

鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金

2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：鹏扬基金管理有限公司

基金托管人：中国工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。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	17
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	40

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	41
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	56
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	63
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	63
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	63
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	64
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	64
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	64
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	64
7.12	投资组合报告附注	64
§ 8	基金份额持有人信息	65
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	65
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	65
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的情况	66
§ 9	开放式基金份额变动	66
§ 10	重大事件揭示	66
10.1	基金份额持有人大会决议	66
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	66
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	67
10.4	基金投资策略的改变	67
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	67
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	67
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	67
10.8	其他重大事件	69
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	71
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	71
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	71
§ 12	备查文件目录	71
12.1	备查文件目录	71
12.2	存放地点	72
12.3	查阅方式	72

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金	
基金简称	鹏扬元合量化股票	
基金主代码	007137	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 7 月 9 日	
基金管理人	鹏扬基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	83,760,865.04 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	鹏扬元合量化股票 A	鹏扬元合量化股票 C
下属分级基金的交易代码	007137	007138
报告期末下属分级基金的份额总额	33,252,965.88 份	50,507,899.16 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在力求有效控制投资风险的前提下，力争实现达到或超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金的投资策略包括：股票投资策略、债券投资策略、衍生品投资策略、资产支持证券投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*45%+中证 500 指数收益率*45%+银行活期存款利率（税后）*10%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金可能投资于港股通标的股票，需承担汇率风险及境外市场的风险。

注：本基金自 2024 年 3 月 28 日起变更业绩比较基准为“沪深 300 指数收益率*45%+中证 500 指数收益率*45%+银行活期存款利率（税后）*10%”。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	鹏扬基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	宋震
	联系电话	400-968-6688
	电子邮箱	service@pyamc.com
客户服务电话	400-968-6688	95588
传真	010-68105915	(010) 66105798
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区栖霞路 120 号 3 层 302 室	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	北京市西城区复兴门外大街 A2 号	北京市西城区复兴门内大街 55 号

	西城金茂中心 16 层	
邮政编码	100045	100140
法定代表人	杨爱斌	廖林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.pyamc.com
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	鹏扬基金管理有限公司	北京市西城区复兴门外大街 A2 号西城金茂中心 16 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

基金类别	鹏扬元合量化股票 A	鹏扬元合量化股票 C
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）	报告期（2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	759,283.88	1,949,041.60
本期利润	-499,318.02	159,530.60
加权平均基金份额本期利润	-0.0246	0.0035
本期加权平均净值利润率	-2.33%	0.35%
本期基金份额净值增长率	0.11%	-0.29%
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	1,306,433.85	-745,322.43
期末可供分配基金份额利润	0.0393	-0.0148
期末基金资产净值	34,559,399.73	49,762,576.73
期末基金份额净值	1.0393	0.9852
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	27.66%	20.90%

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

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

(3) 本报告所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

鹏扬元量化股票 A

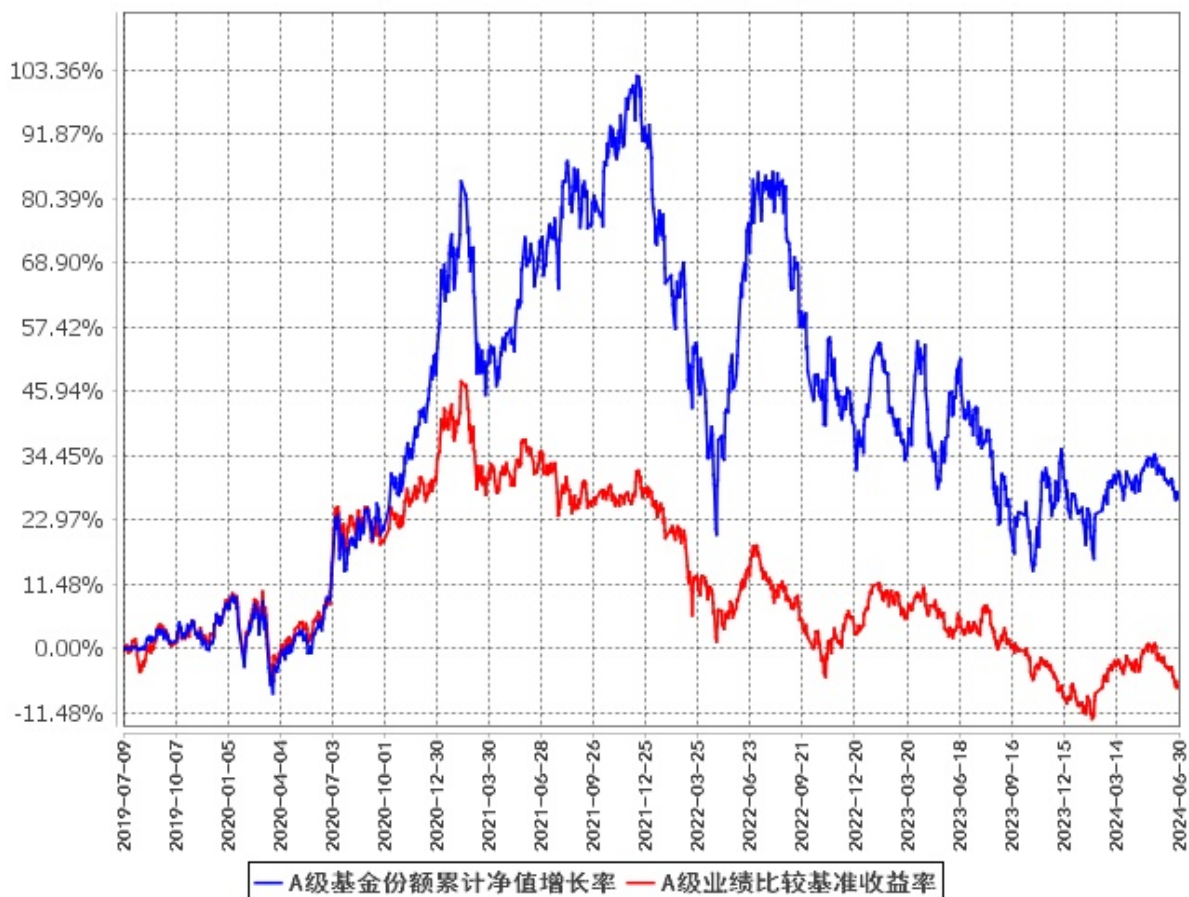
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-2.74%	0.61%	-4.60%	0.61%	1.86%	0.00%
过去三个月	-0.96%	0.79%	-3.86%	0.83%	2.90%	-0.04%
过去六个月	0.11%	1.01%	-0.30%	0.88%	0.41%	0.13%
过去一年	-9.74%	1.36%	-9.74%	0.82%	0.00%	0.54%
过去三年	-26.40%	1.60%	-30.74%	0.95%	4.34%	0.65%
自基金合同生效起至今	27.66%	1.50%	-6.81%	1.03%	34.47%	0.47%

鹏扬元量化股票 C

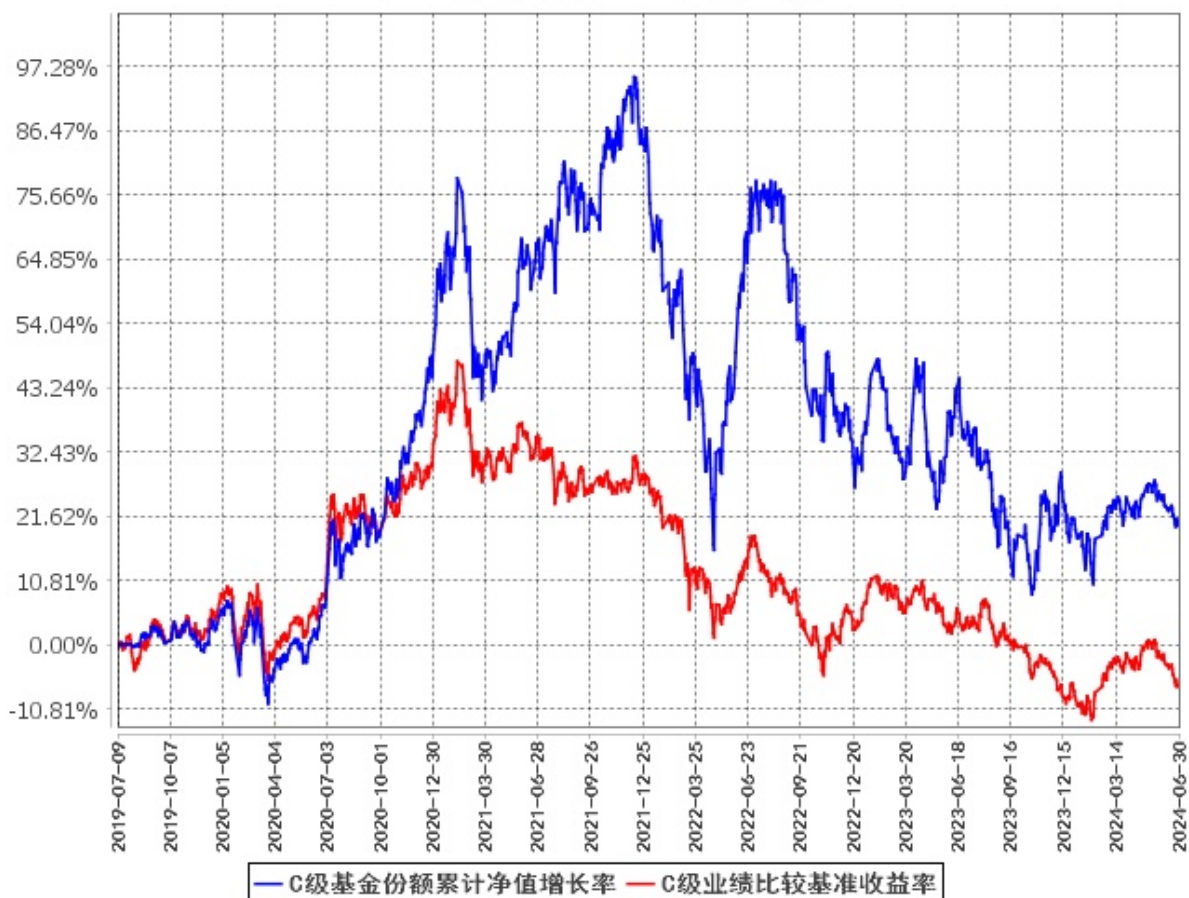
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-2.81%	0.61%	-4.60%	0.61%	1.79%	0.00%
过去三个月	-1.16%	0.79%	-3.86%	0.83%	2.70%	-0.04%
过去六个月	-0.29%	1.01%	-0.30%	0.88%	0.01%	0.13%
过去一年	-10.47%	1.36%	-9.74%	0.82%	-0.73%	0.54%
过去三年	-28.14%	1.60%	-30.74%	0.95%	2.60%	0.65%
自基金合同生效起至今	20.90%	1.50%	-6.81%	1.03%	27.71%	0.47%

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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2019年7月9日至2024年6月30日)



**C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2019年7月9日至2024年6月30日)**



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

公司践行高质量发展。在业务布局和人才战略方面,公司形成了固定收益、主动股票、指数量化、多资产四大业务板块,汇聚海内外优秀人才,致力于打造一支将服务投资者作为长期事业的人才队伍。公司核心投资人员均具有10年以上知名金融机构工作经历。公司致力于打造平台化、团队化、一体化的投研体系,实现“宏观、策略、行业、公司”的全维度研究覆盖,为客户提供“全天候”的资产管理解决方案。其中,固收团队持续提升宏观研究与资产配置、利率交易、信用研究、转债增强、国债期货等核心投资能力,力求为投资人获取长期、稳健的收益;股票团队致力于做深

度的个股研究和产业研究，遵循基本面理念严选个股，同时充分保留基金经理自身风格特点，在不同风格策略领域布局权益产品以适应客户的多元化需求；指数量化团队聚焦高质量核心资产，以科学方法深挖面向未来的行业主题和选股因子，努力为投资者提供具有长期良好持有体验的指数产品；多资产团队将基于大数据的定量研究和基于调研访谈的定性研究有机结合，为投资者提供便捷的多策略组合配置方案，有效分散投资风险，助力资产稳健增值。

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

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

鹏扬基金以“为客户创造价值，为美好生活助力”为使命，秉持“客户至上、勇于担当、拥抱变化、合作共赢”的价值观，以“专业稳健，回报信任”作为经营宗旨，专注于长期目标，寻求服务投资者的最佳方案，全力以赴争创一流投资机构，在大资管行业迈向高阶发展的进程中行稳致远。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理） 期限		证券 从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
施红俊	本基金 基金经 理,数 量投资 部总经 理兼指 数投资 总监	2020 年 6 月 9 日	2024 年 4 月 23 日	19	同济大学管理学博士。曾任大公国际资信评估有限公司上海分公司中小企业评级部部门经理，中证指数有限公司研究员、固定收益主管、研究开发部副总监。现任鹏扬基金管理有限公司数量投资部总经理兼指数投资总监。2019 年 8 月 29 日至 2022 年 11 月 8 日任鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金基金经理；2020 年 6 月 9 日

				<p>至 2024 年 4 月 23 日任鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金基金经理；2021 年 5 月 25 日至今任鹏扬沪深 300 质量成长低波动指数证券投资基金基金经理；2021 年 7 月 16 日至 2022 年 11 月 30 日任鹏扬中证科创创业 50 指数证券投资基金基金经理；2021 年 8 月 4 日至今任鹏扬中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2021 年 12 月 22 日至今任鹏扬中证数字经济主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2022 年 4 月 27 日至 2023 年 8 月 17 日任鹏扬中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金基金经理；2022 年 9 月 26 日至今任鹏扬中证数字经济主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理；2022 年 10 月 26 日至今任鹏扬中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2022 年 11 月 9 日至今任鹏扬中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；2022 年 12 月 1 日至今任鹏扬中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；2023 年 4 月 25 日至今任鹏扬北证 50 成份指数证券投资基金基金经理；2023 年 5 月 19 日至今任鹏扬中债-30 年期国债交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2023 年 6 月 29 日至今任鹏扬国证财富管理交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2023 年 8 月 17 日至今任鹏扬数字</p>
--	--	--	--	---

					经济先锋混合型证券投资基金基金经理；2023 年 8 月 25 日至今任鹏扬中证国有企业红利交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2023 年 12 月 19 日至今任鹏扬消费量化选股混合型证券投资基金基金经理；2024 年 1 月 30 日至今任鹏扬国证财富管理交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理；2024 年 3 月 19 日至今任鹏扬中证国有企业红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。
姜峰	本基金基金经理	2023 年 12 月 7 日	-	11	美国伊利诺伊大学香槟分校金融工程专业理学硕士。曾任中粮期货有限公司金融工程部高级研究员，北京鹏扬投资管理有限公司产品部数据分析师。现任鹏扬基金管理有限公司量化投资部基金经理。2023 年 12 月 7 日至今任鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金基金经理。
马超	本基金基金经理, 量化投资部副总经理	2024 年 4 月 16 日	-	7	中国人民大学管理科学与工程硕士。曾任创金合信基金管理有限公司量化分析师、投资经理，珠海宽德投资管理有限公司投资经理，创金合信基金管理有限公司量化指数与国际部总监助理、基金经理。现任鹏扬基金管理有限公司量化投资部副总经理。2024 年 4 月 16 日至今任鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金基金经理。

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未出现涉及本基金的同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024年上半年，全球经济动能总体延续较强的韧性，部分发达国家央行逐渐步入降息周期。其中，美国经济“软着陆”仍是主流叙事，供给端进一步正常化叠加需求放缓降低了市场以及美联储对于二次通胀的担忧。在6月份公布的美国通胀数据超预期回落以及失业率数据抬升后，美联储已逐步具备实施预防式降息的条件。

2024年上半年，国内经济动能先回升后放缓。政策方面，总量政策强调“固本培元”，房地产政策方向从“三大工程”转为“放开限购+贷款收储”。经济增长方面，受外需和产业政策的带动，出口与制造业投资在保持较高增速，消费和基建投资的动能有所放缓，房地产销售与投资相对偏弱。通货膨胀方面，上游资源品价格维持强势，中游制造和下游消费品价格延续低迷，核心原因是内需

偏弱、外需偏强、上游产能受限以及中下游资本开支较大。流动性方面，虽然央行没有降息，但市场资金利率基本保持平稳。信用扩张方面，央行在高质量信贷的目标下挤掉部分信贷水分，信贷和存款增速下滑；结构上，私人部门融资偏弱，政府部门融资回升。

2024 年上半年，海外股票市场整体保持强势。美国股市受益于人工智能提升大型科技股的盈利预期。A 股市场整体呈现结构高度分化的特征，期间受政策发力和经济预期修复的驱动出现了超跌反弹的行情。从风格来看，红利和价值风格表现较好，成长风格整体弱势。从行业板块来看，表现较好的是具备高股息特征的行业，例如银行、煤炭、公用事业等。

操作方面，本基金本报告期内总体保持较高股票仓位，未主动对仓位做大幅调整。行业与风格方面，本基金继续保持相对均衡的配置，不做过度的主动风险暴露，坚持均衡配置、寻找超额收益的策略。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末鹏扬元合量化股票 A 的基金份额净值为 1.0393 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.11%；截至本报告期末鹏扬元合量化股票 C 的基金份额净值为 0.9852 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.29%；同期业绩比较基准收益率为-0.30%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2024 年下半年，我们预计美国消费支出放缓、就业市场降温，美债利率中枢进一步回落。美国经济动能将放缓，但居民部门资产负债表总体健康，利率政策操作空间较大，暂不具备经济硬着陆风险的条件。

展望 2024 年下半年，国内政策方面，三中全会明确了政策主线是安全发展和培育经济新动能，财政和信贷资源将向制造业和新质生产力倾斜，需求侧政策保持“固本培元”的思路。货币、财政和房地产政策均有调整空间以应对潜在风险。经济增长方面，国内经济动能总体保持平稳和韧性，局部有亮点。今年以来，工业生产与出口旺盛，预计出口仍将保持较高水平，但未来贸易摩擦的风险将加大。总需求方面，新房需求低迷对房企流动性形成压力，商品房收储在实践中仍有阻力，居民消费下滑压力有所加大。企业部门实际投资回报率较低，叠加地缘政治的不确定性，企业逆周期增加资本开支的意愿将减弱。政策部门的税收和土地收入下滑，政府隐性债务扩张受到严格监管，因此政府支出压力较大，但政府发行专项债和国债的空间较大。在高质量信贷政策倾向之下，金融部门总体处于紧信用状态。通货膨胀方面，考虑到制造业产能和劳动力供给充足、私人部门需求承压以及需求侧政策力度有限，通胀中枢大概率将保持偏低位置。

展望 2024 年下半年权益市场，预计市场结构表现继续保持分化。我们认为市场拥挤度正在降低，

产业政策将持续出台，指数总体处于底部区间，一旦政策范式转变和企业盈利的拐点出现，届时股票市场将面临重大转机，扭转过去几年的趋势并形成较强的上升动能。个股方面机会将增加，适合继续采取均衡配置、寻找超额收益的策略。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人——鹏扬基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值

计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对鹏扬基金管理有限公司编制和披露的本基金 2024 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金

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	6,039,586.85	4,925,997.22
结算备付金		7,179.75	881,891.97
存出保证金		-	39,485.76
交易性金融资产	6.4.7.2	78,537,735.93	53,419,409.60
其中：股票投资		78,537,735.93	50,183,463.57
基金投资		-	-
债券投资		-	3,235,946.03
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	-	-
应收清算款		-	1,221,150.73
应收股利		-	-
应收申购款		994.01	60,481.29
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		84,585,496.54	60,548,416.57
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		-	1,000,904.14
应付清算款		-	1,326,609.91
应付赎回款		23,957.23	3,668,510.87
应付管理人报酬		57,478.58	38,220.55
应付托管费		14,369.64	9,555.13
应付销售服务费		32,317.15	30,052.51
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	0.98
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	135,397.48	388,510.87
负债合计		263,520.08	6,462,364.96
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	83,760,865.04	54,094,108.12
未分配利润	6.4.7.8	561,111.42	-8,056.51
净资产合计		84,321,976.46	54,086,051.61
负债和净资产总计		84,585,496.54	60,548,416.57

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额总额 83,760,865.04 份，其中鹏扬元合量化股票 A 基金份额净值 1.0393 元，基金份额总额 33,252,965.88 份；鹏扬元合量化股票 C 基金份额净值 0.9852 元，基金份额总额 50,507,899.16 份。

6.2 利润表

会计主体：鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金

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		254,952.99	2,952,149.44
1. 利息收入		15,189.19	6,029.87
其中：存款利息收入	6.4.7.9	15,189.19	4,525.11
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		-	1,504.76
其他利息收入		-	-

2. 投资收益（损失以“-”填列）		3,099,675.81	-6,110,304.73
其中：股票投资收益	6.4.7.10	1,973,068.53	-6,241,849.09
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	14,671.17	51,203.14
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	235,033.13	-
股利收益	6.4.7.15	876,902.98	80,341.22
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-3,048,112.90	9,036,458.55
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	188,200.89	19,965.75
减：二、营业总支出		594,740.41	619,614.10
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	266,206.68	257,678.92
2. 托管费	6.4.10.2.2	66,551.62	80,524.73
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	181,374.55	205,482.58
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		7,429.35	1,400.53
其中：卖出回购金融资产支出		7,429.35	1,400.53
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		849.11	5.53
8. 其他费用	6.4.7.19	72,329.10	74,521.81
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-339,787.42	2,332,535.34
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-339,787.42	2,332,535.34
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-339,787.42	2,332,535.34

6.3 净资产变动表

会计主体：鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金

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	54,094,108.12	-	-8,056.51	54,086,051.61
二、本期期初净资产	54,094,108.12	-	-8,056.51	54,086,051.61
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	29,666,756.92	-	569,167.93	30,235,924.85
(一)、综合收益总额	-	-	-339,787.42	-339,787.42
(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)	29,666,756.92	-	908,955.35	30,575,712.27
其中：1. 基金申购款	67,172,053.86	-	2,475,590.50	69,647,644.36
2. 基金赎回款	-37,505,296.94	-	-1,566,635.15	-39,071,932.09
(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、本期期末净资产	83,760,865.04	-	561,111.42	84,321,976.46
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	65,748,621.93	-	4,674,212.80	70,422,834.73
二、本期期初净资产	65,748,621.93	-	4,674,212.80	70,422,834.73
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-9,990,933.26	-	1,512,972.98	-8,477,960.28
(一)、综合收益总额	-	-	2,332,535.34	2,332,535.34
(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)	-9,990,933.26	-	-819,562.36	-10,810,495.62
其中：1. 基金申购款	8,619,598.48	-	1,560,424.90	10,180,023.38
2. 基金赎回款	-18,610,531.74	-	-2,379,987.26	-20,990,519.00
(三)、本期向基金份 额持有人分配利润产 生的净资产变动(净资 产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	55,757,688.67	-	6,187,185.78	61,944,874.45

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

杨爱斌	崔雁巍	韩欢
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金(以下简称“本基金”),系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[2019]335号《关于准予鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金注册的批复》注册,由鹏扬基金管理有限公司于2019年6月4日至2019年7月5日向社会公开募集,首次募集的有效净认购金额为人民币212,838,113.10元,有效净认购资金在募集期间产生的利息为人民币48,257.17元,业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2019)验字第61290365_A10号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,基金合同于2019年7月9日生效,基金合同生效日的基金份额总额为212,886,370.27份基金份额,其中认购资金利息折合48,257.17份基金份额,本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为鹏扬基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括主板、中小板、创业板及其他中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证)、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许投资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(包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持债券、可转债、可交换债、可分离交易可转债的纯债部分及其他经中国证监会允许投资的债券)、衍生品(包括权证、股指期货等)、货币市场工具(含同业存单)、资产支持证券、债券回购以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

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。

基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的80%-95%(其中投资于港股通标的股票的比例不得超过本基金所投资股票资产的50%),投资于本基金界定的大盘股票的资产占非现金基金资产的比例不低于80%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等;股指期货及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会

计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)编制,同时,在信息披露和估值方面,也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和净值变动情况等有关信息。

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

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

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自 2008 年 4 月 24 日起,调整证券(股票)交易印花税税率,由原先的 3‰调整为 1‰;

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自 2008 年 9 月 19 日起,调整由出让方按证券(股票)交易印花税税率缴纳印花税,受让方不再征收,税率不变。

根据财政部、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》的规定,自 2023 年 8 月 28 日起,证券交易印花税实施减半征收。

6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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(以下简称“资管产品运营业务”)，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，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；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票(不包括限售股)、债券、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股票收盘价(2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价)、债券估值(中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值)、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；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额

为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

6.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

6.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25%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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.6.5 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《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[2016]127 号文《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》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

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	4,560,371.67
等于：本金	4,559,890.40
加：应计利息	481.27
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	1,479,215.18
等于：本金	1,479,044.80
加：应计利息	170.38
减：坏账准备	-
合计	6,039,586.85

注：其他存款为存放在证券经纪机构的证券资金账户中的证券交易结算资金。

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	80,199,053.62	-	78,537,735.93	-1,661,317.69
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	80,199,053.62	-	78,537,735.93	-1,661,317.69

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	0.16
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	21,546.74
其中：交易所市场	21,546.74
银行间市场	-
应付利息	-
预收股利	4,206.00
预提费用	109,644.58
合计	135,397.48

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

鹏扬元合量化股票 A		
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	12,648,817.58	12,648,817.58
本期申购	36,900,208.47	36,900,208.47
本期赎回（以“-”号填列）	-16,296,060.17	-16,296,060.17
本期末	33,252,965.88	33,252,965.88

金额单位：人民币元

鹏扬元合量化股票 C		
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	41,445,290.54	41,445,290.54
本期申购	30,271,845.39	30,271,845.39
本期赎回（以“-”号填列）	-21,209,236.77	-21,209,236.77
本期末	50,507,899.16	50,507,899.16

注：总申购份额含红利再投、转换入份额等；总赎回份额含转换出份额等。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

鹏扬元量化股票 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,171,987.31	-688,588.77	483,398.54
本期期初	1,171,987.31	-688,588.77	483,398.54
本期利润	759,283.88	-1,258,601.90	-499,318.02
本期基金份额交易产生的变动数	2,647,361.71	-1,325,008.38	1,322,353.33
其中：基金申购款	4,749,250.68	-2,462,340.30	2,286,910.38
基金赎回款	-2,101,888.97	1,137,331.92	-964,557.05
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,578,632.90	-3,272,199.05	1,306,433.85

单位：人民币元

鹏扬元量化股票 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,703,877.47	-2,195,332.52	-491,455.05
本期期初	1,703,877.47	-2,195,332.52	-491,455.05
本期利润	1,949,041.60	-1,789,511.00	159,530.60
本期基金份额交易产生的变动数	384,938.40	-798,336.38	-413,397.98
其中：基金申购款	2,015,943.40	-1,827,263.28	188,680.12
基金赎回款	-1,631,005.00	1,028,926.90	-602,078.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,037,857.47	-4,783,179.90	-745,322.43

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日 至 2024 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	4,507.23
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	2,590.19
结算备付金利息收入	7,899.81
其他	191.96
合计	15,189.19

注：其他存款利息收入为存放在证券经纪机构的证券资金账户中的证券交易结算资金产生的利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 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	548,567,411.44
减：卖出股票成本总额	545,728,652.38
减：交易费用	865,690.53
买卖股票差价收入	1,973,068.53

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日 至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	17,086.02
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付） 差价收入	-2,414.85
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	14,671.17

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日 至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	3,457,027.98
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,403,271.00
减：应计利息总额	56,166.98
减：交易费用	4.85
买卖债券差价收入	-2,414.85

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.13 贵金属投资收益

无。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日 至2024年6月30日
股指期货投资收益	235,033.13

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日 至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	876,902.98
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	876,902.98

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日 至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	-3,048,112.90
——股票投资	-3,052,067.90
——债券投资	3,955.00
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-

——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-3,048,112.90

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日 至2024年6月30日
基金赎回费收入	185,283.82
基金转出费收入	2,917.07
合计	188,200.89

6.4.7.18 信用减值损失

无。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日 至2024年6月30日
审计费用	24,863.02
信息披露费	39,781.56
证券出借违约金	-
账户维护费	6,000.00
银行费用	1,284.52
开户费	400.00
合计	72,329.10

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

截至财务报表批准日，本基金无需要说明的重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
鹏扬基金管理有限公司（“鹏扬基金”）	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人、基金代销机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

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	266,206.68	257,678.92
其中：应支付销售机构的客户维护费	38,513.60	29,100.18
应支付基金管理人的净管理费	227,693.08	228,578.74

注：基金管理费每日计提，按月支付。本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.80%年费率计提。

管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日	上年度可比期间 2023年1月1日
----	-----------------	----------------------

	至 2024 年 6 月 30 日	至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	66,551.62	80,524.73

注：（1）基金托管费每日计提，按月支付。本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

（2）根据本基金管理人 2023 年 7 月 29 日发布的《鹏扬基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，自 2023 年 7 月 31 日起，本基金托管费率由 0.25% 年费率调至 0.20% 年费率。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鹏扬元合量化股票 A	鹏扬元合量化股票 C	合计
鹏扬基金	-	145,073.01	145,073.01
工商银行	-	5,392.77	5,392.77
合计	-	150,465.78	150,465.78
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鹏扬元合量化股票 A	鹏扬元合量化股票 C	合计
鹏扬基金	-	179,819.23	179,819.23
工商银行	-	4,796.57	4,796.57
合计	-	184,615.80	184,615.80

注：基金销售服务费每日计提，按月支付。本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.80% 年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% / \text{当年天数}$$

H 为每日 C 类基金份额应计提的销售服务费

E 为前一日 C 类基金份额的基金资产净值

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2024 年 1 月 1 日 至 2024 年 6 月 30 日	
	鹏扬元量化股票 A	鹏扬元量化股票 C
基金合同生效日（2019 年 7 月 9 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	27,297.40	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	27,297.40	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.03%	-

项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日 至 2023 年 6 月 30 日	
	鹏扬元量化股票 A	鹏扬元量化股票 C
基金合同生效日（2019 年 7 月 9 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	145,588.39	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	118,290.99	-
报告期末持有的基金份额	27,297.40	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.05%	-

注：（1）基金管理人投资本基金的相关费用符合基金招募说明书及相关临时公告、交易所、登记结算机构的有关规定。

（2）对于分级基金，下属分级份额的比例的分母采用基金总份额。

（3）总申购份额含红利再投、转换入份额等；总赎回份额含转换出份额等。

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

无。

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
工商银行	4,560,371.67	4,507.23	30,541.57	377.25

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金管理人将风险管理思想融入公司整体组织架构的设计中，从而实现全方位、多角度风险

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

同时，本基金管理人采用科学的风险管理分析方法对组合面对的投资风险进行分析，主要通过定性分析和定量分析的方法，评估各种金融工具的风险及可能产生的损失。本基金管理人从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重性；从定量分析的角度出发，根据基金资产所投资的不同金融工具的特征，制定相关风险量化指标及模型，并通过日常量化分析报告确定风险损失的限度和相应置信程度，及时对各种风险进行监督、检查和评估，并制定相应决策，将风险控制在预期可承受的范围之内。

6.4.13.2 信用风险

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	3,235,946.03

合计	-	3,235,946.03
----	---	--------------

注：（1）债券评级取自第三方评级机构（不含中债资信评估有限责任公司）的债项评级。

（2）未评级债券包括国债、政策性金融债、央票、地方政府债、短期融资券、公司债等。

（3）债券投资以全价列示。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

注：（1）债券评级取自第三方评级机构（不含中债资信评估有限责任公司）的债项评级。

（2）未评级债券包括国债、政策性金融债、央票、地方政府债、中期票据、公司债等。

（3）债券投资以全价列示。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指因金融资产的流动性不足，无法在合理价格变现资产。本基金的流动性风险主要来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的流动性不足，导致金融资产不能在合理价格变现。本基金管理人通过限制投资集中度、监控流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时基金管理人通过分析持有人结构、申购赎回行为分析、变现比例、压力测试等方法评估组合的流动性风险。

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

过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
-----	-------	-------	-------	-----	----

2024 年 6 月 30 日					
资产					
货币资金	6,039,586.85	-	-	-	6,039,586.85
结算备付金	7,179.75	-	-	-	7,179.75
交易性金融资产	-	-	-	78,537,735.93	78,537,735.93
应收申购款	-	-	-	994.01	994.01
资产总计	6,046,766.60	-	-	78,538,729.94	84,585,496.54
负债					
应付赎回款	-	-	-	23,957.23	23,957.23
应付管理人报酬	-	-	-	57,478.58	57,478.58
应付托管费	-	-	-	14,369.64	14,369.64
应付销售服务费	-	-	-	32,317.15	32,317.15
其他负债	-	-	-	135,397.48	135,397.48
负债总计	-	-	-	263,520.08	263,520.08
利率敏感度缺口	6,046,766.60	-	-	78,275,209.86	84,321,976.46
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	4,925,997.22	-	-	-	4,925,997.22
结算备付金	881,891.97	-	-	-	881,891.97
存出保证金	39,485.76	-	-	-	39,485.76
交易性金融资产	3,235,946.03	-	-	50,183,463.57	53,419,409.60
应收清算款	-	-	-	1,221,150.73	1,221,150.73
应收申购款	-	-	-	60,481.29	60,481.29
资产总计	9,083,320.98	-	-	51,465,095.59	60,548,416.57
负债					
卖出回购金融资产款	1,000,904.14	-	-	-	1,000,904.14
应付清算款	-	-	-	1,326,609.91	1,326,609.91
应付赎回款	-	-	-	3,668,510.87	3,668,510.87
应付管理人报酬	-	-	-	38,220.55	38,220.55
应付托管费	-	-	-	9,555.13	9,555.13
应付销售服务费	-	-	-	30,052.51	30,052.51
应交税费	-	-	-	0.98	0.98
其他负债	-	-	-	388,510.87	388,510.87
负债总计	1,000,904.14	-	-	5,461,460.82	6,462,364.96
利率敏感度缺口	8,082,416.84	-	-	46,003,634.77	54,086,051.61

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有固定收益类资产的利率风险状况测算的理论变动值对基金资产净值的影响金额。
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他变量不变。

	此项影响并未考虑管理层为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	市场利率上升 25 个基点	-	-3,357.50
	市场利率下降 25 个基点	-	3,365.61

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金本报告期末未持有外币计价的资产和负债，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素发生变动时产生的价格波动风险。本基金主要投资于上市交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。并且，基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，动态、及时地跟踪和控制其他价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	78,537,735.93	93.14	50,183,463.57	92.78
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	78,537,735.93	93.14	50,183,463.57	92.78

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	该其他价格风险的敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有股票资产的其他价格风险状况测算的理论变动值对基金资产净值的影响金额。
	假定市场基准变动 5%，其他变量不变。

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	市场基准上升 5%	4,356,454.35	2,780,942.64
市场基准下降 5%	-4,356,454.35	-2,780,942.64	

注：股票市场基准取沪深 300 指数。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	78,537,735.93	50,183,463.57
第二层次	-	3,235,946.03
第三层次	-	-
合计	78,537,735.93	53,419,409.60

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃(包括重大事项停牌、境内股票涨跌停等导致的交易不活跃)和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策以导致各层次之间转换的事项发生日作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

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	78,537,735.93	92.85
	其中：股票	78,537,735.93	92.85
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	6,046,766.60	7.15
8	其他各项资产	994.01	0.00
9	合计	84,585,496.54	100.00

注：存放在证券经纪商的证券交易资金账户中的证券交易结算资金统计在“银行存款和结算备付金合计”项内。

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

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	39,038.00	0.05
B	采矿业	3,437,674.00	4.08
C	制造业	47,450,835.19	56.27

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,608,966.20	4.28
E	建筑业	1,949,449.00	2.31
F	批发和零售业	1,026,456.14	1.22
G	交通运输、仓储和邮政业	2,271,206.00	2.69
H	住宿和餐饮业	80,136.00	0.10
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,893,147.20	4.62
J	金融业	12,906,194.90	15.31
K	房地产业	348,317.31	0.41
L	租赁和商务服务业	242,573.00	0.29
M	科学研究和技术服务业	171,540.99	0.20
N	水利、环境和公共设施管理业	245,030.00	0.29
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	831,182.00	0.99
S	综合	35,990.00	0.04
	合计	78,537,735.93	93.14

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通标的股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	601328	交通银行	248,400	1,855,548.00	2.20
2	600000	浦发银行	213,700	1,758,751.00	2.09
3	601601	中国太保	61,100	1,702,246.00	2.02
4	601668	中国建筑	294,300	1,562,733.00	1.85
5	300750	宁德时代	8,500	1,530,255.00	1.81
6	002594	比亚迪	5,700	1,426,425.00	1.69
7	603501	韦尔股份	14,100	1,401,117.00	1.66
8	000333	美的集团	21,700	1,399,650.00	1.66
9	601166	兴业银行	78,200	1,377,884.00	1.63
10	002475	立讯精密	33,900	1,332,609.00	1.58
11	601985	中国核电	115,700	1,233,362.00	1.46
12	601628	中国人寿	39,300	1,220,265.00	1.45
13	002252	上海莱士	146,900	1,148,758.00	1.36
14	600299	安迪苏	108,600	1,053,420.00	1.25
15	000768	中航西飞	41,300	992,439.00	1.18
16	600050	中国联通	200,800	943,760.00	1.12

17	002415	海康威视	30,100	930,391.00	1.10
18	000858	五粮液	7,100	909,084.00	1.08
19	002340	格林美	142,000	904,540.00	1.07
20	601127	赛力斯	9,900	902,088.00	1.07
21	601766	中国中车	112,000	841,120.00	1.00
22	000596	古井贡酒	3,900	823,173.00	0.98
23	601899	紫金矿业	46,000	808,220.00	0.96
24	000975	山金国际	48,700	793,323.00	0.94
25	688525	佰维存储	12,000	769,800.00	0.91
26	600519	贵州茅台	500	733,695.00	0.87
27	301308	江波龙	7,400	701,076.00	0.83
28	300054	鼎龙股份	30,400	689,472.00	0.82
29	600161	天坛生物	28,060	684,664.00	0.81
30	688076	诺泰生物	7,600	594,928.00	0.71
31	600008	首创环保	219,500	588,260.00	0.70
32	600703	三安光电	49,300	577,796.00	0.69
33	688516	奥特维	13,800	576,978.00	0.68
34	600018	上港集团	94,400	545,632.00	0.65
35	601600	中国铝业	70,800	540,204.00	0.64
36	300408	三环集团	18,500	540,015.00	0.64
37	600809	山西汾酒	2,500	527,200.00	0.63
38	000039	中集集团	56,100	519,486.00	0.62
39	600577	精达股份	128,000	508,160.00	0.60
40	688111	金山办公	2,200	500,500.00	0.59
41	002053	云南能投	40,800	493,272.00	0.58
42	600887	伊利股份	18,800	485,792.00	0.58
43	000567	海德股份	79,400	445,434.00	0.53
44	601211	国泰君安	31,300	424,115.00	0.50
45	002736	国信证券	48,300	419,727.00	0.50
46	601728	中国电信	68,000	418,200.00	0.50
47	600377	宁沪高速	32,600	410,760.00	0.49
48	000541	佛山照明	84,100	409,567.00	0.49
49	600875	东方电气	22,100	407,745.00	0.48
50	000703	恒逸石化	56,800	402,712.00	0.48
51	600028	中国石化	63,100	398,792.00	0.47
52	601898	中煤能源	31,800	396,864.00	0.47
53	002311	海大集团	8,400	395,220.00	0.47
54	600406	国电南瑞	15,600	389,376.00	0.46
55	600879	航天电子	49,900	387,723.00	0.46
56	601009	南京银行	36,500	379,235.00	0.45
57	600664	哈药股份	143,100	377,784.00	0.45
58	600690	海尔智家	13,000	368,940.00	0.44
59	601318	中国平安	8,600	355,696.00	0.42

60	002001	新和成	18,100	347,520.00	0.41
61	000563	陕国投 A	120,300	330,825.00	0.39
62	002352	顺丰控股	9,000	321,210.00	0.38
63	600941	中国移动	2,900	311,750.00	0.37
64	600095	湘财股份	50,300	299,788.00	0.36
65	000725	京东方 A	67,900	277,711.00	0.33
66	600803	新奥股份	13,100	272,480.00	0.32
67	603355	莱克电气	12,500	270,000.00	0.32
68	600183	生益科技	12,800	269,568.00	0.32
69	002152	广电运通	25,400	265,684.00	0.32
70	300121	阳谷华泰	33,600	262,080.00	0.31
71	601360	三六零	33,700	258,816.00	0.31
72	300207	欣旺达	17,000	257,890.00	0.31
73	600929	雪天盐业	48,500	257,050.00	0.30
74	601633	长城汽车	10,100	255,530.00	0.30
75	601975	招商南油	70,600	253,454.00	0.30
76	601615	明阳智能	25,700	242,608.00	0.29
77	601187	厦门银行	45,400	241,982.00	0.29
78	300014	亿纬锂能	6,000	239,520.00	0.28
79	002008	大族激光	11,100	230,880.00	0.27
80	600521	华海药业	13,400	228,470.00	0.27
81	600886	国投电力	12,500	228,000.00	0.27
82	000738	航发控制	11,200	224,784.00	0.27
83	000830	鲁西化工	19,200	222,528.00	0.26
84	600694	大商股份	13,030	219,034.30	0.26
85	688506	百利天恒	1,200	217,680.00	0.26
86	002078	太阳纸业	15,600	217,620.00	0.26
87	600282	南钢股份	43,500	216,630.00	0.26
88	603863	松炆资源	11,300	216,056.00	0.26
89	300251	光线传媒	25,600	215,296.00	0.26
90	300003	乐普医疗	14,500	215,180.00	0.26
91	600497	驰宏锌锗	39,900	213,066.00	0.25
92	002241	歌尔股份	10,900	212,659.00	0.25
93	000878	云南铜业	16,900	210,574.00	0.25
94	000425	徐工机械	29,400	210,210.00	0.25
95	000050	深天马 A	28,800	209,664.00	0.25
96	002507	涪陵榨菜	17,000	208,250.00	0.25
97	600928	西安银行	63,500	207,645.00	0.25
98	601058	赛轮轮胎	14,800	207,200.00	0.25
99	002019	亿帆医药	16,700	206,412.00	0.24
100	605507	国邦医药	12,300	204,795.00	0.24
101	300088	长信科技	42,800	201,160.00	0.24
102	600048	保利发展	22,900	200,604.00	0.24

103	000066	中国长城	22,900	200,375.00	0.24
104	601901	方正证券	25,900	200,207.00	0.24
105	600361	创新新材	46,700	188,201.00	0.22
106	600332	白云山	6,300	184,779.00	0.22
107	002128	电投能源	8,600	181,460.00	0.22
108	002139	拓邦股份	16,400	174,168.00	0.21
109	300529	健帆生物	6,300	171,423.00	0.20
110	603025	大豪科技	12,400	171,368.00	0.20
111	300492	华图山鼎	1,800	169,560.00	0.20
112	600760	中航沈飞	4,200	168,420.00	0.20
113	600584	长电科技	5,300	168,063.00	0.20
114	601808	中海油服	9,600	165,120.00	0.20
115	002945	华林证券	16,300	162,674.00	0.19
116	601877	正泰电器	8,500	162,010.00	0.19
117	002423	中粮资本	21,600	161,784.00	0.19
118	300390	天华新能	9,300	159,774.00	0.19
119	603658	安图生物	3,400	156,638.00	0.19
120	300433	蓝思科技	8,200	149,650.00	0.18
121	000900	现代投资	40,600	148,596.00	0.18
122	301071	力量钻石	5,200	144,092.00	0.17
123	002563	森马服饰	24,300	141,183.00	0.17
124	601019	山东出版	11,600	137,112.00	0.16
125	000887	中鼎股份	11,100	135,864.00	0.16
126	603233	大参林	9,500	135,850.00	0.16
127	600862	中航高科	7,200	135,216.00	0.16
128	000027	深圳能源	18,500	135,050.00	0.16
129	002379	宏创控股	23,000	134,780.00	0.16
130	601989	中国重工	27,300	134,589.00	0.16
131	600236	桂冠电力	17,400	133,458.00	0.16
132	000683	远兴能源	19,100	131,981.00	0.16
133	000818	航锦科技	5,900	130,272.00	0.15
134	601088	中国神华	2,900	128,673.00	0.15
135	002410	广联达	13,400	128,372.00	0.15
136	000883	湖北能源	21,200	127,412.00	0.15
137	000155	川能动力	11,800	127,086.00	0.15
138	601298	青岛港	13,100	125,236.00	0.15
139	603031	安孚科技	5,500	124,190.00	0.15
140	000636	风华高科	9,300	121,458.00	0.14
141	603568	伟明环保	5,900	121,422.00	0.14
142	002138	顺络电子	4,400	120,824.00	0.14
143	000519	中兵红箭	8,000	117,360.00	0.14
144	000630	铜陵有色	32,300	116,603.00	0.14
145	600900	长江电力	4,000	115,680.00	0.14

146	600959	江苏有线	43,400	114,576.00	0.14
147	600585	海螺水泥	4,800	113,232.00	0.13
148	601607	上海医药	5,900	112,749.00	0.13
149	002997	瑞鹄模具	3,500	111,895.00	0.13
150	002722	物产金轮	9,900	111,870.00	0.13
151	002739	万达电影	9,200	111,228.00	0.13
152	002534	西子洁能	11,100	111,111.00	0.13
153	600926	杭州银行	8,500	110,925.00	0.13
154	002064	华峰化学	15,400	110,418.00	0.13
155	601827	三峰环境	13,000	110,370.00	0.13
156	603288	海天味业	3,200	110,304.00	0.13
157	601611	中国核建	13,600	110,024.00	0.13
158	600989	宝丰能源	6,300	109,179.00	0.13
159	605389	长龄液压	5,200	109,148.00	0.13
160	603883	老百姓	5,860	107,589.60	0.13
161	603577	汇金通	15,500	107,570.00	0.13
162	601888	中国中免	1,700	106,233.00	0.13
163	601658	邮储银行	20,900	105,963.00	0.13
164	600348	华阳股份	10,500	104,580.00	0.12
165	600967	内蒙一机	14,400	103,680.00	0.12
166	002648	卫星化学	5,700	102,486.00	0.12
167	000906	浙商中拓	15,200	102,448.00	0.12
168	003816	中国广核	22,000	101,860.00	0.12
169	601319	中国人保	19,600	100,940.00	0.12
170	000501	武商集团	15,100	100,717.00	0.12
171	601700	风范股份	22,900	100,531.00	0.12
172	603317	天味食品	8,800	100,408.00	0.12
173	600219	南山铝业	26,000	99,060.00	0.12
174	688327	云从科技	8,600	97,266.00	0.12
175	002478	常宝股份	19,500	97,110.00	0.12
176	000800	一汽解放	12,400	97,092.00	0.12
177	002371	北方华创	300	95,967.00	0.11
178	002832	比音勒芬	3,900	94,263.00	0.11
179	000157	中联重科	12,200	93,696.00	0.11
180	300144	宋城演艺	11,600	93,148.00	0.11
181	600036	招商银行	2,700	92,313.00	0.11
182	601138	工业富联	3,300	90,420.00	0.11
183	002020	京新药业	8,600	90,042.00	0.11
184	003019	宸展光电	3,550	89,921.50	0.11
185	601399	国机重装	34,700	89,526.00	0.11
186	002106	莱宝高科	8,200	89,380.00	0.11
187	603676	卫信康	11,100	88,911.00	0.11
188	603103	横店影视	6,400	88,576.00	0.11

189	300249	依米康	13,600	88,128.00	0.10
190	601717	郑煤机	5,900	87,320.00	0.10
191	002286	保龄宝	15,800	87,058.00	0.10
192	002538	司尔特	19,300	86,464.00	0.10
193	603589	口子窖	2,200	86,218.00	0.10
194	601801	皖新传媒	12,400	85,932.00	0.10
195	000598	兴蓉环境	11,400	85,728.00	0.10
196	300308	中际旭创	600	82,728.00	0.10
197	002180	纳思达	3,100	81,902.00	0.10
198	601991	大唐发电	27,000	81,270.00	0.10
199	688586	江航装备	8,675	80,677.50	0.10
200	600582	天地科技	11,700	80,613.00	0.10
201	601007	金陵饭店	12,600	80,136.00	0.10
202	002487	大金重工	3,500	80,080.00	0.09
203	002203	海亮股份	10,000	79,800.00	0.09
204	600025	华能水电	7,400	79,772.00	0.09
205	600459	贵研铂业	5,900	79,709.00	0.09
206	600031	三一重工	4,800	79,200.00	0.09
207	601512	中新集团	10,300	78,486.00	0.09
208	000060	中金岭南	18,500	78,440.00	0.09
209	603181	皇马科技	8,700	78,213.00	0.09
210	601336	新华保险	2,600	78,078.00	0.09
211	603203	快克智能	3,300	77,814.00	0.09
212	002961	瑞达期货	7,100	77,745.00	0.09
213	600029	南方航空	13,100	77,159.00	0.09
214	002919	名臣健康	6,600	76,626.00	0.09
215	603939	益丰药房	3,100	76,105.00	0.09
216	603096	新经典	4,500	76,050.00	0.09
217	600346	恒力石化	5,420	75,609.00	0.09
218	000825	太钢不锈	22,200	75,036.00	0.09
219	600039	四川路桥	9,500	74,955.00	0.09
220	000902	新洋丰	6,300	74,781.00	0.09
221	002876	三利谱	3,100	74,772.00	0.09
222	000958	电投产融	19,900	72,834.00	0.09
223	600309	万华化学	900	72,774.00	0.09
224	000538	云南白药	1,400	71,610.00	0.08
225	603922	金鸿顺	2,900	71,340.00	0.08
226	601997	贵阳银行	13,500	71,145.00	0.08
227	002928	华夏航空	11,200	71,008.00	0.08
228	600893	航发动力	1,900	69,445.00	0.08
229	605166	聚合顺	6,600	69,234.00	0.08
230	600276	恒瑞医药	1,800	69,228.00	0.08
231	002558	巨人网络	7,200	67,968.00	0.08

232	002550	千红制药	12,500	67,375.00	0.08
233	600901	江苏金租	13,300	67,165.00	0.08
234	301012	扬电科技	2,700	66,852.00	0.08
235	000921	海信家电	2,000	64,480.00	0.08
236	002267	陕天然气	8,500	64,260.00	0.08
237	002835	同为股份	3,700	62,493.00	0.07
238	601616	广电电气	21,200	61,692.00	0.07
239	002863	今飞凯达	15,100	61,457.00	0.07
240	000917	电广传媒	12,100	61,105.00	0.07
241	002387	维信诺	10,000	60,800.00	0.07
242	300136	信维通信	3,100	60,698.00	0.07
243	601216	君正集团	16,400	60,516.00	0.07
244	601677	明泰铝业	5,200	60,112.00	0.07
245	601229	上海银行	8,240	59,822.40	0.07
246	600699	均胜电子	4,000	59,280.00	0.07
247	601186	中国铁建	6,800	58,276.00	0.07
248	601228	广州港	19,100	58,255.00	0.07
249	600643	爱建集团	15,100	56,927.00	0.07
250	601117	中国化学	6,900	56,856.00	0.07
251	000600	建投能源	9,000	56,700.00	0.07
252	600372	中航机载	4,700	56,259.00	0.07
253	601311	骆驼股份	7,000	56,140.00	0.07
254	600380	健康元	5,000	55,850.00	0.07
255	300802	矩子科技	3,500	55,195.00	0.07
256	002493	荣盛石化	5,700	55,062.00	0.07
257	603730	岱美股份	5,500	54,670.00	0.06
258	601969	海南矿业	8,600	54,524.00	0.06
259	000030	富奥股份	11,100	54,501.00	0.06
260	603733	仙鹤股份	3,100	54,498.00	0.06
261	301028	东亚机械	6,200	54,374.00	0.06
262	603229	奥翔药业	5,400	54,270.00	0.06
263	603155	新亚强	4,900	53,704.00	0.06
264	002801	微光股份	2,800	53,088.00	0.06
265	000963	华东医药	1,900	52,839.00	0.06
266	600308	华泰股份	16,800	52,752.00	0.06
267	000788	北大医药	10,500	52,395.00	0.06
268	000582	北部湾港	7,000	52,080.00	0.06
269	002463	沪电股份	1,400	51,100.00	0.06
270	002204	大连重工	11,800	50,386.00	0.06
271	002727	一心堂	3,300	49,797.00	0.06
272	601636	旗滨集团	7,600	49,020.00	0.06
273	600428	中远海特	7,900	48,348.00	0.06
274	600787	中储股份	10,000	48,100.00	0.06

275	002532	天山铝业	5,900	47,849.00	0.06
276	000063	中兴通讯	1,700	47,549.00	0.06
277	688099	晶晨股份	800	47,456.00	0.06
278	600776	东方通信	4,800	47,184.00	0.06
279	600820	隧道股份	7,100	46,363.00	0.05
280	601169	北京银行	7,900	46,136.00	0.05
281	000919	金陵药业	7,300	45,698.00	0.05
282	002422	科伦药业	1,500	45,495.00	0.05
283	002498	汉缆股份	13,800	45,402.00	0.05
284	603311	金海高科	5,300	45,156.00	0.05
285	603786	科博达	700	44,905.00	0.05
286	000708	中信特钢	3,300	44,781.00	0.05
287	603348	文灿股份	1,600	44,304.00	0.05
288	002249	大洋电机	9,300	43,989.00	0.05
289	002950	奥美医疗	6,600	43,560.00	0.05
290	001309	德明利	500	43,200.00	0.05
291	600919	江苏银行	5,800	43,094.00	0.05
292	601963	重庆银行	5,500	42,625.00	0.05
293	603976	正川股份	3,000	42,330.00	0.05
294	300502	新易盛	400	42,220.00	0.05
295	603020	爱普股份	6,300	42,021.00	0.05
296	002142	宁波银行	1,900	41,914.00	0.05
297	002179	中航光电	1,100	41,855.00	0.05
298	300170	汉得信息	6,700	41,138.00	0.05
299	600336	澳柯玛	9,500	40,660.00	0.05
300	600718	东软集团	4,900	40,523.00	0.05
301	300323	华灿光电	9,300	40,455.00	0.05
302	601818	光大银行	12,700	40,259.00	0.05
303	601857	中国石油	3,900	40,248.00	0.05
304	002028	思源电气	600	40,140.00	0.05
305	000166	申万宏源	9,100	39,221.00	0.05
306	600433	冠豪高新	14,800	39,220.00	0.05
307	002958	青农商行	14,600	39,128.00	0.05
308	688685	迈信林	1,600	39,120.00	0.05
309	000544	中原环保	4,900	38,563.00	0.05
310	601698	中国卫通	2,700	38,043.00	0.05
311	600999	招商证券	2,700	37,557.00	0.04
312	001872	招商港口	1,900	36,575.00	0.04
313	000987	越秀资本	7,300	36,208.00	0.04
314	002414	高德红外	6,100	35,929.00	0.04
315	600288	大恒科技	5,500	35,805.00	0.04
316	000338	潍柴动力	2,200	35,728.00	0.04
317	002651	利君股份	6,500	35,685.00	0.04

318	600517	国网英大	8,200	35,506.00	0.04
319	603629	利通电子	1,900	35,074.00	0.04
320	600522	中天科技	2,200	34,870.00	0.04
321	600019	宝钢股份	5,200	34,580.00	0.04
322	601609	金田股份	6,100	34,526.00	0.04
323	300872	天阳科技	2,600	34,450.00	0.04
324	603160	汇顶科技	500	34,375.00	0.04
325	601198	东兴证券	4,300	34,228.00	0.04
326	603380	易德龙	1,700	34,136.00	0.04
327	300498	温氏股份	1,700	33,694.00	0.04
328	600713	南京医药	7,900	33,338.00	0.04
329	301309	万得凯	1,300	33,228.00	0.04
330	300628	亿联网络	900	33,093.00	0.04
331	603189	网达软件	3,000	32,820.00	0.04
332	603993	洛阳钼业	3,800	32,300.00	0.04
333	000795	英洛华	5,700	31,578.00	0.04
334	002004	华邦健康	8,300	31,540.00	0.04
335	600562	国睿科技	2,300	31,418.00	0.04
336	002465	海格通信	3,000	31,080.00	0.04
337	600420	国药现代	2,900	30,972.00	0.04
338	002332	仙琚制药	2,700	30,807.00	0.04
339	300048	合康新能	6,600	30,558.00	0.04
339	688779	五矿新能	6,600	30,558.00	0.04
341	002907	华森制药	2,400	30,288.00	0.04
342	300181	佐力药业	2,000	30,240.00	0.04
343	600668	尖峰集团	3,800	30,210.00	0.04
344	600663	陆家嘴	3,400	29,988.00	0.04
345	688055	龙腾光电	9,400	29,798.00	0.04
346	300760	迈瑞医疗	100	29,091.00	0.03
347	002441	众业达	3,800	28,804.00	0.03
348	600586	金晶科技	4,900	28,420.00	0.03
349	002942	新农股份	2,400	28,296.00	0.03
350	000999	华润三九	650	27,677.00	0.03
351	600079	人福医药	1,600	27,472.00	0.03
352	002185	华天科技	3,300	26,895.00	0.03
353	000786	北新建材	900	26,694.00	0.03
354	000031	大悦城	11,400	26,676.00	0.03
355	002215	诺普信	3,500	26,075.00	0.03
356	300559	佳发教育	2,700	25,839.00	0.03
357	601838	成都银行	1,700	25,823.00	0.03
358	301193	家联科技	1,600	25,536.00	0.03
359	600489	中金黄金	1,700	25,160.00	0.03
360	688778	厦钨新能	800	24,992.00	0.03

361	600021	上海电力	2,500	24,725.00	0.03
362	603299	苏盐井神	2,600	24,700.00	0.03
363	300383	光环新网	2,900	24,505.00	0.03
364	603496	恒为科技	1,000	24,450.00	0.03
365	600998	九州通	4,998	24,390.24	0.03
366	603277	银都股份	800	24,032.00	0.03
367	002110	三钢闽光	8,100	23,895.00	0.03
368	000895	双汇发展	1,000	23,770.00	0.03
369	600261	阳光照明	8,800	23,760.00	0.03
370	603456	九洲药业	1,700	23,324.00	0.03
371	600588	用友网络	2,300	23,000.00	0.03
372	600528	中铁工业	3,100	22,692.00	0.03
373	601233	桐昆股份	1,400	22,344.00	0.03
374	002978	安宁股份	800	22,288.00	0.03
375	002202	金风科技	3,300	22,176.00	0.03
376	600655	豫园股份	4,300	22,145.00	0.03
377	600196	复星医药	1,000	22,140.00	0.03
378	603239	浙江仙通	1,600	21,936.00	0.03
379	300212	易华录	1,300	21,879.00	0.03
380	600925	苏能股份	4,300	21,715.00	0.03
381	000739	普洛药业	1,600	21,712.00	0.03
382	600741	华域汽车	1,300	21,294.00	0.03
383	688567	孚能科技	2,200	21,120.00	0.03
384	603995	甬金股份	1,200	21,024.00	0.02
385	002065	东华软件	4,600	20,792.00	0.02
386	000532	华金资本	1,700	20,502.00	0.02
387	300755	华致酒行	1,500	20,490.00	0.02
388	300113	顺网科技	2,000	20,480.00	0.02
389	000997	新大陆	1,400	19,474.00	0.02
390	600329	达仁堂	600	19,434.00	0.02
391	301280	珠城科技	500	19,400.00	0.02
392	002245	蔚蓝锂芯	2,500	19,375.00	0.02
393	601128	常熟银行	2,550	19,303.50	0.02
394	688819	天能股份	800	19,088.00	0.02
395	605180	华生科技	1,600	18,960.00	0.02
396	000937	冀中能源	2,800	18,760.00	0.02
397	001234	泰慕士	1,100	18,689.00	0.02
398	600426	华鲁恒升	700	18,648.00	0.02
399	300303	聚飞光电	3,800	18,468.00	0.02
400	301262	海看股份	800	18,040.00	0.02
401	002429	兆驰股份	3,700	17,797.00	0.02
402	300743	天地数码	1,300	17,602.00	0.02
403	000807	云铝股份	1,300	17,563.00	0.02

404	002237	恒邦股份	1,500	17,265.00	0.02
405	600352	浙江龙盛	2,000	17,180.00	0.02
406	688330	宏力达	800	16,312.00	0.02
407	002439	启明星辰	900	15,534.00	0.02
408	600673	东阳光	2,200	15,488.00	0.02
409	000959	首钢股份	5,600	15,232.00	0.02
410	688159	有方科技	400	15,144.00	0.02
411	601669	中国电建	2,700	15,093.00	0.02
412	300005	探路者	3,000	15,030.00	0.02
413	601816	京沪高铁	2,700	14,499.00	0.02
414	600089	特变电工	1,000	13,870.00	0.02
415	600548	深高速	1,300	13,819.00	0.02
416	600482	中国动力	700	13,636.00	0.02
417	000930	中粮科技	2,700	13,581.00	0.02
418	600845	宝信软件	420	13,410.60	0.02
419	003006	百亚股份	560	13,272.00	0.02
420	603408	建霖家居	1,000	13,190.00	0.02
421	600233	圆通速递	800	12,520.00	0.01
422	000415	渤海租赁	4,900	12,495.00	0.01
423	600038	中直股份	300	12,333.00	0.01
424	600765	中航重机	600	12,240.00	0.01
425	002500	山西证券	2,600	12,220.00	0.01
426	002121	科陆电子	3,200	12,128.00	0.01
427	001210	金房能源	860	11,412.20	0.01
428	600232	金鹰股份	2,600	11,206.00	0.01
429	002472	双环传动	500	11,010.00	0.01
430	002294	信立泰	400	10,652.00	0.01
431	600888	新疆众和	1,500	10,605.00	0.01
432	002916	深南电路	100	10,577.00	0.01
433	600549	厦门钨业	600	10,350.00	0.01
434	601225	陕西煤业	400	10,308.00	0.01
435	600707	彩虹股份	1,500	10,215.00	0.01
436	601018	宁波港	3,000	10,200.00	0.01
437	002449	国星光电	1,400	9,968.00	0.01
438	002120	韵达股份	1,200	9,288.00	0.01
439	688981	中芯国际	200	9,220.00	0.01
440	603919	金徽酒	500	9,085.00	0.01
441	002291	遥望科技	2,100	9,030.00	0.01
442	601800	中国交建	1,000	8,940.00	0.01
443	601288	农业银行	2,000	8,720.00	0.01
444	688138	清溢光电	400	8,600.00	0.01
445	603156	养元饮品	400	8,508.00	0.01
446	600170	上海建工	3,900	8,385.00	0.01

447	002296	辉煌科技	800	8,248.00	0.01
448	300790	宇瞳光学	600	8,100.00	0.01
449	300679	电连技术	200	8,046.00	0.01
450	601369	陕鼓动力	1,000	8,020.00	0.01
451	002322	理工能科	500	8,010.00	0.01
452	002708	光洋股份	1,100	7,931.00	0.01
453	601038	一拖股份	500	7,905.00	0.01
454	605008	长鸿高科	600	7,860.00	0.01
455	300194	福安药业	2,100	7,854.00	0.01
455	601988	中国银行	1,700	7,854.00	0.01
457	000651	格力电器	200	7,844.00	0.01
458	601390	中国中铁	1,200	7,824.00	0.01
459	000576	甘化科工	1,300	7,800.00	0.01
460	300062	中能电气	1,600	7,792.00	0.01
461	000100	TCL 科技	1,800	7,776.00	0.01
462	002354	天娱数科	2,600	7,774.00	0.01
463	601727	上海电气	2,100	7,770.00	0.01
463	600751	海航科技	3,500	7,770.00	0.01
465	600987	航民股份	1,100	7,766.00	0.01
466	301161	唯万密封	500	7,765.00	0.01
467	300140	节能环境	1,300	7,761.00	0.01
468	600468	百利电气	1,800	7,758.00	0.01
469	605188	国光连锁	1,000	7,750.00	0.01
470	002583	海能达	1,900	7,733.00	0.01
471	600011	华能国际	800	7,696.00	0.01
472	002264	新华都	1,500	7,665.00	0.01
473	300035	中科电气	900	7,659.00	0.01
474	600141	兴发集团	400	7,632.00	0.01
475	600391	航发科技	500	7,625.00	0.01
476	000547	航天发展	1,300	7,618.00	0.01
477	000688	国城矿业	800	7,616.00	0.01
477	688313	仕佳光子	800	7,616.00	0.01
479	000488	晨鸣纸业	2,200	7,612.00	0.01
480	601881	中国银河	700	7,602.00	0.01
481	002515	金字火腿	2,000	7,580.00	0.01
482	688148	芳源股份	1,800	7,578.00	0.01
483	001330	博纳影业	1,400	7,574.00	0.01
484	002878	元隆雅图	600	7,542.00	0.01
485	603861	白云电器	900	7,533.00	0.01
486	002897	意华股份	200	7,532.00	0.01
487	300821	东岳硅材	1,100	7,524.00	0.01
488	605555	德昌股份	400	7,444.00	0.01
489	002601	龙佰集团	400	7,428.00	0.01

490	600933	爱柯迪	500	7,395.00	0.01
491	003025	思进智能	600	7,386.00	0.01
492	603567	珍宝岛	700	7,371.00	0.01
493	603138	海量数据	700	7,336.00	0.01
494	300482	万孚生物	300	7,320.00	0.01
494	002023	海特高新	800	7,320.00	0.01
496	002111	威海广泰	700	7,294.00	0.01
497	600030	中信证券	400	7,292.00	0.01
498	688234	天岳先进	155	7,272.60	0.01
499	000409	云鼎科技	900	7,263.00	0.01
500	600717	天津港	1,700	7,259.00	0.01
501	600757	长江传媒	900	7,254.00	0.01
502	600160	巨化股份	300	7,239.00	0.01
503	000983	山西焦煤	700	7,217.00	0.01
504	000828	东莞控股	800	7,208.00	0.01
505	300047	天源迪科	1,100	7,194.00	0.01
506	002741	光华科技	800	7,184.00	0.01
507	300636	同和药业	700	7,119.00	0.01
508	600362	江西铜业	300	7,104.00	0.01
509	002788	鹭燕医药	900	7,092.00	0.01
510	603368	柳药集团	400	7,000.00	0.01
511	002318	久立特材	300	6,999.00	0.01
512	688006	杭可科技	400	6,980.00	0.01
513	603693	江苏新能	600	6,972.00	0.01
514	600475	华光环能	800	6,968.00	0.01
515	001979	招商蛇口	789	6,935.31	0.01
516	300409	道氏技术	800	6,848.00	0.01
517	300463	迈克生物	600	6,828.00	0.01
518	600874	创业环保	1,200	6,708.00	0.01
519	300002	神州泰岳	800	6,496.00	0.01
520	002695	煌上煌	1,000	6,490.00	0.01
521	300777	中简科技	300	6,450.00	0.01
522	300331	苏大维格	400	6,432.00	0.01
523	601828	美凯龙	2,500	6,375.00	0.01
524	301200	大族数控	200	6,312.00	0.01
525	600323	瀚蓝环境	300	6,270.00	0.01
526	603301	振德医疗	300	6,258.00	0.01
527	601098	中南传媒	500	6,210.00	0.01
528	688472	阿特斯	600	6,108.00	0.01
529	601865	福莱特	300	6,030.00	0.01
530	603707	健友股份	500	5,940.00	0.01
531	603893	瑞芯微	100	5,917.00	0.01
532	688425	铁建重工	1,600	5,888.00	0.01

533	000404	长虹华意	1,100	5,863.00	0.01
534	688088	虹软科技	200	5,772.00	0.01
535	001203	大中矿业	600	5,766.00	0.01
536	301327	华宝新能	100	5,730.00	0.01
537	600956	新天绿能	700	5,719.00	0.01
538	002705	新宝股份	400	5,628.00	0.01
538	000517	荣安地产	2,100	5,628.00	0.01
540	688002	睿创微纳	200	5,594.00	0.01
541	601089	福元医药	400	5,540.00	0.01
542	300285	国瓷材料	300	5,355.00	0.01
543	002906	华阳集团	200	5,352.00	0.01
543	000559	万向钱潮	1,200	5,352.00	0.01
545	600315	上海家化	300	5,334.00	0.01
546	002003	伟星股份	400	5,020.00	0.01
547	002725	跃岭股份	600	5,016.00	0.01
548	600416	湘电股份	500	4,970.00	0.01
549	603579	荣泰健康	320	4,947.20	0.01
550	688276	百克生物	171	4,851.27	0.01
551	688670	金迪克	400	4,712.00	0.01
552	600755	厦门国贸	600	4,302.00	0.01
553	002083	孚日股份	1,000	4,230.00	0.01
554	301299	卓创资讯	100	4,200.00	0.00
555	600037	歌华有线	700	4,186.00	0.00
556	002556	辉隆股份	1,000	4,170.00	0.00
557	002302	西部建设	800	4,160.00	0.00
558	603019	中科曙光	100	4,150.00	0.00
559	601118	海南橡胶	900	4,095.00	0.00
560	301408	华人健康	400	4,092.00	0.00
561	000001	平安银行	400	4,060.00	0.00
562	002056	横店东磁	300	3,741.00	0.00
563	000513	丽珠集团	100	3,721.00	0.00
564	603360	百傲化学	300	3,525.00	0.00
565	603195	公牛集团	45	3,470.40	0.00
566	600837	海通证券	400	3,424.00	0.00
567	688683	莱尔科技	200	3,202.00	0.00
568	002303	美盈森	1,300	3,133.00	0.00
569	603980	吉华集团	800	2,992.00	0.00
570	002557	洽洽食品	100	2,819.00	0.00
571	601811	新华文轩	200	2,802.00	0.00
572	600885	宏发股份	100	2,768.00	0.00
573	601916	浙商银行	1,000	2,760.00	0.00
574	002080	中材科技	200	2,580.00	0.00
575	002444	巨星科技	100	2,470.00	0.00

576	002984	森麒麟	100	2,409.00	0.00
577	688009	中国通号	400	2,400.00	0.00
578	600388	龙净环保	200	2,322.00	0.00
579	600729	重庆百货	100	2,236.00	0.00
580	601939	建设银行	300	2,220.00	0.00
581	603051	鹿山新材	100	2,183.00	0.00
582	600167	联美控股	400	2,084.00	0.00
583	603595	东尼电子	100	2,059.00	0.00
584	688105	诺唯赞	99	1,980.99	0.00
585	002926	华西证券	300	1,977.00	0.00
586	600096	云天化	100	1,942.00	0.00
587	600674	川投能源	100	1,875.00	0.00
588	002027	分众传媒	300	1,818.00	0.00
589	600839	四川长虹	400	1,796.00	0.00
590	600746	江苏索普	300	1,767.00	0.00
591	600985	淮北矿业	100	1,674.00	0.00
592	002826	易明医药	200	1,586.00	0.00
593	600177	雅戈尔	200	1,424.00	0.00
594	600057	厦门象屿	200	1,360.00	0.00
595	688375	国博电子	19	1,342.16	0.00
596	002074	国轩高科	70	1,340.50	0.00
597	002403	爱仕达	200	1,324.00	0.00
598	688678	福立旺	120	1,299.60	0.00
599	688136	科兴制药	77	1,290.52	0.00
600	603071	物产环能	100	1,253.00	0.00
601	600598	北大荒	100	1,249.00	0.00
602	000626	远大控股	300	1,245.00	0.00
603	300551	古鳌科技	200	1,126.00	0.00
604	688185	康希诺	26	1,068.34	0.00
605	688507	索辰科技	21	1,020.60	0.00
606	603856	东宏股份	100	1,018.00	0.00
607	000009	中国宝安	100	860.00	0.00
608	601990	南京证券	100	768.00	0.00
609	000728	国元证券	100	606.00	0.00
610	600080	金花股份	100	597.00	0.00
611	000153	丰原药业	80	430.40	0.00
612	600525	长园集团	100	426.00	0.00
613	002793	罗欣药业	90	322.20	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	600219	南山铝业	4,472,533.00	8.27
2	300750	宁德时代	3,907,117.00	7.22
3	000333	美的集团	3,791,461.00	7.01
4	002001	新和成	3,668,858.00	6.78
5	601601	中国太保	3,555,973.00	6.57
6	000725	京东方 A	3,410,018.00	6.30
7	601318	中国平安	3,178,650.96	5.88
8	601328	交通银行	3,006,645.00	5.56
9	601628	中国人寿	2,927,092.00	5.41
10	601668	中国建筑	2,787,403.00	5.15
11	600406	国电南瑞	2,752,889.00	5.09
12	300502	新易盛	2,683,860.00	4.96
13	600989	宝丰能源	2,671,498.90	4.94
14	600900	长江电力	2,629,417.00	4.86
15	601633	长城汽车	2,628,766.00	4.86
16	603501	韦尔股份	2,589,754.00	4.79
17	603993	洛阳钼业	2,560,630.00	4.73
18	601166	兴业银行	2,555,500.00	4.72
19	600000	浦发银行	2,535,493.00	4.69
20	601766	中国中车	2,529,251.00	4.68
21	600690	海尔智家	2,527,670.00	4.67
22	601600	中国铝业	2,500,190.00	4.62
23	600050	中国联通	2,481,677.00	4.59
24	600309	万华化学	2,456,429.00	4.54
25	600025	华能水电	2,391,439.00	4.42
26	601058	赛轮轮胎	2,332,021.00	4.31
27	300551	古鳌科技	2,320,312.20	4.29
28	002594	比亚迪	2,290,704.80	4.24
29	600887	伊利股份	2,265,596.00	4.19
30	600183	生益科技	2,263,110.93	4.18
31	300308	中际旭创	2,257,243.00	4.17
32	002415	海康威视	2,256,638.00	4.17
33	601127	赛力斯	2,241,515.00	4.14
34	002252	上海莱士	2,200,287.00	4.07
35	002736	国信证券	2,191,087.00	4.05
36	600582	天地科技	2,136,293.00	3.95

37	002138	顺络电子	2,116,412.00	3.91
38	601009	南京银行	2,107,706.00	3.90
39	601319	中国人保	2,101,652.00	3.89
40	600028	中国石化	2,091,477.00	3.87
41	002064	华峰化学	2,089,114.00	3.86
42	600161	天坛生物	2,078,883.00	3.84
43	002648	卫星化学	2,060,779.97	3.81
44	600299	安迪苏	2,049,218.00	3.79
45	300682	朗新集团	2,048,725.00	3.79
46	601985	中国核电	2,048,288.00	3.79
47	002422	科伦药业	2,040,530.00	3.77
48	600535	天士力	2,030,799.00	3.75
49	002078	太阳纸业	2,030,739.06	3.75
50	601728	中国电信	2,018,948.00	3.73
51	600066	宇通客车	2,002,145.00	3.70
52	000338	潍柴动力	1,992,493.00	3.68
53	600809	山西汾酒	1,990,470.00	3.68
54	601989	中国重工	1,971,276.00	3.64
55	000975	山金国际	1,965,341.00	3.63
56	300433	蓝思科技	1,963,613.00	3.63
57	002340	格林美	1,961,740.00	3.63
58	600901	江苏金租	1,922,769.00	3.56
59	600018	上港集团	1,913,018.00	3.54
60	601816	京沪高铁	1,909,834.00	3.53
61	600511	国药股份	1,909,213.00	3.53
62	600019	宝钢股份	1,908,778.00	3.53
63	000883	湖北能源	1,905,143.00	3.52
64	601138	工业富联	1,874,542.00	3.47
65	000858	五粮液	1,870,994.00	3.46
66	601899	紫金矿业	1,860,095.00	3.44
67	600867	通化东宝	1,836,394.00	3.40
68	002155	湖南黄金	1,820,985.00	3.37
69	601898	中煤能源	1,794,578.00	3.32
70	605333	沪光股份	1,793,106.00	3.32
71	601233	桐昆股份	1,790,818.00	3.31
72	688276	百克生物	1,782,792.34	3.30
73	002311	海大集团	1,778,299.00	3.29
74	601919	中远海控	1,753,621.00	3.24
75	000039	中集集团	1,736,899.00	3.21
76	600346	恒力石化	1,708,334.80	3.16
77	601390	中国中铁	1,703,184.00	3.15
78	600919	江苏银行	1,675,448.00	3.10
79	000596	古井贡酒	1,671,957.00	3.09

80	300280	紫天科技	1,654,481.00	3.06
81	600886	国投电力	1,622,181.00	3.00
82	688516	奥特维	1,598,296.70	2.96
83	002475	立讯精密	1,594,984.00	2.95
84	600875	东方电气	1,592,725.00	2.94
85	300003	乐普医疗	1,556,163.00	2.88
86	003816	中国广核	1,518,317.00	2.81
87	601211	国泰君安	1,514,454.00	2.80
88	000768	中航西飞	1,508,757.00	2.79
89	601857	中国石油	1,503,760.00	2.78
90	600497	驰宏锌锗	1,495,448.00	2.76
91	601108	财通证券	1,492,182.00	2.76
92	000060	中金岭南	1,484,016.00	2.74
93	601688	华泰证券	1,477,527.00	2.73
94	603629	利通电子	1,467,607.00	2.71
95	300207	欣旺达	1,464,838.00	2.71
96	000598	兴蓉环境	1,463,874.00	2.71
97	600885	宏发股份	1,447,117.00	2.68
98	600332	白云山	1,432,543.00	2.65
99	000157	中联重科	1,422,040.00	2.63
100	000021	深科技	1,418,844.00	2.62
101	002600	领益智造	1,411,920.00	2.61
102	002053	云南能投	1,403,740.00	2.60
103	601700	风范股份	1,397,768.00	2.58
104	000563	陕国投 A	1,393,608.00	2.58
105	600660	福耀玻璃	1,383,558.00	2.56
106	002493	荣盛石化	1,374,904.00	2.54
107	688525	佰维存储	1,365,399.48	2.52
108	601988	中国银行	1,359,853.00	2.51
109	000651	格力电器	1,352,291.00	2.50
110	000166	申万宏源	1,351,021.00	2.50
111	002410	广联达	1,345,523.00	2.49
112	601881	中国银河	1,342,461.00	2.48
113	600663	陆家嘴	1,341,411.00	2.48
114	002352	顺丰控股	1,334,295.00	2.47
115	002050	三花智控	1,331,372.00	2.46
116	600703	三安光电	1,319,267.00	2.44
117	601818	光大银行	1,309,051.00	2.42
118	600547	山东黄金	1,306,409.00	2.42
119	000100	TCL 科技	1,303,440.00	2.41
120	601288	农业银行	1,294,170.00	2.39
121	002273	水晶光电	1,284,960.00	2.38
122	600276	恒瑞医药	1,273,900.60	2.36

123	600141	兴发集团	1,261,994.00	2.33
124	000630	铜陵有色	1,259,926.00	2.33
125	603160	汇顶科技	1,251,551.00	2.31
126	601012	隆基绿能	1,247,572.00	2.31
127	300529	健帆生物	1,243,382.00	2.30
128	002506	协鑫集成	1,236,908.00	2.29
129	002241	歌尔股份	1,236,046.00	2.29
130	000878	云南铜业	1,234,570.00	2.28
131	600482	中国动力	1,219,423.00	2.25
132	603288	海天味业	1,217,632.00	2.25
133	300850	新强联	1,212,987.68	2.24
134	600104	上汽集团	1,208,132.00	2.23
135	002429	兆驰股份	1,201,301.00	2.22
136	688136	科兴制药	1,184,180.82	2.19
137	001872	招商港口	1,178,526.00	2.18
138	603259	药明康德	1,175,617.00	2.17
139	603456	九州药业	1,167,212.00	2.16
140	003031	中瓷电子	1,163,089.00	2.15
141	000932	华菱钢铁	1,159,955.00	2.14
142	601169	北京银行	1,149,530.00	2.13
143	601615	明阳智能	1,145,586.00	2.12
144	000937	冀中能源	1,136,472.00	2.10
145	300760	迈瑞医疗	1,135,829.00	2.10
146	002653	海思科	1,130,879.00	2.09
147	301262	海看股份	1,127,352.32	2.08
148	001309	德明利	1,123,826.00	2.08
149	001979	招商蛇口	1,116,786.49	2.06
150	600737	中粮糖业	1,116,108.00	2.06
151	688008	澜起科技	1,107,493.97	2.05
152	603355	莱克电气	1,102,550.60	2.04
153	002714	牧原股份	1,102,278.00	2.04
154	600820	隧道股份	1,096,314.00	2.03
155	000887	中鼎股份	1,095,476.00	2.03
156	601901	方正证券	1,091,627.00	2.02
157	600372	中航机载	1,091,604.68	2.02
158	603863	松炆资源	1,089,166.00	2.01
159	603379	三美股份	1,082,001.00	2.00

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产
----	------	------	----------	---------

				净值比例 (%)
1	600219	南山铝业	4,560,427.00	8.43
2	002001	新和成	3,736,122.00	6.91
3	000725	京东方 A	3,278,059.00	6.06
4	601058	赛轮轮胎	3,150,416.00	5.82
5	600406	国电南瑞	2,959,038.00	5.47
6	000100	TCL 科技	2,937,959.00	5.43
7	601318	中国平安	2,924,326.00	5.41
8	600582	天地科技	2,833,207.00	5.24
9	600989	宝丰能源	2,808,937.00	5.19
10	000630	铜陵有色	2,808,032.00	5.19
11	300502	新易盛	2,802,931.00	5.18
12	000338	潍柴动力	2,801,540.00	5.18
13	603993	洛阳钼业	2,704,191.00	5.00
14	600887	伊利股份	2,691,266.00	4.98
15	300750	宁德时代	2,601,392.00	4.81
16	300308	中际旭创	2,564,145.00	4.74
17	600028	中国石化	2,553,698.00	4.72
18	600900	长江电力	2,526,391.00	4.67
19	600025	华能水电	2,514,674.00	4.65
20	601601	中国太保	2,496,410.22	4.62
21	601633	长城汽车	2,477,201.00	4.58
22	600309	万华化学	2,472,844.00	4.57
23	002648	卫星化学	2,461,957.75	4.55
24	601138	工业富联	2,454,489.00	4.54
25	000333	美的集团	2,446,861.00	4.52
26	600901	江苏金租	2,442,787.00	4.52
27	600690	海尔智家	2,293,901.00	4.24
28	300551	古鳌科技	2,279,249.00	4.21
29	601600	中国铝业	2,274,752.00	4.21
30	600066	宇通客车	2,266,880.00	4.19
31	000651	格力电器	2,263,631.00	4.19
32	601288	农业银行	2,255,161.00	4.17
33	601319	中国人保	2,248,828.00	4.16
34	601818	光大银行	2,152,305.00	3.98
35	601012	隆基绿能	2,133,387.00	3.94
36	600497	驰宏锌锗	2,101,467.00	3.89
37	601766	中国中车	2,073,542.00	3.83
38	601919	中远海控	2,069,699.00	3.83
39	002064	华峰化学	2,068,740.00	3.82
40	600183	生益科技	2,050,088.00	3.79
41	601989	中国重工	2,049,092.00	3.79
42	600535	天士力	2,036,807.00	3.77

43	600019	宝钢股份	2,034,224.87	3.76
44	600050	中国联通	2,007,423.00	3.71
45	600276	恒瑞医药	2,002,909.00	3.70
46	002415	海康威视	1,992,554.00	3.68
47	002138	顺络电子	1,984,937.00	3.67
48	300682	朗新集团	1,983,429.00	3.67
49	600867	通化东宝	1,961,575.00	3.63
50	600511	国药股份	1,952,271.00	3.61
51	002422	科伦药业	1,924,458.00	3.56
52	002241	歌尔股份	1,919,476.00	3.55
53	601816	京沪高铁	1,915,994.09	3.54
54	002155	湖南黄金	1,915,525.00	3.54
55	600016	民生银行	1,912,713.00	3.54
56	300433	蓝思科技	1,901,858.00	3.52
57	601390	中国中铁	1,870,591.00	3.46
58	601233	桐昆股份	1,848,079.00	3.42
59	002078	太阳纸业	1,843,885.00	3.41
60	000598	兴蓉环境	1,842,698.00	3.41
61	601628	中国人寿	1,833,027.00	3.39
62	605333	沪光股份	1,791,029.00	3.31
63	000883	湖北能源	1,776,440.00	3.28
64	300850	新强联	1,756,494.00	3.25
65	300015	爱尔眼科	1,735,164.00	3.21
66	600919	江苏银行	1,733,721.00	3.21
67	601009	南京银行	1,729,938.00	3.20
68	002736	国信证券	1,728,630.00	3.20
69	688276	百克生物	1,623,665.60	3.00
70	600346	恒力石化	1,619,696.58	2.99
71	601728	中国电信	1,606,469.00	2.97
72	601857	中国石油	1,567,556.00	2.90
73	600663	陆家嘴	1,560,092.00	2.88
74	002600	领益智造	1,544,374.00	2.86
75	600885	宏发股份	1,537,131.00	2.84
76	300280	紫天科技	1,520,450.00	2.81
77	002653	海思科	1,505,112.00	2.78
78	002493	荣盛石化	1,489,047.00	2.75
79	003816	中国广核	1,488,592.00	2.75
80	601108	财通证券	1,486,164.00	2.75
81	601211	国泰君安	1,481,077.00	2.74
82	601688	华泰证券	1,480,807.00	2.74
83	000157	中联重科	1,475,652.00	2.73
84	300003	乐普医疗	1,463,310.00	2.71
85	000021	深科技	1,440,389.90	2.66

86	600886	国投电力	1,439,627.00	2.66
87	601898	中煤能源	1,432,996.00	2.65
88	000060	中金岭南	1,425,284.00	2.64
89	300776	帝尔激光	1,414,284.00	2.61
90	601988	中国银行	1,413,355.00	2.61
91	601881	中国银河	1,391,908.00	2.57
92	002311	海大集团	1,374,844.00	2.54
93	600018	上港集团	1,373,250.00	2.54
94	601127	赛力斯	1,353,548.00	2.50
95	002273	水晶光电	1,344,382.00	2.49
96	300043	星辉娱乐	1,342,159.00	2.48
97	600547	山东黄金	1,327,406.00	2.45
98	688516	奥特维	1,326,574.51	2.45
99	000166	申万宏源	1,325,256.00	2.45
100	600660	福耀玻璃	1,314,547.00	2.43
101	002027	分众传媒	1,308,372.00	2.42
102	603369	今世缘	1,303,334.00	2.41
103	600674	川投能源	1,301,130.00	2.41
104	600161	天坛生物	1,300,807.00	2.41
105	002050	三花智控	1,295,791.00	2.40
106	603629	利通电子	1,286,792.00	2.38
107	002410	广联达	1,279,716.00	2.37
108	600141	兴发集团	1,274,402.00	2.36
109	600809	山西汾酒	1,273,433.00	2.35
110	603160	汇顶科技	1,260,175.00	2.33
111	001309	德明利	1,255,365.00	2.32
112	600737	中粮糖业	1,255,325.00	2.32
113	300017	网宿科技	1,248,891.00	2.31
114	601700	风范股份	1,239,358.00	2.29
115	000039	中集集团	1,237,248.50	2.29
116	000932	华菱钢铁	1,231,914.00	2.28
117	000617	中油资本	1,230,127.00	2.27
118	601328	交通银行	1,229,685.00	2.27
119	600808	马钢股份	1,228,314.00	2.27
120	000895	双汇发展	1,228,091.00	2.27
121	002506	协鑫集成	1,226,074.00	2.27
122	000415	渤海租赁	1,219,271.00	2.25
123	300207	欣旺达	1,217,332.00	2.25
124	600820	隧道股份	1,217,067.00	2.25
125	600157	永泰能源	1,215,606.00	2.25
126	600482	中国动力	1,214,613.00	2.25
127	600875	东方电气	1,208,711.00	2.23
128	600332	白云山	1,204,278.00	2.23

129	001979	招商蛇口	1,202,502.00	2.22
130	603259	药明康德	1,194,728.00	2.21
131	002429	兆驰股份	1,184,112.00	2.19
132	603225	新凤鸣	1,183,140.00	2.19
133	601229	上海银行	1,177,084.00	2.18
134	600519	贵州茅台	1,173,096.00	2.17
135	600104	上汽集团	1,169,546.00	2.16
136	002532	天山铝业	1,168,894.00	2.16
137	601166	兴业银行	1,166,355.00	2.16
138	002714	牧原股份	1,164,640.00	2.15
139	601668	中国建筑	1,161,914.00	2.15
140	601169	北京银行	1,158,337.00	2.14
141	003031	中瓷电子	1,155,434.00	2.14
142	688188	柏楚电子	1,155,133.60	2.14
143	688235	百济神州	1,153,855.33	2.13
144	688008	澜起科技	1,149,369.03	2.13
145	000089	深圳机场	1,149,022.00	2.12
146	001872	招商港口	1,139,428.00	2.11
147	600372	中航机载	1,128,934.71	2.09
148	000975	山金国际	1,108,055.00	2.05
149	300760	迈瑞医疗	1,098,348.00	2.03
150	000937	冀中能源	1,096,634.00	2.03
151	603288	海天味业	1,089,042.00	2.01

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	577,134,992.63
卖出股票收入（成交）总额	548,567,411.44

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时,将根据风险管理原则,以套期保值为主要目的,采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平,与现货资产进行匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金投资于股指期货,对基金总体风险的影响很小,并符合既定的投资政策和投资目标。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本报告期内,本基金未参与国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本报告期内,本基金未参与国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体中,交通银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。中国太平洋保险(集团)股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局上海市分局的处罚。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外,本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-

2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	994.01
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	994.01

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，各比例的分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
鹏扬元量化股票 A	847	39,259.70	27,297.40	0.08%	33,225,668.48	99.92%
鹏扬元量化股票 C	428	118,009.11	36,483,424.06	72.23%	14,024,475.10	27.77%
合计	1,275	65,694.80	36,510,721.46	43.59%	47,250,143.58	56.41%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	鹏扬元量化股票 A	2,035,929.78	6.1226%
	鹏扬元量化股票 C	17,938.64	0.0355%

	合计	2,053,868.42	2.4521%
--	----	--------------	---------

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的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	鹏扬元合量化股票 A	>100
	鹏扬元合量化股票 C	0~10
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	鹏扬元合量化股票 A	50~100
	鹏扬元合量化股票 C	0~10
	合计	50~100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	鹏扬元合量化股票 A	鹏扬元合量化股票 C
基金合同生效日（2019 年 7 月 9 日）基金份额总额	53,299,335.93	159,587,034.34
本报告期期初基金份额总额	12,648,817.58	41,445,290.54
本报告期基金总申购份额	36,900,208.47	30,271,845.39
减：本报告期基金总赎回份额	16,296,060.17	21,209,236.77
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	33,252,965.88	50,507,899.16

注：总申购份额含红利再投、转换入份额等；总赎回份额含转换出份额等。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人：

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

2、基金托管人托管部门：

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国新证券	3	565,576,866.50	50.24%	327,813.92	63.14%	
湘财证券	2	560,125,537.56	49.76%	191,397.30	36.86%	
中信建投	2	-	-	-	-	
国联证券	2	-	-	-	-	
国信证券	2	-	-	-	-	
东吴证券	2	-	-	-	-	
东方财富证券	2	-	-	-	-	
东方证券	2	-	-	-	-	
兴业证券	2	-	-	-	-	
国海证券	2	-	-	-	-	
中金公司	3	-	-	-	-	

国投证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-

注：(1) 本基金证券经纪机构的选择标准为该机构财务状况良好、经营行为规范、研究实力较强、能满足公募基金采用券商交易模式进行证券交易和结算需要。

(2) 本基金证券经纪机构的选择程序为根据标准进行考察后，确定证券经纪机构的选择。经公司批准后与被选择的证券经纪机构及基金托管人签订证券经纪服务协议。

(3) 本基金实际支付的佣金按证券经纪服务协议约定的费率计算，在进行交易结算时逐笔清算并完成交收。本基金的证券经纪机构国新证券股份有限公司与本基金管理人不存在关联关系。

(4) 在上述租用的券商交易单元中，国新证券、国联证券的交易单元为本基金本报告期内新增的交易单元。本基金于 2024 年 4 月 11 日启动了证券交易结算模式的转换工作，上述转换工作已于 2024 年 4 月 12 日完成。中金公司、中信建投、国投证券、东方证券、国信证券、国海证券、湘财证券、兴业证券、东吴证券、太平洋证券、东方财富证券、国联证券的交易单元为本基金本报告期内剔除的交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
国新证券	3,300,922.00	91.67%	-	-	-	-	-	-
湘财证券	299,985.00	8.33%	20,800,000.00	100.00%	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-

兴业证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
国海证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-	-	-
国投证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋 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	鹏扬基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2024 年 3 月 22 日
2	鹏扬基金管理有限公司关于旗下部分基金参与深圳前海微众银行股份有限公司费率优惠活动的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2024 年 2 月 26 日
3	鹏扬基金管理有限公司关于旗下部分基金参与深圳市前海排排网基金销售有限责任公司费率优惠活动的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2024 年 6 月 7 日
4	鹏扬基金管理有限公司关于深圳分公司办公地址变更的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2024 年 5 月 9 日
5	鹏扬基金管理有限公司关于增加基金合作销售机构并参加费率优惠活动的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2024 年 4 月 16 日
6	鹏扬基金管理有限公司关于增加基金合作销售机构并参加费率优惠活动的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2024 年 5 月 23 日
7	关于鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金变更基金经理的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2024 年 4 月 25 日
8	关于鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金变更业绩比较基准并修订基金合同的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2024 年 3 月 28 日
9	关于鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金增聘基金经理的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2024 年 4 月 18 日
10	关于鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金证券交易结算模式转换完成的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2024 年 4 月 13 日
11	关于鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金转换证券交易结算模式有关事项的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2024 年 4 月 10 日

12	鹏扬基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在代销渠道开展费率优惠活动的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2024 年 6 月 21 日
13	鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2024 年 1 月 19 日
14	鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金 2023 年年度报告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2024 年 3 月 29 日
15	鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2024 年 4 月 19 日
16	鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金(A 份额)基金产品资料概要(更新)	证监会指定报刊及网站、公司官网	2024 年 3 月 28 日
17	鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金(A 份额)基金产品资料概要(更新)	证监会指定报刊及网站、公司官网	2024 年 4 月 19 日
18	鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金(A 份额)基金产品资料概要(更新)	证监会指定报刊及网站、公司官网	2024 年 4 月 26 日
19	鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金(A 份额)基金产品资料概要(更新)	证监会指定报刊及网站、公司官网	2024 年 6 月 9 日
20	鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金更新的招募说明书(2024 年第 5 号)	证监会指定报刊及网站、公司官网	2024 年 6 月 9 日
21	鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金更新的招募说明书(2024 年第 1 号)	证监会指定报刊及网站、公司官网	2024 年 3 月 28 日
22	鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金更新的招募说明书(2024 年第 2 号)	证监会指定报刊及网站、公司官网	2024 年 4 月 13 日
23	鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金更新的招募说明书(2024 年第 3 号)	证监会指定报刊及网站、公司官网	2024 年 4 月 19 日
24	鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金更新的招募说明书(2024 年第 4 号)	证监会指定报刊及网站、公司官网	2024 年 4 月 26 日
25	鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金基金合同	证监会指定报刊及网站、公司官网	2024 年 3 月 28 日
26	鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金托管协议	证监会指定报刊及网站、公司官网	2024 年 4 月 13 日
27	鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金(C 份额)基金产品资料概要(更新)	证监会指定报刊及网站、公司官网	2024 年 3 月 28 日

28	鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金(C 份额)基金产品资料概要(更新)	证监会指定报刊及网站、公司官网	2024 年 4 月 19 日
29	鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金(C 份额)基金产品资料概要(更新)	证监会指定报刊及网站、公司官网	2024 年 4 月 26 日
30	鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金(C 份额)基金产品资料概要(更新)	证监会指定报刊及网站、公司官网	2024 年 6 月 9 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2024 年 1 月 1 日 -2024 年 6 月 30 日	31,699,740.17	-	-	31,699,740.17	37.85%
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额 20%的情形,在市场流动性不足的情况下,如遇投资者巨额赎回或集中赎回,基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产,有可能对基金净值产生一定的影响,甚至可能引发基金的流动性风险。本基金管理人将审慎确认大额申购与大额赎回,有效防控产品流动性风险,在运作中保持合适的流动性水平,保护持有人利益。

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

1. 中国证监会核准鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金募集的文件;
2. 《鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金基金合同》;
3. 《鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金托管协议》;

4. 基金管理人业务资格批件和营业执照；
5. 基金托管人业务资格批件和营业执照；
6. 报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

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

鹏扬基金管理有限公司

2024 年 8 月 29 日