

鹏华中证 A500 交易型开放式指数证券投资
基金
2026 年中期报告

2026 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2026 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 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 2026 年 01 月 01 日起至 2026 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	12
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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	56
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	56
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	56

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	56
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	56
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	57
7.12 投资组合报告附注	57
§ 8 基金份额持有人信息	58
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	58
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	58
8.3 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	58
§ 9 开放式基金份额变动	58
§ 10 重大事件揭示	59
10.1 基金份额持有人大会决议	59
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	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	59
10.4 基金投资策略的改变	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	59
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	59
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	60
10.8 其他重大事件	61
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	62
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	62
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	62
§ 12 备查文件目录	62
12.1 备查文件目录	62
12.2 存放地点	62
12.3 查阅方式	63

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	鹏华中证 A500ETF
场内简称	A500(扩位简称:A500ETF 鹏华)
基金主代码	512020
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2024 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	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	941,012,667.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2024 年 12 月 2 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。本基金力争将日均跟踪偏离度控制在 0.2%以内，年跟踪误差控制在 2%以内。
投资策略	本基金采取完全复制策略，即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化对股票投资组合进行相应调整。 当预期成份股发生调整或成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。 本基金力争将日均跟踪偏离度控制在 0.2%以内，年跟踪误差控制在 2%以内。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。 1、股票投资策略 （1）股票投资组合的构建 本基金在建仓期内，将按照标的指数各成份股的基准权重对其逐步买入，在力求跟踪误差最小化的前提下，本基金可采取适当方法，以降低买入成本。当遇到成份股停牌、流动性不足等其他市场因素而无法依指数权重购买某成份股及预期标的指数的成份股即将调整或其他影响指数复制的因素时，本基金可以根据市场情况，结合研究分析，对基金财产进行适当调整，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。 （2）股票投资组合的调整

	本基金所构建的股票投资组合将根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况，对其进行适时调整，以保证基金份额净值增长率与标的指数同期增长率间的高度正相关和跟踪误差最小化。基金管理人将对成份股的流动性进行分析，如发现流动性欠佳的个股将可能采用合理方法寻求替代。由于受到各项持股比例限制，基金可能不能按照成份股权重持有成份股，基金将会采用合理方法寻求替代。 1) 定期调整 根据标的指数的调整规则和备选股票的预期，对股票投资组合及时进行调整。 2) 不定期调整 根据指数编制规则，当标的指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重新调整时，本基金将根据各成份股的权重变化进行相应调整； 根据本基金的申购和赎回情况，对股票投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数； 根据法律、法规规定，成份股在标的指数中的权重因其它特殊原因发生相应变化的，本基金可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。 2、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。 3、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。 本基金可投资可转换债券及可交换债券，可转换债券及可交换债券兼具债权和股权双重属性，本基金将通过对目标公司股票的投资价值分析和债券价值分析综合开展投资决策，力争增强本基金的收益。 4、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。 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。 6、融资及转融通投资策略 本基金可在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素基础上，参与融资业务。 为更好地实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎经营原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与转融通证券出借业务。本基金将在分析市场环境、投资者类型与结构、基金历史申赎情况、出借证券流动性情况等因素的基础上，合理确定出借证券的范围、期限和比例。 未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，本基金可在履行适当程序后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。
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。同时本基金为交易型开放式指数基金，具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。

注：无。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		鹏华基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	高永杰	王小飞
	联系电话	0755-81395402	021-60637103
	电子邮箱	xxpl@phfund.com.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		4006788533	021-60637228
传真		0755-82021126	021-60635778
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	北京市西城区金融大街 25 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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		518048	100033
法定代表人		张纳沙	张金良

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.phfund.com.cn
基金中期报告置备地点	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(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	286,130,971.03
本期利润	214,645,502.59
加权平均基金份额本期利润	0.1721
本期加权平均净值利润率	13.07%
本期基金份额净值增长率	12.84%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	368,111,481.74
期末可供分配基金份额利润	0.3912
期末基金资产净值	1,333,400,843.99
期末基金份额净值	1.4170
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	41.70%

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。

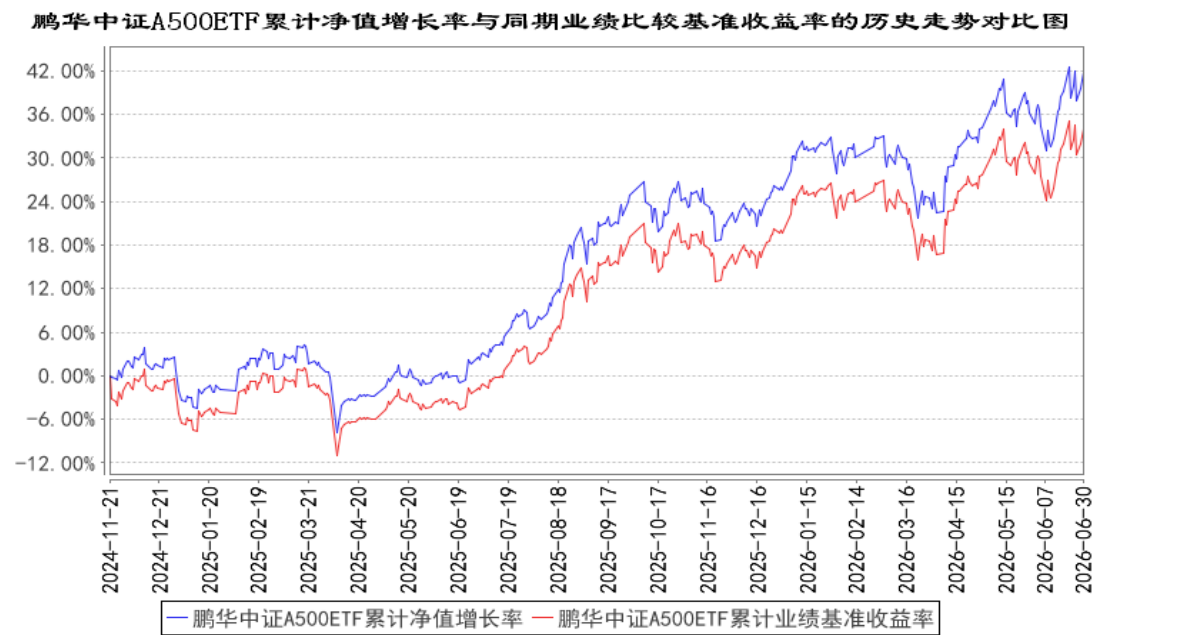
3.2 基金净值表现

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
过去三个月	15.19%	1.39%	14.26%	1.41%	0.93%	-0.02%
过去六个月	12.84%	1.27%	11.91%	1.29%	0.93%	-0.02%
过去一年	38.45%	1.13%	36.38%	1.14%	2.07%	-0.01%
自基金合同生效起至今	41.70%	1.09%	33.91%	1.13%	7.79%	-0.04%

注：业绩比较基准=中证 A500 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



注：1、本基金基金合同于 2024 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，公司管理资产总规模为 15,047 亿元，公司管理着 410 只公募基金，23 只社保基金、养老基金及划转资本组合。历经二十余年基金投资管理实践，公司在基金投资运作、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	2024-11-21	-	9 年	余展昌先生, 国籍中国, 金融硕士, 9 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总经理助理/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基金经理, 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基金经理, 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 2026 年 03 月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 2025 年 01 月担任鹏华中证 A500 指数证券投资基金基金经理, 2025 年 01 月至今担任鹏华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理, 2025 年 01 月至 2025 年 03 月担任鹏华上证 180 指数发起式证券投资基金基金经理, 2025 年 01 月至 2026 年 03 月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 03 月至今担任鹏华上证 180 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，2025 年 07 月至今担任鹏华恒生交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2025 年 09 月至今担任鹏华标普港股通低波红利交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2026 年 05 月至今担任鹏华恒生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. 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：本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

本报告期内，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%的交易共有 1 次，为投资组合的投资策略需要而发生的同日反向交易。

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。本报告期内，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

差的主要来源分为几个方面，包括成分股的调整、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 ETF 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。

指数表现方面，中证 A500 指数在 2026 年的指数表现较优。2026 年元旦后，市场风险偏好明显有所提升，增量资金入市，热点频出，科技和周期是两大主线，受到了资金的青睐，市场的成交量也稳步上升。3 月份受到美伊战争的冲突，A 股市场尤其是科技板块回调明显，但随着美伊矛盾逐步缓和叠加海内外科技链条的业绩释放，大盘指数在科技板块的带动下迅速修复，而 A500 由于科技占比较沪深 300 等指数更高，所以指数表现更优。

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 12.84%，同期业绩比较基准增长率为 11.91%。

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，2026 年上半年国内经济整体平稳运行，GDP 同比增长 4.7%，呈现一季度走强、二季度小幅放缓态势，整体处于年度增长目标区间。经济结构分化特征突出，高技术制造、外贸出口、线下服务消费构成核心支撑，地产链、传统内需修复偏慢，工业企业盈利持续改善，物价温和回升，政策端持续发力稳内需、培育新质生产力，对冲传统行业下行压力，经济向好基础仍在巩固。

从证券市场角度看，年初在科技和周期的双轮驱动下，A 股市场一路上扬，但随着美伊冲突有所回落。二季度随着美伊冲突的缓和叠加海内外科技产业的业绩释放，大盘指数在科技带动下创下新高。一方面，当前处于科技产业革命爆发阶段，只要相关产业需求能提供强支撑，科技板块的估值或能维持，但短期需要警惕交易拥挤度过高带来的流动性风险。另一方面，传统消费、地产等板块仍需要更强有力的政策支撑才能带来好转，但估值已经较低。三季度市场风格或在科技高位震荡后恢复均衡，但指数级别的上涨仍有待基本面和政策面的驱动。

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 368,111,481.74 元，期末基金份额净值 1.4170 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 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 A500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	11,898,197.25	73,925,957.77
结算备付金		121,287.53	120,680.05
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	1,322,202,639.97	2,166,519,108.63
其中：股票投资		1,322,202,639.97	2,166,519,108.63
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		29,357.36	4,947,045.85
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	60,492.63	-
资产总计		1,334,311,974.74	2,245,512,792.30
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-

应付管理人报酬		161,273.41	350,670.89
应付托管费		53,757.81	116,890.29
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	696,099.53	19,752,777.18
负债合计		911,130.75	20,220,338.36
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	941,012,667.00	1,772,012,667.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	392,388,176.99	453,279,786.94
净资产合计		1,333,400,843.99	2,225,292,453.94
负债和净资产总计		1,334,311,974.74	2,245,512,792.30

注： 报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.4170 元，基金份额总额 941,012,667.00 份。

6.2 利润表

会计主体：鹏华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		216,440,513.88	115,600,616.50
1. 利息收入		19,423.67	76,248.41
其中：存款利息收入	6.4.7.13	19,423.67	76,248.41
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		-	-
2. 投资收益（损失以 “-” 填列）		287,230,670.52	38,533,903.91
其中：股票投资收益	6.4.7.14	275,293,330.48	-7,885,822.42
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	11,937,340.04	46,419,726.33
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	-71,485,468.44	77,173,064.51
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	675,888.13	-182,600.33
减：二、营业总支出		1,795,011.29	4,279,336.21
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,225,745.73	3,075,771.80
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	408,581.88	1,025,257.20
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		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	160,683.68	178,307.21
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		214,645,502.59	111,321,280.29
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		214,645,502.59	111,321,280.29
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		214,645,502.59	111,321,280.29

6.3 净资产变动表

会计主体：鹏华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 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, 772, 012, 667.00	-	453, 279, 786. 94	2, 225, 292, 453. 94
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1, 772, 012, 667.00	-	453, 279, 786. 94	2, 225, 292, 453. 94
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-	-	-60, 891, 609. 95	-891, 891, 609. 95
831, 000, 000. 00				
(一)、综合收益总额	-	-	214, 645, 502. 59	214, 645, 502. 59
(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)	-	-	-	-
831, 000, 000. 00			275, 537, 112. 54	1, 106, 537, 112. 54
其中：1. 基金申购款	252, 000, 000. 00	-	78, 158, 980. 65	330, 158, 980. 65
2. 基金赎回款	-	-	-	-
1, 083, 000, 000. 00			353, 696, 093. 19	1, 436, 696, 093. 19
(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	941, 012, 667. 00	-	392, 388, 176. 99	1, 333, 400, 843. 99
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	3, 764, 012, 667. 00	-	30, 019, 135. 19	3, 794, 031, 802. 19

资产	00			9
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	3,764,012,667.00	-	30,019,135.19	3,794,031,802.19
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	- 225,000,000.00	-	53,197,333.22	-171,802,666.78
(一)、综合收益总额	-	-	111,321,280.29	111,321,280.29
(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)	- 225,000,000.00	-	-58,123,947.07	-283,123,947.07
其中：1. 基金申购款	2,736,000,000.00	-	-59,291,016.53	2,676,708,983.47
2. 基金赎回款	- 2,961,000,000.00	-	1,167,069.46	- 2,959,832,930.54
(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	3,539,012,667.00	-	83,216,468.41	3,622,229,135.41

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 A500 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[2024]1527 号《关于准予鹏华中证 A500 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 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,999,999,403.00 元(含募集股票市值),业经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)德师报(验)字(24)第 00226 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2024 年 11 月 21 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 2,000,012,667.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 13,264.00 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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号—定期报告的内容与格式》、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《公开募集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》和《证券投资基金会计核算业务指引》、《鹏华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》以及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 2026 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 2026 年 06 月 30 日的财务状况以及 2026 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

根据国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》和财政部、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[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》、财税[2025] 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》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，截至 2027 年 12 月 31 日适用简易计税方法，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，截至 2027 年 12 月 31 日免征增值税；对金融同业往来利息收入，截至 2027 年 12 月 31 日免征增值税；自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。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 2026 年 6 月 30 日
活期存款	1,221,058.53
等于：本金	1,220,806.73
加：应计利息	251.80
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	10,677,138.72
等于：本金	10,677,002.12
加：应计利息	136.60
减：坏账准备	-
合计	11,898,197.25

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		1,085,952,479.70	-	1,322,202,639.97	236,250,160.27
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		1,085,952,479.70	-	1,322,202,639.97	236,250,160.27

注：股票投资的公允价值和股票投资的公允价值变动均含可退替代款估值增值。

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

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	60,492.63
合计	60,492.63

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 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	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	98,185.26
应退替代款	532,520.05

可退替代款	24,862.32
其他	40,531.90
合计	696,099.53

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,772,012,667.00	1,772,012,667.00
本期申购	252,000,000.00	252,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-1,083,000,000.00	-1,083,000,000.00
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	941,012,667.00	941,012,667.00

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	299,801,683.95	153,478,102.99	453,279,786.94
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	299,801,683.95	153,478,102.99	453,279,786.94
本期利润	286,130,971.03	-71,485,468.44	214,645,502.59
本期基金份额交易产生的变动数	-217,821,173.24	-57,715,939.30	-275,537,112.54
其中：基金申购款	68,725,072.24	9,433,908.41	78,158,980.65
基金赎回款	-286,546,245.48	-67,149,847.71	-353,696,093.19
本期已分配利润	-	-	-
本期末	368,111,481.74	24,276,695.25	392,388,176.99

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	15,214.69

定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	3,601.50
结算备付金利息收入	607.48
其他	-
合计	19,423.67

注：1、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。
2、其他存款利息收入为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金的利息收入。

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 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	194,269,871.04
股票投资收益——赎回差价收入	81,023,459.44
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	275,293,330.48

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 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出股票成交总额	955,354,354.20
减：卖出股票成本总额	760,246,021.10
减：交易费用	838,462.06
买卖股票差价收入	194,269,871.04

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 2026年1月1日至2026年6月30日
赎回基金份额对价总额	1,436,696,093.19
减：现金支付赎回款总额	691,909,195.19
减：赎回股票成本总额	663,763,438.56
减：交易费用	-
赎回差价收入	81,023,459.44

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	11,937,340.04
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	11,937,340.04

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-71,485,468.44
股票投资	-71,485,468.44
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	-71,485,468.44

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	675,888.13
合计	675,888.13

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	28,760.90
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费用	2,991.05
登记结算费	59,507.37
IOPV 计算和发布费	9,916.99
合计	160,683.68

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、关联关系

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
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	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 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“鹏华中证 A500ETF 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

注：无。

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

注：无。

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,225,745.73	3,075,771.80
其中：应支付销售机构的客户维 护费	119,513.22	240,516.45
应支付基金管理人的净管理费	1,106,232.51	2,835,255.35

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	408,581.88	1,025,257.20

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.05%的年费率计提，逐日累

计至每月月底，按月支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.05%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：无。

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

注：无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2024 年 11 月 21 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	8,450,600.00	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	8,450,600.00	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.8980%	-

注：本基金管理人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。

6.4.10.5.2 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 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）

国信证券	1,327,800.00	0.14	799,900.00	0.05
鹏华中证 A500ETF联接	382,166,748.00	40.61	311,821,206.00	17.60

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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
中国建设银行	1,221,058.53	15,214.69	14,161,876.58	33,161.19

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

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（2026 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
001220	世盟股份	2026 年 1 月 27 日	6 个月	新股流通受限	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-
001399	惠科股份	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通受限	10.12	27.73	6,241	63,158.92	173,062.93	-
301513	尚水智能	2026 年 4 月 10 日	6 个月	新股流通受限	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-

301531	春光集团	2026年4月28日	6个月	新股流通受限	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
301599	理奇智能	2026年4月22日	6个月	新股流通受限	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-
301666	大普微-UW	2026年4月8日	6个月	新股流通受限	46.08	463.33	1,220	56,217.60	565,262.60	-
301683	慧谷新材	2026年3月24日	6个月	新股流通受限	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	-
301696	三瑞智能	2026年3月31日	6个月	新股流通受限	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
603284	林平发展	2026年2月3日	6个月	新股流通受限	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-
603293	埃泰克	2026年4月9日	6个月	新股流通受限	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
603407	长裕集团	2026年4月29日	6个月	新股流通受限	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-
603459	红板科技	2026年3月31日	6个月	新股流通受限	17.70	84.32	330	5,841.00	27,825.60	-
688635	长进光子	2026年5月20日	6个月	新股流通受限	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-
688712	北芯生命	2026年1月28日	6个月	新股流通受限	17.52	35.92	1,500	26,280.00	53,880.00	-

688797	臻宝科技	2026年6月16日	6个月	新股流通受限	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-
688808	联讯仪器	2026年4月16日	6个月	新股流通受限	81.88	1,584.33	163	13,346.44	258,245.79	-
688811	有研复材	2026年4月1日	6个月	新股流通受限	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-
688816	易思维	2026年2月4日	6个月	新股流通受限	55.95	57.10	177	9,903.15	10,106.70	-

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
688072	拓荆科技	2026年6月29日	重大事项	832.00	2026年7月13日	890.99	7,884	2,146,960.25	6,559,488.00	-

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

注：无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数型基金。本基金主要投资于标的指数成份股（含存托凭证）、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国内依法发行或上市交易的其他非成份股（包含主板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、存托凭证、债券（含国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、政府支持机构债、地方政府债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券及其他中国证监会允许基金投资的债券）、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款等）、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）。本基金可根据相关法律法规和基金合同的约定，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，基金管理人将在履行适当程序后，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建设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 2026 年 06 月 30 日，本基金未持有信用类债券（2025 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 2026 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%。

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 2026 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	11,898,197.25	-	-	-	11,898,197.25
结算备付金	121,287.53	-	-	-	121,287.53
交易性金融资产	-	-	-	1,322,202,639.97	1,322,202,639.97
应收清算款	-	-	-	29,357.36	29,357.36
其他资产	-	-	-	60,492.63	60,492.63
资产总计	12,019,484.78	-	-	1,322,292,489.96	1,334,311,974.74
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	161,273.41	161,273.41
应付托管费	-	-	-	53,757.81	53,757.81
其他负债	-	-	-	696,099.53	696,099.53
负债总计	-	-	-	911,130.75	911,130.75
利率敏感度缺口	12,019,484.78	-	-	1,321,381,359.21	1,333,400,843.99
上年度末 2025 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	73,925,957.77	-	-	-	73,925,957.77
结算备付金	120,680.05	-	-	-	120,680.05
交易性金融资产	-	-	-	2,166,519,108.63	2,166,519,108.63
应收清算款	-	-	-	4,947,045.85	4,947,045.85
资产总计	74,046,637.82	-	-	2,171,466,154.48	2,245,512,792.30
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	350,670.89	350,670.89
应付托管费	-	-	-	116,890.29	116,890.29
其他负债	-	-	-	19,752,777.18	19,752,777.18
负债总计	-	-	-	20,220,338.36	20,220,338.36
利率敏感度缺口	74,046,637.82	-	-	2,151,245,816.12	2,225,292,453.94

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 2026 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（含存托凭证）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，经基金管理人履行适当程序后以变更后的比例为准，本基金的投资比例会做相应调整。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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 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	1,322,202,639.97	99.16	2,166,519,108.63	97.36
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	1,322,202,639.97	99.16	2,166,519,108.63	97.36

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（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	比较基准上涨 5% 资产净值变动	65,669,991.57	108,961,445.01
	比较基准下降 5% 资产净值变动	-65,669,991.57	-108,961,445.01

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 2026 年 6 月 30 日
第一层次	1,314,316,003.35
第二层次	6,559,488.00
第三层次	1,327,148.62
合计	1,322,202,639.97

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	1,322,202,639.97	99.09

	其中：股票	1, 322, 202, 639. 97	99. 09
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	12, 019, 484. 78	0. 90
8	其他各项资产	89, 849. 99	0. 01
9	合计	1, 334, 311, 974. 74	100. 00

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

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	4, 156, 319. 99	0. 31
B	采矿业	54, 290, 805. 35	4. 07
C	制造业	932, 993, 541. 60	69. 97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	28, 758, 013. 00	2. 16
E	建筑业	16, 076, 834. 25	1. 21
F	批发和零售业	10, 187, 051. 90	0. 76
G	交通运输、仓储和邮政业	29, 392, 197. 86	2. 20
H	住宿和餐饮业	616, 091. 00	0. 05
I	信息传输、软件和信息技术服务业	73, 806, 169. 47	5. 54
J	金融业	127, 944, 488. 00	9. 60
K	房地产业	7, 379, 832. 00	0. 55
L	租赁和商务服务业	9, 538, 337. 40	0. 72
M	科学研究和技术服务业	15, 766, 522. 00	1. 18
N	水利、环境和公共设施管理业	2, 262, 531. 60	0. 17
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—

P	教育	442,080.00	0.03
Q	卫生和社会工作	2,583,797.00	0.19
R	文化、体育和娱乐业	1,011,943.00	0.08
S	综合	2,383,820.00	0.18
	合计	1,319,590,375.42	98.96

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	2,611,240.09	0.20
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	1,583.46	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	—	—
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	2,612,823.55	0.20

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	300308	中际旭创	44,400	56,388,000.00	4.23
2	300750	宁德时代	105,240	41,360,372.40	3.10
3	300502	新易盛	55,520	33,700,640.00	2.53
4	600519	贵州茅台	24,861	29,472,466.89	2.21
5	603986	兆易创新	26,500	21,597,500.00	1.62
6	601318	中国平安	424,500	20,265,630.00	1.52
7	688256	寒武纪	12,516	19,969,903.80	1.50
8	600036	招商银行	492,870	17,496,885.00	1.31
9	601899	紫金矿业	656,300	16,499,382.00	1.24
10	002371	北方华创	17,235	15,245,391.60	1.14
11	000333	美的集团	193,630	14,624,873.90	1.10
12	002475	立讯精密	203,100	14,298,240.00	1.07
13	688008	澜起科技	45,675	14,154,682.50	1.06
14	688012	中微公司	29,851	13,985,193.50	1.05
15	688041	海光信息	37,026	13,710,727.80	1.03
16	002384	东山精密	51,000	13,379,850.00	1.00
17	600900	长江电力	487,200	12,896,184.00	0.97
18	688981	中芯国际	81,138	12,886,337.16	0.97
19	000725	京东方 A	1,447,600	12,565,168.00	0.94
20	603259	药明康德	98,400	12,251,784.00	0.92
21	601166	兴业银行	674,200	11,164,752.00	0.84
22	600030	中信证券	388,600	11,164,478.00	0.84
23	300059	东方财富	504,000	10,271,520.00	0.77
24	600183	生益科技	58,000	10,057,200.00	0.75
25	600276	恒瑞医药	177,765	9,250,890.60	0.69
26	300274	阳光电源	57,700	9,175,454.00	0.69
27	601398	工商银行	1,288,400	9,108,988.00	0.68
28	300408	三环集团	53,400	8,912,460.00	0.67
29	002594	比亚迪	108,100	8,615,570.00	0.65
30	600487	亨通光电	78,500	8,583,190.00	0.64
31	300476	胜宏科技	24,300	8,418,249.00	0.63
32	002463	沪电股份	53,600	8,190,080.00	0.61
33	601211	国泰海通	449,900	8,188,180.00	0.61
34	300394	天孚通信	26,026	7,877,549.68	0.59
35	688498	源杰科技	4,000	7,544,000.00	0.57
36	688525	佰维存储	15,030	7,435,791.90	0.56
37	000988	华工科技	40,000	7,384,400.00	0.55
38	301308	江波龙	10,200	7,178,760.00	0.54

39	600176	中国巨石	95,600	6,967,328.00	0.52
40	601288	农业银行	1,144,200	6,945,294.00	0.52
41	601328	交通银行	1,062,300	6,830,589.00	0.51
42	000651	格力电器	178,400	6,690,000.00	0.50
43	600522	中天科技	108,700	6,595,916.00	0.49
44	688072	拓荆科技	7,884	6,559,488.00	0.49
45	603019	中科曙光	58,200	6,240,786.00	0.47
46	688521	芯原股份	16,762	6,221,048.68	0.47
47	603993	洛阳钼业	347,600	6,100,380.00	0.46
48	600150	中国船舶	179,723	6,072,840.17	0.46
49	600887	伊利股份	251,900	6,035,524.00	0.45
50	300604	长川科技	17,600	6,008,992.00	0.45
51	600584	长电科技	57,000	5,902,350.00	0.44
52	000338	潍柴动力	214,000	5,831,500.00	0.44
53	000858	五粮液	77,200	5,712,800.00	0.43
54	688347	华虹宏力	16,245	5,463,193.50	0.41
55	601816	京沪高铁	1,169,000	5,295,570.00	0.40
56	600309	万华化学	74,734	5,112,552.94	0.38
57	688120	华海清科	15,768	5,080,134.24	0.38
58	300124	汇川技术	75,400	5,001,282.00	0.38
59	002415	海康威视	145,900	4,989,780.00	0.37
60	002916	深南电路	10,879	4,981,494.10	0.37
61	002281	光迅科技	19,200	4,933,248.00	0.37
62	002008	大族激光	32,800	4,923,608.00	0.37
63	600111	北方稀土	100,700	4,838,635.00	0.36
64	000100	TCL 科技	828,300	4,820,706.00	0.36
65	300857	协创数据	13,700	4,656,630.00	0.35
66	000063	中兴通讯	128,300	4,643,177.00	0.35
67	300136	信维通信	38,500	4,591,125.00	0.34
68	600000	浦发银行	530,500	4,567,605.00	0.34
69	600089	特变电工	201,200	4,527,000.00	0.34
70	601857	中国石油	515,800	4,477,144.00	0.34
71	002028	思源电气	24,720	4,276,560.00	0.32
72	601088	中国神华	109,300	4,267,072.00	0.32
73	300433	蓝思科技	79,200	4,249,872.00	0.32
74	600031	三一重工	236,200	4,081,536.00	0.31
75	300014	亿纬锂能	60,500	3,934,315.00	0.30
76	300475	香农芯创	13,100	3,930,000.00	0.29
77	002050	三花智控	89,100	3,905,253.00	0.29
78	601601	中国太保	136,200	3,884,424.00	0.29
79	000001	平安银行	386,400	3,883,320.00	0.29
80	300223	北京君正	15,400	3,833,060.00	0.29
81	000792	盐湖股份	126,400	3,816,016.00	0.29

82	002714	牧原股份	108,701	3,803,447.99	0.29
83	600549	厦门钨业	44,200	3,765,840.00	0.28
84	002353	杰瑞股份	24,374	3,717,035.00	0.28
85	002156	通富微电	48,300	3,664,521.00	0.27
86	600406	国电南瑞	159,900	3,653,715.00	0.27
87	601668	中国建筑	822,700	3,570,518.00	0.27
88	000657	中钨高新	36,300	3,474,636.00	0.26
89	002436	兴森科技	67,600	3,444,220.00	0.26
90	601919	中远海控	250,000	3,315,000.00	0.25
91	002602	世纪华通	234,800	3,310,680.00	0.25
92	300760	迈瑞医疗	24,100	3,273,503.00	0.25
93	601988	中国银行	570,100	3,260,972.00	0.24
94	600660	福耀玻璃	63,800	3,218,072.00	0.24
95	300054	鼎龙股份	30,300	3,210,891.00	0.24
96	601728	中国电信	618,300	3,208,977.00	0.24
97	603501	豪威集团	33,700	3,196,445.00	0.24
98	601012	隆基绿能	241,380	3,166,905.60	0.24
99	601225	陕西煤业	154,400	3,142,040.00	0.24
100	002230	科大讯飞	76,500	3,124,260.00	0.23
101	600941	中国移动	35,900	3,092,067.00	0.23
102	600690	海尔智家	149,400	3,049,254.00	0.23
103	002352	顺丰控股	95,500	2,985,330.00	0.22
104	688777	中控技术	25,217	2,962,997.50	0.22
105	601985	中国核电	327,600	2,958,228.00	0.22
106	002460	赣锋锂业	44,900	2,936,460.00	0.22
107	002709	天赐材料	56,800	2,921,224.00	0.22
108	603799	华友钴业	60,400	2,914,904.00	0.22
109	300757	罗博特科	4,700	2,909,300.00	0.22
110	002938	鹏鼎控股	27,600	2,908,488.00	0.22
111	300033	同花顺	12,040	2,901,640.00	0.22
112	000977	浪潮信息	40,900	2,863,000.00	0.21
113	600160	巨化股份	53,700	2,846,637.00	0.21
114	002851	麦格米特	16,200	2,708,316.00	0.20
115	300442	润泽科技	32,600	2,708,082.00	0.20
116	000425	徐工机械	326,400	2,640,576.00	0.20
117	000938	紫光股份	91,100	2,629,146.00	0.20
118	002202	金风科技	109,900	2,626,610.00	0.20
119	688126	沪硅产业	65,810	2,625,160.90	0.20
120	601600	中国铝业	315,600	2,594,232.00	0.19
121	600028	中国石化	580,200	2,587,692.00	0.19
122	600938	中国海油	95,199	2,584,652.85	0.19
123	300346	南大光电	27,480	2,546,022.00	0.19
124	600460	士兰微	46,300	2,530,758.00	0.19

125	002600	领益智造	145,500	2,522,970.00	0.19
126	002466	天齐锂业	41,100	2,520,252.00	0.19
127	601766	中国中车	484,400	2,518,880.00	0.19
128	600050	中国联通	622,500	2,490,000.00	0.19
129	300661	圣邦股份	17,300	2,482,204.00	0.19
130	300567	精测电子	7,800	2,477,280.00	0.19
131	002837	英维克	30,380	2,417,032.80	0.18
132	002080	中材科技	26,700	2,403,000.00	0.18
133	002049	紫光国微	27,000	2,396,250.00	0.18
134	002407	多氟多	47,600	2,390,948.00	0.18
135	002185	华天科技	105,800	2,360,398.00	0.18
136	002138	顺络电子	32,100	2,346,510.00	0.18
137	601628	中国人寿	66,300	2,343,705.00	0.18
138	002179	中航光电	50,500	2,333,100.00	0.17
139	688002	睿创微纳	14,979	2,317,101.51	0.17
140	601100	恒立液压	21,300	2,291,028.00	0.17
141	000568	泸州老窖	29,300	2,271,336.00	0.17
142	601872	招商轮船	128,600	2,259,502.00	0.17
143	600879	航天电子	105,100	2,237,579.00	0.17
144	300395	菲利华	16,700	2,233,291.00	0.17
145	002241	歌尔股份	98,900	2,228,217.00	0.17
146	603288	海天味业	66,400	2,201,824.00	0.17
147	601006	大秦铁路	474,600	2,187,906.00	0.16
148	601658	邮储银行	439,100	2,164,763.00	0.16
149	000408	藏格矿业	31,200	2,162,784.00	0.16
150	300390	天华新能	23,100	2,160,081.00	0.16
151	605117	德业股份	20,188	2,143,561.84	0.16
152	688017	绿的谐波	5,113	2,136,518.18	0.16
153	688469	芯联集成-U	200,301	2,125,193.61	0.16
154	600905	三峡能源	569,200	2,111,732.00	0.16
155	600489	中金黄金	115,800	2,090,190.00	0.16
156	601888	中国中免	38,800	2,083,948.00	0.16
157	002625	光启技术	68,600	2,079,952.00	0.16
158	688396	华润微	21,167	2,064,840.85	0.15
159	000630	铜陵有色	320,400	2,037,744.00	0.15
160	600893	航发动力	53,000	2,032,020.00	0.15
161	600673	东阳光	59,900	2,011,442.00	0.15
162	600010	宝钢股份	900,500	2,008,115.00	0.15
163	688271	联影医疗	19,701	1,994,332.23	0.15
164	601127	赛力斯	32,500	1,990,625.00	0.15
165	300058	蓝色光标	142,940	1,966,854.40	0.15
166	688111	金山办公	9,204	1,960,912.20	0.15
167	002273	水晶光电	55,200	1,958,496.00	0.15

168	601689	拓普集团	34,600	1,952,132.00	0.15
169	300037	新宙邦	21,000	1,949,850.00	0.15
170	002027	分众传媒	402,600	1,948,584.00	0.15
171	600118	中国卫星	23,500	1,928,175.00	0.14
172	300751	迈为股份	6,700	1,892,482.00	0.14
173	600019	宝钢股份	346,900	1,883,667.00	0.14
174	000426	兴业银锡	56,500	1,862,240.00	0.14
175	600760	中航沈飞	45,100	1,853,610.00	0.14
176	000807	云铝股份	82,800	1,833,192.00	0.14
177	601168	西部矿业	66,400	1,802,096.00	0.14
178	600362	江西铜业	41,270	1,786,991.00	0.13
179	600104	上汽集团	183,089	1,786,948.64	0.13
180	600989	宝丰能源	87,600	1,780,908.00	0.13
181	300450	先导智能	43,600	1,775,392.00	0.13
182	601727	上海电气	251,200	1,758,400.00	0.13
183	600875	东方电气	60,700	1,746,339.00	0.13
184	600988	赤峰黄金	66,200	1,742,384.00	0.13
185	002001	新和成	61,100	1,736,462.00	0.13
186	688099	晶晨股份	16,866	1,735,511.40	0.13
187	605589	圣泉集团	26,900	1,710,033.00	0.13
188	002422	科伦药业	44,300	1,706,436.00	0.13
189	600667	太极实业	58,300	1,701,194.00	0.13
190	601390	中国中铁	407,700	1,700,109.00	0.13
191	600885	宏发股份	49,260	1,698,977.40	0.13
192	002738	中矿资源	28,700	1,693,013.00	0.13
193	000538	云南白药	35,540	1,683,529.80	0.13
194	002126	银轮股份	33,700	1,678,260.00	0.13
195	000960	锡业股份	39,300	1,677,717.00	0.13
196	600392	盛和资源	55,800	1,661,166.00	0.12
197	600547	山东黄金	71,900	1,660,171.00	0.12
198	600795	国电电力	355,100	1,658,317.00	0.12
199	000831	中国稀土	29,500	1,636,955.00	0.12
200	600418	江淮汽车	62,800	1,622,124.00	0.12
201	600585	海螺水泥	95,500	1,618,725.00	0.12
202	601669	中国电建	343,000	1,612,100.00	0.12
203	002648	卫星化学	67,000	1,573,830.00	0.12
204	600141	兴发集团	33,500	1,573,495.00	0.12
205	300316	晶盛机电	26,000	1,570,400.00	0.12
206	002812	恩捷股份	23,400	1,565,694.00	0.12
207	002129	TCL 中环	128,775	1,547,875.50	0.12
208	600096	云天化	50,800	1,544,320.00	0.12
209	300015	爱尔眼科	185,600	1,533,056.00	0.11
210	301358	湖南裕能	20,100	1,524,987.00	0.11

211	601179	中国西电	102,000	1,521,840.00	0.11
212	300782	卓胜微	13,780	1,510,012.40	0.11
213	600346	恒力石化	84,000	1,487,640.00	0.11
214	601868	中国能建	557,100	1,487,457.00	0.11
215	600482	中国动力	45,100	1,479,280.00	0.11
216	002195	岩山科技	225,800	1,476,732.00	0.11
217	000066	中国长城	77,000	1,466,850.00	0.11
218	600497	驰宏锌锗	120,400	1,458,044.00	0.11
219	002558	巨人网络	52,900	1,457,924.00	0.11
220	300418	昆仑万维	35,800	1,444,888.00	0.11
221	600580	卧龙电驱	43,500	1,439,850.00	0.11
222	600066	宇通客车	52,900	1,418,249.00	0.11
223	000625	长安汽车	197,600	1,416,792.00	0.11
224	600426	华鲁恒升	58,900	1,408,888.00	0.11
225	600157	永泰能源	868,800	1,398,768.00	0.10
226	002532	天山铝业	129,000	1,384,170.00	0.10
227	600221	海航控股	1,023,700	1,381,995.00	0.10
228	000157	中联重科	197,800	1,378,666.00	0.10
229	600895	张江高科	37,000	1,378,250.00	0.10
230	688036	传音控股	22,932	1,351,841.40	0.10
231	600711	盛屯矿业	123,000	1,349,310.00	0.10
232	002340	格林美	203,100	1,342,491.00	0.10
233	605499	东鹏饮料	10,850	1,339,215.50	0.10
234	300803	指南针	14,600	1,338,382.00	0.10
235	600011	华能国际	175,100	1,329,009.00	0.10
236	000933	神火股份	62,600	1,327,120.00	0.10
237	600048	保利发展	286,000	1,324,180.00	0.10
238	600436	片仔癀	12,100	1,322,288.00	0.10
239	600143	金发科技	85,100	1,314,795.00	0.10
240	600438	通威股份	107,500	1,301,825.00	0.10
241	002821	凯莱英	8,000	1,296,000.00	0.10
242	300017	网宿科技	99,300	1,291,893.00	0.10
243	600115	中国东航	339,000	1,291,590.00	0.10
244	002236	大华股份	78,100	1,287,869.00	0.10
245	002493	荣盛石化	119,300	1,282,475.00	0.10
246	002131	利欧股份	269,600	1,280,600.00	0.10
247	600570	恒生电子	60,300	1,277,757.00	0.10
248	600886	国投电力	95,600	1,272,436.00	0.10
249	002456	欧菲光	133,700	1,264,802.00	0.09
250	600352	浙江龙盛	103,600	1,254,596.00	0.09
251	688047	龙芯中科	7,988	1,235,503.96	0.09
252	601233	桐昆股份	56,800	1,229,720.00	0.09
253	603659	璞泰来	42,500	1,229,525.00	0.09

254	003816	中国广核	313,200	1,224,612.00	0.09
255	300339	润和软件	31,649	1,218,802.99	0.09
256	601360	三六零	139,300	1,210,517.00	0.09
257	601058	赛轮轮胎	104,700	1,207,191.00	0.09
258	000301	东方盛虹	105,300	1,205,685.00	0.09
259	688213	思特威-W	11,220	1,201,325.40	0.09
260	300759	康龙化成	41,200	1,191,916.00	0.09
261	600026	中远海能	66,400	1,191,216.00	0.09
262	002074	国轩高科	43,100	1,185,681.00	0.09
263	688578	艾力斯	10,757	1,174,664.40	0.09
264	300438	鹏辉能源	14,100	1,168,185.00	0.09
265	688235	百济神州	4,570	1,163,567.70	0.09
266	002555	三七互娱	61,600	1,162,392.00	0.09
267	600009	上海机场	49,500	1,143,450.00	0.09
268	688122	西部超导	18,118	1,137,991.58	0.09
269	600196	复星医药	50,600	1,136,982.00	0.09
270	000768	中航西飞	55,300	1,132,544.00	0.08
271	000975	山金国际	66,200	1,125,400.00	0.08
272	601111	中国国航	185,600	1,122,880.00	0.08
273	002472	双环传动	27,000	1,120,770.00	0.08
274	300207	欣旺达	58,800	1,116,612.00	0.08
275	300001	特锐德	29,400	1,112,202.00	0.08
276	600029	南方航空	214,600	1,111,628.00	0.08
277	600415	小商品城	109,100	1,108,456.00	0.08
278	002517	恺英网络	68,000	1,105,000.00	0.08
279	603129	春风动力	4,300	1,099,940.00	0.08
280	600674	川投能源	77,600	1,099,592.00	0.08
281	600219	南山铝业	274,300	1,094,457.00	0.08
282	002601	龙佰集团	66,400	1,094,272.00	0.08
283	601186	中国铁建	183,200	1,090,040.00	0.08
284	300458	全志科技	27,600	1,089,096.00	0.08
285	002128	电投能源	47,000	1,086,640.00	0.08
286	002595	豪迈科技	23,090	1,075,994.00	0.08
287	600233	圆通速递	68,100	1,072,575.00	0.08
288	601117	中国化学	145,915	1,072,475.25	0.08
289	601877	正泰电器	42,764	1,072,093.48	0.08
290	300115	长盈精密	37,800	1,056,132.00	0.08
291	301236	软通动力	24,700	1,048,515.00	0.08
292	600372	中航机载	96,300	1,044,855.00	0.08
293	002155	湖南黄金	43,560	1,039,777.20	0.08
294	600839	四川长虹	147,000	1,026,060.00	0.08
295	002465	海格通信	79,000	1,008,830.00	0.08
296	300568	星源材质	53,500	1,001,520.00	0.08

297	300454	深信服	10,400	1,000,480.00	0.08
298	688506	百利天恒	3,367	989,999.01	0.07
299	300347	泰格医药	20,500	984,000.00	0.07
300	000963	华东医药	34,900	981,388.00	0.07
301	000547	航天发展	50,900	974,735.00	0.07
302	002920	德赛西威	11,945	973,517.50	0.07
303	600741	华域汽车	62,700	973,104.00	0.07
304	603650	彤程新材	9,900	970,002.00	0.07
305	300024	机器人	49,800	962,634.00	0.07
306	002130	沃尔核材	50,100	949,896.00	0.07
307	002497	雅化集团	45,800	932,946.00	0.07
308	688676	金盘科技	10,991	930,278.24	0.07
309	300012	华测检测	67,000	928,620.00	0.07
310	001979	招商蛇口	143,600	923,348.00	0.07
311	000878	云南铜业	57,900	919,452.00	0.07
312	002432	九安医疗	13,000	918,840.00	0.07
313	688331	荣昌生物	7,000	911,820.00	0.07
314	300496	中科创达	14,700	908,313.00	0.07
315	002271	东方雨虹	76,100	903,307.00	0.07
316	300083	创世纪	66,300	903,006.00	0.07
317	002414	高德红外	68,000	901,680.00	0.07
318	300866	安克创新	8,600	898,700.00	0.07
319	000034	神州数码	32,300	896,325.00	0.07
320	002444	巨星科技	28,500	886,350.00	0.07
321	601021	春秋航空	19,402	884,343.16	0.07
322	300474	景嘉微	14,600	883,008.00	0.07
323	603979	金诚信	14,810	874,234.30	0.07
324	000733	振华科技	15,400	872,256.00	0.07
325	300763	锦浪科技	9,600	867,360.00	0.07
326	000661	长春高新	13,000	865,800.00	0.06
327	688266	泽璟制药-U	7,382	861,184.12	0.06
328	601319	中国人保	127,200	859,872.00	0.06
329	002756	永兴材料	15,000	849,600.00	0.06
330	600699	均胜电子	38,900	840,629.00	0.06
331	300748	金力永磁	27,200	839,120.00	0.06
332	601615	明阳智能	72,000	833,040.00	0.06
333	002078	太阳纸业	66,693	832,995.57	0.06
334	300073	当升科技	17,300	831,092.00	0.06
335	002025	航天电器	10,900	830,798.00	0.06
336	300142	沃森生物	63,600	826,164.00	0.06
337	601677	明泰铝业	49,500	821,700.00	0.06
338	300432	富临精工	40,800	819,672.00	0.06
339	603606	东方电缆	19,700	817,747.00	0.06

340	300919	中伟新材	18,600	813,750.00	0.06
341	000423	东阿阿胶	17,900	811,944.00	0.06
342	600039	四川路桥	103,800	811,716.00	0.06
343	603087	甘李药业	14,300	811,668.00	0.06
344	601800	中国交建	141,600	808,536.00	0.06
345	000002	万科 A	271,000	802,160.00	0.06
346	002252	上海莱士	183,700	797,258.00	0.06
347	600226	亨通股份	82,900	795,011.00	0.06
348	688599	天合光能	56,035	791,214.20	0.06
349	688608	恒玄科技	4,701	785,960.19	0.06
350	688169	石头科技	8,263	784,737.11	0.06
351	300724	捷佳伟创	11,100	783,660.00	0.06
352	688223	晶科能源	163,589	777,047.75	0.06
353	002064	华峰化学	79,000	749,710.00	0.06
354	600588	用友网络	81,600	749,088.00	0.06
355	601633	长城汽车	49,600	748,464.00	0.06
356	001965	招商公路	81,100	742,876.00	0.06
357	000786	北新建材	40,672	735,756.48	0.06
358	688390	固德威	6,748	732,225.48	0.05
359	002831	裕同科技	20,500	728,980.00	0.05
360	688180	君实生物-U	21,374	722,868.68	0.05
361	300677	英科医疗	18,200	712,894.00	0.05
362	002294	信立泰	22,100	704,769.00	0.05
363	000519	中兵红箭	33,200	699,524.00	0.05
364	603806	福斯特	41,500	696,785.00	0.05
365	601618	中国中冶	284,300	693,692.00	0.05
366	300972	万辰集团	4,000	693,640.00	0.05
367	600177	雅戈尔	92,000	692,760.00	0.05
368	600516	方大炭素	112,200	692,274.00	0.05
369	302132	中航成飞	11,800	688,176.00	0.05
370	688065	凯赛生物	14,368	687,508.80	0.05
371	688188	柏楚电子	6,425	685,547.50	0.05
372	603260	合盛硅业	14,200	685,292.00	0.05
373	601607	上海医药	44,400	683,760.00	0.05
374	002176	江特电机	67,900	679,679.00	0.05
375	000623	吉林敖东	38,100	675,513.00	0.05
376	000617	中油资本	100,600	662,954.00	0.05
377	300699	光威复材	23,100	661,815.00	0.05
378	300558	贝达药业	10,100	657,207.00	0.05
379	002085	万丰奥威	59,100	655,419.00	0.05
380	300832	新产业	15,600	655,200.00	0.05
381	002318	久立特材	27,200	650,080.00	0.05
382	300251	光线传媒	58,400	647,656.00	0.05

383	002459	晶澳科技	79,000	639,900.00	0.05
384	300342	天银机电	13,600	639,200.00	0.05
385	002065	东华软件	89,300	637,602.00	0.05
386	600499	科达制造	45,800	632,040.00	0.05
387	002266	浙富控股	124,700	630,982.00	0.05
388	600085	同仁堂	27,300	630,903.00	0.05
389	688617	惠泰医疗	3,455	627,289.80	0.05
390	002044	美年健康	124,700	627,241.00	0.05
391	688472	阿特斯	57,949	627,008.18	0.05
392	605090	九丰能源	16,800	624,456.00	0.05
393	600515	海南机场	227,500	623,350.00	0.05
394	603596	伯特利	25,011	621,273.24	0.05
395	300409	道氏技术	31,100	619,823.00	0.05
396	000400	许继电气	28,300	614,110.00	0.05
397	002223	鱼跃医疗	23,900	613,274.00	0.05
398	301550	斯菱智驱	6,700	612,581.00	0.05
399	002405	四维图新	94,400	610,768.00	0.05
400	688005	容百科技	19,933	609,949.80	0.05
401	300003	乐普医疗	51,300	607,905.00	0.05
402	000032	深桑达 A	24,100	601,295.00	0.05
403	000415	渤海租赁	147,700	601,139.00	0.05
404	600521	华海药业	41,700	600,480.00	0.05
405	601216	君正集团	134,400	599,424.00	0.04
406	600862	中航高科	33,200	598,596.00	0.04
407	000683	博源化工	103,600	596,736.00	0.04
408	000999	华润三九	26,509	596,187.41	0.04
409	000039	中集集团	73,300	594,463.00	0.04
410	603766	隆鑫通用	49,000	584,570.00	0.04
411	600803	新奥股份	36,900	583,020.00	0.04
412	600704	物产中大	123,500	582,920.00	0.04
413	600312	平高电气	32,400	572,184.00	0.04
414	603605	珀莱雅	9,500	569,240.00	0.04
415	600018	上港集团	120,500	568,760.00	0.04
416	000967	盈峰环境	53,500	563,355.00	0.04
417	000887	中鼎股份	31,400	561,746.00	0.04
418	600332	白云山	27,900	559,116.00	0.04
419	600765	中航重机	43,200	558,144.00	0.04
420	688116	天奈科技	14,603	557,834.60	0.04
421	300122	智飞生物	47,600	556,444.00	0.04
422	600166	福田汽车	189,100	550,281.00	0.04
423	600153	建发股份	69,200	548,756.00	0.04
424	000830	鲁西化工	45,500	546,000.00	0.04
425	002410	广联达	65,700	536,112.00	0.04

426	600323	瀚蓝环境	19,400	532,724.00	0.04
427	002007	华兰生物	43,600	531,484.00	0.04
428	300896	爱美客	6,060	528,432.00	0.04
429	601799	星宇股份	5,700	516,534.00	0.04
430	688114	华大智造	9,957	508,603.56	0.04
431	603568	伟明环保	32,620	501,695.60	0.04
432	600398	海澜之家	95,600	499,988.00	0.04
433	002603	以岭药业	33,200	498,000.00	0.04
434	600486	扬农化工	9,700	491,790.00	0.04
435	688009	中国通号	103,041	490,475.16	0.04
436	601000	唐山港	117,956	489,517.40	0.04
437	601018	宁波港	154,900	487,935.00	0.04
438	600529	山东药玻	26,400	487,080.00	0.04
439	002389	航天彩虹	27,400	486,898.00	0.04
440	600208	衢州发展	169,400	479,402.00	0.04
441	600316	洪都航空	17,100	477,774.00	0.04
442	000738	航发控制	26,100	477,369.00	0.04
443	600008	首创环保	175,400	477,088.00	0.04
444	000932	华菱钢铁	136,400	473,308.00	0.04
445	603486	科沃斯	9,300	471,975.00	0.04
446	600170	上海建工	212,300	471,306.00	0.04
447	600998	九州通	100,310	470,453.90	0.04
448	600820	隧道股份	87,600	456,396.00	0.03
449	600161	天坛生物	39,300	455,094.00	0.03
450	300118	东方日升	36,300	451,935.00	0.03
451	601238	广汽集团	88,200	448,056.00	0.03
452	603885	吉祥航空	43,500	447,615.00	0.03
453	688303	大全能源	25,640	446,905.20	0.03
454	002607	中公教育	245,600	442,080.00	0.03
455	603816	顾家家居	19,600	438,256.00	0.03
456	603939	益丰药房	24,100	433,318.00	0.03
457	688166	博瑞医药	12,154	425,511.54	0.03
458	600763	通策医疗	12,500	423,500.00	0.03
459	601567	三星电气	27,900	416,826.00	0.03
460	600038	中直股份	16,300	412,227.00	0.03
461	300049	福瑞医科	10,600	412,128.00	0.03
462	300676	华大基因	11,700	410,202.00	0.03
463	300573	兴齐眼药	10,017	408,292.92	0.03
464	603392	万泰生物	15,041	405,655.77	0.03
465	601880	辽港股份	293,235	404,664.30	0.03
466	600535	天士力	29,700	392,931.00	0.03
467	600511	国药股份	15,000	390,600.00	0.03
468	600816	建元信托	156,800	382,592.00	0.03

469	300100	双林股份	13,700	380,586.00	0.03
470	002244	滨江集团	49,500	376,200.00	0.03
471	000833	粤桂股份	15,900	372,378.00	0.03
472	601155	新城控股	36,000	369,360.00	0.03
473	002120	韵达股份	57,700	366,972.00	0.03
474	300144	宋城演艺	62,700	364,287.00	0.03
475	688063	派能科技	6,819	363,248.13	0.03
476	000998	隆平高科	46,800	352,872.00	0.03
477	002544	普天科技	18,900	344,358.00	0.03
478	600064	南京高科	48,200	343,666.00	0.03
479	601866	中远海发	155,300	343,213.00	0.03
480	600635	大众公用	77,000	329,560.00	0.02
481	600754	锦江酒店	18,100	325,619.00	0.02
482	300457	赢合科技	15,400	324,632.00	0.02
483	000035	中国天楹	66,500	321,195.00	0.02
484	600655	豫园股份	77,400	318,114.00	0.02
485	300601	康泰生物	26,600	301,644.00	0.02
486	603899	晨光股份	14,500	299,135.00	0.02
487	600004	白云机场	41,000	297,660.00	0.02
488	600663	陆家嘴	47,000	295,160.00	0.02
489	600258	首旅酒店	26,600	290,472.00	0.02
490	600859	王府井	31,300	287,334.00	0.02
491	002091	江苏国泰	38,900	281,247.00	0.02
492	300070	碧水源	86,500	275,935.00	0.02
493	000069	华侨城 A	160,000	262,400.00	0.02
494	600864	哈投股份	49,700	257,943.00	0.02
495	301078	孩子王	35,200	237,952.00	0.02
496	002292	奥飞娱乐	35,300	231,568.00	0.02
497	603833	欧派家居	7,300	219,803.00	0.02
498	002891	中宠股份	7,700	205,744.00	0.02
499	600325	华发股份	87,600	202,356.00	0.02
500	002572	索菲亚	23,000	167,900.00	0.01

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	688797	臻宝科技	2,070	1,382,689.62	0.10
2	301666	大普微-UW	1,220	565,262.60	0.04
3	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.02
4	001399	惠科股份	6,241	173,062.93	0.01
5	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.00
6	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
7	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00

8	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
9	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
10	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
11	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
12	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
13	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
14	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
15	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
16	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
17	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
18	001220	世盟股份	57	1,583.46	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	300308	中际旭创	28,410,213.00	1.28
2	300750	宁德时代	23,499,666.80	1.06
3	002371	北方华创	14,427,943.60	0.65
4	600519	贵州茅台	12,840,778.00	0.58
5	688041	海光信息	9,883,255.17	0.44
6	300394	天孚通信	9,369,252.60	0.42
7	000333	美的集团	7,176,284.72	0.32
8	688498	源杰科技	5,720,472.08	0.26
9	300476	胜宏科技	5,528,344.00	0.25
10	301308	江波龙	5,505,364.18	0.25
11	002594	比亚迪	5,505,309.00	0.25
12	300502	新易盛	5,398,076.00	0.24
13	688525	佰维存储	5,233,565.95	0.24
14	000858	五粮液	4,848,535.00	0.22
15	002475	立讯精密	4,762,899.84	0.21
16	688008	澜起科技	4,261,987.55	0.19
17	002384	东山精密	4,044,864.00	0.18
18	300604	长川科技	4,030,122.00	0.18
19	300059	东方财富	3,949,918.00	0.18
20	688347	华虹宏力	3,863,583.37	0.17

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	300750	宁德时代	57,234,968.80	2.57
2	300308	中际旭创	51,387,061.00	2.31
3	300502	新易盛	23,582,224.20	1.06

4	000333	美的集团	20,952,463.20	0.94
5	002371	北方华创	19,373,756.08	0.87
6	688256	寒武纪	17,646,549.17	0.79
7	002475	立讯精密	15,269,254.86	0.69
8	002594	比亚迪	14,170,467.00	0.64
9	300059	东方财富	13,830,215.56	0.62
10	300394	天孚通信	13,093,836.82	0.59
11	300274	阳光电源	11,502,566.21	0.52
12	000858	五粮液	11,085,371.35	0.50
13	300476	胜宏科技	11,035,247.28	0.50
14	002384	东山精密	9,265,104.20	0.42
15	688012	中微公司	8,924,662.99	0.40
16	000651	格力电器	8,691,303.00	0.39
17	000725	京东方 A	8,480,054.00	0.38
18	300124	汇川技术	8,320,652.95	0.37
19	002028	思源电气	7,530,908.00	0.34
20	000338	潍柴动力	7,324,185.00	0.33

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	488,725,823.83
卖出股票收入（成交）总额	955,354,354.20

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，从而更好的跟踪标的指数，实现投资目标。同时，本基金将力争利用股指期货的杠杆作用，降低申购赎回时现金资产对投资组合的影响及仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，从而达到稳定投资组合资产净值的目的。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

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

招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局的处罚。

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约定的备选股票库

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	应收清算款	29,357.36
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	60,492.63
8	其他	-
9	合计	89,849.99

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	301666	大普微-UW	565,262.60	0.04	新股流通受限
2	688808	联讯仪器	258,245.79	0.02	新股流通受限
3	001399	惠科股份	173,062.93	0.01	新股流通受限
4	688797	臻宝科技	97,014.69	0.01	新股流通受限
5	688712	北芯生命	53,880.00	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（%）
3,511	268,018.42	819,032,446.00	87.04	121,980,221.00	12.96

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（%）
中国建设银行股份有限公司-鹏华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	382,166,748.00	40.61

8.2 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。

8.3 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(2024 年 11 月 21 日)	
基金份额总额	2,000,012,667.00
本报告期期初基金份额总额	1,772,012,667.00
本报告期基金总申购份额	252,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	1,083,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	941,012,667.00

§ 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：

报告期内，公司原副总经理李伟先生因个人原因辞职，经公司第六届董事会第三百三十八次会议审议通过，自 2026 年 4 月 3 日起，李伟先生不再担任公司副总经理。

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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

注：无。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：无。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：无。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：无。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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(%)	
兴业证券	5	1,442,866,889.11	100.00	268,245.09	100.00	本报告期新增1个

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证券交易费用管理规定》（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。

10.7.2 基金租用或者通过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	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 (%)		(%)		的比例 (%)
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	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分上交所 ETF 变更扩位证券简称的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 01 月 15 日
2	鹏华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要（更新）	《上海证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 01 月 20 日
3	鹏华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	《上海证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 01 月 21 日
4	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华鑫证券有限责任公司为申购赎回代理券商的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 02 月 10 日
5	鹏华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年年度报告	《上海证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 03 月 30 日
6	鹏华基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《上海证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 04 月 04 日
7	鹏华基金管理有限公司关于暂停客服电话服务的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 04 月 17 日
8	鹏华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	《上海证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 04 月 21 日
9	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金增加金融街证券股份有限公司为申购赎回代理券商的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 04 月 29 日
10	鹏华基金管理有限公司关于终止中证金牛(北京)基金销售有限公司办	《上海证券报》、基金管理人网站及/或中国	2026 年 05 月 30 日

	理本公司旗下基金销售业务的公告	证监会基金电子披露网站	
11	鹏华基金管理有限公司关于终止浦领基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 06 月 24 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	20260101~20260114	385,797,660.00	0.00	385,797,660.00	0.00	0.00
	2	20260114~20260630	311,821,206.00	246,377,542.00	176,032,000.00	382,166,748.00	40.61
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资份额；

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 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- (二)《鹏华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- (三)《鹏华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金 2026 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：400-6788-533。

鹏华基金管理有限公司

2026 年 8 月 28 日