

鹏华改革红利股票型证券投资基金 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	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	9
§ 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	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	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
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	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
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	12
§ 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	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52
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	52
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	52

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	52
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	52
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
7.12 投资组合报告附注	53
§ 8 基金份额持有人信息	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	54
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	54
§ 9 开放式基金份额变动	54
§ 10 重大事件揭示	55
10.1 基金份额持有人大会决议	55
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	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	55
10.4 基金投资策略的改变	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	55
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	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	56
10.8 其他重大事件	58
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	59
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	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	59
§ 12 备查文件目录	59
12.1 备查文件目录	59
12.2 存放地点	60
12.3 查阅方式	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华改革红利股票型证券投资基金
基金简称	鹏华改革红利股票
基金主代码	001188
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 4 月 28 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	206,927,516.56 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票型基金，在有效控制风险前提下，精选受益于改革红利的优质上市公司，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上市公司，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）改革红利的定义</p> <p>“改革红利”是指国家通过体制变革和机制创新为社会发展进步带来的全部有益成果的总和。全面深化改革政策的推出，加快经济转型，也必将对资本市场产生深远影响。在这一背景下，上市公司有望能长期受益、提升盈利能力的改革领域包括：国企改革（比如：引入多元股权结构的混合所有制改革、管理层股权激励、兼并重组、集团平台的资产注入整合等）、企业经营边界的拓展（比如：自贸区、“一带一路”等）、要素价格体系的市场化（比如：土地、水、电力等价格机制的调整）、增加有效需求（比如：户籍人口制度改革、社会保障机制的完善、文教卫体等领域的体制、生态文明等）、金融市场改革（比如：多层次资本市场的推进、金融机构监管政策转变）等。除上述领域之外，如</p>

果某些细分领域和公司同样符合改革红利的定义，本基金也会酌情将其纳入改革红利的投资范围。

未来如果基金管理人认为有更适当的改革红利的划分标准，基金管理人有权对上述界定方法进行变更。本基金由于上述原因变更界定方法不需经基金份额持有人大会通过，但应及时告知基金托管人并公告。

若因基金管理人界定方法的调整等原因导致本基金持有的受益于改革红利的股票的比例低于非现金基金资产的 80%，本基金将在三十个交易日之内进行调整。

(2) 自上而下的行业遴选

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。

(3) 自下而上的个股选择

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。

1) 定性分析

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上市公司：

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上市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。

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。

2) 定量分析

本基金通过对上市公司定量的估值分析，挖掘优质的投资标的。通过对估值方法的选择和估值倍数的比较，选择股价相对低估的股票。就估值方法而言，基于行业的特点确定对股价最有影响力的关键估值方法（包括 PE、PEG、PB、PS、EV/EBITDA 等）；就估值倍数而言，通过业内比较、历史比较和增长性分析，确定具有上升基础的股价水平。

(4) 存托凭证投资策略

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。

3、债券投资策略

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

	<p>券，以增强组合的持有期收益。</p> <p>4、权证投资策略 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 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 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、资产支持证券投资策略 本基金综合考虑市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量等因素，主要从资产池信用状况、违约相关性、历史违约记录和损失比例、证券的信用增强方式、利差补偿程度等方面对资产支持证券的风险与收益状况进行评估，在严格控制风险的情况下，确定资产合理配置比例，在保证资产安全性的前提条件下，以期获得长期稳定收益。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金，属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种。

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	1,832,792.89
本期利润	-24,096,935.90
加权平均基金份额本期利润	-0.1127
本期加权平均净值利润率	-11.00%
本期基金份额净值增长率	-9.75%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)
期末可供分配利润	5,821,527.62
期末可供分配基金份额利润	0.0281
期末基金资产净值	212,749,044.18
期末基金份额净值	1.028
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	2.80%

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

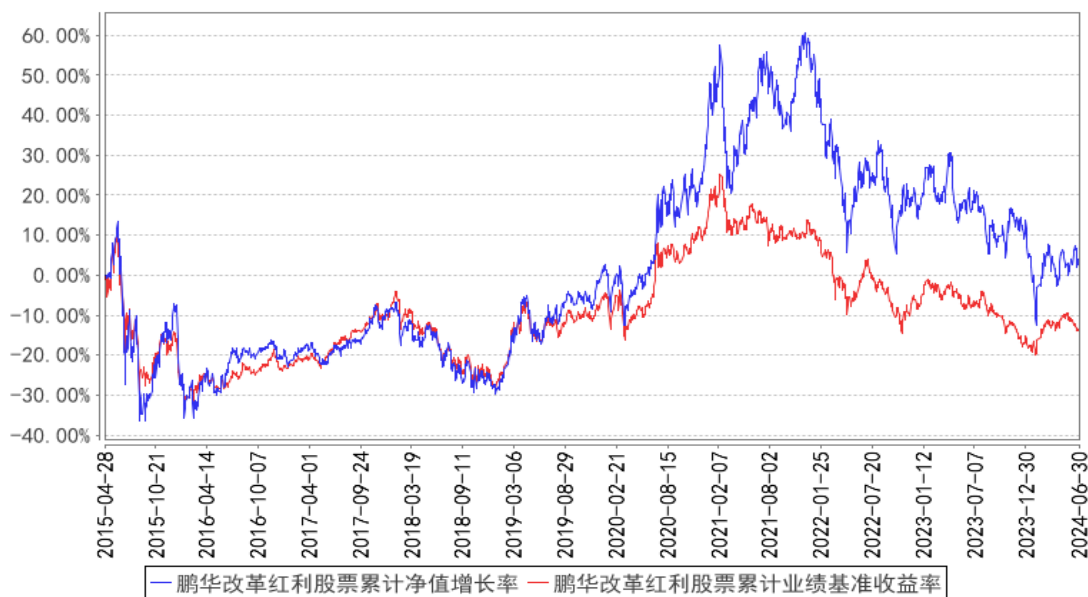
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.39%	1.17%	-2.48%	0.38%	2.87%	0.79%
过去三个月	-0.87%	1.22%	-1.35%	0.60%	0.48%	0.62%
过去六个月	-9.75%	1.53%	1.56%	0.72%	-11.31%	0.81%
过去一年	-13.18%	1.38%	-6.79%	0.70%	-6.39%	0.68%
过去三年	-33.29%	1.45%	-25.42%	0.83%	-7.87%	0.62%
自基金合同生效起至今	2.80%	1.58%	-13.77%	1.09%	16.57%	0.49%

注：业绩比较基准=沪深 300 指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

鹏华改革红利股票累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2015 年 04 月 28 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		
王璐	基金经理	2021-08-13	-	9 年	王璐女士，国籍中国，理学硕士，9 年证券从业经验。曾任广发证券股份有限公司电子行业资深分析师。2020 年 05 月加盟鹏华基金管理有限公司，历任权益投资二部基金经理助理，从事研究分析工作，现担任权益投资二部基金经理。2021 年 08 月至今担任鹏华改革红利股票型证券投资基金基金经理，2022 年 09 月至今担任鹏华优质回报两年定期开放混合型证券投资基金基金经理，2023 年 05 月至今担任鹏华芯片产业混合型发起式证券投资基金基金经理，王璐女士具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理未发生变动。

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规、中国证监会的有关规定

以及基金合同的约定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合规，不存在违反基金合同和损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

开年以来，市场经历 1 月下跌后，逐渐企稳，个股表现严重分化，外部环境的不确定性和中美关系的变化对市场带来巨大波动。但我们认为随着美联储降息周期的开启，制造业库存周期有望见底，企业盈利企稳；国内新质生产力方面政策推进，产业加速升级，我们对市场保持乐观，持续寻找成长带来的投资机会。第一，AI 带来的产业变革正在发生，以英伟达为代表的硬件产业链高速成长，驱动全球科技产业周期触底反转，我们看好国内参与到 AI 浪潮中的企业业绩快速增长。第二，半导体板块的景气度有全球经济周期同步，我们观察到在弱复苏的背景下，行业已经在营收端呈现复苏，毛利率端底部逐步确认，周期反转确定性加强。第三，医药反腐影响逐渐消除，我们看好政策友好的创新药方向，越来越多优秀的国内企业开始出海授权。

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-9.75%，同期业绩比较基准增长率为 1.56%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们继续对代表新质生产力的半导体各环节龙头和优质创新药企业保持看好。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1、截止本报告期末，本基金期末可供分配利润为 5,821,527.62 元，期末基金份额净值 1.028 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：鹏华改革红利股票型证券投资基金

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	33,129,742.39	40,078,504.57
结算备付金		29,347.20	329,921.64
存出保证金		6,704.87	25,017.27
交易性金融资产	6.4.7.2	180,826,563.61	204,980,976.74
其中：股票投资		180,826,563.61	204,980,976.74
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	3,204,579.18
应收股利		-	-
应收申购款		1,774.70	4,252.24
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		213,994,132.77	248,623,251.64
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		649,216.93	-
应付赎回款		235,609.10	62,126.40
应付管理人报酬		213,470.90	250,301.09
应付托管费		35,578.48	41,716.84
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	111,213.18	208,664.75
负债合计		1,245,088.59	562,809.08
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	206,927,516.56	217,849,138.94
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	5,821,527.62	30,211,303.62
净资产合计		212,749,044.18	248,060,442.56
负债和净资产总计		213,994,132.77	248,623,251.64

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.028 元，基金份额总额 206,927,516.56 份。

6.2 利润表

会计主体：鹏华改革红利股票型证券投资基金

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		-22,480,184.57	6,995,458.26
1. 利息收入		125,027.67	94,903.68
其中：存款利息收入	6.4.7.13	63,820.68	68,557.76
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		61,206.99	26,345.92
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		3,308,511.79	6,061,585.47
其中：股票投资收益	6.4.7.14	2,452,272.67	4,961,490.04
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-

资产支持证券投资收益	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	856,239.12	1,100,095.43
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	-25,929,728.79	812,683.79
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	16,004.76	26,285.32
减：二、营业总支出		1,616,751.33	2,660,111.28
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,305,323.97	2,199,810.60
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	217,554.00	366,635.12
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	93,873.36	93,665.56
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-24,096,935.90	4,335,346.98
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-24,096,935.90	4,335,346.98
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-24,096,935.90	4,335,346.98

6.3 净资产变动表

会计主体：鹏华改革红利股票型证券投资基金

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	217,849,138.94	-	30,211,303.62	248,060,442.56
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	217,849,138.94	-	30,211,303.62	248,060,442.56
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-10,921,622.38	-	-24,389,776.00	-35,311,398.38
(一)、综合收益总额	-	-	-24,096,935.90	-24,096,935.90
(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)	-10,921,622.38	-	-292,840.10	-11,214,462.48
其中：1. 基金申购款	2,975,335.24	-	63,461.44	3,038,796.68
2. 基金赎回款	-13,896,957.62	-	-356,301.54	-14,253,259.16
(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	206,927,516.56	-	5,821,527.62	212,749,044.18
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	237,881,687.93	-	39,684,047.41	277,565,735.34
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	237,881,687.93	-	39,684,047.41	277,565,735.34
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	9,203,082.03	-	5,700,240.79	14,903,322.82
(一)、综合收益总额	-	-	4,335,346.98	4,335,346.98
(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)	9,203,082.03	-	1,364,893.81	10,567,975.84
其中：1. 基金申购款	31,362,545.20	-	6,676,143.44	38,038,688.64
2. 基金赎回款	-22,159,463.17	-	-5,311,249.63	-27,470,712.80
(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	247,084,769.96	-	45,384,288.20	292,469,058.16

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

鹏华改革红利股票型证券投资基金(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[2015]411号《关于准予鹏华改革红利股票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《鹏华改革红利

股票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 3,683,111,765.79 元，业经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）普华永道中天验字(2015)第 385 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《鹏华改革红利股票型证券投资基金基金合同》于 2015 年 4 月 28 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 3,685,224,044.28 份基金份额，其中认购资金利息折合 2,112,278.49 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》、《鹏华改革红利股票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	33,129,742.39
等于：本金	33,126,831.34
加：应计利息	2,911.05
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	33,129,742.39

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	247,044,362.53	-	180,826,563.61	-66,217,798.92
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	247,044,362.53	-	180,826,563.61	-66,217,798.92

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	6.82
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	26,671.00
其中：交易所市场	26,671.00
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	84,535.36
合计	111,213.18

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	217,849,138.94	217,849,138.94
本期申购	2,975,335.24	2,975,335.24
本期赎回（以“-”号填列）	-13,896,957.62	-13,896,957.62
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	206,927,516.56	206,927,516.56

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	102,473,552.91	-72,262,249.29	30,211,303.62
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	102,473,552.91	-72,262,249.29	30,211,303.62

本期利润	1,832,792.89	-25,929,728.79	-24,096,935.90
本期基金份额交易产生的变动数	-5,185,799.57	4,892,959.47	-292,840.10
其中：基金申购款	1,399,864.47	-1,336,403.03	63,461.44
基金赎回款	-6,585,664.04	6,229,362.50	-356,301.54
本期已分配利润	-	-	-
本期末	99,120,546.23	-93,299,018.61	5,821,527.62

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		57,601.90
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		6,124.34
其他		94.44
合计		63,820.68

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		2,452,272.67
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		2,452,272.67

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		21,292,463.84
减：卖出股票成本总额		18,790,253.01
减：交易费用		49,938.16
买卖股票差价收入		2,452,272.67

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	856,239.12
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	856,239.12

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	-25,929,728.79
股票投资	-25,929,728.79
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-25,929,728.79

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	15,648.91
基金转换费收入	355.85
合计	16,004.76

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	338.00
账户维护费	9,000.00
合计	93,873.36

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	-	-	46,923,057.25	19.68

6.4.10.1.2 债券交易

注：无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

6.4.10.1.4 权证交易

注：无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
国信证券	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
国信证券	43,228.77	19.81	37,594.29	39.10

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	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年6	2023年1月1日至2023

	月 30 日	年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,305,323.97	2,199,810.60
其中：应支付销售机构的客户维护费	343,332.62	548,933.89
应支付基金管理人的净管理费	961,991.35	1,650,876.71

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	217,554.00	366,635.12

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	33,129,742.39	57,601.90	22,912,872.78	66,345.57

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	224	16,231.04
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	1,309	52,072.02
国信证券	688562	航天软件	网下申购	4,555	57,757.40
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	102	1,773.78	2,101.20	-
001379	腾达科技	2024年1月11日	6个月	新股流通受限	16.98	13.48	97	1,647.06	1,307.56	-
001387	雪祺电气	2024年1月4日	6个月	新股流通受限	15.38	15.25	140	1,661.04	2,135.00	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	110	1,917.30	3,801.60	-
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	130	3,641.30	4,917.90	-
301536	星辰科技	2024年3月20日	6个月	新股流通受限	16.16	32.27	333	5,381.28	10,745.91	-
301538	骏鼎达	2024年3月13日	6个月	新股流通受限	55.82	91.24	95	3,795.76	8,667.80	骏鼎达于2024年5月22日每10股送4股
301539	宏	2024	6个月	新股	10.64	19.82	315	3,351.60	6,243.30	-

	鑫科技	年4月3日		流通受限						
301565	中仑新材	2024年6月13日	6个月	新股流通受限	11.88	18.98	260	3,088.80	4,934.80	-
301566	达利凯普	2023年12月22日	6个月	新股流通受限	8.90	16.97	478	4,254.20	8,111.66	-
301580	爱迪特	2024年6月19日	6个月	新股流通受限	44.95	65.93	93	4,180.35	6,131.49	-
301587	中瑞股份	2024年3月27日	6个月	新股流通受限	21.73	25.26	169	3,672.37	4,268.94	-
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	320	22,586.42	60,163.20	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	172	3,341.96	6,360.56	-
601033	永兴股份	2024年1月11日	6个月	新股流通受限	16.20	15.96	264	4,276.80	4,213.44	-
603082	北自科	2024年1月23日	6个月	新股流通受限	21.28	29.49	62	1,319.36	1,828.38	-

	技	日								
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	743	13,856.95	13,856.95	-
603285	键邦股份	2024年6月28日	6个月	新股流通受限	18.65	18.65	83	1,547.95	1,547.95	-
603312	西典新能	2024年1月4日	6个月	新股流通受限	29.02	25.36	57	1,654.14	1,445.52	-
603325	博隆技术	2024年1月3日	6个月	新股流通受限	72.46	68.06	23	1,666.58	1,565.38	-
603341	龙旗科技	2024年2月23日	6个月	新股流通受限	26.00	37.49	93	2,418.00	3,486.57	-
603344	星德胜	2024年3月13日	6个月	新股流通受限	19.18	22.66	101	1,937.18	2,288.66	-
603350	安乃达	2024年6月26日	1个月内(含)	新股未上市	20.56	20.56	935	19,223.60	19,223.60	-
603350	安乃达	2024年6月26日	6个月	新股流通受限	20.56	20.56	104	2,138.24	2,138.24	-
603375	盛景微	2024年1月17日	6个月	新股流通受限	38.18	38.90	44	1,679.92	1,711.60	-
603381	永臻股份	2024年6月19日	6个月	新股流通受限	23.35	25.13	73	1,704.55	1,834.49	-
688530	欧莱新	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	-

	材	日								
688584	上海合晶	2024年2月1日	6个月	新股流通受限	22.66	15.89	221	5,007.86	3,511.69	-
688691	灿芯股份	2024年4月2日	6个月	新股流通受限	19.86	42.51	145	2,879.70	6,163.95	-
688692	达梦数据	2024年6月4日	6个月	新股流通受限	86.96	174.93	60	5,217.60	10,495.80	-
688695	中创股份	2024年3月6日	6个月	新股流通受限	22.43	31.55	152	3,409.36	4,795.60	-
688709	成都华微	2024年1月31日	6个月	新股流通受限	15.69	18.79	248	3,891.12	4,659.92	-

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

本基金为股票型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（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）。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：未持有）。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理职能部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本

基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2024 年 06 月 30 日，本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限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为银行存款、结算备付金，其余大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	33,129,742.39	-	-	-	33,129,742.39
结算备付金	29,347.20	-	-	-	29,347.20
存出保证金	6,704.87	-	-	-	6,704.87
交易性金融资产	-	-	-	180,826,563.61	180,826,563.61
应收申购款	-	-	-	1,774.70	1,774.70
资产总计	33,165,794.46	-	-	180,828,338.31	213,994,132.77
负债					
应付赎回款	-	-	-	235,609.10	235,609.10
应付管理人报酬	-	-	-	213,470.90	213,470.90
应付托管费	-	-	-	35,578.48	35,578.48
应付清算款	-	-	-	649,216.93	649,216.93
其他负债	-	-	-	111,213.18	111,213.18
负债总计	-	-	-	1,245,088.59	1,245,088.59
利率敏感度缺口	33,165,794.46	-	-	-179,583,249.72	212,749,044.18
上年度末	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

2023 年 12 月 31 日					
资产					
货币资金	40,078,504.57	-	-	-	40,078,504.57
结算备付金	329,921.64	-	-	-	329,921.64
存出保证金	25,017.27	-	-	-	25,017.27
交易性金融资产	-	-	-	-204,980,976.74	204,980,976.74
应收申购款	-	-	-	4,252.24	4,252.24
应收清算款	-	-	-	3,204,579.18	3,204,579.18
资产总计	40,433,443.48	-	-	-208,189,808.16	248,623,251.64
负债					
应付赎回款	-	-	-	62,126.40	62,126.40
应付管理人报酬	-	-	-	250,301.09	250,301.09
应付托管费	-	-	-	41,716.84	41,716.84
其他负债	-	-	-	208,664.75	208,664.75
负债总计	-	-	-	562,809.08	562,809.08
利率敏感度缺口	40,433,443.48	-	-	-207,626,999.08	248,060,442.56

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 80%—95%；投资受益于改革红利的上市公司发行的股票（含存托凭证）占非现金基金资产的比例不低于 80%；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，本基金在履行适当程序后，将对投资范围进行相应调整。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	180,826,563.61	85.00	204,980,976.74	82.63
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	180,826,563.61	85.00	204,980,976.74	82.63

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	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

	动	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		11,494,830.86
比较基准下降 5% 资产净值变动		-11,494,830.86	-10,275,903.83

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	180,591,781.76
第二层次	36,766.74
第三层次	198,015.11
合计	180,826,563.61

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	180,826,563.61	84.50
	其中：股票	180,826,563.61	84.50
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	33,159,089.59	15.50
8	其他各项资产	8,479.57	0.00
9	合计	213,994,132.77	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-

B	采矿业	78,107.03	0.04
C	制造业	155,240,823.16	72.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	112,420.39	0.05
E	建筑业	4,469.57	0.00
F	批发和零售业	87,489.82	0.04
G	交通运输、仓储和邮政业	28,147.86	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	24,592,986.42	11.56
J	金融业	79,973.88	0.04
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	10,272.84	0.00
M	科学研究和技术服务业	240,494.07	0.11
N	水利、环境和公共设施管理业	259,810.42	0.12
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	72,286.91	0.03
R	文化、体育和娱乐业	19,281.24	0.01
S	综合	-	-
	合计	180,826,563.61	85.00

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	002371	北方华创	64,195	20,535,338.55	9.65
2	688008	澜起科技	217,435	12,428,584.60	5.84
3	300661	圣邦股份	140,335	11,616,931.30	5.46
4	688279	峰昭科技	88,041	9,763,746.90	4.59
5	688235	百济神州-U	81,554	9,447,215.36	4.44
6	300782	卓胜微	90,940	7,069,675.60	3.32
7	600845	宝信软件	202,627	6,469,880.11	3.04
8	002185	华天科技	734,000	5,982,100.00	2.81
9	603501	韦尔股份	55,350	5,500,129.50	2.59
10	600707	彩虹股份	803,000	5,468,430.00	2.57
11	688192	迪哲医药-U	144,541	5,324,890.44	2.50
12	002138	顺络电子	162,400	4,459,504.00	2.10
13	600733	北汽蓝谷	454,800	3,674,784.00	1.73
14	688536	思瑞浦	35,741	3,495,827.21	1.64

15	300458	全志科技	142,700	3,354,877.00	1.58
16	300679	电连技术	83,300	3,351,159.00	1.58
17	688107	安路科技	124,480	3,164,281.60	1.49
18	600760	中航沈飞	76,500	3,067,650.00	1.44
19	300545	联得装备	111,700	2,742,235.00	1.29
20	688120	华海清科	14,061	2,665,684.38	1.25
21	688361	中科飞测	55,322	2,616,730.60	1.23
22	603606	东方电缆	52,500	2,562,525.00	1.20
23	600563	法拉电子	30,100	2,293,018.00	1.08
24	688112	鼎阳科技	83,395	2,250,831.05	1.06
25	603160	汇顶科技	32,500	2,234,375.00	1.05
26	688728	格科微	171,424	2,075,944.64	0.98
27	688331	荣昌生物	45,471	1,964,347.20	0.92
28	002028	思源电气	28,500	1,906,650.00	0.90
29	688387	信科移动-U	374,602	1,887,994.08	0.89
30	600522	中天科技	114,800	1,819,580.00	0.86
31	601179	中国西电	219,300	1,763,172.00	0.83
32	688325	赛微微电	54,077	1,696,395.49	0.80
33	603328	依顿电子	213,400	1,677,324.00	0.79
34	688428	诺诚健华-U	195,630	1,586,559.30	0.75
35	603061	金海通	22,700	1,459,156.00	0.69
36	002415	海康威视	44,400	1,372,404.00	0.65
37	688150	莱特光电	53,907	1,045,795.80	0.49
38	301260	格力博	76,300	1,039,206.00	0.49
39	688203	海正生材	120,380	1,023,230.00	0.48
40	603766	隆鑫通用	147,700	1,001,406.00	0.47
41	002539	云图控股	121,300	864,869.00	0.41
42	688798	艾为电子	15,084	854,056.08	0.40
43	688508	芯朋微	22,449	816,470.13	0.38
44	002241	歌尔股份	40,500	790,155.00	0.37
45	000777	中核科技	50,200	767,056.00	0.36
46	688484	南芯科技	19,866	737,028.60	0.35
47	300818	耐普矿机	25,340	646,170.00	0.30
48	301160	翔楼新材	15,718	585,495.50	0.28
49	688366	昊海生科	9,187	566,654.16	0.27
50	002387	维信诺	92,400	561,792.00	0.26
51	300408	三环集团	18,300	534,177.00	0.25
52	300613	富瀚微	13,300	437,703.00	0.21
53	600745	闻泰科技	11,500	324,875.00	0.15
54	688031	星环科技-U	8,451	310,236.21	0.15
55	688271	联影医疗	1,325	145,352.50	0.07
56	688692	达梦数据	593	130,090.34	0.06
57	301259	艾布鲁	6,276	127,716.60	0.06

58	688539	高华科技	4,630	124,593.30	0.06
59	688306	均普智能	25,700	104,342.00	0.05
60	688210	统联精密	4,704	104,193.60	0.05
61	301538	骏鼎达	949	96,014.92	0.05
62	688119	中钢洛耐	26,767	88,063.43	0.04
63	688352	硕中科技	7,515	85,746.15	0.04
64	301377	鼎泰高科	4,665	81,870.75	0.04
65	688334	西高院	4,996	80,435.60	0.04
66	601059	信达证券	5,628	79,973.88	0.04
67	301359	东南电子	3,271	79,812.40	0.04
68	301172	君逸数码	2,479	72,833.02	0.03
69	688419	耐科装备	2,431	72,735.52	0.03
70	301220	亚香股份	2,849	72,706.48	0.03
71	301291	明阳电气	2,377	71,428.85	0.03
72	688562	航天软件	4,555	69,554.85	0.03
73	688543	国科军工	1,638	67,272.66	0.03
74	600276	恒瑞医药	1,700	65,382.00	0.03
75	301428	世纪恒通	2,260	64,862.00	0.03
76	301388	欣灵电气	2,610	64,493.10	0.03
77	688480	赛恩斯	2,302	64,133.72	0.03
78	301565	中仑新材	2,594	63,681.58	0.03
79	301517	陕西华达	1,173	63,342.00	0.03
80	688563	航材股份	1,174	62,081.12	0.03
81	688523	航天环宇	3,529	60,875.25	0.03
82	301589	诺瓦星云	320	60,163.20	0.03
83	301328	维峰电子	1,614	59,572.74	0.03
84	301486	致尚科技	1,402	59,318.62	0.03
85	688435	英方软件	2,376	59,304.96	0.03
86	301267	华夏眼科	2,843	58,906.96	0.03
87	688570	天玛智控	2,881	58,743.59	0.03
88	301171	易点天下	3,872	56,918.40	0.03
89	688531	日联科技	1,172	54,099.52	0.03
90	301399	英特科技	2,730	53,726.40	0.03
91	301386	未来电器	2,540	52,679.60	0.02
92	688114	华大智造	1,108	52,530.28	0.02
93	688603	天承科技	973	50,800.33	0.02
94	688307	中润光学	2,455	50,793.95	0.02
95	301502	华阳智能	1,292	50,433.44	0.02
96	301337	亚华电子	1,796	49,533.68	0.02
97	301323	新莱福	1,565	49,422.70	0.02
98	301587	中瑞股份	1,681	49,099.74	0.02
99	301262	海看股份	2,121	47,828.55	0.02
100	001389	广合科技	1,092	47,765.74	0.02

101	301261	恒工精密	1,268	47,004.76	0.02
102	301202	朗威股份	1,730	46,294.80	0.02
103	301315	威士顿	1,419	46,245.21	0.02
104	301550	斯菱股份	953	45,658.23	0.02
105	301283	聚胶股份	1,609	45,647.33	0.02
106	301292	海科新源	3,688	45,620.56	0.02
107	688143	长盈通	2,124	45,496.08	0.02
108	600925	苏能股份	8,960	45,248.00	0.02
109	301251	威尔高	1,314	45,241.02	0.02
110	301332	德尔玛	5,086	44,960.24	0.02
111	301505	苏州规划	1,483	44,490.00	0.02
112	688648	中邮科技	2,035	44,444.40	0.02
113	301376	致欧科技	2,096	44,372.32	0.02
114	301507	民生健康	3,460	43,665.20	0.02
115	688581	安杰思	892	43,645.56	0.02
116	001286	陕西能源	3,767	43,433.51	0.02
117	301555	惠柏新材	1,532	43,401.56	0.02
118	688503	聚和材料	1,524	42,824.40	0.02
119	688653	康希通信	3,268	42,091.84	0.02
120	688646	逸飞激光	1,314	41,009.94	0.02
121	688381	帝奥微	2,092	40,752.16	0.02
122	301296	新巨丰	5,639	40,657.19	0.02
123	301568	思泰克	1,271	40,443.22	0.02
124	301548	崇德科技	760	40,340.80	0.02
125	301519	舜禹股份	2,401	39,760.56	0.02
126	301355	南王科技	4,131	39,616.29	0.02
127	301265	华新环保	5,007	39,605.37	0.02
128	688489	三未信安	1,450	38,628.00	0.02
129	301309	万得凯	1,505	38,467.80	0.02
130	301115	建科股份	2,750	38,170.00	0.02
131	301157	华塑科技	1,169	38,109.40	0.02
132	688651	盛邦安全	1,293	37,820.25	0.02
133	688152	麒麟信安	974	37,713.28	0.02
134	301456	盘古智能	1,439	37,543.51	0.02
135	301520	万邦医药	893	36,952.34	0.02
136	688702	盛科通信-U	891	36,085.50	0.02
137	688429	时创能源	2,130	36,082.20	0.02
138	603341	龙旗科技	928	36,034.87	0.02
139	301281	科源制药	1,567	35,179.15	0.02
140	688693	锆威特	975	35,022.00	0.02
141	688391	钜泉科技	1,108	32,320.36	0.02
142	688420	美腾科技	1,548	32,012.64	0.02
143	688602	康鹏科技	4,142	31,769.14	0.01

144	301322	绿通科技	1,508	28,305.16	0.01
145	688716	中研股份	1,334	28,280.80	0.01
146	301301	川宁生物	2,149	27,464.22	0.01
147	603281	江瀚新材	1,208	27,119.60	0.01
148	688433	华曙高科	1,286	26,825.96	0.01
149	301500	飞南资源	1,516	26,454.20	0.01
150	603193	润本股份	1,354	24,900.06	0.01
151	688612	威迈斯	937	24,896.09	0.01
152	001282	三联锻造	882	24,440.22	0.01
153	601089	福元医药	1,749	24,223.65	0.01
154	301515	港通医疗	1,244	23,810.16	0.01
155	688249	晶合集成	1,617	23,721.39	0.01
156	001359	平安电工	1,015	22,433.71	0.01
157	301286	侨源股份	784	22,430.24	0.01
158	301487	盟固利	867	22,420.62	0.01
159	001258	立新能源	3,188	22,092.84	0.01
160	688301	奕瑞科技	190	21,893.70	0.01
161	603350	安乃达	1,039	21,361.84	0.01
162	603107	上海汽配	1,331	21,149.59	0.01
163	301297	富乐德	1,015	20,614.65	0.01
164	001311	多利科技	844	20,407.92	0.01
165	301187	欧圣电气	841	20,394.25	0.01
166	001239	永达股份	1,469	20,389.72	0.01
167	301162	国能日新	468	20,386.08	0.01
168	603172	万丰股份	1,220	19,715.20	0.01
169	001314	亿道信息	508	19,522.44	0.01
170	001330	博纳影业	3,564	19,281.24	0.01
171	603082	北自科技	620	18,702.30	0.01
172	001337	四川黄金	795	18,451.95	0.01
173	301175	中科环保	4,040	17,735.60	0.01
174	603211	晋拓股份	1,287	17,644.77	0.01
175	601022	宁波远洋	1,983	17,490.06	0.01
176	603276	恒兴新材	1,234	17,201.96	0.01
177	301127	天源环保	1,454	17,186.28	0.01
178	001326	联域股份	475	17,033.50	0.01
179	603191	望变电气	1,149	17,005.20	0.01
180	001323	慕思股份	573	16,485.21	0.01
181	001338	永顺泰	1,649	16,160.20	0.01
182	301120	新特电气	1,548	16,083.72	0.01
183	301266	宇邦新材	517	15,840.88	0.01
184	001306	夏厦精密	290	15,657.10	0.01
185	301368	丰立智能	337	15,528.96	0.01
186	603285	键邦股份	826	15,404.90	0.01

187	603097	江苏华辰	577	15,302.04	0.01
188	603206	嘉环科技	1,210	15,282.30	0.01
189	301018	申菱环境	782	15,202.08	0.01
190	601121	宝地矿业	2,532	14,407.08	0.01
191	301238	瑞泰新材	949	14,206.53	0.01
192	301285	鸿日达	538	14,036.42	0.01
193	002245	蔚蓝锂芯	1,800	13,950.00	0.01
194	603235	天新药业	572	13,745.16	0.01
195	301132	满坤科技	355	13,557.45	0.01
196	301361	众智科技	460	13,386.00	0.01
197	301293	三博脑科	355	13,379.95	0.01
198	688525	佰维存储	205	13,150.75	0.01
199	301348	蓝箭电子	428	13,006.92	0.01
200	603153	上海建科	740	12,513.40	0.01
201	301101	明月镜片	557	12,443.38	0.01
202	301311	昆船智能	669	12,296.22	0.01
203	301217	铜冠铜箔	1,268	12,172.80	0.01
204	001318	阳光乳业	1,142	11,751.18	0.01
205	603255	鼎际得	488	11,370.40	0.01
206	688469	芯联集成-U	2,864	11,341.44	0.01
207	603237	五芳斋	455	11,220.30	0.01
208	688535	华海诚科	158	10,826.16	0.01
209	603190	亚通精工	470	10,791.20	0.01
210	301536	星辰科技	333	10,745.91	0.01
211	603162	海通发展	1,146	10,657.80	0.01
212	301112	信邦智能	484	10,497.96	0.00
213	688472	阿特斯	1,016	10,342.88	0.00
214	301180	万祥科技	654	10,228.56	0.00
215	001229	魅视科技	347	10,121.99	0.00
216	301516	中远通	543	10,116.09	0.00
217	301141	中科磁业	305	9,836.25	0.00
218	301419	阿莱德	392	9,733.36	0.00
219	002179	中航光电	255	9,702.75	0.00
220	301320	豪江智能	642	9,642.84	0.00
221	301510	固高科技	344	9,546.00	0.00
222	688478	晶升股份	325	9,464.00	0.00
223	301339	通行宝	473	9,407.97	0.00
224	603062	麦加芯彩	283	9,398.43	0.00
225	301277	新天地	713	9,254.74	0.00
226	301358	湖南裕能	294	9,249.24	0.00
227	301317	鑫磊股份	593	9,215.22	0.00
228	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
229	001322	箭牌家居	1,238	9,049.78	0.00

230	301206	三元生物	363	8,922.54	0.00
231	605028	世茂能源	615	8,874.45	0.00
232	301268	铭利达	568	8,832.40	0.00
233	001319	铭科精技	536	8,736.80	0.00
234	001300	三柏硕	763	8,675.31	0.00
235	301095	广立微	207	8,511.84	0.00
236	603130	云中马	480	8,467.20	0.00
237	301151	冠龙节能	572	8,419.84	0.00
238	603057	紫燕食品	549	8,410.68	0.00
239	301110	青木股份	283	8,356.99	0.00
240	301302	华如科技	484	8,349.00	0.00
241	301185	鸥玛软件	578	8,282.74	0.00
242	301222	浙江恒威	332	8,220.32	0.00
243	301526	国际复材	2,467	8,215.11	0.00
244	301566	达利凯普	478	8,111.66	0.00
245	001228	永泰运	383	8,073.64	0.00
246	301207	华兰疫苗	452	7,986.84	0.00
247	300904	威力传动	198	7,914.06	0.00
248	603282	亚光股份	457	7,705.02	0.00
249	301168	通灵股份	273	7,583.94	0.00
250	301221	光庭信息	212	7,564.16	0.00
251	001278	一彬科技	473	7,478.13	0.00
252	001331	胜通能源	539	7,465.15	0.00
253	001222	源飞宠物	608	7,448.00	0.00
254	001238	浙江正特	374	7,412.68	0.00
255	301363	美好医疗	255	7,395.00	0.00
256	301096	百诚医药	126	7,318.08	0.00
257	301327	华宝新能	126	7,219.80	0.00
258	603280	南方路机	363	7,201.92	0.00
259	301135	瑞德智能	338	7,196.02	0.00
260	301325	曼恩斯特	169	7,168.98	0.00
261	001366	播恩集团	645	7,159.50	0.00
262	301219	腾远钴业	187	7,154.62	0.00
263	301489	思泉新材	100	7,058.00	0.00
264	001333	光华股份	426	7,029.00	0.00
265	001268	联合精密	409	6,924.37	0.00
266	001368	通达创智	351	6,862.05	0.00
267	001299	美能能源	576	6,796.80	0.00
268	301381	赛维时代	299	6,796.27	0.00
269	301117	佳缘科技	262	6,759.60	0.00
270	301282	金禄电子	284	6,753.52	0.00
271	301357	北方长龙	204	6,585.12	0.00
272	603291	联合水务	536	6,571.36	0.00

273	301318	维海德	239	6,565.33	0.00
274	301498	乖宝宠物	122	6,563.60	0.00
275	688593	新相微	649	6,490.00	0.00
276	603170	宝立食品	542	6,438.96	0.00
277	301591	肯特股份	172	6,360.56	0.00
278	301190	善水科技	453	6,355.59	0.00
279	301370	国科恒泰	583	6,337.21	0.00
280	301488	豪恩汽电	131	6,301.10	0.00
281	001230	劲旅环境	450	6,250.50	0.00
282	301539	宏鑫科技	315	6,243.30	0.00
283	688691	灿芯股份	145	6,163.95	0.00
284	301580	爱迪特	93	6,131.49	0.00
285	301421	波长光电	141	6,095.43	0.00
286	301413	安培龙	147	6,078.45	0.00
287	301382	蜂助手	335	6,060.15	0.00
288	301233	盛帮股份	158	6,007.16	0.00
289	001336	楚环科技	274	5,986.90	0.00
290	301126	达嘉维康	662	5,977.86	0.00
291	688549	中巨芯-U	881	5,946.75	0.00
292	603051	鹿山新材	272	5,937.76	0.00
293	301100	风光股份	457	5,936.43	0.00
294	001287	中电港	354	5,851.62	0.00
295	301499	维科精密	257	5,841.61	0.00
296	688573	信宇人	269	5,751.22	0.00
297	603182	嘉华股份	546	5,743.92	0.00
298	688548	广钢气体	626	5,715.38	0.00
299	301163	宏德股份	277	5,628.64	0.00
300	603296	华勤技术	101	5,578.23	0.00
301	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
302	601061	中信金属	801	5,502.87	0.00
303	688720	艾森股份	135	5,472.90	0.00
304	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
305	688652	京仪装备	139	5,433.51	0.00
306	301161	唯万密封	346	5,373.38	0.00
307	301316	慧博云通	359	5,270.12	0.00
308	301116	益客食品	577	5,152.61	0.00
309	601096	宏盛华源	1,239	5,067.51	0.00
310	301558	三态股份	593	4,975.27	0.00
311	301373	凌玮科技	218	4,970.40	0.00
312	301360	荣旗科技	114	4,930.50	0.00
313	688695	中创股份	152	4,795.60	0.00
314	301533	威马农机	186	4,778.34	0.00
315	301152	天力锂能	197	4,745.73	0.00

316	688627	精智达	102	4,734.84	0.00
317	301118	恒光股份	315	4,696.65	0.00
318	301158	德石股份	379	4,688.23	0.00
319	688709	成都华微	248	4,659.92	0.00
320	301290	东星医疗	229	4,559.39	0.00
321	301578	辰奕智能	115	4,550.55	0.00
322	301511	德福科技	308	4,546.08	0.00
323	301276	嘉曼服饰	216	4,527.36	0.00
324	688591	泰凌微	231	4,516.05	0.00
325	301459	丰茂股份	112	4,447.52	0.00
326	301166	优宁维	161	4,347.00	0.00
327	603065	宿迁联盛	581	4,340.07	0.00
328	301319	唯特偶	143	4,294.29	0.00
329	301439	泓淋电力	336	4,257.12	0.00
330	601033	永兴股份	264	4,213.44	0.00
331	301329	信音电子	210	4,059.30	0.00
332	301418	协昌科技	101	4,040.00	0.00
333	301272	英华特	104	4,012.32	0.00
334	301528	多浦乐	89	3,812.76	0.00
335	301518	长华化学	210	3,639.30	0.00
336	688584	上海合晶	221	3,511.69	0.00
337	301393	昊帆生物	82	3,482.54	0.00
338	603135	中重科技	268	3,358.04	0.00
339	301177	迪阿股份	179	3,329.40	0.00
340	301371	敷尔佳	106	3,292.36	0.00
341	301170	锡南科技	125	3,256.25	0.00
342	301529	福赛科技	95	3,116.95	0.00
343	688479	友车科技	183	2,907.87	0.00
344	301559	中集环科	196	2,855.72	0.00
345	688237	超卓航科	129	2,586.45	0.00
346	603119	浙江荣泰	143	2,533.96	0.00
347	601133	柏诚股份	233	2,490.77	0.00
348	001328	登康口腔	97	2,454.10	0.00
349	688719	爱科赛博	91	2,372.37	0.00
350	001378	德冠新材	98	2,338.28	0.00
351	301349	信德新材	84	2,321.76	0.00
352	601065	江盐集团	264	2,288.88	0.00
353	603344	星德胜	101	2,288.66	0.00
354	603273	天元智能	122	2,238.70	0.00
355	603373	安邦护卫	80	2,199.20	0.00
356	603125	常青科技	126	2,168.46	0.00
357	603004	鼎龙科技	127	2,152.65	0.00
358	301525	儒竞科技	38	2,138.64	0.00

359	001387	雪祺电气	140	2,135.00	0.00
360	603137	恒尚节能	194	1,978.80	0.00
361	001324	长青科技	114	1,846.80	0.00
362	603381	永臻股份	73	1,834.49	0.00
363	603375	盛景微	44	1,711.60	0.00
364	001367	海森药业	71	1,657.14	0.00
365	603325	博隆技术	23	1,565.38	0.00
366	603270	金帝股份	78	1,547.52	0.00
367	603075	热威股份	86	1,517.90	0.00
368	603312	西典新能	57	1,445.52	0.00
369	001379	腾达科技	97	1,307.56	0.00
370	000541	佛山照明	200	974.00	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	600733	北汽蓝谷	3,830,757.00	1.54
2	603606	东方电缆	2,621,677.00	1.06
3	300679	电连技术	2,168,042.00	0.87
4	688325	赛微微电	1,890,529.86	0.76
5	600522	中天科技	1,743,575.00	0.70
6	601179	中国西电	1,334,596.00	0.54
7	000801	四川九洲	1,128,853.00	0.46
8	002539	云图控股	1,085,911.00	0.44
9	603766	隆鑫通用	1,073,129.00	0.43
10	688150	莱特光电	1,064,832.12	0.43
11	688728	格科微	1,046,057.02	0.42
12	300818	耐普矿机	656,817.00	0.26
13	301536	星辰科技	53,796.64	0.02
14	688692	达梦数据	51,567.28	0.02
15	688584	上海合晶	49,942.64	0.02
16	301589	诺瓦星云	45,045.95	0.02
17	601033	永兴股份	42,703.20	0.02
18	301580	爱迪特	41,713.60	0.02
19	688709	成都华微	38,785.68	0.02
20	301538	骏鼎达	37,845.96	0.02

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	001309	德明利	3,327,915.68	1.34
2	300750	宁德时代	2,808,339.40	1.13
3	002371	北方华创	2,169,328.00	0.87
4	301345	涛涛车业	2,005,008.48	0.81
5	000801	四川九洲	1,533,404.00	0.62
6	688378	奥来德	1,531,380.88	0.62
7	688331	荣昌生物	1,100,517.67	0.44
8	000777	中核科技	988,583.00	0.40
9	600733	北汽蓝谷	972,079.00	0.39
10	300976	达瑞电子	608,080.00	0.25
11	603267	鸿远电子	543,469.00	0.22
12	688328	深科达	530,817.76	0.21
13	688031	星环科技-U	395,827.60	0.16
14	600745	闻泰科技	387,003.00	0.16
15	688347	华虹公司	192,747.60	0.08
16	301392	汇成真空	148,932.00	0.06
17	301536	星宸科技	129,327.60	0.05
18	301591	肯特股份	117,344.00	0.05
19	301539	宏鑫科技	110,217.00	0.04
20	688486	龙迅股份	108,561.59	0.04

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	20,565,568.67
卖出股票收入（成交）总额	21,292,463.84

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：无。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：无。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目标，选择流动性好、交易活跃的股指期货的期货合约，充分考虑股指期货的风险收益特征，通过多头或空头的套期保值策略，以改善投资组合的投资效果，实现股票组合的超额收益。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券备选库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	6,704.87
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,774.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,479.57

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比 例 (%)	持有份额	占总份额比 例 (%)
5,800	35,677.16	5,115,798.61	2.47	201,811,717.95	97.53

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	350,711.33	0.1695

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	-
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

注：1、截至本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金份额。

2、截至本报告期末，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 (2015 年 4 月 28 日) 基金份额总额	3,685,224,044.28
本报告期期初基金份额总额	217,849,138.94
本报告期基金总申购份额	2,975,335.24
减：本报告期基金总赎回份额	13,896,957.62
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	206,927,516.56

§ 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 (%)	
东吴证券	1	14,672,823.82	35.84	12,687.76	34.60	-
中信证券	1	9,964,238.98	24.34	8,875.92	24.20	-
招商证券	1	5,871,806.40	14.34	5,409.93	14.75	-
西南证券	1	3,826,665.71	9.35	3,581.22	9.77	-
申万宏源证券	2	3,598,709.67	8.79	3,351.15	9.14	-
国泰君安	1	2,551,916.04	6.23	2,351.00	6.41	-
中信建投证券	1	451,079.22	1.10	415.57	1.13	-
财通证券	1	-	-	-	-	本报告期新增
国信证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华林证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中邮证券	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(%)
东吴证券	-	-	504,543,000.00	70.39	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	116,767,000.00	16.29	-	-
中信建投证券	-	-	95,455,000.00	13.32	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-

海通证 券	-	-	-	-	-	-
华林证 券	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-
中邮证 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	鹏华改革红利股票型证券投资基金 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金持有的股票停牌后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 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	《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	鹏华改革红利股票型证券投资基金 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	鹏华改革红利股票型证券投资基金	《中国证券报》、基金	2024 年 04 月 10 日

	基金产品资料概要（更新）	管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	
12	鹏华改革红利股票型证券投资基金更新的招募说明书	《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 10 日
13	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
14	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
15	鹏华改革红利股票型证券投资基金 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
16	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
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	《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
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	《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
19	鹏华改革红利股票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

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）《鹏华改革红利股票型证券投资基金基金合同》；
- （二）《鹏华改革红利股票型证券投资基金托管协议》；
- （三）《鹏华改革红利股票型证券投资基金 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