

鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式
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：上海浦东发展银行股份有限公司

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。

基金托管人上海浦东发展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	6
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	8
§ 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	10
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
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	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	45
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53
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	53
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	54

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	54
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	54
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	54
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
7.12	投资组合报告附注	54
§ 8	基金份额持有人信息	55
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
8.2	期末上市基金前十名持有人	56
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56
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	56
8.5	发起式基金发起资金持有份额情况	57
§ 9	重大事件揭示	57
9.1	基金份额持有人大会决议	57
9.2	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	57
9.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
9.4	基金投资策略的改变	58
9.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	58
9.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	58
9.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	58
9.8	其他重大事件	60
§ 10	影响投资者决策的其他重要信息	61
10.1	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	61
10.2	影响投资者决策的其他重要信息	61
§ 11	备查文件目录	62
11.1	备查文件目录	62
11.2	存放地点	62
11.3	查阅方式	62

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金
基金简称	鹏华前海万科 REITs
场内简称	鹏华前海 REIT
基金主代码	184801
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	2015 年 7 月 6 日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	29,995,915.35 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2015 年 9 月 30 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过投资于目标公司股权参与前海金融创新，力争分享金融创新的红利。
投资策略	<p>基金合同生效后，本基金根据与目标公司及其股东所签订的增资协议等相关协议约定的程序和时间，通过增资方式持有目标公司股权至 2023 年 7 月 24 日，获取自 2015 年 1 月 1 日起至 2023 年 7 月 24 日期间前海企业公馆项目 100% 的实际或应当取得的除物业管理费收入之外的营业收入，营业收入依据相关协议约定的业绩补偿机制和激励机制进行调整。前述目标公司的概况、增资入股情况、退出安排、交易结构、业绩补偿机制和激励措施等详见招募说明书。 本基金投资目标公司之外的基金资产可投资于依法发行或上市的股票（含存托凭证）、债券和货币市场工具等。</p> <p>1、对于目标公司的投资策略 本基金将审慎论证宏观经济因素（就业、利率、人口结构等）、商业地产周期（供需结构、租金和资产价格波动等）、以及其他可比投资资产项目的风险和预期收益率来判断目标公司持有商业物业当前的投资价值以及未来的发展空间。在此基础上，基金将深入调研目标公司所持商业物业的基本面（包括位置、质量、资产价格、出租率、租金价格、租户、租约、现金流等）和运营基本面（包括定位、经营策略、租赁能力、物业管理能力等），通过合适的估值方法评估其收益状况和增值潜力、预测现金流收入的规模和建立合适的估值模型。 本基金将根据投资需要参与所投资项目商业运营并代表持有人行使股东权利，并与目标公司服务机构签订相应的股权回购协议以及建立运营绩效保证机制，力争获取稳定的租金收益，具体交易结构详见招募说明书。</p> <p>2、固定收益资产投资策略 本基金投资目标公司前的基金资产以及投资目标公司后的剩</p>

	<p>余资产、本基金获得的分红款、本基金对目标公司股权的退出款在按照本《基金合同》约定进行分配或支付前，可全部投资于依法发行或上市的债券和货币市场工具等固定收益类资产。本基金将采用持有到期策略构建投资组合，以获取相对确定的目标收益。首先对存款利率、回购利率和债券收益率进行比较，并在对封闭运作期内资金面进行判断的基础上，判断是否存在利差套利空间，以确定是否进行杠杆操作；其次对各类固定收益资产在封闭运作期内的持有期收益进行比较，确定优先配置的资产类别，并结合各类固定收益资产的市场容量，确定配置比例。本基金将对整体固定收益组合久期做严格管理和匹配，完全配合基金合同期限内的允许范围。投资决策委员会将定期或不定期召开会议，确定本基金固定收益资产各类属的配置比例、组合的杠杆水平等目标区间。本公司信用评估团队依托基金管理人信用分析系统评估债务人的相对违约率并确定个券的信用评级，为本基金的组合构建和调整提供标的建议。本基金将依据投资决策委员会决议和信用分析团队的建议制定具体的配置和调整计划，进行固定收益投资组合的构建和日常管理。</p> <p>3、权益类资产投资策略</p> <p>在严格控制风险、保持资产流动性的前提下，本基金将根据发行人的基本面情况，并结合对市场流动性、上市后表现的预期，适当参与股票等权益类投资，以增加基金收益。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>
业绩比较基准	十年期国债收益率+1.5%
风险收益特征	本基金在封闭运作期内投资于目标公司股权，以获取商业物业租金收益为目标，因此与股票型基金和债券型基金有不同的风险收益特征，本基金预期风险和收益高于债券型基金和货币型基金，低于股票型基金。

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	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	高永杰	朱萍
	联系电话	0755-81395402	021-31888888
	电子邮箱	xxpl@phfund.com.cn	zhup02@spdb.com.cn
客户服务电话		4006788999	95528
传真		0755-82021126	021-63602540
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	上海市中山东一路 12 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	上海市博成路 1388 号浦银中心 A 栋
邮政编码		518048	200126
法定代表人		张纳沙	张为忠

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	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	-20,538,430.71
本期利润	-13,631,970.69
加权平均基金份额本期利润	-0.4545
本期加权平均净值利润率	-0.46%
本期基金份额净值增长率	-0.43%
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	-5,740,633.77
期末可供分配基金份额利润	-0.1914
期末基金资产净值	2,993,850,923.95
期末基金份额净值	99.809
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	49.76%

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，封闭式基金交易佣金等），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

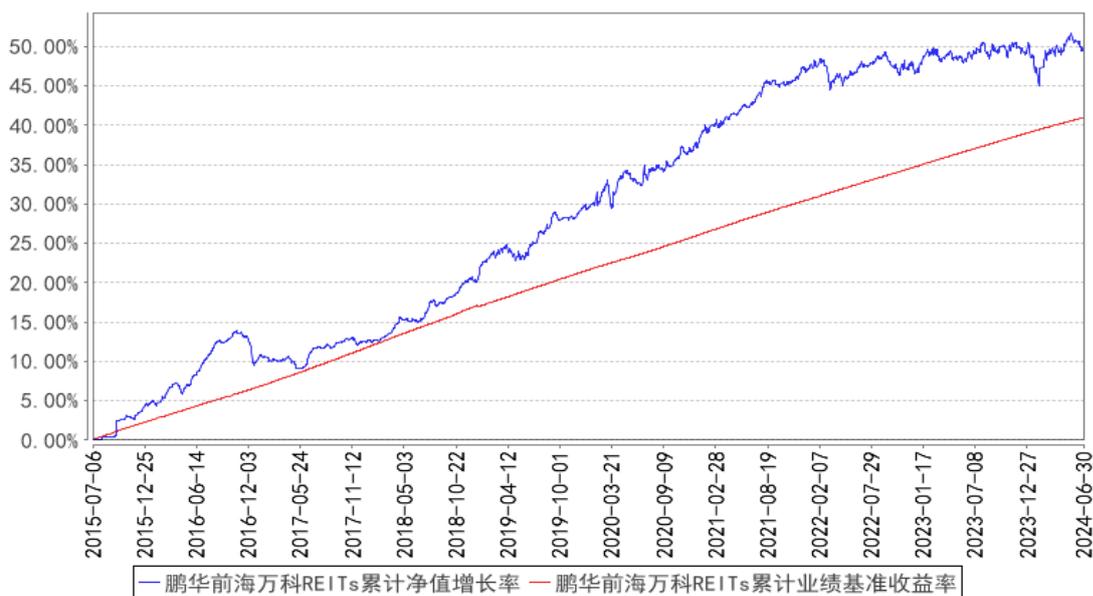
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-0.52%	0.12%	0.31%	0.01%	-0.83%	0.11%
过去三个月	0.09%	0.18%	0.94%	0.01%	-0.85%	0.17%
过去六个月	-0.43%	0.24%	1.92%	0.01%	-2.35%	0.23%
过去一年	0.48%	0.21%	4.01%	0.01%	-3.53%	0.20%
过去三年	4.85%	0.17%	12.63%	0.01%	-7.78%	0.16%
自基金合同生效起至今	49.76%	0.16%	40.97%	0.01%	8.79%	0.15%

注：业绩比较基准=十年期国债收益率+1.5%

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

鹏华前海万科REITs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 2015 年 07 月 06 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		
刘方正	基金经理	2015-08-06	-	14 年	刘方正先生，国籍中国，理学硕士，14 年证券从业经验。2010 年 6 月加盟鹏华基金管理有限公司，从事债券研究工作，历任固定收益部高级研究员、基金经理助理，现任稳定收益投资部副总经理/基金经理。2015 年 03 月至 2017 年 01 月担任鹏华弘利灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015 年 03 月至 2015 年 08 月担任鹏华行业成长证券投资基金基金经理，2015 年 04 月至 2017 年 01 月担任鹏华弘润灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015 年 05 月至今担任鹏华弘和灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015 年 05 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，2015 年 05 月至 2017 年 01 月担任鹏华弘益灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015 年 06 月至 2017 年 01 月担任鹏华弘鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015 年 08 月至今担任鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金基金经理，2015 年 08 月至 2017 年 01 月担任鹏华弘泰灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 03 月至 2017 年 05 月担任鹏华弘实灵活配置混合型证

				券投资基金基金经理，2016年03月至2018年05月担任鹏华弘锐灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016年03月至2022年12月担任鹏华弘信灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016年08月至2023年12月担任鹏华弘达灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016年08月至2017年12月担任鹏华弘嘉灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016年09月至2022年08月担任鹏华弘惠灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016年11月至2018年01月担任鹏华兴裕定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016年11月至今担任鹏华兴泰定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016年12月至2024年04月担任鹏华兴悦定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017年09月至2018年08月担任鹏华兴益定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2018年05月至今担任鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2023年02月至2024年02月担任鹏华永瑞一年封闭式债券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，刘方正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

2024 年上半年，宏观经济总需求延续 2023 年的弱趋势震荡走势，一季度相对较强，二季度略有回落，内需方面，基建投资和房地产投资都呈现偏弱的走势，地方政府化债过程中存在一定投资动力和意愿不足的情况，房地产的弱势趋势在政府适度的政策调整情况之下有一定的趋缓，但整体下行趋势仍然延续，其中随着限购限贷等政策的调整，一二线城市二手房成交量有所提升，但对一级市场的投资带动力量有限。在新质生产力为方向的鼓励和带动下，制造业整体投资仍保持一定韧性，尤其是外需为主的产业展现出一定积极信号，对整体需求有较为明显的支撑。整体来看，外需有一定亮点，内需稳步回落有一定支撑的表现。财政政策并没有明显积极发力的迹象，地方政府债发行节奏偏缓，投融资节奏向下半年有一定压缩。金融数据方面，社融整体也有一定调整，总量相比 2023 年有所控制，同比增速有所回落，投融资需求偏弱。2024 年上半年，权益市场经历了年初快速回落以后的反弹，以及二季度逐步再次走弱的过程，市场结构上来看，红利方向仍是市场集中度较高的方向，且确定性较好，虽有一定交易拥挤，但高分红逻辑仍然较强。其他类似低估值权重股也有较好支撑，在一季度短暂回调以后表现较为突出。成长方向以外需为主，TMT 中 AI 和电子等行业相对突出，内需消费等领域相对落后。债券收益率水平有持续回落的走势，中间虽有小幅上行，但十年以上的中长期利率品种都有较为明显的收益率回落。本基金以追求稳定收益为主要投资策略，控制基金净值回撤幅度。在操作上，保持稳健的中短久期债券资产配置，以固定收益类资产为主要方向，在严格控制整体仓位的前提下，少量参与股票二级市场投资，同时，积极参与新股、可转债、可交换债的网下申购获取增强收益。

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-0.43%，同期业绩比较基准增长率为 1.92%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，我们认为内外需都有一定不确定性，外需来讲，高利率持续时间较长，对于投资的抑制逐步体现在经济层面，有一定调整的意愿，但中国制造业整体成本控制良好，具备长期竞争优势。内需生长动力不足，对宏观总需求影响体现在实体经济各个环节。其中，商旅活动出行等仍维持一定景气趋势，但单客消费能力有所回落，中高端消费场景逐步消失，房地产价格下跌带来净资产回落以后对整体消费产生的抑制趋势仍将持续。投资方面，制造业投资仍然稳定，基建方面也以中央项目为主保持一定支撑力量，房地产投资下行趋势会略有缓解，但趋势尚未结束。因此，总需求上仍然面对较弱的走势，政府主导的大规模投资刺激可能性仍然较低。需求不足的情况仍将维持一段时间。经济虽然存在一定自发修复动力，金融环境也将保持宽松，实体和金融体系流动性良好，央行仍会保持一定定力以防资金空转形成泡沫。在此环境下，我们认为权益市场整体趋势性机会较小，但底部区域在经历过去两年调整以后逐步确立，高分红和价值方向仍是值得期待和获取确定性收益机会的领域，成长方向的投资难度较大，依赖于外需和部分内需成长的行业方向仍然存在，但也许持续关注基本面的变化。消费电子、AI 等领域仍有长期耕耘的机会。债券基本面仍维持良好，持有期票息收益虽然为历史较低水平，但伴随美国降息周期临近，国内也存在一定降息空间，收益率有进一步回落的机会。未来我们仍将坚持稳健的投资策略，稳步增加固定收益率资产配置，保持中高仓位、中短久期的债券配置，严控仓位情况下适当参与股票市场，并通过参与新股、可转债、可交换债网下申购等投资，追求稳定的投资收益。

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-5,740,633.77 元，期末基金份额净值 99.809 元，不符合利润分配条件。

2、本基金于 2024 年 01 月 12 日进行利润分配，分配金额为 71,039,326.34 元。

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，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现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

本报告期内，由鹏华基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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：鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金

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	17,556,396.71	15,350,967.07
结算备付金		43,891,539.33	94,796,290.99
存出保证金		119,664.05	127,897.82
交易性金融资产	6.4.7.2	3,484,490,887.68	3,016,378,046.09
其中: 股票投资		541,563,303.69	594,764,618.68
基金投资		-	-
债券投资		2,942,927,583.99	2,421,613,427.41
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		114,111.60	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		3,546,172,599.37	3,126,653,201.97
负债和净资产	附注号	本期末	上年度末
		2024年6月30日	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		548,000,000.00	44,895,543.48
应付清算款		1,415,442.32	317,826.05
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,600,568.10	1,688,949.61
应付托管费		246,241.25	259,838.43
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		492,482.50	519,676.84
应交税费		92,774.61	159,109.63
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	474,166.64	290,036.95
负债合计		552,321,675.42	48,130,980.99

净资产：			
实收基金	6.4.7.10	2,999,591,557.72	2,999,591,557.72
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-5,740,633.77	78,930,663.26
净资产合计		2,993,850,923.95	3,078,522,220.98
负债和净资产总计		3,546,172,599.37	3,126,653,201.97

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 99.809 元，基金份额总额 29,995,915.35 份。

6.2 利润表

会计主体：鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金

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		4,574,203.81	82,375,028.01
1. 利息收入		406,300.37	974,372.88
其中：存款利息收入	6.4.7.13	406,300.37	970,076.99
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		-	4,295.89
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-2,738,556.58	69,415,348.18
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-45,821,177.26	6,715,184.74
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	36,538,837.86	55,649,982.01
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	6,543,782.82	4,709,056.92
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		-	2,341,124.51
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	6,906,460.02	11,985,306.95

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		18,206,174.50	35,683,326.13
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	9,661,183.50	9,815,890.97
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,486,335.98	1,510,137.04
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		2,972,671.80	3,020,274.20
5. 利息支出		3,888,287.50	20,988,305.89
其中：卖出回购金融资产支出		3,888,287.50	20,988,305.89
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		60,101.70	209,410.80
8. 其他费用	6.4.7.23	137,594.02	139,307.23
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-13,631,970.69	46,691,701.88
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-13,631,970.69	46,691,701.88
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-13,631,970.69	46,691,701.88

注：其他投资投资收益为物业收益权收益。根据《鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金招募说明书》，目标公司投资收益为本基金根据与目标公司及其股东所签订的增资协议等相关协议约定的程序和时间，通过增资方式持有目标公司股权至 2023 年 7 月 24 日，获取自 2015 年 1 月 1 日起至 2023 年 7 月 24 日期间前海企业公馆项目 100% 的实际或应当取得的扣除物业管理费收入之外的营业收入，营业收入依据相关协议约定的业绩补偿机制和激励机制进行调整。

6.3 净资产变动表

会计主体：鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金

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	2,999,591,557.72	-	78,930,663.26	3,078,522,220.98

加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	2,999,591,557.72	-	78,930,663.26	3,078,522,220.98
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-	-	-84,671,297.03	-84,671,297.03
(一)、综合收益总额	-	-	-13,631,970.69	-13,631,970.69
(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)	-	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-	-
(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)	-	-	-71,039,326.34	-71,039,326.34
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	2,999,591,557.72	-	-5,740,633.77	2,993,850,923.95
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	2,999,591,557.72	-	43,991,468.18	3,043,583,025.90
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	2,999,591,557.72	-	43,991,468.18	3,043,583,025.90
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-	-	7,097,092.33	7,097,092.33
(一)、综合收益总额	-	-	46,691,701.88	46,691,701.88
(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)	-	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-	-
(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)	-	-	-39,594,609.55	-39,594,609.55
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	2,999,591,557.72	-	51,088,560.51	3,050,680,118.23

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金(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[2015]1116 号《关于准予鹏华前海万科 REITs

封闭式混合型发起式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《鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型基金，在基金合同生效后十年内(含十年)封闭运作，在深圳证券交易所(以下简称“深交所”)上市交易，封闭期结束后转为上市开放式基金(LOF)，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 2,998,986,947.73 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(2015)第 878 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2015 年 7 月 6 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,999,591,557.72 份基金份额，其中认购资金利息折合 604,609.99 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，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

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》、《鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式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	17,556,396.71
等于：本金	17,551,338.47
加：应计利息	5,058.24
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	17,556,396.71

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	594,675,325.95	-	541,563,303.69	- 53,112,022.26	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	1,418,742,101.85	20,590,312.65	1,437,278,295.81	-2,054,118.69
	银行间市场	1,491,008,958.41	19,755,288.18	1,505,649,288.18	-5,114,958.41
	合计	2,909,751,060.26	40,345,600.83	2,942,927,583.99	-7,169,077.10
资产支持证券	-	-	-	-	

基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	3,504,426,386.21	40,345,600.83	3,484,490,887.68	- 60,281,099.36

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	359,794.20
其中：交易所市场	345,669.20
银行间市场	14,125.00
应付利息	-
预提费用	114,372.44
合计	474,166.64

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	29,995,915.35	2,999,591,557.72
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
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	29,995,915.35	2,999,591,557.72

注：根据《鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金招募说明书》的相关规定，本基金合同生效后（2015年7月6日）十年之内（含十年）为封闭期，在此期间投资人不能申购、赎回基金份额，但可在本基金上市交易后通过深圳证券交易所买卖基金份额。

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	146,118,222.64	-67,187,559.38	78,930,663.26
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	146,118,222.64	-67,187,559.38	78,930,663.26
本期利润	-20,538,430.71	6,906,460.02	-13,631,970.69
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-71,039,326.34	-	-71,039,326.34
本期末	54,540,465.59	-60,281,099.36	-5,740,633.77

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	77,283.80
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	327,838.50
其他	1,178.07
合计	406,300.37

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	-45,821,177.26
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	-45,821,177.26

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	380,663,346.93
减：卖出股票成本总额	425,626,020.19
减：交易费用	858,504.00
买卖股票差价收入	-45,821,177.26

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	43,266,009.35
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-6,727,171.49
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	36,538,837.86

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	1,930,622,943.28
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,919,922,336.68
减：应计利息总额	17,410,103.09
减：交易费用	17,675.00
买卖债券差价收入	-6,727,171.49

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	6,543,782.82
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	6,543,782.82

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	6,906,460.02
股票投资	-205,488.76
债券投资	7,111,948.78
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	6,906,460.02

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	54,700.10
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行汇划费用	4,621.58
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	137,594.02

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、基金销售机构、基金发起人
上海浦东发展银行股份有限公司（“上海浦东发展银行”）	基金托管人、基金代销机构
国信证券股份有限公司（“国信证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
深圳市前海金融控股有限公司（“前海金控”）	基金投资顾问、基石投资人、《合作框架协议》其他签订方

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

注：无。

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

注：无。

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	9,661,183.50	9,815,890.97
其中：应支付销售机构的客户维护费	557,886.39	619,676.00
应支付基金管理人的净管理费	9,103,297.11	9,196,214.97

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 0.65%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×0.65%÷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	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	1,486,335.98	1,510,137.04

注：支付基金托管人上海浦东发展银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10%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×0.10%/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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

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
基金合同生效日（2015 年 7 月 6 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	100,027.00	100,027.00
报告期间申购/买入总份额	-	-

报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	100,027.00	100,027.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.3335%	0.3335%

注：本基金管理人投资本基金的费率标准与其他相同条件的投资者适用的费率标准相一致。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例 (%)
前海金控	3,000,405.00	10.00	3,000,405.00	10.00

注：除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的费率标准与其他相同条件的投资者适用的费率标准相一致。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 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
上海浦东发展银行	17,556,396.71	77,283.80	155,179,110.13	81,509.55

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

本基金支付基金投资顾问前海金控的投资顾问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。其计算公式为：

日投资顾问费 = 前一日基金资产净值 × 0.20% ÷ 当年天数。

本基金本报告期发生的投资顾问费为人民币 2,972,671.80 元。于 2024 年 6 月 30 日，本基金需支付的投资顾问费余额为人民币 492,482.50 元。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2024 年 1 月 12 日	2024 年 01 月 15 日	2024 年 01 月 12 日	23.6830	71,039,326.34	-	71,039,326.34	-
合计	-	-	-	23.6830	71,039,326.34	-	71,039,326.34	-

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	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
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	2024 年 1	6 个月	新股	16.98	13.48	213	3,616.74	2,871.24	-

	科技	月 11 日		流通受限						
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	星辰科技	2024 年 3 月 20 日	6 个月	新股流通受限	16.16	32.27	481	7,772.96	15,521.87	-
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	126.89	188.01	1,244	87,680.99	233,884.44	诺瓦 星云 于 2024 年 5

				限						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	1,258	20,379.60	20,077.68	-
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	-
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	72.46	68.06	66	4,782.36	4,491.96	-

				受限						
603341	龙旗科技	2024年2月23日	6个月	新股流通受限	26.00	37.49	298	7,748.00	11,172.02	-
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	永臻股份	2024年6月19日	6个月	新股流通受限	23.35	25.13	178	4,156.30	4,473.14	-
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	2024	6个月	新	22.66	15.89	866	19,623.56	13,760.74	-

	海合晶	年2月1日		股流通受限						
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	1,045	16,396.05	19,635.55	-

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

截至本报告期末 2024 年 06 月 30 日止,基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 548,000,000.00 元,于 2024 年 07 月 01 日、2024 年 07 月 12 日(先后)到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

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。本基金封闭运作期内按照基金合同的约定投资于确定的、单一的目标公司股权。本基金的其他基金资产可以投资于固定收益类资产(具体包括:国债、金融债、企业(公司)债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、资产支持证券、债券回购、银行存款等)、现金,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。本基金同时可参与股票(含存托凭证)、权证等权益类资产的投资。基金的投资组合比例为:本基金投资于确定的、单一的目标公司股权的比例不超过基金资产的 50%,投资于固定收益类资产、权益类资产等的比例不低于基金资产的 50%。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，将风险控制在可接受的范围内。

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上海浦东发展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	2,758,651,984.74	2,407,241,608.64
AAA 以下	13,510,419.53	14,371,818.77
未评级	20,412,700.27	-
合计	2,792,575,104.54	2,421,613,427.41

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，除卖出回购金融资产款余额 548,000,000.00 元将在一个月内到期且计息外，本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

持续的监测和分析。

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

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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，此外还持有银行存款、结算备付金等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。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，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

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	17,556,396.71	-	-	-	17,556,396.71
结算备付金	43,891,539.33	-	-	-	43,891,539.33
存出保证金	119,664.05	-	-	-	119,664.05
交易性金融资产	1,873,418,232.25	802,754,487.56	266,754,864.18	541,563,303.69	3,484,490,887.68
应收清算款	-	-	-	114,111.60	114,111.60
资产总计	1,934,985,832.34	802,754,487.56	266,754,864.18	541,677,415.29	3,546,172,599.37
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	1,600,568.10	1,600,568.10
应付托管费	-	-	-	246,241.25	246,241.25
应付清算款	-	-	-	1,415,442.32	1,415,442.32
卖出回购金融资产款	548,000,000.00	-	-	-	548,000,000.00
应付投资顾问费	-	-	-	492,482.50	492,482.50
应交税费	-	-	-	92,774.61	92,774.61
其他负债	-	-	-	474,166.64	474,166.64
负债总计	548,000,000.00	-	-	4,321,675.42	552,321,675.42
利率敏感度缺口	1,386,985,832.34	802,754,487.56	266,754,864.18	537,355,739.87	2,993,850,923.95
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	15,350,967.07	-	-	-	15,350,967.07
结算备付金	94,796,290.99	-	-	-	94,796,290.99
存出保证金	127,897.82	-	-	-	127,897.82
交易性金融资产	1,369,028,286.84	815,739,950.40	236,845,190.17	594,764,618.68	3,016,378,046.09
资产总计	1,479,303,442.72	815,739,950.40	236,845,190.17	594,764,618.68	3,126,653,201.97
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	1,688,949.61	1,688,949.61
应付托管费	-	-	-	259,838.43	259,838.43
应付清算款	-	-	-	317,826.05	317,826.05
卖出回购金融资产款	44,895,543.48	-	-	-	44,895,543.48
应付投资顾问费	-	-	-	519,676.84	519,676.84
应交税费	-	-	-	159,109.63	159,109.63
其他负债	-	-	-	290,036.95	290,036.95
负债总计	44,895,543.48	-	-	3,235,437.51	48,130,980.99
利率敏感度缺口	1,434,407,899.24	815,739,950.40	236,845,190.17	591,529,181.17	3,078,522,220.98

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

假设	该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有债券资产的利率风险状况测算的理论变动值对基金资产净值的影响金额。		
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。		
	此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
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）
	市场利率下降 25 个基点	8,531,494.83	5,284,375.81
	市场利率上升 25 个基点	-8,454,281.36	-5,257,847.14

注：无。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无。

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。基金的投资组合比例为：本基金投资于确定的、单一的目标公司股权的比例不超过基金资产的 50%，投资于固定收益类资产、权益类资产等的比例不低于基金资产的 50%。

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。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	541,563,303.69	18.09	594,764,618.68	19.32
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	34,390,650.85	1.15	35,347,749.58	1.15
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	575,953,954.54	19.24	630,112,368.26	20.47

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	-	26,767,750.71

	比较基准下降 5% 资产净值变动	-	-26,767,750.71
--	------------------	---	----------------

注：于 2024 年 06 月 30 日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金净资产的比例为 19.24%，因此除市场利率和外汇利率以外的市场价格因素的变动对本基金资产净值无重大影响。

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	575,409,395.36
第二层次	2,908,582,544.25
第三层次	498,948.07
合计	3,484,490,887.68

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	541,563,303.69	15.27
	其中：股票	541,563,303.69	15.27
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,942,927,583.99	82.99
	其中：债券	2,942,927,583.99	82.99
	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	61,447,936.04	1.73
8	其他各项资产	233,775.65	0.01
9	合计	3,546,172,599.37	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	22,404,980.00	0.75
B	采矿业	8,256,303.00	0.28
C	制造业	395,835,418.50	13.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,287,788.87	0.28
E	建筑业	20,421.16	0.00

F	批发和零售业	67,308.14	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	28,167,097.28	0.94
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,649,403.26	0.06
J	金融业	67,644,421.12	2.26
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	8,930,000.00	0.30
M	科学研究和技术服务业	101,947.59	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	93,788.43	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	15,147.00	0.00
Q	卫生和社会工作	89,279.34	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	541,563,303.69	18.09

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	002475	立讯精密	990,400	38,932,624.00	1.30
2	600150	中国船舶	814,800	33,170,508.00	1.11
3	600031	三一重工	1,944,000	32,076,000.00	1.07
4	000338	潍柴动力	1,897,900	30,821,896.00	1.03
5	000001	平安银行	2,552,100	25,903,815.00	0.87
6	000333	美的集团	350,000	22,575,000.00	0.75
7	601689	拓普集团	400,000	21,444,000.00	0.72
8	603477	巨星农牧	732,200	21,014,140.00	0.70
9	002840	华统股份	1,229,960	20,405,036.40	0.68
10	002185	华天科技	2,500,000	20,375,000.00	0.68
11	600690	海尔智家	700,000	19,866,000.00	0.66
12	688639	华恒生物	232,819	17,785,043.41	0.59
13	003021	兆威机电	381,780	17,619,147.00	0.59
14	001965	招商公路	1,400,000	16,604,000.00	0.55
15	000893	亚钾国际	1,000,000	16,160,000.00	0.54
16	002050	三花智控	823,900	15,720,012.00	0.53
17	688169	石头科技	40,000	15,704,000.00	0.52
18	002142	宁波银行	700,000	15,442,000.00	0.52
19	300760	迈瑞医疗	50,000	14,545,500.00	0.49

20	000708	中信特钢	1,000,000	13,570,000.00	0.45
21	601318	中国平安	300,000	12,408,000.00	0.41
22	001872	招商港口	600,000	11,550,000.00	0.39
23	688012	中微公司	80,000	11,300,800.00	0.38
24	601601	中国太保	330,000	9,193,800.00	0.31
25	600153	建发股份	1,000,000	8,930,000.00	0.30
26	603878	武进不锈	1,302,520	8,518,480.80	0.28
27	601857	中国石油	800,000	8,256,000.00	0.28
28	600905	三峡能源	1,889,400	8,237,784.00	0.28
29	600989	宝丰能源	300,000	5,199,000.00	0.17
30	688533	上声电子	200,000	5,174,000.00	0.17
31	601229	上海银行	520,000	3,775,200.00	0.13
32	000951	中国重汽	234,741	3,361,491.12	0.11
33	300408	三环集团	100,000	2,919,000.00	0.10
34	000400	许继电气	73,400	2,525,694.00	0.08
35	002714	牧原股份	31,900	1,390,840.00	0.05
36	601628	中国人寿	27,000	838,350.00	0.03
37	600941	中国移动	6,600	709,500.00	0.02
38	301589	诺瓦星云	1,244	233,884.44	0.01
39	301580	爱迪特	2,018	153,513.06	0.01
40	301392	汇成真空	2,189	128,899.54	0.00
41	301251	威尔高	3,207	110,417.01	0.00
42	301456	盘古智能	4,061	105,951.49	0.00
43	301548	崇德科技	1,959	103,983.72	0.00
44	688562	航天软件	6,525	99,636.75	0.00
45	001389	广合科技	2,219	97,078.01	0.00
46	301320	豪江智能	6,416	96,368.32	0.00
47	301516	中远通	5,033	93,764.79	0.00
48	688381	帝奥微	4,723	92,004.04	0.00
49	301303	真兰仪表	7,804	89,902.08	0.00
50	301587	中瑞股份	3,056	89,267.06	0.00
51	688525	佰维存储	1,367	87,693.05	0.00
52	301317	鑫磊股份	5,636	87,583.44	0.00
53	688257	新锐股份	5,683	87,120.39	0.00
54	688049	炬芯科技	3,912	86,533.44	0.00
55	301363	美好医疗	2,947	85,463.00	0.00
56	301399	英特科技	4,241	83,462.88	0.00
57	688620	安凯微	10,157	82,677.98	0.00
58	688401	路维光电	3,138	82,215.60	0.00
59	688602	康鹏科技	10,653	81,708.51	0.00
60	688416	恒烁股份	2,147	81,521.59	0.00
61	688523	航天环宇	4,717	81,368.25	0.00
62	601059	信达证券	5,628	79,973.88	0.00

63	301359	东南电子	3,271	79,812.40	0.00
64	301293	三博脑科	2,111	79,563.59	0.00
65	301500	飞南资源	4,550	79,397.50	0.00
66	688489	三未信安	2,953	78,667.92	0.00
67	688549	中巨芯-U	11,649	78,630.75	0.00
68	301386	未来电器	3,776	78,314.24	0.00
69	301281	科源制药	3,368	75,611.60	0.00
70	301315	威士顿	2,253	73,425.27	0.00
71	301519	舜禹股份	4,414	73,095.84	0.00
72	301357	北方长龙	2,240	72,307.20	0.00
73	301388	欣灵电气	2,920	72,153.20	0.00
74	301135	瑞德智能	3,376	71,875.04	0.00
75	688629	华丰科技	2,698	71,119.28	0.00
76	688719	爱科赛博	2,715	70,780.05	0.00
77	688530	欧莱新材	3,437	69,099.55	0.00
78	301566	达利凯普	4,055	68,813.35	0.00
79	688152	麒麟信安	1,772	68,611.84	0.00
80	688646	逸飞激光	2,190	68,349.90	0.00
81	688435	英方软件	2,728	68,090.88	0.00
82	688305	科德数控	1,056	68,069.76	0.00
83	300699	光威复材	2,700	67,041.00	0.00
84	301172	君逸数码	2,276	66,868.88	0.00
85	301518	长华化学	3,850	66,720.50	0.00
86	301283	聚胶股份	2,344	66,499.28	0.00
87	688648	中邮科技	3,025	66,066.00	0.00
88	301428	世纪恒通	2,289	65,694.30	0.00
89	301290	东星医疗	3,291	65,523.81	0.00
90	300904	威力传动	1,637	65,430.89	0.00
91	301337	亚华电子	2,318	63,930.44	0.00
92	301555	惠柏新材	2,235	63,317.55	0.00
93	688695	中创股份	1,856	63,082.50	0.00
94	301373	凌玮科技	2,764	63,019.20	0.00
95	688072	拓荆科技	515	61,856.65	0.00
96	688581	安杰思	1,225	59,939.25	0.00
97	301295	美硕科技	3,004	59,809.64	0.00
98	301529	福赛科技	1,816	59,582.96	0.00
99	301588	美新科技	2,568	59,238.22	0.00
100	301505	苏州规划	1,934	58,020.00	0.00
101	301533	威马农机	2,243	57,622.67	0.00
102	002032	苏泊尔	1,100	55,110.00	0.00
103	688433	华曙高科	2,619	54,632.34	0.00
104	301355	南王科技	5,624	53,934.16	0.00
105	301502	华阳智能	1,375	53,673.83	0.00

106	688479	友车科技	3,318	52,723.02	0.00
107	301316	慧博云通	3,584	52,613.12	0.00
108	688651	盛邦安全	1,778	52,006.50	0.00
109	301382	蜂助手	2,834	51,267.06	0.00
110	688237	超卓航科	2,449	49,102.45	0.00
111	301157	华塑科技	1,498	48,834.80	0.00
112	001378	德冠新材	2,044	48,769.84	0.00
113	301292	海科新源	3,924	48,539.88	0.00
114	688084	晶品特装	1,104	48,244.80	0.00
115	603107	上海汽配	2,920	46,398.80	0.00
116	301301	川宁生物	3,574	45,675.72	0.00
117	600195	中牧股份	6,000	44,940.00	0.00
118	301376	致欧科技	2,092	44,287.64	0.00
119	301515	港通医疗	2,294	43,907.16	0.00
120	001286	陕西能源	3,767	43,433.51	0.00
121	603344	星德胜	1,813	42,892.99	0.00
122	301202	朗威股份	1,560	41,745.60	0.00
123	301217	铜冠铜箔	4,284	41,126.40	0.00
124	001359	平安电工	1,833	40,513.63	0.00
125	603270	金帝股份	1,943	38,549.12	0.00
126	301153	中科江南	1,289	36,427.14	0.00
127	001326	联域股份	986	35,357.96	0.00
128	301323	新莱福	1,077	34,011.66	0.00
129	603273	天元智能	1,772	32,516.20	0.00
130	002841	视源股份	1,100	32,483.00	0.00
131	301329	信音电子	1,677	32,416.41	0.00
132	603082	北自科技	1,070	32,276.55	0.00
133	603325	博隆技术	460	31,591.28	0.00
134	688692	达梦数据	175	30,612.75	0.00
135	301095	广立微	740	30,428.80	0.00
136	688376	美埃科技	938	29,415.68	0.00
137	001282	三联锻造	1,045	28,956.95	0.00
138	301219	腾远钴业	751	28,733.26	0.00
139	603375	盛景微	714	28,339.56	0.00
140	603276	恒兴新材	1,737	24,213.78	0.00
141	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.00
142	301206	三元生物	945	23,228.10	0.00
143	001287	中电港	1,386	22,910.58	0.00
144	301286	侨源股份	784	22,430.24	0.00
145	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.00
146	301187	欧圣电气	876	21,243.00	0.00
147	301162	国能日新	468	20,386.08	0.00
148	601033	永兴股份	1,277	20,385.29	0.00

149	603137	恒尚节能	1,935	19,737.00	0.00
150	603172	万丰股份	1,220	19,715.20	0.00
151	688709	成都华微	1,045	19,635.55	0.00
152	301550	斯菱股份	400	19,164.00	0.00
153	301339	通行宝	913	18,159.57	0.00
154	301536	星辰科技	481	15,521.87	0.00
155	301508	中机认检	419	15,486.24	0.00
156	002607	中公教育	9,900	15,147.00	0.00
157	301285	鸿日达	565	14,740.85	0.00
158	301160	翔楼新材	392	14,602.00	0.00
159	688584	上海合晶	866	13,760.74	0.00
160	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00
161	301565	中仑新材	711	13,494.78	0.00
162	688693	锆威特	363	13,038.96	0.00
163	301517	陕西华达	241	13,014.00	0.00
164	301510	固高科技	457	12,681.75	0.00
165	601083	锦江航运	1,263	12,074.28	0.00
166	301302	华如科技	699	12,057.75	0.00
167	301507	民生健康	909	11,471.58	0.00
168	301418	协昌科技	286	11,440.00	0.00
169	603341	龙旗科技	298	11,172.02	0.00
170	301318	维海德	402	11,042.94	0.00
171	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
172	301152	天力锂能	433	10,430.97	0.00
173	301268	铭利达	641	9,967.55	0.00
174	301306	西测测试	255	9,868.50	0.00
175	301239	普瑞眼科	275	9,715.75	0.00
176	301115	建科股份	685	9,507.80	0.00
177	301112	信邦智能	399	8,654.31	0.00
178	603057	紫燕食品	549	8,410.68	0.00
179	688653	康希通信	648	8,346.24	0.00
180	301520	万邦医药	196	8,110.48	0.00
181	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
182	301100	风光股份	599	7,781.01	0.00
183	301528	多浦乐	178	7,625.52	0.00
184	301296	新巨丰	1,042	7,512.82	0.00
185	688419	耐科装备	240	7,180.80	0.00
186	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
187	001333	光华股份	426	7,029.00	0.00
188	603291	联合水务	536	6,571.36	0.00
189	001256	炜冈科技	474	6,503.28	0.00
190	301233	盛帮股份	158	6,007.16	0.00
191	603193	润本股份	322	5,921.58	0.00

192	688716	中研股份	267	5,660.40	0.00
193	301116	益客食品	577	5,152.61	0.00
194	301319	唯特偶	167	5,015.01	0.00
195	603381	永臻股份	178	4,473.14	0.00
196	603062	麦加芯彩	126	4,184.46	0.00
197	301393	昊帆生物	97	4,119.59	0.00
198	603125	常青科技	232	3,992.72	0.00
199	603075	热威股份	212	3,741.80	0.00
200	001328	登康口腔	145	3,668.50	0.00
201	001306	夏厦精密	64	3,455.36	0.00
202	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
203	600036	招商银行	96	3,282.24	0.00
204	301328	维峰电子	87	3,211.17	0.00
205	001379	腾达科技	213	2,871.24	0.00
206	301261	恒工精密	73	2,706.11	0.00
207	001387	雪祺电气	173	2,638.25	0.00
208	301132	满坤科技	68	2,596.92	0.00
209	301170	锡南科技	96	2,500.80	0.00
210	301349	信德新材	70	1,934.80	0.00
211	301338	凯格精机	60	1,927.80	0.00
212	603173	福斯达	88	1,910.48	0.00
213	001367	海森药业	81	1,890.54	0.00
214	301309	万得凯	71	1,814.76	0.00
215	301360	荣旗科技	40	1,730.00	0.00
216	301117	佳缘科技	62	1,599.60	0.00
217	001311	多利科技	64	1,547.52	0.00
218	301238	瑞泰新材	97	1,452.09	0.00
219	301171	易点天下	85	1,249.50	0.00
220	603119	浙江荣泰	69	1,222.68	0.00
221	301272	英华特	29	1,118.82	0.00
222	603162	海通发展	110	1,023.00	0.00
223	301297	富乐德	47	954.57	0.00
224	301282	金禄电子	34	808.52	0.00
225	301161	唯万密封	46	714.38	0.00
226	601133	柏诚股份	64	684.16	0.00
227	601065	江盐集团	75	650.25	0.00
228	301265	华新环保	81	640.71	0.00
229	301110	青木股份	18	531.54	0.00
230	301266	宇邦新材	17	520.88	0.00
231	001324	长青科技	31	502.20	0.00
232	301120	新特电气	48	498.72	0.00
233	301298	东利机械	34	433.50	0.00
234	603135	中重科技	28	350.84	0.00

235	001314	亿道信息	8	307.44	0.00
236	301175	中科环保	70	307.30	0.00
237	600925	苏能股份	60	303.00	0.00
238	301511	德福科技	18	265.68	0.00
239	301499	维科精密	9	204.57	0.00
240	603281	江瀚新材	8	179.60	0.00
241	601061	中信金属	16	109.92	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	601006	大秦铁路	26,680,000.00	0.87
2	688639	华恒生物	23,710,534.56	0.77
3	000333	美的集团	23,424,566.88	0.76
4	600153	建发股份	20,548,742.00	0.67
5	000893	亚钾国际	19,478,787.00	0.63
6	600690	海尔智家	19,329,496.42	0.63
7	000338	潍柴动力	16,495,000.00	0.54
8	603878	武进不锈	15,780,078.49	0.51
9	001965	招商公路	15,756,742.00	0.51
10	000420	吉林化纤	15,721,516.00	0.51
11	000708	中信特钢	15,195,967.83	0.49
12	300760	迈瑞医疗	15,165,928.00	0.49
13	001872	招商港口	14,067,455.42	0.46
14	603477	巨星农牧	11,410,155.00	0.37
15	601689	拓普集团	10,671,715.00	0.35
16	601857	中国石油	8,501,384.00	0.28
17	601318	中国平安	8,425,584.00	0.27
18	002840	华统股份	7,961,146.00	0.26
19	000949	新乡化纤	7,684,803.00	0.25
20	600905	三峡能源	7,270,334.00	0.24

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	000651	格力电器	28,647,610.31	0.93
2	601006	大秦铁路	25,311,936.00	0.82
3	603773	沃格光电	25,049,711.26	0.81
4	002601	龙佰集团	22,250,794.00	0.72
5	002567	唐人神	15,212,022.00	0.49

6	000420	吉林化纤	14,323,398.00	0.47
7	301220	亚香股份	9,979,771.40	0.32
8	600153	建发股份	9,885,285.00	0.32
9	600519	贵州茅台	9,125,098.00	0.30
10	000949	新乡化纤	8,734,668.26	0.28
11	600309	万华化学	8,668,409.00	0.28
12	688007	光峰科技	8,372,659.90	0.27
13	300622	博士眼镜	8,193,591.00	0.27
14	688323	瑞华泰	7,435,144.03	0.24
15	603062	麦加芯彩	7,088,788.21	0.23
16	300441	鲍斯股份	6,730,310.00	0.22
17	002913	奥士康	6,695,242.00	0.22
18	601801	皖新传媒	5,948,932.00	0.19
19	600111	北方稀土	5,783,025.00	0.19
20	688418	震有科技	5,617,301.64	0.18

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	372,630,193.96
卖出股票收入（成交）总额	380,663,346.93

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

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	1,801,191,657.23	60.16
	其中：政策性金融债	150,352,479.45	5.02
4	企业债券	1,086,649,778.64	36.30
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	20,695,497.27	0.69
7	可转债（可交换债）	34,390,650.85	1.15
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,942,927,583.99	98.30

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	1928036	19 中信银行 永续债	2,000,000	206,587,213.11	6.90
2	2028006	20 邮储银行 永续债	2,000,000	204,478,410.96	6.83
3	1928032	19 建设银行 永续债	1,500,000	155,193,459.02	5.18
4	1928021	19 农业银行 永续债 01	1,200,000	124,946,662.30	4.17
5	242400011	24 广发银行 永续债 01	1,200,000	120,434,860.27	4.02

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细
注：无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
注：无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
注：无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

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

广发银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局的处罚。

杭州银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局浙江监管局的处罚。

交通银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局的处罚。

中国建设银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局的处罚。

中国农业银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局、国家外汇管理局北京市分局的处罚。

中国邮政储蓄银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到中国人民银行的处罚。

中信银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局的处罚。

以上证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

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	119,664.05
2	应收清算款	114,111.60
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	233,775.65

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	123107	温氏转债	16,810,217.07	0.56
2	128136	立讯转债	9,215,862.62	0.31
3	118018	瑞科转债	4,294,556.91	0.14
4	113053	隆 22 转债	4,070,014.25	0.14

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 (%)
1,931	15,533.88	24,263,660.41	80.89	5,732,254.94	19.11

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	苏银理财有限责任公司—苏银理财恒源融达 1 号	1,423,214.00	8.43
2	同方全球人寿保险有限公司	953,941.00	5.65
3	兴银理财有限责任公司—兴业银行天天万利宝稳利 1 号净值型理财产品 J 款	877,325.00	5.20
4	兴银理财有限责任公司—兴业银行天天万利宝稳利 1 号净值型理财产品 H 款	779,844.00	4.62
5	兴全基金—兴业银行—兴业证券股份有限公司	652,969.00	3.87
6	兴银理财有限责任公司—兴业银行天天万利宝稳利 1 号净值型理财产品 E 款	487,403.00	2.89
6	兴银理财有限责任公司—兴银理财天天万利宝稳利恒盈 7 号 H 款净值型理财产品	487,403.00	2.89
8	兴业银行股份有限公司—兴全安泰积极养老目标五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）	457,069.00	2.71
9	赵岩	457,000.00	2.71
10	兴银理财有限责任公司—兴业银行天天万利宝稳利 1 号净值型理财产品 L 款	428,497.00	2.54

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。

8.5 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	100,027.00	0.33	100,027.00	0.33	三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	3,000,405.00	10.00	-	-	二年
合计	3,100,432.00	10.33	100,027.00	0.33	-

注：1、本基金自 2015 年 6 月 26 日至 2015 年 7 月 1 日止期间公开发售，于 2015 年 7 月 6 日基金合同正式生效。

2、本基金管理人在募集期间认购本基金份额 10,002,700.27 份，2015 年 9 月 18 日本基金经折算后的份额为 100,027 份。

3、本基金基石投资人前海金控在募集期间认购本基金份额 300,040,500.13 份，2015 年 9 月 18 日本基金经折算后的份额为 3,000,405 份。

4、本基金管理人投资本基金的费率标准与其他相同条件的投资者适用的费率标准相一致。

§ 9 重大事件揭示

9.1 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。

9.2 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：

无。

9.3 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。

9.4 基金投资策略的改变

无。

9.5 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。

9.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

9.6.1 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。

9.6.2 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。

9.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

9.7.1 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	

			(%)		(%)	
中信建投 证券	1	203,243,612 .45	27.05	165,436.03	26.68	-
中金公司	2	190,849,938 .79	25.40	156,692.53	25.27	-
招商证券	1	120,810,314 .77	16.08	99,221.92	16.00	-
华西证券	1	85,464,943. 96	11.38	71,438.93	11.52	-
广发证券	1	64,402,591. 55	8.57	52,894.06	8.53	-
华泰证券	1	40,053,134. 42	5.33	32,895.64	5.31	-
国泰君安	2	32,917,225. 72	4.38	30,325.58	4.89	-
海通证券	1	13,513,488. 14	1.80	11,097.91	1.79	-
兴业证券	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

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。

9.7.2 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	债券交易	债券回购交易	权证交易
-----	------	--------	------

称	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
中信建投证券	-	-	24,261,500.00	54.10	-	-
中金公司	10,233,600.00	2.35	9,993,247.00	22.28	-	-
招商证券	10,237,650.00	2.36	-	-	-	-
华西证券	-	-	3,052,000.00	6.81	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	414,152,040.00	95.29	5,097,000.00	11.36	-	-
海通证券	-	-	2,445,000.00	5.45	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-

9.8 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 A 股的公告	《上海证券报》、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关于鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金 2024 年第 1 次分红公告	《上海证券报》、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 10 日
3	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《上海证券报》、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
4	鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	《上海证券报》、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
5	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	《上海证券报》、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
6	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	《上海证券报》、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

7	鹏华基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《上海证券报》、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
8	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	《上海证券报》、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
9	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	《上海证券报》、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
10	鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金 2023 年年度报告	《上海证券报》、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
11	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	《上海证券报》、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
12	鹏华基金管理有限公司关于董事长变更的公告	《上海证券报》、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
13	鹏华基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《上海证券报》、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	鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	《上海证券报》、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
15	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《上海证券报》、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
16	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	《上海证券报》、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
17	鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金基金产品资料概要（更新）	《上海证券报》、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。

§ 10 影响投资者决策的其他重要信息

10.1 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。

10.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- (一)《鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金基金合同》；
- (二)《鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金托管协议》；
- (三)《鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金 2024 年中期报告》(原文)。

11.2 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。

11.3 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