209.15	81.35	-
长江证券	1	8,733,236.56	18.58	7,153.95	18.65	-
中信建投证券	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、及时性以及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 (%)
华泰证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-

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	《证券时报》、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	《证券时报》、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	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金增加开源证券股份有限公司为申购赎回代理券商的公告	《证券时报》、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14日
4	鹏华国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	《证券时报》、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
5	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华安证券股份有限公司为申购赎回代理券商的公告	《证券时报》、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21日
6	鹏华国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金 2021 年年度报告	《证券时报》、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
7	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金增加东吴证券股份有限公司为申购赎回代理券商的公告	《证券时报》、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07日
8	鹏华国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	《证券时报》、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
9	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	《证券时报》、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
10	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	《证券时报》、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
11	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分	《证券时报》、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

	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	人网站及中国证监会基金电子披露网站	
--	------------------------------	-------------------	--

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

注：无。

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)《鹏华国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- (二)《鹏华国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- (三)《鹏华国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金 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