

鹏华价值共赢两年持有期混合型证券投资  
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：中国银行股份有限公司

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。

基金托管人中国银行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 01 月 01 日起至 2023 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	9
3.3 其他指标	10
3.4 过去三年基金的利润分配情况	10
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
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	18
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	18
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>18</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	18
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	18
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	18
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>18</b>
6.1 审计报告基本信息	18
6.2 审计报告的基本内容	18
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>20</b>
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	22
7.3 净资产变动表	23
7.4 报表附注	25

<b>§ 8 投资组合报告</b>	<b>64</b>
8.1 期末基金资产组合情况	64
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	65
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	66
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	82
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	84
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	84
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	84
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	84
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	84
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	84
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	84
8.12 投资组合报告附注	85
<b>§ 9 基金份额持有人信息</b>	<b>85</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	85
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	86
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	86
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	86
<b>§ 10 开放式基金份额变动</b>	<b>86</b>
<b>§ 11 重大事件揭示</b>	<b>86</b>
11.1 基金份额持有人大会决议	86
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	86
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	87
11.4 基金投资策略的改变	87
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	87
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	87
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	87
11.8 其他重大事件	90
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息</b>	<b>93</b>
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	93
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	93
<b>§ 13 备查文件目录</b>	<b>93</b>
13.1 备查文件目录	93
13.2 存放地点	93
13.3 查阅方式	93

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华价值共赢两年持有期混合型证券投资基金
基金简称	鹏华价值共赢两年持有期混合
基金主代码	009086
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 4 月 29 日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	875,014,538.96 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在有效控制投资组合风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略 本基金将通过跟踪考量通常的宏观经济变量（包括 GDP 增长率、CPI 走势、M2 的绝对水平和增长率、利率水平与走势等）以及各项国家政策（包括财政、货币、税收、汇率政策等）来判断经济周期目前的位置以及未来将发展的方向，在此基础上对各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估，制定股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。</p> <p>2、股票投资策略 本基金所称的价值型股票，即在深入的基本面研究基础上，股票价格相对于内在价值存在明显低估的股票；它可以是由于经济周期或市场情绪造成的低估值股票，也可以是拥有核心技术、具备持续盈利增长前景、具有吸引人的合理价格的股票。本基金的股票投资将在行业研究的基础上，通过自上而下和自下而上相结合的方式挖掘优质的公司，精选内在价值被低估的股票构建投资组合。核心思路在于：1）自上而下地分析行业的成长前景、行业结构、商业模式、竞争要素等分析把握其投资机会；2）自下而上地精选基本面良好，具有较好盈利能力和市场竞争力的公司，寻找明显低估的股票。</p> <p>（1）自上而下的行业遴选 本基金将自上而下地进行行业遴选，重点关注行业增长前景、行业利润前景和行业成功要素。对行业增长前景，主要分析行业的外部发展环境、行业的生命周期以及行业波动与经济周期的关系等；对行业利润前景，主要分析行业结构，特别是业内竞争的方式、业内竞争的激烈程度、以及业内厂商的谈判能力等。基于对行业结构的分析形成对业内竞争的关键成功要素的判断，为预测企业经营环境的变化建立起扎实的基础。</p> <p>（2）自下而上的个股选择 本基金通过定性和定量相结合的方法进行自下而上的个股选择，对企业基本面和估值水平进行综合的研判，精选优质个股。</p> <p>1）定量方面 估值水平评估。本基金考察企业贴现现金流以及内在价值贴现，结合市盈率（市值/净利润）、市净率（市值/净资产）、市销率（市值/营业收入）等指标衡量股票的价值是否被低估，并且基于公司所属的不同行业，采取不同的估值方</p>

法, 以此寻找不同行业股票的合理价格区间, 并进行动态调整。成长性评估。本基金采用年复合营业收入增长率、盈利增长率、息税前利润增长率、净资产收益率以及现金流量增长率等指标综合考察上市公司的成长性。盈利水平评估。本基金重点考察主营业务收入、ROE、经营现金流、盈利波动程度四大关键指标, 以衡量具有高质量持续增长的公司。

2) 定性分析 本基金通过以下两方面标准对股票的基本面进行研究分析并筛选出优质的公司: 一方面是竞争力分析, 通过对公司竞争策略和核心竞争力的分析, 选择具有可持续竞争优势的公司或未来具有广阔成长空间的公司。就公司竞争策略, 基于行业分析的结果判断策略的有效性、策略的实施支持和策略的执行成果; 就核心竞争力, 分析公司的现有核心竞争力, 并判断公司能否利用现有的资源、能力和定位取得可持续竞争优势。另一方面是管理层分析, 通过着重考察公司的管理层以及管理制度, 选择具有良好治理结构、管理水平较高的优质公司。

(3) 港股通标的股票投资策略 本基金所投资港股通标的股票除适用上述个股投资策略外, 本基金投资港股通标的股票还需关注: 1) 在港股市场上市、具有行业代表性的优质中资公司; 2) 具有行业稀缺性的香港本地和外资公司; 3) 港股市场在行业结构、估值、AH 股折溢价、分红率等方面具有吸引力的投资标的。

(4) 科创板股票投资策略 设立科创板的目的是落实创新驱动和科技强国战略、推动高质量发展。因此, 在适用上述个股投资策略的基础上, 还需关注: 1) 在定性分析方面, 本基金通过以下研究方法进行个股筛选: 一是行业研判。科创板重点支持新一代信息技术、高端装备、新材料、新能源、节能环保以及生物医药等高新技术产业和战略性新兴产业上市, 我们通过产业调研的方式跟踪各子行业的需求空间、发展阶段和增长速度, 挑选具备远期成长性的优质子行业。二是竞争力分析。我们关注该公司具备的核心技术, 以及这种技术的成熟度、易用性和研发壁垒。核心技术开发投入大、周期长、具有研发和应用上的较大不确定性, 同时也是企业的核心竞争力所在。2) 在定量分析方面, 传统的 PE、PB、DCF 等估值方法对于许多发展成熟、盈利稳定的高科技公司仍然是最好的估值方法, 但对于一些业务模式特殊、业务扩张迅速但仍处亏损期的高科技公司而言, 传统的估值方法已不再适用。因此, 在科创板企业的定量分析中, 本基金将采取特殊高科技企业估值方法进行定量分析, 例如, 对云计算相关企业采取 PS 估值方法进行估值, 对高速成长的萌芽期企业采取 P/FCF 进行估值, 对部分互联网公司采取 MAU (月活跃用户数量) 和单用户价值量进行估值, 对电子商务平台采取 GMV (网站成交金额) 作为估值依据等。综上, 本基金将分析科创板相关企业所处产业的发展阶段、企业自身的发展阶段、当前商业模式以及相关业务指标进行综合估值, 以辅助投资决策。

(5) 存托凭证投资策略 本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略, 基于对基础证券投资价值的深入研究判断, 进行存托凭证的投资。

3、债券投资策略 本基金债券投资将采取久期策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、个券选择策略、信用策略等积极投资策略, 自上而下地管理组合的久期, 灵活地调整组合的券种搭配, 同时精选个券, 以增

	<p>强组合的持有期收益。 4、股指期货投资策略 本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目标，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，充分考虑股指期货的风险收益特征，通过多头或空头的套期保值策略，以改善投资组合的投资效果，实现股票组合的超额收益。 5、资产支持证券的投资策略 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。 未来，如果港股通业务规则发生变化或出现法律法规或监管部门允许投资的其他模式，基金管理人可相应调整，不需召开基金份额持有人大会。 未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，本基金可相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书中更新并公告。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×70%+恒生指数收益率×10%（经汇率估值调整）+中证综合债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金将投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

注：无。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	鹏华基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	高永杰
	联系电话	0755-81395402
	电子邮箱	xxpl@phfund.com.cn
客户服务电话	4006788999	95566
传真	0755-82021126	010-66594942
注册地址	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	518048	100818
法定代表人	何如	葛海蛟

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.phfund.com.cn">http://www.phfund.com.cn</a>
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	2022 年	2021 年
本期已实现收益	-144,407,302.18	-99,578,908.03	116,182,327.22
本期利润	-145,096,693.08	-380,206,081.31	-431,911,055.38
加权平均基金份额本期利润	-0.1504	-0.2578	-0.2295
本期加权平均净值利润率	-16.10%	-25.36%	-17.41%
本期基金份额净值增长率	-15.79%	-17.23%	-16.04%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
期末可供分配利润	-143,528,636.92	-8,177,518.69	90,794,647.55
期末可供分配基金份额利润	-0.1640	-0.0073	0.0482
期末基金资产净值	731,485,902.04	1,110,521,946.03	2,257,377,310.39
期末基金份额净值	0.8360	0.9927	1.1993
3.1.3 累计期末指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
基金份额累计净值增长率	-16.40%	-0.73%	19.93%

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。

### 3.2 基金净值表现

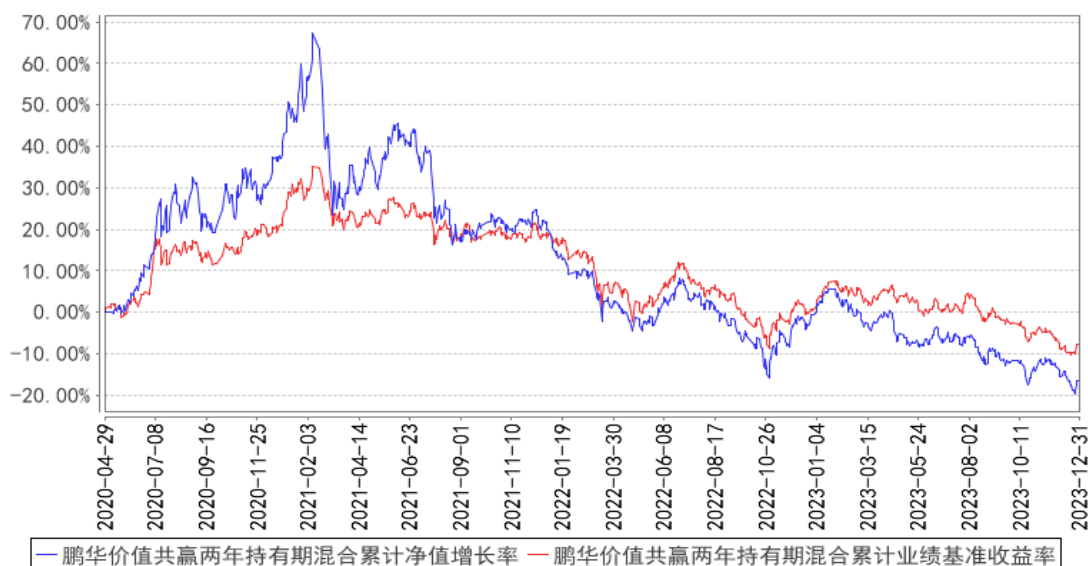
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	-5.30%	0.93%	-5.18%	0.64%	-0.12%	0.29%
过去六个月	-10.58%	0.93%	-8.24%	0.69%	-2.34%	0.24%
过去一年	-15.79%	0.88%	-8.24%	0.69%	-7.55%	0.19%
过去三年	-41.48%	1.26%	-25.49%	0.89%	-15.99%	0.37%
自基金合同生效起至今	-16.40%	1.32%	-7.60%	0.90%	-8.80%	0.42%

注：业绩比较基准=沪深 300 指数收益率×70%+恒生指数收益率×10%（经汇率估值调整）+中证综合债指数收益率×20%

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

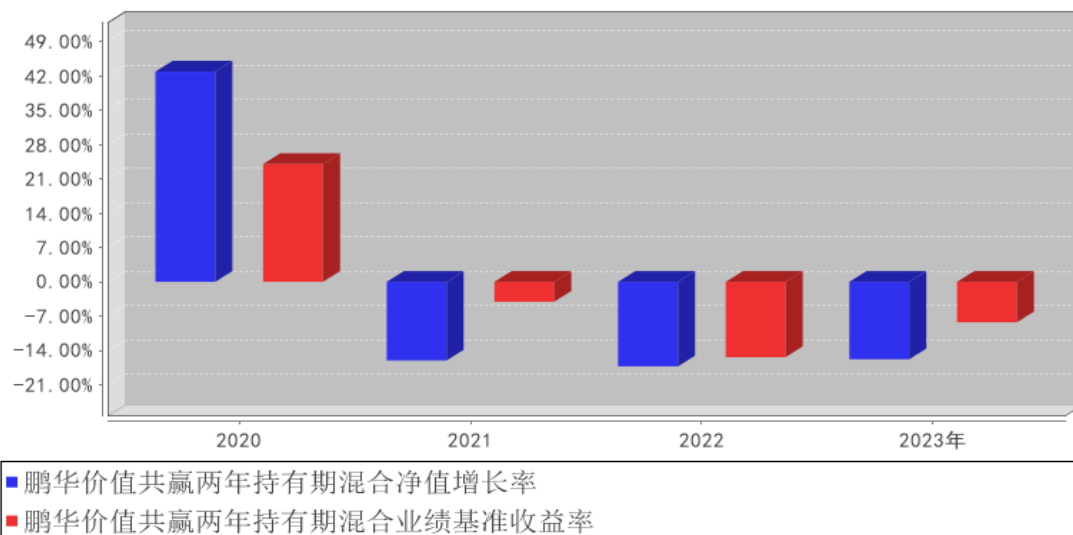
鹏华价值共赢两年持有期混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2020 年 04 月 29 日生效。2、截至建仓期结束，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

### 3.2.3 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

鹏华价值共赢两年持有期混合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		
王宗合	基金经理	2020-04-29	2023-03-04	17 年	王宗合先生，国籍中国，金融学硕士，17 年证券从业经验。曾任职于招商基金从事食品饮料、商业零售、农林牧渔、纺织服装、汽车等行业的研究。2009 年 5 月加盟鹏华基金管理有限公司，从事食品饮料、农林牧渔、商业零售、造纸包装等行业的研究工作，担任鹏华动力增长混合（LOF）基金基金经理助理。现担任公司副总裁/权益投资二部总经理/稳定收益投资部总经理，投资决策委员会成员。2010 年 12 月至 2023 年 03 月担任鹏华消费优选混合型证券投资基金基金经理，2012 年 06 月至 2018 年 07 月担任鹏华金鼎保本混合型证券投资基金基金经理，2014 年 07 月至 2019 年 04 月担任鹏华品牌传承灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2014 年 12 月至 2023 年 03 月担任鹏华养老产业股票型证券投资基金基金经理，2016 年 04 月至 2018 年 10 月担任鹏华金鼎保本混合型证券投资基金基金经理，2016 年 06 月至 2019 年 06 月担任鹏华金城保本混合型证券投资基金基金经理，2017 年 02 月至 2019 年 09 月担任鹏华安益增强混合型证券投资基金基金经理，2017 年 07 月至 2023 年 02 月担任鹏华中国 50 开放式证券投资基金基金经理，2017 年 09 月至 2020 年 08 月担任鹏华策略回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2018 年 05 月至 2023 年 03 月担任鹏华产业精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2018 年 07 月至 2019 年 09 月担任鹏华宏观灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2018 年 10 月至 2019 年 09 月担任鹏华金鼎灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2019 年 01 月至 2020 年 02 月担任鹏华优选回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2019 年 06 月至 2019 年 06 月担任鹏华金城灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2019 年 06 月至 2023 年 02 月担任鹏华精选回报三年定期开放混合型证券投资基金基金经理，2020 年 02 月至 2023 年 02 月担任鹏华优质回报两年定期

					<p>开放混合型证券投资基金基金经理, 2020 年 04 月至 2023 年 03 月担任鹏华价值共赢两年持有期混合型证券投资基金基金经理, 2020 年 05 月至 2023 年 02 月担任鹏华成长价值混合型证券投资基金基金经理, 2020 年 07 月至 2023 年 04 月担任鹏华匠心精选混合型证券投资基金基金经理, 2020 年 09 月至 2022 年 02 月担任鹏华创新未来 18 个月封闭运作混合型证券投资基金基金经理, 2022 年 02 月至 2023 年 03 月担任鹏华创新未来混合型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 王宗合先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理发生变动, 王宗合不再担任本基金基金经理。本报告期内本基金基金经理发生变动, 增聘张鹏为本基金基金经理, 王宗合不再担任本基金基金经理。</p>
张鹏	基金经理	2023-01-13	-	10 年	<p>张鹏先生, 国籍中国, 金融学硕士, 10 年证券从业经验。曾任鹏华基金管理有限公司研究部助理研究员、研究员, 中欧基金管理有限公司研究部研究员, 自 2017 年任鹏华基金管理有限公司研究部高级研究员、基金经理助理/研究员, 现担任权益投资二部基金经理。2021 年 08 月至今担任鹏华策略回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2021 年 08 月至今担任鹏华价值精选股票型证券投资基金基金经理, 2023 年 01 月至今担任鹏华价值共赢两年持有期混合型证券投资基金基金经理, 2023 年 03 月至今担任鹏华产业精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2023 年 04 月至今担任鹏华优质治理混合型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 张鹏先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理发生变动, 增聘张鹏为本基金基金经理, 王宗合不再担任本基金基金经理。</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中的公平交易程序，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、分配等各环节得到公平对待。公司对不同投资组合在不同时间窗口下（日内、3日内、5日内）的同向交易价差进行专项分析，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

##### 4.3.2.1 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

回顾 2023 年整年，A 股整体下跌，结构分化剧烈，各板块轮动快。在 1 月短暂的新能源板块反弹之后，整个上半年成长风格中的泛 AI 线索软硬件板块、数据要素线索和部分半导体公司涨幅明显，下半年风格切换，在 A 股下跌的大背景下，汽车的需求率先走出强于其他消费品的趋势，板块差额明显，医药经过长达接近半年的调整，电子板块也在充分调整后迎来了创新和需求修复

的双重预期修复，前者以医药反腐阶段性告一段落为起点，后者以白马 3 季度业绩超预期为起点，阶段性超额明显。除了上述阶段性机会之外，还有几个特征，一是房地产链、消费复苏链、新能源链等板块的弱势贯穿全年，二是各类主题层出不穷各领风骚然后迅速调整，如机器人、华为链、卫星链等等，各以主题方式展开，三是具体到个股上，机构筹码集中的白马标的明显弱于筹码较轻的个股，具有一定的筹码驱动的因素；

基金经理个人对去年的市场的理解归纳为——破与立。抱团在破，历史上尤其是近些年主流认可的核心资产的泡沫在破，资金抱团在破，押注赛道的投资方式在破，主流的审美指向在破，甚至是原有的业绩超预期驱动方式、基于对认知惯性带来的趋势投资方式、基于 DCF 估值模型终局价值投资方式等都在破，参与股票投资的资金的固有结构也在破。随之而来的是立，新的投资主体在立，如没有情绪纪律俨然的量化资金等，新的审美指向在立，喝酒还是看 AI 做的短剧？年轻人和年轻资金追随的方向在立，而不是盲目的去追随历史的话语权，过去的核心资产不一定是未来的优质资产，年轻人自己的定价权在立，整个时代的红利规则都在重建。而破与立的过程中，必然涉及到对原有资产的留恋与反复，以及对新产业趋势的怀疑和分歧，原有的资产必然出现下跌与反弹的波动，而新的产业必然出现试探性的投资与恐惧驱动的回撤，以主题形式展开，其定价期间的大起大落就是愿意尝试前沿产业投资的资金的必然属性。回顾历史莫不如此，可以理解，值得关注，乐见其成。同样在破与立的过程中，对新产业趋势暂时保持观察中立态度，换仓的方向指向就是高确定性低估值的红利板块，因此红利板块与 AI 等新产业趋势双线索，成为去年的核心观察，但是无论如何，底层逻辑都是破与立，只是对立的新方向置信度的不同，带来了双主线。

每个时代有每个时代的局限和主线，基于这个背景和解释，未来的时代级别的主线一定是在变化中诞生，过程一定曲折，主角有待观察，但是必然是新产业，必然是新人，必然符合新一代人的审美，他们接受什么，他们怎么生活和追求，无关对错，就是未来时代的主线。因此基金经理的思路在 2023 年已经逐渐收敛到对变化的观察、研究和学习上，甚至预期会是至少未来两到三年的主要策略思路。

因此，基金经理贯穿全年的操作可以概括为，在自己擅长的泛制造业范畴内，寻找符合新产业趋势的投资标的，边际上出清历史上曾经辉煌如今下跌较多有待反复的投资机会。具体到板块上，我们清仓军工，大幅减仓新能源板块保留部分新技术公司，显著加仓了 TMT 板块和电子板块中和泛 AI 线索有关的公司。在核心板块汽车板块中，用未来有新技术新客户新产业趋势的相关公司平替了部分高增过去业绩平稳的公司。价值共赢这个产品一季度接手，由于原有持仓结构与自己的想法差异非常大，同时接手后赶上原有结构的快速下跌，因此调仓相对稳健，与其他产品有一定的差异，在完成调仓之后，结构上已经全面体现基金经理现有的思路。

虽然破与立的过程中必然有混乱和挫折，但是基金经理认为这是个好迹象，历史上从五朵金花切到消费到医药再切到移动互联网再切到新能源等大级别主线的过程中，都有混乱的过程，所谓不破不立，混乱的过程正孕育着新主线的大机会，背后是全社会审美方向的逐渐变化，慢，但是不可逆。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期份额净值增长率为-15.79%，同期业绩比较基准增长率为-8.24%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

看 2024 年，我们看好几个方向，一是经济企稳需求复苏从居民和市场认知上逐渐落地，预期逐渐修复，工业金属大宗商品由于供给侧的刚性，是比较好的选择；二是制造业中跨越红海蓝海之争论，产品全方位有变化的行业，即使供给过剩但是顺应变化的优质供给依然稀缺的行业，比如汽车板块中的自主企业，比如半导体领域中在创新和国产化上具有竞争优势的公司；三是泛 AI 线索中，能够真的构建自己的产品，能落地并带来实际需求的软硬件公司；四是未来的变化未必一定是 AI，一些新的产业苗头也可能是未来变化中走出来的黑马主角。

但是实话实说，虽然基金经理对新产业趋势抱有极大的兴趣，对新投资机会保持高敏感，但是遗憾的是并不认为新的投资主线会一蹴而就，或者对于立刻产生巨大的投资机会相对保守。因此 24 年依然会相对均衡的结构，会注意控制回撤，需要经过深度研究才会重仓，在认为过度乐观的时点适当兑现。

再多说两句自己的底层体系，在过去年季报中多次提及的不忘初心，这一处处屡见不鲜的概念，于我有独特的心路历程，从出身草根追求个人价值，到真正追求社会价值，承担起无数个家庭的财富保值增值的责任，是逐步形成的理念，因此比较坚定。我时刻提醒自己，基民背后的家庭和我普通但勤劳有爱的父母亲都是我最坚实的基础，年轻人未来就是我的未来，我会时刻保持这份初心，剥离无效的内耗，每一步都有进步。2024 年，加油！

#### 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、风控管理部、监察稽核部、各投资部门、研究部门负责人、基金经理等成员组成，估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规和基金估值运作等方面的专业能力。基金经理可与估值委员会成员共同商定估值原则和政策，但不参与日常估值的执行。

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

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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

## 4.8 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，本基金期末可供分配利润为-143,528,636.92 元，期末基金份额净值 0.8360 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**

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本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**

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在本托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、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 25692 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	鹏华价值共赢两年持有期混合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>我们审计了鹏华价值共赢两年持有期混合型证券投资基金(以下简称“鹏华价值共赢两年持有期混合基金”)的财务报表,包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表,2023 年度的</p>

	<p>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，公允反映了鹏华价值共赢两年持有期混合基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度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，我们独立于鹏华价值共赢两年持有期混合基金，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>鹏华价值共赢两年持有期混合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价值共赢两年持有期混合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价值共赢两年持有期混合基金、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价值共赢两年持有期混合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</p>

	<p>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，就可能对导致对鹏华价值共赢两年持有期混合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价值共赢两年持有期混合基金不能持续经营。</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。</p>
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：鹏华价值共赢两年持有期混合型证券投资基金

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	上年度末 2022年12月31日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	87,586,285.87	64,990,528.15
结算备付金		1,345,002.69	-
存出保证金		149,267.88	129,799.89
交易性金融资产	7.4.7.2	651,541,160.74	1,048,639,613.73
其中：股票投资		650,889,525.37	1,047,960,736.73
基金投资		-	-
债券投资		651,635.37	678,877.00
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		23.43	-
应收申购款		34,084.16	62,715.37
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		740,655,824.77	1,113,822,657.14
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年12月31日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
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		6,876,715.62	33.42
应付赎回款		638,516.53	2,070,731.01
应付管理人报酬		502,434.29	748,902.21
应付托管费		125,608.56	234,031.93
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		15.98	3.82
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	1,026,631.75	247,008.72
负债合计		9,169,922.73	3,300,711.11
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.10	875,014,538.96	1,118,699,464.72
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	-143,528,636.92	-8,177,518.69
净资产合计		731,485,902.04	1,110,521,946.03
负债和净资产总计		740,655,824.77	1,113,822,657.14

注：（1）报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.8360 元，基金份额总额 875,014,538.96 份。

（2）报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金资产净值（暂估业绩报酬前） 731,485,902.04 元，

基金份额总额 875,014,538.96 份，基金份额净值(暂估业绩报酬前)0.8360 元。于本报告期间，利润表未体现暂估业绩报酬金额为-26,069.02 元(可比期间：-11,666,629.76 元)。于 2023 年 12 月 31 日，相关暂估业绩报酬余额为 737.43 元(2022 年 12 月 31 日：26,806.45 元)，基金资产净值(暂估业绩报酬后)731,485,164.61 元。该暂估业绩报酬余额是各基金份额持有人于报告期末时点的暂估业绩报酬的合计，各基金份额持有人实际应承担的业绩报酬金额根据其持有期间的实际收益情况计算确认，可能与上述暂估业绩报酬金额存在差异。

## 7.2 利润表

会计主体：鹏华价值共赢两年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		-135,536,538.62	-364,026,939.01
1. 利息收入		583,161.31	1,405,832.81
其中：存款利息收入	7.4.7.13	444,394.77	1,405,832.81
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		138,766.54	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益(损失以“-”填列)		-135,430,309.03	-84,805,598.54
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-143,586,658.64	-103,241,446.53
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	2,280.68	947.47
资产支持证券投资	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	8,154,068.93	18,434,900.52
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	-689,390.90	-280,627,173.28

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	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		9,560,154.46	16,179,142.30
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	7,243,966.16	12,124,993.69
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	2,069,950.94	3,789,060.47
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		8.44	3.61
8. 其他费用	7.4.7.23	246,228.92	265,084.53
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-145,096,693.08	-380,206,081.31
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-145,096,693.08	-380,206,081.31
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-145,096,693.08	-380,206,081.31

### 7.3 净资产变动表

会计主体：鹏华价值共赢两年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 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	1,118,699,464. 72	-	-8,177,518.69	1,110,521,946.0 3
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,118,699,464. 72	-	-8,177,518.69	1,110,521,946.0 3

三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-243,684,925.76	-	-135,351,118.23	-379,036,043.99
(一)、综合收益总额	-	-	-145,096,693.08	-145,096,693.08
(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)	-243,684,925.76	-	9,745,574.85	-233,939,350.91
其中：1. 基金申购款	4,825,963.01	-	-307,451.12	4,518,511.89
2. 基金赎回款	-248,510,888.77	-	10,053,025.97	-238,457,862.80
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	875,014,538.96	-	-143,528,636.92	731,485,902.04
项目	上年度可比期间			
	2022年1月1日至2022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	1,882,265,943.24	-	375,111,367.15	2,257,377,310.39
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,882,265,943.24	-	375,111,367.15	2,257,377,310.39
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-763,566,478.5	-	-383,288,885.8	-1,146,855,364.



号填列)	2		4	36
(一)、综合收益总额	-	-	-380,206,081.31	-380,206,081.31
(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)	-763,566,478.52	-	-3,082,804.53	-766,649,283.05
其中：1. 基金申购款	11,720,517.05	-	181,036.64	11,901,553.69
2. 基金赎回款	-775,286,995.57	-	-3,263,841.17	-778,550,836.74
(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	1,118,699,464.72	-	-8,177,518.69	1,110,521,946.03

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

鹏华价值共赢两年持有期混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2020]241号《关于准予鹏华价值共赢两年持有期混合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《鹏华价值共赢两年持有期混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币1,469,686,524.41

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(2020)第 0353 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华价值共赢两年持有期混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 4 月 29 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,470,239,869.71 份基金份额,其中认购资金利息折合 553,345.30 份基金份额。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

#### 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》、《鹏华价值共赢两年持有期混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 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 年度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 年度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。

##### 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。本基金在上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。

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(包括基础管理费和业绩报酬)、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。

其中业绩报酬在满足计提条件时于相应的基金赎回/转出确认日或基金终止日，按投资者赎回/转出申请日或基金终止日的基金实际收益情况计算确认，未达到支付条件的暂估业绩报酬不计入当

期损益。暂估业绩报酬为假设本基金于本报告期末按照当日的基金份额净值(计提业绩报酬前)清算,根据基金份额持有人持有的基金份额(包括未到期份额)至该日止持有期间的收益情况估算的业绩报酬。

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

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[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	87,586,285.87	64,990,528.15
等于：本金	87,579,371.89	64,984,049.45
加：应计利息	6,913.98	6,478.70
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	87,586,285.87	64,990,528.15

##### 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	731,206,194.08	-	650,889,525.37	-80,316,668.71	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	599,300.00	905.94	651,635.37	51,429.43
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	599,300.00	905.94	651,635.37	51,429.43
资产支持证券	-	-	-	-	

基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		731,805,494.08	905.94	651,541,160.74	-80,265,239.28
项目	上年度末 2022年12月31日				
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		1,127,615,962.14	-	1,047,960,736.73	-79,655,225.41
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	599,300.00	199.97	678,877.00	79,377.03
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	599,300.00	199.97	678,877.00	79,377.03
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,128,215,262.14	199.97	1,048,639,613.73	-79,575,848.38

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	上年度末
	2023 年 12 月 31 日	2022 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	826,631.75	27,008.72
其中：交易所市场	826,631.75	27,008.72
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	200,000.00	220,000.00
合计	1,026,631.75	247,008.72

#### 7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	1, 118, 699, 464. 72	1, 118, 699, 464. 72
本期申购	4, 825, 963. 01	4, 825, 963. 01
本期赎回（以“-”号填列）	-248, 510, 888. 77	-248, 510, 888. 77
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	875, 014, 538. 96	875, 014, 538. 96

注：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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3, 267, 289. 50	-11, 444, 808. 19	-8, 177, 518. 69
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	3, 267, 289. 50	-11, 444, 808. 19	-8, 177, 518. 69
本期利润	-144, 407, 302. 18	-689, 390. 90	-145, 096, 693. 08
本期基金份额交易产生的变动数	12, 156, 814. 93	-2, 411, 240. 08	9, 745, 574. 85
其中：基金申购款	-313, 529. 20	6, 078. 08	-307, 451. 12
基金赎回款	12, 470, 344. 13	-2, 417, 318. 16	10, 053, 025. 97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-128, 983, 197. 75	-14, 545, 439. 17	-143, 528, 636. 92

#### 7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	390, 698. 18	1, 385, 125. 81
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	51, 098. 82	14, 816. 95
其他	2, 597. 77	5, 890. 05
合计	444, 394. 77	1, 405, 832. 81

注：其他包含认/申购款利息收入、结算保证金利息收入、风控金利息收入等

## 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1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-143,586,658.64	-103,241,446.53
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	-143,586,658.64	-103,241,446.53

## 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1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
卖出股票成交总额	3,511,648,562.49	799,905,433.43
减：卖出股票成本总额	3,645,863,242.17	900,770,197.02
减：交易费用	9,371,978.96	2,376,682.94
买卖股票差价收入	-143,586,658.64	-103,241,446.53

## 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

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
债券投资收益——利息收入	2,280.68	947.47
债券投资收益——买卖债券（债转股及债	-	-

券到期兑付) 差价收入		
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	2,280.68	947.47

#### 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1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月 31日
股票投资产生的股利收益	8,154,068.93	18,434,900.52
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	8,154,068.93	18,434,900.52

## 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1月1日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
1. 交易性金融资产	-689,390.90	-280,627,173.28
股票投资	-661,443.30	-280,589,485.82
债券投资	-27,947.60	-37,687.46
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	-689,390.90	-280,627,173.28

## 7.4.7.21 其他收入

注：无。

## 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	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
审计费用	80,000.00	100,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费用	22,337.19	15,589.55
账户维护费	18,000.00	18,000.00
证券组合费	5,418.93	10,398.82
存托服务费	472.80	1,096.16
合计	246,228.92	265,084.53

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

## 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1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)
国信证券	470,906,023.10	6.99	94,644,597.78	6.53

#### 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1月1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	占期末应付佣金总量的比例(%)
国信证券	387,988.73	6.89	94,600.54	11.44
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	占期末应付佣金总量的比例(%)
国信证券	79,532.76	6.62	-	-

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	上年度可比期间
----	----	---------

	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	7,243,966.16	12,124,993.69
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,732,329.87	4,538,863.32
应支付基金管理人的净管理费	4,511,636.29	7,586,130.37

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 0.80%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×0.80%÷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。

### 3、业绩报酬

支付基金管理人鹏华基金的业绩报酬于基金份额持有人赎回/转出基金份额日或本基金终止日，对每笔基金份额年化收益率(R)超过 8%的部分，按比例提取业绩报酬 H2。其计算公式为：

$$R=(A-B)/C \times 365/D \times 100\%;$$

当  $R \leq 8\%$  时， $H2=0$ ；

当  $8\% < R \leq 12\%$  时， $H2=N \times (R-8\%) \times 12\% \times D/365$ ；

当  $R > 12\%$  时， $H2=N \times [E + (R-12\%) \times 20\%] \times D/365$

其中，R 为该笔基金份额的年化收益率；A 为业绩报酬计提日的基金份额累计净值；B 为业绩报酬计提起始日的基金份额累计净值；C 为业绩报酬计提起始日的基金份额单位净值；D 为业绩报酬计提起始日(不含)到本次业绩报酬计提日(含)的天数；N 为该笔基金份额业绩报酬计提起始日的资产净值； $E=(12\%-8\%) \times 12\%=0.48\%$ 。

每笔基金份额业绩报酬计提起始日为：

- 募集期内认购的基金份额，以基金合同生效日为该笔基金份额业绩报酬计提起始日；
- 存续期内申购/转入的基金份额，以申购/转入申请日为该笔基金份额业绩报酬计提起始日。

每笔基金份额业绩报酬计提日为基金份额持有人赎回/转出申请日或本基金终止运作日。

## 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,069,950.94	3,789,060.47

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

每月月底，按月支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

#### 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自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：本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方没有投资及持有本基金份额。

#### 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1月1日至2023年12月 31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	87,586,285.87	390,698.18	64,990,528.15	1,385,125.81

#### 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1月1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	301488	豪恩汽电	网下申购	2,618	104,144.04
国信证券	603270	金帝股份	网下申购	1,943	42,299.11
国信证券	688307	中润光学	网下申购	2,455	58,625.40
国信证券	688562	航天软件	网下申购	7,254	91,980.72

上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	301338	凯格精机	网下申购	2,568	118,975.44
国信证券	688401	路维光电	网下申购	4,947	124,070.76
国信证券	688231	隆达股份	网下申购	7,835	306,191.80
国信证券	301161	唯万密封	网下申购	3,460	64,563.60
国信证券	688244	永信至诚	网下申购	1,506	74,080.14

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	64	3,432.32	4,823.04	-
001326	联域股份	2023 年 11 月 1 日	6 个月	新股流通受限	41.18	48.64	99	4,076.82	4,815.36	-
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	2023 年 10 月	6 个月	新股流通	31.68	31.27	205	6,494.40	6,410.35	-

	新材	月 23 日		受限							
300904	威力传动	2023 年 8 月 2 日	6 个月	新股流通受限	35.41	61.53	304	10,764.64	18,705.12	-	
301172	君逸数码	2023 年 7 月 19 日	6 个月	新股流通受限	31.33	38.16	438	13,722.54	16,714.08	-	
301202	朗威股份	2023 年 6 月 28 日	6 个月	新股流通受限	25.82	31.80	306	7,900.92	9,730.80	-	
301251	威尔高	2023 年 8 月 30 日	6 个月	新股流通受限	28.88	34.59	321	9,270.48	11,103.39	-	
301261	恒工精密	2023 年 6 月 29 日	6 个月	新股流通受限	36.90	50.85	198	7,306.20	10,068.30	-	
301272	英华特	2023 年 7 月 6 日	6 个月	新股流通受限	51.39	53.38	173	8,890.47	9,234.74	-	
301291	明阳电气	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股流通受限	38.13	28.36	858	32,715.54	24,332.88	-	
301292	海科新源	2023 年 6 月 29 日	6 个月	新股流通受限	19.99	19.35	583	11,654.17	11,281.05	-	
301329	信音电子	2023 年 7 月 5 日	6 个月	新股流通受限	21.00	22.23	458	9,618.00	10,181.34	-	
301348	蓝箭电子	2023 年 8 月 1 日	6 个月	新股流通受限	18.08	44.57	613	11,083.04	27,321.41	-	
301370	国科	2023 年 7 月	6 个月	新股流通	13.39	16.01	1,240	16,603.60	19,852.40	-	

	恒泰	月3日		受限							
301371	敷尔佳	2023年7月24日	6个月	新股流通受限	55.68	37.58	365	20,323.20	13,716.70	-	
301381	赛维时代	2023年7月5日	6个月	新股流通受限	20.45	29.69	571	11,676.95	16,952.99	-	
301393	昊帆生物	2023年7月5日	6个月	新股流通受限	67.68	59.37	260	17,596.80	15,436.20	-	
301413	安培龙	2023年12月11日	6个月	新股流通受限	33.25	58.19	164	5,453.00	9,543.16	-	
301418	协昌科技	2023年8月10日	6个月	新股流通受限	51.88	50.20	189	9,805.32	9,487.80	-	
301421	波长光电	2023年8月16日	6个月	新股流通受限	29.38	59.37	332	9,754.16	19,710.84	-	
301456	盘古智能	2023年7月6日	6个月	新股流通受限	37.96	30.39	407	15,449.72	12,368.73	-	
301459	丰茂股份	2023年12月6日	6个月	新股流通受限	31.90	39.84	208	6,635.20	8,286.72	-	
301486	致尚科技	2023年6月30日	6个月	新股流通受限	57.66	47.25	482	27,792.12	22,774.50	-	
301487	盟固利	2023年8月1日	6个月	新股流通受限	5.32	40.96	867	4,612.44	35,512.32	-	
301488	豪恩	2023年6月	6个月	新股流通	39.78	69.09	262	10,422.36	18,101.58	-	

	汽电	月 26 日		受限							
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	465	18,595.35	18,046.65	-	
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	455	10,906.35	9,504.95	-	
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	851	8,510.00	13,488.35	-	
301508	中机认检	2023 年 11 月 23 日	6 个月	新股流通受限	16.82	26.68	419	7,047.58	11,178.92	-	
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	832	23,296.00	18,861.44	-	
301515	港通医疗	2023 年 7 月 13 日	6 个月	新股流通受限	31.16	28.27	230	7,166.80	6,502.10	-	
301516	中远	2023 年 12	6 个月	新股流通	6.87	15.51	604	4,149.48	9,368.04	-	



	通	月 1 日		受限							
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	385	9,913.75	8,858.85	-	
301519	舜禹股份	2023 年 7 月 19 日	6 个月	新股流通受限	20.93	20.21	442	9,251.06	8,932.82	-	
301520	万邦医药	2023 年 9 月 18 日	6 个月	新股流通受限	67.88	52.74	160	10,860.80	8,438.40	-	
301525	儒竞科技	2023 年 8 月 23 日	6 个月	新股流通受限	99.57	81.46	157	15,632.49	12,789.22	-	
301526	国际复材	2023 年 12 月 19 日	6 个月	新股流通受限	2.66	4.45	8,070	21,466.20	35,911.50	-	
301528	多浦乐	2023 年 8 月 17 日	6 个月	新股流通受限	71.80	68.91	148	10,626.40	10,198.68	-	
301529	福赛科技	2023 年 8 月 31 日	6 个月	新股流通受限	36.60	37.88	182	6,661.20	6,894.16	-	
301533	威马农机	2023 年 8 月 7 日	6 个月	新股流通受限	29.50	33.16	225	6,637.50	7,461.00	-	
301548	崇德科技	2023 年 9 月 11 日	6 个月	新股流通受限	66.80	58.99	136	9,084.80	8,022.64	-	
301550	斯菱	2023 年 9 月	6 个月	新股流通	37.56	43.57	260	9,765.60	11,328.20	-	

	股份	月 6 日		受限							
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	1,458	10,687.14	19,537.20	-	
301559	中集环科	2023 年 9 月 26 日	6 个月	新股流通受限	24.22	18.24	733	17,753.26	13,369.92	-	
301566	达利凯普	2023 年 12 月 22 日	6 个月	新股流通受限	8.90	22.14	576	5,126.40	12,752.64	-	
301568	思泰克	2023 年 11 月 21 日	6 个月	新股流通受限	23.23	35.58	246	5,714.58	8,752.68	-	
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	855	9,618.75	9,464.85	-	
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	麦加芯彩	2023 年 10 月 31 日	6 个月	新股流通受限	58.08	57.81	114	6,621.12	6,590.34	-	
603075	热威股份	2023 年 9 月 1 日	6 个月	新股流通受限	23.10	23.31	182	4,204.20	4,242.42	-	
603107	上海	2023 年 10	6 个月	新股流通	14.23	18.19	292	4,155.16	5,311.48	-	

	汽配	月 25 日		受限							
603119	浙江荣泰	2023 年 7 月 21 日	6 个月	新股流通受限	15.32	23.87	226	3,462.32	5,394.62	-	
603193	润本股份	2023 年 10 月 9 日	6 个月	新股流通受限	17.38	16.66	303	5,266.14	5,047.98	-	
603231	索宝蛋白	2023 年 12 月 6 日	6 个月	新股流通受限	21.29	21.53	161	3,427.69	3,466.33	-	
603270	金帝股份	2023 年 8 月 25 日	6 个月	新股流通受限	21.77	29.58	195	4,245.15	5,768.10	-	
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	265	21,412.00	20,603.75	-	
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	-	
688347	华虹公司	2023 年 7 月 27 日	6 个月	新股流通受限	52.00	42.06	18,669	970,788.00	785,218.14	-	
688450	光格科技	2023 年 7 月 17 日	6 个月	新股流通受限	53.09	36.42	167	8,866.03	6,082.14	-	
688548	广钢	2023 年 8 月	6 个月	新股流通	9.87	12.75	2,362	23,312.94	30,115.50	-	

	气体	月 8 日		受限							
688549	中巨芯-U	2023 年 8 月 30 日	6 个月	新股流通受限	5.18	8.09	3,409	17,658.62	27,578.81	-	
688563	航材股份	2023 年 7 月 12 日	6 个月	新股流通受限	78.99	60.49	451	35,624.49	27,280.99	-	
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	648	17,327.52	25,058.16	-	
688591	泰凌微	2023 年 8 月 18 日	6 个月	新股流通受限	24.98	28.02	681	17,011.38	19,081.62	-	
688602	康鹏科技	2023 年 7 月 13 日	6 个月	新股流通受限	8.66	11.06	1,066	9,231.56	11,789.96	-	
688603	天承科技	2023 年 6 月 30 日	6 个月	新股流通受限	55.00	74.14	140	7,700.00	10,379.60	-	
688612	威迈斯	2023 年 7 月 19 日	6 个月	新股流通受限	47.29	37.97	332	15,700.28	12,606.04	-	
688627	精智达	2023 年 7 月 11 日	6 个月	新股流通受限	46.77	87.72	222	10,382.94	19,473.84	-	
688638	誉辰智能	2023 年 7 月 4 日	6 个月	新股流通受限	83.90	59.68	141	11,829.90	8,414.88	-	
688646	逸飞	2023 年 7 月	6 个月	新股流通	46.80	36.07	219	10,249.20	7,899.33	-	

	激光	月 21 日		受限							
688648	中邮科技	2023 年 11 月 6 日	6 个月	新股流通受限	15.18	21.43	303	4,599.54	6,493.29	-	
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	416	13,291.20	21,736.00	-	
688653	康希通信	2023 年 11 月 10 日	6 个月	新股流通受限	10.50	15.99	648	6,804.00	10,361.52	-	
688657	浩辰软件	2023 年 9 月 25 日	6 个月	新股流通受限	103.40	78.23	101	10,443.40	7,901.23	-	
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	-	
688693	锆威特	2023 年 8 月 10 日	6 个月	新股流通受限	40.83	43.41	178	7,267.74	7,726.98	-	
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	350	14,931.00	16,863.00	-	
688716	中研股份	2023 年 9 月 13 日	6 个月	新股流通受限	29.66	36.39	267	7,919.22	9,716.13	-	
688719	爱科赛博	2023 年 9 月 20 日	6 个月	新股流通受限	69.98	60.10	194	13,576.12	11,659.40	-	
688720	艾	2023	6 个月	新股	28.03	49.84	165	4,624.95	8,223.60	-	

	森 股 份	年 11 月 29 日		流 通 受 限						
--	-------------	-------------------	--	------------------	--	--	--	--	--	--

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

注：无。

#### 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

本基金为混合型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括境内依法发行的股票（包含中小板、创业板、科创板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（含国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券等）、债券回购、银行存款、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）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目

标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人致力于全面内部控制体系的建设，建立了从董事会层面到各业务部门的风险管理组织架构。本基金的基金管理人在董事会下设风险控制和合规审计委员会，主要负责制定基金管理人风险控制战略和控制政策、协调突发重大风险等事项；督察长负责对基金管理人各业务环节合法合规运作进行监督检查，组织、指导基金管理人内部监察稽核工作，并可向董事会和中国证监会直接报告；在公司内部设立独立的监察稽核部，专职负责对基金管理人各部门、各业务的风险控制情况进行督促和检查，并适时提出整改建议。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 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中国银行股份有限公司及其他具有基金托管资格的银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。

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

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

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。下列表格列示中不含国债、央行票据、政策性金融债券等非信用债券投资。

##### 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**

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	651,635.37	678,877.00
未评级	-	-
合计	651,635.37	678,877.00

注：上述评级均由经中国证监会核准从事证券市场资信评级业务的评级机构作出。

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

于 2023 年 12 月 31 日，本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不



计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 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、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股股票不得超过该上市公司可流通股股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注“期末本基金持有的流通受限证券”。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流

动性情况良好。

#### 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主要为银行存款、结算备付金及债券投资等，其余大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

##### 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	87,586,285.87	-	-	-	87,586,285.87
结算备付金	1,345,002.69	-	-	-	1,345,002.69
存出保证金	149,267.88	-	-	-	149,267.88
交易性金融资产	-	651,635.37	-	650,889,525.37	651,541,160.74
应收股利	-	-	-	23.43	23.43
应收申购款	-	-	-	34,084.16	34,084.16
资产总计	89,080,556.44	651,635.37	-	650,923,632.96	740,655,824.77
负债					
应付赎回款	-	-	-	638,516.53	638,516.53
应付管理人报酬	-	-	-	502,434.29	502,434.29
应付托管费	-	-	-	125,608.56	125,608.56
应付清算款	-	-	-	6,876,715.62	6,876,715.62
应交税费	-	-	-	15.98	15.98
其他负债	-	-	-	1,026,631.75	1,026,631.75
负债总计	-	-	-	9,169,922.73	9,169,922.73
利率敏感度缺口	89,080,556.44	651,635.37	-	641,753,710.23	731,485,902.04
上年度末 2022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	64,990,528.15	-	-	-	64,990,528.15
存出保证金	129,799.89	-	-	-	129,799.89
交易性金融资产	-	486,238.47	192,638.53	1,047,960,736.73	1,048,639,613.73

应收申购款	-	-	-	62,715.37	62,715.37
资产总计	65,120,328.04	486,238.47	192,638.53	1,048,023,452.10	1,113,822,657.14
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,070,731.01	2,070,731.01
应付管理人报酬	-	-	-	748,902.21	748,902.21
应付托管费	-	-	-	234,031.93	234,031.93
应付清算款	-	-	-	33.42	33.42
应交税费	-	-	-	3.82	3.82
其他负债	-	-	-	247,008.72	247,008.72
负债总计	-	-	-	3,300,711.11	3,300,711.11
利率敏感度缺口	65,120,328.04	486,238.47	192,638.53	1,044,722,740.99	1,110,521,946.03

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约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 0.09%，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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇风险进行监控。

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
交易性金融资产	-	31,980,374.71	-	31,980,374.71
资产合计	-	31,980,374.71	-	31,980,374.71
以外币计价的 负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口净 额	-	31,980,374.71	-	31,980,374.71

项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民 币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	136,176,503.92	-	136,176,503.92
资产合计	-	136,176,503.92	-	136,176,503.92
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	136,176,503.92	-	136,176,503.92

#### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023 年 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	人民币升值 5%	1,599,018.74	6,808,825.20
	人民币贬值 5%	-1,599,018.74	-6,808,825.20

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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券投资品种，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。基金的投资组合比例为：股票（含存托凭证）资产占基金资产的比例为 60%—95%（其中，投资于港股通标的股票占股票资产的比例不超过 50%）；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，基金保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR（Value at Risk）指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 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		上年度末 2022 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	650,889,525.37	88.98	1,047,960,736.73	94.37
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	651,635.37	0.09	678,877.00	0.06
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	651,541,160.74	89.07	1,048,639,613.73	94.43

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

假设	除业绩比较基准外的其他市场变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023 年 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）

比较基准上涨 5%资产净值变动	31,439,264.07	44,604,113.96
比较基准下降 5%资产净值变动	-31,439,264.07	-44,604,113.96

注：无。

#### 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	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	649,646,171.24	1,033,297,295.24
第二层次	-	-
第三层次	1,894,989.50	15,342,318.49
合计	651,541,160.74	1,048,639,613.73

###### 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1月1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	-	15,342,318.49	15,342,318.49
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	3,016,223.90	3,016,223.90
转出第三层次	-	17,415,601.68	17,415,601.68
当期利得或损失总额	-	952,048.79	952,048.79
其中：计入损益的利得或损失	-	952,048.79	952,048.79
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,894,989.50	1,894,989.50
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	-	-4,726.27	-4,726.27
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	-	5,327,896.66	5,327,896.66
当期购买	-	12,499,995.24	12,499,995.24
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	2,455,907.59	2,455,907.59
转出第三层次	-	6,760,338.34	6,760,338.34
当期利得或损失总额	-	1,818,857.34	1,818,857.34
其中：计入损益的利得或损失	-	1,818,857.34	1,818,857.34
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	15,342,318.49	15,342,318.49

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	-	1,399,466.50	1,399,466.50
---	---	--------------	--------------

#### 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	1,894,989.50	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.1855-2.1988	负相关
项目	上年度末公允价值	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	15,342,318.49	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.2063-2.4756	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	650,889,525.37	87.88
	其中：股票	650,889,525.37	87.88
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	651,635.37	0.09
	其中：债券	651,635.37	0.09
	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	88,931,288.56	12.01
8	其他各项资产	183,375.47	0.02
9	合计	740,655,824.77	100.00

注：本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 31,980,374.71 元，占净值比 4.37%。

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,819,025.20	0.25
B	采矿业	14,337,588.93	1.96
C	制造业	451,527,384.10	61.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,915,227.73	0.54
E	建筑业	2,347,741.28	0.32
F	批发和零售业	2,065,331.28	0.28
G	交通运输、仓储和邮政业	15,101,970.76	2.06
H	住宿和餐饮业	205,154.00	0.03
I	信息传输、软件和信息技术服务业	82,834,269.97	11.32
J	金融业	25,979,487.28	3.55
K	房地产业	9,805,145.00	1.34
L	租赁和商务服务业	1,064,516.40	0.15
M	科学研究和技术服务业	5,539,971.27	0.76
N	水利、环境和公共设施管理业	271,385.65	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	307,944.00	0.04
Q	卫生和社会工作	109,126.06	0.01
R	文化、体育和娱乐业	1,677,881.75	0.23
S	综合	-	-
	合计	618,909,150.66	84.61

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
原材料	-	-
能源	-	-
金融	-	-

非日常生活消费品	23,172,089.36	3.17
日常消费品	-	-
医疗保健	6,284,804.26	0.86
信息技术	-	-
通信服务	1,535.50	0.00
房地产	2,518,675.37	0.34
工业	3,270.22	0.00
公用事业	-	-
合计	31,980,374.71	4.37

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

### 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

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	600519	贵州茅台	15,977	27,576,302.00	3.77
2	300661	圣邦股份	178,999	15,932,700.99	2.18
3	688533	上声电子	297,269	11,331,894.28	1.55
4	002920	德赛西威	85,907	11,125,815.57	1.52
5	688008	澜起科技	173,313	10,183,871.88	1.39
6	600276	恒瑞医药	214,720	9,711,785.60	1.33
7	601006	大秦铁路	1,326,100	9,561,181.00	1.31
8	002371	北方华创	37,300	9,164,983.00	1.25
9	02333	长城汽车	715,000	6,570,185.62	0.90
9	601633	长城汽车	100,858	2,543,638.76	0.35
10	300525	博思软件	538,500	8,034,420.00	1.10
11	603997	继峰股份	584,600	7,874,562.00	1.08
12	02015	理想汽车-W	58,800	7,838,331.77	1.07
13	002142	宁波银行	386,950	7,781,564.50	1.06
14	603728	鸣志电器	116,200	7,651,770.00	1.05
15	002648	卫星化学	505,139	7,450,800.25	1.02
16	03690	美团-W	97,515	7,237,506.55	0.99
17	603000	人民网	256,400	7,174,072.00	0.98
18	301363	美好医疗	190,245	7,001,016.00	0.96
19	688107	安路科技	177,654	6,534,114.12	0.89
20	601838	成都银行	568,700	6,403,562.00	0.88
21	300782	卓胜微	42,190	5,948,790.00	0.81
22	300858	科拓生物	306,796	5,921,162.80	0.81
23	601636	旗滨集团	854,598	5,845,450.32	0.80
24	688066	航天宏图	138,050	5,831,232.00	0.80
25	688279	峰岹科技	44,750	5,643,870.00	0.77
26	603596	伯特利	77,424	5,365,483.20	0.73
27	601601	中国太保	225,400	5,360,012.00	0.73
28	603737	三棵树	102,900	4,899,069.00	0.67

29	000625	长安汽车	290,200	4,884,066.00	0.67
30	688361	中科飞测-U	62,215	4,630,662.45	0.63
31	02269	药明生物	171,685	4,605,297.67	0.63
32	600684	珠江股份	1,324,500	4,596,015.00	0.63
33	688737	中自科技	136,960	4,533,376.00	0.62
34	300698	万马科技	121,100	4,420,150.00	0.60
35	301313	凡拓数创	112,147	4,044,020.82	0.55
36	688012	中微公司	25,264	3,880,550.40	0.53
37	688120	华海清科	20,548	3,856,859.60	0.53
38	688590	新致软件	169,877	3,842,617.74	0.53
39	601021	春秋航空	75,800	3,805,160.00	0.52
40	002557	洽洽食品	108,200	3,767,524.00	0.52
41	601899	紫金矿业	301,900	3,761,674.00	0.51
42	688595	芯海科技	86,757	3,756,578.10	0.51
43	300036	超图软件	177,600	3,711,840.00	0.51
44	688099	晶晨股份	59,123	3,702,873.49	0.51
45	601989	中国重工	889,200	3,672,396.00	0.50
46	600422	昆药集团	174,200	3,633,812.00	0.50
47	002241	歌尔股份	170,200	3,575,902.00	0.49
48	002555	三七互娱	188,000	3,536,280.00	0.48
49	600418	江淮汽车	218,200	3,523,930.00	0.48
50	600941	中国移动	35,400	3,521,592.00	0.48
51	688428	诺诚健华-U	304,960	3,507,040.00	0.48
52	688292	浩瀚深度	127,354	3,504,782.08	0.48
53	688592	司南导航	66,723	3,462,923.70	0.47
54	603806	福斯特	142,000	3,446,340.00	0.47
55	000837	秦川机床	318,700	3,426,025.00	0.47
56	688617	惠泰医疗	8,730	3,391,605.00	0.46
57	600309	万华化学	43,700	3,357,034.00	0.46
58	601318	中国平安	81,400	3,280,420.00	0.45
59	002517	恺英网络	292,700	3,269,459.00	0.45
60	688418	震有科技	170,548	3,216,535.28	0.44
61	601898	中煤能源	321,800	3,118,242.00	0.43
62	603019	中科曙光	78,260	3,090,487.40	0.42
63	603379	三美股份	88,600	3,012,400.00	0.41
64	688205	德科立	59,605	2,949,255.40	0.40
65	688516	奥特维	31,636	2,863,058.00	0.39
66	600266	城建发展	590,200	2,856,568.00	0.39
67	300684	中石科技	131,700	2,830,233.00	0.39
68	688278	特宝生物	53,096	2,779,575.60	0.38
69	000975	银泰黄金	184,500	2,767,500.00	0.38
70	603501	韦尔股份	25,900	2,763,789.00	0.38
71	603190	亚通精工	92,970	2,722,161.60	0.37

72	300748	金力永磁	133,100	2,691,282.00	0.37
73	002011	盾安环境	193,700	2,663,375.00	0.36
74	600761	安徽合力	143,900	2,620,419.00	0.36
75	000338	潍柴动力	187,700	2,562,105.00	0.35
76	000426	兴业银锡	281,700	2,557,836.00	0.35
77	301488	豪恩汽电	36,562	2,546,033.58	0.35
78	301387	光大同创	37,321	2,526,631.70	0.35
79	00123	越秀地产	437,000	2,518,675.37	0.34
80	688458	美芯晟	32,660	2,513,513.60	0.34
81	301227	森鹰窗业	92,340	2,499,643.80	0.34
82	002967	广电计量	164,400	2,467,644.00	0.34
83	002459	晶澳科技	117,904	2,442,970.88	0.33
84	002180	纳思达	107,700	2,437,251.00	0.33
85	301345	涛涛车业	39,952	2,433,076.80	0.33
86	003000	劲仔食品	196,300	2,398,786.00	0.33
87	300757	罗博特科	29,400	2,392,866.00	0.33
88	688270	臻镭科技	34,902	2,386,598.76	0.33
89	688049	炬芯科技	62,546	2,381,126.22	0.33
90	688484	南芯科技	58,933	2,348,480.05	0.32
91	301191	菲菱科思	25,400	2,341,880.00	0.32
92	688017	绿的谐波	15,223	2,336,730.50	0.32
93	600150	中国船舶	79,100	2,328,704.00	0.32
94	688720	艾森股份	38,636	2,326,486.06	0.32
95	002845	同兴达	130,900	2,323,475.00	0.32
96	300803	指南针	38,000	2,289,880.00	0.31
97	605128	上海沿浦	39,400	2,287,170.00	0.31
98	688728	格科微	111,585	2,284,144.95	0.31
99	688800	瑞可达	56,767	2,280,898.06	0.31
100	000887	中鼎股份	184,300	2,279,791.00	0.31
101	603992	松霖科技	124,300	2,254,802.00	0.31
102	002385	大北农	377,100	2,247,516.00	0.31
103	688326	经纬恒润-W	19,341	2,244,523.05	0.31
104	601233	桐昆股份	148,000	2,239,240.00	0.31
105	688256	寒武纪-U	16,534	2,231,428.64	0.31
106	603129	春风动力	21,600	2,208,384.00	0.30
107	000700	模塑科技	314,900	2,204,300.00	0.30
108	688498	源杰科技	14,627	2,179,130.46	0.30
109	002919	名臣健康	84,700	2,171,708.00	0.30
110	688627	精智达	24,166	2,154,799.76	0.29
111	001322	箭牌家居	180,800	2,144,288.00	0.29
112	605388	均瑶健康	170,600	2,139,324.00	0.29
113	000933	神火股份	127,100	2,135,280.00	0.29
114	002851	麦格米特	86,400	2,125,440.00	0.29

115	300812	易天股份	50,900	2,116,931.00	0.29
116	000926	福星股份	506,700	2,112,939.00	0.29
117	600803	新奥股份	124,800	2,099,136.00	0.29
118	300766	每日互动	136,000	2,098,480.00	0.29
119	000063	中兴通讯	79,200	2,097,216.00	0.29
120	002840	华统股份	100,800	2,095,632.00	0.29
121	300567	精测电子	23,500	2,059,070.00	0.28
122	301153	中科江南	26,200	2,050,674.00	0.28
123	300832	新产业	25,700	2,009,740.00	0.27
124	301159	三维天地	43,300	1,975,779.00	0.27
125	300571	平治信息	55,000	1,943,150.00	0.27
126	300928	华安鑫创	38,300	1,931,852.00	0.26
127	002508	老板电器	87,000	1,894,860.00	0.26
128	300188	国投智能	116,803	1,871,184.06	0.26
129	688362	甬矽电子	71,435	1,870,882.65	0.26
130	603758	秦安股份	160,700	1,838,408.00	0.25
131	688668	鼎通科技	32,450	1,795,134.00	0.25
132	688041	海光信息	25,217	1,789,902.66	0.24
133	002236	大华股份	91,300	1,684,485.00	0.23
134	09939	开拓药业-B	1,137,000	1,679,506.59	0.23
135	688325	赛微微电	42,362	1,660,166.78	0.23
136	600933	爱柯迪	74,000	1,623,560.00	0.22
137	600079	人福医药	65,100	1,618,386.00	0.22
138	688387	信科移动-U	223,709	1,612,941.89	0.22
139	600480	凌云股份	175,500	1,598,805.00	0.22
140	600850	电科数字	72,600	1,579,050.00	0.22
141	600938	中国海油	75,300	1,579,041.00	0.22
142	301325	曼恩斯特	20,242	1,569,564.68	0.21
143	09868	小鹏汽车-W	29,700	1,526,065.42	0.21
144	002530	金财互联	172,900	1,505,959.00	0.21
145	688322	奥比中光-UW	39,977	1,502,335.66	0.21
146	600820	隧道股份	258,500	1,488,960.00	0.20
147	688197	首药控股-U	26,682	1,472,579.58	0.20
148	688502	茂莱光学	6,756	1,465,984.44	0.20
149	002709	天赐材料	58,000	1,454,640.00	0.20
150	600201	生物股份	134,300	1,446,411.00	0.20
151	301529	福赛科技	36,282	1,445,479.16	0.20
152	300479	神思电子	73,300	1,442,544.00	0.20
153	001270	铖昌科技	22,800	1,429,788.00	0.20
154	300327	中颖电子	60,300	1,374,840.00	0.19
155	603170	宝立食品	80,200	1,356,182.00	0.19
156	300310	宜通世纪	296,700	1,311,414.00	0.18
157	300342	天银机电	85,300	1,311,061.00	0.18

158	603225	新凤鸣	89,500	1,270,900.00	0.17
159	600707	彩虹股份	184,500	1,245,375.00	0.17
160	688025	杰普特	13,273	1,228,416.15	0.17
161	600584	长电科技	38,100	1,137,666.00	0.16
162	601678	滨化股份	266,000	1,119,860.00	0.15
163	600845	宝信软件	22,920	1,118,496.00	0.15
164	688235	百济神州-U	7,747	1,077,142.88	0.15
165	601975	招商南油	376,300	1,053,640.00	0.14
166	002126	银轮股份	54,200	1,011,914.00	0.14
167	002234	民和股份	82,600	999,460.00	0.14
168	300677	英科医疗	42,600	995,136.00	0.14
169	600801	华新水泥	79,700	990,671.00	0.14
170	603296	华勤技术	12,146	969,776.84	0.13
171	002657	中科金财	52,800	962,016.00	0.13
172	603629	利通电子	30,500	959,530.00	0.13
173	301525	儒竞科技	11,169	941,981.78	0.13
174	605268	王力安防	96,600	940,884.00	0.13
175	003021	兆威机电	9,800	921,102.00	0.13
176	000568	泸州老窖	5,100	915,042.00	0.13
177	688489	三未信安	19,398	912,093.96	0.12
178	300601	康泰生物	33,200	901,380.00	0.12
179	300374	中铁装配	72,900	891,567.00	0.12
180	001323	慕思股份	26,573	810,476.50	0.11
181	300213	佳讯飞鸿	112,200	807,840.00	0.11
182	603918	金桥信息	42,300	791,010.00	0.11
183	688347	华虹公司	18,798	790,735.47	0.11
184	688116	天奈科技	27,070	786,112.80	0.11
185	300634	彩讯股份	38,200	781,954.00	0.11
186	601595	上海电影	30,200	780,066.00	0.11
187	301312	智立方	7,200	780,048.00	0.11
188	300499	高澜股份	52,700	755,718.00	0.10
189	600415	小商品城	103,100	754,692.00	0.10
190	603801	志邦家居	44,000	737,880.00	0.10
191	688192	迪哲医药-U	15,246	729,521.10	0.10
192	300496	中科创达	9,000	720,540.00	0.10
193	603267	鸿远电子	14,200	712,840.00	0.10
194	605090	九丰能源	25,100	701,043.00	0.10
195	688981	中芯国际	13,161	697,796.22	0.10
196	000600	建投能源	138,100	691,881.00	0.09
197	688233	神工股份	19,577	690,872.33	0.09
198	301310	鑫宏业	14,100	685,965.00	0.09
199	002821	凯莱英	5,900	684,990.00	0.09
200	000798	中水渔业	75,100	667,639.00	0.09

201	301085	亚康股份	11,400	654,474.00	0.09
202	002150	通润装备	35,700	633,318.00	0.09
203	600211	西藏药业	12,700	619,760.00	0.08
204	688719	爱科赛博	9,546	612,244.84	0.08
205	688358	祥生医疗	15,996	604,328.88	0.08
206	000818	航锦科技	19,200	602,496.00	0.08
207	688678	福立旺	28,390	522,659.90	0.07
208	301205	联特科技	4,800	502,800.00	0.07
209	688443	智翔金泰-U	12,305	491,584.75	0.07
210	688375	国博电子	6,110	485,928.30	0.07
211	688469	芯联集成-U	89,903	451,313.06	0.06
212	601801	皖新传媒	64,500	448,275.00	0.06
213	300085	银之杰	30,800	441,056.00	0.06
214	301526	国际复材	80,697	437,538.81	0.06
215	688112	鼎阳科技	10,497	420,299.88	0.06
216	300570	太辰光	10,700	417,835.00	0.06
217	600563	法拉电子	4,000	370,400.00	0.05
218	688352	颀中科技	23,609	363,814.69	0.05
219	603713	密尔克卫	6,200	329,902.00	0.05
220	601618	中国中冶	103,700	317,322.00	0.04
221	300192	科德教育	31,200	307,944.00	0.04
222	688146	中船特气	8,948	304,321.48	0.04
223	688548	广钢气体	22,881	298,093.64	0.04
224	002756	永兴材料	5,700	297,597.00	0.04
225	688531	日联科技	2,941	297,276.28	0.04
226	688549	中巨芯-U	34,089	284,677.21	0.04
227	603496	恒为科技	8,900	277,324.00	0.04
228	688563	航材股份	4,503	275,263.39	0.04
229	301160	翔楼新材	6,492	274,157.16	0.04
230	603306	华懋科技	9,800	265,678.00	0.04
231	688029	南微医学	2,692	260,585.60	0.04
232	688062	迈威生物-U	7,922	258,970.18	0.04
233	001287	中电港	12,325	256,729.75	0.04
234	688338	赛科希德	7,439	249,950.40	0.03
235	601456	国联证券	22,900	248,236.00	0.03
236	603979	金诚信	6,500	245,440.00	0.03
237	301291	明阳电气	8,571	243,073.56	0.03
238	688570	天玛智控	8,837	240,454.77	0.03
239	301486	致尚科技	4,820	230,694.84	0.03
240	601139	深圳燃气	33,300	229,437.00	0.03
241	688543	国科军工	4,094	228,854.60	0.03
242	688536	思瑞浦	1,549	226,618.70	0.03
243	601658	邮储银行	51,900	225,765.00	0.03

244	605289	罗曼股份	3,900	224,250.00	0.03
245	603598	引力传媒	10,800	223,344.00	0.03
246	601360	三六零	24,200	218,042.00	0.03
247	601061	中信金属	27,970	215,648.70	0.03
248	301262	海看股份	6,917	215,464.55	0.03
249	688403	汇成股份	20,419	215,420.45	0.03
250	688271	联影医疗	1,570	215,105.70	0.03
251	301303	真兰仪表	10,574	208,202.06	0.03
252	600765	中航重机	10,800	206,388.00	0.03
253	688777	中控技术	4,533	205,571.55	0.03
254	603029	天鹅股份	10,000	204,000.00	0.03
255	301370	国科恒泰	12,395	200,340.30	0.03
256	603108	润达医疗	9,700	197,395.00	0.03
257	002635	安洁科技	12,053	196,825.49	0.03
258	603259	药明康德	2,700	196,452.00	0.03
259	603722	阿科力	3,600	194,040.00	0.03
260	600436	片仔癀	800	193,592.00	0.03
261	301511	德福科技	8,317	192,438.59	0.03
262	603901	永创智能	15,900	189,210.00	0.03
263	688609	九联科技	14,217	187,664.40	0.03
264	688227	品高股份	9,805	186,981.35	0.03
265	600373	中文传媒	14,100	185,838.00	0.03
266	600459	贵研铂业	12,500	179,500.00	0.02
267	688121	卓然股份	8,810	178,226.30	0.02
268	600879	航天电子	23,100	178,101.00	0.02
269	688562	航天软件	7,254	174,096.00	0.02
270	688159	有方科技	4,601	173,227.65	0.02
271	002833	弘亚数控	9,700	172,078.00	0.02
272	600977	中国电影	14,000	171,360.00	0.02
273	688285	高铁电气	19,284	171,241.92	0.02
274	301172	君逸数码	4,376	169,705.38	0.02
275	601728	中国电信	30,500	165,005.00	0.02
276	600297	广汇汽车	95,700	164,604.00	0.02
277	301566	达利凯普	5,755	162,891.85	0.02
278	688581	安杰思	1,294	161,504.14	0.02
279	301322	绿通科技	3,905	160,729.80	0.02
280	688575	亚辉龙	7,006	160,227.22	0.02
281	603893	瑞芯微	2,500	158,500.00	0.02
282	603208	江山欧派	5,320	157,950.80	0.02
283	601138	工业富联	10,400	157,248.00	0.02
284	600895	张江高科	8,100	156,330.00	0.02
285	301393	昊帆生物	2,597	155,679.57	0.02
286	688114	华大智造	1,805	155,266.10	0.02



287	688334	西高院	8,879	153,873.07	0.02
288	603301	振德医疗	6,223	152,463.50	0.02
289	600975	新五丰	14,500	151,525.00	0.02
290	688331	荣昌生物	2,385	148,013.10	0.02
291	603378	亚士创能	17,400	147,204.00	0.02
292	688593	新相微	9,584	141,076.48	0.02
293	301508	中机认检	4,186	140,801.39	0.02
294	301408	华人健康	8,784	140,104.80	0.02
295	601689	拓普集团	1,900	139,650.00	0.02
296	603297	永新光学	1,400	139,090.00	0.02
297	301371	敷尔佳	3,645	139,045.50	0.02
298	301439	泓淋电力	9,486	138,685.32	0.02
299	688579	山大地纬	10,880	138,176.00	0.02
300	301559	中集环科	7,323	137,657.32	0.02
301	688772	珠海冠宇	6,241	137,364.41	0.02
302	301332	德尔玛	11,211	136,998.42	0.02
303	301317	鑫磊股份	6,936	136,361.76	0.02
304	688639	华恒生物	1,083	136,349.70	0.02
305	688166	博瑞医药	3,836	134,260.00	0.02
306	600021	上海电力	15,700	132,822.00	0.02
307	600050	中国联通	30,000	131,400.00	0.02
308	688630	芯碁微装	1,533	130,872.21	0.02
309	688433	华曙高科	4,171	130,343.75	0.02
310	688507	索辰科技	940	128,545.00	0.02
311	603380	易德龙	5,000	128,050.00	0.02
312	688139	海尔生物	3,141	127,273.32	0.02
313	688653	康希通信	6,478	127,078.12	0.02
314	603600	永艺股份	11,500	126,960.00	0.02
315	600475	华光环能	12,200	126,880.00	0.02
316	600809	山西汾酒	549	126,670.77	0.02
317	688416	恒烁股份	2,147	125,792.73	0.02
318	688257	新锐股份	5,005	125,325.20	0.02
319	301456	盘古智能	4,061	124,911.93	0.02
320	601600	中国铝业	22,000	124,080.00	0.02
321	688612	威迈斯	3,190	123,925.14	0.02
322	601136	首创证券	7,300	123,808.00	0.02
323	300181	佐力药业	11,500	122,590.00	0.02
324	301419	阿莱德	3,292	122,133.20	0.02
325	600699	均胜电子	6,800	122,128.00	0.02
326	688249	晶合集成	7,029	121,250.25	0.02
327	601555	东吴证券	16,500	120,615.00	0.02
328	688620	安凯微	10,157	120,055.74	0.02
329	688208	道通科技	5,041	119,723.75	0.02

330	688300	联瑞新材	2,260	119,667.00	0.02
331	688602	康鹏科技	10,653	119,451.97	0.02
332	301315	威士顿	2,253	119,093.58	0.02
333	301320	豪江智能	6,416	118,503.52	0.02
334	688232	新点软件	3,271	118,410.20	0.02
335	600760	中航沈飞	2,800	118,104.00	0.02
336	688072	拓荆科技	508	117,500.40	0.02
337	603035	常熟汽饰	6,200	116,994.00	0.02
338	600019	宝钢股份	19,700	116,821.00	0.02
339	603730	岱美股份	8,015	116,137.35	0.02
340	688110	东芯股份	3,359	115,650.37	0.02
341	688550	瑞联新材	2,902	115,151.36	0.02
342	688522	纳睿雷达	2,075	115,141.75	0.02
343	688472	阿特斯	9,107	115,021.41	0.02
344	301281	科源制药	3,366	114,578.64	0.02
345	301251	威尔高	3,207	114,566.49	0.02
346	688032	禾迈股份	424	114,480.00	0.02
347	000032	深桑达 A	5,400	114,372.00	0.02
348	688305	科德数控	1,491	113,986.95	0.02
349	301292	海科新源	5,824	113,480.55	0.02
350	603416	信捷电气	3,000	112,680.00	0.02
351	600258	首旅酒店	7,200	112,464.00	0.02
352	688625	呈和科技	2,865	112,365.30	0.02
353	301399	英特科技	2,925	111,939.75	0.02
354	603986	兆易创新	1,200	110,868.00	0.02
355	301568	思泰克	2,456	109,572.88	0.01
356	301528	多浦乐	1,478	107,940.38	0.01
357	600988	赤峰黄金	7,700	107,877.00	0.01
358	601128	常熟银行	16,800	107,352.00	0.01
359	603197	保隆科技	1,900	107,160.00	0.01
360	601000	唐山港	30,500	106,750.00	0.01
361	688036	传音控股	765	105,876.00	0.01
362	601083	锦江航运	8,546	105,525.44	0.01
363	688439	振华风光	1,182	105,328.02	0.01
364	688716	中研股份	2,668	104,555.63	0.01
365	688085	三友医疗	5,351	104,344.50	0.01
366	301329	信音电子	4,577	103,682.64	0.01
367	688582	芯动联科	2,655	102,668.85	0.01
368	603135	中重科技	6,273	102,626.28	0.01
369	301261	恒工精密	1,973	101,693.80	0.01
370	600602	云赛智联	8,700	100,659.00	0.01
371	688652	京仪装备	1,725	100,603.25	0.01
372	600984	建设机械	26,800	100,500.00	0.01

373	688391	钜泉科技	2,026	100,489.60	0.01
374	688315	诺禾致源	4,304	100,455.36	0.01
375	301376	致欧科技	4,192	100,272.64	0.01
376	601065	江盐集团	8,748	100,077.12	0.01
377	301500	飞南资源	4,550	98,243.60	0.01
378	301202	朗威股份	3,060	98,216.82	0.01
379	002790	瑞尔特	9,400	98,136.00	0.01
380	688373	盟科药业-U	15,013	98,034.89	0.01
381	688111	金山办公	310	98,022.00	0.01
382	600141	兴发集团	5,300	96,725.00	0.01
383	601865	福莱特	3,600	96,120.00	0.01
384	301386	未来电器	3,776	96,023.68	0.01
385	301357	北方长龙	1,900	95,912.00	0.01
386	300457	赢合科技	5,200	95,888.00	0.01
387	603739	蔚蓝生物	6,200	94,364.00	0.01
388	688551	科威尔	1,643	93,815.30	0.01
389	603650	彤程新材	2,800	93,240.00	0.01
390	600754	锦江酒店	3,100	92,690.00	0.01
391	688031	星环科技-U	1,424	92,659.68	0.01
392	688071	华依科技	1,886	91,867.06	0.01
393	600301	华锡有色	7,300	91,834.00	0.01
394	601799	星宇股份	700	91,777.00	0.01
395	688131	皓元医药	1,761	91,677.66	0.01
396	301555	惠柏新材	2,235	91,587.79	0.01
397	301519	舜禹股份	4,414	90,914.90	0.01
398	600536	中国软件	2,500	90,650.00	0.01
399	301518	长华化学	3,850	89,939.85	0.01
400	301578	辰奕智能	1,175	89,662.16	0.01
401	603032	德新科技	4,380	88,914.00	0.01
402	301520	万邦医药	1,596	87,849.20	0.01
403	688351	微电生理-U	3,421	87,748.65	0.01
404	601133	柏诚股份	6,632	87,343.44	0.01
405	601668	中国建筑	17,900	86,099.00	0.01
406	601965	中国汽研	3,900	86,034.00	0.01
407	688488	艾迪药业	6,862	85,843.62	0.01
408	603103	横店影视	4,800	85,344.00	0.01
409	301355	南王科技	5,624	85,203.60	0.01
410	301323	新莱福	2,277	84,226.23	0.01
411	688638	誉辰智能	1,401	84,216.48	0.01
412	000516	国际医学	10,300	83,533.00	0.01
413	601155	新城控股	7,300	83,293.00	0.01
414	688702	盛科通信-U	1,652	83,199.90	0.01
415	688657	浩辰软件	1,008	82,656.17	0.01

416	301548	崇德科技	1,351	82,246.99	0.01
417	688088	虹软科技	2,003	82,203.12	0.01
418	301373	凌玮科技	2,764	81,952.60	0.01
419	002493	荣盛石化	7,900	81,765.00	0.01
420	605088	冠盛股份	3,500	80,500.00	0.01
421	688646	逸飞激光	2,190	80,116.77	0.01
422	688401	路维光电	2,563	78,735.36	0.01
423	688651	盛邦安全	1,673	78,551.60	0.01
424	605377	华旺科技	4,100	78,269.00	0.01
425	688601	力芯微	1,492	78,165.88	0.01
426	688648	中邮科技	3,025	78,163.55	0.01
427	001378	德冠新材	2,044	77,818.72	0.01
428	600690	海尔智家	3,700	77,700.00	0.01
429	688479	友车科技	3,318	77,375.76	0.01
430	688307	中润光学	2,455	76,350.50	0.01
431	301170	锡南科技	2,496	75,953.28	0.01
432	603799	华友钴业	2,300	75,739.00	0.01
433	600012	皖通高速	6,800	74,936.00	0.01
434	300679	电连技术	1,800	74,700.00	0.01
435	300723	一品红	2,500	74,575.00	0.01
436	600585	海螺水泥	3,300	74,448.00	0.01
437	603348	文灿股份	1,900	73,720.00	0.01
438	688023	安恒信息	660	73,187.40	0.01
439	688429	时创能源	3,452	73,147.88	0.01
440	688006	杭可科技	3,101	72,811.48	0.01
441	301295	美硕科技	2,146	71,225.74	0.01
442	301337	亚华电子	2,318	70,953.98	0.01
443	688603	天承科技	947	70,888.46	0.01
444	688409	富创精密	905	70,870.55	0.01
445	002334	英威腾	8,100	70,713.00	0.01
446	301505	苏州规划	1,934	70,283.14	0.01
447	603062	麦加芯彩	1,132	70,154.26	0.01
448	603004	鼎龙科技	1,948	69,190.05	0.01
449	600456	宝钛股份	2,200	69,058.00	0.01
450	603052	可川科技	1,580	68,856.40	0.01
451	603107	上海汽配	2,920	66,438.76	0.01
452	688048	长光华芯	1,057	66,242.19	0.01
453	688191	智洋创新	3,552	65,712.00	0.01
454	301515	港通医疗	2,294	65,573.78	0.01
455	600963	岳阳林纸	10,900	64,201.00	0.01
456	301157	华塑科技	1,498	64,114.40	0.01
457	601020	华钰矿业	6,200	63,860.00	0.01
458	600446	金证股份	5,500	63,635.00	0.01

459	301273	瑞晨环保	2,300	63,457.00	0.01
460	688450	光格科技	1,662	61,217.74	0.01
461	688680	海优新材	913	59,938.45	0.01
462	603270	金帝股份	1,943	59,431.70	0.01
463	688682	霍莱沃	1,237	59,017.27	0.01
464	688052	纳芯微	352	58,731.20	0.01
465	603507	振江股份	2,200	57,002.00	0.01
466	001306	夏厦精密	631	56,221.59	0.01
467	301095	广立微	740	55,300.20	0.01
468	688238	和元生物	6,094	54,785.06	0.01
469	688591	泰凌微	1,902	54,576.09	0.01
470	603193	润本股份	3,022	54,479.40	0.01
471	603119	浙江荣泰	2,253	54,448.02	0.01
472	688152	麒麟信安	774	54,234.18	0.01
473	603383	顶点软件	1,100	54,230.00	0.01
474	001326	联域股份	986	53,715.67	0.01
475	001319	铭科精技	2,100	53,697.00	0.01
476	600132	重庆啤酒	800	53,160.00	0.01
477	688053	思科瑞	1,063	53,086.22	0.01
478	603087	甘李药业	1,000	52,650.00	0.01
479	688359	三孚新科	761	52,425.29	0.01
480	300752	隆利科技	2,800	50,876.00	0.01
481	688485	九州一轨	3,580	50,048.40	0.01
482	688425	铁建重工	12,552	49,831.44	0.01
483	603486	科沃斯	1,200	49,728.00	0.01
484	603040	新坐标	1,900	49,685.00	0.01
485	600925	苏能股份	8,960	49,369.60	0.01
486	688435	英方软件	1,013	48,644.26	0.01
487	603125	常青科技	1,596	47,911.92	0.01
488	605333	沪光股份	2,400	47,760.00	0.01
489	688045	必易微	1,111	47,584.13	0.01
490	603220	中贝通信	1,400	47,544.00	0.01
491	688408	中信博	640	45,920.00	0.01
492	300394	天孚通信	500	45,760.00	0.01
493	603305	旭升集团	2,300	45,379.00	0.01
494	688608	恒玄科技	290	44,738.30	0.01
495	001239	永达股份	1,887	44,228.22	0.01
496	603075	热威股份	1,812	43,802.52	0.01
497	603273	天元智能	1,772	43,322.30	0.01
498	301358	湖南裕能	1,259	42,743.05	0.01
499	001358	兴欣新材	867	41,281.92	0.01
500	001328	登康口腔	1,445	40,907.95	0.01
501	001282	三联锻造	1,045	37,797.65	0.01

502	603373	安邦护卫	876	36,981.40	0.01
503	002400	省广集团	6,600	36,630.00	0.01
504	688535	华海诚科	389	36,091.42	0.00
505	301487	盟固利	867	35,512.32	0.00
506	603276	恒兴新材	1,336	34,970.56	0.00
507	601028	玉龙股份	3,200	34,272.00	0.00
508	001286	陕西能源	3,767	32,207.85	0.00
509	300996	普联软件	1,400	32,060.00	0.00
510	600859	王府井	2,000	31,940.00	0.00
511	603281	江瀚新材	1,208	31,758.32	0.00
512	601916	浙商银行	12,400	31,248.00	0.00
513	603097	江苏华辰	1,300	31,187.00	0.00
514	301301	川宁生物	3,574	30,021.60	0.00
515	301499	维科精密	1,009	29,496.61	0.00
516	688667	菱电电控	348	28,549.92	0.00
517	688478	晶升股份	544	28,288.00	0.00
518	001324	长青科技	1,131	27,449.37	0.00
519	301348	蓝箭电子	613	27,321.41	0.00
520	301367	怡和嘉业	223	27,150.25	0.00
521	603137	恒尚节能	1,382	27,114.84	0.00
522	002843	泰嘉股份	1,000	26,500.00	0.00
523	688580	伟思医疗	407	26,019.51	0.00
524	001367	海森药业	549	24,134.04	0.00
525	301327	华宝新能	315	24,066.00	0.00
526	301207	华兰疫苗	853	23,713.40	0.00
527	688169	石头科技	83	23,484.85	0.00
528	301101	明月镜片	556	23,274.16	0.00
529	601022	宁波远洋	1,983	21,991.47	0.00
530	001337	四川黄金	795	21,965.85	0.00
531	603172	万丰股份	1,220	21,508.60	0.00
532	301293	三博脑科	333	20,785.86	0.00
533	002871	伟隆股份	1,859	20,783.62	0.00
534	688248	南网科技	815	20,350.55	0.00
535	301311	昆船智能	832	20,217.60	0.00
536	301421	波长光电	332	19,710.84	0.00
537	301558	三态股份	1,458	19,537.20	0.00
538	301171	易点天下	985	19,473.45	0.00
539	301297	富乐德	715	19,276.40	0.00
540	300904	威力传动	304	18,705.12	0.00
541	301339	通行宝	913	18,424.34	0.00
542	603132	金徽股份	1,342	18,358.56	0.00
543	300339	润和软件	700	18,186.00	0.00
544	688223	晶科能源	2,046	18,127.56	0.00

545	301498	乖宝宠物	465	18,046.65	0.00
546	001376	百通能源	804	17,897.04	0.00
547	601121	宝地矿业	2,532	17,875.92	0.00
548	603122	合富中国	2,198	17,693.90	0.00
549	002223	鱼跃医疗	500	17,290.00	0.00
550	688629	华丰科技	777	17,016.30	0.00
551	301381	赛维时代	571	16,952.99	0.00
552	603231	索宝蛋白	710	16,378.81	0.00
553	300693	盛弘股份	540	16,151.40	0.00
554	301510	固高科技	457	16,059.35	0.00
555	600547	山东黄金	700	16,009.00	0.00
556	301152	天力锂能	433	15,839.14	0.00
557	603153	上海建科	740	15,636.20	0.00
558	603885	吉祥航空	1,300	15,600.00	0.00
559	002819	东方中科	600	15,366.00	0.00
560	301058	中粮科工	1,386	15,148.98	0.00
561	301141	中科磁业	317	14,753.18	0.00
562	301382	蜂助手	408	14,532.96	0.00
563	301151	冠龙节能	703	14,390.41	0.00
564	301328	维峰电子	286	14,002.56	0.00
565	301307	美利信	400	13,876.00	0.00
566	603162	海通发展	774	13,715.28	0.00
567	002035	华帝股份	2,200	13,662.00	0.00
568	603209	兴通股份	833	13,569.57	0.00
569	301507	民生健康	851	13,488.35	0.00
570	301132	满坤科技	468	13,436.28	0.00
571	603173	福斯达	588	13,241.76	0.00
572	301349	信德新材	270	12,711.60	0.00
573	688523	航天环宇	472	12,659.04	0.00
574	601088	中国神华	400	12,540.00	0.00
575	301361	众智科技	517	12,325.28	0.00
576	301115	建科股份	685	12,261.50	0.00
577	001278	一彬科技	473	12,260.16	0.00
578	301489	思泉新材	178	11,986.08	0.00
579	301089	拓新药业	220	11,882.20	0.00
580	603057	紫燕食品	549	11,847.42	0.00
581	688631	莱斯信息	336	11,844.00	0.00
582	603282	亚光股份	457	11,808.88	0.00
583	300884	狄耐克	900	11,772.00	0.00
584	300926	博俊科技	400	11,732.00	0.00
585	688573	信宇人	397	11,545.60	0.00
586	301550	斯菱股份	260	11,328.20	0.00
587	301517	陕西华达	241	11,213.05	0.00

588	300814	中富电路	328	11,053.60	0.00
589	301318	维海德	309	10,941.69	0.00
590	688693	锆威特	250	10,925.94	0.00
591	000920	沃顿科技	1,100	10,923.00	0.00
592	301282	金禄电子	434	10,845.66	0.00
593	301296	新巨丰	1,042	10,732.60	0.00
594	001366	播恩集团	645	10,623.15	0.00
595	001313	粤海饲料	1,232	10,619.84	0.00
596	688539	高华科技	238	10,424.40	0.00
597	002601	龙佰集团	600	10,278.00	0.00
598	001266	宏英智能	346	10,137.80	0.00
599	301516	中远通	633	9,983.13	0.00
600	301413	安培龙	164	9,543.16	0.00
601	301418	协昌科技	189	9,487.80	0.00
602	001333	光华股份	426	9,431.64	0.00
603	301272	英华特	173	9,234.74	0.00
604	301045	天禄科技	335	9,112.00	0.00
605	301290	东星医疗	330	9,104.70	0.00
606	301285	鸿日达	565	9,028.70	0.00
607	002632	道明光学	900	8,892.00	0.00
608	301048	金鹰重工	843	8,885.22	0.00
609	301428	世纪恒通	229	8,850.85	0.00
610	001368	通达创智	351	8,806.59	0.00
611	301359	东南电子	328	8,728.08	0.00
612	300049	福瑞股份	200	8,718.00	0.00
613	301265	华新环保	819	8,394.75	0.00
614	601888	中国中免	100	8,369.00	0.00
615	301270	汉仪股份	210	8,347.50	0.00
616	002929	润建股份	200	8,346.00	0.00
617	301316	慧博云通	359	8,343.16	0.00
618	301459	丰茂股份	208	8,286.72	0.00
619	301269	华大九天	77	8,150.45	0.00
620	603291	联合水务	536	8,141.84	0.00
621	603065	宿迁联盛	581	8,006.18	0.00
622	301046	能辉科技	290	7,864.80	0.00
623	001314	亿道信息	108	7,768.44	0.00
624	688671	碧兴物联	226	7,751.80	0.00
625	301283	聚胶股份	235	7,726.80	0.00
626	300604	长川科技	200	7,598.00	0.00
627	301533	威马农机	225	7,461.00	0.00
628	300031	宝通科技	400	7,416.00	0.00
629	300994	久祺股份	504	7,408.80	0.00
630	301276	嘉曼服饰	303	7,387.14	0.00



631	301197	工大科雅	380	7,140.20	0.00
632	301388	欣灵电气	292	7,121.88	0.00
633	300059	东方财富	500	7,020.00	0.00
634	301233	盛帮股份	158	7,018.36	0.00
635	688776	国光电气	72	7,012.08	0.00
636	301231	荣信文化	275	6,998.75	0.00
637	301161	唯万密封	346	6,996.12	0.00
638	002049	紫光国微	100	6,745.00	0.00
639	301319	唯特偶	115	6,717.15	0.00
640	301300	远翔新材	211	6,673.93	0.00
641	000977	浪潮信息	200	6,640.00	0.00
642	300750	宁德时代	40	6,530.40	0.00
643	301383	天键股份	100	6,500.00	0.00
644	300252	金信诺	700	6,461.00	0.00
645	301309	万得凯	228	6,372.60	0.00
646	603666	亿嘉和	200	6,278.00	0.00
647	301228	实朴检测	373	6,184.34	0.00
648	000938	紫光股份	300	5,805.00	0.00
649	300759	康龙化成	200	5,796.00	0.00
650	301062	上海艾录	523	5,658.86	0.00
651	600867	通化东宝	500	5,415.00	0.00
652	688628	优利德	128	5,043.20	0.00
653	000425	徐工机械	900	4,914.00	0.00
654	300045	华力创通	200	4,866.00	0.00
655	300776	帝尔激光	80	4,820.80	0.00
656	688316	青云科技-U	92	4,764.68	0.00
657	001311	多利科技	95	4,703.45	0.00
658	300314	戴维医疗	300	4,542.00	0.00
659	000948	南天信息	300	4,521.00	0.00
660	300781	因赛集团	100	4,500.00	0.00
661	301267	华夏眼科	136	4,364.24	0.00
662	300995	奇德新材	191	4,062.57	0.00
663	300845	捷安高科	223	4,029.61	0.00
664	001309	德明利	40	3,795.60	0.00
665	301360	荣旗科技	40	3,744.00	0.00
666	002876	三利谱	100	3,677.00	0.00
667	300854	中兰环保	203	3,542.35	0.00
668	00558	力劲科技	716	3,270.22	0.00
669	002254	泰和新材	200	2,992.00	0.00
670	301220	亚香股份	89	2,941.45	0.00
671	000301	东方盛虹	300	2,880.00	0.00
672	600570	恒生电子	100	2,876.00	0.00
673	300548	博创科技	100	2,697.00	0.00

674	601991	大唐发电	1,100	2,662.00	0.00
675	300946	恒而达	71	2,291.17	0.00
676	601800	中国交建	300	2,280.00	0.00
677	002605	姚记科技	100	2,222.00	0.00
678	301306	西测测试	55	2,177.45	0.00
679	600316	洪都航空	100	2,117.00	0.00
680	002345	潮宏基	300	2,043.00	0.00
681	002997	瑞鹄模具	57	1,899.24	0.00
682	002351	漫步者	100	1,767.00	0.00
683	300229	拓尔思	100	1,686.00	0.00
684	301377	鼎泰高科	70	1,655.50	0.00
685	002837	英维克	60	1,648.80	0.00
686	002364	中恒电气	200	1,540.00	0.00
687	01024	快手-W	32	1,535.50	0.00
688	002536	飞龙股份	100	1,391.00	0.00
689	300986	志特新材	103	1,311.19	0.00
690	301277	新天地	58	1,206.98	0.00
691	300490	华自科技	100	1,161.00	0.00
692	300611	美力科技	100	1,149.00	0.00
693	300253	卫宁健康	100	719.00	0.00
694	002185	华天科技	81	690.12	0.00
695	002908	德生科技	40	570.40	0.00
696	000589	贵州轮胎	80	489.60	0.00
697	301091	深城交	21	481.95	0.00
698	301020	密封科技	21	456.33	0.00
699	300015	爱尔眼科	28	442.96	0.00
700	300498	温氏股份	20	401.20	0.00
701	601398	工商银行	1	4.78	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	601633	长城汽车	33,087,698.12	2.98
2	300858	科拓生物	25,589,244.44	2.30
3	688008	澜起科技	23,993,558.88	2.16
4	688031	星环科技-U	22,172,212.78	2.00
5	600845	宝信软件	21,717,668.42	1.96
6	600276	恒瑞医药	21,516,211.84	1.94
7	301191	菲菱科思	20,849,280.90	1.88
8	002920	德赛西威	20,569,351.16	1.85
9	688279	峰昭科技	19,182,406.73	1.73
10	002430	杭氧股份	18,915,377.32	1.70

11	603000	人民网	18,840,931.04	1.70
12	688006	杭可科技	18,629,299.77	1.68
13	603997	继峰股份	18,571,371.00	1.67
14	688595	芯海科技	18,488,710.51	1.66
15	002517	恺英网络	18,285,221.59	1.65
16	688533	上声电子	18,184,292.32	1.64
17	603501	韦尔股份	17,900,339.65	1.61
18	301039	中集车辆	17,650,863.65	1.59
19	002236	大华股份	17,203,919.25	1.55
20	688107	安路科技	16,780,711.75	1.51

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	603605	珀莱雅	95,264,995.70	8.58
2	600519	贵州茅台	79,539,696.45	7.16
3	600036	招商银行	63,167,428.87	5.69
4	300015	爱尔眼科	61,341,692.34	5.52
5	600809	山西汾酒	60,188,338.83	5.42
6	002410	广联达	57,700,112.69	5.20
7	002601	龙佰集团	50,708,270.60	4.57
8	002142	宁波银行	49,032,859.49	4.42
9	300601	康泰生物	31,083,893.76	2.80
10	600905	三峡能源	30,996,582.65	2.79
11	601633	长城汽车	28,913,116.00	2.60
12	300896	爱美客	26,460,627.00	2.38
13	300661	圣邦股份	25,816,527.94	2.32
14	00291	华润啤酒	25,662,897.21	2.31
15	600845	宝信软件	23,593,501.24	2.12
16	688031	星环科技-U	23,462,345.79	2.11
17	688536	思瑞浦	21,749,732.62	1.96
18	03690	美团-W	20,917,514.60	1.88
19	301039	中集车辆	20,063,184.24	1.81
20	02269	药明生物	19,824,632.67	1.79

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	3,249,453,474.11
卖出股票收入（成交）总额	3,511,648,562.49

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	651,635.37	0.09
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	651,635.37	0.09

## 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	128136	立讯转债	4,463	490,501.43	0.07
2	113661	福22转债	1,530	161,133.94	0.02

## 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，实现股票组合的超额收益。

## 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

大秦铁路股份有限公司在报告编制日前一年内受到西安铁路监督管理局的处罚。

以上证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

### 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	149,267.88
2	应收清算款	-
3	应收股利	23.43
4	应收利息	-
5	应收申购款	34,084.16
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	183,375.47

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	128136	立讯转债	490,501.43	0.07
2	113661	福22转债	161,133.94	0.02

### 8.12.5 期末前十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

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 (%)

43,926	19,920.20	0.00	0.00	875,014,538.96	100.00
--------	-----------	------	------	----------------	--------

## 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	201,314.24	0.0230

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

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	-
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

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

2、截至本报告期末，本基金的基金经理投资、持有本基金符合相关法律法规、中国证监会规定及相关管理制度的规定。

## 9.4 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

注：无。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2020年4月29日） 基金份额总额	1,470,239,869.71
本报告期期初基金份额总额	1,118,699,464.72
本报告期基金总申购份额	4,825,963.01
减：本报告期基金总赎回份额	248,510,888.77
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	875,014,538.96

## § 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

基金管理人的重大人事变动：

无。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

### 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

未改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未改聘为本基金审计的会计师事务所。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 80,000.00 元，该审计机构已提供审计服务的年限为 4 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 (%)	
浙商证券	1	1,000,166,283.52	14.84	823,587.23	14.63	本报告期新增
广发证券	3	789,013,557.23	11.71	711,806.69	12.65	-
财通证券	2	757,627,213.03	11.24	623,783.78	11.08	-
华创证券	1	639,361,090.79	9.49	530,372.10	9.42	-
国联证券	1	629,248,109.53	9.34	518,896.67	9.22	-
德邦证券	2	599,491,014.56	8.90	498,351.71	8.85	-
长江证券	1	499,286,837.	7.41	417,810.97	7.42	-

		81				
国信证券	2	470,906,023.10	6.99	387,988.73	6.89	-
东方证券	1	393,331,041.80	5.84	323,977.26	5.76	-
招商证券	1	335,131,869.60	4.97	275,369.20	4.89	-
华西证券	1	223,412,206.43	3.32	183,491.77	3.26	-
海通证券	2	220,235,850.80	3.27	180,877.26	3.21	-
天风证券	2	91,758,074.68	1.36	79,023.43	1.40	-
银河证券	1	40,825,268.57	0.61	33,530.33	0.60	-
方正证券	1	28,404,087.11	0.42	23,331.44	0.41	-
东北证券	1	19,430,322.09	0.29	15,958.56	0.28	本报告期新增
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
摩根大通证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
中邮证券	1	-	-	-	-	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 & 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 (%)
浙商证券	-	-	519,280,000.00	39.11	-	-
广发证券	-	-	84,661,000.00	6.38	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	241,387,000.00	18.18	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	77,594,000.00	5.84	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	132,295,000.00	9.96	-	-
华西证券	-	-	190,577,000.00	14.35	-	-
海通证券	-	-	22,687,000.00	1.71	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-

银河证 券	-	-	-	-	-	-
方正证 券	-	-	59,318,000.0 0	4.47	-	-
东北证 券	-	-	-	-	-	-
恒泰证 券	-	-	-	-	-	-
摩根大 通证券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源证券	-	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-
中邮证 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	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023年01月04日
2	关于调整旗下部分基金参与中国工商银行股份有限公司申购、定期定额申购费率优惠活动时间公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023年01月05日
3	鹏华价值共赢两年持有期混合型证券投资基金基金经理变更公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023年01月13日
4	鹏华价值共赢两年持有期混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023年01月18日
5	鹏华价值共赢两年持有期混合型证券投资基金更新的招募说明书（2023年第1号）	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023年01月18日
6	鹏华价值共赢两年持有期混合型证券投资基金2022年第4季度报告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023年01月20日
7	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购中润光学首次公开发行A股的公告	《证券日报》、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10日
8	鹏华价值共赢两年持有期混合型证券投资基金基金经理变更公告	《证券日报》、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04日
9	鹏华价值共赢两年持有期混合型证券投资基金更新的招募说明书	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基	2023年03月08日

		金电子披露网站	
10	鹏华价值共赢两年持有期混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	《证券日报》、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 08 日
11	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	《证券日报》、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
12	鹏华价值共赢两年持有期混合型证券投资基金 2022 年年度报告	《证券日报》、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 30 日
13	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	《证券日报》、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
14	鹏华价值共赢两年持有期混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	《证券日报》、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 21 日
15	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	《证券日报》、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
16	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	《证券日报》、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
17	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	《证券日报》、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
18	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	《证券日报》、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
19	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	《证券日报》、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
20	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	《证券日报》、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
21	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	《证券日报》、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
22	鹏华价值共赢两年持有期混合型证券投资基金托管协议	《证券日报》、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 08 日
23	鹏华基金管理有限公司关于调低旗下	《证券日报》、基金管理人	2023 年 07 月 08 日

	部分基金费率并修订基金合同的公告	人网站及中国证监会基金电子披露网站	
24	鹏华价值共赢两年持有期混合型证券投资基金基金合同	《证券日报》、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 08 日
25	鹏华价值共赢两年持有期混合型证券投资基金更新的招募说明书（2023 年第 2 号）	《证券日报》、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 12 日
26	鹏华价值共赢两年持有期混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	《证券日报》、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 12 日
27	鹏华价值共赢两年持有期混合型证券投资基金 2023 年第 2 季度报告	《证券日报》、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
28	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	《证券日报》、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
29	鹏华基金管理有限公司关于运用自有资金投资旗下基金的公告	《证券日报》、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
30	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	《证券日报》、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
31	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	《证券日报》、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
32	鹏华价值共赢两年持有期混合型证券投资基金 2023 年中期报告	《证券日报》、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
33	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	《证券日报》、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
34	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《证券日报》、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
35	鹏华价值共赢两年持有期混合型证券投资基金 2023 年第 3 季度报告	《证券日报》、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
36	鹏华基金管理有限公司关于运用自有资金投资旗下基金的公告	《证券日报》、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
37	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	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基	2023 年 11 月 16 日

	(含定期定额投资)费率优惠活动的公告	金电子披露网站	
--	--------------------	---------	--

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

注：无。

### 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)《鹏华价值共赢两年持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- (二)《鹏华价值共赢两年持有期混合型证券投资基金托管协议》；
- (三)《鹏华价值共赢两年持有期混合型证券投资基金 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