

鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资
基金
2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 08 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	49
7.1 期末基金资产组合情况	49
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	50
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	52
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	64
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	66
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	66
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	66

7.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	66
7.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	66
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	66
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	66
7.12	投资组合报告附注	66
§ 8	基金份额持有人信息	68
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	68
8.2	期末上市基金前十名持有人	68
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	69
8.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	69
§ 9	开放式基金份额变动	69
§ 10	重大事件揭示	69
10.1	基金份额持有人大会决议	69
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	69
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	70
10.4	基金投资策略的改变	70
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	70
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	70
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	70
10.8	其他重大事件	73
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	74
11.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	74
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	75
§ 12	备查文件目录	75
12.1	备查文件目录	75
12.2	存放地点	75
12.3	查阅方式	75

§ 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	346,211,253.00 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。</p> <p>当预期成份股发生调整或成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。</p> <p>本基金力争将日均跟踪偏离度控制在 0.2% 以内，年跟踪误差控制在 2% 以内。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。</p> <p>1、股票投资策略</p> <p>（1）股票投资组合的构建</p> <p>本基金在建仓期内，将按照标的指数各成份股的基准权重对其逐步买入，在力求跟踪误差最小化的前提下，本基金可采取适当方法，以降低买入成本。当遇到成份股停牌、流动性不足等其他市场因素而无法依指数权重购买某成份股及预期标的指数的成份股即将调整或其他影响指数复制的因素时，本基金可以根据市场情况，结合研究分析，对基金财产进行适当调整，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。</p> <p>（2）股票投资组合的调整</p> <p>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</p>

	<p>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, 如发现流动性不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。</p> <p>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。</p> <p>(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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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</p>
--	--

	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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		张纳沙	廖林

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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.phfund.com.cn
基金中期报告备置地点	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层鹏华基金管理有限公司

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024年1月1日-2024年6月30日)
本期已实现收益	-60,707,897.32
本期利润	-53,169,833.44
加权平均基金份额本期利润	-0.0963
本期加权平均净值利润率	-7.49%
本期基金份额净值增长率	-7.53%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)
期末可供分配利润	79,768,113.46
期末可供分配基金份额利润	0.2304
期末基金资产净值	425,979,366.46
期末基金份额净值	1.2304
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)
基金份额累计净值增长率	23.04%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

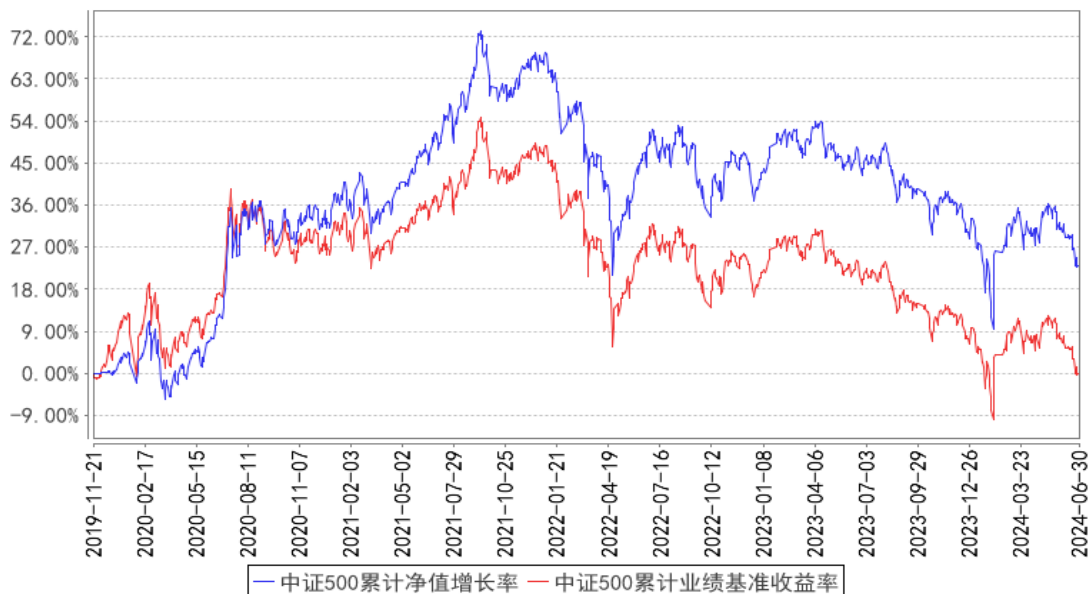
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-6.08%	0.95%	-6.89%	0.96%	0.81%	-0.01%
过去三个月	-5.08%	1.13%	-6.50%	1.14%	1.42%	-0.01%
过去六个月	-7.53%	1.58%	-8.96%	1.61%	1.43%	-0.03%
过去一年	-15.29%	1.26%	-17.60%	1.27%	2.31%	-0.01%
过去三年	-18.62%	1.17%	-27.40%	1.20%	8.78%	-0.03%

自基金合同生效起至今	23.04%	1.21%	-0.07%	1.27%	23.11%	-0.06%
------------	--------	-------	--------	-------	--------	--------

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。

3.3 其他指标

注：无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

鹏华基金管理有限公司成立于 1998 年 12 月 22 日，业务范围包括基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。截至本报告期末，公司股东由国信证券股份有限公司、意大利欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）、深圳市北融信投资发展有限公司组成，公司性质为中外合资企业，公司注册资本 15,000 万元人民币。截至本报告期末，公司资产管理总规模达到 12,020 亿元（联接基金不折算，不含投顾），公司管理着 324 只公募基金、13 只全国社保投资组合、8 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	-	15 年	陈龙先生, 国籍中国, 经济学硕士, 15 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 800 证券保险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 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 月至今担任鹏华中证空天一体军工指数证券投资基金(LOF)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, 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 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 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，2023 年 02 月至今担任鹏华国证疫苗与生物科技交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2023 年 07 月至今担任鹏华国证粮食产业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。
--	--	--	--	--	--

注：1. 任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日；担任新成立基金基金经理的，任职日期为基金合同生效日。2. 证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规、中国证监会的有关规定以及基金合同的约定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合规，不存在违反基金合同和损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

本基金跟踪的标的指数为中证 500 指数，中证 500 指数是在中证全指样本空间内，剔除沪深 300 指数成分股及最近一年日均总市值排名在前 300 名的股票之后，并剔除样本空间剩余股票最

近一年日均成交金额后 20%的股票，选取最近一年日均总市值排名前 500 名的股票，以综合反映 A 股市场中小市值公司的整体情况。

上半年，中证 500 指数下跌 8.96%，同期上证指数下跌 0.25%，沪深 300 指数上涨 0.89%。小市值风格经历了过去两年多的持续占优之后，今年迎来了均值回归，具体来看有以下几方面因素：一是年初的流动性冲击导致中小市值风格指数大幅波动，以私募量化为代表的部分资金陆续撤离或调整策略；二是 4 月中旬以来，随着新“国九条”落地，进一步驱动资金向大市值龙头个股集中；三是上半年大市值宽基 ETF 持续获得大额资金的流入，进一步强化了大市值风格的优势。

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，基金管理人通过对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期份额净值增长率为-7.53%，同期业绩比较基准增长率为-8.96%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年，宏观经济总体保持平稳，一季度实际 GDP 增长 5.3%，高于全年经济增长目标，二季度经济环比的动能有所减弱，但考虑到去年二季度较低的基数，预计仍可实现目标之上的水平。与强劲的宏观数据相比，微观主体的感受是偏弱的，背后与经济结构特征有一定的关联：一是“以价换量”，以出口数据为例，1-5 月份的出口金额仍保持可观的增长，但是出口价格总指数同比下降近 4%；二是“强生产，弱消费”，从而进一步加剧了价格下行的压力。映射到资本市场，上市公司的整体盈利依然承压，一季报仍延续了负增长，二季度环比有所改善，但修复的弹性偏弱。

中长期来看，国内经济两大制约的因素依然存在：一是房地产周期，除了直接影响地产相关的产业链之外，还会通过财富效应间接影响居民的消费和收入预期；二是产能周期，在部分高端制造领域，存在不同程度的产能过剩的压力，在大国博弈背景下，难以通过出口来有效化解。这也使得短期之内，经济难以摆脱当下这种偏通缩的状态，从而持续的压制上市公司的盈利及权益市场的表现。

对投资而言，需要尽量去回避受地产周期和产能周期影响较大方向。具体来看，上半年市场选择了三个方向：一是以国央企代表的红利类资产，其大多处于垄断资源类行业；二是出海细分方向，如家电、商用车、工程机械、船舶等；三是代表未来产业趋势的 AI 方向，包括算力、消费电子终端以及半导体芯片等。

展望下半年，预计三季度宏观经济、上市公司中报等依然乏善可陈，期间虽有重要会议加持，对市场整体的信心提振依然有限，预计市场依然处于震荡磨底的过程。

进入四季度之后，随着美联储开启新一轮降息，以及美国大选尘埃落定，外部环境对国内宏观政策的掣肘也会有所弱化，考虑到当前国内较高的实际利率，政策利率仍然具备进一步调降的空间。

其次，不管是地产周期，还是产能周期的约束，在明年均有望迎来边际改善，今年四季度有可能会提前发酵预期，有助于改变当下这种偏悲观的情绪。

结构方面，红利资产依然可以作为重要的底仓配置的方向，但是要适当调降对超额收益的预期；

其次，要特别重视科技成长方向的产业趋势变化，明年有望迎来景气度拐点，包括国产 AI、国防军工等有望迎来新一轮景气上行周期。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1、截止本报告期末，本基金期末可供分配利润为 79,768,113.46 元，期末基金份额净值 1.2304 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。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期内，本基金的管理人——鹏华基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对鹏华基金管理有限公司编制和披露的本基金 2024 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	11,561,313.91	29,911,463.16
结算备付金		10,925,696.08	14,103,710.79
存出保证金		2,607,775.30	4,156,109.56
交易性金融资产	6.4.7.2	401,306,202.38	1,311,390,087.66
其中：股票投资		401,306,202.38	1,311,390,087.66
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-

其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		3,251.33	2,941,864.11
应收股利		28,262.03	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	6,675.23	66,927.13
资产总计		426,439,176.26	1,362,570,162.41
负债和净资产	附注号	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	550,119.12
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		54,815.88	192,763.68
应付托管费		18,271.96	64,254.56
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,285.55	10,092.54
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	385,436.41	4,268,546.59
负债合计		459,809.80	5,085,776.49
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	346,211,253.00	1,020,211,253.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	79,768,113.46	337,273,132.92
净资产合计		425,979,366.46	1,357,484,385.92
负债和净资产总计		426,439,176.26	1,362,570,162.41

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.2304 元，基金份额总额 346,211,253.00 份。

6.2 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-52,268,059.27	14,818,224.19
1. 利息收入		545,483.29	380,926.68
其中：存款利息收入	6.4.7.13	93,262.91	62,187.17
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		10,645.89	-
其他利息收入		441,574.49	318,739.51
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-61,004,579.33	3,441,387.04
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-65,912,797.25	-1,131,718.89
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-935,894.88	23,817.25
股利收益	6.4.7.19	5,844,112.80	4,549,288.68
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	7,538,063.88	10,782,565.49
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	652,972.89	213,344.98
减：二、营业总支出		901,774.17	530,051.42
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	532,856.62	283,258.60
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	177,618.82	94,419.52
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
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	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		1,590.50	1,623.04
8. 其他费用	6.4.7.23	189,708.23	150,750.26
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-53,169,833.44	14,288,172.77
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-53,169,833.44	14,288,172.77
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-53,169,833.44	14,288,172.77

6.3 净资产变动表

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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,020,211,253.00	-	337,273,132.92	1,357,484,385.92
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,020,211,253.00	-	337,273,132.92	1,357,484,385.92
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	674,000,000.00	-	257,505,019.46	-931,505,019.46
（一）、综合收益总额	-	-	-53,169,833.44	-53,169,833.44
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	674,000,000.00	-	204,335,186.02	-878,335,186.02
其中：1. 基金申	40,000,000.00	-	9,675,035.69	49,675,035.69

购款				
2. 基金赎回款	- 714,000,000.00	-	- 214,010,221.71	-928,010,221.71
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	346,211,253.00	-	79,768,113.46	425,979,366.46
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	252,211,253.00	-	99,455,200.03	351,666,453.03
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	252,211,253.00	-	99,455,200.03	351,666,453.03
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	34,000,000.00	-	30,046,477.71	64,046,477.71
(一)、综合收益总额	-	-	14,288,172.77	14,288,172.77
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	34,000,000.00	-	15,758,304.94	49,758,304.94
其中：1. 基金申购款	56,000,000.00	-	26,817,888.44	82,817,888.44
2. 基金赎回款	-22,000,000.00	-	-11,059,583.50	-33,059,583.50
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净	-	-	-	-

资产变动（净资产减少以“-”号填列）				
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	286,211,253.00	-	129,501,677.74	415,712,930.74

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>邓召明</u>	<u>聂连杰</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

6.4 报表附注

6.4.1 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》准予,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。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的《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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2024 年上半年财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 06 月 30 日的财务状况以及 2024 年上半年的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

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

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018

年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

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

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	11,561,313.91
等于：本金	11,560,349.09
加：应计利息	964.82
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	11,561,313.91

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	451,345,021.53	-	401,306,202.38	-50,038,819.15
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	451,345,021.53	-	401,306,202.38	-50,038,819.15

注：股票投资的公允价值和股票投资的公允价值变动均含可退替代款估值增值。

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

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	20,460,000.00	-	-	-
其中： 股指期货 投资	20,460,000.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-

合计	20,460,000.00	-	-
----	---------------	---	---

6.4.7.3.2 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
IC2409	IC2409	20.00	19,500,800.00	-959,200.00
合计				-959,200.00
减：可抵销期货暂收款				-959,200.00
净额				0.00

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应收利息	-
其他应收款	6,675.23
待摊费用	-
合计	6,675.23

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	258,880.41
其中：交易所市场	258,880.41
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	82,546.10
应付指数使用费	44,009.90
合计	385,436.41

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,020,211,253.00	1,020,211,253.00
本期申购	40,000,000.00	40,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-714,000,000.00	-714,000,000.00
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	346,211,253.00	346,211,253.00

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。

6.4.7.11 其他综合收益

注：无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	546,219,767.74	-208,946,634.82	337,273,132.92
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	546,219,767.74	-208,946,634.82	337,273,132.92
本期利润	-60,707,897.32	7,538,063.88	-53,169,833.44
本期基金份额交易产生的变动数	-330,516,305.86	126,181,119.84	-204,335,186.02
其中：基金申购款	18,837,821.12	-9,162,785.43	9,675,035.69
基金赎回款	-349,354,126.98	135,343,905.27	-214,010,221.71
本期已分配利润	-	-	-
本期末	154,995,564.56	-75,227,451.10	79,768,113.46

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	32,933.29
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	57,074.90
其他	3,254.72
合计	93,262.91

注：其他包含认/申购款利息收入、结算保证金利息收入、风控金利息收入等。

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-33,470,451.52
股票投资收益——赎回差价收入	-32,442,345.73
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	-65,912,797.25

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	539,207,886.53
减：卖出股票成本总额	571,769,734.64
减：交易费用	908,603.41
买卖股票差价收入	-33,470,451.52

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
赎回基金份额对价总额	928,010,221.71
减：现金支付赎回款总额	473,335,103.71
减：赎回股票成本总额	487,117,463.73
减：交易费用	-
赎回差价收入	-32,442,345.73

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股指期货投资收益	-935,894.88

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	5,844,112.80
其中：证券出借权益补偿收入	361,310.70
基金投资产生的股利收益	-
合计	5,844,112.80

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	8,055,023.88
股票投资	8,055,023.88

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	-516,960.00
权证投资	-
期货投资	-516,960.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	7,538,063.88

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	652,972.89
合计	652,972.89

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

6.4.7.22 信用减值损失

注：无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	22,873.76
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行汇划费用	381.00
指数使用费	106,571.31
存托服务费	209.82
合计	189,708.23

6.4.7.24 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
鹏华基金管理有限公司（“鹏华基金公司”）	基金管理人
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
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：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
国信证券	467,684,477.40	71.11	44,387,247.90	26.82

6.4.10.1.2 债券交易

注：无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

6.4.10.1.4 权证交易

注：无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
国信证券	428,263.39	71.76	155,516.35	60.07
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
国信证券	40,894.17	26.91	40,894.17	30.37

注：（1）佣金的计算公式

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

(佣金比率按照与一般证券公司签订的协议条款订立。)

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	532,856.62
其中：应支付销售机构的客户维护 费	6,977.97	4,532.76
应支付基金管理人的净管理费	525,878.65	278,725.84

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	177,618.82	94,419.52

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。

6.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

单位：人民币元

本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日						
关联方名称	交易金额	费率区间 (%)	加权平均费率 (%)	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	3,859,471.00	2.00~3.10	2.33	3,669.85	-	-
上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日						
关联方名称	交易金额	费率区间 (%)	加权平均费率 (%)	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	882,730.00	3.10~3.20	3.10	989.32	249,289.00	227.82

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 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	152,952,037.00	44.18	832,254,037.00	81.58

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月 30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	11,561,313.91	32,933.29	11,714,543.40	15,899.19

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2024年1月1日至2024年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单 位：股/ 张）	总金额
国信证券	603325	博隆技术	网下申购	660	47,823.60
上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单 位：股/ 张）	总金额
国信证券	688307	中润光学	网下申购	2,455	58,625.40
国信证券	688562	航天软件	网下申购	6,732	85,361.76
国信证券	301488	豪恩汽电	网下申购	2,244	89,266.32

注：本表包含参与基金托管人的关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

注：无。

6.4.12 期末（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001359	平安电工	2024 年 3 月 19 日	6 个月	新股流通受限	17.39	20.60	184	3,199.76	3,790.40	-
001379	腾达科技	2024 年 1 月 11 日	6 个月	新股流通受限	16.98	13.48	213	3,616.74	2,871.24	-
001387	雪祺电气	2024 年 1 月 4 日	6 个月	新股流通受限	15.38	15.25	173	2,045.54	2,638.25	雪祺电气于 2024 年 6 月 3 日每 10 股送 3 股
001389	广合科技	2024 年 3 月 26 日	6 个月	新股流通受限	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	-
301392	汇成真空	2024 年 5 月 28 日	6 个月	新股流通受限	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
301502	华阳智能	2024 年 1 月 26 日	6 个月	新股流通受限	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-
301536	星辰科技	2024 年 3 月 20 日	6 个月	新股流通受限	16.16	32.27	481	7,772.96	15,521.87	-
301538	骏鼎	2024 年 3 月	6 个月	新股流通	55.82	91.24	150	5,972.74	13,686.00	骏鼎达于

	达	月 13 日		受限							2024 年 5 月 22 日 每 10 股 送 4 股
301539	宏鑫科技	2024 年 4 月 3 日	6 个月	新股流通受限	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-	
301565	中仑新材	2024 年 6 月 13 日	6 个月	新股流通受限	11.88	18.98	544	6,462.72	10,325.12	-	
301566	达利凯普	2023 年 12 月 22 日	6 个月	新股流通受限	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-	
301580	爱迪特	2024 年 6 月 19 日	6 个月	新股流通受限	44.95	65.93	202	9,079.90	13,317.86	-	
301587	中瑞股份	2024 年 3 月 27 日	6 个月	新股流通受限	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	-	
301588	美新科技	2024 年 3 月 6 日	6 个月	新股流通受限	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-	
301591	肯特股份	2024 年 2 月 20 日	6 个月	新股流通受限	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-	
601033	永兴股份	2024 年 1 月 11 日	6 个月	新股流通受限	16.20	15.96	1,258	20,379.60	20,077.68	-	
603082	北自科技	2024 年 1 月 23 日	6 个月	新股流通受限	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	-	
603285	键	2024	1 个月	新股	18.65	18.65	1,158	21,596.70	21,596.70	-	

	邦股份	年6月28日	内(含)	未上市						
603285	键邦股份	2024年6月28日	6个月	新股流通受限	18.65	18.65	129	2,405.85	2,405.85	-
603312	西典新能	2024年1月4日	6个月	新股流通受限	29.02	25.36	130	3,772.60	3,296.80	-
603325	博隆技术	2024年1月3日	6个月	新股流通受限	72.46	68.06	66	4,782.36	4,491.96	-
603341	龙旗科技	2024年2月23日	6个月	新股流通受限	26.00	37.49	298	7,748.00	11,172.02	-
603344	星德胜	2024年3月13日	6个月	新股流通受限	19.18	22.66	182	3,490.76	4,124.12	-
603350	安乃达	2024年6月26日	1个月内(含)	新股未上市	20.56	20.56	945	19,429.20	19,429.20	-
603350	安乃达	2024年6月26日	6个月	新股流通受限	20.56	20.56	106	2,179.36	2,179.36	-
603375	盛景微	2024年1月17日	6个月	新股流通受限	38.18	38.90	72	2,748.96	2,800.80	-
603381	永臻股份	2024年6月19日	6个月	新股流通受限	23.35	25.13	150	3,502.50	3,769.50	-
688530	欧莱新材	2024年4月29日	6个月	新股流通受限	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-
688584	上	2024	6个月	新股	22.66	15.89	839	19,011.74	13,331.71	-

	海合晶	年 2 月 1 日		流通受限						
688691	灿芯股份	2024 年 4 月 2 日	6 个月	新股流通受限	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-
688692	达梦数据	2024 年 6 月 4 日	6 个月	新股流通受限	86.96	174.93	137	11,913.52	23,965.41	-
688695	中创股份	2024 年 3 月 6 日	6 个月	新股流通受限	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
688709	成都华微	2024 年 1 月 31 日	6 个月	新股流通受限	15.69	18.79	899	14,105.31	16,892.21	-

注：1、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中需要限售的部分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。

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、基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

4、基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后 6 个月内不得转让。

6.4.12.2 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
400174	中天3	2023 年 08 月 30 日	重大事项	0.00	-	-	286,500	500,813.56	0.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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	000021	深科技	2024年7月9日	15.12	5,000	75,600.00
2	000539	粤电力A	2024年7月9日	5.08	5,800	29,464.00
3	000598	兴蓉环境	2024年7月5日	7.52	20,000	150,400.00
4	000629	钒钛股份	2024年7月3日-2024年7月9日	2.50	40,100	100,250.00
5	000723	美锦能源	2024年7月3日	4.76	7,500	35,700.00
6	000739	普洛药业	2024年7月9日	13.57	4,000	54,280.00
7	000831	中国稀土	2024年7月3日	25.35	6,000	152,100.00
8	000887	中鼎股份	2024年7月3日	12.24	8,000	97,920.00
9	000937	冀中能源	2024年7月1日	6.70	10,000	67,000.00
10	000967	盈峰环境	2024年7月4日	4.23	2,800	11,844.00
11	001286	陕西能源	2024年7月9日	11.53	9,200	106,076.00
12	002056	横店东磁	2024年7月1日	12.47	4,700	58,609.00
13	002080	中材科技	2024年7月1日	12.90	7,200	92,880.00
14	002155	湖南黄金	2024年7月9日	18.10	9,000	162,900.00
15	002266	浙富控股	2024年7月1日	2.79	6,500	18,135.00
16	002268	电科网安	2024年7月3日	14.23	6,000	85,380.00
17	002368	太极股份	2024年7月1日	22.55	4,300	96,965.00
18	002372	伟星新材	2024年7月9日	15.42	8,000	123,360.00
19	002408	齐翔腾	2024年7月1日-2024	5.60	13,000	72,800.00

		达	年 7 月 2 日			
20	002409	雅克科技	2024 年 7 月 3 日	62.91	3,000	188,730.00
21	002423	中粮资本	2024 年 7 月 1 日	7.49	9,000	67,410.00
22	002444	巨星科技	2024 年 7 月 3 日	24.70	6,700	165,490.00
23	002487	大金重工	2024 年 7 月 1 日	22.88	3,000	68,640.00
24	002518	科士达	2024 年 7 月 1 日	17.70	2,300	40,710.00
25	002531	天顺风能	2024 年 7 月 3 日-2024 年 7 月 9 日	8.94	9,000	80,460.00
26	002557	洽洽食品	2024 年 7 月 5 日	28.19	3,500	98,665.00
27	002568	百润股份	2024 年 7 月 1 日-2024 年 7 月 4 日	16.83	5,300	89,199.00
28	002572	索菲亚	2024 年 7 月 9 日	15.33	7,000	107,310.00
29	002624	完美世界	2024 年 7 月 1 日	7.60	4,000	30,400.00
30	002670	国盛金控	2024 年 7 月 1 日	8.47	12,000	101,640.00
31	002690	美亚光电	2024 年 7 月 2 日	16.50	3,000	49,500.00
32	002738	中矿资源	2024 年 7 月 9 日	26.80	4,100	109,880.00
33	002831	裕同科技	2024 年 7 月 1 日	25.59	3,000	76,770.00
34	002936	郑州银行	2024 年 7 月 1 日-2024 年 7 月 9 日	1.73	43,000	74,390.00
35	003022	联泓新科	2024 年 7 月 1 日	13.71	3,500	47,985.00
36	300017	网宿科技	2024 年 7 月 1 日-2024 年 7 月 5 日	7.90	25,000	197,500.00
37	300058	蓝色光标	2024 年 7 月 1 日	5.44	5,400	29,376.00
38	300070	碧水源	2024 年 7 月 2 日	4.19	2,000	8,380.00
39	300073	当升科技	2024 年 7 月 9 日	34.31	3,000	102,930.00
40	300118	东方日升	2024 年 7 月 4 日-2024 年 7 月 10 日	12.10	3,000	36,300.00
41	300144	宋城演艺	2024 年 7 月 9 日	8.03	22,000	176,660.00
42	300212	易华录	2024 年 7 月 1 日	16.83	4,800	80,784.00

43	300677	英科医疗	2024 年 7 月 9 日	26.81	4,500	120,645.00
44	300682	朗新集团	2024 年 7 月 9 日	8.51	2,700	22,977.00
45	300748	金力永磁	2024 年 7 月 3 日	12.96	1,000	12,960.00
46	300776	帝尔激光	2024 年 7 月 2 日	45.96	1,200	55,152.00
47	301029	怡合达	2024 年 7 月 9 日	19.66	1,500	29,490.00
48	600004	白云机场	2024 年 7 月 9 日	9.48	10,400	98,592.00
49	600032	浙江新能	2024 年 7 月 3 日	7.28	2,000	14,560.00
50	600056	中国医药	2024 年 7 月 5 日	10.12	7,000	70,840.00
51	600060	海信视像	2024 年 7 月 9 日	24.74	1,200	29,688.00
52	600066	宇通客车	2024 年 7 月 9 日	25.80	7,000	180,600.00
53	600095	湘财股份	2024 年 7 月 1 日	5.96	10,400	61,984.00
54	600118	中国卫星	2024 年 7 月 9 日	22.23	2,900	64,467.00
55	600131	国网信通	2024 年 7 月 2 日	16.87	2,000	33,740.00
56	600157	永泰能源	2024 年 7 月 1 日	1.18	48,500	57,230.00
57	600258	首旅酒店	2024 年 7 月 9 日	12.35	7,000	86,450.00
58	600298	安琪酵母	2024 年 7 月 3 日	27.93	2,200	61,446.00
59	600299	安迪苏	2024 年 7 月 3 日	9.70	300	2,910.00
60	600315	上海家化	2024 年 7 月 3 日	17.78	4,500	80,010.00
61	600325	华发股份	2024 年 7 月 4 日	6.50	20,000	130,000.00
62	600339	中油工程	2024 年 7 月 1 日-2024 年 7 月 9 日	3.12	17,100	53,352.00
63	600373	中文传媒	2024 年 7 月 1 日	14.84	8,200	121,688.00
64	600377	宁沪高速	2024 年 7 月 1 日	12.60	5,000	63,000.00
65	600378	昊华科技	2024 年 7 月 1 日-2024 年 7 月 9 日	28.90	2,300	66,470.00

66	600392	盛和资源	2024年7月9日	8.62	15,000	129,300.00
67	600398	海澜之家	2024年7月9日	9.24	15,800	145,992.00
68	600418	江淮汽车	2024年7月1日-2024年7月9日	15.84	16,000	253,440.00
69	600483	福能股份	2024年7月2日	11.66	8,000	93,280.00
70	600499	科达制造	2024年7月2日	8.43	6,200	52,266.00
71	600546	山煤国际	2024年7月9日	14.62	10,000	146,200.00
72	600582	天地科技	2024年7月1日	6.89	16,000	110,240.00
73	600583	海油工程	2024年7月1日	5.91	6,400	37,824.00
74	600655	豫园股份	2024年7月3日	5.15	500	2,575.00
75	600699	均胜电子	2024年7月4日	14.82	6,200	91,884.00
76	600755	厦门国贸	2024年7月9日	7.17	6,100	43,737.00
77	600808	马钢股份	2024年7月3日-2024年7月5日	2.02	18,200	36,764.00
78	600839	四川长虹	2024年7月1日	4.49	10,000	44,900.00
79	600859	王府井	2024年7月1日	11.74	9,700	113,878.00
80	600867	通化东宝	2024年7月5日	8.37	100	837.00
81	600901	江苏金租	2024年7月1日-2024年7月5日	5.05	16,000	80,800.00
82	600959	江苏有线	2024年7月9日	2.64	36,800	97,152.00
83	600968	海油发展	2024年7月1日	4.12	12,000	49,440.00
84	600995	南网储能	2024年7月1日	9.66	6,000	57,960.00
85	601058	赛轮轮胎	2024年7月1日	14.00	27,000	378,000.00
86	601098	中南传媒	2024年7月1日-2024年7月3日	12.42	8,700	108,054.00
87	601106	中国一重	2024年7月9日	2.31	33,600	77,616.00

88	601156	东航物流	2024年7月3日	20.35	5,000	101,750.00
89	601158	重庆水务	2024年7月1日	4.80	2,100	10,080.00
90	601179	中国西电	2024年7月5日-2024年7月9日	8.04	25,000	201,000.00
91	601228	广州港	2024年7月9日	3.05	18,500	56,425.00
92	601298	青岛港	2024年7月1日	9.56	3,000	28,680.00
93	601611	中国核建	2024年7月3日	8.09	13,000	105,170.00
94	601828	美凯龙	2024年7月3日	2.55	1,700	4,335.00
95	601958	金钼股份	2024年7月9日	10.41	10,000	104,100.00
96	601992	金隅集团	2024年7月3日	1.37	5,400	7,398.00
97	603000	人民网	2024年7月1日-2024年7月5日	19.99	5,800	115,942.00
98	603056	德邦股份	2024年7月3日	13.10	1,000	13,100.00
99	603077	和邦生物	2024年7月9日	1.65	59,400	98,010.00
100	603127	昭衍新药	2024年7月5日	13.27	3,000	39,810.00
101	603218	日月股份	2024年7月1日	10.27	4,000	41,080.00
102	603225	新凤鸣	2024年7月3日-2024年7月9日	15.59	6,600	102,894.00
103	603228	景旺电子	2024年7月5日	31.80	4,000	127,200.00
104	603233	大参林	2024年7月3日	14.30	4,500	64,350.00
105	603305	旭升集团	2024年7月1日	10.56	3,000	31,680.00
106	603379	三美股份	2024年7月3日	39.14	2,500	97,850.00
107	603529	爱玛科技	2024年7月9日	27.33	2,800	76,524.00
108	603688	石英股份	2024年7月3日	29.61	1,500	44,415.00
109	603707	健友股份	2024年7月9日	11.88	5,000	59,400.00
110	603816	顾家家居	2024年7月1日	32.29	5,000	161,450.00
111	603826	坤彩科技	2024年7月1日	28.97	1,400	40,558.00

112	603882	金城医学	2024 年 7 月 5 日	27.19	3,000	81,570.00
113	603927	中科软	2024 年 7 月 1 日	18.09	3,000	54,270.00
114	603939	益丰药房	2024 年 7 月 3 日	24.55	400	9,820.00
115	605358	立昂微	2024 年 7 月 4 日	23.14	9,000	208,260.00
116	688005	容百科技	2024 年 7 月 9 日	23.28	2,500	58,200.00
117	688006	杭可科技	2024 年 7 月 9 日	17.45	2,600	45,370.00
118	688063	派能科技	2024 年 7 月 3 日	39.71	1,960	77,831.60
119	688200	华峰测控	2024 年 7 月 3 日	91.75	1,000	91,750.00
120	688234	天岳先进	2024 年 7 月 9 日	46.92	1,600	75,072.00
121	688385	复旦微电子	2024 年 7 月 3 日	31.38	1,100	34,518.00
122	688425	铁建重工	2024 年 7 月 9 日	3.68	16,000	58,880.00
123	688516	奥特维	2024 年 7 月 1 日	41.81	1,500	62,715.00
124	688520	神州细胞-U	2024 年 7 月 9 日	39.35	1,100	43,285.00
125	688521	芯原股份	2024 年 7 月 9 日	26.75	2,600	69,550.00
126	688536	思瑞浦	2024 年 7 月 1 日	97.81	1,000	97,810.00
127	688538	和辉光电-U	2024 年 7 月 1 日	1.98	20,000	39,600.00
128	688567	孚能科技	2024 年 7 月 3 日	9.60	2,600	24,960.00
129	688778	厦钨新能	2024 年 7 月 9 日	31.24	1,400	43,736.00
130	688779	长远锂科	2024 年 7 月 9 日	4.63	11,800	54,634.00
131	689009	九号公司-WD	2024 年 7 月 1 日	36.81	1,800	66,258.00
合计	-	-	-	-	1,096,060	10,322,452.60

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数型基金。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股（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。

6.4.13.2 信用风险

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

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

本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算,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 2024 年 06 月 30 日，本基金未持有信用类债券（2023 年 12 月 31 日：未持有）。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理职能部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间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 2024 年 06 月 30 日，本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（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。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注“期末本基金持有的流通受限证券”。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	11,561,313.91	-	-	-	11,561,313.91
结算备付金	10,925,696.08	-	-	-	10,925,696.08
存出保证金	2,607,775.30	-	-	-	2,607,775.30
交易性金融资产	-	-	-	401,306,202.38	401,306,202.38
应收股利	-	-	-	28,262.03	28,262.03
应收清算款	-	-	-	3,251.33	3,251.33
其他资产	-	-	-	6,675.23	6,675.23
资产总计	25,094,785.29	-	-	401,344,390.97	426,439,176.26
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	54,815.88	54,815.88
应付托管费	-	-	-	18,271.96	18,271.96
应交税费	-	-	-	1,285.55	1,285.55
其他负债	-	-	-	385,436.41	385,436.41
负债总计	-	-	-	459,809.80	459,809.80
利率敏感度缺口	25,094,785.29	-	-	400,884,581.17	425,979,366.46
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	29,911,463.16	-	-	-	29,911,463.16
结算备付金	14,103,710.79	-	-	-	14,103,710.79
存出保证金	4,156,109.56	-	-	-	4,156,109.56
交易性金融资产	-	-	-	1,311,390,087.66	1,311,390,087.66
应收清算款	-	-	-	2,941,864.11	2,941,864.11
其他资产	-	-	-	66,927.13	66,927.13
资产总计	48,171,283.51	-	-	1,314,398,878.90	1,362,570,162.41
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	192,763.68	192,763.68
应付托管费	-	-	-	64,254.56	64,254.56
应付清算款	-	-	-	550,119.12	550,119.12
应交税费	-	-	-	10,092.54	10,092.54
其他负债	-	-	-	4,268,546.59	4,268,546.59
负债总计	-	-	-	5,085,776.49	5,085,776.49
利率敏感度缺口	48,171,283.51	-	-	1,309,313,102.41	1,357,484,385.92

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2024 年 06 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资和资产支持证券公允价值占基金资产净

值的比例为 0.00%，因此当利率发生合理、可能的变动时，对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无。

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金为被动式指数基金，原则上采用完全复制的方法，按照个券在标的指数中的基准权重构建投资组合。基金所构建的指数化投资组合将根据标的指数成份券及其权重的变动而进行相应调整。同时，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、新股增发等变化，对基金投资组合进行相应调整，以保证基金份额净值增长率与标的指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股（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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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	401,306,202.38	94.21	1,311,390,087.66	96.60
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	401,306,202.38	94.21	1,311,390,087.66	96.60

注：债券投资为可转债、可交换债券投资。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准外的其他市场变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	比较基准上涨 5% 资产净值变动	20,981,613.69	66,380,986.47
	比较基准下降 5% 资产净值变动	-20,981,613.69	-66,380,986.47

注：无。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年6月30日
第一层次	401,009,220.65
第二层次	45,611.11
第三层次	251,370.62
合计	401,306,202.38

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	401,306,202.38	94.11
	其中：股票	401,306,202.38	94.11
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	22,487,009.99	5.27
8	其他各项资产	2,645,963.89	0.62
9	合计	426,439,176.26	100.00

注：1、上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而 7.2 的合计项不含可退替代款估值增值。

2、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 10,322,452.60 元，占基金资产净值比为 2.42%。

3、报告期末本基金投资的存托凭证公允价值为：1,244,178.00 元，占净值比 0.29%。本报告所指的“股票”均包含存托凭证。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	2,515,654.00	0.59
B	采矿业	18,737,386.30	4.40
C	制造业	253,558,397.22	59.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,151,397.80	3.79
E	建筑业	4,082,028.00	0.96
F	批发和零售业	8,517,272.48	2.00
G	交通运输、仓储和邮政业	8,068,697.50	1.89
H	住宿和餐饮业	1,266,139.85	0.30
I	信息传输、软件和信息技术服务业	28,528,276.10	6.70
J	金融业	37,271,228.12	8.75
K	房地产业	4,535,633.00	1.06
L	租赁和商务服务业	3,064,524.00	0.72
M	科学研究和技术	3,203,916.40	0.75

	服务业		
N	水利、环境和公共设施管理业	1,820,525.67	0.43
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	446,454.00	0.10
Q	卫生和社会工作	2,487,950.00	0.58
R	文化、体育和娱乐业	6,030,310.00	1.42
S	综合	717,376.00	0.17
	合计	401,003,166.44	94.14

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	242,624.58	0.06
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	40,333.68	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	0.00	0.00
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	20,077.68	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-

	合计	303,035.94	0.07
--	----	------------	------

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	300502	新易盛	47,900	5,055,845.00	1.19
2	002028	思源电气	41,500	2,776,350.00	0.65
3	601058	赛轮轮胎	177,800	2,489,200.00	0.58
4	688169	石头科技	6,317	2,480,054.20	0.58
5	600066	宇通客车	89,900	2,319,420.00	0.54
6	002340	格林美	347,200	2,211,664.00	0.52
7	000933	神火股份	106,500	2,154,495.00	0.51
8	601077	渝农商行	418,500	2,100,870.00	0.49
9	000988	华工科技	68,000	2,035,240.00	0.48
10	601168	西部矿业	112,800	2,024,760.00	0.48
11	300394	天孚通信	22,560	1,994,755.20	0.47
12	002384	东山精密	92,400	1,912,680.00	0.45
13	000423	东阿阿胶	30,400	1,903,040.00	0.45
14	000630	铜陵有色	518,800	1,872,868.00	0.44
15	600418	江淮汽车	118,200	1,872,288.00	0.44
16	600988	赤峰黄金	112,400	1,836,616.00	0.43
17	601233	桐昆股份	114,100	1,821,036.00	0.43
18	600157	永泰能源	1,501,800	1,772,124.00	0.42
19	002625	光启技术	102,000	1,769,700.00	0.42
20	600096	云天化	86,900	1,687,598.00	0.40
21	601567	三星医疗	47,600	1,666,000.00	0.39
22	000400	许继电气	48,200	1,658,562.00	0.39
23	688777	中控技术	42,600	1,606,020.00	0.38
24	002156	通富微电	71,718	1,605,766.02	0.38
25	002128	电投能源	75,700	1,597,270.00	0.37
26	002273	水晶光电	93,900	1,594,422.00	0.37
27	601555	东吴证券	268,690	1,585,271.00	0.37
28	002078	太阳纸业	113,400	1,581,930.00	0.37
29	600885	宏发股份	56,420	1,561,705.60	0.37
30	601128	常熟银行	203,810	1,542,841.70	0.36
31	002532	天山铝业	188,700	1,530,357.00	0.36
32	002223	鱼跃医疗	40,700	1,530,320.00	0.36
33	300207	欣旺达	100,700	1,527,619.00	0.36

34	600352	浙江龙盛	175,800	1,510,122.00	0.35
35	600398	海澜之家	162,300	1,499,652.00	0.35
36	002138	顺络电子	54,600	1,499,316.00	0.35
37	002966	苏州银行	198,280	1,487,100.00	0.35
38	002353	杰瑞股份	41,500	1,455,820.00	0.34
39	601108	财通证券	219,800	1,452,878.00	0.34
40	600765	中航重机	70,160	1,431,264.00	0.34
41	688617	惠泰医疗	3,100	1,413,910.00	0.33
42	002185	华天科技	173,400	1,413,210.00	0.33
43	002517	恺英网络	145,500	1,389,525.00	0.33
44	600879	航天电子	178,300	1,385,391.00	0.33
45	301236	软通动力	38,700	1,362,627.00	0.32
46	603606	东方电缆	27,800	1,356,918.00	0.32
47	600873	梅花生物	135,000	1,352,700.00	0.32
48	688099	晶晨股份	22,600	1,340,632.00	0.31
49	600177	雅戈尔	187,800	1,337,136.00	0.31
50	601577	长沙银行	163,100	1,334,158.00	0.31
51	600109	国金证券	175,640	1,326,082.00	0.31
52	600079	人福医药	77,100	1,323,807.00	0.31
53	300003	乐普医疗	89,100	1,322,244.00	0.31
54	002738	中矿资源	49,261	1,320,194.80	0.31
55	600060	海信视像	53,000	1,311,220.00	0.31
56	300017	网宿科技	165,000	1,303,500.00	0.31
57	600497	驰宏锌锗	240,900	1,286,406.00	0.30
58	300136	信维通信	65,400	1,280,532.00	0.30
59	603160	汇顶科技	18,600	1,278,750.00	0.30
60	603979	金诚信	24,900	1,258,197.00	0.30
61	002202	金风科技	186,600	1,253,952.00	0.29
62	002739	万达电影	103,200	1,247,688.00	0.29
63	689009	九号公司-WD	33,800	1,244,178.00	0.29
64	000932	华菱钢铁	280,200	1,241,286.00	0.29
65	688120	华海清科	6,529	1,237,767.82	0.29
66	600536	中国软件	40,802	1,220,795.84	0.29
67	002409	雅克科技	19,400	1,220,454.00	0.29
68	600985	淮北矿业	72,900	1,220,346.00	0.29
69	000683	远兴能源	176,500	1,219,615.00	0.29
70	002465	海格通信	117,500	1,217,300.00	0.29
71	600348	华阳股份	121,950	1,214,622.00	0.29
72	002444	巨星科技	48,845	1,206,471.50	0.28
73	002281	光迅科技	32,200	1,203,314.00	0.28
74	000009	中国宝安	139,568	1,200,284.80	0.28
75	002008	大族激光	57,000	1,185,600.00	0.28
76	300474	景嘉微	18,700	1,182,401.00	0.28

77	000878	云南铜业	94,700	1,179,962.00	0.28
78	002436	兴森科技	114,100	1,177,512.00	0.28
79	688122	西部超导	30,690	1,176,040.80	0.28
80	600642	申能股份	132,400	1,169,092.00	0.27
81	601615	明阳智能	122,800	1,159,232.00	0.27
82	002797	第一创业	227,200	1,156,448.00	0.27
83	000039	中集集团	124,500	1,152,870.00	0.27
84	600298	安琪酵母	41,200	1,150,716.00	0.27
85	300054	鼎龙股份	50,700	1,149,876.00	0.27
86	601990	南京证券	149,500	1,148,160.00	0.27
87	000066	中国长城	130,900	1,145,375.00	0.27
88	300012	华测检测	113,800	1,144,828.00	0.27
89	600529	山东药玻	44,800	1,135,232.00	0.27
90	601666	平煤股份	100,500	1,125,600.00	0.26
91	002673	西部证券	181,300	1,122,247.00	0.26
92	600839	四川长虹	249,700	1,121,153.00	0.26
93	603596	伯特利	28,716	1,117,052.40	0.26
94	601179	中国西电	138,700	1,115,148.00	0.26
95	688525	佰维存储	17,300	1,109,795.00	0.26
96	000831	中国稀土	42,900	1,087,515.00	0.26
97	000783	长江证券	224,400	1,083,852.00	0.25
98	300395	菲利华	35,200	1,082,400.00	0.25
99	601717	郑煤机	73,100	1,081,880.00	0.25
100	603816	顾家家居	33,400	1,078,486.00	0.25
101	300002	神州泰岳	132,500	1,075,900.00	0.25
102	000728	国元证券	176,900	1,072,014.00	0.25
103	002432	九安医疗	26,400	1,070,256.00	0.25
104	000738	航发控制	53,300	1,069,731.00	0.25
105	600862	中航高科	56,630	1,063,511.40	0.25
106	000703	恒逸石化	148,700	1,054,283.00	0.25
107	688180	君实生物-U	36,258	1,053,294.90	0.25
108	601198	东兴证券	131,100	1,043,556.00	0.24
109	688188	柏楚电子	5,652	1,043,076.60	0.24
110	601997	贵阳银行	197,700	1,041,879.00	0.24
111	603338	浙江鼎力	17,200	1,039,224.00	0.24
112	000960	锡业股份	66,800	1,034,732.00	0.24
113	002155	湖南黄金	56,953	1,030,849.30	0.24
114	002595	豪迈科技	26,900	1,026,773.00	0.24
115	603345	安井食品	13,800	1,025,478.00	0.24
116	600863	内蒙华电	220,700	1,024,048.00	0.24
117	300866	安克创新	14,360	1,022,575.60	0.24
118	601696	中银证券	112,600	1,022,408.00	0.24
119	601162	天风证券	468,600	1,021,548.00	0.24

120	300037	新宙邦	35,760	1,021,305.60	0.24
121	300724	捷佳伟创	18,900	1,020,789.00	0.24
122	600038	中直股份	24,800	1,019,528.00	0.24
123	600521	华海药业	59,400	1,012,770.00	0.24
124	000921	海信家电	31,300	1,009,112.00	0.24
125	603939	益丰药房	41,100	1,009,005.00	0.24
126	002294	信立泰	37,800	1,006,614.00	0.24
127	300001	特锐德	50,000	1,006,000.00	0.24
128	002472	双环传动	45,600	1,004,112.00	0.24
129	002984	森麒麟	41,600	1,002,144.00	0.24
130	600141	兴发集团	52,300	997,884.00	0.23
131	600549	厦门钨业	57,600	993,600.00	0.23
132	600699	均胜电子	66,700	988,494.00	0.23
133	002407	多氟多	80,600	985,738.00	0.23
134	600546	山煤国际	67,000	979,540.00	0.23
135	300699	光威复材	39,420	978,798.60	0.23
136	002262	恩华药业	41,000	973,340.00	0.23
137	600820	隧道股份	148,800	971,664.00	0.23
138	002850	科达利	12,700	970,026.00	0.23
139	600895	张江高科	52,400	968,352.00	0.23
140	600369	西南证券	269,600	965,168.00	0.23
141	002195	岩山科技	384,100	964,091.00	0.23
142	301358	湖南裕能	30,600	962,676.00	0.23
143	002064	华峰化学	134,200	962,214.00	0.23
144	600872	中炬高新	42,400	962,056.00	0.23
145	300285	国瓷材料	53,890	961,936.50	0.23
146	603589	口子窖	24,400	956,236.00	0.22
147	000021	深科技	63,200	955,584.00	0.22
148	601000	唐山港	200,300	941,410.00	0.22
149	600021	上海电力	95,100	940,539.00	0.22
150	603087	甘李药业	20,300	940,296.00	0.22
151	300073	当升科技	27,300	936,663.00	0.22
152	300146	汤臣倍健	69,000	934,950.00	0.22
153	600486	扬农化工	16,490	930,860.50	0.22
154	000513	丽珠集团	24,900	926,529.00	0.22
155	300058	蓝色光标	168,200	915,008.00	0.21
156	601966	玲珑轮胎	49,800	914,826.00	0.21
157	600704	物产中大	210,600	914,004.00	0.21
158	002756	永兴材料	25,400	908,812.00	0.21
159	600153	建发股份	101,600	907,288.00	0.21
160	300114	中航电测	20,039	906,764.75	0.21
161	600155	华创云信	152,901	903,644.91	0.21
162	603179	新泉股份	23,000	902,520.00	0.21

163	000830	鲁西化工	77,600	899,384.00	0.21
164	300529	健帆生物	32,800	892,488.00	0.21
165	600118	中国卫星	40,100	891,423.00	0.21
166	688065	凯赛生物	19,600	889,644.00	0.21
167	600583	海油工程	149,500	883,545.00	0.21
168	002558	巨人网络	93,300	880,752.00	0.21
169	002152	广电运通	84,000	878,640.00	0.21
170	000591	太阳能	185,000	871,350.00	0.20
171	601156	东航物流	42,800	870,980.00	0.20
172	000623	吉林敖东	64,700	866,980.00	0.20
173	002025	航天电器	18,600	862,668.00	0.20
174	600970	中材国际	71,500	862,290.00	0.20
175	300373	扬杰科技	22,100	859,690.00	0.20
176	002385	大北农	222,400	856,240.00	0.20
177	300144	宋城演艺	106,400	854,392.00	0.20
178	002439	启明星辰	49,500	854,370.00	0.20
179	600380	健康元	75,600	844,452.00	0.20
180	605358	立昂微	36,400	842,296.00	0.20
181	601216	君正集团	228,200	842,058.00	0.20
182	000729	燕京啤酒	95,200	840,616.00	0.20
183	000723	美锦能源	175,500	835,380.00	0.20
184	600143	金发科技	126,300	834,843.00	0.20
185	300251	光线传媒	99,200	834,272.00	0.20
186	600998	九州通	170,459	831,839.92	0.20
187	000519	中兵红箭	56,600	830,322.00	0.19
188	600282	南钢股份	166,700	830,166.00	0.19
189	600637	东方明珠	136,400	829,312.00	0.19
190	600516	方大炭素	190,600	821,486.00	0.19
191	300383	光环新网	97,200	821,340.00	0.19
192	300677	英科医疗	30,600	820,386.00	0.19
193	300024	机器人	83,900	817,186.00	0.19
194	600392	盛和资源	94,700	816,314.00	0.19
195	000636	风华高科	62,500	816,250.00	0.19
196	600763	通策医疗	15,100	816,155.00	0.19
197	000818	航锦科技	36,700	810,336.00	0.19
198	002958	青农商行	300,400	805,072.00	0.19
199	601665	齐鲁银行	163,400	802,294.00	0.19
200	600909	华安证券	190,540	802,173.40	0.19
201	002044	美年健康	211,700	800,226.00	0.19
202	600008	首创环保	297,700	797,836.00	0.19
203	000883	湖北能源	132,300	795,123.00	0.19
204	600566	济川药业	24,900	789,579.00	0.19
205	000629	钒钛股份	314,200	785,500.00	0.18

206	601016	节能风电	262,620	785,233.80	0.18
207	600867	通化东宝	93,700	784,269.00	0.18
208	600511	国药股份	25,400	782,066.00	0.18
209	688213	思特威-W	16,100	780,850.00	0.18
210	300088	长信科技	165,934	779,889.80	0.18
211	601456	国联证券	80,800	778,912.00	0.18
212	000997	新大陆	55,900	777,569.00	0.18
213	600170	上海建工	360,400	774,860.00	0.18
214	600582	天地科技	111,800	770,302.00	0.18
215	600499	科达制造	90,802	765,460.86	0.18
216	600498	烽火通信	48,000	763,200.00	0.18
217	600535	天士力	60,500	761,090.00	0.18
218	601933	永辉超市	306,700	760,616.00	0.18
219	600129	太极集团	26,300	760,596.00	0.18
220	000598	兴蓉环境	100,900	758,768.00	0.18
221	002120	韵达股份	98,000	758,520.00	0.18
222	600004	白云机场	79,900	757,452.00	0.18
223	601991	大唐发电	251,400	756,714.00	0.18
224	000750	国海证券	259,000	753,690.00	0.18
225	600580	卧龙电驱	62,000	753,300.00	0.18
226	000060	中金岭南	176,800	749,632.00	0.18
227	002261	拓维信息	67,700	749,439.00	0.18
228	603000	人民网	37,400	747,626.00	0.18
229	300568	星源材质	90,900	745,380.00	0.17
230	300118	东方日升	61,600	745,360.00	0.17
231	002430	杭氧股份	33,300	740,925.00	0.17
232	300567	精测电子	13,100	740,281.00	0.17
233	002429	兆驰股份	153,100	736,411.00	0.17
234	603486	科沃斯	15,500	731,290.00	0.17
235	600166	福田汽车	324,600	730,350.00	0.17
236	002939	长城证券	109,000	730,300.00	0.17
237	603156	养元饮品	34,300	729,561.00	0.17
238	603658	安图生物	15,800	727,906.00	0.17
239	603228	景旺电子	22,820	725,676.00	0.17
240	600325	华发股份	111,500	724,750.00	0.17
241	600816	建元信托	266,100	721,131.00	0.17
242	601231	环旭电子	44,700	717,435.00	0.17
243	600673	东阳光	101,900	717,376.00	0.17
244	300487	蓝晓科技	17,100	714,096.00	0.17
245	603568	伟明环保	34,626	712,603.08	0.17
246	300765	新诺威	28,240	712,495.20	0.17
247	603927	中科软	39,356	711,950.04	0.17
248	000893	亚钾国际	43,900	709,424.00	0.17

249	600754	锦江酒店	30,800	707,784.00	0.17
250	002508	老板电器	32,000	707,200.00	0.17
251	300601	康泰生物	45,200	705,572.00	0.17
252	000027	深圳能源	96,380	703,574.00	0.17
253	002926	华西证券	106,500	701,835.00	0.16
254	601636	旗滨集团	108,700	701,115.00	0.16
255	000998	隆平高科	71,300	700,879.00	0.16
256	688052	纳芯微	6,794	698,287.32	0.16
257	002624	完美世界	91,700	696,920.00	0.16
258	002653	海思科	22,700	696,890.00	0.16
259	603298	杭叉集团	35,400	695,256.00	0.16
260	600737	中粮糖业	72,400	694,316.00	0.16
261	002497	雅化集团	77,800	693,976.00	0.16
262	603290	斯达半导	8,040	692,324.40	0.16
263	601866	中远海发	267,700	690,666.00	0.16
264	300604	长川科技	25,400	690,118.00	0.16
265	300253	卫宁健康	116,900	689,710.00	0.16
266	603077	和邦生物	417,900	689,535.00	0.16
267	002299	圣农发展	50,500	688,820.00	0.16
268	002056	横店东磁	55,100	687,097.00	0.16
269	600131	国网信通	40,700	686,609.00	0.16
270	002065	东华软件	151,700	685,684.00	0.16
271	600563	法拉电子	9,000	685,620.00	0.16
272	002500	山西证券	145,620	684,414.00	0.16
273	300390	天华新能	39,750	682,905.00	0.16
274	601958	金铂股份	65,500	681,855.00	0.16
275	002414	高德红外	115,500	680,295.00	0.16
276	688772	珠海冠宇	45,600	679,440.00	0.16
277	688002	睿创微纳	24,283	679,195.51	0.16
278	600655	豫园股份	131,700	678,255.00	0.16
279	600373	中文传媒	45,700	678,188.00	0.16
280	688385	复旦微电	21,600	677,808.00	0.16
281	300009	安科生物	79,192	676,299.68	0.16
282	300763	锦浪科技	16,200	674,568.00	0.16
283	002507	涪陵榨菜	54,640	669,340.00	0.16
284	002372	伟星新材	43,100	664,602.00	0.16
285	603893	瑞芯微	11,200	662,704.00	0.16
286	002368	太极股份	29,379	662,496.45	0.16
287	600707	彩虹股份	97,000	660,570.00	0.16
288	601611	中国核建	81,600	660,144.00	0.15
289	688114	华大智造	13,883	658,193.03	0.15
290	603885	吉祥航空	59,800	657,202.00	0.15
291	000887	中鼎股份	53,500	654,840.00	0.15

292	603379	三美股份	16,540	647,375.60	0.15
293	002203	海亮股份	81,000	646,380.00	0.15
294	603225	新凤鸣	41,300	643,867.00	0.15
295	002831	裕同科技	25,100	642,309.00	0.15
296	600755	厦门国贸	89,500	641,715.00	0.15
297	688390	固德威	11,372	638,196.64	0.15
298	600859	王府井	53,800	631,612.00	0.15
299	688521	芯原股份	23,590	631,032.50	0.15
300	601880	辽港股份	509,100	626,193.00	0.15
301	600995	南网储能	64,800	625,968.00	0.15
302	600329	达仁堂	19,300	625,127.00	0.15
303	600801	华新水泥	45,400	624,250.00	0.15
304	600416	湘电股份	62,600	622,244.00	0.15
305	600884	杉杉股份	76,200	618,744.00	0.15
306	002683	广东宏大	30,700	617,991.00	0.15
307	600390	五矿资本	152,100	616,005.00	0.14
308	300070	碧水源	146,961	615,766.59	0.14
309	002019	亿帆医药	49,800	615,528.00	0.14
310	300296	利亚德	136,723	615,253.50	0.14
311	002506	协鑫集成	316,400	613,816.00	0.14
312	600435	北方导航	71,100	612,882.00	0.14
313	002244	滨江集团	84,200	611,292.00	0.14
314	600739	辽宁成大	72,500	606,825.00	0.14
315	600483	福能股份	52,000	606,320.00	0.14
316	000050	深天马 A	83,100	604,968.00	0.14
317	601098	中南传媒	48,500	602,370.00	0.14
318	300748	金力永磁	46,380	601,084.80	0.14
319	300803	指南针	16,500	600,765.00	0.14
320	600399	抚顺特钢	106,700	600,721.00	0.14
321	601598	中国外运	106,700	600,721.00	0.14
322	600598	北大荒	48,000	599,520.00	0.14
323	002572	索菲亚	39,100	599,403.00	0.14
324	002568	百润股份	35,500	597,465.00	0.14
325	600901	江苏金租	118,060	596,203.00	0.14
326	000155	川能动力	55,100	593,427.00	0.14
327	300676	华大基因	16,900	591,669.00	0.14
328	002487	大金重工	25,800	590,304.00	0.14
329	600848	上海临港	64,700	589,417.00	0.14
330	001286	陕西能源	50,700	584,571.00	0.14
331	002080	中材科技	45,300	584,370.00	0.14
332	002240	盛新锂能	43,500	583,770.00	0.14
333	002373	千方科技	64,100	581,387.00	0.14
334	002557	洽洽食品	20,600	580,714.00	0.14

335	002936	郑州银行	334,647	578,939.31	0.14
336	300595	欧普康视	36,500	572,320.00	0.13
337	000563	陕国投 A	207,500	570,625.00	0.13
338	002268	电科网安	40,100	570,623.00	0.13
339	603858	步长制药	37,500	568,125.00	0.13
340	603712	七一二	31,209	567,691.71	0.13
341	601928	凤凰传媒	51,700	566,632.00	0.13
342	600968	海油发展	137,500	566,500.00	0.13
343	603883	老百姓	30,761	564,771.96	0.13
344	000778	新兴铸管	161,800	563,064.00	0.13
345	688301	奕瑞科技	4,874	561,631.02	0.13
346	688017	绿的谐波	6,809	559,018.90	0.13
347	600258	首旅酒店	45,211	558,355.85	0.13
348	601212	白银有色	200,200	556,556.00	0.13
349	688538	和辉光电-U	281,000	556,380.00	0.13
350	300558	贝达药业	17,000	553,350.00	0.13
351	600271	航天信息	75,000	552,000.00	0.13
352	600528	中铁工业	75,000	549,000.00	0.13
353	600062	华润双鹤	28,000	548,240.00	0.13
354	600977	中国电影	50,500	543,380.00	0.13
355	000709	河钢股份	279,500	542,230.00	0.13
356	603688	石英股份	18,300	541,863.00	0.13
357	002531	天顺风能	60,600	541,764.00	0.13
358	601155	新城控股	61,000	541,070.00	0.13
359	002408	齐翔腾达	96,000	537,600.00	0.13
360	000739	普洛药业	39,600	537,372.00	0.13
361	600959	江苏有线	202,900	535,656.00	0.13
362	600378	昊华科技	18,500	534,650.00	0.13
363	603444	吉比特	3,000	534,030.00	0.13
364	688536	思瑞浦	5,449	532,966.69	0.13
365	688234	天岳先进	11,324	531,322.08	0.12
366	688005	容百科技	22,800	530,784.00	0.12
367	601118	海南橡胶	115,700	526,435.00	0.12
368	688220	翱捷科技-U	14,001	524,477.46	0.12
369	000825	太钢不锈	154,700	522,886.00	0.12
370	603882	金域医学	19,100	519,329.00	0.12
371	688200	华峰测控	5,620	515,635.00	0.12
372	603737	三棵树	14,180	514,308.60	0.12
373	688331	荣昌生物	11,860	512,352.00	0.12
374	600056	中国医药	50,600	512,072.00	0.12
375	000987	越秀资本	101,775	504,804.00	0.12
376	601399	国机重装	195,000	503,100.00	0.12
377	600906	财达证券	87,800	503,094.00	0.12

378	600517	国网英大	116,000	502,280.00	0.12
379	603456	九洲药业	36,500	500,780.00	0.12
380	601019	山东出版	42,200	498,804.00	0.12
381	600612	老凤祥	8,500	494,615.00	0.12
382	300212	易华录	29,300	493,119.00	0.12
383	002266	浙富控股	176,400	492,156.00	0.12
384	600316	洪都航空	29,000	482,270.00	0.11
385	600871	石化油服	275,200	478,848.00	0.11
386	603650	彤程新材	16,200	478,710.00	0.11
387	603529	爱玛科技	17,500	478,275.00	0.11
388	000937	冀中能源	71,300	477,710.00	0.11
389	688567	孚能科技	49,700	477,120.00	0.11
390	600925	苏能股份	93,000	469,650.00	0.11
391	002423	中粮资本	62,200	465,878.00	0.11
392	688063	派能科技	11,616	461,271.36	0.11
393	000032	深桑达 A	30,700	459,886.00	0.11
394	601965	中国汽研	27,000	456,030.00	0.11
395	001227	兰州银行	191,200	455,056.00	0.11
396	600098	广州发展	71,100	455,040.00	0.11
397	603728	鸣志电器	11,300	454,599.00	0.11
398	600208	新湖中宝	287,600	454,408.00	0.11
399	601298	青岛港	47,300	452,188.00	0.11
400	601608	中信重工	117,400	447,294.00	0.11
401	002607	中公教育	291,800	446,454.00	0.10
402	688297	中无人机	13,505	446,070.15	0.10
403	002670	国盛金控	52,400	443,828.00	0.10
404	600663	陆家嘴	50,200	442,764.00	0.10
405	688516	奥特维	10,559	441,471.79	0.10
406	600022	山东钢铁	361,600	441,152.00	0.10
407	600578	京能电力	135,700	439,668.00	0.10
408	603233	大参林	30,692	438,895.60	0.10
409	300438	鹏辉能源	23,900	438,326.00	0.10
410	688561	奇安信-U	18,400	434,608.00	0.10
411	300357	我武生物	21,284	430,362.48	0.10
412	601106	中国一重	185,500	428,505.00	0.10
413	600500	中化国际	121,400	423,686.00	0.10
414	600377	宁沪高速	33,600	423,360.00	0.10
415	003031	中瓷电子	9,060	418,934.40	0.10
416	300776	帝尔激光	9,100	418,236.00	0.10
417	600967	内蒙一机	57,600	414,720.00	0.10
418	000785	居然之家	170,100	413,343.00	0.10
419	002865	钧达股份	10,700	410,666.00	0.10
420	600315	上海家化	22,900	407,162.00	0.10

421	600350	山东高速	45,700	404,445.00	0.09
422	300888	稳健医疗	15,980	404,294.00	0.09
423	688349	三一重能	16,200	402,408.00	0.09
424	600827	百联股份	54,300	400,734.00	0.09
425	000958	电投产融	109,100	399,306.00	0.09
426	000559	万向钱潮	89,400	398,724.00	0.09
427	601568	北元集团	107,440	398,602.40	0.09
428	000537	中绿电	41,800	398,354.00	0.09
429	688425	铁建重工	108,100	397,808.00	0.09
430	002608	江苏国信	51,100	396,025.00	0.09
431	002690	美亚光电	23,960	395,340.00	0.09
432	688029	南微医学	6,415	394,907.40	0.09
433	688032	禾迈股份	3,421	392,662.38	0.09
434	000156	华数传媒	62,500	392,500.00	0.09
435	603707	健友股份	32,817	389,865.96	0.09
436	002867	周大生	29,600	386,576.00	0.09
437	601992	金隅集团	281,900	386,203.00	0.09
438	603517	绝味食品	25,000	385,000.00	0.09
439	603826	坤彩科技	13,160	381,245.20	0.09
440	600126	杭钢股份	91,300	375,243.00	0.09
441	300682	朗新集团	43,900	373,589.00	0.09
442	003022	联泓新科	27,000	370,170.00	0.09
443	000967	盈峰环境	85,700	362,511.00	0.09
444	603218	日月股份	34,900	358,423.00	0.08
445	688475	萤石网络	10,408	355,016.88	0.08
446	600032	浙江新能	48,700	354,536.00	0.08
447	600361	创新新材	87,900	354,237.00	0.08
448	600481	双良节能	75,800	353,986.00	0.08
449	600339	中油工程	113,200	353,184.00	0.08
450	603786	科博达	5,500	352,825.00	0.08
451	301267	华夏眼科	17,000	352,240.00	0.08
452	688778	厦钨新能	11,200	349,888.00	0.08
453	688520	神州细胞-U	8,800	346,280.00	0.08
454	600095	湘财股份	58,100	346,276.00	0.08
455	000898	鞍钢股份	160,700	340,684.00	0.08
456	603127	昭衍新药	25,520	338,650.40	0.08
457	688281	华秦科技	4,064	338,612.48	0.08
458	003035	南网能源	76,800	337,920.00	0.08
459	688248	南网科技	11,300	334,819.00	0.08
460	600808	马钢股份	162,600	328,452.00	0.08
461	002563	森马服饰	54,700	317,807.00	0.07
462	002153	石基信息	55,442	317,682.66	0.07
463	603185	弘元绿能	18,423	314,849.07	0.07

464	601228	广州港	102,100	311,405.00	0.07
465	000539	粤电力 A	60,100	305,308.00	0.07
466	688779	长远锂科	65,300	302,339.00	0.07
467	001872	招商港口	15,600	300,300.00	0.07
468	600928	西安银行	90,200	294,954.00	0.07
469	001203	大中矿业	30,500	293,105.00	0.07
470	000401	冀东水泥	71,900	291,914.00	0.07
471	000959	首钢股份	105,500	286,960.00	0.07
472	688006	杭可科技	16,240	283,388.00	0.07
473	600764	中国海防	14,400	282,672.00	0.07
474	002518	科士达	15,800	279,660.00	0.07
475	603056	德邦股份	20,905	273,855.50	0.06
476	603305	旭升集团	25,100	265,056.00	0.06
477	600299	安迪苏	27,100	262,870.00	0.06
478	601139	深圳燃气	39,000	260,520.00	0.06
479	688172	燕东微	16,100	260,498.00	0.06
480	300861	美畅股份	12,900	249,615.00	0.06
481	603317	天味食品	21,631	246,809.71	0.06
482	688375	国博电子	3,300	233,112.00	0.05
483	688276	百克生物	8,200	232,634.00	0.05
484	688387	信科移动-U	46,100	232,344.00	0.05
485	301029	怡合达	11,620	228,449.20	0.05
486	002791	坚朗五金	8,600	222,482.00	0.05
487	600927	永安期货	19,700	219,655.00	0.05
488	688819	天能股份	9,029	215,431.94	0.05
489	688153	唯捷创芯	5,742	212,454.00	0.05
490	688107	安路科技	8,182	207,986.44	0.05
491	601858	中国科传	10,700	204,584.00	0.05
492	000031	大悦城	87,000	203,580.00	0.05
493	601158	重庆水务	39,000	187,200.00	0.04
494	601828	美凯龙	73,400	187,170.00	0.04
495	002945	华林证券	18,300	182,634.00	0.04
496	688348	昱能科技	3,081	181,779.00	0.04
497	600956	新天绿能	20,900	170,753.00	0.04
498	301165	锐捷网络	4,600	137,264.00	0.03
499	688295	中复神鹰	6,700	136,010.00	0.03
500	603868	飞科电器	3,300	126,720.00	0.03

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.01
2	688692	达梦数据	137	23,965.41	0.01

3	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.01
4	601033	永兴股份	1,258	20,077.68	0.00
5	688709	成都华微	899	16,892.21	0.00
6	301536	星辰科技	481	15,521.87	0.00
7	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00
8	688584	上海合晶	839	13,331.71	0.00
9	301580	爱迪特	202	13,317.86	0.00
10	603341	龙旗科技	298	11,172.02	0.00
11	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
12	301565	中仑新材	544	10,325.12	0.00
13	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
14	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
15	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
16	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
17	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
18	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
19	301578	辰奕智能	153	6,054.21	0.00
20	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
21	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
22	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
23	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
24	603325	博隆技术	66	4,491.96	0.00
25	603344	星德胜	182	4,124.12	0.00
26	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
27	603381	永臻股份	150	3,769.50	0.00
28	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
29	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
30	001379	腾达科技	213	2,871.24	0.00
31	603375	盛景微	72	2,800.80	0.00
32	001387	雪祺电气	173	2,638.25	0.00
33	400174	中天 3	286,500	0.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	688777	中控技术	1,902,785.66	0.14
2	002850	科达利	1,661,331.00	0.12
3	601567	三星医疗	1,647,098.00	0.12
4	600563	法拉电子	1,604,102.00	0.12
5	688617	惠泰医疗	1,402,011.87	0.10
6	002202	金风科技	1,382,429.00	0.10
7	603979	金诚信	1,305,620.00	0.10

8	601615	明阳智能	1,285,985.00	0.09
9	002436	兴森科技	1,259,911.00	0.09
10	301358	湖南裕能	1,250,003.00	0.09
11	300002	神州泰岳	1,234,235.00	0.09
12	000921	海信家电	1,204,679.04	0.09
13	300054	鼎龙股份	1,183,185.00	0.09
14	600872	中炬高新	1,141,138.00	0.08
15	603345	安井食品	1,122,754.00	0.08
16	002865	钧达股份	1,110,503.00	0.08
17	002984	森麒麟	1,049,129.00	0.08
18	002028	思源电气	1,044,652.00	0.08
19	603179	新泉股份	999,275.00	0.07
20	688525	佰维存储	974,954.83	0.07

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

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600160	巨化股份	6,161,247.00	0.45
2	600161	天坛生物	5,269,129.80	0.39
3	601058	赛轮轮胎	5,129,386.00	0.38
4	601168	西部矿业	5,067,724.00	0.37
5	600415	小商品城	4,643,362.00	0.34
6	600157	永泰能源	4,455,717.00	0.33
7	600482	中国动力	4,383,558.00	0.32
8	601555	东吴证券	4,028,277.00	0.30
9	601077	渝农商行	3,997,241.00	0.29
10	600079	人福医药	3,991,037.00	0.29
11	600988	赤峰黄金	3,929,071.00	0.29
12	688072	拓荆科技	3,928,289.66	0.29
13	600418	江淮汽车	3,788,790.00	0.28
14	600066	宇通客车	3,690,807.00	0.27
15	601233	桐昆股份	3,610,775.00	0.27
16	601108	财通证券	3,555,327.00	0.26
17	002463	沪电股份	3,507,213.50	0.26
18	600109	国金证券	3,419,294.00	0.25
19	600352	浙江龙盛	3,382,956.00	0.25
20	600096	云天化	3,352,995.00	0.25

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	120,273,543.79
--------------	----------------

卖出股票收入（成交）总额	539,207,886.53
--------------	----------------

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：无。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：无。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

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

思源电气股份有限公司在报告编制日前一年内受到中华人民共和国洋山港海事局的处罚。

以上证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券备选库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,607,775.30
2	应收清算款	3,251.33
3	应收股利	28,262.03
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	6,675.23
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,645,963.89

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	601058	赛轮轮胎	378,000.00	0.09	转融通流通受限
2	600066	宇通客车	180,600.00	0.04	转融通流通受限

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	603285	键邦股份	21,596.70	0.01	新股未上市
1	603285	键邦股份	2,405.85	0.00	新股流通受限
2	688692	达梦数据	23,965.41	0.01	新股流通受限
3	603350	安乃达	19,429.20	0.00	新股未上市
3	603350	安乃达	2,179.36	0.00	新股流通受限
4	601033	永兴股份	20,077.68	0.00	新股流通受限
5	688709	成都华微	16,892.21	0.00	新股流通受限

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

8.1.1 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 (%)
9,116	37,978.42	176,411,184.00	50.95	169,800,069.00	49.05

8.1.2 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	152,952,037.00	44.18

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	胡小彩	5,500,000.00	1.59
2	招商证券股份有限公司	4,140,491.00	1.20
3	上海柏泰华盈私募基金管理有限公司-柏泰华盈常青藤套利 2 号私募证券投资基金	3,723,900.00	1.08
4	方正证券股份有限公司	2,802,923.00	0.81
5	中国银河证券股份有限公司	2,355,100.00	0.68
6	魏丽君	2,105,200.00	0.61
7	中信建投证券股份有限公司	2,093,008.00	0.60
8	长城基金-兴业银行-长城基金泓湖百世自动驾驶 1 号集合资产管理计划	2,033,300.00	0.59
9	王雪有	2,000,000.00	0.58
10	于明中	1,986,700.00	0.57
-	中国工商银行股份有限公司-鹏华中证 500 交易型开放式指	152,952,037.00	44.18

	数证券投资基金联接基金		
--	-------------	--	--

注：持有人为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：截至本报告期末，本基金管理人所有从业人员未持有本基金份额。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(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	1,020,211,253.00
本报告期基金总申购份额	40,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	714,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	346,211,253.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人的重大人事变动：

本报告期内，公司原副总经理王宗合先生辞去本公司副总经理职务，经公司第六届董事会第二百零四次会议审议通过，董事会同意王宗合先生不再担任公司副总经理，离任日期为 2024 年 2 月 6 日。

本报告期内，公司原副总经理邢彪先生辞去本公司副总经理职务，经公司第六届董事会第二百一十七次会议审议通过，董事会同意邢彪先生不再担任公司副总经理，离任日期为 2024 年 4 月 11 日。

本报告期内，公司原董事长何如先生不再担任公司董事长。经公司 2024 年第三次临时股东大会和第六届董事会第二百一十八次会议审议通过，股东会同意聘任张纳沙女士担任公司董事，董事会选举张纳沙女士担任公司董事长，任职日期自 2024 年 4 月 12 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。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

10.4 基金投资策略的改变

无。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未改聘为本基金审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人及相关责任人员
受到稽查或处罚等措施的时间	2024 年 4 月 19 日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会深圳监管局
受到的具体措施类型	责令改正及警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	个别规定未严格执行，个别业务内控管理不完善
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	管理人高度重视，按照法律法规及相关要求积极落实整改工作。截至报告日，上述事项已整改完毕
其他	-

注：无。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
国信证券	2	467,684,477.40	71.11	428,263.39	71.76	-
中金公司	1	91,310,522.	13.88	84,092.75	14.09	-

		42				
申万宏源 证券	2	49,459,680. 37	7.52	40,498.44	6.79	-
中泰证券	1	22,678,461. 83	3.45	21,226.02	3.56	-
国元证券	1	13,034,786. 01	1.98	10,895.94	1.83	-
华西证券	1	6,808,042.2 1	1.04	5,690.80	0.95	-
平安证券	1	3,960,495.4 9	0.60	3,648.93	0.61	-
招商证券	1	1,424,972.5 2	0.22	1,312.87	0.22	-
国泰君安	1	935,092.18	0.14	861.59	0.14	-
国盛证券	1	393,490.60	0.06	328.86	0.06	-
西南证券	1	17,239.04	0.00	16.14	0.00	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	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；
- (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；
- (4) 合规风控能力较强，内部管理规范、严格，具备健全的内控制度；
- (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

的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；

- (6) 交易、研究服务能力较强。

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。我公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、合规风控能力和交易、研究水平等后，向券商租用交易单元作为基金交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
国信证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	15,000,000.00	100.00	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购博隆技术首次公开发行 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	2024 年 01 月 04 日
2	鹏华基金管理有限公司关于指定部分证券投资基金主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	2024 年 01 月 05 日
3	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	2024 年 01 月 18 日
4	鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2023 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	2024 年 01 月 19 日
5	鹏华基金管理有限公司关于暂停北京中期时代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	2024 年 02 月 02 日
6	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	2024 年 02 月 08 日
7	鹏华基金管理有限公司关于终止与北京中期时代基金销售有限公司销售合作关系的公告	《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	2024 年 03 月 04 日
8	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华创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	2024 年 03 月 13 日
9	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金增加信达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	2024 年 03 月 18 日
10	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金新增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	2024 年 03 月 18 日
11	鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2023 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	2024 年 03 月 28 日
12	鹏华基金管理有限公司关于鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金持有的“中天 3”估值方法变更的提示性公告	《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	2024 年 04 月 01 日
13	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	2024 年 04 月 13 日
14	鹏华基金管理有限公司关于董事长变更的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会	2024 年 04 月 13 日

		会基金电子披露网站	
15	鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2024 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	2024 年 04 月 19 日
16	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金增加民生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	2024 年 04 月 24 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	2024 年 05 月 10 日
18	鹏华基金管理有限公司关于调整个人投资者开立基金账户证件类型类型的公告	《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	2024 年 05 月 16 日
19	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金增加爱建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	2024 年 06 月 14 日
20	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金新增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	2024 年 06 月 28 日
21	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	2024 年 06 月 28 日
22	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金增加东方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	2024 年 06 月 28 日

注：无。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20240101~20240630	832,254,037.00	7,500,000.00	686,802,000.00	152,952,037.00	44.18
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

份额；

2、赎回份额包含基金赎回份额、基金转换出份额、强制调减份额、场内卖出份额。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一)《鹏华中证 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 2024 年中期报告》(原文)。

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

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

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

鹏华基金管理有限公司

2024 年 8 月 29 日