

鹏华中证 1000 增强策略交易型开放式指
数证券投资基金
2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 08 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§ 5 托管人报告	15
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 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	51
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	51
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	51

7.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	52
7.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	52
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	52
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	52
7.12	投资组合报告附注	52
§ 8	基金份额持有人信息	53
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	53
8.2	期末上市基金前十名持有人	53
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	54
8.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	54
§ 9	开放式基金份额变动	54
§ 10	重大事件揭示	54
10.1	基金份额持有人大会决议	54
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	54
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	55
10.4	基金投资策略的改变	55
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	55
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	55
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	55
10.8	其他重大事件	58
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	60
11.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	60
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	60
§ 12	备查文件目录	60
12.1	备查文件目录	60
12.2	存放地点	60
12.3	查阅方式	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	1000ETF 增强
场内简称	1000 鹏华(扩位简称:1000ETF 增强)
基金主代码	560590
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 9 月 1 日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	22,710,000.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2023 年 9 月 25 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在力求有效跟踪标的指数基础上，通过主动化投资管理，力争获取超越指数表现的投资收益。
投资策略	<p>1、股票投资策略</p> <p>本基金以中证 1000 指数为标的指数，基金股票投资方面将主要采用指数增强量化投资策略，在力求有效跟踪标的指数基础上，力争获取超越指数表现的投资收益。</p> <p>指数增强量化投资策略主要借鉴国内外成熟的组合投资策略，在对标的指数成份股及其他股票基本面的深入研究的基础上，运用多因子量化选股模型构建投资组合，同时优化组合交易并严格控制组合风险，力求实现超额收益。</p> <p>(1) 多因子量化选股模型</p> <p>本基金将以多因子量化选股模型构建股票组合。多因子模型针对个股构建价值、质量、动量、成长、一致预期等因子，通过量化方法处理因子与个股超额回报之间的特征关系，挑选出具有基本面逻辑支撑和统计意义有效的因子组合，进而得出具有稳定超额回报的股票组合。本基金对因子的有效性进行持续的跟踪，分析其变化规律，基金经理根据市场状况结合因子变化趋势，对模型使用的因子结构进行动态调整。</p> <p>(2) 风险控制与调整</p> <p>本基金在追求超额收益的同时，需要控制跟踪偏离过大的风险。基金将根据投资组合相对标的指数的暴露度等因素的分析，对组合跟踪效果进行预估，及时调整投资组合，力求将跟踪误差控制在目标范围内。</p> <p>本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 6.5%。</p>

	<p>(3) 投资组合优化模型</p> <p>本基金将综合考虑预期回报、风险及交易成本进行投资组合优化。选股范围以标的指数成份股为主，也包括非成份股中与成份股相关性强，流动性好，基本面信息充足的股票。</p> <p>(4) 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，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。</p> <p>2、债券投资策略</p> <p>本基金债券投资组合将采用自上而下的投资策略，根据宏观经济分析、资金面动向分析等判断未来利率变化，并利用债券定价技术，进行个券选择。</p> <p>本基金可投资可转换债券及可交换债券，可转换债券及可交换债券兼具债权和股权双重属性，本基金将通过对目标公司股票的投资价值分析和债券价值分析综合开展投资决策，以增强本基金的收益。</p> <p>3、股指期货投资策略</p> <p>本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，以改善投资组合的投资效果，实现股票组合的超额收益。同时，本基金将力争利用股指期货的杠杆作用，降低申购赎回时现金资产对投资组合的影响及仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，从而达到稳定投资组合资产净值的目的。</p> <p>基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项，同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。</p> <p>4、资产支持证券的投资策略</p> <p>本基金将综合运用战略资产配置和战术资产配置进行资产支持证券的投资组合管理，并根据信用风险、利率风险和流动性风险变化积极调整投资策略，严格遵守法律法规和基金合同的约定，在保证本金安全和基金资产流动性的基础上获得稳定收益。</p> <p>5、融资及转融通投资策略</p> <p>本基金可在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素基础上，参与融资业务。</p> <p>为更好地实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎经营原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与转融通证券出借业务。本基金将在分析市场环境、投资者类型与结构、基金历史申赎情况、出借证券流动性情况等因素的基础上，合理确定出借证券的范围、期限和比例。</p> <p>未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，本基金在履行适当程序后可相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书中更新公告。</p>
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。同时本基金具有与标的指数以及

	标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。
--	----------------------

注：无。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		鹏华基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	高永杰	张姗
	联系电话	0755-81395402	400-61-95555
	电子邮箱	xxp1@phfund.com.cn	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		4006788999	400-61-95555
传真		0755-82021126	0755-83195201
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		518048	518040
法定代表人		张纳沙	缪建民

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-1,166,919.66
本期利润	-2,182,522.46
加权平均基金份额本期利润	-0.0791
本期加权平均净值利润率	-8.44%
本期基金份额净值增长率	-12.03%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-2,776,850.90
期末可供分配基金份额利润	-0.1223

期末基金资产净值	19,933,149.10
期末基金份额净值	0.8777
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-12.23%

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

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

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

3.2 基金净值表现

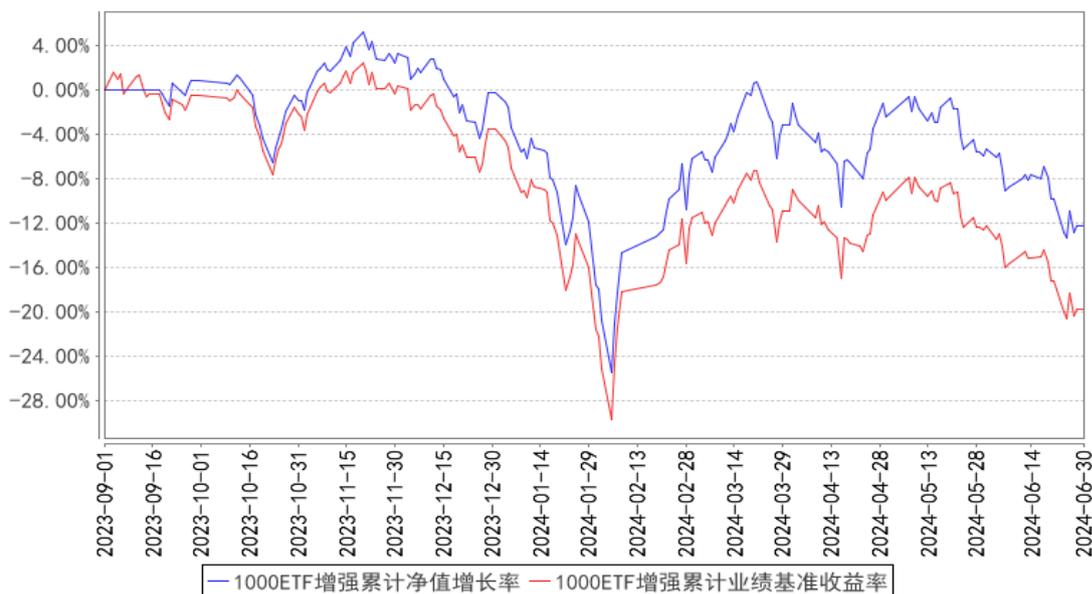
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-7.29%	1.41%	-8.58%	1.43%	1.29%	-0.02%
过去三个月	-9.36%	1.51%	-10.02%	1.49%	0.66%	0.02%
过去六个月	-12.03%	1.92%	-16.84%	1.97%	4.81%	-0.05%
自基金合同生效起至今	-12.23%	1.59%	-19.79%	1.64%	7.56%	-0.05%

注：业绩比较基准=中证1000指数收益率

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

1000ETF增强累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2023 年 09 月 01 日生效，截至本报告期末本基金基金合同生效未满一年。2、截至建仓期结束，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例

3.3 其他指标

注：无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

鹏华基金管理有限公司成立于 1998 年 12 月 22 日，业务范围包括基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。截至本报告期末，公司股东由国信证券股份有限公司、意大利欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）、深圳市北融信投资发展有限公司组成，公司性质为中外合资企业，公司注册资本 15,000 万元人民币。截至本报告期末，公司资产管理总规模达到 12,020 亿元（联接基金不折算，不含投顾），公司管理着 324 只公募基金、13 只全国社保投资组合、8 只基本养老保险投资组合。经过 20 余年投资管理基金，在基金投资、风险控制等方面积累了丰富经验。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		

罗英宇	基金经理	2023-09-01	-	17 年	<p>罗英宇先生, 国籍中国, 管理学硕士, 17 年证券从业经验。曾任招商银行股份有限公司高级程序员, 博时基金管理有限公司信息技术部高级程序员。2008 年 6 月加盟鹏华基金管理有限公司, 历任信息技术部系统分析员、总经理助理、副总经理、量化及衍生品投资部金融科技副总监, 现担任量化及衍生品投资部基金经理。2020 年 12 月至 2022 年 01 月担任鹏华中证高股息龙头交易型开放式指数证券投资基金联接基金, 2020 年 12 月至 2022 年 03 月担任鹏华中证高股息龙头交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2020 年 12 月至今担任鹏华国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2021 年 01 月至 2022 年 08 月担任鹏华国证钢铁行业指数型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2021 年 01 月至今担任鹏华中证高铁产业指数型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2021 年 01 月至今担任鹏华中证信息技术指数型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2021 年 01 月至今担任鹏华中证一带一路主题指数型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2021 年 01 月至今担任鹏华中证移动互联网指数型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2021 年 08 月至今担任鹏华国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金联接基金, 2021 年 09 月至今担任鹏华国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2021 年 11 月至今担任鹏华中证云计算与大数据主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2022 年 01 月至今担任鹏华中证工业互联网主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2022 年 08 月至今担任鹏华中证传媒交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2022 年 08 月至今担任鹏华中证传媒指数型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2022 年 08 月至今担任鹏华中证车联网主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2023 年 09 月至今担任鹏华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2024 年 01 月至今担任鹏华道琼斯工业平均交易型开放式指数证券投资基金</p>
-----	------	------------	---	------	--

					<p>(QDII) 基金经理, 2024 年 04 月至今担任鹏华中证电信主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2024 年 04 月至今担任鹏华中证车联网主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金, 2024 年 06 月至今担任鹏华国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金, 2024 年 06 月至今担任鹏华中证工业互联网主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金, 罗英宇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。</p>
苏俊杰	基金经理	2023-09-01	-	12 年	<p>苏俊杰先生, 国籍中国, 理学硕士, 12 年证券从业经验。曾任 MSCI INC. 分析师, 华泰柏瑞基金管理有限公司专户投资经理, 财通基金管理有限公司基金经理。2019 年 07 月加盟鹏华基金管理有限公司, 历任量化及衍生品投资部副总经理, 现担任量化及衍生品投资部总经理/基金经理。2021 年 03 月至今担任鹏华沪深 300 指数增强型证券投资基金基金经理, 2021 年 03 月至今担任鹏华量化先锋混合型证券投资基金基金经理, 2022 年 01 月至今担任鹏华中证 500 指数增强型证券投资基金基金经理, 2022 年 08 月至 2023 年 12 月担任鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2022 年 08 月至 2023 年 08 月担任鹏华创业板指数型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2022 年 08 月至 2023 年 08 月担任鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2022 年 12 月至今担任鹏华上证科创板 50 成份增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2022 年 12 月至今担任鹏华创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2022 年 12 月至今担任鹏华中证 1000 指数增强型证券投资基金基金经理, 2023 年 02 月至今担任鹏华国证 2000 指数增强型证券投资基金基金经理, 2023 年 06 月至今担任鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2023 年 08 月至今担任鹏华创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理, 2023 年 09 月至今担任鹏华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券</p>

					投资基金基金经理，2023 年 09 月至今担任鹏华上证科创板 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2023 年 12 月至今担任鹏华上证科创板 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2023 年 12 月至今担任鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）基金经理，2024 年 01 月至今担任鹏华智投 800 混合型证券投资基金基金经理，2024 年 05 月至今担任鹏华智投数字经济混合型证券投资基金基金经理，2024 年 06 月至今担任鹏华中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，苏俊杰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。
寇斌权	基金经理	2023-12-09	-	6 年	寇斌权先生，国籍中国，物理学博士，6 年证券从业经验。2018 年 7 月加盟鹏华基金管理有限公司，历任量化及衍生品投资部大数据分析研究助理、量化研究员、高级量化研究员、资深量化研究员，现担任量化及衍生品投资部基金经理。2023 年 06 月至今担任鹏华弘华灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2023 年 09 月至今担任鹏华弘达灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2023 年 09 月至今担任鹏华弘实灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2023 年 12 月至今担任鹏华畅享债券型证券投资基金基金经理，2023 年 12 月至今担任鹏华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理，寇斌权先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理未发生变动。

注：1. 任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日；担任新成立基金基金经理的，任职日期为基金合同生效日。2. 证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

和损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，本基金采用量化模型选股，在控制相对基准指数中证 1000 指数跟踪误差的基础上，力争稳健地获取相对基准的超额收益。量化选股模型继续坚持动态配置不同预测收益来源、不同预测周期的因子；积极跟踪市场波动加剧时期的资金面和情绪面对风格切换的影响，以及组合中个股特异性风险对组合净值的影响程度，来评估是否需要策略调整。在报告期内，通过定期的市场结构性行情演化、风格因子轮动情况、风格因子拥挤度的复盘，我们积极测试策略在不同风险敞口下的表现。在基准指数调样后，择机进行了组合调整，收紧相对基准指数在行业和风格的因子暴露敞口，降低了组合中的权重股的集中程度。后续我们将继续动态追踪沪深 300、中证 500、中证 1000 和中证 2000 等规模指数以及基于中证 1000 指数的 SmartBeta 系列指数的趋势分化，动态评估是否对组合的行业、风格敞口进一步调整。在策略端继续加大对低相关性、有效投资因子的研发力度，来提升组合的收益风险比。继续以稳健均衡的风格，在模型长期有效性和对短期市场环境波动的适应性中寻找平衡。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期份额净值增长率为-12.03%，同期业绩比较基准增长率为-16.84%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年市场整体分化较大，区间波动率显著放大。开年以来 A 股市场持续下行，中小盘随着市场的整体下行最终出现连续的快速回撤，在一季度末短暂修复了超跌部分后、在二季度持续震荡下行；在经历了年初极端行情后，市场整体风险偏好较低，红利类资产持续维持了较高热度。

而随着四月底上市公司 23 年年报、今年一季报的陆续披露完成，市场表现出很强的回归基本面的特征。

与红利资产高度相关的周期、消费和稳定板块表现在二季度逐渐出现分化；消费、周期板块在 5 月中旬先后到达阶段性高位后持续调整，稳定类资产则持续性走强，从结构上看红利资产逐步趋于集中到特定板块/行业。如果资金在红利相关的强势板块进一步集中度到细分板块，则有必要关注红利类资产的短期调整风险。而成长板块科技属性较强的医药与 TMT 也在二季度中旬开始出现较大分化。

在“国九条”及配套制度对优化上市公司分红制度、退市制度等的政策引导下，投资者风险偏好出现结构性调整。一方面有提升权益仓位需求的中长期投资者更加偏好盈利质量优秀、估值较低的高股息企业，一方面风险偏好较高交易型投资者也相应降低对盈利质量较弱的小市值企业的敞口暴露。展望下半年，我们仍然认为回归基本面是未来影响市场风格特征的主要因素，中期视角我们认为继续看好价值风格，短期视角成长板块具有阶段性配置价值。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术。

本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本基金管理人设有估值委员会，由登记结算部、风控管理部、监察稽核部、各投资部门、研究部门负责人、基金经理等成员组成，估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规和基金估值运作等方面的专业能力。基金经理可与估值委员会成员共同商定估值原则和政策，但不参与日常估值的执行。

基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值发生重大变化的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

本基金管理人已与第三方定价服务机构签署服务协议，由其按约定提供相关参考数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1、截止本报告期末，本基金期末可供分配利润为-2,776,850.90 元，期末基金份额净值 0.8777 元，不符合利润分配条件。

2、本基金本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金自 2024 年 04 月 22 日至 2024 年 06 月 28 日期间出现连续二十个（或以上）工作日基金资产净值低于五千万的情形。

本基金自 2024 年 01 月 19 日至 2024 年 04 月 18 日期间出现连续二十个（或以上）工作日基金资产净值低于五千万的情形。

本基金自 2023 年 10 月 31 日至 2024 年 01 月 17 日期间出现连续二十个（或以上）工作日基金资产净值低于五千万的情形。

§ 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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：鹏华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	1,764,157.67	1,442,748.27
结算备付金		33,365.08	183,251.04
存出保证金		29,443.66	82,970.19
交易性金融资产	6.4.7.2	18,120,068.29	18,069,226.42
其中：股票投资		18,120,068.29	18,069,226.42
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	75,409.12	-
资产总计		20,022,443.82	19,778,195.92
负债和净资产			
	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		15,139.56	14,247.48
应付托管费		2,838.66	2,671.42
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-

其他负债	6.4.7.9	71,316.50	96,762.60
负债合计		89,294.72	113,681.50
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	22,710,000.00	19,710,000.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-2,776,850.90	-45,485.58
净资产合计		19,933,149.10	19,664,514.42
负债和净资产总计		20,022,443.82	19,778,195.92

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.8777 元，基金份额总额 22,710,000.00 份。

6.2 利润表

会计主体：鹏华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-1,960,832.77
1. 利息收入		4,238.51
其中：存款利息收入	6.4.7.13	4,238.51
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-1,057,175.77
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-1,297,227.57
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-
股利收益	6.4.7.19	240,051.80
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-1,015,602.80
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	107,707.29

减：二、营业总支出		221,689.69
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	102,287.68
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6.4.10.2.2	19,178.96
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	6.4.7.23	100,223.05
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-2,182,522.46
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-2,182,522.46
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-2,182,522.46

注：本基金合同于 2023 年 09 月 01 日生效，无上年度可比较期间及可比较数据。

6.3 净资产变动表

会计主体：鹏华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	19,710,000.00	-	-45,485.58	19,664,514.42
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	19,710,000.00	-	-45,485.58	19,664,514.42
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	3,000,000.00	-	-2,731,365.32	268,634.68
(一)、综合收益总额	-	-	-2,182,522.46	-2,182,522.46
(二)、本期基金份额交易产生的	3,000,000.00	-	-548,842.86	2,451,157.14

净资产变动数 (净资产减少以 “-”号填列)				
其中：1. 基金申 购款	87,000,000.00	-	-6,508,827.18	80,491,172.82
2. 基金赎 回款	-84,000,000.00	-	5,959,984.32	-78,040,015.68
(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	22,710,000.00	-	-2,776,850.90	19,933,149.10

注：本基金合同于 2023 年 09 月 01 日生效，无上年度可比较期间及可比较数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

邓召明

聂连杰

郝文高

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

鹏华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2023]428 号《关于准予鹏华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》准予，由鹏华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式，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 205,710,000.00 元，业经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)德师报(验)字(23)第 00220 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《鹏华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2023 年 9 月 1 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 205,710,000.00 份基金份额，无认购资金利息份额。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公

司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、《资产管理产品相关会计处理规定》(财会[2022]14号)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《鹏华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2024 年上半年财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 06 月 30 日的财务状况以及 2024 年上半年的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

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

[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	1,764,157.67

等于：本金	1,763,987.11
加：应计利息	170.56
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	1,764,157.67

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	19,159,834.93	-	18,120,068.29	-1,039,766.64
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	19,159,834.93	-	18,120,068.29	-1,039,766.64

注：股票投资的公允价值和股票投资的公允价值变动均含可退替代款估值增值。

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

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	75,409.12
合计	75,409.12

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	41,083.62
其中：交易所市场	41,083.62
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	30,232.88
合计	71,316.50

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	19,710,000.00	19,710,000.00
本期申购	87,000,000.00	87,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-84,000,000.00	-84,000,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	22,710,000.00	22,710,000.00

注：投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购、赎回单位的整数倍。

6.4.7.11 其他综合收益

注：无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	597,920.22	-643,405.80	-45,485.58
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	597,920.22	-643,405.80	-45,485.58
本期利润	-1,166,919.66	-1,015,602.80	-2,182,522.46
本期基金份额交易产生的变动数	509,778.09	-1,058,620.95	-548,842.86

其中：基金申购款	1,315,018.86	-7,823,846.04	-6,508,827.18
基金赎回款	-805,240.77	6,765,225.09	5,959,984.32
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-59,221.35	-2,717,629.55	-2,776,850.90

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
活期存款利息收入		2,921.19
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		811.09
其他		506.23
合计		4,238.51

注：其他包含认/申购款利息收入、结算保证金利息收入、风控金利息收入等。

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入		-808,731.01
股票投资收益——赎回差价收入		-488,496.56
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		-1,297,227.57

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
卖出股票成交总额		53,454,511.74
减：卖出股票成本总额		54,145,751.63
减：交易费用		117,491.12
买卖股票差价收入		-808,731.01

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	

赎回基金份额对价总额	78,040,015.68
减：现金支付赎回款总额	45,342,385.68
减：赎回股票成本总额	33,186,126.56
减：交易费用	-
赎回差价收入	-488,496.56

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	240,051.80
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	240,051.80

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	-1,015,602.80
股票投资	-1,015,602.80
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-1,015,602.80

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日

基金赎回费收入	-
替代损益	107,707.29
合计	107,707.29

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

6.4.7.22 信用减值损失

注：无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	14,918.54
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行汇划费用	769.15
登记结算费	74,590.88
IOPV 计算和发布费	9,944.48
合计	100,223.05

6.4.7.24 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
鹏华基金管理有限公司(“鹏华基金公司”)	基金管理人
招商银行股份有限公司(“招商银行”)	基金托管人
国信证券股份有限公司(“国信证券”)	基金管理人的股东、基金的一级交易商

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金基金合同于 2023 年 09 月 01 日生效，截至本报告期末不满一年，无上年度可比期间数据。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
国信证券	90,804,760.67	83.94

6.4.10.1.2 债券交易

注：无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

6.4.10.1.4 权证交易

注：无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
国信证券	74,579.50	88.97	32,004.82	77.90

注：（1）佣金的计算公式

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

（佣金比率按照与一般证券公司签订的协议条款订立。）

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	102,287.68
其中：应支付销售机构的客户维护费	4,738.99
应支付基金管理人的净管理费	97,548.69

注：1、支付基金管理人鹏华基金公司的管理人报酬年费率为 0.80%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×0.80%÷当年天数。

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	19,178.96

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

6.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：无。

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

注：无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行	1,764,157.67	2,921.19

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。本基金在上年度可比期间未成立。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

注：无。

6.4.12 期末（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于 2024 年 06 月 30 日，本基金未持有信用类债券（2023 年 12 月 31 日：未持有）。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时或于约定开放日要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理职能部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大部分证券均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，因此除附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外，

本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2024 年 06 月 30 日，本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注“期末本基金持有的流通受限证券”。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金持有的利率敏感性资产为银行存款、结算备付金，其余大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

资产					
货币资金	1,764,157.67	-	-	-	1,764,157.67
结算备付金	33,365.08	-	-	-	33,365.08
存出保证金	29,443.66	-	-	-	29,443.66
交易性金融资产	-	-	-	18,120,068.29	18,120,068.29
其他资产	-	-	-	75,409.12	75,409.12
资产总计	1,826,966.41	-	-	18,195,477.41	20,022,443.82
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	15,139.56	15,139.56
应付托管费	-	-	-	2,838.66	2,838.66
其他负债	-	-	-	71,316.50	71,316.50
负债总计	-	-	-	89,294.72	89,294.72
利率敏感度缺口	1,826,966.41	-	-	18,106,182.69	19,933,149.10
上年度末 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	1,442,748.27	-	-	-	1,442,748.27
结算备付金	183,251.04	-	-	-	183,251.04
存出保证金	82,970.19	-	-	-	82,970.19
交易性金融资产	-	-	-	18,069,226.42	18,069,226.42
资产总计	1,708,969.50	-	-	18,069,226.42	19,778,195.92
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	14,247.48	14,247.48
应付托管费	-	-	-	2,671.42	2,671.42
其他负债	-	-	-	96,762.60	96,762.60
负债总计	-	-	-	113,681.50	113,681.50
利率敏感度缺口	1,708,969.50	-	-	17,955,544.92	19,664,514.42

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2024 年 06 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资和资产支持证券公允价值占基金资产净值的比例为 0.00%，因此当利率发生合理、可能的变动时，对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无。

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于标的指数成份券和备选成份券，所面临的其他价格风险来源于标的指数成份券和备选成份券证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金为被动式指数基金，原则上采用完全复制的方法，按照个券在标的指数中的基准权重构建投资组合。基金所构建的指数化投资组合将根据标的指数成份券及其权重的变动而进行相应调整。同时，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、新股增发等变化，对基金投资组合进行相应调整，以保证基金份额净值增长率与标的指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。基金的投资组合比例为：投资于股票及存托凭证资产占基金资产的比例不低于 80%，其中投资于标的指数成份股（含存托凭证）及其备选成份股（含存托凭证）的比例不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023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	18,120,068.29	90.90	18,069,226.42	91.89
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—

交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	18,120,068.29	90.90	18,069,226.42	91.89

注：债券投资为可转债、可交换债券投资。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准外的其他市场变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	比较基准上涨5%资产净值变动	936,559.01	-
	比较基准下降5%资产净值变动	-936,559.01	-

注：于2023年12月31日，由于本基金运行期间不足一年，尚不存在足够的经验数据，因此，无法对本基金资产净值对于市场价格风险的敏感性作定量分析。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日
第一层次	18,120,068.29
第二层次	-
第三层次	-
合计	18,120,068.29

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票、债券和基金的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	18,120,068.29	90.50
	其中：股票	18,120,068.29	90.50
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	1,797,522.75	8.98
8	其他各项资产	104,852.78	0.52
9	合计	20,022,443.82	100.00

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

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	103,320.00	0.52
B	采矿业	553,147.00	2.78
C	制造业	10,064,082.65	50.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	427,729.00	2.15
E	建筑业	352,726.00	1.77
F	批发和零售业	517,249.00	2.59
G	交通运输、仓储和邮政业	248,623.00	1.25
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,088,603.91	10.48
J	金融业	392,390.00	1.97
K	房地产业	412,328.00	2.07
L	租赁和商务服务业	43,029.00	0.22
M	科学研究和技术服务业	136,980.45	0.69
N	水利、环境和公共设施管理业	203,547.00	1.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	76,688.00	0.38
R	文化、体育和娱乐业	425,585.00	2.14
S	综合	-	-

	合计	16,046,028.01	80.50
--	----	---------------	-------

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,468,416.28	7.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	143,488.00	0.72
E	建筑业	77,896.00	0.39
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	99,192.00	0.50
J	金融业	-	-
K	房地产业	47,988.00	0.24
L	租赁和商务服务业	67,490.00	0.34
M	科学研究和技术服务业	69,819.00	0.35
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	13,013.00	0.07
Q	卫生和社会工作	71,442.00	0.36
R	文化、体育和娱乐业	15,296.00	0.08
S	综合	-	-
	合计	2,074,040.28	10.40

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	---------	--------------

1	002085	万丰奥威	20,500	271,420.00	1.36
2	002215	诺普信	28,200	210,090.00	1.05
3	002020	京新药业	19,300	202,071.00	1.01
4	002782	可立克	17,500	193,900.00	0.97
5	000528	柳工	17,100	191,349.00	0.96
6	000426	兴业银锡	13,700	186,046.00	0.93
7	601801	皖新传媒	26,800	185,724.00	0.93
8	605222	起帆电缆	10,100	154,934.00	0.78
9	300573	兴齐眼药	900	147,600.00	0.74
10	600064	南京高科	23,300	141,431.00	0.71
11	603171	税友股份	5,200	140,608.00	0.71
12	600158	中体产业	17,900	137,651.00	0.69
13	300232	洲明科技	26,000	135,720.00	0.68
14	002283	天润工业	31,100	133,419.00	0.67
15	000810	创维数字	15,300	131,274.00	0.66
16	600216	浙江医药	11,700	128,466.00	0.64
17	600685	中船防务	4,600	128,340.00	0.64
18	600391	航发科技	8,400	128,100.00	0.64
19	688166	博瑞医药	3,600	126,000.00	0.63
20	300319	麦捷科技	13,500	125,955.00	0.63
21	000650	仁和药业	21,300	125,670.00	0.63
22	603236	移远通信	2,600	121,498.00	0.61
23	600761	安徽合力	5,600	121,184.00	0.61
24	002434	万里扬	24,500	120,050.00	0.60
25	601677	明泰铝业	9,900	114,444.00	0.57
26	002276	万马股份	15,800	113,286.00	0.57
27	600552	凯盛科技	11,700	110,331.00	0.55
28	002222	福晶科技	4,840	109,045.20	0.55
29	002544	普天科技	5,800	108,402.00	0.54
30	603393	新天然气	3,100	107,694.00	0.54
31	601369	陕鼓动力	13,300	106,666.00	0.54
32	600776	东方通信	10,700	105,181.00	0.53
33	601101	昊华能源	11,300	103,847.00	0.52
34	603477	巨星农牧	3,600	103,320.00	0.52
35	000090	天健集团	25,300	101,706.00	0.51
36	002390	信邦制药	30,600	101,286.00	0.51
37	600874	创业环保	18,000	100,620.00	0.50
38	601519	大智慧	18,000	100,080.00	0.50
39	300134	大富科技	14,600	99,572.00	0.50
40	600502	安徽建工	23,100	99,330.00	0.50
41	002643	万润股份	9,900	99,000.00	0.50
42	002063	远光软件	18,800	98,512.00	0.49
43	603989	艾华集团	7,000	98,420.00	0.49

44	603197	保隆科技	3,100	97,650.00	0.49
45	000727	冠捷科技	47,300	97,438.00	0.49
46	600120	浙江东方	29,100	97,194.00	0.49
47	300738	奥飞数据	9,500	96,140.00	0.48
48	002534	西子洁能	9,600	96,096.00	0.48
49	300747	锐科激光	5,400	95,850.00	0.48
50	000917	电广传媒	18,900	95,445.00	0.48
51	688676	金盘科技	1,800	93,870.00	0.47
52	600657	信达地产	30,600	93,330.00	0.47
53	603985	恒润股份	7,800	92,820.00	0.47
54	002036	联创电子	13,700	92,475.00	0.46
55	600556	天下秀	25,400	92,456.00	0.46
56	002243	力合科创	16,700	92,351.00	0.46
57	002351	漫步者	7,000	92,050.00	0.46
58	002891	中宠股份	4,400	91,828.00	0.46
59	002498	汉缆股份	27,900	91,791.00	0.46
60	688173	希荻微	8,313	91,692.39	0.46
61	300109	新开源	7,900	91,482.00	0.46
62	600475	华光环能	10,500	91,455.00	0.46
63	002484	江海股份	6,900	91,425.00	0.46
64	300068	南都电源	11,000	91,080.00	0.46
65	002335	科华数据	4,300	90,859.00	0.46
66	301219	腾远钴业	2,300	87,998.00	0.44
67	002928	华夏航空	13,800	87,492.00	0.44
68	603108	润达医疗	5,700	86,298.00	0.43
69	300080	易成新能	29,400	84,672.00	0.42
70	688586	江航装备	9,100	84,630.00	0.42
71	300476	胜宏科技	2,600	83,876.00	0.42
72	002267	陕天然气	11,000	83,160.00	0.42
73	600667	太极实业	14,500	82,795.00	0.42
74	002291	遥望科技	18,800	80,840.00	0.41
75	002237	恒邦股份	7,000	80,570.00	0.40
76	000951	中国重汽	5,600	80,192.00	0.40
77	002091	江苏国泰	11,700	79,677.00	0.40
78	002389	航天彩虹	5,700	79,173.00	0.40
79	603063	禾望电气	5,100	78,183.00	0.39
80	600446	金证股份	7,800	77,454.00	0.39
81	300203	聚光科技	7,600	76,684.00	0.38
82	600012	皖通高速	5,400	75,438.00	0.38
83	600641	万业企业	6,400	75,200.00	0.38
84	688408	中信博	800	73,664.00	0.37
85	000034	神州数码	3,200	73,248.00	0.37
86	600459	贵研铂业	5,400	72,954.00	0.37

87	600285	羚锐制药	3,000	72,630.00	0.36
88	601208	东材科技	10,000	72,600.00	0.36
89	688100	威胜信息	1,900	72,485.00	0.36
90	600267	海正药业	10,300	72,306.00	0.36
91	000503	国新健康	10,800	72,036.00	0.36
92	600971	恒源煤电	6,000	71,640.00	0.36
93	600458	时代新材	6,900	69,690.00	0.35
94	300432	富临精工	10,800	69,552.00	0.35
95	601028	玉龙股份	5,500	68,750.00	0.34
96	600328	中盐化工	10,000	68,600.00	0.34
97	603308	应流股份	5,500	68,310.00	0.34
98	600577	精达股份	17,100	67,887.00	0.34
99	002317	众生药业	5,900	67,437.00	0.34
100	603636	南威软件	8,700	66,990.00	0.34
101	300451	创业慧康	19,200	66,432.00	0.33
102	600449	宁夏建材	5,600	65,800.00	0.33
103	002597	金禾实业	3,300	65,637.00	0.33
104	300113	顺网科技	6,400	65,536.00	0.33
105	688372	伟测科技	1,665	65,484.45	0.33
106	605589	圣泉集团	3,225	65,435.25	0.33
107	603533	掌阅科技	3,500	65,345.00	0.33
108	600420	国药现代	6,100	65,148.00	0.33
109	600691	阳煤化工	37,800	64,638.00	0.32
110	000555	神州信息	6,900	64,308.00	0.32
111	000686	东北证券	11,300	63,054.00	0.32
112	300620	光库科技	1,700	62,526.00	0.31
113	601609	金田股份	10,800	61,128.00	0.31
114	600037	歌华有线	10,100	60,398.00	0.30
115	301207	华兰疫苗	3,400	60,078.00	0.30
116	600623	华谊集团	10,300	59,534.00	0.30
117	002649	博彦科技	7,400	58,904.00	0.30
118	300687	赛意信息	4,200	58,464.00	0.29
119	000035	中国天楹	12,900	58,437.00	0.29
120	000766	通化金马	3,600	58,284.00	0.29
121	600557	康缘药业	3,700	58,090.00	0.29
122	688327	云从科技-UW	5,000	56,550.00	0.28
123	301205	联特科技	900	56,475.00	0.28
124	603530	神马电力	2,100	55,629.00	0.28
125	002396	星网锐捷	4,200	55,482.00	0.28
126	688158	优刻得-W	5,400	55,242.00	0.28
127	600100	同方股份	10,800	54,972.00	0.28
128	600882	妙可蓝多	4,400	54,868.00	0.28
129	301217	铜冠铜箔	5,600	53,760.00	0.27

130	002549	凯美特气	10,500	53,655.00	0.27
131	002967	广电计量	4,500	53,100.00	0.27
132	002011	盾安环境	5,400	53,082.00	0.27
133	301316	慧博云通	3,600	52,848.00	0.27
134	002100	天康生物	7,600	52,668.00	0.26
135	002068	黑猫股份	7,400	52,540.00	0.26
136	300323	华灿光电	12,000	52,200.00	0.26
137	300143	盈康生命	6,900	51,957.00	0.26
138	300188	国投智能	4,600	51,106.00	0.26
139	002446	盛路通信	9,000	50,850.00	0.26
140	600331	宏达股份	8,700	50,373.00	0.25
141	600206	有研新材	5,600	49,840.00	0.25
142	603439	贵州三力	3,900	49,764.00	0.25
143	002176	江特电机	6,100	49,715.00	0.25
144	600116	三峡水利	7,200	49,680.00	0.25
145	601001	晋控煤业	3,000	49,560.00	0.25
146	000682	东方电子	4,400	48,576.00	0.24
147	600197	伊力特	2,700	48,087.00	0.24
148	600717	天津港	11,200	47,824.00	0.24
149	601811	新华文轩	3,400	47,634.00	0.24
150	300685	艾德生物	2,700	47,628.00	0.24
151	600587	新华医疗	2,980	46,905.20	0.24
152	688209	英集芯	3,600	44,676.00	0.22
153	603013	亚普股份	3,300	44,451.00	0.22
154	300525	博思软件	3,494	44,373.80	0.22
155	601869	长飞光纤	1,800	43,794.00	0.22
156	002745	木林森	5,400	43,524.00	0.22
157	600335	国机汽车	7,500	43,275.00	0.22
158	002467	二六三	12,900	43,086.00	0.22
159	603129	春风动力	300	42,702.00	0.21
160	300079	数码视讯	10,500	42,630.00	0.21
161	603906	龙蟠科技	5,400	42,066.00	0.21
162	603997	继峰股份	4,100	41,943.00	0.21
163	300475	香农芯创	1,400	41,398.00	0.21
164	000628	高新发展	900	39,933.00	0.20
165	601279	英利汽车	10,700	39,911.00	0.20
166	002214	大立科技	3,500	39,480.00	0.20
167	300768	迪普科技	3,300	39,105.00	0.20
168	001236	弘业期货	5,500	39,105.00	0.20
169	603093	南华期货	4,500	38,970.00	0.20
170	603103	横店影视	2,800	38,752.00	0.19
171	603132	金徽股份	2,800	38,528.00	0.19
172	600929	雪天盐业	7,200	38,160.00	0.19

173	603936	博敏电子	4,500	37,800.00	0.19
174	600618	氯碱化工	4,200	36,876.00	0.18
175	688235	百济神州-U	300	34,752.00	0.17
176	600986	浙文互联	8,100	34,020.00	0.17
177	600201	生物股份	4,600	33,166.00	0.17
178	300613	富瀚微	1,000	32,910.00	0.17
179	600185	格力地产	7,700	32,725.00	0.16
180	000627	天茂集团	18,100	31,675.00	0.16
181	603733	仙鹤股份	1,800	31,644.00	0.16
182	600688	上海石化	11,700	30,537.00	0.15
183	600812	华北制药	7,400	30,488.00	0.15
184	603915	国茂股份	2,900	29,841.00	0.15
185	300294	博雅生物	900	29,700.00	0.15
186	000968	蓝焰控股	4,500	28,620.00	0.14
187	002405	四维图新	4,600	28,612.00	0.14
188	603666	亿嘉和	1,800	28,404.00	0.14
189	600531	豫光金铅	4,400	28,336.00	0.14
190	000795	英洛华	5,100	28,254.00	0.14
191	600797	浙大网新	6,100	28,243.00	0.14
192	600780	通宝能源	4,700	27,730.00	0.14
193	002567	唐人神	5,100	27,336.00	0.14
194	300303	聚飞光电	5,600	27,216.00	0.14
195	603881	数据港	2,132	27,097.72	0.14
196	002182	宝武镁业	2,400	27,072.00	0.14
197	002204	大连重工	6,300	26,901.00	0.13
198	002488	金固股份	6,100	26,779.00	0.13
199	300757	罗博特科	300	26,205.00	0.13
200	300206	理邦仪器	3,000	25,770.00	0.13
201	605333	沪光股份	900	25,065.00	0.13
202	000837	秦川机床	3,400	25,024.00	0.13
203	688110	东芯股份	1,300	24,791.00	0.12
204	301239	普瑞眼科	700	24,731.00	0.12
205	002545	东方铁塔	3,600	24,516.00	0.12
206	600125	铁龙物流	4,100	24,477.00	0.12
207	605168	三人行	900	23,697.00	0.12
208	600266	城建发展	6,300	23,562.00	0.12
209	000059	华锦股份	5,600	23,464.00	0.12
210	603283	赛腾股份	300	22,920.00	0.11
211	300672	国科微	400	21,136.00	0.11
212	600195	中牧股份	2,700	20,223.00	0.10
213	002060	广东建工	5,900	20,178.00	0.10
214	002859	洁美科技	1,000	20,080.00	0.10
215	000058	深赛格	3,600	19,332.00	0.10

216	002402	和而泰	1,800	19,278.00	0.10
217	000029	深深房 A	1,800	19,134.00	0.10
218	688046	药康生物	1,800	18,396.00	0.09
219	300775	三角防务	600	18,360.00	0.09
220	002990	盛视科技	900	18,117.00	0.09
221	000718	苏宁环球	10,500	17,640.00	0.09
222	300369	绿盟科技	3,400	17,374.00	0.09
223	000688	国城矿业	1,800	17,136.00	0.09
224	601619	嘉泽新能	5,600	16,968.00	0.09
225	000791	甘肃能源	2,700	16,659.00	0.08
226	603348	文灿股份	600	16,614.00	0.08
227	301039	中集车辆	1,900	16,340.00	0.08
228	603229	奥翔药业	1,600	16,080.00	0.08
229	601595	上海电影	800	15,824.00	0.08
230	603057	紫燕食品	1,000	15,320.00	0.08
231	688403	汇成股份	1,800	15,264.00	0.08
232	002815	崇达技术	1,600	15,008.00	0.08
233	600933	爱柯迪	1,000	14,790.00	0.07
234	688088	虹软科技	500	14,430.00	0.07
235	600869	远东股份	4,100	14,309.00	0.07
236	002250	联化科技	2,900	13,920.00	0.07
237	000582	北部湾港	1,800	13,392.00	0.07
238	000685	中山公用	1,800	12,978.00	0.07
239	300379	东方通	1,600	12,928.00	0.06
240	600273	嘉化能源	1,800	12,852.00	0.06
241	603719	良品铺子	1,100	12,837.00	0.06
242	000597	东北制药	3,300	12,771.00	0.06
243	601528	瑞丰银行	2,700	12,744.00	0.06
244	600223	福瑞达	1,800	12,726.00	0.06
245	603877	太平鸟	900	12,357.00	0.06
246	000690	宝新能源	2,400	12,240.00	0.06
247	002705	新宝股份	800	11,256.00	0.06
248	000761	本钢板材	4,400	11,044.00	0.06
249	600363	联创光电	400	11,008.00	0.06
250	300587	天铁股份	2,700	10,908.00	0.05
251	300953	震裕科技	200	10,840.00	0.05
252	603170	宝立食品	900	10,692.00	0.05
253	688048	长光华芯	300	9,372.00	0.05
254	600073	光明肉业	1,700	9,367.00	0.05
255	003012	东鹏控股	1,500	9,165.00	0.05
256	600480	凌云股份	900	8,847.00	0.04
257	601886	江河集团	1,800	8,784.00	0.04
258	600877	电科芯片	800	8,576.00	0.04

259	300973	立高食品	300	8,427.00	0.04
260	600123	兰花科创	900	8,055.00	0.04
261	600648	外高桥	900	7,974.00	0.04
262	688700	东威科技	300	7,863.00	0.04
263	600063	皖维高新	2,100	7,392.00	0.04
264	300576	容大感光	200	7,306.00	0.04
265	002212	天融信	1,500	7,305.00	0.04
266	600151	航天机电	1,600	7,232.00	0.04
267	300315	掌趣科技	1,600	6,672.00	0.03
268	002038	双鹭药业	900	6,633.00	0.03
269	600773	西藏城投	600	6,192.00	0.03
270	600864	哈投股份	1,300	6,175.00	0.03
271	300459	汤姆猫	1,800	6,102.00	0.03
272	002171	楚江新材	900	5,931.00	0.03
273	601952	苏垦农发	600	5,412.00	0.03
274	300910	瑞丰新材	100	4,372.00	0.02
275	688232	新点软件	200	3,944.00	0.02
276	002807	江阴银行	900	3,393.00	0.02
277	600604	市北高新	900	3,114.00	0.02
278	002145	中核钛白	900	2,952.00	0.01
279	688707	振华新材	300	2,922.00	0.01
280	300065	海兰信	400	2,644.00	0.01
281	603071	物产环能	200	2,506.00	0.01
282	600750	江中药业	100	2,311.00	0.01
283	002773	康弘药业	100	2,165.00	0.01
284	600771	广誉远	100	1,883.00	0.01
285	605365	立达信	100	1,587.00	0.01
286	600562	国睿科技	100	1,366.00	0.01
287	601222	林洋能源	200	1,254.00	0.01
288	603599	广信股份	100	1,213.00	0.01
289	601606	长城军工	100	956.00	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	300502	新易盛	2,700	284,985.00	1.43
2	002436	兴森科技	11,300	116,616.00	0.59
3	600578	京能电力	35,200	114,048.00	0.57
4	000921	海信家电	3,500	112,840.00	0.57
5	002611	东方精工	19,700	103,425.00	0.52
6	688425	铁建重工	25,791	94,910.88	0.48
7	601567	三星医疗	2,700	94,500.00	0.47
8	300394	天孚通信	960	84,883.20	0.43

9	603235	天新药业	3,400	81,702.00	0.41
10	000032	深桑达 A	5,200	77,896.00	0.39
11	605007	五洲特纸	6,100	77,043.00	0.39
12	002664	信质集团	6,100	72,590.00	0.36
13	002044	美年健康	18,900	71,442.00	0.36
14	603520	司太立	7,000	66,780.00	0.34
15	002344	海宁皮城	21,200	64,872.00	0.33
16	002636	金安国纪	9,500	60,325.00	0.30
17	603018	华设集团	6,000	54,540.00	0.27
18	002517	恺英网络	5,200	49,660.00	0.25
19	300002	神州泰岳	6,100	49,532.00	0.25
20	600510	黑牡丹	12,900	47,988.00	0.24
21	002838	道恩股份	4,000	36,240.00	0.18
22	600876	凯盛新能	3,500	33,040.00	0.17
23	600098	广州发展	4,600	29,440.00	0.15
24	002017	东信和平	3,400	28,322.00	0.14
25	600523	贵航股份	2,100	20,790.00	0.10
26	300653	正海生物	1,000	20,350.00	0.10
27	601858	中国科传	800	15,296.00	0.08
28	688238	和元生物	3,300	15,279.00	0.08
29	003032	传智教育	1,300	13,013.00	0.07
30	600129	太极集团	400	11,568.00	0.06
31	300767	震安科技	1,300	11,024.00	0.06
32	002810	山东赫达	900	10,602.00	0.05
33	600172	黄河旋风	4,400	8,272.00	0.04
34	688017	绿的谐波	100	8,210.00	0.04
35	300497	富祥药业	900	8,037.00	0.04
36	300114	中航电测	100	4,525.00	0.02
37	300981	中红医疗	400	3,828.00	0.02
38	688153	唯捷创芯	100	3,700.00	0.02
39	300900	广联航空	140	2,622.20	0.01
40	600984	建设机械	1,100	2,618.00	0.01
41	002645	华宏科技	400	2,544.00	0.01
42	688277	天智航-U	300	2,322.00	0.01
43	002979	雷赛智能	100	1,820.00	0.01

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002085	万丰奥威	1,648,817.00	8.38
2	300502	新易盛	1,548,387.00	7.87
3	002436	兴森科技	1,151,854.00	5.86

4	002611	东方精工	980,929.00	4.99
5	002215	诺普信	976,323.00	4.96
6	002544	普天科技	971,853.00	4.94
7	300394	天孚通信	951,614.00	4.84
8	002891	中宠股份	948,255.00	4.82
9	000921	海信家电	944,869.00	4.80
10	002484	江海股份	899,391.00	4.57
11	300109	新开源	896,663.00	4.56
12	000917	电广传媒	881,229.00	4.48
13	002782	可立克	863,604.00	4.39
14	002020	京新药业	851,369.00	4.33
15	002063	远光软件	848,478.49	4.31
16	002664	信质集团	837,529.00	4.26
17	300738	奥飞数据	822,004.00	4.18
18	002351	漫步者	813,083.00	4.13
19	002044	美年健康	806,718.00	4.10
20	301219	腾远钴业	798,890.50	4.06
21	000951	中国重汽	781,561.00	3.97
22	000032	深桑达 A	749,546.00	3.81
23	002928	华夏航空	737,643.00	3.75
24	301207	华兰疫苗	692,393.00	3.52
25	002434	万里扬	686,558.80	3.49
26	002344	海宁皮城	686,129.00	3.49
27	300203	聚光科技	681,338.00	3.46
28	000686	东北证券	669,908.00	3.41
29	300451	创业慧康	669,539.00	3.40
30	002237	恒邦股份	663,202.00	3.37
31	300232	洲明科技	618,105.00	3.14
32	002068	黑猫股份	607,361.00	3.09
33	000555	神州信息	596,272.00	3.03
34	002636	金安国纪	575,809.00	2.93
35	300323	华灿光电	556,240.00	2.83
36	002967	广电计量	554,381.00	2.82
37	002291	遥望科技	531,403.00	2.70
38	301217	铜冠铜箔	518,834.00	2.64
39	300188	国投智能	518,350.00	2.64
40	300143	盈康生命	500,074.00	2.54
41	300002	神州泰岳	498,107.00	2.53
42	000426	兴业银锡	486,459.00	2.47
43	000035	中国天楹	481,601.00	2.45
44	000528	柳工	481,303.00	2.45
45	002243	力合科创	475,243.00	2.42
46	002517	恺英网络	459,991.00	2.34

47	002283	天润工业	443,796.00	2.26
48	002467	二六三	436,812.00	2.22
49	300525	博思软件	418,205.00	2.13
50	002838	道恩股份	407,850.00	2.07
51	002335	科华数据	407,685.00	2.07
52	000810	创维数字	406,195.00	2.07
53	300613	富瀚微	404,053.70	2.05
54	000627	天茂集团	403,200.00	2.05
55	002036	联创电子	395,093.00	2.01

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

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300502	新易盛	2,073,266.00	10.54
2	002085	万丰奥威	2,056,056.00	10.46
3	002436	兴森科技	1,282,044.00	6.52
4	000921	海信家电	1,111,907.00	5.65
5	002611	东方精工	1,045,570.00	5.32
6	002891	中宠股份	1,003,110.00	5.10
7	002484	江海股份	988,410.00	5.03
8	002215	诺普信	985,792.00	5.01
9	300394	天孚通信	981,503.00	4.99
10	300109	新开源	981,221.00	4.99
11	002544	普天科技	975,763.00	4.96
12	000917	电广传媒	967,563.00	4.92
13	002063	远光软件	950,708.00	4.83
14	300738	奥飞数据	920,841.00	4.68
15	002351	漫步者	907,005.00	4.61
16	301219	腾远钴业	891,969.98	4.54
17	002782	可立克	866,379.00	4.41
18	002664	信质集团	853,775.00	4.34
19	002020	京新药业	848,442.00	4.31
20	002044	美年健康	846,218.00	4.30
21	002928	华夏航空	843,404.00	4.29
22	000032	深桑达 A	815,812.00	4.15
23	000951	中国重汽	809,815.00	4.12
24	300203	聚光科技	727,725.00	3.70
25	002237	恒邦股份	727,716.00	3.70
26	002344	海宁皮城	720,639.00	3.66
27	300451	创业慧康	712,111.00	3.62
28	000686	东北证券	710,218.00	3.61
29	301207	华兰疫苗	706,966.50	3.60

30	000555	神州信息	680,356.00	3.46
31	002434	万里扬	668,870.00	3.40
32	002068	黑猫股份	656,554.00	3.34
33	002636	金安国纪	633,416.00	3.22
34	300323	华灿光电	600,380.00	3.05
35	002967	广电计量	594,507.00	3.02
36	300232	洲明科技	587,472.00	2.99
37	301217	铜冠铜箔	570,887.00	2.90
38	300002	神州泰岳	570,170.00	2.90
39	300188	国投智能	567,437.00	2.89
40	000035	中国天楹	550,128.00	2.80
41	300143	盈康生命	535,830.00	2.72
42	002517	恺英网络	519,619.00	2.64
43	002291	遥望科技	512,322.00	2.61
44	002467	二六三	474,965.00	2.42
45	300525	博思软件	459,426.00	2.34
46	300613	富瀚微	451,899.00	2.30
47	002243	力合科创	446,045.00	2.27
48	002838	道恩股份	439,357.00	2.23
49	000627	天茂集团	417,268.00	2.12
50	000682	东方电子	414,415.00	2.11
51	002214	大立科技	411,967.00	2.09
52	000426	兴业银锡	407,267.00	2.07
53	000528	柳工	403,400.00	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。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	54,723,265.86
卖出股票收入（成交）总额	53,454,511.74

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：无。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：无。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**7.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券备选库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	29,443.66
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	75,409.12
8	其他	-
9	合计	104,852.78

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比 例 (%)	持有份额	占总份额比 例 (%)
306	74,215.69	11,983,490.00	52.77	10,726,510.00	47.23

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	鹏华基金—上海证券正和 2 号 FOF 单一资产管理计划—鹏华基金安益 1 号单一资产管理	4,846,700.00	21.34
2	招商证券股份有限公司	4,826,700.00	21.25
3	华泰证券股份有限公司	1,262,800.00	5.56
4	石国华	1,000,000.00	4.40
5	BARCLAYS BANK PLC	664,500.00	2.93
6	郑浏芬	660,200.00	2.91
7	周鑫	499,500.00	2.20
8	陈珊珊	484,500.00	2.13
9	简街香港有限公司—JSQB 有限公司 (R)	382,690.00	1.69
10	甘凤	374,600.00	1.65

注：持有人为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：截至本报告期末，本基金管理人所有从业人员未持有本基金份额。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

注：截至本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人及本基金的基金经理未持有本基金份额。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2023年9月1日） 基金份额总额	205,710,000.00
本报告期期初基金份额总额	19,710,000.00
本报告期基金总申购份额	87,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	84,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	22,710,000.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人的重大人事变动：

本报告期内，公司原副总经理王宗合先生辞去本公司副总经理职务，经公司第六届董事会第二百零四次会议审议通过，董事会同意王宗合先生不再担任公司副总经理，离任日期为 2024 年 2 月 6 日。

本报告期内，公司原副总经理邢彪先生辞去本公司副总经理职务，经公司第六届董事会第二百一十七次会议审议通过，董事会同意邢彪先生不再担任公司副总经理，离任日期为 2024 年 4 月 11 日。

本报告期内，公司原董事长何如先生不再担任公司董事长。经公司 2024 年第三次临时股东大会和第六届董事会第二百一十八次会议审议通过，股东会同意聘任张纳沙女士担任公司董事，董事会选举张纳沙女士担任公司董事长，任职日期自 2024 年 4 月 12 日起。

本公司已将上述变更事项报中国证券监督管理委员会深圳监管局备案。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的，与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

无。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未改聘为本基金审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人及相关责任人员
受到稽查或处罚等措施的时间	2024 年 4 月 19 日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会深圳监管局
受到的具体措施类型	责令改正及警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	个别规定未严格执行，个别业务内控管理不完善
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	管理人高度重视，按照法律法规及相关要求积极落实整改工作。截至报告日，上述事项已整改完毕
其他	-

注：无。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
国信证券	2	90,804,760.67	83.94	74,579.50	88.97	-
摩根大通证券	1	8,841,537.00	8.17	7,390.95	8.82	-
开源证券	2	8,311,122.6	7.68	1,658.80	1.98	-

		3				
浙商证券	2	104,260.70	0.10	87.14	0.10	-
中泰证券	2	84,554.60	0.08	79.11	0.09	-
国投证券	2	31,542.00	0.03	29.05	0.03	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方财富 证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	3	-	-	-	-	本报告 期新增 1个
国海证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中信建投 证券	1	-	-	-	-	-
中原证券	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；
- (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；
- (4) 合规风控能力较强，内部管理规范、严格，具备健全的内控制度；
- (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) 交易、研究服务能力较强。

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。我公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、合规风控能力和交易、研究水平等后，向券商租用交易单元作为基金交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
国信证券	-	-	-	-	-	-
摩根大通证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-

广发证 券	-	-	-	-	-	-
国海证 券	-	-	-	-	-	-
国金证 券	-	-	-	-	-	-
国盛证 券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
民生证 券	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-
山西证 券	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-
西南证 券	-	-	-	-	-	-
信达证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
中信建 投证券	-	-	-	-	-	-
中原证 券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 01 月 18 日
2	鹏华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 01 月 19 日
3	鹏华基金管理有限公司关于暂停北京中期时代基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 02 月 02 日
4	关于鹏华中证 1000 增强策略交易型	《证券日报》、基金管	2024 年 02 月 02 日

	开放式指数证券投资基金增加部分证券公司为申购赎回代理券商的公告	理人网站及中国证监会基金电子披露网站	
5	鹏华基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 02 月 08 日
6	鹏华基金管理有限公司关于终止与北京中期时代基金销售有限公司销售合作关系的公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 03 月 04 日
7	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金增加信达证券股份有限公司为申购赎回代理券商的公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 03 月 18 日
8	鹏华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 2023 年年度报告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 03 月 28 日
9	鹏华基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 04 月 13 日
10	鹏华基金管理有限公司关于董事长变更的公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 04 月 13 日
11	鹏华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 04 月 19 日
12	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金增加民生证券股份有限公司为申购赎回代理券商的公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 04 月 24 日
13	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华福证券有限责任公司为申购赎回代理券商的公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 04 月 29 日
14	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 05 月 10 日
15	鹏华基金管理有限公司关于调整个人投资者开立基金账户证件类型类型的公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 05 月 16 日
16	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金增加爱建证券有限责任公司为申购赎回代理券商的公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 06 月 14 日
17	鹏华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要（更新）	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 06 月 28 日

注：无。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比(%)
机构	1	20240117~20240118	0.00	81,000,000.00	81,000,000.00	0.00	0.00
	2	20240101~20240116, 20240119~20240411, 20240621~20240630	5,200,100.00	34,953,700.00	35,327,100.00	4,826,700.00	21.25
	3	20240412~20240630	0.00	32,370,000.00	27,523,300.00	4,846,700.00	21.34
产品特有风险							
基金份额持有人持有的基金份额所占比例过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引起基金净值剧烈波动，甚至可能引发基金流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。							

注：1、申购份额包含基金申购份额、基金转换入份额、强制调增份额、场内买入份额和红利再投资份额；

2、赎回份额包含基金赎回份额、基金转换出份额、强制调减份额、场内卖出份额。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一)《鹏华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- (二)《鹏华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- (三)《鹏华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 2024 年中期报告》(原文)。

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅，也可按工本费购买复印件，或通过本基金管理

人网站 (<http://www.phfund.com.cn>) 查阅。

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

鹏华基金管理有限公司

2024 年 8 月 29 日