

鹏华研究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：中国工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。

基金托管人中国工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	10
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	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	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
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	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	58
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	59
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	60

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	60
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	60
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	60
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	60
7.12 投资组合报告附注	60
§ 8 基金份额持有人信息	61
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	61
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	61
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
§ 9 开放式基金份额变动	62
§ 10 重大事件揭示	62
10.1 基金份额持有人大会决议	62
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	62
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	63
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	63
10.8 其他重大事件	66
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	67
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	67
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	67
§ 12 备查文件目录	67
12.1 备查文件目录	67
12.2 存放地点	67
12.3 查阅方式	67

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华研究智选混合型证券投资基金
基金简称	鹏华研究智选混合
基金主代码	007146
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 5 月 6 日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	189,603,039.60 份
基金合同存续期	不定期

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、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）自上而下地分析行业的增长前景、行业结构、商业模式、竞争要素等分析把握其投资机会；2）自下而上地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增长的大趋势，对企业基本面和估值水平进行综合的研判，深度挖掘优质的个股。</p> <p>（1）自上而下的行业遴选</p> <p>本基金将自上而下地进行行业遴选，重点关注行业增长前景、行业利润前景和行业成功要素。对行业增长前景，主要分析行业的外部发展环境、行业的生命周期以及行业波动与经济周期的关系等；对行业利润前景，主要分析行业结构，特别是业内竞争的方式、业内竞争的激烈程度、以及业内厂商的谈判能力等。基于对行业结构的分析形成对业内竞争的关键成功要素的判断，为预测企业经营环境的变化建立起扎实的基础。</p> <p>（2）自下而上的个股选择</p> <p>本基金通过定性和定量相结合的方法进行自下而上的个股选择，对企业基本面和估值水平进行综合的研判，精选优质个股。</p> <p>1) 定性分析</p>

	<p>本基金通过以下两方面标准对股票的基本面进行研究分析并筛选出优质的公司：</p> <p>一方面是竞争力分析，通过对公司竞争策略和核心竞争力的分析，选择具有可持续竞争优势的公司或未来具有广阔成长空间的公司。就公司竞争策略，基于行业分析的结果判断策略的有效性、策略的实施支持和策略的执行成果；就核心竞争力，分析公司的现有核心竞争力，并判断公司能否利用现有的资源、能力和定位取得可持续竞争优势。</p> <p>另一方面是管理层分析，通过着重考察公司的管理层以及管理制度，选择具有良好治理结构、管理水平较高的优质公司。</p> <p>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，从估值、盈利、成长三个定量维度出发，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>利用包括估值、盈利、成长性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>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，本基金投资港股通标的股票还需关注：</p>
--	---

	<p>1) 在港股市场上市、具有行业代表性的优质中资公司；</p> <p>2) 具有行业稀缺性的香港本地和外资公司；</p> <p>3) 港股市场在行业结构、估值、AH 股折溢价、分红率等方面具有吸引力的投资标的。</p> <p>(4) 存托凭证投资策略</p> <p>本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>本基金债券投资将采取久期策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、个券选择策略、信用策略等积极投资策略，自上而下地管理组合的久期，灵活地调整组合的券种搭配，同时精选个券，以增强组合的持有期收益。</p> <p>4、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、中小企业私募债投资策略</p> <p>中小企业私募债券是在中国境内以非公开方式发行和转让，约定在一定期限还本付息的公司债券。由于其非公开性及条款可协商性，普遍具有较高收益。本基金将深入研究发行人资信及公司运营情况，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，尽力规避风险，并获取超额收益。</p> <p>6、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>7、资产支持证券的投资策略</p> <p>本基金将综合运用战略资产配置和战术资产配置进行资产支持证券的投资组合管理，并根据信用风险、利率风险和流动性风险变化积极调整投资策略，严格遵守法律法规和基金合同的约定，在保证本金安全和基金资产流动性的基础上获得稳定收益。</p> <p>未来，如果港股通业务规则发生变化或出现法律法规或监管部门允许投资的其他模式，基金管理人可相应调整，不需召开基金份额持有人大会。</p> <p>未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，本基金可相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书中更新公告。</p>
<p>业绩比较基准</p>	<p>中证 800 指数收益率*60%+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*30%</p>
<p>风险收益特征</p>	<p>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。本基金将投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p>

注：无。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		鹏华基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	高永杰	郭明
	联系电话	0755-81395402	(010) 66105799
	电子邮箱	xxpl@phfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4006788999	95588
传真		0755-82021126	(010) 66105798
注册地址		深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		518048	100140
法定代表人		张纳沙	廖林

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	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	-39,585,373.19
本期利润	-15,029,807.86
加权平均基金份额本期利润	-0.0738
本期加权平均净值利润率	-4.56%
本期基金份额净值增长率	-4.26%
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	118,189,730.04
期末可供分配基金份额利润	0.6234
期末基金资产净值	307,792,769.64
期末基金份额净值	1.6234
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	62.34%
-------------	--------

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

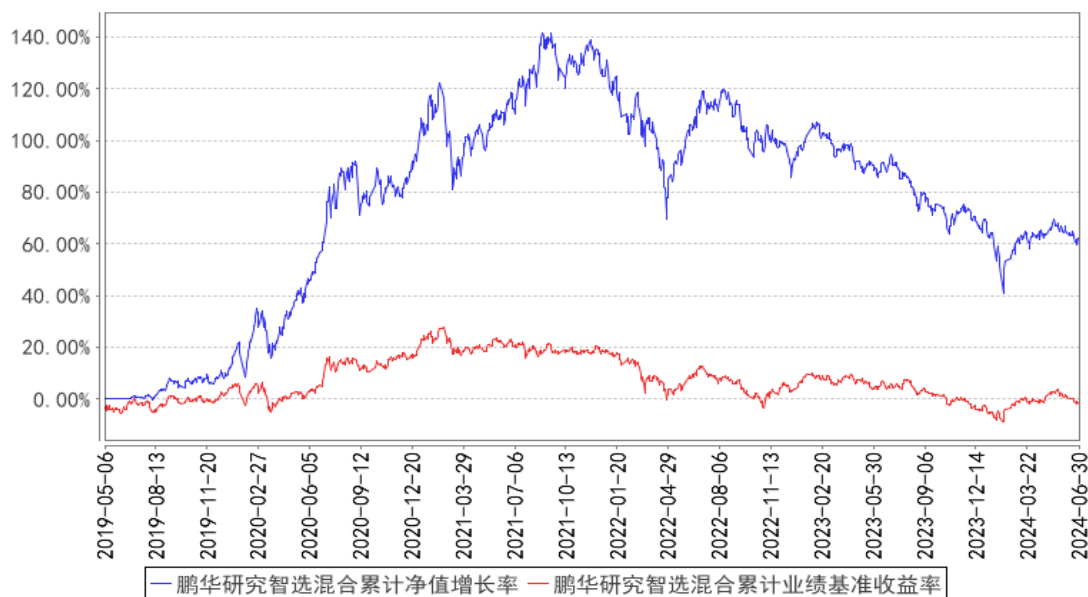
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-1.24%	0.78%	-2.44%	0.36%	1.20%	0.42%
过去三个月	-0.14%	0.80%	-0.63%	0.55%	0.49%	0.25%
过去六个月	-4.26%	1.16%	0.74%	0.70%	-5.00%	0.46%
过去一年	-15.72%	0.98%	-6.10%	0.65%	-9.62%	0.33%
过去三年	-25.68%	1.10%	-19.52%	0.73%	-6.16%	0.37%
自基金合同生效起至今	62.34%	1.22%	-1.68%	0.79%	64.02%	0.43%

注：业绩比较基准=中证 800 指数收益率*60%+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*30%

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

鹏华研究智选混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2019 年 05 月 06 日生效。2、截至建仓期结束，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

3.3 其他指标

注：无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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

包兵华	基金经理	2019-05-06	-	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。
-----	------	------------	---	------	--

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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，本报告期份额净值增长率为-4.26%，同期业绩比较基准增长率为 0.74%。

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，今年大概率是市场转折年，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，本基金期末可供分配利润为 118,189,730.04 元，期末基金份额净值

- 1.6234 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

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人——鹏华基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对鹏华基金管理有限公司编制和披露的本基金 2024 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：鹏华研究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	62,598,456.26	52,522,036.55
结算备付金		105,324.29	198,754.68
存出保证金		39,172.00	52,298.84

交易性金融资产	6.4.7.2	245,897,816.93	312,014,891.52
其中：股票投资		245,773,088.02	311,879,223.23
基金投资		-	-
债券投资		124,728.91	135,668.29
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		-	397,847.72
应收股利		18,496.00	15.34
应收申购款		8,007.34	10,673.23
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		308,667,272.82	365,196,517.88
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		1.10	1.07
应付赎回款		267,953.35	2,233,795.65
应付管理人报酬		306,234.09	397,764.91
应付托管费		51,038.99	66,294.17
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.67	0.69
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	249,274.98	212,277.57
负债合计		874,503.18	2,910,134.06
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	189,603,039.60	213,659,359.32
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	118,189,730.04	148,627,024.50
净资产合计		307,792,769.64	362,286,383.82

负债和净资产总计		308,667,272.82	365,196,517.88
----------	--	----------------	----------------

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.6234 元，基金份额总额 189,603,039.60 份。

6.2 利润表

会计主体：鹏华研究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		-12,641,575.77	-6,441,689.57
1. 利息收入		126,931.96	223,110.76
其中：存款利息收入	6.4.7.13	111,240.60	222,382.00
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		15,691.36	728.76
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-37,352,718.19	-35,615,208.83
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-39,879,788.41	-39,504,390.61
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	90.00	487.09
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	2,526,980.22	3,888,694.69
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	24,555,565.33	28,736,880.00
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	28,645.13	213,528.50
减：二、营业总支出		2,388,232.09	4,447,630.58
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,966,308.03	3,731,711.85

其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	327,718.02	621,952.00
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		0.42	1.69
8. 其他费用	6.4.7.23	94,205.62	93,965.04
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-15,029,807.86	-10,889,320.15
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-15,029,807.86	-10,889,320.15
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-15,029,807.86	-10,889,320.15

6.3 净资产变动表

会计主体：鹏华研究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	213,659,359.32	-	148,627,024.50	362,286,383.82
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	213,659,359.32	-	148,627,024.50	362,286,383.82
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-24,056,319.72	-	-30,437,294.46	-54,493,614.18
（一）、综合收益总额	-	-	-15,029,807.86	-15,029,807.86
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数	-24,056,319.72	-	-15,407,486.60	-39,463,806.32

(净资产减少以“-”号填列)				
其中：1. 基金申购款	2,626,125.62	-	1,397,455.25	4,023,580.87
2. 基金赎回款	-26,682,445.34	-	-16,804,941.85	-43,487,387.19
(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	189,603,039.60	-	118,189,730.04	307,792,769.64
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	197,052,689.53	-	182,399,538.26	379,452,227.79
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	197,052,689.53	-	182,399,538.26	379,452,227.79
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	66,665,743.54	-	61,865,704.74	128,531,448.28
(一)、综合收益总额	-	-	-10,889,320.15	-10,889,320.15
(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)	66,665,743.54	-	72,755,024.89	139,420,768.43
其中：1. 基金申购款	153,512,040.36	-	158,641,671.39	312,153,711.75
2. 基金赎回款	-86,846,296.82	-	-85,886,646.50	-172,732,943.32

(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	263,718,433.07	-	244,265,243.00	507,983,676.07

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

鹏华研究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[2018]1767号《关于准予鹏华研究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《鹏华研究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1,315,512,019.38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(2019)第0284号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华研究智选混合型证券投资基金基金合同》于2019年5月6日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,316,628,973.89份基金份额,其中认购资金利息折合1,116,954.51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,基金托管人为中国工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》、《鹏华研究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	62,598,456.26

等于：本金	62,593,310.15
加：应计利息	5,146.11
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	62,598,456.26

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	236,951,637.98	-	245,773,088.02	8,821,450.04	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	118,000.00	168.11	124,728.91	6,560.80
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	118,000.00	168.11	124,728.91	6,560.80
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	237,069,637.98	168.11	245,897,816.93	8,828,010.84	

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	152.92

应付证券出借违约金	-
应付交易费用	164,586.70
其中：交易所市场	164,586.70
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	84,535.36
合计	249,274.98

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	213,659,359.32	213,659,359.32
本期申购	2,626,125.62	2,626,125.62
本期赎回（以“-”号填列）	-26,682,445.34	-26,682,445.34
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	189,603,039.60	189,603,039.60

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	181,032,329.00	-32,405,304.50	148,627,024.50
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	181,032,329.00	-32,405,304.50	148,627,024.50
本期利润	-39,585,373.19	24,555,565.33	-15,029,807.86
本期基金份额交易产生的变动数	-16,319,306.60	911,820.00	-15,407,486.60
其中：基金申购款	2,058,256.60	-660,801.35	1,397,455.25
基金赎回款	-18,377,563.20	1,572,621.35	-16,804,941.85
本期已分配利润	-	-	-
本期末	125,127,649.21	-6,937,919.17	118,189,730.04

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	108,067.59
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	2,827.12
其他	345.89
合计	111,240.60

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	-39,879,788.41
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	-39,879,788.41

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	230,703,259.48
减：卖出股票成本总额	270,074,811.82
减：交易费用	508,236.07
买卖股票差价收入	-39,879,788.41

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	90.00
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
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	90.00

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	2,526,980.22
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	2,526,980.22

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	24,555,565.33
股票投资	24,566,598.33
债券投资	-11,033.00
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	24,555,565.33

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	27,897.33
基金转换费收入	747.80
合计	28,645.13

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	450.00
账户维护费	9,000.00
证券组合费	182.88
存托服务费	37.38
合计	94,205.62

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
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	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	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	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	56,049,558.47	13.71	138,303,402.16	10.16

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	10,000,000.00	5.56	-	-

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	52,160.13	14.28	43,886.57	26.66
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	127,950.58	10.47	102,152.66	21.95

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	1,966,308.03	3,731,711.85
其中：应支付销售机构的客户维护费	419,781.68	788,426.32
应支付基金管理人的净管理费	1,546,526.35	2,943,285.53

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	327,718.02	621,952.00

注：支付基金托管人中国工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

注：无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：无。

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

注：无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

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
中国工商银行	62,598,456.26	108,067.59	71,692,230.94	213,786.32

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	422	30,578.12
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	175	3,043.25	3,605.00	-
001379	腾达科技	2024年1月11日	6个月	新股流通受限	16.98	13.48	162	2,750.76	2,183.76	-
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	185	3,224.55	6,393.60	-
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	2024年3月	6个月	新股流通	55.82	91.24	150	5,972.74	13,686.00	骏鼎达于

	达	月 13 日		受限							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	439	5,215.32	8,332.22	-	
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	148	6,652.60	9,757.64	-	
301587	中瑞股份	2024 年 3 月 27 日	6 个月	新股流通受限	21.73	25.26	294	6,388.62	7,426.44	-	
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	416	6,739.20	6,639.36	-	
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	2024	1 个月	新股	18.65	18.65	1,148	21,410.20	21,410.20	-	

	邦股份	年6月28日	内(含)	未上市							
603285	键邦股份	2024年6月28日	6个月	新股流通受限	18.65	18.65	128	2,387.20	2,387.20	-	
603312	西典新能	2024年1月4日	6个月	新股流通受限	29.02	25.36	96	2,785.92	2,434.56	-	
603325	博隆技术	2024年1月3日	6个月	新股流通受限	72.46	68.06	43	3,115.78	2,926.58	-	
603341	龙旗科技	2024年2月23日	6个月	新股流通受限	26.00	37.49	155	4,030.00	5,810.95	-	
603344	星德胜	2024年3月13日	6个月	新股流通受限	19.18	22.66	167	3,203.06	3,784.22	-	
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	109	2,545.15	2,739.17	-	
688530	欧莱新材	2024年4月29日	6个月	新股流通受限	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-	
688584	上	2024	6个月	新股	22.66	15.89	378	8,565.48	6,006.42	-	

	海合晶	年 2 月 1 日		流通受限						
688691	灿芯股份	2024 年 4 月 2 日	6 个月	新股流通受限	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-
688692	达梦数据	2024 年 6 月 4 日	6 个月	新股流通受限	86.96	174.93	95	8,261.20	16,618.35	-
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	418	6,558.42	7,854.22	-

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

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

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

4、基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后 6 个月内不得转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括境内依法发行的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证）、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（含国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券、中小企业私募债等）、货币市场工具、同业存单、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工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。

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	124,728.91	135,668.29
未评级	-	-
合计	124,728.91	135,668.29

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

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

公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	62,598,456.26	-	-	-	62,598,456.26
结算备付金	105,324.29	-	-	-	105,324.29
存出保证金	39,172.00	-	-	-	39,172.00
交易性金融资产	-	-	124,728.91	245,773,088.02	245,897,816.93
应收股利	-	-	-	18,496.00	18,496.00
应收申购款	-	-	-	8,007.34	8,007.34

资产总计	62,742,952.55	-	124,728.91	245,799,591.36	308,667,272.82
负债					
应付赎回款	-	-	-	267,953.35	267,953.35
应付管理人报酬	-	-	-	306,234.09	306,234.09
应付托管费	-	-	-	51,038.99	51,038.99
应付清算款	-	-	-	1.10	1.10
应交税费	-	-	-	0.67	0.67
其他负债	-	-	-	249,274.98	249,274.98
负债总计	-	-	-	874,503.18	874,503.18
利率敏感度缺口	62,742,952.55	-	124,728.91	244,925,088.18	307,792,769.64
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	52,522,036.55	-	-	-	52,522,036.55
结算备付金	198,754.68	-	-	-	198,754.68
存出保证金	52,298.84	-	-	-	52,298.84
交易性金融资产	-	-	135,668.29	311,879,223.23	312,014,891.52
应收股利	-	-	-	15.34	15.34
应收申购款	-	-	-	10,673.23	10,673.23
应收清算款	-	-	-	397,847.72	397,847.72
资产总计	52,773,090.07	-	135,668.29	312,287,759.52	365,196,517.88
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,233,795.65	2,233,795.65
应付管理人报酬	-	-	-	397,764.91	397,764.91
应付托管费	-	-	-	66,294.17	66,294.17
应付清算款	-	-	-	1.07	1.07
应交税费	-	-	-	0.69	0.69
其他负债	-	-	-	212,277.57	212,277.57
负债总计	-	-	-	2,910,134.06	2,910,134.06
利率敏感度缺口	52,773,090.07	-	135,668.29	309,377,625.46	362,286,383.82

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2024 年 06 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资和资产支持证券公允价值占基金资产净值的比例为 0.04%，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	-	4,841,671.03	-	4,841,671.03
资产合计	-	4,841,671.03	-	4,841,671.03
以外币计价的 负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净 额	-	4,841,671.03	-	4,841,671.03
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	-	4,832,689.12	-	4,832,689.12
资产合计	-	4,832,689.12	-	4,832,689.12
以外币计价的 负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净 额	-	4,832,689.12	-	4,832,689.12

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%	242,083.55	241,634.46
	人民币贬值 5%	-242,083.55	-241,634.46

注：无。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。基金的投资组合比例为：股票（含存托凭证）资产占基金资产的比例为 60%—95%（其中，投资于港股通标的股票占股票资产的比例不超过 50%）；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金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	245,773,088.02	79.85	311,879,223.23	86.09
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-

交易性金融资产—债券投资	124,728.91	0.04	135,668.29	0.04
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	245,897,816.93	79.89	312,014,891.52	86.13

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	13,336,660.71	11,542,444.19
	比较基准下降 5% 资产净值变动	-13,336,660.71	-11,542,444.19

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	245,655,355.77
第二层次	45,405.96
第三层次	197,055.20
合计	245,897,816.93

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	245,773,088.02	79.62
	其中：股票	245,773,088.02	79.62
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	124,728.91	0.04
	其中：债券	124,728.91	0.04
	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	62,703,780.55	20.31
8	其他各项资产	65,675.34	0.02
9	合计	308,667,272.82	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 4,841,671.03 元，占净值比 1.57%。

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	1,456,580.39	0.47
B	采矿业	9,408,800.95	3.06
C	制造业	158,445,001.70	51.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	26,381,869.39	8.57
E	建筑业	168,938.98	0.05
F	批发和零售业	941,164.78	0.31
G	交通运输、仓储和邮政业	12,985,801.54	4.22
H	住宿和餐饮业	1,206,595.00	0.39
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,486,223.97	2.11
J	金融业	20,602,921.78	6.69
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	521,267.76	0.17
M	科学研究和技术服务业	676,933.69	0.22
N	水利、环境和公共设施管理业	399,424.73	0.13
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,009,577.00	0.33
Q	卫生和社会工作	97,280.40	0.03
R	文化、体育和娱乐业	143,034.93	0.05
S	综合	-	-
	合计	240,931,416.99	78.28

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
原材料	-	-
金融	-	-

能源	-	-
非日常生活消费品	834,171.64	0.27
日常消费品	553,522.17	0.18
医疗保健	897,931.09	0.29
信息技术	2,083,597.33	0.68
通信服务	-	-
房地产	-	-
工业	472,448.80	0.15
公用事业	-	-
合计	4,841,671.03	1.57

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	570,600	16,501,752.00	5.36
2	601916	浙商银行	2,551,360	7,041,753.60	2.29
3	000400	许继电气	196,100	6,747,801.00	2.19
4	601989	中国重工	1,127,900	5,560,547.00	1.81
5	605499	东鹏饮料	25,100	5,415,325.00	1.76
6	601179	中国西电	652,800	5,248,512.00	1.71
7	600150	中国船舶	123,600	5,031,756.00	1.63
8	000039	中集集团	508,400	4,707,784.00	1.53
9	600482	中国动力	226,700	4,416,116.00	1.43
10	600988	赤峰黄金	267,200	4,366,048.00	1.42
11	688100	威胜信息	96,316	3,674,455.40	1.19
12	688009	中国通号	526,396	3,158,376.00	1.03
12	03969	中国通号	136,000	417,058.25	0.14
13	688187	时代电气	71,830	3,546,965.40	1.15
14	603298	杭叉集团	178,640	3,508,489.60	1.14
15	000725	京东方 A	804,500	3,290,405.00	1.07
16	688617	惠泰医疗	7,040	3,210,944.00	1.04
17	601021	春秋航空	56,600	3,188,278.00	1.04
18	600685	中船防务	97,500	2,720,250.00	0.88
19	000680	山推股份	284,800	2,640,096.00	0.86
20	000100	TCL 科技	605,900	2,617,488.00	0.85
21	603050	科林电气	106,080	2,573,500.80	0.84
22	688789	宏华数科	23,715	2,556,477.00	0.83
23	300181	佐力药业	166,300	2,514,456.00	0.82
24	601318	中国平安	59,800	2,473,328.00	0.80
25	600761	安徽合力	113,200	2,449,648.00	0.80
26	601567	三星医疗	69,000	2,415,000.00	0.78

27	603111	康尼机电	409,400	2,382,708.00	0.77
28	601766	中国中车	316,700	2,378,417.00	0.77
29	300857	协创数据	41,500	2,365,500.00	0.77
30	301004	嘉益股份	24,412	2,221,492.00	0.72
31	301291	明阳电气	70,355	2,114,167.75	0.69
32	601658	邮储银行	415,700	2,107,599.00	0.68
33	600674	川投能源	112,100	2,101,875.00	0.68
34	601128	常熟银行	276,870	2,095,905.90	0.68
35	600968	海油发展	500,000	2,060,000.00	0.67
36	688575	亚辉龙	88,194	2,056,684.08	0.67
37	600519	贵州茅台	1,400	2,054,346.00	0.67
38	600312	平高电气	100,000	1,945,000.00	0.63
39	603338	浙江鼎力	31,600	1,909,272.00	0.62
40	600961	株冶集团	200,000	1,888,000.00	0.61
41	601126	四方股份	97,800	1,879,716.00	0.61
42	688488	艾迪药业	180,066	1,840,274.52	0.60
43	000682	东方电子	165,900	1,831,536.00	0.60
44	000528	柳工	163,600	1,830,684.00	0.59
45	600021	上海电力	180,000	1,780,200.00	0.58
46	300979	华利集团	29,193	1,776,394.05	0.58
47	301345	涛涛车业	31,891	1,757,194.10	0.57
48	601872	招商轮船	200,000	1,690,000.00	0.55
49	01810	小米集团-W	110,800	1,666,539.08	0.54
50	000951	中国重汽	112,600	1,612,432.00	0.52
51	002533	金杯电工	160,600	1,597,970.00	0.52
52	300832	新产业	22,700	1,530,888.00	0.50
53	601975	招商南油	426,100	1,529,699.00	0.50
54	002444	巨星科技	61,500	1,519,050.00	0.49
55	603179	新泉股份	38,300	1,502,892.00	0.49
56	688012	中微公司	10,228	1,444,807.28	0.47
57	300498	温氏股份	72,800	1,442,896.00	0.47
58	600011	华能国际	149,900	1,442,038.00	0.47
59	600566	济川药业	44,000	1,395,240.00	0.45
60	000088	盐田港	306,600	1,388,898.00	0.45
61	300760	迈瑞医疗	4,600	1,338,186.00	0.43
62	000899	赣能股份	131,800	1,274,506.00	0.41
63	605020	永和股份	65,790	1,261,852.20	0.41
64	002683	广东宏大	62,000	1,248,060.00	0.41
65	601838	成都银行	81,300	1,234,947.00	0.40
66	600258	首旅酒店	97,700	1,206,595.00	0.39
67	300307	慈星股份	202,100	1,202,495.00	0.39
68	601108	财通证券	180,000	1,189,800.00	0.39
69	002948	青岛银行	352,100	1,186,577.00	0.39

70	600583	海油工程	200,000	1,182,000.00	0.38
71	600845	宝信软件	36,048	1,151,012.64	0.37
72	000883	湖北能源	191,300	1,149,713.00	0.37
73	601038	一拖股份	72,600	1,147,806.00	0.37
74	600809	山西汾酒	5,400	1,138,752.00	0.37
75	603871	嘉友国际	63,980	1,131,806.20	0.37
76	600262	北方股份	68,700	1,128,741.00	0.37
77	603198	迎驾贡酒	19,000	1,092,500.00	0.35
78	601058	赛轮轮胎	77,300	1,082,200.00	0.35
79	600661	昂立教育	89,900	1,009,577.00	0.33
80	002928	华夏航空	145,800	924,372.00	0.30
81	00460	四环医药	1,892,000	897,931.09	0.29
82	600642	申能股份	101,000	891,830.00	0.29
83	002966	苏州银行	117,800	883,500.00	0.29
84	000338	潍柴动力	53,000	860,720.00	0.28
85	601963	重庆银行	109,500	848,625.00	0.28
86	000596	古井贡酒	4,000	844,280.00	0.27
87	603530	神马电力	31,600	837,084.00	0.27
88	02469	粉笔	219,000	833,486.76	0.27
89	002270	华明装备	37,000	822,880.00	0.27
90	601166	兴业银行	43,900	773,518.00	0.25
91	601665	齐鲁银行	153,500	753,685.00	0.24
92	600707	彩虹股份	110,000	749,100.00	0.24
93	601728	中国电信	120,000	738,000.00	0.24
94	000913	钱江摩托	44,000	693,440.00	0.23
95	688408	中信博	7,434	684,522.72	0.22
96	600875	东方电气	37,000	682,650.00	0.22
97	603885	吉祥航空	60,000	659,400.00	0.21
98	600026	中远海能	41,900	654,059.00	0.21
99	001965	招商公路	54,800	649,928.00	0.21
100	600268	国电南自	108,000	616,680.00	0.20
101	600428	中远海特	100,000	612,000.00	0.20
102	603699	纽威股份	33,700	576,944.00	0.19
103	06186	中国飞鹤	168,000	553,522.17	0.18
104	000957	中通客车	45,300	476,556.00	0.15
105	03808	中国重汽	25,500	472,448.80	0.15
106	603992	松霖科技	25,000	459,750.00	0.15
107	000975	银泰黄金	28,000	456,120.00	0.15
108	688036	传音控股	5,872	449,442.88	0.15
109	600098	广州发展	69,800	446,720.00	0.15
110	002027	分众传媒	72,300	438,138.00	0.14
111	603209	兴通股份	30,233	418,424.72	0.14
112	688249	晶合集成	28,505	418,168.35	0.14

113	601500	通用股份	78,200	417,588.00	0.14
114	605196	华通线缆	37,200	391,344.00	0.13
115	601991	大唐发电	123,700	372,337.00	0.12
116	688347	华虹公司	10,244	367,247.40	0.12
117	002332	仙琚制药	31,100	354,851.00	0.12
118	301391	卡莱特	7,980	349,364.40	0.11
119	688469	芯联集成-U	52,990	209,840.40	0.07
120	688443	智翔金泰-U	6,932	206,157.68	0.07
121	688539	高华科技	7,468	200,963.88	0.07
122	301127	天源环保	16,843	199,084.26	0.06
123	603711	香飘飘	14,300	198,055.00	0.06
124	688172	燕东微	12,133	196,311.94	0.06
125	688472	阿特斯	18,850	191,893.00	0.06
126	301187	欧圣电气	7,824	189,732.00	0.06
127	688629	华丰科技	7,073	186,444.28	0.06
128	000537	中绿电	17,700	168,681.00	0.05
129	301536	星辰科技	4,809	167,218.27	0.05
130	301368	丰立智能	3,368	155,197.44	0.05
131	301508	中机认检	4,186	154,714.56	0.05
132	688146	中船特气	5,130	153,130.50	0.05
133	301311	昆船智能	8,320	152,921.60	0.05
134	688486	龙迅股份	2,629	150,641.70	0.05
135	301361	众智科技	5,169	150,417.90	0.05
136	688232	新点软件	7,557	149,024.04	0.05
137	301285	鸿日达	5,643	147,225.87	0.05
138	688362	甬矽电子	7,507	146,086.22	0.05
139	688110	东芯股份	7,584	144,626.88	0.05
140	301179	泽宇智能	7,412	144,237.52	0.05
141	688334	西高院	8,879	142,951.90	0.05
142	301339	通行宝	7,125	141,716.25	0.05
143	688392	骄成超声	3,266	138,609.04	0.05
144	688543	国科军工	3,316	136,188.12	0.04
145	301421	波长光电	3,109	134,402.07	0.04
146	301325	曼恩斯特	3,163	134,174.46	0.04
147	688522	纳睿雷达	2,824	132,389.12	0.04
148	688563	航材股份	2,480	131,142.40	0.04
149	301381	赛维时代	5,710	129,788.30	0.04
150	301358	湖南裕能	4,121	129,646.66	0.04
151	688691	灿芯股份	2,461	128,948.97	0.04
152	301498	乖宝宠物	2,396	128,904.80	0.04
153	301172	君逸数码	4,376	128,566.88	0.04
154	301259	艾布鲁	6,276	127,716.60	0.04
155	301488	豪恩汽电	2,618	125,925.80	0.04

156	301377	鼎泰高科	7,166	125,763.30	0.04
157	301370	国科恒泰	11,522	125,244.14	0.04
158	688432	有研硅	12,868	124,690.92	0.04
159	688549	中巨芯-U	18,117	122,289.75	0.04
160	301277	新天地	9,206	119,493.88	0.04
161	688035	德邦科技	3,686	118,762.92	0.04
162	301486	致尚科技	2,804	118,637.24	0.04
163	301141	中科磁业	3,664	118,164.00	0.04
164	001287	中电港	7,143	118,073.79	0.04
165	688290	景业智能	3,648	117,100.80	0.04
166	688478	晶升股份	4,013	116,858.56	0.04
167	688376	美埃科技	3,713	116,439.68	0.04
168	688531	日联科技	2,509	115,815.44	0.04
169	301516	中远通	6,033	112,394.79	0.04
170	301580	爱迪特	1,473	112,047.64	0.04
171	601061	中信金属	16,245	111,603.15	0.04
172	688496	清越科技	12,000	110,880.00	0.04
173	688548	广钢气体	12,143	110,865.59	0.04
174	688562	航天软件	7,254	110,768.58	0.04
175	301217	铜冠铜箔	11,536	110,745.60	0.04
176	688535	华海诚科	1,607	110,111.64	0.04
177	301510	固高科技	3,957	109,806.75	0.04
178	688570	天玛智控	5,302	108,107.78	0.04
179	301317	鑫磊股份	6,936	107,785.44	0.04
180	301565	中仑新材	4,385	107,653.04	0.03
181	603296	华勤技术	1,935	106,870.05	0.03
182	300814	中富电路	3,280	105,911.20	0.03
183	301303	真兰仪表	9,178	105,730.56	0.03
184	301398	星源卓镁	2,549	103,361.95	0.03
185	688582	芯动联科	3,613	101,742.08	0.03
186	301096	百诚医药	1,730	100,478.40	0.03
187	688652	京仪装备	2,556	99,914.04	0.03
188	301221	光庭信息	2,791	99,582.88	0.03
189	301517	陕西华达	1,841	99,414.00	0.03
190	301262	海看股份	4,381	98,791.55	0.03
191	688306	均普智能	24,265	98,515.90	0.03
192	301566	达利凯普	5,755	97,662.35	0.03
193	688285	高铁电气	15,159	97,472.37	0.03
194	301267	华夏眼科	4,695	97,280.40	0.03
195	301199	迈赫股份	4,014	97,058.52	0.03
196	301558	三态股份	11,565	97,030.35	0.03
197	688409	富创精密	2,624	96,930.56	0.03
198	301550	斯菱股份	2,022	96,874.02	0.03

199	688627	精智达	2,086	96,832.12	0.03
200	688305	科德数控	1,496	96,432.16	0.03
201	688102	斯瑞新材	8,442	96,407.64	0.03
202	301320	豪江智能	6,416	96,368.32	0.03
203	301382	蜂助手	5,304	95,949.36	0.03
204	688593	新相微	9,584	95,840.00	0.03
205	301251	威尔高	2,758	94,957.94	0.03
206	688591	泰凌微	4,802	93,879.10	0.03
207	301539	宏鑫科技	3,607	92,654.66	0.03
208	301507	民生健康	7,261	91,633.82	0.03
209	688697	纽威数控	5,837	91,582.53	0.03
210	301168	通灵股份	3,281	91,146.18	0.03
211	688419	耐科装备	3,039	90,926.88	0.03
212	301489	思泉新材	1,278	90,201.24	0.03
213	688167	炬光科技	1,640	90,200.00	0.03
214	301511	德福科技	6,084	89,799.84	0.03
215	002891	中宠股份	4,300	89,741.00	0.03
216	301332	德尔玛	10,101	89,292.84	0.03
217	301591	肯特股份	2,184	88,113.42	0.03
218	301413	安培龙	2,123	87,786.05	0.03
219	688581	安杰思	1,784	87,291.12	0.03
220	688257	新锐股份	5,683	87,120.39	0.03
221	688433	华曙高科	4,171	87,007.06	0.03
222	688049	炬芯科技	3,912	86,533.44	0.03
223	301357	北方长龙	2,660	85,864.80	0.03
224	301587	中瑞股份	2,934	85,702.44	0.03
225	301329	信音电子	4,381	84,684.73	0.03
226	301136	招标股份	7,172	84,486.16	0.03
227	301499	维科精密	3,709	84,305.57	0.03
228	301399	英特科技	4,241	83,462.88	0.03
229	688653	康希通信	6,478	83,436.64	0.03
230	301185	鸥玛软件	5,776	82,770.08	0.03
231	301548	崇德科技	1,559	82,751.72	0.03
232	301459	丰茂股份	2,077	82,477.67	0.03
233	301222	浙江恒威	3,315	82,079.40	0.03
234	688626	翔宇医疗	2,583	81,984.42	0.03
235	301202	朗威股份	3,060	81,885.60	0.03
236	603345	安井食品	1,100	81,741.00	0.03
237	301419	阿莱德	3,292	81,740.36	0.03
238	301110	青木股份	2,766	81,679.98	0.03
239	688523	航天环宇	4,717	81,368.25	0.03
240	688507	索辰科技	1,667	81,016.20	0.03
241	688620	安凯微	9,912	80,683.68	0.03

242	001389	广合科技	1,844	80,667.03	0.03
243	688709	成都华微	4,179	80,516.74	0.03
244	301359	东南电子	3,271	79,812.40	0.03
245	301190	善水科技	5,606	78,652.18	0.03
246	301386	未来电器	3,776	78,314.24	0.03
247	301568	思泰克	2,456	78,149.92	0.03
248	301456	盘古智能	2,990	78,009.10	0.03
249	301100	风光股份	5,985	77,745.15	0.03
250	301151	冠龙节能	5,245	77,206.40	0.03
251	301206	三元生物	3,117	76,615.86	0.02
252	301193	家联科技	4,752	75,841.92	0.02
253	301281	科源制药	3,367	75,589.15	0.02
254	301418	协昌科技	1,886	75,440.00	0.02
255	688702	盛科通信-U	1,852	75,006.00	0.02
256	301408	华人健康	7,281	74,484.63	0.02
257	301393	昊帆生物	1,743	74,025.21	0.02
258	301200	大族数控	2,341	73,881.96	0.02
259	301315	威士顿	2,253	73,425.27	0.02
260	301261	恒工精密	1,973	73,139.11	0.02
261	301519	舜禹股份	4,414	73,095.84	0.02
262	688603	天承科技	1,391	72,624.11	0.02
263	002990	盛视科技	3,600	72,468.00	0.02
264	301388	欣灵电气	2,920	72,153.20	0.02
265	301292	海科新源	5,824	72,042.88	0.02
266	301323	新莱福	2,277	71,907.66	0.02
267	301135	瑞德智能	3,376	71,875.04	0.02
268	301439	泓淋电力	5,596	70,901.32	0.02
269	301052	果麦文化	3,394	69,577.00	0.02
270	688141	杰华特	4,276	69,100.16	0.02
271	688530	欧莱新材	3,437	69,099.55	0.02
272	688646	逸飞激光	2,190	68,349.90	0.02
273	688084	晶品特装	1,562	68,259.40	0.02
274	688435	英方软件	2,728	68,090.88	0.02
275	301138	华研精机	2,849	68,062.61	0.02
276	603135	中重科技	5,416	67,862.48	0.02
277	688458	美芯晟	2,527	67,723.60	0.02
278	301117	佳缘科技	2,616	67,492.80	0.02
279	601033	永兴股份	4,160	67,254.72	0.02
280	301518	长华化学	3,850	66,720.50	0.02
281	301272	英华特	1,729	66,704.82	0.02
282	688720	艾森股份	1,644	66,647.76	0.02
283	688648	中邮科技	3,025	66,066.00	0.02
284	301520	万邦医药	1,596	66,042.48	0.02

285	301428	世纪恒通	2,289	65,694.30	0.02
286	301290	东星医疗	3,291	65,523.81	0.02
287	688602	康鹏科技	8,522	65,363.74	0.02
288	301170	锡南科技	2,496	65,020.80	0.02
289	301219	腾远钴业	1,685	64,468.10	0.02
290	301028	东亚机械	7,329	64,275.33	0.02
291	688480	赛恩斯	2,302	64,133.72	0.02
292	301337	亚华电子	2,318	63,930.44	0.02
293	301045	天禄科技	3,350	63,851.00	0.02
294	688259	创耀科技	1,595	63,736.20	0.02
295	688693	锆威特	1,773	63,686.16	0.02
296	688678	福立旺	5,877	63,647.91	0.02
297	688152	麒麟信安	1,639	63,462.08	0.02
298	301276	嘉曼服饰	3,026	63,424.96	0.02
299	301555	惠柏新材	2,235	63,317.55	0.02
300	301528	多浦乐	1,478	63,317.52	0.02
301	688695	中创股份	1,856	63,082.50	0.02
302	301371	敷尔佳	2,029	63,020.74	0.02
303	301373	凌玮科技	2,764	63,019.20	0.02
304	688787	海天瑞声	1,144	62,782.72	0.02
305	301133	金钟股份	2,860	62,319.40	0.02
306	688584	上海合晶	3,778	61,936.42	0.02
307	688573	信宇人	2,844	60,804.72	0.02
308	301108	洁雅股份	2,492	60,580.52	0.02
309	301578	辰奕智能	1,527	60,423.39	0.02
310	603341	龙旗科技	1,541	59,837.23	0.02
311	301295	美硕科技	3,004	59,809.64	0.02
312	301265	华新环保	7,560	59,799.60	0.02
313	301126	达嘉维康	6,615	59,733.45	0.02
314	301529	福赛科技	1,816	59,582.96	0.02
315	301588	美新科技	2,568	59,238.22	0.02
316	688429	时创能源	3,452	58,476.88	0.02
317	301309	万得凯	2,271	58,046.76	0.02
318	301505	苏州规划	1,934	58,020.00	0.02
319	301360	荣旗科技	1,340	57,955.00	0.02
320	301533	威马农机	2,243	57,622.67	0.02
321	301046	能辉科技	2,891	56,865.97	0.02
322	688489	三未信安	2,124	56,583.36	0.02
323	301559	中集环科	3,868	56,356.76	0.02
324	301163	宏德股份	2,764	56,164.48	0.02
325	688103	国力股份	1,595	55,442.20	0.02
326	300994	久祺股份	5,034	55,323.66	0.02
327	301166	优宁维	2,022	54,594.00	0.02

328	688716	中研股份	2,561	54,293.20	0.02
329	301500	飞南资源	3,094	53,990.30	0.02
330	688143	长盈通	2,519	53,956.98	0.02
331	301355	南王科技	5,624	53,934.16	0.02
332	301161	唯万密封	3,460	53,733.80	0.02
333	301502	华阳智能	1,375	53,673.83	0.02
334	301062	上海艾录	5,225	53,347.25	0.02
335	301036	双乐股份	2,047	53,262.94	0.02
336	301111	粤万年青	3,783	52,772.85	0.02
337	688683	莱尔科技	3,296	52,768.96	0.02
338	688479	友车科技	3,318	52,723.02	0.02
339	301316	慧博云通	3,584	52,613.12	0.02
340	688651	盛邦安全	1,778	52,006.50	0.02
341	301177	迪阿股份	2,772	51,559.20	0.02
342	301116	益客食品	5,764	51,472.52	0.02
343	605168	三人行	1,936	50,974.88	0.02
344	688307	中润光学	2,455	50,793.95	0.02
345	301313	凡拓数创	2,464	50,142.40	0.02
346	301319	唯特偶	1,666	50,029.98	0.02
347	688612	威迈斯	1,874	49,792.18	0.02
348	601133	柏诚股份	4,657	49,783.33	0.02
349	688737	中自科技	3,061	49,588.20	0.02
350	301157	华塑科技	1,498	48,834.80	0.02
351	603119	浙江荣泰	2,723	48,251.56	0.02
352	688420	美腾科技	2,304	47,646.72	0.02
353	301118	恒光股份	3,142	46,847.22	0.02
354	301158	德石股份	3,783	46,795.71	0.02
355	001378	德冠新材	1,953	46,598.58	0.02
356	301026	浩通科技	2,027	46,539.92	0.02
357	688255	凯尔达	2,309	46,295.45	0.02
358	301525	儒竞科技	818	46,037.04	0.01
359	688719	爱科赛博	1,764	45,987.48	0.01
360	601065	江盐集团	5,278	45,760.26	0.01
361	601083	锦江航运	4,736	45,276.16	0.01
362	600925	苏能股份	8,960	45,248.00	0.01
363	603551	奥普科技	4,600	45,080.00	0.01
364	688509	正元地信	15,433	44,601.37	0.01
365	301322	绿通科技	2,356	44,222.12	0.01
366	301515	港通医疗	2,294	43,907.16	0.01
367	601156	东航物流	2,090	42,531.50	0.01
368	301033	迈普医学	1,076	42,082.36	0.01
369	688173	希荻微	3,773	41,616.19	0.01
370	688722	同益中	3,687	41,257.53	0.01

371	603193	润本股份	2,238	41,156.82	0.01
372	301025	读客文化	4,027	40,229.73	0.01
373	603125	常青科技	2,314	39,823.94	0.01
374	603344	星德胜	1,663	39,344.14	0.01
375	301066	万事利	4,810	38,961.00	0.01
376	688267	中触媒	1,956	38,846.16	0.01
377	301068	大地海洋	1,867	38,721.58	0.01
378	001359	平安电工	1,748	38,635.71	0.01
379	301078	孩子王	7,551	38,208.06	0.01
380	001328	登康口腔	1,445	36,558.50	0.01
381	301072	中捷精工	1,802	35,823.76	0.01
382	605589	圣泉集团	1,750	35,507.50	0.01
383	001326	联域股份	986	35,357.96	0.01
384	301049	超越科技	1,954	35,074.30	0.01
385	301032	新柴股份	5,124	34,382.04	0.01
386	603107	上海汽配	2,114	33,591.46	0.01
387	300904	威力传动	837	33,454.89	0.01
388	603004	鼎龙科技	1,948	33,018.60	0.01
389	603270	金帝股份	1,645	32,636.80	0.01
390	603273	天元智能	1,772	32,516.20	0.01
391	688511	天微电子	1,490	32,437.30	0.01
392	603082	北自科技	1,070	32,276.55	0.01
393	688768	容知日新	1,342	31,416.22	0.01
394	001306	夏厦精密	581	31,368.19	0.01
395	688501	青达环保	2,287	31,286.16	0.01
396	301053	远信工业	1,544	30,818.24	0.01
397	603381	永臻股份	1,089	30,179.17	0.01
398	603075	热威股份	1,669	29,457.85	0.01
399	603325	博隆技术	422	28,994.20	0.01
400	300774	倍杰特	4,435	28,960.55	0.01
401	001282	三联锻造	1,045	28,956.95	0.01
402	603375	盛景微	714	28,339.56	0.01
403	603281	江瀚新材	1,208	27,119.60	0.01
404	688718	唯赛勃	3,145	26,889.75	0.01
405	001387	雪祺电气	1,729	26,756.25	0.01
406	001239	永达股份	1,887	26,191.56	0.01
407	001358	兴欣新材	1,214	24,911.28	0.01
408	603312	西典新能	959	24,613.66	0.01
409	600955	维远股份	1,694	24,410.54	0.01
410	688361	中科飞测	512	24,217.60	0.01
411	603276	恒兴新材	1,737	24,213.78	0.01
412	601921	浙版传媒	3,154	24,096.56	0.01
413	603373	安邦护卫	876	24,081.24	0.01

414	605555	德昌股份	1,284	23,895.24	0.01
415	688071	华依科技	1,101	23,858.67	0.01
416	603285	键邦股份	1,276	23,797.40	0.01
417	603231	索宝蛋白	1,391	23,702.64	0.01
418	001213	中铁特货	5,818	22,981.10	0.01
419	301487	盟固利	867	22,420.62	0.01
420	001379	腾达科技	1,617	22,175.46	0.01
421	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.01
422	001311	多利科技	844	20,407.92	0.01
423	603071	物产环能	1,627	20,386.31	0.01
424	301162	国能日新	468	20,386.08	0.01
425	605507	国邦医药	1,202	20,013.30	0.01
426	300919	中伟股份	640	19,833.60	0.01
427	603062	麦加芯彩	597	19,826.37	0.01
428	603137	恒尚节能	1,935	19,737.00	0.01
429	603172	万丰股份	1,220	19,715.20	0.01
430	001308	康冠科技	867	19,507.50	0.01
431	300308	中际旭创	140	19,303.20	0.01
432	605167	利柏特	2,471	19,298.51	0.01
433	001367	海森药业	813	18,975.42	0.01
434	301348	蓝箭电子	613	18,629.07	0.01
435	603132	金徽股份	1,342	18,465.92	0.01
436	001337	四川黄金	795	18,451.95	0.01
437	001324	长青科技	1,131	18,322.20	0.01
438	688556	高测股份	1,499	17,823.11	0.01
439	301050	雷电微力	365	17,578.40	0.01
440	601022	宁波远洋	1,983	17,490.06	0.01
441	603171	税友股份	637	17,224.48	0.01
442	605598	上海港湾	774	17,097.66	0.01
443	688692	达梦数据	95	16,618.35	0.01
444	001338	永顺泰	1,649	16,160.20	0.01
445	301120	新特电气	1,548	16,083.72	0.01
446	301526	国际复材	4,683	15,594.39	0.01
447	300674	宇信科技	1,400	15,512.00	0.01
448	603206	嘉环科技	1,210	15,282.30	0.00
449	301018	申菱环境	782	15,202.08	0.00
450	001288	运机集团	537	14,864.16	0.00
451	001216	华瓷股份	1,177	14,783.12	0.00
452	601121	宝地矿业	2,532	14,407.08	0.00
453	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00
454	601528	瑞丰银行	2,899	13,683.28	0.00
455	001208	华菱线缆	1,754	13,295.32	0.00
456	301058	中粮科工	1,386	13,125.42	0.00

457	301029	怡合达	665	13,073.90	0.00
458	605011	杭州热电	525	12,773.25	0.00
459	603173	福斯达	588	12,765.48	0.00
460	603153	上海建科	740	12,513.40	0.00
461	605599	菜百股份	980	12,475.40	0.00
462	001217	华尔泰	1,239	11,336.85	0.00
463	603122	合富中国	2,198	11,187.82	0.00
464	300997	欢乐家	928	10,968.96	0.00
465	603219	富佳股份	739	10,907.64	0.00
466	301015	百洋医药	462	10,870.86	0.00
467	300941	创识科技	598	10,799.88	0.00
468	603190	亚通精工	470	10,791.20	0.00
469	300968	格林精密	1,162	10,760.12	0.00
470	603162	海通发展	1,146	10,657.80	0.00
471	300925	法本信息	1,020	10,291.80	0.00
472	605365	立达信	645	10,236.15	0.00
473	301180	万祥科技	654	10,228.56	0.00
474	300918	南山智尚	1,063	10,141.02	0.00
475	605056	咸亨国际	933	10,057.74	0.00
476	605162	新中港	1,377	9,955.71	0.00
477	001207	联科科技	682	9,902.64	0.00
478	688352	颀中科技	845	9,641.45	0.00
479	601096	宏盛华源	2,322	9,496.98	0.00
480	300930	屹通新材	322	9,366.98	0.00
481	001313	粤海饲料	1,232	9,264.64	0.00
482	605577	龙版传媒	588	9,131.64	0.00
483	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
484	300972	万辰集团	430	9,085.90	0.00
485	605028	世茂能源	615	8,874.45	0.00
486	001300	三柏硕	763	8,675.31	0.00
487	603070	万控智造	775	8,672.25	0.00
488	300932	三友联众	896	8,628.48	0.00
489	300993	玉马遮阳	959	8,573.46	0.00
490	603130	云中马	480	8,467.20	0.00
491	001215	千味央厨	295	8,339.65	0.00
492	605580	恒盛能源	916	8,161.56	0.00
493	001228	永泰运	383	8,073.64	0.00
494	300894	火星人	628	8,050.96	0.00
495	001296	长江材料	564	8,037.00	0.00
496	300973	立高食品	282	7,921.38	0.00
497	300996	普联软件	539	7,907.13	0.00
498	300962	中金辐照	576	7,856.64	0.00
499	603282	亚光股份	457	7,705.02	0.00

500	001266	宏英智能	346	7,515.12	0.00
501	001278	一彬科技	473	7,478.13	0.00
502	603280	南方路机	363	7,201.92	0.00
503	001366	播恩集团	645	7,159.50	0.00
504	600298	安琪酵母	255	7,122.15	0.00
505	603216	梦天家居	772	7,086.96	0.00
506	301069	凯盛新材	539	7,066.29	0.00
507	001333	光华股份	426	7,029.00	0.00
508	001219	青岛食品	597	7,026.69	0.00
509	301048	金鹰重工	843	6,996.90	0.00
510	001368	通达创智	351	6,862.05	0.00
511	001299	美能能源	576	6,796.80	0.00
512	603048	浙江黎明	464	6,737.28	0.00
513	300975	商络电子	738	6,671.52	0.00
514	301020	密封科技	421	6,660.22	0.00
515	605566	福莱蒾特	435	6,625.05	0.00
516	300985	致远新能	413	6,616.26	0.00
517	603291	联合水务	536	6,571.36	0.00
518	301089	拓新药业	220	6,527.40	0.00
519	001256	炜冈科技	474	6,503.28	0.00
520	603150	万朗磁塑	250	6,260.00	0.00
521	300940	南极光	491	6,255.34	0.00
522	001209	洪兴股份	450	6,210.00	0.00
523	603151	邦基科技	535	6,173.90	0.00
524	605287	德才股份	489	6,156.51	0.00
525	301009	可靠股份	801	5,983.47	0.00
526	603213	镇洋发展	799	5,976.52	0.00
527	300963	中洲特材	552	5,939.52	0.00
528	301012	扬电科技	238	5,892.88	0.00
529	300981	中红医疗	612	5,856.84	0.00
530	603182	嘉华股份	546	5,743.92	0.00
531	001234	泰慕士	333	5,657.67	0.00
532	300978	东箭科技	593	5,473.39	0.00
533	300927	江天化学	391	5,344.97	0.00
534	605033	美邦股份	423	5,253.66	0.00
535	300922	天秦装备	402	5,221.98	0.00
536	300950	德固特	328	4,998.72	0.00
537	300937	药易购	244	4,972.72	0.00
538	605567	春雪食品	629	4,818.14	0.00
539	300987	川网传媒	391	4,746.74	0.00
540	300966	共同药业	286	4,673.24	0.00
541	301016	雷尔伟	275	4,628.25	0.00
542	300967	晓鸣股份	507	4,598.49	0.00

543	301021	英诺激光	290	4,547.20	0.00
544	301011	华立科技	295	4,545.95	0.00
545	300998	宁波方正	201	4,419.99	0.00
546	301002	崧盛股份	261	4,403.07	0.00
547	603065	宿迁联盛	581	4,340.07	0.00
548	300945	曼卡龙	474	4,223.34	0.00
549	300943	春晖智控	382	4,121.78	0.00
550	300986	志特新材	554	3,750.58	0.00
551	605138	盛泰集团	723	3,622.23	0.00
552	301007	德迈仕	303	3,539.04	0.00
553	300960	通业科技	234	3,526.38	0.00
554	300958	建工修复	300	3,189.00	0.00
555	603328	依顿电子	400	3,144.00	0.00
556	300942	易瑞生物	443	2,653.57	0.00
557	01999	敏华控股	140	684.88	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	4,836,651.00	1.34
2	688187	时代电气	4,393,791.83	1.21
3	000039	中集集团	4,334,339.70	1.20
4	000400	许继电气	4,022,291.44	1.11
5	688575	亚辉龙	3,414,251.08	0.94
6	601179	中国西电	3,356,548.00	0.93
7	601598	中国外运	3,159,129.00	0.87
8	600566	济川药业	3,080,065.00	0.85
9	300037	新宙邦	3,031,300.56	0.84
10	002415	海康威视	2,983,340.00	0.82
11	601108	财通证券	2,967,692.00	0.82
12	688009	中国通号	2,938,477.20	0.81
13	000725	京东方 A	2,936,915.00	0.81
14	688127	蓝特光学	2,885,414.05	0.80
15	688100	威胜信息	2,809,652.05	0.78
16	001286	陕西能源	2,606,991.00	0.72
17	603111	康尼机电	2,488,645.00	0.69
18	002116	中国海诚	2,420,457.00	0.67
19	600519	贵州茅台	2,373,059.00	0.66
20	603050	科林电气	2,305,508.80	0.64

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	688676	金盘科技	4,254,138.75	1.17
2	600298	安琪酵母	3,921,377.00	1.08
3	603093	南华期货	3,770,558.00	1.04
4	002803	吉宏股份	3,762,880.00	1.04
5	000777	中核科技	3,590,632.00	0.99
6	603179	新泉股份	3,521,809.00	0.97
7	300092	科新机电	3,420,827.50	0.94
8	001286	陕西能源	3,048,163.51	0.84
9	002116	中国海诚	3,013,882.00	0.83
10	688127	蓝特光学	3,010,570.00	0.83
11	002415	海康威视	2,994,095.00	0.83
12	601598	中国外运	2,947,067.84	0.81
13	002533	金杯电工	2,936,629.00	0.81
14	300708	聚灿光电	2,708,121.00	0.75
15	300037	新宙邦	2,687,612.00	0.74
16	002033	丽江股份	2,548,136.00	0.70
17	002737	葵花药业	2,547,066.00	0.70
18	002929	润建股份	2,542,054.00	0.70
19	000811	冰轮环境	2,536,470.00	0.70
20	688631	莱斯信息	2,519,322.94	0.70

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	179,402,078.28
卖出股票收入（成交）总额	230,703,259.48

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

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

7	可转债（可交换债）	124,728.91	0.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	124,728.91	0.04

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	118042	奥维转债	1,180	124,728.91	0.04

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

注：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	39,172.00
2	应收清算款	-
3	应收股利	18,496.00
4	应收利息	-
5	应收申购款	8,007.34
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	65,675.34

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	118042	奥维转债	124,728.91	0.04

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 (%)
9,089	20,860.72	46,399,086.34	24.47	143,203,953.26	75.53

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	468,747.17	0.2472

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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

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（2019年5月6日） 基金份额总额	1,316,628,973.89
本报告期期初基金份额总额	213,659,359.32
本报告期基金总申购份额	2,626,125.62
减：本报告期基金总赎回份额	26,682,445.34
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	189,603,039.60

§ 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，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
国信证券	2	56,049,558.47	13.71	52,160.13	14.28	-
中金公司	1	49,710,776.63	12.16	46,124.32	12.63	-
华西证券	2	44,490,134.49	10.88	38,724.60	10.61	-

国元证券	1	44,420,196.27	10.87	37,130.50	10.17	-
申万宏源证券	3	40,052,340.39	9.80	34,087.96	9.34	-
东吴证券	1	38,877,037.06	9.51	31,930.39	8.74	-
长江证券	1	36,723,398.74	8.98	34,204.01	9.37	-
国泰君安	2	30,885,665.51	7.55	28,195.34	7.72	-
招商证券	2	26,146,912.54	6.40	23,969.94	6.56	-
广发证券	1	23,053,740.46	5.64	21,469.42	5.88	-
中信建投证券	1	16,502,807.40	4.04	15,389.38	4.21	-
兴业证券	1	1,904,549.50	0.47	1,754.67	0.48	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	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	-	-	10,000,000.00	5.56	-	-
中金公司	-	-	48,000,000.00	26.67	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	122,000,000.00	67.78	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

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	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 01 月 04 日
2	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 01 月 18 日
3	鹏华研究智选混合型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 01 月 19 日
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	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 01 月 23 日
5	鹏华基金管理有限公司关于暂停北京中期时代基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 02 月 02 日
6	鹏华基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 02 月 08 日
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	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 03 月 04 日
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	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 03 月 16 日
9	鹏华研究智选混合型证券投资基金 2023 年年度报告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 03 月 28 日
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	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 03 月 30 日
11	鹏华研究智选混合型证券投资基金更新的招募说明书	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 04 月 10 日
12	鹏华研究智选混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 04 月 10 日
13	鹏华基金管理有限公司关于董事长变更的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 04 月 13 日
14	鹏华基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会	2024 年 04 月 13 日

		会基金电子披露网站	
15	鹏华研究智选混合型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 04 月 19 日
16	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 05 月 10 日
17	鹏华基金管理有限公司关于调整个人投资者开立基金账户证件类型的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 05 月 16 日
18	鹏华基金管理有限公司关于调整旗下部分基金单笔最低赎回份额和账户最低份额余额限制的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 06 月 12 日
19	鹏华研究智选混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 06 月 28 日

注：无。

§ 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）《鹏华研究智选混合型证券投资基金基金合同》；
- （二）《鹏华研究智选混合型证券投资基金托管协议》；
- （三）《鹏华研究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