

# 鹏华价值精选股票型证券投资基金 2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 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：2024 年 3 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。本年度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 2024 年 03 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。

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）注册会计师对本基金出具了“标准无保留意见”的审计报告。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>7</b>
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
3.4 过去三年基金的利润分配情况	9
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
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	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	15
4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	16
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>16</b>
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>18</b>
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	19
7.3 净资产变动表	20
7.4 报表附注	22

<b>§ 8 投资组合报告</b>	<b>60</b>
8.1 期末基金资产组合情况	60
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	61
8.3 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	61
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	81
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	83
8.6 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	83
8.7 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	83
8.8 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	83
8.9 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	83
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	83
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	83
8.12 投资组合报告附注	83
<b>§ 9 基金份额持有人信息</b>	<b>84</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	84
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	84
9.3 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	84
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	85
<b>§ 10 开放式基金份额变动</b>	<b>85</b>
<b>§ 11 重大事件揭示</b>	<b>85</b>
11.1 基金份额持有人大会决议	85
11.2 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	85
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	85
11.4 基金投资策略的改变	85
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	85
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	86
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	86
11.8 其他重大事件	89
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息</b>	<b>92</b>
12.1 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	92
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	92
<b>§ 13 备查文件目录</b>	<b>92</b>
13.1 备查文件目录	92
13.2 存放地点	92
13.3 查阅方式	92

## § 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	73,454,340.16 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	王小飞
	联系电话	0755-81395402	021-60637103
	电子邮箱	xxpl@phfund.com.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.phfund.com.cn">http://www.phfund.com.cn</a>
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

#### 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	2023 年	2022 年	2021 年
本期已实现收益	-16,978,893.01	-31,448,146.12	152,427,225.43
本期利润	-19,391,393.08	-64,954,055.87	84,790,256.15
加权平均基金份额本期利润	-0.2495	-0.7403	0.7736
本期加权平均净值利润率	-8.50%	-23.26%	24.07%
本期基金份额净值增长率	-9.01%	-19.71%	26.30%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
期末可供分配利润	124,748,895.89	167,383,357.29	226,111,316.71
期末可供分配基金份额利润	1.6983	1.9652	2.4890
期末基金资产净值	198,203,236.05	252,558,389.99	335,466,668.60
期末基金份额净值	2.698	2.965	3.693
3.1.3 累计期末指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
基金份额累计净值增长率	169.80%	196.50%	269.30%

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 12 月 31 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	-3.99%	0.98%	-6.19%	0.71%	2.20%	0.27%
过去六个月	-11.16%	0.97%	-9.47%	0.76%	-1.69%	0.21%
过去一年	-9.01%	0.95%	-9.81%	0.76%	0.80%	0.19%
过去三年	-7.73%	1.46%	-30.16%	1.00%	22.43%	0.46%
过去五年	177.29%	1.56%	15.78%	1.09%	161.51%	0.47%
自基金合同生效起至今	169.80%	1.55%	39.27%	1.23%	130.53%	0.32%

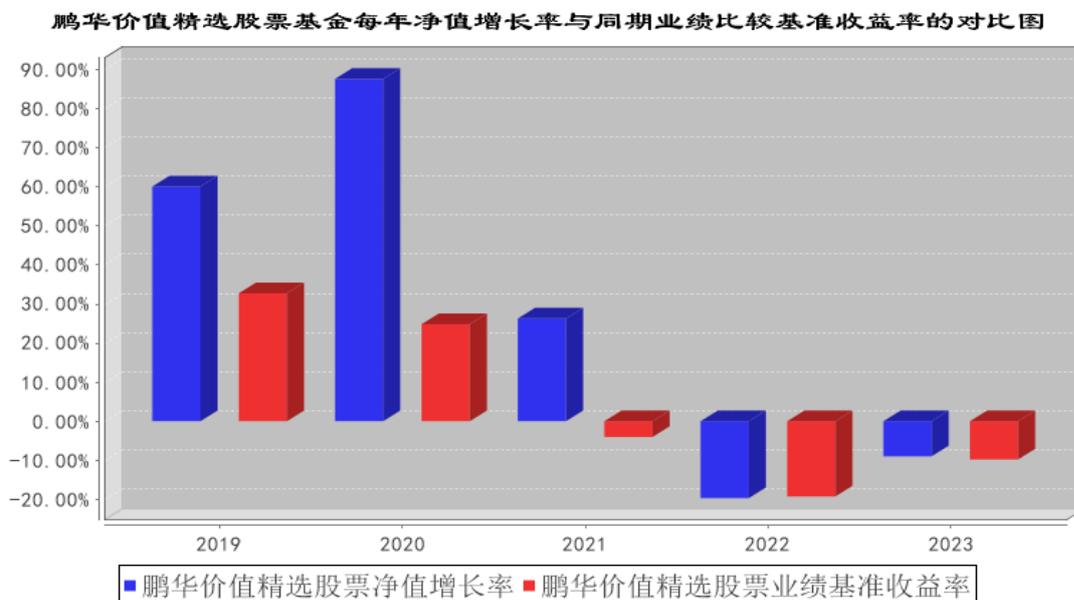
注：业绩比较基准=沪深 300 指数收益率×90%+中证综合债指数收益率×10%

#### 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。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：合同生效当年按照实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 其他指标

注：无。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

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达到 11052 亿元，313 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-	-	10 年	张鹏先生，国籍中国，金融学硕士，10 年

		24			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。

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《鹏华基金管理有限公司公平交易管理规定》，将公司所管理的封闭式基金、开放式基金、社保组合、养老组合、特定客户资产管理组合等不同资产组合的授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动均纳入公平交易管理，在业务流程和岗位职责中制定公平交易的控制规则和控制活动，建立对公平交易的执行、监督及审核流程，严禁在不同投资组合之间进行利益输送。

在投资研究环节：1、公司使用唯一的研究报告发布平台“研究报告管理平台”，确保各投资组合在获得投资信息、研究支持、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；2、公司严格按照《股票库管理规定》、《信用债券投资与风险控制管理规定》，执行股票及信用产品出入库及日常维护工作，确保相关证券入库以内容严谨、观点明确的研究报告作为依据；3、在公司股票库基础上，各涉及股票投资的资产组合根据各自的投资目标、投资风格、投资范围和防范关联交易的原则分别建立资产组合股票库，基金经理在股票库基础上根据投资授权以及基金合同择股方式构建具体的投资组合；4、严格执行投资授权制度，明确投资决策委员会、分管投资副总裁、基金经理等各主体的职责和权限划分，合理确定基金经理的投资权限，超过投资权限的操作，应严格履行审批程序。

在交易执行环节：1、所有公司管理的资产组合的交易必须通过集中交易室完成，集中交易室负责建立和执行交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会；2、针对交易所公开竞价交易，集中交易室应严格启用恒生交易系统内的公平交易程序，交易系统则自动启用公平交易功能，由系统按照“未委托数量”的比例对不同资产组合进行委托量的公平分配；如果相关基金经理坚持以不同的价格进行交易，且当前市场价格不能同时满足多个资产组合的指令价格要求时，交易系统自动按照“价格优先”原则进行委托；当市场价格同时满足多个资产组合的指令价格要求时，则交易系统自动按照“同一指令价格下的公平交易”模式，进行公平委托和交易量分配；3、银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易需依据公司《股票投资交易流程》和《固定收益投资管理流程》的规定执行；银行间市场交易、交易所大宗交易等以公司名义进行的交易，各投资组合经理应在交易前独立确定各投资组合的交易价格和数量，公司按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；4、新股、新债申购及非公开定向增发交易需依据公司《新股申购流程》、《固定收益投资管理流程》和《非公开定向增发流程》的规定执行，对新股和新债申购方案和分配过程进行审核和监控。

在交易监控、分析与评估环节：1、为加强对日常投资交易行为的监控和管理，杜绝利益输送、不公平交易等违规交易行为，防范日常交易风险，公司明确了关注类交易的界定及对应的监控和评估措施机制；所监控的交易包括但不限于：交易所公开竞价交易中同日同向交易的交易时机和交易价差、不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差、关联交易、债券交易收益率偏离度、成交量和成交价格异常、银行间债券交易对手交易等；2、将公平交易作为投资组合业绩归因分析和交易绩效评价的重要关注内容，发现的异常情况由投资监察员进行分析；3、风控管理部分别于每季度和每年度编写《公平交易执行情况检查报告》，内容包括关注类交易监控执行情况、不同投资组合的整体收益率差异分析和同向交易价差分析。

### 4.3.2 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。

#### 4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

### 4.3.3 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

回顾 2023 年整年，A 股整体下跌，结构分化剧烈，各板块轮动快。在 1 月短暂的新能源板块反弹之后，整个上半年成长风格中的泛 AI 线索软硬件板块、数据要素线索和部分半导体公司涨幅明显，下半年风格切换，在 A 股下跌的大背景下，汽车的需求率先走出强于其他消费品的趋势，板块差额明显，医药经过长达接近半年的调整，电子板块也在充分调整后迎来了创新和需求修复的双重预期修复，前者以医药反腐阶段性告一段落为起点，后者以白马 3 季度业绩超预期为起点，阶段性超额明显。除了上述阶段性机会之外，还有几个特征，一是房地产链、消费复苏链、新能源链等板块的弱势贯穿全年，二是各类主题层出不穷各领风骚然后迅速调整，如机器人、华为链、卫星链等等，各以主题方式展开，三是具体到个股上，机构筹码集中的白马标的明显弱于筹码较轻的个股，具有一定的筹码驱动的因素；

基金经理个人对去年的市场的理解归纳为——破与立。抱团在破，历史上尤其是近些年主流认可的核心资产的泡沫在破，资金抱团在破，押注赛道的投资方式在破，主流的审美指向在破，甚至是原有的业绩超预期驱动方式、基于对认知惯性带来的趋势投资方式、基于 DCF 估值模型终局价值投资方式等都在破，参与股票投资的资金的固有结构也在破。随之而来的是立，新的投资主体在立，如没有情绪纪律俨然的量化资金等，新的审美指向在立，喝酒还是看 AI 做的短剧？年轻人和年轻资金追随的方向在立，而不是盲目的去追随历史的话语权，过去的核心资产不一定是未来的优质资产，年轻人自己的定价权在立，整个时代的红利规则都在重建。而破与立的过程中，必然涉及到对原有资产的留恋与反复，以及对新产业趋势的怀疑和分歧，原有的资产必然出现下跌与反弹的波动，而新的产业必然出现试探性的投资与恐惧驱动的回撤，以主题形式展开，其定

价期间的大起大落就是愿意尝试前沿产业投资的资金的必然属性。回顾历史莫不如此，可以理解，值得关注，乐见其成。同样在破与立的过程中，对新产业趋势暂时保持观察中立态度，换仓的方向指向就是高确定性低估值的红利板块，因此红利板块与 AI 等新产业趋势双线索，成为去年的核心观察，但是无论如何，底层逻辑都是破与立，只是对立的新方向置信度的不同，带来了双主线。

每个时代有每个时代的局限和主线，基于这个背景和解释，未来的时代级别的主线一定是在变化中诞生，过程一定曲折，主角有待观察，但是必然是新产业，必然是新人，必然符合新一代人的审美，他们接受什么，他们怎么生活和追求，无关对错，就是未来时代的主线。因此基金经理的思路在 2023 年已经逐渐收敛到对变化的观察、研究和学习上，甚至预期会是至少未来两到三年的主要策略思路。

因此，基金经理贯穿全年的操作可以概括为，在自己擅长的泛制造业范畴内，寻找符合新产业趋势的投资标的，边际上出清历史上曾经辉煌如今下跌较多有待反复的投资机会。具体到板块上，我们清仓军工，大幅减仓新能源板块保留部分新技术公司，显著加仓了 TMT 板块和电子板块中和泛 AI 线索有关的公司。在核心板块汽车板块中，用未来有新技术新客户新产业趋势的相关公司平替了部分高增过去业绩平稳的公司。

虽然破与立的过程中必然有混乱和挫折，但是基金经理认为这是个好迹象，历史上从五朵金花切到消费到医药再切到移动互联网再切到新能源等大级别主线的过程中，都有混乱的过程，所谓不破不立，混乱的过程正孕育着新主线的大机会，背后是全社会审美方向的逐渐变化，慢，但是不可逆。

#### 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-9.01%，同期业绩比较基准增长率为-9.81%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

看 2024 年，我们看好几个方向，一是经济企稳需求复苏从居民和市场认知上逐渐落地，预期逐渐修复，工业金属大宗商品由于供给侧的刚性，是比较好的选择；二是制造业中跨越红海蓝海之争论，产品全方位有变化的行业，即使供给过剩但是顺应变化的优质供给依然稀缺的行业，比如汽车板块中的自主企业，比如半导体领域中在创新和国产化上具有竞争优势的公司；三是泛 AI 线索中，能够真的构建自己的产品，能落地并带来实际需求的软硬件公司；四是未来的变化未必一定是 AI，一些新的产业苗头也可能是未来变化中走出来的黑马主角。

但是实话实说，虽然基金经理对新产业趋势抱有极大的兴趣，对新投资机会保持高敏感，但是遗憾的是并不认为新的投资主线会一蹴而就，或者对于立刻产生巨大的投资机会相对保守。因此 24 年依然会相对均衡的结构，会注意控制回撤，需要经过深度研究才会重仓，在认为过度乐观

的时点适当兑现。

再多说两句自己的底层体系，在过去年季报中多次提及的不忘初心，这一处处屡见不鲜的概念，于我有独特的心路历程，从出身草根追求个人价值，到真正追求社会价值，承担起无数个家庭的财富保值增值的责任，是逐步形成的理念，因此比较坚定。我时刻提醒自己，基民背后的家庭和我普通但勤劳有爱的父母亲都是我最坚实的基础，年轻人未来就是我的未来，我会时刻保持这份初心，剥离无效的内耗，每一步都有进步。2024 年，加油！

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人继续完善内部控制、提升风险管理水平，着重开展了以下各项工作：

##### 1、继续完善内部控制体系

公司根据法律法规、监管要求及业务发展需求，不断优化现有的标准化业务流程体系，强调业务流程服务于加强风险防范和提升运营效率，通过信息技术手段持续提升业务操作的系统化程度，并不断优化。

##### 2、规范基金销售业务，保证基金销售业务的合法合规性

报告期内，在基金募集和持续营销活动中，公司严格规范基金销售业务，按照《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及相关法规规定审查宣传推介材料，逐步落实反洗钱法律法规各项要求，并督促销售部门做好投资者教育工作。

##### 3、开展以风险为导向的内部稽核

报告期内，监察稽核部开展了对信息技术管理、投资相关流程、员工行为、反洗钱业务、子公司管理和公司日常运作的定期监察稽核与专项监察稽核。监察稽核人员开展了以风险为导向的内部稽核，通过稽核发现提高了公司标准化操作流程的执行效率，优化了标准化操作流程手册。报告期内，公司未发生重大风险事件。

此外，在投资日常合规监控工作方面，公司根据法律法规和产品特点进一步完善了投资合规风控制度流程及投资监控系统，加强对投资限制的监控提示；持续完善公平交易、异常交易等监测管控机制，在实现交易价差分析、银行间交易分析、研究报告检查等专项检查工作定期化、日常化的基础上，公司多次开展有关内幕交易、未公开信息等重要内容的合规培训，进一步强化全体投研人员的合规意识。

#### 4.7 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。

#### 4.8 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 124,748,895.89 元，期末基金份额净值 2.698 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。

#### 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

#### 4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

### 5.3 托管人对本年度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 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2024)第 25741 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	鹏华价值精选股票型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了鹏华价值精选股票型证券投资基金(以下简称“鹏华价值精选股票基金”)的财务报表,包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表,2023 年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了鹏华价值精选股票基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于鹏华价值精选股票基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	无。
其他事项	无。
其他信息	无。
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>鹏华价值精选股票基金的基金管理人鹏华基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p>

	<p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估鹏华价值精选股票基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算鹏华价值精选股票基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督鹏华价值精选股票基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对鹏华价值精选股票基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致鹏华价值精选股票基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
<p>会计师事务所的名称</p>	<p>普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)</p>
<p>注册会计师的姓名</p>	<p>单峰   仲文渊</p>
<p>会计师事务所的地址</p>	<p>中国上海市</p>
<p>审计报告日期</p>	<p>2024 年 3 月 25 日</p>

## § 7 年度财务报表

## 7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	23,709,406.14	18,380,737.07
结算备付金		369,336.61	858,192.25
存出保证金		72,119.52	91,209.21
交易性金融资产	7.4.7.2	176,312,870.20	220,605,693.80
其中：股票投资		176,312,870.20	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	10,119,974.93
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		-	3,732,997.92
应收股利		-	-
应收申购款		49,863.19	52,540.16
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		200,513,595.66	253,841,345.34
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		1,254,409.73	184,614.82
应付赎回款		381,246.65	130,717.79

应付管理人报酬		204,499.31	257,760.09
应付托管费		34,083.21	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	7.4.7.9	436,120.71	656,161.94
负债合计		2,310,359.61	1,282,955.35
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.10	73,454,340.16	85,175,032.70
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	124,748,895.89	167,383,357.29
净资产合计		198,203,236.05	252,558,389.99
负债和净资产总计		200,513,595.66	253,841,345.34

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 2.698 元，基金份额总额 73,454,340.16 份。

## 7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		-15,952,512.51	-60,728,709.43
1. 利息收入		140,475.36	176,253.49
其中：存款利息收入	7.4.7.13	96,897.44	119,529.46
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		43,577.92	56,724.03
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-13,706,580.16	-27,462,023.83
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-15,784,985.40	-29,654,653.24
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	70,664.26	25.15
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	2,007,740.98	2,192,604.26

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）	7.4.7.20	-2,412,500.07	-33,505,909.75
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	26,092.36	62,970.66
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>3,438,880.57</b>	<b>4,225,346.44</b>
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,744,919.69	3,353,937.14
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	520,673.37	698,736.96
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
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	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		0.07	0.09
8. 其他费用	7.4.7.23	173,287.44	172,672.25
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-19,391,393.08</b>	<b>-64,954,055.87</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-19,391,393.08</b>	<b>-64,954,055.87</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-19,391,393.08</b>	<b>-64,954,055.87</b>

### 7.3 净资产变动表

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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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	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	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)	-11,720,692.54	-	-42,634,461.40	-54,355,153.94
(一)、综合收益总额	-	-	-19,391,393.08	-19,391,393.08
(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)	-11,720,692.54	-	-23,243,068.32	-34,963,760.86
其中：1. 基金申购款	6,673,245.98	-	13,226,938.77	19,900,184.75
2. 基金赎回款	-18,393,938.52	-	-36,470,007.09	-54,863,945.61
(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	73,454,340.16	-	124,748,895.89	198,203,236.05
项目	上年度可比期间			
	2022年1月1日至2022年12月31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	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	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)	-5,667,775.48	-	-77,240,503.13	-82,908,278.61

(一)、综合收益总额	-	-	-64,954,055.87	-64,954,055.87
(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)	-5,667,775.48	-	-12,286,447.26	-17,954,222.74
其中：1. 基金申购款	14,575,067.28	-	32,469,790.45	47,044,857.73
2. 基金赎回款	-20,242,842.76	-	-44,756,237.71	-64,999,080.47
(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	85,175,032.70	-	167,383,357.29	252,558,389.99

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

邓召明

邢彪

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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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。

#### 7.4.2 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。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 年度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 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和基金净资产变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

###### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅

为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具；即不包含付款的合同义务且享有发行人净资产和剩余收益的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具（主要为股票投资）按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

## （2）金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑在资产负债表日无须付出不必要的额外成本和努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经

发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。本基金在上一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形的，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本基金利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、基金投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场,采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时,优先使用可观察输入值,只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下,才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件,应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的;且 2) 交易双方准备按净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征:(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利,这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产;这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位,并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量;(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别,即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具,且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权;(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别),所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征,并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同);(4)除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外,该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征;(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额,应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具,是指根据合同约定,持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利,或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时,自动回售给发行方的金融工具。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税(和/或)股票交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率或者发行价计算的利息及在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费(如有)在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

以摊余成本计量的负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现

平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券

除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 7.4.6 税项

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

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税,对国债、地方政府债以

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

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

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

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

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

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	23,709,406.14	18,380,737.07
等于：本金	23,707,231.89	18,377,984.39
加：应计利息	2,174.25	2,752.68
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	23,709,406.14	18,380,737.07

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	186,965,413.50	-	176,312,870.20	-10,652,543.30	
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	186,965,413.50	-	176,312,870.20	-10,652,543.30	
项目	上年度末 2022年12月31日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	228,697,711.08	-	220,419,350.65	-8,278,360.43	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	148,000.00	25.95	186,343.15	38,317.20
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	148,000.00	25.95	186,343.15	38,317.20
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	228,845,711.08	25.95	220,605,693.80	-8,240,043.23	

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。

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无。

##### 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

## 7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

## 7.4.7.4 买入返售金融资产

## 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	10,119,974.93	-
银行间市场	-	-
合计	10,119,974.93	-

## 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

## 7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。
----

## 7.4.7.5 债权投资

## 7.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

## 7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

## 7.4.7.6 其他债权投资

## 7.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

## 7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

## 7.4.7.7 其他权益工具投资

## 7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

## 7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

## 7.4.7.8 其他资产

注：无。

## 7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	46.96	284.79
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	266,073.75	485,877.15
其中：交易所市场	266,073.75	485,877.15
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	170,000.00	170,000.00
合计	436,120.71	656,161.94

## 7.4.7.10 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 12 月 31 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	6,673,245.98	6,673,245.98
本期赎回（以“-”号填列）	-18,393,938.52	-18,393,938.52
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	73,454,340.16	73,454,340.16

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

## 7.4.7.11 其他综合收益

注：无。

## 7.4.7.12 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
加：会计政策变更	-	-	-

前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	182,149,089.53	-14,765,732.24	167,383,357.29
本期利润	-16,978,893.01	-2,412,500.07	-19,391,393.08
本期基金份额交易产生的变动数	-24,629,246.56	1,386,178.24	-23,243,068.32
其中：基金申购款	14,078,609.58	-851,670.81	13,226,938.77
基金赎回款	-38,707,856.14	2,237,849.05	-36,470,007.09
本期已分配利润	-	-	-
本期末	140,540,949.96	-15,792,054.07	124,748,895.89

#### 7.4.7.13 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12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
活期存款利息收入	78,926.33	102,803.38
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	16,442.44	14,647.00
其他	1,528.67	2,079.08
合计	96,897.44	119,529.46

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

#### 7.4.7.14 股票投资收益

##### 7.4.7.14.1 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12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-15,784,985.40	-29,654,653.24
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	-15,784,985.40	-29,654,653.24

##### 7.4.7.14.2 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12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
卖出股票成交总额	1,178,113,892.93	1,260,831,208.14
减：卖出股票成本总额	1,190,525,635.61	1,286,710,724.41

减：交易费用	3,373,242.72	3,775,136.97
买卖股票差价收入	-15,784,985.40	-29,654,653.24

#### 7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

#### 7.4.7.15 债券投资收益

##### 7.4.7.15.1 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12 月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 12月31日
债券投资收益——利息收入	20.12	25.15
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	25.15

##### 7.4.7.15.2 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12 月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12 月31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	-

##### 7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

##### 7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 7.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

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

注：无。

## 7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

## 7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

## 7.4.7.17 贵金属投资收益

## 7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

## 7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

## 7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

## 7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

## 7.4.7.18 衍生工具收益

## 7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

## 7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

## 7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资产生的股利收益	2,007,740.98	2,192,604.26
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	2,007,740.98	2,192,604.26

## 7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
1. 交易性金融资产	-2,412,500.07	-33,505,909.75
股票投资	-2,374,182.87	-33,544,226.95
债券投资	-38,317.20	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	-2,412,500.07	-33,505,909.75

#### 7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
基金赎回费收入	22,672.18	58,731.00
基金转换费收入	3,420.18	4,239.66
合计	26,092.36	62,970.66

#### 7.4.7.22 信用减值损失

注：无。

#### 7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费用	3,287.44	2,672.25
合计	173,287.44	172,672.25

#### 7.4.7.24 分部报告

无。

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

无。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

### 7.4.9 关联方关系

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、基金注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“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
深圳市北融信投资发展有限公司	基金管理人的股东
意大利欧利盛资本资产管理股份公司(“Eurizon Capital SGR S.p.A.”)	基金管理人的股东
鹏华资产管理有限公司(“鹏华资产”)	基金管理人的子公司

注：1、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。

2、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 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12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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	48,107,509.76	2.08	21,413,254.77	0.86

##### 7.4.10.1.2 债券交易

注：无。

##### 7.4.10.1.3 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12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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	40,432,000.00	10.18	-	-

##### 7.4.10.1.4 权证交易

注：无。

## 7.4.10.1.5 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12月31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	44,672.41	2.09	4,962.90	1.87
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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	0.86	-	-

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。

## 7.4.10.2 关联方报酬

## 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,744,919.69	3,353,937.14
其中：应支付销售机构的客户维护 费	865,768.80	1,065,972.20
应支付基金管理人的净管理费	1,879,150.89	2,287,964.94

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。

## 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	520,673.37	698,736.96

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 0.20%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×0.20%/当年天数。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

#### 7.4.10.4 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

##### 7.4.10.4.1 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。

##### 7.4.10.4.2 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。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自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 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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	10.0536%	8.6701%

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。

##### 7.4.10.5.2 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。

7.4.10.6 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12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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	23,709,406.14	78,926.33	18,380,737.07	102,803.38

7.4.10.7 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12月31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	603270	金帝股份	网下申购	790	17,198.30
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12月31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	301338	凯格精机	网下申购	2,226	103,130.58
国信证券	688401	路维光电	网下申购	4,898	122,841.84
国信证券	301161	唯万密封	网下申购	3,460	64,563.60
国信证券	688244	永信至诚	网下申购	1,506	74,080.14
国信证券	688231	隆达股份	网下申购	2,524	98,637.92

注：本表包含参与基金托管人的关联方承销证券的情况。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

注：无。

7.4.12 期末（2023年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名	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：）	期末成本总额	期末估值总额	备注

	称						股)			
001239	永达股份	2023年12月4日	6个月	新股流通受限	12.05	19.92	133	1,602.65	2,649.36	-
001306	夏厦精密	2023年11月9日	6个月	新股流通受限	53.63	75.36	28	1,501.64	2,110.08	-
001326	联域股份	2023年11月1日	6个月	新股流通受限	41.18	48.64	50	2,059.00	2,432.00	-
001358	兴欣新材	2023年12月14日	6个月	新股流通受限	41.00	44.16	48	1,968.00	2,119.68	-
001378	德冠新材	2023年10月23日	6个月	新股流通受限	31.68	31.27	91	2,882.88	2,845.57	-
300904	威力传动	2023年8月2日	6个月	新股流通受限	35.41	61.53	188	6,657.08	11,567.64	-
301172	君逸数码	2023年7月19日	6个月	新股流通受限	31.33	38.16	229	7,174.57	8,738.64	-
301202	朗威股份	2023年6月28日	6个月	新股流通受限	25.82	31.80	155	4,002.10	4,929.00	-
301251	威尔高	2023年8月30日	6个月	新股流通受限	28.88	34.59	135	3,898.80	4,669.65	-
301261	恒工精密	2023年6月29日	6个月	新股流通受限	36.90	50.85	108	3,985.20	5,491.80	-
301272	英华特	2023年7月6日	6个月	新股流通受限	51.39	53.38	97	4,984.83	5,177.86	-

		日								
301291	明阳电气	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	38.13	28.36	211	8,045.43	5,983.96	-
301292	海科新源	2023年6月29日	6个月	新股流通受限	19.99	19.35	315	6,296.85	6,095.25	-
301329	信音电子	2023年7月5日	6个月	新股流通受限	21.00	22.23	197	4,137.00	4,379.31	-
301348	蓝箭电子	2023年8月1日	6个月	新股流通受限	18.08	44.57	355	6,418.40	15,822.35	-
301370	国科恒泰	2023年7月3日	6个月	新股流通受限	13.39	16.01	519	6,949.41	8,309.19	-
301371	敷尔佳	2023年7月24日	6个月	新股流通受限	55.68	37.58	94	5,233.92	3,532.52	-
301381	赛维时代	2023年7月5日	6个月	新股流通受限	20.45	29.69	282	5,766.90	8,372.58	-
301393	昊帆生物	2023年7月5日	6个月	新股流通受限	67.68	59.37	78	5,279.04	4,630.86	-
301413	安培龙	2023年12月11日	6个月	新股流通受限	33.25	58.19	101	3,358.25	5,877.19	-
301418	协昌科技	2023年8月10日	6个月	新股流通受限	51.88	50.20	92	4,772.96	4,618.40	-
301421	波长光	2023年8月16日	6个月	新股流通受限	29.38	59.37	147	4,318.86	8,727.39	-

	电	日								
301456	盘古智能	2023年7月6日	6个月	新股流通受限	37.96	30.39	133	5,048.68	4,041.87	-
301459	丰茂股份	2023年12月6日	6个月	新股流通受限	31.90	39.84	103	3,285.70	4,103.52	-
301486	致尚科技	2023年6月30日	6个月	新股流通受限	57.66	47.25	123	7,092.18	5,811.75	-
301487	盟固利	2023年8月1日	6个月	新股流通受限	5.32	40.96	867	4,612.44	35,512.32	-
301488	豪恩汽电	2023年6月26日	6个月	新股流通受限	39.78	69.09	120	4,773.60	8,290.80	-
301489	思泉新材	2023年10月16日	6个月	新股流通受限	41.66	64.11	77	3,207.82	4,936.47	-
301498	乖宝宠物	2023年8月9日	6个月	新股流通受限	39.99	38.81	115	4,598.85	4,463.15	-
301499	维科精密	2023年7月13日	6个月	新股流通受限	19.50	28.93	240	4,680.00	6,943.20	-
301500	飞南资源	2023年9月13日	6个月	新股流通受限	23.97	20.89	152	3,643.44	3,175.28	-
301505	苏州规划	2023年7月12日	6个月	新股流通受限	26.35	35.81	136	3,583.60	4,870.16	-
301507	民生健	2023年8月24日	6个月	新股流通受限	10.00	15.85	349	3,490.00	5,531.65	-

	康日									
301508	中机认检	2023年11月23日	6个月	新股流通受限	16.82	26.68	215	3,616.30	5,736.20	-
301510	固高科技	2023年8月4日	6个月	新股流通受限	12.00	35.01	315	3,780.00	11,028.15	-
301511	德福科技	2023年8月8日	6个月	新股流通受限	28.00	22.67	206	5,768.00	4,670.02	-
301515	港通医疗	2023年7月13日	6个月	新股流通受限	31.16	28.27	114	3,552.24	3,222.78	-
301516	中远通	2023年12月1日	6个月	新股流通受限	6.87	15.51	477	3,276.99	7,398.27	-
301517	陕西华达	2023年10月9日	6个月	新股流通受限	26.87	43.69	97	2,606.39	4,237.93	-
301518	长华化学	2023年7月26日	6个月	新股流通受限	25.75	23.01	186	4,789.50	4,279.86	-
301519	舜禹股份	2023年7月19日	6个月	新股流通受限	20.93	20.21	224	4,688.32	4,527.04	-
301520	万邦医药	2023年9月18日	6个月	新股流通受限	67.88	52.74	80	5,430.40	4,219.20	-
301525	儒竞科技	2023年8月23日	6个月	新股流通受限	99.57	81.46	38	3,783.66	3,095.48	-
301526	国际复	2023年12月19日	6个月	新股流通受限	2.66	4.45	2,191	5,828.06	9,749.95	-

	材	日								
301528	多浦乐	2023年8月17日	6个月	新股流通受限	71.80	68.91	83	5,959.40	5,719.53	-
301529	福赛科技	2023年8月31日	6个月	新股流通受限	36.60	37.88	95	3,477.00	3,598.60	-
301533	威马农机	2023年8月7日	6个月	新股流通受限	29.50	33.16	167	4,926.50	5,537.72	-
301548	崇德科技	2023年9月11日	6个月	新股流通受限	66.80	58.99	53	3,540.40	3,126.47	-
301550	斯菱股份	2023年9月6日	6个月	新股流通受限	37.56	43.57	99	3,718.44	4,313.43	-
301555	惠柏新材	2023年10月24日	6个月	新股流通受限	22.88	32.44	147	3,363.36	4,768.68	-
301558	三态股份	2023年9月21日	6个月	新股流通受限	7.33	13.40	561	4,112.13	7,517.40	-
301559	中集环科	2023年9月26日	6个月	新股流通受限	24.22	18.24	184	4,456.48	3,356.16	-
301566	达利凯普	2023年12月22日	6个月	新股流通受限	8.90	22.14	400	3,560.00	8,856.00	-
301568	思泰克	2023年11月21日	6个月	新股流通受限	23.23	35.58	119	2,764.37	4,234.02	-
301578	辰奕智	2023年12月21日	6个月	新股流通受限	48.94	68.32	73	3,572.62	4,987.36	-

	能	日								
601083	锦 江 航 运	2023 年 11 月 28 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	11.25	11.07	226	2,542.50	2,501.82	-
601096	宏 盛 华 源	2023 年 12 月 15 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	1.70	4.06	1,062	1,805.40	4,311.72	-
603004	鼎 龙 科 技	2023 年 12 月 20 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	16.80	31.19	104	1,747.20	3,243.76	-
603062	麦 加 芯 彩	2023 年 10 月 31 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	58.08	57.81	29	1,684.32	1,676.49	-
603075	热 威 股 份	2023 年 9 月 1 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	23.10	23.31	70	1,617.00	1,631.70	-
603107	上 海 汽 配	2023 年 10 月 25 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	14.23	18.19	102	1,451.46	1,855.38	-
603119	浙 江 荣 泰	2023 年 7 月 21 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	15.32	23.87	96	1,470.72	2,291.52	-
603193	润 本 股 份	2023 年 10 月 9 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	17.38	16.66	109	1,894.42	1,815.94	-
603231	索 宝 蛋 白	2023 年 12 月 6 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	21.29	21.53	65	1,383.85	1,399.45	-
603270	金 帝 股 份	2023 年 8 月 25 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	21.77	29.58	79	1,719.83	2,336.82	-
603273	天 元 智	2023 年 10 月 16	6 个月	新 股 流 通 受 限	9.50	18.97	120	1,140.00	2,276.40	-

	能	日								
603276	恒兴新材	2023年9月18日	6个月	新股流通受限	25.73	24.88	83	2,135.59	2,065.04	-
603296	华勤技术	2023年8月1日	6个月	新股流通受限	80.80	77.75	68	5,494.40	5,287.00	-
603373	安邦护卫	2023年12月13日	6个月	新股流通受限	19.10	34.75	69	1,317.90	2,397.75	-
688347	华虹公司	2023年7月27日	6个月	新股流通受限	52.00	42.06	4,791	249,132.00	201,509.46	-
688450	光格科技	2023年7月17日	6个月	新股流通受限	53.09	36.42	72	3,822.48	2,622.24	-
688548	广钢气体	2023年8月8日	6个月	新股流通受限	9.87	12.75	594	5,862.78	7,573.50	-
688549	中巨芯-U	2023年8月30日	6个月	新股流通受限	5.18	8.09	881	4,563.58	7,127.29	-
688563	航材股份	2023年7月12日	6个月	新股流通受限	78.99	60.49	111	8,767.89	6,714.39	-
688573	信宇人	2023年8月9日	6个月	新股流通受限	23.68	28.80	248	5,872.64	7,142.40	-
688582	芯动联科	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	26.74	38.67	161	4,305.14	6,225.87	-
688591	泰凌微	2023年8月18日	6个月	新股流通受限	24.98	28.02	231	5,770.38	6,472.62	-

		日								
688602	康鹏科技	2023年7月13日	6个月	新股流通受限	8.66	11.06	391	3,386.06	4,324.46	-
688603	天承科技	2023年6月30日	6个月	新股流通受限	55.00	74.14	87	4,785.00	6,450.18	-
688612	威迈斯	2023年7月19日	6个月	新股流通受限	47.29	37.97	85	4,019.65	3,227.45	-
688627	精智达	2023年7月11日	6个月	新股流通受限	46.77	87.72	92	4,302.84	8,070.24	-
688638	誉辰智能	2023年7月4日	6个月	新股流通受限	83.90	59.68	64	5,369.60	3,819.52	-
688646	逸飞激光	2023年7月21日	6个月	新股流通受限	46.80	36.07	115	5,382.00	4,148.05	-
688648	中邮科技	2023年11月6日	6个月	新股流通受限	15.18	21.43	201	3,051.18	4,307.43	-
688651	盛邦安全	2023年7月19日	6个月	新股流通受限	39.90	46.05	114	4,548.60	5,249.70	-
688652	京仪装备	2023年11月22日	6个月	新股流通受限	31.95	52.25	124	3,961.80	6,479.00	-
688653	康希通信	2023年11月10日	6个月	新股流通受限	10.50	15.99	313	3,286.50	5,004.87	-
688657	浩辰软	2023年9月25日	6个月	新股流通受限	103.40	78.23	43	4,446.20	3,363.89	-

	件	日								
688671	碧兴物联	2023年8月2日	6个月	新股流通受限	36.12	34.30	156	5,634.72	5,350.80	-
688693	锆威特	2023年8月10日	6个月	新股流通受限	40.83	43.41	98	4,001.34	4,254.18	-
688702	盛科通信-U	2023年9月6日	6个月	新股流通受限	42.66	48.18	86	3,668.76	4,143.48	-
688716	中研股份	2023年9月13日	6个月	新股流通受限	29.66	36.39	126	3,737.16	4,585.14	-
688719	爱科赛博	2023年9月20日	6个月	新股流通受限	69.98	60.10	62	4,338.76	3,726.20	-
688720	艾森股份	2023年11月29日	6个月	新股流通受限	28.03	49.84	121	3,391.63	6,030.64	-

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。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

## 7.4.13 金融工具风险及管理

### 7.4.13.1 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）。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。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。

#### 7.4.13.2 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 12 月 31 日，本基金未持有信用类债券（2022 年 12 月 31 日：0.07%）。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

##### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

##### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

##### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	186,343.15
未评级	-	-
合计	-	186,343.15

注：上述评级均由经中国证监会核准从事证券市场资信评级业务的评级机构作出。

##### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

#### 7.4.13.3 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 12 月 31 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。

#### 7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

#### 7.4.13.3.2 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公司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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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，其余金融资产和金融负债均不计息，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。

## 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	23,709,406.14	-	-	-	23,709,406.14
结算备付金	369,336.61	-	-	-	369,336.61
存出保证金	72,119.52	-	-	-	72,119.52
交易性金融资产	-	-	-	176,312,870.20	176,312,870.20
应收申购款	-	-	-	49,863.19	49,863.19
资产总计	24,150,862.27	-	-	176,362,733.39	200,513,595.66
负债					
应付赎回款	-	-	-	381,246.65	381,246.65
应付管理人报酬	-	-	-	204,499.31	204,499.31
应付托管费	-	-	-	34,083.21	34,083.21
应付清算款	-	-	-	1,254,409.73	1,254,409.73
其他负债	-	-	-	436,120.71	436,120.71
负债总计	-	-	-	2,310,359.61	2,310,359.61
利率敏感度缺口	24,150,862.27	-	-	174,052,373.78	198,203,236.05
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					
货币资金	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，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2023 年 12 月 31 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。

#### 7.4.13.4.2 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。

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无。

##### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无。

#### 7.4.13.4.3 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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31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	176,312,870.20	88.96	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	176,312,870.20	88.96	220,605,693.80	87.34

注：债券投资为可转债、可交换债券投资。

#### 7.4.13.4.3.2 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（2023年12月31日）	上年度末（2022年12月31日）
	比较基准上涨 5%资产净值变动	8,131,287.76	10,476,122.02
	比较基准下降 5%资产净值变动	-8,131,287.76	-10,476,122.02

注：无。

#### 7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

## 7.4.14 公允价值

### 7.4.14.1 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。

### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

#### 7.4.14.2.1 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 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	175,614,915.71	217,592,289.04
第二层次	-	-
第三层次	697,954.49	3,013,404.76
合计	176,312,870.20	220,605,693.80

#### 7.4.14.2.2 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。

#### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

##### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	3,013,404.76	3,013,404.76

当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	1,122,405.95	1,122,405.95
转出第三层次	-	3,929,190.87	3,929,190.87
当期利得或损失总额	-	491,334.65	491,334.65
其中：计入损益的利得或损失	-	491,334.65	491,334.65
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	697,954.49	697,954.49
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	71,260.57	71,260.57
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	5,081,189.93	5,081,189.93
当期购买	-	1,999,996.10	1,999,996.10
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	2,639,183.21	2,639,183.21
转出第三层次	-	7,133,282.82	7,133,282.82
当期利得或损失总额	-	426,318.34	426,318.34
其中：计入损益的利得或损失	-	426,318.34	426,318.34
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	3,013,404.76	3,013,404.76
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-153,487.39	-153,487.39

## 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系

流通受限股票	697,954.49	平均价格 亚式期权 模型	预期波动率	0.1855-2.1988	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流通受限股票	3,013,404.76	平均价格 亚式期权 模型	预期波动率	0.2063-2.4756	负相关

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

#### 7.4.14.4 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。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	176,312,870.20	87.93
	其中：股票	176,312,870.20	87.93
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	24,078,742.75	12.01
8	其他各项资产	121,982.71	0.06
9	合计	200,513,595.66	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 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	944,863.96	0.48
B	采矿业	4,414,761.93	2.23
C	制造业	133,224,174.32	67.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,116,963.91	0.56
E	建筑业	559,635.23	0.28
F	批发和零售业	694,231.52	0.35
G	交通运输、仓储和邮政业	2,702,477.01	1.36
H	住宿和餐饮业	69,218.00	0.03
I	信息传输、软件和信息技术服务业	22,351,211.17	11.28
J	金融业	5,797,168.20	2.92
K	房地产业	1,436,566.00	0.72
L	租赁和商务服务业	643,316.80	0.32
M	科学研究和技术服务业	1,589,218.33	0.80
N	水利、环境和公共设施管理业	237,397.92	0.12
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	81,921.00	0.04
Q	卫生和社会工作	65,723.66	0.03
R	文化、体育和娱乐业	384,021.24	0.19
S	综合	-	-
	合计	176,312,870.20	88.96

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

### 8.3 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	115,700	8,018,010.00	4.05
2	002648	卫星化学	433,067	6,387,738.25	3.22
3	688533	上声电子	90,039	3,432,286.68	1.73
4	002371	北方华创	13,700	3,366,227.00	1.70
5	002920	德赛西威	22,900	2,965,779.00	1.50
6	688008	澜起科技	43,527	2,557,646.52	1.29
7	603997	继峰股份	177,900	2,396,313.00	1.21
8	601006	大秦铁路	313,800	2,262,498.00	1.14
9	603728	鸣志电器	33,300	2,192,805.00	1.11

10	300525	博思软件	140,400	2,094,768.00	1.06
11	603000	人民网	66,400	1,857,872.00	0.94
12	301363	美好医疗	50,400	1,854,720.00	0.94
13	601601	中国太保	76,600	1,821,548.00	0.92
14	601838	成都银行	141,500	1,593,290.00	0.80
15	601633	长城汽车	59,400	1,498,068.00	0.76
16	603019	中科曙光	37,200	1,469,028.00	0.74
17	300858	科拓生物	74,450	1,436,885.00	0.72
18	688192	迪哲医药-U	29,487	1,410,952.95	0.71
19	688279	峰岬科技	11,054	1,394,130.48	0.70
20	600276	恒瑞医药	30,000	1,356,900.00	0.68
21	688107	安路科技	36,095	1,327,574.10	0.67
22	002517	恺英网络	116,700	1,303,539.00	0.66
23	000625	长安汽车	75,800	1,275,714.00	0.64
24	300782	卓胜微	8,900	1,254,900.00	0.63
25	600079	人福医药	49,400	1,228,084.00	0.62
26	688361	中科飞测-U	16,482	1,226,755.26	0.62
27	603737	三棵树	25,740	1,225,481.40	0.62
28	688737	中自科技	36,299	1,201,496.90	0.61
29	688418	震有科技	62,486	1,178,485.96	0.59
30	688066	航天宏图	26,295	1,110,700.80	0.56
31	301313	凡拓数创	30,641	1,104,914.46	0.56
32	300698	万马科技	30,200	1,102,300.00	0.56
33	688012	中微公司	6,969	1,070,438.40	0.54
34	002555	三七互娱	56,200	1,057,122.00	0.53
35	600584	长电科技	35,300	1,054,058.00	0.53
36	600422	昆药集团	49,100	1,024,226.00	0.52
37	601899	紫金矿业	82,200	1,024,212.00	0.52
38	688120	华海清科	5,455	1,023,903.50	0.52
39	601989	中国重工	241,300	996,569.00	0.50
40	300036	超图软件	47,200	986,480.00	0.50
41	002557	洽洽食品	28,000	974,960.00	0.49
42	688595	芯海科技	22,453	972,214.90	0.49
43	002241	歌尔股份	46,200	970,662.00	0.49
44	688099	晶晨股份	15,358	961,871.54	0.49
45	301345	涛涛车业	15,528	945,655.20	0.48
46	688592	司南导航	18,176	943,334.40	0.48
47	601636	旗滨集团	137,500	940,500.00	0.47
48	600418	江淮汽车	58,200	939,930.00	0.47
49	600941	中国移动	9,200	915,216.00	0.46
50	603806	福斯特	37,600	912,552.00	0.46
51	688428	诺诚健华-U	79,305	912,007.50	0.46
52	000837	秦川机床	83,700	899,775.00	0.45

53	600519	贵州茅台	500	863,000.00	0.44
54	002459	晶澳科技	41,176	853,166.72	0.43
55	002180	纳思达	37,400	846,362.00	0.43
56	601898	中煤能源	87,100	843,999.00	0.43
57	688292	浩瀚深度	30,471	838,561.92	0.42
58	601318	中国平安	20,700	834,210.00	0.42
59	002236	大华股份	45,100	832,095.00	0.42
60	688617	惠泰医疗	2,138	830,613.00	0.42
61	603225	新凤鸣	58,300	827,860.00	0.42
62	600938	中国海油	39,400	826,218.00	0.42
63	688800	瑞可达	20,527	824,774.86	0.42
64	603379	三美股份	23,200	788,800.00	0.40
65	688205	德科立	15,690	776,341.20	0.39
66	688516	奥特维	8,523	771,331.50	0.39
67	002011	盾安环境	55,400	761,750.00	0.38
68	300684	中石科技	34,900	750,001.00	0.38
69	688278	特宝生物	14,302	748,709.70	0.38
70	688325	赛微微电	18,834	738,104.46	0.37
71	600266	城建发展	148,800	720,192.00	0.36
72	300634	彩讯股份	35,100	718,497.00	0.36
73	688590	新致软件	31,496	712,439.52	0.36
74	300748	金力永磁	35,200	711,744.00	0.36
75	688678	福立旺	38,506	708,895.46	0.36
76	600761	安徽合力	38,900	708,369.00	0.36
77	000975	银泰黄金	47,000	705,000.00	0.36
78	300757	罗博特科	8,600	699,954.00	0.35
79	000426	兴业银锡	75,700	687,356.00	0.35
80	003021	兆威机电	7,300	686,127.00	0.35
81	603501	韦尔股份	6,400	682,944.00	0.34
82	600733	北汽蓝谷	110,600	677,978.00	0.34
83	688720	艾森股份	11,249	676,603.92	0.34
84	600309	万华化学	8,700	668,334.00	0.34
85	688458	美芯晟	8,670	667,243.20	0.34
86	000338	潍柴动力	48,600	663,390.00	0.33
87	600684	珠江股份	187,600	650,972.00	0.33
88	301488	豪恩汽电	9,320	648,978.80	0.33
89	600809	山西汾酒	2,800	646,044.00	0.33
90	002967	广电计量	43,000	645,430.00	0.33
91	688270	臻镭科技	9,412	643,592.56	0.32
92	301227	森鹰窗业	23,768	643,399.76	0.32
93	003000	劲仔食品	52,300	639,106.00	0.32
94	600150	中国船舶	21,500	632,960.00	0.32
95	688017	绿的谐波	4,099	629,196.50	0.32

96	301191	菲菱科思	6,800	626,960.00	0.32
97	601233	桐昆股份	41,300	624,869.00	0.32
98	300498	温氏股份	31,000	621,860.00	0.31
99	002845	同兴达	34,700	615,925.00	0.31
100	605128	上海沿浦	10,600	615,330.00	0.31
101	688728	格科微	30,055	615,225.85	0.31
102	688484	南芯科技	15,437	615,164.45	0.31
103	603992	松霖科技	33,800	613,132.00	0.31
104	300661	圣邦股份	6,870	611,498.70	0.31
105	688049	炬芯科技	16,048	610,947.36	0.31
106	002385	大北农	101,800	606,728.00	0.31
107	001380	华纬科技	17,400	606,216.00	0.31
108	688256	寒武纪-U	4,478	604,350.88	0.30
109	300803	指南针	10,000	602,600.00	0.30
110	688326	经纬恒润-W	5,178	600,906.90	0.30
111	000887	中鼎股份	48,500	599,945.00	0.30
112	603129	春风动力	5,800	592,992.00	0.30
113	000933	神火股份	35,200	591,360.00	0.30
114	600845	宝信软件	11,944	582,867.20	0.29
115	301153	中科江南	7,366	576,536.82	0.29
116	300601	康泰生物	21,200	575,580.00	0.29
117	000568	泸州老窖	3,200	574,144.00	0.29
118	300812	易天股份	13,800	573,942.00	0.29
119	605388	均瑶健康	45,500	570,570.00	0.29
120	600803	新奥股份	33,700	566,834.00	0.29
121	603190	亚通精工	19,270	564,225.60	0.28
122	601901	方正证券	69,200	557,752.00	0.28
123	300567	精测电子	6,300	552,006.00	0.28
124	002351	漫步者	30,500	538,935.00	0.27
125	688627	精智达	6,032	537,799.44	0.27
126	000063	中兴通讯	20,200	534,896.00	0.27
127	301159	三维天地	11,500	524,745.00	0.26
128	002840	华统股份	25,000	519,750.00	0.26
129	300571	平治信息	14,700	519,351.00	0.26
130	002851	麦格米特	21,100	519,060.00	0.26
131	300832	新产业	6,600	516,120.00	0.26
132	300928	华安鑫创	10,100	509,444.00	0.26
133	001322	箭牌家居	42,300	501,678.00	0.25
134	300188	国投智能	31,300	501,426.00	0.25
135	002508	老板电器	22,600	492,228.00	0.25
136	603758	秦安股份	43,000	491,920.00	0.25
137	000700	模塑科技	70,100	490,700.00	0.25
138	688362	甬矽电子	18,628	487,867.32	0.25

139	301387	光大同创	7,200	487,440.00	0.25
140	688668	鼎通科技	8,771	485,211.72	0.24
141	688496	清越科技	20,890	467,727.10	0.24
142	600933	爱柯迪	20,000	438,800.00	0.22
143	001323	慕思股份	14,200	433,100.00	0.22
144	600480	凌云股份	47,400	431,814.00	0.22
145	688387	信科移动-U	59,136	426,370.56	0.22
146	688575	亚辉龙	18,589	425,130.43	0.21
147	600850	电科数字	19,500	424,125.00	0.21
148	301325	曼恩斯特	5,456	423,058.24	0.21
149	688502	茂莱光学	1,915	415,535.85	0.21
150	301360	荣旗科技	4,437	415,303.20	0.21
151	600820	隧道股份	70,300	404,928.00	0.20
152	301529	福赛科技	9,895	394,128.60	0.20
153	600201	生物股份	36,500	393,105.00	0.20
154	300479	神思电子	19,900	391,632.00	0.20
155	688041	海光信息	5,484	389,254.32	0.20
156	001270	铖昌科技	6,200	388,802.00	0.20
157	688197	首药控股-U	6,837	377,334.03	0.19
158	002709	天赐材料	15,000	376,200.00	0.19
159	300327	中颖电子	16,100	367,080.00	0.19
160	300310	宜通世纪	81,900	361,998.00	0.18
161	603170	宝立食品	21,000	355,110.00	0.18
162	002446	盛路通信	42,100	349,430.00	0.18
163	300342	天银机电	22,600	347,362.00	0.18
164	300280	紫天科技	8,100	346,113.00	0.17
165	600707	彩虹股份	50,000	337,500.00	0.17
166	300760	迈瑞医疗	1,150	334,190.00	0.17
167	603378	亚士创能	37,400	316,404.00	0.16
168	300766	每日互动	20,200	311,686.00	0.16
169	300570	太辰光	7,800	304,590.00	0.15
170	688025	杰普特	3,200	296,160.00	0.15
171	002530	金财互联	33,600	292,656.00	0.15
172	600859	王府井	17,400	277,878.00	0.14
173	300677	英科医疗	11,800	275,648.00	0.14
174	601678	滨化股份	65,200	274,492.00	0.14
175	002234	民和股份	22,400	271,040.00	0.14
176	300679	电连技术	6,400	265,600.00	0.13
177	603296	华勤技术	3,271	261,174.67	0.13
178	600801	华新水泥	20,800	258,544.00	0.13
179	603629	利通电子	8,200	257,972.00	0.13
180	688235	百济神州-U	1,840	255,833.60	0.13
181	002635	安洁科技	15,000	244,950.00	0.12

182	688498	源杰科技	1,560	232,408.80	0.12
183	300374	中铁装配	18,900	231,147.00	0.12
184	688489	三未信安	4,843	227,717.86	0.11
185	002657	中科金财	12,200	222,284.00	0.11
186	688719	爱科赛博	3,333	213,789.82	0.11
187	688116	天奈科技	7,346	213,327.84	0.11
188	603918	金桥信息	11,400	213,180.00	0.11
189	300304	云意电气	31,200	211,848.00	0.11
190	301312	智立方	1,900	205,846.00	0.10
191	300499	高澜股份	14,300	205,062.00	0.10
192	300213	佳讯飞鸿	28,200	203,040.00	0.10
193	688347	华虹公司	4,791	201,509.46	0.10
194	688981	中芯国际	3,789	200,892.78	0.10
195	600415	小商品城	27,400	200,568.00	0.10
196	301525	儒竞科技	2,375	200,291.54	0.10
197	300750	宁德时代	1,200	195,912.00	0.10
198	601975	招商南油	69,000	193,200.00	0.10
199	300496	中科创达	2,400	192,144.00	0.10
200	603801	志邦家居	11,400	191,178.00	0.10
201	603267	鸿远电子	3,800	190,760.00	0.10
202	301310	鑫宏业	3,900	189,735.00	0.10
203	605090	九丰能源	6,700	187,131.00	0.09
204	002150	通润装备	10,200	180,948.00	0.09
205	688233	神工股份	4,957	174,932.53	0.09
206	002821	凯莱英	1,500	174,150.00	0.09
207	002858	力盛体育	9,100	172,900.00	0.09
208	301085	亚康股份	3,000	172,230.00	0.09
209	688358	祥生医疗	4,546	171,747.88	0.09
210	000818	航锦科技	5,300	166,314.00	0.08
211	688603	天承科技	1,966	147,337.60	0.07
212	301205	联特科技	1,400	146,650.00	0.07
213	000600	建投能源	28,900	144,789.00	0.07
214	301526	国际复材	21,901	118,746.25	0.06
215	301566	达利凯普	3,999	113,191.01	0.06
216	601136	首创证券	6,600	111,936.00	0.06
217	688112	鼎阳科技	2,752	110,190.08	0.06
218	603306	华懋科技	3,600	97,596.00	0.05
219	688029	南微医学	965	93,412.00	0.05
220	600563	法拉电子	1,000	92,600.00	0.05
221	000301	东方盛虹	9,500	91,200.00	0.05
222	002756	永兴材料	1,740	90,845.40	0.05
223	603713	密尔克卫	1,700	90,457.00	0.05
224	688352	颀中科技	5,823	89,732.43	0.05

225	300192	科德教育	8,300	81,921.00	0.04
226	688548	广钢气体	6,057	78,920.28	0.04
227	688593	新相微	5,183	76,293.76	0.04
228	688687	凯因科技	2,182	76,064.52	0.04
229	688549	中巨芯-U	8,801	73,496.89	0.04
230	301508	中机认检	2,148	72,250.73	0.04
231	688146	中船特气	2,107	71,659.07	0.04
232	688531	日联科技	692	69,947.36	0.04
233	688201	信安世纪	3,445	67,797.60	0.03
234	688563	航材股份	1,109	67,791.99	0.03
235	301315	威士顿	1,265	66,867.90	0.03
236	688543	国科军工	1,194	66,744.60	0.03
237	301281	科源制药	1,946	66,241.84	0.03
238	688322	奥比中光-UW	1,761	66,178.38	0.03
239	601456	国联证券	6,000	65,040.00	0.03
240	301388	欣灵电气	2,645	64,511.55	0.03
241	603979	金诚信	1,700	64,192.00	0.03
242	301160	翔楼新材	1,500	63,345.00	0.03
243	688570	天玛智控	2,267	61,685.07	0.03
244	301292	海科新源	3,145	61,280.25	0.03
245	688653	康希通信	3,121	61,221.03	0.03
246	301290	东星医疗	2,194	60,532.46	0.03
247	301373	凌玮科技	2,039	60,456.35	0.03
248	688334	西高院	3,477	60,256.41	0.03
249	301555	惠柏新材	1,469	60,200.14	0.03
250	688271	联影医疗	438	60,010.38	0.03
251	301528	多浦乐	821	59,955.15	0.03
252	301295	美硕科技	1,802	59,808.38	0.03
253	301399	英特科技	1,562	59,777.74	0.03
254	301291	明阳电气	2,101	59,584.36	0.03
255	301262	海看股份	1,890	58,873.50	0.03
256	603103	横店影视	3,300	58,674.00	0.03
257	603259	药明康德	800	58,208.00	0.03
258	603598	引力传媒	2,800	57,904.00	0.03
259	688772	珠海冠宇	2,618	57,622.18	0.03
260	601139	深圳燃气	8,200	56,498.00	0.03
261	301386	未来电器	2,197	55,869.71	0.03
262	301578	辰奕智能	723	55,167.36	0.03
263	601360	三六零	6,100	54,961.00	0.03
264	688433	华曙高科	1,758	54,937.50	0.03
265	601658	邮储银行	12,500	54,375.00	0.03
266	600699	均胜电子	3,000	53,880.00	0.03
267	600489	中金黄金	5,400	53,784.00	0.03

268	688581	安杰思	430	53,668.30	0.03
269	688121	卓然股份	2,649	53,589.27	0.03
270	600765	中航重机	2,800	53,508.00	0.03
271	603108	润达医疗	2,600	52,910.00	0.03
272	301283	聚胶股份	1,609	52,903.92	0.03
273	301568	思泰克	1,184	52,819.32	0.03
274	301276	嘉曼服饰	2,156	52,563.28	0.03
275	688648	中邮科技	2,007	51,859.41	0.03
276	688403	汇成股份	4,908	51,779.40	0.03
277	601061	中信金属	6,654	51,302.34	0.03
278	603029	天鹅股份	2,500	51,000.00	0.03
279	600760	中航沈飞	1,200	50,616.00	0.03
280	301355	南王科技	3,298	49,964.70	0.03
281	301202	朗威股份	1,543	49,525.44	0.02
282	301332	德尔玛	4,047	49,454.34	0.02
283	600925	苏能股份	8,960	49,369.60	0.02
284	301505	苏州规划	1,354	49,205.36	0.02
285	688716	中研股份	1,253	49,101.64	0.02
286	688609	九联科技	3,702	48,866.40	0.02
287	603722	阿科力	900	48,510.00	0.02
288	600436	片仔癀	200	48,398.00	0.02
289	301251	威尔高	1,346	48,084.00	0.02
290	301265	华新环保	4,680	47,970.00	0.02
291	600879	航天电子	6,200	47,802.00	0.02
292	603901	永创智能	4,000	47,600.00	0.02
293	301511	德福科技	2,056	47,571.52	0.02
294	600373	中文传媒	3,600	47,448.00	0.02
295	688511	天微电子	1,490	46,890.30	0.02
296	301393	昊帆生物	779	46,697.87	0.02
297	301323	新莱福	1,252	46,311.48	0.02
298	301519	舜禹股份	2,239	46,116.64	0.02
299	600459	贵研铂业	3,200	45,952.00	0.02
300	688159	有方科技	1,204	45,330.60	0.02
301	688085	三友医疗	2,324	45,318.00	0.02
302	600258	首旅酒店	2,900	45,298.00	0.02
303	301049	超越科技	1,954	45,254.64	0.02
304	301337	亚华电子	1,477	45,210.97	0.02
305	301329	信音电子	1,961	44,422.11	0.02
306	603893	瑞芯微	700	44,380.00	0.02
307	301520	万邦医药	798	43,924.60	0.02
308	688602	康鹏科技	3,906	43,797.91	0.02
309	301068	大地海洋	1,436	43,654.40	0.02
310	301157	华塑科技	1,019	43,613.20	0.02

311	301518	长华化学	1,855	43,334.46	0.02
312	301053	远信工业	1,544	43,015.84	0.02
313	301439	泓淋电力	2,940	42,982.80	0.02
314	600977	中国电影	3,500	42,840.00	0.02
315	301309	万得凯	1,505	42,064.75	0.02
316	688646	逸飞激光	1,146	41,923.89	0.02
317	603208	江山欧派	1,410	41,862.90	0.02
318	600297	广汇汽车	24,200	41,624.00	0.02
319	601728	中国电信	7,600	41,116.00	0.02
320	688285	高铁电气	4,606	40,901.28	0.02
321	301456	盘古智能	1,329	40,878.67	0.02
322	600975	新五丰	3,900	40,755.00	0.02
323	688114	华大智造	473	40,687.46	0.02
324	600895	张江高科	2,100	40,530.00	0.02
325	688429	时创能源	1,860	39,413.40	0.02
326	601138	工业富联	2,600	39,312.00	0.02
327	603301	振德医疗	1,600	39,200.00	0.02
328	605189	富春染织	2,400	38,880.00	0.02
329	301322	绿通科技	943	38,813.88	0.02
330	688630	芯碁微装	452	38,587.24	0.02
331	688639	华恒生物	306	38,525.40	0.02
332	688638	誉辰智能	637	38,291.20	0.02
333	688052	纳芯微	229	38,208.65	0.02
334	601088	中国神华	1,200	37,620.00	0.02
335	603004	鼎龙科技	1,039	36,903.76	0.02
336	688338	赛科希德	1,097	36,859.20	0.02
337	300059	东方财富	2,600	36,504.00	0.02
338	688331	荣昌生物	587	36,429.22	0.02
339	603135	中重科技	2,216	36,253.76	0.02
340	603885	吉祥航空	3,000	36,000.00	0.02
341	301371	敷尔佳	939	35,819.97	0.02
342	688023	安恒信息	321	35,595.69	0.02
343	688166	博瑞医药	1,017	35,595.00	0.02
344	301487	盟固利	867	35,512.32	0.02
345	300854	中兰环保	2,026	35,353.70	0.02
346	688657	浩辰软件	428	35,095.59	0.02
347	600050	中国联通	7,900	34,602.00	0.02
348	301559	中集环科	1,840	34,588.32	0.02
349	001378	德冠新材	908	34,569.68	0.02
350	603600	永艺股份	3,100	34,224.00	0.02
351	600475	华光环能	3,200	33,280.00	0.02
352	600021	上海电力	3,900	32,994.00	0.02
353	688032	禾迈股份	122	32,940.00	0.02

354	688257	新锐股份	1,314	32,902.56	0.02
355	688479	友车科技	1,410	32,881.20	0.02
356	301500	飞南资源	1,516	32,733.16	0.02
357	601600	中国铝业	5,800	32,712.00	0.02
358	301515	港通医疗	1,133	32,386.56	0.02
359	001286	陕西能源	3,767	32,207.85	0.02
360	688612	威迈斯	829	32,206.25	0.02
361	688139	海尔生物	792	32,091.84	0.02
362	300181	佐力药业	3,000	31,980.00	0.02
363	301548	崇德科技	524	31,899.86	0.02
364	688296	和达科技	1,760	31,627.20	0.02
365	688472	阿特斯	2,503	31,612.89	0.02
366	603730	岱美股份	2,175	31,515.75	0.02
367	601555	东吴证券	4,300	31,433.00	0.02
368	688401	路维光电	1,016	31,211.52	0.02
369	688190	云路股份	435	31,159.05	0.02
370	688300	联瑞新材	587	31,081.65	0.02
371	688308	欧科亿	1,114	31,080.60	0.02
372	001239	永达股份	1,321	30,959.40	0.02
373	600019	宝钢股份	5,200	30,836.00	0.02
374	603380	易德龙	1,200	30,732.00	0.02
375	688038	中科通达	2,132	30,722.12	0.02
376	688232	新点软件	848	30,697.60	0.02
377	688522	纳睿雷达	553	30,685.97	0.02
378	688323	瑞华泰	1,428	30,659.16	0.02
379	688776	国光电气	314	30,580.46	0.02
380	601377	兴业证券	5,200	30,524.00	0.02
381	600955	维远股份	1,694	30,407.30	0.02
382	605289	罗曼股份	525	30,187.50	0.02
383	601089	福元医药	1,749	30,152.76	0.02
384	601000	唐山港	8,600	30,100.00	0.02
385	603416	信捷电气	800	30,048.00	0.02
386	688550	瑞联新材	756	29,998.08	0.02
387	688208	道通科技	1,249	29,663.75	0.01
388	688625	呈和科技	753	29,532.66	0.01
389	600988	赤峰黄金	2,100	29,421.00	0.01
390	603373	安邦护卫	690	29,131.80	0.01
391	688249	晶合集成	1,683	29,031.75	0.01
392	600570	恒生电子	1,000	28,760.00	0.01
393	601128	常熟银行	4,500	28,755.00	0.01
394	688652	京仪装备	492	28,651.00	0.01
395	688110	东芯股份	826	28,439.18	0.01
396	603035	常熟汽饰	1,500	28,305.00	0.01

397	603097	江苏华辰	1,177	28,236.23	0.01
398	603197	保隆科技	500	28,200.00	0.01
399	002493	荣盛石化	2,700	27,945.00	0.01
400	601083	锦江航运	2,252	27,806.56	0.01
401	688628	优利德	705	27,777.00	0.01
402	603986	兆易创新	300	27,717.00	0.01
403	600536	中国软件	760	27,557.60	0.01
404	603137	恒尚节能	1,382	27,114.84	0.01
405	688036	传音控股	195	26,988.00	0.01
406	688582	芯动联科	695	26,875.65	0.01
407	001326	联域股份	493	26,854.59	0.01
408	301239	普瑞眼科	312	26,832.00	0.01
409	688439	振华风光	300	26,733.00	0.01
410	601865	福莱特	1,000	26,700.00	0.01
411	000822	山东海化	3,900	26,676.00	0.01
412	603650	彤程新材	800	26,640.00	0.01
413	600984	建设机械	7,100	26,625.00	0.01
414	600602	云赛智联	2,300	26,611.00	0.01
415	688111	金山办公	84	26,560.80	0.01
416	688450	光格科技	720	26,520.48	0.01
417	601799	星宇股份	200	26,222.00	0.01
418	001282	三联锻造	719	26,006.23	0.01
419	603739	蔚蓝生物	1,700	25,874.00	0.01
420	300457	赢合科技	1,400	25,816.00	0.01
421	001258	立新能源	3,188	25,759.04	0.01
422	001330	博纳影业	3,564	25,660.80	0.01
423	600141	兴发集团	1,400	25,550.00	0.01
424	688315	诺禾致源	1,088	25,393.92	0.01
425	688702	盛科通信-U	502	25,338.68	0.01
426	601133	柏诚股份	1,916	25,233.72	0.01
427	002790	瑞尔特	2,400	25,056.00	0.01
428	688651	盛邦安全	533	24,967.84	0.01
429	601065	江盐集团	2,172	24,847.68	0.01
430	603211	晋拓股份	1,287	24,761.88	0.01
431	603071	物产环能	1,627	24,730.40	0.01
432	001306	夏厦精密	277	24,681.93	0.01
433	688551	科威尔	430	24,553.00	0.01
434	688071	华依科技	503	24,501.13	0.01
435	001213	中铁特货	5,818	24,435.60	0.01
436	603032	德新科技	1,200	24,360.00	0.01
437	601965	中国汽研	1,100	24,266.00	0.01
438	001308	康冠科技	867	24,258.66	0.01
439	603270	金帝股份	790	24,164.52	0.01

440	600754	锦江酒店	800	23,920.00	0.01
441	600301	华锡有色	1,900	23,902.00	0.01
442	688301	奕瑞科技	73	23,743.98	0.01
443	000917	电广传媒	4,300	23,564.00	0.01
444	688131	皓元医药	452	23,531.12	0.01
445	301101	明月镜片	557	23,316.02	0.01
446	603119	浙江荣泰	957	23,127.72	0.01
447	603107	上海汽配	1,016	23,115.02	0.01
448	688507	索辰科技	169	23,110.75	0.01
449	301286	侨源股份	793	23,044.58	0.01
450	001358	兴欣新材	477	22,711.68	0.01
451	002334	英威腾	2,600	22,698.00	0.01
452	688536	思瑞浦	155	22,676.50	0.01
453	002871	伟隆股份	2,000	22,360.00	0.01
454	601689	拓普集团	300	22,050.00	0.01
455	002179	中航光电	565	22,035.00	0.01
456	688088	虹软科技	536	21,997.44	0.01
457	001337	四川黄金	795	21,965.85	0.01
458	688031	星环科技-U	337	21,928.59	0.01
459	601155	新城控股	1,900	21,679.00	0.01
460	603276	恒兴新材	828	21,673.44	0.01
461	601668	中国建筑	4,500	21,645.00	0.01
462	603206	嘉环科技	1,210	21,550.10	0.01
463	603172	万丰股份	1,220	21,508.60	0.01
464	603125	常青科技	713	21,404.26	0.01
465	688488	艾迪药业	1,697	21,229.47	0.01
466	000516	国际医学	2,600	21,086.00	0.01
467	600690	海尔智家	1,000	21,000.00	0.01
468	605377	华旺科技	1,100	20,999.00	0.01
469	300723	一品红	700	20,881.00	0.01
470	605598	上海港湾	774	20,712.24	0.01
471	605088	冠盛股份	900	20,700.00	0.01
472	001227	兰州银行	7,868	20,456.80	0.01
473	600585	海螺水泥	900	20,304.00	0.01
474	688601	力芯微	381	19,960.59	0.01
475	001338	永顺泰	1,649	19,886.94	0.01
476	603799	华友钴业	600	19,758.00	0.01
477	600446	金证股份	1,700	19,669.00	0.01
478	688518	联赢激光	955	19,558.40	0.01
479	603193	润本股份	1,083	19,523.26	0.01
480	603348	文灿股份	500	19,400.00	0.01
481	301095	广立微	255	19,056.15	0.01
482	600456	宝钛股份	600	18,834.00	0.01

483	688006	杭可科技	796	18,690.08	0.01
484	688409	富创精密	235	18,402.85	0.01
485	603132	金徽股份	1,342	18,358.56	0.01
486	301120	新特电气	1,548	17,941.32	0.01
487	002387	维信诺	1,600	17,936.00	0.01
488	001376	百通能源	804	17,897.04	0.01
489	688579	山大地纬	1,409	17,894.30	0.01
490	601121	宝地矿业	2,532	17,875.92	0.01
491	603191	望变电气	1,149	17,843.97	0.01
492	688227	品高股份	925	17,639.75	0.01
493	688478	晶升股份	339	17,628.00	0.01
494	603062	麦加芯彩	283	17,536.25	0.01
495	601020	华钰矿业	1,700	17,510.00	0.01
496	001217	华尔泰	1,239	17,494.68	0.01
497	688535	华海诚科	188	17,442.64	0.01
498	688048	长光华芯	278	17,422.26	0.01
499	001367	海森药业	395	17,364.20	0.01
500	301029	怡合达	665	17,143.70	0.01
501	600963	岳阳林纸	2,900	17,081.00	0.01
502	688191	智洋创新	919	17,001.50	0.01
503	001318	阳光乳业	1,142	16,947.28	0.01
504	603075	热威股份	699	16,897.53	0.01
505	301301	川宁生物	2,011	16,892.40	0.01
506	301327	华宝新能	217	16,578.80	0.01
507	301050	雷电微力	283	16,487.58	0.01
508	001319	铭科精技	636	16,262.52	0.01
509	688682	霍莱沃	337	16,078.27	0.01
510	300623	捷捷微电	1,000	15,870.00	0.01
511	301348	蓝箭电子	355	15,822.35	0.01
512	688591	泰凌微	551	15,775.02	0.01
513	301238	瑞泰新材	896	15,706.88	0.01
514	603153	上海建科	740	15,636.20	0.01
515	688680	海优新材	238	15,624.70	0.01
516	301311	昆船智能	640	15,552.00	0.01
517	001300	三柏硕	763	15,473.64	0.01
518	301175	中科环保	3,005	14,994.95	0.01
519	688238	和元生物	1,656	14,887.44	0.01
520	603383	顶点软件	300	14,790.00	0.01
521	688707	振华新材	716	14,678.00	0.01
522	605599	菜百股份	980	14,592.20	0.01
523	300752	隆利科技	800	14,536.00	0.01
524	688359	三孚新科	211	14,535.79	0.01
525	300941	创识科技	599	14,531.74	0.01

526	301272	英华特	268	14,466.58	0.01
527	688173	希荻微	821	14,441.39	0.01
528	301499	维科精密	494	14,413.34	0.01
529	688053	思科瑞	280	13,983.20	0.01
530	600547	山东黄金	600	13,722.00	0.01
531	605577	龙版传媒	588	13,718.04	0.01
532	603162	海通发展	774	13,715.28	0.01
533	688152	麒麟信安	195	13,663.65	0.01
534	688150	莱特光电	630	13,601.70	0.01
535	603209	兴通股份	833	13,569.57	0.01
536	603237	五芳斋	455	13,331.50	0.01
537	603040	新坐标	500	13,075.00	0.01
538	301328	维峰电子	264	12,925.44	0.01
539	301293	三博脑科	203	12,671.26	0.01
540	301141	中科磁业	271	12,612.34	0.01
541	688045	必易微	293	12,549.19	0.01
542	688435	英方软件	261	12,533.22	0.01
543	300982	苏文电能	380	12,479.20	0.01
544	301127	天源环保	1,135	12,473.65	0.01
545	603486	科沃斯	300	12,432.00	0.01
546	688629	华丰科技	565	12,373.50	0.01
547	001229	魅视科技	347	12,353.20	0.01
548	001278	一彬科技	473	12,260.16	0.01
549	301268	铭利达	406	12,110.98	0.01
550	301187	欧圣电气	606	12,065.46	0.01
551	688408	中信博	168	12,054.00	0.01
552	301510	固高科技	342	11,999.88	0.01
553	605333	沪光股份	600	11,940.00	0.01
554	301135	瑞德智能	480	11,913.60	0.01
555	603176	汇通集团	1,924	11,890.32	0.01
556	603057	紫燕食品	549	11,847.42	0.01
557	603305	旭升集团	600	11,838.00	0.01
558	603282	亚光股份	457	11,808.88	0.01
559	688443	智翔金泰-U	295	11,785.25	0.01
560	688608	恒玄科技	76	11,724.52	0.01
561	300904	威力传动	188	11,567.64	0.01
562	301222	浙江恒威	386	11,475.78	0.01
563	688351	微电生理-U	435	11,157.75	0.01
564	605566	福莱茵特	435	10,962.00	0.01
565	301298	东利机械	640	10,880.00	0.01
566	301317	鑫磊股份	545	10,714.70	0.01
567	001317	三羊马	300	10,695.00	0.01
568	605580	恒盛能源	916	10,643.92	0.01

569	001366	播恩集团	645	10,623.15	0.01
570	001313	粤海饲料	1,232	10,619.84	0.01
571	001219	青岛食品	460	10,603.00	0.01
572	301320	豪江智能	569	10,509.43	0.01
573	301259	艾布鲁	628	10,380.84	0.01
574	601595	上海电影	400	10,332.00	0.01
575	001268	联合精密	409	10,225.00	0.01
576	603220	中贝通信	300	10,188.00	0.01
577	001266	宏英智能	346	10,137.80	0.01
578	688573	信宇人	346	10,062.80	0.01
579	603219	富佳股份	739	10,020.84	0.01
580	688320	禾川科技	241	9,881.00	0.00
581	301163	宏德股份	364	9,864.40	0.00
582	301288	清研环境	516	9,793.68	0.00
583	301217	铜冠铜箔	824	9,772.64	0.00
584	301132	满坤科技	339	9,732.69	0.00
585	300045	华力创通	400	9,732.00	0.00
586	301300	远翔新材	307	9,710.41	0.00
587	603280	南方路机	363	9,706.62	0.00
588	000875	吉电股份	2,200	9,680.00	0.00
589	301200	大族数控	256	9,669.12	0.00
590	001296	长江材料	403	9,482.59	0.00
591	002918	蒙娜丽莎	700	9,478.00	0.00
592	001331	胜通能源	539	9,410.94	0.00
593	301516	中远通	569	9,349.59	0.00
594	300981	中红医疗	582	9,323.64	0.00
595	301367	怡和嘉业	76	9,253.00	0.00
596	301285	鸿日达	578	9,236.44	0.00
597	301358	湖南裕能	271	9,200.45	0.00
598	300996	普联软件	400	9,160.00	0.00
599	300394	天孚通信	100	9,152.00	0.00
600	688290	景业智能	191	9,124.07	0.00
601	001299	美能能源	576	8,945.28	0.00
602	300962	中金辐照	576	8,939.52	0.00
603	001222	源飞宠物	608	8,937.60	0.00
604	688562	航天软件	372	8,928.00	0.00
605	301048	金鹰重工	843	8,885.22	0.00
606	300866	安克创新	100	8,860.00	0.00
607	001368	通达创智	351	8,806.59	0.00
608	001230	劲旅环境	375	8,797.50	0.00
609	601916	浙商银行	3,470	8,744.40	0.00
610	301172	君逸数码	229	8,738.64	0.00
611	301359	东南电子	328	8,728.08	0.00

612	301421	波长光电	147	8,727.39	0.00
613	688281	华秦科技	64	8,682.24	0.00
614	301228	实朴检测	521	8,638.18	0.00
615	603213	镇洋发展	799	8,621.21	0.00
616	301116	益客食品	664	8,512.48	0.00
617	301199	迈赫股份	322	8,452.50	0.00
618	301381	赛维时代	282	8,372.58	0.00
619	301270	汉仪股份	210	8,347.50	0.00
620	301316	慧博云通	359	8,343.16	0.00
621	301370	国科恒泰	519	8,309.19	0.00
622	301273	瑞晨环保	300	8,277.00	0.00
623	301138	华研精机	285	8,265.00	0.00
624	301151	冠龙节能	399	8,167.53	0.00
625	300693	盛弘股份	273	8,165.43	0.00
626	001234	泰慕士	333	8,145.18	0.00
627	300978	东箭科技	593	8,141.89	0.00
628	603291	联合水务	536	8,141.84	0.00
629	301152	天力锂能	222	8,120.76	0.00
630	301517	陕西华达	166	8,095.03	0.00
631	301318	维海德	228	8,073.48	0.00
632	603065	宿迁联盛	581	8,006.18	0.00
633	603231	索宝蛋白	344	7,961.53	0.00
634	002843	泰嘉股份	300	7,950.00	0.00
635	301179	泽宇智能	306	7,940.70	0.00
636	605567	春雪食品	629	7,931.69	0.00
637	301193	家联科技	461	7,827.78	0.00
638	301190	善水科技	410	7,777.70	0.00
639	001314	亿道信息	108	7,768.44	0.00
640	605069	正和生态	790	7,757.80	0.00
641	002460	赣锋锂业	180	7,704.00	0.00
642	300073	当升科技	200	7,640.00	0.00
643	688667	菱电电控	93	7,629.72	0.00
644	605033	美邦股份	423	7,592.85	0.00
645	301197	工大科雅	401	7,534.79	0.00
646	301558	三态股份	561	7,517.40	0.00
647	688523	航天环宇	280	7,509.60	0.00
648	601028	玉龙股份	700	7,497.00	0.00
649	603272	联翔股份	443	7,477.84	0.00
650	300952	恒辉安防	340	7,405.20	0.00
651	603150	万朗磁塑	250	7,262.50	0.00
652	300967	晓鸣股份	507	7,239.96	0.00
653	301382	蜂助手	203	7,230.86	0.00
654	688580	伟思医疗	113	7,224.09	0.00

655	301428	世纪恒通	184	7,111.60	0.00
656	002833	弘亚数控	400	7,096.00	0.00
657	301231	荣信文化	275	6,998.75	0.00
658	600406	国电南瑞	312	6,963.84	0.00
659	300987	川网传媒	391	6,928.52	0.00
660	301166	优宁维	179	6,877.18	0.00
661	301182	凯旺科技	294	6,873.72	0.00
662	301282	金禄电子	274	6,847.26	0.00
663	002049	紫光国微	100	6,745.00	0.00
664	603363	傲农生物	1,100	6,677.00	0.00
665	301206	三元生物	228	6,584.64	0.00
666	301383	天键股份	100	6,500.00	0.00
667	688035	德邦科技	120	6,403.20	0.00
668	301158	德石股份	383	6,162.47	0.00
669	300975	商络电子	738	6,103.26	0.00
670	300971	博亚精工	245	6,100.50	0.00
671	301016	雷尔伟	275	6,066.50	0.00
672	688693	锆威特	138	6,031.38	0.00
673	301319	唯特偶	101	5,899.41	0.00
674	301413	安培龙	101	5,877.19	0.00
675	688400	凌云光	217	5,859.00	0.00
676	301486	致尚科技	123	5,811.75	0.00
677	301297	富乐德	215	5,796.40	0.00
678	301357	北方长龙	114	5,754.72	0.00
679	301062	上海艾录	523	5,658.86	0.00
680	605138	盛泰集团	723	5,603.25	0.00
681	301533	威马农机	167	5,537.72	0.00
682	301507	民生健康	349	5,531.65	0.00
683	002169	智光电气	800	5,504.00	0.00
684	300943	春晖智控	383	5,492.22	0.00
685	301261	恒工精密	108	5,491.80	0.00
686	301221	光庭信息	94	5,480.20	0.00
687	301098	金埔园林	461	5,444.41	0.00
688	301002	崧盛股份	261	5,413.14	0.00
689	688671	碧兴物联	156	5,350.80	0.00
690	300950	德固特	329	5,306.77	0.00
691	603087	甘李药业	100	5,265.00	0.00
692	688620	安凯微	442	5,224.44	0.00
693	300958	建工修复	300	5,217.00	0.00
694	301032	新柴股份	513	5,196.69	0.00
695	300339	润和软件	200	5,196.00	0.00
696	300960	通业科技	234	5,190.12	0.00
697	300942	易瑞生物	443	5,178.67	0.00

698	301267	华夏眼科	160	5,134.40	0.00
699	301007	德迈仕	303	5,123.73	0.00
700	002819	东方中科	200	5,122.00	0.00
701	601952	苏垦农发	500	5,120.00	0.00
702	688539	高华科技	115	5,037.00	0.00
703	301100	风光股份	248	5,029.44	0.00
704	605555	德昌股份	220	5,027.00	0.00
705	688119	中钢洛耐	1,015	4,953.20	0.00
706	301489	思泉新材	77	4,936.47	0.00
707	301115	建科股份	275	4,922.50	0.00
708	688316	青云科技-U	95	4,920.05	0.00
709	688248	南网科技	193	4,819.21	0.00
710	003038	鑫铂股份	140	4,809.00	0.00
711	688253	英诺特	192	4,801.92	0.00
712	301269	华大九天	45	4,763.25	0.00
713	300948	冠中生态	324	4,668.84	0.00
714	300998	宁波方正	201	4,639.08	0.00
715	688223	晶科能源	523	4,633.78	0.00
716	301418	协昌科技	92	4,618.40	0.00
717	301025	读客文化	403	4,574.05	0.00
718	301040	中环海陆	241	4,571.77	0.00
719	002101	广东鸿图	300	4,569.00	0.00
720	300774	倍杰特	444	4,568.76	0.00
721	301036	双乐股份	205	4,544.85	0.00
722	301376	致欧科技	189	4,520.88	0.00
723	300781	因赛集团	100	4,500.00	0.00
724	688237	超卓航科	119	4,495.82	0.00
725	301498	乖宝宠物	115	4,463.15	0.00
726	002400	省广集团	800	4,440.00	0.00
727	300961	深水海纳	394	4,424.62	0.00
728	688631	莱斯信息	124	4,371.00	0.00
729	603052	可川科技	100	4,358.00	0.00
730	002372	伟星新材	300	4,341.00	0.00
731	300992	泰福泵业	200	4,316.00	0.00
732	301550	斯菱股份	99	4,313.43	0.00
733	601096	宏盛华源	1,062	4,311.72	0.00
734	301037	保立佳	212	4,225.16	0.00
735	002929	润建股份	100	4,173.00	0.00
736	600508	上海能源	300	4,158.00	0.00
737	601012	隆基绿能	180	4,122.00	0.00
738	301459	丰茂股份	103	4,103.52	0.00
739	300995	奇德新材	191	4,062.57	0.00
740	688456	有研粉材	141	3,971.97	0.00

741	002041	登海种业	300	3,969.00	0.00
742	301349	信德新材	84	3,954.72	0.00
743	300979	华利集团	75	3,948.00	0.00
744	300855	图南股份	130	3,926.00	0.00
745	301306	西测测试	99	3,919.41	0.00
746	300604	长川科技	100	3,799.00	0.00
747	002414	高德红外	520	3,796.00	0.00
748	300031	宝通科技	200	3,708.00	0.00
749	002876	三利谱	100	3,677.00	0.00
750	300929	华骐环保	293	3,565.81	0.00
751	688148	芳源股份	457	3,505.19	0.00
752	300890	翔丰华	100	3,458.00	0.00
753	600025	华能水电	400	3,452.00	0.00
754	301170	锡南科技	113	3,438.59	0.00
755	002601	龙佰集团	200	3,426.00	0.00
756	688425	铁建重工	861	3,418.17	0.00
757	001311	多利科技	69	3,416.19	0.00
758	000977	浪潮信息	100	3,320.00	0.00
759	002472	双环传动	126	3,278.52	0.00
760	000651	格力电器	100	3,217.00	0.00
761	001269	欧晶科技	60	3,207.00	0.00
762	603666	亿嘉和	100	3,139.00	0.00
763	000932	华菱钢铁	600	3,090.00	0.00
764	301155	海力风电	52	3,075.80	0.00
765	688419	耐科装备	84	2,986.20	0.00
766	000920	沃顿科技	300	2,979.00	0.00
767	300596	利安隆	100	2,956.00	0.00
768	688171	纬德信息	131	2,947.50	0.00
769	300926	博俊科技	100	2,933.00	0.00
770	688247	宣泰医药	267	2,931.66	0.00
771	000915	华特达因	100	2,896.00	0.00
772	600223	福瑞达	300	2,889.00	0.00
773	300548	博创科技	100	2,697.00	0.00
774	300814	中富电路	80	2,696.00	0.00
775	688722	同益中	176	2,692.80	0.00
776	688231	隆达股份	120	2,641.20	0.00
777	300884	狄耐克	200	2,616.00	0.00
778	600522	中天科技	200	2,498.00	0.00
779	301046	能辉科技	90	2,440.80	0.00
780	688268	华特气体	36	2,425.68	0.00
781	688255	凯尔达	99	2,420.55	0.00
782	002997	瑞鹄模具	72	2,399.04	0.00
783	301021	英诺激光	90	2,367.90	0.00

784	688353	华盛锂电	86	2,356.40	0.00
785	300611	美力科技	200	2,298.00	0.00
786	001324	长青科技	94	2,281.38	0.00
787	603273	天元智能	120	2,276.40	0.00
788	301220	亚香股份	68	2,247.40	0.00
789	301015	百洋医药	62	2,223.32	0.00
790	002605	姚记科技	100	2,222.00	0.00
791	001336	楚环科技	74	2,125.28	0.00
792	688718	唯赛勃	142	2,121.48	0.00
793	688141	杰华特	75	2,074.50	0.00
794	002345	潮宏基	300	2,043.00	0.00
795	000921	海信家电	100	2,040.00	0.00
796	000938	紫光股份	100	1,935.00	0.00
797	301219	腾远钴业	47	1,850.39	0.00
798	300252	金信诺	200	1,846.00	0.00
799	300845	捷安高科	100	1,807.00	0.00
800	603130	云中马	80	1,724.00	0.00
801	601991	大唐发电	700	1,694.00	0.00
802	300229	拓尔思	100	1,686.00	0.00
803	301133	金钟股份	60	1,654.20	0.00
804	600096	云天化	100	1,560.00	0.00
805	000948	南天信息	100	1,507.00	0.00
806	301377	鼎泰高科	62	1,466.30	0.00
807	600746	江苏索普	200	1,464.00	0.00
808	000960	锡业股份	100	1,432.00	0.00
809	301091	深城交	59	1,354.05	0.00
810	300986	志特新材	105	1,336.65	0.00
811	301150	中一科技	38	1,263.88	0.00
812	603233	大参林	48	1,195.20	0.00
813	603048	浙江黎明	64	1,188.48	0.00
814	001231	农心科技	55	1,145.65	0.00
815	301180	万祥科技	54	976.86	0.00
816	301136	招标股份	72	910.80	0.00
817	301277	新天地	43	894.83	0.00
818	000690	宝新能源	200	886.00	0.00
819	301052	果麦文化	20	875.60	0.00
820	002037	保利联合	100	861.00	0.00
821	301069	凯盛新材	39	835.38	0.00
822	002753	永东股份	100	825.00	0.00
823	301126	达嘉维康	62	807.86	0.00
824	301012	扬电科技	38	767.60	0.00
825	300968	格林精密	62	748.96	0.00
826	300253	卫宁健康	100	719.00	0.00

827	000785	居然之家	200	660.00	0.00
828	000589	贵州轮胎	100	612.00	0.00
829	600409	三友化工	100	549.00	0.00
830	002340	格林美	100	546.00	0.00
831	300614	百川畅银	29	543.17	0.00
832	300993	玉马遮阳	49	538.02	0.00
833	301020	密封科技	21	456.33	0.00
834	301078	孩子王	51	418.71	0.00
835	300997	欢乐家	28	391.16	0.00
836	301118	恒光股份	15	366.45	0.00
837	300994	久祺股份	24	352.80	0.00
838	600376	首开股份	100	304.00	0.00
839	002837	英维克	10	274.80	0.00
840	002724	海洋王	20	164.40	0.00
841	000733	振华科技	1	58.84	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 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	601633	长城汽车	11,299,001.00	4.47
2	301039	中集车辆	11,123,069.02	4.40
3	688008	澜起科技	8,062,717.73	3.19
4	301191	菲菱科思	8,031,994.12	3.18
5	603997	继峰股份	7,771,337.50	3.08
6	002430	杭氧股份	6,908,148.52	2.74
7	300858	科拓生物	6,839,307.50	2.71
8	688006	杭可科技	6,506,494.27	2.58
9	688279	峰昭科技	6,390,013.93	2.53
10	600418	江淮汽车	6,231,061.00	2.47
11	688031	星环科技-U	6,039,128.89	2.39
12	688256	寒武纪-U	5,963,185.72	2.36
13	601636	旗滨集团	5,948,610.00	2.36
14	600845	宝信软件	5,837,780.00	2.31
15	603501	韦尔股份	5,785,529.00	2.29
16	300661	圣邦股份	5,509,591.52	2.18
17	002920	德赛西威	5,473,265.37	2.17
18	002517	恺英网络	5,432,758.00	2.15
19	688608	恒玄科技	5,296,425.82	2.10
20	301220	亚香股份	5,222,715.34	2.07
21	000063	中兴通讯	5,208,344.00	2.06
22	002756	永兴材料	5,163,019.40	2.04
23	002555	三七互娱	5,153,246.00	2.04

24	001270	铖昌科技	5,127,604.60	2.03
25	603000	人民网	5,099,737.00	2.02

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。

#### 8.4.2 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	13,920,058.55	5.51
2	301039	中集车辆	12,982,247.30	5.14
3	688279	峰昭科技	11,842,533.09	4.69
4	002371	北方华创	10,133,194.88	4.01
5	601633	长城汽车	9,127,786.00	3.61
6	002459	晶澳科技	8,658,329.86	3.43
7	301191	菲菱科思	7,828,082.20	3.10
8	002648	卫星化学	7,670,012.46	3.04
9	603997	继峰股份	7,555,134.00	2.99
10	300858	科拓生物	7,455,349.84	2.95
11	688617	惠泰医疗	7,451,131.59	2.95
12	688008	澜起科技	7,271,988.41	2.88
13	002738	中矿资源	7,220,030.00	2.86
14	002756	永兴材料	7,213,722.98	2.86
15	603348	文灿股份	7,164,762.29	2.84
16	002430	杭氧股份	6,972,434.44	2.76
17	300498	温氏股份	6,680,699.00	2.65
18	002493	荣盛石化	6,665,825.00	2.64
19	300014	亿纬锂能	6,511,408.00	2.58
20	688235	百济神州-U	6,498,571.80	2.57
21	688031	星环科技-U	6,291,701.61	2.49
22	688006	杭可科技	6,102,480.93	2.42
23	000988	华工科技	6,087,332.69	2.41
24	600845	宝信软件	6,037,609.40	2.39
25	688256	寒武纪-U	5,579,820.52	2.21
26	603596	伯特利	5,447,722.00	2.16
27	603032	德新科技	5,322,190.00	2.11
28	688608	恒玄科技	5,319,292.33	2.11
29	603220	中贝通信	5,177,212.11	2.05

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。

#### 8.4.3 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	1,148,793,338.03
卖出股票收入（成交）总额	1,178,113,892.93

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。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：无。

#### 8.6 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。

#### 8.7 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。

#### 8.8 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。

#### 8.9 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。

#### 8.10 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。

#### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 8.11.1 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。

##### 8.11.2 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。

#### 8.12 投资组合报告附注

##### 8.12.1 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

大秦铁路股份有限公司在报告编制日前一年内受到西安铁路监督管理局的处罚。

以上证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

##### 8.12.2 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。

##### 8.12.3 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	72,119.52
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-

5	应收申购款	49,863.19
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	121,982.71

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

#### 8.12.6 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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 (%)
6,883	10,671.85	8,907,956.39	12.13	64,546,383.77	87.87

### 9.2 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	60,340.09	0.0821

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。

### 9.3 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、基金投资和研究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、基金投资和研究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。

#### 9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

注：无。

### § 10 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	6,673,245.98
减：本报告期基金总赎回份额	18,393,938.52
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	73,454,340.16

### § 11 重大事件揭示

#### 11.1 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。

#### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人的重大人事变动：

无。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门根据工作需要，任命牛环起、施伟为资产管理业务部副总经理。

#### 11.3 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。

#### 11.4 基金投资策略的改变

未改变

#### 11.5 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。本年度应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用 50,000.00 元，该审计机构已提供审计服务的年限为 12 年。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：无。

### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：根据我行审计报告，本行不存在涉嫌犯罪被依法立案调查的情况，本行的控股股东、实际控制人、董事、监事、高级管理人员不存在涉嫌犯罪被依法采取强制措施、涉嫌严重违纪违法或者职务犯罪被纪检监察机关采取留置措施且影响其履行职责的情况；本行或者本行的控股股东、实际控制人、董事、监事、高级管理人员不存在受到刑事处罚，涉嫌违法违规被中国证监会立案调查或者受到中国证监会行政处罚，或者受到其他有权机关重大行政处罚，或者被中国证监会采取行政监管措施和被证券交易所采取纪律处分的情况；本行董事、监事、高级管理人员不存在因涉嫌违法违规被其他有权机关采取强制措施且影响其履行职责的情况。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 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	1,150,547,051.49	49.64	1,061,763.98	49.63	-
天风证券	1	293,176,597.68	12.65	270,111.87	12.63	-
长江证券	1	196,474,102.44	8.48	181,004.84	8.46	-
中信证券	1	151,058,997.29	6.52	139,263.73	6.51	-
广发证券	1	129,048,233.38	5.57	119,574.27	5.59	-
国投证券	1	70,085,936.94	3.02	64,658.13	3.02	-
西部证券	1	68,143,531.65	2.94	62,976.89	2.94	-
华创证券	1	60,070,474.26	2.59	55,770.19	2.61	-
国信证券	1	48,107,509.76	2.08	44,672.41	2.09	-
中金公司	1	30,002,472.16	1.29	27,639.65	1.29	-

方正证券	1	29,062,036.92	1.25	27,200.74	1.27	-
银河证券	1	27,751,010.82	1.20	25,566.89	1.20	-
中信建投证券	1	25,156,924.94	1.09	23,175.25	1.08	-
兴业证券	1	20,276,644.97	0.87	18,776.41	0.88	-
招商证券	1	9,121,344.77	0.39	8,536.68	0.40	-
国泰君安	1	8,674,586.28	0.37	7,993.08	0.37	-
中金财富	1	807,474.00	0.03	755.75	0.04	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
东方财富证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	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	2	-	-	-	-	本报告期新增
湘财证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	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。

### 11.7.2 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	1.81	-	-
天风证券	-	-	63,477,000.00	15.99	-	-
长江证券	-	-	77,524,000.00	19.53	-	-
中信证券	-	-	53,388,000.00	13.45	-	-
广发证券	-	-	14,343,000.00	3.61	-	-
国投证券	-	-	33,028,000.00	8.32	-	-
西部证券	218,699.60	100.00	40,166,000.00	10.12	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	40,432,000.00	10.18	-	-
中金公司	-	-	16,668,000.00	4.20	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	39,957,000.00	10.07	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-

兴业证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	10,804,000.0 0	2.72	-	-
国泰君 安	-	-	-	-	-	-
中金财 富	-	-	-	-	-	-
长城证 券	-	-	-	-	-	-
东方财 富证券	-	-	-	-	-	-
东莞证 券	-	-	-	-	-	-
高华证 券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
中航证 券	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-

### 11.8 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
9	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
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 19 日
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	《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

	动的公告		
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
18	鹏华价值精选股票型证券投资基金基金合同	《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 07 月 08 日
19	鹏华基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告	《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 07 月 08 日
20	鹏华价值精选股票型证券投资基金托管协议	《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 07 月 08 日
21	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 07 月 12 日
22	鹏华价值精选股票型证券投资基金更新的招募说明书（2023 年第 1 号）	《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 07 月 12 日
23	鹏华价值精选股票型证券投资基金 2023 年第 2 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 07 月 20 日
24	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与部分销售机构申购（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 08 月 07 日
25	鹏华基金管理有限公司关于运用固有资金投资旗下基金的公告	《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 08 月 21 日
26	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 08 月 22 日
27	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购金帝股份首次公开发行 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 08 月 26 日
28	鹏华价值精选股票型证券投资基金 2023 年中期报告	《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 08 月 30 日
29	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与国金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 09 月 27 日
30	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 10 月 13 日

31	鹏华价值精选股票型证券投资基金 2023 年第 3 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 10 月 24 日
32	鹏华基金管理有限公司关于运用固有资金投资旗下基金的公告	《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 11 月 07 日
33	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与南京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 11 月 16 日

注：无。

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 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 年年度报告》（原文）。

### 13.2 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。

### 13.3 查阅方式

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

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

鹏华基金管理有限公司

2024 年 3 月 28 日