

鹏华价值精选股票型证券投资基金

2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2025 年 8 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 08 月 27 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 2025 年 01 月 01 日起至 2025 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	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
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	11
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等内容真实、准确和完整发表意见	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	57
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	57
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	57

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	57
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	57
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	57
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	57
7.12 投资组合报告附注	58
§ 8 基金份额持有人信息.....	58
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	58
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	59
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	59
§ 9 开放式基金份额变动.....	59
§ 10 重大事件揭示	59
10.1 基金份额持有人大会决议	59
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	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	60
10.4 基金投资策略的改变	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	60
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	60
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	60
10.8 其他重大事件	64
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	65
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	65
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	65
§ 12 备查文件目录	65
12.1 备查文件目录	65
12.2 存放地点	65
12.3 查阅方式	65

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华价值精选股票型证券投资基金
基金简称	鹏华价值精选股票
基金主代码	206012
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012 年 4 月 16 日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	59,339,389.53 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在适度控制风险并保持良好流动性的前提下，精选具备估值优势以及良好基本面的上市公司，力争实现超额收益与长期资本增值。
投资策略	1、资产配置策略 本基金通过对宏观经济、微观经济运行态势、政策环境、利率走势、证券市场走势及证券市场现阶段的系统性风险以及未来一段时期内各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估，运用定量及定性相结合的手段，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。 2、股票投资策略 本基金通过定性与定量相结合的积极投资策略，自下而上地精选价值被低估并且具有良好基本面的股票构建股票投资组合。 （1）定性分析 本基金通过以下标准对股票的基本面进行研究分析并筛选出基本面优异的上市公司： 第一、根据公司的核心业务竞争力、市场地位、经营管理者能力、人才资源等选择具备良好竞争优势的公司； 第二、根据上市公司股权结构、公司组织框架、信息透明度等角度定性分析，选择公司治理结构良好的公司； 第三、通过定性的方式分析公司在自身的发展过程中，受国家政策的扶持程度，公司发展方向，核心产品发展前景，公司规模增长及经营效益的趋势。另外还将考察公司在同业中的地位、核心产品的竞争力、市场需求状况及公司的决策体系及其开拓精神等。 （2）定量分析 本基金通过对上市公司内在价值的深入分析，挖掘具备估值优势的上市公司。本基金将在宏观经济分析、行业分析的基础上，根据公司的基本面以及财务报表信息灵活运用各类估值方法评估公司的价值。本基金采用的估值方法及评估指标包括 PE、PEG、

	PB、PS、EV/EBITDA 等。 (3) 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 本基金通过久期配置、类属配置、期限结构配置等，采取积极主动的投资策略，在严格控制风险的前提下，发掘和利用市场失衡提供的投资机会，实现债券组合增值。 4、权证产品投资策略 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。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×90%+中证综合债指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为采用高仓位运作的股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金及普通股票型基金，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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	高永杰	王小飞
	联系电话	0755-81395402	021-60637103
	电子邮箱	xxpl@phfund.com.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		4006788999	021-60637228
传真		0755-82021126	021-60635778
注册地址		深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		518048	100033
法定代表人		张纳沙	张金良

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《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(2025 年 1 月 1 日-2025 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	10,260,783.41
本期利润	10,045,228.57
加权平均基金份额本期利润	0.1619
本期加权平均净值利润率	5.65%
本期基金份额净值增长率	5.70%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	113,889,182.04
期末可供分配基金份额利润	1.9193
期末基金资产净值	174,949,417.22
期末基金份额净值	2.948
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	194.80%

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	4.39%	0.51%	2.30%	0.52%	2.09%	-0.01%
过去三个月	0.10%	1.13%	1.34%	0.98%	-1.24%	0.15%
过去六个月	5.70%	1.08%	0.20%	0.91%	5.50%	0.17%
过去一年	18.68%	1.48%	13.05%	1.24%	5.63%	0.24%
过去三年	-9.98%	1.27%	-9.38%	0.99%	-0.60%	0.28%

自基金合同生效 起至今	194.80%	1.54%	59.38%	1.22%	135.42 %	0.32%
----------------	---------	-------	--------	-------	-------------	-------

注：业绩比较基准=沪深 300 指数收益率×90%+中证综合债指数收益率×10%。

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



注：1、本基金基金合同于 2012 年 04 月 16 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，公司管理资产总规模达到 12,513 亿元，359 只公募基金、12 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	证券从	说明
----	----	-----------	-----	----

		(助理) 期限		业年限	
		任职日期	离任日期		
张鹏	本基金的基金经理	2021-08-24	-	12 年	张鹏先生, 国籍中国, 金融学硕士, 12 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。

注：1. 基金经理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：本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

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、分配等各环节得到公平对待。公司对不同投资组合在不同时间窗口下（日内、3 日内、5 日内）的同向交易价差进行专项分析，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2025 年上半年，市场整体比较强势，流动性比较充沛，线索繁多，结构分化，轮动快速。大致分为几个阶段，开年以来延续去年底市场冲高后的高位调整趋势，1 月中开始小幅反弹，春节后 Deepseek 国产大模型横空出世，带动泛 AI 线索上的科技股显著上涨，以机器人、AI 应用等为代表的板块上涨，同时阿里上调未来资本开支预期，以及民营企业会议加速了这一行情，同期算力板块由于通缩担忧调整。此段窗口期内成长板块显著跑赢价值板块。到 3 月初，科技股波动率放大后，股价开始调整，直到 4 月 7 日中美对等关税事件导致市场大面积跌停，调整阶段性结束。此段窗口期内，价值板块占优。4 月 7 日后，市场开展超跌反弹，先是围绕黄金等避险线索和自主可控线索反弹，进入 5 月后直到 6 月末，市场强势，流动性充沛，各板块轮动上涨。此窗口期内，行情分化到两端，一端是以银行金融为代表的大盘价值板块，一端是以创新药、新消费等主题为代表的高弹性高成长板块，两端都有显著的超额收益。期间又夹杂了海外算力链、稳定币、商品等板块的阶段性情。

上半年的操作上，整体上未做仓位择时，围绕估值合理的优势公司构建的核心持仓未变，边际上参与轮动行情。核心持仓包括银行等低估值优质大盘价值股，和估值合理成长空间较大的制造业公司，以及供给刚性股价底部的商品板块。边际上，3 月初科技板块波动率放大时兑现部分 2024 年 Q4 加仓的科技股，4 月份市场见底后，持续小幅加仓银行、非银和大宗周期品仓位，边际加仓创新药、海外算力等板块，并在 6 月份兑现部分超涨标的。高点减仓了汽车板块。

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 5.70%，同期业绩比较基准增长率为 0.20%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当期基本面，现实弱预期逐渐转强，市场流动性较充沛需要载体，整体看多预期高度一致，结构上分化较大，多方资金审美迥异，造成市场相对割裂的分化行情，市场最终会选择方向。基金经理对牛市的节奏判断相对克制，方向上不做终局判断而是以观察为主。首先在流动性上，历史上流动性的持续更多是基于高 sharp 率，由高弹性收益率支撑的夏普比率持续性存疑，在成长板块的增量流动性的方向变化一直都是比较快的，不能够线性外推，第二个科创板的估值处于

百倍以上相对高位，虽然科技板块创新药等产业发展很热，但是产业发展和股价上涨之间，估值是一个值得考量的风险因素，第三个看 AI 行业的发展上，如果应用端始终无法观察到明显的落地场景的话，AI 的发展速度可能需要重新评估，实际上持续的资本开支以及 Deepseek 等优质大模型的出现，反而拉近了观察久期，AI 的发展或许需要市场更多的耐心；

因此，展望 2025 年下半年，在高成长高弹性板块的配置上，组合会在控制回撤风险敞口的基础上，通过精选个股的方式来配置，不做仓位押注式投资。同时保持对 AI 产业、创新药产业等宏大叙事空间远大的方向，做好跟踪观察，根据观察的结果动态调整策略。

此外，还会选择估值和股价、关注度处于相对底部的板块做一些左侧的研究和布局，包括但不限于金融板块、周期品板块，以及一些有变化的制造业方向。

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 113,889,182.04 元，期末基金份额净值 2.948 元。

2、本基金本报告期内未进行利润分配。

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：鹏华价值精选股票型证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	22,539,338.49	23,172,031.79
结算备付金		350,510.61	303,296.43
存出保证金		56,064.29	45,884.13
交易性金融资产	6.4.7.2	156,287,130.73	153,130,515.15
其中：股票投资		156,287,130.73	153,130,515.15
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		120,814.40	3,006,021.42
应收股利		-	-
应收申购款		9,835.04	29,198.44
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		179,363,693.56	179,686,947.36
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 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		3,741,082.70	-
应付赎回款		248,946.07	1,230,687.80
应付管理人报酬		174,557.11	185,785.88
应付托管费		29,092.86	30,964.32
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	220,597.60	300,758.70
负债合计		4,414,276.34	1,748,196.70
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	59,339,389.53	63,798,062.22
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	115,610,027.69	114,140,688.44
净资产合计		174,949,417.22	177,938,750.66
负债和净资产总计		179,363,693.56	179,686,947.36

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额净值 2.948 元，基金份额总额 59,339,389.53 份。

6.2 利润表

会计主体：鹏华价值精选股票型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		11,352,213.65	-14,204,250.98
1. 利息收入		34,674.11	46,561.80
其中：存款利息收入	6.4.7.13	34,674.11	40,895.44
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		-	5,666.36
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以 “-”填列）		11,516,587.03	-26,810,440.28
其中：股票投资收益	6.4.7.14	9,945,317.65	-28,440,886.49
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	1,571,269.38	1,630,446.21
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	-215,554.84	12,550,857.95
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	16,507.35	8,769.55
减：二、营业总支出		1,306,985.08	1,300,595.19
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,057,188.11	1,040,950.91
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	176,198.05	173,491.80
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	73, 598. 92	86, 152. 48
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		10, 045, 228. 57	-15, 504, 846. 17
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		10, 045, 228. 57	-15, 504, 846. 17
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		10, 045, 228. 57	-15, 504, 846. 17

6.3 净资产变动表

会计主体：鹏华价值精选股票型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	63, 798, 062. 22	-	114, 140, 688. 44	177, 938, 750. 66
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	63, 798, 062. 22	-	114, 140, 688. 44	177, 938, 750. 66
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-4, 458, 672. 69	-	1, 469, 339. 25	-2, 989, 333. 44
（一）、综合收益总额	-	-	10, 045, 228. 57	10, 045, 228. 57
（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）	-4, 458, 672. 69	-	-8, 575, 889. 32	-13, 034, 562. 01
其中：1. 基金申购款	5, 123, 939. 42	-	9, 584, 135. 93	14, 708, 075. 35
2. 基金赎	-9, 582, 612. 11	-	-18, 160, 025. 25	-27, 742, 637. 36

回款				
（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	59,339,389.53	-	115,610,027.69	174,949,417.22
项目	上年度可比期间 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	73,454,340.16	-	124,748,895.89	198,203,236.05
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	73,454,340.16	-	124,748,895.89	198,203,236.05
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-4,031,069.34	-	-21,744,720.52	-25,775,789.86
（一）、综合收益总额	-	-	-15,504,846.17	-15,504,846.17
（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）	-4,031,069.34	-	-6,239,874.35	-10,270,943.69
其中：1. 基金申购款	2,216,007.36	-	3,179,447.09	5,395,454.45
2. 基金赎回款	-6,247,076.70	-	-9,419,321.44	-15,666,398.14
（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	69,423,270.82	-	103,004,175.37	172,427,446.19

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
基金管理人负责人

聂连杰
主管会计工作负责人

郝文高
会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

鹏华价值精选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[2011]1627 号《关于核准鹏华价值精选股票型证券投资基金募集的批复》核准，由鹏华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华价值精选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 334,728,307.80 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第 090 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《鹏华价值精选股票型证券投资基金基金合同》于 2012 年 4 月 16 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 334,825,290.98 份基金份额，其中认购资金利息折合 96,983.18 份基金份额。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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》、《鹏华价值精选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 2025 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 2025

年 06 月 30 日的财务状况以及 2025 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 2025 年 6 月 30 日
活期存款	22,539,338.49
等于：本金	22,537,101.28
加：应计利息	2,237.21
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	22,539,338.49

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		149,383,214.89	-	156,287,130.73	6,903,915.84
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		149,383,214.89	-	156,287,130.73	6,903,915.84

注：股票投资的成本、公允价值及公允价值变动均包含中国存托凭证的成本、公允价值及公允价值变动。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.8 其他资产

注：无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	104.29
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	148,589.25
其中：交易所市场	148,589.25
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	71,904.06
合计	220,597.60

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	63,798,062.22	63,798,062.22
本期申购	5,123,939.42	5,123,939.42
本期赎回（以“-”号填列）	-9,582,612.11	-9,582,612.11
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	59,339,389.53	59,339,389.53

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	111,797,448.24	2,343,240.20	114,140,688.44
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	111,797,448.24	2,343,240.20	114,140,688.44
本期利润	10,260,783.41	-215,554.84	10,045,228.57
本期基金份额交易产生的变动数	-8,169,049.61	-406,839.71	-8,575,889.32
其中：基金申购款	9,545,518.94	38,616.99	9,584,135.93
基金赎回款	-17,714,568.55	-445,456.70	-18,160,025.25
本期已分配利润	-	-	-
本期末	113,889,182.04	1,720,845.65	115,610,027.69

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	33,844.22
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	568.93
其他	260.96
合计	34,674.11

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 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收	9,945,317.65

入	
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	9,945,317.65

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	295,190,157.30
减：卖出股票成本总额	284,797,402.88
减：交易费用	447,436.77
买卖股票差价收入	9,945,317.65

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
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,571,269.38
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	1,571,269.38

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-215,554.84
股票投资	-215,554.84
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	-215,554.84

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	16,394.04
基金转换费收入	113.31
合计	16,507.35

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	12,396.69
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费用	1,694.86
合计	73,598.92

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	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构

司”)	
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人、基金代销机构
国信证券股份有限公司(“国信证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	1,901,385.38	0.33	22,201,457.77	3.43

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	-	-	8,761,000.00	32.02

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	857.40	0.33	-	-

关联方名称	上年度可比期间 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	20,453.68	3.50	16,307.45	5.42

注：1. 上述佣金按协议约定的佣金率计算，以扣除证管费、经手费等费用后的净额列示。佣金率由协议签订方参考市场价格确定。佣金协议的服务范围符合《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》相关要求。

2. 根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,057,188.11	1,040,950.91
其中：应支付销售机构的客户维护费	340,406.78	327,114.22
应支付基金管理人的净管理费	716,781.33	713,836.69

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	176,198.05	173,491.80

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累

计至每月月底，按月支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：无。

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

注：无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2012 年 4 月 16 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	7,384,785.82	7,384,785.82
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	7,384,785.82	7,384,785.82
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	12.4450%	10.6373%

注：本基金管理人投资本基金的费率标准与其他相同条件的投资者适用的费率标准相一致。

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	22,539,338.49	33,844.22	23,742,771.24	36,990.52

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 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
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 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	198	14,347.08

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（2025 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
001335	信凯科技	2025 年 4 月 2 日	6 个月	新股流通受限	12.80	28.05	80	1,024.00	2,244.00	-
001356	富岭股份	2025 年 1 月 16 日	6 个月	新股流通受限	5.30	14.44	358	1,897.40	5,169.52	-
001382	新	2025	6 个月	新股	7.40	20.21	366	2,708.40	7,396.86	-

	亚电 缆	年 3 月 13 日		流通 受限						
001388	信通 电子	2025 年 6 月 24 日	1 个月 内 (含)	新股 未上 市	16.42	16.42	824	13,530.08	13,530.08	-
001388	信通 电子	2025 年 6 月 24 日	6 个月	新股 流通 受限	16.42	16.42	92	1,510.64	1,510.64	-
001395	亚联 机械	2025 年 1 月 20 日	6 个月	新股 流通 受限	19.08	47.25	80	1,526.40	3,780.00	-
301173	毓恬 冠佳	2025 年 2 月 24 日	6 个月	新股 流通 受限	28.33	44.98	121	3,427.93	5,442.58	-
301275	汉朔 科技	2025 年 3 月 4 日	6 个月	新股 流通 受限	27.50	56.19	156	4,290.00	8,765.64	-
301458	钧崑 电子	2025 年 1 月 2 日	6 个月	新股 流通 受限	10.40	34.11	393	4,087.20	13,405.23	-
301479	弘景 光电	2025 年 3 月 6 日	6 个月	新股 流通 受限	41.90	77.87	132	3,938.60	10,278.84	弘景 光电 于 2025 年 5 月 28 日 每 10 股 送 4 股
301501	恒鑫 生活	2025 年 3 月 11 日	6 个月	新股 流通 受限	39.92	45.22	141	3,872.24	6,376.02	恒鑫 生活 于 2025 年 6 月 6 日 每

										10 股 送 4.5 股
301535	浙江华远	2025 年 3 月 18 日	6 个月	新股 流通 受限	4.92	18.99	734	3,611.28	13,938.66	-
301560	众捷汽车	2025 年 4 月 17 日	6 个月	新股 流通 受限	16.50	27.45	185	3,052.50	5,078.25	-
301590	优优绿能	2025 年 5 月 28 日	6 个月	新股 流通 受限	89.60	139.48	37	3,315.20	5,160.76	-
301595	太力科技	2025 年 5 月 12 日	6 个月	新股 流通 受限	17.05	29.10	193	3,290.65	5,616.30	-
301601	惠通科技	2025 年 1 月 8 日	6 个月	新股 流通 受限	11.80	33.85	342	4,035.60	11,576.70	-
301602	超研股份	2025 年 1 月 15 日	6 个月	新股 流通 受限	6.70	24.80	508	3,403.60	12,598.40	-
301636	泽润新能	2025 年 4 月 30 日	6 个月	新股 流通 受限	33.06	47.46	101	3,339.06	4,793.46	-
301658	首航新能	2025 年 3 月 26 日	6 个月	新股 流通 受限	11.80	22.98	370	4,366.00	8,502.60	-
301662	宏工科技	2025 年 4 月 10 日	6 个月	新股 流通 受限	26.60	82.50	141	3,750.60	11,632.50	-
301665	泰禾股份	2025 年 4 月 2 日	6 个月	新股 流通 受限	10.27	22.39	393	4,036.11	8,799.27	-
301678	新	2025	6 个月	新股	12.80	44.54	247	3,161.60	11,001.38	-

	恒汇	年 6 月 13 日		流通受限						
603014	威高血净	2025 年 5 月 12 日	6 个月	新股流通受限	26.50	32.68	82	2,173.00	2,679.76	-
603072	天和磁材	2024 年 12 月 24 日	6 个月	新股流通受限	12.30	54.45	97	1,193.10	5,281.65	-
603120	肯特催化	2025 年 4 月 9 日	6 个月	新股流通受限	15.00	33.43	65	975.00	2,172.95	-
603124	江南新材	2025 年 3 月 12 日	6 个月	新股流通受限	10.54	46.31	88	927.52	4,075.28	-
603202	天有为	2025 年 4 月 16 日	6 个月	新股流通受限	93.50	90.66	25	2,337.50	2,266.50	-
603210	泰鸿万立	2025 年 4 月 1 日	6 个月	新股流通受限	8.60	15.61	242	2,081.20	3,777.62	-
603257	中国瑞林	2025 年 3 月 28 日	6 个月	新股流通受限	20.52	37.47	69	1,415.88	2,585.43	-
603271	永杰新材	2025 年 3 月 4 日	6 个月	新股流通受限	20.60	35.08	77	1,586.20	2,701.16	-
603382	海阳科技	2025 年 6 月 5 日	6 个月	新股流通受限	11.50	22.39	105	1,207.50	2,350.95	-
603400	华之杰	2025 年 6 月 12 日	6 个月	新股流通受限	19.88	43.81	57	1,133.16	2,497.17	-
603409	汇	2025	6 个月	新股	24.18	33.32	61	1,474.98	2,032.52	-

	通 控 股	年 2 月 25 日		流通 受限						
688411	海 博 思 创	2025 年 1 月 20 日	6 个月	新股 流通 受限	19.38	83.49	306	5,930.28	25,547.94	-
688545	兴 福 电 子	2025 年 1 月 15 日	6 个月	新股 流通 受限	11.68	26.95	402	4,695.36	10,833.90	-
688583	思 看 科 技	2025 年 1 月 8 日	6 个月	新股 流通 受限	33.46	79.68	186	4,784.78	14,820.48	思看 科技 于 2025 年 6 月 19 日 每 10 股 送 3 股
688755	汉 邦 科 技	2025 年 5 月 9 日	6 个月	新股 流通 受限	22.77	39.33	203	4,622.31	7,983.99	-
688757	胜 科 纳 米	2025 年 3 月 18 日	6 个月	新股 流通 受限	9.08	25.94	536	4,866.88	13,903.84	-
688758	赛 分 科 技	2025 年 1 月 2 日	6 个月	新股 流通 受限	4.32	16.97	777	3,356.64	13,185.69	-
688775	影 石 创 新	2025 年 6 月 4 日	6 个月	新股 流通 受限	47.27	124.16	133	6,286.91	16,513.28	-

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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300950	德固特	2025 年 6 月 30 日	重大事项	22.27	2025 年 7 月 14 日	26.72	329	1,841.79	7,326.83	-

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、货币市场工具、权证、资产支持证券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的相关规定）。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 85%—95%；债券、货币市场工具、权证及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他资产不高于基金资产的 15%；基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；基金保留的现金或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，其它金融工具的投资比例符合相关法律法规和监管机构的规定。若法律法规或监管机构允许，本基金在履行适当程序后，可调整上述投资比例，或将法律法规或监管机构以后允许基金投资的其它品种纳入投资范围。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同责任，或者基金所投资证券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

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

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

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

于 2025 年 06 月 30 日，本基金未持有信用类债券（2024 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 2025 年 06 月 30 日，本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要

求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司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 2025 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	22,539,338.49	-	-	-	22,539,338.49
结算备付金	350,510.61	-	-	-	350,510.61
存出保证金	56,064.29	-	-	-	56,064.29
交易性金融资产	-	-	-	156,287,130.73	156,287,130.73
应收申购款	-	-	-	9,835.04	9,835.04
应收清算款	-	-	-	120,814.40	120,814.40
资产总计	22,945,913.39	-	-	156,417,780.17	179,363,693.56
负债					
应付赎回款	-	-	-	248,946.07	248,946.07
应付管理人报酬	-	-	-	174,557.11	174,557.11
应付托管费	-	-	-	29,092.86	29,092.86
应付清算款	-	-	-	3,741,082.70	3,741,082.70
其他负债	-	-	-	220,597.60	220,597.60
负债总计	-	-	-	4,414,276.34	4,414,276.34
利率敏感度缺口	22,945,913.39	-	-	152,003,503.83	174,949,417.22
上年度末 2024 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	23,172,031.79	-	-	-	23,172,031.79
结算备付金	303,296.43	-	-	-	303,296.43
存出保证金	45,884.13	-	-	-	45,884.13
交易性金融资产	-	-	-	153,130,515.15	153,130,515.15
应收申购款	-	-	-	29,198.44	29,198.44
应收清算款	-	-	-	3,006,021.42	3,006,021.42
资产总计	23,521,212.35	-	-	156,165,735.01	179,686,947.36
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,230,687.80	1,230,687.80
应付管理人报酬	-	-	-	185,785.88	185,785.88
应付托管费	-	-	-	30,964.32	30,964.32
其他负债	-	-	-	300,758.70	300,758.70
负债总计	-	-	-	1,748,196.70	1,748,196.70
利率敏感度缺口	23,521,212.35	-	-	154,417,538.31	177,938,750.66

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 2025 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 85%—95%；债券、货币市场工具、权证及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他资产不高于基金资产的 15%；基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；基金保留的现金或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，其它金融工具的投资比例符合相关法律法规和监管机构的规定。

若法律法规或监管机构允许，本基金在履行适当程序后，可调整上述投资比例，或将法律法规或监管机构以后允许基金投资的其它品种纳入投资范围。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 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024 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	156,287,130.73	89.33	153,130,515.15	86.06
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	156,287,130.73	89.33	153,130,515.15	86.06

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（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	比较基准上涨 5% 资产净值变动	8,621,507.28	9,194,095.25
	比较基准下降 5% 资产净值变动	-8,621,507.28	-9,194,095.25

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 2025 年 6 月 30 日
第一层次	155,967,996.10
第二层次	22,367.55
第三层次	296,767.08
合计	156,287,130.73

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	156,287,130.73	87.13
	其中：股票	156,287,130.73	87.13
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	22,889,849.10	12.76
8	其他各项资产	186,713.73	0.10
9	合计	179,363,693.56	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	1,278,959.50	0.73
B	采矿业	15,542,590.00	8.88
C	制造业	86,537,305.32	49.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,132,179.80	1.22
E	建筑业	5,820,911.26	3.33
F	批发和零售业	46,821.91	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	1,702,770.70	0.97
H	住宿和餐饮业	3,657.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,531,079.06	5.45
J	金融业	25,797,614.05	14.75
K	房地产业	7,539,375.00	4.31
L	租赁和商务服务业	12,134.00	0.01
M	科学研究和技术服务业	129,944.79	0.07
N	水利、环境和公共设施管理业	23,746.82	0.01

0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	3,067.20	0.00
R	文化、体育和娱乐业	182,648.32	0.10
S	综合	2,326.00	0.00
	合计	156,287,130.73	89.33

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	601288	农业银行	1,485,000	8,731,800.00	4.99
2	000651	格力电器	114,500	5,143,340.00	2.94
3	603129	春风动力	18,500	4,005,250.00	2.29
4	002648	卫星化学	221,567	3,839,756.11	2.19
5	601668	中国建筑	656,200	3,786,274.00	2.16
6	601088	中国神华	93,200	3,778,328.00	2.16
7	002463	沪电股份	81,700	3,478,786.00	1.99
8	002294	信立泰	63,200	2,991,256.00	1.71
9	601899	紫金矿业	152,200	2,967,900.00	1.70
10	688347	华虹公司	53,329	2,928,295.39	1.67
11	002371	北方华创	6,600	2,918,586.00	1.67
12	600031	三一重工	160,200	2,875,590.00	1.64
13	300750	宁德时代	11,397	2,874,551.34	1.64
14	601601	中国太保	74,700	2,801,997.00	1.60
15	688063	派能科技	61,049	2,752,088.92	1.57
16	601318	中国平安	49,500	2,746,260.00	1.57
17	600030	中信证券	99,100	2,737,142.00	1.56
18	601728	中国电信	349,900	2,711,725.00	1.55
19	002171	楚江新材	278,239	2,707,265.47	1.55
20	601818	光大银行	650,700	2,700,405.00	1.54
21	300408	三环集团	80,800	2,698,720.00	1.54
22	600050	中国联通	472,400	2,522,616.00	1.44
23	600383	金地集团	665,300	2,521,487.00	1.44
24	600028	中国石化	412,800	2,328,192.00	1.33
25	600066	宇通客车	91,600	2,277,176.00	1.30
26	300308	中际旭创	15,300	2,231,658.00	1.28
27	603596	伯特利	42,100	2,218,249.00	1.27
28	300850	新强联	60,100	2,152,782.00	1.23
29	603986	兆易创新	16,500	2,087,745.00	1.19

30	600027	华电国际	371,800	2,033,746.00	1.16
31	601688	华泰证券	111,900	1,992,939.00	1.14
32	600938	中国海油	76,100	1,986,971.00	1.14
33	600039	四川路桥	198,500	1,965,150.00	1.12
34	300926	博俊科技	73,745	1,952,030.15	1.12
35	603993	洛阳钼业	226,700	1,908,814.00	1.09
36	600731	湖南海利	257,500	1,877,175.00	1.07
37	601988	中国银行	331,600	1,863,592.00	1.07
38	000951	中国重汽	105,800	1,859,964.00	1.06
39	002170	芭田股份	181,300	1,858,325.00	1.06
40	001979	招商蛇口	185,500	1,626,835.00	0.93
41	688209	英集芯	85,964	1,587,755.08	0.91
42	000932	华菱钢铁	360,100	1,584,440.00	0.91
43	600760	中航沈飞	25,600	1,500,672.00	0.86
44	600426	华鲁恒升	68,600	1,486,562.00	0.85
45	000425	徐工机械	191,000	1,484,070.00	0.85
46	601898	中煤能源	130,800	1,430,952.00	0.82
47	600048	保利发展	176,600	1,430,460.00	0.82
48	600519	贵州茅台	1,000	1,409,520.00	0.81
49	600782	新钢股份	391,100	1,384,494.00	0.79
50	600557	康缘药业	92,800	1,371,584.00	0.78
51	300401	花园生物	86,100	1,309,581.00	0.75
52	002714	牧原股份	29,900	1,256,099.00	0.72
53	603799	华友钴业	30,300	1,121,706.00	0.64
54	600547	山东黄金	34,800	1,111,164.00	0.64
55	301608	博实结	12,400	1,104,592.00	0.63
56	688365	光云科技	71,844	1,093,465.68	0.63
57	601211	国泰海通	54,600	1,046,136.00	0.60
58	601155	新城控股	74,800	1,023,264.00	0.58
59	688361	中科飞测	11,681	983,423.39	0.56
60	688018	乐鑫科技	6,721	981,938.10	0.56
61	002244	滨江集团	96,000	936,000.00	0.54
62	600595	中孚实业	211,000	924,180.00	0.53
63	688630	芯碁微装	11,298	896,722.26	0.51
64	002602	ST 华通	79,800	884,184.00	0.51
65	603063	禾望电气	26,100	883,746.00	0.51
66	300682	朗新集团	37,000	869,500.00	0.50
67	601519	大智慧	84,700	863,093.00	0.49
68	002851	麦格米特	17,200	862,408.00	0.49
69	688981	中芯国际	9,590	845,550.30	0.48
70	601919	中远海控	56,000	842,240.00	0.48
71	600346	恒力石化	58,000	827,080.00	0.47
72	688266	泽璟制药-U	7,499	806,217.49	0.46

73	000338	潍柴动力	50,800	781,304.00	0.45
74	000725	京东方 A	190,300	759,297.00	0.43
75	000737	北方铜业	68,300	741,738.00	0.42
76	601872	招商轮船	94,500	591,570.00	0.34
77	688518	联赢激光	24,494	499,432.66	0.29
78	600486	扬农化工	6,500	377,000.00	0.22
79	600026	中远海能	23,300	240,689.00	0.14
80	601900	南方传媒	10,000	156,400.00	0.09
81	301662	宏工科技	1,403	145,177.34	0.08
82	688256	寒武纪-U	203	122,104.50	0.07
83	301665	泰禾股份	3,922	116,292.61	0.07
84	301658	首航新能	3,699	110,536.45	0.06
85	301479	弘景光电	1,312	109,398.84	0.06
86	600104	上汽集团	6,400	102,720.00	0.06
87	688213	思特威-W	899	91,895.78	0.05
88	601963	重庆银行	8,200	89,052.00	0.05
89	688525	佰维存储	1,295	87,283.00	0.05
90	600036	招商银行	1,800	82,710.00	0.05
91	600933	爱柯迪	5,100	81,651.00	0.05
92	688757	胜科纳米	2,752	76,528.00	0.04
93	600309	万华化学	1,400	75,964.00	0.04
94	603606	东方电缆	1,400	72,394.00	0.04
95	600141	兴发集团	3,400	69,802.00	0.04
96	601336	新华保险	1,000	58,500.00	0.03
97	601138	工业富联	2,500	53,450.00	0.03
98	601799	星宇股份	400	50,000.00	0.03
99	603296	华勤技术	595	48,004.60	0.03
100	603699	纽威股份	1,500	46,755.00	0.03
101	601998	中信银行	5,500	46,750.00	0.03
102	600459	贵研铂业	3,000	46,530.00	0.03
103	600073	光明肉业	6,200	45,756.00	0.03
104	603893	瑞芯微	300	45,558.00	0.03
105	605333	沪光股份	1,580	43,371.00	0.02
106	600803	新奥股份	2,200	41,580.00	0.02
107	688385	复旦微电	836	41,189.72	0.02
108	600585	海螺水泥	1,900	40,793.00	0.02
109	600584	长电科技	1,200	40,428.00	0.02
110	603337	杰克股份	1,100	39,468.00	0.02
111	688579	山大地纬	3,485	38,997.15	0.02
112	600602	云赛智联	1,900	38,323.00	0.02
113	601800	中国交建	4,300	38,227.00	0.02
114	603382	海阳科技	1,045	31,970.35	0.02
115	603400	华之杰	569	31,875.73	0.02

116	688605	先锋精科	484	30,322.60	0.02
117	688041	海光信息	213	30,094.77	0.02
118	688326	经纬恒润-W	327	29,181.48	0.02
119	603766	隆鑫通用	2,250	28,710.00	0.02
120	688411	海博思创	306	25,547.94	0.01
121	601166	兴业银行	800	18,672.00	0.01
122	300502	新易盛	140	17,782.80	0.01
123	688775	影石创新	133	16,513.28	0.01
124	301357	北方长龙	160	15,273.60	0.01
125	001388	信通电子	916	15,040.72	0.01
126	688583	思看科技	186	14,820.48	0.01
127	301535	浙江华远	734	13,938.66	0.01
128	301345	涛涛车业	128	13,836.80	0.01
129	301458	钧崑电子	393	13,405.23	0.01
130	688758	赛分科技	777	13,185.69	0.01
131	301602	超研股份	508	12,598.40	0.01
132	605580	恒盛能源	916	12,448.44	0.01
133	001222	源飞宠物	608	11,989.76	0.01
134	301132	满坤科技	339	11,959.92	0.01
135	301421	波长光电	147	11,758.53	0.01
136	300803	指南针	145	11,695.70	0.01
137	301601	惠通科技	342	11,576.70	0.01
138	001296	长江材料	564	11,483.04	0.01
139	603533	掌阅科技	500	11,155.00	0.01
140	688359	三孚新科	211	11,128.14	0.01
141	301678	新恒汇	247	11,001.38	0.01
142	301200	大族数控	256	10,872.32	0.01
143	688545	兴福电子	402	10,833.90	0.01
144	002557	洽洽食品	500	10,810.00	0.01
145	301298	东利机械	640	10,572.80	0.01
146	688720	艾森股份	247	10,569.13	0.01
147	688680	海优新材	238	10,519.60	0.01
148	601975	招商南油	3,600	10,512.00	0.01
149	301382	蜂助手	264	10,494.00	0.01
150	688800	瑞可达	213	10,479.60	0.01
151	301050	雷电微力	196	10,446.80	0.01
152	688478	晶升股份	339	10,373.40	0.01
153	001268	联合精密	409	10,351.79	0.01
154	301217	铜冠铜箔	824	10,308.24	0.01
155	300962	中金辐照	576	10,212.48	0.01
156	300904	威力传动	188	10,208.40	0.01
157	601390	中国中铁	1,800	10,098.00	0.01
158	301413	安培龙	132	10,091.40	0.01

159	301318	维海德	296	10,016.64	0.01
160	301270	汉仪股份	210	10,008.60	0.01
161	301138	华研精机	285	9,892.35	0.01
162	001376	百通能源	804	9,840.96	0.01
163	688707	振华新材	716	9,701.80	0.01
164	300952	恒辉安防	340	9,683.20	0.01
165	300570	太辰光	100	9,638.00	0.01
166	301272	英华特	268	9,621.20	0.01
167	603162	海通发展	1,146	9,569.10	0.01
168	301516	中远通	569	9,502.30	0.01
169	001313	粤海饲料	1,232	9,486.40	0.01
170	688648	中邮科技	201	9,481.17	0.01
171	301359	东南电子	459	9,450.81	0.01
172	301517	陕西华达	232	9,440.08	0.01
173	301007	德迈仕	303	9,389.97	0.01
174	300967	晓鸣股份	507	9,379.50	0.01
175	301048	金鹰重工	843	9,239.28	0.01
176	603176	汇通集团	1,924	9,235.20	0.01
177	605020	永和股份	400	9,216.00	0.01
178	001230	劲旅环境	450	9,211.50	0.01
179	001266	宏英智能	346	9,151.70	0.01
180	603280	南方路机	363	9,143.97	0.01
181	603305	旭升集团	700	9,135.00	0.01
182	605566	福莱蒾特	435	9,069.75	0.01
183	601928	凤凰传媒	800	8,936.00	0.01
184	603213	镇洋发展	799	8,924.83	0.01
185	300975	商络电子	738	8,915.04	0.01
186	301367	瑞迈特	106	8,914.60	0.01
187	301297	富乐德	215	8,885.95	0.01
188	001331	胜通能源	906	8,860.68	0.01
189	603341	龙旗科技	218	8,857.34	0.01
190	300073	当升科技	200	8,774.00	0.01
191	301275	汉朔科技	156	8,765.64	0.01
192	688053	思科瑞	280	8,660.40	0.00
193	000059	华锦股份	1,600	8,624.00	0.00
194	688435	英方软件	261	8,597.34	0.00
195	300056	中创环保	600	8,580.00	0.00
196	688351	微电生理	435	8,569.50	0.00
197	688721	龙图光罩	189	8,523.90	0.00
198	301488	豪恩汽电	120	8,496.00	0.00
199	300602	飞荣达	400	8,484.00	0.00
200	301358	湖南裕能	271	8,452.49	0.00
201	001299	美能能源	749	8,418.76	0.00

202	300996	普联软件	560	8,416.80	0.00
203	603220	中贝通信	390	8,373.30	0.00
204	301348	蓝箭电子	355	8,353.15	0.00
205	603348	文灿股份	400	8,352.00	0.00
206	688443	智翔金泰-U	295	8,183.30	0.00
207	001368	通达创智	351	8,167.77	0.00
208	001278	一彬科技	473	8,159.25	0.00
209	001219	青岛食品	598	8,144.76	0.00
210	688755	汉邦科技	203	7,983.99	0.00
211	301526	国际复材	2,191	7,975.24	0.00
212	600566	济川药业	300	7,899.00	0.00
213	001366	播恩集团	645	7,875.45	0.00
214	301261	恒工精密	108	7,872.12	0.00
215	600546	山煤国际	900	7,857.00	0.00
216	301153	中科江南	299	7,833.80	0.00
217	603282	亚光股份	457	7,782.71	0.00
218	300981	中红医疗	640	7,660.80	0.00
219	603556	海兴电力	300	7,641.00	0.00
220	300045	华力创通	400	7,636.00	0.00
221	000521	长虹美菱	1,100	7,634.00	0.00
222	301319	唯特偶	212	7,632.00	0.00
223	301428	世纪恒通	184	7,630.48	0.00
224	688281	华秦科技	126	7,624.26	0.00
225	605088	冠盛股份	200	7,584.00	0.00
226	605577	龙版传媒	588	7,561.68	0.00
227	300987	川网传媒	391	7,554.12	0.00
228	301268	铭利达	406	7,531.30	0.00
229	001382	新亚电缆	366	7,396.86	0.00
230	301585	蓝宇股份	214	7,340.20	0.00
231	301116	益客食品	664	7,337.20	0.00
232	300950	德固特	329	7,326.83	0.00
233	002028	思源电气	100	7,291.00	0.00
234	301508	中机认检	215	7,267.00	0.00
235	300573	兴齐眼药	140	7,250.60	0.00
236	000837	秦川机床	600	7,212.00	0.00
237	301193	家联科技	461	7,177.77	0.00
238	001234	泰慕士	333	7,136.19	0.00
239	001391	国货航	1,060	7,133.80	0.00
240	600406	国电南瑞	312	6,991.92	0.00
241	688562	航天软件	372	6,971.28	0.00
242	301151	冠龙节能	399	6,962.55	0.00
243	300982	苏文电能	380	6,836.20	0.00
244	301282	金禄电子	274	6,792.46	0.00

245	603395	红四方	200	6,746.00	0.00
246	301159	三维天地	200	6,710.00	0.00
247	301631	壹连科技	81	6,690.60	0.00
248	688692	达梦数据	30	6,686.70	0.00
249	300548	长芯博创	100	6,677.00	0.00
250	002843	泰嘉股份	300	6,657.00	0.00
251	301158	德石股份	383	6,656.54	0.00
252	600975	新五丰	1,100	6,655.00	0.00
253	301172	君逸数码	321	6,628.65	0.00
254	300661	圣邦股份	91	6,622.07	0.00
255	300978	东箭科技	593	6,617.88	0.00
256	002049	紫光国微	100	6,586.00	0.00
257	301206	三元生物	228	6,568.68	0.00
258	002833	弘亚数控	400	6,544.00	0.00
259	003021	兆威机电	60	6,489.00	0.00
260	301501	恒鑫生活	141	6,376.02	0.00
261	301617	博苑股份	155	6,362.75	0.00
262	002997	瑞鹄模具	172	6,338.20	0.00
263	301565	中仑新材	229	6,320.40	0.00
264	301533	威马农机	167	6,272.52	0.00
265	002819	东方中科	200	6,260.00	0.00
266	301259	艾布鲁	128	6,256.64	0.00
267	301489	思泉新材	108	6,208.92	0.00
268	688308	欧科亿	336	6,199.20	0.00
269	603291	联合水务	536	6,196.16	0.00
270	002400	省广集团	800	6,112.00	0.00
271	688248	南网科技	193	6,071.78	0.00
272	688523	航天环宇	280	6,022.80	0.00
273	301391	卡莱特	140	5,992.00	0.00
274	688253	英诺特	192	5,925.12	0.00
275	300943	春晖智控	383	5,925.01	0.00
276	301313	凡拓数创	241	5,856.30	0.00
277	002918	蒙娜丽莎	700	5,810.00	0.00
278	603065	宿迁联盛	581	5,792.57	0.00
279	301383	天键股份	140	5,779.20	0.00
280	301002	崧盛股份	261	5,770.71	0.00
281	603193	润本股份	183	5,748.03	0.00
282	600011	华能国际	800	5,712.00	0.00
283	301459	丰茂股份	134	5,681.60	0.00
284	688530	欧莱新材	344	5,665.68	0.00
285	603391	力聚热能	145	5,663.70	0.00
286	688066	航天宏图	288	5,639.04	0.00
287	603231	索宝蛋白	344	5,634.72	0.00

288	301381	赛维时代	282	5,625.90	0.00
289	301595	太力科技	193	5,616.30	0.00
290	301269	华大九天	45	5,574.60	0.00
291	603350	安乃达	158	5,534.74	0.00
292	688620	安凯微	442	5,529.42	0.00
293	301370	国科恒泰	519	5,527.35	0.00
294	603052	可川科技	196	5,521.32	0.00
295	688512	慧智微-U	504	5,498.64	0.00
296	301166	优宁维	179	5,475.61	0.00
297	301173	毓恬冠佳	121	5,442.58	0.00
298	301591	肯特股份	141	5,421.45	0.00
299	300781	因赛集团	100	5,412.00	0.00
300	002414	高德红外	520	5,330.00	0.00
301	688136	科兴制药	139	5,312.58	0.00
302	688085	三友医疗	276	5,307.48	0.00
303	603072	天和磁材	97	5,281.65	0.00
304	301179	泽宇智能	346	5,279.96	0.00
305	002840	华统股份	500	5,205.00	0.00
306	002169	智光电气	800	5,176.00	0.00
307	001356	富岭股份	358	5,169.52	0.00
308	688019	安集科技	34	5,161.20	0.00
309	301590	优优绿能	37	5,160.76	0.00
310	300395	菲利华	100	5,110.00	0.00
311	301560	众捷汽车	185	5,078.25	0.00
312	688456	有研粉材	141	5,068.95	0.00
313	301507	民生健康	349	5,063.99	0.00
314	301558	三态股份	561	5,054.61	0.00
315	688667	菱电电控	93	4,948.53	0.00
316	603205	健尔康	128	4,944.64	0.00
317	601952	苏垦农发	500	4,935.00	0.00
318	300627	华测导航	140	4,900.00	0.00
319	301221	光庭信息	94	4,885.18	0.00
320	688035	德邦科技	120	4,874.40	0.00
321	605138	盛泰集团	723	4,844.10	0.00
322	301636	泽润新能	101	4,793.46	0.00
323	605555	德昌股份	286	4,739.02	0.00
324	002929	润建股份	100	4,726.00	0.00
325	688584	上海合晶	263	4,702.44	0.00
326	000988	华工科技	100	4,701.00	0.00
327	300611	美力科技	200	4,658.00	0.00
328	603979	金诚信	100	4,644.00	0.00
329	301580	爱迪特	112	4,640.16	0.00
330	603194	中力股份	101	4,584.39	0.00

331	688693	锆威特	138	4,555.38	0.00
332	301568	思泰克	119	4,527.95	0.00
333	301062	上海艾录	523	4,518.72	0.00
334	301025	读客文化	403	4,433.00	0.00
335	601096	宏盛华源	1,062	4,396.68	0.00
336	002345	潮宏基	300	4,389.00	0.00
337	002837	英维克	147	4,367.37	0.00
338	301100	风光股份	248	4,320.16	0.00
339	688539	高华科技	161	4,282.60	0.00
340	301220	亚香股份	95	4,265.50	0.00
341	301502	华阳智能	105	4,264.05	0.00
342	301115	联检科技	275	4,259.75	0.00
343	300942	易瑞生物	443	4,243.94	0.00
344	688119	中钢洛耐	1,015	4,242.70	0.00
345	002472	双环传动	126	4,219.74	0.00
346	301325	曼恩斯特	67	4,174.10	0.00
347	301187	欧圣电气	148	4,084.80	0.00
348	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00
349	000550	江铃汽车	200	4,066.00	0.00
350	301555	惠柏新材	147	4,046.91	0.00
351	300958	建工修复	300	3,951.00	0.00
352	300979	华利集团	75	3,942.75	0.00
353	300774	倍杰特	444	3,885.00	0.00
354	688516	奥特维	115	3,822.60	0.00
355	003038	鑫铂股份	196	3,820.04	0.00
356	600025	华能水电	400	3,820.00	0.00
357	001395	亚联机械	80	3,780.00	0.00
358	603210	泰鸿万立	242	3,777.62	0.00
359	002384	东山精密	100	3,777.00	0.00
360	688695	中创股份	127	3,771.90	0.00
361	002459	晶澳科技	376	3,752.48	0.00
362	688722	同益中	176	3,743.52	0.00
363	301155	海力风电	52	3,738.80	0.00
364	300229	拓尔思	200	3,688.00	0.00
365	301487	盟固利	167	3,645.61	0.00
366	000831	中国稀土	100	3,612.00	0.00
367	301152	天力锂能	122	3,569.72	0.00
368	000915	华特达因	100	3,535.00	0.00
369	300342	天银机电	200	3,528.00	0.00
370	688425	铁建重工	861	3,512.88	0.00
371	600508	上海能源	300	3,510.00	0.00
372	300766	每日互动	100	3,494.00	0.00
373	301376	致欧科技	189	3,449.25	0.00

374	603666	亿嘉和	100	3,424.00	0.00
375	301418	协昌科技	92	3,361.68	0.00
376	600570	恒生电子	100	3,354.00	0.00
377	688255	凯尔达	99	3,335.31	0.00
378	002250	联化科技	300	3,300.00	0.00
379	002487	大金重工	100	3,290.00	0.00
380	301349	信德新材	84	3,281.88	0.00
381	300890	翔丰华	100	3,269.00	0.00
382	300049	福瑞股份	100	3,243.00	0.00
383	002601	龙佰集团	200	3,242.00	0.00
384	000920	沃顿科技	300	3,240.00	0.00
385	688419	耐科装备	84	3,131.52	0.00
386	300855	图南股份	130	3,091.40	0.00
387	605296	神农集团	100	3,074.00	0.00
388	301267	华夏眼科	160	3,067.20	0.00
389	301170	锡南科技	113	3,025.01	0.00
390	002041	登海种业	300	2,937.00	0.00
391	600489	中金黄金	200	2,926.00	0.00
392	301091	深城交	100	2,924.00	0.00
393	600511	国药股份	100	2,916.00	0.00
394	600522	中天科技	200	2,892.00	0.00
395	300596	利安隆	100	2,877.00	0.00
396	688353	华盛锂电	86	2,844.88	0.00
397	301021	英诺激光	90	2,831.40	0.00
398	300552	万集科技	100	2,784.00	0.00
399	000902	新洋丰	200	2,766.00	0.00
400	688247	宣泰医药	267	2,758.11	0.00
401	601808	中海油服	200	2,752.00	0.00
402	300814	中富电路	80	2,732.80	0.00
403	688223	晶科能源	523	2,714.37	0.00
404	601012	隆基绿能	180	2,703.60	0.00
405	603271	永杰新材	77	2,701.16	0.00
406	603014	威高血净	82	2,679.76	0.00
407	002606	大连电瓷	300	2,676.00	0.00
408	600845	宝信软件	113	2,669.06	0.00
409	002858	力盛体育	200	2,664.00	0.00
410	002050	三花智控	100	2,638.00	0.00
411	002179	中航光电	65	2,623.40	0.00
412	603257	中国瑞林	69	2,585.43	0.00
413	000921	海信家电	100	2,570.00	0.00
414	002568	百润股份	100	2,561.00	0.00
415	002876	三利谱	100	2,519.00	0.00
416	301219	腾远钴业	47	2,496.64	0.00

417	600988	赤峰黄金	100	2,488.00	0.00
418	688148	芳源股份	457	2,472.37	0.00
419	600223	福瑞达	300	2,466.00	0.00
420	688141	杰华特	75	2,443.50	0.00
421	300327	中颖电子	100	2,422.00	0.00
422	688575	亚辉龙	166	2,421.94	0.00
423	001311	多利科技	117	2,418.39	0.00
424	001378	德冠新材	108	2,394.36	0.00
425	603130	云中马	80	2,360.80	0.00
426	600673	东阳光	200	2,326.00	0.00
427	301286	侨源股份	93	2,324.07	0.00
428	300252	金信诺	200	2,296.00	0.00
429	603202	天有为	25	2,266.50	0.00
430	301337	亚华电子	77	2,249.17	0.00
431	300752	隆利科技	100	2,248.00	0.00
432	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00
433	600754	锦江酒店	100	2,244.00	0.00
434	301377	鼎泰高科	62	2,229.52	0.00
435	300693	盛弘股份	73	2,187.08	0.00
436	603120	肯特催化	65	2,172.95	0.00
437	688231	隆达股份	120	2,166.00	0.00
438	000948	南天信息	100	2,115.00	0.00
439	603273	天元智能	120	2,078.40	0.00
440	601456	国联民生	200	2,070.00	0.00
441	603409	汇通控股	61	2,032.52	0.00
442	601838	成都银行	100	2,010.00	0.00
443	300113	顺网科技	100	1,976.00	0.00
444	603172	万丰股份	120	1,911.60	0.00
445	600446	金证股份	100	1,897.00	0.00
446	002456	欧菲光	160	1,896.00	0.00
447	300986	志特新材	147	1,852.20	0.00
448	001324	长青科技	94	1,851.80	0.00
449	600820	隧道股份	300	1,830.00	0.00
450	688268	华特气体	36	1,813.32	0.00
451	002709	天赐材料	100	1,812.00	0.00
452	301046	能辉科技	90	1,786.50	0.00
453	300499	高澜股份	100	1,780.00	0.00
454	601881	中国银河	100	1,715.00	0.00
455	603097	江苏华辰	77	1,682.45	0.00
456	601168	西部矿业	100	1,663.00	0.00
457	600968	海油发展	400	1,632.00	0.00
458	301039	中集车辆	200	1,626.00	0.00
459	300862	蓝盾光电	60	1,588.80	0.00

460	000426	兴业银锡	100	1,580.00	0.00
461	688276	百克生物	75	1,575.00	0.00
462	600746	江苏索普	200	1,562.00	0.00
463	001269	欧晶科技	60	1,536.00	0.00
464	000913	钱江摩托	100	1,500.00	0.00
465	301150	中一科技	69	1,480.74	0.00
466	600216	浙江医药	100	1,479.00	0.00
467	601133	柏诚股份	116	1,474.36	0.00
468	600258	首旅酒店	100	1,413.00	0.00
469	600866	星湖科技	200	1,382.00	0.00
470	301133	金钟股份	60	1,360.80	0.00
471	600684	珠江股份	300	1,329.00	0.00
472	688678	福立旺	69	1,313.76	0.00
473	002756	永兴材料	40	1,270.00	0.00
474	603048	浙江黎明	64	1,258.24	0.00
475	000719	中原传媒	100	1,241.00	0.00
476	600188	兖矿能源	100	1,217.00	0.00
477	301277	新天地	84	1,207.08	0.00
478	002871	伟隆股份	100	1,113.00	0.00
479	300525	博思软件	76	1,106.56	0.00
480	301052	果麦文化	27	1,101.60	0.00
481	301012	扬电科技	53	1,054.70	0.00
482	688591	泰凌微	21	1,005.90	0.00
483	688292	浩瀚深度	51	981.24	0.00
484	002668	TCL 智家	100	977.00	0.00
485	002387	维信诺	100	969.00	0.00
486	000528	柳工	100	961.00	0.00
487	000690	宝新能源	200	910.00	0.00
488	300968	格林精密	62	906.44	0.00
489	301136	招标股份	72	895.68	0.00
490	300818	耐普矿机	40	882.00	0.00
491	002448	中原内配	100	837.00	0.00
492	601089	福元医药	49	817.32	0.00
493	002234	民和股份	100	815.00	0.00
494	301180	万祥科技	54	795.42	0.00
495	002334	英威腾	100	793.00	0.00
496	300993	玉马科技	49	742.84	0.00
497	002790	瑞尔特	100	727.00	0.00
498	002753	永东股份	100	716.00	0.00
499	301126	达嘉维康	62	687.58	0.00
500	301515	港通医疗	33	670.89	0.00
501	001227	兰州银行	268	670.00	0.00
502	301078	孩子王	51	666.57	0.00

503	001258	立新能源	88	646.80	0.00
504	002340	格林美	100	635.00	0.00
505	301069	凯盛新材	39	628.29	0.00
506	601179	中国西电	100	614.00	0.00
507	000785	居然智家	200	610.00	0.00
508	601083	锦江航运	52	577.72	0.00
509	300997	欢乐家	28	493.92	0.00
510	600409	三友化工	100	486.00	0.00
511	301020	密封科技	21	458.43	0.00
512	000589	贵州轮胎	100	457.00	0.00
513	601033	永兴股份	28	442.68	0.00
514	601000	唐山港	100	406.00	0.00
515	601128	常熟银行	55	405.35	0.00
516	300994	久祺股份	24	375.36	0.00
517	688377	迪威尔	15	358.05	0.00
518	301118	恒光股份	15	350.55	0.00
519	000630	铜陵有色	100	334.00	0.00
520	001239	永达股份	21	313.74	0.00
521	001330	博纳影业	64	311.04	0.00
522	688131	皓元医药	6	290.10	0.00
523	688652	京仪装备	4	229.28	0.00
524	688166	博瑞医药	4	214.84	0.00
525	603730	岱美股份	36	204.84	0.00
526	688114	华大智造	3	194.49	0.00
527	688279	峰昭科技	1	185.50	0.00
528	688627	精智达	2	176.02	0.00
529	688052	纳芯微	1	174.49	0.00
530	002724	海洋王	20	166.00	0.00
531	603208	江山欧派	10	156.80	0.00
532	301301	川宁生物	11	132.44	0.00
533	688702	盛科通信-U	2	122.16	0.00
534	688631	莱斯信息	1	89.20	0.00
535	688533	上声电子	3	80.79	0.00
536	001213	中铁特货	18	73.08	0.00
537	688628	优利德	2	67.10	0.00
538	688709	成都华微	2	65.48	0.00
539	688049	炬芯科技	1	60.50	0.00
540	000733	振华科技	1	50.05	0.00
541	688300	联瑞新材	1	46.55	0.00
542	688595	芯海科技	1	37.39	0.00
543	688401	路维光电	1	34.70	0.00
544	603135	中重科技	2	19.84	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	002463	沪电股份	5,109,453.00	2.87
2	000651	格力电器	4,926,191.00	2.77
3	002294	信立泰	4,741,952.00	2.66
4	002290	禾盛新材	4,579,098.00	2.57
5	301608	博实结	4,376,014.00	2.46
6	300750	宁德时代	4,247,739.92	2.39
7	601288	农业银行	4,229,759.00	2.38
8	002648	卫星化学	3,910,382.00	2.20
9	300401	花园生物	3,842,192.00	2.16
10	000988	华工科技	3,663,852.00	2.06
11	601088	中国神华	3,566,544.00	2.00
12	688525	佰维存储	3,545,891.23	1.99
13	600383	金地集团	3,528,085.00	1.98
14	600938	中国海油	3,309,253.00	1.86
15	601318	中国平安	3,302,052.00	1.86
16	600933	爱柯迪	3,200,151.00	1.80
17	000951	中国重汽	3,173,580.00	1.78
18	601872	招商轮船	3,115,420.00	1.75
19	600050	中国联通	2,951,265.00	1.66
20	002170	芭田股份	2,895,398.00	1.63

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	002648	卫星化学	7,550,702.00	4.24
2	000975	山金国际	6,052,568.00	3.40
3	000528	柳工	5,955,406.85	3.35
4	688385	复旦微电	5,355,548.20	3.01
5	002171	楚江新材	5,234,180.00	2.94
6	002290	禾盛新材	4,998,642.00	2.81
7	600933	爱柯迪	4,827,750.00	2.71
8	300408	三环集团	4,732,571.00	2.66
9	301608	博实结	3,599,502.00	2.02
10	300002	神州泰岳	3,558,849.00	2.00
11	600066	宇通客车	3,529,727.00	1.98
12	688002	睿创微纳	3,304,036.39	1.86

13	000988	华工科技	3,193,653.00	1.79
14	688192	迪哲医药-U	2,995,688.30	1.68
15	688326	经纬恒润-W	2,842,814.59	1.60
16	002463	沪电股份	2,827,560.00	1.59
17	603997	继峰股份	2,795,728.00	1.57
18	002594	比亚迪	2,793,980.00	1.57
19	688525	佰维存储	2,764,540.68	1.55
20	603596	伯特利	2,643,119.00	1.49

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	288,169,573.30
卖出股票收入（成交）总额	295,190,157.30

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

本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

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

中国建筑股份有限公司在报告编制日前一年内受到北京市住房和城乡建设委员会、绍兴市交通运输局、诸暨市交通运输局的处罚。

中国农业银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到中国人民银行的处罚。

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	56,064.29
2	应收清算款	120,814.40
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	9,835.04
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	186,713.73

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 (%)

5,375	11,039.89	7,384,785.82	12.44	51,954,603.71	87.56
-------	-----------	--------------	-------	---------------	-------

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	54,170.94	0.0913

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	0~10

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（2012 年 4 月 16 日） 基金份额总额	334,825,290.98
本报告期期初基金份额总额	63,798,062.22
本报告期基金总申购份额	5,123,939.42
减：本报告期基金总赎回份额	9,582,612.11
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	59,339,389.53

§ 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：

无。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）研究决定，聘任陈颖钰为中国建设银行资产托管业务部总经理。

陈颖钰女士曾先后在中国建设银行财务会计、重组改制、资产负债、同业业务、金融科技等领域工作，并在中国建设银行总行同业业务中心、财务会计部、资产托管业务部以及山东省分行、建信金融科技有限责任公司等机构担任领导职务，具有丰富的财会、科技和资金资产管理经验。

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

未改变。

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

注：无。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
华福证券	1	235,722,026.42	40.49	106,286.73	40.49	-
中金公司	2	123,727,056.09	21.25	55,788.57	21.25	-
国联民生证券	1	119,079,960.47	20.45	53,693.99	20.45	-
中信证券	2	36,340,245.49	6.24	16,385.94	6.24	-
广发证券	2	21,122,514.89	3.63	9,524.25	3.63	-
海通证券	3	17,463,876.	3.00	7,875.06	3.00	-

		98				
长江证券	2	14,625,889.97	2.51	6,595.99	2.51	-
申万宏源 证券	2	7,082,766.55	1.22	3,193.93	1.22	-
国海证券	1	3,615,500.40	0.62	1,630.21	0.62	-
国信证券	2	1,901,385.38	0.33	857.40	0.33	-
华泰证券	1	1,507,287.00	0.26	679.65	0.26	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
东方财富 证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
高盛中国	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安 证券	2	-	-	-	-	-
国投证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
瑞信方正	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中航证券	2	-	-	-	-	-
中金财富	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投 证券	2	-	-	-	-	-

注：交易单元选择的标准和程序：

1. 根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》（以下简称《规定》），基金管理人制定了相应的管理制度规范交易单元选择的标准和程序。基金管理人负责选择代理本基金证券买

卖的证券公司，选择标准包括：财务状况良好，经营行为规范；有完备的合规管理流程和制度，风险控制能力较强；研究、交易等服务能力较强，交易设施能够为投资组合提供有效的交易执行；中国证监会或有权机关规定的其他条件等。

2. 选择程序如下：

- （1）基金管理人根据上述标准评估并确定选用的证券公司；
- （2）基金管理人与提供证券交易服务的证券公司签订协议，并办理开立交易账户等事宜；
- （3）基金管理人定期对证券公司进行评价，依据评价结果选择交易单元。

3. 根据《规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率；其他类型基金股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍。

4. 国泰海通会商并获得上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所、全国中小企业股份转让系统、中国结算、各签约存管银行及基金管理公司等相关单位的协同支持，拟定于 2025 年 9 月 12 日的日终清算后，于上述单位实施法人切换、客户及业务迁移合并，将原海通证券的客户及业务迁移合并入国泰海通。截止本报告期末，原租用海通证券、国泰君安的交易单元未完成迁移合并，故本表列示的海通证券、国泰君安数据包含本基金在本报告期内通过原交易单元交易的情况。

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 (%)
华福证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
国联民生证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-

长江证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源证券	-	-	-	-	-	-
国海证 券	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
华泰证 券	-	-	-	-	-	-
财通证 券	-	-	-	-	-	-
长城证 券	-	-	-	-	-	-
东方财 富证券	-	-	-	-	-	-
东方证 券	-	-	-	-	-	-
东海证 券	-	-	-	-	-	-
方正证 券	-	-	-	-	-	-
高盛中 国	-	-	-	-	-	-
光大证 券	-	-	-	-	-	-
国金证 券	-	-	-	-	-	-
国泰君 安证券	-	-	-	-	-	-
国投证 券	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-
瑞信方 正	-	-	-	-	-	-
瑞银证 券	-	-	-	-	-	-
上海证 券	-	-	-	-	-	-

天风证 券	-	-	-	-	-	-
西部证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
中航证 券	-	-	-	-	-	-
中金财 富	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-
中信建 投证券	-	-	-	-	-	-

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	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/或中国证监会基金电子披露网站	2025 年 01 月 04 日
2	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/或中国证监会基金电子披露网站	2025 年 01 月 15 日
3	鹏华价值精选股票型证券投资基金 2024 年第 4 季度报告	《中国证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025 年 01 月 21 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/或中国证监会基金电子披露网站	2025 年 02 月 08 日
5	鹏华价值精选股票型证券投资基金 2024 年年度报告	《中国证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025 年 03 月 28 日
6	鹏华价值精选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/或中国证监会基金电子披露网站	2025 年 04 月 09 日

7	鹏华价值精选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/或中国证监会基金电子披露网站	2025 年 04 月 09 日
8	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/或中国证监会基金电子披露网站	2025 年 04 月 12 日
9	鹏华价值精选股票型证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	《中国证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025 年 04 月 21 日
10	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与招商证券股份有限公司申购（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/或中国证监会基金电子披露网站	2025 年 06 月 30 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）《鹏华价值精选股票型证券投资基金基金合同》；
- （二）《鹏华价值精选股票型证券投资基金托管协议》；
- （三）《鹏华价值精选股票型证券投资基金 2025 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

2025 年 8 月 28 日