

# 鹏华中证 500 指数证券投资基金（LOF）

## 2025 年中期报告

2025 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：2025 年 8 月 28 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 2025 年 08 月 27 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 2025 年 01 月 01 日起至 2025 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	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	8
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	9
3.3 其他指标	11
<b>§ 4 管理人报告</b>	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
<b>§ 5 托管人报告</b>	16
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	16
<b>§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)</b>	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	18
6.3 净资产变动表	19
6.4 报表附注	21
<b>§ 7 投资组合报告</b>	47
7.1 期末基金资产组合情况	47
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	62
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	63
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	63
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	63

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 .....	64
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 .....	64
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	64
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	64
7.12 投资组合报告附注 .....	64
<b>§ 8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>65</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	65
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	65
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	66
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 .....	66
<b>§ 9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>66</b>
<b>§ 10 重大事件揭示</b> .....	<b>67</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	67
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 .....	67
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	67
10.4 基金投资策略的改变 .....	67
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	67
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 .....	67
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	67
10.8 其他重大事件 .....	69
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>70</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况 .....	70
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	70
<b>§ 12 备查文件目录</b> .....	<b>70</b>
12.1 备查文件目录 .....	70
12.2 存放地点 .....	71
12.3 查阅方式 .....	71

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF)		
基金简称	鹏华中证 500 指数 (LOF)		
场内简称	鹏华 500LOF		
基金主代码	160616		
基金运作方式	上市契约型开放式 (LOF)		
基金合同生效日	2010 年 2 月 5 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	197,201,543.85 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	2010 年 4 月 28 日		
下属分级基金的基金简称	鹏华中证 500 指数 (LOF) A	鹏华中证 500 指数 (LOF) C	鹏华中证 500 指数 (LOF) I
下属分级基金的场内简称	鹏华 500LOF	-	-
下属分级基金的交易代码	160616	006938	022992
报告期末下属分级基金的份额总额	181,976,143.28 份	14,958,877.91 份	266,522.66 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	采用指数化投资方式，追求基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间的跟踪误差最小化，力争将日均跟踪偏离度控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内，以实现对中证 500 指数的有效跟踪。
投资策略	<p>本基金采用完全复制法，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 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 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>当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制</p>

<p>机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。</p>
<p><b>1、股票投资策略</b></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) 定期调整</p>
<p>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</p>
<p>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；</p>
<p>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><b>2、存托凭证投资策略</b></p>
<p>本基金在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素的基础上，根据审慎原则合理参与存托凭证的投资，以更好地跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。</p>
<p><b>3、债券投资策略</b></p>
<p>本基金债券投资将采取久期策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、个券选择策略、信用策略等积极投资策略，自上而下地管理组合的久期，灵活地调整组合的券种搭配，同时精选个券，以增强组合的持有期收益。</p>
<p><b>4、股指期货投资策略</b></p>
<p>本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目标，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，充分考虑股指期货的风险收益特征，通过多头或空头的套期保值策略，以改善投资组合的投资效果。</p>

	<p>5、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>6、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。 未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，在不改变投资目标的前提下，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。</p>
业绩比较基准	中证 500 指数收益率 $\times$ 95% + 银行同业存款利率 $\times$ 5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。本基金为指数型基金，具有与标的指数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	<a href="http://www.phfund.com.cn">http://www.phfund.com.cn</a>
基金中期报告备置地点	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层鹏华基金管理有限公司

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号
注册登记机构 [鹏华中证 500 指数(LOF) I]	鹏华基金管理有限公司	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层

## § 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(2025 年 1 月 1 日-2025 年 6 月 30 日)		
	鹏华中证 500 指数 (LOF) A	鹏华中证 500 指数 (LOF) C	鹏华中证 500 指数 (LOF) I
本期已实现 收益	2,296,484.39	190,750.04	1,295.56
本期利润	15,434,818.66	1,669,837.33	1,887.18
加权平均基 金份额本期 利润	0.0814	0.0937	0.0110
本期加权平 均净值利润 率	4.89%	5.39%	1.12%
本期基金份 额净值增长 率	4.76%	4.66%	4.72%
3.1.2 期 末数据和 指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)		
期末可供分 配利润	132,190,569.66	9,442,920.97	1,873.06
期末可供分 配基金份额 利润	0.7264	0.6313	0.0070

期末基金资产净值	314,166,712.94	26,972,380.44	271,384.95
期末基金份额净值	1.7264	1.8031	1.0182
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)		
基金份额累计净值增长率	72.64%	80.31%	1.82%

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

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

鹏华中证 500 指数 (LOF) A

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	4.90%	0.73%	4.09%	0.75%	0.81%	-0.02%
过去三个月	2.12%	1.42%	0.97%	1.43%	1.15%	-0.01%
过去六个月	4.76%	1.28%	3.21%	1.29%	1.55%	-0.01%
过去一年	21.99%	1.62%	18.83%	1.64%	3.16%	-0.02%
过去三年	-1.57%	1.27%	-7.61%	1.29%	6.04%	-0.02%
自基金合同生效起至今	72.64%	1.53%	35.86%	1.50%	36.78%	0.03%

鹏华中证 500 指数 (LOF) C

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	4.88%	0.73%	4.09%	0.75%	0.79%	-0.02%
过去三个月	2.08%	1.42%	0.97%	1.43%	1.11%	-0.01%
过去六个月	4.66%	1.28%	3.21%	1.29%	1.45%	-0.01%
过去一年	21.76%	1.62%	18.83%	1.64%	2.93%	-0.02%
过去三年	-2.16%	1.27%	-7.61%	1.29%	5.45%	-0.02%
自基金合同生效起至今	80.31%	1.31%	34.37%	1.32%	45.94%	-0.01%

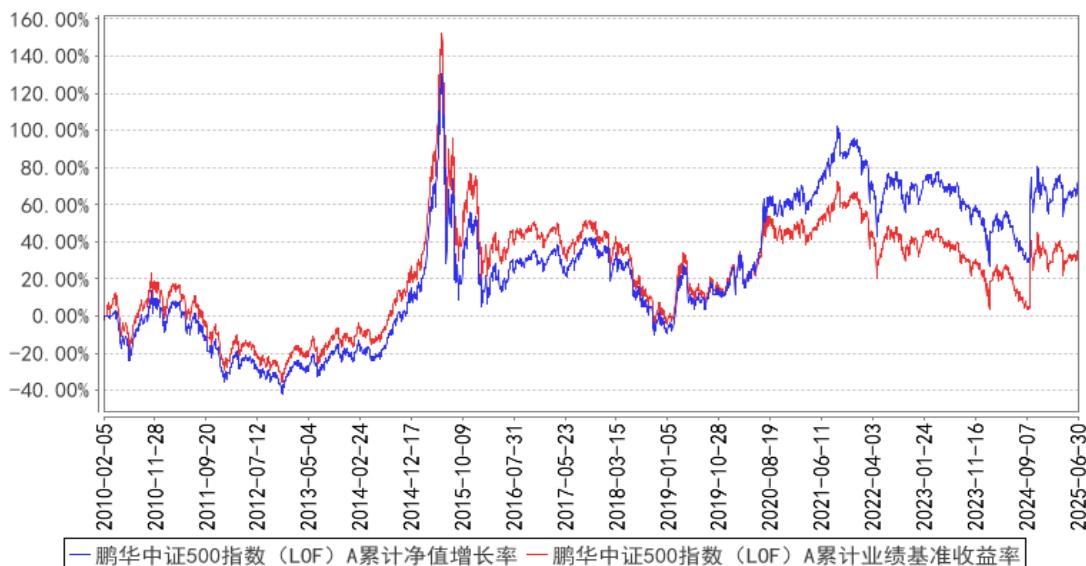
鹏华中证500指数(LOF)I

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	4.88%	0.73%	4.09%	0.75%	0.79%	-0.02%
过去三个月	2.10%	1.42%	0.97%	1.43%	1.13%	-0.01%
过去六个月	4.72%	1.28%	3.21%	1.29%	1.51%	-0.01%
自基金合同生效起至今	1.82%	1.28%	0.50%	1.28%	1.32%	0.00%

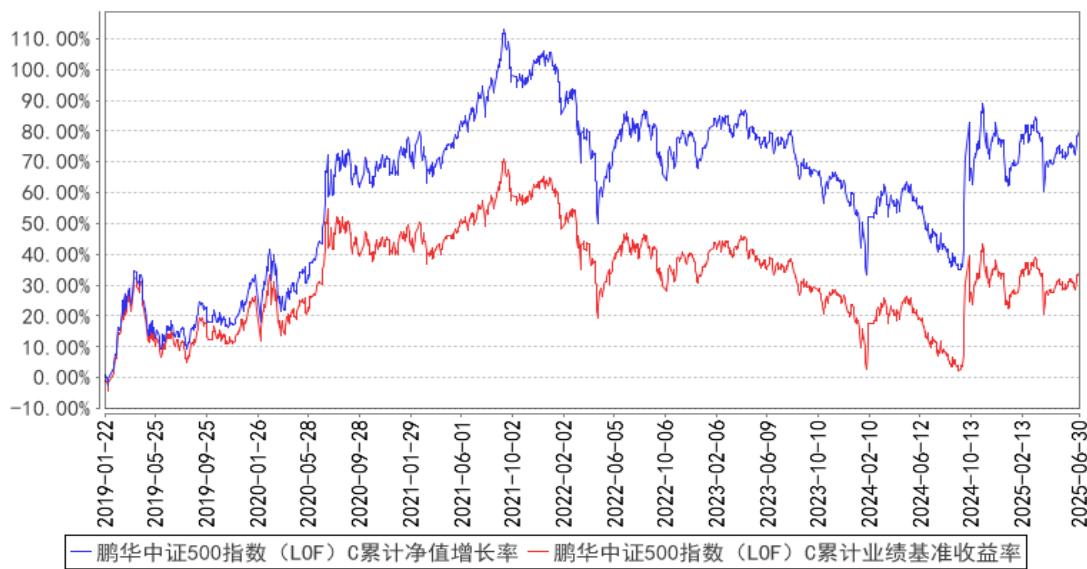
注：业绩比较基准=中证500指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%。

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

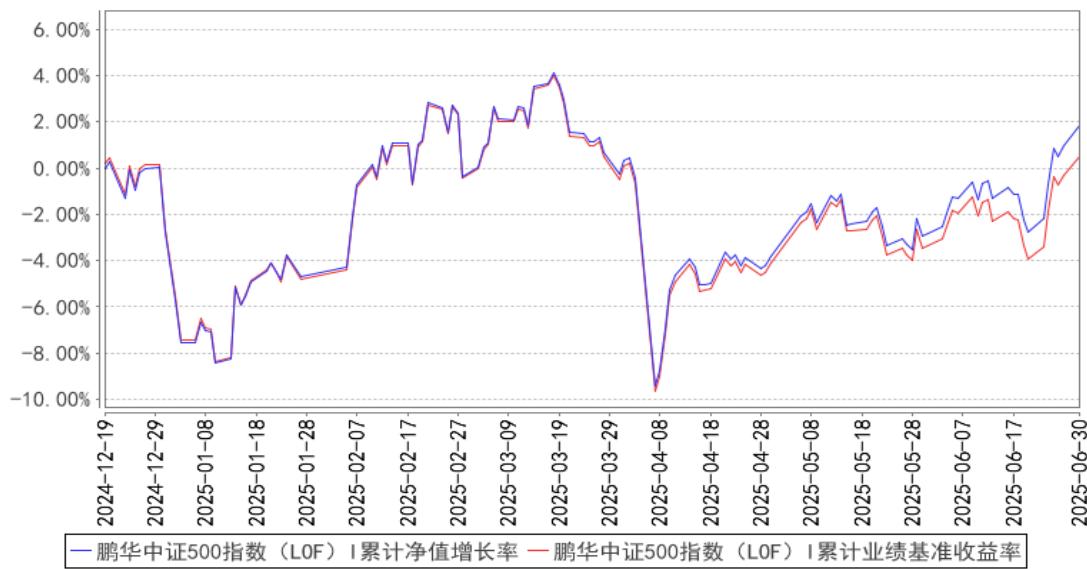
鹏华中证500指数(LOF)A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



鹏华中证500指数(LOF)C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势  
对比图



鹏华中证500指数(LOF)I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2010年02月05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 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 12,513 亿元，359 只公募基金、12 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		
余展昌	本基金的 基金经理	2023-08- 24	-	8 年	余展昌先生，国籍中国，金融硕士，8 年证券从业经验。2017 年 7 月加盟鹏华基金管理有限公司，历任量化及衍生品投资部量化研究员、高级量化研究员，2020 年 8 月至 2022 年 10 月担任量化及衍生品投资部投资经理，现担任指数与量化投资部基金经理。2022 年 10 月至今担任鹏华国证证券龙头交易型开放式指数证券投资基金管理人，2022 年 10 月至今担任鹏华中证 800 证券保险交易型开放式指数证券投资基金管理人，2022 年 10 月至今担任鹏华中证 800 证券保险指数型证券投资基金（LOF）基金经理，2022 年 10 月至今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，2022 年 10 月至今担任鹏华中证银行交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2022 年 10 月至今担任鹏华中证银行指数型证券投资基金（LOF）基金经理，2023 年 08 月至今担任鹏华创业板指数型证券投资基金（LOF）基金经理，2023 年 08 月至今担任鹏华中证 500 指数证券投资基金（LOF）基金经理，2024 年 04 月至今担任鹏华恒生中国央企交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理，2024 年 11 月至今担任鹏华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2024 年 12 月至今担任鹏华上证 180 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2024 年 12 月至今担任鹏华中证 A500 指数证券投资基金基金经理，2025 年 01 月至今担任鹏华上证 180 指数发起式证券投资基金基金经理，2025 年 01 月至今担任鹏华恒

					生港股通高股息率指数发起式证券投资基金基金经理, 2025 年 02 月至今担任鹏华上证科创板 200 交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2025 年 03 月至今担任鹏华恒生中国央企交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理, 2025 年 05 月至今担任鹏华上证科创板 200 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理, 余展昌先生具备基金从业资格。
--	--	--	--	--	---

注: 1. 基金经理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: 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遵规守信情况的说明

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

作为宽基指数基金, 本基金旨在为看好该宽基的投资者提供投资工具。报告期内, 本基金秉承指数基金的投资策略, 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。跟踪误

差的主要来源主要分为几个方面，包括成分股的调整、日常申赎的交易影响、股票的分红、风险股票的处置、股票的打新等。为了进一步控制跟踪误差，鹏华基金建立了一套完备的指数跟踪机制，事前对成分股的异动进行密切跟踪，及时调整，在交易环节采用算法交易等方式进一步减少交易冲击成本和摩擦，在仓位控制上，基金经理在紧密跟踪指数的基础上，也会针对客户申赎的情况做优化调整。

中证 500 指数的整体表现跑赢上证 50、沪深 300 等宽基指数。一季度的行情主要是春节前后 Deepseek 概念引起的 AI 投资热情，而中证 500 指数在 TMT 板块的占比更高，而且市值更小，成长性相比传统宽基更强，故指数表现相对占优。而二季度市场的上涨主要源于资金抱团银行等金融板块，带动了一波快速上涨行情，而中证 500 在金融板块的权重占比相比沪深 300 更低，故表现处于劣势。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期 A 类份额净值增长率为 4.76%，同期业绩比较基准增长率为 3.21%；C 类份额净值增长率为 4.66%，同期业绩比较基准增长率为 3.21%；I 类份额净值增长率为 4.72%，同期业绩比较基准增长率为 3.21%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从宏观经济情况看，2025 年一季度由于消费刺激政策的带动，加上房地产止跌企稳的系列政策托底，财政的前置，出口效应等多重因素叠加，GDP 增速高达 5.4%。二季度虽然受到中美贸易摩擦扰动，但由于中美贸易谈判进展较为顺利，叠加出口转口和抢出口效应，出口的回落并不明显。从最新的经济数据看，国内经济上半年主要来自财政的支持，包括消费的“以旧换新”政策和基建的托底，但往后看三季度由于抢出口效应减弱叠加贸易战的不确定性，国内经济仍有一定压力。从最新的披露的经济数据看，GDP 平减指数跌幅扩大说明内需仍然疲软，后续需要更大力度的消费刺激政策支持。

从证券市场角度看，2025 年市场整体处于复苏态势，尤其是 4 月 7 日市场大跌后，随着国内降准降息，以及贸易谈判取得一定进展，叠加二季度经济数据超预期，使得资本市场一路走高。展望后市，海外方面主要关注关税政策和降息，若美联储开始降息节奏，对资金回流中国市场以及人民币汇率稳定均有推动作用。若关税能取得更进一步进展，对国内风险偏好的修复也有促进作用。A 股市场三季度的走势更看自身的基本面，目前仍处于博弈政策预期的阶段，若有更大的财政刺激政策落地，或能推动资本市场进一步向上。

展望后市，作为宽基指数，中证 500 的行情表现取决于整体市场风险偏好的修复。

我们看到中证 500 作为大中盘指数，能很好地代表资本市场的整体表现。对于三季度而言，刺激

政策的预期、经济数据表现和外围的政治环境都是影响市场整体风险偏好的关键因素，总体来看，目前海外风险有所缓解，国内经济虽仍面临需求疲软问题以及后续的出口冲击，但政策预期仍在。后续若外围中美贸易谈判取得突破性进展或者国内经济出现超预期修复，都有望驱动宽基指数向上的行情。

#### 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，鹏华中证 500 指数 (LOF) A 期末可供分配利润为 132,190,569.66 元，期末基金份额净值 1.7264 元；鹏华中证 500 指数 (LOF) C 期末可供分配利润为 9,442,920.97 元，期末基金份额净值 1.8031 元；鹏华中证 500 指数 (LOF) I 期末可供分配利润为 1,873.06 元，期末基金份额净值 1.0182 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 2025 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 指数证券投资基金（LOF）

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	20,235,404.79	20,234,315.54
结算备付金		—	2,999.55
存出保证金		11,936.95	68,396.72
交易性金融资产	6.4.7.2	324,302,643.26	346,500,086.75
其中：股票投资		324,302,643.26	346,500,086.75
基金投资		—	—
债券投资		—	—
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
其他投资		—	—
衍生金融资产	6.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	—	—

债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		56,364.48	807,232.78
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		344,606,349.48	367,613,031.34
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2025 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2024 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		182.71	0.68
应付赎回款		2,850,692.46	620,367.53
应付管理人报酬		206,264.07	242,869.51
应付托管费		41,252.79	48,573.91
应付销售服务费		4,567.78	6,614.32
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	92,911.34	214,136.61
负债合计		3,195,871.15	1,132,562.56
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	197,201,543.85	221,452,440.93
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	144,208,934.48	145,028,027.85
净资产合计		341,410,478.33	366,480,468.78
负债和净资产总计		344,606,349.48	367,613,031.34

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额总额为 197,201,543.85 份，其中鹏华中证 500 指数 (LOF) A 基金份额总额为 181,976,143.28 份，基金份额净值 1.7264 元；鹏华中证 500 指数 (LOF) C 基金份额总额为 14,958,877.91 份，基金份额净值 1.8031 元；鹏华中证 500 指数 (LOF) I 基金份额总额为 266,522.66 份，基金份额净值 1.0182 元。

## 6.2 利润表

会计主体：鹏华中证 500 指数证券投资基金（LOF）

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		18,762,914.84	-34,239,689.07
1. 利息收入		33,725.59	686,162.27
其中：存款利息收入	6.4.7.13	33,725.59	51,739.12
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		-	-
其他利息收入		-	634,423.15
2. 投资收益（损失以 “-”填列）		4,064,956.68	-4,365,689.83
其中：股票投资收益	6.4.7.14	863,807.89	-10,340,499.37
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资 收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	3,201,148.79	5,974,809.54
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	14,618,013.18	-30,573,262.42
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	46,219.39	13,100.91
<b>减：二、营业总支出</b>		1,656,371.67	2,289,289.97
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,290,190.17	1,803,956.12
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	258,038.02	360,791.23
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	30,923.82	22,332.28
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		-	2,284.77
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	77,219.66	99,925.57
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		17,106,543.17	-36,528,979.04
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		17,106,543.17	-36,528,979.04
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		17,106,543.17	-36,528,979.04

### 6.3 净资产变动表

会计主体：鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF)

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	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	221,452,440.93	-	145,028,027.85	366,480,468.78
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	221,452,440.93	-	145,028,027.85	366,480,468.78
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-24,250,897.08	-	-819,093.37	-25,069,990.45
(一)、综合收益总额	-	-	17,106,543.17	17,106,543.17
(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)	-24,250,897.08	-	-17,925,636.54	-42,176,533.62
其中：1. 基金申购款	26,711,735.03	-	18,054,735.46	44,766,470.49

2. 基金赎回款	-50,962,632.11	-	-35,980,372.00	-86,943,004.11
(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	197,201,543.85	-	144,208,934.48	341,410,478.33
项目				
上年度可比期间 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	325,913,490.12	-	173,540,062.61	499,453,552.73
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	325,913,490.12	-	173,540,062.61	499,453,552.73
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-3,324,826.01	-	-38,713,903.12	-42,038,729.13
(一)、综合收益总额	-	-	-36,528,979.04	-36,528,979.04
(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)	-3,324,826.01	-	-2,184,924.08	-5,509,750.09
其中：1. 基金申购款	33,154,432.37	-	16,678,437.58	49,832,869.95
2. 基金赎回款	-36,479,258.38	-	-18,863,361.66	-55,342,620.04
(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)	-	-	-	-

填列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	322, 588, 664. 11	-	134, 826, 159. 49	457, 414, 823. 60

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

邓召明

聂连杰

郝文高

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

鹏华中证 500 指数证券投资基金(LOF) (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[2009]第 1374 号《关于核准鹏华中证 500 指数证券投资基金(LOF)募集的批复》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 指数证券投资基金(LOF)基金合同》负责公开募集。本基金为上市契约型开放式, 存续期限不定, 首次设立募集不包括认购资金利息共募集 2, 629, 831, 732. 31 元, 业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2009)第 021 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案, 《鹏华中证 500 指数证券投资基金(LOF)基金合同》于 2010 年 2 月 5 日正式生效, 基金合同生效日的基金份额总额为 2, 630, 723, 634. 12 份基金份额, 其中认购资金利息折合 891, 901. 81 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 指数证券投资基金(LOF)基金合同》和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2025 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 2025 年 06 月 30 日的财务状况以及 2025 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 2025 年 6 月 30 日
活期存款	20,235,404.79
等于： 本金	20,233,744.46
加： 应计利息	1,660.33
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	20,235,404.79

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	323,301,295.17	-	324,302,643.26	1,001,348.09
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	323,301,295.17	-	324,302,643.26	1,001,348.09

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

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注: 无。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注: 无。

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注: 无。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注: 无。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注: 无。

##### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。
----

**6.4.7.5 债权投资****6.4.7.5.1 债权投资情况**

注：无。

**6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况**

注：无。

**6.4.7.6 其他债权投资****6.4.7.6.1 其他债权投资情况**

注：无。

**6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况**

注：无。

**6.4.7.7 其他权益工具投资****6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况**

注：无。

**6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况**

注：无。

**6.4.7.8 其他资产**

注：无。

**6.4.7.9 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	1,289.46
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	14,807.29
其中：交易所市场	14,807.29
银行间市场	—
应付利息	—
预提费用	76,814.59
合计	92,911.34

**6.4.7.10 实收基金**

金额单位：人民币元

鹏华中证 500 指数 (LOF) A

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	200,743,415.23	200,743,415.23
本期申购	14,574,488.43	14,574,488.43
本期赎回 (以“-”号填列)	-33,341,760.38	-33,341,760.38
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	181,976,143.28	181,976,143.28

## 鹏华中证 500 指数 (LOF) C

项目	本期	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	20,708,525.70	20,708,525.70
本期申购	11,718,891.69	11,718,891.69
本期赎回 (以“-”号填列)	-17,468,539.48	-17,468,539.48
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	14,958,877.91	14,958,877.91

## 鹏华中证 500 指数 (LOF) I

项目	本期	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	500.00	500.00
本期申购	418,354.91	418,354.91
本期赎回 (以“-”号填列)	-152,332.25	-152,332.25
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	266,522.66	266,522.66

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

注：无。

#### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

## 鹏华中证 500 指数 (LOF) A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	263,685,694.12	-133,625,824.62	130,059,869.50

加: 会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	263,685,694.12	-133,625,824.62	130,059,869.50
本期利润	2,296,484.39	13,138,334.27	15,434,818.66
本期基金份额交易产生的变动数	-24,733,337.10	11,429,218.60	-13,304,118.50
其中: 基金申购款	19,213,750.30	-9,761,673.54	9,452,076.76
基金赎回款	-43,947,087.40	21,190,892.14	-22,756,195.26
本期已分配利润	-	-	-
本期末	241,248,841.41	-109,058,271.75	132,190,569.66

## 鹏华中证 500 指数 (LOF) C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	12,844,870.20	2,123,302.00	14,968,172.20
加: 会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	12,844,870.20	2,123,302.00	14,968,172.20
本期利润	190,750.04	1,479,087.29	1,669,837.33
本期基金份额交易产生的变动数	-3,592,699.27	-1,031,807.73	-4,624,507.00
其中: 基金申购款	7,329,367.59	1,273,895.50	8,603,263.09
基金赎回款	-10,922,066.86	-2,305,703.23	-13,227,770.09
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,442,920.97	2,570,581.56	12,013,502.53

## 鹏华中证 500 指数 (LOF) I

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	0.11	-13.96	-13.85
加: 会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	0.11	-13.96	-13.85
本期利润	1,295.56	591.62	1,887.18
本期基金份额交易产生的变动数	577.39	2,411.57	2,988.96
其中: 基金申购款	1,392.71	-1,997.10	-604.39
基金赎回款	-815.32	4,408.67	3,593.35
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,873.06	2,989.23	4,862.29

## 6.4.7.13 存款利息收入

单位: 人民币元

项目	本期
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

活期存款利息收入	33,423.78
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	118.86
其他	182.95
合计	33,725.59

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 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	863,807.89
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	863,807.89

##### 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 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出股票成交总额	83,130,190.08
减：卖出股票成本总额	82,193,093.01
减：交易费用	73,289.18
买卖股票差价收入	863,807.89

##### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：无。

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

##### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

**6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入**

注：无。

**6.4.7.16 资产支持证券投资收益****6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成**

注：无。

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

注：无。

**6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入**

注：无。

**6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入**

注：无。

**6.4.7.17 贵金属投资收益****6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成**

注：无。

**6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

注：无。

**6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

注：无。

**6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

注：无。

**6.4.7.18 衍生工具收益****6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：无。

**6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益**

注：无。

**6.4.7.19 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	3,201,148.79
其中：证券出借权益补偿收入	-

基金投资产生的股利收益	-
合计	3,201,148.79

#### 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位: 人民币元

项目名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
1. 交易性金融资产	14,618,013.18
股票投资	14,618,013.18
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减: 应税金融商品公允价值变动 产生的预估增值税	-
合计	14,618,013.18

#### 6.4.7.21 其他收入

单位: 人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
基金赎回费收入	44,814.92
基金转换费收入	1,404.47
合计	46,219.39

#### 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 2025年1月1日至2025年6月30日
审计费用	17,307.22
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费用	289.00
存托服务费	116.07
合计	77,219.66

#### 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(“鹏华基金管理公司”)	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人、基金代销机构
国信证券股份有限公司(“国信证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024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	71,381,859.17	56.27	11,557,558.31	8.88

#### 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 2025年1月1日至2025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	13,269.80	56.27	8,419.89	56.86
关联方名称	上年度可比期间 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	10,695.82	8.91	6,969.92	6.48

注：1. 上述佣金按协议约定的佣金率计算，以扣除证管费、经手费等费用后的净额列示。佣金率由协议签订方参考市场价格确定。佣金协议的服务范围符合《公开募集证券投资基金管理费用管理规定》相关要求。

2. 根据《公开募集证券投资基金管理费用管理规定》，自2024年7月1日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

### 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 2025年1月1日至2025年6 月30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024 年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,290,190.17	1,803,956.12
其中：应支付销售机构的客户维 护费	439,565.85	397,905.55
应支付基金管理人的净管理费	850,624.32	1,406,050.57

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

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

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位: 人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	258,038.02	360,791.23

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

### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位: 人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期			
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	鹏华中证 500 指数 (LOF) A	鹏华中证 500 指数 (LOF) C	鹏华中证 500 指数 (LOF) I	合计
国信证券	-	664.56	-	664.56
鹏华基金管理有限公司	-	2,444.04	82.23	2,526.27
中国工商银行	-	6,523.23	-	6,523.23
合计	-	9,631.83	82.23	9,714.06
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间			
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	鹏华中证 500 指数 (LOF) A	鹏华中证 500 指数 (LOF) C	鹏华中证 500 指数 (LOF) I	合计
国信证券	-	154.23	-	154.23
鹏华基金管理有限公司	-	2,522.88	-	2,522.88
中国工商银行	-	552.09	-	552.09
合计	-	3,229.20	-	3,229.20

注: 鹏华中证 500 指数 (LOF) A 基金份额不支付销售服务费; 支付基金销售机构的鹏华中证 500 指数 (LOF) C 基金份额的销售服务费年费率为 0.2%, 逐日计提, 按月支付, 日销售服务费=前一日分类基金资产净值×0.2%÷当年天数; 支付基金销售机构的鹏华中证 500 指数 (LOF) I 基金份额的销售服务费年费率为 0.1%, 逐日计提, 按月支付, 日销售服务费=前一日分类基金资产净值×0.1%÷当年天数。

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注: 无。

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

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

注：无。

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

单位：人民币元

本期						
2025 年 1 月 1 日至 2025 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
-	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间						
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	4,194,610.00	2.00~3.10	2.62	4,238.22	742,950.00	656.29

#### 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

注：本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方没有投资及持有本基金份额。

#### 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		上年度可比期间	
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	20,235,404.79	33,423.78	27,912,266.23	50,250.09

#### 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

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
-	-	-	-	-	-

上年度可比期间 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	528	38,258.88

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（2025 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
001335	信凯科技	2025 年 4 月 2 日	6 个月	新股流通受限	12.80	28.05	80	1,024.00	2,244.00	-
001356	富岭股份	2025 年 1 月 16 日	6 个月	新股流通受限	5.30	14.44	709	3,757.70	10,237.96	-
001382	新亚电缆	2025 年 3 月 13 日	6 个月	新股流通受限	7.40	20.21	366	2,708.40	7,396.86	-
001388	信通电子	2025 年 6 月 24 日	1 个月内 (含)	新股未上市	16.42	16.42	843	13,842.06	13,842.06	-
001388	信通电子	2025 年 6 月 24 日	6 个月	新股流通受限	16.42	16.42	94	1,543.48	1,543.48	-
001395	亚	2025	6 个月	新股	19.08	47.25	80	1,526.40	3,780.00	-

	联 机 械	年 1 月 20 日		流通 受限						
301173	毓 恬 冠 佳	2025 年 2 月 24 日	6 个月	新股 流通 受限	28.33	44.98	173	4,901.09	7,781.54	-
301275	汉 朔 科 技	2025 年 3 月 4 日	6 个月	新股 流通 受限	27.50	56.19	315	8,662.50	17,699.85	-
301458	钧 崴 电 子	2025 年 1 月 2 日	6 个月	新股 流通 受限	10.40	34.11	701	7,290.40	23,911.11	-
301479	弘 景 光 电	2025 年 3 月 6 日	6 个月	新股 流通 受限	41.90	77.87	182	5,447.00	14,172.34	弘景 光电 于 2025 年 5 月 28 日 每 10 股 送 4 股
301501	恒 鑫 生 活	2025 年 3 月 11 日	6 个月	新股 流通 受限	39.92	45.22	284	7,824.32	12,842.48	恒鑫 生 活 于 2025 年 6 月 6 日 每 10 股 送 4.5 股
301535	浙 江 华 远	2025 年 3 月 18 日	6 个月	新股 流通 受限	4.92	18.99	734	3,611.28	13,938.66	-
301560	众 捷 汽 车	2025 年 4 月 17 日	6 个月	新股 流通 受限	16.50	27.45	190	3,135.00	5,215.50	-
301590	优	2025	6 个月	新股	89.60	139.48	73	6,540.80	10,182.04	-

	优 绿 能	年 5 月 28 日		流通 受限						
301595	太 力 科 技	2025 年 5 月 12 日	6 个 月	新股 流通 受限	17.05	29.10	196	3,341.80	5,703.60	-
301601	惠 通 科 技	2025 年 1 月 8 日	6 个 月	新股 流通 受限	11.80	33.85	342	4,035.60	11,576.70	-
301602	超 研 股 份	2025 年 1 月 15 日	6 个 月	新股 流通 受限	6.70	24.80	658	4,408.60	16,318.40	-
301636	泽 润 新 能	2025 年 4 月 30 日	6 个 月	新股 流通 受限	33.06	47.46	128	4,231.68	6,074.88	-
301658	首 航 新 能	2025 年 3 月 26 日	6 个 月	新股 流通 受限	11.80	22.98	437	5,156.60	10,042.26	-
301662	宏 工 科 技	2025 年 4 月 10 日	6 个 月	新股 流通 受限	26.60	82.50	143	3,803.80	11,797.50	-
301665	泰 禾 股 份	2025 年 4 月 2 日	6 个 月	新股 流通 受限	10.27	22.39	393	4,036.11	8,799.27	-
301678	新 恒 汇	2025 年 6 月 13 日	6 个 月	新股 流通 受限	12.80	44.54	382	4,889.60	17,014.28	-
603014	威 高 血 净	2025 年 5 月 12 日	6 个 月	新股 流通 受限	26.50	32.68	155	4,107.50	5,065.40	-
603072	天 和 磁 材	2024 年 12 月 24 日	6 个 月	新股 流通 受限	12.30	54.45	209	2,570.70	11,380.05	-
603120	肯	2025	6 个 月	新股	15.00	33.43	65	975.00	2,172.95	-

	特 催 化	年4 月9 日		流通 受限						
603124	江 南 新 材	2025 年3 月12 日	6个月	新股 流通 受限	10.54	46.31	88	927.52	4,075.28	-
603202	天 有 为	2025 年4 月16 日	6个月	新股 流通 受限	93.50	90.66	48	4,488.00	4,351.68	-
603210	泰 鸿 万 立	2025 年4 月1 日	6个月	新股 流通 受限	8.60	15.61	286	2,459.60	4,464.46	-
603257	中 国 瑞 林	2025 年3 月28 日	6个月	新股 流通 受限	20.52	37.47	78	1,600.56	2,922.66	-
603271	永 杰 新 材	2025 年3 月4 日	6个月	新股 流通 受限	20.60	35.08	126	2,595.60	4,420.08	-
603382	海 阳 科 技	2025 年6 月5 日	6个月	新股 流通 受限	11.50	22.39	105	1,207.50	2,350.95	-
603400	华 之 杰	2025 年6 月12 日	6个月	新股 流通 受限	19.88	43.81	57	1,133.16	2,497.17	-
603409	汇 通 控 股	2025 年2 月25 日	6个月	新股 流通 受限	24.18	33.32	100	2,418.00	3,332.00	-
688411	海 博 思 创	2025 年1 月20 日	6个月	新股 流通 受限	19.38	83.49	560	10,852.80	46,754.40	-
688545	兴 福 电 子	2025 年1 月15 日	6个月	新股 流通 受限	11.68	26.95	833	9,729.44	22,449.35	-
688583	思	2025	6个月	新股	33.46	79.68	227	5,855.50	18,087.36	思看

	看科技	年1月8日		流通受限						科技于2025年6月19日每10股送3股
688755	汉邦科技	2025年5月9日	6个月	新股流通受限	22.77	39.33	203	4,622.31	7,983.99	-
688757	胜科纳米	2025年3月18日	6个月	新股流通受限	9.08	25.94	536	4,866.88	13,903.84	-
688758	赛分科技	2025年1月2日	6个月	新股流通受限	4.32	16.97	777	3,356.64	13,185.69	-
688775	影石创新	2025年6月4日	6个月	新股流通受限	47.27	124.16	251	11,864.77	31,164.16	-

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	重大事项	0.00	-	-	377,100	823,694.89	0.00	-

		月 30 日							
--	--	-----------	--	--	--	--	--	--	--

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及其备选成份股（均含存托凭证），为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、存托凭证、债券（含国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券等）、债券回购、银行存款、货币市场工具、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可依据法律法规的规定，参与融资及转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。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本基金的托管行中国工商银行股份有限公司及其他具有基金托管资格的银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。

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

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

于 2025 年 06 月 30 日，本基金未持有信用类债券（2024 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 2025 年 06 月 30 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。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

#### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短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%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原

则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金持有的利率敏感性资产为银行存款、结算备付金，其余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 2025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	20,235,404.79	-	-	-	20,235,404.79
存出保证金	11,936.95	-	-	-	11,936.95
交易性金融资产	-	-	-	324,302,643.26	324,302,643.26
应收申购款	-	-	-	56,364.48	56,364.48
资产总计	20,247,341.74	-	-	324,359,007.74	344,606,349.48
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,850,692.46	2,850,692.46
应付管理人报酬	-	-	-	206,264.07	206,264.07
应付托管费	-	-	-	41,252.79	41,252.79
应付清算款	-	-	-	182.71	182.71
应付销售服务费	-	-	-	4,567.78	4,567.78
其他负债	-	-	-	92,911.34	92,911.34
负债总计	-	-	-	3,195,871.15	3,195,871.15
利率敏感度缺口	20,247,341.74	-	-	321,163,136.59	341,410,478.33
上年度末	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

2024 年 12 月 31 日					
<b>资产</b>					
货币资金	20,234,315.54	—	—	—	20,234,315.54
结算备付金	2,999.55	—	—	—	2,999.55
存出保证金	68,396.72	—	—	—	68,396.72
交易性金融资产	—	—	—	346,500,086.75	346,500,086.75
应收申购款	—	—	—	807,232.78	807,232.78
<b>资产总计</b>	<b>20,305,711.81</b>	<b>—</b>	<b>—</b>	<b>347,307,319.53</b>	<b>367,613,031.34</b>
<b>负债</b>					
应付赎回款	—	—	—	620,367.53	620,367.53
应付管理人报酬	—	—	—	242,869.51	242,869.51
应付托管费	—	—	—	48,573.91	48,573.91
应付清算款	—	—	—	0.68	0.68
应付销售服务费	—	—	—	6,614.32	6,614.32
其他负债	—	—	—	214,136.61	214,136.61
<b>负债总计</b>	<b>—</b>	<b>—</b>	<b>—</b>	<b>1,132,562.56</b>	<b>1,132,562.56</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>20,305,711.81</b>	<b>—</b>	<b>—</b>	<b>346,174,756.97</b>	<b>366,480,468.78</b>

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2025 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：投资于标的指数成份股和备选成份股（均含存托凭证）的比例不低于基金资产净值的 90%且不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如果法律法规对该比例要求有变更的，本基金在履行适当程序后以变更后的比例为准，本基金的投资比例可做相应调整。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 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024 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	324,302,643.26	94.99	346,500,086.75	94.55
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	324,302,643.26	94.99	346,500,086.75	94.55

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。
	对资产负债表日基金资产净值的

分析	相关风险变量的变动	影响金额 (单位: 人民币元)	
		本期末 (2025 年 6 月 30 日)	上年度末 (2024 年 12 月 31 日)
	比较基准上涨 5% 资产净值变动	16,097,504.05	17,220,917.23
	比较基准下降 5% 资产净值变动	-16,097,504.05	-17,220,917.23

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 2025 年 6 月 30 日
第一层次	323,869,967.02
第二层次	15,385.54
第三层次	417,290.70
合计	324,302,643.26

###### 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	324,302,643.26	94.11
	其中：股票	324,302,643.26	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	20,235,404.79	5.87
8	其他各项资产	68,301.43	0.02
9	合计	344,606,349.48	100.00

注：报告期末本基金投资的存托凭证公允价值为：1,491,202.34 元，占净值比 0.44%。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	806,290.00	0.24

	业		
B	采矿业	11,562,862.50	3.39
C	制造业	205,181,841.31	60.10
D	电力、热力、燃 气及水生产和供 应业	10,423,270.60	3.05
E	建筑业	2,841,223.00	0.83
F	批发和零售业	7,093,846.29	2.08
G	交通运输、仓储 和邮政业	5,377,359.88	1.58
H	住宿和餐饮业	867,879.00	0.25
I	信息传输、软件 和信息技术服务 业	30,104,404.31	8.82
J	金融业	31,792,588.39	9.31
K	房地产业	4,003,442.25	1.17
L	租赁和商务服务 业	2,780,027.40	0.81
M	科学研究和技术 服务业	2,195,747.76	0.64
N	水利、环境和公 共设施管理业	1,355,023.40	0.40
O	居民服务、修理 和其他服务业	-	-
P	教育	663,102.00	0.19
Q	卫生和社会工作	1,489,302.20	0.44
R	文化、体育和娱 乐业	4,547,086.00	1.33
S	综合	769,312.87	0.23
	合计	323,854,609.16	94.86

### 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	402,029.04	0.12
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	2,244.00	0.00
G	交通运输、仓储 和邮政业	15,357.86	0.00

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	28,403.20	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	448,034.10	0.13

### 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	300476	胜宏科技	26,600	3,574,508.00	1.05
2	000988	华工科技	44,250	2,080,192.50	0.61
3	600988	赤峰黄金	73,100	1,818,728.00	0.53
4	300339	润和软件	35,000	1,779,050.00	0.52
5	002966	苏州银行	196,380	1,724,216.40	0.51
6	600839	四川长虹	162,200	1,576,584.00	0.46
7	601162	天风证券	311,700	1,536,681.00	0.45
8	601555	东吴证券	174,580	1,527,575.00	0.45
9	688521	芯原股份	15,537	1,499,320.50	0.44
10	689009	九号公司-WD	25,202	1,491,202.34	0.44
11	002517	恺英网络	75,100	1,450,181.00	0.42
12	002340	格林美	225,200	1,430,020.00	0.42
13	002195	岩山科技	249,621	1,405,366.23	0.41
14	002558	巨人网络	59,500	1,401,225.00	0.41

15	603893	瑞芯微	9,200	1,397,112.00	0.41
16	002156	通富微电	53,400	1,368,108.00	0.40
17	002261	拓维信息	44,200	1,367,990.00	0.40
18	600487	亨通光电	86,700	1,326,510.00	0.39
19	600157	永泰能源	975,800	1,307,572.00	0.38
20	300251	光线传媒	64,500	1,307,415.00	0.38
21	002797	第一创业	184,600	1,306,968.00	0.38
22	300207	欣旺达	64,900	1,301,894.00	0.38
23	688608	恒玄科技	3,700	1,287,526.00	0.38
24	300803	指南针	15,830	1,276,847.80	0.37
25	688213	思特威-W	12,431	1,270,696.82	0.37
26	000066	中国长城	85,100	1,259,480.00	0.37
27	688777	中控技术	27,778	1,247,509.98	0.37
28	688120	华海清科	7,319	1,234,715.30	0.36
29	600096	云天化	56,100	1,232,517.00	0.36
30	600536	中国软件	26,135	1,222,333.95	0.36
31	002273	水晶光电	61,084	1,219,847.48	0.36
32	601168	西部矿业	73,300	1,218,979.00	0.36
33	002465	海格通信	87,300	1,216,962.00	0.36
34	600879	航天电子	116,000	1,214,520.00	0.36
35	300450	先导智能	48,200	1,197,770.00	0.35
36	688235	百济神州-U	5,100	1,191,564.00	0.35
37	000831	中国稀土	32,700	1,181,124.00	0.35
38	601099	太平洋	299,400	1,176,642.00	0.34
39	600352	浙江龙盛	114,400	1,162,304.00	0.34
40	002294	信立泰	24,500	1,159,585.00	0.34
41	300017	网宿科技	107,500	1,152,400.00	0.34
42	000933	神火股份	69,200	1,151,488.00	0.34
43	600885	宏发股份	51,337	1,145,328.47	0.34
44	002185	华天科技	112,600	1,137,260.00	0.33
45	688617	惠泰医疗	3,825	1,136,025.00	0.33
46	601108	财通证券	142,800	1,129,548.00	0.33
47	688002	睿创微纳	16,021	1,116,984.12	0.33
48	601128	常熟银行	145,725	1,073,993.25	0.31
49	002130	沃尔核材	44,300	1,055,226.00	0.31
50	300454	深信服	11,200	1,054,816.00	0.31
51	688099	晶晨股份	14,839	1,053,717.39	0.31
52	601577	长沙银行	106,000	1,053,640.00	0.31
53	002281	光迅科技	21,360	1,053,475.20	0.31
54	600079	人福医药	50,200	1,053,196.00	0.31
55	688122	西部超导	20,129	1,044,292.52	0.31
56	002595	豪迈科技	17,600	1,042,272.00	0.31
57	002085	万丰奥威	65,300	1,037,617.00	0.30

58	688469	芯联集成-U	217,329	1,036,659.33	0.30
59	000423	东阿阿胶	19,800	1,035,540.00	0.30
60	300223	北京君正	14,900	1,031,080.00	0.30
61	000997	新大陆	31,786	1,029,230.68	0.30
62	002738	中矿资源	31,720	1,020,115.20	0.30
63	300058	蓝色光标	155,440	1,019,686.40	0.30
64	002532	天山铝业	122,600	1,018,806.00	0.30
65	603129	春风动力	4,700	1,017,550.00	0.30
66	300002	神州泰岳	86,200	1,017,160.00	0.30
67	000783	长江证券	145,800	1,010,394.00	0.30
68	300458	全志科技	25,400	1,008,126.00	0.30
69	300474	景嘉微	13,800	1,007,400.00	0.30
70	600109	国金证券	114,200	1,001,534.00	0.29
71	002138	顺络电子	35,500	998,260.00	0.29
72	002472	双环传动	29,800	998,002.00	0.29
73	002078	太阳纸业	73,728	992,378.88	0.29
74	603596	伯特利	18,740	987,410.60	0.29
75	002436	兴森科技	74,300	983,732.00	0.29
76	601933	永辉超市	199,300	976,570.00	0.29
77	002410	广联达	72,600	973,566.00	0.29
78	688072	拓荆科技	6,282	965,606.22	0.28
79	002851	麦格米特	19,200	962,688.00	0.28
80	688525	佰维存储	14,276	962,202.40	0.28
81	002850	科达利	8,500	961,945.00	0.28
82	300346	南大光电	30,400	961,856.00	0.28
83	300765	新诺威	18,600	961,434.00	0.28
84	600862	中航高科	36,800	959,744.00	0.28
85	600143	金发科技	92,700	955,737.00	0.28
86	300136	信维通信	42,500	952,000.00	0.28
87	600580	卧龙电驱	48,143	951,787.11	0.28
88	601198	东兴证券	85,200	949,980.00	0.28
89	300024	机器人	55,100	946,618.00	0.28
90	002065	东华软件	98,600	946,560.00	0.28
91	300054	鼎龙股份	33,000	946,440.00	0.28
92	002353	杰瑞股份	27,000	945,000.00	0.28
93	002223	鱼跃医疗	26,505	943,578.00	0.28
94	603606	东方电缆	18,200	941,122.00	0.28
95	000034	神州数码	25,000	941,000.00	0.28
96	300395	菲利华	18,400	940,240.00	0.28
97	600298	安琪酵母	26,700	939,039.00	0.28
98	600873	梅花生物	87,800	938,582.00	0.27
99	600363	联创光电	16,000	933,280.00	0.27
100	002202	金风科技	91,000	932,750.00	0.27

101	002673	西部证券	117,800	928,264.00	0.27
102	688578	艾力斯	9,968	927,422.72	0.27
103	300496	中科创达	16,200	926,964.00	0.27
104	601615	明阳智能	79,900	918,051.00	0.27
105	300857	协创数据	10,600	912,236.00	0.27
106	000728	国元证券	115,000	907,350.00	0.27
107	002624	完美世界	59,700	905,649.00	0.27
108	300383	光环新网	63,200	903,760.00	0.26
109	002008	大族激光	37,000	901,690.00	0.26
110	000021	深科技	48,056	900,569.44	0.26
111	300115	长盈精密	41,700	892,380.00	0.26
112	603659	璞泰来	47,000	882,660.00	0.26
113	600549	厦门钨业	41,900	876,548.00	0.26
114	600895	张江高科	34,100	876,370.00	0.26
115	300604	长川科技	19,480	874,846.80	0.26
116	603087	甘李药业	15,900	871,002.00	0.26
117	603605	珀莱雅	10,500	869,295.00	0.25
118	603160	汇顶科技	12,200	866,566.00	0.25
119	688220	翱捷科技-U	11,052	865,371.60	0.25
120	300012	华测检测	74,000	865,060.00	0.25
121	000426	兴业银锡	54,600	862,680.00	0.25
122	002155	湖南黄金	48,110	858,763.50	0.25
123	600171	上海贝岭	25,000	856,250.00	0.25
124	000733	振华科技	17,100	855,855.00	0.25
125	300627	华测导航	24,120	844,200.00	0.25
126	688361	中科飞测	9,877	831,544.63	0.24
127	605589	圣泉集团	29,800	826,950.00	0.24
128	601216	君正集团	148,300	818,616.00	0.24
129	600392	盛和资源	61,629	811,653.93	0.24
130	300037	新宙邦	23,020	810,304.00	0.24
131	300699	光威复材	25,580	810,118.60	0.24
132	000750	国海证券	196,380	809,085.60	0.24
133	601665	齐鲁银行	128,000	808,960.00	0.24
134	688180	君实生物-U	23,742	806,753.16	0.24
135	000519	中兵红箭	36,708	803,538.12	0.24
136	002444	巨星科技	31,495	803,437.45	0.24
137	601997	贵阳银行	128,500	801,840.00	0.23
138	000932	华菱钢铁	182,060	801,064.00	0.23
139	000729	燕京啤酒	61,900	800,367.00	0.23
140	300003	乐普医疗	57,900	797,862.00	0.23
141	600153	建发股份	76,500	793,305.00	0.23
142	600060	海信视像	34,400	791,888.00	0.23
143	601717	郑煤机	47,505	789,533.10	0.23

144	688052	纳芯微	4,504	785,902.96	0.23
145	601990	南京证券	97,200	785,376.00	0.23
146	601233	桐昆股份	74,000	784,400.00	0.23
147	601696	中银证券	73,300	783,577.00	0.23
148	000878	云南铜业	61,600	783,552.00	0.23
149	300073	当升科技	17,800	780,886.00	0.23
150	300001	特锐德	32,500	779,025.00	0.23
151	002821	凯莱英	8,800	776,600.00	0.23
152	300142	沃森生物	70,300	773,300.00	0.23
153	002414	高德红外	75,100	769,775.00	0.23
154	600673	东阳光	66,149	769,312.87	0.23
155	603979	金诚信	16,500	766,260.00	0.22
156	600369	西南证券	175,200	762,120.00	0.22
157	002837	英维克	25,600	760,576.00	0.22
158	600699	均胜电子	43,360	756,198.40	0.22
159	002007	华兰生物	48,200	755,294.00	0.22
160	688065	凯赛生物	15,980	752,658.00	0.22
161	300373	扬杰科技	14,400	747,360.00	0.22
162	600118	中国卫星	26,000	742,820.00	0.22
163	688027	国盾量子	2,700	742,527.00	0.22
164	600177	雅戈尔	101,600	741,680.00	0.22
165	600521	华海药业	39,800	741,474.00	0.22
166	000893	亚钾国际	24,400	735,416.00	0.22
167	600398	海澜之家	105,500	734,280.00	0.22
168	002152	广电运通	54,600	733,824.00	0.21
169	603345	安井食品	9,100	731,822.00	0.21
170	600435	北方导航	46,472	724,498.48	0.21
171	600704	物产中大	136,900	721,463.00	0.21
172	000738	航发控制	34,700	720,025.00	0.21
173	300748	金力永磁	30,200	719,968.00	0.21
174	600909	华安证券	123,350	719,130.50	0.21
175	688249	晶合集成	35,244	714,395.88	0.21
176	000623	吉林敖东	42,100	713,595.00	0.21
177	600316	洪都航空	18,900	712,530.00	0.21
178	600497	驰宏锌锗	134,200	709,918.00	0.21
179	002044	美年健康	137,600	707,264.00	0.21
180	000009	中国宝安	79,380	704,894.40	0.21
181	002958	青农商行	195,200	704,672.00	0.21
182	603179	新泉股份	15,000	704,550.00	0.21
183	002318	久立特材	30,100	704,039.00	0.21
184	688385	复旦微电	14,284	703,772.68	0.21
185	600038	中直股份	18,100	702,461.00	0.21
186	600765	中航重机	41,593	702,089.84	0.21

187	600141	兴发集团	33,918	696,336.54	0.20
188	603228	景旺电子	16,488	689,857.92	0.20
189	600562	国睿科技	21,900	689,631.00	0.20
190	002409	雅克科技	12,600	689,094.00	0.20
191	688188	柏楚电子	5,194	683,842.04	0.20
192	000400	许继电气	31,400	683,578.00	0.20
193	000528	柳工	71,000	682,310.00	0.20
194	002683	广东宏大	20,100	682,194.00	0.20
195	600155	华创云信	97,700	679,992.00	0.20
196	001696	宗申动力	30,200	677,990.00	0.20
197	300919	中伟股份	20,600	677,328.00	0.20
198	300724	捷佳伟创	12,300	667,890.00	0.20
199	000960	锡业股份	43,400	664,020.00	0.19
200	002607	中公教育	216,700	663,102.00	0.19
201	600637	东方明珠	88,600	661,842.00	0.19
202	300757	罗博特科	4,400	659,868.00	0.19
203	600498	烽火通信	31,300	658,239.00	0.19
204	300623	捷捷微电	22,000	655,600.00	0.19
205	600884	杉杉股份	69,200	654,632.00	0.19
206	603939	益丰药房	26,628	651,587.16	0.19
207	600529	山东药玻	29,200	646,488.00	0.19
208	600563	法拉电子	5,923	646,140.07	0.19
209	688568	中科星图	17,900	644,579.00	0.19
210	300558	贝达药业	11,100	643,245.00	0.19
211	002739	万达电影	55,700	636,651.00	0.19
212	002841	视源股份	18,400	636,640.00	0.19
213	000039	中集集团	80,980	636,502.80	0.19
214	000415	渤海租赁	190,200	633,366.00	0.19
215	600486	扬农化工	10,800	626,400.00	0.18
216	002653	海思科	14,800	624,856.00	0.18
217	301358	湖南裕能	20,000	623,800.00	0.18
218	002025	航天电器	12,100	622,061.00	0.18
219	688017	绿的谐波	4,963	619,829.07	0.18
220	002926	华西证券	69,200	618,648.00	0.18
221	600901	江苏金租	101,760	616,665.60	0.18
222	002385	大北农	151,100	610,444.00	0.18
223	000887	中鼎股份	34,700	610,373.00	0.18
224	300285	国瓷材料	35,100	608,985.00	0.18
225	300763	锦浪科技	10,600	608,334.00	0.18
226	688582	芯动联科	8,900	598,080.00	0.18
227	688114	华大智造	9,211	597,149.13	0.17
228	300679	电连技术	13,100	594,478.00	0.17
229	002939	长城证券	70,900	594,142.00	0.17

230	603486	科沃斯	10,200	593,946.00	0.17
231	300144	宋城演艺	69,200	591,660.00	0.17
232	002568	百润股份	23,100	591,591.00	0.17
233	600820	隧道股份	96,700	589,870.00	0.17
234	600132	重庆啤酒	10,700	589,570.00	0.17
235	600863	内蒙华电	143,400	589,374.00	0.17
236	000723	美锦能源	135,400	584,928.00	0.17
237	600008	首创环保	193,530	584,460.60	0.17
238	000513	丽珠集团	16,020	577,360.80	0.17
239	002064	华峰化学	87,200	576,392.00	0.17
240	600390	五矿资本	98,800	576,004.00	0.17
241	002080	中材科技	29,500	575,250.00	0.17
242	600516	方大炭素	123,800	574,432.00	0.17
243	603568	伟明环保	29,965	571,732.20	0.17
244	002312	川发龙蟒	49,800	571,704.00	0.17
245	600998	九州通	110,818	569,604.52	0.17
246	600763	通策医疗	13,790	569,251.20	0.17
247	688538	和辉光电-U	242,997	568,612.98	0.17
248	000703	恒逸石化	96,700	568,596.00	0.17
249	600166	福田汽车	208,700	565,577.00	0.17
250	688183	生益电子	11,000	563,200.00	0.16
251	300487	蓝晓科技	11,150	560,845.00	0.16
252	600170	上海建工	234,200	559,738.00	0.16
253	002262	恩华药业	26,800	556,904.00	0.16
254	603816	顾家家居	21,700	553,784.00	0.16
255	603589	口子窖	15,900	553,320.00	0.16
256	600208	衢州发展	186,900	553,224.00	0.16
257	601179	中国西电	90,100	553,214.00	0.16
258	002500	山西证券	94,670	552,872.80	0.16
259	300676	华大基因	11,100	552,447.00	0.16
260	600312	平高电气	35,800	550,962.00	0.16
261	605358	立昂微	23,600	549,880.00	0.16
262	000683	博源化工	114,400	547,976.00	0.16
263	601155	新城控股	39,800	544,464.00	0.16
264	600021	上海电力	61,900	544,101.00	0.16
265	002203	海亮股份	52,700	543,864.00	0.16
266	600985	淮北矿业	47,400	537,516.00	0.16
267	600126	杭钢股份	59,400	534,600.00	0.16
268	002244	滨江集团	54,692	533,247.00	0.16
269	600380	健康元	48,248	532,175.44	0.16
270	002432	九安医疗	14,600	531,878.00	0.16
271	603338	浙江鼎力	11,200	530,880.00	0.16
272	000403	派林生物	29,250	530,302.50	0.16

273	600583	海油工程	97,100	530,166.00	0.16
274	000591	太阳能	120,500	528,995.00	0.15
275	601000	唐山港	130,198	528,603.88	0.15
276	600348	华阳股份	79,300	528,138.00	0.15
277	688728	格科微	34,265	527,681.00	0.15
278	300567	精测电子	8,700	527,307.00	0.15
279	000060	中金岭南	115,000	526,700.00	0.15
280	000921	海信家电	20,400	524,280.00	0.15
281	000629	钒钛股份	204,200	522,752.00	0.15
282	603885	吉祥航空	38,700	521,289.00	0.15
283	600872	中炬高新	27,400	520,600.00	0.15
284	603379	三美股份	10,800	519,696.00	0.15
285	000830	鲁西化工	50,427	519,398.10	0.15
286	601991	大唐发电	163,400	517,978.00	0.15
287	002603	以岭药业	36,700	517,470.00	0.15
288	688278	特宝生物	7,146	515,298.06	0.15
289	600535	天士力	32,900	514,885.00	0.15
290	002984	森麒麟	27,300	511,875.00	0.15
291	002439	启明星辰	32,000	511,680.00	0.15
292	600816	建元信托	173,000	510,350.00	0.15
293	002056	横店东磁	35,808	506,683.20	0.15
294	300146	汤臣倍健	44,900	504,676.00	0.15
295	600095	湘财股份	50,300	504,509.00	0.15
296	600970	中材国际	58,050	498,069.00	0.15
297	600499	科达制造	50,600	495,880.00	0.15
298	002423	中粮资本	40,500	495,315.00	0.15
299	603927	中科软	25,572	494,562.48	0.14
300	000062	深圳华强	18,400	494,224.00	0.14
301	601880	辽港股份	329,422	494,133.00	0.14
302	601016	节能风电	170,600	493,034.00	0.14
303	600685	中船防务	18,100	492,139.00	0.14
304	603000	人民网	24,300	491,103.00	0.14
305	301308	江波龙	5,600	489,944.00	0.14
306	000636	风华高科	35,600	489,144.00	0.14
307	300390	天华新能	25,580	487,810.60	0.14
308	601611	中国核建	53,000	487,070.00	0.14
309	000958	电投产融	71,000	485,640.00	0.14
310	603298	杭叉集团	23,100	483,945.00	0.14
311	601666	平煤股份	65,300	483,873.00	0.14
312	600511	国药股份	16,592	483,822.72	0.14
313	300212	易华录	22,220	483,507.20	0.14
314	000563	陕国投 A	134,832	481,350.24	0.14
315	600859	王府井	34,649	481,274.61	0.14

316	603737	三棵树	13,000	479,050.00	0.14
317	000155	川能动力	48,700	478,234.00	0.14
318	688297	中无人机	8,951	477,983.40	0.14
319	601456	国联民生	46,100	477,135.00	0.14
320	603077	和邦生物	271,580	475,265.00	0.14
321	600655	豫园股份	85,600	475,080.00	0.14
322	600004	白云机场	52,000	473,200.00	0.14
323	000598	兴蓉环境	65,600	472,976.00	0.14
324	300677	英科医疗	19,960	472,652.80	0.14
325	601966	玲珑轮胎	32,200	472,374.00	0.14
326	600483	福能股份	48,900	471,396.00	0.14
327	600325	华发股份	96,775	471,294.25	0.14
328	688301	奕瑞科技	5,362	469,764.82	0.14
329	603156	养元饮品	22,200	469,752.00	0.14
330	603899	晨光股份	16,200	469,638.00	0.14
331	002773	康弘药业	16,200	469,314.00	0.14
332	688520	神州细胞	7,831	468,685.35	0.14
333	600131	国网信通	26,400	467,280.00	0.14
334	601958	金钼股份	42,600	466,044.00	0.14
335	600378	昊华科技	17,000	460,190.00	0.13
336	000050	深天马 A	54,000	460,080.00	0.13
337	600663	陆家嘴	51,900	459,834.00	0.13
338	600282	南钢股份	108,400	455,280.00	0.13
339	300529	健帆生物	21,100	455,127.00	0.13
340	002507	涪陵榨菜	35,565	454,876.35	0.13
341	002756	永兴材料	14,300	454,025.00	0.13
342	000987	越秀资本	66,180	453,994.80	0.13
343	000951	中国重汽	25,800	453,564.00	0.13
344	600271	航天信息	48,900	451,836.00	0.13
345	600598	北大荒	31,300	451,346.00	0.13
346	600754	锦江酒店	20,100	451,044.00	0.13
347	601001	晋控煤业	36,800	449,696.00	0.13
348	300601	康泰生物	29,500	448,105.00	0.13
349	301536	星宸科技	7,400	446,220.00	0.13
350	000559	万向钱潮	58,100	444,465.00	0.13
351	600739	辽宁成大	40,400	444,400.00	0.13
352	600737	中粮糖业	47,000	444,150.00	0.13
353	688234	天岳先进	7,568	443,106.40	0.13
354	601918	新集能源	68,300	441,218.00	0.13
355	688363	华熙生物	8,507	436,834.45	0.13
356	002429	兆驰股份	99,500	435,810.00	0.13
357	600582	天地科技	72,745	435,742.55	0.13
358	300751	迈为股份	6,200	431,272.00	0.13

359	603290	斯达半导	5,300	430,731.00	0.13
360	601333	广深铁路	149,000	430,610.00	0.13
361	300070	碧水源	95,600	430,200.00	0.13
362	688772	珠海冠宇	29,994	428,614.26	0.13
363	002120	韵达股份	63,700	426,790.00	0.13
364	601866	中远海发	172,700	426,569.00	0.12
365	600566	济川药业	16,200	426,546.00	0.12
366	603728	鸣志电器	7,400	425,278.00	0.12
367	600764	中国海防	12,500	425,000.00	0.12
368	003031	中瓷电子	7,980	424,615.80	0.12
369	601231	环旭电子	29,000	424,270.00	0.12
370	300735	光弘科技	16,900	424,190.00	0.12
371	600867	通化东宝	51,700	423,940.00	0.12
372	002430	杭氧股份	21,700	421,414.00	0.12
373	300888	稳健医疗	10,240	420,864.00	0.12
374	603688	石英股份	11,900	419,118.00	0.12
375	600329	达仁堂	12,562	419,068.32	0.12
376	603341	龙旗科技	10,300	418,489.00	0.12
377	600258	首旅酒店	29,500	416,835.00	0.12
378	601098	中南传媒	31,600	414,592.00	0.12
379	688778	厦钨新能	7,406	414,143.52	0.12
380	600995	南网储能	42,200	412,716.00	0.12
381	688561	奇安信-U	12,072	410,206.56	0.12
382	688676	金盘科技	12,200	408,090.00	0.12
383	600707	彩虹股份	63,100	407,626.00	0.12
384	601212	白银有色	130,100	407,213.00	0.12
385	000032	深桑达 A	20,000	404,600.00	0.12
386	000027	深圳能源	62,700	400,026.00	0.12
387	600578	京能电力	88,300	396,467.00	0.12
388	002508	老板电器	20,800	395,408.00	0.12
389	603858	步长制药	24,300	394,632.00	0.12
390	000709	河钢股份	181,600	392,256.00	0.11
391	603529	爱玛科技	11,400	392,160.00	0.11
392	002299	圣农发展	27,400	391,546.00	0.11
393	300573	兴齐眼药	7,560	391,532.40	0.11
394	688318	财富趋势	3,400	390,728.00	0.11
395	600906	财达证券	57,100	389,422.00	0.11
396	000967	盈峰环境	55,700	387,115.00	0.11
397	000883	湖北能源	85,700	386,507.00	0.11
398	600517	国网英大	75,400	384,540.00	0.11
399	002670	国盛金控	25,520	384,076.00	0.11
400	002831	裕同科技	16,360	383,151.20	0.11
401	301498	乖宝宠物	3,500	382,795.00	0.11

402	600848	上海临港	42,100	381,847.00	0.11
403	600546	山煤国际	43,600	380,628.00	0.11
404	601399	国机重装	126,800	380,400.00	0.11
405	600959	江苏有线	109,900	378,056.00	0.11
406	601928	凤凰传媒	33,600	375,312.00	0.11
407	601156	东航物流	27,900	365,211.00	0.11
408	600968	海油发展	89,300	364,344.00	0.11
409	600808	马钢股份	105,300	363,285.00	0.11
410	300595	欧普康视	23,700	361,899.00	0.11
411	600528	中铁工业	48,800	360,144.00	0.11
412	000825	太钢不锈	100,300	360,077.00	0.11
413	000739	普洛药业	25,700	359,800.00	0.11
414	603225	新凤鸣	33,520	356,988.00	0.10
415	002572	索菲亚	25,400	355,854.00	0.10
416	601118	海南橡胶	75,200	354,944.00	0.10
417	601636	旗滨集团	70,800	354,708.00	0.10
418	301301	川宁生物	29,400	353,976.00	0.10
419	002266	浙富控股	114,640	353,091.20	0.10
420	603565	中谷物流	36,900	352,395.00	0.10
421	601608	中信重工	80,500	351,785.00	0.10
422	600977	中国电影	32,800	351,616.00	0.10
423	600801	华新水泥	29,530	349,635.20	0.10
424	000543	皖能电力	49,800	348,600.00	0.10
425	600871	石化油服	178,500	348,075.00	0.10
426	688563	航材股份	6,095	345,159.85	0.10
427	600062	华润双鹤	18,312	341,701.92	0.10
428	601598	中国外运	69,300	341,649.00	0.10
429	603650	彤程新材	10,600	340,790.00	0.10
430	600056	中国医药	32,912	340,310.08	0.10
431	688387	信科移动-U	60,060	339,339.00	0.10
432	000582	北部湾港	40,900	337,425.00	0.10
433	601106	中国一重	120,500	337,400.00	0.10
434	000785	居然智家	109,400	333,670.00	0.10
435	300957	贝泰妮	7,500	331,650.00	0.10
436	688702	盛科通信-U	5,400	329,832.00	0.10
437	603233	大参林	20,064	327,043.20	0.10
438	600925	苏能股份	60,600	316,938.00	0.09
439	600373	中文传媒	30,700	315,289.00	0.09
440	601965	中国汽研	17,700	314,175.00	0.09
441	002153	石基信息	36,022	311,950.52	0.09
442	000429	粤高速 A	23,000	306,590.00	0.09
443	000537	中绿电	36,400	304,304.00	0.09
444	600606	绿地控股	185,200	301,876.00	0.09

445	002372	伟星新材	28,020	290,287.20	0.09
446	688281	华秦科技	4,792	289,963.92	0.08
447	601568	北元集团	69,800	289,670.00	0.08
448	600098	广州发展	46,200	288,750.00	0.08
449	600361	创新新材	72,200	288,078.00	0.08
450	001286	陕西能源	33,000	287,100.00	0.08
451	688425	铁建重工	70,274	286,717.92	0.08
452	603658	安图生物	7,618	285,675.00	0.08
453	003022	联泓新科	17,600	278,608.00	0.08
454	600612	老凤祥	5,600	278,600.00	0.08
455	600688	上海石化	96,600	275,310.00	0.08
456	688349	三一重能	10,884	271,446.96	0.08
457	000937	冀中能源	46,600	267,950.00	0.08
458	301165	锐捷网络	4,240	260,590.40	0.08
459	601019	山东出版	27,500	260,425.00	0.08
460	000898	鞍钢股份	104,900	243,368.00	0.07
461	002608	江苏国信	33,200	243,356.00	0.07
462	601139	深圳燃气	38,000	241,680.00	0.07
463	688100	威胜信息	6,500	240,825.00	0.07
464	600339	中油工程	73,600	240,672.00	0.07
465	600032	浙江新能	31,700	239,652.00	0.07
466	603707	健友股份	21,289	237,372.35	0.07
467	688248	南网科技	7,456	234,565.76	0.07
468	600720	中交设计	30,300	234,219.00	0.07
469	000959	首钢股份	68,300	232,220.00	0.07
470	600928	西安银行	58,600	229,712.00	0.07
471	003035	南网能源	50,000	229,500.00	0.07
472	600295	鄂尔多斯	26,100	227,331.00	0.07
473	688032	禾迈股份	2,235	223,187.10	0.07
474	002461	珠江啤酒	19,500	220,155.00	0.06
475	603556	海兴电力	8,600	219,042.00	0.06
476	688475	萤石网络	6,910	217,803.20	0.06
477	601228	广州港	66,300	214,149.00	0.06
478	301267	华夏眼科	11,100	212,787.00	0.06
479	688172	燕东微	10,638	209,143.08	0.06
480	688375	国博电子	3,381	202,893.81	0.06
481	603786	科博达	3,600	199,476.00	0.06
482	600927	永安期货	12,800	189,568.00	0.06
483	601061	中信金属	23,700	187,467.00	0.05
484	002563	森马服饰	35,500	186,730.00	0.05
485	600007	中国国贸	8,900	183,162.00	0.05
486	000539	粤电力 A	39,200	177,968.00	0.05
487	002945	华林证券	11,900	171,003.00	0.05

488	600299	安迪苏	17,700	170,805.00	0.05
489	688819	天能股份	6,144	170,557.44	0.05
490	603826	坤彩科技	8,640	169,084.80	0.05
491	300140	节能环保	27,300	168,441.00	0.05
492	001213	中铁特货	39,100	158,746.00	0.05
493	601921	浙版传媒	19,600	157,976.00	0.05
494	601858	中国科传	7,000	136,150.00	0.04
495	688153	唯捷创芯	3,883	120,411.83	0.04
496	601158	重庆水务	25,300	117,392.00	0.03
497	600956	新天绿能	13,600	104,992.00	0.03
498	001389	广合科技	1,700	99,909.00	0.03
499	688295	中复神鹰	4,470	92,976.00	0.03
500	603868	飞科电器	2,100	75,327.00	0.02

### 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	688411	海博思创	560	46,754.40	0.01
2	688775	影石创新	251	31,164.16	0.01
3	301458	钧崴电子	701	23,911.11	0.01
4	688545	兴福电子	833	22,449.35	0.01
5	688583	思看科技	227	18,087.36	0.01
6	301275	汉朔科技	315	17,699.85	0.01
7	301678	新恒汇	382	17,014.28	0.00
8	301602	超研股份	658	16,318.40	0.00
9	001388	信通电子	937	15,385.54	0.00
10	001391	国货航	2,282	15,357.86	0.00
11	301479	弘景光电	182	14,172.34	0.00
12	301535	浙江华远	734	13,938.66	0.00
13	688757	胜科纳米	536	13,903.84	0.00
14	688758	赛分科技	777	13,185.69	0.00
15	301501	恒鑫生活	284	12,842.48	0.00
16	301662	宏工科技	143	11,797.50	0.00
17	301601	惠通科技	342	11,576.70	0.00
18	603072	天和磁材	209	11,380.05	0.00
19	001356	富岭股份	709	10,237.96	0.00
20	301590	优优绿能	73	10,182.04	0.00
21	301658	首航新能	437	10,042.26	0.00
22	301665	泰禾股份	393	8,799.27	0.00
23	688755	汉邦科技	203	7,983.99	0.00
24	301173	毓恬冠佳	173	7,781.54	0.00
25	001382	新亚电缆	366	7,396.86	0.00
26	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00

27	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
28	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
29	603014	威高血净	155	5,065.40	0.00
30	603210	泰鸿万立	286	4,464.46	0.00
31	603271	永杰新材	126	4,420.08	0.00
32	603202	天有为	48	4,351.68	0.00
33	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00
34	001395	亚联机械	80	3,780.00	0.00
35	603409	汇通控股	100	3,332.00	0.00
36	603257	中国瑞林	78	2,922.66	0.00
37	603400	华之杰	57	2,497.17	0.00
38	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00
39	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00
40	603120	肯特催化	65	2,172.95	0.00
41	400174	中天 3	377,100	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	688608	恒玄科技	1,407,050.56	0.38
2	688235	百济神州-U	1,306,736.43	0.36
3	000933	神火股份	1,170,119.00	0.32
4	300450	先导智能	1,073,111.00	0.29
5	002130	沃尔核材	1,003,264.00	0.27
6	300454	深信服	998,725.00	0.27
7	300458	全志科技	987,233.80	0.27
8	600363	联创光电	949,395.00	0.26
9	300346	南大光电	917,329.60	0.25
10	002851	麦格米特	887,083.00	0.24
11	300857	协创数据	875,052.00	0.24
12	300115	长盈精密	872,244.00	0.24
13	605589	圣泉集团	804,539.00	0.22
14	600171	上海贝岭	803,935.00	0.22
15	603659	璞泰来	793,612.00	0.22
16	002007	华兰生物	785,254.00	0.21
17	300627	华测导航	762,309.00	0.21
18	688027	国盾量子	730,494.61	0.20
19	000528	柳工	693,903.00	0.19
20	002837	英维克	690,292.40	0.19

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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600418	江淮汽车	3,716,547.00	1.01
2	002625	光启技术	2,967,798.00	0.81
3	002384	东山精密	2,159,574.00	0.59
4	301236	软通动力	1,569,952.00	0.43
5	302132	中航成飞	1,297,655.00	0.35
6	300866	安克创新	1,189,389.60	0.32
7	688047	龙芯中科	1,103,593.03	0.30
8	002128	电投能源	1,084,854.00	0.30
9	600642	申能股份	865,293.00	0.24
10	601567	三星医疗	823,600.00	0.22
11	688536	思瑞浦	765,914.27	0.21
12	002407	多氟多	697,743.40	0.19
13	603444	吉比特	618,862.00	0.17
14	000818	航锦科技	604,437.00	0.16
15	002487	大金重工	570,987.00	0.16
16	688331	荣昌生物	560,220.71	0.15
17	688005	容百科技	554,813.43	0.15
18	000998	隆平高科	552,391.08	0.15
19	600416	湘电股份	536,126.00	0.15
20	002019	亿帆医药	529,618.00	0.14

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交量）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	45,377,636.34
卖出股票收入（成交）总额	83,130,190.08

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

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：无。

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

注：无。

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

注：无。

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

注：无。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：无。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

## 7.12 投资组合报告附注

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

东吴证券股份有限公司在报告编制日前一年内受到中国证券监督管理委员会的处罚。

胜宏科技(惠州)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梅沙海关的处罚。

苏州银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局江苏监管局的处罚。

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	11,936.95
2	应收清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	56,364.48
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	68,301.43

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

#### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688411	海博思创	46,754.40	0.01	新股流通受限
2	688775	影石创新	31,164.16	0.01	新股流通受限
3	301458	钧崴电子	23,911.11	0.01	新股流通受限
4	688545	兴福电子	22,449.35	0.01	新股流通受限
5	688583	思看科技	18,087.36	0.01	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

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
鹏华中证 500 指数 (LOF) A	24,398	7,458.65	3,839,763.85	2.11	178,136,379.43	97.89
鹏华中证 500 指数 (LOF) C	997	15,003.89	0.00	0.00	14,958,877.91	100.00
鹏华中证 500 指数 (LOF) I	94	2,835.35	0.00	0.00	266,522.66	100.00
合计	25,489	7,736.73	3,839,763.85	1.95	193,361,780.00	98.05

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

鹏华中证 500 指数 (LOF) A

第 65 页 共 71 页

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	赵建伟	448,372.00	9.96
2	施红梅	196,914.00	4.38
3	陈吉荃	150,042.00	3.33
4	鹿敏理	119,003.00	2.64
5	赵丽丽	100,017.00	2.22
6	张碧云	100,003.00	2.22
7	于兆瑞	90,403.00	2.01
8	汪心红	90,005.00	2.00
9	王曦	90,000.00	2.00
10	葛春萍	79,004.00	1.76

注：持有人为场内持有人。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	鹏华中证 500 指数 (LOF) A	24,849.57	0.0137
	鹏华中证 500 指数 (LOF) C	73,668.34	0.4925
	鹏华中证 500 指数 (LOF) I	233.12	0.0875
	合计	98,751.03	0.0501

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

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

注：截至本报告期末，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

项目	鹏华中证 500 指数 (LOF) A	鹏华中证 500 指数 (LOF) C	鹏华中证 500 指数 (LOF) I
基金合同生效日（2010 年 2 月 5 日）基金份额总额	2,630,723,634.12	-	-
本报告期期初基金份额总额	200,743,415.23	20,708,525.70	500.00
本报告期基金	14,574,488.43	11,718,891.69	418,354.91

总申购份额			
减：本报告期基金总赎回份额	33,341,760.38	17,468,539.48	152,332.25
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	181,976,143.28	14,958,877.91	266,522.66

## § 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：

无。

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

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	71,381,859.17	56.27	13,269.80	56.27	-
银河证券	1	34,114,598.40	26.89	6,340.88	26.89	-
广发证券	1	21,365,807.26	16.84	3,973.14	16.85	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-

注：交易单元选择的标准和程序：

1. 根据《公开募集证券投资基金管理费用管理规定》(以下简称《规定》)，基金管理人制定了相应的管理制度规范交易单元选择的标准和程序。基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券公司，选择标准包括：财务状况良好，经营行为规范；有完备的合规管理流程和制度，风险控制能力较强；研究、交易等服务能力较强，交易设施能够为投资组合提供有效的交易执行；中国证监会或有权机关规定的其他条件等。

2. 选择程序如下：

- (1) 基金管理人根据上述标准评估并确定选用的证券公司；
- (2) 基金管理人与提供证券交易服务的证券公司签订协议，并办理开立交易账户等事宜；
- (3) 基金管理人定期对证券公司进行评价，依据评价结果选择交易单元。

3. 根据《规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率；其他类型基金股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍。

4. 国泰海通会商并获得上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所、全国中小企业股份转让系统、中国结算、各签约存管银行及基金管理公司等相关单位的协同支持，拟定于 2025 年 9 月 12 日的日终清算后，于上述单位实施法人切换、客户及业务迁移合并，将原海通证券的客户及业务迁移合并入国泰海通。截止本报告期末，原租用海通证券、国泰君安的交易单元未完成迁移合并，故本表列示的海通证券、国泰君安数据包含本基金在本报告期内通过原交易单元交易的情况。

#### 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	债券交易	债券回购交易	权证交易
-----	------	--------	------

称 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	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后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/或中国证监会基金电子披露网站	2025 年 01 月 04 日
2	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025 年 01 月 15 日
3	鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 2024 年第 4 季度报告	《中国证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025 年 01 月 21 日
4	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025 年 02 月 08 日
5	鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 2024 年年度报告	《中国证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025 年 03 月 28 日
6	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025 年 04 月 12 日
7	鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 2025 年第 1 季度报告	《中国证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025 年 04 月 21 日

		站	
8	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金变更 I 类基金份额登记机构的提示性公告	《中国证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025 年 05 月 28 日
9	鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同	《中国证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025 年 06 月 06 日
10	鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 托管协议	《中国证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025 年 06 月 06 日
11	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金 I 类基金份额登记机构变更完成并修改基金合同和托管协议的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025 年 06 月 06 日
12	鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 更新的招募说明书 (2025 年第 1 号)	《中国证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025 年 06 月 11 日
13	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与招商证券股份有限公司申购 (含定期定额投资) 费率优惠活动的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025 年 06 月 30 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

注：无。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (一) 《鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》；
- (二) 《鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 托管协议》；
- (三) 《鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 2025 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

2025 年 8 月 28 日