

鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资 基金 2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 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：2023 年 3 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。本年度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 2023 年 03 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。

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）注册会计师对本基金出具了“标准无保留意见”的审计报告。

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 2022 年 12 月 31 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	6
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、基金净值表现及利润分配情况	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
3.4 过去三年基金的利润分配情况	10
§ 4 管理人报告	10
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	11
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	13
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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	15
4.10 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	16
§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	16
§ 6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
§ 7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	19
7.3 净资产（基金净值）变动表	21
7.4 报表附注	24

§ 8 投资组合报告	84
8.1 期末基金资产组合情况	84
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	85
8.3 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	86
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	99
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	101
8.6 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	101
8.7 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	101
8.8 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	101
8.9 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	101
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	101
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	101
8.12 投资组合报告附注	101
§ 9 基金份额持有人信息	103
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	103
9.2 期末上市基金前十名持有人	103
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	103
9.4 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	104
9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	104
§ 10 开放式基金份额变动	104
§ 11 重大事件揭示	104
11.1 基金份额持有人大会决议	104
11.2 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	104
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	105
11.4 基金投资策略的改变	105
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	105
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	105
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	105
11.8 其他重大事件	107
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	110
12.1 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	110
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	110
§ 13 备查文件目录	110
13.1 备查文件目录	110
13.2 存放地点	111
13.3 查阅方式	111

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	中证 500
场内简称	中证 500ETF 鹏华
基金主代码	159982
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 11 月 21 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	252,211,253.00 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	2020 年 2 月 20 日

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。
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。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。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 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内，尽量缩小跟踪误差。</p> <p>(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。</p> <p>1) 定</p>

	<p>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。 (3) 存托凭证投资策略 本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略,基于对基础证券投资价值的深入研究判断,进行存托凭证的投资。 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、参与融资及转融通证券出借业务策略 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。 本基金将密切跟踪国内关于基金参与融券业务法律法规的实施进展,待允许本基金参与融券业务的相关规定颁布后,将在届时相应法律法规的框架内,参与融券业务。 未来,随着证券市场投资工具的发展和丰富,本基金可相应调整和更新相关投资策略,并在招募说明书中更新公告。</p>
业绩比较基准	中证 500 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	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	《中国证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.phfund.com.cn
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2022 年	2021 年	2020 年
本期已实现 收益	-36,201,345.74	66,718,205.35	72,111,848.90
本期利润	-73,275,949.53	78,185,237.29	76,763,795.02
加权平均基 金份额本期 利润	-0.2733	0.3329	0.2913
本期加权平 均净值利润 率	-18.83%	21.86%	25.52%
本期基金份 额净值增长 率	-17.29%	25.13%	33.61%
3.1.2 期末 数据和指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末

期末可供分配利润	99,455,200.03	137,431,525.33	57,481,437.92
期末可供分配基金份额利润	0.3943	0.5918	0.3054
期末基金资产净值	351,666,453.03	391,430,855.45	253,561,077.16
期末基金份额净值	1.3943	1.6857	1.3472
3.1.3 累计期末指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
基金份额累计净值增长率	39.43%	68.57%	34.72%

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 12 月 31 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

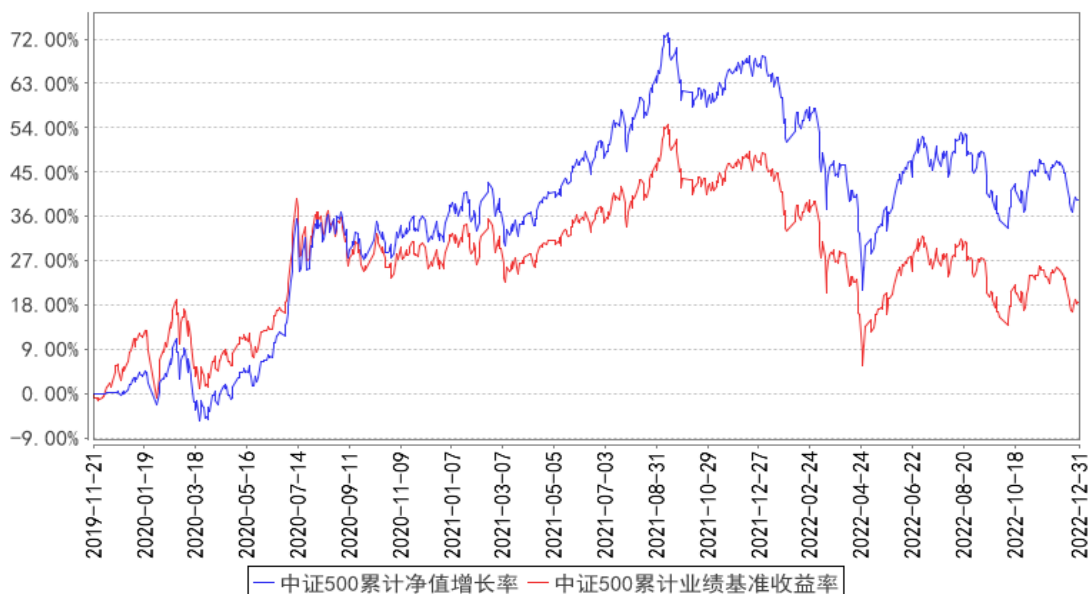
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	3.02%	1.00%	2.63%	1.03%	0.39%	-0.03%
过去六个月	-7.46%	1.07%	-9.14%	1.10%	1.68%	-0.03%
过去一年	-17.29%	1.35%	-20.31%	1.38%	3.02%	-0.03%
过去三年	38.28%	1.28%	11.33%	1.35%	26.95%	-0.07%
自基金合同生效起至今	39.43%	1.26%	18.56%	1.33%	20.87%	-0.07%

注：业绩比较基准=中证 500 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

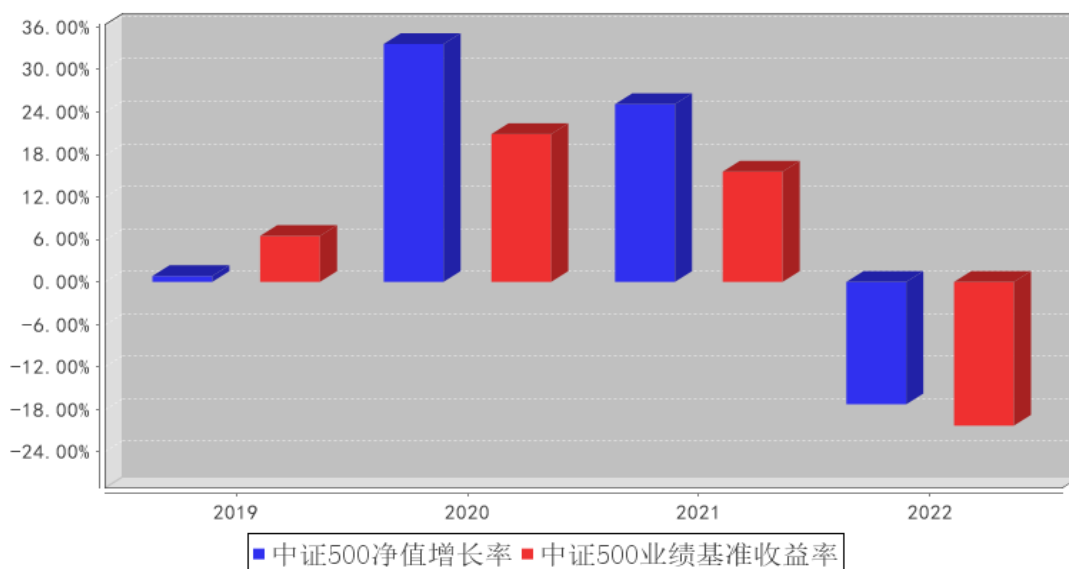
中证500累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2019 年 11 月 21 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。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中证500基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按照实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 其他指标

注：无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

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 11137.97 亿元，284 只公募基金、13 只全国社保投资组合、6 只基本养老保险投资组合。经过 20 余年投资管理基金，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		
陈龙	基金经理	2019-11-21	-	13 年	陈龙先生，国籍中国，经济学硕士，13 年证券从业经验。曾任杭州衡泰软件公司金融工程师，2009 年 12 月加盟鹏华基金管理有限公司，历任监察稽核部金融工程总监助理、量化及衍生品投资部量化研究总监助理，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量化研究副总经理、基金经理。2015 年 09 月至 2018 年 05 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，2016 年 07 月至 2018 年 04 月担任鹏华创业板指数分级证券投资基金基金经理，2016 年 09 月至 2018 年 04 月担任鹏华中证 800 地产指数分级证券投资基金基金经理，2016 年 09 月至 2018 年 05 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，2016 年 10 月至 2018 年 04 月担任鹏华中证移动互联网指数分级证券投资基金基金经理，2019 年 03 月至 2020 年 12 月担任鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金经理，2019 年 03 月至 2020 年 12 月担任鹏华中证国防指数分级证券投资基金基金经理，2019 年 03 月至今担任鹏华

					<p>中证空天一体军工指数证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2019 年 03 月至 2020 年 12 月担任鹏华中证 800 证券保险指数分级证券投资基金基金经理, 2019 年 11 月至今担任鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2019 年 12 月至 2022 年 10 月担任鹏华国证证券龙头交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2020 年 01 月至今担任鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理, 2021 年 01 月至今担任鹏华中证国防指数型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2021 年 01 月至 2022 年 10 月担任鹏华中证全指证券公司指数型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2021 年 01 月至 2022 年 10 月担任鹏华中证 800 证券保险指数型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2021 年 02 月至今担任鹏华中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2022 年 08 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, 陈龙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。

4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

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 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《鹏华基金管

理有限公司公平交易管理规定》，将公司所管理的封闭式基金、开放式基金、社保组合、养老组合、特定客户资产管理组合等不同资产组合的授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动均纳入公平交易管理，在业务流程和岗位职责中制定公平交易的控制规则和控制活动，建立对公平交易的执行、监督及审核流程，严禁在不同投资组合之间进行利益输送。

在投资研究环节：1、公司使用唯一的研究报告发布平台“研究报告管理平台”，确保各投资组合在获得投资信息、研究支持、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；2、公司严格按照《股票库管理规定》、《信用债券投资与风险控制管理规定》，执行股票及信用产品出入库及日常维护工作，确保相关证券入库以内容严谨、观点明确的研究报告作为依据；3、在公司股票库基础上，各涉及股票投资的资产组合根据各自的投资目标、投资风格、投资范围和防范关联交易的原则分别建立资产组合股票库，基金经理在股票库基础上根据投资授权以及基金合同择股方式构建具体的投资组合；4、严格执行投资授权制度，明确投资决策委员会、分管投资副总裁、基金经理等各主体的职责和权限划分，合理确定基金经理的投资权限，超过投资权限的操作，应严格履行审批程序。

在交易执行环节：1、所有公司管理的资产组合的交易必须通过集中交易室完成，集中交易室负责建立和执行交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会；2、针对交易所公开竞价交易，集中交易室应严格启用恒生交易系统中的公平交易程序，交易系统则自动启用公平交易功能，由系统按照“未委托数量”的比例对不同资产组合进行委托量的公平分配；如果相关基金经理坚持以不同的价格进行交易，且当前市场价格不能同时满足多个资产组合的指令价格要求时，交易系统自动按照“价格优先”原则进行委托；当市场价格同时满足多个资产组合的指令价格要求时，则交易系统自动按照“同一指令价格下的公平交易”模式，进行公平委托和交易量分配；3、银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易需依据公司《股票投资交易流程》和《固定收益投资管理流程》的规定执行；银行间市场交易、交易所大宗交易等以公司名义进行的交易，各投资组合经理应在交易前独立确定各投资组合的交易价格和数量，公司按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；4、新股、新债申购及非公开定向增发交易需依据公司《新股申购流程》、《固定收益投资管理流程》和《非公开定向增发流程》的规定执行，对新股和新债申购方案和分配过程进行审核和监控。

在交易监控、分析与评估环节：1、为加强对日常投资交易行为的监控和管理，杜绝利益输送、不公平交易等违规交易行为，防范日常交易风险，公司明确了关注类交易的界定及对应的监控和评估措施机制；所监控的交易包括但不限于：交易所公开竞价交易中同日同向交易的交易时机和交易价差、不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差、关联交易、

债券交易收益率偏离度、成交量和成交价格异常、银行间债券交易对手交易等；2、将公平交易作为投资组合业绩归因分析和交易绩效评价的重要关注内容，发现的异常情况由投资监察员进行分析；3、风控管理部分别于每季度和每年度编写《公平交易执行情况检查报告》，内容包括关注类交易监控执行情况、不同投资组合的整体收益率差异分析和同向交易价差分析。

4.3.2 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、分配各环节得到公平对待。公司对不同投资组合在不同时间窗口下（日内、3日内、5日内）的同向交易价差进行专项分析，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.3.3 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，本报告期鹏华中证 500ETF 份额净值增长率为-17.29%，同期业绩比较基准增长率为-20.31%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从长周期的维度看，2022 年是个转折之年，尤其是 10 月份的二十大会议是一个重要分水岭。11 月份，市场迎来了重大的政策转向，一方面是防疫政策出现了重大的调整，另一方面前期受到压制的一些行业，政策环境开始显著改善，最典型的如房地产、互联网等行业。

宏观环境的变化，在资本市场的反应也是立竿见影。从股、债、商等大类资产的角度，股票及商品等都出现了明显的修复，而债市则出现了较大幅度的波动。而从股票内的行业风格来看，11 月份之前，以高端制造为代表的景气成长方向显著占优，而 11 月之后市场风格则快速转向消费、保险等疫后复苏的方向。

从全球范围来看，本轮行情中修复力度最大的当属港股，尤其是港股互联网行业。除了受益

于国内疫情放开带来的经济复苏之外，同时还受益于美联储紧缩政策的边际趋缓，以及互联网监管环境的改善。

展望 2023 年，确定性与不确定性如影随形：疫后经济的复苏是确定的，但是复苏的力度和节奏是存在不确定性；海外经济衰退是确定性的，但是衰退的幅度的持续的时间是不确定的；美联储在一季度的某个时点停止加息是确定性的，但是终端利率维持的时间，以及什么时候开始降息是不确定性的。

从近期各个地方政府提出的全年目标来看，我们预计全年的经济增长目标可能会在 5%-5.5% 之间，与 2021 年的疫后复苏还是有比较大的差距。而当下的经济压力，除了疫情等短期的因素之外，其实也叠加了很多中长期的因素，比如居民收入、杠杆、人口等。另外，财政的压力也是显而易见，这些都会制约稳增长政策的空间。

从权益市场来看，年初以来，到春节前，市场更多的还是在交易复苏的预期，叠加了北上资金的大幅流入，催生了一轮开门红行情。全年的维度来看，我们的观点可能略偏中性，A 股可能还不具备走出一轮新的趋势性行情：资产端角度，疫情仍有可能反复，对经济仍有可能带来阶段性的一些冲击，也会影响居民消费的信心；负债端的角度，过去几年市场整理缺乏赚钱效应，公募基金亏损情况较为严重，市场阶段性上涨之后带来的赎回压力也会压制市场整体上行的空间。

板块结构方面，至少在上半年，市场大概率还是围绕三条主线进行轮动，包括疫后复苏、地产链以及以新半军创为代表的景气成长方向，板块间的高低切换可能是较为核心的投资策略。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人继续完善内部控制、提升风险管理水平，着重开展了以下各项工作：

1、继续完善内部控制体系

公司根据法律法规、监管要求及业务发展需求，不断优化现有的标准化业务流程体系，强调业务流程服务于加强风险防范和提升运营效率，通过信息技术手段持续提升业务操作的系统化程度，并不断优化。

2、规范基金销售业务，保证基金销售业务的合法合规性

报告期内，在基金募集和持续营销活动中，公司严格规范基金销售业务，按照《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及相关法规规定审查宣传推介材料，逐步落实反洗钱法律法规各项要求，并督促销售部门做好投资者教育工作。

3、开展以风险为导向的内部稽核

报告期内，监察稽核部开展了对信息技术管理、投资相关流程、员工行为、反洗钱业务、子公司管理和公司日常运作的定期监察稽核与专项监察稽核。监察稽核人员开展了以风险为导向的

内部稽核，通过稽核发现提高了公司标准化操作流程手册的执行效力，优化了标准化操作流程手册。报告期内，公司未发生重大风险事件。

此外，在投资日常合规监控工作方面，公司根据法律法规和产品特点进一步完善了投资合规风控制度流程及投资监控系统，加强对投资限制的监控提示；持续完善公平交易、异常交易等监测管控机制，在实现交易价差分析、银行间交易分析、研究报告检查等专项检查工作定期化、日常化的基础上，公司多次开展有关内幕交易、未公开信息等重要内容的合规培训，进一步强化全体投研人员的合规意识。

4.7 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。

4.8 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 99,455,200.03 元，期末基金份额净值 1.3943 元。

2、本基金本报告期内未进行利润分配。

3、根据相关法律法规及本基金基金合同的规定，本基金管理人将会综合考虑各方面因素，在严格遵守规定前提下，对本报告期内可供分配利润适时作出相应安排。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.10 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，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度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 年年度报告中财务指标、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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2023)第 23822 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“中证 500ETF 基金”)的财务报表,包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表,2022 年度的利润表和净资产(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行</p>

	<p>业实务操作编制，公允反映了中证 500ETF 基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于中证 500ETF 基金，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	无。
其他事项	无。
其他信息	无。
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>中证 500ETF 基金的基金管理人鹏华基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估中证 500ETF 基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算中证 500ETF 基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督中证 500ETF 基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对中证</p>

	<p>500ETF 基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致中证 500ETF 基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	单峰 胡莲莲
会计师事务所的地址	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
审计报告日期	2023 年 3 月 27 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	9,213,589.85	9,693,729.64
结算备付金		8,550,735.13	10,374,271.32
存出保证金		1,915,009.33	2,124,606.75
交易性金融资产	7.4.7.2	332,510,595.62	369,701,845.73
其中：股票投资		332,510,595.62	369,701,845.73
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-

其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		217,033.45	-
应收股利		1,485.00	280.00
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	10,632.64	16,390.74
资产总计		352,419,081.02	391,911,124.18
负债和净资产	附注号	本期末 2022年12月31日	上年度末 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	7.4.7.3	-	-
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		46,139.47	50,651.98
应付托管费		15,379.84	16,883.98
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,603.98	7,672.16
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	689,504.70	405,060.61
负债合计		752,627.99	480,268.73
净资产:			
实收基金	7.4.7.10	252,211,253.00	232,211,253.00
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	99,455,200.03	159,219,602.45
净资产合计		351,666,453.03	391,430,855.45
负债和净资产总计		352,419,081.02	391,911,124.18

注：报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.3943 元，基金份额总额 252,211,253.00 份。

7.2 利润表

会计主体：鹏华中证 500 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 12 月 31 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 12 月 31 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-72,170,586.30	80,225,857.47

1. 利息收入		766,429.89	408,773.97
其中：存款利息收入	7.4.7.13	138,095.40	107,441.99
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		628,334.49	301,331.98
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-38,616,734.80	67,529,027.83
其中：股票投资收益	7.4.7.14.2	-42,890,622.26	59,263,209.82
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	-	-
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-1,607,348.44	4,079,725.04
股利收益	7.4.7.19	5,881,235.90	4,186,092.97
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）	7.4.7.20	-37,075,218.93	11,467,069.96
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	2,754,937.54	820,985.71
减：二、营业总支出		1,105,363.23	2,040,620.18
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	600,672.20	535,787.49
2. 托管费	7.4.10.2.2	200,224.07	178,595.81
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		1,647.90	16,045.49
8. 其他费用	7.4.7.23	302,819.06	1,310,191.39
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-73,275,949.53	78,185,237.29
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”		-73,275,949.53	78,185,237.29

号填列)			
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-73,275,949.53	78,185,237.29

7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：鹏华中证 500 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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)	232,211,253.00	-	159,219,602.45	391,430,855.45
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)	232,211,253.00	-	159,219,602.45	391,430,855.45
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	20,000,000.00	-	-59,764,402.42	-39,764,402.42
(一)、综合收益总额	-	-	-73,275,949.53	-73,275,949.53
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值	20,000,000.00	-	13,511,547.11	33,511,547.11

减少以“-”号填列)				
其中:1. 基金申购款	562,000,000.00	-	225,813,527.39	787,813,527.39
2. 基金赎回款	-542,000,000.00	-	-212,301,980.28	-754,301,980.28
(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、本期期末净资产(基金净值)	252,211,253.00	-	99,455,200.03	351,666,453.03
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31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)	188,211,253.00	-	65,349,824.16	253,561,077.16
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)	188,211,253.00	-	65,349,824.16	253,561,077.16
三、本 期 增 减 变 动 额(减 少以“- ”号 填列)	44,000,000.00	-	93,869,778.29	137,869,778.29
(一)、 综 合 收 益 总 额	-	-	78,185,237.29	78,185,237.29
(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)	44,000,000.00	-	15,684,541.00	59,684,541.00
其中:1. 基 金 申 购 款	208,000,000.00	-	108,024,518.95	316,024,518.95
2 .基 金 赎 回 款	-164,000,000.00	-	-92,339,977.95	-256,339,977.95
(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、本期期末净资产(基金净值)	232,211,253.00	-	159,219,602.45	391,430,855.45

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>邓召明</u>	<u>邢彪</u>	<u>郝文高</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

鹏华中证 500 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[2019]第 1504 号《关于准予鹏华中证 500 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《鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,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 490,173,730.00 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(2019)第 0669 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2019 年 11 月 21 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 490,211,253.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 37,523.00 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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

7.4.2 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”)、《资产管理产品相关会计处理规定》(财会[2022]14 号)、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》、《鹏华中证 500 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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2022 年度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 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

新金融工具准则

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具；即不包含付款的合同义务且享有发行人净资产和剩余收益的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益

工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益,在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金在投资人申购、赎回过程中而待与投资人结算的可退替代款分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债,在资产负债表中的其他负债科目下列示。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则,但选择不重述比较信息。因此,比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、基金投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金在投资人申购、赎回过程中而待与投资人结算的可退替代款分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债,在资产负债表中以其他负债列示。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

新金融工具准则

金融资产和金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息,确认为应

计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金在上一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本基金利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；

或者(3) 该金融资产已转移,虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬,但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时,终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额,计入当期损益。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则,但选择不重述比较信息。因此,比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

金融资产和金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债,按照公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的,予以终止确认:(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止;(2) 该金融资产已转移,且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方;或者(3) 该金融资产已转移,虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬,但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时,终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额,计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、基金投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的,应对市场交易价格进行调整,确定公允价值。与上述投资品种相同,但具有不同特征的,应以相同资产或负债的公允价值为基础,并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等,

如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

新金融工具准则

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税（和/或）股票交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投

资收益。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率或者发行价计算的利息及在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

本基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率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（以下简称“证金公司”）出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

原金融工具准则（截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则）

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税（和/或）股票交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收

益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

本基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率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(以下简称“证金公司”)出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

新金融工具准则

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费(如有)在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

以摊余成本计量的负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费(如有)在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，本基金可以进行收益分配。在符合有关基金收益分配条件的前提下，每次收益分配比例根据以下原则确定：使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补亏损为前提，收益分配后基金份额净值有可能低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指

数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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》，公募基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，财政部于 2022 年颁布了《关于印发《资产管理产品相关会计处理规定》的通知》（财会[2022]14 号），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

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、其它资产、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 880.67 元、2,983.61 元、35.60 元、-16,390.74 元、12,490.86 元、-200,060.61 元和 200,060.61 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。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2022年12月31日	2021年12月31日
活期存款	9,213,589.85	9,693,729.64
等于：本金	9,212,753.75	9,693,729.64
加：应计利息	836.10	-
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	9,213,589.85	9,693,729.64

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2022年12月31日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	348,962,105.93	-	332,510,595.62	-16,451,510.31
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	348,962,105.93	-	332,510,595.62	-16,451,510.31
项目	上年度末			
	2021年12月31日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	349,717,370.90	-	369,701,845.73	19,984,474.83

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	349,717,370.90	-	369,701,845.73	19,984,474.83

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。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	12,217,160.00	-	-	-
其中：股指期货投资	12,217,160.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	12,217,160.00	-	-	-
项目	上年度末 2021年12月31日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	14,435,600.00	-	-	-
其中：股指期货投资	14,435,600.00	-	-	-

其他衍生工具	-	-	-
合计	14,435,600.00	-	-

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2303	IC2303	10.00	11,748,800.00	-468,360.00
合计				-468,360.00
减：可抵销期货暂收款				-468,360.00
净额				0.00

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

7.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应收利息	-	16,390.74
其他应收款	10,632.64	-
待摊费用	-	-
合计	10,632.64	16,390.74

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 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	492,477.78	200,060.61
其中：交易所市场	492,477.78	200,060.61
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	162,000.00	170,000.00
应付指数使用费	35,026.92	35,000.00
合计	689,504.70	405,060.61

7.4.7.10 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 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	232,211,253.00	232,211,253.00
本期申购	562,000,000.00	562,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-542,000,000.00	-542,000,000.00
- 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	252,211,253.00	252,211,253.00

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。

7.4.7.11 其他综合收益

注：无。

7.4.7.12 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	137,431,525.33	21,788,077.12	159,219,602.45
本期利润	-36,201,345.74	-37,074,603.79	-73,275,949.53
本期基金份额交易产生的变动数	30,790,847.79	-17,279,300.68	13,511,547.11
其中：基金申购款	332,039,048.19	-106,225,520.80	225,813,527.39
基金赎回款	-301,248,200.40	88,946,220.12	-212,301,980.28
本期已分配利润	-	-	-
本期末	132,021,027.38	-32,565,827.35	99,455,200.03

7.4.7.13 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12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
活期存款利息收入	45,786.67	38,692.38
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	90,839.00	67,486.05
其他	1,469.73	1,263.56
合计	138,095.40	107,441.99

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

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 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12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-16,440,540.39	53,958,914.65
股票投资收益——赎回差价收入	-26,450,081.87	5,304,295.17
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	-42,890,622.26	59,263,209.82

7.4.7.14.2 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12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
卖出股票成交总额	591,770,852.11	305,254,929.28
减：卖出股票成本总额	606,372,415.90	251,296,014.63
减：交易费用	1,838,976.60	-
买卖股票差价收入	-16,440,540.39	53,958,914.65

7.4.7.14.3 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12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
赎回基金份额对价总额	754,301,980.28	256,339,977.95
减：现金支付赎回款总额	413,983,287.28	126,285,158.95
减：赎回股票成本总额	366,768,774.87	124,750,523.83
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	-26,450,081.87	5,304,295.17

7.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：无。

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 收益金额 2021年1月1日至2021年12月31日
股指期货投资收益	-1,607,348.44	4,079,725.04

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
股票投资产生的股利	5,881,235.90	4,186,092.97

收益		
其中：证券出借权益补偿收入	644,640.39	109,862.00
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	5,881,235.90	4,186,092.97

7.4.7.20 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 12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021 年12月31日
1. 交易性金融资产	-36,435,985.14	11,456,506.85
股票投资	-36,435,985.14	11,456,506.85
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	-644,360.00	10,880.00
权证投资	-	-
期货投资	-644,360.00	10,880.00
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-5,126.21	316.89
合计	-37,075,218.93	11,467,069.96

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021 年12月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	2,754,937.54	820,985.71
合计	2,754,937.54	820,985.71

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。

7.4.7.22 信用减值损失

注：无。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
审计费用	42,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费用	669.00	731.00
指数使用费	140,026.92	140,000.00
交易费用	-	999,460.39
存托服务费	123.14	-
合计	302,819.06	1,310,191.39

7.4.7.24 分部报告

无。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

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
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人
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
深圳市北融信投资发展有限公司	基金管理人的股东
意大利欧利盛资本资产管理股份公司(“Eurizon Capital SGR S.p.A.”)	基金管理人的股东
鹏华资产管理有限公司(“鹏华资产”)	基金管理人的子公司
鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(“鹏华中证 500ETF 联接”)	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：1、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。

2、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31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	11,979,212.79	0.99	221,582,402.43	34.08

7.4.10.1.2 债券交易

注：无。

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

7.4.10.1.4 权证交易

注：无。

7.4.10.1.5 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12月31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	11,017.95	0.99	240.29	0.05
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31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	201,928.02	34.14	63,467.65	31.72

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

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12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	600,672.20	535,787.49
其中：支付销售机构的客户维护费	4,143.12	1,241.65

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0.15%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×0.15%÷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。

7.4.10.2.2 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12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	200,224.07	178,595.81

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0.05%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×0.05%/当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：无。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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

单位：人民币元

本期 2022年1月1日至2022年12月31日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
国信证券	11,935,260.00	8,312.46	-	-
上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
国信证券	8,779,958.00	5,675.00	832,234.00	281.03

注：（1）转融券金额为出借证券按照成交当日该证券收盘价计算的市值（展期转融券金额为按展期日该证券收盘价计算的市值）。

（2）转融券费用的计算公式为：每笔转融券费用=出借证券出借日或者展期日收盘价×该笔交易出借证券数量或者展期证券数量×该笔交易出借日或者展期日转融券费率×实际占用天数/360（计尾不计头）。

7.4.10.4.2 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

单位：人民币元

本期 2022年1月1日至2022年12月31日										
关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量 (单位:股)	出借期限 (单位:天)	费率 (%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
国信证券	2022011100011983	掌趣科技	2022年1月11日	20,460.00	4,400	14	3.20	25.46	-	-
国信证券	2022011700000944	捷成股份	2022年1月17日	25,230.00	3,000	14	3.20	47.10	-	-
国信证券	2022011900000790	蓝色光标	2022年1月19日	90,885.00	8,300	14	3.20	153.49	-	-
国信证券	2022011900000794	万达信息	2022年1月19日	88,288.00	6,200	14	3.20	149.11	-	-
国信证券	2022011900000796	长信科技	2022年1月19日	108,252.00	9,300	14	3.20	182.82	-	-
国信证券	202201190000079	网宿科技	2022年1月19日	40,768.00	5,600	14	3.20	68.85	-	-

	7		日							
国信证券	20220 12100 00088 3	红日 药业	2022 年1 月21 日	20,670.0 0	3,000	14	3.20	31.23	-	-
国信证券	20220 12100 00089 1	机器 人	2022 年1 月21 日	58,250.0 0	5,000	14	3.20	88.02	-	-
国信证券	20220 20700 04681 1	蓝色 光标	2022 年2 月7 日	70,965.0 0	8,300	14	3.20	88.31	-	-
国信证券	20220 20700 04681 3	长信 科技	2022 年2 月7 日	91,977.0 0	9,300	14	3.20	114.46	-	-
国信证券	20220 20700 04681 9	红日 药业	2022 年2 月7 日	18,540.0 0	3,000	14	3.20	23.07	-	-
国信证券	20220 20700 04682 3	捷成 股份	2022 年2 月7 日	18,600.0 0	3,000	14	3.20	23.15	-	-
国信证券	20220 20700 04684 3	万达 信息	2022 年2 月7 日	73,904.0 0	6,200	14	3.20	91.97	-	-
国信证券	20220 22100 03783 9	红日 药业	2022 年2 月21 日	18,840.0 0	3,000	14	3.20	23.45	-	-
国信证券	20220 22100 03784 1	蓝色 光标	2022 年2 月21 日	67,811.0 0	8,300	14	3.20	84.39	-	-
国信证券	20220 22100 03784 3	长信 科技	2022 年2 月21 日	92,256.0 0	9,300	14	3.20	114.81	-	-
国信证券	20220 22100 04756	捷成 股份	2022 年2 月21	19,830.0 0	3,000	14	3.20	24.68	-	-

	3		日							
国信证券	20220220000943	红日药业	2022年2月22日	19,260.00	3,000	14	3.20	23.97	-	-
国信证券	20220220000945	网宿科技	2022年2月22日	21,840.00	3,000	14	3.20	27.18	-	-
国信证券	202202230000914	红日药业	2022年2月23日	20,250.00	3,000	14	3.20	25.20	-	-
国信证券	202203070035356	长信科技	2022年3月7日	82,398.00	9,300	14	3.20	102.54	-	-
国信证券	202203070035362	捷成股份	2022年3月7日	17,430.00	3,000	14	3.20	21.69	-	-
国信证券	202203070038082	红日药业	2022年3月7日	20,490.00	3,000	14	3.20	25.50	-	-
国信证券	202203070042648	蓝色光标	2022年3月7日	42,728.00	5,600	14	3.20	53.17	-	-
国信证券	202203080013666	红日药业	2022年3月8日	18,240.00	3,000	14	3.20	22.70	-	-
国信证券	202203080015974	网宿科技	2022年3月8日	18,750.00	3,000	14	3.20	23.33	-	-
国信证券	202203090018085	红日药业	2022年3月9日	17,610.00	3,000	14	3.20	21.91	-	-
国信证券	20220321002843	红日药业	2022年3月21日	27,660.00	3,000	14	3.20	39.34	-	-

	7		日							
国信证券	2022032100028441	捷成股份	2022年3月21日	17,850.00	3,000	14	3.20	25.38	-	-
国信证券	2022032100029413	蓝色光标	2022年3月21日	45,696.00	5,600	14	3.20	64.99	-	-
国信证券	2022032200012707	红日药业	2022年3月22日	25,470.00	3,000	14	3.20	33.96	-	-
国信证券	2022032300001154	蓝色光标	2022年3月23日	40,900.00	5,000	14	3.20	50.90	-	-
国信证券	2022032300013735	红日药业	2022年3月23日	25,020.00	3,000	14	3.20	31.14	-	-
国信证券	2022040600051103	捷成股份	2022年4月6日	18,750.00	3,000	14	3.20	23.33	-	-
国信证券	2022040600062411	红日药业	2022年4月6日	24,990.00	3,000	14	3.20	31.10	-	-
国信证券	2022040600062413	红日药业	2022年4月6日	24,990.00	3,000	14	3.20	31.10	-	-
国信证券	2022040600062415	红日药业	2022年4月6日	24,990.00	3,000	14	3.20	31.10	-	-
国信证券	2022040600062417	蓝色光标	2022年4月6日	49,336.00	5,600	14	3.20	61.40	-	-
国信证券	202204060006241	蓝色光标	2022年4月6日	44,050.00	5,000	14	3.20	54.82	-	-

	9		日							
国信证券	202204070000961	红日药业	2022年4月7日	24,540.00	3,000	14	3.20	30.54	-	-
国信证券	202204200044824	红日药业	2022年4月20日	18,660.00	3,000	14	3.20	24.88	-	-
国信证券	202204200044826	红日药业	2022年4月20日	18,660.00	3,000	14	3.20	24.88	-	-
国信证券	202204200044828	红日药业	2022年4月20日	18,660.00	3,000	14	3.20	24.88	-	-
国信证券	202204200044830	蓝色光标	2022年4月20日	37,072.00	5,600	14	3.20	49.43	-	-
国信证券	202204200044832	蓝色光标	2022年4月20日	33,100.00	5,000	14	3.20	44.13	-	-
国信证券	202204200044834	捷成股份	2022年4月20日	14,940.00	3,000	14	3.20	19.92	-	-
国信证券	202204210001379	蓝色光标	2022年4月21日	18,990.00	3,000	14	3.20	23.63	-	-
国信证券	202204210013681	红日药业	2022年4月21日	18,120.00	3,000	14	3.20	22.55	-	-
国信证券	202205050072517	红日药业	2022年5月5日	17,760.00	3,000	14	3.20	22.10	-	-
国信证券	20220505007251	红日药业	2022年5月5日	17,760.00	3,000	14	3.20	22.10	-	-

	9		日							
国信证券	202205050072521	红日药业	2022年5月5日	17,760.00	3,000	14	3.20	22.10	-	-
国信证券	202205050072523	红日药业	2022年5月5日	17,760.00	3,000	14	3.20	22.10	-	-
国信证券	202205050072525	蓝色光标	2022年5月5日	31,920.00	5,600	14	3.20	39.72	-	-
国信证券	202205050072527	蓝色光标	2022年5月5日	28,500.00	5,000	14	3.20	35.47	-	-
国信证券	202205050072529	蓝色光标	2022年5月5日	17,100.00	3,000	14	3.20	21.28	-	-
国信证券	202205050072533	捷成股份	2022年5月5日	14,520.00	3,000	14	3.20	18.07	-	-
国信证券	2022051900041423	红日药业	2022年5月19日	17,460.00	3,000	14	3.20	21.73	-	-
国信证券	2022051900041425	红日药业	2022年5月19日	17,460.00	3,000	14	3.20	21.73	-	-
国信证券	2022051900041427	红日药业	2022年5月19日	17,460.00	3,000	14	3.20	21.73	-	-
国信证券	2022051900041429	红日药业	2022年5月19日	17,460.00	3,000	14	3.20	21.73	-	-
国信证券	202205190004143	蓝色光标	2022年5月19日	29,050.00	5,000	14	3.20	36.15	-	-

	1		日							
国信证券	2022051900041433	蓝色光标	2022年5月19日	17,430.00	3,000	14	3.20	21.69	-	-
国信证券	2022051900041445	蓝色光标	2022年5月19日	32,536.00	5,600	14	3.20	40.49	-	-
国信证券	2022051900041447	捷成股份	2022年5月19日	14,700.00	3,000	14	3.20	18.29	-	-
国信证券	2022060200013696	红日药业	2022年6月2日	16,260.00	3,000	14	3.20	20.23	-	-
国信证券	2022060200013698	红日药业	2022年6月2日	16,260.00	3,000	14	3.20	20.23	-	-
国信证券	2022060200013700	红日药业	2022年6月2日	16,260.00	3,000	14	3.20	20.23	-	-
国信证券	2022060200013702	红日药业	2022年6月2日	16,260.00	3,000	14	3.20	20.23	-	-
国信证券	2022060200013704	蓝色光标	2022年6月2日	30,500.00	5,000	14	3.20	37.96	-	-
国信证券	2022060200013706	蓝色光标	2022年6月2日	34,160.00	5,600	14	3.20	42.51	-	-
国信证券	2022060200013708	蓝色光标	2022年6月2日	18,300.00	3,000	14	3.20	22.77	-	-
国信证券	202206070000133	红日药业	2022年6月7日	29,800.00	5,000	14	3.20	37.08	-	-

	6		日							
国信证券	2022061600015905	红日药业	2022年6月16日	17,850.00	3,000	14	3.20	22.21	-	-
国信证券	2022061600015907	红日药业	2022年6月16日	17,850.00	3,000	14	3.20	22.21	-	-
国信证券	2022061600015909	红日药业	2022年6月16日	17,850.00	3,000	14	3.20	22.21	-	-
国信证券	2022061600017959	红日药业	2022年6月16日	17,850.00	3,000	14	3.20	22.21	-	-
国信证券	2022061600017961	蓝色光标	2022年6月16日	34,550.00	5,000	14	3.20	43.00	-	-
国信证券	2022061600017963	蓝色光标	2022年6月16日	38,696.00	5,600	14	3.20	48.16	-	-
国信证券	2022061600017965	蓝色光标	2022年6月16日	20,730.00	3,000	14	3.20	25.80	-	-
国信证券	2022062100009414	红日药业	2022年6月21日	34,250.00	5,000	14	3.20	42.62	-	-
国信证券	2022063000021091	红日药业	2022年6月30日	23,100.00	3,000	14	3.20	28.75	-	-
国信证券	2022063000021093	红日药业	2022年6月30日	23,100.00	3,000	14	3.20	28.75	-	-
国信证券	202206300002109	红日药业	2022年6月30日	23,100.00	3,000	14	3.20	28.75	-	-

	5		日							
国信证券	2022063000021097	蓝色光标	2022年6月30日	36,568.00	5,600	14	3.20	45.51	-	-
国信证券	2022063000021099	蓝色光标	2022年6月30日	19,590.00	3,000	14	3.20	24.38	-	-
国信证券	2022070500009626	红日药业	2022年7月5日	37,850.00	5,000	14	3.20	47.10	-	-
国信证券	2022071400014722	红日药业	2022年7月14日	20,700.00	3,000	14	3.20	25.76	-	-
国信证券	2022071400014724	红日药业	2022年7月14日	20,700.00	3,000	14	3.20	25.76	-	-
国信证券	2022071400014726	红日药业	2022年7月14日	20,700.00	3,000	14	3.20	25.76	-	-
国信证券	2022071400014728	蓝色光标	2022年7月14日	17,700.00	3,000	14	3.20	22.03	-	-
国信证券	2022071800001309	蓝色光标	2022年7月18日	76,310.00	13,000	14	3.20	94.96	-	-
国信证券	2022071900009732	红日药业	2022年7月19日	33,300.00	5,000	14	3.20	41.44	-	-
国信证券	2022072800015379	红日药业	2022年7月28日	19,410.00	3,000	14	3.20	24.15	-	-
国信证券	202207280001538	红日药业	2022年7月28日	19,410.00	3,000	14	3.20	24.15	-	-

	1		日							
国信证券	2022072800015383	红日药业	2022年7月28日	19,410.00	3,000	14	3.20	24.15	-	-
国信证券	2022072800015385	蓝色光标	2022年7月28日	18,000.00	3,000	14	3.20	22.40	-	-
国信证券	2022080100001142	蓝色光标	2022年8月1日	23,800.00	4,000	14	3.20	29.62	-	-
国信证券	2022080100013829	蓝色光标	2022年8月1日	77,350.00	13,000	14	3.20	96.26	-	-
国信证券	2022080200010751	红日药业	2022年8月2日	29,300.00	5,000	14	3.20	36.46	-	-
国信证券	2022081100016050	红日药业	2022年8月11日	18,420.00	3,000	14	3.20	22.92	-	-
国信证券	2022081500001389	红日药业	2022年8月15日	19,488.00	3,200	14	3.20	24.25	-	-
国信证券	2022081500017851	蓝色光标	2022年8月15日	34,770.00	5,700	14	3.20	43.27	-	-
国信证券	2022081500018109	蓝色光标	2022年8月15日	24,400.00	4,000	14	3.20	30.36	-	-
国信证券	2022081600009450	红日药业	2022年8月16日	30,600.00	5,000	14	3.20	38.08	-	-
国信证券	202208250001503	红日药业	2022年8月25日	17,760.00	3,000	14	3.20	22.10	-	-

	2		日							
国信证券	2022082900015995	蓝色光标	2022年8月29日	23,240.00	4,000	14	3.20	30.99	-	-
国信证券	2022082900018043	红日药业	2022年8月29日	18,848.00	3,200	14	3.20	25.14	-	-
国信证券	2022082900018121	蓝色光标	2022年8月29日	33,117.00	5,700	14	3.20	44.15	-	-
国信证券	2022083000012664	红日药业	2022年8月30日	28,350.00	5,000	14	3.20	35.28	-	-
国信证券	2022090800016810	红日药业	2022年9月8日	16,800.00	3,000	14	3.20	20.91	-	-
国信证券	2022091300025771	红日药业	2022年9月13日	28,700.00	5,000	14	3.20	35.72	-	-
国信证券	2022091300028149	蓝色光标	2022年9月13日	21,560.00	4,000	14	3.20	26.83	-	-
国信证券	2022091300030961	红日药业	2022年9月13日	18,368.00	3,200	14	3.20	22.86	-	-
国信证券	2022092700030367	红日药业	2022年9月27日	26,050.00	5,000	14	3.20	32.42	-	-
国信证券	2022092700030371	红日药业	2022年9月27日	16,672.00	3,200	14	3.20	20.75	-	-
国信证券	202210280000129	红日药业	2022年10月28日	13,500.00	2,000	14	3.20	16.80	-	-

	8		日							
国信证券	20221 10300 00147 4	蓝色 光标	2022 年 11 月 3 日	139,860. 00	27,000	14	3.20	174.05	-	-
国信证券	20221 11100 01304 5	红日 药业	2022 年 11 月 11 日	13,160.0 0	2,000	14	3.20	16.38	-	-
国信证券	20221 11700 00755 8	蓝色 光标	2022 年 11 月 17 日	158,220. 00	27,000	14	3.20	196.90	-	-
国信证券	20221 12500 00714 8	红日 药业	2022 年 11 月 25 日	13,280.0 0	2,000	14	3.20	16.53	-	-
国信证券	20221 20100 00759 0	蓝色 光标	2022 年 12 月 1 日	145,530. 00	27,000	14	3.20	181.10	-	-
国信证券	20221 20900 00588 4	红日 药业	2022 年 12 月 9 日	13,680.0 0	2,000	14	3.20	17.02	-	-
国信证券	20221 22300 00916 6	红日 药业	2022 年 12 月 23 日	11,220.0 0	2,000	14	3.20	13.96	11,360 .00	7.98
上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日										
关联方 名称	合约 编号	证券 名称	成交 时间	交易金 额	交易 数量 (单 位: 股)	出 借 期 限 (单 位: 天)	费 率 (%)	利息 收入	期末 证券 出借 业务 余额	期末应 收利息 余额
国信证券	20211 01400 00100 3	神州 泰岳	2021- 10-14	58,400.0 0	10,000	14	3.40	77.22	-	-
国信证券	20211	神州	2021-	52,300.0	10,000	14	3.40	69.15	-	-

	02800 01358 1	泰岳	10-28	0						
国信证券	20211 11100 01158 2	神州 泰岳	2021- 11-11	61,200.0 0	10,000	14	3.20	76.16	-	-
国信证券	20211 11200 00077 4	长信 科技	2021- 11-12	38,100.0 0	3,000	14	3.20	47.41	-	-
国信证券	20211 11500 00145 8	利亚 德	2021- 11-15	33,376.0 0	3,200	14	3.20	41.53	-	-
国信证券	20211 11500 00145 9	掌趣 科技	2021- 11-15	13,380.0 0	3,000	14	3.20	16.65	-	-
国信证券	20211 11600 00106 9	利亚 德	2021- 11-16	70,265.0 0	6,500	14	3.20	87.44	-	-
国信证券	20211 11600 00106 8	掌趣 科技	2021- 11-16	20,152.0 0	4,400	14	3.20	25.08	-	-
国信证券	20211 11700 00078 0	利亚 德	2021- 11-17	68,224.0 0	6,400	14	3.20	84.90	-	-
国信证券	20211 11700 00077 8	掌趣 科技	2021- 11-17	19,221.0 0	4,300	14	3.20	23.92	-	-
国信证券	20211 11800 00091 3	光环 新网	2021- 11-18	73,300.0 0	5,000	14	3.20	91.22	-	-
国信证券	20211 11800 00090 8	华宇 软件	2021- 11-18	92,160.0 0	8,000	14	3.20	114.69	-	-
国信证券	20211	红日	2021-	20,850.0	5,000	14	3.20	25.95	-	-

	11800 00091 0	药业	11-18	0						
国信证券	20211 11900 00091 6	利亚德	2021- 11-19	116,480. 00	11,200	14	3.20	144.95	-	-
国信证券	20211 12500 00938 2	神州泰岳	2021- 11-25	58,400.0 0	10,000	14	3.20	72.68	-	-
国信证券	20211 12900 00491 5	利亚德	2021- 11-29	33,440.0 0	3,200	14	3.20	41.61	-	-
国信证券	20211 12900 00491 7	掌趣科技	2021- 11-29	12,030.0 0	3,000	14	3.20	14.97	-	-
国信证券	20211 13000 00416 5	掌趣科技	2021- 11-30	17,732.0 0	4,400	14	3.20	22.07	-	-
国信证券	20211 13000 00471 1	利亚德	2021- 11-30	64,953.0 0	6,300	14	3.20	80.83	-	-
国信证券	20211 20100 00454 1	利亚德	2021- 12-1	64,108.0 0	6,200	14	3.20	79.78	-	-
国信证券	20211 20100 00469 7	掌趣科技	2021- 12-1	17,802.0 0	4,300	14	3.20	22.15	-	-
国信证券	20211 20300 02337 5	利亚德	2021- 12-3	101,082. 00	10,200	14	3.20	125.79	-	-
国信证券	20211 21300 00921 9	掌趣科技	2021- 12-13	13,380.0 0	3,000	14	3.20	16.65	-	-
国信证券	20211	利亚	2021-	33,632.0	3,200	14	3.20	41.85	-	-

	21300 00972 7	德	12-13	0							
国信证券	20211 21400 01109 6	掌趣 科技	2021- 12-14	19,668.0 0	4,400	14	3.20	24.48	-	-	
国信证券	20211 21400 01152 2	利亚 德	2021- 12-14	65,268.0 0	6,300	14	3.20	81.22	-	-	
国信证券	20211 21500 01663 3	利亚 德	2021- 12-15	64,356.0 0	6,200	14	3.20	80.09	-	-	
国信证券	20211 21500 01671 3	掌趣 科技	2021- 12-15	19,995.0 0	4,300	14	3.20	24.88	-	-	
国信证券	20211 21700 02745 4	利亚 德	2021- 12-17	109,548. 00	10,200	14	3.20	136.33	-	-	
国信证券	20211 22700 00927 4	掌趣 科技	2021- 12-27	13,410.0 0	3,000	14	3.20	16.69	14,580 .00	4.77	
国信证券	20211 22700 00927 2	利亚 德	2021- 12-27	33,056.0 0	3,200	14	3.20	41.14	32,800 .00	11.75	
国信证券	20211 22800 01432 6	利亚 德	2021- 12-28	53,040.0 0	5,200	14	3.20	66.01	53,300 .00	14.14	
国信证券	20211 22800 01408 4	掌趣 科技	2021- 12-28	19,668.0 0	4,400	14	3.20	24.48	21,384 .00	5.24	
国信证券	20211 22900 01055 2	掌趣 科技	2021- 12-29	8,900.00	2,000	14	3.20	11.08	9,720. 00	1.58	

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 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。

7.4.10.5.2 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12月31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（%）
鹏华中证 500ETF联接	62,577,637.00	24.81	51,373,737.00	22.12

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。

7.4.10.6 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12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31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	9,213,589.85	45,786.67	9,693,729.64	38,692.38

7.4.10.7 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12月31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： 股/张）	总金额
国信证券	301338	凯格精机	网下申购	2,568	118,975.44
国信证券	688401	路维光电	网下申购	4,947	124,070.76
国信证券	688231	隆达股份	网下申购	3,308	129,276.64
国信证券	301161	唯万密封	网下申购	3,460	64,563.60
国信证券	688244	永信至诚	网下申购	1,506	74,080.14
上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31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： 股/张）	总金额
国信证券	301091	深城交	网下申购	3,973	145,014.50
国信证券	301066	万事利	网下申购	3,436	18,004.64

国信证券	688622	禾信仪器	网下申购	1,204	21,310.80
国信证券	301032	新柴股份	网下申购	5,124	25,466.28
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
国信证券	300957	贝泰妮	网下申购	1,898	89,832.34

注：本表包含参与基金托管人的关联方承销证券的情况。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

注：无。

7.4.12 期末（2022 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
301095	广立微	2022年7月28日	6个月	新股流通受限	58.00	86.49	254	14,732.00	21,968.46	-
301115	建科股份	2022年8月23日	6个月	新股流通受限	42.05	24.04	340	14,297.00	8,173.60	-
301132	满坤科技	2022年8月3日	6个月	新股流通受限	26.80	24.48	433	11,604.40	10,599.84	-
301152	天力锂能	2022年8月19日	6个月	新股流通受限	57.00	46.64	241	13,737.00	11,240.24	-
301161	唯万密封	2022年9月6日	6个月	新股流通受限	18.66	21.73	346	6,456.36	7,518.58	-
301171	易点天下	2022年8月10日	6个月	新股流通受限	18.18	17.72	493	8,962.74	8,735.96	-
301175	中科环保	2022年6月30日	6个月	新股流通受限	3.82	6.01	3,859	14,741.38	23,192.59	-
301197	工大科雅	2022年7月29日	6个月	新股流通受限	25.50	20.08	380	9,690.00	7,630.40	-

		日									
301231	荣信文化	2022年8月31日	6个月	新股流通受限	25.49	20.38	275	7,009.75	5,604.50		-
301233	盛帮股份	2022年6月24日	6个月	新股流通受限	41.52	34.30	158	6,560.16	5,419.40		-
301239	普瑞眼科	2022年6月22日	6个月	新股流通受限	33.65	69.68	408	13,729.20	28,429.44		-
301265	华新环保	2022年12月8日	6个月	新股流通受限	13.28	11.40	688	9,136.64	7,843.20		-
301267	华夏眼科	2022年10月26日	6个月	新股流通受限	50.88	66.20	287	14,602.56	18,999.40		-
301269	华大九天	2022年7月21日	6个月	新股流通受限	32.69	87.94	318	10,395.42	27,964.92		-
301270	汉仪股份	2022年8月19日	6个月	新股流通受限	25.68	28.37	210	5,392.80	5,957.70		-
301276	嘉曼服饰	2022年9月1日	6个月	新股流通受限	40.66	22.61	265	10,774.90	5,991.65		-
301277	新天地	2022年11月9日	6个月	新股流通受限	27.00	25.78	439	11,853.00	11,317.42		-
301282	金禄电子	2022年8月18日	6个月	新股流通受限	30.38	25.25	340	10,329.20	8,585.00		-
301283	聚胶股份	2022年8月26日	6个月	新股流通受限	52.69	51.41	200	10,538.00	10,282.00		-
301285	鸿日达	2022年9月21日	6个月	新股流通受限	14.60	12.60	565	8,249.00	7,119.00		-
301290	东星医疗	2022年11月23日	6个月	新股流通受限	44.09	35.13	316	13,932.44	11,101.08		-
301296	新巨丰	2022年8月26日	6个月	新股流通受限	18.19	14.90	699	12,714.81	10,415.10		-
301297	富乐	2022年	6个月	新股流	8.48	12.99	1,015	8,607.20	13,184.85		-

	德	12月23日		通受限							
301300	远翔新材	2022年8月9日	6个月	新股流通受限	36.15	29.37	211	7,627.65	6,197.07		-
301301	川宁生物	2022年12月20日	6个月	新股流通受限	5.00	7.53	2,922	14,610.00	22,002.66		-
301306	西测测试	2022年7月19日	6个月	新股流通受限	43.23	42.29	251	10,850.73	10,614.79		-
301309	万得凯	2022年9月8日	6个月	新股流通受限	39.00	24.46	189	7,371.00	4,622.94		-
301311	昆船智能	2022年11月23日	6个月	新股流通受限	13.88	15.86	832	11,548.16	13,195.52		-
301313	凡拓数创	2022年9月22日	6个月	新股流通受限	25.25	29.14	247	6,236.75	7,197.58		-
301316	慧博云通	2022年9月29日	6个月	新股流通受限	7.60	14.32	359	2,728.40	5,140.88		-
301318	维海德	2022年8月3日	6个月	新股流通受限	64.68	41.74	148	9,572.64	6,177.52		-
301319	唯特偶	2022年9月22日	6个月	新股流通受限	47.75	53.27	115	5,491.25	6,126.05		-
301327	华宝新能	2022年9月8日	6个月	新股流通受限	237.50	176.97	121	28,737.50	21,413.37		-
301328	维峰电子	2022年8月30日	6个月	新股流通受限	78.80	76.96	136	10,716.80	10,466.56		-
301338	凯格精机	2022年8月8日	6个月	新股流通受限	46.33	48.99	257	11,906.81	12,590.43		-
301339	通行宝	2022年9月2日	6个月	新股流通受限	18.78	15.59	593	11,136.54	9,244.87		-
301349	信德新材	2022年8月30日	6个月	新股流通受限	138.88	103.52	72	9,999.36	7,453.44		-

301359	东南电子	2022年11月2日	6个月	新股流通受限	20.84	19.90	328	6,835.52	6,527.20	-
301361	众智科技	2022年11月8日	6个月	新股流通受限	26.44	20.96	517	13,669.48	10,836.32	-
301363	美好医疗	2022年9月28日	6个月	新股流通受限	30.66	37.85	324	9,933.84	12,263.40	-
301367	怡和嘉业	2022年10月21日	6个月	新股流通受限	119.88	175.78	173	20,739.24	30,409.94	-
301368	丰立智能	2022年12月7日	6个月	新股流通受限	22.33	18.52	337	7,525.21	6,241.24	-
301377	鼎泰高科	2022年11月11日	6个月	新股流通受限	22.88	17.63	645	14,757.60	11,371.35	-
301388	欣灵电气	2022年10月26日	6个月	新股流通受限	25.88	21.60	292	7,556.96	6,307.20	-
301398	星源卓镁	2022年12月8日	6个月	新股流通受限	34.40	28.94	255	8,772.00	7,379.70	-
688035	德邦科技	2022年9月9日	6个月	新股流通受限	46.12	48.82	2,988	137,806.56	145,874.16	-
688147	微导纳米	2022年12月16日	6个月	新股流通受限	24.21	23.91	4,699	113,762.79	112,353.09	-

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份，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，锁定期限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。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600038	中直股份	2022年12月26日	重大事项	46.41	2023年1月10日	51.05	15,400	709,551.43	714,714.00	-
300850	新强联	2022年12月30日	重大事项	53.28	2023年1月10日	56.88	10,200	611,223.61	543,456.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值单价	数量(单位:股)	期末估值总额
1	000009	中国宝安	2023年1月3日	12.09	17,000	205,530.00
2	000012	南玻A	2023年1月4日	6.71	11,000	73,810.00
3	000027	深圳能	2023年1月5日	6.36	15,000	95,400.00

		源				
4	000031	大悦城	2023 年 1 月 3 日	3.76	12,000	45,120.00
5	000050	深天马 A	2023 年 1 月 5 日	8.66	11,000	95,260.00
6	000402	金融 街	2023 年 1 月 5 日	5.25	10,000	52,500.00
7	000415	渤海租 赁	2023 年 1 月 3 日	2.21	21,000	46,410.00
8	000540	中天金 融	2023 年 1 月 3 日	1.51	30,000	45,300.00
9	000559	万向钱 潮	2023 年 1 月 4 日	4.87	10,000	48,700.00
10	000563	陕国投 A	2023 年 1 月 5 日	3.03	16,000	48,480.00
11	000591	太阳能	2023 年 1 月 10 日	7.33	20,000	146,600.00
12	000598	兴蓉环 境	2023 年 1 月 10 日	4.89	10,000	48,900.00
13	000629	钒钛股 份	2023 年 1 月 4 日-2023 年 1 月 5 日	4.73	30,000	141,900.00
14	000630	铜陵有 色	2023 年 1 月 10 日	3.12	68,000	212,160.00
15	000656	金科股 份	2023 年 1 月 4 日-2023 年 1 月 9 日	1.91	34,800	66,468.00
16	000683	远兴能 源	2023 年 1 月 10 日	7.84	22,000	172,480.00
17	000703	恒逸石 化	2023 年 1 月 10 日	7.03	18,000	126,540.00
18	000807	云铝股 份	2023 年 1 月 9 日	11.12	17,000	189,040.00
19	000878	云南铜 业	2023 年 1 月 9 日	11.75	10,000	117,500.00
20	000883	湖北能 源	2023 年 1 月 3 日	4.20	10,400	43,680.00
21	000959	首钢股 份	2023 年 1 月 5 日	3.77	12,000	45,240.00
22	000961	中南建 设	2023 年 1 月 3 日	2.19	10,600	23,214.00
23	000967	盈峰环 境	2023 年 1 月 3 日	4.54	11,000	49,940.00
24	000975	银泰黄 金	2023 年 1 月 11 日	11.04	14,000	154,560.00
25	002002	鸿达兴 业	2023 年 1 月 12 日	3.24	15,000	48,600.00

26	002010	传化智联	2023 年 1 月 3 日	5.34	12,000	64,080.00
27	002065	东华软件	2023 年 1 月 4 日	5.66	11,900	67,354.00
28	002078	太阳纸业	2023 年 1 月 3 日	11.52	10,000	115,200.00
29	002081	金螳螂	2023 年 1 月 3 日	4.85	14,000	67,900.00
30	002124	天邦食品	2023 年 1 月 3 日	6.11	13,000	79,430.00
31	002127	南极电商	2023 年 1 月 3 日	4.81	17,000	81,770.00
32	002131	利欧股份	2023 年 1 月 4 日-2023 年 1 月 10 日	1.77	59,100	104,607.00
33	002146	荣盛发展	2023 年 1 月 5 日	2.17	20,000	43,400.00
34	002152	广电运通	2023 年 1 月 5 日	9.94	10,000	99,400.00
35	002156	通富微电	2023 年 1 月 3 日	16.48	10,000	164,800.00
36	002183	怡亚通	2023 年 1 月 3 日	6.43	10,000	64,300.00
37	002185	华天科技	2023 年 1 月 3 日	8.29	24,000	198,960.00
38	002195	二三四五	2023 年 1 月 3 日-2023 年 1 月 5 日	2.01	50,000	100,500.00
39	002203	海亮股份	2023 年 1 月 3 日	11.30	10,000	113,000.00
40	002212	天融信	2023 年 1 月 5 日	9.99	10,000	99,900.00
41	002244	滨江集团	2023 年 1 月 3 日	8.83	11,000	97,130.00
42	002249	大洋电机	2023 年 1 月 4 日	5.12	14,000	71,680.00
43	002266	浙富控股	2023 年 1 月 13 日	3.91	18,000	70,380.00
44	002273	水晶光电	2023 年 1 月 13 日	11.79	12,000	141,480.00
45	002340	格林美	2023 年 1 月 12 日	7.43	45,000	334,350.00
46	002384	东山精密	2023 年 1 月 9 日	24.73	12,000	296,760.00
47	002385	大北农	2023 年 1 月 3 日	8.90	29,000	258,100.00
48	002408	齐翔腾	2023 年 1 月 3 日	7.04	14,000	98,560.00

		达				
49	002422	科伦药业	2023 年 1 月 3 日	26.61	10,000	266,100.00
50	002429	兆驰股份	2023 年 1 月 3 日-2023 年 1 月 13 日	3.49	21,000	73,290.00
51	002465	海格通信	2023 年 1 月 3 日	8.12	15,000	121,800.00
52	002497	雅化集团	2023 年 1 月 5 日	23.25	10,000	232,500.00
53	002505	鹏都农牧	2023 年 1 月 3 日	2.58	28,000	72,240.00
54	002506	协鑫集成	2023 年 1 月 3 日	2.91	37,000	107,670.00
55	002532	天山铝业	2023 年 1 月 5 日	7.72	12,000	92,640.00
56	002624	完美世界	2023 年 1 月 3 日	12.72	12,000	152,640.00
57	002625	光启技术	2023 年 1 月 5 日	17.02	11,000	187,220.00
58	002670	国盛金控	2023 年 1 月 12 日	7.41	10,000	74,100.00
59	002739	万达电影	2023 年 1 月 6 日	14.00	10,000	140,000.00
60	002797	第一创业	2023 年 1 月 3 日	5.63	24,000	135,120.00
61	002936	郑州银行	2023 年 1 月 12 日	2.35	45,000	105,750.00
62	002939	长城证券	2023 年 1 月 9 日	8.28	10,000	82,800.00
63	002948	青岛银行	2023 年 1 月 4 日	3.36	15,000	50,400.00
64	002966	苏州银行	2023 年 1 月 11 日	7.78	30,000	233,400.00
65	003035	南网能源	2023 年 1 月 9 日	5.67	10,000	56,700.00
66	300001	特锐德	2023 年 1 月 5 日	15.21	7,300	111,033.00
67	300003	乐普医疗	2023 年 1 月 11 日	22.97	11,000	252,670.00
68	300009	安科生物	2023 年 1 月 4 日	9.36	10,800	101,088.00
69	300012	华测检测	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 12 日	22.30	10,900	243,070.00
70	300017	网宿科	2023 年 1 月 3 日	5.58	21,600	120,528.00

		技				0
71	300024	机器人	2023 年 1 月 3 日-2023 年 1 月 4 日	8.98	11,700	105,066.0 0
72	300026	红日药 业	2023 年 1 月 3 日-2023 年 1 月 6 日	5.68	19,600	111,328.0 0
73	300058	蓝色光 标	2023 年 1 月 3 日-2023 年 1 月 13 日	5.05	22,000	111,100.0 0
74	300070	碧水源	2023 年 1 月 3 日-2023 年 1 月 4 日	4.73	20,700	97,911.00
75	300072	海新能 科	2023 年 1 月 5 日	4.36	14,000	61,040.00
76	300073	当升科 技	2023 年 1 月 4 日	56.40	3,300	186,120.0 0
77	300088	长信科 技	2023 年 1 月 3 日-2023 年 1 月 4 日	5.97	23,000	137,310.0 0
78	300115	长盈精 密	2023 年 1 月 11 日	10.33	7,000	72,310.00
79	300136	信维通 信	2023 年 1 月 4 日	16.51	9,000	148,590.0 0
80	300144	宋城演 艺	2023 年 1 月 4 日	14.60	14,000	204,400.0 0
81	300146	汤臣倍 健	2023 年 1 月 3 日	22.82	10,000	228,200.0 0
82	300168	万达信 息	2023 年 1 月 4 日	8.43	10,000	84,300.00
83	300182	捷成股 份	2023 年 1 月 3 日-2023 年 1 月 5 日	4.47	19,400	86,718.00
84	300212	易华录	2023 年 1 月 3 日-2023 年 1 月 9 日	20.41	3,400	69,394.00
85	300244	迪安诊 断	2023 年 1 月 3 日	25.13	4,500	113,085.0 0
86	300251	光线传 媒	2023 年 1 月 3 日-2023 年 1 月 4 日	8.66	10,400	90,064.00
87	300257	开山股 份	2023 年 1 月 4 日	15.00	3,900	58,500.00
88	300296	利亚德	2023 年 1 月 3 日	5.66	19,000	107,540.0 0
89	300308	中际旭 创	2023 年 1 月 3 日	27.03	4,800	129,744.0 0
90	300357	我武生 物	2023 年 1 月 10 日	55.10	3,000	165,300.0 0
91	300363	博腾股 份	2023 年 1 月 3 日	40.85	3,000	122,550.0 0
92	300373	扬杰科	2023 年 1 月 9 日	52.60	2,200	115,720.0

		技				0
93	300376	易事特	2023 年 1 月 3 日	6.83	10,000	68,300.00
94	300383	光环新网	2023 年 1 月 5 日-2023 年 1 月 9 日	8.16	12,600	102,816.00
95	300390	天华超净	2023 年 1 月 4 日	55.88	3,500	195,580.00
96	300418	昆仑万维	2023 年 1 月 12 日	14.41	8,000	115,280.00
97	300463	迈克生物	2023 年 1 月 4 日	17.30	3,000	51,900.00
98	300482	万孚生物	2023 年 1 月 9 日	31.87	2,300	73,301.00
99	300558	贝达药业	2023 年 1 月 4 日	49.27	2,200	108,394.00
100	300568	星源材质	2023 年 1 月 11 日	21.26	8,000	170,080.00
101	300604	长川科技	2023 年 1 月 10 日	44.58	3,000	133,740.00
102	300618	寒锐钴业	2023 年 1 月 3 日	40.05	2,000	80,100.00
103	300630	普利制药	2023 年 1 月 9 日	24.66	2,300	56,718.00
104	300676	华大基因	2023 年 1 月 13 日	51.69	1,900	98,211.00
105	300677	英科医疗	2023 年 1 月 3 日	21.03	4,000	84,120.00
106	300682	朗新科技	2023 年 1 月 10 日	21.98	4,000	87,920.00
107	300699	光威复材	2023 年 1 月 3 日	72.25	2,700	195,075.00
108	300724	捷佳伟创	2023 年 1 月 12 日	114.02	2,000	228,040.00
109	300741	华宝股份	2023 年 1 月 9 日	23.53	1,000	23,530.00
110	300832	新产业	2023 年 1 月 3 日	50.14	2,800	140,392.00
111	300850	新强联	2023 年 1 月 9 日	53.28	1,200	63,936.00
112	300869	康泰医学	2023 年 1 月 9 日	32.57	1,400	45,598.00
113	300888	稳健医疗	2023 年 1 月 6 日	71.50	1,000	71,500.00
114	600008	首创环保	2023 年 1 月 5 日-2023 年 1 月 10 日	2.83	38,000	107,540.00
115	600021	上海电	2023 年 1 月 4 日	10.01	10,000	100,100.00

		力				0
116	600026	中远海能	2023年1月3日	12.05	10,000	120,500.00
117	600027	华电国际	2023年1月4日-2023年1月5日	5.88	29,700	174,636.00
118	600079	人福医药	2023年1月10日	23.89	10,000	238,900.00
119	600143	金发科技	2023年1月3日-2023年1月4日	9.69	17,000	164,730.00
120	600155	华创阳安	2023年1月4日	6.50	10,000	65,000.00
121	600157	永泰能源	2023年1月3日-2023年1月10日	1.53	196,700	300,951.00
122	600160	巨化股份	2023年1月10日	15.51	11,500	178,365.00
123	600167	联美控股	2023年1月3日	6.32	10,000	63,200.00
124	600170	上海建工	2023年1月5日	2.60	45,000	117,000.00
125	600177	雅戈尔	2023年1月13日	6.33	21,600	136,728.00
126	600201	生物股份	2023年1月3日	9.01	10,000	90,100.00
127	600271	航天信息	2023年1月13日	10.41	10,000	104,100.00
128	600297	广汇汽车	2023年1月3日-2023年1月6日	2.10	34,500	72,450.00
129	600307	酒钢宏兴	2023年1月12日	1.65	27,000	44,550.00
130	600325	华发股份	2023年1月10日	9.06	14,000	126,840.00
131	600339	中油工程	2023年1月4日	2.98	10,000	29,800.00
132	600348	华阳股份	2023年1月5日	14.25	10,000	142,500.00
133	600352	浙江龙盛	2023年1月10日	9.90	22,000	217,800.00
134	600376	首开股份	2023年1月12日	5.69	11,000	62,590.00
135	600380	健康元	2023年1月3日	11.29	10,000	112,900.00
136	600390	五矿资本	2023年1月3日	5.08	19,000	96,520.00
137	600392	盛和资	2023年1月12日	14.00	12,000	168,000.00

		源				0
138	600398	海澜之家	2023 年 1 月 10 日	5.30	14,000	74,200.00
139	600409	三友化工	2023 年 1 月 4 日	6.61	10,000	66,100.00
140	600415	小商品城	2023 年 1 月 4 日	5.24	25,000	131,000.00
141	600418	江淮汽车	2023 年 1 月 3 日	13.13	10,000	131,300.00
142	600487	亨通光电	2023 年 1 月 4 日	15.06	17,000	256,020.00
143	600497	驰宏锌锗	2023 年 1 月 10 日	5.06	26,400	133,584.00
144	600499	科达制造	2023 年 1 月 3 日	14.21	10,000	142,100.00
145	600500	中化国际	2023 年 1 月 4 日	6.61	11,000	72,710.00
146	600516	方大炭素	2023 年 1 月 4 日-2023 年 1 月 11 日	6.12	20,000	122,400.00
147	600517	国网英大	2023 年 1 月 10 日	4.84	14,000	67,760.00
148	600528	中铁工业	2023 年 1 月 4 日	7.63	11,000	83,930.00
149	600567	山鹰国际	2023 年 1 月 3 日	2.48	27,700	68,696.00
150	600582	天地科技	2023 年 1 月 13 日	5.20	14,000	72,800.00
151	600637	东方明珠	2023 年 1 月 4 日	6.65	11,100	73,815.00
152	600655	豫园股份	2023 年 1 月 10 日	7.61	16,000	121,760.00
153	600667	太极实业	2023 年 1 月 13 日	5.16	10,000	51,600.00
154	600673	东阳光	2023 年 1 月 4 日	8.69	15,000	130,350.00
155	600704	物产中大	2023 年 1 月 3 日	4.81	26,000	125,060.00
156	600705	中航产融	2023 年 1 月 12 日-2023 年 1 月 13 日	3.28	33,200	108,896.00
157	600707	彩虹股份	2023 年 1 月 3 日	4.14	11,000	45,540.00
158	600728	佳都科技	2023 年 1 月 3 日	5.28	12,300	64,944.00
159	600737	中粮糖	2023 年 1 月 3 日	6.94	10,000	69,400.00

		业				
160	600755	厦门国贸	2023 年 1 月 3 日	7.14	14,300	102,102.00
161	600820	隧道股份	2023 年 1 月 5 日	5.27	20,000	105,400.00
162	600839	四川长虹	2023 年 1 月 4 日-2023 年 1 月 5 日	2.64	33,200	87,648.00
163	600848	上海临港	2023 年 1 月 3 日	11.92	10,000	119,200.00
164	600863	内蒙华电	2023 年 1 月 3 日	3.49	28,000	97,720.00
165	600867	通化东宝	2023 年 1 月 10 日	9.18	12,000	110,160.00
166	600871	石化油服	2023 年 1 月 5 日-2023 年 1 月 6 日	1.98	35,000	69,300.00
167	600906	财达证券	2023 年 1 月 10 日	7.57	10,000	75,700.00
168	600928	西安银行	2023 年 1 月 5 日	3.52	10,000	35,200.00
169	600959	江苏有线	2023 年 1 月 3 日-2023 年 1 月 13 日	2.97	23,800	70,686.00
170	600968	海油发展	2023 年 1 月 11 日	2.88	10,000	28,800.00
171	600970	中材国际	2023 年 1 月 6 日	8.52	10,000	85,200.00
172	600985	淮北矿业	2023 年 1 月 3 日	12.80	10,000	128,000.00
173	600988	赤峰黄金	2023 年 1 月 3 日	18.05	10,000	180,500.00
174	601000	唐山港	2023 年 1 月 11 日	2.74	25,000	68,500.00
175	601016	节能风电	2023 年 1 月 9 日-2023 年 1 月 10 日	3.81	30,000	114,300.00
176	601058	赛轮轮胎	2023 年 1 月 4 日	10.02	21,700	217,434.00
177	601077	渝农商行	2023 年 1 月 12 日	3.53	53,000	187,090.00
178	601118	海南橡胶	2023 年 1 月 13 日	4.38	15,000	65,700.00
179	601168	西部矿业	2023 年 1 月 3 日	10.20	10,000	102,000.00
180	601179	中国西电	2023 年 1 月 4 日	4.61	17,000	78,370.00
181	601233	桐昆股份	2023 年 1 月 10 日	14.45	14,000	202,300.00

182	601568	北元集团	2023 年 1 月 13 日	5.67	10,000	56,700.00
183	601598	中国外运	2023 年 1 月 3 日	3.84	15,000	57,600.00
184	601607	上海医药	2023 年 1 月 12 日	17.83	10,000	178,300.00
185	601636	旗滨集团	2023 年 1 月 11 日	11.39	13,000	148,070.00
186	601666	平煤股份	2023 年 1 月 10 日	10.81	11,000	118,910.00
187	601699	潞安环能	2023 年 1 月 11 日	16.85	10,000	168,500.00
188	601718	际华集团	2023 年 1 月 4 日	2.91	24,300	70,713.00
189	601778	晶科科技	2023 年 1 月 3 日	5.50	15,000	82,500.00
190	601866	中远海发	2023 年 1 月 3 日-2023 年 1 月 5 日	2.42	39,400	95,348.00
191	601872	招商轮船	2023 年 1 月 3 日-2023 年 1 月 5 日	5.59	27,700	154,843.00
192	601880	辽港股份	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 10 日	1.62	65,000	105,300.00
193	601991	大唐发电	2023 年 1 月 10 日	2.79	20,000	55,800.00
194	601992	金隅集团	2023 年 1 月 12 日	2.54	35,000	88,900.00
195	603077	和邦生物	2023 年 1 月 13 日	3.04	55,000	167,200.00
196	688002	睿创微纳	2023 年 1 月 6 日	37.19	2,400	89,256.00
197	688006	杭可科技	2023 年 1 月 9 日	43.77	1,100	48,147.00
198	688099	晶晨股份	2023 年 1 月 3 日	70.51	2,000	141,020.00
199	688208	道通科技	2023 年 1 月 3 日	31.55	2,400	75,720.00
200	688256	寒武纪-U	2023 年 1 月 3 日	54.56	1,500	81,840.00
201	688289	圣湘生物	2023 年 1 月 6 日	21.95	1,000	21,950.00
202	688385	复旦微电	2023 年 1 月 9 日	69.81	2,300	160,563.00
203	688567	孚能科技	2023 年 1 月 10 日	27.03	6,000	162,180.00

204	688690	纳微科技	2023 年 1 月 9 日	51.77	1,400	72,478.00
205	688777	中控技术	2023 年 1 月 6 日	90.83	3,000	272,490.00
206	689009	九号公司-WD	2023 年 1 月 12 日	30.49	3,000	91,470.00
合计	-	-	-	-	3,332,400	23,336,826.00

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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(含存托凭证)。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的股票，存托凭证)，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。

7.4.13.2 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，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 12 月 31 日，本基金未持有信用类债券（2021 年 12 月 31 日：未持有）。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：无。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

7.4.13.3 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 12 月 31 日，本基金所持有的全部金融负债的合约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（净资产）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。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

7.4.13.3.2 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%。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 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	9,213,589.85	-	-	-	9,213,589.85
结算备付金	8,550,735.13	-	-	-	8,550,735.13
存出保证金	1,915,009.33	-	-	-	1,915,009.33
交易性金融资产	-	-	-	-332,510,595.62	332,510,595.62
应收股利	-	-	-	1,485.00	1,485.00
应收清算款	-	-	-	217,033.45	217,033.45
其他资产	-	-	-	10,632.64	10,632.64
资产总计	19,679,334.31	-	-	-332,739,746.71	352,419,081.02
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	46,139.47	46,139.47
应付托管费	-	-	-	15,379.84	15,379.84
应交税费	-	-	-	1,603.98	1,603.98
其他负债	-	-	-	689,504.70	689,504.70
负债总计	-	-	-	752,627.99	752,627.99
利率敏感度缺口	19,679,334.31	-	-	-331,987,118.72	351,666,453.03
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	9,693,729.64	-	-	-	9,693,729.64
结算备付金	10,374,271.32	-	-	-	10,374,271.32
存出保证金	2,124,606.75	-	-	-	2,124,606.75
交易性金融资产	-	-	-	-369,701,845.73	369,701,845.73
应收股利	-	-	-	280.00	280.00
其他资产	-	-	-	16,390.74	16,390.74

资产总计	22,192,607.71	-	-369,718,516.47	391,911,124.18
负债				
应付管理人报酬	-	-	50,651.98	50,651.98
应付托管费	-	-	16,883.98	16,883.98
应交税费	-	-	7,672.16	7,672.16
其他负债	-	-	405,060.61	405,060.61
负债总计	-	-	480,268.73	480,268.73
利率敏感度缺口	22,192,607.71	-	-369,238,247.74	391,430,855.45

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2022 年 12 月 31 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。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无。

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无。

7.4.13.4.3 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（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%，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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 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	332,510,595.62	94.55	369,701,845.73	94.45
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	332,510,595.62	94.55	369,701,845.73	94.45

注：债券投资为可转换债券、可交换债券投资。

7.4.13.4.3.2 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）		上年度末（2021 年 12 月 31 日）
	本期末（2022 年 12 月 31 日）		
分析	业绩比较基准上升 5%	17,222,864.54	19,187,940.53
	业绩比较基准下降 5%	-17,222,864.54	-19,187,940.53

注：无。

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	330,483,144.01	366,783,986.18
第二层次	1,258,170.00	933,993.05
第三层次	769,281.61	1,983,866.50
合计	332,510,595.62	369,701,845.73

7.4.14.2.2 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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	1,983,866.50	1,983,866.50
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	1,232,957.34	1,232,957.34
转出第三层次	-	2,211,620.72	2,211,620.72
当期利得或损失总额	-	-235,921.51	-235,921.51
其中：计入损益的利得或损失	-	-235,921.51	-235,921.51
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	769,281.61	769,281.61
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	31,342.86	31,342.86
项目	上年度可比同期		
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
债券投资	股票投资		
期初余额	-	-	-
当期购买	-	910,846.09	910,846.09
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	1,073,020.41	1,073,020.41
其中：计入损益的利得或损失	-	1,073,020.41	1,073,020.41
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,983,866.50	1,983,866.50
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	1,073,020.41	1,073,020.41

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流通受限股票	769,281.61	平均价格 亚式期权 模型	预期波动率	0.2063-2.4756	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流通受限股票	1,983,866.50	平均价格 亚式期权 模型	预期波动率	0.3138-2.7417	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

7.4.14.4 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。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	332,510,595.62	94.35
	其中：股票	332,510,595.62	94.35
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	17,764,324.98	5.04
8	其他各项资产	2,144,160.42	0.61

9	合计	352,419,081.02	100.00
---	----	----------------	--------

注：1、上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而 8.2.1 的合计项不含可退替代款估值增值。

2、报告期末本基金投资的存托凭证公允价值为：676,878.00 元，占净值比 0.19%。本报告所指的“股票”均包含存托凭证。

3、报告期末，本基金参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为人民币 23,336,826.00 元，占基金资产净值比为 6.64%。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	3,173,735.20	0.90
B	采矿业	14,540,130.75	4.13
C	制造业	201,759,831.59	57.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,093,907.00	3.15
E	建筑业	2,944,998.00	0.84
F	批发和零售业	14,083,206.14	4.00
G	交通运输、仓储和邮政业	7,391,480.94	2.10
H	住宿和餐饮业	865,792.80	0.25
I	信息传输、软件和信息技术服务业	23,793,375.81	6.77
J	金融业	28,850,442.80	8.20
K	房地产业	6,850,546.20	1.95
L	租赁和商务服务业	3,861,285.00	1.10
M	科学研究和技术服务业	3,650,352.00	1.04
N	水利、环境和公共设施管理业	1,854,417.78	0.53
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	658,406.00	0.19
R	文化、体育和娱乐业	4,386,697.00	1.25
S	综合	1,982,709.00	0.56
	合计	331,741,314.01	94.33

8.2.2 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	567,241.67	0.16
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	93,840.77	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	31,973.24	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	23,192.59	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	47,428.84	0.01
R	文化、体育和娱乐业	5,604.50	0.00
S	综合	-	-
	合计	769,281.61	0.22

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

8.3 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

8.3.1 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	002340	格林美	267,400	1,986,782.00	0.56
2	300012	华测检测	87,600	1,953,480.00	0.56
3	600157	永泰能源	1,157,100	1,770,363.00	0.50
4	002384	东山精密	71,300	1,763,249.00	0.50
5	300724	捷佳伟创	14,500	1,653,290.00	0.47
6	688777	中控技术	18,198	1,652,924.34	0.47

7	688122	西部超导	17,000	1,609,730.00	0.46
8	603613	国联股份	18,135	1,603,859.40	0.46
9	300003	乐普医疗	68,500	1,573,445.00	0.45
10	002422	科伦药业	59,000	1,569,990.00	0.45
11	600487	亨通光电	102,900	1,549,674.00	0.44
12	002385	大北农	172,600	1,536,140.00	0.44
13	688063	派能科技	4,800	1,515,120.00	0.43
14	002966	苏州银行	190,880	1,485,046.40	0.42
15	603345	安井食品	9,100	1,473,108.00	0.42
16	603606	东方电缆	21,400	1,451,562.00	0.41
17	600885	宏发股份	43,420	1,450,662.20	0.41
18	600765	中航重机	46,060	1,432,005.40	0.41
19	600079	人福医药	59,500	1,421,455.00	0.40
20	600096	云天化	66,900	1,407,576.00	0.40
21	002497	雅化集团	60,100	1,397,325.00	0.40
22	601555	东吴证券	208,690	1,362,745.70	0.39
23	600352	浙江龙盛	135,500	1,341,450.00	0.38
24	002625	光启技术	78,500	1,336,070.00	0.38
25	002407	多氟多	40,000	1,332,800.00	0.38
26	002603	以岭药业	43,500	1,303,260.00	0.37
27	000009	中国宝安	107,500	1,299,675.00	0.37
28	601058	赛轮轮胎	127,600	1,278,552.00	0.36
29	601233	桐昆股份	87,900	1,270,155.00	0.36
30	000630	铜陵有色	407,100	1,270,152.00	0.36
31	002738	中矿资源	19,000	1,266,540.00	0.36
32	600988	赤峰黄金	69,300	1,250,865.00	0.36
33	600489	中金黄金	151,500	1,240,785.00	0.35
34	603605	珀莱雅	7,400	1,239,352.00	0.35
35	688390	固德威	3,820	1,234,203.80	0.35
36	600298	安琪酵母	27,200	1,229,984.00	0.35
37	603688	石英股份	9,300	1,221,276.00	0.35
38	002028	思源电气	31,900	1,219,218.00	0.35
39	300146	汤臣倍健	53,200	1,214,024.00	0.35
40	601108	财通证券	169,300	1,205,416.00	0.34
41	000807	云铝股份	108,300	1,204,296.00	0.34
42	600536	中国软件	20,640	1,203,931.20	0.34
43	300390	天华超净	21,500	1,201,420.00	0.34
44	603939	益丰药房	18,800	1,200,192.00	0.34
45	600418	江淮汽车	91,100	1,196,143.00	0.34
46	300144	宋城演艺	81,700	1,192,820.00	0.34
47	300073	当升科技	21,000	1,184,400.00	0.34
48	300037	新宙邦	27,160	1,180,645.20	0.34
49	300699	光威复材	16,300	1,177,675.00	0.33

50	600141	兴发集团	40,600	1,177,400.00	0.33
51	600399	抚顺特钢	82,200	1,176,282.00	0.33
52	600859	王府井	41,400	1,164,996.00	0.33
53	603517	绝味食品	19,000	1,160,710.00	0.33
54	300285	国瓷材料	41,900	1,155,183.00	0.33
55	601077	渝农商行	322,500	1,138,425.00	0.32
56	300568	星源材质	53,300	1,133,158.00	0.32
57	600873	梅花生物	110,900	1,128,962.00	0.32
58	600563	法拉电子	7,000	1,119,160.00	0.32
59	603456	九洲药业	26,100	1,107,423.00	0.31
60	002185	华天科技	133,400	1,105,886.00	0.31
61	002138	顺络电子	42,000	1,099,560.00	0.31
62	603816	顾家家居	25,600	1,093,376.00	0.31
63	600160	巨化股份	70,300	1,090,353.00	0.31
64	603589	口子窖	18,800	1,084,196.00	0.31
65	601128	常熟银行	142,800	1,078,140.00	0.31
66	000783	长江证券	201,600	1,074,528.00	0.31
67	600153	建发股份	78,300	1,068,795.00	0.30
68	688099	晶晨股份	15,100	1,064,701.00	0.30
69	000629	钒钛股份	224,100	1,059,993.00	0.30
70	002192	融捷股份	10,800	1,057,320.00	0.30
71	601699	潞安环能	62,400	1,051,440.00	0.30
72	605358	立昂微	24,600	1,047,960.00	0.30
73	300357	我武生物	19,000	1,046,900.00	0.30
74	601162	天风证券	361,000	1,036,070.00	0.29
75	000683	远兴能源	132,000	1,034,880.00	0.29
76	601607	上海医药	57,900	1,032,357.00	0.29
77	600392	盛和资源	73,100	1,023,400.00	0.29
78	688567	孚能科技	37,800	1,021,734.00	0.29
79	603596	伯特利	12,800	1,021,440.00	0.29
80	002568	百润股份	27,300	1,019,928.00	0.29
81	600161	天坛生物	42,800	1,015,644.00	0.29
82	000932	华菱钢铁	215,900	1,014,730.00	0.29
83	600521	华海药业	46,400	1,014,304.00	0.29
84	601168	西部矿业	99,300	1,012,860.00	0.29
85	600109	国金证券	116,400	1,012,680.00	0.29
86	600499	科达制造	71,102	1,010,359.42	0.29
87	600486	扬农化工	9,700	1,007,830.00	0.29
88	000831	中国稀土	30,600	1,006,128.00	0.29
89	600027	华电国际	169,900	999,012.00	0.28
90	002223	鱼跃医疗	31,300	997,218.00	0.28
91	002797	第一创业	175,200	986,376.00	0.28
92	603077	和邦生物	322,000	978,880.00	0.28

93	688385	复旦微电	13,900	970,359.00	0.28
94	600862	中航高科	43,530	970,283.70	0.28
95	002078	太阳纸业	84,000	967,680.00	0.28
96	000975	银泰黄金	87,560	966,662.40	0.27
97	000999	华润三九	20,600	964,286.00	0.27
98	002294	信立泰	29,100	955,935.00	0.27
99	601636	旗滨集团	83,900	955,621.00	0.27
100	601872	招商轮船	169,300	946,387.00	0.27
101	002268	卫士通	30,800	940,324.00	0.27
102	600497	驰宏锌锗	185,700	939,642.00	0.27
103	600143	金发科技	96,900	938,961.00	0.27
104	002532	天山铝业	121,100	934,892.00	0.27
105	002025	航天电器	14,100	934,125.00	0.27
106	002299	圣农发展	38,900	921,541.00	0.26
107	300253	卫宁健康	89,600	921,088.00	0.26
108	601696	中银证券	86,900	918,533.00	0.26
109	600177	雅戈尔	144,700	915,951.00	0.26
110	601990	南京证券	115,300	914,329.00	0.26
111	002439	启明星辰	34,800	907,584.00	0.26
112	600705	中航产融	275,900	904,952.00	0.26
113	002624	完美世界	70,700	899,304.00	0.26
114	000591	太阳能	122,100	894,993.00	0.25
115	600348	华阳股份	62,700	893,475.00	0.25
116	603737	三棵树	7,800	887,874.00	0.25
117	000998	隆平高科	54,900	882,243.00	0.25
118	000738	航发控制	34,300	879,452.00	0.25
119	600026	中远海能	72,400	872,420.00	0.25
120	688301	奕瑞科技	1,900	869,972.00	0.25
121	600549	厦门钨业	44,300	866,065.00	0.25
122	600258	首旅酒店	34,911	865,792.80	0.25
123	000728	国元证券	136,400	863,412.00	0.25
124	600482	中国动力	56,300	860,827.00	0.24
125	000988	华工科技	52,400	859,884.00	0.24
126	002850	科达利	7,200	855,432.00	0.24
127	002273	水晶光电	72,500	854,775.00	0.24
128	000519	中兵红箭	43,500	854,340.00	0.24
129	002673	西部证券	139,600	850,164.00	0.24
130	300604	长川科技	18,800	838,104.00	0.24
131	601997	贵阳银行	152,300	836,127.00	0.24
132	002507	涪陵榨菜	32,400	834,948.00	0.24
133	300136	信维通信	50,400	832,104.00	0.24
134	300832	新产业	16,500	827,310.00	0.24
135	002092	中泰化学	108,400	808,664.00	0.23

136	002430	杭氧股份	20,500	806,880.00	0.23
137	000703	恒逸石化	114,500	804,935.00	0.23
138	300363	博腾股份	19,700	804,745.00	0.23
139	600325	华发股份	88,300	799,998.00	0.23
140	002030	达安基因	51,196	796,609.76	0.23
141	002056	横店东磁	42,500	796,450.00	0.23
142	002739	万达电影	56,800	795,200.00	0.23
143	002557	洽洽食品	15,900	795,000.00	0.23
144	300308	中际旭创	29,200	789,276.00	0.22
145	600529	山东药玻	27,600	783,840.00	0.22
146	603233	大参林	19,760	782,496.00	0.22
147	601666	平煤股份	72,300	781,563.00	0.22
148	600704	物产中大	162,400	781,144.00	0.22
149	601198	东兴证券	101,000	779,720.00	0.22
150	002465	海格通信	96,000	779,520.00	0.22
151	000729	燕京啤酒	73,400	779,508.00	0.22
152	002156	通富微电	47,300	779,504.00	0.22
153	601016	节能风电	203,620	775,792.20	0.22
154	600655	豫园股份	101,500	772,415.00	0.22
155	600879	航天电子	113,400	771,120.00	0.22
156	300088	长信科技	127,834	763,168.98	0.22
157	603658	安图生物	12,300	760,755.00	0.22
158	002409	雅克科技	14,900	750,513.00	0.21
159	600546	山煤国际	51,700	749,133.00	0.21
160	600415	小商品城	142,900	748,796.00	0.21
161	688116	天奈科技	9,700	748,258.00	0.21
162	002353	杰瑞股份	26,800	747,988.00	0.21
163	002080	中材科技	34,900	747,907.00	0.21
164	000830	鲁西化工	60,000	743,400.00	0.21
165	002683	广东宏大	27,400	738,704.00	0.21
166	603267	鸿远电子	7,300	738,468.00	0.21
167	000878	云南铜业	62,700	736,725.00	0.21
168	000960	锡业股份	52,200	736,020.00	0.21
169	000400	许继电气	36,800	734,896.00	0.21
170	600516	方大炭素	118,900	727,668.00	0.21
171	000623	吉林敖东	48,500	727,015.00	0.21
172	600170	上海建工	278,300	723,580.00	0.21
173	603444	吉比特	2,300	719,532.00	0.20
174	603160	汇顶科技	14,300	717,860.00	0.20
175	600038	中直股份	15,400	714,714.00	0.20
176	002444	巨星科技	37,645	714,502.10	0.20
177	300418	昆仑万维	49,300	710,413.00	0.20
178	002531	天顺风能	46,900	709,597.00	0.20

179	600637	东方明珠	106,700	709,555.00	0.20
180	300017	网宿科技	127,100	709,218.00	0.20
181	002372	伟星新材	33,200	708,488.00	0.20
182	601577	长沙银行	104,700	707,772.00	0.20
183	600166	福田汽车	250,100	702,781.00	0.20
184	600739	辽宁成大	55,800	702,522.00	0.20
185	600642	申能股份	127,900	702,171.00	0.20
186	600699	均胜电子	49,900	701,095.00	0.20
187	601456	国联证券	62,200	699,750.00	0.20
188	300373	扬杰科技	13,300	699,580.00	0.20
189	603712	七一二	20,009	698,714.28	0.20
190	002326	永太科技	32,000	698,560.00	0.20
191	002203	海亮股份	61,500	694,950.00	0.20
192	000970	中科三环	50,675	691,207.00	0.20
193	603127	昭衍新药	11,800	689,238.00	0.20
194	002508	老板电器	24,800	688,448.00	0.20
195	688002	睿创微纳	18,483	687,382.77	0.20
196	000155	川能动力	38,400	685,056.00	0.19
197	600673	东阳光	78,600	683,034.00	0.19
198	603026	胜华新材	7,400	683,020.00	0.19
199	600380	健康元	60,300	680,787.00	0.19
200	689009	九号公司-WD	22,200	676,878.00	0.19
201	000039	中集集团	96,000	675,840.00	0.19
202	600909	华安证券	146,840	673,995.60	0.19
203	300676	华大基因	13,000	671,970.00	0.19
204	600056	中国医药	39,000	671,970.00	0.19
205	600867	通化东宝	72,700	667,386.00	0.19
206	600118	中国卫星	30,800	663,740.00	0.19
207	600985	淮北矿业	51,800	663,040.00	0.19
208	002065	东华软件	116,900	661,654.00	0.19
209	000739	普洛药业	30,700	661,278.00	0.19
210	000750	国海证券	198,500	661,005.00	0.19
211	300244	迪安诊断	26,200	658,406.00	0.19
212	300058	蓝色光标	129,700	654,985.00	0.19
213	600008	首创环保	229,400	649,202.00	0.18
214	600369	西南证券	173,100	649,125.00	0.18
215	688009	中国通号	134,700	645,213.00	0.18
216	300474	景嘉微	11,800	643,926.00	0.18
217	002152	广电运通	64,700	643,118.00	0.18
218	600372	中航电子	40,200	641,994.00	0.18
219	002831	裕同科技	19,400	641,558.00	0.18
220	300558	贝达药业	13,000	640,510.00	0.18
221	600998	九州通	48,800	636,352.00	0.18

222	601880	辽港股份	392,200	635,364.00	0.18
223	000513	丽珠集团	19,500	633,360.00	0.18
224	000027	深圳能源	99,180	630,784.80	0.18
225	600435	北方导航	54,300	629,880.00	0.18
226	002936	郑州银行	267,861	629,473.35	0.18
227	000636	风华高科	42,300	627,309.00	0.18
228	000547	航天发展	66,800	627,252.00	0.18
229	002408	齐翔腾达	88,900	625,856.00	0.18
230	300070	碧水源	132,000	624,360.00	0.18
231	002131	利欧股份	351,800	622,686.00	0.18
232	300866	安克创新	10,500	622,335.00	0.18
233	300026	红日药业	109,500	621,960.00	0.18
234	002506	协鑫集成	213,300	620,703.00	0.18
235	002926	华西证券	82,000	617,460.00	0.18
236	002212	天融信	61,800	617,382.00	0.18
237	603883	老百姓	15,162	613,606.14	0.17
238	300383	光环新网	74,900	611,184.00	0.17
239	600378	昊华科技	14,200	609,322.00	0.17
240	002183	怡亚通	94,700	608,921.00	0.17
241	603858	步长制药	28,900	607,189.00	0.17
242	300682	朗新科技	27,600	606,648.00	0.17
243	002572	索菲亚	33,300	604,728.00	0.17
244	600820	隧道股份	114,700	604,469.00	0.17
245	600271	航天信息	57,900	602,739.00	0.17
246	002195	二三四五	298,100	599,181.00	0.17
247	600580	卧龙电驱	48,000	598,080.00	0.17
248	002250	联化科技	38,500	596,750.00	0.17
249	300296	利亚德	105,400	596,564.00	0.17
250	000887	中鼎股份	41,200	596,164.00	0.17
251	002368	太极股份	21,179	595,765.27	0.17
252	600390	五矿资本	117,100	594,868.00	0.17
253	600848	上海临港	49,900	594,808.00	0.17
254	002500	山西证券	112,220	594,766.00	0.17
255	600863	内蒙华电	170,000	593,300.00	0.17
256	603893	瑞芯微	8,600	591,766.00	0.17
257	603156	养元饮品	26,400	587,928.00	0.17
258	600021	上海电力	58,700	587,587.00	0.17
259	688779	长远锂科	40,200	586,518.00	0.17
260	002958	青农商行	202,500	585,225.00	0.17
261	601958	金钼股份	50,500	583,275.00	0.17
262	688538	和辉光电-U	216,900	581,292.00	0.17
263	300024	机器人	64,700	581,006.00	0.17
264	688256	寒武纪-U	10,600	578,336.00	0.16

265	300001	特锐德	38,000	577,980.00	0.16
266	688521	芯原股份-U	13,100	577,317.00	0.16
267	002244	滨江集团	64,900	573,067.00	0.16
268	600755	厦门国贸	80,100	571,914.00	0.16
269	300009	安科生物	61,092	571,821.12	0.16
270	600208	新湖中宝	224,000	568,960.00	0.16
271	002155	湖南黄金	43,853	567,896.35	0.16
272	600315	上海家化	17,800	566,930.00	0.16
273	002511	中顺洁柔	41,100	564,714.00	0.16
274	600316	洪都航空	22,400	564,256.00	0.16
275	603885	吉祥航空	34,600	559,828.00	0.16
276	000997	新大陆	43,000	559,430.00	0.16
277	000060	中金岭南	136,300	558,830.00	0.16
278	601231	环旭电子	34,400	558,312.00	0.16
279	000050	深天马 A	64,100	555,106.00	0.16
280	300776	帝尔激光	4,400	554,400.00	0.16
281	600060	海信视像	40,900	553,786.00	0.16
282	601005	重庆钢铁	349,200	551,736.00	0.16
283	601992	金隅集团	217,200	551,688.00	0.16
284	600511	国药股份	19,700	549,630.00	0.16
285	603927	中科软	18,540	548,969.40	0.16
286	300850	新强联	10,200	543,456.00	0.15
287	688185	康希诺	3,700	540,274.00	0.15
288	601717	郑煤机	48,000	535,680.00	0.15
289	300251	光线传媒	61,200	529,992.00	0.15
290	600528	中铁工业	69,400	529,522.00	0.15
291	600801	华新水泥	35,500	526,110.00	0.15
292	600201	生物股份	58,338	525,625.38	0.15
293	600566	济川药业	19,200	522,624.00	0.15
294	002939	长城证券	63,100	522,468.00	0.15
295	300168	万达信息	61,900	521,817.00	0.15
296	000021	深科技	48,800	521,672.00	0.15
297	600066	宇通客车	69,200	519,692.00	0.15
298	600171	上海贝岭	29,800	519,414.00	0.15
299	000825	太钢不锈	119,400	515,808.00	0.15
300	002373	千方科技	57,600	513,792.00	0.15
301	603218	日月股份	25,300	513,590.00	0.15
302	600906	财达证券	67,500	510,975.00	0.15
303	600598	北大荒	37,100	510,496.00	0.15
304	600827	百联股份	41,900	507,828.00	0.14
305	600839	四川长虹	192,300	507,672.00	0.14
306	300677	英科医疗	24,100	506,823.00	0.14
307	600282	南钢股份	160,600	505,890.00	0.14

308	600535	天士力	46,900	504,644.00	0.14
309	688188	柏楚电子	2,320	503,625.60	0.14
310	600970	中材国际	59,000	502,680.00	0.14
311	601866	中远海发	206,500	499,730.00	0.14
312	601778	晶科科技	90,500	497,750.00	0.14
313	601665	齐鲁银行	119,200	497,064.00	0.14
314	600500	中化国际	74,900	495,089.00	0.14
315	002128	电投能源	40,100	494,834.00	0.14
316	002127	南极电商	102,400	492,544.00	0.14
317	601179	中国西电	106,800	492,348.00	0.14
318	002153	石基信息	32,840	492,271.60	0.14
319	603568	伟明环保	26,526	491,526.78	0.14
320	603000	人民网	28,900	487,543.00	0.14
321	600498	烽火通信	37,100	487,494.00	0.14
322	000930	中粮科技	58,300	487,388.00	0.14
323	300861	美畅股份	9,900	486,684.00	0.14
324	000709	河钢股份	215,300	486,578.00	0.14
325	002595	豪迈科技	20,900	483,835.00	0.14
326	000012	南玻 A	71,500	479,765.00	0.14
327	300182	捷成股份	107,300	479,631.00	0.14
328	300888	稳健医疗	6,700	479,050.00	0.14
329	600398	海澜之家	90,100	477,530.00	0.14
330	600663	陆家嘴	48,900	476,286.00	0.14
331	002701	奥瑞金	93,800	473,690.00	0.13
332	002019	亿帆医药	38,400	470,400.00	0.13
333	000987	越秀资本	78,475	470,065.25	0.13
334	002124	天邦食品	76,720	468,759.20	0.13
335	002985	北摩高科	10,382	468,228.20	0.13
336	002396	星网锐捷	24,300	465,588.00	0.13
337	000581	威孚高科	26,200	464,526.00	0.13
338	600959	江苏有线	156,300	464,211.00	0.13
339	600895	张江高科	40,400	458,136.00	0.13
340	603707	健友股份	25,317	456,718.68	0.13
341	000598	兴蓉环境	93,300	456,237.00	0.13
342	000401	冀东水泥	55,400	455,942.00	0.13
343	000778	新兴铸管	124,700	455,155.00	0.13
344	300618	寒锐钴业	11,300	452,565.00	0.13
345	300115	长盈精密	43,780	452,247.40	0.13
346	688208	道通科技	14,300	451,165.00	0.13
347	600582	天地科技	86,300	448,760.00	0.13
348	002670	国盛金控	60,500	448,305.00	0.13
349	300482	万孚生物	14,000	446,180.00	0.13
350	002249	大洋电机	86,800	444,416.00	0.13

351	600718	东软集团	44,600	443,770.00	0.13
352	600297	广汇汽车	211,300	443,730.00	0.13
353	002690	美亚光电	18,360	438,804.00	0.12
354	600507	方大特钢	72,771	438,081.42	0.12
355	002266	浙富控股	111,900	437,529.00	0.12
356	600329	达仁堂	15,000	436,500.00	0.12
357	688690	纳微科技	8,400	434,868.00	0.12
358	603225	新凤鸣	39,900	434,112.00	0.12
359	600517	国网英大	89,400	432,696.00	0.12
360	000883	湖北能源	102,700	431,340.00	0.12
361	603866	桃李面包	27,820	428,428.00	0.12
362	002505	鹏都农牧	166,000	428,280.00	0.12
363	600409	三友化工	64,600	427,006.00	0.12
364	000656	金科股份	222,400	424,784.00	0.12
365	300212	易华录	20,800	424,528.00	0.12
366	601000	唐山港	154,300	422,782.00	0.12
367	600259	广晟有色	10,500	422,100.00	0.12
368	600022	山东钢铁	285,100	421,948.00	0.12
369	002002	鸿达兴业	130,100	421,524.00	0.12
370	000089	深圳机场	53,500	420,510.00	0.12
371	600871	石化油服	212,100	419,958.00	0.12
372	601106	中国一重	142,900	418,697.00	0.12
373	000785	居然之家	102,100	417,589.00	0.12
374	600567	山鹰国际	168,300	417,384.00	0.12
375	600064	南京高科	63,120	417,223.20	0.12
376	300376	易事特	60,500	413,215.00	0.12
377	002468	申通快递	39,963	412,817.79	0.12
378	600216	浙江医药	35,200	411,488.00	0.12
379	002429	兆驰股份	117,900	411,471.00	0.12
380	600782	新钢股份	99,700	407,773.00	0.12
381	002081	金螳螂	82,900	402,065.00	0.11
382	601333	广深铁路	176,600	400,882.00	0.11
383	601718	际华集团	137,300	399,543.00	0.11
384	688029	南微医学	4,840	397,509.20	0.11
385	600667	太极实业	76,900	396,804.00	0.11
386	601187	厦门银行	68,600	393,078.00	0.11
387	601118	海南橡胶	89,200	390,696.00	0.11
388	600062	华润双鹤	21,800	390,002.00	0.11
389	002010	传化智联	72,900	389,286.00	0.11
390	002191	劲嘉股份	53,700	388,251.00	0.11
391	300463	迈克生物	22,400	387,520.00	0.11
392	600728	佳都科技	73,300	387,024.00	0.11
393	600737	中粮糖业	55,700	386,558.00	0.11

394	000537	广宇发展	29,200	386,316.00	0.11
395	600597	光明乳业	35,900	386,284.00	0.11
396	000540	中天金融	255,300	385,503.00	0.11
397	600155	华创阳安	58,901	382,856.50	0.11
398	600376	首开股份	67,200	382,368.00	0.11
399	601156	东航物流	24,800	378,448.00	0.11
400	002745	木林森	46,400	376,304.00	0.11
401	002221	东华能源	49,300	376,159.00	0.11
402	600131	国网信通	25,100	375,496.00	0.11
403	601098	中南传媒	37,500	374,250.00	0.11
404	300072	海新能科	85,700	373,652.00	0.11
405	002416	爱施德	38,800	367,824.00	0.10
406	600967	内蒙一机	44,400	366,744.00	0.10
407	600126	杭钢股份	87,900	363,027.00	0.10
408	000156	华数传媒	48,300	361,767.00	0.10
409	601991	大唐发电	129,100	360,189.00	0.10
410	603379	三美股份	12,640	359,734.40	0.10
411	603228	景旺电子	17,620	356,628.80	0.10
412	002048	宁波华翔	25,500	354,450.00	0.10
413	600808	马钢股份	126,000	354,060.00	0.10
414	601568	北元集团	62,140	352,333.80	0.10
415	000937	冀中能源	55,200	351,072.00	0.10
416	002281	光迅科技	21,900	344,268.00	0.10
417	002423	中粮资本	48,000	343,680.00	0.10
418	600901	江苏租赁	62,300	341,404.00	0.10
419	688289	圣湘生物	15,508	340,400.60	0.10
420	001914	招商积余	22,100	339,898.00	0.10
421	300630	普利制药	13,701	337,866.66	0.10
422	600373	中文传媒	35,300	337,821.00	0.10
423	600095	湘财股份	44,600	337,176.00	0.10
424	003035	南网能源	59,200	335,664.00	0.10
425	603056	德邦股份	16,105	335,467.15	0.10
426	000559	万向钱潮	68,800	335,056.00	0.10
427	000898	鞍钢股份	124,900	333,483.00	0.09
428	002434	万里扬	41,000	330,050.00	0.09
429	301029	怡合达	5,000	328,700.00	0.09
430	000402	金融街	62,300	327,075.00	0.09
431	603317	天味食品	11,894	326,847.12	0.09
432	002867	周大生	22,900	321,287.00	0.09
433	600556	天下秀	47,100	317,454.00	0.09
434	601608	中信重工	90,500	315,845.00	0.09
435	601611	中国核建	41,500	315,400.00	0.09
436	601598	中国外运	82,100	315,264.00	0.09

437	601928	凤凰传媒	39,800	315,216.00	0.09
438	000563	陕国投 A	103,300	312,999.00	0.09
439	300257	开山股份	20,700	310,500.00	0.09
440	600195	中牧股份	26,680	310,021.60	0.09
441	600707	彩虹股份	74,800	309,672.00	0.09
442	002948	青岛银行	91,900	308,784.00	0.09
443	000959	首钢股份	81,500	307,255.00	0.09
444	600968	海油发展	105,900	304,992.00	0.09
445	001203	大中矿业	23,500	303,855.00	0.09
446	600167	联美控股	47,700	301,464.00	0.09
447	000967	盈峰环境	66,300	301,002.00	0.09
448	002110	三钢闽光	63,900	300,330.00	0.09
449	002705	新宝股份	17,300	288,045.00	0.08
450	603650	彤程新材	9,300	286,719.00	0.08
451	000415	渤海租赁	128,800	284,648.00	0.08
452	688006	杭可科技	6,500	284,505.00	0.08
453	000990	诚志股份	31,700	278,960.00	0.08
454	300869	康泰医学	8,400	273,588.00	0.08
455	002925	盈趣科技	16,400	270,928.00	0.08
456	600307	酒钢宏兴	163,200	269,280.00	0.08
457	002242	九阳股份	16,100	265,328.00	0.08
458	601828	美凯龙	56,400	264,516.00	0.08
459	603638	艾迪精密	17,580	262,293.60	0.07
460	688819	天能股份	7,100	260,854.00	0.07
461	600339	中油工程	87,300	260,154.00	0.07
462	600764	中国海防	11,100	254,856.00	0.07
463	000031	大悦城	67,000	251,920.00	0.07
464	002399	海普瑞	19,500	250,575.00	0.07
465	002653	海思科	11,200	249,200.00	0.07
466	600623	华谊集团	39,400	249,008.00	0.07
467	002146	荣盛发展	113,300	245,861.00	0.07
468	600928	西安银行	69,500	244,640.00	0.07
469	688088	虹软科技	10,700	240,857.00	0.07
470	601969	海南矿业	31,800	235,638.00	0.07
471	600006	东风汽车	41,800	233,244.00	0.07
472	600648	外高桥	19,500	233,025.00	0.07
473	603719	良品铺子	6,200	228,594.00	0.07
474	600787	中储股份	45,600	226,632.00	0.06
475	002563	森马服饰	42,200	221,128.00	0.06
476	000961	中南建设	99,700	218,343.00	0.06
477	000869	张裕 A	7,100	214,704.00	0.06
478	600377	宁沪高速	25,900	212,898.00	0.06
479	601869	长飞光纤	6,300	205,569.00	0.06

480	000553	安道麦 A	22,700	205,435.00	0.06
481	601298	青岛港	36,600	205,326.00	0.06
482	000062	深圳华强	16,400	200,244.00	0.06
483	600350	山东高速	35,100	199,719.00	0.06
484	601139	深圳燃气	30,100	196,854.00	0.06
485	002945	华林证券	14,100	185,838.00	0.05
486	603868	飞科电器	2,600	175,058.00	0.05
487	001872	招商港口	12,100	173,756.00	0.05
488	600299	安迪苏	21,000	173,460.00	0.05
489	601228	广州港	55,000	173,250.00	0.05
490	603355	莱克电气	6,100	171,044.00	0.05
491	601158	重庆水务	30,000	153,900.00	0.04
492	600956	新天绿能	15,900	153,276.00	0.04
493	300741	华宝股份	6,400	150,592.00	0.04
494	603786	科博达	2,200	144,826.00	0.04
495	600927	永安期货	8,400	135,408.00	0.04
496	600917	重庆燃气	16,400	130,544.00	0.04
497	600032	浙江新能	10,800	124,092.00	0.04
498	001227	兰州银行	32,600	122,902.00	0.03
499	688772	珠海冠宇	5,800	108,112.00	0.03
500	002901	大博医疗	3,000	102,090.00	0.03

8.3.2 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	688035	德邦科技	2,988	145,874.16	0.04
2	688147	微导纳米	4,699	112,353.09	0.03
3	301367	怡和嘉业	173	30,409.94	0.01
4	301239	普瑞眼科	408	28,429.44	0.01
5	301269	华大九天	318	27,964.92	0.01
6	301175	中科环保	3,859	23,192.59	0.01
7	301301	川宁生物	2,922	22,002.66	0.01
8	301095	广立微	254	21,968.46	0.01
9	301327	华宝新能	121	21,413.37	0.01
10	301267	华夏眼科	287	18,999.40	0.01
11	301311	昆船智能	832	13,195.52	0.00
12	301297	富乐德	1,015	13,184.85	0.00
13	301338	凯格精机	257	12,590.43	0.00
14	301363	美好医疗	324	12,263.40	0.00
15	301377	鼎泰高科	645	11,371.35	0.00
16	301277	新天地	439	11,317.42	0.00
17	301152	天力锂能	241	11,240.24	0.00
18	301290	东星医疗	316	11,101.08	0.00
19	301361	众智科技	517	10,836.32	0.00

20	301306	西测测试	251	10,614.79	0.00
21	301132	满坤科技	433	10,599.84	0.00
22	301328	维峰电子	136	10,466.56	0.00
23	301296	新巨丰	699	10,415.10	0.00
24	301283	聚胶股份	200	10,282.00	0.00
25	301339	通行宝	593	9,244.87	0.00
26	301171	易点天下	493	8,735.96	0.00
27	301282	金禄电子	340	8,585.00	0.00
28	301115	建科股份	340	8,173.60	0.00
29	301265	华新环保	688	7,843.20	0.00
30	301197	工大科雅	380	7,630.40	0.00
31	301161	唯万密封	346	7,518.58	0.00
32	301349	信德新材	72	7,453.44	0.00
33	301398	星源卓镁	255	7,379.70	0.00
34	301313	凡拓数创	247	7,197.58	0.00
35	301285	鸿日达	565	7,119.00	0.00
36	301359	东南电子	328	6,527.20	0.00
37	301388	欣灵电气	292	6,307.20	0.00
38	301368	丰立智能	337	6,241.24	0.00
39	301300	远翔新材	211	6,197.07	0.00
40	301318	维海德	148	6,177.52	0.00
41	301319	唯特偶	115	6,126.05	0.00
42	301276	嘉曼服饰	265	5,991.65	0.00
43	301270	汉仪股份	210	5,957.70	0.00
44	301231	荣信文化	275	5,604.50	0.00
45	301233	盛帮股份	158	5,419.40	0.00
46	301316	慧博云通	359	5,140.88	0.00
47	301309	万得凯	189	4,622.94	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	600522	中天科技	8,176,424.00	2.09
2	600256	广汇能源	7,648,103.00	1.95
3	603613	国联股份	7,208,050.00	1.84
4	603345	安井食品	6,596,632.00	1.69
5	600563	法拉电子	6,544,858.00	1.67
6	600096	云天化	6,152,504.00	1.57
7	603605	珀莱雅	5,792,967.72	1.48
8	300769	德方纳米	5,622,078.00	1.44
9	601615	明阳智能	5,184,508.00	1.32
10	688122	西部超导	5,052,131.86	1.29

11	600487	亨通光电	4,982,229.08	1.27
12	600157	永泰能源	4,832,109.00	1.23
13	688180	君实生物-U	4,748,517.19	1.21
14	603267	鸿远电子	4,716,836.61	1.21
15	601058	赛轮轮胎	4,499,957.63	1.15
16	603026	胜华新材	4,488,133.40	1.15
17	600141	兴发集团	4,435,796.00	1.13
18	600885	宏发股份	4,369,589.40	1.12
19	605117	德业股份	4,249,958.00	1.09
20	601108	财通证券	4,148,999.50	1.06

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。

8.4.2 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	600522	中天科技	10,152,816.60	2.59
2	600256	广汇能源	9,840,684.00	2.51
3	601615	明阳智能	7,581,438.00	1.94
4	603613	国联股份	7,578,021.05	1.94
5	600563	法拉电子	6,373,989.19	1.63
6	603605	珀莱雅	6,074,640.12	1.55
7	603345	安井食品	5,355,919.00	1.37
8	600233	圆通速递	5,237,459.20	1.34
9	300769	德方纳米	5,011,780.00	1.28
10	600487	亨通光电	5,011,407.96	1.28
11	600157	永泰能源	4,890,533.00	1.25
12	600732	爱旭股份	4,777,380.00	1.22
13	605117	德业股份	4,583,361.00	1.17
14	603267	鸿远电子	4,501,603.00	1.15
15	600875	东方电气	4,303,552.00	1.10
16	688180	君实生物-U	4,278,143.48	1.09
17	600141	兴发集团	4,247,967.00	1.09
18	600885	宏发股份	4,115,442.40	1.05
19	600039	四川路桥	3,834,128.00	0.98
20	600096	云天化	3,824,141.13	0.98

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。

8.4.3 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	638,302,059.88
卖出股票收入（成交）总额	591,770,852.11

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：无。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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

本基金投资的前十名证券中本期没有发行主体被监管部门立案调查的、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

8.12.2 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。

8.12.3 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	1,915,009.33
2	应收清算款	217,033.45
3	应收股利	1,485.00
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	10,632.64
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,144,160.42

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	002340	格林美	334,350.00	0.10	转融通流通受限
2	600157	永泰能源	300,951.00	0.09	转融通流通受限
3	002384	东山精密	296,760.00	0.08	转融通流通受限
4	688777	中控技术	272,490.00	0.08	转融通流通受限
5	002422	科伦药业	266,100.00	0.08	转融通流通受限
6	300003	乐普医疗	252,670.00	0.07	转融通流通受限
7	300012	华测检测	243,070.00	0.07	转融通流通受限
8	300724	捷佳伟创	228,040.00	0.06	转融通流通受限

8.12.5.2 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	688035	德邦科技	145,874.16	0.04	新股流通受限
2	688147	微导纳米	112,353.09	0.03	新股流通受限
3	301367	怡和嘉业	30,409.94	0.01	新股流通受限
4	301239	普瑞眼科	28,429.44	0.01	新股流通受限
5	301269	华大九天	27,964.92	0.01	新股流通受限

8.12.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

9.1.1 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 (%)
11,318	22,284.08	73,319,621.00	29.07	178,891,632.00	70.93

9.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额 (份)	占总份额比例 (%)
中国工商银行股份有限公司-鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	62,577,637.00	24.81

9.2 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	胡小彩	5,500,000.00	2.18
2	招商证券股份有限公司	3,853,607.00	1.53
3	魏晓玲	2,950,000.00	1.17
4	中信建投证券股份有限公司	2,616,435.00	1.04
5	方正证券股份有限公司	2,123,527.00	0.84
6	魏丽君	2,105,200.00	0.83
7	王雪有	2,000,000.00	0.79
8	于明中	1,986,700.00	0.79
9	金佳	1,826,400.00	0.72
10	秦琚	1,747,200.00	0.69
-	中国工商银行股份有限公司-鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	62,577,637.00	24.81

注：持有人为场内持有人。

9.3 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。

9.4 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。

9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产情况

注：无。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2019年11月21日） 基金份额总额	490,211,253.00
本报告期期初基金份额总额	232,211,253.00
本报告期基金总申购份额	562,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	542,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	252,211,253.00

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

基金管理人的重大人事变动：

报告期内，公司原董事 AndreaVismara 先生辞去本公司董事职务。经 2022 年第三次临时股东大会会议审议通过，股东会同意由 SandroVesprini 先生担任本公司董事，任职日期自 2022 年 3 月 31 日起。

报告期内，公司原监事 SandroVesprini 先生辞去本公司监事职务。经 2022 年第三次临时股东大会会议审议通过，股东会同意由 LorenzoPetracca 先生担任本公司监事，任职日期自 2022 年 3 月 31 日起。

报告期内，刘嵌先生不再担任监事。经民主选举，宁江先生当选为公司职工监事，任职日期自 2022 年 9 月 8 日起。

报告期内，经公司第六届董事会第一百一十次会议审议通过，聘任刘嵌先生担任公司副总经理，任职日期自 2022 年 9 月 7 日起。

本公司已将上述变更事项报中国证券监督管理委员会深圳监管局备案。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：
无。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

未改变。

11.5 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。本年度应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用 42,000.00 元，该审计机构已提供审计服务的年限为 3 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：无。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：无。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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 (%)	
中金公司	1	797,685,106.38	65.79	734,481.63	66.26	-
平安证券	1	216,931,984.89	17.89	199,848.29	18.03	-
华西证券	1	55,293,083.64	4.56	45,391.29	4.09	-
兴业证券	1	54,982,024.29	4.53	50,633.79	4.57	-
招商证券	1	49,615,230.10	4.09	45,708.62	4.12	-
国元证券	1	20,589,651.92	1.70	16,884.74	1.52	-
国信证券	2	11,979,212.7	0.99	11,017.95	0.99	-

		9				
国盛证券	1	3,148,079.50	0.26	2,574.42	0.23	-
中泰证券	1	1,630,990.57	0.13	1,486.34	0.13	-
国泰君安	1	542,690.99	0.04	499.98	0.05	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源 证券	2	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
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
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。

11.7.2 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(%)

中金公司	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-

注：无。

11.8 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	《中国证券报》、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	《中国证券报》、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	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会	2022年01月14日

	购赎回代理券商的公告	基金电子披露网站	
4	鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	《中国证券报》、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
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	《中国证券报》、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 21 日
6	鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2021 年年度报告	《中国证券报》、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
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	《中国证券报》、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 07 日
8	鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	《中国证券报》、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
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	《中国证券报》、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
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	《中国证券报》、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
11	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	《中国证券报》、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
12	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 07 月 06 日
13	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购隆达股份首次公开发行 A 股的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 07 月 15 日
14	鹏华基金管理有限公司关于暂停喜鹊财富基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 07 月 15 日
15	鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年第 2 季度报告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 07 月 20 日
16	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金增加广发证券股份有限公司为申购赎回代理券商的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 07 月 20 日
17	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 08 月 04 日
18	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分	《中国证券报》、基金管	2022 年 08 月 10 日

	基金申购凯格精机首次公开发行 A 股的公告	理人网站及中国证监会基金电子披露网站	
19	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 08 月 11 日
20	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购路维光电首次公开发行 A 股的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 08 月 12 日
21	鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年中期报告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 08 月 30 日
22	鹏华基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 09 月 07 日
23	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购唯万密封首次公开发行 A 股的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 09 月 08 日
24	关于鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金增加部分证券公司为申购赎回代理券商的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 09 月 26 日
25	关于鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金增加光大证券股份有限公司为申购赎回代理券商的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 09 月 27 日
26	关于鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金增加部分证券公司为申购赎回代理券商的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 09 月 29 日
27	鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金更新的招募说明书	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 10 月 13 日
28	鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要（更新）	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 10 月 13 日
29	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购永信至诚首次公开发行 A 股的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 10 月 14 日
30	鹏华基金管理有限公司关于运用固有资金投资旗下基金的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 10 月 18 日
31	鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年第 3 季度报告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 10 月 25 日
32	关于鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 11 月 14 日

33	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海证券有限责任公司为申购赎回代理券商的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 12 月 13 日
34	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 12 月 14 日
35	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与华泰证券股份有限公司认/申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 12 月 15 日

注：无。

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	20220921~20220921	344.00	72,000,000.00	72,000,000.00	344.00	0.00
	2	20220101~20220920, 20221018~20221231	51,373,737.00	35,053,900.00	23,850,000.00	62,577,637.00	24.81

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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- (一)《鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- (二)《鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- (三)《鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年年度报告》（原文）。

13.2 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。

13.3 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

2023 年 3 月 30 日