

鹏华成长智选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：招商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

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

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	8
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	11
§ 4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
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	16
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	17
6.3 净资产变动表	19
6.4 报表附注	21
§ 7 投资组合报告	48
7.1 期末基金资产组合情况	48
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48
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	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	63
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	65
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	65
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	65

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	65
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	65
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	65
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	65
7.12 投资组合报告附注	65
§ 8 基金份额持有人信息	66
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	66
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	66
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	67
§ 9 开放式基金份额变动	67
§ 10 重大事件揭示	68
10.1 基金份额持有人大会决议	68
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	68
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	68
10.4 基金投资策略的改变	68
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	68
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	68
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	69
10.8 其他重大事件	72
§ 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	74
12.1 备查文件目录	74
12.2 存放地点	74
12.3 查阅方式	74

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华成长智选混合型证券投资基金	
基金简称	鹏华成长智选混合	
基金主代码	010264	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 10 月 19 日	
基金管理人	鹏华基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	3,352,560,642.47 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	鹏华成长智选混合 A	鹏华成长智选混合 C
下属分级基金的交易代码	010264	010265
报告期末下属分级基金的份额总额	3,063,807,299.22 份	288,753,343.25 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，通过对不同资产类别的动态配置和个股精选，力求超额收益与长期资本增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金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、存托凭证、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>本基金将深度挖掘成长型股票的投资机会，通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘优质的公司，构建股票投资组合。核心思路在于：1）自上而下地分析国内外宏观经济走势、经济结构转型方向、国家经济与产业政策导向及经济周期调整等因素，挖掘未来受益于行业成长的投资机会；2）自下而上地评判企业的核心竞争力、管理层、治理结构等以及其所提供的产品和服务是否契合未来行业成长的大趋势，对企业成长性及基本面进行综合的研判，深度挖掘优质的个股。</p> <p>（1）自上而下的行业遴选</p> <p>本基金将在考虑当前经济形势和资本市场特征的基础上，结合行业生命周期、宏观经济周期不同阶段的行业景气程度以及股票市场行业轮动规律的基础上，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</p>

	<p>景，主要分析行业的外部发展环境、行业的使用寿命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。同时，本基金将根据宏观经济及证券市场环境的变化，及时对行业配置进行动态调整。</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，对企业成长性及基本面进行综合的研判，精选优质个股。</p> <p>1) 定性分析</p> <p>本基金通过以下两方面标准对股票的成长性及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>2) 定量分析</p> <p>本基金利用定量分析方法对基本面投资理念系统化，将基本面分析框架中的关键要素及研究方法进行定量刻画，通过智能选股系统与基本面分析框架相结合的方式，从成长、估值、盈利三个定量维度出发，再结合市场短期的成交、价格、资金流动等市场情绪维度，以智能选股方法构建股票组合，进行智能动态调仓，并结合行业基本面研究成果对股票组合进行评估，包括行业景气度判断，个股成长可持续性修正，剔除投资风险较大的个股等，以期获得相对市场表现的稳定超额回报。</p> <p>智能选股系统涵盖投资策略测试验证、指标选股、财务数据跟踪选股、强周期行业动态跟踪选股、市场异动个股跟踪等模块。</p> <p>A、投资策略测试验证</p> <p>智能学习国内外市场上不同的投资理念，对投资理念进行验证，对于验证过的正确的适合 A 股市场的投资理念进行系统化处理、自动跟踪，形成成熟的投资策略；</p> <p>B、指标选股</p> <p>利用包括成长性、估值、盈利等对于超额收益有解释能力的指标，综合自动选取全市场性价比较高的个股组合。</p> <p>成长性评估。本基金主要考察成长的持续性，选取营业收入增长率、盈利增长率、息税前利润增长率及现金流量增长率等排名靠前的公司。</p> <p>估值水平评估。本基金将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，主要选取市盈率（市值/净利润）、市净率（市值/净资产）、市销率（市值/</p>
--	---

	<p>营业收入)等指标衡量股票的价值是否被低估,并且进行动态调整。</p> <p>盈利水平评估。本基金重点考察企业是否具备良好的盈利能力,选择 ROA、ROE、净利率等较高的企业。</p> <p>C、财务数据跟踪选股</p> <p>跟踪公司的年报、季报、半年报、业绩预告、业绩快报等定期报告,包括分析公司已经实现的盈利能力、营运能力、偿债能力等。利用财务数据自动筛选可被证明的过往经营管理能力比较优秀的公司,通过公司财务数据的变化分析公司现阶段经营的变化,选取未来经营状况变好的公司,规避经营状况变差的公司。</p> <p>D、周期行业动态跟踪选股</p> <p>构建完整的周期性行业数据库,包括产品价格、库存、产能、供求状况等产品信息,以及估值、盈利等周期性行业公司信息,综合分析数据信息,智能把握强周期行业个股投资机会。</p> <p>E、个股异动跟踪筛选</p> <p>利用成交、换手率等市场指标及时跟踪发生交易异动的公司,再结合公司盈利、估值、成长以及行业状况,筛选出有投资机会的公司。</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,还需关注:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1) 在港股市场上市、具有行业代表性的优质中资公司; 2) 具有行业稀缺性的香港本地和外资公司; 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>3、存托凭证投资策略</p> <p>本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略,基于对基础证券投资价值的深入研究判断,进行存托凭证的投资。</p> <p>4、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>5、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>6、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</p>
--	---

	额持有人大会。 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。
业绩比较基准	中证 800 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%
风险收益特征	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。

注：无。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		鹏华基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	高永杰	张姗
	联系电话	0755-81395402	400-61-95555
	电子邮箱	xxp1@phfund.com.cn	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		4006788999	400-61-95555
传真		0755-82021126	0755-83195201
注册地址		深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		518048	518040
法定代表人		张纳沙	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
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	报告期(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)	
据和指标	鹏华成长智选混合 A	鹏华成长智选混合 C

本期已实现收益	-403,626,209.14	-37,265,041.94
本期利润	-43,493,142.60	-4,728,905.12
加权平均基金份额本期利润	-0.0137	-0.0160
本期加权平均净值利润率	-1.93%	-2.31%
本期基金份额净值增长率	-1.70%	-2.09%
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	-862,091,520.34	-87,310,890.44
期末可供分配基金份额利润	-0.2814	-0.3024
期末基金资产净值	2,201,715,778.88	201,442,452.81
期末基金份额净值	0.7186	0.6976
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	-28.14%	-30.24%

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

鹏华成长智选混合 A

阶段	份额净	份额净值	业绩比较	业绩比较基准	①-③	②-④
----	-----	------	------	--------	-----	-----

	值增长率①	增长率标准差②	基准收益率③	收益率标准差④		
过去一个月	-1.16%	0.67%	-2.95%	0.41%	1.79%	0.26%
过去三个月	0.98%	0.72%	-1.14%	0.64%	2.12%	0.08%
过去六个月	-1.70%	1.02%	0.15%	0.80%	-1.85%	0.22%
过去一年	-11.67%	0.86%	-7.87%	0.74%	-3.80%	0.12%
过去三年	-29.41%	0.93%	-23.90%	0.84%	-5.51%	0.09%
自基金合同生效起至今	-28.14%	0.88%	-17.79%	0.84%	- 10.35%	0.04%

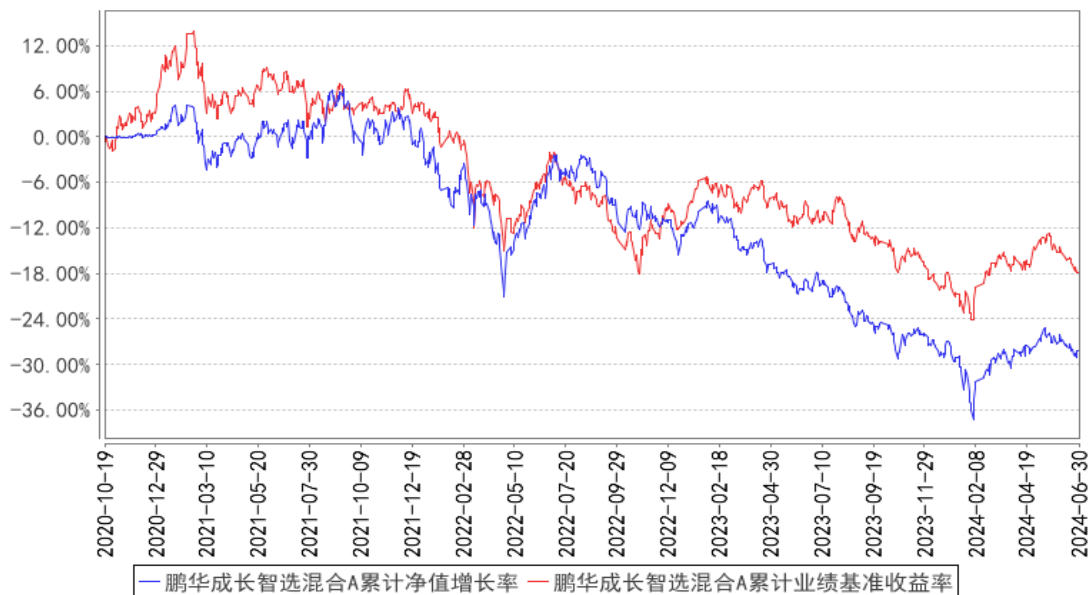
鹏华成长智选混合 C

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	-1.23%	0.67%	-2.95%	0.41%	1.72%	0.26%
过去三个月	0.78%	0.72%	-1.14%	0.64%	1.92%	0.08%
过去六个月	-2.09%	1.02%	0.15%	0.80%	-2.24%	0.22%
过去一年	-12.37%	0.86%	-7.87%	0.74%	-4.50%	0.12%
过去三年	-31.09%	0.93%	-23.90%	0.84%	-7.19%	0.09%
自基金合同生效起至今	-30.24%	0.88%	-17.79%	0.84%	- 12.45%	0.04%

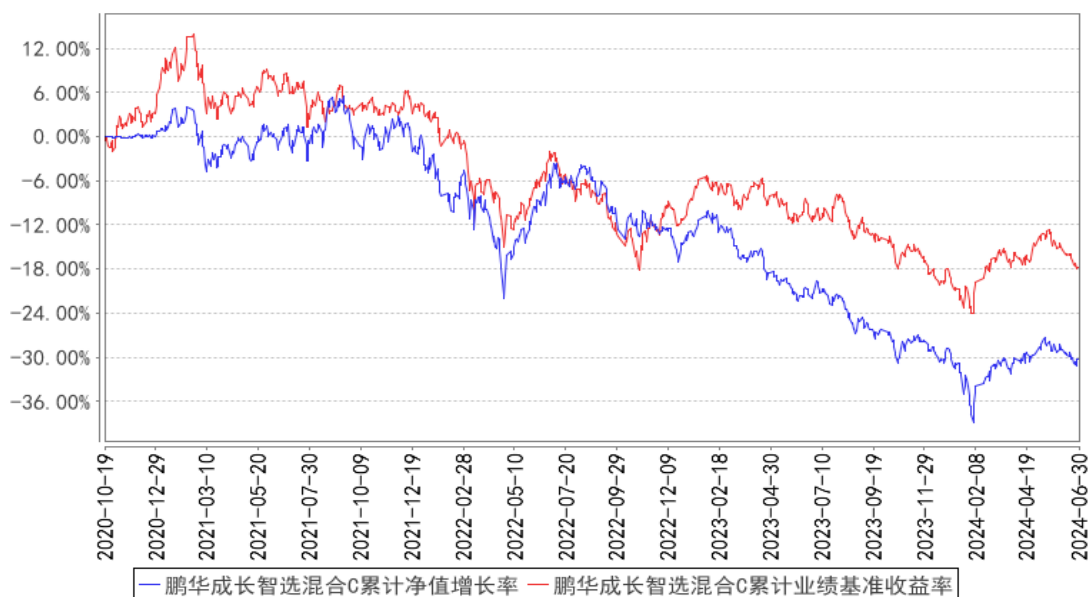
注：业绩比较基准=中证 800 指数收益率×70%+恒生指数收益率×10%（经汇率估值调整）+中证综合债指数收益率×20%

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

鹏华成长智选混合A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



鹏华成长智选混合C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 10 月 19 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		
包兵华	基金经理	2020-10-19	-	13 年	包兵华先生，国籍中国，管理学硕士，13 年证券从业经验。历任长城证券股份有限公司量化投资部研究员，第一创业证券股份有限公司衍生产品部研究员；2016 年 11 月加盟鹏华基金管理有限公司，历任研究部高级策略研究员，现任权益投资二部基金经理。2019 年 04 月至今担任鹏华研究驱动混合型证券投资基金基金经理，2019 年 05 月至今担任鹏华研究智选混合型证券投资基金基金经理，2020 年 10 月至今担任鹏华成长智选混合型证券投资基金基金经理，2021 年 11 月至 2024 年 01 月担任鹏华股息精选混合型证券投资基金基金经理，包兵华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。
梁浩	基金经理	2020-10-19	-	16 年	梁浩先生，国籍中国，经济学博士，16 年证券从业经验。曾任职于信息产业部电信研究院，从事产业政策研究工作；2008 年 5 月加盟鹏华基金管理有限公司，从事研究分析工作，历任研究部高级研究员、基金经理助理、副总经理、董事总经理（MD）/总经理，现担任公司副总裁/国际业务部总经理，投资决策委员会成员。2011 年 07 月至今担任鹏华新兴产业混合型证券投资

					<p>资基金基金经理，2014年03月至2015年12月担任鹏华环保产业股票型证券投资基金基金经理，2014年11月至2015年12月担任鹏华先进制造股票型证券投资基金基金经理，2015年07月至2017年03月担任鹏华动力增长混合型证券投资基金（LOF）基金经理，2016年01月至2017年03月担任鹏华健康环保灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016年06月至2017年07月担任鹏华医药科技股票型证券投资基金基金经理，2017年10月至2023年08月担任鹏华研究精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2018年06月至2021年01月担任鹏华创新驱动混合型证券投资基金基金经理，2018年09月至2020年03月担任鹏华研究驱动混合型证券投资基金基金经理，2019年05月至2021年01月担任鹏华研究智选混合型证券投资基金基金经理，2019年12月至2021年01月担任鹏华价值驱动混合型证券投资基金基金经理，2020年01月至2022年11月担任鹏华科技创新混合型证券投资基金基金经理，2020年07月至今担任鹏华新兴成长混合型证券投资基金基金经理，2020年10月至今担任鹏华成长智选混合型证券投资基金基金经理，2021年01月至今担任鹏华汇智优选混合型证券投资基金基金经理，2021年07月至2024年01月担任鹏华新能源精选混合型证券投资基金基金经理，梁浩先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理未发生变动。</p>
--	--	--	--	--	--

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

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
梁浩	公募基金	4	10,167,479,321.70	2011-07-14
	私募资产管理计划	3	8,631,657,572.01	2023-09-20

	其他组合	-	-	-
	合计	7	18,799,136,893.71	-

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

今年以来，指数层面整体震荡向下，具体而言，从风格上看，大盘远远好于小盘，价值优于成长，高股息优于其他板块，以微盘股为代表的小盘股跌幅较大。除此之外，苹果产业链和英伟达产业链个股也相对较优。

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 A 类份额净值增长率为-1.70%，同期业绩比较基准增长率为 0.15%；C 类份额净值增长率为-2.09%，同期业绩比较基准增长率为 0.15%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从 2021 年以来，因多重因素共同作用的结果，市场整体处于调整周期，除了个别股息价值风格个股之外，消费、医药、新能源等持续调整。经过三年多的估值消化，目前市场整体估值性价比处于相对较优的水平，未来机会远大于风险，未来会有很多机会不断孕育。

本组合策略整体上注重盈利增长和估值的匹配，侧重于成长和盈利质量风格，操作上，本基金个

股配置上较为分散，以求抓到更多机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本基金管理人设有估值委员会，由登记结算部、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，鹏华成长智选混合 A 期末可供分配利润为-862,091,520.34 元，期末基金份额净值 0.7186 元，不符合利润分配条件；鹏华成长智选混合 C 期末可供分配利润为-87,310,890.44 元，期末基金份额净值 0.6976 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

托管人声明：

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

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

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

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

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：鹏华成长智选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	316,839,298.52	266,263,457.27
结算备付金		172,742,816.07	122,510,092.62
存出保证金		178,833.18	300,110.58
交易性金融资产	6.4.7.2	1,919,992,621.67	2,242,812,720.79
其中：股票投资		1,919,992,621.67	2,240,102,154.35
基金投资		-	-
债券投资		-	2,710,566.44
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		-	3,500,432.11

应收股利		-	6.68
应收申购款		30,916.22	20,835.19
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		2,409,784,485.66	2,635,407,655.24
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		11.60	21.54
应付赎回款		2,667,927.20	9,719,202.26
应付管理人报酬		2,396,412.92	2,681,886.82
应付托管费		399,402.15	446,981.17
应付销售服务费		133,689.43	147,203.66
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	22.23
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	1,028,810.67	947,675.64
负债合计		6,626,253.97	13,942,993.32
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	3,352,560,642.47	3,593,803,007.97
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-949,402,410.78	-972,338,346.05
净资产合计		2,403,158,231.69	2,621,464,661.92
负债和净资产总计		2,409,784,485.66	2,635,407,655.24

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额为 3,352,560,642.47 份，其中鹏华成长智选混合 A 基金份额总额为 3,063,807,299.22 份，基金份额净值 0.7186 元；鹏华成长智选混合 C 基金份额总额为 288,753,343.25 份，基金份额净值 0.6976 元。

6.2 利润表

会计主体：鹏华成长智选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		-30,174,628.22	-197,979,757.30
1. 利息收入		1,274,992.99	2,745,020.51

其中：存款利息收入	6.4.7.13	1,210,676.36	2,353,014.29
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		64,316.63	392,006.22
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-424,120,566.30	-208,392,067.83
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-443,048,582.09	-230,516,712.59
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	176,085.56	4,947.96
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	18,751,930.23	22,119,696.80
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	392,669,203.36	7,660,234.90
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	1,741.73	7,055.12
减：二、营业总支出		18,047,419.50	31,754,339.15
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	14,656,413.49	26,123,522.39
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,442,735.61	4,353,920.31
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	812,096.88	1,140,699.45
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		1.99	17.93
8. 其他费用	6.4.7.23	136,171.53	136,179.07
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-48,222,047.72	-229,734,096.45
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-48,222,047.72	-229,734,096.45
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-48,222,047.72	-229,734,096.45

6.3 净资产变动表

会计主体：鹏华成长智选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	3,593,803,007. 97	-	- 972,338,346.05	2,621,464,661.9 2
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	3,593,803,007. 97	-	- 972,338,346.05	2,621,464,661.9 2
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	- 241,242,365.50	-	22,935,935.27	-218,306,430.23
（一）、综合收益总额	-	-	-48,222,047.72	-48,222,047.72
（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）	- 241,242,365.50	-	71,157,982.99	-170,084,382.51
其中：1. 基金申购款	8,654,347.16	-	-2,616,457.68	6,037,889.48
2. 基金赎回款	- 249,896,712.66	-	73,774,440.67	-176,122,271.99
（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	3,352,560,642.47	-	949,402,410.78	2,403,158,231.69
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	4,259,162,513.90	-	558,571,225.74	3,700,591,288.16
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	4,259,162,513.90	-	558,571,225.74	3,700,591,288.16
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	336,041,332.08	-	178,863,956.65	-514,905,288.73
(一)、综合收益总额	-	-	229,734,096.45	-229,734,096.45
(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)	336,041,332.08	-	50,870,139.80	-285,171,192.28
其中：1. 基金申购款	17,058,481.53	-	-2,287,533.69	14,770,947.84
2. 基金赎回款	353,099,813.61	-	53,157,673.49	-299,942,140.12
(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	3,923,121,181.82	-	737,435,182.39	3,185,685,999.43

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

鹏华成长智选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]2199号《关于准予鹏华成长智选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《鹏华成长智选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14,239,253,396.69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0908号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华成长智选混合型证券投资基金基金合同》于2020年10月19日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为14,244,520,560.70份基金份额,其中认购资金利息折合5,267,164.01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,基金托管人为招商银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、《资产管理产品相关会计处理规定》(财会[2022]14号)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《鹏华成长智选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、赠与联交所上市股票，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	316,839,298.52
等于：本金	316,808,853.68
加：应计利息	30,444.84
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	316,839,298.52

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	1,883,357,187.93	-	1,919,992,621.67	36,635,433.74
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,883,357,187.93	-	1,919,992,621.67	36,635,433.74

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	75.26
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	914,362.97
其中：交易所市场	913,282.97
银行间市场	1,080.00
应付利息	-
预提费用	114,372.44
合计	1,028,810.67

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

鹏华成长智选混合 A

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	3,290,169,619.61	3,290,169,619.61
本期申购	7,115,701.56	7,115,701.56
本期赎回（以“-”号填列）	-233,478,021.95	-233,478,021.95
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	3,063,807,299.22	3,063,807,299.22

鹏华成长智选混合 C

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	303,633,388.36	303,633,388.36
本期申购	1,538,645.60	1,538,645.60
本期赎回（以“-”号填列）	-16,418,690.71	-16,418,690.71
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	288,753,343.25	288,753,343.25

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

鹏华成长智选混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-365,436,528.24	-519,601,283.36	-885,037,811.60
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-365,436,528.24	-519,601,283.36	-885,037,811.60
本期利润	-403,626,209.14	360,133,066.54	-43,493,142.60
本期基金份额交易产生的变动数	43,570,634.53	22,868,799.33	66,439,433.86
其中：基金申购款	-1,285,633.73	-851,521.44	-2,137,155.17

基金赎回款	44,856,268.26	23,720,320.77	68,576,589.03
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-725,492,102.85	-136,599,417.49	-862,091,520.34

鹏华成长智选混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-40,080,892.26	-47,219,642.19	-87,300,534.45
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-40,080,892.26	-47,219,642.19	-87,300,534.45
本期利润	-37,265,041.94	32,536,136.82	-4,728,905.12
本期基金份额交易产生的变动数	3,094,615.92	1,623,933.21	4,718,549.13
其中：基金申购款	-313,760.74	-165,541.77	-479,302.51
基金赎回款	3,408,376.66	1,789,474.98	5,197,851.64
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-74,251,318.28	-13,059,572.16	-87,310,890.44

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	539,600.01
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	669,484.82
其他	1,591.53
合计	1,210,676.36

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	-443,048,582.09
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	-443,048,582.09

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	1,355,332,575.44
减：卖出股票成本总额	1,795,457,286.15
减：交易费用	2,923,871.38
买卖股票差价收入	-443,048,582.09

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	79,895.90
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	96,189.66
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	176,085.56

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	99,504,313.44
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	99,132,000.00
减：应计利息总额	274,935.39
减：交易费用	1,188.39
买卖债券差价收入	96,189.66

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	18,751,930.23
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	18,751,930.23

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	392,669,203.36
股票投资	392,872,953.36
债券投资	-203,750.00
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	392,669,203.36

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	1,732.36
基金转换费收入	9.37
合计	1,741.73

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	10,125.37
账户维护费	9,000.00
证券组合费	2,673.72
合计	136,171.53

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
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	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	541,393,622.15	22.23	411,614,185.52	11.74

6.4.10.1.2 债券交易

注：无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	占当期债券回 购 成交总额的比 例 (%)	成交金额	占当期债券回 购 成交总额的比 例 (%)
国信证券	210,000,000.00	28.53	-	-

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	444,645.00	21.55	285,845.17	31.30
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	338,329.61	11.22	269,831.93	13.82

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	14,656,413.49	26,123,522.39
其中：应支付销售机构的客户维护费	7,065,376.14	12,017,091.37
应支付基金管理人的净管理费	7,591,037.35	14,106,431.02

注：1、支付基金管理人鹏华基金公司的管理人报酬年费率为 1.20%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×1.20%÷当年天数。

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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	2,442,735.61	4,353,920.31

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鹏华成长智选混合 A	鹏华成长智选混合 C	合计
国信证券	-	7,069.01	7,069.01
鹏华基金公司	-	5,757.51	5,757.51
招商银行	-	524,104.17	524,104.17
合计	-	536,930.69	536,930.69
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鹏华成长智选混合 A	鹏华成长智选混合 C	合计
国信证券	-	9,520.77	9,520.77
鹏华基金公司	-	16,201.11	16,201.11
招商银行	-	722,305.94	722,305.94
合计	-	748,027.82	748,027.82

注：鹏华成长智选混合 A 基金份额不支付销售服务费；支付基金销售机构的鹏华成长智选混合 C 基金份额的销售服务费年费率为 0.8%，逐日计提，按月支付，日销售服务费=前一日分类基金资产净值×0.8%÷当年天数。

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

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
招商银行	316,839,298.52	539,600.01	694,681,464.96	1,640,358.82

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	2024	6个月	新股	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-

	阳智能	年 1 月 26 日		流通受限						
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	-
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	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	上海合晶	2024年2月1日	6个月	新股 流通 受限	22.66	15.89	866	19,623.56	13,760.74	-
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

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，包括国内依法发行或上市交易的股票（包含主板、中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、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”）、存托凭证、债券（含国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、政府支持机构债、地方政府债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券及其他中国证监会允许基金投资的债券）、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款等）、货币市场工具、同业存单、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。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，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

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

于 2024 年 06 月 30 日，本基金未持有信用类债券（2023 年 12 月 31 日：0.10%）。

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	-	2,710,566.44
未评级	-	-
合计	-	2,710,566.44

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时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金

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

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

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	316,839,298.52	-	-	-	316,839,298.52
结算备付金	172,742,816.07	-	-	-	172,742,816.07
存出保证金	178,833.18	-	-	-	178,833.18
交易性金融资产	-	-	-	1,919,992,621.67	1,919,992,621.67
应收申购款	-	-	-	30,916.22	30,916.22
资产总计	489,760,947.77	-	-	1,920,023,537.89	2,409,784,485.66
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,667,927.20	2,667,927.20
应付管理人报酬	-	-	-	2,396,412.92	2,396,412.92
应付托管费	-	-	-	399,402.15	399,402.15
应付清算款	-	-	-	11.60	11.60
应付销售服务费	-	-	-	133,689.43	133,689.43
其他负债	-	-	-	1,028,810.67	1,028,810.67
负债总计	-	-	-	6,626,253.97	6,626,253.97
利率敏感度缺口	489,760,947.77	-	-	1,913,397,283.92	2,403,158,231.69
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	266,263,457.27	-	-	-	266,263,457.27
结算备付金	122,510,092.62	-	-	-	122,510,092.62
存出保证金	300,110.58	-	-	-	300,110.58
交易性金融资产	-	2,710,566.44	-	2,240,102,154.35	2,242,812,720.79
应收股利	-	-	-	6.68	6.68
应收申购款	-	-	-	20,835.19	20,835.19
应收清算款	-	-	-	3,500,432.11	3,500,432.11
资产总计	389,073,660.47	2,710,566.44	-	2,243,623,428.33	2,635,407,655.24
负债					
应付赎回款	-	-	-	9,719,202.26	9,719,202.26
应付管理人报酬	-	-	-	2,681,886.82	2,681,886.82
应付托管费	-	-	-	446,981.17	446,981.17
应付清算款	-	-	-	21.54	21.54
应付销售服务费	-	-	-	147,203.66	147,203.66
应交税费	-	-	-	22.23	22.23
其他负债	-	-	-	947,675.64	947,675.64
负债总计	-	-	-	13,942,993.32	13,942,993.32
利率敏感度缺口	389,073,660.47	2,710,566.44	-	2,229,680,435.01	2,621,464,661.92

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金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	-	51,173,079.63	-	51,173,079.63
资产合计	-	51,173,079.63	-	51,173,079.63
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	-	51,173,079.63	-	51,173,079.63
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 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	-	98,029,709.94	-	98,029,709.94
资产合计	-	98,029,709.94	-	98,029,709.94
以外币计价的 负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外	-	98,029,709.94	-	98,029,709.94

汇风险敞口净额				
---------	--	--	--	--

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%	2,558,653.98	4,901,485.50
	人民币贬值 5%	-2,558,653.98	-4,901,485.50

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：股票资产及存托凭证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，基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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	1,919,992,621.67	79.89	2,240,102,154.35	85.45
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	2,710,566.44	0.10
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	1,919,992,621.67	79.89	2,242,812,720.79	85.55

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	97,111,624.14	81,396,477.75
比较基准下降 5% 资产净值变动	-97,111,624.14	-81,396,477.75	

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	1,919,681,946.93
第二层次	45,611.11
第三层次	265,063.63
合计	1,919,992,621.67

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	1,919,992,621.67	79.67
	其中：股票	1,919,992,621.67	79.67
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	489,582,114.59	20.32
8	其他各项资产	209,749.40	0.01
9	合计	2,409,784,485.66	100.00

注：本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 51,173,079.63 元，占净值比 2.13%。

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	22,050,404.75	0.92
B	采矿业	50,265,724.95	2.09
C	制造业	1,067,267,493.30	44.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	318,178,594.79	13.24
E	建筑业	12,492,623.73	0.52
F	批发和零售业	9,599,010.69	0.40
G	交通运输、仓储和邮政业	104,078,661.08	4.33
H	住宿和餐饮业	17,649,697.40	0.73
I	信息传输、软件和信息技术服务业	47,463,127.12	1.98
J	金融业	205,526,869.18	8.55
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	7,867,544.92	0.33
M	科学研究和技术服务业	734,084.41	0.03

N	水利、环境和公共设施管理业	1,195,942.30	0.05
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	4,143,870.00	0.17
Q	卫生和社会工作	162,858.49	0.01
R	文化、体育和娱乐业	143,034.93	0.01
S	综合	-	-
	合计	1,868,819,542.04	77.77

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	16,681,611.10	0.69
能源	-	-
非日常生活消费品	4,287,617.27	0.18
日常消费品	6,664,765.86	0.28
医疗保健	7,030,739.11	0.29
信息技术	14,044,201.56	0.58
通信服务	-	-
房地产	-	-
工业	2,464,144.73	0.10
公用事业	-	-
合计	51,173,079.63	2.13

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	600900	长江电力	4,742,820	137,162,354.40	5.71
2	600674	川投能源	4,215,000	79,031,250.00	3.29
3	601916	浙商银行	20,657,650	57,015,114.00	2.37
4	000400	许继电气	1,319,600	45,407,436.00	1.89
5	600150	中国船舶	1,000,500	40,730,355.00	1.69
6	601989	中国重工	7,411,200	36,537,216.00	1.52
7	300181	佐力药业	2,383,000	36,030,960.00	1.50
8	000039	中集集团	3,632,300	33,635,098.00	1.40
9	600023	浙能电力	4,660,100	33,133,311.00	1.38
10	601179	中国西电	4,117,300	33,103,092.00	1.38
11	600482	中国动力	1,659,200	32,321,216.00	1.34
12	600988	赤峰黄金	1,977,400	32,310,716.00	1.34
13	000423	东阿阿胶	500,900	31,356,340.00	1.30
14	600021	上海电力	2,764,500	27,340,905.00	1.14
15	000725	京东方 A	6,027,000	24,650,430.00	1.03

16	600685	中船防务	863,100	24,080,490.00	1.00
17	605499	东鹏饮料	110,000	23,732,500.00	0.99
18	688789	宏华数科	204,840	22,081,752.00	0.92
19	688187	时代电气	432,624	21,362,973.12	0.89
20	300857	协创数据	371,800	21,192,600.00	0.88
21	601766	中国中车	2,770,900	20,809,459.00	0.87
22	688100	威胜信息	540,118	20,605,501.70	0.86
23	688617	惠泰医疗	44,789	20,428,262.90	0.85
24	600011	华能国际	2,098,100	20,183,722.00	0.84
25	688009	中国通号	3,338,103	20,028,618.00	0.83
26	603298	杭叉集团	1,019,569	20,024,335.16	0.83
27	601128	常熟银行	2,517,350	19,056,339.50	0.79
28	000100	TCL 科技	4,146,900	17,914,608.00	0.75
29	601021	春秋航空	313,900	17,681,987.00	0.74
30	600761	安徽合力	808,786	17,502,129.04	0.73
31	03908	中金公司	2,102,400	16,674,532.17	0.69
32	600845	宝信软件	502,488	16,044,441.84	0.67
33	688575	亚辉龙	674,457	15,728,337.24	0.65
34	601567	三星医疗	433,400	15,169,000.00	0.63
35	601318	中国平安	361,238	14,940,803.68	0.62
36	603885	吉祥航空	1,354,100	14,881,559.00	0.62
37	01810	小米集团-W	933,730	14,044,201.56	0.58
38	601728	中国电信	2,267,300	13,943,895.00	0.58
39	000680	山推股份	1,502,100	13,924,467.00	0.58
40	002100	天康生物	2,000,000	13,860,000.00	0.58
41	600519	贵州茅台	8,900	13,059,771.00	0.54
42	688488	艾迪药业	1,269,845	12,977,815.90	0.54
43	002311	海大集团	270,900	12,745,845.00	0.53
44	600926	杭州银行	975,000	12,723,750.00	0.53
45	601939	建设银行	1,682,900	12,453,460.00	0.52
46	300760	迈瑞医疗	42,300	12,305,493.00	0.51
47	601868	中国能建	5,803,100	12,302,572.00	0.51
48	601975	招商南油	3,320,700	11,921,313.00	0.50
49	603050	科林电气	490,440	11,898,074.40	0.50
50	600428	中远海特	1,939,500	11,869,740.00	0.49
51	603111	康尼机电	1,959,800	11,406,036.00	0.47
52	601872	招商轮船	1,345,500	11,369,475.00	0.47
53	600961	株冶集团	1,200,000	11,328,000.00	0.47
54	601069	西部黄金	957,000	11,129,910.00	0.46
55	603338	浙江鼎力	184,200	11,129,364.00	0.46
56	002714	牧原股份	250,200	10,908,720.00	0.45
57	601658	邮储银行	2,141,400	10,856,898.00	0.45
58	601126	四方股份	562,622	10,813,594.84	0.45

59	300979	华利集团	177,225	10,784,141.25	0.45
60	600809	山西汾酒	49,400	10,417,472.00	0.43
61	000951	中国重汽	717,100	10,268,872.00	0.43
62	300832	新产业	150,100	10,122,744.00	0.42
63	002142	宁波银行	453,200	9,997,592.00	0.42
64	600566	济川药业	310,000	9,830,100.00	0.41
65	300498	温氏股份	492,600	9,763,332.00	0.41
66	600312	平高电气	500,000	9,725,000.00	0.40
67	601878	浙商证券	900,000	9,648,000.00	0.40
68	000682	东方电子	848,800	9,370,752.00	0.39
69	002533	金杯电工	927,800	9,231,610.00	0.38
70	000596	古井贡酒	43,100	9,097,117.00	0.38
71	000528	柳工	796,500	8,912,835.00	0.37
72	301004	嘉益股份	97,712	8,891,792.00	0.37
73	603699	纽威股份	514,400	8,806,528.00	0.37
74	601108	财通证券	1,300,000	8,593,000.00	0.36
75	601058	赛轮轮胎	611,600	8,562,400.00	0.36
76	301291	明阳电气	282,465	8,488,073.25	0.35
77	002948	青岛银行	2,495,500	8,409,835.00	0.35
78	600707	彩虹股份	1,180,000	8,035,800.00	0.33
79	600079	人福医药	466,023	8,001,614.91	0.33
80	601166	兴业银行	451,600	7,957,192.00	0.33
81	601326	秦港股份	2,449,500	7,764,915.00	0.32
82	300661	圣邦股份	93,615	7,749,449.70	0.32
83	301345	涛涛车业	138,952	7,656,255.20	0.32
84	000088	盐田港	1,664,300	7,539,279.00	0.31
85	601038	一拖股份	474,400	7,500,264.00	0.31
86	000338	潍柴动力	461,000	7,486,640.00	0.31
87	301363	美好医疗	257,647	7,471,763.00	0.31
88	000899	赣能股份	738,200	7,138,394.00	0.30
89	002444	巨星科技	288,900	7,135,830.00	0.30
90	600754	锦江酒店	292,400	6,719,352.00	0.28
91	06186	中国飞鹤	2,022,000	6,662,034.65	0.28
92	300059	东方财富	630,362	6,656,622.72	0.28
93	601838	成都银行	428,900	6,514,991.00	0.27
94	601636	旗滨集团	1,007,600	6,499,020.00	0.27
95	600262	北方股份	394,800	6,486,564.00	0.27
96	002966	苏州银行	854,900	6,411,750.00	0.27
97	600258	首旅酒店	513,500	6,341,725.00	0.26
98	603198	迎驾贡酒	110,000	6,325,000.00	0.26
99	00460	四环医药	13,227,000	6,277,449.55	0.26
100	002597	金禾实业	310,084	6,167,570.76	0.26
101	002928	华夏航空	906,700	5,748,478.00	0.24

102	002707	众信旅游	949,300	5,448,982.00	0.23
103	600529	山东药玻	206,000	5,220,040.00	0.22
104	600875	东方电气	278,700	5,142,015.00	0.21
105	002415	海康威视	160,000	4,945,600.00	0.21
106	601665	齐鲁银行	1,001,700	4,918,347.00	0.20
107	000913	钱江摩托	311,500	4,909,240.00	0.20
108	603806	福斯特	333,003	4,895,144.10	0.20
109	603530	神马电力	183,200	4,852,968.00	0.20
110	600026	中远海能	302,800	4,726,708.00	0.20
111	600642	申能股份	529,400	4,674,602.00	0.19
112	301073	君亭酒店	252,122	4,588,620.40	0.19
113	600887	伊利股份	170,100	4,395,384.00	0.18
114	002683	广东宏大	215,700	4,342,041.00	0.18
115	603992	松霖科技	234,000	4,303,260.00	0.18
116	02469	粉笔	1,126,500	4,287,318.86	0.18
117	688408	中信博	45,695	4,207,595.60	0.18
118	000065	北方国际	400,000	4,148,000.00	0.17
119	600661	昂立教育	369,000	4,143,870.00	0.17
120	603871	嘉友国际	233,340	4,127,784.60	0.17
121	605020	永和股份	212,790	4,081,312.20	0.17
122	600710	苏美达	500,000	4,075,000.00	0.17
123	000883	湖北能源	668,200	4,015,882.00	0.17
124	001965	招商公路	332,700	3,945,822.00	0.16
125	600160	巨化股份	158,400	3,822,192.00	0.16
126	601398	工商银行	637,000	3,630,900.00	0.15
127	601963	重庆银行	464,700	3,601,425.00	0.15
128	002270	华明装备	161,100	3,582,864.00	0.15
129	300866	安克创新	48,880	3,480,744.80	0.14
130	603379	三美股份	76,200	2,982,468.00	0.12
131	300633	开立医疗	74,300	2,940,794.00	0.12
132	300307	慈星股份	488,700	2,907,765.00	0.12
133	601991	大唐发电	965,700	2,906,757.00	0.12
134	605196	华通线缆	245,611	2,583,827.72	0.11
135	301269	华大九天	33,300	2,565,765.00	0.11
136	300525	博思软件	200,080	2,541,016.00	0.11
137	002332	仙琚制药	219,500	2,504,495.00	0.10
138	000957	中通客车	235,000	2,472,200.00	0.10
139	03808	中国重汽	133,000	2,464,144.73	0.10
140	688036	传音控股	32,099	2,456,857.46	0.10
141	000975	银泰黄金	146,500	2,386,485.00	0.10
142	601500	通用股份	445,200	2,377,368.00	0.10
143	600098	广州发展	365,500	2,339,200.00	0.10
144	603209	兴通股份	168,333	2,329,728.72	0.10

145	603711	香飘飘	166,500	2,306,025.00	0.10
146	688676	金盘科技	42,835	2,233,845.25	0.09
147	603518	锦泓集团	253,500	2,230,800.00	0.09
148	002027	分众传媒	350,400	2,123,424.00	0.09
149	688347	华虹公司	57,825	2,073,026.25	0.09
150	601288	农业银行	471,600	2,056,176.00	0.09
151	603638	艾迪精密	140,000	1,964,200.00	0.08
152	600460	士兰微	109,350	1,914,718.50	0.08
153	301391	卡莱特	43,400	1,900,052.00	0.08
154	301367	怡和嘉业	28,024	1,743,092.80	0.07
155	601890	亚星锚链	200,000	1,410,000.00	0.06
156	002299	圣农发展	100,049	1,364,668.36	0.06
157	002891	中宠股份	64,899	1,354,442.13	0.06
158	688443	智翔金泰-U	30,329	901,984.46	0.04
159	688563	航材股份	15,010	793,728.80	0.03
160	603661	恒林股份	18,400	776,664.00	0.03
161	09996	沛嘉医疗-B	362,000	753,289.56	0.03
162	600323	瀚蓝环境	31,600	660,440.00	0.03
163	688172	燕东微	40,177	650,063.86	0.03
164	688469	芯联集成-U	137,994	546,456.24	0.02
165	688581	安杰思	10,563	516,847.59	0.02
166	600966	博汇纸业	104,300	498,554.00	0.02
167	603296	华勤技术	8,295	458,132.85	0.02
168	301217	铜冠铜箔	42,831	411,177.60	0.02
169	688076	诺泰生物	4,984	390,147.52	0.02
170	688409	富创精密	9,374	346,275.56	0.01
171	688146	中船特气	10,101	301,514.85	0.01
172	301498	乖宝宠物	5,531	297,567.80	0.01
173	688549	中巨芯-U	42,933	289,797.75	0.01
174	300881	盛德鑫泰	11,160	286,700.40	0.01
175	301219	腾远钴业	7,491	286,605.66	0.01
176	688295	中复神鹰	13,998	284,159.40	0.01
177	688522	纳睿雷达	6,019	282,170.72	0.01
178	601061	中信金属	40,154	275,857.98	0.01
179	301200	大族数控	8,566	270,342.96	0.01
180	688110	东芯股份	14,044	267,819.08	0.01
181	605168	三人行	9,988	262,984.04	0.01
182	688116	天奈科技	10,240	236,339.20	0.01
183	002737	葵花药业	10,100	236,138.00	0.01
184	301206	三元生物	9,438	231,986.04	0.01
185	688531	日联科技	5,017	231,584.72	0.01
186	001287	中电港	13,860	229,105.80	0.01
187	688190	云路股份	3,026	226,072.46	0.01

188	688702	盛科通信-U	5,488	222,264.00	0.01
189	301187	欧圣电气	8,759	212,405.75	0.01
190	301486	致尚科技	4,820	203,934.20	0.01
191	601033	永兴股份	12,577	203,332.29	0.01
192	301511	德福科技	13,738	202,772.88	0.01
193	688543	国科军工	4,913	201,776.91	0.01
194	688709	成都华微	10,448	201,301.51	0.01
195	688539	高华科技	7,468	200,963.88	0.01
196	301127	天源环保	16,843	199,084.26	0.01
197	688269	凯立新材	7,684	196,326.20	0.01
198	688432	有研硅	20,044	194,226.36	0.01
199	301559	中集环科	13,144	191,508.08	0.01
200	688306	均普智能	47,094	191,201.64	0.01
201	688629	华丰科技	7,073	186,444.28	0.01
202	301325	曼恩斯特	4,363	185,078.46	0.01
203	688582	芯动联科	6,476	182,364.16	0.01
204	301339	通行宝	9,127	181,536.03	0.01
205	688551	科威尔	5,759	181,408.50	0.01
206	688570	天玛智控	8,837	180,186.43	0.01
207	002138	顺络电子	6,400	175,744.00	0.01
208	301371	敷尔佳	5,637	175,085.22	0.01
209	301565	中仑新材	7,103	174,381.42	0.01
210	688239	航宇科技	4,926	171,424.80	0.01
211	301303	真兰仪表	14,804	170,542.08	0.01
212	301536	星辰科技	4,809	167,218.27	0.01
213	688392	骄成超声	3,843	163,096.92	0.01
214	301293	三博脑科	4,321	162,858.49	0.01
215	688652	京仪装备	4,157	162,497.13	0.01
216	688141	杰华特	9,946	160,727.36	0.01
217	688035	德邦科技	4,981	160,487.82	0.01
218	688486	龙迅股份	2,793	160,038.90	0.01
219	301096	百诚医药	2,714	157,629.12	0.01
220	688507	索辰科技	3,231	157,026.60	0.01
221	301262	海看股份	6,917	155,978.35	0.01
222	301368	丰立智能	3,368	155,197.44	0.01
223	301508	中机认检	4,186	154,714.56	0.01
224	301580	爱迪特	2,018	153,513.06	0.01
225	301311	昆船智能	8,320	152,921.60	0.01
226	688362	甬矽电子	7,779	151,379.34	0.01
227	301361	众智科技	5,169	150,417.90	0.01
228	301525	儒竞科技	2,660	149,704.80	0.01
229	688660	电气风电	51,238	147,565.44	0.01
230	301177	迪阿股份	7,920	147,312.00	0.01

231	301285	鸿日达	5,643	147,225.87	0.01
232	301179	泽宇智能	7,412	144,237.52	0.01
233	301421	波长光电	3,315	143,307.45	0.01
234	688334	西高院	8,879	142,951.90	0.01
235	688584	上海合晶	8,659	141,955.59	0.01
236	688687	凯因科技	5,354	136,580.54	0.01
237	301377	鼎泰高科	7,695	135,047.25	0.01
238	301370	国科恒泰	12,395	134,733.65	0.01
239	688591	泰凌微	6,806	133,057.30	0.01
240	301381	赛维时代	5,710	129,788.30	0.01
241	688691	灿芯股份	2,461	128,948.97	0.01
242	301172	君逸数码	4,376	128,566.88	0.01
243	301259	艾布鲁	6,276	127,716.60	0.01
244	301488	豪恩汽电	2,618	125,925.80	0.01
245	301550	斯菱股份	2,600	124,566.00	0.01
246	301558	三态股份	14,578	122,309.42	0.01
247	601083	锦江航运	12,630	120,742.80	0.01
248	301439	泓淋电力	9,486	120,187.62	0.01
249	301277	新天地	9,205	119,480.90	0.00
250	301141	中科磁业	3,664	118,164.00	0.00
251	688290	景业智能	3,648	117,100.80	0.00
252	688478	晶升股份	4,013	116,858.56	0.00
253	688376	美埃科技	3,713	116,439.68	0.00
254	603341	龙旗科技	2,978	115,638.42	0.00
255	301516	中远通	6,033	112,394.79	0.00
256	688776	国光电气	2,026	112,240.40	0.00
257	688612	威迈斯	4,218	112,072.26	0.00
258	688496	清越科技	12,000	110,880.00	0.00
259	688167	炬光科技	2,014	110,770.00	0.00
260	688562	航天软件	7,254	110,768.58	0.00
261	301251	威尔高	3,207	110,417.01	0.00
262	301393	昊帆生物	2,597	110,294.59	0.00
263	688535	华海诚科	1,607	110,111.64	0.00
264	301510	固高科技	3,957	109,806.75	0.00
265	301317	鑫磊股份	6,936	107,785.44	0.00
266	301507	民生健康	8,509	107,383.58	0.00
267	301456	盘古智能	4,061	105,951.49	0.00
268	300814	中富电路	3,280	105,911.20	0.00
269	301548	崇德科技	1,959	103,983.72	0.00
270	002271	东方雨虹	8,400	103,656.00	0.00
271	301151	冠龙节能	7,025	103,408.00	0.00
272	301398	星源卓镁	2,549	103,361.95	0.00
273	688627	精智达	2,212	102,681.04	0.00

274	301322	绿通科技	5,467	102,615.59	0.00
275	301221	光庭信息	2,791	99,582.88	0.00
276	301517	陕西华达	1,841	99,414.00	0.00
277	301332	德尔玛	11,211	99,105.24	0.00
278	301566	达利凯普	5,755	97,662.35	0.00
279	688285	高铁电气	15,159	97,472.37	0.00
280	001389	广合科技	2,219	97,078.01	0.00
281	301199	迈赫股份	4,014	97,058.52	0.00
282	688305	科德数控	1,496	96,432.16	0.00
283	688102	斯瑞新材	8,442	96,407.64	0.00
284	301320	豪江智能	6,416	96,368.32	0.00
285	301382	蜂助手	5,304	95,949.36	0.00
286	688593	新相微	9,584	95,840.00	0.00
287	301539	宏鑫科技	3,607	92,654.66	0.00
288	688697	纽威数控	5,837	91,582.53	0.00
289	301168	通灵股份	3,281	91,146.18	0.00
290	688419	耐科装备	3,039	90,926.88	0.00
291	301489	思泉新材	1,278	90,201.24	0.00
292	301408	华人健康	8,784	89,860.32	0.00
293	688087	英科再生	3,457	89,467.16	0.00
294	301587	中瑞股份	3,056	89,267.06	0.00
295	301329	信音电子	4,577	88,473.41	0.00
296	301591	肯特股份	2,184	88,113.42	0.00
297	301413	安培龙	2,123	87,786.05	0.00
298	688257	新锐股份	5,683	87,120.39	0.00
299	688433	华曙高科	4,171	87,007.06	0.00
300	688049	炬芯科技	3,912	86,533.44	0.00
301	301357	北方长龙	2,660	85,864.80	0.00
302	688097	博众精工	3,983	84,758.24	0.00
303	301136	招标股份	7,172	84,486.16	0.00
304	301499	维科精密	3,709	84,305.57	0.00
305	301399	英特科技	4,241	83,462.88	0.00
306	688653	康希通信	6,478	83,436.64	0.00
307	301110	青木股份	2,818	83,215.54	0.00
308	301185	鸥玛软件	5,776	82,770.08	0.00
309	688458	美芯晟	3,088	82,758.40	0.00
310	688620	安凯微	10,157	82,677.98	0.00
311	301459	丰茂股份	2,077	82,477.67	0.00
312	301222	浙江恒威	3,315	82,079.40	0.00
313	688084	晶品特装	1,875	81,937.50	0.00
314	301202	朗威股份	3,060	81,885.60	0.00
315	301419	阿莱德	3,292	81,740.36	0.00
316	688602	康鹏科技	10,653	81,708.51	0.00

317	688523	航天环宇	4,717	81,368.25	0.00
318	301190	善水科技	5,741	80,546.23	0.00
319	301359	东南电子	3,271	79,812.40	0.00
320	301500	飞南资源	4,550	79,397.50	0.00
321	688489	三未信安	2,953	78,667.92	0.00
322	603135	中重科技	6,273	78,600.69	0.00
323	301386	未来电器	3,776	78,314.24	0.00
324	301568	思泰克	2,456	78,149.92	0.00
325	301100	风光股份	5,985	77,745.15	0.00
326	601065	江盐集团	8,748	75,845.16	0.00
327	301193	家联科技	4,752	75,841.92	0.00
328	301281	科源制药	3,366	75,566.70	0.00
329	301418	协昌科技	1,886	75,440.00	0.00
330	301315	威士顿	2,253	73,425.27	0.00
331	301261	恒工精密	1,973	73,139.11	0.00
332	301519	舜禹股份	4,414	73,095.84	0.00
333	688603	天承科技	1,391	72,624.11	0.00
334	301388	欣灵电气	2,920	72,153.20	0.00
335	301292	海科新源	5,824	72,042.88	0.00
336	301323	新莱福	2,277	71,907.66	0.00
337	301135	瑞德智能	3,376	71,875.04	0.00
338	601133	柏诚股份	6,632	70,896.08	0.00
339	688719	爱科赛博	2,714	70,753.98	0.00
340	301052	果麦文化	3,394	69,577.00	0.00
341	688530	欧莱新材	3,437	69,099.55	0.00
342	688152	麒麟信安	1,772	68,611.84	0.00
343	688646	逸飞激光	2,190	68,349.90	0.00
344	301166	优宁维	2,528	68,256.00	0.00
345	688435	英方软件	2,728	68,090.88	0.00
346	301108	洁雅股份	2,800	68,068.00	0.00
347	301138	华研精机	2,849	68,062.61	0.00
348	301117	佳缘科技	2,616	67,492.80	0.00
349	301518	长华化学	3,850	66,720.50	0.00
350	301272	英华特	1,729	66,704.82	0.00
351	688720	艾森股份	1,644	66,647.76	0.00
352	688648	中邮科技	3,025	66,066.00	0.00
353	301520	万邦医药	1,596	66,042.48	0.00
354	301428	世纪恒通	2,289	65,694.30	0.00
355	301290	东星医疗	3,291	65,523.81	0.00
356	301170	锡南科技	2,496	65,020.80	0.00
357	301265	华新环保	8,181	64,711.71	0.00
358	301028	东亚机械	7,329	64,275.33	0.00
359	688480	赛恩斯	2,302	64,133.72	0.00

360	301337	亚华电子	2,318	63,930.44	0.00
361	301045	天禄科技	3,350	63,851.00	0.00
362	688259	创耀科技	1,595	63,736.20	0.00
363	688693	锆威特	1,773	63,686.16	0.00
364	301276	嘉曼服饰	3,026	63,424.96	0.00
365	301555	惠柏新材	2,235	63,317.55	0.00
366	301528	多浦乐	1,478	63,317.52	0.00
367	688695	中创股份	1,856	63,082.50	0.00
368	301373	凌玮科技	2,764	63,019.20	0.00
369	688787	海天瑞声	1,144	62,782.72	0.00
370	301133	金钟股份	2,860	62,319.40	0.00
371	300904	威力传动	1,537	61,433.89	0.00
372	688573	信宇人	2,844	60,804.72	0.00
373	603093	南华期货	7,000	60,620.00	0.00
374	301578	辰奕智能	1,527	60,423.39	0.00
375	301295	美硕科技	3,004	59,809.64	0.00
376	301126	达嘉维康	6,615	59,733.45	0.00
377	301529	福赛科技	1,816	59,582.96	0.00
378	301588	美新科技	2,568	59,238.22	0.00
379	688429	时创能源	3,452	58,476.88	0.00
380	301309	万得凯	2,271	58,046.76	0.00
381	301505	苏州规划	1,934	58,020.00	0.00
382	301360	荣旗科技	1,340	57,955.00	0.00
383	301533	威马农机	2,243	57,622.67	0.00
384	301046	能辉科技	2,891	56,865.97	0.00
385	688716	中研股份	2,668	56,561.60	0.00
386	301163	宏德股份	2,764	56,164.48	0.00
387	603193	润本股份	3,022	55,574.58	0.00
388	688103	国力股份	1,595	55,442.20	0.00
389	300994	久祺股份	5,034	55,323.66	0.00
390	688143	长盈通	2,519	53,956.98	0.00
391	301355	南王科技	5,624	53,934.16	0.00
392	301161	唯万密封	3,460	53,733.80	0.00
393	301502	华阳智能	1,375	53,673.83	0.00
394	301062	上海艾录	5,225	53,347.25	0.00
395	301036	双乐股份	2,047	53,262.94	0.00
396	301111	粤万年青	3,783	52,772.85	0.00
397	688479	友车科技	3,318	52,723.02	0.00
398	301316	慧博云通	3,584	52,613.12	0.00
399	688651	盛邦安全	1,778	52,006.50	0.00
400	603119	浙江荣泰	2,929	51,901.88	0.00
401	301116	益客食品	5,764	51,472.52	0.00
402	688307	中润光学	2,455	50,793.95	0.00

403	301313	凡拓数创	2,464	50,142.40	0.00
404	301319	唯特偶	1,666	50,029.98	0.00
405	688420	美腾科技	2,408	49,797.44	0.00
406	688737	中自科技	3,061	49,588.20	0.00
407	603381	永臻股份	1,778	49,273.14	0.00
408	301157	华塑科技	1,498	48,834.80	0.00
409	001378	德冠新材	2,044	48,769.84	0.00
410	301118	恒光股份	3,142	46,847.22	0.00
411	301158	德石股份	3,783	46,795.71	0.00
412	688173	希荻微	4,236	46,723.08	0.00
413	301026	浩通科技	2,027	46,539.92	0.00
414	603107	上海汽配	2,920	46,398.80	0.00
415	688255	凯尔达	2,309	46,295.45	0.00
416	603325	博隆技术	660	45,347.28	0.00
417	600925	苏能股份	8,960	45,248.00	0.00
418	688509	正元地信	15,433	44,601.37	0.00
419	301515	港通医疗	2,294	43,907.16	0.00
420	603344	星德胜	1,813	42,892.99	0.00
421	301033	迈普医学	1,076	42,082.36	0.00
422	603062	麦加芯彩	1,258	41,778.18	0.00
423	688722	同益中	3,687	41,257.53	0.00
424	001359	平安电工	1,833	40,513.63	0.00
425	301025	读客文化	4,027	40,229.73	0.00
426	603125	常青科技	2,314	39,823.94	0.00
427	300910	瑞丰新材	901	39,391.72	0.00
428	688345	博力威	2,332	39,387.48	0.00
429	301066	万事利	4,810	38,961.00	0.00
430	301068	大地海洋	1,867	38,721.58	0.00
431	603270	金帝股份	1,943	38,549.12	0.00
432	301078	孩子王	7,551	38,208.06	0.00
433	001328	登康口腔	1,445	36,558.50	0.00
434	301072	中捷精工	1,802	35,823.76	0.00
435	605589	圣泉集团	1,750	35,507.50	0.00
436	001326	联域股份	986	35,357.96	0.00
437	301049	超越科技	1,954	35,074.30	0.00
438	301032	新柴股份	5,124	34,382.04	0.00
439	001306	夏厦精密	631	34,067.69	0.00
440	603312	西典新能	1,296	33,263.00	0.00
441	603004	鼎龙科技	1,948	33,018.60	0.00
442	603273	天元智能	1,772	32,516.20	0.00
443	688511	天微电子	1,490	32,437.30	0.00
444	301526	国际复材	9,723	32,377.59	0.00
445	603082	北自科技	1,070	32,276.55	0.00

446	603075	热威股份	1,812	31,981.80	0.00
447	688768	容知日新	1,342	31,416.22	0.00
448	688501	青达环保	2,287	31,286.16	0.00
449	301053	远信工业	1,544	30,818.24	0.00
450	688692	达梦数据	175	30,612.75	0.00
451	001379	腾达科技	2,128	29,183.34	0.00
452	300774	倍杰特	4,435	28,960.55	0.00
453	001282	三联锻造	1,045	28,956.95	0.00
454	603375	盛景微	714	28,339.56	0.00
455	603231	索宝蛋白	1,610	27,434.40	0.00
456	603281	江瀚新材	1,208	27,119.60	0.00
457	688718	唯赛勃	3,145	26,889.75	0.00
458	001387	雪祺电气	1,729	26,756.25	0.00
459	300919	中伟股份	854	26,465.46	0.00
460	001239	永达股份	1,887	26,191.56	0.00
461	001358	兴欣新材	1,214	24,911.28	0.00
462	600955	维远股份	1,694	24,410.54	0.00
463	603276	恒兴新材	1,737	24,213.78	0.00
464	601921	浙版传媒	3,154	24,096.56	0.00
465	603373	安邦护卫	876	24,081.24	0.00
466	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.00
467	688071	华依科技	1,101	23,858.67	0.00
468	001213	中铁特货	5,818	22,981.10	0.00
469	301487	盟固利	867	22,420.62	0.00
470	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.00
471	600941	中国移动	200	21,500.00	0.00
472	001311	多利科技	844	20,407.92	0.00
473	603071	物产环能	1,627	20,386.31	0.00
474	301162	国能日新	468	20,386.08	0.00
475	301050	雷电微力	419	20,179.04	0.00
476	603137	恒尚节能	1,935	19,737.00	0.00
477	603172	万丰股份	1,220	19,715.20	0.00
478	001314	亿道信息	508	19,522.44	0.00
479	001308	康冠科技	867	19,507.50	0.00
480	605167	利柏特	2,471	19,298.51	0.00
481	001367	海森药业	813	18,975.42	0.00
482	301348	蓝箭电子	613	18,629.07	0.00
483	603132	金徽股份	1,342	18,465.92	0.00
484	001337	四川黄金	795	18,451.95	0.00
485	001324	长青科技	1,131	18,322.20	0.00
486	601022	宁波远洋	1,983	17,490.06	0.00
487	603171	税友股份	637	17,224.48	0.00
488	605598	上海港湾	774	17,097.66	0.00

489	001338	永顺泰	1,649	16,160.20	0.00
490	301120	新特电气	1,548	16,083.72	0.00
491	601096	宏盛华源	3,918	16,024.62	0.00
492	603206	嘉环科技	1,210	15,282.30	0.00
493	301018	申菱环境	782	15,202.08	0.00
494	001288	运机集团	537	14,864.16	0.00
495	001216	华瓷股份	1,177	14,783.12	0.00
496	601121	宝地矿业	2,532	14,407.08	0.00
497	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00
498	601528	瑞丰银行	2,899	13,683.28	0.00
499	300981	中红医疗	1,407	13,464.99	0.00
500	001208	华菱线缆	1,754	13,295.32	0.00
501	301058	中粮科工	1,386	13,125.42	0.00
502	301029	怡合达	665	13,073.90	0.00
503	605011	杭州热电	525	12,773.25	0.00
504	603173	福斯达	588	12,765.48	0.00
505	603153	上海建科	740	12,513.40	0.00
506	605599	莱百股份	980	12,475.40	0.00
507	001217	华尔泰	1,239	11,336.85	0.00
508	603122	合富中国	2,198	11,187.82	0.00
509	300997	欢乐家	928	10,968.96	0.00
510	603219	富佳股份	739	10,907.64	0.00
511	301015	百洋医药	462	10,870.86	0.00
512	300941	创识科技	598	10,799.88	0.00
513	603190	亚通精工	470	10,791.20	0.00
514	300968	格林精密	1,162	10,760.12	0.00
515	603162	海通发展	1,146	10,657.80	0.00
516	300033	同花顺	100	10,370.00	0.00
517	300925	法本信息	1,020	10,291.80	0.00
518	605365	立达信	645	10,236.15	0.00
519	301180	万祥科技	654	10,228.56	0.00
520	300918	南山智尚	1,063	10,141.02	0.00
521	300973	立高食品	360	10,112.40	0.00
522	605056	咸亨国际	933	10,057.74	0.00
523	605162	新中港	1,377	9,955.71	0.00
524	001207	联科科技	682	9,902.64	0.00
525	300930	屹通新材	322	9,366.98	0.00
526	001313	粤海饲料	1,232	9,264.64	0.00
527	605577	龙版传媒	588	9,131.64	0.00
528	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
529	300972	万辰集团	430	9,085.90	0.00
530	605028	世茂能源	615	8,874.45	0.00
531	001300	三柏硕	763	8,675.31	0.00

532	603070	万控智造	775	8,672.25	0.00
533	300932	三友联众	896	8,628.48	0.00
534	300993	玉马遮阳	959	8,573.46	0.00
535	603130	云中马	480	8,467.20	0.00
536	001215	千味央厨	295	8,339.65	0.00
537	605580	恒盛能源	916	8,161.56	0.00
538	001228	永泰运	383	8,073.64	0.00
539	300894	火星人	628	8,050.96	0.00
540	001296	长江材料	564	8,037.00	0.00
541	300996	普联软件	539	7,907.13	0.00
542	300962	中金辐照	576	7,856.64	0.00
543	603282	亚光股份	457	7,705.02	0.00
544	001266	宏英智能	346	7,515.12	0.00
545	001278	一彬科技	473	7,478.13	0.00
546	603280	南方路机	363	7,201.92	0.00
547	001366	播恩集团	645	7,159.50	0.00
548	603216	梦天家居	772	7,086.96	0.00
549	00388	香港交易所	31	7,078.93	0.00
550	301069	凯盛新材	539	7,066.29	0.00
551	001333	光华股份	426	7,029.00	0.00
552	001219	青岛食品	597	7,026.69	0.00
553	301048	金鹰重工	843	6,996.90	0.00
554	001368	通达创智	351	6,862.05	0.00
555	001299	美能能源	576	6,796.80	0.00
556	603048	浙江黎明	464	6,737.28	0.00
557	300975	商络电子	738	6,671.52	0.00
558	301020	密封科技	421	6,660.22	0.00
559	605566	福莱茵特	435	6,625.05	0.00
560	300985	致远新能	413	6,616.26	0.00
561	603291	联合水务	536	6,571.36	0.00
562	301089	拓新药业	220	6,527.40	0.00
563	001256	炜冈科技	474	6,503.28	0.00
564	603150	万朗磁塑	250	6,260.00	0.00
565	300940	南极光	491	6,255.34	0.00
566	001209	洪兴股份	450	6,210.00	0.00
567	603151	邦基科技	535	6,173.90	0.00
568	605287	德才股份	489	6,156.51	0.00
569	301009	可靠股份	801	5,983.47	0.00
570	603213	镇洋发展	799	5,976.52	0.00
571	300963	中洲特材	552	5,939.52	0.00
572	301012	扬电科技	238	5,892.88	0.00
573	603182	嘉华股份	546	5,743.92	0.00
574	001234	泰慕士	333	5,657.67	0.00

575	300978	东箭科技	593	5,473.39	0.00
576	605033	美邦股份	423	5,253.66	0.00
577	300922	天秦装备	402	5,221.98	0.00
578	300950	德固特	328	4,998.72	0.00
579	300937	药易购	244	4,972.72	0.00
580	605567	春雪食品	629	4,818.14	0.00
581	300987	川网传媒	391	4,746.74	0.00
582	300966	共同药业	286	4,673.24	0.00
583	301016	雷尔伟	275	4,628.25	0.00
584	300967	晓鸣股份	507	4,598.49	0.00
585	301021	英诺激光	290	4,547.20	0.00
586	301011	华立科技	295	4,545.95	0.00
587	300998	宁波方正	201	4,419.99	0.00
588	301002	崧盛股份	261	4,403.07	0.00
589	603065	宿迁联盛	581	4,340.07	0.00
590	300945	曼卡龙	474	4,223.34	0.00
591	300943	春晖智控	382	4,121.78	0.00
592	300986	志特新材	553	3,743.81	0.00
593	605138	盛泰集团	723	3,622.23	0.00
594	301007	德迈仕	303	3,539.04	0.00
595	300960	通业科技	234	3,526.38	0.00
596	300958	建工修复	300	3,189.00	0.00
597	06969	思摩尔国际	316	2,731.21	0.00
598	300942	易瑞生物	443	2,653.57	0.00
599	002568	百润股份	32	538.56	0.00
600	01999	敏华控股	61	298.41	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	600482	中国动力	32,237,740.07	1.23
2	000039	中集集团	31,284,398.96	1.19
3	000400	许继电气	26,921,686.00	1.03
4	688575	亚辉龙	25,366,265.69	0.97
5	000725	京东方 A	22,008,078.00	0.84
6	601179	中国西电	21,641,544.54	0.83
7	600566	济川药业	21,617,213.32	0.82
8	688187	时代电气	20,896,327.95	0.80
9	688009	中国通号	18,716,880.11	0.71
10	601766	中国中车	18,571,693.00	0.71
11	002415	海康威视	18,283,004.00	0.70
12	601598	中国外运	17,057,237.00	0.65

13	688100	威胜信息	16,786,995.08	0.64
14	600150	中国船舶	15,985,731.00	0.61
15	601108	财通证券	15,583,642.37	0.59
16	600519	贵州茅台	15,090,846.00	0.58
17	300037	新宙邦	14,947,679.60	0.57
18	002116	中国海诚	13,812,722.73	0.53
19	688789	宏华数科	13,745,992.04	0.52
20	600961	株冶集团	13,723,126.00	0.52

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002011	盾安环境	31,080,642.81	1.19
2	688676	金盘科技	25,068,455.36	0.96
3	000777	中核科技	21,191,596.00	0.81
4	600298	安琪酵母	18,300,778.22	0.70
5	002803	吉宏股份	17,992,914.00	0.69
6	603259	药明康德	16,698,768.47	0.64
7	002116	中国海诚	16,261,163.00	0.62
8	002179	中航光电	15,892,106.35	0.61
9	688019	安集科技	15,852,835.68	0.60
10	000063	中兴通讯	15,840,931.96	0.60
11	601598	中国外运	15,832,542.80	0.60
12	300674	宇信科技	15,739,108.00	0.60
13	300708	聚灿光电	15,582,294.40	0.59
14	301153	中科江南	15,498,684.60	0.59
15	03908	中金公司	15,308,392.81	0.58
16	600079	人福医药	15,252,319.00	0.58
17	688029	南微医学	14,454,705.03	0.55
18	688127	蓝特光学	13,786,682.08	0.53
19	001286	陕西能源	13,226,340.50	0.50
20	002415	海康威视	12,899,404.13	0.49

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	1,082,474,800.11
卖出股票收入（成交）总额	1,355,332,575.44

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：无。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：无。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金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

浙商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、国家税务总局浙江省税务局第三税务分局的处罚。

中国船舶重工股份有限公司在报告编制日前一年内受到中国证券监督管理委员会北京监管局的处罚。

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	178,833.18
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	30,916.22
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	209,749.40

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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（%）
鹏华成长智选混合 A	40,244	76,130.78	26,462,355.10	0.86	3,037,344,944.12	99.14
鹏华成长智选混合 C	4,968	58,122.65	0.00	0.00	288,753,343.25	100.00
合计	45,212	74,152.01	26,462,355.10	0.79	3,326,098,287.37	99.21

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所	鹏华成长智选混合 A	666,234.08	0.0217
	鹏华成长智选混合 C	222,198.36	0.0770

有从业人员持有本基金			
	合计	888,432.44	0.0265

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	份额级别	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	鹏华成长智选混合 A	50~100
	鹏华成长智选混合 C	-
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	鹏华成长智选混合 A	-
	鹏华成长智选混合 C	-
	合计	-

注：1、截至本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人投资、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。

2、截至本报告期末，本基金的基金经理未持有本基金份额。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	鹏华成长智选混合 A	鹏华成长智选混合 C
基金合同生效日（2020年10月19日）基金份额总额	12,391,326,950.83	1,853,193,609.87
本报告期期初基金份额总额	3,290,169,619.61	303,633,388.36
本报告期基金总申购份额	7,115,701.56	1,538,645.60
减：本报告期基金总赎回份额	233,478,021.95	16,418,690.71
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	3,063,807,299.22	288,753,343.25

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人的重大人事变动：

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

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

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

本公司已将上述变更事项报中国证券监督管理委员会深圳监管局备案。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

10.4 基金投资策略的改变

无。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未改聘为本基金审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人及相关责任人员
受到稽查或处罚等措施的时间	2024 年 4 月 19 日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会深圳监管局

受到的具体措施类型	责令改正及警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	个别规定未严格执行，个别业务内控管理不完善
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	管理人高度重视，按照法律法规及相关要求积极落实整改工作。截至报告日，上述事项已整改完毕
其他	-

注：无。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
国信证券	2	541,393,622.15	22.23	444,645.00	21.55	-
开源证券	2	519,380,071.32	21.32	431,069.07	20.89	-
浙商证券	2	223,492,931.89	9.17	187,312.55	9.08	-
东方证券	2	152,081,165.16	6.24	140,110.71	6.79	-
中泰证券	2	144,833,993.60	5.95	135,555.46	6.57	-
招商证券	1	136,939,527.23	5.62	124,196.96	6.02	-
国海证券	2	121,768,088.20	5.00	96,689.89	4.69	-
东吴证券	1	120,554,194.54	4.95	99,203.85	4.81	-
东方财富证券	1	109,931,466.36	4.51	89,127.39	4.32	-
平安证券	1	82,396,228.14	3.38	75,912.59	3.68	-
国投证券	2	61,067,027.85	2.51	56,262.52	2.73	-
天风证券	2	56,979,020.85	2.34	48,996.20	2.37	-
广发证券	3	47,093,863.12	1.93	33,970.14	1.65	本报告期

						内新增 1 个
信达证券	1	42,015,387.20	1.72	35,120.68	1.70	-
民生证券	2	27,367,269.88	1.12	22,875.99	1.11	-
中信建投证券	1	18,359,652.39	0.75	16,915.07	0.82	-
国盛证券	2	18,134,097.07	0.74	15,159.22	0.73	-
华西证券	1	9,559,803.60	0.39	7,991.02	0.39	-
东北证券	1	2,596,909.00	0.11	2,430.50	0.12	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
摩根大通证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
中原证券	1	-	-	-	-	-

注：交易单元选择的标准和程序：

1) 基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其交易单元作为基金的专用交易单元，选择的标准是：

- (1) 实力雄厚，信誉良好；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范；
- (4) 合规风控能力较强，内部管理规范、严格，具备健全的内控制度；
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的

的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；

- (6) 交易、研究服务能力较强。

2) 选择交易单元的程序：

我公司根据上述标准，选定符合条件的证券公司作为租用交易单元的对象。我公司在比较了

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
国信证券	-	-	210,000,000.00	28.53	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	2,713,404.35	100.00	-	-	-	-
招商证券	-	-	350,000,000.00	47.55	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-

国盛证 券	-	-	176,000,000. 00	23.91	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
东北证 券	-	-	-	-	-	-
爱建证 券	-	-	-	-	-	-
长江证 券	-	-	-	-	-	-
方正证 券	-	-	-	-	-	-
光大证 券	-	-	-	-	-	-
国金证 券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
摩根大 通证券	-	-	-	-	-	-
山西证 券	-	-	-	-	-	-
西南证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
中原证 券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	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	《证券时报》、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	《证券时报》、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	鹏华成长智选混合型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	《证券时报》、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	《证券时报》、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	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会	2024 年 02 月 02 日

	旗下基金相关销售业务的公告	基金电子披露网站	
6	鹏华基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《证券时报》、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	《证券时报》、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	《证券时报》、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
9	鹏华成长智选混合型证券投资基金 2023 年年度报告	《证券时报》、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
10	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	《证券时报》、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
11	鹏华基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《证券时报》、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
12	鹏华基金管理有限公司关于董事长变更的公告	《证券时报》、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	鹏华成长智选混合型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	《证券时报》、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
14	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 05 月 10 日
15	鹏华基金管理有限公司关于调整个人投资者开立基金账户证件类型的公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 05 月 16 日
16	鹏华基金管理有限公司关于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	《证券时报》、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
17	鹏华成长智选混合型证券投资基金（A 类基金份额）基金产品资料概要（更新）	《证券时报》、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
18	鹏华成长智选混合型证券投资基金（C 类基金份额）基金产品资料概要（更新）	《证券时报》、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)《鹏华成长智选混合型证券投资基金基金合同》；
- (二)《鹏华成长智选混合型证券投资基金托管协议》；
- (三)《鹏华成长智选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