

鹏扬国证财富管理交易型开放式指数
证券投资基金
2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：鹏扬基金管理有限公司

基金托管人：华泰证券股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人华泰证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 6 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	5
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	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 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	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	36

7.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	37
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	38
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	40
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	40
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	40
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	40
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	40
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	40
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	40
7.12	投资组合报告附注	41
§ 8	基金份额持有人信息	42
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	42
8.2	期末上市基金前十名持有人	42
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	43
8.4	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的情况	43
§ 9	开放式基金份额变动	43
§ 10	重大事件揭示	43
10.1	基金份额持有人大会决议	43
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	43
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	44
10.4	基金投资策略的改变	44
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	44
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	44
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	44
10.8	其他重大事件	45
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	46
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	46
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	47
§ 12	备查文件目录	47
12.1	备查文件目录	47
12.2	存放地点	48
12.3	查阅方式	48

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏扬国证财富管理交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	鹏扬国证财富管理 ETF
场内简称	财富管理 ETF
基金主代码	159503
交易代码	159503
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 6 月 29 日
基金管理人	鹏扬基金管理有限公司
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	32,777,361.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2023 年 7 月 20 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法股票投资策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。在一般情况下，本基金将根据标的指数的成份股票的构成及其权重构建股票资产组合。此外，本基金的投资策略还包括债券与资产支持证券投资策略、衍生品投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略等。
业绩比较基准	国证财富管理指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为被动投资的交易型开放式指数基金，主要采用完全复制策略，跟踪标的指数市场表现，具有与标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

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		鹏扬基金管理有限公司	华泰证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	宋震	李双均
	联系电话	400-968-6688	025-83389842
	电子邮箱	service@pyamc.com	lishuangjun@htsc.com
客户服务电话		400-968-6688	95597
传真		010-68105915	025-83387215

注册地址	中国（上海）自由贸易试验区栖霞路 120 号 3 层 302 室	江苏省南京市江东中路 228 号
办公地址	北京市西城区复兴门外大街 A2 号 西城金茂中心 16 层	江苏省南京市江东中路 228 号
邮政编码	100045	210019
法定代表人	杨爱斌	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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.pyamc.com
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-489,173.65
本期利润	-1,941,329.45
加权平均基金份额本期利润	-0.0493
本期加权平均净值利润率	-5.05%
本期基金份额净值增长率	-6.59%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2024 年 6 月 30 日）
期末可供分配利润	-2,542,156.35
期末可供分配基金份额利润	-0.0776
期末基金资产净值	30,235,204.65
期末基金份额净值	0.9224
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2024 年 6 月 30 日）
基金份额累计净值增长率	-7.76%

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。

（2）期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

(3) 本报告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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

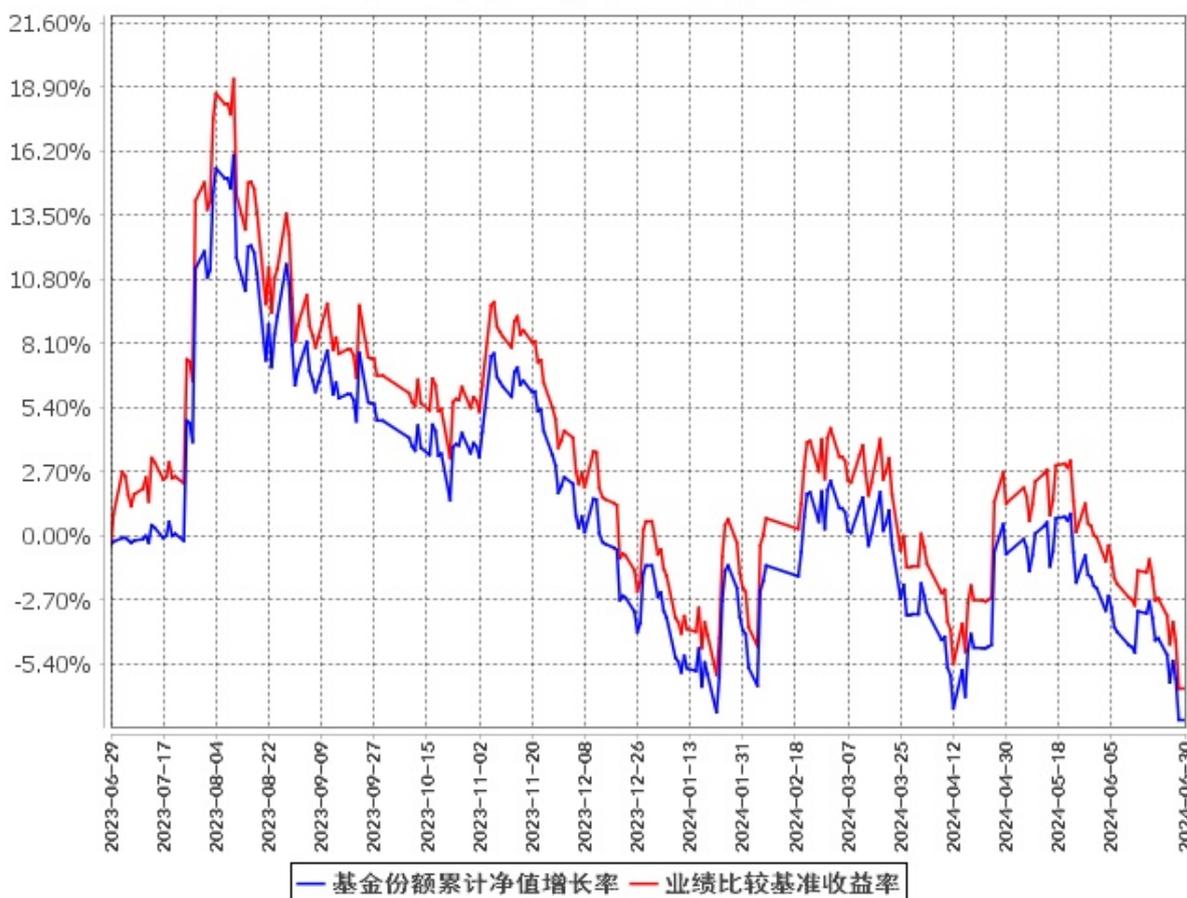
3.2 基金净值表现

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	-5.68%	0.83%	-6.36%	0.83%	0.68%	0.00%
过去三个月	-4.61%	1.07%	-5.22%	1.09%	0.61%	-0.02%
过去六个月	-6.59%	1.15%	-7.00%	1.18%	0.41%	-0.03%
过去一年	-7.54%	1.22%	-7.29%	1.27%	-0.25%	-0.05%
自基金合同生效起至今	-7.76%	1.22%	-6.43%	1.27%	-1.33%	-0.05%

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

基金份额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
(2023年6月29日至2024年6月30日)



注：按基金合同规定，本基金的建仓期为自基金合同生效之日起 6 个月。建仓期结束时，本基金的

投资组合比例符合本基金合同的有关规定。

§ 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

鹏扬基金管理有限公司(以下简称“鹏扬基金”)成立于 2016 年 7 月 6 日,是经中国证监会批准成立的全国性公募基金公司,总部位于北京。截至 2024 年 6 月末,公司管理资产总规模 1588 亿元,非货公募资产总规模 1055 亿元,累计创造投资收益超 202 亿元,分红超 86 亿元。

公司践行高质量发展。在业务布局和人才战略方面,公司形成了固定收益、主动股票、指数量化、多资产四大业务板块,汇聚海内外优秀人才,致力于打造一支将服务投资者作为长期事业的人才队伍。公司核心投资人员均具有 10 年以上知名金融机构工作经历。公司致力于打造平台化、团队化、一体化的投研体系,实现“宏观、策略、行业、公司”的全维度研究覆盖,为客户提供“全天候”的资产管理解决方案。其中,固收团队持续提升宏观研究与资产配置、利率交易、信用研究、转债增强、国债期货等核心投资能力,力求为投资人获取长期、稳健的收益;股票团队致力于做深度的个股研究和产业研究,遵循基本面理念严选个股,同时充分保留基金经理自身风格特点,在不同风格策略领域布局权益产品以适应客户的多元化需求;指数量化团队聚焦高质量核心资产,以科学方法深挖面向未来的行业主题和选股因子,努力为投资者提供具有长期良好持有体验的指数产品;多资产团队将基于大数据的定量研究和基于调研访谈的定性研究有机结合,为投资者提供便捷的多策略组合配置方案,有效分散投资风险,助力资产稳健增值。

公司坚持守法合规经营,高度注重风险管理,以金融科技赋能业务。公司严守法律合规的风险底线,在管理上树立全员风险防范意识;在业务流程上实现风险管理对投前、投中、投后的全流程覆盖;在评价方式上以结果为导向检验风险管理成效,杜绝风险事件的发生。公司成立以来对债券信用风险施行严格管控,投资的债券保持零违约。公司自主研发的金融科技成果“神灯智投”顺利通过了证监会资本市场金融科技创新(首批)试点项目评审,并转常态化投产运营,实现研究、投资、交易、风控的一体化,大幅提升资管全流程的运作效率,提升风险管理的有效性。

鹏扬基金作为一家有理想、有担当的公募基金公司,积极履行社会责任,书写“五篇金融大文章”。2024 年上半年,公司在云南省泸水市、陕西省延长县、北京市西城区等多地开展公益行动,覆盖乡村教育、消费助农、居民养老等领域。作为中国基金业协会投教专委会委员单位,公司积极联合各类媒体平台和行业机构力量,开展投资者教育和保护工作,为行业高质量发展建言献策。

鹏扬基金以“为客户创造价值,为美好生活助力”为使命,秉持“客户至上、勇于担当、拥抱

变化、合作共赢”的价值观，以“专业稳健，回报信任”作为经营宗旨，专注于长期目标，寻求服务投资者的最佳方案，全力以赴争创一流投资机构，在大资管行业迈向高阶发展的进程中行稳致远。

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		
施红俊	本基金 基金经 理, 数 量投资 部总经 理兼指 数投资 总监	2023 年 6 月 29 日	-	19	同济大学管理学博士。曾任大公国际资信评估有限公司上海分公司中小企业评级部部门经理，中证指数有限公司研究员、固定收益主管、研究开发部副总监。现任鹏扬基金管理有限公司数量投资部总经理兼指数投资总监。2019 年 8 月 29 日至 2022 年 11 月 8 日任鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金基金经理；2020 年 6 月 9 日至 2024 年 4 月 23 日任鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金基金经理；2021 年 5 月 25 日至今任鹏扬沪深 300 质量成长低波动指数证券投资基金基金经理；2021 年 7 月 16 日至 2022 年 11 月 30 日任鹏扬中证科创创业 50 指数证券投资基金基金经理；2021 年 8 月 4 日至今任鹏扬中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2021 年 12 月 22 日至今任鹏扬中证数字经济主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2022 年 4 月 27 日至 2023 年 8 月 17 日任鹏扬中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金基金经理；2022 年 9 月 26 日至今任鹏扬中证数字经济主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理；2022 年 10 月 26 日至今

				任鹏扬中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2022 年 11 月 9 日至今任鹏扬中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；2022 年 12 月 1 日至今任鹏扬中证科创创业 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 4 月 25 日至今任鹏扬北证 50 成份指数证券投资基金基金经理；2023 年 5 月 19 日至今任鹏扬中债-30 年期国债交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2023 年 6 月 29 日至今任鹏扬国证财富管理交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2023 年 8 月 17 日至今任鹏扬数字经济先锋混合型证券投资基金基金经理；2023 年 8 月 25 日至今任鹏扬中证国有企业红利交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2023 年 12 月 19 日至今任鹏扬消费量化选股混合型证券投资基金基金经理；2024 年 1 月 30 日至今任鹏扬国证财富管理交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理；2024 年 3 月 19 日至今任鹏扬中证国有企业红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。
--	--	--	--	---

注：（1）此处的“任职日期”和“离任日期”分别为公告确定的聘任日期和解聘日期。

（2）证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、

勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，无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

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及《鹏扬基金管理有限公司公平交易制度》，公平对待旗下管理的所有基金及其它组合。

本基金管理人通过统计检验的方法对本公司旗下管理的所有投资组合，在本报告期内不同时间窗口下(1日内、3日内、5日内)同向交易的价差进行了专项分析，包括旗下各大类资产组合之间的同向交易价差、各组合与其他所有组合之间的同向交易价差、以及旗下任意两个组合之间的同向交易价差。根据对样本个数、平均溢价率是否为0的T检验显著程度、平均溢价率以及溢价率分布概率、同向交易价差对投资组合的业绩影响等因素的综合分析，未发现旗下组合存在违反公平交易的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未出现涉及本基金的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

2024年上半年，美国财政政策继续保持扩张状态，大型科技公司对AI的大规模投资维持了美国经济的韧性。但美国政府债台高筑和利率高企意味着美国宽松财政政策的可持续性面临巨大挑战；AI的巨额资本投入在应用端暂时没有看到杀手级应用，意味着该资本投入短期可能收效甚微。美联储维持偏高利率水平的可能时间太长，需要通过快速降低利率来避免经济陷入衰退的自我循环。

2024年上半年，国内经济动能先回升后放缓。政策方面，总量政策强调“固本培元”；房地产政策从“三大工程”转为“放开限购+贷款收储”；货币政策受制于汇率稳定，宽松力度低于预期；财政政策在落实过紧日子要求、推进地方化债等因素影响下，强度低于预期。经济增长方面，出口与制造业投资在外需和产业结构的带动下保持较高增速，消费和基建投资的动能走弱，房地产销售与投资依然较弱。通货膨胀方面，上游资源品价格维持强势，中游制造和下游消费品价格延续低迷，核心原因是内需偏弱、外需偏强、上游产能受限以及中下游资本开支较大。流动性方面，受到汇率贬值压力的影响，降息预期落空，但资金利率基本保持平稳。信用扩张方面，央行在高质量信贷的

目标下挤掉信贷水分，信贷和存款增速下滑；结构上，私人部门融资偏弱，政府部门融资回升。

2024 年上半年，海外股票市场整体保持强势。美国股市受益于人工智能提升大型科技股的盈利预期；印度股市受益于当期盈利高速增长；日本股市受益于汇率贬值以及公司股东回报提升。A 股市场整体表现低迷，市场呈现结构高度分化的特征，期间受政策发力和经济预期修复的驱动出现了超跌反弹的行情。从风格来看，红利和价值风格表现较好。从行业板块来看，表现较好的是防御型的高股息行业以及受海外映射的 AI 相关电子行业。

操作方面，本基金本报告期内严格按照基金合同要求跟踪指数，并做好日常申购赎回的 PCF 管理和现金替代补券。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.9224 元，本报告期基金份额净值增长率为-6.59%；同期业绩比较基准收益率为-7.00%。年化跟踪误差 0.82%，各项指标均在合同规定的目标控制范围之内。

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 年下半年，我们预计美国消费支出放缓、就业市场降温，美债利率中枢进一步回落。美国经济动能将放缓，但经济硬着陆的条件暂不具备，核心原因是居民部门资产负债表健康、利率操作空间较大以及美股泡沫化程度不够极致。

展望 2024 年下半年，国内政策方面，三中全会明确了政策主线是安全发展和培育经济新动能，财政和信贷资源向制造业和新质生产力倾斜，需求侧政策保持“固本培元”的思路。若下半年出现风险事件，货币、财政和房地产政策均有调整空间。中期最重要的是观察政策范式的转变何时到来，包括大幅度降息、财政资金参与收储商品房以及控制部分行业的产能扩张。经济增长方面，在政策范式转变前，国内经济动能总体承压，但也有局部亮点。2024 年以来工业生产与出口旺盛，预计出口将保持较高水平，但贸易摩擦风险将加大。居民部门资产负债表受损，低迷的新房需求对房企流动性形成压力，商品房收储在实践中仍有阻力，居民消费下滑压力有所加大。企业部门实际投资回报率较低，叠加地缘政治的不确定性，企业逆周期增加资本开支的意愿将减弱。政策部门的税收和土地收入下滑，政府隐性债务扩张受到严格监管，因此政府支出压力较大，但政府发行专项债和国债的空间较大。在高质量信贷政策倾向之下，金融部门总体处于紧信用状态。通货膨胀方面，考虑到制造业产能和劳动力供给充足、私人部门需求承压以及需求侧政策力度有限，通胀中枢大概率将保持偏低位置。

鹏扬国证财富管理交易型开放式指数证券投资基金于 2024 年 7 月 12 日公告，本基金的最后运作日定为 2024 年 7 月 18 日，并于 2024 年 7 月 19 日进入清算程序。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及本基金合同约定，本基金管理人严格按照《企业会计准则》、《资产管理产品相关会计处理规定》、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持投资品种进行估值。

本基金管理人制订的证券投资基金估值政策与估值程序确定了估值目的、估值日、估值对象、估值程序、估值方法以及估值差错处理、暂停估值和特殊情形处理等事项。日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值委员会（成员包括公司分管领导以及投资研究部、风险管理部、监察稽核部、交易管理部、基金运营部等部门负责人及相关业务骨干，估值委员会成员中不包括基金经理）。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经历。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。定价服务机构按照协议约定提供定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

本基金本报告期内出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，时间系从 2023 年 12 月 7 日至 2024 年 2 月 19 日，2024 年 2 月 21 日至 2024 年 4 月 25 日，2024 年 4 月 29 日至 2024 年 6 月 28 日。本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

§ 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遵规守信、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、费用开支进行了复核，未发现基金管理人存在损害本基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

华泰证券作为基金托管人，复核了本基金 2024 年中期报告中的有关财务数据、收益分配、投资组合报告等财务信息相关内容，相关内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：鹏扬国证财富管理交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	542,162.40	439,821.62
结算备付金		36,665.62	62,509.78
存出保证金		135,004.68	611,605.60
交易性金融资产	6.4.7.2	29,582,664.52	34,088,987.21
其中：股票投资		29,582,664.52	34,088,987.21
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	-	-19.89
应收清算款		245,769.22	264,079.56
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		30,542,266.44	35,466,983.88
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		24,634.56	-

应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		14,589.13	15,688.70
应付托管费		2,917.84	3,137.75
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		4.45	30.61
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	264,915.81	118,442.24
负债合计		307,061.79	137,299.30
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	32,777,361.00	35,777,361.00
未分配利润	6.4.7.8	-2,542,156.35	-447,676.42
净资产合计		30,235,204.65	35,329,684.58
负债和净资产总计		30,542,266.44	35,466,983.88

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9224 元，基金份额总额 32,777,361.00 份。

6.2 利润表

会计主体：鹏扬国证财富管理交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 6 月 29 日(基金合 同生效日)至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-1,765,910.32	-728,140.78
1. 利息收入		10,526.75	38,574.42
其中：存款利息收入	6.4.7.9	8,026.47	38,574.42
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		2,500.28	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		-346,578.30	1,060.00
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-588,271.14	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
资产支持证券投 资收益	6.4.7.12	-	-

贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	241,692.84	1,060.00
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益 (损失以“-”号填列)	6.4.7.16	-1,452,155.80	-769,006.00
4. 汇兑收益(损失以“-” 号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-” 号填列)	6.4.7.17	22,297.03	1,230.80
减：二、营业总支出		175,419.13	6,165.52
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	95,333.87	4,241.88
2. 托管费	6.4.10.2.2	19,066.78	848.38
3. 销售服务费		-	-
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	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		9.00	-
8. 其他费用	6.4.7.19	61,009.48	1,075.26
三、利润总额(亏损总 额以“-”号填列)		-1,941,329.45	-734,306.30
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以 “-”号填列)		-1,941,329.45	-734,306.30
五、其他综合收益的税 后净额		-	-
六、综合收益总额		-1,941,329.45	-734,306.30

注：本基金合同于 2023 年 6 月 29 日生效，上年度可比期间自 2023 年 6 月 29 日至 2023 年 6 月 30 日。

6.3 净资产变动表

会计主体：鹏扬国证财富管理交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	35,777,361.00	-	-447,676.42	35,329,684.58

二、本期期初净资产	35,777,361.00	-	-447,676.42	35,329,684.58
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-3,000,000.00	-	-2,094,479.93	-5,094,479.93
（一）、综合收益总额	-	-	-1,941,329.45	-1,941,329.45
（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）	-3,000,000.00	-	-153,150.48	-3,153,150.48
其中：1. 基金申购款	39,500,000.00	-	-417,981.93	39,082,018.07
2. 基金赎回款	-42,500,000.00	-	264,831.45	-42,235,168.55
（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、本期期末净资产	32,777,361.00	-	-2,542,156.35	30,235,204.65
项目	上年度可比期间 2023 年 6 月 29 日(基金合同生效日)至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-	-
二、本期期初净资产	310,777,361.00	-	-	310,777,361.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-	-	-734,306.30	-734,306.30
（一）、综合收益总额	-	-	-734,306.30	-734,306.30
（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）	-	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-	-

(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、本期期末净资产	310,777,361.00	-	-734,306.30	310,043,054.70

注：本基金合同于 2023 年 6 月 29 日生效，上年度可比期间自 2023 年 6 月 29 日至 2023 年 6 月 30 日。

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：

杨爱斌	崔雁巍	韩欢
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

鹏扬国证财富管理交易型开放式指数证券投资基金(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]775号《关于准予鹏扬国证财富管理交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》准予注册，由鹏扬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《鹏扬国证财富管理交易型开放式指数证券投资基金基金合同》(以下简称“本基金基金合同”)于 2023 年 6 月 8 日至 2023 年 6 月 21 日向社会公开募集。本基金为交易型开放式，存续期限不定，首次募集的有效净认购金额为人民币 310,755,325.00 元，有效净认购资金在募集期间产生的利息为人民币 23,266.80 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 0355 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，本基金基金合同于 2023 年 6 月 29 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 310,777,361.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 22,036.00 份基金份额。本基金的基金管理人为鹏扬基金管理有限公司，基金托管人为华泰证券股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2023]615 号审核同意，本基金 310,777,361.00 份基金份额于 2023 年 7 月 20 日在深交所挂牌交易。

本基金的基金管理人鹏扬基金管理有限公司以本基金为目标 ETF，募集成立了鹏扬国证财富管理交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(以下简称“鹏扬国证财富管理 ETF 发起式联接基金”)。鹏扬国证财富管理 ETF 发起式联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝

大多数基金资产投资于本基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和本基金基金合同的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股(含存托凭证)、备选成份股(含存托凭证)。为更好地实现投资目标，本基金还可少量投资于非成份股(包括创业板及其他中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证)、债券(包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持债券、可转债、可交换债、可分离交易可转债及其他经中国证监会允许投资的债券)、衍生品(包括股指期货、国债期货、股票期权)、货币市场工具、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、资产支持证券、债券回购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。本基金可以根据法律法规的规定参与融资和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。

在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；其他金融工具的投资比例依据法律法规和监管机构的规定执行。

如法律法规或监管机构变更投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资比例。

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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、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>》、本基金基金合同和在财务报表附注 6.4.4 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。

根据本基金基金合同以及基金管理人鹏扬基金管理有限公司于 2024 年 7 月 12 日发布的《鹏扬国证财富管理交易型开放式指数证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，本基金于 2024 年 7 月 19 日进入财产清算期，详情参见附注 6.4.8.2 资产负债表日后事项，因此本基金财务报表以清算基础编制。于 2024 年 6 月 30 日，所有资产以可收回金额和账面价值孰低计量，负债以预计需要清偿的金额计量。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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本报告期末的财务状况以及本报告期间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

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

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[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》、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。存款利息收入不征收增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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，股权的股息、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。对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。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，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继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	542,162.40
等于：本金	541,948.15
加：应计利息	214.25
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	542,162.40

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024年6月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		32,399,403.00	-	29,582,664.52	-2,816,738.48
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		32,399,403.00	-	29,582,664.52	-2,816,738.48

注：股票投资的公允价值和公允价值变动均包含可退替代款估值增值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	18,292.63
其中：交易所市场	18,292.63
银行间市场	-
应付利息	-
应付替代款	185,613.70
预提费用	61,009.48
合计	264,915.81

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	35,777,361.00	35,777,361.00
本期申购	39,500,000.00	39,500,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-42,500,000.00	-42,500,000.00
本期末	32,777,361.00	32,777,361.00

6.4.7.8 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	4,442,602.93	-4,890,279.35	-447,676.42
本期期初	4,442,602.93	-4,890,279.35	-447,676.42
本期利润	-489,173.65	-1,452,155.80	-1,941,329.45
本期基金份额交易产生的变动数	-376,845.05	223,694.57	-153,150.48
其中：基金申购款	4,432,983.70	-4,850,965.63	-417,981.93
基金赎回款	-4,809,828.75	5,074,660.20	264,831.45
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,576,584.23	-6,118,740.58	-2,542,156.35

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日 至 2024 年 6 月 30 日
	活期存款利息收入
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	1,300.52
其他	1,802.23
合计	8,026.47

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日 至 2024 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-88,708.30
股票投资收益——赎回差价收入	-499,562.84
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	-588,271.14

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日 至 2024 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	34,815,872.69
减：卖出股票成本总额	34,849,663.05
减：交易费用	54,917.94
买卖股票差价收入	-88,708.30

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日 至 2024 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	42,235,168.55
减：现金支付赎回款总额	31,693,505.55
减：赎回股票成本总额	11,041,225.84
减：交易费用	-
赎回差价收入	-499,562.84

6.4.7.11 债券投资收益

无。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.13 贵金属投资收益

无。

6.4.7.14 衍生工具收益

无。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日 至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	241,692.84
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	241,692.84

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日 至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	-1,452,155.80
——股票投资	-1,452,155.80
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——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	-1,452,155.80

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日 至2024年6月30日

基金赎回费收入	-
替代损益	22,297.03
合计	22,297.03

6.4.7.18 信用减值损失

无。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日 至2024年6月30日
审计费用	25,532.50
信息披露费	25,532.50
证券出借违约金	-
IOPV 计算与发布费用	9,944.48
合计	61,009.48

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

根据本基金基金合同以及基金管理人鹏扬基金管理有限公司于 2024 年 7 月 12 日发布的《鹏扬国证财富管理交易型开放式指数证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，本基金于 2024 年 7 月 19 日进入财产清算期。

截至财务报表批准日，除以上情况外，本基金无其他需要说明的重大资产负债表日后事项。

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

本基金本报告期不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。

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
鹏扬基金管理有限公司（“鹏扬基金”）	基金管理人
华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）	基金托管人

鹏扬国证财富管理交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（“鹏扬国证财富管理 ETF 发起式联接”）	该基金是本基金的联接基金
---	--------------

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日 至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年6月29日(基金合同生效日) 至2023年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
华泰证券	67,977,320.69	100.00%	-	-

6.4.10.1.2 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日 至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年6月29日(基金合同生效日) 至2023年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例
华泰证券	28,972,000.00	100.00%	-	-

6.4.10.1.3 权证交易

无。

6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的 比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总 额的比例
华泰证券	33,150.41	100.00%	18,292.63	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2023年6月29日(基金合同生效日)至2023年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的 比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总 额的比例

-	-	-	-	-
---	---	---	---	---

注：(1)上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定。

(2)该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究服务等。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日 至2024年6月30日	上年度可比期间 2023年6月29日(基金合同 生效日) 至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	95,333.87	4,241.88
其中：应支付销售机构的客户维护费	16,552.99	323.92
应支付基金管理人的净管理费	78,780.88	3,917.96

注：基金管理费每日计提，按月支付。本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.50%年费率计提。

管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日 至2024年6月30日	上年度可比期间 2023年6月29日(基金合同 生效日) 至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	19,066.78	848.38

注：基金托管费每日计提，按月支付。本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.10%年费率计提。

托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

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

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

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
鹏扬国证财富管理 ETF 发起式联接	9,500,000.00	28.98%	-	-
华泰证券	6,178,718.00	18.85%	7,169,993.00	20.04%

注：以上关联方投资本基金的相关费用符合基金招募说明书及相关临时公告、交易所、登记结算机构的有关规定。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 6 月 29 日 (基金合同生效日) 至 2023 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
华泰证券	542,162.40	4,923.72	285,774,913.96	38,574.42

注：本基金的托管人为华泰证券股份有限公司，银行存款存放在具有基金托管资格的中国工商银行股份有限公司，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

于 2024 年 06 月 30 日，本基金持有 152600 股 601688_华泰证券（为托管人或其他关联方发行证券），占期末基金净资产 6.25%。于上年度可比期末 2023 年 06 月 30 日，本基金持有 78700 股 601688_华泰证券（为托管人或其他关联方发行证券），占期末基金净资产 0.35%。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人通过制定政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程持续监控上述各类风险。

本基金管理人将风险管理思想融入公司整体组织架构的设计中，从而实现全方位、多角度风险管理，确保产品风险暴露不超越投资者的风险承受能力。本基金管理人建立了由风险管理委员会、督察长、风险管理部、监察稽核部和相关业务部门构成的多层次风险管理架构体系。基金经理、风险管理部、交易管理部、基金运营部以及监察稽核部从不同角度、不同环节对投资的全过程实行风险监控和管理。从投资决策制定层面，投资决策委员会、投资总监、投资部门负责人和基金经理对投资行为及相关风险进行管理。从投资决策执行层面，风险管理部、交易管理部与基金运营部对投资交易与交收的合规风险、操作风险等风险进行管理。从风险监控层面，公司督察长、风险管理部及监察稽核人员对风险控制措施和合规风险情况进行全面检查、监督，并视所发生问题情节轻重及时反馈给各部门经理、公司总经理、风险管理委员会、董事会、监管机构。督察长独立于公司其他业务部门和公司管理层，对内部控制制度的执行情况实行严格检查和及时反馈，并独立报告。

同时，本基金管理人采用科学的风险管理分析方法对组合面对的投资风险进行分析，主要通过定性分析和定量分析的方法，评估各种金融工具的风险及可能产生的损失。本基金管理人从定性分

析的角度出发，判断风险损失的严重性；从定量分析的角度出发，根据基金资产所投资的不同金融工具的特征，制定相关风险量化指标及模型，并通过日常量化分析报告确定风险损失的限度和相应置信程度，及时对各种风险进行监督、检查和评估，并制定相应决策，将风险控制在预期可承受的范围之内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金管理人通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指因金融资产的流动性不足，无法在合理价格变现资产。本基金的流动性风险主要来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的流动性不足，导致金融资产不能在合理价格变现。

本基金管理人通过限制投资集中度、监控流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时基金管理人通过分析持有人结构、申购赎回行为分析、变现比例、压力测试等方法评估组合的流动性风险。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，除在“6.4.12 期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限的情况外（如有），其余均能及时变现。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。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时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。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

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

在日常运作中，本基金严格按照相关法律法规要求、基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理，确保投资组合资产变现能力与投资者赎回需求保持动态平衡。

在资产端，本基金遵循组合管理、分散投资的基本原则，主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具。基金管理人对基金持有资产的集中度、高流动性资产比例、流动性受限资产比例、逆回购分布等指标进行监控，定期开展压力测试，持续对投资组合流动性水平进行监测与评估。

在负债端，基金管理人建立了投资者申购赎回管理机制，结合市场形势对投资者申购赎回情况进行分析，合理控制投资组合持有人结构。在极端情形下，投资组合面临巨额赎回时，基金管理人将根据相关法律法规要求以及基金合同的约定，审慎利用流动性风险管理工具处理赎回申请，保障基金持有人利益。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

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

利率风险是指基金的公允价值和未来现金流量因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。

本基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方

法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	542,162.40	-	-	-	542,162.40
结算备付金	36,665.62	-	-	-	36,665.62
存出保证金	135,004.68	-	-	-	135,004.68
交易性金融资产	-	-	-	29,582,664.52	29,582,664.52
应收清算款	-	-	-	245,769.22	245,769.22
资产总计	713,832.70	-	-	29,828,433.74	30,542,266.44
负债					
应付清算款	-	-	-	24,634.56	24,634.56
应付管理人报酬	-	-	-	14,589.13	14,589.13
应付托管费	-	-	-	2,917.84	2,917.84
应交税费	-	-	-	4.45	4.45
其他负债	-	-	-	264,915.81	264,915.81
负债总计	-	-	-	307,061.79	307,061.79
利率敏感度缺口	713,832.70	-	-	29,521,371.95	30,235,204.65
上年度末 2023年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	439,821.62	-	-	-	439,821.62
结算备付金	62,509.78	-	-	-	62,509.78
存出保证金	611,605.60	-	-	-	611,605.60
交易性金融资产	-	-	-	34,088,987.21	34,088,987.21
买入返售金融资产	-19.89	-	-	-	-19.89
应收清算款	-	-	-	264,079.56	264,079.56
资产总计	1,113,917.11	-	-	34,353,066.77	35,466,983.88
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	15,688.70	15,688.70
应付托管费	-	-	-	3,137.75	3,137.75
应交税费	-	-	-	30.61	30.61
其他负债	-	-	-	118,442.24	118,442.24
负债总计	-	-	-	137,299.30	137,299.30
利率敏感度缺口	1,113,917.11	-	-	34,215,767.47	35,329,684.58

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本期末及上年度末本基金未持有交易性债券投资(不包括可转换债券、可交换债券)或资产支持

证券投资，因此市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金本报告期末未持有外币计价的资产和负债，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是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发生变动时产生的价格波动风险。本基金主要投资于上市交易的证券，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。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。并且，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，动态、及时地跟踪和控制其他价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	29,582,664.52	97.84	34,088,987.21	96.49
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	29,582,664.52	97.84	34,088,987.21	96.49

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	该其他价格风险的敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有股票资产的其他价格风险状况测算的理论变动值对基金资产净值的影响金额。		
	假定市场基准变动 5%，其他变量不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	市场基准上升 5%	1,719,867.04	2,170,743.10
	市场基准下降 5%	-1,719,867.04	-2,170,743.10

注：股票市场基准取沪深 300 指数。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	29,582,664.52	34,087,554.68
第二层次	-	-
第三层次	-	1,432.53
合计	29,582,664.52	34,088,987.21

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券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

于 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2023 年 12 月 31 日：同)。

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	29,582,664.52	96.86
	其中：股票	29,582,664.52	96.86
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	578,828.02	1.90
8	其他各项资产	380,773.90	1.25
9	合计	30,542,266.44	100.00

注：股票投资的金额包含可退替代款估值增值。

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	29,582,664.52	97.84
K	房地产业	-	-

L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	29,582,664.52	97.84

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通标的股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

7.3.1 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	600030	中信证券	252,200	4,597,606.00	15.21
2	300059	东方财富	381,567	4,029,347.52	13.33
3	601688	华泰证券	152,600	1,890,714.00	6.25
4	601211	国泰君安	127,700	1,730,335.00	5.72
5	600036	招商银行	33,100	1,131,689.00	3.74
6	601995	中金公司	35,000	1,036,350.00	3.43
7	601328	交通银行	137,300	1,025,631.00	3.39
8	601788	光大证券	62,300	910,826.00	3.01
9	600000	浦发银行	108,000	888,840.00	2.94
10	601009	南京银行	77,400	804,186.00	2.66
11	000776	广发证券	62,300	758,191.00	2.51
12	600999	招商证券	52,900	735,839.00	2.43
13	002142	宁波银行	28,700	633,122.00	2.09
14	600958	东方证券	82,800	629,280.00	2.08
15	601108	财通证券	94,100	622,001.00	2.06
16	600837	海通证券	68,700	588,072.00	1.94
17	600926	杭州银行	42,600	555,930.00	1.84
18	601377	兴业证券	101,600	514,096.00	1.70
19	601696	中银证券	50,800	461,264.00	1.53

20	601066	中信建投	23,300	448,292.00	1.48
21	601166	兴业银行	25,400	447,548.00	1.48
22	601162	天风证券	166,200	362,316.00	1.20
23	601901	方正证券	43,300	334,709.00	1.11
24	601998	中信银行	48,100	322,270.00	1.07
25	601878	浙商证券	29,500	316,240.00	1.05
26	600109	国金证券	41,700	314,835.00	1.04
27	002736	国信证券	29,500	256,355.00	0.85
28	600155	华创云信	43,100	254,721.00	0.84
29	601881	中国银河	23,300	253,038.00	0.84
30	600918	中泰证券	43,700	247,779.00	0.82
31	601456	国联证券	24,800	239,072.00	0.79
32	002797	第一创业	45,000	229,050.00	0.76
33	000166	申万宏源	52,400	225,844.00	0.75
34	000001	平安银行	20,600	209,090.00	0.69
35	002926	华西证券	31,600	208,244.00	0.69
36	000686	东北证券	36,400	203,112.00	0.67
37	000750	国海证券	60,100	174,891.00	0.58
38	600909	华安证券	36,400	153,244.00	0.51
39	000783	长江证券	30,600	147,798.00	0.49
40	601555	东吴证券	22,200	130,980.00	0.43
41	601229	上海银行	14,800	107,448.00	0.36
42	002500	山西证券	21,200	99,640.00	0.33
43	600621	华鑫股份	5,700	69,882.00	0.23
44	601136	首创证券	3,400	69,564.00	0.23
45	601059	信达证券	3,700	52,577.00	0.17
46	601236	红塔证券	6,500	41,730.00	0.14
47	000728	国元证券	6,800	41,208.00	0.14
48	601990	南京证券	5,000	38,400.00	0.13
49	002939	长城证券	3,400	22,780.00	0.08
50	600095	湘财股份	2,800	16,688.00	0.06

7.3.2 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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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	600030	中信证券	6,199,174.00	17.55
2	601688	华泰证券	2,513,640.00	7.11
3	601211	国泰君安	2,280,624.00	6.46
4	600036	招商银行	1,714,288.00	4.85
5	601328	交通银行	1,467,827.00	4.15
6	601995	中金公司	1,454,505.00	4.12
7	601009	南京银行	1,407,180.00	3.98
8	600958	东方证券	1,371,928.00	3.88
9	601788	光大证券	1,261,617.00	3.57
10	601166	兴业银行	1,184,722.00	3.35
11	600000	浦发银行	965,667.00	2.73
12	600999	招商证券	881,511.00	2.50
13	601108	财通证券	858,208.00	2.43
14	300059	东方财富	828,551.00	2.35
15	600837	海通证券	757,699.00	2.14
16	600109	国金证券	710,424.00	2.01
17	601377	兴业证券	684,201.00	1.94
18	600926	杭州银行	658,579.00	1.86
19	601696	中银证券	633,855.00	1.79
20	601901	方正证券	626,217.00	1.77

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	600030	中信证券	6,060,370.45	17.15
2	601211	国泰君安	2,244,059.00	6.35
3	600036	招商银行	2,166,814.00	6.13
4	601009	南京银行	2,064,820.11	5.84
5	601328	交通银行	1,927,709.00	5.46
6	600958	东方证券	1,843,387.00	5.22
7	601166	兴业银行	1,838,142.00	5.20
8	601688	华泰证券	1,701,155.00	4.82
9	601995	中金公司	1,441,022.00	4.08
10	601788	光大证券	1,277,513.00	3.62
11	600000	浦发银行	1,032,904.00	2.92
12	600109	国金证券	929,636.00	2.63
13	600999	招商证券	877,549.00	2.48
14	601901	方正证券	867,280.00	2.45
15	601108	财通证券	847,265.00	2.40
16	600926	杭州银行	808,227.00	2.29

17	600837	海通证券	764,183.00	2.16
18	601377	兴业证券	680,057.00	1.92
19	601998	中信银行	652,389.00	1.85
20	601696	中银证券	626,924.00	1.77

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	33,161,448.00
卖出股票收入（成交）总额	34,815,872.69

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期内，本基金未参与股指期货投资。

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

本报告期内，本基金未参与国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本报告期内，本基金未参与国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本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的发行主体中，光大证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到深圳证券交易所、中国银行间市场交易商协会、中国证监会地方监管机构的处罚。国泰君安证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到深圳证券交易所、中国证监会、中国证监会地方监管机构的处罚。华泰证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局江苏省分局、央行江苏省分行、中国证监会地方监管机构的处罚。交通银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。南京银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局江苏省分局的处罚。招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、国家金融监督管理总局深圳监管局、国家外汇管理局深圳市分局的处罚。中国国际金融股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行间市场交易商协会、中国证监会、中国证监会地方监管机构的处罚。中信证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到上海证券交易所、深圳证券交易所、中国证监会、中国证监会地方监管机构的处罚。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期没有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。

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

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	135,004.68
2	应收清算款	245,769.22
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	380,773.90

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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，各比例的分项之和与合计可能有尾差。

§ 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		鹏扬国证财富管理 ETF 发起式联接	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
364	90,047.70	16,112,377.00	49.16%	7,164,984.00	21.86%	9,500,000.00	28.98%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例
1	华泰证券股份有限公司	6,178,718.00	18.85%
2	招商证券股份有限公司	5,455,162.00	16.64%
3	中信证券股份有限公司	3,040,989.00	9.28%
4	陆润荣	1,654,800.00	5.05%
5	中信建投证券股份有限公司	1,437,408.00	4.39%
6	彭志红	580,000.00	1.77%
7	罗赛	300,037.00	0.92%
8	庾江	193,700.00	0.59%
9	吴蝶儿	175,600.00	0.54%
10	邢桂如	148,600.00	0.45%
11	华泰证券股份有限公司—鹏扬国	9,500,000.00	28.98%

	证财富管理交易型开放式指数证 券投资基金发起式联接基金	
--	--------------------------------	--

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本报告期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

8.4 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的情况

截至本报告期末，本基金管理人高级管理人员，基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数据区间为 0；本基金的基金经理持有本基金份额总量的数据区间为 0。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2023 年 6 月 29 日）基金份额总额	310,777,361.00
本报告期期初基金份额总额	35,777,361.00
本报告期基金总申购份额	39,500,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	42,500,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	32,777,361.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

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

1、基金管理人：

本基金管理人于 2024 年 3 月 22 日发布《鹏扬基金管理有限公司高级管理人员变动公告》，李净女士自 2024 年 3 月 21 日起担任鹏扬基金管理有限公司副总经理。

2、基金托管人托管部门：

2024 年 3 月 26 日，本基金托管人发布公告，专门基金托管部门联席负责人冯伟到龄退休，变更后的部门负责人为卢小群。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金基金管理人、基金财产以及基金托管人基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

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

本报告期内未发生公司和董事、监事和高级管理人员被中国证监会、基金业协会、证券交易所处罚或公开谴责，以及被财政、外汇和审计等部门施以重大处罚的情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到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	
华泰证券	5	67,977,320.69	100.00%	33,150.41	100.00%	

注：(1)基金专用交易单元的选择标准为该证券经营机构具有较强的研究服务能力，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析报告、个股分析报告、市场服务报告等。

(2)基金专用交易单元的选择程序为根据标准进行考察后，确定证券经营机构的选择。经公司批准后被选择的证券经营机构签订协议。

(3)本基金本报告期内无新增或剔除的交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名	债券交易	债券回购交易	权证交易	基金交易
-----	------	--------	------	------

称	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	成交金额	占当期 基金成 交总额的 比例
华泰证 券	-	-	28,972,000. 00	100.00%	-	-	-	-

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	鹏扬基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2024年3月22日
2	鹏扬基金管理有限公司关于旗下部分基金参与深圳前海微众银行股份有限公司费率优惠活动的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2024年2月26日
3	鹏扬基金管理有限公司关于旗下部分基金参与深圳市前海排排网基金销售有限责任公司费率优惠活动的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2024年6月7日
4	鹏扬基金管理有限公司关于深圳分公司办公地址变更的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2024年5月9日
5	鹏扬基金管理有限公司关于增加基金合作销售机构并参加费率优惠活动的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2024年4月16日
6	鹏扬基金管理有限公司关于增加基金合作销售机构并参加费率优惠活动的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2024年5月23日
7	关于鹏扬基金国证财富管理交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商终止的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2024年6月28日
8	关于指定鹏扬国证财富管理交易型开放式指数证券投资基金主流动性服务商的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2024年3月28日
9	鹏扬国证财富管理交易型开放式指数证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2024年1月19日
10	鹏扬国证财富管理交易型开放式指数证券投资基金 2023 年年度报告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2024年3月29日
11	鹏扬国证财富管理交易型开放式指数证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2024年4月19日
12	鹏扬国证财富管理交易型开放式指数证券投资基金更新的招募说明书(2024年第1号)	证监会指定报刊及网站、公司官网	2024年6月29日
13	鹏扬国证财富管理交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要(更	证监会指定报刊及网站、公司官网	2024年6月29日

	新)		
14	鹏扬基金管理有限公司关于鹏扬国证财富管理交易型开放式指数证券投资基金基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2024 年 1 月 20 日
15	鹏扬基金管理有限公司关于鹏扬国证财富管理交易型开放式指数证券投资基金基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2024 年 2 月 3 日
16	鹏扬基金管理有限公司关于鹏扬国证财富管理交易型开放式指数证券投资基金基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2024 年 2 月 9 日
17	鹏扬基金管理有限公司关于鹏扬国证财富管理交易型开放式指数证券投资基金基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2024 年 4 月 4 日
18	鹏扬基金管理有限公司关于鹏扬国证财富管理交易型开放式指数证券投资基金基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2024 年 4 月 20 日
19	鹏扬基金管理有限公司关于鹏扬国证财富管理交易型开放式指数证券投资基金基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2024 年 4 月 27 日
20	鹏扬基金管理有限公司关于鹏扬国证财富管理交易型开放式指数证券投资基金基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2024 年 6 月 15 日
21	鹏扬基金管理有限公司关于鹏扬国证财富管理交易型开放式指数证券投资基金基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2024 年 6 月 29 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

机构	1	2024年4月26日-2024年4月28日	2,719,536.00	25,390,053.00	25,068,600.00	3,040,989.00	9.28%
	2	2024年1月1日-2024年2月18日;2024年2月20日;2024年3月18日;2024年4月15日-2024年4月17日;2024年4月23日	8,026,791.00	19,849,904.00	26,439,287.00	1,437,408.00	4.39%
个人	-	-	-	-	-	-	-
鹏扬国证财富管理ETF发起式联接	1	2024年2月22日-2024年4月25日;2024年4月29日-2024年6月30日	-	9,600,100.00	100,100.00	9,500,000.00	28.98%

产品特有风险

本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额 20% 的情形。本基金的运作方式为交易型开放式，赎回对价主要为组合证券，赎回行为对本基金的影响大幅减少。基金管理人通过编制申购赎回清单有效防控基金运作风险，保护持有人利益。

注：申购份额包括申购或者买入基金份额，赎回份额包括赎回或者卖出基金份额。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

鹏扬国证财富管理交易型开放式指数证券投资基金于 2024 年 7 月 12 日公告，本基金的最后运作日定为 2024 年 7 月 18 日，并于 2024 年 7 月 19 日进入清算程序，具体情况详见临时公告。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1. 中国证监会核准鹏扬国证财富管理交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；
2. 《鹏扬国证财富管理交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
3. 《鹏扬国证财富管理交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
4. 基金管理人业务资格批件和营业执照；
5. 基金托管人业务资格批件和营业执照；
6. 报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

鹏扬基金管理有限公司

2024 年 8 月 29 日