

鹏华精选群英一年持有期灵活配置混合型
管理人中管理人（MOM）证券投资基金
2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 08 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	8
2.4 基金投资顾问	8
2.5 信息披露方式	8
2.6 其他相关资料	9
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	9
3.1 主要会计数据和财务指标	9
3.2 基金净值表现	9
3.3 其他指标	10
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	47

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	47
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	47
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	48
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
7.12 本报告期末各资产单元的净值及占基金资产净值的比例	48
7.13 投资组合报告附注	48
§ 8 基金份额持有人信息.....	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	49
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	49
§ 9 开放式基金份额变动.....	50
§ 10 重大事件揭示	50
10.1 基金份额持有人大会决议	50
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	50
10.4 基金投资策略的改变	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	51
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	51
10.8 其他重大事件	54
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	56
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	56
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	56
§ 12 备查文件目录	56
12.1 备查文件目录	56
12.2 存放地点	56
12.3 查阅方式	56

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华精选群英一年持有期灵活配置混合型管理人中管理人（MOM）证券投资基金
基金简称	鹏华精选群英一年持有期混合 MOM
基金主代码	011330
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 9 月 23 日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	173,668,272.44 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制和分散组合风险的基础上，本基金通过资产配置及对投资顾问全面深入的研究和考察，精选投资顾问为特定资产单元提供投资建议，力争实现超越业绩比较基准的收益。
投资策略	<p>本基金的投资策略分为三个层次，首先依据大类资产配置策略动态调整基金资产在各大类资产间的分配比例；在完成资产配置以后，本基金将在特定的资产类别下，按照策略类型划分资产单元；最后，本基金将通过甄选投资顾问来实现全部或部分的投资策略。</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金资产配置策略主要是以宏观经济分析为重点，基于经济结构调整过程中相关政策与法规的变化、证券市场环境、金融市场利率变化、经济运行周期、投资者情绪以及证券市场不同类别资产的风险/收益状况等，判断宏观经济发展趋势、政策导向和证券市场的未来发展趋势，确定和构造合适的资产配置比例。</p> <p>具体地说，本基金的资产配置主要由股票和债券组成，基金将严格根据不同资产之间的估值来计算股票资产的风险溢价水平，并根据风险溢价具体的历史分位数以及当时的风险溢价水平的合理性，最终决定股票资产及存托凭证的投资比例，完成上层资产配置的策略。</p> <p>上月末风险溢价(中证 800 指数 E/P 与 10 年期国债收益率之差)历史分位数 本月股票资产及存托凭证占基金资产的比例下限 本月股票资产及存托凭证占基金资产的比例上限</p> <p>75 分位及以上 80% 95%</p> <p>75 分位至 50 分位 60% 80%</p> <p>50 分位至 25 分位 20% 60%</p> <p>25 分位及以下 0% 20%</p> <p>本基金将科学把握建仓节奏，遵守投资策略，适时控制仓位，力求通过仓位控制进一步降低基金资产收益的波动性。</p>

	<p>2、资产单元划分策略</p> <p>确定大类资产配置比例以后，本基金将进一步确定特定的资产类别下的子策略划分，并据此进行资产单元的划分。为了进一步提升组合的稳定性、超配阶段性表现较好的资产，本基金在施行前述资产配置策略确定股债比例后，会进一步确定特定资产类别下的子策略，各投资顾问在既定的子策略下，在各自的资产单元内提供投顾服务。</p> <p>本基金的股票资产主要有消费、医药、科技三个行业子策略。根据历史行业数据，并比照海外投资经验，本基金将投资方向集中在中国具有国家资源禀赋的消费、医药、科技三个行业上，这些行业长期受益于中国巨大的人口基数、人口老龄化趋势、良好的基础教育，在行业未来发展空间、景气度、增长速度等方面都比其它行业有巨大的优势。从短期看，这三个行业由于在社会经济的发展过程中背后的驱动因素各不相同，短期的行业景气度和增速也有较大差异，配置过程中不但可以较好地分散行业风险，也可以阶段性通过超配优势行业获取增强收益。</p> <p>每个行业子策略由特定投资顾问通过自下而上精选个股创造超额收益。本基金定期评估每个子策略的表现，考评子策略的收益、风险、超额收益等指标，在结合基金管理人的行业展望后会最终确定子策略的配置权重。</p> <p>3、投资顾问选择策略</p> <p>在做好大类资产配置和资产单元划分后，本基金将通过精选投资顾问来实现全部或部分的投资策略。本基金通过定量、定性相结合的方式，对投资顾问及其策略管理能力进行综合评价，以此为依据选聘投资顾问。由于本基金的股票部分主要集中在消费、医药和科技三个子行业上，本基金在选聘投资顾问时对其在这三个行业的投资研究经验进行重点考察，并且在业绩评估时会参照相关行业表现来计算超额收益和业绩稳定性，以期寻找到优秀的行业专家长期服务于本基金。</p> <p>(1) 投资顾问评价</p> <p>考察的主要因素包括：</p> <p>经营状况：成立年限、管理规模、产品数目、产品结构、客户结构等；</p> <p>投研团队：总团队人数、从业经历、团队稳定性、投研管理模式、激励机制、特定行业子策略研究投资人员、从业经历等；</p> <p>投研管理：投资决策机制、投研管理流程制度等；</p> <p>风险管理：公司风险管理架构、风险管理办法及流程、风控独立性等；</p> <p>系统建设：投资交易系统、风控系统、投资研究管理系统及绩效评估系统建设。</p> <p>(2) 策略管理能力评价</p> <p>考察的主要因素包括：</p> <p>策略管理规模：管理特定行业子策略产品的数目、规模等；</p> <p>投资人员履历：管理特定行业子策略投资人员的投资年限、任职经历等；</p>
--	--

	<p>策略的稳定性：关于特定的行业子策略是否具有成熟且一致的投资理念及方法，特定行业子策略的历史持仓及表现与基准策略指数的偏离度等。</p> <p>策略业绩状况：特定行业子策略收益率、风险调整后收益率、超过特定行业基准的收益率、不同年度向对于行业基准的表现、极端市场表现等。</p> <p>本基金将建立严格的出入库制度，主要根据以上综合评价的结果，筛选出基础库，并通过进一步的深度研究与尽职调查，筛选出优先库。在基础库和优先库的基础上，构建本基金的管理人库。管理人库将进行定期、不定期维护，按照出入库标准，实现管理人库的动态调整。当投资顾问不符合管理人库入库标准的，或基金管理人合理理由认为投资顾问不适合或不能履行管理义务的，基金管理人有权更换、解聘或撤销投资顾问，在投资顾问更换过程中，基金管理人有权或指定其他投资顾问接管原投资顾问管理的资产单元。</p> <p>4、股票投资策略</p> <p>本基金通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘 A 股和港股优质的公司，构建股票投资组合。核心思路在于：1) 自上而下地分析行业的增长前景、行业结构、商业模式、竞争要素等分析把握其投资机会；2) 自下而上地评判企业的核心竞争力、管理层、治理结构等以及其所提供的产品和服务是否契合未来行业增长的大趋势，对企业基本面和估值水平进行综合的研判，深度挖掘优质的个股。</p> <p>本基金还将关注以下几类港股通标的：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。</p> <p>5、存托凭证投资策略</p> <p>本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。</p> <p>6、债券投资策略</p> <p>本基金债券投资将采取久期策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、个券选择策略、信用策略等积极投资策略，自上而下地管理组合的久期，灵活地调整组合的券种搭配，同时精选个券，以增强组合的持有期收益。</p> <p>7、资产支持证券的投资策略</p> <p>本基金将综合运用战略资产配置和战术资产配置进行资产支持证券的投资组合管理，并根据信用风险、利率风险和流动性风险变化积极调整投资策略，严格遵守法律法规和基金合同的约定，在保证本金安全和基金资产流动性的基础上获得稳定收益。</p> <p>8、股指期货投资策略</p> <p>本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目标，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，充分考虑股指期货的风险收益特征，通过多头或空头的套期保值策略，以改善投资组合的投资效果，实现股票组合的超额收益。</p>
--	---

	<p>9、国债期货投资策略</p> <p>为有效控制债券投资的系统性风险，本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的，适度运用国债期货，提高投资组合的运作效率。在国债期货投资时，本基金将首先分析国债期货各合约价格与最便宜可交割券的关系，选择定价合理的国债期货合约，其次，考虑国债期货各合约的流动性情况，最终确定与现货组合的合适匹配，以达到风险管理的目标。</p>
业绩比较基准	中债综合指数收益率×40% +中证 800 指数收益率×60%
风险收益特征	本基金为混合型管理人中管理人基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金、股票型管理人中管理人基金，高于债券型基金、债券型管理人中管理人基金、货币市场基金及货币型管理人中管理人基金。本基金将投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及香港证券市场的风险。

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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	高永杰	张姗
	联系电话	0755-81395402	400-61-95555
	电子邮箱	xxpl@phfund.com.cn	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		4006788999	400-61-95555
传真		0755-82021126	0755-83195201
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		518048	518040
法定代表人		张纳沙	缪建民

2.4 基金投资顾问

序号	投资顾问名称	是否与基金管理人存在关联关系	是否与其他投资顾问存在关联关系
1	华泰柏瑞基金管理有限公司	否	否
2	惠升基金管理有限责任公司	否	否
3	信达澳亚基金管理有限公司	否	否

注：无。

2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.phfund.com.cn

基金中期报告备置地点	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心 第 43 层鹏华基金管理有限公司
------------	--

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	鹏华基金管理有限公司	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024年1月1日-2024年6月30日)
本期已实现收益	-11,519,364.22
本期利润	-3,484,056.63
加权平均基金份额本期利润	-0.0192
本期加权平均净值利润率	-2.56%
本期基金份额净值增长率	-1.53%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)
期末可供分配利润	-49,110,199.74
期末可供分配基金份额利润	-0.2828
期末基金资产净值	132,742,841.08
期末基金份额净值	0.7643
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-23.57%

注：(1) 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益等未实现收益。

(2) 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(3) 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润期末余额和未分配利润中已实现部分的期末余额的孰低数。表中的“期末”均指报告期最后一日，即 6 月 30 日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

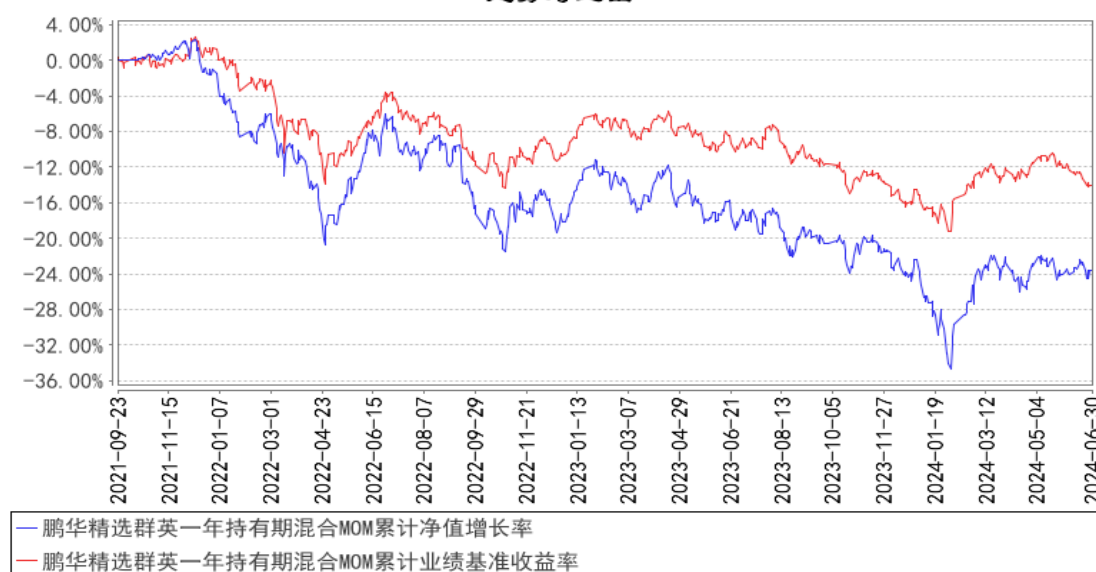
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

过去一个月	0.65%	0.72%	-2.21%	0.34%	2.86%	0.38%
过去三个月	-0.64%	0.86%	-1.24%	0.49%	0.60%	0.37%
过去六个月	-1.53%	1.16%	0.57%	0.61%	-2.10%	0.55%
过去一年	-7.01%	0.99%	-4.96%	0.55%	-2.05%	0.44%
自基金合同生效起至今	-23.57%	0.92%	-14.04%	0.62%	-9.53%	0.30%

注：业绩比较基准=中债综合指数收益率×40% +中证 800 指数收益率×60%

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

鹏华精选群英一年持有期混合MOM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 2021 年 09 月 23 日生效。2、截至建仓期结束，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

3.3 其他指标

注：无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

鹏华基金管理有限公司成立于 1998 年 12 月 22 日，业务范围包括基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。截至本报告期末，公司股东由国信证券股份有限公司、意大利欧利盛资本资产管理股份公司 (Eurizon Capital SGR S.p.A.)、深圳市北融信投资发展有限公司组成，公司性质为中外合资企业，公司注册资本 15,000 万元人民币。截至本报告期末，公

司资产管理总规模达到 12,020 亿元（联接基金不折算，不含投顾），公司管理着 324 只公募基金、13 只全国社保投资组合、8 只基本养老保险投资组合。经过 20 余年投资管理基金，在基金投资、风险控制等方面积累了丰富经验。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
孙博斐	基金经理	2022-05-07	-	10 年	孙博斐先生，国籍中国，管理学硕士，10 年证券从业经验。曾任中国民生银行私人银行事业部投资与策略中心策略研究员，嘉实基金管理有限公司 FOF 研究员，建信信托有限责任公司 FOF 投资经理。2022 年 3 月加盟鹏华基金管理有限公司，现担任资产配置与基金投资部基金经理。2022 年 05 月至 2023 年 10 月担任鹏华聚合多资产 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金经理，2022 年 05 月至 2024 年 05 月担任鹏华长乐稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金经理，2022 年 05 月至今担任鹏华长治稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）基金经理，2022 年 05 月至今担任鹏华精选群英一年持有期灵活配置混合型管理人中管理人（MOM）证券投资基金基金经理，2022 年 05 月至今担任鹏华养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金（FOF）基金经理，2022 年 05 月至今担任鹏华养老目标日期 2045 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金经理，2023 年 01 月至今担任鹏华养老目标日期 2040 五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金经理，孙博斐先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理未发生变动。

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规、中国证监会的有关规定以及基金合同的约定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合规，不存在违反基金合同和损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024 年一季度国内权益市场波动较大，1 月至春节前的市场化充分演绎了投资者的悲观预期，雪球等衍生品相关风险的出清过程放大了市场波动。之后政策面发生积极变化，权益市场也开始估值修复。债券成为资金追捧的避险资产，收益率持续下行，并在 3 月转为震荡。二季度权益、商品等风险资产价格以震荡为主，我们认为价格波动来源于基本面的弱现实，即便是一季度涨幅较高的大宗商品，需求侧的兑现并不明朗，价格更多的演绎某些宏大的宏观叙事。A 股方面，结构性的超额收益集中在两个方向：第一个方向是大市值、高分红、稳健经营的公司上，市场正在逐渐认识到这类公司的特点：供给侧的高壁垒、需求侧的低波动以及经营的永续性；第二个方向是与外需挂钩的成长性机会，包括造船、电网设备、AI 算力等，出海成为为数不多的能见度较高的成长方向。

在投资策略上，我们在一季报着重叙述了对上述机会的观察和理解，并针对性调整了组合配置方向。站在目前时点，海外主要矛盾仍然在美联储的降息预期上，对此我们以跟踪和应对美国经济衰退等风险点为主。国内主要矛盾并未发生变化，我们非常关注国内名义增速的回升幅度，即实际增速能否达到政策目标增速，以及价格同比能否转正。一方面，内需的恢复决定了大类资产的方向，目前沪深 300 指数的估值以及十年国债收益率均处于历史低位，如

果名义增速明显回升，权益资产盈利和估值修复的空间可观，而债券收益率面临上行风险。此外，内需的恢复也会影响经营利润在产业链上中下游的分配比例，一旦利润从上游向下游转移，权益资产的风格也会随之发生变化。

此外，我们对经济转型期的长期性持续加深认识，如果宏观经济数年处于波动较低的状态，经济周期的特征，以及权益资产的风险收益特征可能与过去十几年大相径庭，我们对投资的经验和理解也需要与时俱进。

展望下半年，本基金将密切关注基本面因子的边际变化并做出策略调整。在科技、消费、医药三个赛道的配置上，我们的思路如下：

科技制造板块，我们关注以下几个细分方向：包括 AIPC、智能驾驶、虚拟现实等新一代智能终端的销量和技术演进；与 AI 算力产业链相关的硬件投资机会，和半导体复苏周期叠加国产化的投资机会；具备出海能力的泛制造类企业，包括精细化工、工程机械、通用设备等；涉及能源安全和稳定性相关的发电和电网设备类企业。

医药板块，重点关注创新药和高值耗材相关的投资机会。

消费方面，板块估值五年低位，存在估值修复可能，在去金融化、脱虚向实的宏观导向下，大众消费的逻辑更顺畅。高端消费正在出清的过程当中，我们开始关注其中具备永续经营能力的大市值公司的投资机会。

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-1.53%，同期业绩比较基准增长率为 0.57%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前 A 股主要指数的市净率都在历史低位水平，绝大部分行业的市净率也在历史低位。我们认为下半年存在扭转悲观预期的几个线索：一是国内名义增速等基本面指标的企稳修复，二是海外流动性由紧转松，三是国内政策面有超预期的举措。

上半年 A 股市场有明显超额收益的板块，大多具有大市值、高分红、现金流充沛的特征，这类资产的特点逐渐被市场认知，市场看重其经营的永续性和现金分红的确定性，不断给与估值抬升。另一方面，大部分成长型板块的基本面仍在寻地，但经过数年调整，其估值已经非常值得关注。我们倾向于认为市场的审美偏好在高分红和高成长两类资产中周期性摆动，当其中一类资产的估值性价比过于突出时，对长期资金的吸引力也不言而喻。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1、截止本报告期末，本基金期末可供分配利润为-49,110,199.74 元，期末基金份额净值 0.7643 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。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：鹏华精选群英一年持有期灵活配置混合型管理人中管理人（MOM）证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	15,991,070.25	20,641,646.70
结算备付金		87,524.54	95,116.81
存出保证金		19,813.80	45,069.36
交易性金融资产	6.4.7.2	117,328,158.26	136,416,475.27
其中：股票投资		117,328,158.26	136,416,475.27
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		136,754.05	2,255,151.07
应收股利		44,262.47	-
应收申购款		299.64	98.81
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		133,607,883.01	159,453,558.02

负债和净资产	附注号	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		556,837.22	2,923,389.84
应付赎回款		7,563.73	304,512.66
应付管理人报酬		131,517.01	158,184.87
应付托管费		21,919.49	26,364.10
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	147,204.48	126,003.00
负债合计		865,041.93	3,538,454.47
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	173,668,272.44	200,870,958.87
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-40,925,431.36	-44,955,855.32
净资产合计		132,742,841.08	155,915,103.55
负债和净资产总计		133,607,883.01	159,453,558.02

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.7643 元，基金份额总额 173,668,272.44 份。

6.2 利润表

会计主体：鹏华精选群英一年持有期灵活配置混合型管理人中管理人（MOM）证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024年1月1日至2024 年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年6月30日
一、营业总收入		-2,458,063.10	3,353,191.18
1. 利息收入		32,222.64	66,742.31
其中：存款利息收入	6.4.7.13	32,222.64	65,220.39
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		-	1,521.92

其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-10,525,593.33	-7,565,139.38
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-11,405,910.63	-8,463,127.78
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-44,775.55
资产支持证券投资 投资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	880,317.30	942,763.95
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	8,035,307.59	10,851,588.25
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	-	-
减：二、营业总支出		1,025,993.53	1,884,891.28
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	810,059.67	1,541,947.73
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	135,009.88	256,991.28
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	41.60
8. 其他费用	6.4.7.23	80,923.98	85,910.67
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-3,484,056.63	1,468,299.90
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-3,484,056.63	1,468,299.90
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-3,484,056.63	1,468,299.90

6.3 净资产变动表

会计主体：鹏华精选群英一年持有期灵活配置混合型管理人中管理人（MOM）证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	200,870,958.87	-	-44,955,855.32	155,915,103.55
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	200,870,958.87	-	-44,955,855.32	155,915,103.55
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-27,202,686.43	-	4,030,423.96	-23,172,262.47
(一)、综合收益总额	-	-	-3,484,056.63	-3,484,056.63
(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)	-27,202,686.43	-	7,514,480.59	-19,688,205.84
其中：1. 基金申购款	40,563.56	-	-9,927.12	30,636.44
2. 基金赎回款	-27,243,249.99	-	7,524,407.71	-19,718,842.28
(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	173,668,272.44	-	-40,925,431.36	132,742,841.08
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			

	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	253,460,416.16	-	-45,971,335.18	207,489,080.98
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	253,460,416.16	-	-45,971,335.18	207,489,080.98
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-23,932,383.72	-	5,084,862.55	-18,847,521.17
(一)、综合收益总额	-	-	1,468,299.90	1,468,299.90
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-23,932,383.72	-	3,616,562.65	-20,315,821.07
其中：1. 基金申购款	208,371.27	-	-29,907.25	178,464.02
2. 基金赎回款	-24,140,754.99	-	3,646,469.90	-20,494,285.09
(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	229,528,032.44	-	-40,886,472.63	188,641,559.81

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

邓召明

基金管理人负责人

聂连杰

主管会计工作负责人

郝文高

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

鹏华精选群英一年持有期灵活配置混合型管理人中管理人(MOM)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]3612号《关于准予鹏华精选群英一年持有期灵活配置混合型管理人中管理人(MOM)证券投资基金注册的批复》准予,由鹏华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华精选群英一年持有期灵活配置混合型管理人中管理人(MOM)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355,052,739.25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(2021)第0837号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华精选群英一年持有期灵活配置混合型管理人中管理人(MOM)证券投资基金基金合同》于2021年9月23日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为355,101,287.66份基金份额,其中认购资金利息折合48,548.41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,基金托管人为招商银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、《资产管理产品相关会计处理规定》(财会[2022]14号)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《鹏华精选群英一年持有期灵活配置混合型管理人中管理人(MOM)证券投资基金基金合同》和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2024年上半年财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2024年06月30日的财务状况以及2024年上半年的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	15,991,070.25
等于：本金	15,989,476.44
加：应计利息	1,593.81
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	15,991,070.25

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	115,150,987.81	-	117,328,158.26	2,177,170.45
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	115,150,987.81	-	117,328,158.26	2,177,170.45

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

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.8 其他资产

注：无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	67,641.36
其中：交易所市场	67,641.36
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	79,563.12
合计	147,204.48

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	200,870,958.87	200,870,958.87
本期申购	40,563.56	40,563.56
本期赎回（以“-”号填列）	-27,243,249.99	-27,243,249.99
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	173,668,272.44	173,668,272.44

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

注：无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-44,035,719.21	-920,136.11	-44,955,855.32
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-44,035,719.21	-920,136.11	-44,955,855.32
本期利润	-11,519,364.22	8,035,307.59	-3,484,056.63
本期基金份额交易产生的变动数	6,444,883.69	1,069,596.90	7,514,480.59
其中：基金申购款	-10,752.11	824.99	-9,927.12
基金赎回款	6,455,635.80	1,068,771.91	7,524,407.71
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-49,110,199.74	8,184,768.38	-40,925,431.36

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	30,984.42
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,022.12
其他	216.10
合计	32,222.64

注：其他包含认/申购款利息收入、结算保证金利息收入、风控金利息收入等。

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收	-11,405,910.63

入	
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-11,405,910.63

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	88,954,022.78
减：卖出股票成本总额	100,168,549.74
减：交易费用	191,383.67
买卖股票差价收入	-11,405,910.63

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	880,317.30
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	880,317.30

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	8,035,307.59
股票投资	8,035,307.59
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-

2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	8,035,307.59

6.4.7.21 其他收入

注：无。

6.4.7.22 信用减值损失

注：无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	19,890.78
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行汇划费用	1,272.00
证券组合费	88.86
合计	80,923.98

6.4.7.24 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
鹏华基金管理有限公司（“鹏华基金公司”）	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人、基金代销机构
国信证券股份有限公司（“国信证券”）	基金管理人的股东

惠升基金管理有限责任公司（“惠升基金”）	基金投资顾问
华泰柏瑞基金管理有限公司（“华泰柏瑞”）	基金投资顾问
信达澳亚基金管理有限公司（“信达澳亚”）	基金投资顾问

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年 6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	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	9,576,484.77	5.91	16,355,947.37	4.26

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年 6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	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 成交总额的比例（%）
国信证券	-	-	3,096,337.21	7.22

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

6.4.10.1.4 权证交易

注：无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 （%）
国信证券	7,863.76	5.90	4,082.21	6.04

关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
国信证券	13,584.87	4.19	8,817.21	4.35

注：(1) 佣金的计算公式

上海/深圳证券交易所的交易佣金=股票买(卖)成交金额×佣金比率-买(卖)经手费-买(卖)证管费等由券商承担的费用

(佣金比率按照与一般证券公司签订的协议条款订立。)

(2) 本基金与关联方已按同业统一的基金佣金计算方式和约定的佣金比例签订了《证券交易席位租用协议》。根据协议规定，上述单位定期或不定期地为鹏华基金公司提供研究服务以及其他研究支持。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	810,059.67	1,541,947.73
其中：应支付销售机构的客户维护费	403,531.46	737,604.96
应支付基金管理人的净管理费	406,528.21	804,342.77

注：1、支付基金管理人鹏华基金公司的管理人报酬年费率为1.20%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×1.20%÷当年天数。

2、根据《开放式证券投资基金销售费用管理规定》，基金管理人依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，客户维护费从基金管理费中列支。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	135,009.88	256,991.28

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明**6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

注：无。

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

注：无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况**

注：无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月 30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	15,991,070.25	30,984.42	22,422,177.48	62,631.00

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

注：无。

6.4.12 期末（2024年6月30日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

注：无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为 MOM 型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票）、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、存托凭证、债券（含国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债、可转换债券、可交换债券等）、货币市场工具、同业存单、资产支持证券、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可依据法律法规的规定，参与融资及转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，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，将风险控制可在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

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

于 2024 年 06 月 30 日，本基金未持有信用类债券（2023 年 12 月 31 日：未持有）。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性

风险一方面来自于基金份额持有人可随时或于约定开放日要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理职能部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

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

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

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

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					

货币资金	15,991,070.25	-	-	-	15,991,070.25
结算备付金	87,524.54	-	-	-	87,524.54
存出保证金	19,813.80	-	-	-	19,813.80
交易性金融资产	-	-	-	-117,328,158.26	117,328,158.26
应收股利	-	-	-	44,262.47	44,262.47
应收申购款	-	-	-	299.64	299.64
应收清算款	-	-	-	136,754.05	136,754.05
资产总计	16,098,408.59	-	-	-117,509,474.42	133,607,883.01
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	7,563.73	7,563.73
应付管理人报酬	-	-	-	131,517.01	131,517.01
应付托管费	-	-	-	21,919.49	21,919.49
应付清算款	-	-	-	556,837.22	556,837.22
其他负债	-	-	-	147,204.48	147,204.48
负债总计	-	-	-	865,041.93	865,041.93
利率敏感度缺口	16,098,408.59	-	-	-116,644,432.49	132,742,841.08
上年度末 2023年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	20,641,646.70	-	-	-	20,641,646.70
结算备付金	95,116.81	-	-	-	95,116.81
存出保证金	45,069.36	-	-	-	45,069.36
交易性金融资产	-	-	-	-136,416,475.27	136,416,475.27
应收申购款	-	-	-	98.81	98.81
应收清算款	-	-	-	2,255,151.07	2,255,151.07
资产总计	20,781,832.87	-	-	-138,671,725.15	159,453,558.02
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	304,512.66	304,512.66
应付管理人报酬	-	-	-	158,184.87	158,184.87
应付托管费	-	-	-	26,364.10	26,364.10
应付清算款	-	-	-	2,923,389.84	2,923,389.84
其他负债	-	-	-	126,003.00	126,003.00
负债总计	-	-	-	3,538,454.47	3,538,454.47
利率敏感度缺口	20,781,832.87	-	-	-135,133,270.68	155,915,103.55

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于2024年06月30日，本基金持有的交易性债券投资和资产支持证券公允价值占基金资产净值的比例为0.00%，因此当利率发生合理、可能的变动时，对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基

金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。

6. 4. 13. 4. 2. 1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 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	-	2,497,297.84	-	2,497,297.84
资产合计	-	2,497,297.84	-	2,497,297.84
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	-	2,497,297.84	-	2,497,297.84
项目	上年度末 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	-	2,141,610.82	-	2,141,610.82
资产合计	-	2,141,610.82	-	2,141,610.82
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	-	2,141,610.82	-	2,141,610.82

6. 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	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

	动	本期末（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	人民币升值 5%		124,864.89
人民币贬值 5%		-124,864.89	-107,080.54

注：无。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券投资品种，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。基金的投资组合比例为：股票资产及存托凭证占基金资产的比例为 0—95%；每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	117,328,158.26	88.39	136,416,475.27	87.49
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-

交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	117,328,158.26	88.39	136,416,475.27	87.49

注：债券投资为可转债、可交换债券投资。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准外的其他市场变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	比较基准上涨 5% 资产净值变动	6,386,921.80	6,234,265.42
	比较基准下降 5% 资产净值变动	-6,386,921.80	-6,234,265.42

注：无。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日
第一层次	117,328,158.26
第二层次	-
第三层次	-
合计	117,328,158.26

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票、债券和基金的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	117,328,158.26	87.82
	其中：股票	117,328,158.26	87.82
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-

4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	16,078,594.79	12.03
8	其他各项资产	201,129.96	0.15
9	合计	133,607,883.01	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 2,497,297.84 元，占净值比 1.88%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	9,512,408.00	7.17
C	制造业	74,121,265.17	55.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,128,179.00	5.37
E	建筑业	62,140.00	0.05
F	批发和零售业	326,374.00	0.25
G	交通运输、仓储和邮政业	405,612.00	0.31
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,544,760.08	7.94
J	金融业	10,102,437.30	7.61
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	72,000.00	0.05
M	科学研究和技术服务业	1,014,401.07	0.76
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,073,400.80	0.81
R	文化、体育和娱乐业	467,883.00	0.35
S	综合	-	-
	合计	114,830,860.42	86.51

7.2.2 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	-	-
金融	263,764.52	0.20

能源	817,761.28	0.62
非日常生活消费品	-	-
日常消费品	-	-
医疗保健	1,415,772.04	1.07
信息技术	-	-
通信服务	-	-
房地产	-	-
工业	-	-
公用事业	-	-
合计	2,497,297.84	1.88

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	002475	立讯精密	185,900	7,307,729.00	5.51
2	002371	北方华创	15,300	4,894,317.00	3.69
3	601328	交通银行	548,600	4,098,042.00	3.09
4	601728	中国电信	611,100	3,758,265.00	2.83
5	000063	中兴通讯	108,000	3,020,760.00	2.28
6	603986	兆易创新	29,000	2,772,980.00	2.09
7	688286	敏芯股份	57,188	2,722,148.80	2.05
8	000938	紫光股份	120,000	2,682,000.00	2.02
9	688484	南芯科技	68,879	2,555,410.90	1.93
10	600837	海通证券	295,400	2,528,624.00	1.90
11	002517	恺英网络	262,100	2,503,055.00	1.89
12	600547	山东黄金	90,000	2,464,200.00	1.86
13	601899	紫金矿业	139,100	2,443,987.00	1.84
14	600276	恒瑞医药	61,500	2,365,290.00	1.78
15	601985	中国核电	215,300	2,295,098.00	1.73
16	601600	中国铝业	300,000	2,289,000.00	1.72
17	688016	心脉医疗	21,857	2,143,078.85	1.61
18	300856	科思股份	66,000	2,112,660.00	1.59
19	002444	巨星科技	85,200	2,104,440.00	1.59
20	003816	中国广核	452,800	2,096,464.00	1.58
21	600030	中信证券	114,010	2,078,402.30	1.57
22	600188	兖矿能源	90,000	2,045,700.00	1.54
23	601088	中国神华	40,500	1,796,985.00	1.35
24	600900	长江电力	55,600	1,607,952.00	1.21
25	000738	航发控制	73,800	1,481,166.00	1.12
26	688798	艾为电子	24,492	1,386,737.04	1.04
27	601288	农业银行	297,000	1,294,920.00	0.98

28	600522	中天科技	73,400	1,163,390.00	0.88
29	688019	安集科技	9,034	1,136,477.20	0.86
30	002487	大金重工	48,400	1,107,392.00	0.83
31	600031	三一重工	63,900	1,054,350.00	0.79
32	002050	三花智控	54,900	1,047,492.00	0.79
33	300433	蓝思科技	57,000	1,040,250.00	0.78
34	002270	华明装备	46,200	1,027,488.00	0.77
35	600150	中国船舶	22,200	903,762.00	0.68
36	600519	贵州茅台	600	880,434.00	0.66
37	688385	复旦微电	27,139	851,621.82	0.64
38	300760	迈瑞医疗	2,900	843,639.00	0.64
39	603160	汇顶科技	12,100	831,875.00	0.63
40	688012	中微公司	5,854	826,936.04	0.62
41	002273	水晶光电	48,600	825,228.00	0.62
42	688766	普冉股份	8,436	819,726.12	0.62
43	00883	中国海洋石油	40,000	817,761.28	0.62
44	601567	三星医疗	23,200	812,000.00	0.61
45	600887	伊利股份	30,600	790,704.00	0.60
46	600685	中船防务	27,300	761,670.00	0.57
47	002025	航天电器	15,700	728,166.00	0.55
48	688271	联影医疗	6,600	724,020.00	0.55
49	002138	顺络电子	26,300	722,198.00	0.54
50	000975	银泰黄金	38,400	625,536.00	0.47
51	300679	电连技术	14,800	595,404.00	0.45
52	600875	东方电气	31,300	577,485.00	0.44
53	001309	德明利	6,610	571,104.00	0.43
54	002179	中航光电	15,000	570,750.00	0.43
55	688699	明微电子	17,973	570,642.75	0.43
56	688368	晶丰明源	9,970	552,338.00	0.42
57	688595	芯海科技	18,172	545,160.00	0.41
58	002096	易普力	45,800	545,020.00	0.41
59	300015	爱尔眼科	51,515	531,634.80	0.40
60	688332	中科蓝讯	8,560	504,954.40	0.38
61	600025	华能水电	46,100	496,958.00	0.37
62	300115	长盈精密	40,900	490,391.00	0.37
63	002739	万达电影	38,700	467,883.00	0.35
64	603087	甘李药业	10,000	463,200.00	0.35
65	688617	惠泰医疗	1,000	456,100.00	0.34
66	688050	爱博医疗	6,120	448,718.40	0.34
67	603501	韦尔股份	4,400	437,228.00	0.33
68	300416	苏试试验	33,600	432,096.00	0.33
69	600183	生益科技	20,300	427,518.00	0.32
70	001286	陕西能源	36,900	425,457.00	0.32

71	000528	柳工	37,500	419,625.00	0.32
72	001965	招商公路	34,200	405,612.00	0.31
73	002293	罗莱生活	50,000	404,000.00	0.30
74	688187	时代电气	7,941	392,126.58	0.30
75	688212	澳华内镜	9,800	392,098.00	0.30
76	600872	中炬高新	17,200	390,268.00	0.29
77	688981	中芯国际	8,393	386,917.30	0.29
78	300699	光威复材	15,160	376,422.80	0.28
79	002296	辉煌科技	36,200	373,222.00	0.28
80	688041	海光信息	5,245	368,828.40	0.28
81	600529	山东药玻	13,700	347,158.00	0.26
82	002353	杰瑞股份	9,700	340,276.00	0.26
83	600511	国药股份	10,600	326,374.00	0.25
84	300602	飞荣达	21,400	323,354.00	0.24
85	002837	英维克	14,183	303,374.37	0.23
86	002938	鹏鼎控股	7,600	302,176.00	0.23
87	603882	金城医学	11,000	299,090.00	0.23
88	01530	三生制药	49,000	288,005.30	0.22
89	300633	开立医疗	7,000	277,060.00	0.21
90	01093	石药集团	48,000	272,489.74	0.21
91	600993	马应龙	10,000	266,700.00	0.20
92	02666	环球医疗	68,000	263,764.52	0.20
93	002737	葵花药业	10,600	247,828.00	0.19
94	688601	力芯微	5,585	244,008.65	0.18
95	002044	美年健康	64,200	242,676.00	0.18
96	300213	佳讯飞鸿	42,200	240,540.00	0.18
97	002782	可立克	21,400	237,112.00	0.18
98	301080	百普赛斯	6,750	236,250.00	0.18
99	301308	江波龙	2,400	227,376.00	0.17
100	01515	华润医疗	70,000	225,523.23	0.17
101	600085	同仁堂	5,700	217,797.00	0.16
102	06699	时代天使	4,200	217,537.28	0.16
103	688131	皓元医药	10,920	208,899.60	0.16
104	600674	川投能源	11,000	206,250.00	0.16
105	02162	康诺亚-B	6,500	200,219.18	0.15
106	603061	金海通	3,000	192,840.00	0.15
107	002993	奥海科技	5,000	186,000.00	0.14
108	300687	赛意信息	13,200	183,744.00	0.14
109	688502	茂莱光学	1,798	167,231.98	0.13
110	002644	佛慈制药	25,600	164,352.00	0.12
111	688213	思特威-W	3,125	151,562.50	0.11
112	688519	南亚新材	5,847	149,507.79	0.11
113	603325	博隆技术	2,100	144,438.00	0.11

114	301181	标榜股份	6,330	143,564.40	0.11
115	002216	三全食品	12,900	141,642.00	0.11
116	06160	百济神州	1,800	141,611.43	0.11
117	600114	东睦股份	9,800	141,022.00	0.11
118	600418	江淮汽车	8,800	139,392.00	0.11
119	000680	山推股份	14,900	138,123.00	0.10
120	603993	洛阳钼业	16,000	136,000.00	0.10
121	301360	荣旗科技	3,000	129,750.00	0.10
122	688065	凯赛生物	2,828	128,362.92	0.10
123	000538	云南白药	2,500	127,875.00	0.10
124	600132	重庆啤酒	2,000	121,400.00	0.09
125	000021	深科技	7,700	116,424.00	0.09
126	688157	松井股份	3,359	115,549.60	0.09
127	300358	楚天科技	14,500	107,880.00	0.08
128	600422	昆药集团	5,900	105,197.00	0.08
129	002906	华阳集团	3,900	104,364.00	0.08
130	600566	济川药业	3,200	101,472.00	0.08
131	300832	新产业	1,500	101,160.00	0.08
132	688123	聚辰股份	1,649	100,308.67	0.08
133	688596	正帆科技	2,929	96,657.00	0.07
134	301269	华大九天	1,200	92,460.00	0.07
135	688515	裕太微-U	1,591	92,278.00	0.07
136	300806	斯迪克	8,100	90,720.00	0.07
137	603085	天成自控	9,800	87,612.00	0.07
138	605111	新洁能	2,800	85,652.00	0.06
139	688433	华曙高科	3,821	79,706.06	0.06
140	603319	湘油泵	4,900	78,351.00	0.06
141	688372	伟测科技	1,898	74,648.34	0.06
142	301169	零点有数	2,500	72,000.00	0.05
143	603809	豪能股份	8,732	70,554.56	0.05
144	09969	诺诚健华	16,000	70,385.88	0.05
145	688110	东芯股份	3,615	68,938.05	0.05
146	603929	亚翔集成	2,600	62,140.00	0.05
147	600155	华创云信	10,400	61,464.00	0.05
148	688361	中科飞测	1,170	55,341.00	0.04
149	600879	航天电子	7,000	54,390.00	0.04
150	301358	湖南裕能	1,700	53,482.00	0.04
151	688153	唯捷创芯	1,297	47,989.00	0.04
152	688326	经纬恒润-W	819	46,953.27	0.04
153	300638	广和通	2,600	44,460.00	0.03
154	603659	璞泰来	2,870	40,553.10	0.03
155	301307	美利信	2,000	39,160.00	0.03
156	688105	诺唯赞	1,713	34,277.13	0.03

157	002152	广电运通	2,900	30,334.00	0.02
158	688173	希荻微	2,651	29,240.53	0.02
159	002949	华阳国际	3,000	28,230.00	0.02
160	000977	浪潮信息	700	25,459.00	0.02
161	603019	中科曙光	600	24,900.00	0.02
162	600699	均胜电子	1,600	23,712.00	0.02
163	002065	东华软件	4,900	22,148.00	0.02
164	600109	国金证券	2,800	21,140.00	0.02
165	600918	中泰证券	3,500	19,845.00	0.01
166	688343	云天励飞-U	628	17,929.40	0.01
167	300348	长亮科技	2,300	15,686.00	0.01
168	603005	晶方科技	500	10,190.00	0.01
169	000519	中兵红箭	400	5,868.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002517	恺英网络	2,822,305.00	1.81
2	688286	敏芯股份	2,693,535.56	1.73
3	688016	心脉医疗	2,681,698.32	1.72
4	688385	复旦微电	2,651,176.70	1.70
5	603986	兆易创新	2,539,235.00	1.63
6	300856	科思股份	2,396,165.00	1.54
7	601288	农业银行	2,388,907.00	1.53
8	688484	南芯科技	2,070,391.90	1.33
9	002444	巨星科技	1,977,458.00	1.27
10	600900	长江电力	1,424,919.00	0.91
11	000738	航发控制	1,393,538.00	0.89
12	688012	中微公司	1,330,162.49	0.85
13	688798	艾为电子	1,287,986.64	0.83
14	002487	大金重工	1,228,576.00	0.79
15	601985	中国核电	1,207,725.00	0.77
16	002050	三花智控	1,103,577.00	0.71
17	003816	中国广核	1,088,033.00	0.70
18	605228	神通科技	1,086,824.00	0.70
19	002739	万达电影	1,054,383.00	0.68
20	300017	网宿科技	1,028,275.00	0.66

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
----	------	------	----------	-----------------

	码			
1	603986	兆易创新	3,047,242.00	1.95
2	603993	洛阳钼业	2,821,010.00	1.81
3	600362	江西铜业	2,251,444.00	1.44
4	300017	网宿科技	2,153,573.00	1.38
5	000776	广发证券	2,100,955.00	1.35
6	603626	科森科技	2,016,638.00	1.29
7	600079	人福医药	1,905,107.00	1.22
8	688385	复旦微电	1,804,061.77	1.16
9	601225	陕西煤业	1,798,478.00	1.15
10	300661	圣邦股份	1,547,461.50	0.99
11	601699	潞安环能	1,432,008.00	0.92
12	601318	中国平安	1,411,701.00	0.91
13	300782	卓胜微	1,399,869.00	0.90
14	300274	阳光电源	1,221,738.00	0.78
15	603198	迎驾贡酒	1,129,931.00	0.72
16	601288	农业银行	1,056,847.00	0.68
17	600547	山东黄金	1,051,235.00	0.67
18	601689	拓普集团	1,044,081.00	0.67
19	600745	闻泰科技	1,013,969.00	0.65
20	688599	天合光能	946,867.78	0.61

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	73,044,925.14
卖出股票收入（成交）总额	88,954,022.78

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：无。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：无。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

为有效控制债券投资的系统性风险，本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的，适度运用国债期货，提高投资组合的运作效率。在国债期货投资时，本基金将首先分析国债期货各合约价格与最便宜可交割券的关系，选择定价合理的国债期货合约，其次，考虑国债期货各合约的流动性情况，最终确定与现货组合的合适匹配，以达到风险管理的目标。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 本报告期末各资产单元的净值及占基金资产净值的比例

资产单元	投资顾问名称	报告期末资产单元资产净值 (元)	占期末基金资产净值比例 (%)
1	信达澳亚基金管理有 限公司	27,815,823.32	20.95
2	华泰柏瑞基金管理有 限公司	19,885,019.54	14.98
3	惠升基金管理有限责 任公司	12,462,802.11	9.39

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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

海通证券股份有限公司在报告编制日前一年内受到中国证券监督管理委员会的处罚。

交通银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局的处罚。

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。

7.13.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券备选库。

7.13.3 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	19,813.80
2	应收清算款	136,754.05
3	应收股利	44,262.47
4	应收利息	-
5	应收申购款	299.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	201,129.96

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比 例 (%)	持有份额	占总份额比 例 (%)
1,178	147,426.38	0.00	0.00	173,668,272.44	100.00

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	136,148.07	0.0784

注：截至本报告期末，本基金管理人从业人员投资、持有本基金符合相关法律法规、中国证监会规定及相关管理制度的规定。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	-
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

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

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2021年9月23日）	
基金份额总额	355,101,287.66
本报告期期初基金份额总额	200,870,958.87
本报告期基金总申购份额	40,563.56
减：本报告期基金总赎回份额	27,243,249.99
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	173,668,272.44

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人的重大人事变动：

本报告期内，公司原副总经理王宗合先生辞去本公司副总经理职务，经公司第六届董事会第二百零四次会议审议通过，董事会同意王宗合先生不再担任公司副总经理，离任日期为 2024 年 2 月 6 日。

本报告期内，公司原副总经理邢彪先生辞去本公司副总经理职务，经公司第六届董事会第二百一十七次会议审议通过，董事会同意邢彪先生不再担任公司副总经理，离任日期为 2024 年 4 月 11 日。

本报告期内，公司原董事长何如先生不再担任公司董事长。经公司 2024 年第三次临时股东大会和第六届董事会第二百一十八次会议审议通过，股东会同意聘任张纳沙女士担任公司董事，董事会选举张纳沙女士担任公司董事长，任职日期自 2024 年 4 月 12 日起。

本公司已将上述变更事项报中国证券监督管理委员会深圳监管局备案。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的，与本基金管理人、基金财

产、基金托管业务相关的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

无。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未改聘为本基金审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人及相关责任人员
受到稽查或处罚等措施的时间	2024 年 4 月 19 日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会深圳监管局
受到的具体措施类型	责令改正及警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	个别规定未严格执行，个别业务内控管理不完善
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	管理人高度重视，按照法律法规及相关要求积极落实整改工作。截至报告日，上述事项已整改完毕
其他	-

注：无。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
东吴证券	1	29,646,433.21	18.30	24,456.26	18.34	-
浙商证券	2	24,832,148.07	15.33	19,747.70	14.81	-
开源证券	2	21,890,559.71	13.51	18,297.84	13.72	-
国海证券	2	21,539,244.22	13.30	15,492.80	11.62	-
中泰证券	2	16,862,220.23	10.41	15,794.35	11.84	-

东方证券	2	15,050,498.78	9.29	13,865.99	10.40	-
国信证券	2	9,576,484.77	5.91	7,863.76	5.90	-
国盛证券	2	7,702,219.88	4.75	6,438.05	4.83	-
天风证券	2	5,211,466.81	3.22	4,395.07	3.30	-
摩根大通证券	1	2,712,262.72	1.67	2,267.22	1.70	-
光大证券	1	1,411,637.00	0.87	1,159.38	0.87	-
平安证券	1	1,244,631.00	0.77	561.72	0.42	-
广发证券	3	1,226,138.36	0.76	900.90	0.68	本报告期新增1个
东方财富证券	1	939,708.16	0.58	423.78	0.32	-
中信建投证券	1	804,784.00	0.50	741.44	0.56	-
信达证券	1	489,044.00	0.30	220.50	0.17	-
民生证券	2	457,788.00	0.28	382.66	0.29	-
华西证券	1	401,679.00	0.25	335.77	0.25	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国投证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中原证券	1	-	-	-	-	-

注：交易单元选择的标准和程序：

1) 基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其交易单元作为基金的专用交易单元，选择的标准是：

(1) 实力雄厚，信誉良好；

(2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；

- (3) 经营行为规范；
- (4) 合规风控能力较强，内部管理规范、严格，具备健全的内控制度；
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的
需要，并能为本基金提供全面的信息服务；
- (6) 交易、研究服务能力较强。

2) 选择交易单元的程序：

我公司根据上述标准，选定符合条件的证券公司作为租用交易单元的对象。我公司在比较了
多家证券经营机构的财务状况、经营状况、合规风控能力和交易、研究水平等后，向券商租用交
易单元作为基金交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名 称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债 券 成交总额 的比例 (%)	成交金额	占当期债券 回购成交总 额的比例 (%)	成交金额	占当期权 证 成交总额 的比例 (%)
东吴证 券	-	-	-	-	-	-
浙商证 券	-	-	-	-	-	-
开源证 券	-	-	-	-	-	-
国海证 券	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-
东方证 券	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
国盛证 券	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-
摩根大 通证券	-	-	-	-	-	-
光大证 券	-	-	-	-	-	-

平安证 券	-	-	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-
东方财 富证券	-	-	-	-	-	-
中信建 投证券	-	-	-	-	-	-
信达证 券	-	-	-	-	-	-
民生证 券	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
爱建证 券	-	-	-	-	-	-
长江证 券	-	-	-	-	-	-
东北证 券	-	-	-	-	-	-
方正证 券	-	-	-	-	-	-
国金证 券	-	-	-	-	-	-
国投证 券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
山西证 券	-	-	-	-	-	-
西南证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
中原证 券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024年01月18日
2	鹏华精选群英一年持有期灵活配置	《上海证券报》、基金	2024年01月19日

	混合型管理人中管理人（MOM）证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	
3	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	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 01 月 23 日
4	鹏华基金管理有限公司关于暂停北京中期时代基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 02 月 02 日
5	鹏华基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 02 月 08 日
6	鹏华基金管理有限公司关于终止与北京中期时代基金销售有限公司销售合作关系的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 03 月 04 日
7	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与华福证券有限责任公司申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 03 月 16 日
8	鹏华精选群英一年持有期灵活配置混合型管理人中管理人（MOM）证券投资基金 2023 年年度报告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 03 月 28 日
9	鹏华基金管理有限公司关于旗下证券投资基金持有的股票估值方法变更的提示性公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 03 月 30 日
10	鹏华基金管理有限公司关于董事长变更的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 04 月 13 日
11	鹏华基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 04 月 13 日
12	鹏华精选群英一年持有期灵活配置混合型管理人中管理人（MOM）证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 04 月 19 日
13	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 05 月 10 日
14	鹏华基金管理有限公司关于调整个人投资者开立基金账户证件类型的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 05 月 16 日
15	鹏华基金管理有限公司关于调整旗下部分基金单笔最低申购（含定期定额投资）金额和账户最低余额限制的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 05 月 16 日
16	鹏华精选群英一年持有期灵活配置	《上海证券报》、基金	2024 年 06 月 07 日

	混合型管理人中管理人（MOM）证券投资基金基金产品资料概要（更新）	管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	
17	鹏华精选群英一年持有期灵活配置混合型管理人中管理人（MOM）证券投资基金更新的招募说明书	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 06 月 07 日
18	鹏华基金管理有限公司关于调整旗下部分基金单笔最低赎回份额和账户最低份额余额限制的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 06 月 12 日

注：无。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

（一）《鹏华精选群英一年持有期灵活配置混合型管理人中管理人（MOM）证券投资基金基金合同》；

（二）《鹏华精选群英一年持有期灵活配置混合型管理人中管理人（MOM）证券投资基金托管协议》；

（三）《鹏华精选群英一年持有期灵活配置混合型管理人中管理人（MOM）证券投资基金 2024 年中期报告》（原文）。

12.2 存放地点

深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层鹏华基金管理有限公司。

12.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅，也可按工本费购买复印件，或通过本基金管理人网站（<http://www.phfund.com.cn>）查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人鹏华基金管理有限公司，本公司已开通客户服务系统，咨询电话：4006788999。

鹏华基金管理有限公司

2024 年 8 月 29 日