

鹏华价值共赢两年持有期混合型证券投资
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：中国银行股份有限公司

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。

基金托管人中国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	8
2.5 其他相关资料	8
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	9
3.3 其他指标	10
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	47
7.1 期末基金资产组合情况	47
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
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	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	65
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	66
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	67
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	67

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	67
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	67
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	67
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	67
7.12 投资组合报告附注	67
§8 基金份额持有人信息.....	68
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	68
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	68
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	68
§9 开放式基金份额变动.....	69
§10 重大事件揭示	69
10.1 基金份额持有人大会决议	69
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	69
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	70
10.4 基金投资策略的改变	70
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	70
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	70
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	70
10.8 其他重大事件	73
§11 影响投资者决策的其他重要信息	74
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	74
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	74
§12 备查文件目录	75
12.1 备查文件目录	75
12.2 存放地点	75
12.3 查阅方式	75

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华价值共赢两年持有期混合型证券投资基金
基金简称	鹏华价值共赢两年持有期混合
基金主代码	009086
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 4 月 29 日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	812,056,717.59 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在有效控制投资组合风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金将通过跟踪考量通常的宏观经济变量（包括 GDP 增长率、CPI 走势、M2 的绝对水平和增长率、利率水平与走势等）以及各项国家政策（包括财政、货币、税收、汇率政策等）来判断经济周期目前的位置以及未来将发展的方向，在此基础上对各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估，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>本基金所称的价值型股票，即在深入的基本面研究基础上，股票价格相对于内在价值存在明显低估的股票；它可以是由于经济周期或市场情绪造成的低估值股票，也可以是拥有核心技术、具备持续盈利增长前景、具有吸引人的合理价格的股票。本基金的股票投资将在行业研究的基础上，通过自上而下和自下而上相结合的方式挖掘优质的公司，精选内在价值被低估的股票构建投资组合。核心思路在于：1) 自上而下地分析行业的成长前景、行业结构、商业模式、竞争要素等分析把握其投资机会；2) 自下而上地精选基本面良好，具有较好盈利能力和市场竞争力的公司，寻找明显低估的股票。</p> <p>(1) 自上而下的行业遴选</p> <p>本基金将自上而下地进行行业遴选，重点关注行业增长前景、行业利润前景和行业成功要素。对行业增长前景，主要分析行业的外部发展环境、行业生命周期以及行业波动与经济周期的关系等；对行业利润前景，主要分析行业结构，特别是业内竞争的方式、业内竞争的激烈程度、以及业内厂商的谈判能力等。基于对行业结构的分析形成对业内竞争的关键成功要素的判断，为预测企业经营环境的变化建立起扎实的基础。</p> <p>(2) 自下而上的个股选择</p>

	<p>本基金通过定性和定量相结合的方法进行自下而上的个股选择，对企业基本面和估值水平进行综合的研判，精选优质个股。</p> <p>1) 定量方面</p> <p>估值水平评估。本基金考察企业贴现现金流以及内在价值贴现，结合市盈率（市值/净利润）、市净率（市值/净资产）、市销率（市值/营业收入）等指标衡量股票的价值是否被低估，并且基于公司所属的不同行业，采取不同的估值方法，以此寻找不同行业股票的合理价格区间，并进行动态调整。</p> <p>成长性评估。本基金采用年复合营业收入增长率、盈利增长率、息税前利润增长率、净资产收益率以及现金流量增长率等指标综合考察上市公司的成长性。</p> <p>盈利水平评估。本基金重点考察主营业务收入、ROE、经营现金流、盈利波动程度四大关键指标，以衡量具有高质量持续增长的公司。</p> <p>2) 定性分析</p> <p>本基金通过以下两方面标准对股票的基本面进行研究分析并筛选出优质的公司：</p> <p>一方面是竞争力分析，通过对公司竞争策略和核心竞争力的分析，选择具有可持续竞争优势的公司或未来具有广阔成长空间的公司。就公司竞争策略，基于行业分析的结果判断策略的有效性、策略的实施支持和策略的执行成果；就核心竞争力，分析公司的现有核心竞争力，并判断公司能否利用现有的资源、能力和定位取得可持续竞争优势。</p> <p>另一方面是管理层分析，通过着重考察公司的管理层以及管理制度，选择具有良好治理结构、管理水平较高的优质公司。</p> <p>(3) 港股通标的股票投资策略</p> <p>本基金所投资港股通标的股票除适用上述个股投资策略外，本基金投资港股通标的股票还需关注：</p> <p>1) 在港股市场上市、具有行业代表性的优质中资公司；</p> <p>2) 具有行业稀缺性的香港本地和外资公司；</p> <p>3) 港股市场在行业结构、估值、AH 股折溢价、分红率等方面具有吸引力的投资标的。</p> <p>(4) 科创板股票投资策略</p> <p>设立科创板的目的是落实创新驱动和科技强国战略、推动高质量发展。因此，在适用上述个股投资策略的基础上，还需关注：</p> <p>1) 在定性分析方面，本基金通过以下研究方法进行个股筛选：一是行业研判。科创板重点支持新一代信息技术、高端装备、新材料、新能源、节能环保以及生物医药等高新技术产业和战略性新兴产业上市，我们通过产业调研的方式跟踪各子行业的需求空间、发展阶段和增长速度，挑选具备远期成长性的优质子行业。二是竞争力分析。我们关注该公司具备的核心技术，以及这种技术的成熟度、易用性和研发壁垒。核心技术开发投入大、周期长、具有研发和应用上的较大不确定性，同时也是企业的核心竞争力所在。</p> <p>2) 在定量分析方面，传统的 PE、PB、DCF 等估值方法对于许多</p>
--	--

	<p>发展成熟、盈利稳定的高科技公司仍然是最好的估值方法，但对于一些业务模式特殊、业务扩张迅速但仍处亏损期的高科技公司而言，传统的估值方法已不再适用。因此，在科创板企业的定量分析中，本基金将采取特殊高科技企业估值方法进行定量分析，例如，对云计算相关企业采取 PS 估值方法进行估值，对高速成长的萌芽期企业采取 P/FCF 进行估值，对部分互联网公司采取 MAU（月活跃用户数量）和单用户价值量进行估值，对电子商务平台采取 GMV（网站成交金额）作为估值依据等。</p> <p>综上，本基金将分析科创板相关企业所处产业的发展阶段、企业自身的发展阶段、当前商业模式以及相关业务指标进行综合估值，以辅助投资决策。</p> <p>（5）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>3、债券投资策略</p> <p>本基金债券投资将采取久期策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、个券选择策略、信用策略等积极投资策略，自上而下地管理组合的久期，灵活地调整组合的券种搭配，同时精选个券，以增强组合的持有期收益。</p> <p>4、股指期货投资策略</p> <p>本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目标，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，充分考虑股指期货的风险收益特征，通过多头或空头的套期保值策略，以改善投资组合的投资效果，实现股票组合的超额收益。</p> <p>5、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>未来，如果港股通业务规则发生变化或出现法律法规或监管部门允许投资的其他模式，基金管理人可相应调整，不需召开基金份额持有人大会。</p> <p>未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，本基金可相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书中更新并公告。</p>
<p>业绩比较基准</p>	<p>沪深 300 指数收益率×70%+恒生指数收益率×10%（经汇率估值调整）+中证综合债指数收益率×20%</p>
<p>风险收益特征</p>	<p>本基金为混合型证券投资基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金将投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p>

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	中国银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	高永杰	许俊
	联系电话	0755-81395402	010-66596688
	电子邮箱	xxpl@phfund.com.cn	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		4006788999	95566
传真		0755-82021126	010-66594942
注册地址		深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		518048	100818
法定代表人		张纳沙	葛海蛟

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-135,203,271.41
本期利润	-61,440,117.69
加权平均基金份额本期利润	-0.0732
本期加权平均净值利润率	-9.56%
本期基金份额净值增长率	-8.27%
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	-249,102,570.72
期末可供分配基金份额利润	-0.3068
期末基金资产净值	622,731,575.92
期末基金份额净值	0.7669
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	-23.31%

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

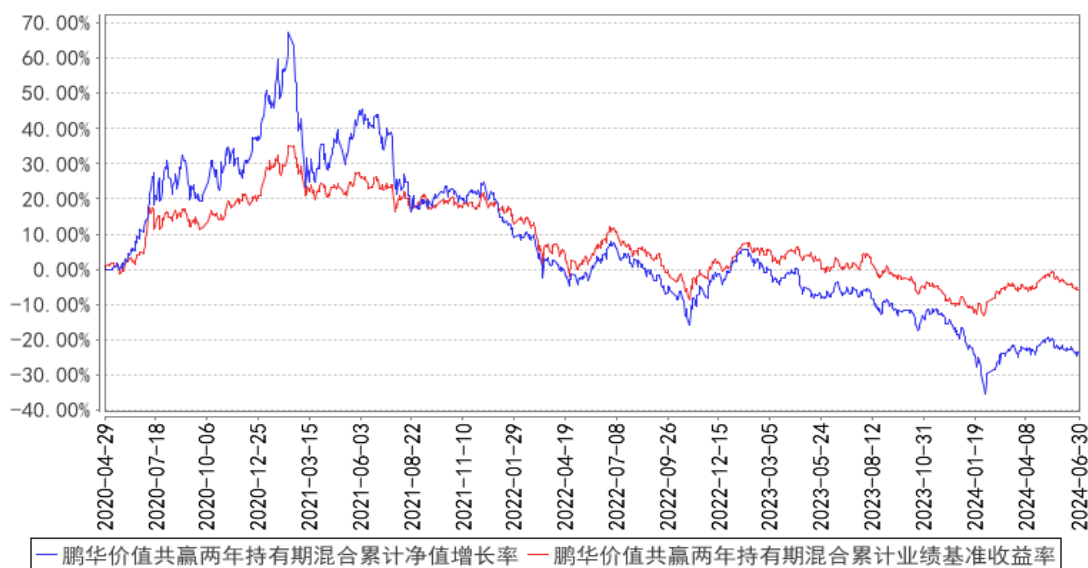
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-0.89%	0.83%	-2.30%	0.37%	1.41%	0.46%
过去三个月	-0.39%	0.91%	-0.34%	0.59%	-0.05%	0.32%
过去六个月	-8.27%	1.34%	2.01%	0.71%	- 10.28%	0.63%
过去一年	-17.97%	1.15%	-6.39%	0.70%	- 11.58%	0.45%
过去三年	-46.49%	1.13%	-24.96%	0.85%	- 21.53%	0.28%
自基金合同生效起至今	-23.31%	1.32%	-5.74%	0.88%	- 17.57%	0.44%

注：业绩比较基准=沪深 300 指数收益率×70%+恒生指数收益率×10%（经汇率估值调整）+中证综合债指数收益率×20%

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

鹏华价值共赢两年持有期混合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 2020 年 04 月 29 日生效。2、截至建仓期结束，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

3.3 其他指标

注：无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

张鹏	基金经理	2023-01-13	-	11 年	张鹏先生, 国籍中国, 金融学硕士, 11 年证券从业经验。曾任鹏华基金管理有限公司研究部助理研究员、研究员, 中欧基金管理有限公司研究部研究员, 自 2017 年任鹏华基金管理有限公司研究部高级研究员、基金经理助理/研究员, 现担任权益投资二部基金经理。2021 年 08 月至今担任鹏华策略回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2021 年 08 月至今担任鹏华价值精选股票型证券投资基金基金经理, 2023 年 01 月至今担任鹏华价值共赢两年持有期混合型证券投资基金基金经理, 2023 年 03 月至 2024 年 04 月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 2024 年 04 月担任鹏华优质治理混合型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2024 年 04 月至今担任鹏华致远成长混合型证券投资基金基金经理, 张鹏先生具备基金从业资格。 本报告期内本基金基金经理未发生变动。
----	------	------------	---	------	--

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

24 年上半年，市场整体下跌，万得全 A 下跌 8%，结构上大幅分化，市值维度上的大盘风格以及估值维度上的价值股，相对小盘和成长风格，录得 15%-20% 的超额收益，大盘价值指数相对微盘股指数超额收益达到 40% 水平，这种风格非常惨烈，小部分涨大部分跌，今年上半年上涨的 A 股只占到全 A 股数量的 15% 左右。因此今年上半年获得超额收益的核心是持仓结构的风格中大市值低估值公司的占比。

具体看，1 季度市场先跌后涨，金属煤炭油气等上游资源品，公用事业等类红利风格板块，银行家电等低估值板块具有明显超额，近两年典型的成长方向一泛 AI 线索上的各个行业，也只有业绩兑现的光模块等部分硬件子行业具有显著超额，其余弱势。市值维度看，微盘股经历两年牛市后崩盘，反弹后波动逐渐收敛，但鲜有收回前高的公司。2 季度市场延续下跌，除五月上半月上涨之外其余窗口期市场均震荡下行。具体结构上，有色煤炭石化等上游资源品板块、银行和公用事业等低估值板块、以船舶集运为代表的交运等景气板块，以及家电和通信行业延续了年初以来的强势，电子板块受益于大基金成立等利好以及苹果 AI 手机等因素驱动反弹。其余行业均延续了年初以来弱势。2 季度与 1 季度市值风格剧烈分化主导行情的显著区别是，价值与成长风格的剧烈分化主导了市场行情。

背后的核心因素有几点，负债端没有增量资金，整体风险偏好向现金流、资产质量、估值安全边际等各方面更好的大盘价值股倾斜，宏观需求延续弱预期弱现实的局面，以 AI 为典型代表的各新兴产业始终没有能够真实落地的应用场景，实际业绩无法落地印证，成长的逻辑和预期持续变弱，以主题轮动的方式展开的过程中，中枢向下。

操作上，总仓位小幅下降，一季度下旬小微盘股反弹过程中大幅出清小市值仓位，保留汽车电子大宗品机械等核心制造业仓位，基于年季报的预期增加了绩优股的仓位，基于政策变化加仓轨交板块，基于景气度研究加仓了黄金、部分化工品种、以及船舶油运和特高压板块。减仓逻辑变弱和业绩低于预期的公司，兑现部分高位 TMT 公司。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期份额净值增长率为-8.27%，同期业绩比较基准增长率为 2.01%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在宏观经济有韧性但缺乏弹性的大背景下，虽然政策指向高质量增长，但是中小市值成长股依然缺乏优质的成长线索，后续选股的重要前提依然是资产质量和业绩兑现度、成长置信度以及合理估值。在这个前提下，具体的策略思路分为中短期和长期两个维度看，中短期上，当前处于中报业绩观察期，绩优方向是重要线索，也是挖掘景气向上业绩持续的公司的的重要印证节点，比如即将进入旺季的化纤和数据可能转正的工程机械子板块等，中长期维度上比较看好方向包括但不限于：供给刚性需求弹性的资源品、渗透率国产化率空间很大的半导体行业，产品力处于上行周期的自主品牌整车及供应链等制造业，泛 AI 线索上能够实际落地的硬件和软件应用。往更远的未来看，核心观察点在于新时代年轻人审美方向上的承接资产是什么，就是最核心的投资机会来源。

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-249,102,570.72 元，期末基金份额净值 0.7669 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

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在本托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：鹏华价值共赢两年持有期混合型证券投资基金

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	94,638,660.19	87,586,285.87
结算备付金		1,916,221.58	1,345,002.69
存出保证金		126,556.94	149,267.88
交易性金融资产	6.4.7.2	535,396,058.91	651,541,160.74
其中：股票投资		534,886,388.59	650,889,525.37
基金投资		-	-
债券投资		509,670.32	651,635.37
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		118,238.89	-
应收股利		125,418.46	23.43
应收申购款		9,796.85	34,084.16
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		632,330,951.82	740,655,824.77
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		7,513,179.92	6,876,715.62
应付赎回款		448,201.12	638,516.53
应付管理人报酬		413,555.09	502,434.29
应付托管费		103,388.76	125,608.56
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		15.29	15.98
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	1,121,035.72	1,026,631.75
负债合计		9,599,375.90	9,169,922.73
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	812,056,717.59	875,014,538.96
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-189,325,141.67	-143,528,636.92
净资产合计		622,731,575.92	731,485,902.04
负债和净资产总计		632,330,951.82	740,655,824.77

注：（1）报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.7669 元，基金份额总额 812,056,717.59 份。

(2) 报告截止日 2024 年 06 月 30 日, 基金资产净值(暂估业绩报酬前) 622,731,575.92 元, 基金份额总额 812,056,717.59 份, 基金份额净值(暂估业绩报酬前)0.7669 元。于本报告期间, 利润表未体现暂估业绩报酬金额为 3,985.57 元(可比期间: -24,494.86 元)。于 2024 年 06 月 30 日, 相关暂估业绩报酬余额为 4,723.00 元(2023 年 12 月 31 日: 737.43 元), 基金资产净值(暂估业绩报酬后) 622,726,852.92 元。该暂估业绩报酬余额是各基金份额持有人于报告期末时点的暂估业绩报酬的合计, 各基金份额持有人实际应承担的业绩报酬金额根据其持有期间的实际收益情况计算确认, 可能与上述暂估业绩报酬金额存在差异。

6.2 利润表

会计主体: 鹏华价值共赢两年持有期混合型证券投资基金

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	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-58,135,806.79	-49,098,960.76
1. 利息收入		146,258.40	331,434.22
其中: 存款利息收入	6.4.7.13	130,294.51	222,712.64
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		15,963.89	108,721.58
其他利息收入		-	-
2. 投资收益(损失以“-”填列)		-132,045,218.91	-55,376,902.56
其中: 股票投资收益	6.4.7.14	-137,705,825.92	-59,988,003.96
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	11,996.66	632.64
资产支持证券投资	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	5,648,610.35	4,610,468.76
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	73,763,153.72	5,946,507.58
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.21	-	-
减：二、营业总支出		3,304,310.90	5,339,795.44
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,551,398.80	3,965,774.21
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	637,849.73	1,239,304.45
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		10.01	2.40
8. 其他费用	6.4.7.23	115,052.36	134,714.38
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-61,440,117.69	-54,438,756.20
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-61,440,117.69	-54,438,756.20
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-61,440,117.69	-54,438,756.20

6.3 净资产变动表

会计主体：鹏华价值共赢两年持有期混合型证券投资基金

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	875,014,538.96	-	- 143,528,636.92	731,485,902.04
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

二、本期期初净资产	875,014,538.96	-	- 143,528,636.92	731,485,902.04
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-62,957,821.37	-	-45,796,504.75	-108,754,326.12
(一)、综合收益总额	-	-	-61,440,117.69	-61,440,117.69
(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)	-62,957,821.37	-	15,643,612.94	-47,314,208.43
其中：1. 基金申购款	2,607,881.26	-	-634,936.59	1,972,944.67
2. 基金赎回款	-65,565,702.63	-	16,278,549.53	-49,287,153.10
(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	812,056,717.59	-	- 189,325,141.67	622,731,575.92
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,118,699,464. 72	-	-8,177,518.69	1,110,521,946.0 3
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,118,699,464. 72	-	-8,177,518.69	1,110,521,946.0 3

三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-	-	-54,487,575.22	-211,205,869.27
	156,718,294.05			
(一)、综合收益总额	-	-	-54,438,756.20	-54,438,756.20
(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)	-	-	-48,819.02	-156,767,113.07
	156,718,294.05			
其中：1. 基金申购款	2,697,512.10	-	-52,584.16	2,644,927.94
2. 基金赎回款	-	-	3,765.14	-159,412,041.01
	159,415,806.15			
(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	961,981,170.67	-	-62,665,093.91	899,316,076.76

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

鹏华价值共赢两年持有期混合型证券投资基金(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[2020]241号《关于准予鹏华价值共赢两年持有期混合型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《鹏华价值共赢两年持有期混合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1,469,686,524.41元,

业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2020)第 0353 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华价值共赢两年持有期混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 4 月 29 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,470,239,869.71 份基金份额,其中认购资金利息折合 553,345.30 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》、《鹏华价值共赢两年持有期混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 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[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与上交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 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	94,638,660.19
等于：本金	94,630,815.52
加：应计利息	7,844.67
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	94,638,660.19

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	541,448,322.98	-	534,886,388.59	-6,561,934.39
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	446,300.00	3,521.49	59,670.32
	银行间市场	-	-	-

	合计	446,300.00	3,521.49	509,670.32	59,848.83
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
	合计	541,894,622.98	3,521.49	535,396,058.91	-6,502,085.56

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

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.8 其他资产

注：无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 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	1,021,581.82
其中：交易所市场	1,021,581.82
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	99,453.90
合计	1,121,035.72

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	875,014,538.96	875,014,538.96
本期申购	2,607,881.26	2,607,881.26
本期赎回（以“-”号填列）	-65,565,702.63	-65,565,702.63
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	812,056,717.59	812,056,717.59

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

注：无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-128,983,197.75	-14,545,439.17	-143,528,636.92
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-128,983,197.75	-14,545,439.17	-143,528,636.92
本期利润	-135,203,271.41	73,763,153.72	-61,440,117.69
本期基金份额交易产生的变动数	15,083,898.44	559,714.50	15,643,612.94
其中：基金申购款	-615,143.76	-19,792.83	-634,936.59
基金赎回款	15,699,042.20	579,507.33	16,278,549.53
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-249,102,570.72	59,777,429.05	-189,325,141.67

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	114,204.27
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	14,917.65
其他	1,172.59
合计	130,294.51

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	-137,705,825.92
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	-137,705,825.92

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	1,193,240,412.37
减：卖出股票成本总额	1,328,244,877.83
减：交易费用	2,701,360.46
买卖股票差价收入	-137,705,825.92

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	2,749.74
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	9,246.92
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	11,996.66

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	162,470.70
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	153,000.00
减：应计利息总额	217.30
减：交易费用	6.48
买卖债券差价收入	9,246.92

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	5,648,610.35
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	5,648,610.35

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	73,763,153.72

股票投资	73,754,734.32
债券投资	8,419.40
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	73,763,153.72

6.4.7.21 其他收入

注：无。

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	39,781.56
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行汇划费用	5,637.90
账户维护费	9,000.00
证券组合费	925.72
存托服务费	34.84
合计	115,052.36

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、基金注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金代销机构
国信证券股份有限公司（“国信证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
国信证券	198,366,677.00	8.51	164,428,889.67	4.59

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	163,271.73	8.50	108,624.79	10.63

关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
国信证券	135,040.98	4.55	91,194.52	5.68

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	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,551,398.80	3,965,774.21
其中：应支付销售机构的客户维护费	962,770.85	1,494,909.83
应支付基金管理人的净管理费	1,588,627.95	2,470,864.38

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。

3、业绩报酬

支付基金管理人鹏华基金的业绩报酬于基金份额持有人赎回/转出基金份额日或本基金终止日，对每笔基金份额年化收益率(R)超过 8%的部分，按比例提取业绩报酬 H2。其计算公式为：

$$R=(A-B)/C \times 365/D \times 100\%;$$

$$\text{当 } R \leq 8\% \text{ 时, } H2=0;$$

$$\text{当 } 8\% < R \leq 12\% \text{ 时, } H2=N \times (R-8\%) \times 12\% \times D/365;$$

当 $R > 12\%$ 时, $H_2 = N \times [E + (R - 12\%) \times 20\%] \times D / 365$

其中, R 为该笔基金份额的年化收益率; A 为业绩报酬计提日的基金份额累计净值; B 为业绩报酬计提起始日的基金份额累计净值; C 为业绩报酬计提起始日的基金份额单位净值; D 为业绩报酬计提起始日(不含)到本次业绩报酬计提日(含)的天数; N 为该笔基金份额业绩报酬计提起始日的资产净值; $E = (12\% - 8\%) \times 12\% = 0.48\%$ 。

每笔基金份额业绩报酬计提起始日为:

- a. 募集期内认购的基金份额, 以基金合同生效日为该笔基金份额业绩报酬计提起始日;
- b. 存续期内申购/转入的基金份额, 以申购/转入申请日为该笔基金份额业绩报酬计提起始日。

每笔基金份额业绩报酬计提日为基金份额持有人赎回/转出申请日或本基金终止运作日。

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	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	637,849.73	1,239,304.45

注: 支付基金托管人中国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 \times 0.20% / 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		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	94,638,660.19	114,204.27	147,223,019.39	195,674.11

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2024年1月1日至2024年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单 位：股/ 张）	总金额
国信证券	603325	博隆技术	网下申购	660	47,823.60
上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单 位：股/ 张）	总金额
国信证券	301488	豪恩汽电	网下申购	2,618	104,144.04
国信证券	688307	中润光学	网下申购	2,455	58,625.40
国信证券	688562	航天软件	网下申购	7,254	91,980.72

注：本表包含参与基金托管人的关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

注：无。

6.4.12 期末（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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名	成功 认购 日	受限 期	流 通 受	认购 价格	期末 估值 单价	数量 （单 位： 股）	期末 成本总额	期末估值总 额	备注

	称			限 类 型			股)			
001359	平安 电工	2024 年 3 月 19 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	17.39	20.60	184	3,199.76	3,790.40	-
001379	腾 达 科 技	2024 年 1 月 11 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	16.98	13.48	213	3,616.74	2,871.24	-
001387	雪 祺 电 气	2024 年 1 月 4 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	15.38	15.25	173	2,045.54	2,638.25	雪祺 电气 于 2024 年 6 月 3 日 每 10 股 送 3 股
001389	广 合 科 技	2024 年 3 月 26 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	-
301392	汇 成 真 空	2024 年 5 月 28 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
301502	华 阳 智 能	2024 年 1 月 26 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-
301536	星	2024	6 个月	新	16.16	32.27	481	7,772.96	15,521.87	-

	宸科技	年3月20日		股 流 通 受 限						
301538	骏鼎达	2024年3月13日	6个月	新 股 流 通 受 限	55.82	91.24	150	5,972.74	13,686.00	骏鼎达于2024年5月22日每10股送4股
301539	宏鑫科技	2024年4月3日	6个月	新 股 流 通 受 限	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-
301565	中仑新材	2024年6月13日	6个月	新 股 流 通 受 限	11.88	18.98	711	8,446.68	13,494.78	-
301566	达利凯普	2023年12月22日	6个月	新 股 流 通 受 限	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-
301580	爱迪特	2024年6月19日	6个月	新 股 流 通 受 限	44.95	65.93	202	9,079.90	13,317.86	-
301587	中瑞股份	2024年3月27日	6个月	新 股 流 通 受 限	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	-

301588	美新科技	2024年3月6日	6个月	新股流通受限	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-
301589	诺瓦星云	2024年2月1日	6个月	新股流通受限	126.89	188.01	959	67,632.37	180,301.59	诺瓦星云于2024年5月30日每10股送8股
301591	肯特股份	2024年2月20日	6个月	新股流通受限	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-
601033	永兴股份	2024年1月11日	6个月	新股流通受限	16.20	15.96	799	12,943.80	12,752.04	-
603082	北自科技	2024年1月23日	6个月	新股流通受限	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	-
603285	键邦股份	2024年6月28日	1个月内(含)	新股未上市	18.65	18.65	1,158	21,596.70	21,596.70	-
603285	键邦股份	2024年6月28日	6个月	新股流通受限	18.65	18.65	129	2,405.85	2,405.85	-

				限						
603312	西典新能	2024年1月4日	6个月	新股流通受限	29.02	25.36	130	3,772.60	3,296.80	-
603325	博隆技术	2024年1月3日	6个月	新股流通受限	72.46	68.06	66	4,782.36	4,491.96	-
603341	龙旗科技	2024年2月23日	6个月	新股流通受限	26.00	37.49	277	7,202.00	10,384.73	-
603344	星德胜	2024年3月13日	6个月	新股流通受限	19.18	22.66	182	3,490.76	4,124.12	-
603350	安乃达	2024年6月26日	1个月内(含)	新股未上市	20.56	20.56	945	19,429.20	19,429.20	-
603350	安乃达	2024年6月26日	6个月	新股流通受限	20.56	20.56	106	2,179.36	2,179.36	-
603375	盛景微	2024年1月17日	6个月	新股流通受限	38.18	38.90	72	2,748.96	2,800.80	-
603381	永臻	2024年6月	6个月	新股	23.35	25.13	178	4,156.30	4,473.14	-

	股份	月 19 日		流通受限						
688530	欧莱新材	2024 年 4 月 29 日	6 个月	新股流通受限	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-
688584	上海合晶	2024 年 2 月 1 日	6 个月	新股流通受限	22.66	15.89	677	15,340.82	10,757.53	-
688691	灿芯股份	2024 年 4 月 2 日	6 个月	新股流通受限	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-
688692	达梦数据	2024 年 6 月 4 日	6 个月	新股流通受限	86.96	174.93	175	15,218.00	30,612.75	-
688695	中创股份	2024 年 3 月 6 日	6 个月	新股流通受限	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
688709	成都华微	2024 年 1 月 31 日	6 个月	新股流通受限	15.69	18.79	742	11,641.98	13,942.18	-

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

之间不能自由转让。

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

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

4、基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后 6 个月内不得转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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

本基金为混合型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括境内依法发行的股票（包含中小板、创业板、科创板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（含国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券等）、债券回购、银行存款、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）。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，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，将风险控制可在承受的范围之内。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。下列表格列示中不含国债、央行票据、政策性金融债券等非信用债券投资。

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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日

AAA	-	-
AAA 以下	509,670.32	651,635.37
未评级	-	-
合计	509,670.32	651,635.37

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。

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

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市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。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	94,638,660.19	-	-	-	94,638,660.19
结算备付金	1,916,221.58	-	-	-	1,916,221.58
存出保证金	126,556.94	-	-	-	126,556.94
交易性金融资产	-	509,670.32	-	534,886,388.59	535,396,058.91
应收股利	-	-	-	125,418.46	125,418.46
应收申购款	-	-	-	9,796.85	9,796.85
应收清算款	-	-	-	118,238.89	118,238.89
资产总计	96,681,438.71	509,670.32	-	535,139,842.79	632,330,951.82
负债					
应付赎回款	-	-	-	448,201.12	448,201.12
应付管理人报酬	-	-	-	413,555.09	413,555.09
应付托管费	-	-	-	103,388.76	103,388.76
应付清算款	-	-	-	7,513,179.92	7,513,179.92
应交税费	-	-	-	15.29	15.29
其他负债	-	-	-	1,121,035.72	1,121,035.72
负债总计	-	-	-	9,599,375.90	9,599,375.90
利率敏感度缺口	96,681,438.71	509,670.32	-	525,540,466.89	622,731,575.92
上年度末 2023年12月31日					
资产					
货币资金	87,586,285.87	-	-	-	87,586,285.87
结算备付金	1,345,002.69	-	-	-	1,345,002.69
存出保证金	149,267.88	-	-	-	149,267.88
交易性金融资产	-	651,635.37	-	650,889,525.37	651,541,160.74
应收股利	-	-	-	23.43	23.43
应收申购款	-	-	-	34,084.16	34,084.16
资产总计	89,080,556.44	651,635.37	-	650,923,632.96	740,655,824.77
负债					

应付赎回款	-	-	-	638,516.53	638,516.53
应付管理人报酬	-	-	-	502,434.29	502,434.29
应付托管费	-	-	-	125,608.56	125,608.56
应付清算款	-	-	-	6,876,715.62	6,876,715.62
应交税费	-	-	-	15.98	15.98
其他负债	-	-	-	1,026,631.75	1,026,631.75
负债总计	-	-	-	9,169,922.73	9,169,922.73
利率敏感度缺口	89,080,556.44	651,635.37	-	-641,753,710.23	731,485,902.04

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 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 0.08%，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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇风险进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
交易性金融资产	-	18,755,681.31	-	18,755,681.31
资产合计	-	18,755,681.31	-	18,755,681.31
以外币计价的 负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口净额	-	18,755,681.31	-	18,755,681.31
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日			
	美元	港币	其他币种	合计

	折合人民币元	折合人民币元	折合人民币元	
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	31,980,374.71	-	31,980,374.71
资产合计	-	31,980,374.71	-	31,980,374.71
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	31,980,374.71	-	31,980,374.71

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以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）
	人民币升值 5%	937,784.07	1,599,018.74
	人民币贬值 5%	-937,784.07	-1,599,018.74

注：无。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券投资品种，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。基金的投资组合比例为：股票（含存托凭证）资产占基金资产的比例为 60%—95%（其中，投资于港股通标的股票占股票资产的比例不超过 50%）；

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，基金保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例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。

如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	534,886,388.59	85.89	650,889,525.37	88.98
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	509,670.32	0.08	651,635.37	0.09
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	535,396,058.91	85.97	651,541,160.74	89.07

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	32,400,723.90	31,439,264.07
	比较基准下降 5%	-32,400,723.90	-31,439,264.07

	资产净值变动		
--	--------	--	--

注：无。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年6月30日
第一层次	534,921,892.09
第二层次	45,611.11
第三层次	428,555.71
合计	535,396,058.91

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	534,886,388.59	84.59
	其中：股票	534,886,388.59	84.59
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	509,670.32	0.08
	其中：债券	509,670.32	0.08
	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	96,554,881.77	15.27
8	其他各项资产	380,011.14	0.06
9	合计	632,330,951.82	100.00

注：1、本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 18,755,681.31 元，占净值比 3.01%。

2、报告期末本基金投资的存托凭证公允价值为：61,067.79 元，占净值比 0.01%。本报告所指的“股票”均包含存托凭证。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末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	10,737,962.40	1.72
B	采矿业	67,144,117.95	10.78
C	制造业	342,564,089.92	55.01

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,371,090.35	2.63
E	建筑业	5,502,041.38	0.88
F	批发和零售业	1,649,699.88	0.26
G	交通运输、仓储和邮政业	25,168,886.34	4.04
H	住宿和餐饮业	160,158.00	0.03
I	信息传输、软件和信息技术服务业	28,240,001.09	4.53
J	金融业	15,152,686.30	2.43
K	房地产业	2,032,845.00	0.33
L	租赁和商务服务业	178,844.24	0.03
M	科学研究和技术服务业	504,474.13	0.08
N	水利、环境和公共设施管理业	308,402.65	0.05
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	67,630.65	0.01
R	文化、体育和娱乐业	261,889.00	0.04
S	综合	85,888.00	0.01
	合计	516,130,707.28	82.88

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
原材料	-	-
金融	-	-
能源	-	-
非日常生活消费品	11,990,492.92	1.93
日常消费品	-	-
医疗保健	907,728.62	0.15
信息技术	-	-
通信服务	1,347.85	0.00
房地产	-	-
工业	5,856,111.92	0.94
公用事业	-	-
合计	18,755,681.31	3.01

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000338	潍柴动力	1,208,200	19,621,168.00	3.15
2	600150	中国船舶	457,000	18,604,470.00	2.99
3	000528	柳工	1,659,100	18,565,329.00	2.98

4	603129	春风动力	115,100	16,383,334.00	2.63
5	000400	许继电气	420,400	14,465,964.00	2.32
6	601899	紫金矿业	727,800	12,787,446.00	2.05
7	002648	卫星化学	700,239	12,590,297.22	2.02
8	688617	惠泰医疗	25,361	11,567,152.10	1.86
9	688575	亚辉龙	483,420	11,273,354.40	1.81
10	000682	东方电子	913,400	10,083,936.00	1.62
11	601872	招商轮船	1,175,960	9,936,862.00	1.60
12	600031	三一重工	597,800	9,863,700.00	1.58
13	601989	中国重工	1,910,000	9,416,300.00	1.51
14	002920	德赛西威	104,207	9,075,387.63	1.46
15	600547	山东黄金	326,700	8,945,046.00	1.44
16	300498	温氏股份	435,920	8,639,934.40	1.39
17	601766	中国中车	1,132,700	8,506,577.00	1.37
18	603920	世运电路	430,700	8,502,018.00	1.37
19	600938	中国海油	254,600	8,401,800.00	1.35
20	603606	东方电缆	171,900	8,390,439.00	1.35
21	601179	中国西电	1,038,600	8,350,344.00	1.34
22	601666	平煤股份	732,200	8,200,640.00	1.32
23	600066	宇通客车	309,200	7,977,360.00	1.28
24	000975	银泰黄金	468,200	7,626,978.00	1.22
25	603225	新风鸣	457,100	7,126,189.00	1.14
26	600487	亨通光电	435,900	6,874,143.00	1.10
27	688009	中国通号	1,103,712	6,622,272.00	1.06
28	601006	大秦铁路	876,600	6,276,456.00	1.01
29	603766	隆鑫通用	897,900	6,087,762.00	0.98
30	01199	中远海运港口	1,190,000	5,854,020.79	0.94
31	603236	移远通信	124,700	5,827,231.00	0.94
32	601808	中海油服	338,700	5,825,640.00	0.94
33	002142	宁波银行	241,250	5,321,975.00	0.85
34	002322	理工能科	329,400	5,276,988.00	0.85
35	603993	洛阳钼业	620,700	5,275,950.00	0.85
36	02333	长城汽车	471,392	5,179,969.81	0.83
36	601633	长城汽车	2,558	64,717.40	0.01
37	600027	华电国际	755,300	5,241,782.00	0.84
38	603179	新泉股份	127,500	5,003,100.00	0.80
39	000425	徐工机械	686,900	4,911,335.00	0.79
40	003816	中国广核	996,200	4,612,406.00	0.74
41	002241	歌尔股份	235,200	4,588,752.00	0.74
42	601838	成都银行	301,900	4,585,861.00	0.74
43	000902	新洋丰	383,100	4,547,397.00	0.73
44	600426	华鲁恒升	160,900	4,286,376.00	0.69
45	001286	陕西能源	359,467	4,144,654.51	0.67

46	002371	北方华创	12,900	4,126,581.00	0.66
47	600309	万华化学	50,900	4,115,774.00	0.66
48	300308	中际旭创	28,920	3,987,489.60	0.64
49	600312	平高电气	200,800	3,905,560.00	0.63
50	603997	继峰股份	375,800	3,844,434.00	0.62
51	603067	振华股份	312,700	3,646,082.00	0.59
52	601919	中远海控	232,300	3,598,327.00	0.58
53	600233	圆通速递	221,400	3,464,910.00	0.56
54	688192	迪哲医药-U	91,965	3,387,990.60	0.54
55	002594	比亚迪	13,100	3,278,275.00	0.53
56	01585	雅迪控股	358,000	3,224,918.27	0.52
57	603809	豪能股份	384,372	3,105,725.76	0.50
58	002517	恺英网络	316,600	3,023,530.00	0.49
59	300049	福瑞股份	59,300	2,985,162.00	0.48
60	600919	江苏银行	394,200	2,928,906.00	0.47
61	000977	浪潮信息	80,100	2,913,237.00	0.47
62	600933	爱柯迪	191,200	2,827,848.00	0.45
63	02015	理想汽车-W	43,400	2,784,604.93	0.45
64	002332	仙琚制药	243,800	2,781,758.00	0.45
65	601918	新集能源	283,900	2,768,025.00	0.44
66	000529	广弘控股	430,500	2,531,340.00	0.41
67	300818	耐普矿机	97,020	2,474,010.00	0.40
68	300502	新易盛	20,000	2,111,000.00	0.34
69	600023	浙能电力	291,700	2,073,987.00	0.33
70	605296	神农集团	58,300	2,049,245.00	0.33
71	300298	三诺生物	80,500	2,039,870.00	0.33
72	002997	瑞鹄模具	62,857	2,009,538.29	0.32
73	603596	伯特利	50,734	1,973,552.60	0.32
74	600968	海油发展	468,200	1,928,984.00	0.31
75	600845	宝信软件	59,400	1,896,642.00	0.30
76	600761	安徽合力	87,100	1,884,844.00	0.30
77	002185	华天科技	229,581	1,871,085.15	0.30
78	601390	中国中铁	285,300	1,860,156.00	0.30
79	001267	汇绿生态	352,900	1,859,783.00	0.30
80	601601	中国太保	66,700	1,858,262.00	0.30
81	001979	招商蛇口	211,400	1,858,206.00	0.30
82	002128	电投能源	84,400	1,780,840.00	0.29
83	688498	源杰科技	13,446	1,761,291.54	0.28
84	600096	云天化	88,400	1,716,728.00	0.28
85	000625	长安汽车	119,000	1,598,170.00	0.26
86	688692	达梦数据	6,292	1,403,145.21	0.23
87	688111	金山办公	6,008	1,366,820.00	0.22
88	600667	太极实业	230,000	1,313,300.00	0.21

89	603871	嘉友国际	70,900	1,254,221.00	0.20
90	688408	中信博	13,399	1,233,779.92	0.20
91	300760	迈瑞医疗	4,200	1,221,822.00	0.20
92	002373	千方科技	132,700	1,203,589.00	0.19
93	601225	陕西煤业	46,400	1,195,728.00	0.19
94	002837	英维克	54,078	1,156,728.42	0.19
95	600985	淮北矿业	65,900	1,103,166.00	0.18
96	600566	济川药业	29,900	948,129.00	0.15
97	688256	寒武纪-U	4,751	943,881.17	0.15
98	000034	神州数码	40,400	924,756.00	0.15
99	02269	药明生物	86,185	907,728.62	0.15
100	09868	小鹏汽车-W	29,700	800,999.91	0.13
101	301345	涛涛车业	12,752	702,635.20	0.11
102	300858	科拓生物	38,296	563,717.12	0.09
103	688668	鼎通科技	9,885	388,381.65	0.06
104	605117	德业股份	3,400	252,756.00	0.04
105	600486	扬农化工	3,900	220,155.00	0.04
106	301589	诺瓦星云	959	180,301.59	0.03
107	000957	中通客车	16,500	173,580.00	0.03
108	600941	中国移动	1,600	172,000.00	0.03
109	601318	中国平安	4,100	169,576.00	0.03
110	600021	上海电力	15,700	155,273.00	0.02
111	301580	爱迪特	2,018	153,513.06	0.02
112	688536	思瑞浦	1,549	151,507.69	0.02
113	601728	中国电信	24,500	150,675.00	0.02
114	603501	韦尔股份	1,500	149,055.00	0.02
115	603893	瑞芯微	2,500	147,925.00	0.02
116	600301	华锡有色	7,300	147,606.00	0.02
117	688235	百济神州-U	1,272	147,348.48	0.02
118	603108	润达医疗	9,700	146,858.00	0.02
119	600482	中国动力	7,400	144,152.00	0.02
120	688418	震有科技	8,381	143,566.53	0.02
121	601000	唐山港	30,500	143,350.00	0.02
122	688709	成都华微	7,418	142,922.50	0.02
123	688187	时代电气	2,890	142,708.20	0.02
124	688337	普源精电	5,600	141,232.00	0.02
125	600050	中国联通	30,000	141,000.00	0.02
126	601128	常熟银行	18,480	139,893.60	0.02
127	688522	纳睿雷达	2,905	136,186.40	0.02
128	301370	国科恒泰	12,395	134,733.65	0.02
129	601898	中煤能源	10,700	133,536.00	0.02
130	688008	澜起科技	2,326	132,954.16	0.02
131	688027	国盾量子	871	131,521.00	0.02

132	600019	宝钢股份	19,700	131,005.00	0.02
133	603301	振德医疗	6,223	129,811.78	0.02
134	601033	永兴股份	7,982	129,044.81	0.02
135	688025	杰普特	3,185	128,642.15	0.02
136	600988	赤峰黄金	7,700	125,818.00	0.02
137	600075	新疆天业	36,300	125,235.00	0.02
138	688208	道通科技	5,041	121,689.74	0.02
139	301439	泓淋电力	9,486	120,187.62	0.02
140	688139	海尔生物	3,141	116,845.20	0.02
141	688166	博瑞医药	3,317	116,095.00	0.02
142	603986	兆易创新	1,200	114,744.00	0.02
143	301371	敷尔佳	3,645	113,213.70	0.02
144	600276	恒瑞医药	2,920	112,303.20	0.02
145	600760	中航沈飞	2,800	112,280.00	0.02
146	688584	上海合晶	6,770	110,987.38	0.02
147	688562	航天软件	7,254	110,768.58	0.02
148	301251	威尔高	3,207	110,417.01	0.02
149	301393	昊帆生物	2,597	110,294.59	0.02
150	601233	桐昆股份	6,900	110,124.00	0.02
151	603341	龙旗科技	2,767	107,444.93	0.02
152	002635	安洁科技	6,953	107,354.32	0.02
153	301559	中集环科	7,323	106,696.11	0.02
154	603529	爱玛科技	3,900	106,587.00	0.02
155	600475	华光环能	12,200	106,262.00	0.02
156	301456	盘古智能	4,061	105,951.49	0.02
157	600690	海尔智家	3,700	105,006.00	0.02
158	301529	福赛科技	3,182	104,401.42	0.02
159	688625	呈和科技	2,865	104,171.40	0.02
160	301548	崇德科技	1,959	103,983.72	0.02
161	603730	岱美股份	10,420	103,574.80	0.02
162	688249	晶合集成	7,029	103,115.43	0.02
163	601689	拓普集团	1,900	101,859.00	0.02
164	603208	江山欧派	5,320	101,824.80	0.02
165	601699	潞安环能	5,600	101,528.00	0.02
166	600141	兴发集团	5,300	101,124.00	0.02
167	600699	均胜电子	6,800	100,776.00	0.02
168	603380	易德龙	5,000	100,400.00	0.02
169	600422	昆药集团	5,600	99,848.00	0.02
170	603279	景津装备	4,600	99,774.00	0.02
171	603368	柳药集团	5,700	99,750.00	0.02
172	601702	华峰铝业	5,400	98,604.00	0.02
173	688484	南芯科技	2,650	98,315.00	0.02
174	600418	江淮汽车	6,200	98,208.00	0.02

175	688099	晶晨股份	1,647	97,700.04	0.02
176	301566	达利凯普	5,755	97,662.35	0.02
177	601555	东吴证券	16,500	97,350.00	0.02
178	001389	广合科技	2,219	97,078.01	0.02
179	301320	豪江智能	6,416	96,368.32	0.02
180	600602	云赛智联	8,700	96,048.00	0.02
181	688630	芯碁微装	1,533	95,919.81	0.02
182	688593	新相微	9,584	95,840.00	0.02
183	600887	伊利股份	3,700	95,608.00	0.02
184	601668	中国建筑	17,900	95,049.00	0.02
185	600012	皖通高速	6,800	94,996.00	0.02
186	600131	国网信通	5,600	94,472.00	0.02
187	688205	德科立	3,268	94,151.08	0.02
188	688472	阿特斯	9,107	92,709.26	0.01
189	301539	宏鑫科技	3,607	92,654.66	0.01
190	600266	城建发展	24,600	92,004.00	0.01
191	688085	三友医疗	5,351	90,431.90	0.01
192	688072	拓荆科技	752	90,322.72	0.01
193	301408	华人健康	8,784	89,860.32	0.01
194	601020	华钰矿业	7,000	89,600.00	0.01
195	601866	中远海发	34,700	89,526.00	0.01
196	688049	炬芯科技	4,043	89,431.16	0.01
197	301587	中瑞股份	3,056	89,267.06	0.01
198	600258	首旅酒店	7,200	88,920.00	0.01
199	301376	致欧科技	4,192	88,744.64	0.01
200	688581	安杰思	1,812	88,661.16	0.01
201	601600	中国铝业	11,600	88,508.00	0.01
202	301329	信音电子	4,577	88,473.41	0.01
203	601168	西部矿业	4,900	87,955.00	0.01
204	688550	瑞联新材	3,773	87,495.87	0.01
205	688433	华曙高科	4,171	87,007.06	0.01
206	603358	华达科技	3,000	86,550.00	0.01
207	601965	中国汽研	5,100	86,139.00	0.01
208	603379	三美股份	2,200	86,108.00	0.01
209	600673	东阳光	12,200	85,888.00	0.01
210	688627	精智达	1,850	85,877.00	0.01
211	301357	北方长龙	2,660	85,864.80	0.01
212	600707	彩虹股份	12,600	85,806.00	0.01
213	603416	信捷电气	3,000	85,740.00	0.01
214	688391	钜泉科技	2,938	85,701.46	0.01
215	688114	华大智造	1,805	85,575.05	0.01
216	600480	凌云股份	8,700	85,521.00	0.01
217	688595	芯海科技	2,847	85,410.00	0.01

218	688579	山大地纬	10,880	85,408.00	0.01
219	603163	圣晖集成	3,300	85,140.00	0.01
220	688062	迈威生物-U	2,940	85,083.60	0.01
221	002790	瑞尔特	9,400	84,882.00	0.01
222	603297	永新光学	1,400	84,686.00	0.01
223	600583	海油工程	14,300	84,513.00	0.01
224	601088	中国神华	1,900	84,303.00	0.01
225	600188	兖矿能源	3,700	84,101.00	0.01
226	600529	山东药玻	3,300	83,622.00	0.01
227	688653	康希通信	6,478	83,436.64	0.01
228	603650	彤程新材	2,800	82,740.00	0.01
229	688639	华恒生物	1,083	82,730.37	0.01
230	688620	安凯微	10,157	82,677.98	0.01
231	688036	传音控股	1,071	81,974.34	0.01
232	301202	朗威股份	3,060	81,885.60	0.01
233	301419	阿莱德	3,292	81,740.36	0.01
234	688602	康鹏科技	10,653	81,708.51	0.01
235	601083	锦江航运	8,546	81,699.76	0.01
236	688416	恒烁股份	2,147	81,521.59	0.01
237	688772	珠海冠宇	5,466	81,443.40	0.01
238	000032	深桑达 A	5,400	80,892.00	0.01
239	600262	北方股份	4,900	80,507.00	0.01
240	301500	飞南资源	4,550	79,397.50	0.01
241	603112	华翔股份	7,500	78,825.00	0.01
242	603035	常熟汽饰	6,200	78,616.00	0.01
243	603135	中重科技	6,273	78,600.69	0.01
244	688439	振华风光	1,182	78,543.90	0.01
245	601799	星宇股份	700	78,428.00	0.01
246	301568	思泰克	2,456	78,149.92	0.01
247	600585	海螺水泥	3,300	77,847.00	0.01
248	688376	美埃科技	2,460	77,145.60	0.01
249	300884	狄耐克	8,900	76,718.00	0.01
250	002493	荣盛石化	7,900	76,314.00	0.01
251	605377	华旺科技	5,740	76,055.00	0.01
252	688533	上声电子	2,933	75,876.71	0.01
253	601065	江盐集团	8,748	75,845.16	0.01
254	301281	科源制药	3,366	75,566.70	0.01
255	688351	微电生理-U	3,421	75,398.84	0.01
256	603190	亚通精工	3,270	75,079.20	0.01
257	600536	中国软件	2,500	74,800.00	0.01
258	688582	芯动联科	2,655	74,764.80	0.01
259	301315	威士顿	2,253	73,425.27	0.01
260	301261	恒工精密	1,973	73,139.11	0.01

261	301519	舜禹股份	4,414	73,095.84	0.01
262	605088	冠盛股份	3,500	72,940.00	0.01
263	601001	晋控煤业	4,400	72,688.00	0.01
264	688032	禾迈股份	632	72,540.96	0.01
265	601865	福莱特	3,600	72,360.00	0.01
266	603507	振江股份	2,200	72,204.00	0.01
267	301292	海科新源	5,824	72,042.88	0.01
268	301323	新莱福	2,277	71,907.66	0.01
269	605016	百龙创园	3,510	71,498.70	0.01
270	688017	绿的谐波	870	71,427.00	0.01
271	688361	中科飞测	1,507	71,281.10	0.01
272	600754	锦江酒店	3,100	71,238.00	0.01
273	601133	柏诚股份	6,632	70,896.08	0.01
274	688120	华海清科	373	70,713.34	0.01
275	600820	隧道股份	10,800	70,524.00	0.01
276	688488	艾迪药业	6,862	70,129.64	0.01
277	688676	金盘科技	1,338	69,776.70	0.01
278	688686	奥普特	1,085	69,472.55	0.01
279	603102	百合股份	2,300	69,253.00	0.01
280	603885	吉祥航空	6,300	69,237.00	0.01
281	688530	欧莱新材	3,437	69,099.55	0.01
282	601975	招商南油	19,200	68,928.00	0.01
283	688728	格科微	5,665	68,603.15	0.01
284	688646	逸飞激光	2,190	68,349.90	0.01
285	688608	恒玄科技	465	68,066.70	0.01
286	688401	路维光电	2,563	67,150.60	0.01
287	688702	盛科通信-U	1,652	66,906.00	0.01
288	301518	长华化学	3,850	66,720.50	0.01
289	603103	横店影视	4,800	66,432.00	0.01
290	688648	中邮科技	3,025	66,066.00	0.01
291	301520	万邦医药	1,596	66,042.48	0.01
292	688501	青达环保	4,813	65,841.84	0.01
293	688373	盟科药业-U	15,013	65,306.55	0.01
294	600373	中文传媒	4,400	65,296.00	0.01
295	688601	力芯微	1,492	65,185.48	0.01
296	301170	锡南科技	2,496	65,020.80	0.01
297	601155	新城控股	7,300	64,751.00	0.01
298	600733	北汽蓝谷	8,000	64,640.00	0.01
299	688232	新点软件	3,271	64,504.12	0.01
300	688362	甬矽电子	3,309	64,393.14	0.01
301	688110	东芯股份	3,359	64,056.13	0.01
302	688377	迪威尔	4,885	63,993.50	0.01
303	600089	特变电工	4,600	63,802.00	0.01

304	600984	建设机械	26,800	63,784.00	0.01
305	300552	万集科技	1,700	63,546.00	0.01
306	600201	生物股份	8,800	63,448.00	0.01
307	301555	惠柏新材	2,235	63,317.55	0.01
308	301528	多浦乐	1,478	63,317.52	0.01
309	688695	中创股份	1,856	63,082.50	0.01
310	301373	凌玮科技	2,764	63,019.20	0.01
311	688458	美芯晟	2,330	62,444.00	0.01
312	603052	可川科技	2,212	62,267.80	0.01
313	300394	天孚通信	700	61,894.00	0.01
314	601801	皖新传媒	8,900	61,677.00	0.01
315	603918	金桥信息	5,900	61,655.00	0.01
316	689009	九号公司-WD	1,659	61,067.79	0.01
317	688100	威胜信息	1,579	60,238.85	0.01
318	688191	智洋创新	3,555	60,186.15	0.01
319	603197	保隆科技	1,900	59,850.00	0.01
320	301295	美硕科技	3,004	59,809.64	0.01
321	688526	科前生物	4,070	59,788.30	0.01
322	603303	得邦照明	5,200	59,696.00	0.01
323	301588	美新科技	2,568	59,238.22	0.01
324	688429	时创能源	3,452	58,476.88	0.01
325	301505	苏州规划	1,934	58,020.00	0.01
326	688012	中微公司	410	57,916.60	0.01
327	603727	博迈科	4,400	57,904.00	0.01
328	688088	虹软科技	2,003	57,806.58	0.01
329	688590	新致软件	4,479	57,779.10	0.01
330	603786	科博达	900	57,735.00	0.01
331	300056	中创环保	7,200	57,240.00	0.01
332	600584	长电科技	1,800	57,078.00	0.01
333	603486	科沃斯	1,200	56,616.00	0.01
334	688716	中研股份	2,668	56,561.60	0.01
335	688279	峰昭科技	510	56,559.00	0.01
336	603728	鸣志电器	1,400	56,322.00	0.01
337	600456	宝钛股份	2,200	56,166.00	0.01
338	603193	润本股份	3,022	55,574.58	0.01
339	600446	金证股份	5,500	54,615.00	0.01
340	688596	正帆科技	1,646	54,318.00	0.01
341	688006	杭可科技	3,101	54,112.45	0.01
342	301355	南王科技	5,624	53,934.16	0.01
343	002459	晶澳科技	4,804	53,804.80	0.01
344	603496	恒为科技	2,200	53,790.00	0.01
345	301502	华阳智能	1,375	53,673.83	0.01
346	688479	友车科技	3,318	52,723.02	0.01

347	600850	电科数字	2,900	52,490.00	0.01
348	600803	新奥股份	2,500	52,000.00	0.01
349	603119	浙江荣泰	2,929	51,901.88	0.01
350	688031	星环科技-U	1,412	51,834.52	0.01
351	688551	科威尔	1,643	51,754.50	0.01
352	688326	经纬恒润-W	894	51,253.02	0.01
353	603799	华友钴业	2,300	50,899.00	0.01
354	688307	中润光学	2,455	50,793.95	0.01
355	601021	春秋航空	900	50,697.00	0.01
356	605333	沪光股份	1,800	50,130.00	0.01
357	603032	德新科技	4,380	50,063.40	0.01
358	688592	司南导航	1,215	50,033.70	0.01
359	688387	信科移动-U	9,904	49,916.16	0.01
360	688409	富创精密	1,339	49,462.66	0.01
361	603381	永臻股份	1,778	49,273.14	0.01
362	300723	一品红	2,500	49,125.00	0.01
363	301157	华塑科技	1,498	48,834.80	0.01
364	600975	新五丰	6,900	48,783.00	0.01
365	001378	德冠新材	2,044	48,769.84	0.01
366	600132	重庆啤酒	800	48,560.00	0.01
367	002334	英威腾	8,100	48,438.00	0.01
368	600546	山煤国际	3,300	48,246.00	0.01
369	688612	威迈斯	1,815	48,224.55	0.01
370	000516	国际医学	10,300	48,204.00	0.01
371	603300	华铁应急	8,700	47,502.00	0.01
372	601678	滨化股份	13,600	47,328.00	0.01
373	601137	博威合金	3,100	47,244.00	0.01
374	688131	皓元医药	2,465	47,155.45	0.01
375	688315	诺禾致源	4,304	46,999.68	0.01
376	688150	莱特光电	2,417	46,889.80	0.01
377	605266	健之佳	1,800	46,710.00	0.01
378	688516	奥特维	1,116	46,659.96	0.01
379	688325	赛微微电	1,486	46,615.82	0.01
380	603107	上海汽配	2,920	46,398.80	0.01
381	688270	臻镭科技	1,772	46,249.20	0.01
382	688425	铁建重工	12,552	46,191.36	0.01
383	603629	利通电子	2,500	46,150.00	0.01
384	603950	长源东谷	3,400	45,832.00	0.01
385	603233	大参林	3,200	45,760.00	0.01
386	301301	川宁生物	3,574	45,675.72	0.01
387	603325	博隆技术	660	45,347.28	0.01
388	600925	苏能股份	8,960	45,248.00	0.01
389	688691	灿芯股份	895	45,167.97	0.01

390	603278	大业股份	7,200	44,712.00	0.01
391	300188	国投智能	4,003	44,473.33	0.01
392	688029	南微医学	719	44,261.64	0.01
393	688358	祥生医疗	1,700	44,149.00	0.01
394	301515	港通医疗	2,294	43,907.16	0.01
395	600079	人福医药	2,500	42,925.00	0.01
396	603344	星德胜	1,813	42,892.99	0.01
397	603151	邦基科技	3,700	42,698.00	0.01
398	603383	顶点软件	1,320	42,332.40	0.01
399	603556	海兴电力	900	42,147.00	0.01
400	300634	彩讯股份	2,500	42,075.00	0.01
401	688502	茂莱光学	449	41,761.49	0.01
402	601958	金铂股份	4,000	41,640.00	0.01
403	603348	文灿股份	1,500	41,535.00	0.01
404	603009	北特科技	2,300	41,239.00	0.01
405	003000	劲仔食品	3,400	40,970.00	0.01
406	688071	华依科技	1,886	40,869.62	0.01
407	001359	平安电工	1,833	40,513.63	0.01
408	603161	科华控股	2,700	40,419.00	0.01
409	688197	首药控股-U	919	40,123.54	0.01
410	600963	岳阳林纸	10,900	40,003.00	0.01
411	603019	中科曙光	960	39,840.00	0.01
412	603125	常青科技	2,314	39,823.94	0.01
413	301358	湖南裕能	1,259	39,608.14	0.01
414	603270	金帝股份	1,943	38,549.12	0.01
415	603717	天域生态	6,300	38,178.00	0.01
416	688116	天奈科技	1,653	38,151.24	0.01
417	603220	中贝通信	1,400	38,024.00	0.01
418	603040	新坐标	1,900	37,867.00	0.01
419	605090	九丰能源	1,300	37,700.00	0.01
420	603062	麦加芯彩	1,132	37,593.72	0.01
421	688201	信安世纪	3,170	37,437.70	0.01
422	688496	清越科技	4,030	37,237.20	0.01
423	688591	泰凌微	1,902	37,184.10	0.01
424	600489	中金黄金	2,500	37,000.00	0.01
425	001328	登康口腔	1,445	36,558.50	0.01
426	688682	霍莱沃	1,237	36,293.58	0.01
427	688052	纳芯微	352	36,178.56	0.01
428	002536	飞龙股份	3,800	36,176.00	0.01
429	601595	上海电影	1,800	35,604.00	0.01
430	001326	联域股份	986	35,357.96	0.01
431	603259	药明康德	900	35,271.00	0.01
432	603806	福斯特	2,380	34,986.00	0.01

433	603097	江苏华辰	1,300	34,476.00	0.01
434	600176	中国巨石	3,100	34,255.00	0.01
435	001319	铭科精技	2,100	34,230.00	0.01
436	601916	浙商银行	12,400	34,224.00	0.01
437	001306	夏厦精密	631	34,067.69	0.01
438	603508	思维列控	1,800	33,750.00	0.01
439	603533	掌阅科技	1,800	33,606.00	0.01
440	688045	必易微	1,111	33,407.77	0.01
441	603312	西典新能	1,296	33,263.00	0.01
442	688048	长光华芯	1,057	33,020.68	0.01
443	603004	鼎龙科技	1,948	33,018.60	0.01
444	601928	凤凰传媒	3,000	32,880.00	0.01
445	688169	石头科技	83	32,585.80	0.01
446	603273	天元智能	1,772	32,516.20	0.01
447	603087	甘李药业	700	32,424.00	0.01
448	603082	北自科技	1,070	32,276.55	0.01
449	002400	省广集团	6,600	32,010.00	0.01
450	603075	热威股份	1,812	31,981.80	0.01
451	600011	华能国际	3,300	31,746.00	0.01
452	600809	山西汾酒	149	31,421.12	0.01
453	688507	索辰科技	638	31,006.80	0.00
454	688359	三孚新科	761	30,440.00	0.00
455	301095	广立微	740	30,428.80	0.00
456	600955	维远股份	2,100	30,261.00	0.00
457	688152	麒麟信安	774	29,969.28	0.00
458	001379	腾达科技	2,128	29,183.34	0.00
459	001282	三联锻造	1,045	28,956.95	0.00
460	301156	美农生物	2,348	28,692.56	0.00
461	002532	天山铝业	3,500	28,385.00	0.00
462	603375	盛景微	714	28,339.56	0.00
463	688238	和元生物	6,094	28,215.22	0.00
464	603281	江瀚新材	1,208	27,119.60	0.00
465	301526	国际复材	8,070	26,873.10	0.00
466	001387	雪祺电气	1,729	26,756.25	0.00
467	688535	华海诚科	389	26,654.28	0.00
468	002840	华统股份	1,600	26,544.00	0.00
469	688023	安恒信息	660	26,406.60	0.00
470	688680	海优新材	913	26,239.62	0.00
471	001239	永达股份	1,887	26,191.56	0.00
472	688053	思科瑞	1,063	26,171.06	0.00
473	603305	旭升集团	2,400	25,344.00	0.00
474	688435	英方软件	1,013	25,284.48	0.00
475	301498	乖宝宠物	465	25,017.00	0.00

476	688066	航天宏图	1,402	24,955.60	0.00
477	605020	永和股份	1,300	24,934.00	0.00
478	001358	兴欣新材	1,214	24,911.28	0.00
479	301179	泽宇智能	1,260	24,519.60	0.00
480	301578	辰奕智能	617	24,414.69	0.00
481	603276	恒兴新材	1,737	24,213.78	0.00
482	688248	南网科技	815	24,148.45	0.00
483	603373	安邦护卫	876	24,081.24	0.00
484	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.00
485	600859	王府井	2,000	23,480.00	0.00
486	688428	诺诚健华-U	2,837	23,008.07	0.00
487	301499	维科精密	1,009	22,934.57	0.00
488	301487	盟固利	867	22,420.62	0.00
489	688631	莱斯信息	352	21,831.04	0.00
490	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.00
491	688308	欧科亿	1,081	20,993.02	0.00
492	300996	普联软件	1,400	20,538.00	0.00
493	603296	华勤技术	371	20,490.33	0.00
494	688629	华丰科技	777	20,481.72	0.00
495	603137	恒尚节能	1,935	19,737.00	0.00
496	603172	万丰股份	1,220	19,715.20	0.00
497	301367	怡和嘉业	312	19,406.40	0.00
498	300331	苏大维格	1,200	19,296.00	0.00
499	301313	凡拓数创	947	19,271.45	0.00
500	601138	工业富联	700	19,180.00	0.00
501	001367	海森药业	813	18,975.42	0.00
502	002223	鱼跃医疗	500	18,800.00	0.00
503	301348	蓝箭电子	613	18,629.07	0.00
504	603132	金徽股份	1,342	18,465.92	0.00
505	001337	四川黄金	795	18,451.95	0.00
506	000066	中国长城	2,100	18,375.00	0.00
507	001324	长青科技	1,131	18,322.20	0.00
508	301339	通行宝	913	18,159.57	0.00
509	301327	华宝新能	315	18,049.50	0.00
510	600684	珠江股份	6,800	17,884.00	0.00
511	301132	满坤科技	468	17,872.92	0.00
512	000837	秦川机床	2,400	17,664.00	0.00
513	601022	宁波远洋	1,983	17,490.06	0.00
514	301310	鑫宏业	700	16,870.00	0.00
515	688800	瑞可达	583	16,370.64	0.00
516	301293	三博脑科	433	16,319.77	0.00
517	688652	京仪装备	416	16,261.44	0.00
518	688478	晶升股份	544	15,841.28	0.00

519	301536	星宸科技	481	15,521.87	0.00
520	688720	艾森股份	382	15,486.28	0.00
521	301508	中机认检	419	15,486.24	0.00
522	002843	泰嘉股份	1,000	15,310.00	0.00
523	301311	昆船智能	832	15,292.16	0.00
524	301207	华兰疫苗	853	15,072.51	0.00
525	301361	众智科技	517	15,044.70	0.00
526	001376	百通能源	804	14,970.48	0.00
527	002871	伟隆股份	1,859	14,872.00	0.00
528	301285	鸿日达	565	14,740.85	0.00
529	300347	泰格医药	300	14,580.00	0.00
530	688223	晶科能源	2,046	14,526.60	0.00
531	301297	富乐德	715	14,521.65	0.00
532	301171	易点天下	985	14,479.50	0.00
533	300339	润和软件	700	14,469.00	0.00
534	601121	宝地矿业	2,532	14,407.08	0.00
535	301421	波长光电	332	14,352.36	0.00
536	301141	中科磁业	444	14,319.00	0.00
537	688667	菱电电控	348	14,198.40	0.00
538	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00
539	301565	中仑新材	711	13,494.78	0.00
540	300229	拓尔思	1,000	13,430.00	0.00
541	301058	中粮科工	1,386	13,125.42	0.00
542	300910	瑞丰新材	300	13,116.00	0.00
543	301517	陕西华达	241	13,014.00	0.00
544	301381	赛维时代	571	12,978.83	0.00
545	603173	福斯达	588	12,765.48	0.00
546	301510	固高科技	457	12,681.75	0.00
547	002819	东方中科	600	12,648.00	0.00
548	301488	豪恩汽电	262	12,602.20	0.00
549	301489	思泉新材	178	12,563.24	0.00
550	603153	上海建科	740	12,513.40	0.00
551	301550	斯菱股份	260	12,456.60	0.00
552	301101	明月镜片	556	12,421.04	0.00
553	301558	三态股份	1,458	12,232.62	0.00
554	688737	中自科技	753	12,198.60	0.00
555	300904	威力传动	304	12,150.88	0.00
556	603231	索宝蛋白	710	12,098.40	0.00
557	688041	海光信息	171	12,024.72	0.00
558	301516	中远通	633	11,792.79	0.00
559	300926	博俊科技	580	11,611.60	0.00
560	603209	兴通股份	833	11,528.72	0.00
561	300693	盛弘股份	540	11,307.60	0.00

562	300310	宜通世纪	3,000	11,190.00	0.00
563	603122	合富中国	2,198	11,187.82	0.00
564	002601	龙佰集团	600	11,142.00	0.00
565	301318	维海德	402	11,042.94	0.00
566	000426	兴业银锡	800	10,864.00	0.00
567	301507	民生健康	851	10,739.62	0.00
568	603162	海通发展	1,146	10,657.80	0.00
569	300814	中富电路	328	10,591.12	0.00
570	301328	维峰电子	286	10,556.26	0.00
571	000949	新乡化纤	3,100	10,540.00	0.00
572	002606	大连电瓷	1,400	10,514.00	0.00
573	301152	天力锂能	433	10,430.97	0.00
574	301151	冠龙节能	703	10,348.16	0.00
575	301282	金禄电子	434	10,320.52	0.00
576	300342	天银机电	700	10,241.00	0.00
577	688019	安集科技	78	9,812.40	0.00
578	301382	蜂助手	530	9,587.70	0.00
579	301115	建科股份	685	9,507.80	0.00
580	001313	粤海饲料	1,232	9,264.64	0.00
581	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
582	688693	锆威特	250	8,980.00	0.00
583	688539	高华科技	333	8,961.03	0.00
584	301413	安培龙	213	8,807.55	0.00
585	688573	信宇人	397	8,487.86	0.00
586	603057	紫燕食品	549	8,410.68	0.00
587	301459	丰茂股份	208	8,259.68	0.00
588	688523	航天环宇	472	8,142.00	0.00
589	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
590	000920	沃顿科技	1,100	8,063.00	0.00
591	301359	东南电子	328	8,003.20	0.00
592	301307	美利信	400	7,832.00	0.00
593	601456	国联证券	800	7,712.00	0.00
594	603282	亚光股份	457	7,705.02	0.00
595	301418	协昌科技	189	7,560.00	0.00
596	001266	宏英智能	346	7,515.12	0.00
597	301296	新巨丰	1,042	7,512.82	0.00
598	001278	一彬科技	473	7,478.13	0.00
599	301349	信德新材	270	7,462.80	0.00
600	002632	道明光学	900	7,254.00	0.00
601	300750	宁德时代	40	7,201.20	0.00
602	001366	播恩集团	645	7,159.50	0.00
603	001333	光华股份	426	7,029.00	0.00
604	301048	金鹰重工	843	6,996.90	0.00

605	300782	卓胜微	90	6,996.60	0.00
606	001368	通达创智	351	6,862.05	0.00
607	301272	英华特	173	6,674.34	0.00
608	301283	聚胶股份	235	6,666.95	0.00
609	301428	世纪恒通	229	6,572.30	0.00
610	603291	联合水务	536	6,571.36	0.00
611	301290	东星医疗	330	6,570.30	0.00
612	301089	拓新药业	220	6,527.40	0.00
613	301265	华新环保	819	6,478.29	0.00
614	301045	天禄科技	335	6,385.10	0.00
615	301276	嘉曼服饰	303	6,350.88	0.00
616	601888	中国中免	100	6,249.00	0.00
617	301391	卡莱特	140	6,129.20	0.00
618	301233	盛帮股份	158	6,007.16	0.00
619	301269	华大九天	77	5,932.85	0.00
620	301309	万得凯	228	5,827.68	0.00
621	301533	威马农机	225	5,780.25	0.00
622	301046	能辉科技	290	5,704.30	0.00
623	300994	久祺股份	504	5,538.96	0.00
624	300752	隆利科技	400	5,432.00	0.00
625	301161	唯万密封	346	5,373.38	0.00
626	301062	上海艾录	523	5,339.83	0.00
627	300059	东方财富	500	5,280.00	0.00
628	301316	慧博云通	359	5,270.12	0.00
629	002049	紫光国微	100	5,260.00	0.00
630	300781	因赛集团	100	5,218.00	0.00
631	301153	中科江南	180	5,086.80	0.00
632	301270	汉仪股份	210	5,067.30	0.00
633	301319	唯特偶	167	5,015.01	0.00
634	688512	慧智微-U	583	4,949.67	0.00
635	002444	巨星科技	200	4,940.00	0.00
636	688292	浩瀚深度	312	4,823.52	0.00
637	001309	德明利	52	4,492.80	0.00
638	300252	金信诺	700	4,375.00	0.00
639	300812	易天股份	200	4,362.00	0.00
640	603065	宿迁联盛	581	4,340.07	0.00
641	688628	优利德	128	4,194.56	0.00
642	600867	通化东宝	500	4,185.00	0.00
643	300661	圣邦股份	49	4,056.22	0.00
644	688776	国光电气	72	3,988.80	0.00
645	301525	儒竞科技	69	3,883.32	0.00
646	002530	金财互联	500	3,850.00	0.00
647	300759	康龙化成	200	3,716.00	0.00

648	000948	南天信息	300	3,705.00	0.00
649	300776	帝尔激光	80	3,676.80	0.00
650	301383	天键股份	140	3,656.80	0.00
651	301106	骏成科技	127	3,651.25	0.00
652	300803	指南针	100	3,641.00	0.00
653	300045	华力创通	200	3,530.00	0.00
654	600866	星湖科技	600	3,312.00	0.00
655	300570	太辰光	100	3,266.00	0.00
656	603666	亿嘉和	200	3,156.00	0.00
657	300314	戴维医疗	300	3,102.00	0.00
658	001311	多利科技	123	2,974.14	0.00
659	002929	润建股份	100	2,911.00	0.00
660	301267	华夏眼科	136	2,817.92	0.00
661	688609	九联科技	315	2,778.30	0.00
662	601800	中国交建	300	2,682.00	0.00
663	000831	中国稀土	100	2,535.00	0.00
664	301129	瑞纳智能	100	2,524.00	0.00
665	002876	三利谱	100	2,412.00	0.00
666	000301	东方盛虹	300	2,391.00	0.00
667	301220	亚香股份	89	2,271.28	0.00
668	000550	江铃汽车	100	2,171.00	0.00
669	301306	西测测试	55	2,128.50	0.00
670	301325	曼恩斯特	50	2,121.00	0.00
671	001323	慕思股份	73	2,100.21	0.00
672	00558	力劲科技	716	2,091.13	0.00
673	300548	博创科技	100	1,949.00	0.00
674	300946	恒而达	71	1,891.44	0.00
675	002254	泰和新材	200	1,770.00	0.00
676	600570	恒生电子	100	1,766.00	0.00
677	301360	荣旗科技	40	1,730.00	0.00
678	301039	中集车辆	200	1,720.00	0.00
679	002568	百润股份	100	1,683.00	0.00
680	600316	洪都航空	100	1,663.00	0.00
681	000913	钱江摩托	100	1,576.00	0.00
682	688107	安路科技	61	1,550.62	0.00
683	301227	森鹰窗业	76	1,429.56	0.00
684	002345	潮宏基	300	1,416.00	0.00
685	01024	快手-W	32	1,347.85	0.00
686	002351	漫步者	100	1,315.00	0.00
687	301363	美好医疗	45	1,305.00	0.00
688	301377	鼎泰高科	70	1,228.50	0.00
689	688717	艾罗能源	25	1,188.75	0.00
690	002364	中恒电气	200	1,100.00	0.00

691	301277	新天地	81	1,051.38	0.00
692	003021	兆威机电	20	923.00	0.00
693	002668	TCL 智家	100	906.00	0.00
694	002456	欧菲光	100	781.00	0.00
695	300611	美力科技	100	762.00	0.00
696	301091	深城交	27	732.78	0.00
697	000630	铜陵有色	200	722.00	0.00
698	300490	华自科技	100	716.00	0.00
699	300986	志特新材	103	697.31	0.00
700	300253	卫宁健康	100	590.00	0.00
701	002448	中原内配	100	574.00	0.00
702	301337	亚华电子	18	496.44	0.00
703	688678	福立旺	39	422.37	0.00
704	000589	贵州轮胎	80	405.60	0.00
705	301020	密封科技	21	332.22	0.00
706	002908	德生科技	40	306.80	0.00
707	300015	爱尔眼科	28	288.96	0.00
708	601398	工商银行	1	5.70	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000338	潍柴动力	23,829,648.00	3.26
2	603129	春风动力	17,853,917.35	2.44
3	000528	柳工	17,644,084.00	2.41
4	603920	世运电路	16,626,331.00	2.27
5	600150	中国船舶	15,083,561.00	2.06
6	688575	亚辉龙	14,408,914.56	1.97
7	300634	彩讯股份	12,504,959.00	1.71
8	601872	招商轮船	12,106,253.00	1.66
9	601666	平煤股份	11,541,614.00	1.58
10	002920	德赛西威	11,380,563.32	1.56
11	000682	东方电子	11,315,017.06	1.55
12	600547	山东黄金	10,604,761.36	1.45
13	000400	许继电气	10,242,791.00	1.40
14	600031	三一重工	10,213,440.00	1.40
15	600027	华电国际	9,679,016.94	1.32
16	300498	温氏股份	9,533,453.00	1.30
17	688617	惠泰医疗	9,456,187.25	1.29
18	603477	巨星农牧	9,151,675.00	1.25
19	600566	济川药业	8,755,166.32	1.20
20	601179	中国西电	8,717,128.00	1.19

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	26,587,744.26	3.63
2	300661	圣邦股份	12,898,490.00	1.76
3	300634	彩讯股份	12,643,490.00	1.73
4	601006	大秦铁路	11,448,632.00	1.57
5	002840	华统股份	11,079,343.00	1.51
6	000426	兴业银锡	11,061,262.00	1.51
7	603477	巨星农牧	9,870,039.00	1.35
8	002920	德赛西威	9,471,799.74	1.29
9	600276	恒瑞医药	9,351,653.80	1.28
10	603920	世运电路	9,226,753.65	1.26
11	688533	上声电子	8,964,666.92	1.23
12	688008	澜起科技	8,723,711.97	1.19
13	600480	凌云股份	8,557,360.00	1.17
14	300796	贝斯美	8,190,095.80	1.12
15	03690	美团-W	8,081,505.96	1.10
16	688418	震有科技	7,818,422.86	1.07
17	603129	春风动力	7,696,089.00	1.05
18	603596	伯特利	7,627,123.00	1.04
19	600566	济川药业	7,484,551.00	1.02
20	02333	长城汽车	7,473,053.44	1.02

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	1,138,487,006.73
卖出股票收入（成交）总额	1,193,240,412.37

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-

5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	509,670.32	0.08
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	509,670.32	0.08

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	128136	立讯转债	4,463	509,670.32	0.08

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

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目标，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，充分考虑股指期货的风险收益特征，通过多头或空头的套期保值策略，以改善投资组合的投资效果，实现股票组合的超额收益。

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	126,556.94
2	应收清算款	118,238.89
3	应收股利	125,418.46
4	应收利息	-
5	应收申购款	9,796.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	380,011.14

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	128136	立讯转债	509,670.32	0.08

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
39,028	20,807.03	0.00	0.00	812,056,717.59	100.00

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	201,304.35	0.0248

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

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
----	--------------------

本公司高级管理人员、基金投资和研 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、基金投资和研部门负责人未持有本基金份额。

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2020年4月29日） 基金份额总额	1,470,239,869.71
本报告期期初基金份额总额	875,014,538.96
本报告期基金总申购份额	2,607,881.26
减：本报告期基金总赎回份额	65,565,702.63
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	812,056,717.59

§ 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，经中国银行股份有限公司研究决定，郭德秋先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
浙商证券	1	579,495,751.79	24.87	484,392.90	25.23	-
广发证券	3	280,543,229.04	12.04	242,770.15	12.64	-
长江证券	1	255,557,828	10.97	208,883.91	10.88	-

		.08				
国信证券	2	198,366,677.00	8.51	163,271.73	8.50	-
天风证券	2	193,832,478.44	8.32	159,195.48	8.29	-
华创证券	1	140,265,970.85	6.02	115,203.21	6.00	-
银河证券	1	122,804,023.64	5.27	94,302.79	4.91	-
德邦证券	2	117,088,955.35	5.03	97,871.46	5.10	-
财通证券	2	116,415,002.26	5.00	97,318.62	5.07	-
国联证券	1	86,384,045.70	3.71	59,725.66	3.11	-
申万宏源 证券	1	70,623,993.26	3.03	58,004.53	3.02	-
招商证券	1	63,200,620.14	2.71	51,900.06	2.70	-
海通证券	2	60,299,650.35	2.59	49,526.87	2.58	-
摩根大通 证券	1	32,099,578.70	1.38	26,830.98	1.40	-
东北证券	1	7,451,755.16	0.32	6,467.82	0.34	-
华西证券	1	5,469,935.93	0.23	4,574.00	0.24	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
中邮证券	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(%)
浙商证券	-	-	31,807,000.00	52.08	-	-
广发证券	162,470.70	100.00	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	29,269,000.00	47.92	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-

摩根大通证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-

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	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购博隆技术首次公开发行的公告	《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 01 月 04 日
2	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
3	鹏华价值共赢两年持有期混合型证券投资基金 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
4	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	《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 23 日
5	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
6	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
7	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
8	鹏华价值共赢两年持有期混合型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 03 月 06 日
9	鹏华价值共赢两年持有期混合型证券投资基金更新的招募说明书	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会	2024 年 03 月 06 日

		基金电子披露网站	
10	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与华福证券有限责任公司申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告	《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 16 日
11	鹏华价值共赢两年持有期混合型证券投资基金 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
12	鹏华基金管理有限公司关于旗下证券投资基金持有的股票估值方法变更的提示性公告	《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 30 日
13	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
14	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
15	鹏华价值共赢两年持有期混合型证券投资基金 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
16	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
17	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
18	鹏华基金管理有限公司关于调整旗下部分基金单笔最低赎回份额和账户最低份额余额限制的公告	《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 12 日
19	鹏华价值共赢两年持有期混合型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

注：无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一)《鹏华价值共赢两年持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- (二)《鹏华价值共赢两年持有期混合型证券投资基金托管协议》；
- (三)《鹏华价值共赢两年持有期混合型证券投资基金 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