

鹏华价值精选股票型证券投资基金 2023 年中期报告

2023 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：2023 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 08 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 2023 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	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	12
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	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	44
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
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	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	59
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	60

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	61
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	61
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	61
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	61
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	61
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	61
7.12 投资组合报告附注	61
§ 8 基金份额持有人信息.....	62
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	62
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	62
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	62
§ 9 开放式基金份额变动.....	62
§ 10 重大事件揭示	63
10.1 基金份额持有人大会决议	63
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	63
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	63
10.4 基金投资策略的改变	63
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	63
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	63
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	63
10.8 其他重大事件	67
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	68
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	68
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	68
§ 12 备查文件目录	68
12.1 备查文件目录	68
12.2 存放地点	68
12.3 查阅方式	68

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华价值精选股票型证券投资基金
基金简称	鹏华价值精选股票
基金主代码	206012
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012 年 4 月 16 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	76,753,770.09 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在适度控制风险并保持良好流动性的前提下，精选具备估值优势以及良好基本面的上市公司，力争实现超额收益与长期资本增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金通过对宏观经济、微观经济运行态势、政策环境、利率走势、证券市场走势及证券市场现阶段的系统性风险以及未来一段时期内各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估，运用定量及定性相结合的手段，制定股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金通过定性与定量相结合的积极投资策略，自下而上地精选价值被低估并且具有良好基本面的股票构建股票投资组合。</p> <p>(1) 定性分析</p> <p>本基金通过以下标准对股票的基本面进行研究分析并筛选出基本面优异的上市公司：</p> <p>第一、根据公司的核心业务竞争力、市场地位、经营管理者能力、人才资源等选择具备良好竞争优势的公司；</p> <p>第二、根据上市公司股权结构、公司组织框架、信息透明度等角度定性分析，选择公司治理结构良好的公司；</p> <p>第三、通过定性的方式分析公司在自身的发展过程中，受国家政策的扶持程度，公司发展方向，核心产品发展前景，公司规模增长及经营效益的趋势。另外还将考察公司在同业中的地位、核心产品的竞争力、市场需求状况及公司的决策体系及其开拓精神等。</p> <p>(2) 定量分析</p> <p>本基金通过对上市公司内在价值的深入分析，挖掘具备估值优势的上市公司。本基金将在宏观经济分析、行业分析的基础上，根据公司的基本面以及财务报表信息灵活运用各类估值方法评估公司的价值。本基金采用的估值方法及评估指标包括 PE、PEG、PB、PS、EV/EBITDA 等。</p> <p>(3) 存托凭证投资策略</p> <p>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</p>

	<p>投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>本基金通过久期配置、类属配置、期限结构配置等，采取积极主动的投资策略，在严格控制风险的前提下，发掘和利用市场失衡提供的投资机会，实现债券组合增值。</p> <p>4、权证产品投资策略</p> <p>本基金通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型及价值挖掘策略、价差策略、双向权证策略等寻求权证的合理估值水平，追求稳定的当期收益。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×90%+中证综合债指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为采用高仓位运作的股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金及普通股票型基金，属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种。

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
	联系电话	0755-81395402
	电子邮箱	xxpl@phfund.com.cn
客户服务电话	4006788999	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	何如	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.phfund.com.cn
基金中期报告备置地点	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层鹏华基金管理有限公司

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	鹏华基金管理有限公司	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023年1月1日-2023年6月30日)
本期已实现收益	273,551.33
本期利润	6,444,928.26
加权平均基金份额本期利润	0.0806
本期加权平均净值利润率	2.66%
本期基金份额净值增长率	2.43%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)
期末可供分配利润	156,318,765.32
期末可供分配基金份额利润	2.0366
期末基金资产净值	233,072,535.41
期末基金份额净值	3.037
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)
基金份额累计净值增长率	203.70%

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
过去一个月	3.19%	1.01%	1.10%	0.78%	2.09%	0.23%
过去三个月	0.56%	0.96%	-4.46%	0.75%	5.02%	0.21%
过去六个月	2.43%	0.92%	-0.37%	0.76%	2.80%	0.16%
过去一年	-7.27%	1.13%	-12.53%	0.89%	5.26%	0.24%
过去三年	41.12%	1.61%	-5.43%	1.08%	46.55%	0.53%
自基金合同生效起至今	203.70%	1.58%	53.84%	1.25%	149.86%	0.33%

注：业绩比较基准=沪深300指数收益率×90%+中证综合债指数收益率×10%

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 2012 年 04 月 16 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 6 月 30 日，公司管理资产总规模达到 11517 亿元，301 只公募基金、13 只全国社保投资组合、7 只基本养老保险投资组合。经过 20 余年投资管理基金，在基金投资、风险控制等方面积累了丰富经验。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张鹏	基金经理	2021-08-24	-	10 年	张鹏先生，国籍中国，金融学硕士，10 年证券从业经验。曾任鹏华基金管理有限公

				司研究部助理研究员、研究员，中欧基金管理有限公司研究部研究员，自 2017 年任鹏华基金管理有限公司研究部高级研究员、基金经理助理/研究员，现担任权益投资二部基金经理。2021 年 08 月至今担任鹏华策略回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2021 年 08 月至今担任鹏华价值精选股票型证券投资基金基金经理，2023 年 01 月至今担任鹏华价值共赢两年持有期混合型证券投资基金基金经理，2023 年 03 月至今担任鹏华产业精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2023 年 04 月至今担任鹏华优质治理混合型证券投资基金（LOF）基金经理，张鹏先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理未发生变动。
--	--	--	--	--

注：1. 任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日；担任新成立基金基金经理的，任职日期为基金合同生效日。

2. 证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

本报告期内，本基金运作合规，不存在违反基金合同和损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行公平交易制度，确保不同投资组合在研究、交易、分配等各环节得到公平对待。公司对不同投资组合在不同时间窗口下（日内、3 日内、5 日内）的同向交易价差进行专项分析，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未发生违法违规且对基金财产造成损失的异常交易行为。本报告期内未发生基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年，市场剧烈震荡，结构显著分化。中信各一级行业指数头尾涨幅差异较大，前列的 TMT 行业涨幅在 40%水平，而尾部的消费者服务、地产等板块跌幅在 20%左右。

1 月份新能源触底反弹为主，2、3、4 月份泛 AI 线索和数据要素在海外出现爆款应用和产业政策驱动下成为市场主线，TMT 及半导体板块涨幅明显，主线外餐饮出行旅游酒店等复苏线板块持续调整，年季报业绩较好的板块（如家电等）取得较大涨幅。5-6 月市场分歧明显加大，TMT 等年初涨幅较大的板块和其他相对底部的板块之间出现了资产价格的再平衡，复苏线整体弱现实的背景下可选消费复苏较好，尤其是汽车价格战趋缓，电车补贴政策落地，渗透率继续向上，同时市场又有新的线索，一是临近中报季，对业绩好甚至有超预期可能的个股和板块的挖掘逐步加深，二是在算力链和应用端预期挖掘比较充分的情况下，海外公司进展和产业政策，催化拓展出了人形机器人和智能驾驶等泛 AI 线上的新线索。

在产品操作上的核心思路，依然是一以贯之的保持了泛制造业的核心持仓。总体仓位水平保持 90%左右未做择时，边际结构上，总体仓位水平保持 90%左右未做择时。边际结构上通过对新兴产业和技术的学习驱动，进行优化，一是愿意容纳和学习 AI 线索等新兴前沿产业的变化，二是结合各类资产价格周期所处的位置进行一定的边际轮动，控制回撤。

增加数据要素链条上进展较快的公司的仓位和泛 AI 线索上的算力、存储、智能驾驶等板块的仓位，增仓如出口链等景气趋势向上的标的，减仓复苏节奏明显低于预期的相关板块，增仓制造业中处于相对较低位置的优质公司。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期鹏华价值精选股票份额净值增长率为 2.43%，同期业绩比较基准增长率为-0.37%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

整体上，23 年是疫情放开后的第一年，市场对复苏普遍抱有较高预期，与政府保持高质量增长、优化结构的政策指向和战略定力，存在一定的认知差，我们认为 23 年产业结构的变化方向和产业政策的指向，是强于总量逻辑的投资线索，因此后续的研究和关注重点依然是政策支持、渗透率向上突破的新兴产业和线索。具体如，泛 AI 线索上的算力、存储等硬件环节和办公、智能驾驶等、智能设备等推进快的应用、数据要素从清洗标注到确权交易各环节的持续推进，带来的数据资产的价值重估、半导体产业的国产化和复苏周期。此外还值得观察的线索包括，联储加息边际放缓、可能的经济刺激政策和内生修复、军工订单的恢复等等。整体上依然是围绕着泛制造

业（广义范围包括硬件软件）各环节，寻找变化带来的投资机会。

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、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 156,318,765.32 元，期末基金份额净值 3.037 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合规守信、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的真实、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：鹏华价值精选股票型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	25,619,169.80	18,380,737.07
结算备付金		830,987.08	858,192.25
存出保证金		96,738.92	91,209.21
交易性金融资产	6.4.7.2	210,536,135.83	220,605,693.80
其中：股票投资		210,536,135.83	220,419,350.65
基金投资		-	-
债券投资		-	186,343.15
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	-	10,119,974.93
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	3,732,997.92
应收股利		-	-
应收申购款		33,237.75	52,540.16

递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		237,116,269.38	253,841,345.34
负债和净资产	附注号	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022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		2,382,943.27	184,614.82
应付赎回款		677,676.80	130,717.79
应付管理人报酬		229,583.81	257,760.09
应付托管费		47,829.95	53,700.02
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	0.69
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	705,700.14	656,161.94
负债合计		4,043,733.97	1,282,955.35
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	76,753,770.09	85,175,032.70
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	156,318,765.32	167,383,357.29
净资产合计		233,072,535.41	252,558,389.99
负债和净资产总计		237,116,269.38	253,841,345.34

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 3.037 元，基金份额总额 76,753,770.09 份。

6.2 利润表

会计主体：鹏华价值精选股票型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		8,279,367.41	-36,409,471.28
1. 利息收入		85,844.21	81,560.74
其中：存款利息收入	6.4.7.13	50,024.10	64,068.48
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产		35,820.11	17,492.26

收入			
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,002,703.64	-29,121,514.18
其中：股票投资收益	6.4.7.14	795,634.61	-30,598,794.25
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	70,664.26	-
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
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	1,136,404.77	1,477,280.07
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	6,171,376.93	-7,411,942.58
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	19,442.63	42,424.74
减：二、营业总支出		1,834,439.15	2,141,218.89
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,446,803.91	1,701,004.38
2. 托管费	6.4.10.2.2	301,417.51	354,375.91
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		0.07	-
8. 其他费用	6.4.7.23	86,217.66	85,838.60
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		6,444,928.26	-38,550,690.17
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		6,444,928.26	-38,550,690.17
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		6,444,928.26	-38,550,690.17

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：鹏华价值精选股票型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	85,175,032.70	-	167,383,357.29	252,558,389.99
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	85,175,032.70	-	167,383,357.29	252,558,389.99
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-8,421,262.61	-	-11,064,591.97	-19,485,854.58
(一)、综合收益总额	-	-	6,444,928.26	6,444,928.26
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-8,421,262.61	-	-17,509,520.23	-25,930,782.84
其中：1. 基金申	3,226,045.01	-	6,593,665.38	9,819,710.39

购款				
2. 基金赎回款	-11,647,307.62	-	-24,103,185.61	-35,750,493.23
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	76,753,770.09	-	156,318,765.32	233,072,535.41
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022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(基金净值)	90,842,808.18	-	244,623,860.42	335,466,668.60
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	90,842,808.18	-	244,623,860.42	335,466,668.60

三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-3,384,184.96	-	-45,666,079.98	-49,050,264.94
(一)、综合收益总额	-	-	-38,550,690.17	-38,550,690.17
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-3,384,184.96	-	-7,115,389.81	-10,499,574.77
其中:1.基金申购款	9,320,705.31	-	20,824,297.13	30,145,002.44
2.基金赎回款	-12,704,890.27	-	-27,939,686.94	-40,644,577.21
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基	87,458,623.22	-	198,957,780.44	286,416,403.66

金净值)				
------	--	--	--	--

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

鹏华价值精选股票型证券投资基金(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[2011]1627 号《关于核准鹏华价值精选股票型证券投资基金募集的批复》核准,由鹏华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华价值精选股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 334,728,307.80 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第 090 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华价值精选股票型证券投资基金基金合同》于 2012 年 4 月 16 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 334,825,290.98 份基金份额,其中认购资金利息折合 96,983.18 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于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、《资产管理产品相关会计处理规定》(财会[2022]14 号)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《鹏华价值精选股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 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 2023 年 06 月 30 日的财务状况以及 2023 年上半年的经营成果和基金净资产变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

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

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个

人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	25,619,169.80
等于：本金	25,616,462.10
加：应计利息	2,707.70
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	25,619,169.80

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	212,604,802.13	-	210,536,135.83	-2,068,666.30
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	212,604,802.13	-	210,536,135.83	-2,068,666.30

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

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.8 其他资产

注：无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	432.21
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	620,965.37
其中：交易所市场	620,965.37
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	84,302.56
合计	705,700.14

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	85,175,032.70	85,175,032.70
本期申购	3,226,045.01	3,226,045.01
本期赎回（以“-”号填列）	-11,647,307.62	-11,647,307.62
- 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	76,753,770.09	76,753,770.09

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

注：无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	182,149,089.53	-14,765,732.24	167,383,357.29
本期利润	273,551.33	6,171,376.93	6,444,928.26
本期基金份额交易产生的变动数	-18,116,859.17	607,338.94	-17,509,520.23
其中：基金申购款	6,958,389.30	-364,723.92	6,593,665.38
基金赎回款	-25,075,248.47	972,062.86	-24,103,185.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	164,305,781.69	-7,987,016.37	156,318,765.32

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	39,382.70
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	9,865.52
其他	775.88
合计	50,024.10

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
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	795,634.61
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	795,634.61

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
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	700,010,771.35
减：卖出股票成本总额	697,137,684.76
减：交易费用	2,077,451.98
买卖股票差价收入	795,634.61

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

6.4.7.15 债券投资收益**6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	20.12
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	70,644.14
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	70,664.26

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	218,699.60
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	148,000.00
减：应计利息总额	46.71
减：交易费用	8.75
买卖债券差价收入	70,644.14

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
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,136,404.77
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	1,136,404.77

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
1. 交易性金融资产	6,171,376.93
股票投资	6,209,694.13
债券投资	-38,317.20
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	6,171,376.93

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	16,326.34
基金转换费收入	3,116.29
合计	19,442.63

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
	2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费用	1,915.10
合计	86,217.66

6.4.7.24 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
鹏华基金管理有限公司（“鹏华基金公	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构

司”)	
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人、基金代销机构
国信证券股份有限公司(“国信证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	18,731,439.96	1.36	21,413,254.77	1.93

6.4.10.1.2 债券交易

注：无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比 例(%)	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比 例(%)
国信证券	11,971,000.00	3.95	-	-

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 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例(%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例(%)
国信证券	17,257.91	1.36	17,257.91	2.78
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	19,655.50	1.94	19,655.50	3.87
------	-----------	------	-----------	------

注：（1）佣金的计算公式

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

（佣金比率按照与一般证券公司签订的协议条款订立。）

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,446,803.91	1,701,004.38
其中：支付销售机构的客户维护费	457,924.32	540,474.87

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1.20%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×1.20%÷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 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	301,417.51	354,375.91

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0.25%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×0.25%/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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2012 年 4 月 16 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	7,384,785.82	7,384,785.82
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	7,384,785.82	7,384,785.82
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	9.6214%	8.4437%

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

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	25,619,169.80	39,382.70	34,115,081.95	56,273.87

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
国信证券	688562	航天软件	网下申购	3,714	47,093.52
国信证券	301488	豪恩汽电	网下申购	1,196	47,576.88
国信证券	688307	中润光学	网下申购	2,455	58,625.40
上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
国信证券	-	-	-	-	-

注：本表包含参与基金托管人的关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

注：无。

6.4.12 期末（2023 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
001282	三联锻造	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	27.93	33.03	72	2,010.96	2,378.16	-
001286	陕西能源	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
001287	中电港	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股流通受限	11.88	21.02	295	3,504.60	6,200.90	-
001324	长青科技	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股流通受限	18.88	19.60	94	1,774.72	1,842.40	-
001328	登康口腔	2023 年 3 月 29 日	6 个月	新股流通受限	20.68	25.49	80	1,654.40	2,039.20	-
001367	海森药业	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股流通受限	44.48	39.48	40	1,779.20	1,579.20	-

		日									
301141	中科磁业	2023年3月27日	6个月	新股流通受限	41.20	42.69	178	7,333.60	7,598.82	-	
301157	华塑科技	2023年3月1日	6个月	新股流通受限	56.50	52.93	102	5,763.00	5,398.86	-	
301170	锡南科技	2023年6月16日	6个月	新股流通受限	34.00	34.93	113	3,842.00	3,947.09	-	
301202	朗威股份	2023年6月28日	1个月内(含)	新股未上市	25.82	25.82	1,388	35,838.16	35,838.16	-	
301202	朗威股份	2023年6月28日	6个月	新股流通受限	25.82	25.82	155	4,002.10	4,002.10	-	
301261	恒工精密	2023年6月29日	1个月内(含)	新股未上市	36.90	36.90	963	35,534.70	35,534.70	-	
301261	恒工精密	2023年6月29日	6个月	新股流通受限	36.90	36.90	108	3,985.20	3,985.20	-	
301262	海看股份	2023年6月13日	6个月	新股流通受限	30.22	25.50	189	5,711.58	4,819.50	-	
301281	科源制药	2023年3月28日	6个月	新股流通受限	44.18	25.10	195	6,141.02	4,894.50	科源制药于2023年5月26日每10股送4股	
301291	明阳电气	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	38.13	31.03	211	8,045.43	6,547.33	-	
301292	海科新源	2023年6月29日	1个月内(含)	新股未上市	19.99	19.99	2,830	56,571.70	56,571.70	-	
301292	海科新源	2023年6月29日	6个月	新股流通受限	19.99	19.99	315	6,296.85	6,296.85	-	
301293	三博脑科	2023年4月25日	6个月	新股流通受限	29.60	71.42	203	6,008.80	14,498.26	-	
301295	美硕科技	2023年6月19日	6个月	新股流通受限	37.40	36.07	181	6,769.40	6,528.67	-	

		日									
301301	川宁生物	2022年12月20日	6个月	新股流通受限	5.00	8.96	2,011	10,055.00	18,018.56	-	
301303	真兰仪表	2023年2月13日	6个月	新股流通受限	26.80	22.32	418	11,202.40	9,329.76	-	
301315	威士顿	2023年6月13日	6个月	新股流通受限	32.29	51.12	127	4,100.83	6,492.24	-	
301317	鑫磊股份	2023年1月12日	6个月	新股流通受限	20.67	26.17	545	11,265.15	14,262.65	-	
301320	豪江智能	2023年6月1日	6个月	新股流通受限	13.06	20.62	569	7,431.14	11,732.78	-	
301322	绿通科技	2023年2月27日	6个月	新股流通受限	131.11	53.24	95	8,259.93	5,057.80	绿通科技于2023年5月25日每10股送5股	
301323	新莱福	2023年5月29日	6个月	新股流通受限	39.06	39.36	126	4,921.56	4,959.36	-	
301325	曼恩斯特	2023年5月4日	6个月	新股流通受限	76.80	107.95	109	8,371.20	11,766.55	-	
301332	德尔玛	2023年5月9日	6个月	新股流通受限	14.81	13.73	405	5,998.05	5,560.65	-	
301337	亚华电子	2023年5月16日	6个月	新股流通受限	32.60	30.37	148	4,824.80	4,494.76	-	
301345	涛涛车业	2023年3月10日	6个月	新股流通受限	73.45	46.64	83	6,096.35	3,871.12	-	
301355	南王科技	2023年6月2日	6个月	新股流通受限	17.55	16.75	330	5,791.50	5,527.50	-	
301357	北方长龙	2023年4月11日	6个月	新股流通受限	50.00	48.39	114	5,700.00	5,516.46	-	
301358	湖南裕能	2023年2月1日	6个月	新股流通受限	23.77	42.89	271	6,441.67	11,623.19	-	

		日									
301360	荣旗科技	2023年 4月17日	6个月	新股流 通受限	71.88	92.60	84	6,037.92	7,778.40	-	
301373	凌玮科技	2023年 1月20日	6个月	新股流 通受限	33.73	31.85	204	6,880.92	6,497.40	-	
301376	致欧科技	2023年 6月14日	6个月	新股流 通受限	24.66	22.51	189	4,660.74	4,254.39	-	
301382	蜂助手	2023年 5月9日	6个月	新股流 通受限	23.80	32.84	203	4,831.40	6,666.52	-	
301386	未来电器	2023年 3月21日	6个月	新股流 通受限	29.99	23.79	220	6,597.80	5,233.80	-	
301399	英特科技	2023年 5月16日	6个月	新股流 通受限	43.99	51.57	157	6,906.43	8,096.49	-	
301408	华人健康	2023年 2月22日	6个月	新股流 通受限	16.24	16.95	505	8,201.20	8,559.75	-	
301419	阿莱德	2023年 2月2日	6个月	新股流 通受限	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50	-	
301428	世纪恒通	2023年 5月10日	6个月	新股流 通受限	26.35	30.60	184	4,848.40	5,630.40	-	
301439	泓淋电力	2023年 3月10日	6个月	新股流 通受限	19.99	16.90	294	5,877.06	4,968.60	-	
301486	致尚科技	2023年 6月30日	1个月 内(含)	新股未 上市	57.66	57.66	1,104	63,656.64	63,656.64	-	
301486	致尚科技	2023年 6月30日	6个月	新股流 通受限	57.66	57.66	123	7,092.18	7,092.18	-	
301488	豪恩汽电	2023年 6月26日	1个月 内(含)	新股未 上市	39.78	39.78	1,076	42,803.28	42,803.28	-	
301488	豪恩汽电	2023年 6月26日	6个月	新股流 通受限	39.78	39.78	120	4,773.60	4,773.60	-	
601061	中信	2023年	6个月	新股流	6.58	7.58	666	4,382.28	5,048.28	-	

	金属	3月30日		通受限							
601065	江盐集团	2023年3月31日	6个月	新股流通受限	10.36	11.84	218	2,258.48	2,581.12	-	
601133	柏诚股份	2023年3月31日	6个月	新股流通受限	11.66	12.26	192	2,238.72	2,353.92	-	
601916	浙商银行	2023年6月27日	1个月内(含)	配股未上市	2.02	2.64	61,470	124,169.40	162,280.80	浙商银行于2023年6月27日每10股配3股	
603125	常青科技	2023年3月30日	6个月	新股流通受限	25.98	24.53	72	1,870.56	1,766.16	-	
603135	中重科技	2023年3月29日	6个月	新股流通受限	17.80	17.89	222	3,951.60	3,971.58	-	
603137	恒尚节能	2023年4月10日	6个月	新股流通受限	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	-	
603172	万丰股份	2023年4月28日	6个月	新股流通受限	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-	
688146	中船特气	2023年4月13日	6个月	新股流通受限	36.15	38.13	211	7,627.65	8,045.43	-	
688249	晶合集成	2023年4月24日	6个月	新股流通受限	19.86	18.06	1,197	23,772.42	21,617.82	-	
688334	西高院	2023年6月9日	6个月	新股流通受限	14.16	16.21	348	4,927.68	5,641.08	-	
688352	颀中科技	2023年4月11日	6个月	新股流通受限	12.10	12.07	583	7,054.30	7,036.81	-	
688361	中科飞测-U	2023年5月12日	6个月	新股流通受限	23.60	64.67	210	4,956.00	13,580.70	-	
688429	时创能源	2023年6月20日	6个月	新股流通受限	19.20	25.53	186	3,571.20	4,748.58	-	
688433	华曙	2023年	6个月	新股流	26.66	31.50	176	4,692.16	5,544.00	-	

	高科	4月7日		通受限							
688443	智翔金泰-U	2023年6月13日	6个月	新股流通受限	37.88	29.49	295	11,174.60	8,699.55		-
688458	美芯晟	2023年5月15日	6个月	新股流通受限	75.00	90.76	74	5,550.00	6,716.24		-
688469	中芯集成-U	2023年4月28日	6个月	新股流通受限	5.69	5.41	2,188	12,449.72	11,837.08		-
688472	阿特斯	2023年6月2日	6个月	新股流通受限	11.10	17.04	807	8,957.70	13,751.28		-
688478	晶升股份	2023年4月13日	6个月	新股流通受限	32.52	42.37	249	8,097.48	10,550.13		-
688479	友车科技	2023年5月4日	6个月	新股流通受限	33.99	29.49	141	4,792.59	4,158.09		-
688502	茂莱光学	2023年2月28日	6个月	新股流通受限	69.72	178.59	926	64,560.72	165,374.34		-
688523	航天环宇	2023年5月26日	6个月	新股流通受限	21.86	23.85	280	6,120.80	6,678.00		-
688531	日联科技	2023年3月24日	6个月	新股流通受限	152.38	135.97	70	10,666.60	9,517.90		-
688535	华海诚科	2023年3月28日	6个月	新股流通受限	35.00	51.23	132	4,620.00	6,762.36		-
688543	国科军工	2023年6月14日	6个月	新股流通受限	43.67	53.05	120	5,240.40	6,366.00		-
688562	航天软件	2023年5月15日	6个月	新股流通受限	12.68	22.31	372	4,716.96	8,299.32		-
688570	天玛智控	2023年5月29日	6个月	新股流通受限	30.26	25.33	227	6,869.02	5,749.91		-
688581	安杰思	2023年5月12日	6个月	新股流通受限	125.80	118.03	50	6,290.00	5,901.50		-

688582	芯动联科	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	26.74	40.68	161	4,305.14	6,549.48	-
688593	新相微	2023年5月25日	6个月	新股流通受限	11.18	14.59	519	5,802.42	7,572.21	-
688603	天承科技	2023年6月30日	1个月内(含)	新股未上市	55.00	55.00	782	43,010.00	43,010.00	-
688603	天承科技	2023年6月30日	6个月	新股流通受限	55.00	55.00	87	4,785.00	4,785.00	-
688620	安凯微	2023年6月15日	6个月	新股流通受限	10.68	12.34	442	4,720.56	5,454.28	-
688629	华丰科技	2023年6月16日	6个月	新股流通受限	9.26	18.59	515	4,768.90	9,573.85	-
688631	莱斯信息	2023年6月19日	6个月	新股流通受限	25.28	29.87	124	3,134.72	3,703.88	-

注：1、根据中国证监会《关于修改〈上市公司证券发行管理办法〉的决定》、《关于修改〈创业板上市公司证券发行管理暂行办法〉的决定》以及《关于修改〈上市公司非公开发行股票实施细则〉的决定》，本基金所认购的2020年2月14日(含)后发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起6个月内不得转让。此外，本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后6个月内，不得转让所受让的股份。

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

3、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起6个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的科创板股票，在受让后6个月内不得转让。

4、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，本基金参与摇号配售或比例配售方式获配的创业板股票自发行人股票上市之日起在发行人约定的限售期内不得转让。

5、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不

能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

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

本基金为股票型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包含中小板，创业板及其他经中国证监会核准上市的股票，存托凭证)，债券，货币市场工具，权证，资产支持证券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的相关规定)。

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，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券（2022 年 12 月 31 日：0.07%）。

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、组合在短期内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，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 2023 年 6 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期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注“期末本基金持有的流通受限证券”。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投

资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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

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

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

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主要为银行存款、结算备付金及债券投资等，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 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	25,619,169.80	-	-	-	25,619,169.80
结算备付金	830,987.08	-	-	-	830,987.08
存出保证金	96,738.92	-	-	-	96,738.92
交易性金融资产	-	-	-	-210,536,135.83	210,536,135.83
应收申购款	-	-	-	33,237.75	33,237.75
资产总计	26,546,895.80	-	-	-210,569,373.58	237,116,269.38

负债					
应付赎回款	-	-	-	677,676.80	677,676.80
应付管理人报酬	-	-	-	229,583.81	229,583.81
应付托管费	-	-	-	47,829.95	47,829.95
应付清算款	-	-	-	2,382,943.27	2,382,943.27
其他负债	-	-	-	705,700.14	705,700.14
负债总计	-	-	-	4,043,733.97	4,043,733.97
利率敏感度缺口	26,546,895.80	-	-	-206,525,639.61	233,072,535.41
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	18,380,737.07	-	-	-	18,380,737.07
结算备付金	858,192.25	-	-	-	858,192.25
存出保证金	91,209.21	-	-	-	91,209.21
交易性金融资产	-	-	186,343.15	220,419,350.65	220,605,693.80
买入返售金融资产	10,119,974.93	-	-	-	10,119,974.93
应收申购款	-	-	-	52,540.16	52,540.16
应收清算款	-	-	-	3,732,997.92	3,732,997.92
资产总计	29,450,113.46	-	186,343.15	224,204,888.73	253,841,345.34
负债					
应付赎回款	-	-	-	130,717.79	130,717.79
应付管理人报酬	-	-	-	257,760.09	257,760.09
应付托管费	-	-	-	53,700.02	53,700.02
应付清算款	-	-	-	184,614.82	184,614.82
应交税费	-	-	-	0.69	0.69
其他负债	-	-	-	656,161.94	656,161.94
负债总计	-	-	-	1,282,955.35	1,282,955.35
利率敏感度缺口	29,450,113.46	-	186,343.15	222,921,933.38	252,558,389.99

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2023 年 6 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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券投资品种，所面临的其他价格风险来源于单个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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

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：股票（含存托凭证）资产占基金资产的 85%–95%；债券，货币市场工具，权证及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他资产不高于基金资产的 15%；基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金，存出保证金，应收申购款等，其它金融工具的投资比例符合相关法律法规和监管机构的规定。若法律法规或监管机构允许，本基金在履行适当程序后，可调整上述投资比例，或将法律法规或监管机构以后允许基金投资的其它品种纳入投资范围。

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 2023年6月30日		上年度末 2022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	210,536,135.83	90.33	220,419,350.65	87.27
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—

交易性金融资产—债券投资	-	-	186,343.15	0.07
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	210,536,135.83	90.33	220,605,693.80	87.34

注：债券投资为可转换债券、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		
	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（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
分析	业绩比较基准上升5%	8,257,759.93	10,476,122.02
	业绩比较基准下降5%	-8,257,759.93	-10,476,122.02

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 2023 年 6 月 30 日
第一层次	209,562,220.74
第二层次	308,349.41
第三层次	665,565.68
合计	210,536,135.83

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	210,536,135.83	88.79
	其中：股票	210,536,135.83	88.79
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	26,450,156.88	11.15
8	其他各项资产	129,976.67	0.05
9	合计	237,116,269.38	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	33,205.02	0.01
B	采矿业	1,951,352.51	0.84
C	制造业	147,179,285.33	63.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,053,167.08	1.31
E	建筑业	1,980,272.80	0.85
F	批发和零售业	1,678,481.40	0.72
G	交通运输、仓储和邮政业	4,118,418.01	1.77
H	住宿和餐饮业	54,955.00	0.02
I	信息传输、软件和信息技术服务业	34,999,477.05	15.02
J	金融业	4,761,337.28	2.04
K	房地产业	3,468.00	0.00
L	租赁和商务服务业	2,099,917.00	0.90
M	科学研究和技术服务业	3,973,277.00	1.70
N	水利、环境和公共设施管理业	153,545.83	0.07
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	340,097.22	0.15
R	文化、体育和娱乐业	4,155,879.30	1.78
S	综合	-	-
	合计	210,536,135.83	90.33

7.2.2 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

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	603596	伯特利	152,900	12,118,854.00	5.20

2	002648	卫星化学	447,067	6,688,122.32	2.87
3	603997	继峰股份	352,300	5,037,890.00	2.16
4	600845	宝信软件	91,644	4,656,431.64	2.00
5	601633	长城汽车	154,900	3,898,833.00	1.67
6	301039	中集车辆	271,211	3,588,121.53	1.54
7	688279	峰昭科技	24,202	3,194,664.00	1.37
8	600276	恒瑞医药	64,400	3,084,760.00	1.32
9	002371	北方华创	9,700	3,081,205.00	1.32
10	300760	迈瑞医疗	9,700	2,908,060.00	1.25
11	601006	大秦铁路	377,400	2,804,082.00	1.20
12	688235	百济神州-U	24,135	2,633,369.85	1.13
13	603501	韦尔股份	25,800	2,529,432.00	1.09
14	002430	杭氧股份	71,800	2,467,048.00	1.06
15	688575	亚辉龙	132,171	2,438,554.95	1.05
16	600584	长电科技	77,500	2,415,675.00	1.04
17	300724	捷佳伟创	21,300	2,393,055.00	1.03
18	000063	中兴通讯	49,800	2,267,892.00	0.97
19	688533	上声电子	48,520	2,267,339.60	0.97
20	688008	澜起科技	39,200	2,250,864.00	0.97
21	002459	晶澳科技	49,376	2,058,979.20	0.88
22	002351	漫步者	98,900	2,045,252.00	0.88
23	688325	赛微微电	51,165	1,997,993.25	0.86
24	000651	格力电器	54,700	1,997,097.00	0.86
25	688800	瑞可达	32,102	1,995,139.30	0.86
26	002920	德赛西威	12,700	1,978,787.00	0.85
27	300946	恒而达	51,700	1,965,634.00	0.84
28	601636	旗滨集团	216,100	1,862,782.00	0.80
29	300661	圣邦股份	21,970	1,804,396.10	0.77
30	600941	中国移动	19,300	1,800,690.00	0.77
31	601899	紫金矿业	153,900	1,749,843.00	0.75
32	001322	箭牌家居	100,700	1,685,718.00	0.72
33	688581	安杰思	13,561	1,660,863.89	0.71
34	300858	科拓生物	98,250	1,588,702.50	0.68
35	000690	宝新能源	223,000	1,565,460.00	0.67
36	688029	南微医学	18,681	1,523,622.36	0.65
37	002129	TCL 中环	45,800	1,520,560.00	0.65
38	688489	三未信安	23,341	1,476,318.25	0.63
39	002555	三七互娱	42,300	1,475,424.00	0.63
40	000503	国新健康	119,500	1,432,805.00	0.61
41	002756	永兴材料	22,640	1,417,490.40	0.61
42	688326	经纬恒润-W	9,805	1,415,743.95	0.61
43	688111	金山办公	2,965	1,400,132.30	0.60
44	688017	绿的谐波	8,599	1,396,477.60	0.60

45	688120	华海清科	5,455	1,374,932.75	0.59
46	001270	铖昌科技	15,700	1,370,610.00	0.59
47	600859	王府井	67,800	1,341,762.00	0.58
48	601318	中国平安	28,900	1,340,960.00	0.58
49	603208	江山欧派	36,510	1,329,694.20	0.57
50	300634	彩讯股份	50,300	1,327,920.00	0.57
51	300750	宁德时代	5,780	1,322,406.20	0.57
52	688192	迪哲医药-U	38,039	1,319,953.30	0.57
53	002079	苏州固锝	89,300	1,303,780.00	0.56
54	688227	品高股份	51,915	1,289,049.45	0.55
55	002709	天赐材料	31,000	1,276,890.00	0.55
56	000719	中原传媒	109,100	1,276,470.00	0.55
57	002126	银轮股份	72,000	1,274,400.00	0.55
58	300458	全志科技	46,200	1,258,950.00	0.54
59	002185	华天科技	135,800	1,249,360.00	0.54
60	603885	吉祥航空	80,800	1,246,744.00	0.53
61	603496	恒为科技	66,000	1,239,480.00	0.53
62	601801	皖新传媒	131,500	1,234,785.00	0.53
63	002850	科达利	9,300	1,229,925.00	0.53
64	688085	三友医疗	46,738	1,227,339.88	0.53
65	601965	中国汽研	59,300	1,224,545.00	0.53
66	002605	姚记科技	26,300	1,221,109.00	0.52
67	688066	航天宏图	20,040	1,220,436.00	0.52
68	001323	慕思股份	35,800	1,215,768.00	0.52
69	600536	中国软件	25,900	1,214,192.00	0.52
70	300212	易华录	35,900	1,192,957.00	0.51
71	002517	恺英网络	74,400	1,171,056.00	0.50
72	600309	万华化学	13,300	1,168,272.00	0.50
73	301310	鑫宏业	16,700	1,150,296.00	0.49
74	001269	欧晶科技	15,060	1,107,361.80	0.48
75	300168	万达信息	97,200	1,101,276.00	0.47
76	688338	赛科希德	19,771	1,096,301.95	0.47
77	000032	深桑达 A	33,200	1,092,280.00	0.47
78	600373	中文传媒	81,300	1,082,916.00	0.46
79	601838	成都银行	87,000	1,062,270.00	0.46
80	601988	中国银行	265,700	1,038,887.00	0.45
81	001380	华纬科技	31,100	1,013,549.00	0.43
82	002236	大华股份	51,100	1,009,225.00	0.43
83	301121	紫建电子	19,400	982,416.00	0.42
84	603728	鸣志电器	12,200	979,660.00	0.42
85	002463	沪电股份	46,600	975,804.00	0.42
86	688458	美芯晟	9,943	955,817.97	0.41
87	603259	药明康德	15,300	953,343.00	0.41

88	300229	拓尔思	34,700	901,159.00	0.39
89	688006	杭可科技	29,068	885,701.96	0.38
90	002908	德生科技	55,400	857,038.00	0.37
91	688516	奥特维	4,469	841,959.60	0.36
92	300007	汉威科技	38,400	812,160.00	0.35
93	300457	赢合科技	45,600	805,296.00	0.35
94	688503	聚和材料	7,923	772,492.50	0.33
95	000951	中国重汽	45,600	768,360.00	0.33
96	000600	建投能源	99,300	767,589.00	0.33
97	000625	长安汽车	59,000	762,870.00	0.33
98	688630	芯碁微装	8,757	735,763.14	0.32
99	688387	信科移动-U	87,729	732,537.15	0.31
100	002602	世纪华通	96,400	731,676.00	0.31
101	688036	传音控股	4,914	722,358.00	0.31
102	601916	浙商银行	266,370	703,216.80	0.30
103	688355	明志科技	22,991	699,386.22	0.30
104	600141	兴发集团	31,400	697,708.00	0.30
105	688300	联瑞新材	14,909	696,995.75	0.30
106	600760	中航沈飞	15,300	688,500.00	0.30
107	301169	零点有数	13,900	687,911.00	0.30
108	300662	科锐国际	19,100	675,567.00	0.29
109	002368	太极股份	16,400	675,188.00	0.29
110	600301	华锡有色	36,900	662,355.00	0.28
111	688579	山大地纬	39,888	657,354.24	0.28
112	601668	中国建筑	112,000	642,880.00	0.28
113	688315	诺禾致源	21,938	582,453.90	0.25
114	688322	奥比中光-UW	13,409	559,423.48	0.24
115	002230	科大讯飞	8,000	543,680.00	0.23
116	003021	兆威机电	6,100	535,153.00	0.23
117	301171	易点天下	23,805	526,090.50	0.23
118	601888	中国中免	4,700	519,491.00	0.22
119	688631	莱斯信息	15,439	502,360.28	0.22
120	688316	青云科技-U	9,925	492,776.25	0.21
121	603000	人民网	16,800	490,560.00	0.21
122	603776	永安行	33,100	476,640.00	0.20
123	300693	盛弘股份	12,573	464,195.16	0.20
124	300291	百纳千成	65,000	457,600.00	0.20
125	000875	吉电股份	84,800	457,072.00	0.20
126	688439	振华风光	4,123	452,787.86	0.19
127	603730	岱美股份	28,400	448,720.00	0.19
128	688131	皓元医药	7,866	448,204.68	0.19
129	300118	东方日升	17,400	445,962.00	0.19
130	300033	同花顺	2,500	438,200.00	0.19

131	688041	海光信息	6,402	437,064.54	0.19
132	002597	金禾实业	17,900	422,440.00	0.18
133	688981	中芯国际	8,336	421,134.72	0.18
134	000977	浪潮信息	8,600	417,100.00	0.18
135	688256	寒武纪-U	2,167	407,396.00	0.17
136	688601	力芯微	8,339	392,766.90	0.17
137	601360	三六零	31,100	389,994.00	0.17
138	601689	拓普集团	4,600	371,220.00	0.16
139	300014	亿纬锂能	6,100	369,050.00	0.16
140	002415	海康威视	9,900	327,789.00	0.14
141	301267	华夏眼科	4,840	294,998.00	0.13
142	300130	新国都	9,200	260,636.00	0.11
143	301191	菲菱科思	2,440	252,344.80	0.11
144	688052	纳芯微	1,568	248,324.16	0.11
145	688590	新致软件	10,754	244,438.42	0.10
146	300315	掌趣科技	31,300	244,140.00	0.10
147	688048	长光华芯	2,458	232,330.16	0.10
148	301185	鸥玛软件	7,000	231,140.00	0.10
149	688249	晶合集成	11,970	224,904.33	0.10
150	688150	莱特光电	9,707	217,436.80	0.09
151	603598	引力传媒	20,300	212,338.00	0.09
152	688502	茂莱光学	1,126	203,774.34	0.09
153	002049	紫光国微	2,000	186,500.00	0.08
154	688361	中科飞测-U	2,092	169,805.52	0.07
155	688248	南网科技	4,350	166,996.50	0.07
156	301419	阿莱德	3,292	150,811.36	0.06
157	688472	阿特斯	8,068	147,063.24	0.06
158	002409	雅克科技	1,900	138,472.00	0.06
159	301320	豪江智能	5,689	137,991.98	0.06
160	688469	中芯集成-U	21,872	123,445.36	0.05
161	301358	湖南裕能	2,709	118,919.57	0.05
162	688539	高华科技	2,560	118,784.00	0.05
163	300308	中际旭创	800	117,960.00	0.05
164	688629	华丰科技	5,147	117,128.89	0.05
165	688478	晶升股份	2,488	116,925.02	0.05
166	688141	杰华特	2,685	104,983.50	0.05
167	688531	日联科技	692	101,891.12	0.04
168	688419	耐科装备	2,387	101,638.46	0.04
169	688562	航天软件	3,714	100,037.22	0.04
170	688201	信安世纪	2,328	99,498.72	0.04
171	688121	卓然股份	2,649	99,072.60	0.04
172	688152	麒麟信安	1,064	98,185.92	0.04
173	301303	真兰仪表	4,176	95,237.64	0.04

174	301277	新天地	4,843	94,486.93	0.04
175	301399	英特科技	1,562	91,693.99	0.04
176	688247	宣泰医药	7,155	91,226.25	0.04
177	688443	智翔金泰-U	2,946	90,641.96	0.04
178	300548	博创科技	2,600	89,570.00	0.04
179	601618	中国中冶	22,400	88,928.00	0.04
180	688146	中船特气	2,107	88,056.63	0.04
181	301408	华人健康	5,046	87,391.51	0.04
182	688593	新相微	5,183	87,373.25	0.04
183	301360	荣旗科技	837	86,301.24	0.04
184	301141	中科磁业	1,771	81,036.12	0.03
185	001287	中电港	2,942	79,734.56	0.03
186	688352	颀中科技	5,823	77,462.41	0.03
187	301382	蜂助手	2,023	76,991.32	0.03
188	301315	威士顿	1,265	74,578.78	0.03
189	688523	航天环宇	2,795	74,306.35	0.03
190	688582	芯动联科	1,602	74,060.33	0.03
191	688234	天岳先进	1,000	73,940.00	0.03
192	688522	纳睿雷达	1,355	72,519.60	0.03
193	301388	欣灵电气	2,645	71,018.25	0.03
194	301486	致尚科技	1,227	70,748.82	0.03
195	301290	东星医疗	2,194	70,317.70	0.03
196	301295	美硕科技	1,802	68,661.60	0.03
197	301291	明阳电气	2,101	68,161.33	0.03
198	688543	国科军工	1,194	66,671.10	0.03
199	301373	凌玮科技	2,039	65,933.05	0.03
200	601138	工业富联	2,600	65,520.00	0.03
201	688687	凯因科技	2,182	64,369.00	0.03
202	301428	世纪恒通	1,831	64,263.60	0.03
203	688032	禾迈股份	180	63,927.00	0.03
204	301292	海科新源	3,145	62,868.55	0.03
205	601601	中国太保	2,400	62,352.00	0.03
206	688334	西高院	3,477	61,837.92	0.03
207	601658	邮储银行	12,500	61,125.00	0.03
208	688570	天玛智控	2,267	60,095.51	0.03
209	688403	汇成股份	4,908	59,975.76	0.03
210	601139	深圳燃气	8,200	59,778.00	0.03
211	688433	华曙高科	1,758	59,332.00	0.03
212	688088	虹软科技	1,378	58,909.50	0.03
213	688617	惠泰医疗	157	58,678.75	0.03
214	301355	南王科技	3,298	58,357.90	0.03
215	603901	永创智能	4,000	58,240.00	0.02
216	601061	中信金属	6,654	57,622.92	0.02

217	301332	德尔玛	4,047	57,604.83	0.02
218	600436	片仔癀	200	57,272.00	0.02
219	301283	聚胶股份	1,609	57,087.32	0.02
220	301157	华塑科技	1,019	56,787.54	0.02
221	688012	中微公司	361	56,478.45	0.02
222	600489	中金黄金	5,400	55,782.00	0.02
223	600925	苏能股份	8,960	55,283.20	0.02
224	301386	未来电器	2,197	55,014.66	0.02
225	301276	嘉曼服饰	2,156	54,978.00	0.02
226	600258	首旅酒店	2,900	54,955.00	0.02
227	301265	华新环保	4,680	54,381.60	0.02
228	688595	芯海科技	1,697	54,270.06	0.02
229	301323	新莱福	1,252	53,658.86	0.02
230	688429	时创能源	1,860	53,210.88	0.02
231	601991	大唐发电	16,000	52,960.00	0.02
232	600418	江淮汽车	4,200	52,878.00	0.02
233	301322	绿通科技	943	52,673.00	0.02
234	603029	天鹅股份	2,500	52,375.00	0.02
235	301439	泓淋电力	2,940	52,173.24	0.02
236	301262	海看股份	1,890	52,022.25	0.02
237	600459	贵研铂业	3,400	52,020.00	0.02
238	688049	炬芯科技	1,389	51,115.20	0.02
239	301281	科源制药	1,946	51,085.88	0.02
240	688511	天微电子	1,490	50,809.00	0.02
241	600297	广汇汽车	24,200	50,336.00	0.02
242	301337	亚华电子	1,477	50,212.36	0.02
243	600977	中国电影	3,500	49,175.00	0.02
244	301068	大地海洋	1,436	48,263.96	0.02
245	688603	天承科技	869	47,795.00	0.02
246	301488	豪恩汽电	1,196	47,576.88	0.02
247	688285	高铁电气	4,606	46,060.00	0.02
248	600761	安徽合力	2,300	45,839.00	0.02
249	688232	新点软件	848	45,630.88	0.02
250	603722	阿科力	900	44,802.00	0.02
251	688609	九联科技	3,760	44,744.00	0.02
252	603135	中重科技	2,216	44,649.18	0.02
253	688308	欧科亿	1,114	44,560.00	0.02
254	688479	友车科技	1,410	44,093.52	0.02
255	301049	超越科技	1,954	43,183.40	0.02
256	601728	中国电信	7,600	42,788.00	0.02
257	600021	上海电力	3,900	42,003.00	0.02
258	603032	德新科技	1,200	41,448.00	0.02
259	301309	万得凯	1,505	41,447.70	0.02

260	688139	海尔生物	792	40,764.24	0.02
261	301162	国能日新	510	40,228.80	0.02
262	301202	朗威股份	1,543	39,840.26	0.02
263	301261	恒工精密	1,071	39,519.90	0.02
264	301345	涛涛车业	828	39,415.07	0.02
265	605189	富春染织	2,400	39,384.00	0.02
266	301053	远信工业	1,544	39,171.28	0.02
267	688208	道通科技	1,249	37,857.19	0.02
268	603379	三美股份	1,600	37,616.00	0.02
269	688107	安路科技	677	37,499.03	0.02
270	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.02
271	605289	罗曼股份	925	35,436.75	0.02
272	301153	中科江南	466	34,931.36	0.01
273	688323	瑞华泰	1,428	34,186.32	0.01
274	603378	亚士创能	3,700	33,707.00	0.01
275	001330	博纳影业	3,564	33,073.92	0.01
276	600955	维远股份	1,694	32,914.42	0.01
277	688331	荣昌生物	587	32,725.25	0.01
278	300854	中兰环保	2,026	32,213.40	0.01
279	603297	永新光学	400	31,960.00	0.01
280	688038	中科通达	2,132	31,894.72	0.01
281	601377	兴业证券	5,200	31,824.00	0.01
282	688190	云路股份	435	31,755.00	0.01
283	000917	电广传媒	4,300	31,433.00	0.01
284	688639	华恒生物	341	30,853.68	0.01
285	301239	普瑞眼科	312	30,600.96	0.01
286	001338	永顺泰	1,649	30,407.56	0.01
287	001258	立新能源	3,188	30,254.12	0.01
288	688110	东芯股份	826	29,818.60	0.01
289	301029	怡合达	665	29,712.20	0.01
290	603040	新坐标	1,100	29,249.00	0.01
291	603035	常熟汽饰	1,500	29,145.00	0.01
292	605598	上海港湾	553	29,120.98	0.01
293	688680	海优新材	238	28,993.16	0.01
294	601065	江盐集团	2,172	28,823.34	0.01
295	601089	福元医药	1,749	28,508.70	0.01
296	601133	柏诚股份	1,916	28,058.76	0.01
297	603071	物产环能	1,627	26,991.93	0.01
298	600988	赤峰黄金	2,000	26,920.00	0.01
299	688518	联赢激光	955	26,606.30	0.01
300	000822	山东海化	3,900	26,559.00	0.01
301	603137	恒尚节能	1,382	26,502.14	0.01
302	002871	伟隆股份	2,000	26,400.00	0.01

303	001213	中铁特货	5,818	25,657.38	0.01
304	002179	中航光电	565	25,622.75	0.01
305	001328	登康口腔	795	25,484.05	0.01
306	001282	三联锻造	719	25,476.06	0.01
307	600446	金证股份	1,700	24,718.00	0.01
308	001337	四川黄金	795	24,557.55	0.01
309	688408	中信博	289	24,371.37	0.01
310	001308	康冠科技	867	23,807.82	0.01
311	603211	晋拓股份	1,287	23,655.06	0.01
312	688608	恒玄科技	195	23,600.85	0.01
313	301120	新特电气	1,548	23,560.56	0.01
314	301286	侨源股份	793	23,393.50	0.01
315	301101	明月镜片	557	22,853.71	0.01
316	301297	富乐德	1,015	22,847.65	0.01
317	301368	丰立智能	330	22,832.70	0.01
318	001227	兰州银行	7,868	22,502.48	0.01
319	603191	望变电气	1,149	22,348.05	0.01
320	688707	振华新材	716	22,045.64	0.01
321	603172	万丰股份	1,220	21,138.94	0.01
322	301095	广立微	255	21,075.75	0.01
323	603206	嘉环科技	1,210	20,872.50	0.01
324	603125	常青科技	713	20,002.61	0.01
325	001324	长青科技	939	19,731.05	0.01
326	601121	宝地矿业	2,532	19,344.48	0.01
327	688031	星环科技-U	145	19,319.80	0.01
328	300982	苏文电能	317	19,197.52	0.01
329	300972	万辰生物	430	19,066.20	0.01
330	000988	华工科技	500	19,005.00	0.01
331	301311	昆船智能	640	18,867.20	0.01
332	301175	中科环保	3,005	18,721.15	0.01
333	301050	雷电微力	283	18,375.19	0.01
334	300979	华利集团	375	18,277.50	0.01
335	301238	瑞泰新材	896	18,224.64	0.01
336	300623	捷捷微电	1,000	18,120.00	0.01
337	301301	川宁生物	2,011	18,018.56	0.01
338	301269	华大九天	145	17,811.80	0.01
339	001367	海森药业	395	17,760.10	0.01
340	603209	兴通股份	833	17,667.93	0.01
341	301327	华宝新能	217	17,166.87	0.01
342	301325	曼恩斯特	156	17,148.05	0.01
343	301268	铭利达	406	16,999.22	0.01
344	603282	亚光股份	457	15,771.07	0.01
345	001318	阳光乳业	1,142	15,451.26	0.01

346	603132	金徽股份	1,342	15,218.28	0.01
347	301328	维峰电子	264	15,032.16	0.01
348	301293	三博脑科	203	14,498.26	0.01
349	001217	华尔泰	1,239	14,421.96	0.01
350	603190	亚通精工	470	14,382.00	0.01
351	301317	鑫磊股份	545	14,262.65	0.01
352	603237	五芳斋	455	13,800.15	0.01
353	603057	紫燕食品	549	13,796.37	0.01
354	603162	海通发展	774	13,196.70	0.01
355	301135	瑞德智能	480	13,161.60	0.01
356	603153	上海建科	740	13,135.00	0.01
357	603097	江苏华辰	577	13,074.82	0.01
358	688281	华泰科技	64	12,960.00	0.01
359	605599	菜百股份	980	12,945.80	0.01
360	688290	景业智能	191	12,741.61	0.01
361	301361	众智科技	443	12,488.17	0.01
362	605580	恒盛能源	916	12,356.84	0.01
363	603176	汇通集团	1,924	12,313.60	0.01
364	301338	凯格精机	316	12,292.40	0.01
365	300941	创识科技	599	12,183.66	0.01
366	301048	金鹰重工	843	11,776.71	0.01
367	301217	铜冠铜箔	824	11,725.52	0.01
368	688320	禾川科技	241	11,621.02	0.00
369	001229	魅视科技	347	11,555.10	0.00
370	301163	宏德股份	364	11,484.20	0.00
371	301270	汉仪股份	210	11,468.10	0.00
372	301222	浙江恒威	386	11,367.70	0.00
373	301367	怡和嘉业	76	11,273.84	0.00
374	001278	一彬科技	473	11,247.94	0.00
375	301187	欧圣电气	606	11,192.82	0.00
376	301127	天源环保	1,135	11,134.35	0.00
377	001317	三羊马	300	11,070.00	0.00
378	002460	赣锋锂业	180	10,972.80	0.00
379	603130	云中马	480	10,900.80	0.00
380	002918	蒙娜丽莎	700	10,808.00	0.00
381	300962	中金辐照	576	10,771.20	0.00
382	300394	天孚通信	100	10,683.00	0.00
383	301377	鼎泰高科	462	10,626.00	0.00
384	603219	富佳股份	739	10,530.75	0.00
385	301298	东利机械	640	10,515.20	0.00
386	688409	富创精密	96	10,464.00	0.00
387	000933	神火股份	800	10,400.00	0.00
388	301138	华研精机	285	10,368.30	0.00

389	301179	泽宇智能	306	10,312.20	0.00
390	301199	迈赫股份	322	10,252.48	0.00
391	301116	益客食品	664	10,225.60	0.00
392	301200	大族数控	256	10,209.28	0.00
393	301313	凡拓数创	241	10,201.53	0.00
394	688535	华海诚科	188	10,185.64	0.00
395	603363	傲农生物	1,100	10,087.00	0.00
396	300073	当升科技	200	10,066.00	0.00
397	001266	宏英智能	346	10,051.30	0.00
398	605566	福莱茵特	435	10,005.00	0.00
399	301132	满坤科技	339	9,963.21	0.00
400	001366	播恩集团	645	9,945.90	0.00
401	301152	天力锂能	222	9,914.52	0.00
402	001331	胜通能源	539	9,847.53	0.00
403	001313	粤海饲料	1,232	9,732.80	0.00
404	301300	远翔新材	307	9,701.20	0.00
405	001300	三柏硕	763	9,690.10	0.00
406	301197	工大科雅	401	9,664.10	0.00
407	300496	中科创达	100	9,635.00	0.00
408	603213	镇洋发展	799	9,532.07	0.00
409	001268	联合精密	409	9,492.89	0.00
410	001299	美能能源	576	9,394.56	0.00
411	301231	荣信文化	275	9,251.00	0.00
412	001222	源飞宠物	608	9,199.04	0.00
413	001230	劲旅环境	375	9,191.25	0.00
414	301398	星源卓镁	238	8,925.00	0.00
415	603280	南方路机	363	8,922.54	0.00
416	001368	通达创智	351	8,922.42	0.00
417	301288	清研环境	516	8,906.16	0.00
418	300957	贝泰妮	100	8,888.00	0.00
419	300981	中红医疗	582	8,817.30	0.00
420	300866	安克创新	100	8,750.00	0.00
421	603065	宿迁联盛	581	8,656.90	0.00
422	001296	长江材料	403	8,467.03	0.00
423	301259	艾布鲁	628	8,446.60	0.00
424	001219	青岛食品	460	8,390.40	0.00
425	301285	鸿日达	578	8,375.22	0.00
426	301359	东南电子	328	8,357.44	0.00
427	301282	金禄电子	274	8,236.44	0.00
428	301316	慧博云通	359	8,203.15	0.00
429	603291	联合水务	536	8,152.56	0.00
430	301228	实朴检测	521	8,117.18	0.00
431	300978	东箭科技	593	8,082.59	0.00

432	301193	家联科技	461	8,081.33	0.00
433	605567	春雪食品	629	8,070.07	0.00
434	300502	新易盛	118	8,020.46	0.00
435	301206	三元生物	228	7,977.72	0.00
436	605033	美邦股份	423	7,910.10	0.00
437	002833	弘亚数控	400	7,864.00	0.00
438	300967	晓鸣股份	507	7,736.82	0.00
439	301190	善水科技	410	7,703.90	0.00
440	301166	优宁维	179	7,686.26	0.00
441	300952	恒辉安防	340	7,670.40	0.00
442	301318	维海德	228	7,649.40	0.00
443	001234	泰慕士	333	7,592.40	0.00
444	603272	联翔股份	443	7,513.28	0.00
445	300987	川网传媒	391	7,393.81	0.00
446	600406	国电南瑞	312	7,207.20	0.00
447	688035	德邦科技	120	7,137.60	0.00
448	301151	冠龙节能	399	7,050.33	0.00
449	300950	德固特	329	6,974.80	0.00
450	605069	正和生态	790	6,912.50	0.00
451	301182	凯旺科技	294	6,753.18	0.00
452	605577	龙版传媒	588	6,697.32	0.00
453	002169	智光电气	800	6,632.00	0.00
454	301158	德石股份	383	6,629.73	0.00
455	688400	凌云光	217	6,614.16	0.00
456	603150	万朗磁塑	250	6,590.00	0.00
457	300943	春晖智控	383	6,495.68	0.00
458	300971	博亚精工	245	6,431.25	0.00
459	605138	盛泰集团	723	6,304.56	0.00
460	301115	建科股份	275	6,286.50	0.00
461	002372	伟星新材	300	6,162.00	0.00
462	301012	扬电科技	238	6,152.30	0.00
463	301319	唯特偶	101	6,044.85	0.00
464	300998	宁波方正	201	6,027.99	0.00
465	002101	广东鸿图	300	5,874.00	0.00
466	601952	苏垦农发	500	5,820.00	0.00
467	003038	鑫铂股份	140	5,804.40	0.00
468	688237	超卓航科	119	5,745.32	0.00
469	688119	中钢洛耐	1,015	5,663.70	0.00
470	688148	芳源股份	457	5,575.40	0.00
471	301098	金埔园林	461	5,555.05	0.00
472	301062	上海艾录	523	5,538.57	0.00
473	300942	易瑞生物	443	5,533.07	0.00
474	301016	雷尔伟	275	5,516.50	0.00

475	301357	北方长龙	114	5,516.46	0.00
476	688620	安凯微	442	5,454.28	0.00
477	301002	崧盛股份	261	5,387.04	0.00
478	300958	建工修复	300	5,322.00	0.00
479	300975	商络电子	738	5,276.70	0.00
480	301221	光庭信息	94	5,248.02	0.00
481	300774	倍杰特	444	5,168.16	0.00
482	601012	隆基绿能	180	5,160.60	0.00
483	301100	风光股份	248	5,123.68	0.00
484	301040	中环海陆	241	4,952.55	0.00
485	688114	华大智造	57	4,933.92	0.00
486	301025	读客文化	403	4,924.66	0.00
487	300948	冠中生态	324	4,895.64	0.00
488	300960	通业科技	234	4,874.22	0.00
489	300339	润和软件	200	4,792.00	0.00
490	300604	长川科技	100	4,749.00	0.00
491	688283	坤恒顺维	71	4,722.92	0.00
492	688456	有研粉材	141	4,719.27	0.00
493	301007	德迈仕	303	4,675.29	0.00
494	688253	英诺特	192	4,665.60	0.00
495	300045	华力创通	400	4,640.00	0.00
496	300855	图南股份	130	4,591.60	0.00
497	301032	新柴股份	513	4,591.35	0.00
498	002041	登海种业	300	4,581.00	0.00
499	002472	双环传动	126	4,573.80	0.00
500	603666	亿嘉和	100	4,515.00	0.00
501	600508	上海能源	300	4,404.00	0.00
502	301376	致欧科技	189	4,254.39	0.00
503	300961	深水海纳	394	4,243.38	0.00
504	301349	信德新材	84	4,211.76	0.00
505	688259	创耀科技	53	4,194.95	0.00
506	688425	铁建重工	861	4,141.41	0.00
507	300890	翔丰华	100	4,110.00	0.00
508	300596	利安隆	100	4,067.00	0.00
509	002414	高德红外	520	4,040.40	0.00
510	300992	泰福泵业	200	4,024.00	0.00
511	301155	海力风电	52	4,008.16	0.00
512	001311	多利科技	69	3,962.67	0.00
513	301170	锡南科技	113	3,947.09	0.00
514	300995	奇德新材	191	3,896.40	0.00
515	002400	省广集团	800	3,848.00	0.00
516	301306	西测测试	99	3,846.15	0.00
517	605555	德昌股份	220	3,841.20	0.00

518	301036	双乐股份	205	3,839.65	0.00
519	301037	保立佳	212	3,777.84	0.00
520	000915	华特达因	100	3,529.00	0.00
521	688231	隆达股份	120	3,423.60	0.00
522	688255	凯尔达	99	3,352.14	0.00
523	300929	华骐环保	293	3,319.69	0.00
524	688722	同益中	176	3,263.04	0.00
525	688171	纬德信息	131	3,201.64	0.00
526	600522	中天科技	200	3,182.00	0.00
527	688353	华盛锂电	86	3,180.28	0.00
528	600223	福瑞达	300	3,078.00	0.00
529	688173	希荻微	130	2,974.40	0.00
530	301046	能辉科技	90	2,943.00	0.00
531	688268	华特气体	36	2,906.28	0.00
532	000932	华菱钢铁	600	2,862.00	0.00
533	600025	华能水电	400	2,852.00	0.00
534	000921	海信家电	100	2,695.00	0.00
535	688718	唯赛勃	142	2,458.02	0.00
536	301021	英诺激光	90	2,352.60	0.00
537	301220	亚香股份	68	2,319.48	0.00
538	300252	金信诺	200	2,248.00	0.00
539	300845	捷安高科	100	2,173.00	0.00
540	001336	楚环科技	74	2,070.52	0.00
541	300986	志特新材	70	1,960.00	0.00
542	300814	中富电路	80	1,927.20	0.00
543	301150	中一科技	38	1,900.38	0.00
544	002234	民和股份	100	1,821.00	0.00
545	301219	腾远钴业	47	1,755.92	0.00
546	301015	百洋医药	62	1,721.12	0.00
547	600096	云天化	100	1,707.00	0.00
548	300766	每日互动	100	1,676.00	0.00
549	688737	中自科技	41	1,598.59	0.00
550	301133	金钟股份	60	1,593.60	0.00
551	002011	盾安环境	100	1,383.00	0.00
552	603233	大参林	48	1,344.48	0.00
553	001231	农心科技	55	1,308.45	0.00
554	600746	江苏索普	200	1,306.00	0.00
555	002334	英威腾	100	1,274.00	0.00
556	000301	东方盛虹	100	1,182.00	0.00
557	301091	深城交	59	1,092.68	0.00
558	603048	浙江黎明	64	1,030.40	0.00
559	301069	凯盛新材	39	992.16	0.00
560	301136	招标股份	72	987.84	0.00

561	301052	果麦文化	20	986.40	0.00
562	301180	万祥科技	54	946.62	0.00
563	002037	保利联合	100	885.00	0.00
564	301126	达嘉维康	62	830.80	0.00
565	300614	百川畅银	29	794.31	0.00
566	000785	居然之家	200	762.00	0.00
567	001319	铭科精技	36	754.56	0.00
568	002753	永东股份	100	729.00	0.00
569	002340	格林美	100	691.00	0.00
570	301078	孩子王	51	582.93	0.00
571	300993	玉马遮阳	49	561.05	0.00
572	000589	贵州轮胎	100	560.00	0.00
573	300968	格林精密	62	551.18	0.00
574	600409	三友化工	100	545.00	0.00
575	301020	密封科技	21	474.81	0.00
576	300997	欢乐家	28	407.96	0.00
577	301118	恒光股份	15	400.95	0.00
578	600376	首开股份	100	390.00	0.00
579	300994	久祺股份	24	370.56	0.00
580	001314	亿道信息	8	338.24	0.00
581	002837	英维克	10	299.40	0.00
582	002724	海洋王	20	173.60	0.00
583	000733	振华科技	1	95.85	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	301039	中集车辆	10,653,746.02	4.22
2	601633	长城汽车	8,503,460.00	3.37
3	603997	继峰股份	7,081,686.50	2.80
4	002430	杭氧股份	6,908,148.52	2.74
5	688006	杭可科技	6,069,993.26	2.40
6	600845	宝信软件	5,822,243.00	2.31
7	300661	圣邦股份	5,509,591.52	2.18
8	688008	澜起科技	5,329,794.77	2.11
9	301220	亚香股份	5,222,715.34	2.07
10	603501	韦尔股份	5,176,535.00	2.05
11	300858	科拓生物	5,082,471.00	2.01
12	603507	振江股份	4,970,219.00	1.97
13	002738	中矿资源	4,962,803.00	1.97
14	002756	永兴材料	4,608,707.40	1.82
15	000988	华工科技	4,603,990.00	1.82

16	688279	峰昭科技	4,592,404.20	1.82
17	000063	中兴通讯	4,579,296.00	1.81
18	601618	中国中冶	4,284,417.00	1.70
19	600941	中国移动	4,022,064.00	1.59
20	301191	菲菱科思	3,983,578.12	1.58

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	002011	盾安环境	11,987,743.55	4.75
2	002371	北方华创	10,133,194.88	4.01
3	301039	中集车辆	8,775,781.00	3.47
4	688279	峰昭科技	8,454,146.30	3.35
5	002459	晶澳科技	8,180,837.86	3.24
6	002738	中矿资源	7,220,030.00	2.86
7	002648	卫星化学	6,789,880.46	2.69
8	300498	温氏股份	6,680,699.00	2.65
9	300014	亿纬锂能	6,153,440.00	2.44
10	000988	华工科技	5,827,219.69	2.31
11	688617	惠泰医疗	5,667,428.86	2.24
12	603348	文灿股份	5,580,868.29	2.21
13	002756	永兴材料	5,492,051.98	2.17
14	002493	荣盛石化	5,338,111.00	2.11
15	603032	德新科技	5,322,190.00	2.11
16	300858	科拓生物	5,240,573.00	2.07
17	603507	振江股份	4,961,809.00	1.96
18	688006	杭可科技	4,838,009.32	1.92
19	002057	中钢天源	4,804,522.00	1.90
20	688008	澜起科技	4,784,225.86	1.89

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	681,044,775.81
卖出股票收入（成交）总额	700,010,771.35

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

本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

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规定的备选股票库

本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券备选库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	96,738.92
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	33,237.75
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	129,976.67

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

注：无。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息**8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

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 (%)
7,426	10,335.82	7,468,354.79	9.73	69,285,415.30	90.27

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	45,092.69	0.0587

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

8.3 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

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	-
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

注：1、截至本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人未持有本基金份额。

2、截至本报告期末，本基金的基金经理投资、持有本基金符合相关法律法规、中国证监会规定及相关管理制度的规定。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2012 年 4 月 16 日) 基金份额总额	334,825,290.98
本报告期期初基金份额总额	85,175,032.70
本报告期基金总申购份额	3,226,045.01

减：本报告期基金总赎回份额	11,647,307.62
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	76,753,770.09

§ 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

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

本基金本报告期投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未改聘为本基金审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：无。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
光大证券	2	706,848,928.32	51.39	651,221.70	51.39	-
天风证券	1	239,851,630.06	17.44	220,985.08	17.44	-

长江证券	1	120,189,542.07	8.74	110,729.05	8.74	-
中信证券	1	80,092,370.90	5.82	73,787.24	5.82	-
安信证券	1	64,005,764.65	4.65	58,967.69	4.65	-
西部证券	1	40,182,885.83	2.92	37,020.82	2.92	-
广发证券	1	28,151,940.67	2.05	25,937.96	2.05	-
华创证券	1	28,120,514.04	2.04	25,909.16	2.04	-
银河证券	1	27,751,010.82	2.02	25,566.89	2.02	-
国信证券	1	18,731,439.96	1.36	17,257.91	1.36	-
中金公司	1	14,651,510.57	1.07	13,497.83	1.07	-
中信建投 证券	1	6,825,675.71	0.50	6,289.70	0.50	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
东方财富 证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	本报告期 新增
华西证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
瑞信方正	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源 证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	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) 基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其交易单元作为基金的专用交易单元，选择的标准是：

- (1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，最近二年未发生因重大违规行为而受到中国证监会处罚；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；
- (6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务。

2) 选择交易单元的程序：

我公司根据上述标准，选定符合条件的证券公司作为租用交易单元的对象。我公司投研部门定期对所选定证券公司的服务进行综合评比，评比内容包括：提供研究报告质量、数量、及时性以及提供研究服务主动性和质量等情况，并依据评比结果确定交易单元交易的具体情况。我公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向券商租用交易单元作为基金专用交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
光大证券	-	-	7,190,000.00	2.37	-	-
天风证券	-	-	57,638,000.00	19.03	-	-
长江证券	-	-	67,953,000.00	22.43	-	-
中信证券	-	-	53,388,000.00	17.63	-	-
安信证券	-	-	33,028,000.00	10.90	-	-
西部证券	218,699.60	100.00	7,917,000.00	2.61	-	-

广发证 券	-	-	7,190,000.00	2.37	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	39,957,000.0 0	13.19	-	-
国信证 券	-	-	11,971,000.0 0	3.95	-	-
中金公 司	-	-	16,668,000.0 0	5.50	-	-
中信建 投证券	-	-	-	-	-	-
长城证 券	-	-	-	-	-	-
东方财 富证券	-	-	-	-	-	-
东莞证 券	-	-	-	-	-	-
方正证 券	-	-	-	-	-	-
高华证 券	-	-	-	-	-	-
国泰君 安	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-
瑞信方 正	-	-	-	-	-	-
瑞银证 券	-	-	-	-	-	-
上海证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源证券	-	-	-	-	-	-
湘财证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-

中航证 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	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 01 月 04 日
2	关于调整旗下部分基金参与中国工商银行股份有限公司申购、定期定额申购费率优惠活动时间的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 01 月 05 日
3	鹏华价值精选股票型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 01 月 20 日
4	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购中润光学首次公开发行 A 股的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 02 月 10 日
5	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与东方财富证券股份有限公司申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 03 月 14 日
6	鹏华价值精选股票型证券投资基金 2022 年年度报告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 03 月 30 日
7	鹏华基金管理有限公司关于新增人民币直销资金专户的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 04 月 07 日
8	鹏华价值精选股票型证券投资基金更新的招募说明书	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 04 月 11 日
9	鹏华价值精选股票型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 04 月 11 日
10	鹏华价值精选股票型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 04 月 21 日
11	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购航天软件首次公开发行 A 股的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 05 月 17 日
12	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票估值方法变更的提示性公	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会	2023 年 05 月 19 日

	告	基金电子披露网站	
13	鹏华基金管理有限公司关于注意防范以协助办理贷款为借口进行诈骗活动的风险提示	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 06 月 03 日
14	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与国海证券股份有限公司申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 06 月 05 日
15	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 06 月 06 日
16	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与北京中植基金销售有限公司申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 06 月 20 日
17	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购豪恩汽电首次公开发行 A 股的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 06 月 28 日

注：无。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- （一）《鹏华价值精选股票型证券投资基金基金合同》；
- （二）《鹏华价值精选股票型证券投资基金托管协议》；
- （三）《鹏华价值精选股票型证券投资基金 2023 年中期报告》（原文）。

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

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

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

鹏华基金管理有限公司

2023 年 8 月 30 日