

鹏华策略回报灵活配置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	7
2.4 信息披露方式	7
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	8
3.3 其他指标	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	44
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	69
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	70
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	71
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	71

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	71
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	71
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	71
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	71
7.12	投资组合报告附注	71
§ 8	基金份额持有人信息	72
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	72
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	72
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	72
§ 9	开放式基金份额变动	73
§ 10	重大事件揭示	73
10.1	基金份额持有人大会决议	73
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	73
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	73
10.4	基金投资策略的改变	74
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	74
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	74
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	74
10.8	其他重大事件	76
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	78
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	78
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	78
§ 12	备查文件目录	78
12.1	备查文件目录	78
12.2	存放地点	78
12.3	查阅方式	78

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华策略回报灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	鹏华策略回报混合
基金主代码	004986
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 9 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	377,969,765.78 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为混合型基金，在控制风险的前提下灵活地采用多种投资策略，通过精选个股，力争长期稳健超额回报的目标。
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>本基金灵活、务实地采用多种投资策略，包括价值投资、成长投资、主题轮动、趋势投资等，将各种理念和方法兼容并蓄，作为实现收益的工具和手段。本基金将重点关注在中国经济持续转型的过程中，因经济结构优化、产业结构升级、技术创新等制度变革等产生的投资机会，并投资于其中的优质上市公司的股票。</p> <p>（1）价值投资策略</p> <p>本基金通过寻找价值被低估的股票进行投资，以谋求估值反转带来的收益。通过运用多项指标如 PE、PB、EV/EBITDA 等进行相对估值，通过与国内同行业其它公司估值水平以及国外同行业公司相对估值水平等进行估值比较，找出价值被相对低估的公司。</p> <p>（2）成长投资策略</p> <p>在充分的行业研究和审慎的公司研究基础上，本基金将关注成长型上市公司，尤其是中小市值股票中具有潜在高成长性和稳健盈利模式的上市公司。在具体操作上，以政策分析、行业分析和公司特质分析等基本面定性分析为主，评估风险，精选投资标的。</p> <p>（3）主题轮动策略</p> <p>主题轮动策略是基于自上而下的投资主题分析框架，综合运用定量和定性的分析方法，针对经济发展趋势及成长动因进行前瞻性的分析，挖掘市场的长期性和阶段性主题投资机会，并从中发现</p>

	<p>与投资主题相符的行业和具有核心竞争力的上市公司，力争获取市场超额收益。</p> <p>(4) 趋势投资策略</p> <p>公司的经营业绩成长和公司投资价值的提升具有连续性和延展性，这决定了公司股票价格的长期趋势。同时，在股票市场上，由于受到当期各种外部因素的影响，股票价格还具有中、短期趋势。中期趋势表现为股价相对长期趋势的估值偏离和估值修复过程，而短期趋势则表现为外部因素影响短期股价偏离和恢复的过程。由于市场反应不足或反应过度，股票价格的涨跌往往表现出一定的惯性。因此，可通过基本面分析、行为金融分析和事件分析，利用股价中、短期趋势的动态特征，进行股票的买入和卖出操作，从而提高单只股票的投资收益。</p> <p>(5) 存托凭证投资策略</p> <p>本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>本基金债券投资将采取久期策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、个券选择策略、信用策略等积极投资策略，自上而下地管理组合的久期，灵活地调整组合的券种搭配，同时精选个券，以增强组合的持有期收益。</p> <p>(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>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</p>
--	--

	<p>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、融资投资策略</p> <p>本基金将在充分考虑风险和收益特征的基础上，审慎参与融资交易。本基金将基于对市场行情和组合风险收益的分析，确定投资时机、标的证券以及投资比例。若相关融资业务法律法规发生变化，本基金将从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。</p>
业绩比较基准	本基金业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×60%+中证综合债指数收益率×40%
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、债券基金，低于股票型基金，属于证券投资基金中中高风险、中高预期收益的品种。

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	《中国证券报》
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	-88,528,202.45
本期利润	-61,325,222.98
加权平均基金份额本期利润	-0.1372
本期加权平均净值利润率	-12.74%
本期基金份额净值增长率	-7.65%
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	31,965,643.57
期末可供分配基金份额利润	0.0846
期末基金资产净值	409,935,409.35
期末基金份额净值	1.0846
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	61.72%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

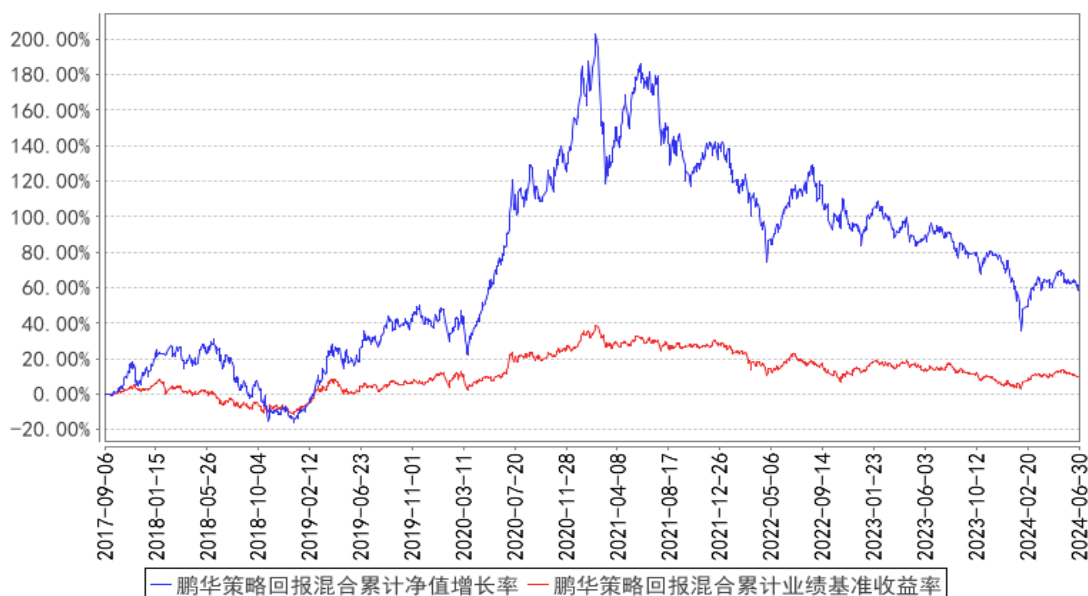
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

过去一个月	-0.44%	0.88%	-1.64%	0.28%	1.20%	0.60%
过去三个月	-0.73%	0.93%	-0.56%	0.44%	-0.17%	0.49%
过去六个月	-7.65%	1.34%	2.20%	0.53%	-9.85%	0.81%
过去一年	-15.85%	1.13%	-3.64%	0.52%	-	0.61%
过去三年	-42.41%	1.27%	-16.33%	0.62%	-	0.65%
自基金合同生效起至今	61.72%	1.52%	9.72%	0.71%	52.00%	0.81%

注：业绩比较基准=本基金业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×60%+中证综合债指数收益率×40%

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

鹏华策略回报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 2017 年 09 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的经验。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

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

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

背后的核心因素有几点，负债端没有增量资金，整体风险偏好向现金流、资产质量、估值安全边际等各方面更好的大盘价值股倾斜，宏观需求延续弱预期弱现实的局面，以 AI 为典型代表的

各新兴产业始终没有能够真实落地的应用场景，实际业绩无法落地印证，成长的逻辑和预期持续变弱，以主题轮动的方式展开的过程中，中枢向下。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期份额净值增长率为-7.65%，同期业绩比较基准增长率为 2.20%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本基金管理人设有估值委员会，由登记结算部、风控管理部、监察稽核部、各投资部门、研究部门负责人、基金经理等成员组成，估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规和基金估值运作等方面的专业能力。基金经理可与估值委员会成员共同商定估值原则和政策，但不参与日常估值的执行。

基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值发生重大变化的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

本基金管理人已与第三方定价服务机构签署服务协议，由其按约定提供相关参考数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1、截止本报告期末，本基金期末可供分配利润为 31,965,643.57 元，期末基金份额净值 1.0846 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：鹏华策略回报灵活配置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	59,341,408.61	153,651,903.04
结算备付金		1,240,532.36	1,888,459.27
存出保证金		138,546.70	105,114.43
交易性金融资产	6.4.7.2	351,384,297.21	529,240,949.98
其中：股票投资		351,368,275.40	529,050,183.27
基金投资		-	-
债券投资		16,021.81	190,766.71
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		81,782.96	-
应收股利		-	-
应收申购款		16,992.58	30,419.36
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		412,203,560.42	684,916,846.08
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		955,064.06	4,860,465.06
应付赎回款		37,045.80	45,003.40
应付管理人报酬		406,124.98	804,366.74
应付托管费		67,687.50	134,061.14
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1.17	1.19
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-

其他负债	6.4.7.9	802,227.56	875,083.46
负债合计		2,268,151.07	6,718,980.99
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	377,969,765.78	577,492,196.04
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	31,965,643.57	100,705,669.05
净资产合计		409,935,409.35	678,197,865.09
负债和净资产总计		412,203,560.42	684,916,846.08

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0846 元，基金份额总额 377,969,765.78 份。

6.2 利润表

会计主体：鹏华策略回报灵活配置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		-57,882,362.30	3,210,300.01
1. 利息收入		237,513.61	118,331.58
其中：存款利息收入	6.4.7.13	140,272.25	73,406.80
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		97,241.36	44,924.78
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-85,923,166.29	-3,837,249.51
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-89,874,521.08	-5,425,368.77
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	10,282.00	157.25
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	3,941,072.79	1,587,962.01
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	27,202,979.47	6,920,146.92
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	600,310.91	9,071.02
减：二、营业总支出		3,442,860.68	2,643,063.16
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,878,130.77	2,192,818.15
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	479,688.48	365,469.79
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		0.79	0.48
8. 其他费用	6.4.7.23	85,040.64	84,774.74
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-61,325,222.98	567,236.85
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-61,325,222.98	567,236.85
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-61,325,222.98	567,236.85

6.3 净资产变动表

会计主体：鹏华策略回报灵活配置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	577,492,196.04	-	100,705,669.05	678,197,865.09
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净	577,492,196.04	-	100,705,669.05	678,197,865.09

资产				
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	199,522,430.26	-	-68,740,025.48	-268,262,455.74
(一)、综合收益总额		-	-61,325,222.98	-61,325,222.98
(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)	199,522,430.26	-	-7,414,802.50	-206,937,232.76
其中：1. 基金申购款	4,107,265.41	-	323,682.41	4,430,947.82
2. 基金赎回款	203,629,695.67	-	-7,738,484.91	-211,368,180.58
(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	377,969,765.78	-	31,965,643.57	409,935,409.35
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	190,440,874.18	-	109,805,973.15	300,246,847.33
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	190,440,874.18	-	109,805,973.15	300,246,847.33
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-12,346,176.43	-	-6,823,856.42	-19,170,032.85
(一)、综合收益总额		-	567,236.85	567,236.85

(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)	-12,346,176.43	-	-7,391,093.27	-19,737,269.70
其中：1. 基金申购款	4,652,630.20	-	2,778,000.29	7,430,630.49
2. 基金赎回款	-16,998,806.63	-	-10,169,093.56	-27,167,900.19
(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	178,094,697.75	-	102,982,116.73	281,076,814.48

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

鹏华策略回报灵活配置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”)《关于准予鹏华策略回报灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2015]2737号文)和机构部函[2017]1679号《关于鹏华策略回报灵活配置混合型证券投资基金延期募集备案的回函》批准,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》及其配套规则和《鹏华策略回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2017年9月6日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集规模为491,760,953.62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(以下简称:工商银行)。本基金于2017年8月7日至2017年9月1日募集。募集期间净认购资金人民币491,532,684.29元,认购资金在募集期间产生的利息人民币

228,269.33 元，募集的有效认购份额及利息结转的基金份额合计 491,760,953.62 份。上述募集资金已由普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)验证，并出具了普华永道中天验字(2017)第 800 号验资报告。

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》、《鹏华策略回报灵活配置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	59,341,408.61
等于：本金	59,336,524.04
加：应计利息	4,884.57
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	59,341,408.61

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	344,250,947.67	-	351,368,275.40	7,117,327.73	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	15,000.00	13.81	16,021.81	1,008.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	15,000.00	13.81	16,021.81	1,008.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	344,265,947.67	13.81	351,384,297.21	7,118,335.73	

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	19.91
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	717,672.29
其中：交易所市场	717,672.29
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	84,535.36
合计	802,227.56

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	577,492,196.04	577,492,196.04
本期申购	4,107,265.41	4,107,265.41
本期赎回（以“-”号填列）	-203,629,695.67	-203,629,695.67
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	377,969,765.78	377,969,765.78

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	720,820,111.49	-620,114,442.44	100,705,669.05
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	720,820,111.49	-620,114,442.44	100,705,669.05
本期利润	-88,528,202.45	27,202,979.47	-61,325,222.98
本期基金份额交易产生的变动数	-222,290,513.15	214,875,710.65	-7,414,802.50
其中：基金申购款	4,667,408.29	-4,343,725.88	323,682.41
基金赎回款	-226,957,921.44	219,219,436.53	-7,738,484.91

本期已分配利润	-	-	-
本期末	410,001,395.89	-378,035,752.32	31,965,643.57

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	119,981.64
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	19,142.28
其他	1,148.33
合计	140,272.25

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	-89,874,521.08
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	-89,874,521.08

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	913,940,647.57
减：卖出股票成本总额	1,001,710,517.06
减：交易费用	2,104,651.59
买卖股票差价收入	-89,874,521.08

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	237.02
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	10,044.98
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	10,282.00

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	176,287.78
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	166,000.00
减：应计利息总额	235.77
减：交易费用	7.03
买卖债券差价收入	10,044.98

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	3,941,072.79
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	3,941,072.79

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	27,202,979.47
股票投资	27,211,657.37
债券投资	-8,677.90
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	27,202,979.47

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	600,249.65
基金转换费收入	61.26
合计	600,310.91

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	481.00
存托服务费	24.28
合计	85,040.64

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 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	518,192,755.42	30.32	140,135,122.97	12.52

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	472,984,000.00	52.12	-	-

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	477,421.49	31.04	136,809.89	19.06
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	129,105.25	13.12	85,657.57	17.94
------	------------	-------	-----------	-------

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《证券交易席位租用协议》。根据协议规定，上述单位定期或不定期地为鹏华基金公司提供研究服务以及其他研究支持。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,878,130.77	2,192,818.15
其中：应支付销售机构的客户维护费	495,328.19	673,714.73
应支付基金管理人的净管理费	2,382,802.58	1,519,103.42

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	479,688.48	365,469.79

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
中国工商银行	59,341,408.61	119,981.64	46,566,437.69	63,033.57

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2024年1月1日至2024年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
国信证券	603325	博隆技术	网下申购	660	47,823.60
上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额

国信证券	301488	豪恩汽电	网下申购	1,458	57,999.24
国信证券	688562	航天软件	网下申购	4,584	58,125.12
国信证券	688307	中润光学	网下申购	2,455	58,625.40

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	2024	6个月	新	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	-

	合科技	年 3 月 26 日		股 流 通 受 限						
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	541	6,427.08	10,268.18	-

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	193	8,675.35	12,724.49	-
301587	中瑞股份	2024年3月27日	6个月	新股流通受限	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	-
301588	美新科技	2024年3月6日	6个月	新股流通受限	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-
301589	诺瓦星云	2024年2月1日	6个月	新股流通受限	126.89	188.01	959	67,632.37	180,301.59	诺瓦星云于2024年5月30日每10股送8股
301591	肯特股份	2024年2月20日	6个月	新股流通受限	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-
601033	永兴股份	2024年1月11日	6个月	新股流通	16.20	15.96	770	12,474.00	12,289.20	-

				受限						
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	272	7,072.00	10,197.28	-
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	2024	1个月	新	20.56	20.56	945	19,429.20	19,429.20	-

	乃达	年6月26日	内(含)	股未上市						
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	144	3,362.40	3,618.72	-
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	662	15,000.92	10,519.18	-
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	86.96	174.93	123	10,696.08	21,516.39	-

				受限						
688695	中创股份	2024年3月6日	6个月	新股流通受限	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
688709	成都华微	2024年1月31日	6个月	新股流通受限	15.69	18.79	742	11,641.98	13,942.18	-

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

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

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

4、基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后6个月内不得转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行

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、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、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）。本基金可以依照法律法规参与融资。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。

于 2024 年 06 月 30 日，本基金未持有信用类债券（2023 年 12 月 31 日：0.03%）。

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	16,021.81	190,766.71
未评级	-	-
合计	16,021.81	190,766.71

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	59,341,408.61	-	-	-	59,341,408.61
结算备付金	1,240,532.36	-	-	-	1,240,532.36
存出保证金	138,546.70	-	-	-	138,546.70
交易性金融资产	-	16,021.81	-	-351,368,275.40	351,384,297.21
应收申购款	-	-	-	16,992.58	16,992.58
应收清算款	-	-	-	81,782.96	81,782.96
资产总计	60,720,487.67	16,021.81	-	-351,467,050.94	412,203,560.42
负债					
应付赎回款	-	-	-	37,045.80	37,045.80
应付管理人报酬	-	-	-	406,124.98	406,124.98
应付托管费	-	-	-	67,687.50	67,687.50
应付清算款	-	-	-	955,064.06	955,064.06
应交税费	-	-	-	1.17	1.17

其他负债	-	-	-	802,227.56	802,227.56
负债总计	-	-	-	2,268,151.07	2,268,151.07
利率敏感度缺口	60,720,487.67	16,021.81	-	-349,198,899.87	409,935,409.35
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	153,651,903.04	-	-	-	153,651,903.04
结算备付金	1,888,459.27	-	-	-	1,888,459.27
存出保证金	105,114.43	-	-	-	105,114.43
交易性金融资产	-	190,766.71	-	-529,050,183.27	529,240,949.98
应收申购款	-	-	-	30,419.36	30,419.36
资产总计	155,645,476.74	190,766.71	-	-529,080,602.63	684,916,846.08
负债					
应付赎回款	-	-	-	45,003.40	45,003.40
应付管理人报酬	-	-	-	804,366.74	804,366.74
应付托管费	-	-	-	134,061.14	134,061.14
应付清算款	-	-	-	4,860,465.06	4,860,465.06
应交税费	-	-	-	1.19	1.19
其他负债	-	-	-	875,083.46	875,083.46
负债总计	-	-	-	6,718,980.99	6,718,980.99
利率敏感度缺口	155,645,476.74	190,766.71	-	-522,361,621.64	678,197,865.09

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 0%—95%；每个交易日日终在扣除股指期货合约等金融工具所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	351,368,275.40	85.71	529,050,183.27	78.01
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	16,021.81	-	190,766.71	0.03
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	351,384,297.21	85.71	529,240,949.98	78.04

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	19,820,377.04	25,917,331.41
比较基准下降 5% 资产净值变动	-19,820,377.04	-25,917,331.41	

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	350,924,789.78
第二层次	45,611.11
第三层次	413,896.32
合计	351,384,297.21

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	351,368,275.40	85.24
	其中：股票	351,368,275.40	85.24
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	16,021.81	0.00
	其中：债券	16,021.81	0.00
	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	60,581,940.97	14.70
8	其他各项资产	237,322.24	0.06
9	合计	412,203,560.42	100.00

注：报告期末本基金投资的存托凭证公允价值为：41,963.40 元，占净值比 0.01%。本报告所指的“股票”均包含存托凭证。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	6,840,466.08	1.67
B	采矿业	41,272,761.64	10.07
C	制造业	245,816,798.80	59.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,265,774.60	2.75
E	建筑业	3,886,900.34	0.95
F	批发和零售业	1,040,117.16	0.25
G	交通运输、仓储和邮政业	16,387,693.23	4.00
H	住宿和餐饮业	50,150.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,387,238.87	4.49
J	金融业	3,935,908.26	0.96
K	房地产业	1,341,094.00	0.33
L	租赁和商务服务业	120,234.55	0.03
M	科学研究和技术服务业	449,489.26	0.11
N	水利、环境和公共设施管理业	191,874.61	0.05
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	17,261.10	0.00
Q	卫生和社会工作	43,398.03	0.01
R	文化、体育和娱乐业	286,769.27	0.07
S	综合	34,345.60	0.01
	合计	351,368,275.40	85.71

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	002648	卫星化学	1,064,401	19,137,929.98	4.67
2	600150	中国船舶	326,400	13,287,744.00	3.24
3	000338	潍柴动力	795,400	12,917,296.00	3.15
4	603129	春风动力	89,900	12,796,366.00	3.12
5	000528	柳工	1,097,100	12,276,549.00	2.99
6	000400	许继电气	297,100	10,223,211.00	2.49
7	688575	亚辉龙	414,964	9,676,960.48	2.36

8	688617	惠泰医疗	17,482	7,973,540.20	1.95
9	000682	东方电子	622,300	6,870,192.00	1.68
10	601989	中国重工	1,380,200	6,804,386.00	1.66
11	601899	紫金矿业	387,100	6,801,347.00	1.66
12	600031	三一重工	403,700	6,661,050.00	1.62
13	601872	招商轮船	763,700	6,453,265.00	1.57
14	601666	平煤股份	553,400	6,198,080.00	1.51
15	002920	德赛西威	67,000	5,835,030.00	1.42
16	601179	中国西电	703,600	5,656,944.00	1.38
17	600938	中国海油	168,800	5,570,400.00	1.36
18	603920	世运电路	281,400	5,554,836.00	1.36
19	300498	温氏股份	270,400	5,359,328.00	1.31
20	600066	宇通客车	205,700	5,307,060.00	1.29
21	600547	山东黄金	184,100	5,040,658.00	1.23
22	688009	中国通号	832,623	4,995,738.00	1.22
23	603596	伯特利	123,740	4,813,486.00	1.17
24	600487	亨通光电	296,500	4,675,805.00	1.14
25	603606	东方电缆	92,200	4,500,282.00	1.10
26	603225	新凤鸣	282,500	4,404,175.00	1.07
27	601766	中国中车	557,200	4,184,572.00	1.02
28	603766	隆鑫通用	584,500	3,962,910.00	0.97
29	601808	中海油服	223,200	3,839,040.00	0.94
30	603236	移远通信	80,400	3,757,092.00	0.92
31	000975	银泰黄金	226,400	3,688,056.00	0.90
32	603993	洛阳钼业	407,500	3,463,750.00	0.84
33	002322	理工能科	215,600	3,453,912.00	0.84
34	600027	华电国际	495,500	3,438,770.00	0.84
35	000425	徐工机械	456,900	3,266,835.00	0.80
36	601006	大秦铁路	443,100	3,172,596.00	0.77
37	003816	中国广核	681,200	3,153,956.00	0.77
38	002371	北方华创	9,800	3,134,922.00	0.76
39	600233	圆通速递	198,200	3,101,830.00	0.76
40	000902	新洋丰	247,400	2,936,638.00	0.72
41	600426	华鲁恒升	109,000	2,903,760.00	0.71
42	001286	陕西能源	244,867	2,823,316.51	0.69
43	603179	新泉股份	71,000	2,786,040.00	0.68
44	002594	比亚迪	10,900	2,727,725.00	0.67
45	002241	歌尔股份	133,600	2,606,536.00	0.64
46	600933	爱柯迪	175,900	2,601,561.00	0.63
47	300308	中际旭创	18,820	2,594,901.60	0.63
48	600312	平高电气	131,000	2,547,950.00	0.62
49	688192	迪哲医药-U	66,872	2,463,564.48	0.60
50	603067	振华股份	204,700	2,386,802.00	0.58

51	601919	中远海控	153,100	2,371,519.00	0.58
52	603997	继峰股份	226,000	2,311,980.00	0.56
53	000977	浪潮信息	59,400	2,160,378.00	0.53
54	603809	豪能股份	252,080	2,036,806.40	0.50
55	002332	仙琚制药	177,700	2,027,557.00	0.49
56	300049	福瑞股份	38,800	1,953,192.00	0.48
57	002517	恺英网络	199,500	1,905,225.00	0.46
58	600919	江苏银行	255,800	1,900,594.00	0.46
59	601918	新集能源	193,500	1,886,625.00	0.46
60	000529	广弘控股	281,200	1,653,456.00	0.40
61	300818	耐普矿机	64,200	1,637,100.00	0.40
62	300502	新易盛	13,500	1,424,925.00	0.35
63	605296	神农集团	40,140	1,410,921.00	0.34
64	600023	浙能电力	190,000	1,350,900.00	0.33
65	002997	瑞鹄模具	41,151	1,315,597.47	0.32
66	300298	三诺生物	51,700	1,310,078.00	0.32
67	600968	海油发展	305,400	1,258,248.00	0.31
68	600761	安徽合力	58,000	1,255,120.00	0.31
69	688498	源杰科技	9,479	1,241,654.21	0.30
70	600845	宝信软件	38,640	1,233,775.20	0.30
71	002185	华天科技	150,400	1,225,760.00	0.30
72	001979	招商蛇口	138,600	1,218,294.00	0.30
73	001267	汇绿生态	230,600	1,215,262.00	0.30
74	601601	中国太保	43,300	1,206,338.00	0.29
75	601390	中国中铁	185,000	1,206,200.00	0.29
76	600309	万华化学	14,800	1,196,728.00	0.29
77	002128	电投能源	55,000	1,160,500.00	0.28
78	600667	太极实业	201,500	1,150,565.00	0.28
79	600096	云天化	57,400	1,114,708.00	0.27
80	000625	长安汽车	82,700	1,110,661.00	0.27
81	688692	达梦数据	4,190	934,069.85	0.23
82	300760	迈瑞医疗	3,100	901,821.00	0.22
83	688111	金山办公	3,907	888,842.50	0.22
84	603871	嘉友国际	46,600	824,354.00	0.20
85	600985	淮北矿业	47,800	800,172.00	0.20
86	002373	千方科技	87,200	790,904.00	0.19
87	688408	中信博	8,568	788,941.44	0.19
88	601225	陕西煤业	30,500	785,985.00	0.19
89	002837	英维克	33,100	708,009.00	0.17
90	600566	济川药业	19,900	631,029.00	0.15
91	688256	寒武纪-U	3,171	629,982.57	0.15
92	000034	神州数码	26,200	599,718.00	0.15
93	301345	涛涛车业	7,727	425,757.70	0.10

94	601838	成都银行	13,300	202,027.00	0.05
95	301589	诺瓦星云	959	180,301.59	0.04
96	600486	扬农化工	2,700	152,415.00	0.04
97	301580	爱迪特	1,921	146,126.09	0.04
98	600418	江淮汽车	6,600	104,544.00	0.03
99	601799	星宇股份	900	100,836.00	0.02
100	688187	时代电气	1,969	97,229.22	0.02
101	001389	广合科技	2,219	97,078.01	0.02
102	688213	思特威-W	1,890	91,665.00	0.02
103	688418	震有科技	5,295	90,703.35	0.02
104	600887	伊利股份	3,500	90,440.00	0.02
105	688027	国盾量子	589	88,939.00	0.02
106	688025	杰普特	2,188	88,373.32	0.02
107	600803	新奥股份	4,200	87,360.00	0.02
108	688352	硕中科技	7,401	84,445.41	0.02
109	300188	国投智能	7,500	83,325.00	0.02
110	601901	方正证券	10,700	82,711.00	0.02
111	688041	海光信息	1,166	81,993.12	0.02
112	605090	九丰能源	2,800	81,200.00	0.02
113	688008	澜起科技	1,408	80,481.28	0.02
114	688334	西高院	4,861	78,262.10	0.02
115	601658	邮储银行	15,200	77,064.00	0.02
116	301291	明阳电气	2,543	76,417.15	0.02
117	600820	隧道股份	11,300	73,789.00	0.02
118	601233	桐昆股份	4,600	73,416.00	0.02
119	688651	盛邦安全	2,481	72,569.25	0.02
120	601702	华峰铝业	3,966	72,419.16	0.02
121	688543	国科军工	1,760	72,283.20	0.02
122	001380	华纬科技	3,692	71,772.48	0.02
123	600511	国药股份	2,300	70,817.00	0.02
124	688549	中巨芯-U	10,432	70,416.00	0.02
125	603713	密尔克卫	1,300	69,576.00	0.02
126	688530	欧莱新材	3,437	69,099.55	0.02
127	600707	彩虹股份	10,100	68,781.00	0.02
128	688592	司南导航	1,657	68,235.26	0.02
129	601699	潞安环能	3,700	67,081.00	0.02
130	601139	深圳燃气	10,000	66,800.00	0.02
131	688687	凯因科技	2,575	65,688.25	0.02
132	600850	电科数字	3,600	65,160.00	0.02
133	603279	景津装备	3,000	65,070.00	0.02
134	688548	广钢气体	7,042	64,293.46	0.02
135	688326	经纬恒润-W	1,121	64,266.93	0.02
136	301045	天禄科技	3,350	63,851.00	0.02

137	002833	弘亚数控	3,500	63,840.00	0.02
138	688048	长光华芯	2,032	63,479.68	0.02
139	600584	长电科技	2,000	63,420.00	0.02
140	688593	新相微	6,324	63,240.00	0.02
141	603102	百合股份	2,100	63,231.00	0.02
142	688789	宏华数科	586	63,170.80	0.02
143	688695	中创股份	1,856	63,082.50	0.02
144	301357	北方长龙	1,950	62,946.00	0.02
145	601965	中国汽研	3,700	62,493.00	0.02
146	600436	片仔癀	300	62,151.00	0.02
147	688017	绿的谐波	757	62,149.70	0.02
148	600765	中航重机	3,000	61,200.00	0.01
149	688676	金盘科技	1,169	60,963.35	0.01
150	600422	昆药集团	3,400	60,622.00	0.01
151	603358	华达科技	2,100	60,585.00	0.01
152	601020	华钰矿业	4,700	60,160.00	0.01
153	301295	美硕科技	3,004	59,809.64	0.01
154	001287	中电港	3,603	59,557.59	0.01
155	603163	圣晖集成	2,300	59,340.00	0.01
156	301588	美新科技	2,568	59,238.22	0.01
157	601168	西部矿业	3,300	59,235.00	0.01
158	300952	恒辉安防	3,398	58,921.32	0.01
159	601975	招商南油	16,400	58,876.00	0.01
160	688728	格科微	4,807	58,212.77	0.01
161	601866	中远海发	22,500	58,050.00	0.01
162	601600	中国铝业	7,600	57,988.00	0.01
163	601963	重庆银行	7,472	57,908.00	0.01
164	601088	中国神华	1,300	57,681.00	0.01
165	688416	恒烁股份	1,519	57,676.43	0.01
166	600583	海油工程	9,700	57,327.00	0.01
167	688376	美埃科技	1,828	57,326.08	0.01
168	688678	福立旺	5,272	57,095.76	0.01
169	688088	虹软科技	1,978	57,085.08	0.01
170	688219	会通股份	7,336	57,000.72	0.01
171	601360	三六零	7,400	56,832.00	0.01
172	600188	兖矿能源	2,500	56,825.00	0.01
173	603190	亚通精工	2,470	56,711.20	0.01
174	688570	天玛智控	2,766	56,398.74	0.01
175	688571	杭华股份	10,660	56,391.40	0.01
176	601061	中信金属	8,168	56,114.16	0.01
177	301373	凌玮科技	2,453	55,928.40	0.01
178	600529	山东药玻	2,200	55,748.00	0.01
179	600266	城建发展	14,900	55,726.00	0.01

180	301283	聚胶股份	1,959	55,576.83	0.01
181	301251	威尔高	1,603	55,191.29	0.01
182	601001	晋控煤业	3,300	54,516.00	0.01
183	300181	佐力药业	3,600	54,432.00	0.01
184	301281	科源制药	2,419	54,306.55	0.01
185	600131	国网信通	3,200	53,984.00	0.01
186	301276	嘉曼服饰	2,572	53,909.12	0.01
187	600975	新五丰	7,600	53,732.00	0.01
188	300889	爱克股份	4,786	53,698.92	0.01
189	301502	华阳智能	1,375	53,673.83	0.01
190	688159	有方科技	1,415	53,571.90	0.01
191	601636	旗滨集团	8,300	53,535.00	0.01
192	301062	上海艾录	5,225	53,347.25	0.01
193	301036	双乐股份	2,047	53,262.94	0.01
194	300857	协创数据	934	53,238.00	0.01
195	688772	珠海冠宇	3,530	52,597.00	0.01
196	600262	北方股份	3,200	52,576.00	0.01
197	688627	精智达	1,129	52,408.18	0.01
198	688100	威胜信息	1,371	52,303.65	0.01
199	605016	百龙创园	2,564	52,228.68	0.01
200	600459	贵研铂业	3,858	52,121.58	0.01
201	300922	天秦装备	4,008	52,063.92	0.01
202	688648	中邮科技	2,374	51,848.16	0.01
203	688595	芯海科技	1,723	51,690.00	0.01
204	301290	东星医疗	2,588	51,527.08	0.01
205	688403	汇成股份	6,011	50,973.28	0.01
206	301262	海看股份	2,259	50,940.45	0.01
207	688307	中润光学	2,455	50,793.95	0.01
208	301555	惠柏新材	1,788	50,654.04	0.01
209	301505	苏州规划	1,676	50,280.00	0.01
210	301511	德福科技	3,402	50,213.52	0.01
211	688143	长盈通	2,340	50,122.80	0.01
212	300950	德固特	3,279	49,971.96	0.01
213	688062	迈威生物-U	1,724	49,892.56	0.01
214	301202	朗威股份	1,863	49,853.88	0.01
215	603501	韦尔股份	500	49,685.00	0.01
216	601318	中国平安	1,200	49,632.00	0.01
217	301261	恒工精密	1,325	49,117.75	0.01
218	301548	崇德科技	919	48,780.52	0.01
219	003035	南网能源	11,046	48,602.40	0.01
220	301323	新莱福	1,537	48,538.46	0.01
221	301376	致欧科技	2,271	48,077.07	0.01
222	688385	复旦微电	1,525	47,854.50	0.01

223	688653	康希通信	3,710	47,784.80	0.01
224	301292	海科新源	3,843	47,537.91	0.01
225	600021	上海电力	4,800	47,472.00	0.01
226	300987	川网传媒	3,905	47,406.70	0.01
227	301329	信音电子	2,452	47,397.16	0.01
228	603893	瑞芯微	800	47,336.00	0.01
229	688085	三友医疗	2,798	47,286.20	0.01
230	601136	首创证券	2,300	47,058.00	0.01
231	002984	森麒麟	1,940	46,734.60	0.01
232	605266	健之佳	1,800	46,710.00	0.01
233	688029	南微医学	757	46,600.92	0.01
234	301026	浩通科技	2,027	46,539.92	0.01
235	688120	华海清科	244	46,257.52	0.01
236	301016	雷尔伟	2,747	46,232.01	0.01
237	600895	张江高科	2,500	46,200.00	0.01
238	301309	万得凯	1,806	46,161.36	0.01
239	301439	泓淋电力	3,636	46,068.12	0.01
240	688608	恒玄科技	314	45,963.32	0.01
241	688190	云路股份	612	45,722.52	0.01
242	601137	博威合金	3,000	45,720.00	0.01
243	688433	华曙高科	2,175	45,370.50	0.01
244	603325	博隆技术	660	45,347.28	0.01
245	688686	奥普特	707	45,269.21	0.01
246	600925	苏能股份	8,960	45,248.00	0.01
247	600977	中国电影	4,200	45,192.00	0.01
248	301568	思泰克	1,415	45,025.30	0.01
249	300552	万集科技	1,200	44,856.00	0.01
250	601000	唐山港	9,500	44,650.00	0.01
251	301519	舜禹股份	2,693	44,596.08	0.01
252	600373	中文传媒	3,000	44,520.00	0.01
253	688260	昀冢科技	2,990	44,461.30	0.01
254	600733	北汽蓝谷	5,500	44,440.00	0.01
255	688616	西力科技	3,918	44,430.12	0.01
256	600089	特变电工	3,200	44,384.00	0.01
257	603629	利通电子	2,400	44,304.00	0.01
258	301265	华新环保	5,596	44,264.36	0.01
259	601128	常熟银行	5,830	44,133.10	0.01
260	300998	宁波方正	2,003	44,045.97	0.01
261	688377	迪威尔	3,354	43,937.40	0.01
262	301002	崧盛股份	2,601	43,878.87	0.01
263	688501	青达环保	3,202	43,803.36	0.01
264	600050	中国联通	9,300	43,710.00	0.01
265	688522	纳睿雷达	932	43,692.16	0.01

266	600906	财达证券	7,597	43,530.81	0.01
267	688646	逸飞激光	1,381	43,101.01	0.01
268	601633	长城汽车	1,700	43,010.00	0.01
269	688212	澳华内镜	1,073	42,930.73	0.01
270	603344	星德胜	1,813	42,892.99	0.01
271	603885	吉祥航空	3,900	42,861.00	0.01
272	601156	东航物流	2,090	42,531.50	0.01
273	301456	盘古智能	1,624	42,370.16	0.01
274	600809	山西汾酒	200	42,176.00	0.01
275	301033	迈普医学	1,076	42,082.36	0.01
276	301157	华塑科技	1,289	42,021.40	0.01
277	688557	兰剑智能	1,812	42,002.16	0.01
278	689009	九号公司-WD	1,140	41,963.40	0.01
279	600201	生物股份	5,800	41,818.00	0.01
280	603496	恒为科技	1,700	41,565.00	0.01
281	688325	赛微微电	1,313	41,188.81	0.01
282	300943	春晖智控	3,813	41,142.27	0.01
283	688526	科前生物	2,792	41,014.48	0.01
284	301393	昊帆生物	964	40,941.08	0.01
285	600988	赤峰黄金	2,500	40,850.00	0.01
286	301528	多浦乐	952	40,783.68	0.01
287	688150	莱特光电	2,101	40,759.40	0.01
288	688777	中控技术	1,080	40,716.00	0.01
289	001359	平安电工	1,833	40,513.63	0.01
290	603950	长源东谷	3,000	40,440.00	0.01
291	600301	华锡有色	2,000	40,440.00	0.01
292	688517	金冠电气	2,892	40,430.16	0.01
293	603728	鸣志电器	1,000	40,230.00	0.01
294	301025	读客文化	4,027	40,229.73	0.01
295	688391	钜泉科技	1,370	39,962.90	0.01
296	600019	宝钢股份	6,000	39,900.00	0.01
297	688071	华依科技	1,837	39,807.79	0.01
298	688191	智洋创新	2,351	39,802.43	0.01
299	603381	永臻股份	1,433	39,710.72	0.01
300	603301	振德医疗	1,900	39,634.00	0.01
301	301520	万邦医药	957	39,600.66	0.01
302	603727	博迈科	3,000	39,480.00	0.01
303	688590	新致软件	3,021	38,970.90	0.01
304	301518	长华化学	2,240	38,819.20	0.01
305	301068	大地海洋	1,867	38,721.58	0.01
306	688612	威迈斯	1,451	38,553.07	0.01
307	603786	科博达	600	38,490.00	0.01
308	688429	时创能源	2,265	38,369.10	0.01

309	301355	南王科技	3,992	38,283.28	0.01
310	688012	中微公司	271	38,281.46	0.01
311	603986	兆易创新	400	38,248.00	0.01
312	605088	冠盛股份	1,816	37,845.44	0.01
313	603348	文灿股份	1,351	37,409.19	0.01
314	688285	高铁电气	5,722	36,792.46	0.01
315	001203	大中矿业	3,809	36,604.49	0.01
316	688596	正帆科技	1,106	36,498.00	0.01
317	688602	康鹏科技	4,734	36,309.78	0.01
318	688169	石头科技	92	36,119.20	0.01
319	600760	中航沈飞	900	36,090.00	0.01
320	603717	天域生态	5,900	35,754.00	0.01
321	688216	气派科技	2,000	35,680.00	0.01
322	000822	山东海化	6,100	35,563.00	0.01
323	605589	圣泉集团	1,750	35,507.50	0.01
324	688691	灿芯股份	714	35,484.47	0.01
325	688031	星环科技-U	966	35,461.86	0.01
326	301007	德迈仕	3,022	35,296.96	0.01
327	301049	超越科技	1,954	35,074.30	0.01
328	301371	敷尔佳	1,127	35,004.62	0.01
329	688420	美腾科技	1,685	34,845.80	0.01
330	002993	奥海科技	936	34,819.20	0.01
331	688496	清越科技	3,768	34,816.32	0.01
332	002179	中航光电	910	34,625.50	0.01
333	301032	新柴股份	5,124	34,382.04	0.01
334	605020	永和股份	1,790	34,332.20	0.01
335	603135	中重科技	2,718	34,056.54	0.01
336	600690	海尔智家	1,200	34,056.00	0.01
337	603901	永创智能	4,800	34,032.00	0.01
338	688092	爱科科技	1,592	33,989.20	0.01
339	688300	联瑞新材	697	33,525.70	0.01
340	002028	思源电气	500	33,450.00	0.01
341	603918	金桥信息	3,200	33,440.00	0.01
342	688257	新锐股份	2,181	33,434.73	0.01
343	601958	金钼股份	3,200	33,312.00	0.01
344	601801	皖新传媒	4,800	33,264.00	0.01
345	603312	西典新能	1,296	33,263.00	0.01
346	603019	中科曙光	800	33,200.00	0.01
347	600475	华光环能	3,800	33,098.00	0.01
348	688508	芯朋微	909	33,060.33	0.01
349	601665	齐鲁银行	6,731	33,049.21	0.01
350	688630	芯碁微装	528	33,036.96	0.01
351	603004	鼎龙科技	1,948	33,018.60	0.01

352	002493	荣盛石化	3,400	32,844.00	0.01
353	603556	海兴电力	700	32,781.00	0.01
354	300059	东方财富	3,100	32,736.00	0.01
355	688072	拓荆科技	272	32,669.92	0.01
356	600699	均胜电子	2,200	32,604.00	0.01
357	688625	呈和科技	895	32,542.20	0.01
358	600480	凌云股份	3,300	32,439.00	0.01
359	688511	天微电子	1,490	32,437.30	0.01
360	600141	兴发集团	1,700	32,436.00	0.01
361	600916	中国黄金	3,371	32,429.02	0.01
362	301526	国际复材	9,723	32,377.59	0.01
363	603730	岱美股份	3,250	32,305.00	0.01
364	301500	飞南资源	1,850	32,282.50	0.01
365	603082	北自科技	1,070	32,276.55	0.01
366	301559	中集环科	2,215	32,272.55	0.01
367	688716	中研股份	1,520	32,224.00	0.01
368	603300	华铁应急	5,900	32,214.00	0.01
369	600546	山煤国际	2,200	32,164.00	0.01
370	603380	易德龙	1,600	32,128.00	0.01
371	301322	绿通科技	1,697	31,852.69	0.01
372	603233	大参林	2,224	31,803.20	0.01
373	601928	凤凰传媒	2,900	31,784.00	0.01
374	688238	和元生物	6,804	31,502.52	0.01
375	688270	臻镭科技	1,203	31,398.30	0.01
376	601377	兴业证券	6,200	31,372.00	0.01
377	603565	中谷物流	3,559	31,105.66	0.01
378	688579	山大地纬	3,948	30,991.80	0.01
379	600673	东阳光	4,400	30,976.00	0.01
380	301053	远信工业	1,544	30,818.24	0.01
381	603208	江山欧派	1,610	30,815.40	0.01
382	605333	沪光股份	1,100	30,635.00	0.01
383	301301	川宁生物	2,395	30,608.10	0.01
384	688249	晶合集成	2,065	30,293.55	0.01
385	603297	永新光学	500	30,245.00	0.01
386	601555	东吴证券	5,100	30,090.00	0.01
387	688338	赛科希德	1,386	30,006.90	0.01
388	600011	华能国际	3,100	29,822.00	0.01
389	600602	云赛智联	2,700	29,808.00	0.01
390	601668	中国建筑	5,500	29,205.00	0.01
391	001379	腾达科技	2,128	29,183.34	0.01
392	688581	安杰思	592	28,966.56	0.01
393	300774	倍杰特	4,435	28,960.55	0.01
394	603151	邦基科技	2,500	28,850.00	0.01

395	003000	劲仔食品	2,384	28,727.20	0.01
396	603009	北特科技	1,600	28,688.00	0.01
397	688314	康拓医疗	1,519	28,587.58	0.01
398	603416	信捷电气	1,000	28,580.00	0.01
399	603278	大业股份	4,600	28,566.00	0.01
400	688582	芯动联科	1,012	28,497.92	0.01
401	605499	东鹏饮料	132	28,479.00	0.01
402	603161	科华控股	1,900	28,443.00	0.01
403	688472	阿特斯	2,787	28,371.66	0.01
404	603375	盛景微	714	28,339.56	0.01
405	601021	春秋航空	500	28,165.00	0.01
406	688305	科德数控	434	27,975.64	0.01
407	603040	新坐标	1,400	27,902.00	0.01
408	601187	厦门银行	5,129	27,337.57	0.01
409	688479	友车科技	1,714	27,235.46	0.01
410	688550	瑞联新材	1,174	27,225.06	0.01
411	600258	首旅酒店	2,200	27,170.00	0.01
412	603281	江瀚新材	1,208	27,119.60	0.01
413	605377	华旺科技	2,030	26,897.50	0.01
414	688639	华恒生物	352	26,889.28	0.01
415	001387	雪祺电气	1,729	26,756.25	0.01
416	603119	浙江荣泰	1,508	26,721.76	0.01
417	688114	华大智造	562	26,644.42	0.01
418	603650	彤程新材	900	26,595.00	0.01
419	688358	祥生医疗	1,019	26,463.43	0.01
420	301515	港通医疗	1,382	26,451.48	0.01
421	601568	北元集团	7,095	26,322.45	0.01
422	001239	永达股份	1,887	26,191.56	0.01
423	002790	瑞尔特	2,900	26,187.00	0.01
424	688502	茂莱光学	281	26,135.81	0.01
425	001378	德冠新材	1,090	26,007.40	0.01
426	688201	信安世纪	2,196	25,934.76	0.01
427	603739	蔚蓝生物	2,000	25,840.00	0.01
428	601083	锦江航运	2,673	25,553.88	0.01
429	688585	上纬新材	4,922	25,446.74	0.01
430	601133	柏诚股份	2,358	25,207.02	0.01
431	001328	登康口腔	986	24,945.80	0.01
432	001358	兴欣新材	1,214	24,911.28	0.01
433	600536	中国软件	829	24,803.68	0.01
434	688439	振华风光	368	24,453.60	0.01
435	001282	三联锻造	882	24,440.22	0.01
436	301578	辰奕智能	617	24,414.69	0.01
437	603508	思维列控	1,300	24,375.00	0.01

438	603193	润本股份	1,325	24,366.75	0.01
439	601089	福元医药	1,749	24,223.65	0.01
440	003009	中天火箭	623	24,097.64	0.01
441	601921	浙版传媒	3,154	24,096.56	0.01
442	603035	常熟汽饰	1,900	24,092.00	0.01
443	603373	安邦护卫	876	24,081.24	0.01
444	301286	侨源股份	839	24,003.79	0.01
445	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.01
446	601595	上海电影	1,200	23,736.00	0.01
447	600585	海螺水泥	1,000	23,590.00	0.01
448	603259	药明康德	600	23,514.00	0.01
449	600176	中国巨石	2,100	23,205.00	0.01
450	603087	甘李药业	500	23,160.00	0.01
451	601065	江盐集团	2,668	23,131.56	0.01
452	688032	禾迈股份	201	23,070.78	0.01
453	605368	蓝天燃气	1,685	22,983.40	0.01
454	001213	中铁特货	5,818	22,981.10	0.01
455	600754	锦江酒店	1,000	22,980.00	0.01
456	603507	振江股份	700	22,974.00	0.01
457	600955	维远股份	1,594	22,969.54	0.01
458	688036	传音控股	300	22,962.00	0.01
459	688053	思科瑞	920	22,650.40	0.01
460	000032	深桑达 A	1,500	22,470.00	0.01
461	301487	盟固利	867	22,420.62	0.01
462	001339	智微智能	812	22,419.32	0.01
463	603533	掌阅科技	1,200	22,404.00	0.01
464	688631	莱斯信息	358	22,203.16	0.01
465	600032	浙江新能	3,045	22,167.60	0.01
466	601865	福莱特	1,100	22,110.00	0.01
467	001258	立新能源	3,188	22,092.84	0.01
468	601138	工业富联	800	21,920.00	0.01
469	002536	飞龙股份	2,300	21,896.00	0.01
470	603125	常青科技	1,264	21,753.44	0.01
471	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.01
472	300750	宁德时代	120	21,603.60	0.01
473	688361	中科飞测	456	21,568.80	0.01
474	301499	维科精密	930	21,138.90	0.01
475	301179	泽宇智能	1,084	21,094.64	0.01
476	001326	联域股份	584	20,942.24	0.01
477	603103	横店影视	1,500	20,760.00	0.01
478	600927	永安期货	1,859	20,727.85	0.01
479	603806	福斯特	1,400	20,580.00	0.01
480	603107	上海汽配	1,285	20,418.65	0.00

481	601155	新城控股	2,300	20,401.00	0.00
482	603071	物产环能	1,627	20,386.31	0.00
483	688049	炬芯科技	914	20,217.68	0.00
484	003019	宸展光电	798	20,213.34	0.00
485	605507	国邦医药	1,202	20,013.30	0.00
486	688601	力芯微	457	19,966.33	0.00
487	600984	建设机械	8,300	19,754.00	0.00
488	603137	恒尚节能	1,935	19,737.00	0.00
489	603172	万丰股份	1,220	19,715.20	0.00
490	688279	峰昭科技	177	19,629.30	0.00
491	603324	盛剑环境	732	19,551.72	0.00
492	001308	康冠科技	867	19,507.50	0.00
493	605167	利柏特	2,471	19,298.51	0.00
494	688110	东芯股份	1,011	19,279.77	0.00
495	301313	凡拓数创	947	19,271.45	0.00
496	600489	中金黄金	1,300	19,240.00	0.00
497	688518	联赢激光	1,148	19,171.60	0.00
498	688351	微电生理-U	869	19,152.76	0.00
499	688232	新点软件	968	19,088.96	0.00
500	603270	金帝股份	959	19,026.56	0.00
501	002819	东方中科	900	18,972.00	0.00
502	603197	保隆科技	600	18,900.00	0.00
503	603486	科沃斯	400	18,872.00	0.00
504	301120	新特电气	1,816	18,868.24	0.00
505	601888	中国中免	300	18,747.00	0.00
506	001227	兰州银行	7,868	18,725.84	0.00
507	603132	金徽股份	1,342	18,465.92	0.00
508	001337	四川黄金	795	18,451.95	0.00
509	301050	雷电微力	383	18,445.28	0.00
510	605305	中际联合	711	18,336.69	0.00
511	001324	长青科技	1,131	18,322.20	0.00
512	600132	重庆啤酒	300	18,210.00	0.00
513	688629	华丰科技	682	17,977.52	0.00
514	002334	英威腾	3,000	17,940.00	0.00
515	603276	恒兴新材	1,286	17,926.84	0.00
516	688409	富创精密	484	17,878.96	0.00
517	600456	宝钛股份	700	17,871.00	0.00
518	301187	欧圣电气	732	17,751.00	0.00
519	001306	夏厦精密	328	17,708.72	0.00
520	603799	华友钴业	800	17,704.00	0.00
521	300331	苏大维格	1,100	17,688.00	0.00
522	603211	晋拓股份	1,287	17,644.77	0.00
523	300623	捷捷微电	1,000	17,300.00	0.00

524	605098	行动教育	405	17,261.10	0.00
525	603171	税友股份	637	17,224.48	0.00
526	603931	格林达	844	17,158.52	0.00
527	301132	满坤科技	449	17,147.31	0.00
528	605077	华康股份	1,124	17,141.00	0.00
529	603075	热威股份	970	17,120.50	0.00
530	688323	瑞华泰	1,694	17,058.58	0.00
531	603191	望变电气	1,149	17,005.20	0.00
532	603305	旭升集团	1,600	16,896.00	0.00
533	600446	金证股份	1,700	16,881.00	0.00
534	605366	宏柏新材	2,890	16,790.90	0.00
535	301285	鸿日达	643	16,775.87	0.00
536	001367	海森药业	715	16,688.10	0.00
537	688006	杭可科技	954	16,647.30	0.00
538	301127	天源环保	1,385	16,370.70	0.00
539	688551	科威尔	518	16,317.00	0.00
540	000426	兴业银锡	1,200	16,296.00	0.00
541	603032	德新科技	1,420	16,230.60	0.00
542	001338	永顺泰	1,649	16,160.20	0.00
543	601689	拓普集团	300	16,083.00	0.00
544	605116	奥锐特	642	16,069.26	0.00
545	601096	宏盛华源	3,918	16,024.62	0.00
546	301156	美农生物	1,310	16,008.20	0.00
547	688308	欧科亿	815	15,827.30	0.00
548	000957	中通客车	1,500	15,780.00	0.00
549	300723	一品红	800	15,720.00	0.00
550	688535	华海诚科	229	15,691.08	0.00
551	688387	信科移动-U	3,105	15,649.20	0.00
552	301175	中科环保	3,562	15,637.18	0.00
553	301238	瑞泰新材	1,043	15,613.71	0.00
554	003028	振邦智能	432	15,577.92	0.00
555	301536	星辰科技	481	15,521.87	0.00
556	301327	华宝新能	270	15,471.00	0.00
557	603383	顶点软件	480	15,393.60	0.00
558	603206	嘉环科技	1,210	15,282.30	0.00
559	603155	新亚强	1,394	15,278.24	0.00
560	605277	新亚电子	1,159	14,974.28	0.00
561	001376	百通能源	804	14,970.48	0.00
562	002840	华统股份	900	14,931.00	0.00
563	001201	东瑞股份	802	14,869.08	0.00
564	001288	运机集团	537	14,864.16	0.00
565	001216	华瓷股份	1,177	14,783.12	0.00
566	605399	晨光新材	1,369	14,716.75	0.00

567	688682	霍莱沃	501	14,699.34	0.00
568	688131	皓元医药	762	14,577.06	0.00
569	688720	艾森股份	359	14,553.86	0.00
570	605286	同力日升	597	14,525.01	0.00
571	688315	诺禾致源	1,320	14,414.40	0.00
572	601121	宝地矿业	2,532	14,407.08	0.00
573	605158	华达新材	2,226	14,313.18	0.00
574	688507	索辰科技	292	14,191.20	0.00
575	301141	中科磁业	439	14,157.75	0.00
576	605337	李子园	1,434	14,081.88	0.00
577	000516	国际医学	3,000	14,040.00	0.00
578	301311	昆船智能	761	13,987.18	0.00
579	688709	成都华微	742	13,942.18	0.00
580	300882	万胜智能	801	13,841.28	0.00
581	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00
582	601528	瑞丰银行	2,899	13,683.28	0.00
583	605008	长鸿高科	1,039	13,610.90	0.00
584	603220	中贝通信	500	13,580.00	0.00
585	003040	楚天龙	1,101	13,542.30	0.00
586	605218	伟时电子	837	13,517.55	0.00
587	605338	巴比食品	1,012	13,409.00	0.00
588	001208	华菱线缆	1,754	13,295.32	0.00
589	301239	普瑞眼科	374	13,213.42	0.00
590	002979	雷赛智能	725	13,195.00	0.00
591	603230	内蒙新华	1,140	13,155.60	0.00
592	301058	中粮科工	1,386	13,125.42	0.00
593	301029	怡合达	665	13,073.90	0.00
594	688591	泰凌微	660	12,903.00	0.00
595	003039	顺控发展	1,024	12,830.72	0.00
596	301259	艾布鲁	628	12,779.80	0.00
597	603173	福斯达	588	12,765.48	0.00
598	003029	吉大正元	716	12,737.64	0.00
599	605060	联德股份	883	12,688.71	0.00
600	301348	蓝箭电子	417	12,672.63	0.00
601	603097	江苏华辰	477	12,650.04	0.00
602	600963	岳阳林纸	3,400	12,478.00	0.00
603	605599	菜百股份	980	12,475.40	0.00
604	301101	明月镜片	556	12,421.04	0.00
605	300394	天孚通信	140	12,378.80	0.00
606	605196	华通线缆	1,172	12,329.44	0.00
607	601033	永兴股份	770	12,289.20	0.00
608	605339	南侨食品	864	12,286.08	0.00
609	301293	三博脑科	325	12,249.25	0.00

610	301489	思泉新材	173	12,210.34	0.00
611	688478	晶升股份	413	12,026.56	0.00
612	001319	铭科精技	736	11,996.80	0.00
613	688800	瑞可达	427	11,990.16	0.00
614	601686	友发集团	2,374	11,941.22	0.00
615	688536	思瑞浦	121	11,835.01	0.00
616	605099	共创草坪	624	11,799.84	0.00
617	301516	中远通	633	11,792.79	0.00
618	001318	阳光乳业	1,142	11,751.18	0.00
619	603209	兴通股份	833	11,528.72	0.00
620	603062	麦加芯彩	346	11,490.66	0.00
621	605183	确成股份	741	11,455.86	0.00
622	301095	广立微	278	11,431.36	0.00
623	601916	浙商银行	4,110	11,343.60	0.00
624	001217	华尔泰	1,239	11,336.85	0.00
625	603237	五芳斋	455	11,220.30	0.00
626	688066	航天宏图	629	11,196.20	0.00
627	688052	纳芯微	108	11,100.24	0.00
628	605268	王力安防	1,542	10,994.46	0.00
629	301510	固高科技	395	10,961.25	0.00
630	301318	维海德	398	10,933.06	0.00
631	603219	富佳股份	739	10,907.64	0.00
632	605089	味知香	511	10,904.74	0.00
633	301358	湖南裕能	343	10,790.78	0.00
634	605058	澳弘电子	548	10,784.64	0.00
635	600941	中国移动	100	10,750.00	0.00
636	605086	龙高股份	620	10,701.20	0.00
637	603162	海通发展	1,146	10,657.80	0.00
638	605050	福然德	1,197	10,545.57	0.00
639	003016	欣贺股份	1,681	10,523.06	0.00
640	688584	上海合晶	662	10,519.18	0.00
641	301112	信邦智能	484	10,497.96	0.00
642	605389	长龄液压	498	10,453.02	0.00
643	605228	神通科技	1,217	10,441.86	0.00
644	601678	滨化股份	3,000	10,440.00	0.00
645	688045	必易微	344	10,344.08	0.00
646	301222	浙江恒威	415	10,275.40	0.00
647	301565	中仑新材	541	10,268.18	0.00
648	003013	地铁设计	724	10,266.32	0.00
649	301328	维峰电子	278	10,260.98	0.00
650	003015	日久光电	1,128	10,242.24	0.00
651	605365	立达信	645	10,236.15	0.00
652	605378	野马电池	662	10,208.04	0.00

653	603341	龙旗科技	272	10,197.28	0.00
654	688359	三孚新科	254	10,160.00	0.00
655	300918	南山智尚	1,063	10,141.02	0.00
656	301135	瑞德智能	476	10,134.04	0.00
657	605169	洪通燃气	1,292	10,129.28	0.00
658	001229	魅视科技	347	10,121.99	0.00
659	605005	合兴股份	634	10,118.64	0.00
660	003002	壶化股份	921	10,103.37	0.00
661	605056	咸亨国际	933	10,057.74	0.00
662	605162	新中港	1,377	9,955.71	0.00
663	605118	力鼎光电	667	9,931.63	0.00
664	001207	联科科技	682	9,902.64	0.00
665	603836	海程邦达	733	9,873.51	0.00
666	301217	铜冠铜箔	1,023	9,820.80	0.00
667	603759	海天股份	1,656	9,820.08	0.00
668	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
669	002606	大连电瓷	1,300	9,763.00	0.00
670	300347	泰格医药	200	9,720.00	0.00
671	605500	森林包装	1,579	9,710.85	0.00
672	002400	省广集团	2,000	9,700.00	0.00
673	605177	东亚药业	439	9,688.73	0.00
674	003001	中岩大地	560	9,648.80	0.00
675	301199	迈赫股份	398	9,623.64	0.00
676	301508	中机认检	254	9,387.84	0.00
677	300853	申昊科技	641	9,320.14	0.00
678	001313	粤海饲料	1,232	9,264.64	0.00
679	300866	安克创新	130	9,257.30	0.00
680	002999	天禾股份	1,726	9,234.10	0.00
681	688737	中自科技	569	9,217.80	0.00
682	605577	龙版传媒	588	9,131.64	0.00
683	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
684	300904	威力传动	223	8,913.31	0.00
685	605066	天正电气	1,597	8,895.29	0.00
686	688667	菱电电控	218	8,894.40	0.00
687	605028	世茂能源	615	8,874.45	0.00
688	301413	安培龙	213	8,807.55	0.00
689	603231	索宝蛋白	515	8,775.60	0.00
690	300910	瑞丰新材	200	8,744.00	0.00
691	605318	法狮龙	628	8,722.92	0.00
692	605179	一鸣食品	939	8,573.07	0.00
693	002472	双环传动	389	8,565.78	0.00
694	605006	山东玻纤	1,942	8,564.22	0.00
695	688573	信宇人	397	8,487.86	0.00

696	603057	紫燕食品	549	8,410.68	0.00
697	003010	若羽臣	787	8,326.46	0.00
698	605080	浙江自然	524	8,289.68	0.00
699	688023	安恒信息	207	8,282.07	0.00
700	003018	金富科技	1,027	8,267.35	0.00
701	301268	铭利达	530	8,241.50	0.00
702	001206	依依股份	629	8,189.58	0.00
703	003004	声迅股份	306	8,170.20	0.00
704	605580	恒盛能源	916	8,161.56	0.00
705	301298	东利机械	640	8,160.00	0.00
706	688680	海优新材	282	8,104.68	0.00
707	003037	三和管桩	1,274	8,102.64	0.00
708	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
709	605259	绿田机械	413	8,057.63	0.00
710	301200	大族数控	255	8,047.80	0.00
711	001296	长江材料	564	8,037.00	0.00
712	301359	东南电子	328	8,003.20	0.00
713	301151	冠龙节能	542	7,978.24	0.00
714	605100	华丰股份	685	7,966.55	0.00
715	301459	丰茂股份	199	7,902.29	0.00
716	301381	赛维时代	347	7,887.31	0.00
717	688707	振华新材	809	7,879.66	0.00
718	688253	英诺特	206	7,850.66	0.00
719	301282	金禄电子	330	7,847.40	0.00
720	605488	福莱新材	603	7,839.00	0.00
721	301367	怡和嘉业	125	7,775.00	0.00
722	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
723	603282	亚光股份	457	7,705.02	0.00
724	605180	华生科技	649	7,690.65	0.00
725	688435	英方软件	308	7,687.68	0.00
726	002998	优彩资源	1,353	7,671.51	0.00
727	605018	长华集团	840	7,610.40	0.00
728	301193	家联科技	475	7,581.00	0.00
729	301421	波长光电	175	7,565.25	0.00
730	605007	五洲特纸	598	7,552.74	0.00
731	001266	宏英智能	346	7,515.12	0.00
732	301207	华兰疫苗	424	7,492.08	0.00
733	001278	一彬科技	473	7,478.13	0.00
734	601279	英利汽车	2,004	7,474.92	0.00
735	001331	胜通能源	539	7,465.15	0.00
736	001222	源飞宠物	607	7,435.75	0.00
737	001238	浙江正特	374	7,412.68	0.00
738	301152	天力锂能	307	7,395.63	0.00

739	688152	麒麟信安	191	7,395.52	0.00
740	688378	奥来德	315	7,389.90	0.00
741	301498	乖宝宠物	137	7,370.60	0.00
742	301269	华大九天	95	7,319.75	0.00
743	688320	禾川科技	297	7,288.38	0.00
744	002918	蒙娜丽莎	800	7,248.00	0.00
745	301171	易点天下	493	7,247.10	0.00
746	301517	陕西华达	134	7,236.00	0.00
747	603280	南方路机	363	7,201.92	0.00
748	603176	汇通集团	1,924	7,176.52	0.00
749	001366	播恩集团	645	7,159.50	0.00
750	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
751	000949	新乡化纤	2,100	7,140.00	0.00
752	301302	华如科技	412	7,107.00	0.00
753	688172	燕东微	438	7,086.84	0.00
754	605199	葫芦娃	726	7,078.50	0.00
755	688375	国博电子	100	7,064.00	0.00
756	300045	华力创通	400	7,060.00	0.00
757	301206	三元生物	287	7,054.46	0.00
758	001317	三羊马	300	7,047.00	0.00
759	001219	青岛食品	598	7,038.46	0.00
760	301488	豪恩汽电	146	7,022.60	0.00
761	688248	南网科技	237	7,022.31	0.00
762	300996	普联软件	477	6,997.59	0.00
763	003030	祖名股份	480	6,897.60	0.00
764	001368	通达创智	351	6,862.05	0.00
765	300073	当升科技	200	6,862.00	0.00
766	301138	华研精机	285	6,808.65	0.00
767	001299	美能能源	576	6,796.80	0.00
768	301272	英华特	175	6,751.50	0.00
769	300229	拓尔思	500	6,715.00	0.00
770	301233	盛帮股份	176	6,691.52	0.00
771	605566	福莱蒾特	435	6,625.05	0.00
772	600406	国电南瑞	264	6,589.44	0.00
773	603291	联合水务	536	6,571.36	0.00
774	301428	世纪恒通	226	6,486.20	0.00
775	002996	顺博合金	1,104	6,458.40	0.00
776	000921	海信家电	200	6,448.00	0.00
777	688702	盛科通信-U	158	6,399.00	0.00
778	301297	富乐德	315	6,397.65	0.00
779	003042	中农联合	546	6,393.66	0.00
780	605255	天普股份	530	6,370.60	0.00
781	605300	佳禾食品	576	6,301.44	0.00

782	605155	西大门	686	6,276.90	0.00
783	688458	美芯晟	234	6,271.20	0.00
784	603150	万朗磁塑	250	6,260.00	0.00
785	001230	劲旅环境	450	6,250.50	0.00
786	300782	卓胜微	80	6,219.20	0.00
787	003036	泰坦股份	776	6,200.24	0.00
788	688290	景业智能	193	6,195.30	0.00
789	605287	德才股份	488	6,143.92	0.00
790	003041	真爱美家	503	6,141.63	0.00
791	003023	彩虹集团	385	6,140.75	0.00
792	603296	华勤技术	111	6,130.53	0.00
793	301391	卡莱特	140	6,129.20	0.00
794	002843	泰嘉股份	400	6,124.00	0.00
795	603213	镇洋发展	799	5,976.52	0.00
796	688095	福昕软件	130	5,955.30	0.00
797	001210	金房能源	448	5,944.96	0.00
798	301116	益客食品	664	5,929.52	0.00
799	688523	航天环宇	343	5,916.75	0.00
800	301190	善水科技	420	5,892.60	0.00
801	688693	锆威特	163	5,854.96	0.00
802	301382	蜂助手	322	5,824.98	0.00
803	688652	京仪装备	148	5,785.32	0.00
804	603182	嘉华股份	546	5,743.92	0.00
805	301550	斯菱股份	119	5,701.29	0.00
806	001234	泰慕士	333	5,657.67	0.00
807	301558	三态股份	674	5,654.86	0.00
808	002992	宝明科技	99	5,647.95	0.00
809	301163	宏德股份	277	5,628.64	0.00
810	688233	神工股份	286	5,511.22	0.00
811	605298	必得科技	660	5,478.00	0.00
812	601952	苏垦农发	600	5,412.00	0.00
813	301161	唯万密封	346	5,373.38	0.00
814	688539	高华科技	197	5,301.27	0.00
815	301111	粤万年青	379	5,287.05	0.00
816	301316	慧博云通	359	5,270.12	0.00
817	301507	民生健康	417	5,262.54	0.00
818	002049	紫光国微	100	5,260.00	0.00
819	605033	美邦股份	423	5,253.66	0.00
820	300781	因赛集团	100	5,218.00	0.00
821	301533	威马农机	199	5,112.31	0.00
822	301153	中科江南	180	5,086.80	0.00
823	301270	汉仪股份	210	5,067.30	0.00
824	301129	瑞纳智能	200	5,048.00	0.00

825	301319	唯特偶	167	5,015.01	0.00
826	688677	海泰新光	127	4,982.21	0.00
827	301296	新巨丰	673	4,852.33	0.00
828	605567	春雪食品	629	4,818.14	0.00
829	605136	丽人丽妆	867	4,777.17	0.00
830	300056	中创环保	600	4,770.00	0.00
831	301158	德石股份	383	4,737.71	0.00
832	301166	优宁维	174	4,698.00	0.00
833	605055	迎丰股份	1,146	4,664.22	0.00
834	301115	建科股份	330	4,580.40	0.00
835	688035	德邦科技	142	4,575.24	0.00
836	688127	蓝特光学	248	4,560.72	0.00
837	688223	晶科能源	635	4,508.50	0.00
838	300339	润和软件	216	4,464.72	0.00
839	688697	纽威数控	284	4,455.96	0.00
840	605289	罗曼股份	174	4,419.60	0.00
841	688400	凌云光	263	4,386.84	0.00
842	300812	易天股份	200	4,362.00	0.00
843	688147	微导纳米	175	4,357.50	0.00
844	603065	宿迁联盛	581	4,340.07	0.00
845	688620	安凯微	533	4,338.62	0.00
846	301418	协昌科技	107	4,280.00	0.00
847	688097	博众精工	190	4,043.20	0.00
848	688119	中钢洛耐	1,228	4,040.12	0.00
849	002871	伟隆股份	500	4,000.00	0.00
850	300693	盛弘股份	190	3,978.60	0.00
851	002169	智光电气	900	3,969.00	0.00
852	603052	可川科技	140	3,941.00	0.00
853	603379	三美股份	100	3,914.00	0.00
854	301267	华夏眼科	188	3,895.36	0.00
855	600276	恒瑞医药	100	3,846.00	0.00
856	688699	明微电子	121	3,841.75	0.00
857	688456	有研粉材	141	3,760.47	0.00
858	002223	鱼跃医疗	100	3,760.00	0.00
859	688663	新风光	161	3,746.47	0.00
860	002601	龙佰集团	200	3,714.00	0.00
861	301383	天键股份	140	3,656.80	0.00
862	002387	维信诺	600	3,648.00	0.00
863	300803	指南针	100	3,641.00	0.00
864	605138	盛泰集团	723	3,622.23	0.00
865	301170	锡南科技	138	3,594.90	0.00
866	688292	浩瀚深度	231	3,571.26	0.00
867	300855	图南股份	130	3,437.20	0.00

868	688600	皖仪科技	256	3,422.72	0.00
869	000833	粤桂股份	720	3,369.60	0.00
870	688689	银河微电	156	3,311.88	0.00
871	300570	太辰光	100	3,266.00	0.00
872	688665	四方光电	116	3,217.84	0.00
873	300958	建工修复	300	3,189.00	0.00
874	600522	中天科技	200	3,170.00	0.00
875	688313	仕佳光子	322	3,065.44	0.00
876	002414	高德红外	520	3,062.80	0.00
877	000915	华特达因	100	3,016.00	0.00
878	301100	风光股份	227	2,948.73	0.00
879	000733	振华科技	71	2,948.63	0.00
880	000920	沃顿科技	400	2,932.00	0.00
881	300342	天银机电	200	2,926.00	0.00
882	300858	科拓生物	198	2,914.56	0.00
883	688161	威高骨科	147	2,913.54	0.00
884	002929	润建股份	100	2,911.00	0.00
885	300926	博俊科技	145	2,902.90	0.00
886	301349	信德新材	104	2,874.56	0.00
887	688237	超卓航科	143	2,867.15	0.00
888	002460	赣锋锂业	100	2,865.00	0.00
889	600223	福瑞达	400	2,828.00	0.00
890	688661	和林微纳	91	2,789.15	0.00
891	603273	天元智能	143	2,624.05	0.00
892	301219	腾远钴业	68	2,601.68	0.00
893	300814	中富电路	80	2,583.20	0.00
894	300850	新强联	170	2,553.40	0.00
895	000831	中国稀土	100	2,535.00	0.00
896	601012	隆基绿能	180	2,523.60	0.00
897	300890	翔丰华	100	2,495.00	0.00
898	002444	巨星科技	100	2,470.00	0.00
899	301525	儒竞科技	43	2,420.04	0.00
900	002876	三利谱	100	2,412.00	0.00
901	688425	铁建重工	647	2,380.96	0.00
902	688609	九联科技	268	2,363.76	0.00
903	002967	广电计量	200	2,360.00	0.00
904	688683	莱尔科技	146	2,337.46	0.00
905	688148	芳源股份	543	2,286.03	0.00
906	688255	凯尔达	112	2,245.60	0.00
907	688268	华特气体	43	2,219.23	0.00
908	600866	星湖科技	400	2,208.00	0.00
909	002142	宁波银行	100	2,206.00	0.00
910	000550	江铃汽车	100	2,171.00	0.00

911	688345	博力威	123	2,077.47	0.00
912	003038	鑫铂股份	140	2,067.80	0.00
913	688231	隆达股份	145	2,067.70	0.00
914	002459	晶澳科技	184	2,060.80	0.00
915	688722	同益中	176	1,969.44	0.00
916	301307	美利信	100	1,958.00	0.00
917	300548	博创科技	100	1,949.00	0.00
918	300252	金信诺	300	1,875.00	0.00
919	688353	华盛锂电	106	1,840.16	0.00
920	301046	能辉科技	91	1,789.97	0.00
921	301277	新天地	137	1,778.26	0.00
922	600570	恒生电子	100	1,766.00	0.00
923	603733	仙鹤股份	100	1,758.00	0.00
924	688717	艾罗能源	36	1,711.80	0.00
925	002568	百润股份	100	1,683.00	0.00
926	600316	洪都航空	100	1,663.00	0.00
927	301360	荣旗科技	38	1,643.50	0.00
928	001336	楚环科技	74	1,616.90	0.00
929	002041	登海种业	200	1,616.00	0.00
930	603666	亿嘉和	100	1,578.00	0.00
931	000913	钱江摩托	100	1,576.00	0.00
932	688141	杰华特	97	1,567.52	0.00
933	301021	英诺激光	99	1,552.32	0.00
934	000960	锡业股份	100	1,549.00	0.00
935	688208	道通科技	62	1,496.68	0.00
936	002708	光洋股份	200	1,442.00	0.00
937	600508	上海能源	100	1,415.00	0.00
938	603130	云中马	80	1,411.20	0.00
939	002037	保利联合	200	1,410.00	0.00
940	688768	容知日新	59	1,381.19	0.00
941	002351	漫步者	100	1,315.00	0.00
942	688628	优利德	40	1,310.80	0.00
943	301133	金钟股份	60	1,307.40	0.00
944	688776	国光电气	23	1,274.20	0.00
945	300994	久祺股份	114	1,252.86	0.00
946	301220	亚香股份	49	1,250.48	0.00
947	000948	南天信息	100	1,235.00	0.00
948	301039	中集车辆	140	1,204.00	0.00
949	600746	江苏索普	200	1,178.00	0.00
950	605189	富春染织	107	1,140.62	0.00
951	301069	凯盛新材	86	1,127.46	0.00
952	001269	欧晶科技	40	1,112.00	0.00
953	300932	三友联众	110	1,059.30	0.00

954	002101	广东鸿图	100	1,053.00	0.00
955	688516	奥特维	24	1,003.44	0.00
956	605555	德昌股份	52	967.72	0.00
957	688428	诺诚健华-U	119	965.09	0.00
958	300925	法本信息	95	958.55	0.00
959	002345	潮宏基	200	944.00	0.00
960	301012	扬电科技	38	940.88	0.00
961	300997	欢乐家	79	933.78	0.00
962	301325	曼恩斯特	22	933.24	0.00
963	688533	上声电子	36	931.32	0.00
964	603048	浙江黎明	64	929.28	0.00
965	001311	多利科技	38	918.84	0.00
966	002668	TCL 智家	100	906.00	0.00
967	601800	中国交建	100	894.00	0.00
968	300884	狄耐克	100	862.00	0.00
969	600867	通化东宝	100	837.00	0.00
970	002532	天山铝业	100	811.00	0.00
971	300879	大叶股份	60	802.80	0.00
972	002456	欧菲光	100	781.00	0.00
973	300748	金力永磁	60	777.60	0.00
974	300611	美力科技	100	762.00	0.00
975	301091	深城交	27	732.78	0.00
976	002539	云图控股	100	713.00	0.00
977	301337	亚华电子	25	689.50	0.00
978	605208	永茂泰	105	654.15	0.00
979	300864	南大环境	33	646.80	0.00
980	002908	德生科技	80	613.60	0.00
981	605358	立昂微	26	601.64	0.00
982	300253	卫宁健康	100	590.00	0.00
983	002448	中原内配	100	574.00	0.00
984	301180	万祥科技	36	563.04	0.00
985	300973	立高食品	20	561.80	0.00
986	301052	果麦文化	27	553.50	0.00
987	000875	吉电股份	100	533.00	0.00
988	300946	恒而达	20	532.80	0.00
989	000690	宝新能源	100	510.00	0.00
990	600409	三友化工	100	502.00	0.00
991	688107	安路科技	16	406.72	0.00
992	002385	大北农	100	385.00	0.00
993	000630	铜陵有色	100	361.00	0.00
994	001330	博纳影业	64	346.24	0.00
995	688569	铁科轨道	16	330.72	0.00
996	605133	嵘泰股份	18	329.94	0.00

997	301015	百洋医药	14	329.42	0.00
998	688093	世华科技	16	290.72	0.00
999	301078	孩子王	56	283.36	0.00
1,000	600684	珠江股份	100	263.00	0.00
1,001	600376	首开股份	100	210.00	0.00
1,002	301155	海力风电	5	201.15	0.00
1,003	300891	惠云钛业	25	194.50	0.00
1,004	300968	格林精密	20	185.20	0.00
1,005	301028	东亚机械	19	166.63	0.00
1,006	301020	密封科技	10	158.20	0.00
1,007	301126	达嘉维康	15	135.45	0.00
1,008	300940	南极光	9	114.66	0.00
1,009	003021	兆威机电	2	92.30	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	603129	春风动力	17,030,092.08	2.51
2	000338	潍柴动力	14,629,316.00	2.16
3	603920	世运电路	11,995,285.00	1.77
4	000528	柳工	11,660,370.20	1.72
5	688575	亚辉龙	10,620,764.99	1.57
6	601872	招商轮船	9,552,027.00	1.41
7	601666	平煤股份	8,546,272.74	1.26
8	300634	彩讯股份	8,433,539.00	1.24
9	603477	巨星农牧	8,266,683.57	1.22
10	600027	华电国际	8,191,037.36	1.21
11	002920	德赛西威	7,836,376.20	1.16
12	600150	中国船舶	7,744,609.62	1.14
13	000682	东方电子	7,661,862.57	1.13
14	000400	许继电气	7,232,861.00	1.07
15	300796	贝斯美	6,914,131.08	1.02
16	600031	三一重工	6,900,649.00	1.02
17	603596	伯特利	6,762,960.40	1.00
18	600975	新五丰	6,420,956.91	0.95
19	600547	山东黄金	6,210,036.27	0.92
20	688617	惠泰医疗	6,196,485.12	0.91

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 (%)
----	------	------	----------	-----------------

	码			
1	603596	伯特利	23,410,008.76	3.45
2	603129	春风动力	10,386,132.00	1.53
3	000426	兴业银锡	9,183,367.00	1.35
4	300634	彩讯股份	8,814,554.00	1.30
5	603477	巨星农牧	8,803,265.00	1.30
6	002648	卫星化学	8,774,328.00	1.29
7	688595	芯海科技	8,494,969.49	1.25
8	002371	北方华创	8,199,767.00	1.21
9	002920	德赛西威	7,932,587.00	1.17
10	603019	中科曙光	7,516,361.76	1.11
11	688418	震有科技	7,456,628.16	1.10
12	603920	世运电路	7,286,780.00	1.07
13	300796	贝斯美	7,134,450.00	1.05
14	600480	凌云股份	6,487,450.00	0.96
15	688008	澜起科技	6,468,969.32	0.95
16	600975	新五丰	6,257,003.00	0.92
17	603728	鸣志电器	6,227,431.07	0.92
18	301345	涛涛车业	6,147,574.12	0.91
19	002840	华统股份	6,076,687.00	0.90
20	301363	美好医疗	6,036,149.45	0.89

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	796,816,951.82
卖出股票收入（成交）总额	913,940,647.57

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）	16,021.81	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	16,021.81	0.00
----	----	-----------	------

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	113059	福莱转债	150	16,021.81	0.00

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

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	138,546.70
2	应收清算款	81,782.96
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	16,992.58
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	237,322.24

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	113059	福莱转债	16,021.81	0.00

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 (%)
15,290	24,720.06	206,633,126.08	54.67	171,336,639.70	45.33

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	621,994.92	0.1646

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 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（2017年9月6日） 基金份额总额	491,760,953.62
本报告期期初基金份额总额	577,492,196.04
本报告期基金总申购份额	4,107,265.41
减：本报告期基金总赎回份额	203,629,695.67
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	377,969,765.78

§ 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	518,192,755.42	30.32	477,421.49	31.04	-
招商证券	1	304,300,906.89	17.81	280,355.74	18.23	-
中金公司	1	248,007,877.51	14.51	222,252.02	14.45	-
国盛证券	1	192,748,018.67	11.28	161,138.59	10.48	-
平安证券	1	169,372,230.76	9.91	156,030.15	10.14	-

国泰君安	1	86,808,764.07	5.08	79,977.20	5.20	-
中泰证券	1	78,976,041.29	4.62	73,908.93	4.81	-
申万宏源证券	2	65,447,354.19	3.83	53,753.85	3.49	-
国元证券	1	22,217,578.36	1.30	18,573.19	1.21	-
兴业证券	1	20,854,748.51	1.22	12,975.75	0.84	-
华西证券	1	2,091,179.31	0.12	1,747.83	0.11	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-

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	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 (%)		(%)		的比例 (%)
国信证 券	-	-	472,984,000.00	52.12	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
中金公 司	176,287.78	100.00	87,341,000.00	9.62	-	-
国盛证 券	-	-	147,876,000.00	16.30	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-
国泰君 安	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	199,246,000.00	21.96	-	-
申万宏 源证券	-	-	-	-	-	-
国元证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
东吴证 券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
世纪证 券	-	-	-	-	-	-
西部证 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	《中国证券报》、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	《中国证券报》、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	鹏华策略回报灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	《中国证券报》、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	《中国证券报》、基金	2024 年 01 月 23 日

	金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	
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	《中国证券报》、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	《中国证券报》、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	《中国证券报》、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	《中国证券报》、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	鹏华策略回报灵活配置混合型证券投资基金 2023 年年度报告	《中国证券报》、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	《中国证券报》、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	鹏华基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《中国证券报》、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
12	鹏华基金管理有限公司关于董事长变更的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 04 月 13 日
13	鹏华策略回报灵活配置混合型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	《中国证券报》、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
14	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《中国证券报》、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
15	鹏华基金管理有限公司关于调整个人投资者开立基金账户证件类型的公告	《中国证券报》、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
16	鹏华基金管理有限公司关于调整旗下部分基金单笔最低赎回份额和账户最低份额余额限制的公告	《中国证券报》、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
17	鹏华策略回报灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	《中国证券报》、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

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	20240101~20240306	135,592,542.37	0.00	110,000,000.00	25,592,542.37	6.77
	2	20240101~20240207, 20240219~20240630	136,217,535.03	0.00	30,000,000.00	106,217,535.03	28.10
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)《鹏华策略回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- (二)《鹏华策略回报灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- (三)《鹏华策略回报灵活配置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