

# 鹏华量化先锋混合型证券投资基金 2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设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

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	9
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	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
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>13</b>
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
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>14</b>
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>42</b>
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	59
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	60
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	60
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	61

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 .....	61
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 .....	61
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	61
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	61
7.12 投资组合报告附注 .....	61
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>62</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	62
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	62
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 .....	62
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>62</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>63</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	63
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 .....	63
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	63
10.4 基金投资策略的改变 .....	63
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	63
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 .....	64
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	64
10.8 其他重大事件 .....	67
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>69</b>
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 .....	69
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	69
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>69</b>
12.1 备查文件目录 .....	69
12.2 存放地点 .....	69
12.3 查阅方式 .....	70

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华量化先锋混合型证券投资基金
基金简称	鹏华量化先锋混合
基金主代码	005632
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年2月23日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	463,961,131.54份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过运用量化选股策略，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>本基金采用数量化模型驱动的选股策略为主导投资策略，结合适当的资产配置策略，并依靠严格的投资纪律和风险控制，以保证在控制风险的前提下实现收益最大化。</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金通过对宏观环境和政策导向的分析等构建数量化模型，以对大类资产风险收益状态、投资者行为、市场情绪、市场风险偏好等进行系统分析和评估。本基金根据基本面分析框架、现代投资组合理论以及风险预算模型对大类资产进行综合评估，确定大类资产配置权重，同时合理使用金融工具实现对组合风险暴露的动态调整。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金对股票的投资采用“自上而下”的行业配置策略以及“自下而上”的量化选股策略，在纪律化模型约束下，根据市场变化趋势，对模型进行动态调整。</p> <p>（1）行业配置策略</p> <p>本基金的行业配置策略综合考虑行业的基本面、现代投资组合理论以及风险预算模型，结合定性和定量分析作出行业配置决策，在基金整体风险水平可控的前提下，实现各行业的合理配置和优化。</p> <p>（2）量化选股策略</p> <p>本基金将以多因子选股策略构建股票投资组合。多因子选股策略的信息主要来自于基本面、预期数据、市场交易数据等，每一类信息代表一种选股逻辑。在不同的市场环境下，选股逻辑会有不同的侧重点。基于不同的选股逻辑，构建个股维度的多因子选股策略，包括价值、基本面、市场、成长、预期等，并对因子的有效性进行情景分析和动态监控，筛选出有效因子组合，构建股票资产组合。</p>

	<p>本基金在股票投资组合构建完成后，将根据个股价格波动、风险收益变化的实际情况，定期或不定期调整个股权重，以确保整个股票组合的风险处于可控范围内。</p> <p>(3) 存托凭证投资策略</p> <p>本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>本基金债券投资将采取久期策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、个券选择策略、信用策略、中小企业私募债投资策略等积极投资策略，灵活地调整组合的券种搭配，精选安全边际较高的个券。</p> <p>(1) 久期策略</p> <p>久期管理是债券投资的重要考量因素，本基金将采用以“目标久期”为中心、自上而下的组合久期管理策略。</p> <p>(2) 收益率曲线策略</p> <p>收益率曲线的形状变化是判断市场整体走向的一个重要依据，本基金将据此调整组合长、中、短期债券的搭配，并进行动态调整。</p> <p>(3) 骑乘策略</p> <p>本基金将采用基于收益率曲线分析对债券组合进行适时调整的骑乘策略，以达到增强组合的持有期收益的目的。</p> <p>(4) 息差策略</p> <p>本基金将采用息差策略，以达到更好地利用杠杆放大债券投资的收益的目的。</p> <p>(5) 个券选择策略</p> <p>本基金将根据单个债券到期收益率相对于市场收益率曲线的偏离程度，结合信用等级、流动性、选择权条款、税赋特点等因素，确定其投资价值，选择定价合理或价值被低估的债券进行投资。</p> <p>(6) 信用策略</p> <p>本基金通过主动承担适度的信用风险来获取信用溢价，根据内、外部信用评级结果，结合对类似债券信用利差的分析以及对未来信用利差走势的判断，选择信用利差被高估、未来信用利差可能下降的信用债进行投资。</p> <p>(7) 中小企业私募债投资策略</p> <p>本基金将深入研究发行人资信及公司运营情况，与中小企业私募债券承销券商紧密合作，合理合规合格地进行中小企业私募债券投资。本基金在投资过程中密切监控债券信用等级或发行人信用等级变化情况，力求规避可能存在的债券违约，并获取超额收益。</p> <p>4、权证投资策略</p> <p>本基金通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型及价值挖掘策略、价差策略、双向权证策略等寻求权证的合理估值水平，追求稳定的当期收益。</p> <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</p>
--	--

	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。 6、资产支持证券的投资策略 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。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金属于混合型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金，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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	高永杰	王小飞
	联系电话	0755-81395402	021-60637103
	电子邮箱	xxpl@phfund.com.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		4006788999	021-60637228
传真		0755-82021126	021-60635778
注册地址		深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		518048	100033
法定代表人		张纳沙	张金良

### 2.4 信息披露方式

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

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	鹏华基金管理有限公司	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)
---------------	-------------------------------------

本期已实现收益	-59,892,180.28
本期利润	-69,380,806.32
加权平均基金份额本期利润	-0.0792
本期加权平均净值利润率	-7.66%
本期基金份额净值增长率	-6.61%
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	199,376,477.35
期末可供分配基金份额利润	0.4297
期末基金资产净值	461,917,736.16
期末基金份额净值	0.9956
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	17.59%

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

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

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

## 3.2 基金净值表现

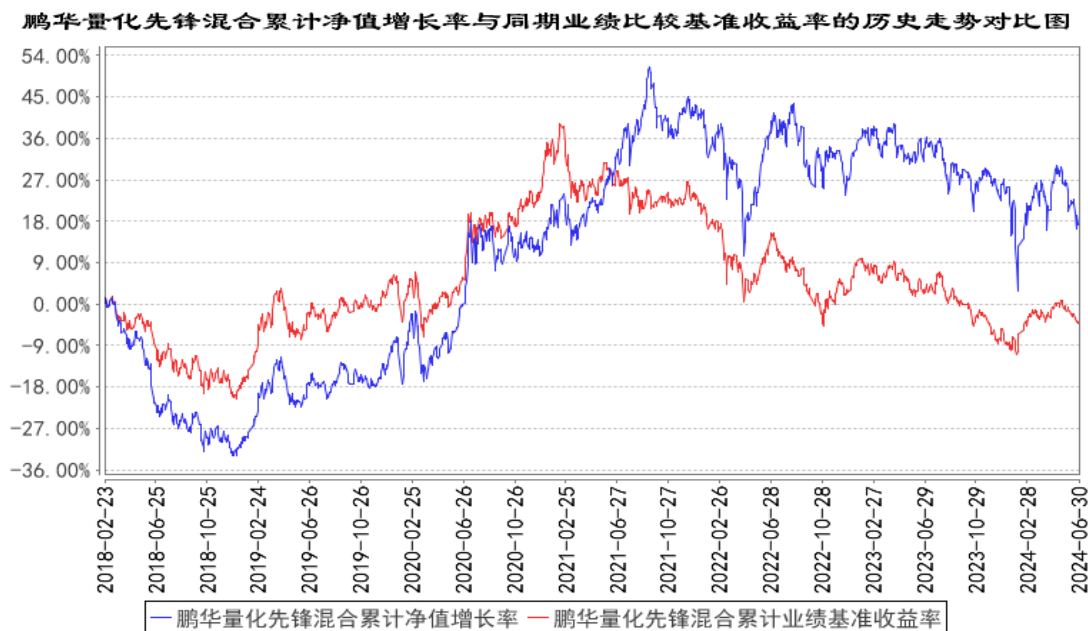
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-6.87%	1.27%	-2.46%	0.38%	-4.41%	0.89%
过去三个月	-5.48%	1.39%	-1.31%	0.60%	-4.17%	0.79%
过去六个月	-6.61%	1.63%	1.65%	0.71%	-8.26%	0.92%
过去一年	-13.03%	1.29%	-6.68%	0.70%	-6.35%	0.59%
过去三年	-12.07%	1.18%	-25.23%	0.83%	13.16%	0.35%
自基金合同生效起至今	17.59%	1.23%	-3.90%	0.97%	21.49%	0.26%

注：业绩比较基准=沪深300指数收益率×80%+中证全债指数收益率×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



注：1、本基金基金合同于 2018 年 02 月 23 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		

<p>苏俊杰</p>	<p>基金经理</p>	<p>2021-03-05</p>	<p>-</p>	<p>12 年</p>	<p>苏俊杰先生, 国籍中国, 理学硕士, 12 年证券从业经验。曾任 MSCI INC. 分析师, 华泰柏瑞基金管理有限公司专户投资经理, 财通基金管理有限公司基金经理。2019 年 07 月加盟鹏华基金管理有限公司, 历任量化及衍生品投资部副总经理, 现担任量化及衍生品投资部总经理/基金经理。2021 年 03 月至今担任鹏华沪深 300 指数增强型证券投资基金基金经理, 2021 年 03 月至今担任鹏华量化先锋混合型证券投资基金基金经理, 2022 年 01 月至今担任鹏华中证 500 指数增强型证券投资基金基金经理, 2022 年 08 月至 2023 年 12 月担任鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2022 年 08 月至 2023 年 08 月担任鹏华创业板指数型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2022 年 08 月至 2023 年 08 月担任鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2022 年 12 月至今担任鹏华上证科创板 50 成份增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2022 年 12 月至今担任鹏华创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2022 年 12 月至今担任鹏华中证 1000 指数增强型证券投资基金基金经理, 2023 年 02 月至今担任鹏华国证 2000 指数增强型证券投资基金基金经理, 2023 年 06 月至今担任鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2023 年 08 月至今担任鹏华创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理, 2023 年 09 月至今担任鹏华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2023 年 09 月至今担任鹏华上证科创板 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2023 年 12 月至今担任鹏华上证科创板 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理, 2023 年 12 月至今担任鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 基金经理, 2024 年 01 月至今担任鹏华智投 800 混合型证券投资基金基金经理, 2024 年 05 月至今担任鹏华智投数字经济混合型证券投资基金基金经理, 2024 年 06 月至今担任鹏华中证 800</p>
------------	-------------	-------------------	----------	-------------	--

					交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 苏俊杰先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理未发生变动。
--	--	--	--	--	--

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

报告期内，本基金以稳定增值为主要投资目标。投资策略方面，本基金采用量化方法进行选股。量化选股模型立足于上市公司的基本面信息，侧重于长期表现有效的因子类别，同时结合短期市场情绪、动量等因子，将模型的短期与长期有效性进行平衡与提高，从而实现相对稳定的超额收益表现。

上半年从因子表现来看，基本面因子有效性较高，量价因子有效性减弱且波动加大，这与 2023 年上半年的情况形鲜明对比，一些以量价因子为主的模型波动加大，我们的量化模型在基本面、量价、另类等因子上采用了相对均衡的配置，尽管一季度市值、流动性、波动率等风格因子

出现了超过历史均值 10 倍标准差的巨幅波动，但对组合超额收益的影响相对可控。展望下半年，随着市场有效性不断提升，在策略竞争日趋激烈的情况下，尤其是市场成交活跃度不足时，模型的稳定性和适应性仍然可能遇到挑战，我们认为高质量、低相关性的 alpha 因子是模型保持生命力的核心因素，因此我们将持续挖掘新的 alpha 因子，对模型进行优化和迭代。

#### 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-6.61%，同期业绩比较基准增长率为 1.65%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年，市场在多重因素冲击和影响下呈现大幅波动。在年初流动性冲击后，随着流动性的持续注入、国内经济超预期复苏和海外资金仓位回补，市场迎来大幅反弹，但在 5 月以后随着经济复苏再度出现波折、海外扰动因素增加，投资者快速下修盈利预期、也降低了风险偏好，海外市场 and 国内债市的强势表现也吸引资金从 A 股流出，仅 6 月北上资金净流出就超过 440 亿元，对 A 股形成一定压制。从风格角度来看，具有长期配置价值和防御属性、并且债性突出的红利类资产和大盘价值股受到投资者青睐，成为上半年增量资金流入的主要方向。

展望未来，市场有望在预期边际好转和资金格局改善推动下，走出震荡修复行情。未来一段时间存在诸多潜在的预期差，当前已经对风险因素进行较为充分的定价，成交量也伴随着投资者情绪不断回落，市场对政策预期也不断调降，但随着国内经济和海外地缘政治的新变化，国内支持性政策有望加速落地，海外美联储降息也可能在年内开启。在资金层面上，外资大幅流出的压力得以较大程度释放，配置型资金减配权益超配债券的趋势有望因债市波动加大而有所逆转，以大型专业机构投资者为代表的长期资金、“耐心资本”正在不断加大对 A 股的投资力度，有望扭转资金面偏弱的格局，推动市场逐步修复。

#### 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 199,376,477.35 元，期末基金份额净值 0.9956 元。

2、本基金本报告期内未进行利润分配。

3、根据相关法律法规及本基金基金合同的规定，本基金管理人将会综合考虑各方面因素，在严格遵守规定前提下，对本报告期内可供分配利润适时作出相应安排。

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

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

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

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：鹏华量化先锋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
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	30,441,276.79	79,416,952.61
结算备付金		5,312,151.24	9,434,101.50
存出保证金		321,910.70	261,268.89
交易性金融资产	6.4.7.2	428,571,551.67	1,098,977,666.43
其中：股票投资		428,571,551.67	1,098,977,666.43
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		6,178.08	150,374.26
应收股利		-	-
应收申购款		2,939.29	93,093.54
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		464,656,007.77	1,188,333,457.23
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2023 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		4.40	-
应付赎回款		64,904.37	39,112.63

应付管理人报酬		605,156.76	1,363,797.90
应付托管费		100,859.46	227,299.65
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	1,967,346.62	3,783,655.47
负债合计		2,738,271.61	5,413,865.65
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	262,541,258.81	627,893,921.98
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	199,376,477.35	555,025,669.60
净资产合计		461,917,736.16	1,182,919,591.58
负债和净资产总计		464,656,007.77	1,188,333,457.23

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.9956 元，基金份额总额 463,961,131.54 份。

## 6.2 利润表

会计主体：鹏华量化先锋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
<b>一、营业总收入</b>		-62,966,264.60	21,804,095.74
1. 利息收入		165,658.79	46,469.70
其中：存款利息收入	6.4.7.13	165,658.79	46,469.70
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-55,205,549.19	12,053,783.55
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-63,298,332.38	8,015,895.74
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益		-	-
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	8,092,783.19	4,037,887.81
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	-9,488,626.04	9,299,013.57
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	1,562,251.84	404,828.92
<b>减：二、营业总支出</b>		6,414,541.72	2,487,543.03
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	5,420,852.62	2,057,747.19
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	903,475.44	342,957.83
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	90,213.66	86,838.01
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-69,380,806.32	19,316,552.71
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-69,380,806.32	19,316,552.71
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-69,380,806.32	19,316,552.71

### 6.3 净资产变动表

会计主体：鹏华量化先锋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	627,893,921.98	-	555,025,669.60	1,182,919,591.58



加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	627,893,921.98	-	555,025,669.60	1,182,919,591.58
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-	-	-	-721,001,855.42
(一)、综合收益总额	365,352,663.17	-	355,649,192.25	-69,380,806.32
(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)	-	-	-	-651,621,049.10
其中：1. 基金申购款	365,352,663.17	-	286,268,385.93	-
2. 基金赎回款	169,117,406.70	-	145,087,952.22	314,205,358.92
(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)	-	-	-	-965,826,408.02
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	262,541,258.81	-	199,376,477.35	461,917,736.16
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	107,671,495.92	-	134,395,045.32	242,066,541.24
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	107,671,495.92	-	134,395,045.32	242,066,541.24
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	15,561,975.05	-	36,812,113.42	52,374,088.47
(一)、综合收益总额	-	-	19,316,552.71	19,316,552.71
(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)	15,561,975.05	-	17,495,560.71	33,057,535.76
其中：1. 基金申购款	93,314,647.28	-	126,775,335.95	220,089,983.23
2. 基金赎回款	-77,752,672.23	-	- 109,279,775.24	-187,032,447.47
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	123,233,470.97	-	171,207,158.74	294,440,629.71

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

邓召明

聂连杰

郝文高

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

鹏华量化先锋混合型证券投资基金（原鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金，以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2013]640 号《关于核准鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金募集的批复》核准，由鹏华基金管理有限公

司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,306,495,157.00 元（含募集股票市值），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(2013)第 380 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2013 年 7 月 19 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,306,582,851.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 87,694.00 份基金份额。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

鹏华量化先锋混合型证券投资基金是根据原鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会于 2018 年 1 月 8 日决议通过的《关于鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金转型并修改基金合同等相关事项的议案》，经中国证券监督管理委员会证监许可[2017]1052 号《关于准予鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金变更注册的批复》准予，由鹏华沪深 300ETF 基金转型而来。原鹏华沪深 300ETF 基金存续期限至 2018 年 2 月 22 日止。自 2018 年 2 月 23 日起，原鹏华沪深 300ETF 基金更名为鹏华量化先锋混合型证券投资基金，《鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》失效的同时《鹏华量化先锋混合型证券投资基金基金合同》生效。本基金为契约开放式，存续期限不定。原鹏华沪深 300ETF 基金失效前的基金资产净值为 32,712,954.49 元，已于本基金的基金合同生效日全部转为本基金的基金资产净值。根据《鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金份额折算和变更登记结果公告》的有关规定，本基金的基金管理人于 2018 年 2 月 22 日日终对投资者持有的鹏华沪深 300ETF 基金基金份额变更登记为本基金基金份额，基金份额总额为 32,712,954.48 份。

#### 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》、《鹏华量化先锋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[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	30,441,276.79
等于：本金	30,436,752.79
加：应计利息	4,524.00
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	30,441,276.79

##### 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	458,595,390.26	-	428,571,551.67	-30,023,838.59
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	458,595,390.26	-	428,571,551.67	-30,023,838.59

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	20.47
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,882,790.79
其中：交易所市场	1,882,790.79
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	84,535.36
合计	1,967,346.62

## 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	1,109,621,364.59	627,893,921.98
本期申购	298,863,809.43	169,117,406.70
本期赎回（以“-”号填列）	-944,524,042.48	-534,470,069.87
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	463,961,131.54	262,541,258.81

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

注：无。

#### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	823,356,635.43	-268,330,965.83	555,025,669.60
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	823,356,635.43	-268,330,965.83	555,025,669.60
本期利润	-59,892,180.28	-9,488,626.04	-69,380,806.32
本期基金份额交易产生的变动数	-450,943,439.36	164,675,053.43	-286,268,385.93
其中：基金申购款	215,797,347.44	-70,709,395.22	145,087,952.22
基金赎回款	-666,740,786.80	235,384,448.65	-431,356,338.15
本期已分配利润	-	-	-
本期末	312,521,015.79	-113,144,538.44	199,376,477.35

#### 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	117,264.26
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	45,359.12
其他	3,035.41
合计	165,658.79

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	-63,298,332.38



入	
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	-63,298,332.38

#### 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	4,211,130,385.26
减：卖出股票成本总额	4,266,607,449.48
减：交易费用	7,821,268.16
买卖股票差价收入	-63,298,332.38

#### 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

注：无。

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

##### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

##### 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

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

注：无。

##### 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

## 6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

## 6.4.7.17 贵金属投资收益

## 6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

## 6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

## 6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

## 6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

## 6.4.7.18 衍生工具收益

## 6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

## 6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

## 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	8,092,783.19
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	8,092,783.19

## 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	-9,488,626.04
股票投资	-9,488,626.04
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-

2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-9,488,626.04

#### 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	1,116,611.64
基金转换费收入	445,640.20
合计	1,562,251.84

#### 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	24,863.02
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行汇划费用	5,664.19
存托服务费	14.11
合计	90,213.66

#### 6.4.7.24 分部报告

无。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
-------	---------

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

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	-	-	4,164,978.54	0.36

###### 6.4.10.1.2 债券交易

注：无。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

###### 6.4.10.1.4 权证交易

注：无。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的 比例(%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
国信证券	-	-	-	-
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	3,837.31	0.43	3,837.31	0.94

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《证券交易所席位租用协议》。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	5,420,852.62	2,057,747.19
其中:应支付销售机构的客户维护费	288,238.27	208,831.91
应支付基金管理人的净管理费	5,132,614.35	1,848,915.28

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	903,475.44	342,957.83

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

##### 6.4.10.2.3 销售服务费

注:无。

##### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:无。

## 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：无。

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

注：无。

## 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

## 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

## 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

## 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月 30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	30,441,276.79	117,264.26	20,835,176.01	38,402.13

## 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	688562	航天软件	网下申购	3,540	44,887.20
国信证券	688307	中润光学	网下申购	2,455	58,625.40
国信证券	301488	豪恩汽电	网下申购	1,645	65,438.10

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	-
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	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	-



	份	日								
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	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	-

	份	日								
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，包括国内依法发行的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证）、债券（含国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券、中小企业私募债等）、货币市场工具（含同业存单等）、权证、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中国建设银行股份有限公司及其他具有基金托管资格的银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。

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

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

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

#### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

注：无。

#### **6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

注：无。

#### **6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

注：无。

#### **6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

注：无。

#### **6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

注：无。

#### **6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

注：无。

### **6.4.13.3 流动性风险**

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

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理职能部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，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	30,441,276.79	-	-	-	30,441,276.79
结算备付金	5,312,151.24	-	-	-	5,312,151.24
存出保证金	321,910.70	-	-	-	321,910.70
交易性金融资产	-	-	-	428,571,551.67	428,571,551.67
应收申购款	-	-	-	2,939.29	2,939.29
应收清算款	-	-	-	6,178.08	6,178.08
资产总计	36,075,338.73	-	-	428,580,669.04	464,656,007.77
负债					
应付赎回款	-	-	-	64,904.37	64,904.37
应付管理人报酬	-	-	-	605,156.76	605,156.76

应付托管费	-	-	-	100,859.46	100,859.46
应付清算款	-	-	-	4.40	4.40
其他负债	-	-	-	1,967,346.62	1,967,346.62
负债总计	-	-	-	2,738,271.61	2,738,271.61
利率敏感度缺口	36,075,338.73	-	-	425,842,397.43	461,917,736.16
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	79,416,952.61	-	-	-	79,416,952.61
结算备付金	9,434,101.50	-	-	-	9,434,101.50
存出保证金	261,268.89	-	-	-	261,268.89
交易性金融资产	-	-	-	1,098,977,666.43	1,098,977,666.43
应收申购款	-	-	-	93,093.54	93,093.54
应收清算款	-	-	-	150,374.26	150,374.26
资产总计	89,112,323.00	-	-	1,099,221,134.23	1,188,333,457.23
负债					
应付赎回款	-	-	-	39,112.63	39,112.63
应付管理人报酬	-	-	-	1,363,797.90	1,363,797.90
应付托管费	-	-	-	227,299.65	227,299.65
其他负债	-	-	-	3,783,655.47	3,783,655.47
负债总计	-	-	-	5,413,865.65	5,413,865.65
利率敏感度缺口	89,112,323.00	-	-	1,093,807,268.58	1,182,919,591.58

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无。

##### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场

交易的证券投资品种，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。基金的投资组合比例为：股票（含存托凭证）资产占基金资产的比例为 60%—95%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金类资产不包括结算备付金、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	428,571,551.67	92.78	1,098,977,666.43	92.90
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	428,571,551.67	92.78	1,098,977,666.43	92.90

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	23,068,171.74	46,157,522.46
比较基准下降 5% 资产净值变动	-23,068,171.74	-46,157,522.46	

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	428,260,876.93
第二层次	45,611.11
第三层次	265,063.63
合计	428,571,551.67

**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	428,571,551.67	92.23
	其中：股票	428,571,551.67	92.23
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	35,753,428.03	7.69
8	其他各项资产	331,028.07	0.07
9	合计	464,656,007.77	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	2,605,071.00	0.56
B	采矿业	9,320,558.00	2.02
C	制造业	299,888,921.56	64.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,575,718.66	2.94
E	建筑业	2,717,259.80	0.59
F	批发和零售业	8,477,502.18	1.84
G	交通运输、仓储和邮政业	7,400,173.00	1.60
H	住宿和餐饮业	1,914,185.00	0.41
I	信息传输、软件和信息技术服务业	48,363,109.66	10.47
J	金融业	15,966,662.49	3.46
K	房地产业	5,879,884.00	1.27
L	租赁和商务服务业	3,687,710.20	0.80
M	科学研究和技术服务业	1,515,445.00	0.33
N	水利、环境和公共设施管理业	1,229,306.68	0.27
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	605,149.00	0.13
Q	卫生和社会工作	160,389.00	0.03
R	文化、体育和娱乐业	5,264,506.44	1.14
S	综合	-	-
	合计	428,571,551.67	92.78

### 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	002267	陕天然气	571,400	4,319,784.00	0.94
2	002255	海陆重工	843,100	4,122,759.00	0.89
3	600663	陆家嘴	441,300	3,892,266.00	0.84
4	300760	迈瑞医疗	11,900	3,461,829.00	0.75
5	601231	环旭电子	209,500	3,362,475.00	0.73
6	300369	绿盟科技	643,500	3,288,285.00	0.71
7	603408	建霖家居	242,200	3,194,618.00	0.69

8	605007	五洲特纸	238,200	3,008,466.00	0.65
9	300081	恒信东方	662,867	2,929,872.14	0.63
10	600819	耀皮玻璃	690,700	2,914,754.00	0.63
11	002613	北玻股份	833,900	2,901,972.00	0.63
12	300311	任子行	831,900	2,828,460.00	0.61
13	300379	东方通	347,700	2,809,416.00	0.61
14	002035	华帝股份	449,800	2,802,254.00	0.61
15	000915	华特达因	90,450	2,727,972.00	0.59
16	688800	瑞可达	94,423	2,651,397.84	0.57
17	601168	西部矿业	145,500	2,611,725.00	0.57
18	600522	中天科技	158,500	2,512,225.00	0.54
19	600618	氯碱化工	285,421	2,505,996.38	0.54
20	002938	鹏鼎控股	62,900	2,500,904.00	0.54
21	600380	健康元	222,600	2,486,442.00	0.54
22	688023	安恒信息	60,598	2,424,525.98	0.52
23	600926	杭州银行	184,892	2,412,840.60	0.52
24	600000	浦发银行	292,900	2,410,567.00	0.52
25	301391	卡莱特	54,000	2,364,120.00	0.51
26	600690	海尔智家	81,900	2,324,322.00	0.50
27	002048	宁波华翔	178,800	2,313,672.00	0.50
28	002897	意华股份	60,400	2,274,664.00	0.49
29	600989	宝丰能源	130,700	2,265,031.00	0.49
30	600557	康缘药业	143,100	2,246,670.00	0.49
31	601336	新华保险	72,700	2,183,181.00	0.47
32	688516	奥特维	51,195	2,140,462.95	0.46
33	002171	楚江新材	324,600	2,139,114.00	0.46
34	688311	盟升电子	103,763	2,126,103.87	0.46
35	600623	华谊集团	367,600	2,124,728.00	0.46
36	300551	古鳌科技	376,900	2,121,947.00	0.46
37	000600	建投能源	332,200	2,092,860.00	0.45
38	000404	长虹华意	392,000	2,089,360.00	0.45
39	603501	韦尔股份	21,000	2,086,770.00	0.45
40	600308	华泰股份	654,100	2,053,874.00	0.44
41	600829	人民同泰	363,978	2,041,916.58	0.44
42	300559	佳发教育	211,900	2,027,883.00	0.44
43	300048	合康新能	437,100	2,023,773.00	0.44
44	002291	遥望科技	469,100	2,017,130.00	0.44
45	300953	震裕科技	37,000	2,005,400.00	0.43
46	300709	精研科技	79,300	2,004,704.00	0.43
47	600126	杭钢股份	482,600	1,983,486.00	0.43
48	002563	森马服饰	338,900	1,969,009.00	0.43
49	605296	神农集团	55,900	1,964,885.00	0.43
50	300122	智飞生物	69,500	1,948,085.00	0.42

51	601728	中国电信	315,800	1,942,170.00	0.42
52	002001	新和成	100,700	1,933,440.00	0.42
53	301073	君亭酒店	104,700	1,905,540.00	0.41
54	002773	康弘药业	87,600	1,896,540.00	0.41
55	603367	辰欣药业	135,700	1,891,658.00	0.41
56	600517	国网英大	430,500	1,864,065.00	0.40
57	002138	顺络电子	66,300	1,820,598.00	0.39
58	603368	柳药集团	102,600	1,795,500.00	0.39
59	600219	南山铝业	469,000	1,786,890.00	0.39
60	600125	铁龙物流	299,200	1,786,224.00	0.39
61	300287	飞利信	1,062,400	1,774,208.00	0.38
62	600968	海油发展	429,100	1,767,892.00	0.38
63	300441	鲍斯股份	285,300	1,691,829.00	0.37
64	300252	金信诺	268,700	1,679,375.00	0.36
65	002301	齐心集团	346,500	1,673,595.00	0.36
66	688503	聚和材料	59,500	1,671,950.00	0.36
67	688276	百克生物	58,000	1,645,460.00	0.36
68	605183	确成股份	103,400	1,598,564.00	0.35
69	600479	千金药业	157,000	1,596,690.00	0.35
70	688365	光云科技	264,304	1,591,110.08	0.34
71	300324	旋极信息	839,100	1,585,899.00	0.34
72	300250	初灵信息	142,000	1,547,800.00	0.34
73	603096	新经典	91,200	1,541,280.00	0.33
74	000157	中联重科	199,900	1,535,232.00	0.33
75	601058	赛轮轮胎	109,600	1,534,400.00	0.33
76	000530	冰山冷热	422,000	1,527,640.00	0.33
77	603015	弘讯科技	201,800	1,525,608.00	0.33
78	300316	晶盛机电	52,500	1,508,325.00	0.33
79	601969	海南矿业	233,600	1,481,024.00	0.32
80	002544	普天科技	79,100	1,478,379.00	0.32
81	601117	中国化学	179,100	1,475,784.00	0.32
82	600938	中国海油	44,700	1,475,100.00	0.32
83	002493	荣盛石化	152,600	1,474,116.00	0.32
84	000931	中关村	417,200	1,472,716.00	0.32
85	000830	鲁西化工	127,000	1,471,930.00	0.32
86	603008	喜临门	84,400	1,462,652.00	0.32
87	601811	新华文轩	103,900	1,455,639.00	0.32
88	000955	欣龙控股	493,800	1,446,834.00	0.31
89	600770	综艺股份	628,700	1,439,723.00	0.31
90	002474	榕基软件	330,200	1,439,672.00	0.31
91	601865	福莱特	71,600	1,439,160.00	0.31
92	603626	科森科技	258,700	1,438,372.00	0.31
93	603228	景旺电子	44,800	1,424,640.00	0.31

94	600458	时代新材	139,500	1,408,950.00	0.31
95	601138	工业富联	51,300	1,405,620.00	0.30
96	601919	中远海控	89,900	1,392,551.00	0.30
97	600183	生益科技	66,000	1,389,960.00	0.30
98	300657	弘信电子	91,600	1,375,832.00	0.30
99	688496	清越科技	141,400	1,306,536.00	0.28
100	002068	黑猫股份	183,700	1,304,270.00	0.28
101	603171	税友股份	47,100	1,273,584.00	0.28
102	600161	天坛生物	52,160	1,272,704.00	0.28
103	300659	中孚信息	97,800	1,268,466.00	0.27
104	002106	莱宝高科	114,800	1,251,320.00	0.27
105	301030	仕净科技	50,700	1,248,234.00	0.27
106	002322	理工能科	77,400	1,239,948.00	0.27
107	000683	远兴能源	178,500	1,233,435.00	0.27
108	601139	深圳燃气	183,900	1,228,452.00	0.27
109	002414	高德红外	205,700	1,211,573.00	0.26
110	601222	林洋能源	193,100	1,210,737.00	0.26
111	601128	常熟银行	159,470	1,207,187.90	0.26
112	002100	天康生物	171,500	1,188,495.00	0.26
113	002790	瑞尔特	131,500	1,187,445.00	0.26
114	603606	东方电缆	24,018	1,172,318.58	0.25
115	300673	佩蒂股份	87,650	1,149,968.00	0.25
116	300248	新开普	175,900	1,141,591.00	0.25
117	002137	实益达	238,500	1,135,260.00	0.25
118	300094	国联水产	444,600	1,129,284.00	0.24
119	002965	祥鑫科技	36,900	1,128,033.00	0.24
120	600810	神马股份	181,800	1,127,160.00	0.24
121	603786	科博达	17,500	1,122,625.00	0.24
122	002101	广东鸿图	105,500	1,110,915.00	0.24
123	300821	东岳硅材	161,800	1,106,712.00	0.24
124	601169	北京银行	189,500	1,106,680.00	0.24
125	000700	模塑科技	208,400	1,094,100.00	0.24
126	600916	中国黄金	112,800	1,085,136.00	0.23
127	002916	深南电路	10,200	1,078,854.00	0.23
128	002615	哈尔斯	174,000	1,078,800.00	0.23
129	600887	伊利股份	41,600	1,074,944.00	0.23
130	300320	海达股份	131,000	1,068,960.00	0.23
131	600558	大西洋	295,900	1,065,240.00	0.23
132	300142	沃森生物	93,100	1,059,478.00	0.23
133	688628	优利德	32,177	1,054,440.29	0.23
134	600707	彩虹股份	153,000	1,041,930.00	0.23
135	600882	妙可蓝多	83,300	1,038,751.00	0.22
136	688176	亚虹医药-U	203,200	1,038,352.00	0.22

137	601628	中国人寿	33,300	1,033,965.00	0.22
138	002895	川恒股份	56,100	1,027,191.00	0.22
139	003012	东鹏控股	168,000	1,026,480.00	0.22
140	300978	东箭科技	111,200	1,026,376.00	0.22
141	603095	越剑智能	77,700	1,018,647.00	0.22
142	300942	易瑞生物	168,200	1,007,518.00	0.22
143	300328	宜安科技	234,600	1,004,088.00	0.22
144	603429	集友股份	239,500	993,925.00	0.22
145	601601	中国太保	35,600	991,816.00	0.21
146	002384	东山精密	47,600	985,320.00	0.21
147	002381	双箭股份	146,500	983,015.00	0.21
148	002057	中钢天源	138,350	968,450.00	0.21
149	002768	国恩股份	51,700	966,790.00	0.21
150	300382	斯莱克	162,900	962,739.00	0.21
151	605099	共创草坪	50,800	960,628.00	0.21
152	605050	福然德	108,300	954,123.00	0.21
153	600114	东睦股份	66,200	952,618.00	0.21
154	002139	拓邦股份	89,700	952,614.00	0.21
155	600529	山东药玻	37,500	950,250.00	0.21
156	002376	新北洋	176,000	948,640.00	0.21
157	002283	天润工业	220,200	944,658.00	0.20
158	300724	捷佳伟创	17,400	939,774.00	0.20
159	002463	沪电股份	25,700	938,050.00	0.20
160	000016	深康佳 A	439,900	936,987.00	0.20
161	300054	鼎龙股份	41,100	932,148.00	0.20
162	603897	长城科技	52,300	917,865.00	0.20
163	002250	联化科技	190,800	915,840.00	0.20
164	688690	纳微科技	52,696	915,329.52	0.20
165	603112	华翔股份	86,800	912,268.00	0.20
166	605299	舒华体育	112,200	911,064.00	0.20
167	002434	万里扬	184,500	904,050.00	0.20
168	300259	新天科技	357,300	903,969.00	0.20
169	603158	腾龙股份	127,800	899,712.00	0.19
170	600328	中盐化工	131,100	899,346.00	0.19
171	002978	安宁股份	32,200	897,092.00	0.19
172	688590	新致软件	69,541	897,078.90	0.19
173	600233	圆通速递	56,800	888,920.00	0.19
174	002073	软控股份	119,500	883,105.00	0.19
175	000550	江铃汽车	40,500	879,255.00	0.19
176	000725	京东方 A	213,700	874,033.00	0.19
177	000848	承德露露	111,000	872,460.00	0.19
178	002449	国星光电	122,300	870,776.00	0.19
179	603379	三美股份	22,200	868,908.00	0.19

180	002334	英威腾	145,000	867,100.00	0.19
181	688289	圣湘生物	49,118	863,494.44	0.19
182	300203	聚光科技	85,400	861,686.00	0.19
183	603766	隆鑫通用	126,600	858,348.00	0.19
184	002252	上海莱士	109,400	855,508.00	0.19
185	300806	斯迪克	76,200	853,440.00	0.18
186	600795	国电电力	141,700	848,783.00	0.18
187	600282	南钢股份	170,300	848,094.00	0.18
188	002115	三维通信	172,600	838,836.00	0.18
189	002971	和远气体	33,800	837,564.00	0.18
190	002469	三维化学	146,600	835,620.00	0.18
191	688033	天宜上佳	138,947	833,682.00	0.18
192	688575	亚辉龙	35,730	833,223.60	0.18
193	300296	利亚德	184,900	832,050.00	0.18
194	300304	云意电气	127,800	831,978.00	0.18
195	688249	晶合集成	56,258	825,304.86	0.18
196	600848	上海临港	90,500	824,455.00	0.18
197	688505	复旦张江	128,815	824,416.00	0.18
198	688468	科美诊断	129,279	818,336.07	0.18
199	603012	创力集团	180,800	806,368.00	0.17
200	603992	松霖科技	43,729	804,176.31	0.17
201	603579	荣泰健康	51,920	802,683.20	0.17
202	600218	全柴动力	118,900	797,819.00	0.17
203	301330	熵基科技	35,397	795,724.56	0.17
204	300639	凯普生物	172,900	795,340.00	0.17
205	600143	金发科技	120,300	795,183.00	0.17
206	688188	柏楚电子	4,304	794,303.20	0.17
207	300170	汉得信息	128,100	786,534.00	0.17
208	300436	广生堂	50,000	785,500.00	0.17
209	605555	德昌股份	42,168	784,746.48	0.17
210	002782	可立克	70,600	782,248.00	0.17
211	300403	汉宇集团	113,700	776,571.00	0.17
212	002273	水晶光电	45,600	774,288.00	0.17
213	601318	中国平安	18,700	773,432.00	0.17
214	688095	福昕软件	16,800	769,608.00	0.17
215	002745	木林森	94,500	761,670.00	0.16
216	300118	东方日升	62,700	758,670.00	0.16
217	002065	东华软件	166,300	751,676.00	0.16
218	002017	东信和平	89,900	748,867.00	0.16
219	002648	卫星化学	41,200	740,776.00	0.16
220	300439	美康生物	79,200	725,472.00	0.16
221	605118	力鼎光电	48,200	717,698.00	0.16
222	002353	杰瑞股份	20,300	712,124.00	0.15



223	600268	国电南自	123,960	707,811.60	0.15
224	002517	恺英网络	74,100	707,655.00	0.15
225	603712	七一二	38,600	702,134.00	0.15
226	300545	联得装备	28,600	702,130.00	0.15
227	603025	大豪科技	50,200	693,764.00	0.15
228	603686	福龙马	90,900	692,658.00	0.15
229	603507	振江股份	21,100	692,502.00	0.15
230	300130	新国都	41,300	687,232.00	0.15
231	603721	中广天择	30,200	678,896.00	0.15
232	600879	航天电子	87,100	676,767.00	0.15
233	300258	精锻科技	82,600	671,538.00	0.15
234	300737	科顺股份	153,300	659,190.00	0.14
235	688789	宏华数科	6,096	657,148.80	0.14
236	002082	万邦德	155,800	655,918.00	0.14
237	300180	华峰超纤	185,800	655,874.00	0.14
238	600577	精达股份	165,100	655,447.00	0.14
239	600262	北方股份	39,700	652,271.00	0.14
240	002212	天融信	133,400	649,658.00	0.14
241	603583	捷昌驱动	31,600	644,008.00	0.14
242	300498	温氏股份	32,300	640,186.00	0.14
243	002911	佛燃能源	69,969	639,516.66	0.14
244	000969	安泰科技	80,000	634,400.00	0.14
245	601566	九牧王	74,600	628,132.00	0.14
246	688165	埃夫特-U	80,294	627,899.08	0.14
247	600521	华海药业	36,800	627,440.00	0.14
248	000825	太钢不锈	185,200	625,976.00	0.14
249	000966	长源电力	141,500	624,015.00	0.14
250	600746	江苏索普	105,800	623,162.00	0.13
251	603618	杭电股份	142,100	622,398.00	0.13
252	600372	中航机载	51,900	621,243.00	0.13
253	605056	咸亨国际	57,300	617,694.00	0.13
254	300682	朗新集团	72,500	616,975.00	0.13
255	603610	麒盛科技	61,700	609,596.00	0.13
256	002705	新宝股份	43,200	607,824.00	0.13
257	002371	北方华创	1,900	607,791.00	0.13
258	002937	兴瑞科技	26,000	606,060.00	0.13
259	300453	三鑫医疗	94,400	603,216.00	0.13
260	300100	双林股份	56,000	603,120.00	0.13
261	603169	兰石重装	134,000	603,000.00	0.13
262	002961	瑞达期货	55,000	602,250.00	0.13
263	002026	山东威达	72,500	601,750.00	0.13
264	002472	双环传动	27,300	601,146.00	0.13
265	603515	欧普照明	34,160	592,334.40	0.13

266	600794	保税科技	185,900	589,303.00	0.13
267	601975	招商南油	164,100	589,119.00	0.13
268	300307	慈星股份	99,000	589,050.00	0.13
269	000058	深赛格	109,300	586,941.00	0.13
270	000906	浙商中拓	87,000	586,380.00	0.13
271	300045	华力创通	33,200	585,980.00	0.13
272	300492	华图山鼎	6,200	584,040.00	0.13
273	603611	诺力股份	34,120	581,404.80	0.13
274	600346	恒力石化	41,600	580,320.00	0.13
275	002452	长高电新	70,000	579,600.00	0.13
276	300193	佳士科技	77,600	575,792.00	0.12
277	600362	江西铜业	24,300	575,424.00	0.12
278	002641	公元股份	145,800	572,994.00	0.12
279	600637	东方明珠	93,800	570,304.00	0.12
280	603569	长久物流	82,900	568,694.00	0.12
281	002075	沙钢股份	150,500	567,385.00	0.12
282	600261	阳光照明	202,800	547,560.00	0.12
283	000807	云铝股份	39,400	532,294.00	0.12
284	603303	得邦照明	46,300	531,524.00	0.12
285	600531	豫光金铅	82,400	530,656.00	0.11
286	300231	银信科技	71,300	524,055.00	0.11
287	600613	神奇制药	97,600	522,160.00	0.11
288	300560	中富通	48,100	520,442.00	0.11
289	300251	光线传媒	61,784	519,603.44	0.11
290	600348	华阳股份	52,050	518,418.00	0.11
291	002111	威海广泰	49,400	514,748.00	0.11
292	002117	东港股份	71,900	509,052.00	0.11
293	688179	阿拉丁	52,500	507,675.00	0.11
294	600803	新奥股份	24,200	503,360.00	0.11
295	000923	河钢资源	29,100	501,102.00	0.11
296	002126	银轮股份	28,700	499,667.00	0.11
297	600386	北巴传媒	178,000	496,620.00	0.11
298	002519	银河电子	100,700	494,437.00	0.11
299	688599	天合光能	29,084	492,101.28	0.11
300	601127	赛力斯	5,400	492,048.00	0.11
301	688306	均普智能	120,334	488,556.04	0.11
302	000919	金陵药业	78,000	488,280.00	0.11
303	300463	迈克生物	42,800	487,064.00	0.11
304	300409	道氏技术	56,200	481,072.00	0.10
305	601877	正泰电器	25,100	478,406.00	0.10
306	603296	华勤技术	8,660	478,291.80	0.10
307	600216	浙江医药	43,400	476,532.00	0.10
308	300348	长亮科技	68,900	469,898.00	0.10

309	688561	奇安信-U	19,835	468,502.70	0.10
310	601311	骆驼股份	58,030	465,400.60	0.10
311	603348	文灿股份	16,800	465,192.00	0.10
312	000409	云鼎科技	57,300	462,411.00	0.10
313	603711	香飘飘	33,200	459,820.00	0.10
314	002091	江苏国泰	67,100	456,951.00	0.10
315	603056	德邦股份	34,800	455,880.00	0.10
316	300341	麦克奥迪	51,600	442,728.00	0.10
317	688321	微芯生物	25,100	441,760.00	0.10
318	002191	劲嘉股份	122,000	440,420.00	0.10
319	002454	松芝股份	78,700	439,933.00	0.10
320	002015	协鑫能科	54,900	437,004.00	0.09
321	605305	中际联合	16,900	435,851.00	0.09
322	002837	英维克	20,230	432,719.70	0.09
323	301327	华宝新能	7,510	430,323.00	0.09
324	603098	森特股份	54,700	429,942.00	0.09
325	605168	三人行	16,240	427,599.20	0.09
326	000680	山推股份	45,800	424,566.00	0.09
327	688352	硕中科技	37,104	423,356.64	0.09
328	002833	弘亚数控	23,000	419,520.00	0.09
329	603217	元利科技	29,700	418,770.00	0.09
330	688362	甬矽电子	21,497	418,331.62	0.09
331	688432	有研硅	43,094	417,580.86	0.09
332	688029	南微医学	6,774	417,007.44	0.09
333	002993	奥海科技	11,200	416,640.00	0.09
334	000719	中原传媒	40,900	413,499.00	0.09
335	002416	爱施德	46,700	413,295.00	0.09
336	600420	国药现代	38,400	410,112.00	0.09
337	300179	四方达	62,000	409,820.00	0.09
338	688317	之江生物	28,266	407,313.06	0.09
339	688268	华特气体	7,863	405,809.43	0.09
340	002947	恒铭达	11,500	404,800.00	0.09
341	000065	北方国际	38,300	397,171.00	0.09
342	688036	传音控股	5,180	396,477.20	0.09
343	300134	大富科技	58,000	395,560.00	0.09
344	688232	新点软件	19,971	393,828.12	0.09
345	603859	能科科技	18,728	393,662.56	0.09
346	002739	万达电影	32,300	390,507.00	0.08
347	601991	大唐发电	128,700	387,387.00	0.08
348	000524	岭南控股	47,800	385,268.00	0.08
349	600587	新华医疗	24,460	385,000.40	0.08
350	688439	振华风光	5,774	383,682.30	0.08
351	002429	兆驰股份	79,100	380,471.00	0.08

352	688380	中微半导	22,661	378,891.92	0.08
353	000029	深深房 A	35,100	373,113.00	0.08
354	300034	钢研高纳	23,200	368,648.00	0.08
355	002970	锐明技术	10,100	363,903.00	0.08
356	600050	中国联通	77,200	362,840.00	0.08
357	300233	金城医药	24,000	358,080.00	0.08
358	002539	云图控股	49,800	355,074.00	0.08
359	603033	三维股份	30,335	354,919.50	0.08
360	300088	长信科技	74,200	348,740.00	0.08
361	002249	大洋电机	73,100	345,763.00	0.07
362	300070	碧水源	82,500	345,675.00	0.07
363	688366	昊海生科	5,540	341,707.20	0.07
364	601068	中铝国际	81,000	341,010.00	0.07
365	300226	上海钢联	19,800	335,412.00	0.07
366	605098	行动教育	7,800	332,436.00	0.07
367	000156	华数传媒	52,800	331,584.00	0.07
368	603399	吉翔股份	53,100	328,689.00	0.07
369	002276	万马股份	45,800	328,386.00	0.07
370	002083	孚日股份	77,100	326,133.00	0.07
371	688685	迈信林	13,200	322,740.00	0.07
372	605188	国光连锁	41,300	320,075.00	0.07
373	002332	仙琚制药	28,000	319,480.00	0.07
374	000560	我爱我家	142,800	317,016.00	0.07
375	002724	海洋王	70,800	315,060.00	0.07
376	601717	郑煤机	21,200	313,760.00	0.07
377	600036	招商银行	9,100	311,129.00	0.07
378	603111	康尼机电	53,400	310,788.00	0.07
379	688520	神州细胞-U	7,800	306,930.00	0.07
380	603866	桃李面包	60,500	306,735.00	0.07
381	600667	太极实业	53,700	306,627.00	0.07
382	688209	英集芯	24,433	303,213.53	0.07
383	300458	全志科技	12,800	300,928.00	0.07
384	002277	友阿股份	137,500	297,000.00	0.06
385	002567	唐人神	55,100	295,336.00	0.06
386	688586	江航装备	31,682	294,642.60	0.06
387	300861	美畅股份	15,200	294,120.00	0.06
388	000631	顺发恒业	122,100	285,714.00	0.06
389	688556	高测股份	23,506	279,486.34	0.06
390	301219	腾远钴业	7,300	279,298.00	0.06
391	000543	皖能电力	31,400	277,890.00	0.06
392	600081	东风科技	31,700	277,375.00	0.06
393	603203	快克智能	11,700	275,886.00	0.06
394	002282	博深股份	43,000	274,770.00	0.06

395	603299	苏盐井神	28,500	270,750.00	0.06
396	603530	神马电力	10,200	270,198.00	0.06
397	600500	中化国际	77,000	268,730.00	0.06
398	000639	西王食品	111,700	265,846.00	0.06
399	688055	龙腾光电	83,404	264,390.68	0.06
400	605333	沪光股份	9,400	261,790.00	0.06
401	002550	千红制药	48,100	259,259.00	0.06
402	688228	开普云	6,782	258,801.12	0.06
403	300776	帝尔激光	5,400	248,184.00	0.05
404	002152	广电运通	23,575	246,594.50	0.05
405	600326	西藏天路	54,100	241,286.00	0.05
406	000541	佛山照明	49,200	239,604.00	0.05
407	301311	昆船智能	13,000	238,940.00	0.05
408	688008	澜起科技	4,156	237,556.96	0.05
409	002036	联创电子	35,100	236,925.00	0.05
410	688567	孚能科技	24,546	235,641.60	0.05
411	301348	蓝箭电子	7,700	234,003.00	0.05
412	601108	财通证券	35,200	232,672.00	0.05
413	603087	甘李药业	5,000	231,600.00	0.05
414	300872	天阳科技	17,460	231,345.00	0.05
415	600704	物产中大	53,300	231,322.00	0.05
416	688578	艾力斯	3,600	229,464.00	0.05
417	300230	永利股份	68,100	228,816.00	0.05
418	603893	瑞芯微	3,800	224,846.00	0.05
419	603983	丸美股份	8,000	220,240.00	0.05
420	603160	汇顶科技	3,200	220,000.00	0.05
421	300797	钢研纳克	23,700	219,462.00	0.05
422	000901	航天科技	25,000	219,000.00	0.05
423	002666	德联集团	60,200	217,924.00	0.05
424	300181	佐力药业	14,400	217,728.00	0.05
425	600661	昂立教育	19,300	216,739.00	0.05
426	601688	华泰证券	17,300	214,347.00	0.05
427	003039	顺控发展	17,000	213,010.00	0.05
428	000030	富奥股份	43,000	211,130.00	0.05
429	002204	大连重工	49,400	210,938.00	0.05
430	688631	莱斯信息	3,367	208,821.34	0.05
431	300768	迪普科技	17,500	207,375.00	0.04
432	600025	华能水电	19,200	206,976.00	0.04
433	600869	远东股份	59,200	206,608.00	0.04
434	300662	科锐国际	12,800	206,464.00	0.04
435	600619	海立股份	39,600	204,732.00	0.04
436	300687	赛意信息	14,700	204,624.00	0.04
437	603999	读者传媒	42,800	202,444.00	0.04

438	002630	华西能源	93,900	199,068.00	0.04
439	600929	雪天盐业	37,500	198,750.00	0.04
440	000887	中鼎股份	16,200	198,288.00	0.04
441	002752	昇兴股份	38,400	194,304.00	0.04
442	002801	微光股份	10,000	189,600.00	0.04
443	600851	海欣股份	40,600	185,542.00	0.04
444	000958	电投产融	49,400	180,804.00	0.04
445	601838	成都银行	11,900	180,761.00	0.04
446	688139	海尔生物	4,826	179,527.20	0.04
447	000997	新大陆	12,700	176,657.00	0.04
448	300882	万胜智能	10,200	176,256.00	0.04
449	002901	大博医疗	6,800	175,644.00	0.04
450	603328	依顿电子	22,300	175,278.00	0.04
451	600999	招商证券	12,600	175,266.00	0.04
452	000863	三湘印象	43,600	174,400.00	0.04
453	300011	鼎汉技术	34,400	171,656.00	0.04
454	603039	泛微网络	5,400	171,504.00	0.04
455	002161	远望谷	36,442	168,362.04	0.04
456	603489	八方股份	6,200	167,276.00	0.04
457	301318	维海德	6,000	164,820.00	0.04
458	002738	中矿资源	6,100	163,480.00	0.04
459	300005	探路者	32,600	163,326.00	0.04
460	002123	梦网科技	23,200	163,096.00	0.04
461	300143	盈康生命	21,300	160,389.00	0.03
462	600415	小商品城	21,500	159,530.00	0.03
463	002923	润都股份	17,100	158,346.00	0.03
464	300384	三联虹普	12,000	157,440.00	0.03
465	000990	诚志股份	21,068	156,745.92	0.03
466	600645	中源协和	9,700	156,170.00	0.03
467	000928	中钢国际	28,000	155,400.00	0.03
468	601126	四方股份	8,000	153,760.00	0.03
469	002536	飞龙股份	16,000	152,320.00	0.03
470	603987	康德莱	24,900	152,139.00	0.03
471	300973	立高食品	5,300	148,877.00	0.03
472	603977	国泰集团	14,000	142,380.00	0.03
473	300815	玉禾田	12,200	142,008.00	0.03
474	300377	赢时胜	26,000	132,080.00	0.03
475	300969	恒帅股份	1,900	131,347.00	0.03
476	300866	安克创新	1,840	131,026.40	0.03
477	300663	科蓝软件	13,200	130,284.00	0.03
478	300601	康泰生物	8,300	129,563.00	0.03
479	600713	南京医药	30,300	127,866.00	0.03
480	002380	科远智慧	6,900	126,270.00	0.03

481	002130	沃尔核材	8,900	125,668.00	0.03
482	002643	万润股份	12,200	122,000.00	0.03
483	002866	传艺科技	9,400	120,978.00	0.03
484	688569	铁科轨道	5,822	120,340.74	0.03
485	600105	永鼎股份	31,200	116,064.00	0.03
486	300829	金丹科技	8,000	115,840.00	0.03
487	688300	联瑞新材	2,300	110,630.00	0.02
488	603520	司太立	11,500	109,710.00	0.02
489	601665	齐鲁银行	22,100	108,511.00	0.02
490	002481	双塔食品	28,000	108,360.00	0.02
491	688158	优刻得-W	10,550	107,926.50	0.02
492	002917	金奥博	12,000	106,560.00	0.02
493	600843	上工申贝	14,300	106,106.00	0.02
494	600399	抚顺特钢	18,700	105,281.00	0.02
495	688336	三生国健	5,148	104,761.80	0.02
496	300047	天源迪科	15,700	102,678.00	0.02
497	600617	国新能源	40,320	100,800.00	0.02
498	603861	白云电器	12,000	100,440.00	0.02
499	301301	川宁生物	7,822	99,965.16	0.02
500	688408	中信博	1,068	98,341.44	0.02
501	000612	焦作万方	15,100	98,150.00	0.02
502	000049	德赛电池	4,100	96,145.00	0.02
503	600640	国脉文化	8,800	91,080.00	0.02
504	000822	山东海化	15,600	90,948.00	0.02
505	601116	三江购物	11,900	90,559.00	0.02
506	300430	诚益通	5,900	88,972.00	0.02
507	300482	万孚生物	3,600	87,840.00	0.02
508	300110	华仁药业	28,400	87,756.00	0.02
509	600350	山东高速	9,800	86,730.00	0.02
510	300468	四方精创	10,000	86,600.00	0.02
511	603181	皇马科技	9,600	86,304.00	0.02
512	603698	航天工程	7,200	86,184.00	0.02
513	600812	华北制药	20,800	85,696.00	0.02
514	600215	派斯林	12,000	85,560.00	0.02
515	603676	卫信康	10,600	84,906.00	0.02
516	300795	米奥会展	4,800	84,144.00	0.02
517	688103	国力股份	2,400	83,424.00	0.02
518	300894	火星人	6,500	83,330.00	0.02
519	001308	康冠科技	3,700	83,250.00	0.02
520	600797	浙大网新	17,500	81,025.00	0.02
521	600579	克劳斯	13,800	80,592.00	0.02
522	002823	凯中精密	6,600	80,520.00	0.02
523	300349	金卡智能	6,700	79,864.00	0.02

524	000636	风华高科	6,000	78,360.00	0.02
525	301139	元道通信	3,600	77,436.00	0.02
526	002120	韵达股份	9,400	72,756.00	0.02
527	002498	汉缆股份	21,500	70,735.00	0.02
528	300770	新媒股份	2,000	66,760.00	0.01
529	002095	生意宝	5,300	64,872.00	0.01
530	600664	哈药股份	23,900	63,096.00	0.01
531	688166	博瑞医药	1,762	61,670.00	0.01
532	002913	奥士康	2,300	61,663.00	0.01
533	603699	纽威股份	3,566	61,049.92	0.01
534	300791	仙乐健康	2,400	60,480.00	0.01
535	002225	濮耐股份	14,300	58,487.00	0.01
536	002467	二六三	17,400	58,116.00	0.01
537	688799	华纳药厂	1,368	58,044.24	0.01
538	300194	福安药业	15,000	56,100.00	0.01
539	300192	科德教育	5,700	55,974.00	0.01
540	688006	杭可科技	3,049	53,205.05	0.01
541	603899	晨光股份	1,700	53,176.00	0.01
542	002441	众业达	7,000	53,060.00	0.01
543	600055	万东医疗	4,100	50,635.00	0.01
544	688035	德邦科技	1,517	48,877.74	0.01
545	301061	匠心家居	1,040	48,838.40	0.01
546	688157	松井股份	1,400	48,160.00	0.01
547	603387	基蛋生物	6,100	47,336.00	0.01
548	603393	新天然气	1,300	45,162.00	0.01
549	002149	西部材料	3,200	44,672.00	0.01
550	300206	理邦仪器	5,200	44,668.00	0.01
551	002537	海联金汇	8,300	42,911.00	0.01
552	600582	天地科技	6,200	42,718.00	0.01
553	301215	中汽股份	7,000	41,020.00	0.01
554	600061	国投资本	7,100	40,115.00	0.01
555	600135	乐凯胶片	8,200	40,016.00	0.01
556	300175	朗源股份	5,600	38,640.00	0.01
557	301345	涛涛车业	700	38,570.00	0.01
558	300447	全信股份	3,100	38,378.00	0.01
559	300860	锋尚文化	1,800	37,872.00	0.01
560	603969	银龙股份	7,635	37,869.60	0.01
561	002543	万和电气	3,500	34,860.00	0.01
562	688236	春立医疗	2,408	34,145.44	0.01
563	605222	起帆电缆	2,200	33,748.00	0.01
564	600363	联创光电	1,200	33,024.00	0.01
565	600177	雅戈尔	4,600	32,752.00	0.01
566	600271	航天信息	4,400	32,384.00	0.01



567	000728	国元证券	5,200	31,512.00	0.01
568	002545	东方铁塔	4,600	31,326.00	0.01
569	688613	奥精医疗	2,460	31,315.80	0.01
570	600459	贵研铂业	2,300	31,073.00	0.01
571	688692	达梦数据	175	30,612.75	0.01
572	002010	传化智联	7,900	30,336.00	0.01
573	002878	元隆雅图	2,400	30,168.00	0.01
574	600925	苏能股份	5,900	29,795.00	0.01
575	300475	香农芯创	1,000	29,570.00	0.01
576	600468	百利电气	6,800	29,308.00	0.01
577	603588	高能环境	4,600	28,888.00	0.01
578	002522	浙江众成	9,000	28,440.00	0.01
579	601208	东材科技	3,800	27,588.00	0.01
580	600497	驰宏锌锗	5,000	26,700.00	0.01
581	002646	天佑德酒	2,600	26,598.00	0.01
582	300072	海新能科	14,500	26,100.00	0.01
583	600901	江苏金租	5,154	26,027.70	0.01
584	002297	博云新材	4,300	25,800.00	0.01
585	000589	贵州轮胎	5,000	25,350.00	0.01
586	601990	南京证券	3,300	25,344.00	0.01
587	002404	嘉欣丝绸	4,700	24,863.00	0.01
588	603466	风语筑	2,900	24,766.00	0.01
589	300326	凯利泰	6,500	24,700.00	0.01
590	605199	葫芦娃	2,500	24,375.00	0.01
591	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.01
592	600682	南京新百	4,800	23,952.00	0.01
593	600058	五矿发展	3,601	23,766.60	0.01
594	301363	美好医疗	800	23,200.00	0.01
595	603976	正川股份	1,588	22,406.68	0.00
596	000544	中原环保	2,800	22,036.00	0.00
597	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.00
598	601033	永兴股份	1,258	20,077.68	0.00
599	688709	成都华微	1,045	19,635.55	0.00
600	600789	鲁抗医药	2,800	19,600.00	0.00
601	002392	北京利尔	5,800	18,270.00	0.00
602	688076	诺泰生物	233	18,239.24	0.00
603	002382	蓝帆医疗	4,200	18,144.00	0.00
604	688566	吉贝尔	765	17,212.50	0.00
605	300893	松原股份	600	17,142.00	0.00
606	300055	万邦达	4,218	17,082.90	0.00
607	603648	畅联股份	2,100	16,632.00	0.00
608	603067	振华股份	1,400	16,324.00	0.00
609	600787	中储股份	3,300	15,873.00	0.00

610	301536	星宸科技	481	15,521.87	0.00
611	603113	金能科技	2,800	15,316.00	0.00
612	600071	凤凰光学	900	14,697.00	0.00
613	000059	华锦股份	3,500	14,665.00	0.00
614	002588	史丹利	1,900	14,307.00	0.00
615	688584	上海合晶	866	13,760.74	0.00
616	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00
617	301565	中仑新材	711	13,494.78	0.00
618	301580	爱迪特	202	13,317.86	0.00
619	301316	慧博云通	900	13,212.00	0.00
620	600383	金地集团	3,800	12,920.00	0.00
621	600104	上汽集团	900	12,474.00	0.00
622	000567	海德股份	2,195	12,313.95	0.00
623	603065	宿迁联盛	1,600	11,952.00	0.00
624	603619	中曼石油	500	11,710.00	0.00
625	603341	龙旗科技	298	11,172.02	0.00
626	300596	利安隆	400	10,852.00	0.00
627	300702	天宇股份	600	10,698.00	0.00
628	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
629	600109	国金证券	1,300	9,815.00	0.00
630	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
631	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
632	600258	首旅酒店	700	8,645.00	0.00
633	600502	安徽建工	1,976	8,496.80	0.00
634	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
635	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
636	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
637	688101	三达膜	671	7,635.98	0.00
638	000967	盈峰环境	1,700	7,191.00	0.00
639	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
640	300285	国瓷材料	400	7,140.00	0.00
641	002532	天山铝业	800	6,488.00	0.00
642	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
643	601229	上海银行	800	5,808.00	0.00
644	301096	百诚医药	100	5,808.00	0.00
645	603053	成都燃气	600	5,796.00	0.00
646	688280	精进电动-UW	1,390	5,657.30	0.00
647	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
648	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
649	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
650	605016	百龙创园	240	4,888.80	0.00
651	603325	博隆技术	66	4,491.96	0.00
652	603381	永臻股份	178	4,473.14	0.00

653	600909	华安证券	1,000	4,210.00	0.00
654	603301	振德医疗	200	4,172.00	0.00
655	603344	星德胜	182	4,124.12	0.00
656	002386	天原股份	1,000	3,820.00	0.00
657	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
658	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
659	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
660	300406	九强生物	200	3,076.00	0.00
661	002170	芭田股份	500	3,005.00	0.00
662	001379	腾达科技	213	2,871.24	0.00
663	600918	中泰证券	502	2,846.34	0.00
664	603375	盛景微	72	2,800.80	0.00
665	003022	联泓新科	200	2,742.00	0.00
666	001387	雪祺电气	173	2,638.25	0.00
667	600780	通宝能源	400	2,360.00	0.00
668	600351	亚宝药业	300	1,683.00	0.00
669	300642	透景生命	100	1,164.00	0.00
670	300196	长海股份	100	1,013.00	0.00
671	603010	万盛股份	100	901.00	0.00
672	000930	中粮科技	100	503.00	0.00
673	603267	鸿远电子	4	136.40	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	601058	赛轮轮胎	12,100,708.00	1.02
2	002106	莱宝高科	11,922,183.17	1.01
3	600502	安徽建工	11,123,711.76	0.94
4	688311	盟升电子	11,051,784.99	0.93
5	688023	安恒信息	10,889,590.91	0.92
6	600028	中国石化	10,763,275.00	0.91
7	688176	亚虹医药-U	10,461,668.61	0.88
8	300551	古鳌科技	10,177,685.00	0.86
9	600886	国投电力	10,177,478.00	0.86
10	600020	中原高速	10,164,841.00	0.86
11	300271	华宇软件	9,709,898.32	0.82
12	300122	智飞生物	9,229,113.60	0.78
13	600033	福建高速	9,228,500.00	0.78
14	300009	安科生物	9,126,642.00	0.77
15	601169	北京银行	9,079,327.00	0.77
16	002274	华昌化工	8,931,448.00	0.76
17	600694	大商股份	8,862,564.00	0.75

18	600979	广安爱众	8,814,426.00	0.75
19	601827	三峰环境	8,587,468.90	0.73
20	000685	中山公用	8,580,902.04	0.73

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	600582	天地科技	16,662,155.80	1.41
2	600901	江苏金租	14,350,002.00	1.21
3	000157	中联重科	13,216,760.00	1.12
4	603323	苏农银行	13,135,549.00	1.11
5	000685	中山公用	12,915,894.96	1.09
6	000921	海信家电	12,715,980.00	1.07
7	601163	三角轮胎	12,509,757.95	1.06
8	000404	长虹华意	11,993,656.99	1.01
9	601886	江河集团	11,693,400.10	0.99
10	600269	赣粤高速	11,674,584.00	0.99
11	600886	国投电力	11,658,563.00	0.99
12	600919	江苏银行	11,613,788.00	0.98
13	688176	亚虹医药-U	11,593,833.15	0.98
14	601058	赛轮轮胎	11,565,700.00	0.98
15	601169	北京银行	11,560,206.00	0.98
16	600023	浙能电力	11,522,934.00	0.97
17	600028	中国石化	11,284,091.00	0.95
18	601668	中国建筑	11,144,244.00	0.94
19	600033	福建高速	11,135,420.00	0.94
20	601233	桐昆股份	11,046,183.00	0.93

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	3,605,689,960.76
卖出股票收入（成交）总额	4,211,130,385.26

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**

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

**7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库**

本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券备选库。

**7.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	321,910.70
2	应收清算款	6,178.08
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,939.29
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	331,028.07

**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

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 (%)
7,677	60,435.21	417,931,719.68	90.08	46,029,411.86	9.92

**8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况**

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	707,628.55	0.1525

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

**8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况**

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究 部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

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投资、持有本基金符合相关法律法规、中国证监会规定及相关管理制度的规定。

**§ 9 开放式基金份额变动**

单位：份

基金合同生效日 (2018 年 2 月 23 日) 基金份额总额	32,712,954.48
本报告期期初基金份额总额	1,109,621,364.59
本报告期基金总申购份额	298,863,809.43

减：本报告期基金总赎回份额	944,524,042.48
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	463,961,131.54

## § 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：

无。

### 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未受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 (%)	
国泰君安	2	6,593,688.9 25.63	84.37	4,077,369.1 5	78.20	-
方正证券	2	796,454,538 .09	10.19	745,415.13	14.30	-
申万宏源 证券	2	229,917,174 .83	2.94	211,817.51	4.06	-
国投证券	1	128,149,842 .94	1.64	118,067.76	2.26	-
中信建投 证券	1	40,721,326. 78	0.52	37,519.28	0.72	-
银河证券	2	26,025,481. 75	0.33	23,977.37	0.46	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
东方财富 证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-



国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
瑞信方正	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	本报告期减少 1 个
招商证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	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 (%)
国泰君安	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-

平安证 券	-	-	-	-	-	-
瑞信方 正	-	-	-	-	-	-
瑞银证 券	-	-	-	-	-	-
上海证 券	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-
西部证 券	-	-	-	-	-	-
湘财证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
中航证 券	-	-	-	-	-	-
中金财 富	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-
中银国 际	-	-	-	-	-	-

### 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	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 01 月 04 日
2	鹏华量化先锋混合型证券投资基金恢复大额申购、转换转入和定期定额投资业务的公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 01 月 16 日
3	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 01 月 18 日
4	鹏华量化先锋混合型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 01 月 19 日

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	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 01 月 23 日
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	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 02 月 02 日
7	鹏华量化先锋混合型证券投资基金更新的招募说明书	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 02 月 07 日
8	鹏华量化先锋混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 02 月 07 日
9	鹏华基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 02 月 08 日
10	鹏华基金管理有限公司关于终止与北京中期时代基金销售有限公司销售合作关系的公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 03 月 04 日
11	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与华福证券有限责任公司申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 03 月 16 日
12	鹏华量化先锋混合型证券投资基金 2023 年年度报告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 03 月 28 日
13	鹏华基金管理有限公司关于旗下证券投资基金持有的股票估值方法变更的提示性公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 03 月 30 日
14	鹏华基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 04 月 13 日
15	鹏华基金管理有限公司关于董事长变更的公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 04 月 13 日
16	鹏华量化先锋混合型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 04 月 19 日
17	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 05 月 10 日
18	鹏华基金管理有限公司关于调整个人投资者开立基金账户证件类型类型的公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 05 月 16 日
19	鹏华基金管理有限公司关于调整旗	《证券日报》、基金管	2024 年 06 月 12 日

	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	理人网站及中国证监会基金电子披露网站	
20	鹏华量化先锋混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 06 月 28 日

注：无。

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20240101~20240620	259,819,373.20	14,174,885.84	273,994,259.04	0.00	0.00
	2	20240101~20240630	311,019,727.44	75,280,648.54	150,000,000.00	236,300,375.98	50.93
产品特有风险							
基金份额持有人持有的基金份额所占比例过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引起基金净值剧烈波动，甚至可能引发基金流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。							

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

2、赎回份额包含基金赎回份额、基金转换出份额、强制调减份额、场内卖出份额。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。
----

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- （一）《鹏华量化先锋混合型证券投资基金基金合同》；
- （二）《鹏华量化先锋混合型证券投资基金托管协议》；
- （三）《鹏华量化先锋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