

鹏华国证 2000 指数增强型证券投资基金 2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：华泰证券股份有限公司

送出日期：2024 年 3 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。本年度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。

基金托管人华泰证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 03 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。

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）注册会计师对本基金出具了“标准无保留意见”的审计报告。

本报告期自 2023 年 02 月 21 日（基金合同生效日）起至 2023 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	11
3.4 过去三年基金的利润分配情况	11
§ 4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	16
4.10 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	16
§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	17
§ 6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§ 7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	20
7.3 净资产变动表	21
7.4 报表附注	23

§ 8 投资组合报告	57
8.1 期末基金资产组合情况	57
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	58
8.3 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	59
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	72
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	74
8.6 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	74
8.7 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	74
8.8 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	74
8.9 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	74
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	74
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	74
8.12 投资组合报告附注	74
§ 9 基金份额持有人信息	75
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	75
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	75
9.3 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	76
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	76
§ 10 开放式基金份额变动	76
§ 11 重大事件揭示	76
11.1 基金份额持有人大会决议	76
11.2 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	77
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	77
11.4 基金投资策略的改变	77
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	77
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	77
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	77
11.8 其他重大事件	78
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	80
12.1 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	80
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	80
§ 13 备查文件目录	81
13.1 备查文件目录	81
13.2 存放地点	81
13.3 查阅方式	81

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华国证 2000 指数增强型证券投资基金	
基金简称	鹏华国证 2000 指数增强	
基金主代码	017892	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 2 月 21 日	
基金管理人	鹏华基金管理有限公司	
基金托管人	华泰证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	418,855,197.94 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	鹏华国证 2000 指数增强 A	鹏华国证 2000 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	017892	017893
报告期末下属分级基金的份额总额	231,905,181.72 份	186,950,016.22 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型基金，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化方法及基本面分析进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	<p>1、股票投资策略</p> <p>本基金为指数增强型基金，以国证 2000 指数为标的指数，基金股票投资方面将主要采用指数增强量化投资策略，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，力争获得超越业绩比较基准的超额收益。指数增强量化投资策略主要借鉴国内外成熟的组合投资策略，在对标的指数成份股及其他股票基本面的深入研究的基础上，运用多因子量化选股模型构建投资组合，同时优化组合交易并严格控制组合风险，力求实现超额收益。</p> <p>（1）多因子量化选股模型</p> <p>本基金将以多因子量化选股模型构建股票组合。多因子模型针对个股构建价值、质量、动量、成长、一致预期等因子，通过量化方法处理因子与个股超额回报之间的特征关系，挑选出具有基本面逻辑支撑和统计意义有效的因子组合，进而得出具有稳定超额回报的股票组合。本基金对因子的有效性进行持续的跟踪，分析其变化规律，基金经理根据市场状况结合因子变化趋势，对模型使用的因子结构进行动态调整。</p> <p>（2）风险控制与调整</p> <p>本基金为指数增强型基金。在追求超额收益的同时，需要控制跟踪偏离过大的风险。基金将根据投资组合相对标的指数的暴露度等因</p>

	<p>素的分析，对组合跟踪效果进行预估，及时调整投资组合，力求将跟踪误差控制在目标范围内。</p> <p>本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%。</p> <p>(3) 投资组合优化模型</p> <p>本基金将综合考虑预期回报、风险及交易成本进行投资组合优化。选股范围以标的指数成份股为主，也包括非成份股中与成份股剪关性强，流动性好，基本面信息充足的股票。</p> <p>2、存托凭证投资策略</p> <p>本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>本基金债券投资将采取久期策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、个券选择策略、信用策略等积极投资策略，自上而下地管理组合的久期，灵活地调整组合的券种搭配，同时精选个券，以增强组合的持有期收益。</p> <p>本基金可投资可转换债券及可交换债券，可转换债券及可交换债券兼具债权和股权双重属性，本基金将通过对目标公司股票的投资价值分析和债券价值分析综合开展投资决策，以增强本基金的收益。</p> <p>4、股指期货投资策略</p> <p>本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目标，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，充分考虑股指期货的风险收益特征，通过多头或空头的套期保值策略，以改善投资组合的投资效果。</p> <p>5、资产支持证券的投资策略</p> <p>本基金将综合运用战略资产配置和战术资产配置进行资产支持证券的投资组合管理，并根据信用风险、利率风险和流动性风险变化积极调整投资策略，严格遵守法律法规和基金合同的约定，在保证本金安全和基金资产流动性的基础上获得稳定收益。</p> <p>6、参与融资及转融通证券出借业务策略</p> <p>本基金可在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素基础上，参与融资业务。</p> <p>为更好地实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎经营原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与转融通证券出借业务。本基金将在分析市场环境、投资者类型与结构、基金历史申赎情况、出借证券流动性情况等因素的基础上，合理确定出借证券的范围、期限和比例。</p> <p>未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，本基金在履行适当程序后可相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书中更新公告。</p>
业绩比较基准	国证 2000 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金属于股票指数增强型基金，其预期的收益和风险高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。本基金为指数型基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。

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	华泰证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	高永杰	李双均
	联系电话	0755-81395402	025-83389842
	电子邮箱	xxpl@phfund.com.cn	lishuangjun@htsc.com
客户服务电话		4006788999	95597
传真		0755-82021126	025-83387215
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	江苏省南京市江东中路 228 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	江苏省南京市江东中路 228 号
邮政编码		518048	210009
法定代表人		何如	张伟

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.phfund.com.cn
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2023 年 2 月 21 日(基金合同生效日)-2023 年 12 月 31 日	
	鹏华国证 2000 指数增强 A	鹏华国证 2000 指数增强 C
本期已实现 收益	-5,611,413.41	-2,783,326.33
本期利润	-12,700,017.58	-6,573,652.81
加权平均基 金份额本期 利润	-0.0618	-0.0309
本期加权平 均净值利润 率	-6.36%	-3.16%
本期基金份	-3.69%	-4.02%

额净值增长率		
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末	
期末可供分配利润	-8,551,723.21	-7,512,582.98
期末可供分配基金份额利润	-0.0369	-0.0402
期末基金资产净值	223,353,458.51	179,437,433.24
期末基金份额净值	0.9631	0.9598
3.1.3 累计期末指标	2023 年末	
基金份额累计净值增长率	-3.69%	-4.02%

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 12 月 31 日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

（4）本基金合同于 2023 年 02 月 21 日生效，至 2023 年 12 月 31 日未满一年，故 2023 年的数据和指标为非完整会计年度数据。

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

鹏华国证 2000 指数增强 A

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
过去三个月	0.10%	0.93%	-1.03%	1.02%	1.13%	-0.09%
过去六个月	-5.15%	0.97%	-7.29%	0.98%	2.14%	-0.01%

自基金合同生效起至今	-3.69%	0.91%	-10.63%	0.95%	6.94%	-0.04%
------------	--------	-------	---------	-------	-------	--------

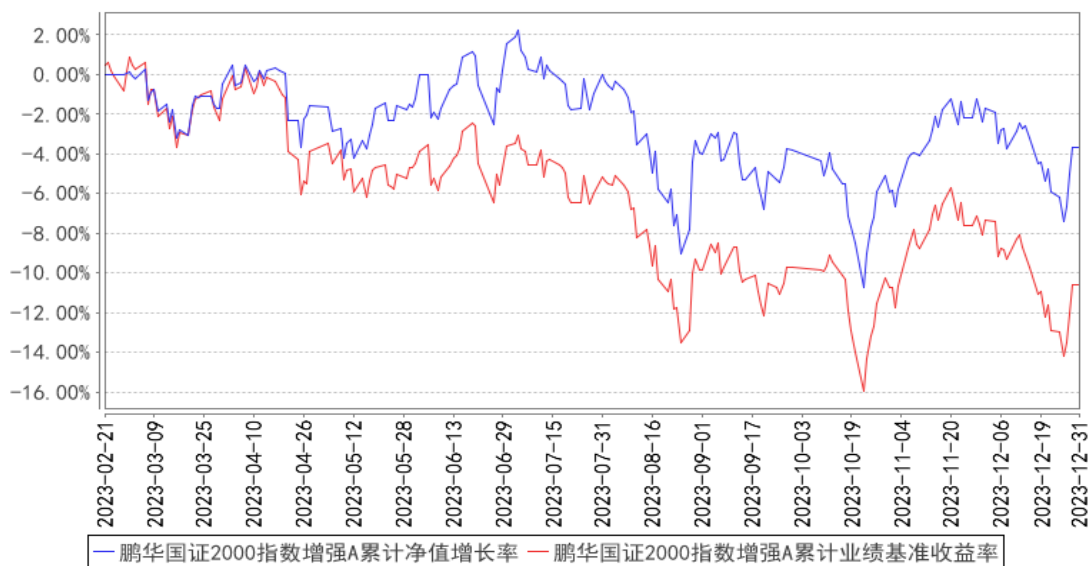
鹏华国证 2000 指数增强 C

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
过去三个月	0.00%	0.93%	-1.03%	1.02%	1.03%	-0.09%
过去六个月	-5.34%	0.97%	-7.29%	0.98%	1.95%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-4.02%	0.91%	-10.63%	0.95%	6.61%	-0.04%

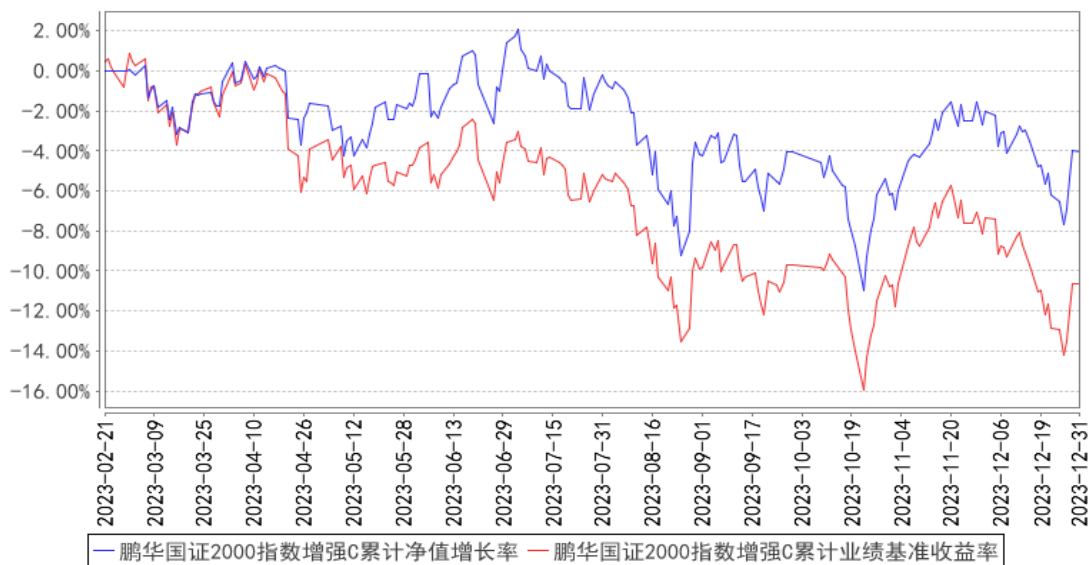
注：业绩比较基准=国证 2000 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%

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

鹏华国证2000指数增强A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



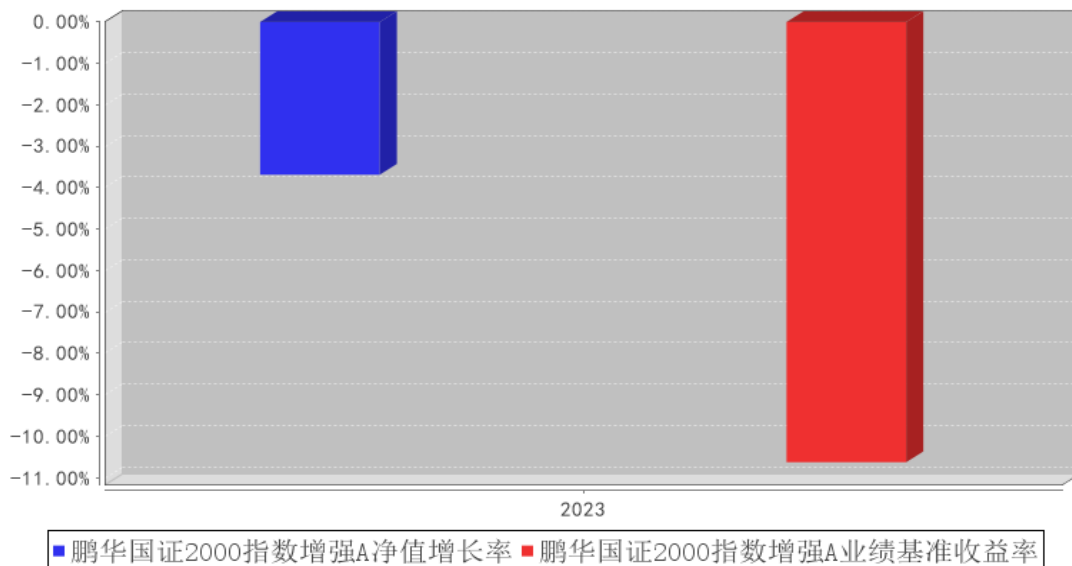
鹏华国证2000指数增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



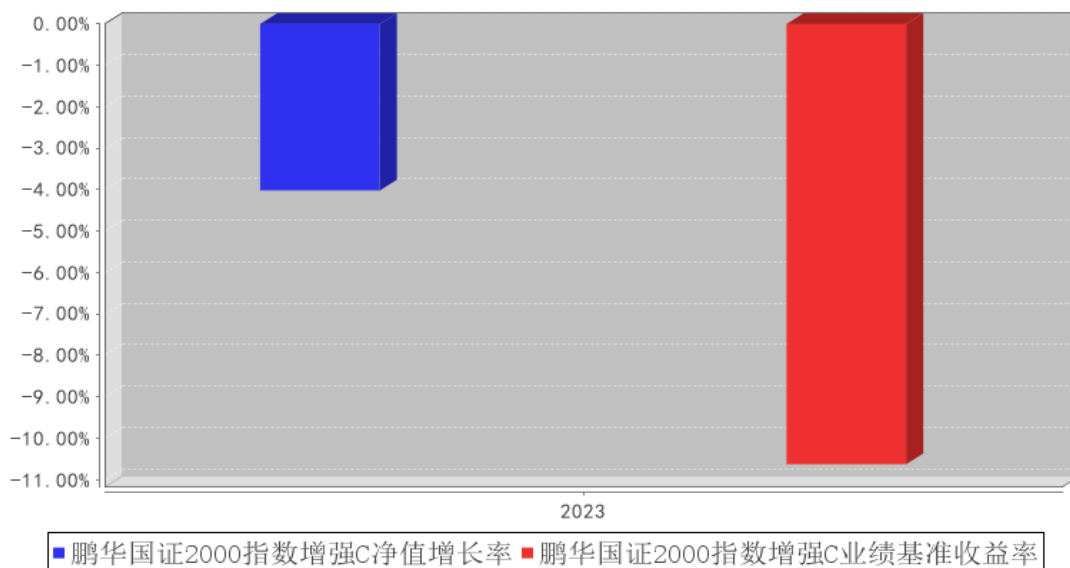
注：1、本基金基金合同于 2023 年 02 月 21 日生效，截至本报告期末本基金基金合同生效未满一年。2、截至建仓期结束，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

鹏华国证2000指数增强A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



鹏华国证2000指数增强C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按照实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 其他指标

注：无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

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 11052 亿元，313 只公募基金、13 只全国社保投资组合、7 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		
苏俊杰	基金经理	2023-02-21	-	11 年	苏俊杰先生，国籍中国，理学硕士，11 年证券从业经验。曾任 MSCI INC. 分析师，华

				<p>泰柏瑞基金管理有限公司专户投资经理，财通基金管理有限公司基金经理。2019 年 07 月加盟鹏华基金管理有限公司，历任量化及衍生品投资部副总经理，现担任量化及衍生品投资部总经理/基金经理。2021 年 03 月至今担任鹏华沪深 300 指数增强型证券投资基金基金经理，2021 年 03 月至今担任鹏华量化先锋混合型证券投资基金基金经理，2022 年 01 月至今担任鹏华中证 500 指数增强型证券投资基金基金经理，2022 年 08 月至 2023 年 12 月担任鹏华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）基金经理，2022 年 08 月至 2023 年 08 月担任鹏华创业板指数型证券投资基金（LOF）基金经理，2022 年 08 月至 2023 年 08 月担任鹏华中证 500 指数证券投资基金（LOF）基金经理，2022 年 12 月至今担任鹏华上证科创板 50 成份增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2022 年 12 月至今担任鹏华中证 1000 指数增强型证券投资基金基金经理，2022 年 12 月至今担任鹏华创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2023 年 02 月至今担任鹏华国证 2000 指数增强型证券投资基金基金经理，2023 年 06 月至今担任鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2023 年 08 月至今担任鹏华创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2023 年 09 月至今担任鹏华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2023 年 09 月至今担任鹏华上证科创板 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2023 年 12 月至今担任鹏华上证科创板 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2023 年 12 月至今担任鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）基金经理，苏俊杰先生具备基金从业资格。本基金为本报告期内新成立基金，聘任苏俊杰为本基金基金经理。</p>
--	--	--	--	---

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。

4.1.4 基金经理薪酬机制

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 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《鹏华基金管理有限公司公平交易管理规定》，将公司所管理的封闭式基金、开放式基金、社保组合、养老组合、特定客户资产管理组合等不同资产组合的授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动均纳入公平交易管理，在业务流程和岗位职责中制定公平交易的控制规则和控制活动，建立对公平交易的执行、监督及审核流程，严禁在不同投资组合之间进行利益输送。

在投资研究环节：1、公司使用唯一的研究报告发布平台“研究报告管理平台”，确保各投资组合在获得投资信息、研究支持、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；2、公司严格按照《股票库管理规定》、《信用债券投资与风险控制管理规定》，执行股票及信用产品出入库及日常维护工作，确保相关证券入库以内容严谨、观点明确的研究报告作为依据；3、在公司股票库基础上，各涉及股票投资的资产组合根据各自的投资目标、投资风格、投资范围和防范关联交易的原则分别建立资产组合股票库，基金经理在股票库基础上根据投资授权以及基金合同择股方式构建具体的投资组合；4、严格执行投资授权制度，明确投资决策委员会、分管投资副总裁、基金经理等各主体的职责和权限划分，合理确定基金经理的投资权限，超过投资权限的操作，应严格履行审批程序。

在交易执行环节：1、所有公司管理的资产组合的交易必须通过集中交易室完成，集中交易室负责建立和执行交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会；2、针对交易所公开竞价交易，集中交易室应严格启用恒生交易系统内的公平交易程序，交易系统则自动启用公平交易功能，由系统按照“未委托数量”的比例对不同资产组合进行委托量的公平分配；如果相关基金经理坚持以不同的价格进行交易，且当前市场价格不能同时满足多个资产组合的指令价格要求时，

交易系统自动按照“价格优先”原则进行委托；当市场价格同时满足多个资产组合的指令价格要求时，则交易系统自动按照“同一指令价格下的公平交易”模式，进行公平委托和交易量分配；3、银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易需依据公司《股票投资交易流程》和《固定收益投资管理流程》的规定执行；银行间市场交易、交易所大宗交易等以公司名义进行的交易，各投资组合经理应在交易前独立确定各投资组合的交易价格和数量，公司按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；4、新股、新债申购及非公开定向增发交易需依据公司《新股申购流程》、《固定收益投资管理流程》和《非公开定向增发流程》的规定执行，对新股和新债申购方案和分配过程进行审核和监控。

在交易监控、分析与评估环节：1、为加强对日常投资交易行为的监控和管理，杜绝利益输送、不公平交易等违规交易行为，防范日常交易风险，公司明确了关注类交易的界定及对应的监控和评估措施机制；所监控的交易包括但不限于：交易所公开竞价交易中同日同向交易的交易时机和交易价差、不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差、关联交易、债券交易收益率偏离度、成交量和成交价格异常、银行间债券交易对手交易等；2、将公平交易作为投资组合业绩归因分析和交易绩效评价的重要关注内容，发现的异常情况由投资监察员进行分析；3、风控管理部分别于每季度和每年度编写《公平交易执行情况检查报告》，内容包括关注类交易监控执行情况、不同投资组合的整体收益率差异分析和同向交易价差分析。

4.3.2 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。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，本基金在控制相对国证 2000 指数跟踪误差的基础上，采用量化方法进行选股，力争在国证 2000 指数收益率的基础上进行增强。量化选股模型侧重于不同预测收益来源、不同预测

周期因子的动态配置，辅以稳健均衡的风格，平衡模型长期有效性和对短期市场环境波动的适应性，力争获取稳健的超额收益。

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 A 类份额净值增长率为-3.69%，同期业绩比较基准增长率为-10.63%；C 类份额净值增长率为-4.02%，同期业绩比较基准增长率为-10.63%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2024 年，市场当前在估值、情绪、资金等各个维度均处于历史低位状态，在年初市场风险再次释放之后，当前资产价格可能已经隐含过于悲观预期；目前市场底部支撑较强，后续仍有结构性上涨机会，但可能会出现叠加快速风格与行业轮动的震荡上行。尽管还存在诸多的不确定因素，权益市场仍然进入了一个安全边际较高的配置窗口，但具体的节奏需考虑国内宏观经济和企业盈利的边际变化情况、以及国外主要经济体所处周期等因素。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人继续完善内部控制、提升风险管理水平，着重开展了以下各项工作：

1、继续完善内部控制体系

公司根据法律法规、监管要求及业务发展需求，不断优化现有的标准化业务流程体系，强调业务流程服务于加强风险防范和提升运营效率，通过信息技术手段持续提升业务操作的系统化程度，并不断优化。

2、规范基金销售业务，保证基金销售业务的合法合规性

报告期内，在基金募集和持续营销活动中，公司严格规范基金销售业务，按照《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及相关法规规定审查宣传推介材料，逐步落实反洗钱法律法规各项要求，并督促销售部门做好投资者教育工作。

3、开展以风险为导向的内部稽核

报告期内，监察稽核部开展了对信息技术管理、投资相关流程、员工行为、反洗钱业务、子公司管理和公司日常运作的定期监察稽核与专项监察稽核。监察稽核人员开展了以风险为导向的内部稽核，通过稽核发现提高了公司标准化操作流程的执行效率，优化了标准化操作流程手册。

报告期内，公司未发生重大风险事件。

此外，在投资日常合规监控工作方面，公司根据法律法规和产品特点进一步完善了投资合规风控制度流程及投资监控系统，加强对投资限制的监控提示；持续完善公平交易、异常交易等监测管控机制，在实现交易价差分析、银行间交易分析、研究报告检查等专项检查工作定期化、日常化的基础上，公司多次开展有关内幕交易、未公开信息等重要内容的合规培训，进一步强化全

体投研人员的合规意识。

4.7 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、风险管理部、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。

4.8 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，鹏华国证 2000 指数增强 A 期末可供分配利润为-8,551,723.21 元，期末基金份额净值 0.9631 元，不符合利润分配条件；鹏华国证 2000 指数增强 C 期末可供分配利润为-7,512,582.98 元，期末基金份额净值 0.9598 元，不符合利润分配条件。

2、本基金本报告期内未进行利润分配。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.10 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

在本报告期内，本基金托管人-华泰证券股份有限公司严格遵守了基金合同和各项法律法规的相关规定，履行了基金托管人应尽的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告期内，华泰证券对基金管理人的投资运作行为依基金合同约定进行了监督，对本基金资产净值计算、利润分配、费用开支等方面进行了复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

华泰证券作为基金托管人，复核了本基金 2023 年年度报告中的有关财务数据、收益分配、投资组合报告等内容，相关内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2024)第 25687 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	鹏华国证 2000 指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了鹏华国证 2000 指数增强型证券投资基金(以下简称“鹏华国证 2000 指数增强基金”)的财务报表,包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表,2023 年 2 月 21 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日止期间的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了鹏华国证 2000 指数增强基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年 2 月 21 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于鹏华国证 2000 指数增强基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	无。
其他事项	无。

其他信息	无。
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>鹏华国证 2000 指数增强基金的基金管理人鹏华基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估鹏华国证 2000 指数增强基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算鹏华国证 2000 指数增强基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督鹏华国证 2000 指数增强基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能导致对鹏华国证 2000 指数增强基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致鹏华国证 2000 指数增强基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容,并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排</p>

	和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	单峰	仲文渊
会计师事务所的地址	中国上海市	
审计报告日期	2024 年 3 月 25 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：鹏华国证 2000 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日
资产：		
货币资金	7.4.7.1	29,890,773.88
结算备付金		83,983.12
存出保证金		-
交易性金融资产	7.4.7.2	377,508,537.74
其中：股票投资		377,508,537.74
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	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
债权投资	7.4.7.5	-
其中：债券投资		-
资产支持证券投资		-
其他投资		-
其他债权投资	7.4.7.6	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		388,757.60
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.8	-
资产总计		407,872,052.34
负债和净资产	附注号	本期末 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	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		-
应付赎回款		4,604,854.72
应付管理人报酬		334,934.20
应付托管费		33,493.42
应付销售服务费		57,878.25
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	7.4.7.9	50,000.00
负债合计		5,081,160.59
净资产：		
实收基金	7.4.7.10	418,855,197.94
其他综合收益	7.4.7.11	-
未分配利润	7.4.7.12	-16,064,306.19
净资产合计		402,790,891.75
负债和净资产总计		407,872,052.34

注：（1）报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额总额为 418,855,197.94 份，其中鹏华国证 2000 指数增强 A 基金份额总额为 231,905,181.72 份，基金份额净值 0.9631 元；鹏华国证 2000 指数增强 C 基金份额总额为 186,950,016.22 份，基金份额净值 0.9598 元。（2）本财务报表的实际编制期间为 2023 年 02 月 21 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日，无上年度末数据。

7.2 利润表

会计主体：鹏华国证 2000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2023 年 2 月 21 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 2 月 21 日（基金合同 生效日）至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-14,661,687.72
1. 利息收入		435,817.67
其中：存款利息收入	7.4.7.13	435,817.67
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-

2. 投资收益（损失以“-”填列）		-4,235,991.01
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-8,120,743.25
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.15	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.16	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-
股利收益	7.4.7.19	3,884,752.24
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）	7.4.7.20	-10,878,930.65
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	17,416.27
减：二、营业总支出		4,611,982.67
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	3,498,352.20
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	7.4.10.2.2	349,835.17
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	713,395.30
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	7.4.7.22	-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	7.4.7.23	50,400.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-19,273,670.39
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-19,273,670.39
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-19,273,670.39

注：本财务报表的实际编制期间为 2023 年 02 月 21 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日止期间，无上年度可比较期间及可比较数据。

7.3 净资产变动表

会计主体：鹏华国证 2000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2023 年 2 月 21 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2023 年 2 月 21 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 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	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	470,611,661.51	-	-	470,611,661.51
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-51,756,463.57	-	-16,064,306.19	-67,820,769.76
（一）、综合收益总额	-	-	-19,273,670.39	-19,273,670.39
（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）	-51,756,463.57	-	3,209,364.20	-48,547,099.37
其中：1. 基金申购款	393,301,798.33	-	-8,431,501.96	384,870,296.37
2. 基金赎回款	-445,058,261.90	-	11,640,866.16	-433,417,395.74
（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	418,855,197.94	-	-16,064,306.19	402,790,891.75

注：本财务报表的实际编制期间为 2023 年 02 月 21 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日止期间，无上年度可比期间及可比较数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

邓召明

邢彪

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

鹏华国证 2000 指数增强型证券投资基金(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[2023]199 号《关于准予鹏华国证 2000 指数增强型证券投资基金注册的批复》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《鹏华国证 2000 指数增强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基金,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 470,545,038.44 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(2023)第 0102 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华国证 2000 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2023 年 2 月 21 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 470,611,661.51 份基金份额,其中认购资金利息折合 66,623.07 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,基金托管人为华泰证券股份有限公司。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《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》、《鹏华国证 2000 指数增强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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 年 02 月 21 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日止期间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 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年 02 月 21 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2023

年 02 月 21 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具；即不包含付款的合同义务且享有发行人净资产和剩余收益的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具（主要为股票投资）按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑在资产负债表日无须付出不必要的额外成本和努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金在前一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形的，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本基金利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：（1）收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

(2) 该金融资产已转移,且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方;或者(3) 该金融资产已转移,虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬,但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时,终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额,计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、基金投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的,应对市场交易价格进行调整,确定公允价值。与上述投资品种相同,但具有不同特征的,应以相同资产或负债的公允价值为基础,并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等,如果该限制是针对资产持有者的,那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外,基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场,采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时,优先使用可观察输入值,只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下,才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件,应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的;且 2) 交易双方准备按净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及

基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4)除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税(和/或)股票交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率或者发行价计算的利息及在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

本基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司（以下简称“证金公司”）出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息以及出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为当期损益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费(如有)在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

以摊余成本计量的负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类/级别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产

生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	14,060,018.55
等于：本金	14,052,938.96
加：应计利息	7,079.59
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	15,830,755.33
等于：本金	15,829,148.91
加：应计利息	1,606.42
减：坏账准备	-
合计	29,890,773.88

注：本期末其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动

股票		388,387,468.39	-	377,508,537.74	-10,878,930.65
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		388,387,468.39	-	377,508,537.74	-10,878,930.65

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。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

7.4.7.8 其他资产

注：无。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	50,000.00
合计	50,000.00

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

鹏华国证 2000 指数增强 A

项目	本期 2023 年 2 月 21 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	143,679,062.77	143,679,062.77
本期申购	196,647,933.07	196,647,933.07
本期赎回（以“-”号填列）	-108,421,814.12	-108,421,814.12
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	231,905,181.72	231,905,181.72
-----	----------------	----------------

鹏华国证 2000 指数增强 C

项目	本期 2023 年 2 月 21 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	326,932,598.74	326,932,598.74
本期申购	196,653,865.26	196,653,865.26
本期赎回（以“-”号填列）	-336,636,447.78	-336,636,447.78
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	186,950,016.22	186,950,016.22

注：1、本基金自 2023 年 2 月 13 日至 2023 年 2 月 17 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 470,545,038.44 元，折合为 470,545,038.44 份基金份额。根据《鹏华国证 2000 指数增强型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币 66,623.07 元，在本基金成立后，折合为 66,623.07 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

2、申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.11 其他综合收益

注：无。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

鹏华国证 2000 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	-5,611,413.41	-7,088,604.17	-12,700,017.58
本期基金份额交易产生的变动数	315,640.44	3,832,653.93	4,148,294.37
其中：基金申购款	905,579.59	-1,371,922.41	-466,342.82
基金赎回款	-589,939.15	5,204,576.34	4,614,637.19
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-5,295,772.97	-3,255,950.24	-8,551,723.21

鹏华国证 2000 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
----	-------	-------	---------

基金合同生效日	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	-2,783,326.33	-3,790,326.48	-6,573,652.81
本期基金份额交易产生的变动数	-2,097,616.19	1,158,686.02	-938,930.17
其中：基金申购款	-2,833,709.38	-5,131,449.76	-7,965,159.14
基金赎回款	736,093.19	6,290,135.78	7,026,228.97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-4,880,942.52	-2,631,640.46	-7,512,582.98

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年2月21日（基金合同生效日）至2023年12月31日
活期存款利息收入	273,540.87
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	78,293.68
结算备付金利息收入	83,983.12
其他	-
合计	435,817.67

注：1、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。

2、本期其他存款利息收入为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金的利息收入。

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年2月21日（基金合同生效日）至2023年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-8,120,743.25
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	-8,120,743.25

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2023 年 2 月 21 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	1,163,015,710.46
减：卖出股票成本总额	1,168,586,552.35
减：交易费用	2,549,901.36
买卖股票差价收入	-8,120,743.25

7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：无。

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 2 月 21 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	3,884,752.24
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,884,752.24

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023 年 2 月 21 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-10,878,930.65
股票投资	-10,878,930.65
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	-10,878,930.65

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2023 年 2 月 21 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	17,402.10
基金转换费收入	14.17
合计	17,416.27

7.4.7.22 信用减值损失

注：无。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 2 月 21 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	50,000.00
信息披露费	-
证券出借违约金	-
其他	400.00
合计	50,400.00

7.4.7.24 分部报告

无。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

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
华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）	基金托管人、基金代销机构
深圳市北融信投资发展有限公司	基金管理人的股东
意大利欧利盛资本资产管理股份公司（“Eurizon Capital SGR S.p.A.”）	基金管理人的股东
国信证券股份有限公司（“国信证券”）	基金管理人的股东
鹏华资产管理有限公司（“鹏华资产”）	基金管理人的子公司

注：1、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。

2、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金基金合同于 2023 年 02 月 21 日生效，截至本报告期末不满一年，无上年度可比期间数据。

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 2 月 21 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
华泰证券	2,708,613,810.15	100.00

7.4.10.1.2 债券交易

注：无。

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

7.4.10.1.4 权证交易

注：无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年2月21日（基金合同生效日）至2023年12月31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（%）
华泰证券	1,439,147.69	100.00	-	-

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 2 月 21 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,498,352.20
其中：应支付销售机构的客户维护费	997,308.65
应支付基金管理人的净管理费	2,501,043.55

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 1.00%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×1.00%÷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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 2 月 21 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	349,835.17

注：支付基金托管人华泰证券的托管费按前一日基金资产净值 0.10%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×0.10%/当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2023 年 2 月 21 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鹏华国证 2000 指数增强 A	鹏华国证 2000 指数增强 C	合计
华泰证券	-	633,361.35	633,361.35
鹏华基金公司	-	176.43	176.43
合计	-	633,537.78	633,537.78

注：鹏华国证 2000 指数增强 A 基金份额不支付销售服务费；支付基金销售机构的鹏华国证 2000 指数增强 C 基金份额的销售服务费年费率为 0.4%，逐日计提，按月支付，日销售服务费=前一日

分类基金资产净值×0.4%÷当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

7.4.10.5.2 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。

7.4.10.6 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 2023年2月21日（基金合同生效日）至2023年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
华泰证券	29,890,773.88	351,834.55

7.4.10.7 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 2023年2月21日（基金合同生效日）至2023年12月31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	603270	金帝股份	网下申购	1,347	29,324.19
国信证券	301488	豪恩汽电	网下申购	1,945	77,372.10
国信证券	688562	航天软件	网下申购	7,254	91,980.72

注：本表包含参与基金托管人的关联方承销证券的情况。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

注：无。

7.4.12 期末（2023 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
001239	永达股份	2023 年 12 月 4 日	6 个月	新股流通受限	12.05	19.92	189	2,277.45	3,764.88	-
001306	夏厦精密	2023 年 11 月 9 日	6 个月	新股流通受限	53.63	75.36	53	2,842.39	3,994.08	-
001326	联域股份	2023 年 11 月 1 日	6 个月	新股流通受限	41.18	48.64	92	3,788.56	4,474.88	-
001358	兴欣新材	2023 年 12 月 14 日	6 个月	新股流通受限	41.00	44.16	87	3,567.00	3,841.92	-
001378	德冠新材	2023 年 10 月 23 日	6 个月	新股流通受限	31.68	31.27	168	5,322.24	5,253.36	-
300904	威力传动	2023 年 8 月 2 日	6 个月	新股流通受限	35.41	61.53	284	10,056.44	17,474.52	-
301172	君逸数码	2023 年 7 月 19 日	6 个月	新股流通受限	31.33	38.16	360	11,278.80	13,737.60	-
301202	朗威股份	2023 年 6 月 28 日	6 个月	新股流通受限	25.82	31.80	248	6,403.36	7,886.40	-
301251	威	2023	6 个月	新股	28.88	34.59	228	6,584.64	7,886.52	-

	尔高	年8月 30日		流通 受限							
301261	恒工精密	2023 年6月 29日	6个月	新股 流通 受限	36.90	50.85	167	6,162.30	8,491.95	-	
301272	英华特	2023 年7月 6日	6个月	新股 流通 受限	51.39	53.38	170	8,736.30	9,074.60	-	
301291	明阳电气	2023 年6月 21日	6个月	新股 流通 受限	38.13	28.36	360	13,726.80	10,209.60	-	
301292	海科新源	2023 年6月 29日	6个月	新股 流通 受限	19.99	19.35	490	9,795.10	9,481.50	-	
301329	信音电子	2023 年7月 5日	6个月	新股 流通 受限	21.00	22.23	327	6,867.00	7,269.21	-	
301348	蓝箭电子	2023 年8月 1日	6个月	新股 流通 受限	18.08	44.57	561	10,142.88	25,003.77	-	
301370	国科恒泰	2023 年7月 3日	6个月	新股 流通 受限	13.39	16.01	740	9,908.60	11,847.40	-	
301371	敷尔佳	2023 年7月 24日	6个月	新股 流通 受限	55.68	37.58	151	8,407.68	5,674.58	-	
301381	赛维时代	2023 年7月 5日	6个月	新股 流通 受限	20.45	29.69	470	9,611.50	13,954.30	-	
301393	昊帆生物	2023 年7月 5日	6个月	新股 流通 受限	67.68	59.37	130	8,798.40	7,718.10	-	
301418	协昌科技	2023 年8月 10日	6个月	新股 流通 受限	51.88	50.20	161	8,352.68	8,082.20	-	

301456	盘古智能	2023年7月6日	6个月	新股流通受限	37.96	30.39	237	8,996.52	7,202.43	-
301459	丰茂股份	2023年12月6日	6个月	新股流通受限	31.90	39.84	202	6,443.80	8,047.68	-
301486	致尚科技	2023年6月30日	6个月	新股流通受限	57.66	47.25	180	10,378.80	8,505.00	-
301488	豪恩汽电	2023年6月26日	6个月	新股流通受限	39.78	69.09	195	7,757.10	13,472.55	-
301489	思泉新材	2023年10月16日	6个月	新股流通受限	41.66	64.11	128	5,332.48	8,206.08	-
301498	乖宝宠物	2023年8月9日	6个月	新股流通受限	39.99	38.81	196	7,838.04	7,606.76	-
301499	维科精密	2023年7月13日	6个月	新股流通受限	19.50	28.93	371	7,234.50	10,733.03	-
301500	飞南资源	2023年9月13日	6个月	新股流通受限	23.97	20.89	246	5,896.62	5,138.94	-
301505	苏州规划	2023年7月12日	6个月	新股流通受限	26.35	35.81	194	5,111.90	6,947.14	-
301507	民生健康	2023年8月24日	6个月	新股流通受限	10.00	15.85	616	6,160.00	9,763.60	-
301508	中机认检	2023年11月23日	6个月	新股流通受限	16.82	26.68	397	6,677.54	10,591.96	-

301510	固高科技	2023年8月4日	6个月	新股流通受限	12.00	35.01	396	4,752.00	13,863.96	-
301511	德福科技	2023年8月8日	6个月	新股流通受限	28.00	22.67	360	10,080.00	8,161.20	-
301515	港通医疗	2023年7月13日	6个月	新股流通受限	31.16	28.27	194	6,045.04	5,484.38	-
301516	中远通	2023年12月1日	6个月	新股流通受限	6.87	15.51	604	4,149.48	9,368.04	-
301517	陕西华达	2023年10月9日	6个月	新股流通受限	26.87	43.69	185	4,970.95	8,082.65	-
301518	长华化学	2023年7月26日	6个月	新股流通受限	25.75	23.01	291	7,493.25	6,695.91	-
301520	万邦医药	2023年9月18日	6个月	新股流通受限	67.88	52.74	138	9,367.44	7,278.12	-
301525	儒竞科技	2023年8月23日	6个月	新股流通受限	99.57	81.46	65	6,472.05	5,294.90	-
301526	国际复材	2023年12月19日	6个月	新股流通受限	2.66	4.45	4,759	12,658.94	21,177.55	-
301528	多浦乐	2023年8月17日	6个月	新股流通受限	71.80	68.91	145	10,411.00	9,991.95	-
301529	福赛科技	2023年8月31日	6个月	新股流通受限	36.60	37.88	168	6,148.80	6,363.84	-
301533	威马	2023年8月	6个月	新股流通	29.50	33.16	225	6,637.50	7,461.00	-

	农机	7 日		受限							
301548	崇德科技	2023 年 9 月 11 日	6 个月	新股流通受限	66.80	58.99	89	5,945.20	5,250.11	-	
301550	斯菱股份	2023 年 9 月 6 日	6 个月	新股流通受限	37.56	43.57	151	5,671.56	6,579.07	-	
301555	惠柏新材	2023 年 10 月 24 日	6 个月	新股流通受限	22.88	32.44	224	5,125.12	7,266.56	-	
301558	三态股份	2023 年 9 月 21 日	6 个月	新股流通受限	7.33	13.40	959	7,029.47	12,850.60	-	
301559	中集环科	2023 年 9 月 26 日	6 个月	新股流通受限	24.22	18.24	316	7,653.52	5,763.84	-	
301568	思泰克	2023 年 11 月 21 日	6 个月	新股流通受限	23.23	35.58	220	5,110.60	7,827.60	-	
301578	辰奕智能	2023 年 12 月 21 日	6 个月	新股流通受限	48.94	68.32	118	5,774.92	8,061.76	-	
601083	锦江航运	2023 年 11 月 28 日	6 个月	新股流通受限	11.25	11.07	430	4,837.50	4,760.10	-	
601096	宏盛华源	2023 年 12 月 15 日	6 个月	新股流通受限	1.70	4.06	2,235	3,799.50	9,074.10	-	
603004	鼎龙科技	2023 年 12 月 20 日	6 个月	新股流通受限	16.80	31.19	195	3,276.00	6,082.05	-	
603062	麦加	2023 年 10 月	6 个月	新股流通	58.08	57.81	54	3,136.32	3,121.74	-	

	芯彩	月 31 日		受限						
603075	热威股份	2023 年 9 月 1 日	6 个月	新股流通受限	23.10	23.31	147	3,395.70	3,426.57	-
603107	上海汽配	2023 年 10 月 25 日	6 个月	新股流通受限	14.23	18.19	188	2,675.24	3,419.72	-
603119	浙江荣泰	2023 年 7 月 21 日	6 个月	新股流通受限	15.32	23.87	155	2,374.60	3,699.85	-
603193	润本股份	2023 年 10 月 9 日	6 个月	新股流通受限	17.38	16.66	187	3,250.06	3,115.42	-
603231	索宝蛋白	2023 年 12 月 6 日	6 个月	新股流通受限	21.29	21.53	132	2,810.28	2,841.96	-
603270	金帝股份	2023 年 8 月 25 日	6 个月	新股流通受限	21.77	29.58	135	2,938.95	3,993.30	-
603273	天元智能	2023 年 10 月 16 日	6 个月	新股流通受限	9.50	18.97	178	1,691.00	3,376.66	-
603276	恒兴新材	2023 年 9 月 18 日	6 个月	新股流通受限	25.73	24.88	134	3,447.82	3,333.92	-
603296	华勤技术	2023 年 8 月 1 日	6 个月	新股流通受限	80.80	77.75	99	7,999.20	7,697.25	-
603373	安邦护卫	2023 年 12 月 13 日	6 个月	新股流通受限	19.10	34.75	88	1,680.80	3,058.00	-
688450	光格	2023 年 7 月	6 个月	新股流通	53.09	36.42	117	6,211.53	4,261.14	-

	科技	17 日		受限						
688548	广钢气体	2023 年 8 月 8 日	6 个月	新股流通受限	9.87	12.75	1,003	9,899.61	12,788.25	-
688549	中巨芯-U	2023 年 8 月 30 日	6 个月	新股流通受限	5.18	8.09	1,546	8,008.28	12,507.14	-
688563	航材股份	2023 年 7 月 12 日	6 个月	新股流通受限	78.99	60.49	190	15,008.10	11,493.10	-
688573	信宇人	2023 年 8 月 9 日	6 个月	新股流通受限	23.68	28.80	285	6,748.80	8,208.00	-
688582	芯动联科	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股流通受限	26.74	38.67	266	7,112.84	10,286.22	-
688591	泰凌微	2023 年 8 月 18 日	6 个月	新股流通受限	24.98	28.02	401	10,016.98	11,236.02	-
688603	天承科技	2023 年 6 月 30 日	6 个月	新股流通受限	55.00	74.14	126	6,930.00	9,341.64	-
688612	威迈斯	2023 年 7 月 19 日	6 个月	新股流通受限	47.29	37.97	138	6,526.02	5,239.86	-
688627	精智达	2023 年 7 月 11 日	6 个月	新股流通受限	46.77	87.72	165	7,717.05	14,473.80	-
688638	誉辰智能	2023 年 7 月 4 日	6 个月	新股流通受限	83.90	59.68	107	8,977.30	6,385.76	-
688646	逸飞激光	2023 年 7 月 21 日	6 个月	新股流通受限	46.80	36.07	182	8,517.60	6,564.74	-
688648	中邮	2023 年 11	6 个月	新股流通	15.18	21.43	303	4,599.54	6,493.29	-

	科技	月6日		受限						
688651	盛邦安全	2023年7月19日	6个月	新股流通受限	39.90	46.05	178	7,102.20	8,196.90	-
688652	京仪装备	2023年11月22日	6个月	新股流通受限	31.95	52.25	228	7,284.60	11,913.00	-
688653	康希通信	2023年11月10日	6个月	新股流通受限	10.50	15.99	595	6,247.50	9,514.05	-
688657	浩辰软件	2023年9月25日	6个月	新股流通受限	103.40	78.23	74	7,651.60	5,789.02	-
688671	碧兴物联	2023年8月2日	6个月	新股流通受限	36.12	34.30	226	8,163.12	7,751.80	-
688702	盛科通信-U	2023年9月6日	6个月	新股流通受限	42.66	48.18	144	6,143.04	6,937.92	-
688716	中研股份	2023年9月13日	6个月	新股流通受限	29.66	36.39	211	6,258.26	7,678.29	-
688719	爱科赛博	2023年9月20日	6个月	新股流通受限	69.98	60.10	107	7,487.86	6,430.70	-

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。

7.4.12.2 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
300096	ST 易联众	2023 年 12 月 29 日	重大事项	6.82	2024 年 1 月 2 日	5.46	20,200	140,815.65	137,764.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行或上市交易的股票（包含主板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、存托凭证、债券（含国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、政府支持机构债、地方政府债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券及其他中国证监会允许基金投资的债券）、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款等）、货币市场工具、同业存单、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可根据相关法律法规和基金合同的约定，参与融资及转融通证券出借业务。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，力争实现基金净值增长率与标的指数增长率间的高度正相关，并保持跟踪误差在合同约定的范围内。

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。

7.4.13.2 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华泰证券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 2023 年 12 月 31 日，本基金未持有信用类债券（未满一年）。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：无。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

7.4.13.3 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、组合在短期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均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，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 2023 年 12 月 31 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。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

本基金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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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，其余金融资产和金融负债均不计息，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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					

货币资金	29,890,773.88	-	-	-	29,890,773.88
结算备付金	83,983.12	-	-	-	83,983.12
交易性金融资产	-	-	-	-377,508,537.74	377,508,537.74
应收申购款	-	-	-	388,757.60	388,757.60
资产总计	29,974,757.00	-	-	-377,897,295.34	407,872,052.34
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	4,604,854.72	4,604,854.72
应付管理人报酬	-	-	-	334,934.20	334,934.20
应付托管费	-	-	-	33,493.42	33,493.42
应付销售服务费	-	-	-	57,878.25	57,878.25
其他负债	-	-	-	50,000.00	50,000.00
负债总计	-	-	-	5,081,160.59	5,081,160.59
利率敏感度缺口	29,974,757.00	-	-	-372,816,134.75	402,790,891.75

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2023 年 12 月 31 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。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无。

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无。

7.4.13.4.3 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。本基金主要投资于标的指数成份券和备选成份券，所面临的其他价格风险来源于标的指数成份券和备选成份券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。

本基金为被动式指数基金，原则上采用完全复制的方法，按照个券在标的指数中的基准权重构建投资组合。基金所构建的指数化投资组合将根据标的指数成份券及其权重的变动而进行相应调整。同时，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、新股增发等变化，对基金投资组合进行相应调整，以保证基金份额净值增长率与标的指数间的高度正相关和跟踪误

差最小化。

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：股票资产及存托凭证占基金资产的比例不低于 80%，投资于标的指数成份股及备选成份股（含存托凭证）的资产不低于非现金基金资产的 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，本基金在履行适当程序后以变更后的比例为准，本基金的投资比例也会做相应调整。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR（Value at Risk）指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	377,508,537.74	93.72
交易性金融资产—基金投资	-	-
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	377,508,537.74	93.72

注：债券投资为可转债、可交换债券投资。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：于 2023 年 12 月 31 日（今年），由于本基金运行期间不足一年，尚不存在足够的经验数据，因此，无法对本基金资产净值对于市场价格风险的敏感性作定量分析。

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 2023 年 12 月 31 日
第一层次	376,682,122.88
第二层次	137,764.00
第三层次	688,650.86
合计	377,508,537.74

7.4.14.2.2 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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 2 月 21 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	1,120,325.03	1,120,325.03

转出第三层次	-	628,820.15	628,820.15
当期利得或损失总额	-	197,145.98	197,145.98
其中：计入损益的利得或损失	-	197,145.98	197,145.98
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	688,650.86	688,650.86
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	116,771.80	116,771.80

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流通受限股票	688,650.86	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.1855-2.1988	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

7.4.14.4 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。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	377,508,537.74	92.56
	其中：股票	377,508,537.74	92.56
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	29,974,757.00	7.35
8	其他各项资产	388,757.60	0.10
9	合计	407,872,052.34	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	1,180,738.00	0.29
B	采矿业	11,376.00	-
C	制造业	237,717,937.01	59.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,996,509.00	1.74
E	建筑业	8,612,783.00	2.14
F	批发和零售业	10,801,317.00	2.68
G	交通运输、仓储和邮政业	2,576,535.00	0.64
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	43,179,247.68	10.72
J	金融业	1,694,880.00	0.42
K	房地产业	3,514,516.00	0.87
L	租赁和商务服务业	127,920.00	0.03
M	科学研究和技术服务业	9,584,411.64	2.38
N	水利、环境和公共设施管理业	801,969.00	0.20
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,313,220.00	0.33
R	文化、体育和娱乐业	3,694,211.00	0.92
S	综合	1,877,271.00	0.47
	合计	333,684,841.33	82.84

8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	55,356.00	0.01
C	制造业	39,245,030.41	9.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	952,590.00	0.24
E	建筑业	853,542.00	0.21
F	批发和零售业	492,162.30	0.12
G	交通运输、仓储和邮政业	394,709.10	0.10
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	969,139.38	0.24
J	金融业	350,892.00	0.09
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,058.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	507,217.22	0.13
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	43,823,696.41	10.88

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

8.3 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

8.3.1 期末指数投资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	300440	运达科技	553,600	4,124,320.00	1.02
2	002035	华帝股份	627,900	3,899,259.00	0.97
3	002533	金杯电工	481,500	3,890,520.00	0.97
4	300318	博晖创新	590,500	3,684,720.00	0.91
5	300349	金卡智能	296,501	3,682,542.42	0.91
6	002449	国星光电	383,700	3,633,639.00	0.90
7	603328	依顿电子	427,000	3,480,050.00	0.86

8	002688	金河生物	716,200	3,444,922.00	0.86
9	300259	新天科技	885,900	3,215,817.00	0.80
10	002641	公元股份	632,700	3,182,481.00	0.79
11	600629	华建集团	614,700	3,171,852.00	0.79
12	688095	福昕软件	41,729	2,914,770.65	0.72
13	300468	四方精创	267,800	2,905,630.00	0.72
14	002345	潮宏基	420,100	2,860,881.00	0.71
15	002160	常铝股份	673,800	2,823,222.00	0.70
16	600894	广日股份	381,300	2,802,555.00	0.70
17	002212	天融信	286,000	2,797,080.00	0.69
18	002283	天润工业	475,400	2,781,090.00	0.69
19	600488	津药药业	566,400	2,775,360.00	0.69
20	603366	日出东方	427,800	2,665,194.00	0.66
21	600797	浙大网新	390,000	2,558,400.00	0.64
22	600268	国电南自	366,800	2,556,596.00	0.63
23	600966	博汇纸业	408,400	2,536,164.00	0.63
24	002376	新北洋	332,500	2,533,650.00	0.63
25	000639	西王食品	566,100	2,502,162.00	0.62
26	600458	时代新材	269,400	2,481,174.00	0.62
27	002016	世荣兆业	377,300	2,373,217.00	0.59
28	002479	富春环保	495,700	2,364,489.00	0.59
29	603681	永冠新材	150,200	2,268,020.00	0.56
30	002546	新联电子	447,200	2,236,000.00	0.56
31	600429	三元股份	498,400	2,222,864.00	0.55
32	300120	经纬辉开	306,100	2,222,286.00	0.55
33	002443	金洲管道	320,700	2,196,795.00	0.55
34	603686	福龙马	214,380	2,193,107.40	0.54
35	688209	英集芯	119,789	2,139,431.54	0.53
36	002398	垒知集团	445,800	2,126,466.00	0.53
37	603897	长城科技	102,700	2,103,296.00	0.52
38	600835	上海机电	176,800	2,098,616.00	0.52
39	000910	大亚圣象	260,700	2,085,600.00	0.52
40	000555	神州信息	183,200	2,068,328.00	0.51
41	688365	光云科技	187,824	2,045,403.36	0.51
42	300248	新开普	209,200	2,006,228.00	0.50
43	002752	昇兴股份	379,800	1,967,364.00	0.49
44	603508	思维列控	124,200	1,949,940.00	0.48
45	600664	哈药股份	574,100	1,923,235.00	0.48
46	300732	设研院	215,440	1,902,335.20	0.47
47	300132	青松股份	363,000	1,894,860.00	0.47
48	603012	创力集团	318,800	1,884,108.00	0.47
49	600577	精达股份	454,700	1,882,458.00	0.47
50	000551	创元科技	179,300	1,877,271.00	0.47

51	002083	孚日股份	369,900	1,864,296.00	0.46
52	002048	宁波华翔	141,100	1,835,711.00	0.46
53	603367	辰欣药业	124,100	1,816,824.00	0.45
54	300758	七彩化学	179,200	1,811,712.00	0.45
55	600628	新世界	257,200	1,802,972.00	0.45
56	002297	博云新材	221,000	1,761,370.00	0.44
57	002302	西部建设	268,900	1,742,472.00	0.43
58	600284	浦东建设	273,400	1,722,420.00	0.43
59	600880	博瑞传播	342,600	1,716,426.00	0.43
60	603018	华设集团	224,800	1,708,480.00	0.42
61	600480	凌云股份	186,000	1,694,460.00	0.42
62	600210	紫江企业	359,300	1,688,710.00	0.42
63	000823	超声电子	172,700	1,652,739.00	0.41
64	000685	中山公用	223,100	1,630,861.00	0.40
65	000990	诚志股份	196,100	1,609,981.00	0.40
66	000600	建投能源	319,900	1,602,699.00	0.40
67	300768	迪普科技	107,600	1,590,328.00	0.39
68	688660	电气风电	307,263	1,579,331.82	0.39
69	603920	世运电路	84,500	1,544,660.00	0.38
70	688148	芳源股份	200,860	1,540,596.20	0.38
71	000717	中南股份	604,100	1,534,414.00	0.38
72	000680	山推股份	310,500	1,533,870.00	0.38
73	600531	豫光金铅	252,900	1,530,045.00	0.38
74	603333	尚纬股份	265,400	1,515,434.00	0.38
75	002148	北纬科技	246,600	1,489,464.00	0.37
76	003012	东鹏控股	179,700	1,482,525.00	0.37
77	002063	远光软件	237,860	1,469,974.80	0.36
78	300384	三联虹普	90,376	1,442,400.96	0.36
79	000789	万年青	209,900	1,439,914.00	0.36
80	002206	海利得	286,500	1,438,230.00	0.36
81	300369	绿盟科技	152,500	1,438,075.00	0.36
82	300219	鸿利智汇	170,100	1,432,242.00	0.36
83	601616	广电电气	392,700	1,425,501.00	0.35
84	300193	佳士科技	182,800	1,420,356.00	0.35
85	603618	杭电股份	221,900	1,420,160.00	0.35
86	002833	弘亚数控	79,000	1,401,460.00	0.35
87	002062	宏润建设	315,300	1,396,779.00	0.35
88	688128	中国电研	67,256	1,380,093.12	0.34
89	002233	塔牌集团	193,500	1,369,980.00	0.34
90	688208	道通科技	57,249	1,359,663.75	0.34
91	600351	亚宝药业	196,600	1,356,540.00	0.34
92	002067	景兴纸业	396,500	1,344,135.00	0.33
93	002390	信邦制药	300,700	1,335,108.00	0.33

94	688699	明微电子	33,008	1,331,872.80	0.33
95	603766	隆鑫通用	255,100	1,316,316.00	0.33
96	002524	光正眼科	203,600	1,313,220.00	0.33
97	601126	四方股份	92,100	1,304,136.00	0.32
98	002483	润邦股份	248,300	1,296,126.00	0.32
99	002462	嘉事堂	90,900	1,291,689.00	0.32
100	002441	众业达	135,900	1,286,973.00	0.32
101	601886	江河集团	191,600	1,276,056.00	0.32
102	300378	鼎捷软件	59,800	1,274,338.00	0.32
103	002361	神剑股份	323,100	1,269,783.00	0.32
104	603611	诺力股份	66,300	1,255,059.00	0.31
105	300303	聚飞光电	211,600	1,254,788.00	0.31
106	603520	司太立	88,200	1,241,856.00	0.31
107	600609	金杯汽车	255,500	1,241,730.00	0.31
108	601137	博威合金	79,300	1,231,529.00	0.31
109	002167	东方锆业	191,100	1,228,773.00	0.31
110	603368	柳药集团	63,900	1,208,988.00	0.30
111	688176	亚虹医药-U	111,657	1,203,662.46	0.30
112	300638	广和通	62,840	1,195,845.20	0.30
113	601163	三角轮胎	81,700	1,177,297.00	0.29
114	300642	透景生命	66,300	1,170,195.00	0.29
115	600371	万向德农	107,900	1,157,767.00	0.29
116	002158	汉钟精机	52,000	1,157,520.00	0.29
117	600710	苏美达	162,400	1,151,416.00	0.29
118	300441	鲍斯股份	167,100	1,151,319.00	0.29
119	000550	江铃汽车	60,100	1,143,703.00	0.28
120	603165	荣晟环保	95,300	1,141,694.00	0.28
121	002440	闰土股份	184,800	1,127,280.00	0.28
122	300323	华灿光电	152,900	1,119,228.00	0.28
123	300409	道氏技术	100,300	1,117,342.00	0.28
124	300055	万邦达	176,300	1,087,771.00	0.27
125	688580	伟思医疗	16,786	1,073,128.98	0.27
126	300381	溢多利	143,700	1,059,069.00	0.26
127	002225	濮耐股份	276,800	1,046,304.00	0.26
128	000026	飞亚达	95,300	1,044,488.00	0.26
129	002107	沃华医药	169,200	1,027,044.00	0.25
130	600798	宁波海运	280,000	1,024,800.00	0.25
131	600897	厦门空港	81,400	1,016,686.00	0.25
132	688403	汇成股份	96,335	1,016,334.25	0.25
133	002969	嘉美包装	245,300	1,010,636.00	0.25
134	600594	益佰制药	174,100	990,629.00	0.25
135	600581	八一钢铁	273,300	981,147.00	0.24
136	000612	焦作万方	166,800	959,100.00	0.24

137	002106	莱宝高科	89,800	955,472.00	0.24
138	600180	瑞茂通	152,700	929,943.00	0.23
139	002286	保龄宝	114,300	928,116.00	0.23
140	300365	恒华科技	136,500	922,740.00	0.23
141	603323	苏农银行	220,500	917,280.00	0.23
142	600757	长江传媒	123,000	916,350.00	0.23
143	601089	福元医药	52,100	898,204.00	0.22
144	300771	智莱科技	82,300	894,601.00	0.22
145	300066	三川智慧	173,500	876,175.00	0.22
146	688083	中望软件	8,633	859,328.82	0.21
147	603916	苏博特	84,300	859,017.00	0.21
148	002301	齐心集团	120,800	858,888.00	0.21
149	688519	南亚新材	33,219	855,721.44	0.21
150	688020	方邦股份	17,647	855,526.56	0.21
151	600058	五矿发展	90,900	852,642.00	0.21
152	002274	华昌化工	111,000	838,050.00	0.21
153	002296	辉煌科技	100,800	831,600.00	0.21
154	601700	风范股份	164,700	825,147.00	0.20
155	300127	银河磁体	46,800	810,108.00	0.20
156	000030	富奥股份	150,000	801,000.00	0.20
157	002061	浙江交科	217,100	792,415.00	0.20
158	600869	远东股份	180,500	792,395.00	0.20
159	300119	瑞普生物	47,900	785,081.00	0.19
160	002768	国恩股份	36,600	783,972.00	0.19
161	000928	中钢国际	133,400	777,722.00	0.19
162	603093	南华期货	64,800	777,600.00	0.19
163	002276	万马股份	75,800	774,676.00	0.19
164	002367	康力电梯	103,000	774,560.00	0.19
165	002913	奥士康	24,900	763,185.00	0.19
166	603989	艾华集团	35,400	761,808.00	0.19
167	002196	方正电机	106,100	761,798.00	0.19
168	300739	明阳电路	49,600	759,376.00	0.19
169	000931	中关村	129,100	757,817.00	0.19
170	600810	神马股份	101,200	752,928.00	0.19
171	300871	回盛生物	51,600	746,136.00	0.19
172	600420	国药现代	75,400	738,166.00	0.18
173	300632	光莆股份	58,200	734,484.00	0.18
174	002649	博彦科技	59,700	732,519.00	0.18
175	002636	金安国纪	81,800	728,838.00	0.18
176	000159	国际实业	112,100	727,529.00	0.18
177	601609	金田股份	107,200	725,744.00	0.18
178	600939	重庆建工	215,100	705,528.00	0.18
179	300348	长亮科技	68,400	705,204.00	0.18

180	000036	华联控股	178,400	693,976.00	0.17
181	600312	平高电气	54,500	691,605.00	0.17
182	605388	均瑶健康	55,100	690,954.00	0.17
183	600216	浙江医药	61,800	663,114.00	0.16
184	300177	中海达	91,800	660,042.00	0.16
185	300439	美康生物	56,700	658,287.00	0.16
186	000859	国风新材	123,500	655,785.00	0.16
187	300062	中能电气	102,900	641,067.00	0.16
188	000055	方大集团	141,100	637,772.00	0.16
189	002522	浙江众成	131,000	630,110.00	0.16
190	605208	永茂泰	65,800	625,100.00	0.16
191	000901	航天科技	66,400	618,848.00	0.15
192	603990	麦迪科技	47,760	617,059.20	0.15
193	603601	再升科技	143,500	617,050.00	0.15
194	300645	正元智慧	33,600	611,184.00	0.15
195	002469	三维化学	100,503	609,048.18	0.15
196	301087	可孚医疗	16,050	608,295.00	0.15
197	600459	贵研铂业	41,100	590,196.00	0.15
198	000543	皖能电力	93,600	585,936.00	0.15
199	600055	万东医疗	34,200	584,136.00	0.15
200	603126	中材节能	84,500	569,530.00	0.14
201	300227	光韵达	72,500	568,400.00	0.14
202	002662	京威股份	160,000	561,600.00	0.14
203	688221	前沿生物-U	56,221	557,712.32	0.14
204	300040	九洲集团	98,700	552,720.00	0.14
205	002588	史丹利	86,400	551,232.00	0.14
206	600572	康恩贝	108,900	549,945.00	0.14
207	300787	海能实业	31,850	535,717.00	0.13
208	002412	汉森制药	79,000	535,620.00	0.13
209	002695	煌上煌	51,100	535,017.00	0.13
210	002478	常宝股份	97,200	529,740.00	0.13
211	601789	宁波建工	125,500	519,570.00	0.13
212	603966	法兰泰克	63,200	516,976.00	0.13
213	002110	三钢闽光	126,800	513,540.00	0.13
214	600525	长园集团	95,800	512,530.00	0.13
215	300099	尤洛卡	81,400	503,866.00	0.13
216	002111	威海广泰	54,900	497,394.00	0.12
217	300772	运达股份	46,300	492,632.00	0.12
218	603859	能科科技	13,000	490,490.00	0.12
219	000088	盐田港	99,400	485,072.00	0.12
220	000682	东方电子	60,200	484,610.00	0.12
221	000407	胜利股份	133,200	482,184.00	0.12
222	601019	山东出版	50,700	475,566.00	0.12

223	688232	新点软件	13,089	473,821.80	0.12
224	002661	克明食品	49,500	471,735.00	0.12
225	300095	华伍股份	56,800	467,464.00	0.12
226	300137	先河环保	83,600	464,816.00	0.12
227	002090	金智科技	46,200	461,076.00	0.11
228	002303	美盈森	129,400	454,194.00	0.11
229	600278	东方创业	64,900	453,002.00	0.11
230	300110	华仁药业	106,400	449,008.00	0.11
231	300147	香雪制药	86,100	443,415.00	0.11
232	000589	贵州轮胎	71,900	440,028.00	0.11
233	688277	天智航-U	33,284	438,683.12	0.11
234	600866	星湖科技	92,700	431,982.00	0.11
235	688505	复旦张江	46,800	431,964.00	0.11
236	603630	拉芳家化	28,200	431,460.00	0.11
237	600425	青松建化	105,900	418,305.00	0.10
238	000811	冰轮环境	30,700	416,599.00	0.10
239	600850	电科数字	19,000	413,250.00	0.10
240	600433	冠豪高新	118,300	409,318.00	0.10
241	603987	康德莱	42,100	401,634.00	0.10
242	601949	中国出版	49,700	401,576.00	0.10
243	600618	氯碱化工	42,600	387,660.00	0.10
244	000521	长虹美菱	68,200	383,966.00	0.10
245	601827	三峰环境	49,900	374,749.00	0.09
246	300685	艾德生物	16,700	367,066.00	0.09
247	688389	普门科技	15,854	356,873.54	0.09
248	601500	通用股份	86,100	356,454.00	0.09
249	002537	海联金汇	52,700	350,982.00	0.09
250	688588	凌志软件	29,371	349,514.90	0.09
251	600184	光电股份	30,200	345,186.00	0.09
252	000881	中广核技	47,200	342,200.00	0.08
253	300815	玉禾田	23,300	340,180.00	0.08
254	300872	天阳科技	24,600	336,528.00	0.08
255	002154	报喜鸟	59,100	335,688.00	0.08
256	002815	崇达技术	34,500	330,510.00	0.08
257	600248	陕建股份	81,100	326,022.00	0.08
258	688553	汇宇制药-W	21,062	318,668.06	0.08
259	300080	易成新能	65,400	316,536.00	0.08
260	002026	山东威达	30,800	312,620.00	0.08
261	002171	楚江新材	41,200	308,176.00	0.08
262	688578	艾力斯	7,293	303,826.38	0.08
263	600979	广安爱众	86,200	298,252.00	0.07
264	688088	虹软科技	7,121	292,245.84	0.07
265	000631	顺发恒业	86,200	286,184.00	0.07

266	300463	迈克生物	18,700	281,809.00	0.07
267	688368	晶丰明源	2,601	280,751.94	0.07
268	300021	大禹节水	56,900	270,844.00	0.07
269	002130	沃尔核材	35,400	267,270.00	0.07
270	603610	麒盛科技	22,300	265,816.00	0.07
271	300377	赢时胜	32,300	250,648.00	0.06
272	002342	巨力索具	57,900	249,549.00	0.06
273	688586	江航装备	22,309	247,406.81	0.06
274	300386	飞天诚信	22,900	245,717.00	0.06
275	000059	华锦股份	42,800	234,972.00	0.06
276	001696	宗申动力	32,400	214,812.00	0.05
277	300215	电科院	40,200	212,658.00	0.05
278	002117	东港股份	24,200	206,910.00	0.05
279	300183	东软载波	13,700	206,733.00	0.05
280	603556	海兴电力	6,900	200,307.00	0.05
281	688201	信安世纪	10,142	199,594.56	0.05
282	300925	法本信息	16,500	193,875.00	0.05
283	002900	哈三联	13,900	189,735.00	0.05
284	688158	优刻得-W	10,967	180,407.15	0.04
285	688299	长阳科技	12,785	178,350.75	0.04
286	600602	云赛智联	15,100	174,707.00	0.04
287	002452	长高电新	24,300	172,530.00	0.04
288	000607	华媒控股	37,300	170,834.00	0.04
289	300451	创业慧康	25,800	168,990.00	0.04
290	002391	长青股份	26,700	168,210.00	0.04
291	301366	一博科技	5,000	166,850.00	0.04
292	601512	中新集团	20,900	161,139.00	0.04
293	603208	江山欧派	5,400	160,326.00	0.04
294	600756	浪潮软件	11,300	156,731.00	0.04
295	603983	丸美股份	6,100	154,147.00	0.04
296	603848	好太太	9,700	150,156.00	0.04
297	300687	赛意信息	6,600	143,748.00	0.04
298	002421	达实智能	44,300	142,646.00	0.04
299	300286	安科瑞	5,500	142,615.00	0.04
300	000597	东北制药	26,400	141,240.00	0.04
301	300102	乾照光电	19,200	141,120.00	0.04
302	688766	普冉股份	1,411	138,249.78	0.03
303	300882	万胜智能	5,500	133,980.00	0.03
304	002004	华邦健康	27,800	129,548.00	0.03
305	002344	海宁皮城	31,200	127,920.00	0.03
306	300194	福安药业	28,500	124,830.00	0.03
307	300428	立中集团	5,900	124,608.00	0.03
308	300241	瑞丰光电	21,700	122,171.00	0.03

309	600586	金晶科技	16,800	112,224.00	0.03
310	600876	凯盛新能	7,900	110,837.00	0.03
311	603699	纽威股份	7,900	109,494.00	0.03
312	002516	旷达科技	21,300	105,009.00	0.03
313	603109	神驰机电	6,000	98,520.00	0.02
314	688173	希荻微	5,600	98,504.00	0.02
315	300222	科大智能	13,300	97,888.00	0.02
316	300036	超图软件	4,500	94,050.00	0.02
317	601566	九牧王	9,000	89,730.00	0.02
318	000650	仁和药业	13,500	89,505.00	0.02
319	600054	黄山旅游	8,000	87,040.00	0.02
320	002224	三力士	15,900	80,931.00	0.02
321	301123	奕东电子	3,400	79,764.00	0.02
322	600063	皖维高新	18,300	78,690.00	0.02
323	002435	长江健康	18,600	77,562.00	0.02
324	600391	航发科技	4,000	76,480.00	0.02
325	000973	佛塑科技	13,800	67,482.00	0.02
326	688569	铁科轨道	2,400	66,264.00	0.02
327	300522	世名科技	4,600	62,100.00	0.02
328	603319	湘油泵	3,500	61,390.00	0.02
329	300497	富祥药业	6,500	60,840.00	0.02
330	000737	北方铜业	9,400	54,520.00	0.01
331	300627	华测导航	1,700	52,734.00	0.01
332	300582	英飞特	4,200	50,442.00	0.01
333	300149	睿智医药	6,500	49,725.00	0.01
334	002645	华宏科技	4,400	49,720.00	0.01
335	603067	振华股份	4,500	45,855.00	0.01
336	000019	深粮控股	5,900	44,486.00	0.01
337	002639	雪人股份	5,600	42,000.00	0.01
338	300358	楚天科技	3,300	35,310.00	0.01
339	002454	松芝股份	4,600	34,546.00	0.01
340	002911	佛燃能源	2,800	32,088.00	0.01
341	601002	晋亿实业	6,500	31,460.00	0.01
342	688568	中科星图	618	30,319.08	0.01
343	600201	生物股份	2,700	29,079.00	0.01
344	002891	中宠股份	1,100	28,985.00	0.01
345	600269	赣粤高速	6,700	27,537.00	0.01
346	603881	数据港	1,300	25,766.00	0.01
347	300465	高伟达	2,500	24,975.00	0.01
348	603421	鼎信通讯	2,500	23,500.00	0.01
349	600359	新农开发	3,100	22,971.00	0.01
350	688697	纽威数控	1,200	22,596.00	0.01
351	600787	中储股份	4,400	22,440.00	0.01

352	603698	航天工程	1,500	21,555.00	0.01
353	603171	税友股份	600	21,228.00	0.01
354	300326	凯利泰	3,200	20,256.00	0.01
355	300233	金城医药	1,100	18,326.00	0.00
356	300305	裕兴股份	1,600	15,808.00	0.00
357	300477	合纵科技	4,200	15,750.00	0.00
358	688179	阿拉丁	803	15,385.48	0.00
359	688003	天准科技	400	15,008.00	0.00
360	002434	万里扬	1,900	14,155.00	0.00
361	603530	神马电力	600	12,444.00	0.00
362	688252	天德钰	591	11,796.36	0.00
363	601101	昊华能源	1,800	11,376.00	0.00
364	300903	科翔股份	1,000	10,060.00	0.00
365	688077	大地熊	411	9,802.35	0.00
366	300113	顺网科技	700	9,800.00	0.00
367	600308	华泰股份	2,800	9,688.00	0.00
368	601811	新华文轩	700	9,562.00	0.00
369	600855	航天长峰	800	8,576.00	0.00
370	002140	东华科技	1,000	8,500.00	0.00
371	002419	天虹股份	1,300	7,189.00	0.00
372	601900	南方传媒	300	3,897.00	0.00

8.3.2 期末积极投资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	600727	鲁北化工	484,600	3,188,668.00	0.79
2	603700	宁水集团	126,900	1,810,863.00	0.45
3	000404	长虹华意	300,500	1,769,945.00	0.44
4	000100	TCL 科技	336,300	1,446,090.00	0.36
5	000959	首钢股份	417,500	1,444,550.00	0.36
6	002381	双箭股份	182,000	1,379,560.00	0.34
7	300289	利德曼	218,300	1,342,545.00	0.33
8	600843	上工申贝	230,000	1,315,600.00	0.33
9	000528	柳工	168,900	1,138,386.00	0.28
10	600624	复旦复华	189,100	1,079,761.00	0.27
11	002753	永东股份	127,800	1,054,350.00	0.26
12	688009	中国通号	226,658	992,762.04	0.25
13	600819	耀皮玻璃	189,000	962,010.00	0.24
14	300425	中建环能	198,400	928,512.00	0.23
15	300843	胜蓝股份	39,400	905,412.00	0.22
16	002745	木林森	104,300	903,238.00	0.22
17	002798	帝欧家居	131,600	861,980.00	0.21
18	601618	中国中冶	272,700	834,462.00	0.21
19	600332	白云山	28,800	823,680.00	0.20

20	603818	曲美家居	145,900	787,860.00	0.20
21	601956	东贝集团	128,600	767,742.00	0.19
22	300082	奥克股份	104,100	725,577.00	0.18
23	600802	福建水泥	135,900	703,962.00	0.17
24	000921	海信家电	33,102	675,280.80	0.17
25	600558	大西洋	165,600	673,992.00	0.17
26	600812	华北制药	114,300	651,510.00	0.16
27	601717	郑煤机	48,000	607,200.00	0.15
28	603111	康尼机电	108,100	602,117.00	0.15
29	600582	天地科技	105,200	572,288.00	0.14
30	300306	远方信息	43,600	526,688.00	0.13
31	603988	中电电机	43,000	488,910.00	0.12
32	002382	蓝帆医疗	72,600	484,968.00	0.12
33	300746	汉嘉设计	48,000	482,400.00	0.12
34	300412	迦南科技	72,600	413,094.00	0.10
35	300018	中元股份	67,300	411,203.00	0.10
36	002094	青岛金王	108,100	409,699.00	0.10
37	600774	汉商集团	41,400	408,204.00	0.10
38	688616	西力科技	29,592	403,634.88	0.10
39	000605	渤海股份	61,900	396,779.00	0.10
40	002492	恒基达鑫	65,100	389,949.00	0.10
41	601139	深圳燃气	52,300	360,347.00	0.09
42	600741	华域汽车	20,100	327,228.00	0.08
43	603115	海星股份	22,300	326,472.00	0.08
44	600841	动力新科	52,800	312,048.00	0.08
45	300281	金明精机	51,700	309,683.00	0.08
46	002054	德美化工	44,100	299,880.00	0.07
47	002879	长缆科技	17,700	283,554.00	0.07
48	300300	海峡创新	68,300	273,883.00	0.07
49	002600	领益智造	40,100	271,076.00	0.07
50	600746	江苏索普	37,000	270,840.00	0.07
51	603010	万盛股份	23,800	256,802.00	0.06
52	000951	中国重汽	18,700	249,832.00	0.06
53	605066	天正电气	26,400	242,352.00	0.06
54	300514	友讯达	14,100	229,830.00	0.06
55	300243	瑞丰高材	22,430	219,141.10	0.05
56	002392	北京利尔	55,600	210,168.00	0.05
57	300800	力合科技	15,200	207,784.00	0.05
58	688030	山石网科	10,000	200,200.00	0.05
59	600023	浙能电力	42,400	195,464.00	0.05
60	000729	燕京啤酒	21,900	188,997.00	0.05
61	600918	中泰证券	27,000	185,220.00	0.05
62	603790	雅运股份	13,200	184,932.00	0.05

63	002097	山河智能	27,600	169,188.00	0.04
64	600390	五矿资本	35,400	165,672.00	0.04
65	600569	安阳钢铁	73,300	156,129.00	0.04
66	688109	品茗科技	5,200	146,484.00	0.04
67	300096	ST 易联众	20,200	137,764.00	0.03
68	300279	和晶科技	19,200	124,224.00	0.03
69	000559	万向钱潮	21,500	111,585.00	0.03
70	688582	芯动联科	2,658	102,784.86	0.03
71	688004	博汇科技	3,442	101,091.54	0.03
72	603926	铁流股份	7,900	98,829.00	0.02
73	601969	海南矿业	8,400	55,356.00	0.01
74	000533	顺钠股份	10,900	51,121.00	0.01
75	603365	水星家纺	3,000	43,140.00	0.01
76	601607	上海医药	2,500	41,825.00	0.01
77	000997	新大陆	2,100	41,181.00	0.01
78	300411	金盾股份	5,000	34,950.00	0.01
79	300407	凯发电气	3,500	33,040.00	0.01
80	301348	蓝箭电子	561	25,003.77	0.01
81	688189	南新制药	2,353	22,188.79	0.01
82	301526	国际复材	4,759	21,177.55	0.01
83	688393	安必平	807	20,150.79	0.01
84	601117	中国化学	3,000	19,080.00	0.00
85	300904	威力传动	284	17,474.52	0.00
86	002373	千方科技	1,400	15,694.00	0.00
87	688629	华丰科技	708	15,505.20	0.00
88	688627	精智达	165	14,473.80	0.00
89	301381	赛维时代	470	13,954.30	0.00
90	301510	固高科技	396	13,863.96	0.00
91	301172	君逸数码	360	13,737.60	0.00
92	301488	豪恩汽电	195	13,472.55	0.00
93	301558	三态股份	959	12,850.60	0.00
94	688548	广钢气体	1,003	12,788.25	0.00
95	688549	中巨芯-U	1,546	12,507.14	0.00
96	688652	京仪装备	228	11,913.00	0.00
97	301370	国科恒泰	740	11,847.40	0.00
98	688563	航材股份	190	11,493.10	0.00
99	688591	泰凌微	401	11,236.02	0.00
100	301262	海看股份	346	10,777.90	0.00
101	301499	维科精密	371	10,733.03	0.00
102	301508	中机认检	397	10,591.96	0.00
103	301291	明阳电气	360	10,209.60	0.00
104	301528	多浦乐	145	9,991.95	0.00
105	688613	奥精医疗	443	9,861.18	0.00

106	301507	民生健康	616	9,763.60	0.00
107	688653	康希通信	595	9,514.05	0.00
108	301292	海科新源	490	9,481.50	0.00
109	301516	中远通	604	9,368.04	0.00
110	688603	天承科技	126	9,341.64	0.00
111	301272	英华特	170	9,074.60	0.00
112	601096	宏盛华源	2,235	9,074.10	0.00
113	688620	安凯微	725	8,569.50	0.00
114	301486	致尚科技	180	8,505.00	0.00
115	301261	恒工精密	167	8,491.95	0.00
116	688573	信宇人	285	8,208.00	0.00
117	301489	思泉新材	128	8,206.08	0.00
118	688651	盛邦安全	178	8,196.90	0.00
119	301511	德福科技	360	8,161.20	0.00
120	301517	陕西华达	185	8,082.65	0.00
121	301418	协昌科技	161	8,082.20	0.00
122	301578	辰奕智能	118	8,061.76	0.00
123	301459	丰茂股份	202	8,047.68	0.00
124	301251	威尔高	228	7,886.52	0.00
125	301202	朗威股份	248	7,886.40	0.00
126	301568	思泰克	220	7,827.60	0.00
127	688671	碧兴物联	226	7,751.80	0.00
128	301393	昊帆生物	130	7,718.10	0.00
129	603296	华勤技术	99	7,697.25	0.00
130	688716	中研股份	211	7,678.29	0.00
131	301498	乖宝宠物	196	7,606.76	0.00
132	301533	威马农机	225	7,461.00	0.00
133	688631	莱斯信息	210	7,402.50	0.00
134	301520	万邦医药	138	7,278.12	0.00
135	301329	信音电子	327	7,269.21	0.00
136	301555	惠柏新材	224	7,266.56	0.00
137	301456	盘古智能	237	7,202.43	0.00
138	301295	美硕科技	215	7,135.85	0.00
139	301505	苏州规划	194	6,947.14	0.00
140	688702	盛科通信-U	144	6,937.92	0.00
141	301518	长华化学	291	6,695.91	0.00
142	301081	严牌股份	600	6,660.00	0.00
143	301550	斯菱股份	151	6,579.07	0.00
144	688646	逸飞激光	182	6,564.74	0.00
145	688648	中邮科技	303	6,493.29	0.00
146	688719	爱科赛博	107	6,430.70	0.00
147	688638	誉辰智能	107	6,385.76	0.00
148	301529	福赛科技	168	6,363.84	0.00

149	002686	亿利达	900	6,093.00	0.00
150	603004	鼎龙科技	195	6,082.05	0.00
151	688657	浩辰软件	74	5,789.02	0.00
152	301559	中集环科	316	5,763.84	0.00
153	301170	锡南科技	188	5,720.84	0.00
154	301371	敷尔佳	151	5,674.58	0.00
155	301515	港通医疗	194	5,484.38	0.00
156	301525	儒竞科技	65	5,294.90	0.00
157	001378	德冠新材	168	5,253.36	0.00
158	301548	崇德科技	89	5,250.11	0.00
159	688612	威迈斯	138	5,239.86	0.00
160	301500	飞南资源	246	5,138.94	0.00
161	601083	锦江航运	430	4,760.10	0.00
162	001326	联域股份	92	4,474.88	0.00
163	688450	光格科技	117	4,261.14	0.00
164	001306	夏厦精密	53	3,994.08	0.00
165	603270	金帝股份	135	3,993.30	0.00
166	001358	兴欣新材	87	3,841.92	0.00
167	001239	永达股份	189	3,764.88	0.00
168	603119	浙江荣泰	155	3,699.85	0.00
169	001316	润贝航科	100	3,481.00	0.00
170	603075	热威股份	147	3,426.57	0.00
171	603107	上海汽配	188	3,419.72	0.00
172	603273	天元智能	178	3,376.66	0.00
173	603276	恒兴新材	134	3,333.92	0.00
174	603062	麦加芯彩	54	3,121.74	0.00
175	603193	润本股份	187	3,115.42	0.00
176	603373	安邦护卫	88	3,058.00	0.00
177	603231	索宝蛋白	132	2,841.96	0.00
178	300625	三雄极光	100	1,482.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	603208	江山欧派	7,964,856.40	1.98
2	002869	金溢科技	7,877,321.00	1.96
3	002957	科瑞技术	7,405,958.00	1.84
4	002533	金杯电工	7,379,915.00	1.83
5	300616	尚品宅配	6,459,279.00	1.60
6	002115	三维通信	6,250,042.00	1.55
7	002458	益生股份	6,027,394.20	1.50
8	300349	金卡智能	5,901,271.30	1.47

9	688088	虹软科技	5,860,654.60	1.46
10	000600	建投能源	5,823,683.00	1.45
11	002912	中新赛克	5,689,692.00	1.41
12	603368	柳药集团	5,649,626.00	1.40
13	600284	浦东建设	5,576,979.00	1.38
14	300545	联得装备	5,562,046.16	1.38
15	601003	柳钢股份	5,441,180.00	1.35
16	002641	公元股份	5,390,918.00	1.34
17	000921	海信家电	5,374,788.88	1.33
18	000534	万泽股份	5,337,206.00	1.33
19	600537	亿晶光电	5,328,893.00	1.32
20	300871	回盛生物	5,317,067.00	1.32

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。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	603208	江山欧派	7,856,234.20	1.95
2	002869	金溢科技	7,483,102.00	1.86
3	002957	科瑞技术	7,334,105.00	1.82
4	002115	三维通信	7,052,787.20	1.75
5	688088	虹软科技	6,236,063.56	1.55
6	300616	尚品宅配	5,898,617.00	1.46
7	300545	联得装备	5,787,712.76	1.44
8	300881	盛德鑫泰	5,660,436.07	1.41
9	002912	中新赛克	5,473,504.00	1.36
10	300113	顺网科技	5,417,407.88	1.34
11	002458	益生股份	5,350,051.30	1.33
12	300168	万达信息	5,336,026.00	1.32
13	300049	福瑞股份	5,159,024.00	1.28
14	300779	惠城环保	5,112,313.00	1.27
15	000921	海信家电	5,088,464.00	1.26
16	688608	恒玄科技	4,873,262.02	1.21
17	300043	星辉娱乐	4,808,829.39	1.19
18	000600	建投能源	4,735,028.80	1.18
19	300684	中石科技	4,659,746.00	1.16
20	300305	裕兴股份	4,642,795.00	1.15

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。

8.4.3 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	1,556,974,020.74
卖出股票收入（成交）总额	1,163,015,710.46

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：无。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	388,757.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	388,757.60

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

8.12.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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 (%)
鹏华国证 2000 指数 增强 A	2,649	87,544.42	149,654,022.51	64.53	82,251,159.21	35.47
鹏华国证 2000 指数 增强 C	22,409	8,342.63	32,035,704.99	17.14	154,914,311.23	82.86
合计	25,058	16,715.43	181,689,727.50	43.38	237,165,470.44	56.62

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	鹏华国证 2000 指数增强 A	177,481.08	0.0765
	鹏华国证 2000 指数增强 C	75,622.11	0.0405
	合计	253,103.19	0.0604

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。

9.3 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

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

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产情况

注：无。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	鹏华国证 2000 指数增强 A	鹏华国证 2000 指数增强 C
基金合同生效日 (2023 年 2 月 21 日) 基金份额总额	143,679,062.77	326,932,598.74
基金合同生效日起至 报告期期末基金总申 购份额	196,647,933.07	196,653,865.26
减：基金合同生效日 起至报告期期末基金 总赎回份额	108,421,814.12	336,636,447.78
基金合同生效日起至 报告期期末基金拆分 变动份额	-	-
本报告期末基金份 额总额	231,905,181.72	186,950,016.22

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

无。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

无。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金管理人聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金审计的会计师事务所。本年度应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用 50,000.00 元。该审计机构为本基金提供审计服务的期间为本基金基金合同生效日（2023 年 02 月 21 日）起到本报告期末，不满 1 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：无。

11.6.2 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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 (%)	
华泰证券	2	2,708,613,810.15	100.00	1,439,147.69	100.00	本报告期新增

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，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- (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，最近二年未发生因重大违规行为而受到中国证监会处罚；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (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需要，并能为本基金提供全面的信息服务；
- (6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务。

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。我公司投研部门定期对所选定证券公司的服务进行综合评比，评比内容包括：提供研究报告质量、数量、及时性及提供研究服务主动性和质量等情况，并依据评比结果确定交易单元交易的具体情况。我公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向券商租用交易单元作为基金专用交易单元。

11.7.2 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(%)
华泰证券	-	-	-	-	-	-

11.8 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	鹏华国证 2000 指数增强型证券投资基金基金合同生效公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 02 月 22 日
2	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 03 月 03 日
3	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与东方财富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	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 03 月 14 日
4	鹏华基金管理有限公司关于新增人民币直销资金专户的公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 04 月 07 日
5	鹏华国证 2000 指数增强型证券投资	《证券时报》、基金管理人	2023 年 05 月 04 日

	基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告	人网站及中国证监会基金电子披露网站	
6	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购航天软件首次公开发行 A 股的公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 05 月 17 日
7	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 05 月 19 日
8	鹏华基金管理有限公司关于注意防范以协助办理贷款为借口进行诈骗活动的风险提示	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 06 月 03 日
9	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与国海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	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 06 月 05 日
10	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 06 月 06 日
11	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与北京中植基金销售有限公司申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 06 月 20 日
12	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购豪恩汽电首次公开发行 A 股的公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 06 月 28 日
13	鹏华国证 2000 指数增强型证券投资基金 2023 年第 2 季度报告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 07 月 20 日
14	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与部分销售机构申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 08 月 07 日
15	鹏华基金管理有限公司关于运用固有资金投资旗下基金的公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 08 月 21 日
16	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 08 月 22 日
17	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购金帝股份首次公开发行 A 股的公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 08 月 26 日
18	鹏华国证 2000 指数增强型证券投资基金 2023 年中期报告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 08 月 30 日
19	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分	《证券时报》、基金管理人	2023 年 09 月 22 日

	基金参与招商银行股份有限公司申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告	人网站及中国证监会基金电子披露网站	
20	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与国金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	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 09 月 27 日
21	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 10 月 13 日
22	鹏华国证 2000 指数增强型证券投资基金 2023 年第 3 季度报告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 10 月 24 日
23	鹏华基金管理有限公司关于运用固有资金投资旗下基金的公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 11 月 07 日
24	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与南京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	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 11 月 16 日

注：无。

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20230621~20231231	0.00	99,057,949.48	0.00	99,057,949.48	23.65
产品特有风险							
基金份额持有人持有的基金份额所占比例过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引起基金净值剧烈波动，甚至可能引发基金流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。							

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

2、赎回份额包含基金赎回份额、基金转换出份额、强制调减份额、场内卖出份额。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- (一)《鹏华国证 2000 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- (二)《鹏华国证 2000 指数增强型证券投资基金托管协议》；
- (三)《鹏华国证 2000 指数增强型证券投资基金 2023 年年度报告》(原文)。

13.2 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。

13.3 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 3 月 28 日