

# 鹏华价值精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：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	12
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
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	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>12</b>
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>40</b>
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	60
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	61
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	61
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	61

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 .....	62
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 .....	62
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	62
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	62
7.12 投资组合报告附注 .....	62
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>63</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	63
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	63
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 .....	63
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>63</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>64</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	64
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 .....	64
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	64
10.4 基金投资策略的改变 .....	64
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	64
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 .....	64
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	65
10.8 其他重大事件 .....	68
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>70</b>
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 .....	70
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	70
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>70</b>
12.1 备查文件目录 .....	70
12.2 存放地点 .....	70
12.3 查阅方式 .....	70

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华价值精选股票型证券投资基金
基金简称	鹏华价值精选股票
基金主代码	206012
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012 年 4 月 16 日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	69,423,270.82 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在适度控制风险并保持良好流动性的前提下，精选具备估值优势以及良好基本面的上市公司，力争实现超额收益与长期资本增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金通过对宏观经济、微观经济运行态势、政策环境、利率走势、证券市场走势及证券市场现阶段的系统性风险以及未来一段时期内各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估，运用定量及定性相结合的手段，制定股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金通过定性与定量相结合的积极投资策略，自下而上地精选价值被低估并且具有良好基本面的股票构建股票投资组合。</p> <p>(1) 定性分析</p> <p>本基金通过以下标准对股票的基本面进行研究分析并筛选出基本面优异的上市公司：</p> <p>第一、根据公司的核心业务竞争力、市场地位、经营管理者能力、人才资源等选择具备良好竞争优势的公司；</p> <p>第二、根据上市公司股权结构、公司组织框架、信息透明度等角度定性分析，选择公司治理结构良好的公司；</p> <p>第三、通过定性的方式分析公司在自身的发展过程中，受国家政策的扶持程度，公司发展方向，核心产品发展前景，公司规模增长及经营效益的趋势。另外还将考察公司在同业中的地位、核心产品的竞争力、市场需求状况及公司的决策体系及其开拓精神等。</p> <p>(2) 定量分析</p> <p>本基金通过对上市公司内在价值的深入分析，挖掘具备估值优势的上市公司。本基金将在宏观经济分析、行业分析的基础上，根据公司的基本面以及财务报表信息灵活运用各类估值方法评估公司的价值。本基金采用的估值方法及评估指标包括 PE、PEG、PB、PS、EV/EBITDA 等。</p>

	<p>(3) 存托凭证投资策略</p> <p>本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>本基金通过久期配置、类属配置、期限结构配置等，采取积极主动的投资策略，在严格控制风险的前提下，发掘和利用市场失衡提供的投资机会，实现债券组合增值。</p> <p>4、权证产品投资策略</p> <p>本基金通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型及价值挖掘策略、价差策略、双向权证策略等寻求权证的合理估值水平，追求稳定的当期收益。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×90%+中证综合债指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为采用高仓位运作的股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金及普通股票型基金，属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种。

注：无。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		鹏华基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	高永杰	王小飞
	联系电话	0755-81395402	021-60637103
	电子邮箱	xxpl@phfund.com.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		4006788999	021-60637228
传真		0755-82021126	021-60635778
注册地址		深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		518048	100033
法定代表人		张纳沙	张金良

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.phfund.com.cn">http://www.phfund.com.cn</a>
基金中期报告备置地点	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

### 2.5 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	-28,055,704.12
本期利润	-15,504,846.17
加权平均基金份额本期利润	-0.2190
本期加权平均净值利润率	-8.87%
本期基金份额净值增长率	-7.93%
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	103,004,175.37
期末可供分配基金份额利润	1.4837
期末基金资产净值	172,427,446.19
期末基金份额净值	2.484
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	148.40%

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	-0.32%	0.87%	-2.89%	0.43%	2.57%	0.44%
过去三个月	-0.64%	0.91%	-1.75%	0.68%	1.11%	0.23%
过去六个月	-7.93%	1.37%	1.23%	0.81%	-9.16%	0.56%
过去一年	-18.21%	1.18%	-8.36%	0.79%	-9.85%	0.39%
过去三年	-23.55%	1.35%	-29.67%	0.94%	6.12%	0.41%

自基金合同生效起至今	148.40%	1.55%	40.98%	1.22%	107.42%	0.33%
------------	---------	-------	--------	-------	---------	-------

注：业绩比较基准=沪深 300 指数收益率×90%+中证综合债指数收益率×10%

### 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



注：1、本基金基金合同于 2012 年 04 月 16 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		
张鹏	基金经理	2021-08-24	-	11 年	张鹏先生, 国籍中国, 金融学硕士, 11 年证券从业经验。曾任鹏华基金管理有限公司研究部助理研究员、研究员, 中欧基金管理有限公司研究部研究员, 自 2017 年任鹏华基金管理有限公司研究部高级研究员、基金经理助理/研究员, 现担任权益投资二部基金经理。2021 年 08 月至今担任鹏华策略回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2021 年 08 月至今担任鹏华价值精选股票型证券投资基金基金经理, 2023 年 01 月至今担任鹏华价值共赢两年持有期混合型证券投资基金基金经理, 2023 年 03 月至 2024 年 04 月担任鹏华产业精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2023 年 04 月至 2024 年 04 月担任鹏华优质治理混合型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2024 年 04 月至今担任鹏华致远成长混合型证券投资基金基金经理, 张鹏先生具备基金从业资格。 本报告期内本基金基金经理未发生变动。

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、分配等

各环节得到公平对待。公司对不同投资组合在不同时间窗口下（日内、3 日内、5 日内）的同向交易价差进行专项分析，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

### 4.3.2 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

24 年上半年，市场整体下跌，万得全 A 下跌 8%，结构上大幅分化，市值维度上的大盘风格以及估值维度上的价值股，相对小盘和成长风格，录得 15%-20% 的超额收益，大盘价值指数相对微盘股指数超额收益达到 40% 水平，小部分涨大部分跌，今年上半年上涨的 A 股只占到全 A 股数量的 15% 左右。因此今年上半年获得超额收益的核心是持仓结构的风格中大市值低估值公司的占比。

具体看，1 季度市场先跌后涨，金属煤炭油气等上游资源品，公用事业等类红利风格板块，银行家电等低估值板块具有明显超额，近两年典型的成长方向一泛 AI 线索上的各个行业，也只有业绩兑现的光模块等部分硬件子行业具有显著超额，其余弱势。市值维度看，微盘股经历两年牛市后崩盘，反弹后波动逐渐收敛，但鲜有收回前高的公司。2 季度市场延续下跌，除五月上半月上涨之外其余窗口期市场均震荡下行。具体结构上，有色煤炭石化等上游资源品板块、银行和公用事业等低估值板块、以船舶集运为代表的交运等景气板块，以及家电和通信行业延续了年初以来的强势，电子板块受益于大基金成立等利好以及苹果 AI 手机等因素驱动反弹。其余行业均延续了年初以来弱势。2 季度与 1 季度市值风格剧烈分化主导行情的显著区别是，价值与成长风格的剧烈分化主导了市场行情。

背后的核心因素有几点，负债端没有增量资金，整体风险偏好向现金流、资产质量、估值安全边际等各方面更好的大盘价值股倾斜，宏观需求延续弱预期弱现实的局面，以 AI 为典型代表的各新兴产业始终没有能够真实落地的应用场景，实际业绩无法落地印证，成长的逻辑和预期持续变弱，以主题轮动的方式展开的过程中，中枢向下。

操作上，总仓位小幅下降，一季度下旬小微盘股反弹过程中大幅出清小市值仓位，保留汽车电子大宗品机械等核心制造业仓位，基于年季报的预期增加了绩优股的仓位，基于政策变化加仓轨交板块，基于景气度研究加仓了黄金、部分化工品种、以及船舶油运和特高压板块。减仓逻辑变弱和业绩低于预期的公司，兑现部分高位 TMT 公司。

#### 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-7.93%，同期业绩比较基准增长率为 1.23%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在宏观经济有韧性但缺乏弹性的大背景下，虽然政策指向高质量增长，但是中小市值成长股依然缺乏优质的成长线索，后续选股的重要前提依然是资产质量和业绩兑现度、成长置信度以及合理估值。在这个前提下，具体的策略思路分为中短期和长期两个维度看，中短期上，当前处于中报业绩观察期，绩优方向是重要线索，也是挖掘景气向上业绩持续的公司的的重要印证节点，比如即将进入旺季的化纤和数据可能转正的工程机械子板块等，中长期维度上比较看好方向包括但不限于：供给刚性需求弹性的资源品、渗透率国产化率空间很大的半导体行业，产品力处于上行周期的自主品牌整车及供应链等制造业，泛 AI 线索上能够实际落地的硬件和软件应用。往更远的未来看，核心观察点在于新时代年轻人审美方向上的承接资产是什么，就是最核心的投资机会来源。

#### 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 103,004,175.37 元，期末基金份额净值 2.484 元。

2、本基金本报告期内未进行利润分配。

3、根据相关法律法规及本基金基金合同的规定，本基金管理人将会综合考虑各方面因素，在严格遵守规定前提下，对本报告期内可供分配利润适时作出相应安排。

#### 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

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了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，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

### 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

本托管人复核审查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。

## § 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：鹏华价值精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
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	23,742,771.24	23,709,406.14
结算备付金		531,061.64	369,336.61
存出保证金		32,048.67	72,119.52
交易性金融资产	6.4.7.2	149,117,562.67	176,312,870.20
其中：股票投资		149,117,562.67	176,312,870.20
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		17,663.08	-
应收股利		-	-
应收申购款		41,356.86	49,863.19
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		173,482,464.16	200,513,595.66
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
		<b>2024年6月30日</b>	<b>2023年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		395,215.58	1,254,409.73
应付赎回款		73,922.70	381,246.65
应付管理人报酬		171,640.01	204,499.31
应付托管费		28,606.66	34,083.21
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	385,633.02	436,120.71
负债合计		1,055,017.97	2,310,359.61
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	69,423,270.82	73,454,340.16
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	103,004,175.37	124,748,895.89
净资产合计		172,427,446.19	198,203,236.05
负债和净资产总计		173,482,464.16	200,513,595.66

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 2.484 元，基金份额总额 69,423,270.82 份。

## 6.2 利润表

会计主体：鹏华价值精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
<b>一、营业总收入</b>		-14,204,250.98	8,279,367.41
1. 利息收入		46,561.80	85,844.21
其中：存款利息收入	6.4.7.13	40,895.44	50,024.10
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		5,666.36	35,820.11
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-26,810,440.28	2,002,703.64
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-28,440,886.49	795,634.61
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	70,664.26
资产支持证券投资	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	1,630,446.21	1,136,404.77
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	12,550,857.95	6,171,376.93
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	8,769.55	19,442.63
<b>减：二、营业总支出</b>		1,300,595.19	1,834,439.15
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,040,950.91	1,446,803.91
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	173,491.80	301,417.51
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		-	0.07
8. 其他费用	6.4.7.23	86,152.48	86,217.66
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-15,504,846.17	6,444,928.26
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-15,504,846.17	6,444,928.26
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-15,504,846.17	6,444,928.26

### 6.3 净资产变动表

会计主体：鹏华价值精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	73,454,340.16	-	124,748,895.89	198,203,236.05
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	73,454,340.16	-	124,748,895.89	198,203,236.05
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-4,031,069.34	-	-21,744,720.52	-25,775,789.86
（一）、综合收益总额	-	-	-15,504,846.17	-15,504,846.17
（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）	-4,031,069.34	-	-6,239,874.35	-10,270,943.69
其中：1. 基金申购款	2,216,007.36	-	3,179,447.09	5,395,454.45

2. 基金赎回款	-6,247,076.70	-	-9,419,321.44	-15,666,398.14
(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	69,423,270.82	-	103,004,175.37	172,427,446.19
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	85,175,032.70	-	167,383,357.29	252,558,389.99
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	85,175,032.70	-	167,383,357.29	252,558,389.99
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-8,421,262.61	-	-11,064,591.97	-19,485,854.58
(一)、综合收益总额	-	-	6,444,928.26	6,444,928.26
(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)	-8,421,262.61	-	-17,509,520.23	-25,930,782.84
其中：1. 基金申购款	3,226,045.01	-	6,593,665.38	9,819,710.39
2. 基金赎回款	-11,647,307.62	-	-24,103,185.61	-35,750,493.23
(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)	-	-	-	-



填列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	76,753,770.09	-	156,318,765.32	233,072,535.41

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：

<u>邓召明</u>	<u>聂连杰</u>	<u>郝文高</u>
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

鹏华价值精选股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2011]1627号《关于核准鹏华价值精选股票型证券投资基金募集的批复》核准,由鹏华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华价值精选股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币334,728,307.80元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第090号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华价值精选股票型证券投资基金基金合同》于2012年4月16日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为334,825,290.98份基金份额,其中认购资金利息折合96,983.18份基金份额。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

### 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》、《鹏华价值精选股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 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[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股票的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的,暂减按 50%计入应纳税所得额;持股期限超过 1 年的,暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

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

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

#### 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	23,742,771.24
等于: 本金	23,740,546.20
加: 应计利息	2,225.04
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	23,742,771.24

## 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	147,219,248.02	-	149,117,562.67	1,898,314.65
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	147,219,248.02	-	149,117,562.67	1,898,314.65

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

## 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	88.77
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	301,008.89
其中：交易所市场	301,008.89
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	84,535.36
合计	385,633.02

## 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	73,454,340.16	73,454,340.16
本期申购	2,216,007.36	2,216,007.36
本期赎回（以“-”号填列）	-6,247,076.70	-6,247,076.70
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	69,423,270.82	69,423,270.82

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	140,540,949.96	-15,792,054.07	124,748,895.89
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	140,540,949.96	-15,792,054.07	124,748,895.89
本期利润	-28,055,704.12	12,550,857.95	-15,504,846.17
本期基金份额交易产生的变动数	-7,105,268.00	865,393.65	-6,239,874.35
其中：基金申购款	3,641,117.69	-461,670.60	3,179,447.09
基金赎回款	-10,746,385.69	1,327,064.25	-9,419,321.44
本期已分配利润	-	-	-
本期末	105,379,977.84	-2,375,802.47	103,004,175.37

#### 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	36,990.52
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	3,562.56
其他	342.36
合计	40,895.44

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	-28,440,886.49

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	-28,440,886.49

#### 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	329,991,509.94
减：卖出股票成本总额	357,641,664.01
减：交易费用	790,732.42
买卖股票差价收入	-28,440,886.49

#### 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	1,630,446.21
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	1,630,446.21

## 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	12,550,857.95
股票投资	12,550,857.95
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	12,550,857.95

#### 6.4.7.21 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	8,712.18
基金转换费收入	57.37
合计	8,769.55

#### 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	24,863.02
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行汇划费用	1,607.66
存托服务费	9.46
合计	86,152.48

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

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	22,201,457.77	3.43	18,731,439.96	1.36

##### 6.4.10.1.2 债券交易

注：无。

##### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)
国信证券	8,761,000.00	32.02	11,971,000.00	3.95

##### 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	20,453.68	3.50	16,307.45	5.42
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	17,257.91	1.36	17,257.91	2.78

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	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年6月30日	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	1,040,950.91	1,446,803.91
其中：应支付销售机构的客户维护费	327,114.22	457,924.32
应支付基金管理人的净管理费	713,836.69	988,879.59

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	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年6月30日	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	173,491.80	301,417.51
----------------	------------	------------

注：支付基金托管人中国建设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	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日
基金合同生效日（2012年4月16日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	7,384,785.82	7,384,785.82
报告期内申购/买入总份额	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	7,384,785.82	7,384,785.82
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	10.6373%	9.6214%

注：本基金管理人投资本基金的费率标准与其他相同条件的投资者适用的费率标准相一致。

##### 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
中国建设银行	23,742,771.24	36,990.52	25,619,169.80	39,382.70

## 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2024年1月1日至2024年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
国信证券	603325	博隆技术	网下申购	198	14,347.08
上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
国信证券	688562	航天软件	网下申购	3,714	47,093.52
国信证券	301488	豪恩汽电	网下申购	1,196	47,576.88
国信证券	688307	中润光学	网下申购	2,455	58,625.40

注：本表包含参与基金托管人的关联方承销证券的情况。

## 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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001379	腾达科技	2024年1月11日	6个月	新股流通受限	16.98	13.48	80	1,358.40	1,078.40	-

001387	雪祺电气	2024年1月4日	6个月	新股流通受限	15.38	15.25	122	1,445.72	1,860.50	雪祺电气于2024年6月3日每10股送3股
301392	汇成真空	2024年5月28日	6个月	新股流通受限	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
301502	华阳智能	2024年1月26日	6个月	新股流通受限	28.01	37.83	105	2,941.05	3,972.15	-
301565	中仑新材	2024年6月13日	6个月	新股流通受限	11.88	18.98	229	2,720.52	4,346.42	-
301566	达利凯普	2023年12月22日	6个月	新股流通受限	8.90	16.97	400	3,560.00	6,788.00	-
301580	爱迪特	2024年6月19日	6个月	新股流通受限	44.95	65.93	80	3,596.00	5,274.40	-
301589	诺瓦星云	2024年2月1日	6个月	新股流通受限	126.89	188.01	248	17,510.82	46,626.48	诺瓦星云于2024年5月30日每10股送8股
301591	肯特股份	2024年2月20日	6个月	新股流通受限	19.43	36.98	141	2,739.63	5,214.18	-

601033	永兴股份	2024年1月11日	6个月	新股流通受限	16.20	15.96	213	3,450.60	3,399.48	-
603082	北自科技	2024年1月23日	6个月	新股流通受限	21.28	29.49	53	1,127.84	1,562.97	-
603285	键邦股份	2024年6月28日	1个月内(含)	新股未上市	18.65	18.65	627	11,693.55	11,693.55	-
603285	键邦股份	2024年6月28日	6个月	新股流通受限	18.65	18.65	70	1,305.50	1,305.50	-
603312	西典新能	2024年1月4日	6个月	新股流通受限	29.02	25.36	50	1,451.00	1,268.00	-
603325	博隆技术	2024年1月3日	6个月	新股流通受限	72.46	68.06	20	1,449.20	1,361.20	-
603341	龙旗科技	2024年2月23日	6个月	新股流通受限	26.00	37.49	72	1,872.00	2,699.28	-
603344	星德胜	2024年3月13日	6个月	新股流通受限	19.18	22.66	83	1,591.94	1,880.78	-
603350	安乃达	2024年6月26日	1个月内(含)	新股未上市	20.56	20.56	772	15,872.32	15,872.32	-
603350	安乃达	2024年6月26日	6个月	新股流通受限	20.56	20.56	86	1,768.16	1,768.16	-
603375	盛景微	2024年1月17日	6个月	新股流通受限	38.18	38.90	37	1,412.66	1,439.30	-

603381	永臻股份	2024年6月19日	6个月	新股流通受限	23.35	25.13	62	1,447.70	1,558.06	-
688530	欧莱新材	2024年4月29日	6个月	新股流通受限	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-
688584	上海合晶	2024年2月1日	6个月	新股流通受限	22.66	15.89	181	4,101.46	2,876.09	-
688691	灿芯股份	2024年4月2日	6个月	新股流通受限	19.86	42.51	132	2,621.52	5,611.32	-
688692	达梦数据	2024年6月4日	6个月	新股流通受限	86.96	174.93	53	4,608.88	9,271.29	-
688695	中创股份	2024年3月6日	6个月	新股流通受限	22.43	31.55	127	2,848.61	4,006.85	-
688709	成都华微	2024年1月31日	6个月	新股流通受限	15.69	18.79	199	3,122.31	3,739.21	-

注：1、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

2、基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起约定限售期内不得转让。

3、基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起6个月内不得转让。

4、基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后6个月内不得转让。

#### 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

本基金为股票型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券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的相关规定）。基金的投资组合比例为：股票（含存托凭证）资产占基金资产的 85%—95%；债券、货币市场工具、权证及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他资产不高于基金资产的 15%；基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；基金保留的现金或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，其它金融工具的投资比例符合相关法律法规和监管机构的规定。若法律法规或监管机构允许，本基金在履行适当程序后，可调整上述投资比例，或将法律法规或监管机构以后允许基金投资的其它品种纳入投资范围。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损

失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 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中国建设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	23,742,771.24	-	-	-	23,742,771.24
结算备付金	531,061.64	-	-	-	531,061.64

存出保证金	32,048.67	-	-	-	32,048.67
交易性金融资产	-	-	-	-149,117,562.67	149,117,562.67
应收申购款	-	-	-	41,356.86	41,356.86
应收清算款	-	-	-	17,663.08	17,663.08
资产总计	24,305,881.55	-	-	-149,176,582.61	173,482,464.16
负债					
应付赎回款	-	-	-	73,922.70	73,922.70
应付管理人报酬	-	-	-	171,640.01	171,640.01
应付托管费	-	-	-	28,606.66	28,606.66
应付清算款	-	-	-	395,215.58	395,215.58
其他负债	-	-	-	385,633.02	385,633.02
负债总计	-	-	-	1,055,017.97	1,055,017.97
利率敏感度缺口	24,305,881.55	-	-	-148,121,564.64	172,427,446.19
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	23,709,406.14	-	-	-	23,709,406.14
结算备付金	369,336.61	-	-	-	369,336.61
存出保证金	72,119.52	-	-	-	72,119.52
交易性金融资产	-	-	-	-176,312,870.20	176,312,870.20
应收申购款	-	-	-	49,863.19	49,863.19
资产总计	24,150,862.27	-	-	-176,362,733.39	200,513,595.66
负债					
应付赎回款	-	-	-	381,246.65	381,246.65
应付管理人报酬	-	-	-	204,499.31	204,499.31
应付托管费	-	-	-	34,083.21	34,083.21
应付清算款	-	-	-	1,254,409.73	1,254,409.73
其他负债	-	-	-	436,120.71	436,120.71
负债总计	-	-	-	2,310,359.61	2,310,359.61
利率敏感度缺口	24,150,862.27	-	-	-174,052,373.78	198,203,236.05

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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无。

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

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（含存托凭证）资产占基金资产的 85%—95%；债券、货币市场工具、权证及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他资产不高于基金资产的 15%；基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；基金保留的现金或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，其它金融工具的投资比例符合相关法律法规和监管机构的规定。

若法律法规或监管机构允许，本基金在履行适当程序后，可调整上述投资比例，或将法律法规或监管机构以后允许基金投资的其它品种纳入投资范围。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	149,117,562.67	86.48	176,312,870.20	88.96
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	149,117,562.67	86.48	176,312,870.20	88.96

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	8,754,141.44	8,131,287.76
	比较基准下降 5% 资产净值变动	-8,754,141.44	-8,131,287.76

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	148,956,426.84
第二层次	30,639.53
第三层次	130,496.30
合计	149,117,562.67

## 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	149,117,562.67	85.96
	其中：股票	149,117,562.67	85.96
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	24,273,832.88	13.99
8	其他各项资产	91,068.61	0.05
9	合计	173,482,464.16	100.00

注：报告期末本基金投资的存托凭证公允价值为：16,748.55 元，占净值比 0.01%。本报告所指的“股票”均包含存托凭证。

## 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	2,969,561.49	1.72
B	采矿业	19,026,786.95	11.03
C	制造业	101,399,939.20	58.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,611,774.40	2.67
E	建筑业	1,629,153.32	0.94
F	批发和零售业	428,069.32	0.25
G	交通运输、仓储和邮政业	6,965,747.74	4.04
H	住宿和餐饮业	54,199.00	0.03
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,918,830.81	4.59
J	金融业	3,121,245.54	1.81
K	房地产业	584,825.00	0.34
L	租赁和商务服务业	45,450.10	0.03
M	科学研究和技术服务业	122,178.23	0.07
N	水利、环境和公共设施管理业	100,585.90	0.06
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	36,456.32	0.02
R	文化、体育和娱乐业	101,351.35	0.06
S	综合	1,408.00	0.00
	合计	149,117,562.67	86.48

## 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

## 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	002648	卫星化学	410,567	7,381,994.66	4.28
2	000338	潍柴动力	334,600	5,433,904.00	3.15
3	000528	柳工	456,700	5,110,473.00	2.96
4	600150	中国船舶	124,100	5,052,111.00	2.93
5	000400	许继电气	135,500	4,662,555.00	2.70
6	603129	春风动力	30,600	4,355,604.00	2.53
7	601899	紫金矿业	198,700	3,491,159.00	2.02
8	688575	亚辉龙	148,431	3,461,410.92	2.01
9	688617	惠泰医疗	6,771	3,088,253.10	1.79
10	601766	中国中车	386,900	2,905,619.00	1.69
11	600547	山东黄金	102,600	2,809,188.00	1.63
12	000682	东方电子	251,000	2,771,040.00	1.61
13	601872	招商轮船	324,800	2,744,560.00	1.59
14	600031	三一重工	164,700	2,717,550.00	1.58
15	601989	中国重工	520,100	2,564,093.00	1.49
16	601666	平煤股份	227,700	2,550,240.00	1.48
17	002920	德赛西威	28,700	2,499,483.00	1.45
18	300498	温氏股份	119,700	2,372,454.00	1.38
19	603920	世运电路	119,000	2,349,060.00	1.36
20	601179	中国西电	289,400	2,326,776.00	1.35
21	600938	中国海油	70,300	2,319,900.00	1.35
22	603606	东方电缆	47,400	2,313,594.00	1.34
23	688009	中国通号	373,210	2,239,260.00	1.30
24	600066	宇通客车	85,100	2,195,580.00	1.27
25	603225	新凤鸣	138,100	2,152,979.00	1.25
26	000975	银泰黄金	123,200	2,006,928.00	1.16
27	600487	亨通光电	119,800	1,889,246.00	1.10
28	601006	大秦铁路	240,800	1,724,128.00	1.00
29	603766	隆鑫通用	247,100	1,675,338.00	0.97
30	603596	伯特利	41,560	1,616,684.00	0.94
31	601808	中海油服	93,400	1,606,480.00	0.93
32	603236	移远通信	34,100	1,593,493.00	0.92
33	002241	歌尔股份	81,000	1,580,310.00	0.92
34	002371	北方华创	4,800	1,535,472.00	0.89
35	002322	理工能科	91,100	1,459,422.00	0.85
36	603993	洛阳钼业	170,400	1,448,400.00	0.84

37	600027	华电国际	207,900	1,442,826.00	0.84
38	000425	徐工机械	189,300	1,353,495.00	0.78
39	603179	新泉股份	33,300	1,306,692.00	0.76
40	003816	中国广核	272,400	1,261,212.00	0.73
41	000902	新洋丰	105,100	1,247,537.00	0.72
42	603997	继峰股份	119,600	1,223,508.00	0.71
43	600426	华鲁恒升	44,100	1,174,824.00	0.68
44	001286	陕西能源	101,767	1,173,373.51	0.68
45	300308	中际旭创	7,980	1,100,282.40	0.64
46	600312	平高电气	55,300	1,075,585.00	0.62
47	601838	成都银行	69,000	1,048,110.00	0.61
48	601919	中远海控	65,200	1,009,948.00	0.59
49	603067	振华股份	86,600	1,009,756.00	0.59
50	688192	迪哲医药-U	26,854	989,301.36	0.57
51	600233	圆通速递	59,000	923,350.00	0.54
52	002594	比亚迪	3,500	875,875.00	0.51
53	002517	恺英网络	90,600	865,230.00	0.50
54	600309	万华化学	10,700	865,202.00	0.50
55	603809	豪能股份	105,900	855,672.00	0.50
56	002332	仙琚制药	73,800	842,058.00	0.49
57	300049	福瑞股份	16,300	820,542.00	0.48
58	600919	江苏银行	108,400	805,412.00	0.47
59	000977	浪潮信息	21,700	789,229.00	0.46
60	601918	新集能源	78,000	760,500.00	0.44
61	600933	爱柯迪	51,100	755,769.00	0.44
62	000529	广弘控股	122,200	718,536.00	0.42
63	300818	耐普矿机	26,640	679,320.00	0.39
64	600023	浙能电力	80,400	571,644.00	0.33
65	605296	神农集团	16,000	562,400.00	0.33
66	300298	三诺生物	22,000	557,480.00	0.32
67	002997	瑞鹤模具	17,372	555,382.84	0.32
68	600845	宝信软件	17,213	549,611.09	0.32
69	601601	中国太保	19,300	537,698.00	0.31
70	600968	海油发展	129,200	532,304.00	0.31
71	600761	安徽合力	24,100	521,524.00	0.30
72	002185	华天科技	63,600	518,340.00	0.30
73	600036	招商银行	15,100	516,269.00	0.30
74	001979	招商蛇口	58,300	512,457.00	0.30
75	601390	中国中铁	78,100	509,212.00	0.30
76	300502	新易盛	4,800	506,640.00	0.29
77	002128	电投能源	23,300	491,630.00	0.29
78	001267	汇绿生态	92,800	489,056.00	0.28
79	600667	太极实业	85,000	485,350.00	0.28

80	600096	云天化	24,400	473,848.00	0.27
81	688498	源杰科技	3,592	470,516.08	0.27
82	688692	达梦数据	1,779	396,551.17	0.23
83	300760	迈瑞医疗	1,250	363,637.50	0.21
84	688111	金山办公	1,580	359,450.00	0.21
85	603871	嘉友国际	19,500	344,955.00	0.20
86	688408	中信博	3,666	337,565.28	0.20
87	002373	千方科技	36,800	333,776.00	0.19
88	601225	陕西煤业	12,800	329,856.00	0.19
89	000625	长安汽车	24,000	322,320.00	0.19
90	600985	淮北矿业	18,500	309,690.00	0.18
91	301345	涛涛车业	5,028	277,042.80	0.16
92	688256	寒武纪-U	1,310	260,257.70	0.15
93	000034	神州数码	11,100	254,079.00	0.15
94	600566	济川药业	4,500	142,695.00	0.08
95	600486	扬农化工	1,100	62,095.00	0.04
96	301580	爱迪特	800	60,858.40	0.04
97	600584	长电科技	1,700	53,907.00	0.03
98	600941	中国移动	500	53,750.00	0.03
99	601360	三六零	6,100	46,848.00	0.03
100	301589	诺瓦星云	248	46,626.48	0.03
101	601318	中国平安	1,100	45,496.00	0.03
102	002837	英维克	2,113	45,197.07	0.03
103	600809	山西汾酒	200	42,176.00	0.02
104	688403	汇成股份	4,908	41,619.84	0.02
105	603893	瑞芯微	700	41,419.00	0.02
106	601000	唐山港	8,600	40,420.00	0.02
107	688187	时代电气	813	40,145.94	0.02
108	688418	震有科技	2,328	39,878.64	0.02
109	603501	韦尔股份	400	39,748.00	0.02
110	603108	润达医疗	2,600	39,364.00	0.02
111	688085	三友医疗	2,324	39,275.60	0.02
112	600895	张江高科	2,100	38,808.00	0.02
113	601728	中国电信	6,300	38,745.00	0.02
114	600021	上海电力	3,900	38,571.00	0.02
115	688709	成都华微	1,985	38,244.73	0.02
116	600977	中国电影	3,500	37,660.00	0.02
117	601128	常熟银行	4,950	37,471.50	0.02
118	601898	中煤能源	3,000	37,440.00	0.02
119	600050	中国联通	7,900	37,130.00	0.02
120	688235	百济神州-U	315	36,489.60	0.02
121	688522	纳睿雷达	774	36,285.12	0.02
122	600026	中远海能	2,300	35,903.00	0.02

123	600258	首旅酒店	2,900	35,815.00	0.02
124	688337	普源精电	1,400	35,308.00	0.02
125	600019	宝钢股份	5,200	34,580.00	0.02
126	601033	永兴股份	2,128	34,403.33	0.02
127	600988	赤峰黄金	2,100	34,314.00	0.02
128	688484	南芯科技	907	33,649.70	0.02
129	600075	新疆天业	9,700	33,465.00	0.02
130	603301	振德医疗	1,600	33,376.00	0.02
131	000818	航锦科技	1,500	33,120.00	0.02
132	688025	杰普特	810	32,715.90	0.02
133	688190	云路股份	435	32,498.85	0.02
134	688166	博瑞医药	896	31,360.00	0.02
135	688027	国盾量子	207	31,257.00	0.02
136	603097	江苏华辰	1,177	31,214.04	0.02
137	600079	人福医药	1,800	30,906.00	0.02
138	301053	远信工业	1,544	30,818.24	0.02
139	600301	华锡有色	1,500	30,330.00	0.02
140	601233	桐昆股份	1,900	30,324.00	0.02
141	688278	特宝生物	566	30,309.30	0.02
142	688208	道通科技	1,249	30,150.86	0.02
143	688651	盛邦安全	1,022	29,893.50	0.02
144	688584	上海合晶	1,810	29,673.14	0.02
145	688139	海尔生物	792	29,462.40	0.02
146	688581	安杰思	602	29,455.86	0.02
147	603986	兆易创新	300	28,686.00	0.02
148	600690	海尔智家	1,000	28,380.00	0.02
149	603901	永创智能	4,000	28,360.00	0.02
150	688300	联瑞新材	587	28,234.70	0.02
151	603279	景津装备	1,300	28,197.00	0.02
152	603730	岱美股份	2,828	28,110.32	0.02
153	603368	柳药集团	1,600	28,000.00	0.02
154	603341	龙旗科技	718	27,880.36	0.02
155	600475	华光环能	3,200	27,872.00	0.02
156	601633	长城汽车	1,100	27,830.00	0.02
157	603135	中重科技	2,216	27,766.48	0.02
158	601636	旗滨集团	4,300	27,735.00	0.02
159	300059	东方财富	2,600	27,456.00	0.02
160	601702	华峰铝业	1,500	27,390.00	0.02
161	688625	呈和科技	753	27,379.08	0.02
162	601699	潞安环能	1,500	27,195.00	0.02
163	603208	江山欧派	1,410	26,987.40	0.02
164	600418	江淮汽车	1,700	26,928.00	0.02
165	301559	中集环科	1,840	26,808.80	0.02

166	600141	兴发集团	1,400	26,712.00	0.02
167	601088	中国神华	600	26,622.00	0.02
168	688401	路维光电	1,016	26,619.20	0.02
169	601377	兴业证券	5,200	26,312.00	0.02
170	002493	荣盛石化	2,700	26,082.00	0.02
171	603358	华达科技	900	25,965.00	0.02
172	688073	毕得医药	869	25,878.82	0.02
173	600887	伊利股份	1,000	25,840.00	0.01
174	301301	川宁生物	2,011	25,700.58	0.01
175	688472	阿特斯	2,503	25,480.54	0.01
176	600602	云赛智联	2,300	25,392.00	0.01
177	688008	澜起科技	444	25,379.04	0.01
178	601555	东吴证券	4,300	25,370.00	0.01
179	688279	峰昭科技	225	24,952.50	0.01
180	601866	中远海发	9,600	24,768.00	0.01
181	688249	晶合集成	1,683	24,689.61	0.01
182	601600	中国铝业	3,200	24,416.00	0.01
183	688099	晶晨股份	411	24,380.52	0.01
184	601020	华钰矿业	1,900	24,320.00	0.01
185	601089	福元医药	1,749	24,223.65	0.01
186	603380	易德龙	1,200	24,096.00	0.01
187	603102	百合股份	800	24,088.00	0.01
188	601668	中国建筑	4,500	23,895.00	0.01
189	688338	赛科希德	1,097	23,750.05	0.01
190	603650	彤程新材	800	23,640.00	0.01
191	688052	纳芯微	229	23,536.62	0.01
192	603379	三美股份	600	23,484.00	0.01
193	688533	上声电子	906	23,438.22	0.01
194	688639	华恒生物	306	23,375.34	0.01
195	601168	西部矿业	1,300	23,335.00	0.01
196	603163	圣晖集成	900	23,220.00	0.01
197	688627	精智达	500	23,210.00	0.01
198	600422	昆药集团	1,300	23,179.00	0.01
199	688628	优利德	705	23,102.85	0.01
200	688772	珠海冠宇	1,548	23,065.20	0.01
201	600583	海油工程	3,900	23,049.00	0.01
202	600262	北方股份	1,400	23,002.00	0.01
203	001213	中铁特货	5,818	22,981.10	0.01
204	603416	信捷电气	800	22,864.00	0.01
205	600529	山东药玻	900	22,806.00	0.01
206	688550	瑞联新材	983	22,795.77	0.01
207	600536	中国软件	760	22,739.20	0.01
208	000822	山东海化	3,900	22,737.00	0.01

209	600188	兖矿能源	1,000	22,730.00	0.01
210	301286	侨源股份	793	22,687.73	0.01
211	688114	华大智造	473	22,424.93	0.01
212	301487	盟固利	867	22,420.62	0.01
213	601799	星宇股份	200	22,408.00	0.01
214	688479	友车科技	1,410	22,404.90	0.01
215	001258	立新能源	3,188	22,092.84	0.01
216	603119	浙江荣泰	1,244	22,043.68	0.01
217	603739	蔚蓝生物	1,700	21,964.00	0.01
218	688595	芯海科技	728	21,840.00	0.01
219	000917	电广传媒	4,300	21,715.00	0.01
220	301515	港通医疗	1,133	21,685.62	0.01
221	002790	瑞尔特	2,400	21,672.00	0.01
222	001378	德冠新材	908	21,664.88	0.01
223	601083	锦江航运	2,252	21,529.12	0.01
224	002179	中航光电	565	21,498.25	0.01
225	600585	海螺水泥	900	21,231.00	0.01
226	605016	百龙创园	1,040	21,184.80	0.01
227	688107	安路科技	829	21,073.18	0.01
228	603112	华翔股份	2,000	21,020.00	0.01
229	688376	美埃科技	669	20,979.84	0.01
230	688205	德科立	727	20,944.87	0.01
231	688036	传音控股	273	20,895.42	0.01
232	688032	禾迈股份	182	20,889.96	0.01
233	300766	每日互动	2,100	20,769.00	0.01
234	603758	秦安股份	2,700	20,520.00	0.01
235	601133	柏诚股份	1,916	20,482.04	0.01
236	605377	华旺科技	1,540	20,405.00	0.01
237	603071	物产环能	1,627	20,386.31	0.01
238	688702	盛科通信-U	502	20,331.00	0.01
239	688608	恒玄科技	138	20,200.44	0.01
240	688031	星环科技-U	548	20,117.08	0.01
241	601865	福莱特	1,000	20,100.00	0.01
242	688062	迈威生物-U	694	20,084.36	0.01
243	688439	振华风光	300	19,935.00	0.01
244	001282	三联锻造	719	19,923.49	0.01
245	603193	润本股份	1,083	19,916.37	0.01
246	002234	民和股份	2,100	19,908.00	0.01
247	603885	吉祥航空	1,800	19,782.00	0.01
248	603137	恒尚节能	1,935	19,737.00	0.01
249	603172	万丰股份	1,220	19,715.20	0.01
250	688582	芯动联科	695	19,571.20	0.01
251	603344	星德胜	826	19,541.89	0.01

252	001308	康冠科技	867	19,507.50	0.01
253	688496	清越科技	2,105	19,450.20	0.01
254	603786	科博达	300	19,245.00	0.01
255	688676	金盘科技	369	19,243.35	0.01
256	688501	青达环保	1,400	19,152.00	0.01
257	688686	奥普特	299	19,144.97	0.01
258	603035	常熟汽饰	1,500	19,020.00	0.01
259	603373	安邦护卫	690	18,968.10	0.01
260	601065	江盐集团	2,172	18,831.24	0.01
261	688361	中科飞测	398	18,825.40	0.01
262	605088	冠盛股份	900	18,756.00	0.01
263	001227	兰州银行	7,868	18,725.84	0.01
264	001387	雪祺电气	1,210	18,724.50	0.01
265	300552	万集科技	500	18,690.00	0.01
266	688017	绿的谐波	227	18,636.70	0.01
267	603132	金徽股份	1,342	18,465.92	0.01
268	001337	四川黄金	795	18,451.95	0.01
269	600754	锦江酒店	800	18,384.00	0.01
270	605266	健之佳	708	18,372.60	0.01
271	001239	永达股份	1,321	18,335.48	0.01
272	601001	晋控煤业	1,100	18,172.00	0.01
273	600089	特变电工	1,300	18,031.00	0.01
274	600201	生物股份	2,500	18,025.00	0.01
275	300750	宁德时代	100	18,003.00	0.01
276	688377	迪威尔	1,372	17,973.20	0.01
277	688728	格科微	1,479	17,910.69	0.01
278	600373	中文传媒	1,200	17,808.00	0.01
279	603125	常青科技	1,034	17,795.14	0.01
280	601901	方正证券	2,300	17,779.00	0.01
281	600733	北汽蓝谷	2,200	17,776.00	0.01
282	603190	亚通精工	770	17,679.20	0.01
283	001326	联域股份	493	17,678.98	0.01
284	600570	恒生电子	1,000	17,660.00	0.01
285	603211	晋拓股份	1,287	17,644.77	0.01
286	603350	安乃达	858	17,640.48	0.01
287	603004	鼎龙科技	1,039	17,611.05	0.01
288	688776	国光电气	314	17,395.60	0.01
289	688488	艾迪药业	1,697	17,343.34	0.01
290	300623	捷捷微电	1,000	17,300.00	0.01
291	688041	海光信息	246	17,298.72	0.01
292	605598	上海港湾	774	17,097.66	0.01
293	688526	科前生物	1,161	17,055.09	0.01
294	603191	望变电气	1,149	17,005.20	0.01



295	603381	永臻股份	611	16,930.06	0.01
296	600984	建设机械	7,100	16,898.00	0.01
297	600446	金证股份	1,700	16,881.00	0.01
298	601155	新城控股	1,900	16,853.00	0.01
299	688362	甬矽电子	863	16,793.98	0.01
300	688049	炬芯科技	758	16,766.96	0.01
301	689009	九号公司-WD	455	16,748.55	0.01
302	688232	新点软件	848	16,722.56	0.01
303	688601	力芯微	381	16,645.89	0.01
304	688191	智洋创新	972	16,455.96	0.01
305	601138	工业富联	600	16,440.00	0.01
306	688691	灿芯股份	333	16,364.82	0.01
307	001338	永顺泰	1,649	16,160.20	0.01
308	603107	上海汽配	1,016	16,144.24	0.01
309	603728	鸣志电器	400	16,092.00	0.01
310	301120	新特电气	1,548	16,083.72	0.01
311	601689	拓普集团	300	16,083.00	0.01
312	603303	得邦照明	1,400	16,072.00	0.01
313	002871	伟隆股份	2,000	16,000.00	0.01
314	603082	北自科技	530	15,987.45	0.01
315	688518	联赢激光	955	15,948.50	0.01
316	603727	博迈科	1,200	15,792.00	0.01
317	688110	东芯股份	826	15,751.82	0.01
318	603197	保隆科技	500	15,750.00	0.01
319	600266	城建发展	4,200	15,708.00	0.01
320	603270	金帝股份	790	15,673.60	0.01
321	002334	英威腾	2,600	15,548.00	0.01
322	688088	虹软科技	536	15,468.96	0.01
323	688590	新致软件	1,193	15,389.70	0.01
324	688612	威迈斯	577	15,330.89	0.01
325	600456	宝钛股份	600	15,318.00	0.01
326	603206	嘉环科技	1,210	15,282.30	0.01
327	688012	中微公司	108	15,256.08	0.01
328	688536	思瑞浦	155	15,160.55	0.01
329	688100	威胜信息	397	15,145.55	0.01
330	301285	鸿日达	578	15,080.02	0.01
331	688116	天奈科技	652	15,048.16	0.01
332	603276	恒兴新材	1,076	14,999.44	0.01
333	001376	百通能源	804	14,970.48	0.01
334	001306	夏厦精密	277	14,955.23	0.01
335	688629	华丰科技	565	14,893.40	0.01
336	688596	正帆科技	447	14,751.00	0.01
337	301187	欧圣电气	606	14,695.50	0.01

338	603496	恒为科技	600	14,670.00	0.01
339	603375	盛景微	369	14,646.26	0.01
340	600850	电科数字	800	14,480.00	0.01
341	601121	宝地矿业	2,532	14,407.08	0.01
342	688323	瑞华泰	1,428	14,379.96	0.01
343	600707	彩虹股份	2,100	14,301.00	0.01
344	688592	司南导航	345	14,207.10	0.01
345	603486	科沃斯	300	14,154.00	0.01
346	603556	海兴电力	300	14,049.00	0.01
347	605333	沪光股份	500	13,925.00	0.01
348	688006	杭可科技	796	13,890.20	0.01
349	688326	经纬恒润-W	240	13,759.20	0.01
350	300723	一品红	700	13,755.00	0.01
351	603032	德新科技	1,200	13,716.00	0.01
352	001358	兴欣新材	668	13,707.36	0.01
353	001367	海森药业	585	13,653.90	0.01
354	301050	雷电微力	283	13,629.28	0.01
355	603325	博隆技术	198	13,604.04	0.01
356	603918	金桥信息	1,300	13,585.00	0.01
357	603233	大参林	948	13,556.40	0.01
358	688551	科威尔	430	13,545.00	0.01
359	600131	国网信通	800	13,496.00	0.01
360	301127	天源环保	1,135	13,415.70	0.01
361	301238	瑞泰新材	896	13,413.12	0.01
362	605289	罗曼股份	525	13,335.00	0.01
363	603799	华友钴业	600	13,278.00	0.01
364	003000	劲仔食品	1,100	13,255.00	0.01
365	688387	信科移动-U	2,618	13,194.72	0.01
366	301175	中科环保	3,005	13,191.95	0.01
367	600546	山煤国际	900	13,158.00	0.01
368	301029	怡合达	665	13,073.90	0.01
369	603285	键邦股份	697	12,999.05	0.01
370	301132	满坤科技	339	12,946.41	0.01
371	601975	招商南油	3,600	12,924.00	0.01
372	603629	利通电子	700	12,922.00	0.01
373	688535	华海诚科	188	12,881.76	0.01
374	688409	富创精密	348	12,855.12	0.01
375	688023	安恒信息	321	12,843.21	0.01
376	301259	艾布鲁	628	12,779.80	0.01
377	688270	臻镭科技	487	12,710.70	0.01
378	688120	华海清科	67	12,701.86	0.01
379	603312	西典新能	492	12,627.40	0.01
380	688029	南微医学	205	12,619.80	0.01

381	603009	北特科技	700	12,551.00	0.01
382	603153	上海建科	740	12,513.40	0.01
383	605599	菜百股份	980	12,475.40	0.01
384	688150	莱特光电	643	12,474.20	0.01
385	603019	中科曙光	300	12,450.00	0.01
386	301101	明月镜片	557	12,443.38	0.01
387	301327	华宝新能	217	12,434.10	0.01
388	300394	天孚通信	140	12,378.80	0.01
389	603075	热威股份	699	12,337.35	0.01
390	688197	首药控股-U	282	12,312.12	0.01
391	301141	中科磁业	379	12,222.75	0.01
392	601137	博威合金	800	12,192.00	0.01
393	000516	国际医学	2,600	12,168.00	0.01
394	603950	长源东谷	900	12,132.00	0.01
395	688131	皓元医药	633	12,109.29	0.01
396	603161	科华控股	800	11,976.00	0.01
397	688315	诺禾致源	1,088	11,880.96	0.01
398	688358	祥生医疗	457	11,868.29	0.01
399	601678	滨化股份	3,400	11,832.00	0.01
400	301311	昆船智能	640	11,763.20	0.01
401	603259	药明康德	300	11,757.00	0.01
402	001318	阳光乳业	1,142	11,751.18	0.01
403	000875	吉电股份	2,200	11,726.00	0.01
404	605090	九丰能源	400	11,600.00	0.01
405	688717	艾罗能源	243	11,554.65	0.01
406	603383	顶点软件	360	11,545.20	0.01
407	603151	邦基科技	1,000	11,540.00	0.01
408	603209	兴通股份	833	11,528.72	0.01
409	601958	金铂股份	1,100	11,451.00	0.01
410	600955	维远股份	794	11,441.54	0.01
411	688502	茂莱光学	123	11,440.23	0.01
412	001217	华尔泰	1,239	11,336.85	0.01
413	601021	春秋航空	200	11,266.00	0.01
414	301499	维科精密	494	11,228.62	0.01
415	603237	五芳斋	455	11,220.30	0.01
416	300188	国投智能	1,000	11,110.00	0.01
417	601801	皖新传媒	1,600	11,088.00	0.01
418	603348	文灿股份	400	11,076.00	0.01
419	688579	山大地纬	1,409	11,060.65	0.01
420	688325	赛微微电	352	11,042.24	0.01
421	301239	普瑞眼科	312	11,022.96	0.01
422	603219	富佳股份	739	10,907.64	0.01
423	688071	华依科技	503	10,900.01	0.01

424	001379	腾达科技	794	10,888.76	0.01
425	300941	创识科技	599	10,817.94	0.01
426	301348	蓝箭电子	355	10,788.45	0.01
427	688591	泰凌微	551	10,772.05	0.01
428	603162	海通发展	1,146	10,657.80	0.01
429	600963	岳阳林纸	2,900	10,643.00	0.01
430	301516	中远通	569	10,600.47	0.01
431	603278	大业股份	1,700	10,557.00	0.01
432	301095	广立微	255	10,485.60	0.01
433	001319	铭科精技	636	10,366.80	0.01
434	301272	英华特	268	10,339.44	0.01
435	603806	福斯特	700	10,290.00	0.01
436	301135	瑞德智能	480	10,219.20	0.01
437	688201	信安世纪	861	10,168.41	0.01
438	001229	魅视科技	347	10,121.99	0.01
439	688720	艾森股份	247	10,013.38	0.01
440	603040	新坐标	500	9,965.00	0.01
441	301293	三博脑科	264	9,950.16	0.01
442	600176	中国巨石	900	9,945.00	0.01
443	601595	上海电影	500	9,890.00	0.01
444	688682	霍莱沃	337	9,887.58	0.01
445	688478	晶升股份	339	9,871.68	0.01
446	600480	凌云股份	1,000	9,830.00	0.01
447	301328	维峰电子	264	9,744.24	0.01
448	002387	维信诺	1,600	9,728.00	0.01
449	603717	天域生态	1,600	9,696.00	0.01
450	688351	微电生理-U	435	9,587.40	0.01
451	601916	浙商银行	3,470	9,577.20	0.01
452	301222	浙江恒威	386	9,557.36	0.01
453	301510	固高科技	342	9,490.50	0.01
454	603062	麦加芯彩	283	9,398.43	0.01
455	603508	思维列控	500	9,375.00	0.01
456	603533	掌阅科技	500	9,335.00	0.01
457	001313	粤海饲料	1,232	9,264.64	0.01
458	603087	甘李药业	200	9,264.00	0.01
459	301578	辰奕智能	234	9,259.38	0.01
460	300866	安克创新	130	9,257.30	0.01
461	605577	龙版传媒	588	9,131.64	0.01
462	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.01
463	688173	希荻微	821	9,055.63	0.01
464	301517	陕西华达	166	8,964.00	0.01
465	688609	九联科技	1,016	8,961.12	0.01
466	688045	必易微	293	8,810.51	0.01

467	688443	智翔金泰-U	295	8,773.30	0.01
468	601928	凤凰传媒	800	8,768.00	0.01
469	688048	长光华芯	278	8,684.72	0.01
470	001300	三柏硕	763	8,675.31	0.01
471	002536	飞龙股份	900	8,568.00	0.00
472	301320	豪江智能	569	8,546.38	0.00
473	301358	湖南裕能	271	8,525.66	0.00
474	301317	鑫磊股份	545	8,469.30	0.00
475	301153	中科江南	299	8,449.74	0.00
476	688359	三孚新科	211	8,440.00	0.00
477	603057	紫燕食品	549	8,410.68	0.00
478	688507	索辰科技	172	8,359.20	0.00
479	600803	新奥股份	400	8,320.00	0.00
480	002840	华统股份	500	8,295.00	0.00
481	605580	恒盛能源	916	8,161.56	0.00
482	301298	东利机械	640	8,160.00	0.00
483	603220	中贝通信	300	8,148.00	0.00
484	301318	维海德	296	8,131.12	0.00
485	301200	大族数控	256	8,079.36	0.00
486	001296	长江材料	564	8,037.00	0.00
487	301359	东南电子	328	8,003.20	0.00
488	301508	中机认检	215	7,946.40	0.00
489	301217	铜冠铜箔	824	7,910.40	0.00
490	300962	中金辐照	576	7,856.64	0.00
491	600406	国电南瑞	312	7,787.52	0.00
492	301199	迈赫股份	322	7,785.96	0.00
493	600975	新五丰	1,100	7,777.00	0.00
494	603282	亚光股份	457	7,705.02	0.00
495	600011	华能国际	800	7,696.00	0.00
496	605020	永和股份	400	7,672.00	0.00
497	688238	和元生物	1,656	7,667.28	0.00
498	688152	麒麟信安	195	7,550.40	0.00
499	001266	宏英智能	346	7,515.12	0.00
500	300904	威力传动	188	7,514.36	0.00
501	688281	华秦科技	90	7,498.80	0.00
502	001278	一彬科技	473	7,478.13	0.00
503	001331	胜通能源	539	7,465.15	0.00
504	001222	源飞宠物	608	7,448.00	0.00
505	688573	信宇人	346	7,397.48	0.00
506	301163	宏德股份	364	7,396.48	0.00
507	603305	旭升集团	700	7,392.00	0.00
508	301193	家联科技	461	7,357.56	0.00
509	688253	英诺特	192	7,317.12	0.00

510	301526	国际复材	2,191	7,296.03	0.00
511	002833	弘亚数控	400	7,296.00	0.00
512	603280	南方路机	363	7,201.92	0.00
513	603176	汇通集团	1,924	7,176.52	0.00
514	300982	苏文电能	380	7,166.80	0.00
515	001366	播恩集团	645	7,159.50	0.00
516	300045	华力创通	400	7,060.00	0.00
517	001317	三羊马	300	7,047.00	0.00
518	001219	青岛食品	598	7,038.46	0.00
519	301048	金鹰重工	843	6,996.90	0.00
520	688707	振华新材	716	6,973.84	0.00
521	301156	美农生物	570	6,965.40	0.00
522	001268	联合精密	409	6,924.37	0.00
523	688458	美芯晟	258	6,914.40	0.00
524	688053	思科瑞	280	6,893.60	0.00
525	001368	通达创智	351	6,862.05	0.00
526	300073	当升科技	200	6,862.00	0.00
527	688680	海优新材	238	6,840.12	0.00
528	301138	华研精机	285	6,808.65	0.00
529	001299	美能能源	576	6,796.80	0.00
530	301566	达利凯普	400	6,788.00	0.00
531	301172	君逸数码	229	6,728.02	0.00
532	300975	商络电子	738	6,671.52	0.00
533	605566	福莱蒾特	435	6,625.05	0.00
534	301367	怡和嘉业	106	6,593.20	0.00
535	603291	联合水务	536	6,571.36	0.00
536	688308	欧科亿	336	6,525.12	0.00
537	301282	金禄电子	274	6,515.72	0.00
538	688435	英方软件	261	6,514.56	0.00
539	301381	赛维时代	282	6,409.86	0.00
540	301421	波长光电	147	6,354.81	0.00
541	002918	蒙娜丽莎	700	6,342.00	0.00
542	688631	莱斯信息	102	6,326.04	0.00
543	301268	铭利达	406	6,313.30	0.00
544	603150	万朗磁塑	250	6,260.00	0.00
545	001230	劲旅环境	450	6,250.50	0.00
546	301498	乖宝宠物	115	6,187.00	0.00
547	688290	景业智能	191	6,131.10	0.00
548	301391	卡莱特	140	6,129.20	0.00
549	688428	诺诚健华-U	755	6,123.05	0.00
550	603213	镇洋发展	799	5,976.52	0.00
551	301116	益客食品	664	5,929.52	0.00
552	688320	禾川科技	241	5,914.14	0.00

553	300952	恒辉安防	340	5,895.60	0.00
554	301151	冠龙节能	399	5,873.28	0.00
555	300996	普联软件	400	5,868.00	0.00
556	603231	索宝蛋白	344	5,861.76	0.00
557	300661	圣邦股份	70	5,794.60	0.00
558	301488	豪恩汽电	120	5,772.00	0.00
559	301190	善水科技	410	5,752.30	0.00
560	688248	南网科技	193	5,718.59	0.00
561	300693	盛弘股份	273	5,716.62	0.00
562	688562	航天软件	372	5,680.44	0.00
563	001234	泰慕士	333	5,657.67	0.00
564	300567	精测电子	100	5,651.00	0.00
565	301370	国科恒泰	519	5,641.53	0.00
566	301179	泽宇智能	288	5,604.48	0.00
567	301206	三元生物	228	5,604.24	0.00
568	300981	中红医疗	582	5,569.74	0.00
569	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
570	300978	东箭科技	593	5,473.39	0.00
571	301413	安培龙	132	5,458.20	0.00
572	301489	思泉新材	77	5,434.66	0.00
573	301152	天力锂能	222	5,347.98	0.00
574	301062	上海艾录	523	5,339.83	0.00
575	301036	双乐股份	205	5,334.10	0.00
576	301159	三维天地	200	5,334.00	0.00
577	301428	世纪恒通	184	5,280.80	0.00
578	301316	慧博云通	359	5,270.12	0.00
579	002049	紫光国微	100	5,260.00	0.00
580	605033	美邦股份	423	5,253.66	0.00
581	603296	华勤技术	95	5,246.85	0.00
582	300781	因赛集团	100	5,218.00	0.00
583	301591	肯特股份	141	5,214.18	0.00
584	301357	北方长龙	160	5,164.80	0.00
585	002460	赣锋锂业	180	5,157.00	0.00
586	688066	航天宏图	288	5,126.40	0.00
587	301270	汉仪股份	210	5,067.30	0.00
588	300950	德固特	329	5,013.96	0.00
589	688693	锆威特	138	4,956.96	0.00
590	301313	凡拓数创	241	4,904.35	0.00
591	300347	泰格医药	100	4,860.00	0.00
592	688652	京仪装备	124	4,847.16	0.00
593	301166	优宁维	179	4,833.00	0.00
594	688523	航天环宇	280	4,830.00	0.00
595	605567	春雪食品	629	4,818.14	0.00

596	688516	奥特维	115	4,808.15	0.00
597	301382	蜂助手	264	4,775.76	0.00
598	300056	中创环保	600	4,770.00	0.00
599	300987	川网传媒	391	4,746.74	0.00
600	301550	斯菱股份	99	4,743.09	0.00
601	301158	德石股份	383	4,737.71	0.00
602	301558	三态股份	561	4,706.79	0.00
603	301016	雷尔伟	275	4,628.25	0.00
604	688800	瑞可达	164	4,605.12	0.00
605	300967	晓鸣股份	507	4,598.49	0.00
606	002843	泰嘉股份	300	4,593.00	0.00
607	300979	华利集团	75	4,563.75	0.00
608	601952	苏垦农发	500	4,510.00	0.00
609	300998	宁波方正	201	4,419.99	0.00
610	000837	秦川机床	600	4,416.00	0.00
611	301507	民生健康	349	4,404.38	0.00
612	301002	崧盛股份	261	4,403.07	0.00
613	688648	中邮科技	201	4,389.84	0.00
614	301319	唯特偶	146	4,384.38	0.00
615	301297	富乐德	215	4,366.65	0.00
616	301565	中仑新材	229	4,346.42	0.00
617	601096	宏盛华源	1,062	4,343.58	0.00
618	603065	宿迁联盛	581	4,340.07	0.00
619	688539	高华科技	161	4,332.51	0.00
620	600025	华能水电	400	4,312.00	0.00
621	301533	威马农机	167	4,290.23	0.00
622	688512	慧智微-U	504	4,278.96	0.00
623	600508	上海能源	300	4,245.00	0.00
624	002819	东方中科	200	4,216.00	0.00
625	002459	晶澳科技	376	4,211.20	0.00
626	301555	惠柏新材	147	4,164.51	0.00
627	300339	润和软件	200	4,134.00	0.00
628	300943	春晖智控	383	4,132.57	0.00
629	605555	德昌股份	220	4,094.20	0.00
630	301459	丰茂股份	103	4,090.13	0.00
631	000426	兴业银锡	300	4,074.00	0.00
632	301025	读客文化	403	4,025.97	0.00
633	688695	中创股份	127	4,006.85	0.00
634	301261	恒工精密	108	4,003.56	0.00
635	301376	致欧科技	189	4,001.13	0.00
636	301502	华阳智能	105	3,972.15	0.00
637	603052	可川科技	140	3,941.00	0.00
638	002400	省广集团	800	3,880.00	0.00



639	688035	德邦科技	120	3,866.40	0.00
640	600276	恒瑞医药	100	3,846.00	0.00
641	301306	西测测试	99	3,831.30	0.00
642	301115	建科股份	275	3,817.00	0.00
643	688667	菱电电控	93	3,794.40	0.00
644	301568	思泰克	119	3,786.58	0.00
645	688456	有研粉材	141	3,760.47	0.00
646	002601	龙佰集团	200	3,714.00	0.00
647	688223	晶科能源	523	3,713.30	0.00
648	301418	协昌科技	92	3,680.00	0.00
649	301383	天键股份	140	3,656.80	0.00
650	300803	指南针	100	3,641.00	0.00
651	605138	盛泰集团	723	3,622.23	0.00
652	688400	凌云光	217	3,619.56	0.00
653	688620	安凯微	442	3,597.88	0.00
654	301007	德迈仕	303	3,539.04	0.00
655	002169	智光电气	800	3,528.00	0.00
656	301269	华大九天	45	3,467.25	0.00
657	301032	新柴股份	513	3,442.23	0.00
658	300855	图南股份	130	3,437.20	0.00
659	301221	光庭信息	94	3,353.92	0.00
660	688119	中钢洛耐	1,015	3,339.35	0.00
661	301267	华夏眼科	160	3,315.20	0.00
662	688019	安集科技	26	3,270.80	0.00
663	300570	太辰光	100	3,266.00	0.00
664	688671	碧兴物联	156	3,233.88	0.00
665	000921	海信家电	100	3,224.00	0.00
666	301100	风光股份	248	3,221.52	0.00
667	300331	苏大维格	200	3,216.00	0.00
668	300958	建工修复	300	3,189.00	0.00
669	688737	中自科技	196	3,175.20	0.00
670	600522	中天科技	200	3,170.00	0.00
671	688425	铁建重工	861	3,168.48	0.00
672	002101	广东鸿图	300	3,159.00	0.00
673	600511	国药股份	100	3,079.00	0.00
674	002414	高德红外	520	3,062.80	0.00
675	000949	新乡化纤	900	3,060.00	0.00
676	000915	华特达因	100	3,016.00	0.00
677	600489	中金黄金	200	2,960.00	0.00
678	301170	锡南科技	113	2,943.65	0.00
679	300342	天银机电	200	2,926.00	0.00
680	002929	润建股份	100	2,911.00	0.00
681	300926	博俊科技	145	2,902.90	0.00

682	300774	倍杰特	444	2,899.32	0.00
683	003038	鑫铂股份	196	2,894.92	0.00
684	301325	曼恩斯特	67	2,842.14	0.00
685	002472	双环传动	126	2,774.52	0.00
686	003021	兆威机电	60	2,769.00	0.00
687	300596	利安隆	100	2,713.00	0.00
688	300229	拓尔思	200	2,686.00	0.00
689	300942	易瑞生物	443	2,653.57	0.00
690	300814	中富电路	80	2,583.20	0.00
691	000831	中国稀土	100	2,535.00	0.00
692	601012	隆基绿能	180	2,523.60	0.00
693	688419	耐科装备	84	2,513.28	0.00
694	300890	翔丰华	100	2,495.00	0.00
695	002041	登海种业	300	2,424.00	0.00
696	002876	三利谱	100	2,412.00	0.00
697	688237	超卓航科	119	2,385.95	0.00
698	301349	信德新材	84	2,321.76	0.00
699	002606	大连电瓷	300	2,253.00	0.00
700	603273	天元智能	120	2,202.00	0.00
701	000920	沃顿科技	300	2,199.00	0.00
702	688247	宣泰医药	267	2,194.74	0.00
703	001311	多利科技	90	2,176.20	0.00
704	688276	百克生物	75	2,127.75	0.00
705	301337	亚华电子	77	2,123.66	0.00
706	600223	福瑞达	300	2,121.00	0.00
707	301155	海力风电	52	2,091.96	0.00
708	301091	深城交	77	2,089.78	0.00
709	002858	力盛体育	200	2,080.00	0.00
710	688255	凯尔达	99	1,984.95	0.00
711	688722	同益中	176	1,969.44	0.00
712	300327	中颖电子	100	1,968.00	0.00
713	600820	隧道股份	300	1,959.00	0.00
714	300548	博创科技	100	1,949.00	0.00
715	601456	国联证券	200	1,928.00	0.00
716	688148	芳源股份	457	1,923.97	0.00
717	688268	华特气体	36	1,857.96	0.00
718	301219	腾远钴业	47	1,798.22	0.00
719	301046	能辉科技	90	1,770.30	0.00
720	301220	亚香股份	68	1,735.36	0.00
721	688231	隆达股份	120	1,711.20	0.00
722	002568	百润股份	100	1,683.00	0.00
723	001269	欧晶科技	60	1,668.00	0.00
724	001336	楚环科技	74	1,616.90	0.00

725	603666	亿嘉和	100	1,578.00	0.00
726	000913	钱江摩托	100	1,576.00	0.00
727	000960	锡业股份	100	1,549.00	0.00
728	300611	美力科技	200	1,524.00	0.00
729	001324	长青科技	94	1,522.80	0.00
730	688353	华盛锂电	86	1,492.96	0.00
731	301015	百洋医药	62	1,458.86	0.00
732	002756	永兴材料	40	1,431.20	0.00
733	002345	潮宏基	300	1,416.00	0.00
734	603130	云中马	80	1,411.20	0.00
735	301021	英诺激光	90	1,411.20	0.00
736	600673	东阳光	200	1,408.00	0.00
737	300752	隆利科技	100	1,358.00	0.00
738	301133	金钟股份	60	1,307.40	0.00
739	301227	森鹰窗业	68	1,279.08	0.00
740	300252	金信诺	200	1,250.00	0.00
741	002456	欧菲光	160	1,249.60	0.00
742	000948	南天信息	100	1,235.00	0.00
743	688141	杰华特	75	1,212.00	0.00
744	600746	江苏索普	200	1,178.00	0.00
745	600866	星湖科技	200	1,104.00	0.00
746	301377	鼎泰高科	62	1,088.10	0.00
747	000690	宝新能源	200	1,020.00	0.00
748	301150	中一科技	53	952.41	0.00
749	301012	扬电科技	38	940.88	0.00
750	603048	浙江黎明	64	929.28	0.00
751	002668	TCL 智家	100	906.00	0.00
752	301136	招标股份	72	848.16	0.00
753	301180	万祥科技	54	844.56	0.00
754	600684	珠江股份	300	789.00	0.00
755	688292	浩瀚深度	51	788.46	0.00
756	301277	新天地	60	778.80	0.00
757	688678	福立旺	69	747.27	0.00
758	300858	科拓生物	50	736.00	0.00
759	300986	志特新材	105	710.85	0.00
760	002037	保利联合	100	705.00	0.00
761	002340	格林美	100	637.00	0.00
762	300253	卫宁健康	100	590.00	0.00
763	002753	永东股份	100	581.00	0.00
764	300968	格林精密	62	574.12	0.00
765	002448	中原内配	100	574.00	0.00
766	301126	达嘉维康	62	559.86	0.00
767	301052	果麦文化	27	553.50	0.00

768	301069	凯盛新材	39	511.29	0.00
769	000589	贵州轮胎	100	507.00	0.00
770	600409	三友化工	100	502.00	0.00
771	000785	居然之家	200	486.00	0.00
772	300993	玉马遮阳	49	438.06	0.00
773	000630	铜陵有色	100	361.00	0.00
774	001330	博纳影业	64	346.24	0.00
775	301020	密封科技	21	332.22	0.00
776	300997	欢乐家	28	330.96	0.00
777	300994	久祺股份	24	263.76	0.00
778	301078	孩子王	51	258.06	0.00
779	301118	恒光股份	15	223.65	0.00
780	600376	首开股份	100	210.00	0.00
781	002724	海洋王	20	89.00	0.00
782	000733	振华科技	1	41.53	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	000338	潍柴动力	6,798,654.00	3.43
2	603920	世运电路	5,405,480.00	2.73
3	000528	柳工	4,857,203.00	2.45
4	603129	春风动力	4,754,247.00	2.40
5	600150	中国船舶	4,101,295.00	2.07
6	688575	亚辉龙	3,925,848.10	1.98
7	601872	招商轮船	3,615,745.43	1.82
8	601666	平煤股份	3,532,102.00	1.78
9	300634	彩讯股份	3,415,841.00	1.72
10	000400	许继电气	3,293,545.00	1.66
11	600547	山东黄金	3,235,864.60	1.63
12	002920	德赛西威	3,130,437.00	1.58
13	000682	东方电子	3,114,343.40	1.57
14	600031	三一重工	2,813,844.00	1.42
15	688617	惠泰医疗	2,641,218.33	1.33
16	601766	中国中车	2,627,742.00	1.33
17	300498	温氏股份	2,618,379.00	1.32
18	600027	华电国际	2,616,415.00	1.32
19	601006	大秦铁路	2,568,813.00	1.30
20	603477	巨星农牧	2,434,114.00	1.23

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	603596	伯特利	6,420,147.80	3.24
2	300634	彩讯股份	3,777,981.00	1.91
3	000426	兴业银锡	3,612,597.00	1.82
4	603920	世运电路	3,358,397.00	1.69
5	601006	大秦铁路	3,136,846.00	1.58
6	002840	华统股份	2,894,632.00	1.46
7	688533	上声电子	2,732,658.54	1.38
8	603477	巨星农牧	2,628,500.00	1.33
9	002920	德赛西威	2,468,307.00	1.25
10	002371	北方华创	2,396,585.00	1.21
11	600480	凌云股份	2,311,912.00	1.17
12	688418	震有科技	2,266,036.51	1.14
13	300796	贝斯美	2,188,102.00	1.10
14	688008	澜起科技	2,185,718.38	1.10
15	000404	长虹华意	2,162,321.00	1.09
16	600566	济川药业	2,127,803.00	1.07
17	301345	涛涛车业	2,091,280.00	1.06
18	603129	春风动力	2,042,392.00	1.03
19	000338	潍柴动力	1,984,546.00	1.00
20	688595	芯海科技	1,930,042.10	0.97

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	317,895,498.53
卖出股票收入（成交）总额	329,991,509.94

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**

本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****7.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

**7.11.2 本期国债期货投资评价**

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

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

本基金投资的前十名证券中本期没有发行主体被监管部门立案调查的、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

**7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库**

本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券备选库。

**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	32,048.67
2	应收清算款	17,663.08
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	41,356.86
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	91,068.61

**7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

注：无。

**7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

注：无。

## 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，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 (%)
6,421	10,811.91	7,468,391.07	10.76	61,954,879.75	89.24

### 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	57,278.76	0.0825

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	0~10

注：1、截至本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研

究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 (2012 年 4 月 16 日) 基金份额总额	334,825,290.98
本报告期期初基金份额总额	73,454,340.16
本报告期基金总申购份额	2,216,007.36
减：本报告期基金总赎回份额	6,247,076.70
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	69,423,270.82

## § 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：

无。

### 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未受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 (%)	
光大证券	2	285,258,042.06	44.07	260,160.44	44.53	-
华创证券	1	89,311,066.81	13.80	82,283.17	14.08	-
中金公司	1	52,380,595.51	8.09	48,259.89	8.26	-
长江证券	1	36,651,681.38	5.66	33,773.68	5.78	-
广发证券	1	32,734,976.67	5.06	26,499.20	4.54	-
国信证券	1	22,201,457.77	3.43	20,453.68	3.50	-
天风证券	1	19,422,270.62	3.00	17,893.30	3.06	-
国泰君安	1	19,242,183.15	2.97	11,641.55	1.99	-
招商证券	1	19,102,027.14	2.95	17,604.17	3.01	-
中信证券	1	17,952,661.97	2.77	16,540.60	2.83	-
国投证券	1	17,114,645.18	2.64	15,768.97	2.70	-
方正证券	1	13,835,038.40	2.14	12,948.13	2.22	-
中信建投证券	1	10,757,751.07	1.66	9,910.33	1.70	-

银河证券	1	5,778,597.14	0.89	5,322.10	0.91	-
中金财富	1	5,561,814.80	0.86	5,205.34	0.89	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
东方财富证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
瑞信方正	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	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必要，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 (%)
光大证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	9,370,000.00	34.24	-	-
国信证券	-	-	8,761,000.00	32.02	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	9,233,000.00	33.74	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-

高华证 券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-
瑞信方 正	-	-	-	-	-	-
瑞银证 券	-	-	-	-	-	-
上海证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源证券	-	-	-	-	-	-
西部证 券	-	-	-	-	-	-
湘财证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
中航证 券	-	-	-	-	-	-
中泰证 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	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购博隆技术首次公开发行 A 股的公告	《中国证券报》、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 04 日
2	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《中国证券报》、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
3	鹏华价值精选股票型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	《中国证券报》、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 19 日
4	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	《中国证券报》、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
5	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	《中国证券报》、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
6	鹏华基金管理有限公司高级管理人员	《中国证券报》、基金	2024 年 02 月 08 日

	员变更公告	管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	
7	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	《中国证券报》、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
8	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	《中国证券报》、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
9	鹏华价值精选股票型证券投资基金 2023 年年度报告	《中国证券报》、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
10	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	《中国证券报》、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
11	鹏华价值精选股票型证券投资基金更新的招募说明书	《中国证券报》、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 10 日
12	鹏华价值精选股票型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	《中国证券报》、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 10 日
13	鹏华基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《中国证券报》、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
14	鹏华基金管理有限公司关于董事长变更的公告	《中国证券报》、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
15	鹏华价值精选股票型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	《中国证券报》、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
16	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《中国证券报》、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
17	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	《中国证券报》、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
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	《中国证券报》、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
19	鹏华价值精选股票型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	《中国证券报》、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 28 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)《鹏华价值精选股票型证券投资基金基金合同》；
- (二)《鹏华价值精选股票型证券投资基金托管协议》；
- (三)《鹏华价值精选股票型证券投资基金 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