

鹏华中证 500 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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
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	57
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	57
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	57

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	57
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	57
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	57
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	58
§ 8 基金份额持有人信息	59
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	59
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	59
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	59
§ 9 开放式基金份额变动	59
§ 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	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	60
10.4 基金投资策略的改变	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	60
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	60
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	63
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	64
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	64
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	64
§ 12 备查文件目录	64
12.1 备查文件目录	64
12.2 存放地点	64
12.3 查阅方式	64

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	中证 500
场内简称	中证 500ETF 鹏华
基金主代码	159982
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 11 月 21 日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	132,211,253.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2020 年 2 月 20 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金采用被动式指数化投资方法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。 当预期成份股发生调整或成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。 本基金力争将日均跟踪偏离度控制在 0.2% 以内，年跟踪误差控制在 2% 以内。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。 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

	率与标的指数收益率间的高度正相关和跟踪误差最小化。基金管理人将对成份股的流动性进行分析，如发现流动性欠佳的个股将可能采用合理方法寻求替代。由于受到各项持股比例限制，基金可能不能按照成份股权重持有成份股，基金将会采用合理方法寻求替代。 1) 定期调整 根据标的指数的调整规则和备选股票的预期，对股票投资组合及时进行调整。 2) 不定期调整 根据指数编制规则，当标的指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重新调整时，本基金将根据各成份股的权重变化进行相应调整； 根据本基金的申购和赎回情况，对股票投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数； 根据法律、法规规定，成份股在标的指数中的权重因其它特殊原因发生相应变化的，本基金可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。 (3) 存托凭证投资策略 本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。 2、债券投资策略 本基金债券投资组合将采用自上而下的投资策略，根据宏观经济分析、资金面动向分析等判断未来利率变化，并利用债券定价技术，进行个券选择。 3、股指期货投资策略 本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数，实现投资目标。同时，本基金将力争利用股指期货的杠杆作用，降低申购赎回时现金资产对投资组合的影响及仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，从而达到稳定投资组合资产净值的目的。基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项，同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。 4、资产支持证券的投资策略 本基金将综合运用战略资产配置和战术资产配置进行资产支持证券的投资组合管理，并根据信用风险、利率风险和流动性风险变化积极调整投资策略，严格遵守法律法规和基金合同的约定，在保证本金安全和基金资产流动性的基础上获得稳定收益。 5、参与融资及转融通证券出借业务策略 本基金可在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素基础上，参与融资业务。 为更好地实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎经营原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与转融通证券出借业务。本基金将在分析市场环境、投资者类型与结构、基金历史申赎情况、出借证券流动性情况等因素的基础上，合理确定出借证券的范围、
--	--

	期限和比例。 本基金将密切跟踪国内关于基金参与融券业务法律法规的实施进展，待允许本基金参与融券业务的相关规定颁布后，将在届时相应法律法规的框架内，参与融券业务。 未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，本基金可相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书中更新公告。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金。同时本基金为交易型开放式指数基金，具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。

注：无。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		鹏华基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	高永杰	郭明
	联系电话	0755-81395402	(010)66105799
	电子邮箱	xxpl@phfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4006788533	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	58,352,676.96
本期利润	64,426,342.76

加权平均基金份额本期利润	0.4251
本期加权平均净值利润率	19.57%
本期基金份额净值增长率	22.91%
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	148,661,113.65
期末可供分配基金份额利润	1.1244
期末基金资产净值	317,429,373.66
期末基金份额净值	2.4009
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	140.09%

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。

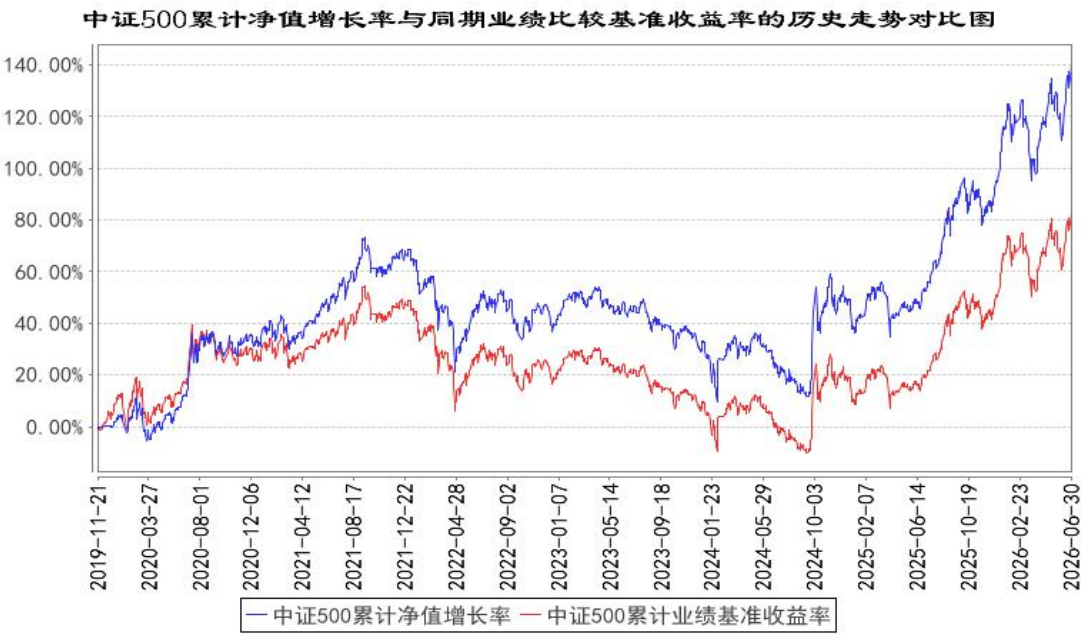
3.2 基金净值表现

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	20.18%	1.63%	18.56%	1.65%	1.62%	-0.02%
过去六个月	22.91%	1.64%	20.97%	1.66%	1.94%	-0.02%
过去一年	57.11%	1.41%	52.68%	1.42%	4.43%	-0.01%
过去三年	65.29%	1.47%	50.55%	1.49%	14.74%	-0.02%
过去五年	58.79%	1.34%	32.65%	1.36%	26.14%	-0.02%
自基金合同生效起至今	140.09%	1.33%	82.59%	1.37%	57.50%	-0.04%

注：业绩比较基准=中证 500 指数收益率。

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



注：1、本基金基金合同于 2019 年 11 月 21 日生效。2、截至建仓期结束，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

3.3 其他指标

注：无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

鹏华基金管理有限公司成立于 1998 年 12 月 22 日，业务范围包括基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。截至本报告期末，公司股东由国信证券股份有限公司、意大利欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）、深圳市北融信投资发展有限公司组成，公司性质为中外合资企业，公司注册资本 15,000 万元人民币。截至本报告期末，公司管理资产总规模为 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		

陈龙	本基金的 基金经理	2019-11- 21	2026-06- 17	17 年	陈龙先生, 国籍中国, 经济学硕士, 17 年证券从业经验。曾任杭州衡泰软件公司金融工程师, 2009 年 12 月加盟鹏华基金管理有限公司, 历任监察稽核部金融工程总监助理、量化及衍生品投资部量化研究总监助理, 先后从事金融工程、量化研究等工作, 现担任指数与量化投资部副总经理、基金经理。2015 年 09 月至 2018 年 05 月担任鹏华国证钢铁行业指数分级证券投资基金基金经理, 2016 年 07 月至 2018 年 04 月担任鹏华创业板指数分级证券投资基金基金经理, 2016 年 09 月至 2018 年 04 月担任鹏华中证 800 地产指数分级证券投资基金基金经理, 2016 年 09 月至 2018 年 05 月担任鹏华港股通中证香港中小企业投资主题指数证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2016 年 10 月至 2018 年 04 月担任鹏华中证移动互联网指数分级证券投资基金基金经理, 2019 年 03 月至 2020 年 12 月担任鹏华中证 800 证券保险指数分级证券投资基金基金经理, 2019 年 03 月至 2020 年 12 月担任鹏华中证国防指数分级证券投资基金基金经理, 2019 年 03 月至 2020 年 12 月担任鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金经理, 2019 年 03 月至今担任鹏华中证空天一体军工指数证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2019 年 11 月至 2026 年 06 月担任鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2019 年 12 月至 2022 年 10 月担任鹏华国证证券龙头交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2020 年 01 月至 2026 年 06 月担任鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理, 2021 年 01 月至 2022 年 10 月担任鹏华中证 800 证券保险指数型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2021 年 01 月至 2022 年 10 月担任鹏华中证全指证券公司指数型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2021 年 01 月至今担任鹏华中证国防指数型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2021 年 02 月至今担任鹏华中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2022 年 08 月至今担任鹏华中证国防交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2023 年 02 月至 2025 年 03 月担任鹏华国
----	--------------	----------------	----------------	------	--

					证疫苗与生物科技交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2023 年 07 月至今担任鹏华国证粮食产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2024 年 09 月至今担任鹏华国证粮食产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，2025 年 03 月至今担任鹏华中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2025 年 07 月至今担任鹏华国证机器人产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2025 年 08 月至今担任鹏华中证环保产业指数型证券投资基金(LOF)基金经理，2025 年 10 月至今担任鹏华国证机器人产业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，2026 年 03 月至今担任鹏华中证 A50 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，2026 年 03 月至今担任鹏华中证全指公用事业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2026 年 04 月至今担任鹏华国证有色金属行业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，2026 年 04 月至今担任鹏华国证有色金属行业交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 陈龙先生具备基金从业资格。
钟成亮	本基金的基金经理	2026-06-17	-	11 年	钟成亮先生, 国籍中国, 理学硕士, 11 年证券从业经验。曾任中国工商银行深圳市分行职员。2015 年 09 月加盟鹏华基金管理有限公司, 历任市场发展部渠道经理、渠道主管、渠道总监助理, 基金投资顾问部总经理助理, 量化及衍生品投资部资深量化研究员, 现担任指数与量化投资部基金经理。2025 年 10 月至今担任鹏华国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2025 年 10 月至今担任鹏华国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理, 2025 年 10 月至今担任鹏华中证沪港深科技龙头指数证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2025 年 11 月至今担任鹏华恒生科技交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 基金经理, 2025 年 12 月至今担任鹏华中证卫星产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2025 年 12 月至今担任鹏华中证通用航空主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2026

					年 03 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，2026 年 06 月至今担任鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2026 年 06 月至今担任鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2026 年 06 月至今担任鹏华中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2026 年 06 月至今担任鹏华国证绿色电力交易型开放式指数证券投资基金基金经理，钟成亮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。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

报告期内，本基金采用被动式指数化投资策略，紧密跟踪标的指数，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。在基金运作过程中，跟踪误差主要受到基金仓位、大额申购与赎回、汇率波动、成份股分红与停牌，以及成份股定期调整等因素的综合影响。针对上述情况，基金管理人通过不断完善日常跟踪交易机制，并在成份股调整期事前制定周密的调仓方案，对投资组合进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。总体而言，本基金的日均跟踪偏离度和跟踪误差均得到了较好的控制，较好地实现了基金运作目标。

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 22.91%，同期业绩比较基准增长率为 20.97%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2026 年上半年，全球及国内宏观经济呈现深度“K 型分化”特征。国内经济正处于新旧动能转换的“拐点之年”，整体呈现供强需弱、外强内弱的格局，经济韧性主要依赖 AI 带动的外需，政策端以落地存量财政为主，货币难大幅宽松；海外方面，美国经济受 AI 固投与财政支撑阶段性走强，但高油价加剧了全球分化，联储紧货币预期延续，年内不加减息为基准情形。在全球增长与政策均围绕 AI 驱动主线展开的背景下，非美市场同样呈现“AI 强、非 AI 弱”的态势。

映射至 A 股市场，上半年正处于新旧动能转换的关键节点，全 A 风险溢价偏热、整体估值略高，成长风格触及高位而价值仍处低位；资金面上个人投资者为主力，机构与外资放缓，宽基 ETF 流出明显，存量博弈特征显著。叠加经济 5 月后跳入信用收缩期，传统信贷失效，转型阵痛或持续至三季度末。对于 AI 行情而言，上半年市场逻辑已由分母端（流动性）切换至分子端（业绩），尽管美股科技 PE 合理但 PS 接近峰值，且 Coding 驱动景气扩张或见顶，资本开支实际高点或在 2026 年下半年。结合中报业绩前瞻，除 AI 外，工业金属、化工、锂电、创新药、券商及部分机械设备具备业绩优势。

展望 2026 年下半年，7 月中报预告密集期或为 AI 股逢低布局的窗口，但在资本开支未提速前，产业链可能面临零和博弈与波动放大。因此，建议重点关注分子端受海外拉动、估值偏低的工程机械、工业金属、贵金属、游戏、创新药、白电，以及 PB-ROE 有修复空间的非银金融板块，在波动中寻找确定性。

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 148,661,113.65 元，期末基金份额净值 2.4009 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 2026 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确

和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：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	4, 146, 661. 57	7, 428, 803. 82
结算备付金		12, 669, 112. 93	9, 037, 861. 18
存出保证金		1, 945, 677. 75	1, 796, 661. 59
交易性金融资产	6. 4. 7. 2	298, 670, 262. 84	283, 323, 383. 90
其中：股票投资		298, 670, 262. 84	283, 323, 383. 90
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		667, 562. 69	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6. 4. 7. 8	-	-
资产总计		318, 099, 277. 78	301, 586, 710. 49
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		11,897.92	1.16
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		37,561.28	36,995.44
应付托管费		12,520.44	12,331.79
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		58,651.90	130,233.60
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	549,272.58	171,154.63
负债合计		669,904.12	350,716.62
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	132,211,253.00	154,211,253.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	185,218,120.66	147,024,740.87
净资产合计		317,429,373.66	301,235,993.87
负债和净资产总计		318,099,277.78	301,586,710.49

注： 报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 2.4009 元，基金份额总额 132,211,253.00 份。

6.2 利润表

会计主体：鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：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		64,842,249.05	19,273,376.81
1. 利息收入		32,019.00	28,448.16
其中：存款利息收入	6.4.7.13	32,019.00	28,448.16
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）		58,929,514.45	12,418,805.23
其中：股票投资收益	6.4.7.14	53,741,987.33	9,449,348.84
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投	6.4.7.16	-	-

资收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	3,284,203.90	161,570.95
股利收益	6.4.7.19	1,903,323.22	2,807,885.44
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	6,073,588.49	6,573,263.17
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	-192,872.89	252,860.25
减：二、营业总支出		415,906.29	411,330.07
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	245,250.19	232,421.21
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	81,750.07	77,473.75
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		11,751.38	2,774.45
8. 其他费用	6.4.7.23	77,154.65	98,660.66
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		64,426,342.76	18,862,046.74
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		64,426,342.76	18,862,046.74
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		64,426,342.76	18,862,046.74

6.3 净资产变动表

会计主体：鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：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	154,211,253.00	-	147,024,740.87	301,235,993.87

资产				
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	154,211,253.00	-	147,024,740.87	301,235,993.87
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-22,000,000.00	-	38,193,379.79	16,193,379.79
(一)、综合收益总额	-	-	64,426,342.76	64,426,342.76
(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)	-22,000,000.00	-	-26,232,962.97	-48,232,962.97
其中：1. 基金申购款	46,000,000.00	-	54,187,898.91	100,187,898.91
2. 基金赎回款	-68,000,000.00	-	-80,420,861.88	-148,420,861.88
(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	132,211,253.00	-	185,218,120.66	317,429,373.66
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、上期期末净资产	234,211,253.00	-	105,672,180.55	339,883,433.55
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

二、本期期初净资产	234,211,253.00	-	105,672,180.55	339,883,433.55
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-40,000,000.00	-	-3,099,328.28	-43,099,328.28
(一)、综合收益总额	-	-	18,862,046.74	18,862,046.74
(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)	-40,000,000.00	-	-21,961,375.02	-61,961,375.02
其中：1. 基金申购款	40,000,000.00	-	17,112,150.47	57,112,150.47
2. 基金赎回款	-80,000,000.00	-	-39,073,525.49	-119,073,525.49
(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	194,211,253.00	-	102,572,852.27	296,784,105.27

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 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]第 1504 号《关于准予鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》准予，由鹏华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为

契约型的交易型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 490,173,730.00 元(含募集股票市值)，经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2019)第 0669 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2019 年 11 月 21 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 490,211,253.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 37,523.00 份基金份额。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、《资产管理产品相关会计处理规定》(财会[2022]14 号)、中国证监会颁布的《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 500 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 第 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	4,146,661.57
等于：本金	4,146,289.30
加：应计利息	372.27
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	4,146,661.57

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	237,824,128.91	-	298,670,262.84	60,846,133.93
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	237,824,128.91	-	298,670,262.84	60,846,133.93

注：股票投资的公允价值和股票投资的公允价值变动均含可退替代款估值增值。

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

动。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	14,686,120.00	-	-	-
其中：股指期货投资	14,686,120.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	14,686,120.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2609	IC2609	9.00	15,770,520.00	1,084,400.00
合计				1,084,400.00
减：可抵销期货暂收款				1,084,400.00
净额				0.00

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.8 其他资产

注：无。

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	33,144.54
其中：交易所市场	33,144.54
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	76,814.59
应退替代款	439,313.45
合计	549,272.58

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	154,211,253.00	154,211,253.00
本期申购	46,000,000.00	46,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-68,000,000.00	-68,000,000.00
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	132,211,253.00	132,211,253.00

注：投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购、赎回单位的整数倍。

6.4.7.11 其他综合收益

注：无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	110,955,582.73	36,069,158.14	147,024,740.87
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	110,955,582.73	36,069,158.14	147,024,740.87
本期利润	58,352,676.96	6,073,665.80	64,426,342.76
本期基金份额交易产生的变动数	-20,647,146.04	-5,585,816.93	-26,232,962.97
其中：基金申购款	37,662,230.33	16,525,668.58	54,187,898.91
基金赎回款	-58,309,376.37	-22,111,485.51	-80,420,861.88
本期已分配利润	-	-	-
本期末	148,661,113.65	36,557,007.01	185,218,120.66

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	12,878.29
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	19,075.19
其他	65.52
合计	32,019.00

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 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	34,824,326.65
股票投资收益——赎回差价收入	18,917,660.68
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	53,741,987.33

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	129,203,517.66
减：卖出股票成本总额	94,253,458.17
减：交易费用	125,732.84
买卖股票差价收入	34,824,326.65

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	148,420,861.88
减：现金支付赎回款总额	75,035,108.88
减：赎回股票成本总额	54,468,092.32
减：交易费用	—
赎回差价收入	18,917,660.68

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	3,284,203.90

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	1,903,323.22
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	1,903,323.22

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	6,095,064.22
股票投资	6,095,064.22
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-22,120.00
权证投资	-
期货投资	-22,120.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-644.27
合计	6,073,588.49

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	-192,872.89
合计	-192,872.89

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

6.4.7.22 信用减值损失

注：无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2026 年 1 月 1 日至 2026 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	255.00
存托服务费	85.06
合计	77,154.65

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
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人
国信证券股份有限公司（“国信证券”）	基金管理人的股东、基金的一级交易商
鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“鹏华中证 500ETF 联接”）	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	
	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	-	-	39,037,841.64	22.08
------	---	---	---------------	-------

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 2026年1月1日至2026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	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 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	7,259.51	22.08	5,862.13	28.91

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证券交易费用管理规定》相关要求。

2. 根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，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 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	245,250.19	232,421.21
其中：应支付销售机构的客户维护费	39,116.60	37,201.72

应支付基金管理人的净管理费	206,133.59	195,219.49
---------------	------------	------------

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	81,750.07	77,473.75

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.05%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.05%/当年天数。

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 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（%）

鹏 华 中 证 500ETF联接	34, 930, 937. 00	26. 42	35, 160, 537. 00	22. 80
---------------------	------------------	--------	------------------	--------

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
中国工商银行	4, 146, 661. 57	12, 878. 29	10, 045, 421. 40	21, 059. 58

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
001312	福恩股份	2026 年 4 月 14 日	6 个月	新股流通受限	18. 38	16. 78	93	1, 709. 34	1, 560. 54	-
001365	天海电子	2026 年 5 月 11 日	6 个月	新股流通受限	27. 19	31. 31	311	8, 456. 09	9, 737. 41	-
001393	维通利	2026 年 5 月 8 日	6 个月	新股流通受限	30. 38	38. 99	222	6, 744. 36	8, 655. 78	-
301599	理	2026	6 个月	新股	13. 91	32. 47	364	5, 063. 24	11, 819. 08	-

	奇智能	年 4 月 22 日		流通受限						
301666	大普微-UW	2026 年 4 月 8 日	6 个月	新股流通受限	46.08	463.33	384	17,694.72	177,918.72	-
301680	固德电材	2026 年 2 月 27 日	6 个月	新股流通受限	58.00	112.16	105	6,090.00	11,776.80	-
301683	慧谷新材	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股流通受限	78.38	121.77	69	5,408.22	8,402.13	-
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	-
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	-
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	-
688781	视涯科技-UW	2026 年 3 月 18 日	6 个月	新股流通受限	22.68	47.61	576	13,063.68	27,423.36	-
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	72	5,895.36	114,071.76	-
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	127	7,105.65	7,251.70	-

688818	电科蓝天	2026年2月3日	6个月	新股流通受限	9.47	70.14	923	8,740.81	64,739.22	-
688820	盛合晶微	2026年4月13日	6个月	新股流通受限	19.68	141.49	400	7,872.00	56,596.00	-

注：1、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

2、基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起约定限售期内不得转让。

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

4、基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后6个月内不得转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
400174	中天3	2023年08月30日	重大事项	0.00	-	-	286,500	500,813.56	0.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数型基金。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股（含存托凭证）。为更

好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准的股票、存托凭证）、债券（含国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券等）、货币市场工具、同业存单、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可依据法律法规的规定，参与融资及转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，力争实现基金净值增长率与标的指数增长率间的高度正相关，并保持跟踪误差在合同约定的范围内。

本基金的基金管理人致力于全面内部控制体系的建设，建立了从董事会层面到各业务部门的风险管理组织架构。本基金的基金管理人在董事会下设风险控制和合规审计委员会，主要负责制定基金管理人风险控制战略和控制政策、协调突发重大风险等事项；督察长负责对基金管理人各业务环节合法合规运作进行监督检查，组织、指导基金管理人内部监察稽核工作，并可向董事会和中国证监会直接报告；在公司内部设立独立的监察稽核部，专职负责对基金管理人各部门、各业务的风险控制情况进行督促和检查，并适时提出整改建议。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

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

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

本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，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同约定到期日均为一个月以内且不计息,可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息,因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理,通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限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	4,146,661.57	-	-	-	4,146,661.57
结算备付金	12,669,112.93	-	-	-	12,669,112.93
存出保证金	1,945,677.75	-	-	-	1,945,677.75
交易性金融资产	-	-	-	-298,670,262.84	298,670,262.84
应收清算款	-	-	-	667,562.69	667,562.69
资产总计	18,761,452.25	-	-	-299,337,825.53	318,099,277.78
负债	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	37,561.28	37,561.28
应付托管费	-	-	-	12,520.44	12,520.44
应付清算款	-	-	-	11,897.92	11,897.92
应交税费	-	-	-	58,651.90	58,651.90
其他负债	-	-	-	549,272.58	549,272.58
负债总计	-	-	-	669,904.12	669,904.12
利率敏感度缺口	18,761,452.25	-	-	-298,667,921.41	317,429,373.66
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	7,428,803.82	-	-	-	7,428,803.82
结算备付金	9,037,861.18	-	-	-	9,037,861.18
存出保证金	1,796,661.59	-	-	-	1,796,661.59
交易性金融资产	-	-	-	-283,323,383.90	283,323,383.90
资产总计	18,263,326.59	-	-	-283,323,383.90	301,586,710.49
负债	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	36,995.44	36,995.44
应付托管费	-	-	-	12,331.79	12,331.79
应付清算款	-	-	-	1.16	1.16
应交税费	-	-	-	130,233.60	130,233.60
其他负债	-	-	-	171,154.63	171,154.63
负债总计	-	-	-	350,716.62	350,716.62
利率敏感度缺口	18,263,326.59	-	-	-282,972,667.28	301,235,993.87

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和备选成份股（含存托凭证）的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。

如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR（Value at Risk）指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	298,670,262.84	94.09	283,323,383.90	94.05
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	298,670,262.84	94.09	283,323,383.90	94.05

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	15,734,974.05	14,971,428.90
	比较基准下降5%资产净值变动	-15,734,974.05	-14,971,428.90

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	298,099,069.56
第二层次	—
第三层次	571,193.28
合计	298,670,262.84

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	298,670,262.84	93.89
	其中：股票	298,670,262.84	93.89
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	—	—

	产		
7	银行存款和结算备付金合计	16,815,774.50	5.29
8	其他各项资产	2,613,240.44	0.82
9	合计	318,099,277.78	100.00

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

2、报告期末本基金投资的存托凭证公允价值为：584,000.20 元，占净值比 0.18%。本报告所指的“股票”均包含存托凭证。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	973,142.00	0.31
B	采矿业	9,180,716.83	2.89
C	制造业	224,406,185.57	70.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,243,183.60	2.28
E	建筑业	1,753,273.00	0.55
F	批发和零售业	5,646,463.47	1.78
G	交通运输、仓储和邮政业	3,607,634.00	1.14
H	住宿和餐饮业	215,880.00	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	19,236,997.37	6.06
J	金融业	16,318,096.28	5.14
K	房地产业	1,199,607.00	0.38
L	租赁和商务服务业	3,046,795.40	0.96
M	科学研究和技术服务业	2,157,323.74	0.68
N	水利、环境和公共设施管理业	1,026,009.18	0.32
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	694,451.12	0.22
R	文化、体育和娱乐业	1,393,311.00	0.44
S	综合	-	-
	合计	298,099,069.56	93.91

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	571, 193. 28	0. 18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	571, 193. 28	0. 18

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	688498	源杰科技	2, 508	4, 730, 088. 00	1. 49
2	300604	长川科技	11, 700	3, 994, 614. 00	1. 26
3	001309	德明利	4, 200	3, 960, 180. 00	1. 25
4	688347	华虹宏力	10, 738	3, 611, 189. 40	1. 14
5	688120	华海清科	10, 362	3, 338, 429. 16	1. 05
6	002281	光迅科技	12, 800	3, 288, 832. 00	1. 04
7	002008	大族激光	21, 700	3, 257, 387. 00	1. 03
8	300857	协创数据	8, 980	3, 052, 302. 00	0. 96

9	300136	信维通信	25,500	3,040,875.00	0.96
10	688361	中科飞测	6,465	2,779,950.00	0.88
11	300475	香农芯创	8,700	2,610,000.00	0.82
12	300223	北京君正	10,200	2,538,780.00	0.80
13	002436	兴森科技	44,800	2,282,560.00	0.72
14	300285	国瓷材料	21,090	2,176,066.20	0.69
15	300054	鼎龙股份	20,100	2,129,997.00	0.67
16	600105	永鼎股份	30,900	2,085,132.00	0.66
17	300666	江丰电子	5,600	2,064,160.00	0.65
18	688777	中控技术	16,680	1,959,900.00	0.62
19	688200	华峰测控	3,660	1,921,866.00	0.61
20	300757	罗博特科	3,100	1,918,900.00	0.60
21	000021	深科技	29,100	1,870,257.00	0.59
22	688037	芯源微	4,202	1,844,888.10	0.58
23	002851	麦格米特	10,700	1,788,826.00	0.56
24	601869	长飞光纤	3,200	1,746,880.00	0.55
25	300548	长芯博创	6,200	1,723,600.00	0.54
26	300346	南大光电	18,220	1,688,083.00	0.53
27	002409	雅克科技	7,500	1,683,750.00	0.53
28	300567	精测电子	5,200	1,651,520.00	0.52
29	688019	安集科技	4,749	1,612,095.54	0.51
30	600498	烽火通信	21,500	1,582,400.00	0.50
31	002407	多氟多	31,400	1,577,222.00	0.50
32	002185	华天科技	70,200	1,566,162.00	0.49
33	002138	顺络电子	21,300	1,557,030.00	0.49
34	688002	睿创微纳	9,823	1,519,519.87	0.48
35	688313	仕佳光子	8,204	1,514,868.60	0.48
36	300620	光库科技	4,000	1,512,800.00	0.48
37	300395	菲利华	11,100	1,484,403.00	0.47
38	600879	航天电子	69,700	1,483,913.00	0.47
39	300390	天华新能	15,450	1,444,729.50	0.46
40	688017	绿的谐波	3,420	1,429,081.20	0.45
41	688469	芯联集成-U	132,669	1,407,618.09	0.44
42	301526	国际复材	29,900	1,395,433.00	0.44
43	300373	扬杰科技	8,600	1,352,178.00	0.43
44	300058	蓝色光标	94,840	1,304,998.40	0.41
45	002273	水晶光电	36,600	1,298,568.00	0.41
46	300037	新宙邦	13,860	1,286,901.00	0.41
47	603256	宏和科技	4,800	1,273,584.00	0.40
48	688702	盛科通信-U	3,261	1,271,757.39	0.40
49	688172	燕东微	15,128	1,265,608.48	0.40
50	300751	迈为股份	4,400	1,242,824.00	0.39
51	301377	鼎泰高科	2,198	1,210,878.20	0.38

52	605358	立昂微	15,600	1,210,560.00	0.38
53	600988	赤峰黄金	43,900	1,155,448.00	0.36
54	688099	晶晨股份	11,111	1,143,321.90	0.36
55	605589	圣泉集团	17,900	1,137,903.00	0.36
56	600885	宏发股份	32,608	1,124,649.92	0.35
57	002738	中矿资源	18,961	1,118,509.39	0.35
58	000960	锡业股份	26,100	1,114,209.00	0.35
59	002126	银轮股份	22,300	1,110,540.00	0.35
60	600392	盛和资源	37,000	1,101,490.00	0.35
61	600601	方正科技	79,000	1,093,360.00	0.34
62	000831	中国稀土	19,600	1,087,604.00	0.34
63	001389	广合科技	4,500	1,067,625.00	0.34
64	002812	恩捷股份	15,600	1,043,796.00	0.33
65	600141	兴发集团	22,200	1,042,734.00	0.33
66	300570	太辰光	4,200	1,036,182.00	0.33
67	600378	昊华科技	13,600	1,025,168.00	0.32
68	301358	湖南裕能	13,400	1,016,658.00	0.32
69	601179	中国西电	67,600	1,008,592.00	0.32
70	688234	天岳先进	5,798	1,006,010.98	0.32
71	002195	岩山科技	149,600	978,384.00	0.31
72	600497	驰宏锌锗	79,900	967,589.00	0.30
73	002850	科达利	5,100	965,430.00	0.30
74	002261	拓维信息	33,200	929,932.00	0.29
75	600157	永泰能源	575,400	926,394.00	0.29
76	688629	华丰科技	4,889	916,736.39	0.29
77	600711	盛屯矿业	81,500	894,055.00	0.28
78	002340	格林美	134,600	889,706.00	0.28
79	600909	华安证券	79,640	884,800.40	0.28
80	600143	金发科技	56,500	872,925.00	0.27
81	688411	海博思创	2,977	866,902.40	0.27
82	688052	纳芯微	2,994	863,200.14	0.27
83	002821	凯莱英	5,300	858,600.00	0.27
84	003031	中瓷电子	4,760	858,228.00	0.27
85	300017	网宿科技	65,900	857,359.00	0.27
86	000783	长江证券	87,600	854,100.00	0.27
87	002131	利欧股份	178,600	848,350.00	0.27
88	600352	浙江龙盛	68,700	831,957.00	0.26
89	601555	东吴证券	104,790	829,936.80	0.26
90	301200	大族数控	2,300	829,495.00	0.26
91	002203	海亮股份	36,290	829,226.50	0.26
92	301611	珂玛科技	4,600	828,322.00	0.26
93	002966	苏州银行	118,080	821,836.80	0.26
94	688027	国盾量子	1,620	816,496.20	0.26

95	601233	桐昆股份	37,700	816,205.00	0.26
96	603659	璞泰来	28,200	815,826.00	0.26
97	688220	翱捷科技-U	6,558	815,290.56	0.26
98	300339	润和软件	21,000	808,710.00	0.25
99	688213	思特威-W	7,388	791,033.16	0.25
100	300759	康龙化成	27,300	789,789.00	0.25
101	688578	艾力斯	7,168	782,745.60	0.25
102	603308	应流股份	12,500	755,000.00	0.24
103	688122	西部超导	11,923	748,883.63	0.24
104	688235	百济神州	2,923	744,225.03	0.23
105	002472	双环传动	17,900	743,029.00	0.23
106	601108	财通证券	85,700	741,305.00	0.23
107	300207	欣旺达	39,000	740,610.00	0.23
108	300001	特锐德	19,500	737,685.00	0.23
109	002517	恺英网络	45,100	732,875.00	0.23
110	002797	第一创业	111,100	729,927.00	0.23
111	002601	龙佰集团	44,100	726,768.00	0.23
112	300458	全志科技	18,260	720,539.60	0.23
113	688387	信科移动-U	36,186	717,930.24	0.23
114	601958	金钼股份	25,500	716,805.00	0.23
115	603129	春风动力	2,800	716,240.00	0.23
116	688385	复旦微电	10,005	713,256.45	0.22
117	688322	奥比中光-W	5,371	701,184.05	0.22
118	300115	长盈精密	25,000	698,500.00	0.22
119	601198	东兴证券	51,200	695,808.00	0.22
120	601991	大唐发电	98,100	694,548.00	0.22
121	002155	湖南黄金	28,799	687,432.13	0.22
122	600563	法拉电子	3,600	686,880.00	0.22
123	000703	恒逸石化	50,500	685,285.00	0.22
124	688301	奕瑞科技	5,434	673,816.00	0.21
125	002465	海格通信	52,400	669,148.00	0.21
126	603179	新泉股份	13,240	657,366.00	0.21
127	601665	齐鲁银行	113,500	654,895.00	0.21
128	300454	深信服	6,800	654,160.00	0.21
129	603156	养元饮品	13,300	652,631.00	0.21
130	002056	横店东磁	21,400	652,272.00	0.21
131	600884	杉杉股份	47,500	643,625.00	0.20
132	600707	彩虹股份	38,000	641,820.00	0.20
133	300024	机器人	33,000	637,890.00	0.20
134	603650	彤程新材	6,500	636,870.00	0.20
135	002130	沃尔核材	33,200	629,472.00	0.20
136	601162	天风证券	186,500	628,505.00	0.20
137	002402	和而泰	24,300	627,669.00	0.20

138	688676	金盘科技	7,357	622,696.48	0.20
139	002429	兆驰股份	59,900	622,361.00	0.20
140	000060	中金岭南	82,000	620,740.00	0.20
141	603379	三美股份	8,140	617,744.60	0.19
142	300012	华测检测	44,500	616,770.00	0.19
143	688331	荣昌生物	4,683	610,007.58	0.19
144	000878	云南铜业	38,400	609,792.00	0.19
145	002432	九安医疗	8,600	607,848.00	0.19
146	601099	太平洋	180,100	606,937.00	0.19
147	600109	国金证券	68,540	601,781.20	0.19
148	002271	东方雨虹	50,500	599,435.00	0.19
149	300496	中科创达	9,700	599,363.00	0.19
150	000893	亚钾国际	14,600	596,994.00	0.19
151	002414	高德红外	45,000	596,700.00	0.19
152	000034	神州数码	21,480	596,070.00	0.19
153	300623	捷捷微电	13,200	593,868.00	0.19
154	002444	巨星科技	18,945	589,189.50	0.19
155	300474	景嘉微	9,700	586,656.00	0.18
156	603688	石英股份	7,100	586,531.00	0.18
157	002487	大金重工	10,100	585,497.00	0.18
158	002335	科华数据	13,775	584,748.75	0.18
159	600256	广汇能源	118,300	584,402.00	0.18
160	603979	金诚信	9,900	584,397.00	0.18
161	689009	九号公司-WD	15,308	584,000.20	0.18
162	000733	振华科技	10,300	583,392.00	0.18
163	600298	安琪酵母	16,000	579,200.00	0.18
164	301536	星辰科技	4,500	579,195.00	0.18
165	688728	格科微	27,487	578,326.48	0.18
166	600060	海信视像	20,700	576,909.00	0.18
167	688266	泽璟制药-U	4,929	575,017.14	0.18
168	000661	长春高新	8,600	572,760.00	0.18
169	300763	锦浪科技	6,300	569,205.00	0.18
170	600021	上海电力	37,300	562,111.00	0.18
171	601128	常熟银行	96,500	561,630.00	0.18
172	002756	永兴材料	9,900	560,736.00	0.18
173	601696	中银证券	44,100	557,865.00	0.18
174	600699	均胜电子	25,800	557,538.00	0.18
175	601577	长沙银行	63,900	556,569.00	0.18
176	300748	金力永磁	17,980	554,683.00	0.17
177	601615	明阳智能	47,800	553,046.00	0.17
178	300073	当升科技	11,500	552,460.00	0.17
179	002078	太阳纸业	44,200	552,058.00	0.17
180	002025	航天电器	7,200	548,784.00	0.17

181	300142	沃森生物	42,200	548,178.00	0.17
182	002157	正邦科技	195,000	547,950.00	0.17
183	688343	云天励飞-U	6,707	547,693.62	0.17
184	603920	世运电路	11,400	547,656.00	0.17
185	300919	中伟新材	12,400	542,500.00	0.17
186	300432	富临精工	27,000	542,430.00	0.17
187	000423	东阿阿胶	11,900	539,784.00	0.17
188	603087	甘李药业	9,500	539,220.00	0.17
189	603606	东方电缆	12,960	537,969.60	0.17
190	002252	上海莱士	121,700	528,178.00	0.17
191	688599	天合光能	37,020	522,722.40	0.16
192	300724	捷佳伟创	7,400	522,440.00	0.16
193	688169	石头科技	5,500	522,335.00	0.16
194	300953	震裕科技	3,900	521,430.00	0.16
195	000728	国元证券	69,326	519,251.74	0.16
196	688608	恒玄科技	3,005	502,405.95	0.16
197	002064	华峰化学	52,500	498,225.00	0.16
198	603119	浙江荣泰	7,500	497,550.00	0.16
199	603290	斯达半导	3,240	495,525.60	0.16
200	688375	国博电子	4,723	492,608.90	0.16
201	000786	北新建材	27,000	488,430.00	0.15
202	001203	大中矿业	16,200	485,190.00	0.15
203	002831	裕同科技	13,639	485,002.84	0.15
204	688018	乐鑫科技	3,776	483,025.92	0.15
205	688180	君实生物-U	14,213	480,683.66	0.15
206	600171	上海贝岭	15,000	479,100.00	0.15
207	688187	时代电气	6,968	478,422.88	0.15
208	300677	英科医疗	12,100	473,957.00	0.15
209	300679	电连技术	7,900	473,921.00	0.15
210	300383	光环新网	38,000	472,720.00	0.15
211	000519	中兵红箭	22,000	463,540.00	0.15
212	603806	福斯特	27,500	461,725.00	0.15
213	600516	方大炭素	74,500	459,665.00	0.14
214	600177	雅戈尔	61,000	459,330.00	0.14
215	002673	西部证券	70,700	458,843.00	0.14
216	688188	柏楚电子	4,289	457,636.30	0.14
217	603160	汇顶科技	7,400	456,654.00	0.14
218	601699	潞安环能	31,700	452,676.00	0.14
219	688065	凯赛生物	9,460	452,661.00	0.14
220	000559	万向钱潮	34,900	451,257.00	0.14
221	300972	万辰集团	2,600	450,866.00	0.14
222	600642	申能股份	51,500	449,595.00	0.14
223	000623	吉林敖东	25,300	448,569.00	0.14

224	002624	完美世界	35,800	444,636.00	0.14
225	688568	中科星图	10,669	442,443.43	0.14
226	600637	东方明珠	53,200	442,092.00	0.14
227	300699	光威复材	15,420	441,783.00	0.14
228	001696	宗申动力	21,100	439,091.00	0.14
229	000983	山西焦煤	75,200	436,160.00	0.14
230	000750	国海证券	118,200	434,976.00	0.14
231	002085	万丰奥威	39,200	434,728.00	0.14
232	603225	新凤鸣	22,100	434,265.00	0.14
233	603345	安井食品	5,400	433,026.00	0.14
234	002318	久立特材	18,000	430,200.00	0.14
235	300558	贝达药业	6,600	429,462.00	0.14
236	002739	儒意电影	44,500	427,200.00	0.13
237	600100	同方股份	62,000	424,700.00	0.13
238	002065	东华软件	59,200	422,688.00	0.13
239	600369	西南证券	105,100	422,502.00	0.13
240	002266	浙富控股	82,700	418,462.00	0.13
241	600499	科达制造	30,302	418,167.60	0.13
242	688617	惠泰医疗	2,297	417,043.32	0.13
243	600595	中孚实业	74,100	416,442.00	0.13
244	600536	中国软件	14,802	416,232.24	0.13
245	300627	华测导航	14,620	415,208.00	0.13
246	002044	美年健康	82,500	414,975.00	0.13
247	603699	纽威股份	8,200	412,460.00	0.13
248	688772	珠海冠宇	20,951	411,268.13	0.13
249	603596	伯特利	16,532	410,654.88	0.13
250	000629	钒钛股份	122,500	409,150.00	0.13
251	000155	川能动力	34,100	408,518.00	0.13
252	002223	鱼跃医疗	15,900	407,994.00	0.13
253	000400	许继电气	18,800	407,960.00	0.13
254	300002	神州泰岳	52,000	406,120.00	0.13
255	300003	乐普医疗	34,100	404,085.00	0.13
256	000032	深桑达 A	16,100	401,695.00	0.13
257	601016	节能风电	103,520	401,657.60	0.13
258	600985	淮北矿业	28,500	400,425.00	0.13
259	002430	杭氧股份	12,900	399,384.00	0.13
260	000415	渤海租赁	97,900	398,453.00	0.13
261	601212	白银有色	78,400	398,272.00	0.13
262	601216	君正集团	89,200	397,832.00	0.13
263	600521	华海药业	27,600	397,440.00	0.13
264	600862	中航高科	22,030	397,200.90	0.13
265	601997	贵阳银行	77,400	397,062.00	0.13
266	601717	中创智领	28,500	396,435.00	0.12

267	000039	中集集团	48,800	395,768.00	0.12
268	000683	博源化工	68,600	395,136.00	0.12
269	300487	蓝晓科技	6,700	394,295.00	0.12
270	603444	吉比特	1,100	394,262.00	0.12
271	600863	华能蒙电	82,700	388,690.00	0.12
272	603766	隆鑫通用	32,500	387,725.00	0.12
273	600704	物产中大	82,000	387,040.00	0.12
274	601001	晋控煤业	22,000	382,580.00	0.12
275	601990	南京证券	58,000	381,060.00	0.12
276	000050	深天马 A	38,400	380,544.00	0.12
277	688538	和辉光电-U	146,206	380,135.60	0.12
278	600873	梅花生物	51,700	379,995.00	0.12
279	002841	视源股份	11,000	379,830.00	0.12
280	600312	平高电气	21,400	377,924.00	0.12
281	603077	和邦生物	162,800	377,696.00	0.12
282	603605	珀莱雅	6,300	377,496.00	0.12
283	000729	燕京啤酒	37,100	375,823.00	0.12
284	000887	中鼎股份	20,900	373,901.00	0.12
285	688297	中无人机	8,978	373,035.90	0.12
286	600332	白云山	18,600	372,744.00	0.12
287	000967	盈峰环境	35,300	371,709.00	0.12
288	600765	中航重机	28,760	371,579.20	0.12
289	688692	达梦数据	1,507	368,145.03	0.12
290	600348	华阳股份	47,750	365,287.50	0.12
291	600166	福田汽车	124,900	363,459.00	0.11
292	600153	建发股份	45,800	363,194.00	0.11
293	000830	鲁西化工	30,200	362,400.00	0.11
294	688615	合合信息	3,198	361,693.80	0.11
295	002939	长城证券	42,700	356,118.00	0.11
296	601611	中国核建	31,800	354,570.00	0.11
297	002410	广联达	43,400	354,144.00	0.11
298	002007	华兰生物	29,000	353,510.00	0.11
299	000062	深圳华强	11,100	353,202.00	0.11
300	600901	江苏金租	61,260	352,245.00	0.11
301	002683	广东宏大	12,000	351,480.00	0.11
302	688582	芯动联科	5,379	349,635.00	0.11
303	600737	中粮糖业	28,300	348,939.00	0.11
304	601799	星宇股份	3,800	344,356.00	0.11
305	600578	京能电力	53,100	342,495.00	0.11
306	600363	联创光电	9,500	339,910.00	0.11
307	002926	华西证券	41,400	338,238.00	0.11
308	603728	鸣志电器	5,500	335,060.00	0.11
309	688114	华大智造	6,535	333,807.80	0.11

310	000921	海信家电	12,200	333,304.00	0.11
311	603568	伟明环保	21,611	332,377.18	0.10
312	000591	太阳能	72,200	332,120.00	0.10
313	000737	北方铜业	25,100	331,822.00	0.10
314	002603	以岭药业	22,100	331,500.00	0.10
315	600398	海澜之家	63,300	331,059.00	0.10
316	603298	杭叉集团	13,800	329,268.00	0.10
317	000528	柳工	43,100	325,405.00	0.10
318	600486	扬农化工	6,390	323,973.00	0.10
319	601000	唐山港	77,900	323,285.00	0.10
320	603341	龙旗科技	7,500	318,675.00	0.10
321	600316	洪都航空	11,400	318,516.00	0.10
322	600208	衢州发展	112,300	317,809.00	0.10
323	000738	航发控制	17,300	316,417.00	0.10
324	600008	首创环保	116,200	316,064.00	0.10
325	000932	华菱钢铁	90,700	314,729.00	0.10
326	600435	北方导航	28,000	313,600.00	0.10
327	600995	南网储能	25,400	312,420.00	0.10
328	600998	九州通	66,559	312,161.71	0.10
329	603486	科沃斯	6,150	312,112.50	0.10
330	600170	上海建工	140,500	311,910.00	0.10
331	000987	越秀资本	39,675	310,258.50	0.10
332	688248	南网科技	4,443	307,366.74	0.10
333	002152	广电运通	32,700	306,726.00	0.10
334	000997	新大陆	18,700	304,810.00	0.10
335	600161	天坛生物	26,100	302,238.00	0.10
336	600820	隧道股份	58,000	302,180.00	0.10
337	002262	恩华药业	16,100	301,875.00	0.10
338	000951	中国重汽	15,400	300,454.00	0.09
339	601106	中国一重	90,600	298,980.00	0.09
340	600483	福能股份	29,300	298,567.00	0.09
341	603885	吉祥航空	29,000	298,410.00	0.09
342	600282	南钢股份	64,900	297,891.00	0.09
343	000009	中国宝安	47,468	295,725.64	0.09
344	600583	海油工程	58,600	294,758.00	0.09
345	002500	山西证券	56,720	292,675.20	0.09
346	603816	顾家家居	13,000	290,680.00	0.09
347	603939	益丰药房	16,100	289,478.00	0.09
348	688295	中复神鹰	4,758	288,049.32	0.09
349	600546	山煤国际	26,300	287,459.00	0.09
350	000582	北部湾港	26,600	285,418.00	0.09
351	603338	浙江鼎力	6,700	284,750.00	0.09
352	688166	博瑞医药	8,095	283,405.95	0.09

353	688778	厦钨新能	5,209	283,369.60	0.09
354	601666	平煤股份	39,300	280,995.00	0.09
355	600763	通策医疗	8,249	279,476.12	0.09
356	600562	国睿科技	13,160	279,255.20	0.09
357	600329	达仁堂	7,500	279,150.00	0.09
358	688318	财富趋势	3,900	278,109.00	0.09
359	601567	三星电气	18,500	276,390.00	0.09
360	600685	中船防务	10,800	274,752.00	0.09
361	002312	川发龙蟒	29,900	274,183.00	0.09
362	000723	美锦能源	81,600	273,360.00	0.09
363	600602	云赛智联	17,000	273,360.00	0.09
364	600380	健康元	29,000	273,180.00	0.09
365	600038	中直股份	10,800	273,132.00	0.09
366	603565	中谷物流	27,800	272,718.00	0.09
367	003022	联泓新科	10,500	271,950.00	0.09
368	600390	五矿资本	59,300	270,408.00	0.09
369	300676	华大基因	7,700	269,962.00	0.09
370	601156	东航物流	16,700	269,204.00	0.08
371	601880	辽港股份	195,000	269,100.00	0.08
372	000513	丽珠集团	9,300	268,677.00	0.08
373	601399	国机重装	76,200	266,700.00	0.08
374	600132	重庆啤酒	6,400	264,320.00	0.08
375	601865	福莱特	25,000	262,750.00	0.08
376	600535	天士力	19,800	261,954.00	0.08
377	600511	国药股份	9,900	257,796.00	0.08
378	601236	红塔证券	37,600	256,432.00	0.08
379	600906	财达证券	34,300	255,878.00	0.08
380	600977	中国电影	19,800	255,816.00	0.08
381	600816	建元信托	104,300	254,492.00	0.08
382	688281	华秦科技	5,058	254,063.34	0.08
383	000739	普洛药业	15,200	253,232.00	0.08
384	000598	兴蓉环境	39,300	252,306.00	0.08
385	688336	三生国健	4,744	251,906.40	0.08
386	002244	滨江集团	33,000	250,800.00	0.08
387	002299	圣农发展	16,500	250,140.00	0.08
388	300100	双林股份	9,000	250,020.00	0.08
389	600970	中材国际	34,800	248,124.00	0.08
390	601155	新城控股	23,800	244,188.00	0.08
391	300718	长盛轴承	4,000	243,880.00	0.08
392	300735	光弘科技	10,700	243,318.00	0.08
393	002120	韵达股份	38,100	242,316.00	0.08
394	600967	内蒙一机	22,300	241,955.00	0.08
395	300144	宋城演艺	41,600	241,696.00	0.08

396	300146	汤臣倍健	26,700	241,368.00	0.08
397	000883	湖北能源	55,800	241,056.00	0.08
398	002568	百润股份	13,800	233,496.00	0.07
399	000027	深圳能源	37,580	232,996.00	0.07
400	000800	一汽解放	39,100	232,645.00	0.07
401	688278	特宝生物	4,260	231,744.00	0.07
402	601608	中信重工	48,100	229,437.00	0.07
403	600131	国网信通	15,700	229,220.00	0.07
404	003021	兆威机电	2,600	227,110.00	0.07
405	688363	华熙生物	6,349	227,103.73	0.07
406	600095	湘财股份	30,100	226,653.00	0.07
407	601866	中远海发	102,300	226,083.00	0.07
408	603737	三棵树	9,370	225,817.00	0.07
409	000088	盐田港	55,000	224,950.00	0.07
410	600801	华新建材	14,200	221,520.00	0.07
411	002583	海能达	28,800	221,472.00	0.07
412	601118	海南橡胶	45,000	221,400.00	0.07
413	600126	杭钢股份	35,500	217,615.00	0.07
414	600871	石化油服	106,600	216,398.00	0.07
415	603000	人民网	14,600	215,934.00	0.07
416	600754	锦江酒店	12,000	215,880.00	0.07
417	600566	济川药业	9,700	215,243.00	0.07
418	002984	森麒麟	16,400	214,348.00	0.07
419	000709	河钢股份	108,900	211,266.00	0.07
420	600517	国网英大	45,000	210,600.00	0.07
421	600655	豫园股份	51,000	209,610.00	0.07
422	603589	口子窖	11,100	207,348.00	0.07
423	000825	太钢不锈	60,000	204,600.00	0.06
424	603858	步长制药	14,000	204,400.00	0.06
425	600598	北大荒	18,800	203,792.00	0.06
426	601598	中国外运	40,800	202,368.00	0.06
427	301606	绿联科技	3,300	201,366.00	0.06
428	001286	陕西能源	19,800	200,772.00	0.06
429	603899	晨光股份	9,700	200,111.00	0.06
430	600350	山东高速	17,900	199,227.00	0.06
431	002423	中粮资本	24,200	199,166.00	0.06
432	002773	康弘药业	9,700	198,365.00	0.06
433	601966	玲珑轮胎	19,400	197,686.00	0.06
434	600663	陆家嘴	31,300	196,564.00	0.06
435	600004	白云机场	27,000	196,020.00	0.06
436	688192	迪哲医药-U	4,860	194,059.80	0.06
437	600582	天地科技	43,600	194,020.00	0.06
438	688709	成都华微	5,087	193,763.83	0.06

439	688349	三一重能	12,707	192,892.26	0.06
440	600848	上海临港	25,400	190,246.00	0.06
441	000429	粤高速 A	13,700	187,005.00	0.06
442	601098	中南传媒	19,000	186,960.00	0.06
443	688563	航材股份	3,619	185,401.37	0.06
444	002508	老板电器	12,500	182,750.00	0.06
445	603233	大参林	11,992	180,239.76	0.06
446	600968	海油发展	53,500	178,155.00	0.06
447	601928	凤凰传媒	20,100	176,679.00	0.06
448	300957	贝泰妮	5,600	176,456.00	0.06
449	600062	华润双鹤	11,000	176,440.00	0.06
450	688561	奇安信-U	7,261	174,118.78	0.05
451	003035	南网能源	29,800	173,436.00	0.05
452	300888	稳健医疗	6,180	172,978.20	0.05
453	688425	铁建重工	42,610	171,292.20	0.05
454	600688	上海石化	58,300	170,819.00	0.05
455	601808	中海油服	15,800	170,798.00	0.05
456	002670	国盛证券	15,300	168,300.00	0.05
457	002032	苏泊尔	4,200	166,320.00	0.05
458	600295	鄂尔多斯	15,500	166,160.00	0.05
459	688708	佳驰科技	3,263	165,760.40	0.05
460	600098	广州发展	27,600	163,116.00	0.05
461	000539	粤电力 A	23,500	160,035.00	0.05
462	002153	石基信息	21,842	157,917.66	0.05
463	000537	绿发电力	21,600	157,896.00	0.05
464	600808	马钢股份	62,700	156,750.00	0.05
465	600292	电投水电	12,700	152,908.00	0.05
466	600377	宁沪高速	13,000	150,410.00	0.05
467	601298	青岛港	18,600	149,730.00	0.05
468	603833	欧派家居	4,800	144,528.00	0.05
469	000959	首钢股份	40,700	142,857.00	0.05
470	002265	建设工业	8,200	142,680.00	0.04
471	301301	川宁生物	17,700	140,538.00	0.04
472	002608	江苏国信	20,100	138,690.00	0.04
473	600606	绿地控股	111,400	134,794.00	0.04
474	600032	浙江新能	19,100	134,655.00	0.04
475	603529	爱玛科技	6,900	134,619.00	0.04
476	600339	中油工程	43,800	134,466.00	0.04
477	000785	居然智家	65,900	131,800.00	0.04
478	603786	科博达	3,200	130,912.00	0.04
479	603658	安图生物	4,500	130,590.00	0.04
480	600764	中国海防	7,400	128,982.00	0.04
481	601139	深圳燃气	22,700	128,482.00	0.04

482	688520	神州细胞	3,730	127,603.30	0.04
483	301498	乖宝宠物	3,100	125,829.00	0.04
484	300140	节能环保	24,600	122,262.00	0.04
485	000937	冀中能源	30,490	121,350.20	0.04
486	000898	鞍钢股份	63,600	118,932.00	0.04
487	603049	中策橡胶	2,600	116,506.00	0.04
488	603175	超颖电子	1,300	115,817.00	0.04
489	688475	萤石网络	4,088	111,806.80	0.04
490	601228	广州港	39,500	111,390.00	0.04
491	601019	山东出版	16,400	104,960.00	0.03
492	002945	华林证券	7,200	96,696.00	0.03
493	600927	永安期货	7,600	94,620.00	0.03
494	601112	振石股份	5,100	92,973.00	0.03
495	002461	珠江啤酒	11,600	87,812.00	0.03
496	600299	安迪苏	10,400	81,640.00	0.03
497	688819	天能股份	3,651	81,052.20	0.03
498	603092	德力佳	1,000	53,970.00	0.02
499	001221	悍高集团	1,100	44,242.00	0.01
500	001386	马可波罗	2,800	39,648.00	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	301666	大普微-UW	384	177,918.72	0.06
2	688808	联讯仪器	72	114,071.76	0.04
3	688818	电科蓝天	923	64,739.22	0.02
4	688820	盛合晶微	400	56,596.00	0.02
5	688635	长进光子	128	39,448.32	0.01
6	688781	视涯科技-UW	576	27,423.36	0.01
7	688811	有研复材	834	20,124.42	0.01
8	301599	理奇智能	364	11,819.08	0.00
9	301680	固德电材	105	11,776.80	0.00
10	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
11	001365	天海电子	311	9,737.41	0.00
12	001393	维通利	222	8,655.78	0.00
13	301683	慧谷新材	69	8,402.13	0.00
14	688816	易思维	127	7,251.70	0.00
15	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
16	001312	福恩股份	93	1,560.54	0.00
17	400174	中天 3	286,500	0.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	688498	源杰科技	3,947,889.39	1.31
2	001309	德明利	2,886,568.00	0.96
3	300666	江丰电子	1,778,708.00	0.59
4	300475	香农芯创	1,723,350.00	0.57
5	600105	永鼎股份	1,675,854.00	0.56
6	688037	芯源微	1,532,960.14	0.51
7	300548	长芯博创	1,447,039.00	0.48
8	601869	长飞光纤	1,446,242.32	0.48
9	688313	仕佳光子	1,357,364.70	0.45
10	688200	华峰测控	1,282,748.81	0.43
11	002407	多氟多	1,244,094.00	0.41
12	300620	光库科技	1,243,064.00	0.41
13	603256	宏和科技	1,106,392.00	0.37
14	600711	盛屯矿业	1,044,340.00	0.35
15	002812	恩捷股份	1,021,994.00	0.34
16	301377	鼎泰高科	1,021,054.00	0.34
17	600487	亨通光电	975,388.00	0.32
18	301526	国际复材	904,769.00	0.30
19	688347	华虹宏力	867,513.16	0.29
20	603308	应流股份	804,749.00	0.27

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

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600487	亨通光电	6,852,409.00	2.27
2	688525	佰维存储	3,950,939.15	1.31
3	600549	厦门钨业	2,987,268.00	0.99
4	002353	杰瑞股份	2,543,959.08	0.84
5	301308	江波龙	2,468,750.00	0.82
6	601168	西部矿业	2,061,210.00	0.68
7	002156	通富微电	2,022,810.88	0.67
8	600673	东阳光	2,001,777.00	0.66
9	000657	中钨高新	1,916,899.00	0.64
10	600118	中国卫星	1,885,918.00	0.63
11	600580	卧龙电驱	1,569,842.60	0.52
12	600096	云天化	1,569,290.00	0.52
13	603228	景旺电子	1,450,931.60	0.48
14	000426	兴业银锡	1,424,439.00	0.47
15	002202	金风科技	1,410,607.00	0.47
16	002837	英维克	1,409,631.60	0.47
17	300450	先导智能	1,252,574.00	0.42
18	002080	中材科技	1,198,521.00	0.40

19	688183	生益电子	1, 153, 996. 23	0. 38
20	000933	神火股份	1, 144, 426. 00	0. 38

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	116, 038, 986. 21
卖出股票收入（成交）总额	129, 203, 517. 66

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：无。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：无。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

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

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

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	1,945,677.75
2	应收清算款	667,562.69
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	2,613,240.44

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	177,918.72	0.06	新股流通受限
2	688808	联讯仪器	114,071.76	0.04	新股流通受限
3	688818	电科蓝天	64,739.22	0.02	新股流通受限
4	688820	盛合晶微	56,596.00	0.02	新股流通受限
5	688635	长进光子	39,448.32	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

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 (%)
5,040	26,232.39	58,941,904.00	44.58	73,269,349.00	55.42

8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额 (份)	占总份额比例 (%)
中国工商银行股份有限公司-鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	34,930,937.00	26.42

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（2019 年 11 月 21 日） 基金份额总额	490,211,253.00
本报告期期初基金份额总额	154,211,253.00
本报告期基金总申购份额	46,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	68,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	132,211,253.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人的重大人事变动：

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：本报告期内托管人无重大受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内托管人相关从业人员无重大受调查或处罚等情况。

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 (%)	
中金公司	1	114,624,375.	46.88	21,314.66	46.89	-

		82				
东方财富 证券	1	65,623,148.2 2	26.84	12,200.05	26.84	-
东吴证券	1	64,248,594.8 2	26.28	11,944.37	26.27	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
国联民生 证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰海通 证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源 证券	2	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
中泰证券	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的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
中金公司	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
国联民生证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
中泰证	-	-	-	-	-	-

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	鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2025 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	2026 年 01 月 21 日
2	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金增加国联民生证券股份有限公司为申购赎回代理券商的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 02 月 06 日
3	鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2025 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	2026 年 03 月 30 日
4	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金增加平安证券股份有限公司为申购赎回代理券商的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 03 月 30 日
5	鹏华基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《中国证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 04 月 04 日
6	鹏华基金管理有限公司关于暂停客服电话服务的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 04 月 17 日
7	鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2026 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	2026 年 04 月 21 日
8	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理本公司旗下基金销售业务的公告	《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	2026 年 05 月 30 日
9	鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理变更公告	《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	2026 年 06 月 17 日
10	鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要（更新）	《中国证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 06 月 23 日
11	鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金更新的招募说明书（2026 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	2026 年 06 月 23 日
12	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	《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	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	20260101~20260205, 20260302~20260630	35,160,537.00	9,130,400.00	9,360,000.00	34,930,937.00	26.42
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 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- (二)《鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- (三)《鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 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