

鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资
基金
2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 3 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 03 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）注册会计师对本基金出具了“标准无保留意见”的审计报告。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 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	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	9
3.4 过去三年基金的利润分配情况	10
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	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	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	15
4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	16
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	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	16
§ 6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
§ 7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	19
7.3 净资产变动表	21
7.4 报表附注	23

§ 8 投资组合报告	79
8.1 期末基金资产组合情况.....	79
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	80
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	81
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	95
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	97
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	97
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	97
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	97
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	97
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	97
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	97
8.12 投资组合报告附注.....	97
§ 9 基金份额持有人信息	99
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	99
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	99
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	100
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	100
9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况.....	100
§ 10 开放式基金份额变动	100
§ 11 重大事件揭示	100
11.1 基金份额持有人大会决议.....	100
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	100
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	100
11.4 基金投资策略的改变.....	101
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	101
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	101
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	101
11.8 其他重大事件.....	102
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	105
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	105
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	105
§ 13 备查文件目录	105
13.1 备查文件目录.....	105
13.2 存放地点.....	105
13.3 查阅方式.....	105

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	中证 500
场内简称	中证 500ETF 鹏华
基金主代码	159982
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 11 月 21 日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
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	1,020,211,253.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2020 年 2 月 20 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	<p>本基金采用被动式指数化投资方法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。当预期成份股发生调整或成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。本基金力争将日均跟踪偏离度控制在 0.2% 以内，年跟踪误差控制在 2% 以内。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。</p> <p>1、股票投资策略（1）股票投资组合的构建 本基金在建仓期内，将按照标的指数各成份股的基准权重对其逐步买入，在力求跟踪误差最小化的前提下，本基金可采取适当方法，以降低买入成本。当遇到成份股停牌、流动性不足等其他市场因素而无法依指数权重购买某成份股及预期标的指数的成份股即将调整或其他影响指数复制的因素时，本基金可以根据市场情况，结合研究分析，对基金财产进行适当调整，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。（2）股票投资组合的调整 本基金所构建的股票投资组合将根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况，对其进行适时调整，以保证基金份额净值增长率与标的指数收益率间的高度正相关和跟踪误差最小化。基金管理人将对成份股的流动性进行分析，如发现流动性欠佳的个股将可能采用合理方法寻求替代。由于受到各项持股比例限制，基金可能不能按照成份股权重持有成份股，基金将会采用合理方法寻求替代。1)定</p>

	<p>期调整 根据标的指数的调整规则和备选股票的预期,对股票投资组合及时进行调整。 2) 不定期调整 根据指数编制规则,当标的指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重新调整时,本基金将根据各成份股的权重变化进行相应调整; 根据本基金的申购和赎回情况,对股票投资组合进行调整,从而有效跟踪标的指数; 根据法律、法规规定,成份股在标的指数中的权重因其它特殊原因发生相应变化的,本基金可以对投资组合管理进行适当变通和调整,力求降低跟踪误差。 (3) 存托凭证投资策略 本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略,基于对基础证券投资价值的深入研究判断,进行存托凭证的投资。 2、债券投资策略 本基金债券投资组合将采用自上而下的投资策略,根据宏观经济分析、资金面动向分析等判断未来利率变化,并利用债券定价技术,进行个券选择。 3、股指期货投资策略 本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约,提高投资效率,从而更好地跟踪标的指数,实现投资目标。同时,本基金将力争利用股指期货的杠杆作用,降低申购赎回时现金资产对投资组合的影响及仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差,从而达到稳定投资组合资产净值的目的。 基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组,授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项,同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。 4、资产支持证券的投资策略 本基金将综合运用战略资产配置和战术资产配置进行资产支持证券的投资组合管理,并根据信用风险、利率风险和流动性风险变化积极调整投资策略,严格遵守法律法规和基金合同的约定,在保证本金安全和基金资产流动性的基础上获得稳定收益。 5、参与融资及转融通证券出借业务策略 本基金可在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素基础上,参与融资业务。 为更好地实现投资目标,在加强风险防范并遵守审慎经营原则的前提下,本基金可根据投资管理的需要参与转融通证券出借业务。本基金将在分析市场环境、投资者类型与结构、基金历史申赎情况、出借证券流动性情况等因素的基础上,合理确定出借证券的范围、期限和比例。 本基金将密切跟踪国内关于基金参与融券业务法律法规的实施进展,待允许本基金参与融券业务的相关规定颁布后,将在届时相应法律法规的框架内,参与融券业务。 未来,随着证券市场投资工具的发展和丰富,本基金可相应调整和更新相关投资策略,并在招募说明书中更新公告。</p>
业绩比较基准	中证 500 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金,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。同时本基金为交易型开放式指数基金,具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。

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	中国工商银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	高永杰	郭明
	联系电话	0755-81395402	(010)66105799
	电子邮箱	xxpl@phfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4006788999	95588
传真		0755-82021126	(010)66105798
注册地址		深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		518048	100140
法定代表人		何如	陈四清

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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.phfund.com.cn
基金年度报告备置地点	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层鹏华基金管理有限公司

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023 年	2022 年	2021 年
本期已实现收益	-9,375,798.69	-36,201,345.74	66,718,205.35
本期利润	-50,992,011.41	-73,275,949.53	78,185,237.29
加权平均基金份额本期利润	-0.1226	-0.2733	0.3329
本期加权平均净值利润率	-8.73%	-18.83%	21.86%
本期基金份额净值增长率	-4.57%	-17.29%	25.13%

3.1.2 期末数据和指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
期末可供分配利润	337,273,132.92	99,455,200.03	137,431,525.33
期末可供分配基金份额利润	0.3306	0.3943	0.5918
期末基金资产净值	1,357,484,385.92	351,666,453.03	391,430,855.45
期末基金份额净值	1.3306	1.3943	1.6857
3.1.3 累计期末指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
基金份额累计净值增长率	33.06%	39.43%	68.57%

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

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

(3) 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润期末余额和未分配利润中已实现部分的期末余额的孰低数。表中的“期末”均指报告期最后一日，即 12 月 31 日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

3.2 基金净值表现

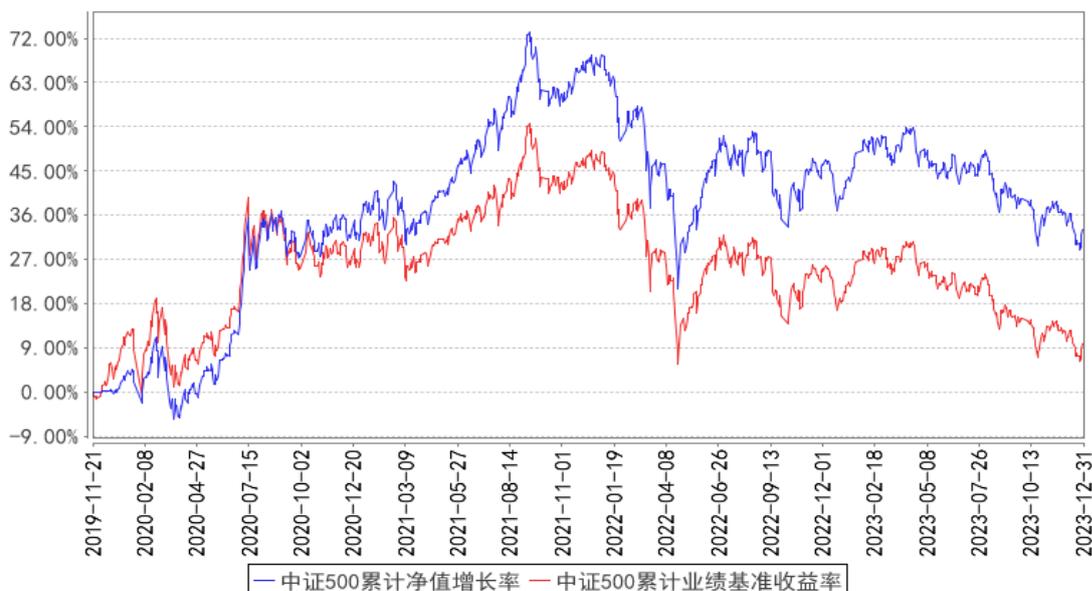
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-4.60%	0.85%	-4.60%	0.86%	0.00%	-0.01%
过去六个月	-8.39%	0.84%	-9.49%	0.86%	1.10%	-0.02%
过去一年	-4.57%	0.81%	-7.42%	0.82%	2.85%	-0.01%
过去三年	-1.23%	1.06%	-14.73%	1.08%	13.50%	-0.02%
自基金合同生效起至今	33.06%	1.16%	9.76%	1.23%	23.30%	-0.07%

注：业绩比较基准=中证 500 指数收益率

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

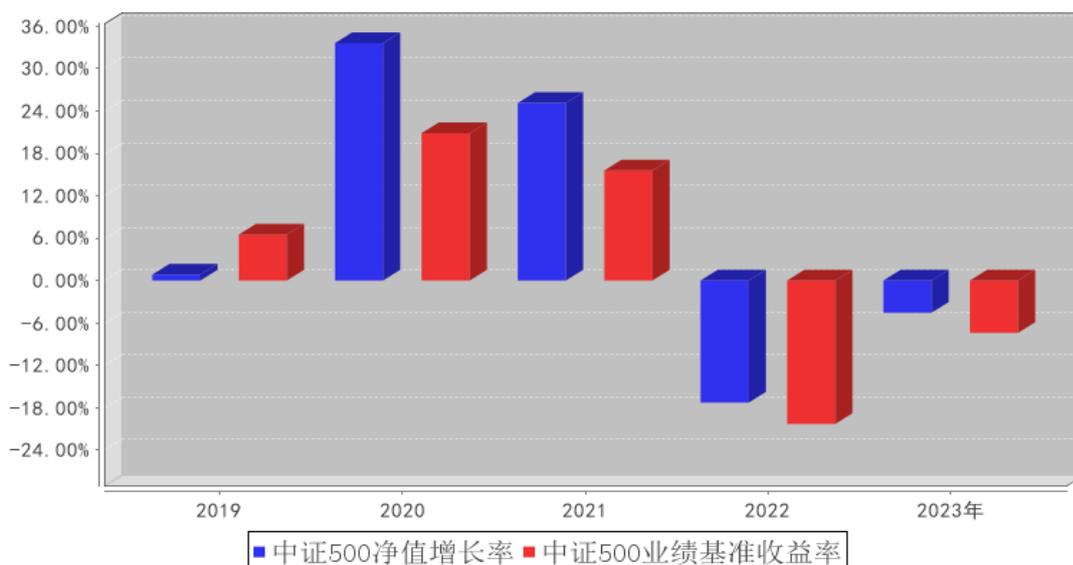
中证500累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2019 年 11 月 21 日生效。2、截至建仓期结束，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中证500基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按照实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 其他指标

注：无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

注：无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

鹏华基金管理有限公司成立于 1998 年 12 月 22 日，业务范围包括基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。截至本报告期末，公司股东由国信证券股份有限公司、意大利欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）、深圳市北融信投资发展有限公司组成，公司性质为中外合资企业，公司注册资本 15,000 万元人民币。截至本报告期末，公司管理资产总规模达到 11052 亿元，313 只公募基金、13 只全国社保投资组合、7 只基本养老保险投资组合。经过 20 余年投资管理基金，在基金投资、风险控制等方面积累了丰富经验。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈龙	基金经理	2019-11-21	-	14 年	陈龙先生，国籍中国，经济学硕士，14 年证券从业经验。曾任杭州衡泰软件公司金融工程师，2009 年 12 月加盟鹏华基金管理有限公司，历任监察稽核部金融工程总监助理、量化及衍生品投资部量化研究总监助理，先后从事金融工程、量化研究等工作，现任量化及衍生品投资部量化研究副总经理、基金经理。2015 年 09 月至 2018 年 05 月担任鹏华国证钢铁行业指数分级证券投资基金基金经理，2016 年 07 月至 2018 年 04 月担任鹏华创业板指数分级证券投资基金基金经理，2016 年 09 月至 2018 年 04 月担任鹏华中证 800 地产指数分级证券投资基金基金经理，2016 年 09 月至 2018 年 05 月担任鹏华港股通中证香港中小企业投资主题指数证券投资基金（LOF）基金经理，2016 年 10 月至 2018 年 04 月担任鹏华中证移动互联网指数分级证券投资基金基金经理，2019 年 03 月至今担任鹏华中证空天一体军工指数证券投资基金（LOF）基金经理，2019 年 03 月至 2020 年 12 月担任鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金经理，2019 年 03 月至 2020 年 12

				<p>月担任鹏华中证 800 证券保险指数分级证券投资基金基金经理, 2019 年 11 月至今担任鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2019 年 12 月至 2022 年 10 月担任鹏华国证证券龙头交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2020 年 01 月至今担任鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理, 2021 年 01 月至 2022 年 10 月担任鹏华中证 800 证券保险指数型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2021 年 01 月至今担任鹏华中证国防指数型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2021 年 01 月至 2022 年 10 月担任鹏华中证全指证券公司指数型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2021 年 02 月至今担任鹏华中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2022 年 08 月至今担任鹏华中证国防交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2023 年 02 月至今担任鹏华国证疫苗与生物科技交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2023 年 07 月至今担任鹏华国证粮食产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 陈龙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。</p>
--	--	--	--	---

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注: 无。

4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《鹏华基金管理有限公司公平交易管理规定》，将公司所管理的封闭式基金、开放式基金、社保组合、养老组合、特定客户资产管理组合等不同资产组合的授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动均纳入公平交易管理，在业务流程和岗位职责中制定公平交易的控制规则和控制活动，建立对公平交易的执行、监督及审核流程，严禁在不同投资组合之间进行利益输送。

在投资研究环节：1、公司使用唯一的研究报告发布平台“研究报告管理平台”，确保各投资组合在获得投资信息、研究支持、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；2、公司严格按照《股票库管理规定》、《信用债券投资与风险控制管理规定》，执行股票及信用产品出入库及日常维护工作，确保相关证券入库以内容严谨、观点明确的研究报告作为依据；3、在公司股票库基础上，各涉及股票投资的资产组合根据各自的投资目标、投资风格、投资范围和防范关联交易的原则分别建立资产组合股票库，基金经理在股票库基础上根据投资授权以及基金合同择股方式构建具体的投资组合；4、严格执行投资授权制度，明确投资决策委员会、分管投资副总裁、基金经理等各主体的职责和权限划分，合理确定基金经理的投资权限，超过投资权限的操作，应严格履行审批程序。

在交易执行环节：1、所有公司管理的资产组合的交易必须通过集中交易室完成，集中交易室负责建立和执行交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会；2、针对交易所公开竞价交易，集中交易室应严格启用恒生交易系统中的公平交易程序，交易系统则自动启用公平交易功能，由系统按照“未委托数量”的比例对不同资产组合进行委托量的公平分配；如果相关基金经理坚持以不同的价格进行交易，且当前市场价格不能同时满足多个资产组合的指令价格要求时，交易系统自动按照“价格优先”原则进行委托；当市场价格同时满足多个资产组合的指令价格要求时，则交易系统自动按照“同一指令价格下的公平交易”模式，进行公平委托和交易量分配；3、银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易需依据公司《股票投资交易流程》和《固定收益投资管理流程》的规定执行；银行间市场交易、交易所大宗交易等以公司名义进行的交易，各投资组合经理应在交易前独立确定各投资组合的交易价格和数量，公司按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；4、新股、新债申购及非公开定向增发交易需依据公司《新股申购流程》、《固定收益投资管理流程》和《非公开定向增发流程》的规定执行，对新股和新债申购方案和分配过程进行审核和监控。

在交易监控、分析与评估环节：1、为加强对日常投资交易行为的监控和管理，杜绝利益输送、

不公平交易等违规交易行为，防范日常交易风险，公司明确了关注类交易的界定及对应的监控和评估措施机制；所监控的交易包括但不限于：交易所公开竞价交易中同日同向交易的交易时机和交易价差、不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差、关联交易、债券交易收益率偏离度、成交量和成交价格异常、银行间债券交易对手交易等；2、将公平交易作为投资组合业绩归因分析和交易绩效评价的重要关注内容，发现的异常情况由投资监察员进行分析；3、风控管理部分别于每季度和每年度编写《公平交易执行情况检查报告》，内容包括关注类交易监控执行情况、不同投资组合的整体收益率差异分析和同向交易价差分析。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金秉承指数基金的投资策略，在应对基金申购赎回的基础上，力争跟踪指数的收益，并将基金跟踪误差控制在合理范围内。

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-4.57%，同期业绩比较基准增长率为-7.42%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2023 年，市场对宏观经济的判断经历了从年初的“强预期、强现实”到 2、3 季度的“强预期、弱现实”，再到年末的“弱预期、弱现实”，所以实际大类资产价格的表现与年初的预期也出现了较大的偏差。之所以会有如此大的转变，我们认为核心有两个因素：一是年初制定的全年经济增长目标为 5%左右，考虑到 2022 年的经济增速仅 3%，所以两年复合增速仅 4%左右，应该是低于了潜在的经济增速；二是经济目标的达成更多依靠市场主体内生的修复动能，政策整体保持定力，尤其是财政政策在二季度呈现了一定的收缩的态势。从微观主体的感受来看，与宏观数据存

在一定的背离，最终体现到上市公司的业绩层面上也是相应承压的。从这个角度看，大类资产的表现总体还是较为合理的反映了经济基本面的状况。

展望 2024 年，从总量的视角，近期各地方政府陆续召开两会，经济大省的全年经济目标基本上都定在 5%左右或以下，这也奠定全国总量经济增长目标为 5%左右，显著高于去年的目标；其次，2023 年 10 月，全国人大常委会批准 1 万亿国债增发额度，将 2023 年的财政赤字率由 3%提升至 3.8%，开启了中央政策加杠杆的模式，打开了今年财政政策的想象空间，更高的经济增长目标也会倒逼财政政策更加积极。结构的视角，房地产周期下行、“消费降级”以及高端制造行业产能过剩带来的对上市公司盈利的压制仍然会存续，叠加市场增量资金相对匮乏，全年来看，A 股依然难以出现趋势性的机会。考虑到年初以来，受流动性冲击，市场已经出现较大幅度的调整，风险释放较为充分，后续应该更加积极关注结构性的机会。

投资策略方面，哑铃策略在当前的市场环境下依然适用，低估值、高股息资产可以作为防御属性的底仓配置，而弹性的方向可以有三个思路：一是周期反转，比如光伏新能源、畜牧及国防军工等，前两者关注产能出清带来的反转，后者关注新一轮订单周期的落地；二是创新驱动，包括算力、AI 应用、智能驾驶、机器人等泛 AI，以及创新药等；三是全球化出海，重点关注新能源车等。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人继续完善内部控制、提升风险管理水平，着重开展了以下各项工作：

1、继续完善内部控制体系

公司根据法律法规、监管要求及业务发展需求，不断优化现有的标准化业务流程体系，强调业务流程服务于加强风险防范和提升运营效率，通过信息技术手段持续提升业务操作的系统化程度，并不断优化。

2、规范基金销售业务，保证基金销售业务的合法合规性

报告期内，在基金募集和持续营销活动中，公司严格规范基金销售业务，按照《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及相关法规规定审查宣传推介材料，逐步落实反洗钱法律法规各项要求，并督促销售部门做好投资者教育工作。

3、开展以风险为导向的内部稽核

报告期内，监察稽核部开展了对信息技术管理、投资相关流程、员工行为、反洗钱业务、子公司管理和公司日常运作的定期监察稽核与专项监察稽核。监察稽核人员开展了以风险为导向的内部稽核，通过稽核发现提高了公司标准化操作流程的执行效率，优化了标准化操作流程手册。报告期内，公司未发生重大风险事件。

此外，在投资日常合规监控工作方面，公司根据法律法规和产品特点进一步完善了投资合规风控制度流程及投资监控系统，加强对投资限制的监控提示；持续完善公平交易、异常交易等监测管控机制，在实现交易价差分析、银行间交易分析、研究报告检查等专项检查工作定期化、日常化的基础上，公司多次开展有关内幕交易、未公开信息等重要内容的合规培训，进一步强化全体投研人员的合规意识。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1、截止本报告期末，本基金期末可供分配利润为 337,273,132.92 元，期末基金份额净值 1.3306 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。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，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——鹏华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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对鹏华基金管理有限公司编制和披露的本基金 2023 年年度报告中财务指标、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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2024)第 25636 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“中证 500ETF 基金”)的财务报表,包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表,2023 年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了中证 500ETF 基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>

<p>形成审计意见的基础</p>	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于中证 500ETF 基金，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
<p>强调事项</p>	<p>无。</p>
<p>其他事项</p>	<p>无。</p>
<p>其他信息</p>	<p>无。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>中证 500ETF 基金的基金管理人鹏华基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估中证 500ETF 基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算中证 500ETF 基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督中证 500ETF 基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对中证 500ETF 基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使</p>

	<p>用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致中证 500ETF 基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	单峰 仲文渊
会计师事务所的地址	中国上海市
审计报告日期	2024 年 3 月 25 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	29,911,463.16	9,213,589.85
结算备付金		14,103,710.79	8,550,735.13
存出保证金		4,156,109.56	1,915,009.33
交易性金融资产	7.4.7.2	1,311,390,087.66	332,510,595.62
其中：股票投资		1,311,390,087.66	332,510,595.62
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		2,941,864.11	217,033.45
应收股利		-	1,485.00

应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	66,927.13	10,632.64
资产总计		1,362,570,162.41	352,419,081.02
负债和净资产	附注号	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		550,119.12	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		192,763.68	46,139.47
应付托管费		64,254.56	15,379.84
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		10,092.54	1,603.98
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	4,268,546.59	689,504.70
负债合计		5,085,776.49	752,627.99
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	1,020,211,253.00	252,211,253.00
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	337,273,132.92	99,455,200.03
净资产合计		1,357,484,385.92	351,666,453.03
负债和净资产总计		1,362,570,162.41	352,419,081.02

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.3306 元，基金份额总额 1,020,211,253.00 份。

7.2 利润表

会计主体：鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年1月1日至2023 年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
一、营业总收入		-49,490,458.68	-72,170,586.30
1. 利息收入		1,269,167.53	766,429.89
其中：存款利息收入	7.4.7.13	145,474.76	138,095.40
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		-	-
其他利息收入		1,123,692.77	628,334.49
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-10,078,799.60	-38,616,734.80
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-15,005,745.07	-42,890,622.26
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	-	-
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-1,498,332.92	-1,607,348.44
股利收益	7.4.7.19	6,425,278.39	5,881,235.90
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.20	-41,616,212.72	-37,075,218.93
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	935,386.11	2,754,937.54
减：二、营业总支出		1,501,552.73	1,105,363.23
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	856,316.12	600,672.20
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	285,438.79	200,224.07
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		4,521.41	1,647.90
8. 其他费用	7.4.7.23	355,276.41	302,819.06
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-50,992,011.41	-73,275,949.53
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-50,992,011.41	-73,275,949.53
五、其他综合收益的税后净额		-	-

六、综合收益总额		-50,992,011.41	-73,275,949.53
----------	--	----------------	----------------

7.3 净资产变动表

会计主体：鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	252,211,253.00	-	99,455,200.03	351,666,453.03
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	252,211,253.00	-	99,455,200.03	351,666,453.03
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	768,000,000.00	-	237,817,932.89	1,005,817,932.89
(一)、综合收益总额	-	-	-50,992,011.41	-50,992,011.41
(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)	768,000,000.00	-	288,809,944.30	1,056,809,944.30
其中：1. 基金申购款	1,008,000,000.00	-	373,017,540.93	1,381,017,540.93
2. 基金赎回款	-240,000,000.00	-	-84,207,596.63	-324,207,596.63
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-

四、本期期末净资产	1,020,211,253.00	-	337,273,132.92	1,357,484,385.92
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	232,211,253.00	-	159,219,602.45	391,430,855.45
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	232,211,253.00	-	159,219,602.45	391,430,855.45
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	20,000,000.00	-	-59,764,402.42	-39,764,402.42
(一)、综合收益总额	-	-	-73,275,949.53	-73,275,949.53
(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)	20,000,000.00	-	13,511,547.11	33,511,547.11
其中：1. 基金申购款	562,000,000.00	-	225,813,527.39	787,813,527.39
2. 基金赎回款	-542,000,000.00	-	-212,301,980.28	-754,301,980.28
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	252,211,253.00	-	99,455,200.03	351,666,453.03

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

邓召明

基金管理人负责人

邢彪

主管会计工作负责人

郝文高

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]第 1504 号《关于准予鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》核准,由鹏华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,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 490,173,730.00 元(含募集股票市值),经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2019)第 0669 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2019 年 11 月 21 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 490,211,253.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 37,523.00 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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、《资产管理产品相关会计处理规定》(财会[2022]14 号)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和基金净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具；即不包含付款的合同义务且享有发行人净资产和剩余收益的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具（主要为股票投资）按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金在投资人申购、赎回过程中而待与投资人结算的可退替代款分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，在资产负债表中的其他负债科目下列示。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑在资产负债表日无须付出不必要的额外成本和努力即可获得有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金在前一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形的，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本基金利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、基金投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份

额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4)除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税(和/或)股票交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将

投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率或者发行价计算的利息及在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

本基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司（以下简称“证金公司”）出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息以及出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为当期损益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费(如有)在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

以摊余成本计量的负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，本基金可以进行收益分配。在符合有关基金收益分配条件的前提下，每次收益分配比例根据以下原则确定：使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补亏损为前提，收益分配后基金份额净值有可能低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产

生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 税项

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2023 年 12 月 31 日	2022 年 12 月 31 日
活期存款	29,911,463.16	9,213,589.85
等于：本金	29,908,496.90	9,212,753.75
加：应计利息	2,966.26	836.10
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	29,911,463.16	9,213,589.85

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2023 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动

股票		1,369,483,930.69	-	1,311,390,087.66	-58,093,843.03
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		1,369,483,930.69	-	1,311,390,087.66	-58,093,843.03
项目	上年度末 2022年12月31日				
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		348,962,105.93	-	332,510,595.62	-16,451,510.31
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		348,962,105.93	-	332,510,595.62	-16,451,510.31

注：股票投资的公允价值和股票投资的公允价值变动均含可退替代款估值增值。

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

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	

权益衍生工具	32,929,840.00	-	-	-
其中：股指期货投资	32,929,840.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	32,929,840.00	-	-	-
项目	上年度末 2022年12月31日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	12,217,160.00	-	-	-
其中：股指期货投资	12,217,160.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	12,217,160.00	-	-	-

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2403	IC2403	30.00	32,487,600.00	-442,240.00
合计				-442,240.00
减：可抵销期货暂收款				-442,240.00
净额				0.00

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

7.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
应收利息	-	-
其他应收款	66,927.13	10,632.64
待摊费用	-	-
合计	66,927.13	10,632.64

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	1,223,276.18	492,477.78
其中：交易所市场	1,223,276.18	492,477.78
银行间市场	-	-

应付利息	-	-
预提费用	166,000.00	162,000.00
应付指数使用费	83,382.52	35,026.92
应退替代款	2,795,887.89	-
合计	4,268,546.59	689,504.70

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	252,211,253.00	252,211,253.00
本期申购	1,008,000,000.00	1,008,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-240,000,000.00	-240,000,000.00
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	1,020,211,253.00	1,020,211,253.00

注：投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购、赎回单位的整数倍。

7.4.7.11 其他综合收益

注：无。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	132,021,027.38	-32,565,827.35	99,455,200.03
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	132,021,027.38	-32,565,827.35	99,455,200.03
本期利润	-9,375,798.69	-41,616,212.72	-50,992,011.41
本期基金份额交易产生的变动数	423,574,539.05	-134,764,594.75	288,809,944.30
其中：基金申购款	553,380,256.23	-180,362,715.30	373,017,540.93
基金赎回款	-129,805,717.18	45,598,120.55	-84,207,596.63
本期已分配利润	-	-	-
本期末	546,219,767.74	-208,946,634.82	337,273,132.92

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
活期存款利息收入	51,616.57	45,786.67
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	91,812.16	90,839.00
其他	2,046.03	1,469.73
合计	145,474.76	138,095.40

注：其他包含认/申购款利息收入、结算保证金利息收入、风控金利息收入等

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-8,957,785.99	-16,440,540.39
股票投资收益——赎回差价收入	-6,047,959.08	-26,450,081.87
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	-15,005,745.07	-42,890,622.26

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
卖出股票成交总额	504,246,680.17	591,770,852.11
减：卖出股票成本总额	511,415,743.08	606,372,415.90
减：交易费用	1,788,723.08	1,838,976.60
买卖股票差价收入	-8,957,785.99	-16,440,540.39

7.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
赎回基金份额对价总额	324,207,596.63	754,301,980.28
减：现金支付赎回款总额	165,204,123.63	413,983,287.28
减：赎回股票成本总额	165,051,432.08	366,768,774.87
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	-6,047,959.08	-26,450,081.87

7.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：无。

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12 月31日
股指期货投资收益	-1,498,332.92	-1,607,348.44

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月 31日
股票投资产生的股利收益	6,425,278.39	5,881,235.90
其中：证券出借权益补偿收入	536,986.29	644,640.39
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	6,425,278.39	5,881,235.90

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
1. 交易性金融资产	-41,642,332.72	-36,435,985.14
股票投资	-41,642,332.72	-36,435,985.14

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	26,120.00	-644,360.00
权证投资	-	-
期货投资	26,120.00	-644,360.00
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-5,126.21
合计	-41,616,212.72	-37,075,218.93

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	935,386.11	2,754,937.54
合计	935,386.11	2,754,937.54

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购(赎回)本基金时，补入(卖出)被替代成分证券的实际买入成本(实际卖出金额)与申购(赎回)确认日估值的差额或强制退款的被替代成分证券在强制退款计算日与申购(赎回)确认日估值的差额。

7.4.7.22 信用减值损失

注：无。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
审计费用	46,000.00	42,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费用	597.00	669.00
指数使用费	188,382.52	140,026.92
存托服务费	296.89	123.14
合计	355,276.41	302,819.06

7.4.7.24 分部报告

无。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
鹏华基金管理有限公司(“鹏华基金公司”)	基金管理人
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人
国信证券股份有限公司(“国信证券”)	基金管理人的股东、基金的一级交易商
深圳市北融信投资发展有限公司	基金管理人的股东
意大利欧利盛资本资产管理股份公司(“Eurizon Capital SGR S.p.A.”)	基金管理人的股东
鹏华资产管理有限公司(“鹏华资产”)	基金管理人的子公司
鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(“鹏华中证 500ETF 联接”)	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：1、本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

2、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
国信证券	336,565,840.03	22.23	11,979,212.79	0.99

7.4.10.1.2 债券交易

注：无。

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

7.4.10.1.4 权证交易

注：无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
国信证券	310,129.03	22.25	260,194.15	21.27
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
国信证券	11,017.95	0.99	240.29	0.05

注：（1）佣金的计算公式

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

（佣金比率按照与一般证券公司签订的协议条款订立。）

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

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 12月31日
	当期发生的基金应支付的管理费	856,316.12
其中：应支付销售机构的客户维护 费	9,384.07	4,143.12
应支付基金管理人的净管理费	846,932.05	596,529.08

注：1、支付基金管理人鹏华基金公司的管理人报酬年费率为 0.15%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×0.15%÷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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	285,438.79	200,224.07

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.05%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×0.05%/当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

单位：人民币元

本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
-	-	-	-	-
上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
国信证券	11,935,260.00	8,312.46	-	-

注：（1）转融券金额为出借证券按照成交当日该证券收盘价计算的市值（展期转融券金额为按展期日该证券收盘价计算的市值）。

（2）转融券费用的计算公式为：每笔转融券费用=出借证券出借日或者展期日收盘价×该笔交易出借证券数量或者展期证券数量×该笔交易出借日或者展期日转融券费率×实际占用天数/360（计尾不计头）。

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

单位：人民币元

本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日						
关联方名称	交易金额	费率区间 (%)	加权平均费率 (%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额

国信证券	3,995,050.00	2.00~3.20	2.66	4,122.07	187,000.00	153.92
上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日						
关联方名称	交易金额	费率区间 (%)	加权平均费率 (%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
国信证券	3,926,019.00	3.20	3.20	5,100.03	11,360.00	7.98

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：无。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2023年12月31日		上年度末 2022年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)
鹏华中证500ETF联接	832,254,037.00	81.58	62,577,637.00	24.81

注：除基金管理人以外的其他关联方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。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	29,911,463.16	51,616.57	9,213,589.85	45,786.67

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

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
本期 2023年1月1日至2023年12月31日					
国信证券	603270	金帝股份	网下申购	1,542	33,569.34
国信证券	688307	中润光学	网下申购	2,455	58,625.40
国信证券	688562	航天软件	网下申购	6,732	85,361.76
国信证券	301488	豪恩汽电	网下申购	2,244	89,266.32

上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
国信证券	301338	凯格精机	网下申购	2,568	118,975.44
国信证券	688401	路维光电	网下申购	4,947	124,070.76
国信证券	688231	隆达股份	网下申购	3,308	129,276.64
国信证券	301161	唯万密封	网下申购	3,460	64,563.60
国信证券	688244	永信至诚	网下申购	1,506	74,080.14

注：本表包含参与基金托管人的关联方承销证券的情况。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

注：无。

7.4.12 期末（2023 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001239	永达股份	2023 年 12 月 4 日	6 个月	新股流通受限	12.05	19.92	189	2,277.45	3,764.88	-
001306	夏厦精密	2023 年 11 月 9 日	6 个月	新股流通受限	53.63	75.36	64	3,432.32	4,823.04	-
001326	联域股份	2023 年 11 月 1 日	6 个月	新股流通受限	41.18	48.64	99	4,076.82	4,815.36	-
001358	兴欣新材	2023 年 12 月 14 日	6 个月	新股流通受限	41.00	44.16	87	3,567.00	3,841.92	-
001378	德冠	2023 年 10 月	6 个月	新股流通	31.68	31.27	182	5,765.76	5,691.14	-

	新材	月 23 日		受限						
300904	威力传动	2023 年8月 2日	6个月	新股 流通 受限	35.41	61.53	304	10,764.64	18,705.12	-
301172	君逸数码	2023 年7月 19日	6个月	新股 流通 受限	31.33	38.16	438	13,722.54	16,714.08	-
301202	朗威股份	2023 年6月 28日	6个月	新股 流通 受限	25.82	31.80	283	7,307.06	8,999.40	-
301251	威尔高	2023 年8月 30日	6个月	新股 流通 受限	28.88	34.59	260	7,508.80	8,993.40	-
301261	恒工精密	2023 年6月 29日	6个月	新股 流通 受限	36.90	50.85	195	7,195.50	9,915.75	-
301272	英华特	2023 年7月 6日	6个月	新股 流通 受限	51.39	53.38	173	8,890.47	9,234.74	-
301291	明阳电气	2023 年6月 21日	6个月	新股 流通 受限	38.13	28.36	393	14,985.09	11,145.48	-
301292	海科新源	2023 年6月 29日	6个月	新股 流通 受限	19.99	19.35	571	11,414.29	11,048.85	-
301329	信音电子	2023 年7月 5日	6个月	新股 流通 受限	21.00	22.23	354	7,434.00	7,869.42	-
301348	蓝箭电子	2023 年8月 1日	6个月	新股 流通 受限	18.08	44.57	613	11,083.04	27,321.41	-
301370	国科恒泰	2023 年7月 3日	6个月	新股 流通 受限	13.39	16.01	951	12,733.89	15,225.51	-

301371	敷尔佳	2023年7月24日	6个月	新股流通受限	55.68	37.58	177	9,855.36	6,651.66	-
301381	赛维时代	2023年7月5日	6个月	新股流通受限	20.45	29.69	506	10,347.70	15,023.14	-
301393	昊帆生物	2023年7月5日	6个月	新股流通受限	67.68	59.37	141	9,542.88	8,371.17	-
301413	安培龙	2023年12月11日	6个月	新股流通受限	33.25	58.19	164	5,453.00	9,543.16	-
301418	协昌科技	2023年8月10日	6个月	新股流通受限	51.88	50.20	176	9,130.88	8,835.20	-
301421	波长光电	2023年8月16日	6个月	新股流通受限	29.38	59.37	281	8,255.78	16,682.97	-
301456	盘古智能	2023年7月6日	6个月	新股流通受限	37.96	30.39	251	9,527.96	7,627.89	-
301459	丰茂股份	2023年12月6日	6个月	新股流通受限	31.90	39.84	208	6,635.20	8,286.72	-
301486	致尚科技	2023年6月30日	6个月	新股流通受限	57.66	47.25	228	13,146.48	10,773.00	-
301487	盟固利	2023年8月1日	6个月	新股流通受限	5.32	40.96	867	4,612.44	35,512.32	-
301488	豪恩光电	2023年6月26日	6个月	新股流通受限	39.78	69.09	225	8,950.50	15,545.25	-
301489	思泉	2023年10	6个月	新股流通	41.66	64.11	128	5,332.48	8,206.08	-

	新材	月 16 日		受限						
301498	乖宝宠物	2023 年 8 月 9 日	6 个月	新股流通受限	39.99	38.81	222	8,877.78	8,615.82	-
301499	维科精密	2023 年 7 月 13 日	6 个月	新股流通受限	19.50	28.93	371	7,234.50	10,733.03	-
301500	飞南资源	2023 年 9 月 13 日	6 个月	新股流通受限	23.97	20.89	298	7,143.06	6,225.22	-
301505	苏州规划	2023 年 7 月 12 日	6 个月	新股流通受限	26.35	35.81	194	5,111.90	6,947.14	-
301507	民生健康	2023 年 8 月 24 日	6 个月	新股流通受限	10.00	15.85	678	6,780.00	10,746.30	-
301508	中机认检	2023 年 11 月 23 日	6 个月	新股流通受限	16.82	26.68	419	7,047.58	11,178.92	-
301510	固高科技	2023 年 8 月 4 日	6 个月	新股流通受限	12.00	35.01	396	4,752.00	13,863.96	-
301511	德福科技	2023 年 8 月 8 日	6 个月	新股流通受限	28.00	22.67	402	11,256.00	9,113.34	-
301515	港通医疗	2023 年 7 月 13 日	6 个月	新股流通受限	31.16	28.27	222	6,917.52	6,275.94	-
301516	中远通	2023 年 12 月 1 日	6 个月	新股流通受限	6.87	15.51	604	4,149.48	9,368.04	-
301517	陕西华	2023 年 10 月 9 日	6 个月	新股流通受限	26.87	43.69	185	4,970.95	8,082.65	-

	达									
301518	长 华 化 学	2023 年7月 26日	6个月	新股 流通 受限	25.75	23.01	361	9,295.75	8,306.61	-
301519	舜 禹 股 份	2023 年7月 19日	6个月	新股 流通 受限	20.93	20.21	426	8,916.18	8,609.46	-
301520	万 邦 医 药	2023 年9月 18日	6个月	新股 流通 受限	67.88	52.74	150	10,182.00	7,911.00	-
301525	儒 竞 科 技	2023 年8月 23日	6个月	新股 流通 受限	99.57	81.46	75	7,467.75	6,109.50	-
301526	国 际 复 材	2023 年12 月19 日	6个月	新股 流通 受限	2.66	4.45	9,723	25,863.18	43,267.35	-
301528	多 浦 乐	2023 年8月 17日	6个月	新股 流通 受限	71.80	68.91	148	10,626.40	10,198.68	-
301529	福 赛 科 技	2023 年8月 31日	6个月	新股 流通 受限	36.60	37.88	182	6,661.20	6,894.16	-
301533	威 马 农 机	2023 年8月 7日	6个月	新股 流通 受限	29.50	33.16	225	6,637.50	7,461.00	-
301548	崇 德 科 技	2023 年9月 11日	6个月	新股 流通 受限	66.80	58.99	102	6,813.60	6,016.98	-
301550	斯 菱 股 份	2023 年9月 6日	6个月	新股 流通 受限	37.56	43.57	194	7,286.64	8,452.58	-
301555	惠 柏 新 材	2023 年10 月24 日	6个月	新股 流通 受限	22.88	32.44	224	5,125.12	7,266.56	-

301558	三态股份	2023年9月21日	6个月	新股流通受限	7.33	13.40	1,079	7,909.07	14,458.60	-
301559	中集环科	2023年9月26日	6个月	新股流通受限	24.22	18.24	365	8,840.30	6,657.60	-
301566	达利凯普	2023年12月22日	6个月	新股流通受限	8.90	22.14	576	5,126.40	12,752.64	-
301568	思泰克	2023年11月21日	6个月	新股流通受限	23.23	35.58	246	5,714.58	8,752.68	-
301578	辰奕智能	2023年12月21日	6个月	新股流通受限	48.94	68.32	118	5,774.92	8,061.76	-
601083	锦江航运	2023年11月28日	6个月	新股流通受限	11.25	11.07	796	8,955.00	8,811.72	-
601096	宏盛华源	2023年12月15日	6个月	新股流通受限	1.70	4.06	3,918	6,660.60	15,907.08	-
603004	鼎龙科技	2023年12月20日	6个月	新股流通受限	16.80	31.19	195	3,276.00	6,082.05	-
603062	麦加芯彩	2023年10月31日	6个月	新股流通受限	58.08	57.81	60	3,484.80	3,468.60	-
603075	热威股份	2023年9月1日	6个月	新股流通受限	23.10	23.31	157	3,626.70	3,659.67	-
603107	上海汽配	2023年10月25日	6个月	新股流通受限	14.23	18.19	203	2,888.69	3,692.57	-

603119	浙江荣泰	2023年7月21日	6个月	新股流通受限	15.32	23.87	184	2,818.88	4,392.08	-
603193	润本股份	2023年10月9日	6个月	新股流通受限	17.38	16.66	211	3,667.18	3,515.26	-
603231	索宝蛋白	2023年12月6日	6个月	新股流通受限	21.29	21.53	161	3,427.69	3,466.33	-
603270	金帝股份	2023年8月25日	6个月	新股流通受限	21.77	29.58	155	3,374.35	4,584.90	-
603273	天元智能	2023年10月16日	6个月	新股流通受限	9.50	18.97	178	1,691.00	3,376.66	-
603276	恒兴新材	2023年9月18日	6个月	新股流通受限	25.73	24.88	134	3,447.82	3,333.92	-
603296	华勤技术	2023年8月1日	6个月	新股流通受限	80.80	77.75	127	10,261.60	9,874.25	-
603373	安邦护卫	2023年12月13日	6个月	新股流通受限	19.10	34.75	88	1,680.80	3,058.00	-
688450	光格科技	2023年7月17日	6个月	新股流通受限	53.09	36.42	139	7,379.51	5,062.38	-
688548	广钢气体	2023年8月8日	6个月	新股流通受限	9.87	12.75	1,129	11,143.23	14,394.75	-
688549	中巨芯-U	2023年8月30日	6个月	新股流通受限	5.18	8.09	1,696	8,785.28	13,720.64	-

688563	航材股份	2023年7月12日	6个月	新股流通受限	78.99	60.49	216	17,061.84	13,065.84	-
688573	信宇人	2023年8月9日	6个月	新股流通受限	23.68	28.80	285	6,748.80	8,208.00	-
688582	芯动联科	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	26.74	38.67	304	8,128.96	11,755.68	-
688591	泰凌微	2023年8月18日	6个月	新股流通受限	24.98	28.02	439	10,966.22	12,300.78	-
688602	康鹏科技	2023年7月13日	6个月	新股流通受限	8.66	11.06	737	6,382.42	8,151.22	-
688603	天承科技	2023年6月30日	6个月	新股流通受限	55.00	74.14	140	7,700.00	10,379.60	-
688612	威迈斯	2023年7月19日	6个月	新股流通受限	47.29	37.97	163	7,708.27	6,189.11	-
688627	精智达	2023年7月11日	6个月	新股流通受限	46.77	87.72	184	8,605.68	16,140.48	-
688638	誉辰智能	2023年7月4日	6个月	新股流通受限	83.90	59.68	111	9,312.90	6,624.48	-
688646	逸飞激光	2023年7月21日	6个月	新股流通受限	46.80	36.07	219	10,249.20	7,899.33	-
688648	中邮科技	2023年11月6日	6个月	新股流通受限	15.18	21.43	303	4,599.54	6,493.29	-
688651	盛邦安全	2023年7月19日	6个月	新股流通受限	39.90	46.05	178	7,102.20	8,196.90	-

688652	京仪装备	2023年11月22日	6个月	新股流通受限	31.95	52.25	416	13,291.20	21,736.00	-
688653	康希通信	2023年11月10日	6个月	新股流通受限	10.50	15.99	648	6,804.00	10,361.52	-
688657	浩辰软件	2023年9月25日	6个月	新股流通受限	103.40	78.23	83	8,582.20	6,493.09	-
688671	碧兴物联	2023年8月2日	6个月	新股流通受限	36.12	34.30	226	8,163.12	7,751.80	-
688693	锆威特	2023年8月10日	6个月	新股流通受限	40.83	43.41	178	7,267.74	7,726.98	-
688702	盛科通信-U	2023年9月6日	6个月	新股流通受限	42.66	48.18	172	7,337.52	8,286.96	-
688716	中研股份	2023年9月13日	6个月	新股流通受限	29.66	36.39	243	7,207.38	8,842.77	-
688719	爱科赛博	2023年9月20日	6个月	新股流通受限	69.98	60.10	120	8,397.60	7,212.00	-
688720	艾森股份	2023年11月29日	6个月	新股流通受限	28.03	49.84	165	4,624.95	8,223.60	-

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

2、基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自

发行结束之日起约定限售期内不得转让。

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

4、基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后 6 个月内不得转让。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
400174	中天3	2023年08月30日	重大事项	0.11	-	-	286,500	500,813.56	31,515.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值单价	数量(单位:股)	期末估值总额
1	000009	中国宝安	2024年1月4日	11.74	51,200	601,088.00
2	000021	深科技	2024年1月2日-2024年1月12日	16.21	36,400	590,044.00
3	000027	深圳能源	2024年1月4日-2024年1月12日	6.45	46,100	297,345.00
4	000031	大悦城	2024年1月2日-2024年1月12日	2.97	50,200	149,094.00
5	000039	中集集团	2024年1月11日	7.65	38,300	292,995.00
6	000060	中金岭南	2024年1月4日-2024年1月12日	4.32	29,000	125,280.00
7	000066	中国长城	2024年1月2日	10.12	50,900	515,108.00
8	000155	川能动力	2024年1月2日-2024年1月11日	13.29	34,100	453,189.00
9	000156	华数传	2024年1月11日	7.37	37,800	278,586.00

		煤				0
10	000400	许继电气	2024年1月10日-2024年1月12日	21.96	15,300	335,988.00
11	000401	冀东水泥	2024年1月2日-2024年1月9日	6.39	33,100	211,509.00
12	000402	金融街	2024年1月2日-2024年1月11日	3.63	38,000	137,940.00
13	000519	中兵红箭	2024年1月2日	14.04	8,000	112,320.00
14	000537	中绿电	2024年1月4日-2024年1月8日	9.63	22,900	220,527.00
15	000539	粤电力A	2024年1月9日-2024年1月11日	4.89	36,400	177,996.00
16	000547	航天发展	2024年1月4日	8.37	12,000	100,440.00
17	000553	安道麦A	2024年1月2日-2024年1月8日	6.94	17,900	124,226.00
18	000559	万向钱潮	2024年1月2日-2024年1月5日	5.19	49,700	257,943.00
19	000563	陕国投A	2024年1月3日	3.04	94,700	287,888.00
20	000581	威孚高科	2024年1月10日-2024年1月12日	15.07	17,400	262,218.00
21	000591	太阳能	2024年1月2日-2024年1月12日	5.58	80,000	446,400.00
22	000598	兴蓉环境	2024年1月2日-2024年1月11日	5.69	45,400	258,326.00
23	000623	吉林敖东	2024年1月2日-2024年1月3日	15.14	40,000	605,600.00
24	000629	钒钛股份	2024年1月2日-2024年1月11日	3.28	175,200	574,656.00
25	000636	风华高科	2024年1月2日-2024年1月10日	13.66	36,600	499,956.00
26	000703	恒逸石化	2024年1月4日	6.72	74,800	502,656.00
27	000723	美锦能源	2024年1月9日	6.66	21,700	144,522.00
28	000739	普洛药业	2024年1月2日-2024年1月8日	15.39	16,600	255,474.00
29	000831	中国稀土	2024年1月2日-2024年1月12日	27.67	26,000	719,420.00
30	000878	云南铜业	2024年1月4日	10.89	10,000	108,900.00
31	000883	湖北能	2024年1月4日-2024年	4.23	64,600	273,258.00

		源	1月10日			0
32	000887	中鼎股份	2024年1月2日-2024年1月12日	12.37	32,200	398,314.00
33	000893	亚钾国际	2024年1月9日	26.24	1,000	26,240.00
34	000898	鞍钢股份	2024年1月2日	2.49	29,000	72,210.00
35	000930	中粮科技	2024年1月2日-2024年1月8日	6.64	38,400	254,976.00
36	000933	神火股份	2024年1月2日	16.80	27,000	453,600.00
37	000937	冀中能源	2024年1月2日-2024年1月12日	7.14	41,400	295,596.00
38	000967	盈峰环境	2024年1月4日-2024年1月8日	4.75	52,300	248,425.00
39	000970	中科三环	2024年1月4日-2024年1月11日	10.35	39,000	403,650.00
40	000975	银泰黄金	2024年1月2日-2024年1月12日	15.00	74,000	1,110,000.00
41	000987	越秀资本	2024年1月10日-2024年1月11日	6.02	20,000	120,400.00
42	000988	华工科技	2024年1月2日-2024年1月10日	29.76	31,800	946,368.00
43	000997	新大陆	2024年1月2日-2024年1月4日	19.61	4,000	78,440.00
44	000998	隆平高科	2024年1月2日-2024年1月9日	14.10	48,700	686,670.00
45	001286	陕西能源	2024年1月2日-2024年1月4日	8.55	40,600	347,130.00
46	001872	招商港口	2024年1月4日	15.96	7,000	111,720.00
47	001914	招商积余	2024年1月10日	11.96	5,000	59,800.00
48	002008	大族激光	2024年1月2日-2024年1月5日	20.72	37,000	766,640.00
49	002010	传化智联	2024年1月2日-2024年1月4日	4.62	32,100	148,302.00
50	002019	亿帆医药	2024年1月4日	14.78	7,000	103,460.00
51	002028	思源电气	2024年1月4日-2024年1月12日	52.04	23,800	1,238,552.00
52	002030	达安基因	2024年1月9日	9.68	30,000	290,400.00
53	002032	苏泊尔	2024年1月3日	53.01	5,400	286,254.00

						0
54	002056	横店东磁	2024年1月4日	13.54	8,000	108,320.00
55	002065	东华软件	2024年1月2日-2024年1月4日	6.17	88,200	544,194.00
56	002078	太阳纸业	2024年1月2日	12.17	16,800	204,456.00
57	002080	中材科技	2024年1月4日-2024年1月12日	15.92	26,000	413,920.00
58	002092	中泰化学	2024年1月4日	6.10	16,000	97,600.00
59	002120	韵达股份	2024年1月9日	7.46	57,000	425,220.00
60	002128	电投能源	2024年1月2日	14.27	10,000	142,700.00
61	002131	利欧股份	2024年1月2日-2024年1月12日	2.28	283,800	647,064.00
62	002138	顺络电子	2024年1月2日-2024年1月5日	27.01	27,300	737,373.00
63	002152	广电运通	2024年1月4日	12.26	1,100	13,486.00
64	002153	石基信息	2024年1月4日	9.74	19,700	191,878.00
65	002155	湖南黄金	2024年1月9日	11.14	34,300	382,102.00
66	002156	通富微电	2024年1月2日-2024年1月5日	23.12	36,900	853,128.00
67	002192	融捷股份	2024年1月4日-2024年1月8日	54.21	8,100	439,101.00
68	002195	岩山科技	2024年1月2日-2024年1月4日	3.07	81,000	248,670.00
69	002203	海亮股份	2024年1月3日	11.15	26,600	296,590.00
70	002240	盛新锂能	2024年1月4日-2024年1月12日	22.75	25,000	568,750.00
71	002244	滨江集团	2024年1月2日-2024年1月12日	7.27	55,300	402,031.00
72	002262	恩华药业	2024年1月9日	27.12	10,000	271,200.00
73	002266	浙富控股	2024年1月8日	3.40	1,000	3,400.00
74	002268	电科网安	2024年1月2日	22.46	2,300	51,658.00
75	002273	水晶光	2024年1月2日-2024年	13.54	32,000	433,280.00

		电	1月11日			0
76	002281	光迅科技	2024年1月2日-2024年1月12日	28.50	15,400	438,900.00
77	002294	信立泰	2024年1月2日-2024年1月10日	32.66	20,900	682,594.00
78	002326	永太科技	2024年1月2日-2024年1月11日	11.62	29,800	346,276.00
79	002340	格林美	2024年1月4日	5.46	10,000	54,600.00
80	002353	杰瑞股份	2024年1月9日	28.11	20,000	562,200.00
81	002368	太极股份	2024年1月2日	29.53	1,100	32,483.00
82	002372	伟星新材	2024年1月8日	14.47	32,700	473,169.00
83	002373	千方科技	2024年1月3日-2024年1月4日	11.21	11,100	124,431.00
84	002384	东山精密	2024年1月4日	18.18	6,000	109,080.00
85	002399	海普瑞	2024年1月2日-2024年1月5日	11.73	17,300	202,929.00
86	002407	多氟多	2024年1月2日-2024年1月12日	15.22	33,600	511,392.00
87	002409	雅克科技	2024年1月9日	55.73	1,000	55,730.00
88	002422	科伦药业	2024年1月3日-2024年1月8日	29.05	40,700	1,182,335.00
89	002423	中粮资本	2024年1月2日-2024年1月9日	6.68	37,900	253,172.00
90	002429	兆驰股份	2024年1月2日-2024年1月11日	5.58	92,500	516,150.00
91	002432	九安医疗	2024年1月2日-2024年1月11日	37.67	15,800	595,186.00
92	002444	巨星科技	2024年1月10日	22.52	8,000	180,160.00
93	002463	沪电股份	2024年1月2日-2024年1月11日	22.12	54,400	1,203,328.00
94	002465	海格通信	2024年1月2日	12.85	20,000	257,000.00
95	002468	申通快递	2024年1月4日	7.79	4,100	31,939.00
96	002472	双环传动	2024年1月11日	26.02	10,700	278,414.00
97	002487	大金重工	2024年1月3日-2024年1月9日	26.62	17,900	476,498.00

98	002497	雅化集团	2024年1月2日-2024年1月12日	13.09	44,800	586,432.00
99	002500	山西证券	2024年1月4日	5.39	22,000	118,580.00
100	002505	鹏都农牧	2024年1月2日-2024年1月12日	1.60	151,800	242,880.00
101	002506	协鑫集成	2024年1月2日-2024年1月12日	2.74	147,800	404,972.00
102	002507	涪陵榨菜	2024年1月2日	14.29	37,300	533,017.00
103	002517	恺英网络	2024年1月9日	11.17	87,100	972,907.00
104	002518	科士达	2024年1月2日-2024年1月9日	27.60	9,500	262,200.00
105	002531	天顺风能	2024年1月2日-2024年1月12日	11.60	35,500	411,800.00
106	002532	天山铝业	2024年1月2日	6.01	11,600	69,716.00
107	002557	洽洽食品	2024年1月3日-2024年1月4日	34.82	6,000	208,920.00
108	002558	巨人网络	2024年01月05日-2024年01月09日	11.14	55,800	621,612.00
109	002572	索菲亚	2024年1月2日-2024年1月5日	15.95	29,500	470,525.00
110	002595	豪迈科技	2024年1月4日-2024年1月12日	29.77	15,400	458,458.00
111	002600	领益智造	2024年1月2日-2024年1月10日	6.76	127,700	863,252.00
112	002607	中公教育	2024年1月2日	4.08	15,500	63,240.00
113	002608	江苏国信	2024年1月4日	6.57	9,000	59,130.00
114	002624	完美世界	2024年1月4日-2024年1月8日	11.84	31,600	374,144.00
115	002625	光启技术	2024年1月2日-2024年1月9日	14.78	53,600	792,208.00
116	002653	海思科	2024年1月2日-2024年1月12日	23.15	13,100	303,265.00
117	002670	国盛金控	2024年1月2日-2024年1月11日	9.32	47,400	441,768.00
118	002683	广东宏大	2024年1月2日	20.08	20,700	415,656.00
119	002738	中矿资源	2024年1月2日-2024年1月12日	37.31	10,300	384,293.00

120	002739	万达电 影	2024年1月2日-2024年 1月10日	13.02	62,300	811,146.0 0
121	002756	永兴材 料	2024年1月9日-2024年 1月10日	52.21	15,400	804,034.0 0
122	002761	浙江建 投	2024年1月2日-2024年 1月9日	10.26	20,500	210,330.0 0
123	002791	坚朗五 金	2024年1月2日-2024年 1月9日	40.49	4,900	198,401.0 0
124	002797	第一创 业	2024年1月11日	5.81	12,000	69,720.00
125	002831	裕同科 技	2024年1月2日-2024年 1月4日	27.51	17,200	473,172.0 0
126	002850	科达利	2024年1月2日-2024年 1月12日	84.46	4,500	380,070.0 0
127	002867	周大生	2024年1月4日-2024年 1月8日	15.18	18,000	273,240.0 0
128	002925	盈趣科 技	2024年1月8日-2024年 1月11日	19.47	12,200	237,534.0 0
129	002936	郑州银 行	2024年1月2日	2.01	236,000	474,360.0 0
130	002945	华林证 券	2024年1月5日-2024年 1月12日	15.10	10,800	163,080.0 0
131	003022	联泓新 科	2024年1月9日	18.31	16,400	300,284.0 0
132	003031	中瓷电 子	2024年1月10日	88.23	2,500	220,575.0 0
133	003035	南网能 源	2024年1月2日	5.26	1,000	5,260.00
134	300001	特锐德	2024年1月2日	20.10	8,600	172,860.0 0
135	300009	安科生 物	2024年1月4日	10.22	10,000	102,200.0 0
136	300012	华测检 测	2024年1月4日-2024年 1月8日	14.20	12,500	177,500.0 0
137	300017	网宿科 技	2024年1月2日-2024年 1月12日	7.85	95,000	745,750.0 0
138	300024	机器人	2024年1月2日-2024年 1月11日	11.87	50,100	594,687.0 0
139	300026	红日药 业	2024年1月2日-2024年 1月9日	4.24	97,200	412,128.0 0
140	300058	蓝色光 标	2024年1月5日-2024年 1月12日	7.18	64,900	465,982.0 0
141	300070	碧水源	2024年1月2日-2024年 1月12日	4.99	84,100	419,659.0 0

142	300073	当升科技	2024年1月2日-2024年1月12日	38.20	15,600	595,920.00
143	300088	长信科技	2024年1月2日-2024年1月11日	6.69	55,500	371,295.00
144	300114	中航电测	2024年1月11日	43.75	7,500	328,125.00
145	300118	东方日升	2024年1月11日-2024年1月12日	17.65	37,300	658,345.00
146	300136	信维通信	2024年1月2日-2024年1月8日	23.60	28,200	665,520.00
147	300212	易华录	2024年1月2日-2024年1月11日	31.45	21,000	660,450.00
148	300251	光线传媒	2024年1月2日	8.15	10,000	81,500.00
149	300253	卫宁健康	2024年1月3日-2024年1月11日	7.19	11,000	79,090.00
150	300257	开山股份	2024年1月2日	15.76	13,000	204,880.00
151	300296	利亚德	2024年1月2日	6.00	86,400	518,400.00
152	300357	我武生物	2024年1月4日	29.00	4,000	116,000.00
153	300363	博腾股份	2024年1月2日-2024年1月12日	25.15	12,600	316,890.00
154	300373	扬杰科技	2024年1月2日-2024年1月10日	36.70	12,500	458,750.00
155	300383	光环新网	2024年1月2日-2024年1月4日	9.72	17,100	166,212.00
156	300390	天华新能	2024年1月2日-2024年1月11日	25.35	23,900	605,865.00
157	300394	天孚通信	2024年1月9日-2024年1月10日	91.52	11,200	1,025,024.00
158	300418	昆仑万维	2024年1月2日-2024年1月4日	37.40	49,000	1,832,600.00
159	300438	鹏辉能源	2024年1月2日-2024年1月10日	28.29	13,900	393,231.00
160	300474	景嘉微	2024年1月4日-2024年1月12日	70.71	6,500	459,615.00
161	300502	新易盛	2024年1月11日	49.32	5,000	246,600.00
162	300558	贝达药业	2024年1月8日	51.55	4,100	211,355.00
163	300568	星源材质	2024年1月2日	15.42	44,000	678,480.00

164	300595	欧普康视	2024年1月2日	22.58	8,800	198,704.00
165	300604	长川科技	2024年1月3日-2024年1月4日	37.99	10,600	402,694.00
166	300676	华大基因	2024年1月2日-2024年1月5日	48.00	4,300	206,400.00
167	300677	英科医疗	2024年1月3日-2024年1月10日	23.36	18,700	436,832.00
168	300682	朗新集团	2024年1月2日-2024年1月11日	16.39	26,900	440,891.00
169	300748	金力永磁	2024年1月3日-2024年1月9日	20.22	23,200	469,104.00
170	300776	帝尔激光	2024年1月2日-2024年1月10日	60.26	5,000	301,300.00
171	300850	新强联	2024年1月2日-2024年1月4日	31.83	3,300	105,039.00
172	300861	美畅股份	2024年1月8日	33.29	8,000	266,320.00
173	300866	安克创新	2024年1月12日	88.60	7,800	691,080.00
174	300888	稳健医疗	2024年1月4日-2024年1月9日	37.25	6,200	230,950.00
175	301029	怡合达	2024年1月2日-2024年1月4日	25.78	6,100	157,258.00
176	301236	软通动力	2024年1月2日-2024年1月9日	46.20	28,400	1,312,080.00
177	600004	白云机场	2024年1月11日	9.78	1,000	9,780.00
178	600008	首创环保	2024年1月2日-2024年1月3日	2.69	53,800	144,722.00
179	600021	上海电力	2024年1月2日-2024年1月11日	8.46	32,600	275,796.00
180	600032	浙江新能	2024年1月2日-2024年1月4日	8.06	4,900	39,494.00
181	600056	中国医药	2024年1月2日	11.17	1,000	11,170.00
182	600060	海信视像	2024年1月2日	20.90	9,000	188,100.00
183	600062	华润双鹤	2024年1月3日-2024年1月10日	18.60	6,900	128,340.00
184	600066	宇通客车	2024年1月4日	13.25	38,100	504,825.00
185	600079	人福医药	2024年1月4日-2024年1月9日	24.86	19,700	489,742.00

186	600095	湘财股份	2024年1月2日	7.51	1,700	12,767.00
187	600096	云天化	2024年1月3日-2024年1月9日	15.60	52,400	817,440.00
188	600118	中国卫星	2024年1月2日-2024年1月11日	25.82	21,100	544,802.00
189	600129	太极集团	2024年1月11日-2024年1月12日	46.46	14,600	678,316.00
190	600131	国网信通	2024年1月4日	15.15	7,000	106,050.00
191	600143	金发科技	2024年1月3日-2024年1月9日	7.99	69,000	551,310.00
192	600153	建发股份	2024年1月4日-2024年1月11日	9.63	12,000	115,560.00
193	600155	华创云信	2024年1月2日-2024年1月12日	8.34	92,400	770,616.00
194	600157	永泰能源	2024年1月8日	1.37	495,000	678,150.00
195	600160	巨化股份	2024年1月2日-2024年1月5日	16.49	46,200	761,838.00
196	600161	天坛生物	2024年1月4日-2024年1月10日	30.94	33,600	1,039,584.00
197	600166	福田汽车	2024年1月4日-2024年1月11日	2.73	59,200	161,616.00
198	600167	联美控股	2024年1月2日-2024年1月12日	5.67	34,600	196,182.00
199	600170	上海建工	2024年1月11日	2.34	254,200	594,828.00
200	600177	雅戈尔	2024年1月2日-2024年1月10日	6.55	6,300	41,265.00
201	600208	新湖中宝	2024年1月2日-2024年1月12日	2.17	182,600	396,242.00
202	600258	首旅酒店	2024年1月2日	15.62	17,100	267,102.00
203	600271	航天信息	2024年1月2日-2024年1月11日	10.64	28,000	297,920.00
204	600298	安琪酵母	2024年1月9日	35.18	22,100	777,478.00
205	600299	安迪苏	2024年1月2日-2024年1月9日	8.00	14,300	114,400.00
206	600315	上海家化	2024年1月4日-2024年1月11日	21.18	7,000	148,260.00
207	600325	华发股份	2024年1月3日-2024年1月12日	7.21	15,700	113,197.00

208	600329	达仁堂	2024年1月8日	33.65	11,700	393,705.00
209	600339	中油工程	2024年1月2日-2024年1月3日	3.03	19,900	60,297.00
210	600348	华阳股份	2024年1月8日	9.76	32,700	319,152.00
211	600350	山东高速	2024年1月8日-2024年1月10日	6.94	27,700	192,238.00
212	600369	西南证券	2024年1月3日	4.09	40,000	163,600.00
213	600373	中文传媒	2024年1月4日-2024年1月9日	13.18	27,700	365,086.00
214	600377	宁沪高速	2024年1月2日-2024年1月5日	10.25	20,000	205,000.00
215	600378	昊华科技	2024年1月12日	30.48	10,600	323,088.00
216	600380	健康元	2024年1月4日	12.43	9,000	111,870.00
217	600390	五矿资本	2024年1月9日-2024年1月11日	4.68	91,900	430,092.00
218	600392	盛和资源	2024年1月3日-2024年1月4日	10.18	47,200	480,496.00
219	600398	海澜之家	2024年1月2日-2024年1月11日	7.42	70,600	523,852.00
220	600415	小商品城	2024年1月9日-2024年1月11日	7.32	112,100	820,572.00
221	600418	江淮汽车	2024年1月2日-2024年1月10日	16.15	71,400	1,153,110.00
222	600435	北方导航	2024年1月12日	11.74	12,000	140,880.00
223	600481	双良节能	2024年1月11日-2024年1月12日	8.46	43,600	368,856.00
224	600482	中国动力	2024年1月2日-2024年1月4日	18.01	7,500	135,075.00
225	600498	烽火通信	2024年1月4日	16.64	6,000	99,840.00
226	600499	科达制造	2024年1月2日-2024年1月12日	10.55	70,800	746,940.00
227	600511	国药股份	2024年1月8日-2024年1月11日	28.62	12,200	349,164.00
228	600516	方大炭素	2024年1月2日-2024年1月10日	5.24	127,600	668,624.00
229	600521	华海药业	2024年1月3日-2024年1月5日	14.67	28,800	422,496.00

230	600529	山东药玻	2024年1月4日	25.60	4,000	102,400.00
231	600535	天士力	2024年1月12日	17.02	34,000	578,680.00
232	600536	中国软件	2024年1月2日-2024年1月12日	36.26	23,600	855,736.00
233	600546	山煤国际	2024年1月2日-2024年1月5日	17.51	21,100	369,461.00
234	600549	厦门钨业	2024年1月5日	17.18	35,100	603,018.00
235	600582	天地科技	2024年1月2日	5.44	76,200	414,528.00
236	600583	海油工程	2024年1月10日	5.94	77,200	458,568.00
237	600597	光明乳业	2024年1月2日	8.73	7,000	61,110.00
238	600598	北大荒	2024年1月2日-2024年1月12日	11.97	24,100	288,477.00
239	600637	东方明珠	2024年1月3日-2024年1月9日	7.52	83,700	629,424.00
240	600655	豫园股份	2024年1月2日-2024年1月11日	6.21	80,200	498,042.00
241	600663	陆家嘴	2024年1月2日-2024年1月9日	8.75	30,300	265,125.00
242	600673	东阳光	2024年1月2日-2024年1月3日	7.33	69,700	510,901.00
243	600699	均胜电子	2024年1月2日-2024年1月3日	17.96	14,800	265,808.00
244	600704	物产中大	2024年1月8日	4.43	128,300	568,369.00
245	600707	彩虹股份	2024年1月2日-2024年1月11日	6.75	60,600	409,050.00
246	600737	中粮糖业	2024年1月4日-2024年1月5日	8.24	14,500	119,480.00
247	600739	辽宁成大	2024年1月9日	11.78	7,200	84,816.00
248	600755	厦门国贸	2024年1月4日-2024年1月11日	6.97	32,400	225,828.00
249	600764	中国海防	2024年1月3日-2024年1月11日	24.95	11,500	286,925.00
250	600801	华新水泥	2024年1月2日-2024年1月4日	12.43	14,800	183,964.00
251	600827	百联股份	2024年1月2日	9.49	8,000	75,920.00

252	600839	四川长虹	2024年1月2日-2024年1月4日	5.29	38,000	201,020.00
253	600848	上海临港	2024年1月11日	10.05	10,000	100,500.00
254	600863	内蒙华电	2024年1月3日-2024年1月12日	3.90	112,100	437,190.00
255	600867	通化东宝	2024年1月2日-2024年1月11日	10.83	50,500	546,915.00
256	600871	石化油服	2024年1月2日-2024年1月12日	1.83	135,700	248,331.00
257	600879	航天电子	2024年1月9日-2024年1月12日	7.71	77,200	595,212.00
258	600884	杉杉股份	2024年1月9日-2024年1月11日	13.62	46,200	629,244.00
259	600885	宏发股份	2024年1月4日	27.64	4,000	110,560.00
260	600895	张江高科	2024年1月2日-2024年1月12日	19.30	39,800	768,140.00
261	600901	江苏金租	2024年1月2日-2024年1月8日	4.84	76,800	371,712.00
262	600928	西安银行	2024年1月10日-2024年1月11日	3.33	34,700	115,551.00
263	600956	新天绿能	2024年1月2日-2024年1月12日	8.13	14,300	116,259.00
264	600959	江苏有线	2024年1月2日-2024年1月3日	3.14	76,200	239,268.00
265	600967	内蒙一机	2024年1月11日-2024年1月12日	8.26	27,300	225,498.00
266	600968	海油发展	2024年1月8日	2.85	1,000	2,850.00
267	600970	中材国际	2024年1月3日	9.34	48,900	456,726.00
268	600977	中国电影	2024年1月9日	12.24	14,000	171,360.00
269	600985	淮北矿业	2024年1月5日	16.63	39,300	653,559.00
270	600988	赤峰黄金	2024年1月3日-2024年1月12日	14.01	23,300	326,433.00
271	600995	南网储能	2024年1月2日-2024年1月11日	9.86	39,100	385,526.00
272	600998	九州通	2024年1月2日-2024年1月8日	7.01	6,800	47,668.00
273	601016	节能风电	2024年1月2日-2024年1月12日	3.00	75,400	226,200.00

274	601058	赛轮轮胎	2024年1月8日-2024年1月10日	11.75	73,400	862,450.00
275	601061	中信金属	2024年1月9日	7.71	20,000	154,200.00
276	601098	中南传媒	2024年1月2日-2024年1月12日	10.17	9,200	93,564.00
277	601106	中国一重	2024年1月2日-2024年1月3日	2.88	127,000	365,760.00
278	601118	海南橡胶	2024年1月2日-2024年1月11日	4.24	69,900	296,376.00
279	601139	深圳燃气	2024年1月10日	6.89	23,400	161,226.00
280	601156	东航物流	2024年1月2日-2024年1月12日	14.78	19,400	286,732.00
281	601158	重庆水务	2024年1月2日-2024年1月10日	5.67	13,000	73,710.00
282	601162	天风证券	2024年1月11日	3.09	283,400	875,706.00
283	601168	西部矿业	2024年1月2日-2024年1月10日	14.27	77,900	1,111,633.00
284	601179	中国西电	2024年1月2日	4.93	86,000	423,980.00
285	601228	广州港	2024年1月2日	3.13	69,700	218,161.00
286	601231	环旭电子	2024年1月8日	15.11	27,200	410,992.00
287	601456	国联证券	2024年1月2日-2024年1月5日	10.84	48,500	525,740.00
288	601568	北元集团	2024年1月2日-2024年1月11日	4.74	52,200	247,428.00
289	601598	中国外运	2024年1月2日-2024年1月11日	5.24	69,800	365,752.00
290	601608	中信重工	2024年1月4日	3.86	27,000	104,220.00
291	601636	旗滨集团	2024年1月4日-2024年1月9日	6.84	65,800	450,072.00
292	601665	齐鲁银行	2024年1月2日-2024年1月8日	3.91	94,300	368,713.00
293	601666	平煤股份	2024年1月2日-2024年1月10日	11.56	66,900	773,364.00
294	601696	中银证券	2024年1月2日	10.29	3,000	30,870.00
295	601717	郑煤机	2024年1月2日-2024年1月11日	12.65	43,900	555,335.00

296	601778	晶科科技	2024年1月2日-2024年1月9日	3.50	105,000	367,500.00
297	601828	美凯龙	2024年1月3日	3.87	50,200	194,274.00
298	601866	中远海发	2024年1月2日-2024年1月11日	2.34	133,100	311,454.00
299	601880	辽港股份	2024年1月2日-2024年1月4日	1.45	334,800	485,460.00
300	601928	凤凰传媒	2024年1月2日-2024年1月12日	8.81	31,100	273,991.00
301	601933	永辉超市	2024年1月5日	2.82	123,400	347,988.00
302	601958	金铂股份	2024年1月2日-2024年1月12日	9.45	37,700	356,265.00
303	601966	玲珑轮胎	2024年1月3日-2024年1月8日	19.23	26,300	505,749.00
304	601991	大唐发电	2024年1月2日-2024年1月3日	2.42	172,200	416,724.00
305	601992	金隅集团	2024年1月2日-2024年1月11日	1.91	170,400	325,464.00
306	601997	贵阳银行	2024年1月3日	5.14	96,800	497,552.00
307	603000	人民网	2024年1月2日-2024年1月12日	27.98	21,200	593,176.00
308	603026	胜华新材	2024年1月4日-2024年1月12日	45.86	6,000	275,160.00
309	603056	德邦股份	2024年1月10日	14.47	12,000	173,640.00
310	603077	和邦生物	2024年1月2日	2.36	73,800	174,168.00
311	603127	昭衍新药	2024年1月2日-2024年1月12日	23.71	11,300	267,923.00
312	603156	养元饮品	2024年1月8日	21.26	3,800	80,788.00
313	603160	汇顶科技	2024年1月8日-2024年1月12日	69.10	4,400	304,040.00
314	603185	弘元绿能	2024年1月9日	33.28	11,000	366,080.00
315	603218	日月股份	2024年1月2日-2024年1月12日	12.37	19,900	246,163.00
316	603225	新凤鸣	2024年1月2日	14.20	5,000	71,000.00
317	603228	景旺电子	2024年1月4日-2024年1月8日	22.56	8,100	182,736.00
318	603233	大参林	2024年1月4日	24.90	4,000	99,600.00

319	603267	鸿远电子	2024年1月9日	50.20	5,000	251,000.00
320	603305	旭升集团	2024年1月11日	19.73	14,600	288,058.00
321	603317	天味食品	2024年1月2日	13.29	10,000	132,900.00
322	603338	浙江鼎力	2024年1月2日-2024年1月11日	51.17	7,900	404,243.00
323	603355	莱克电气	2024年1月2日-2024年1月5日	22.30	5,200	115,960.00
324	603379	三美股份	2024年1月2日	34.00	1,900	64,600.00
325	603444	吉比特	2024年1月8日	245.12	1,500	367,680.00
326	603456	九洲药业	2024年1月4日	24.21	4,000	96,840.00
327	603517	绝味食品	2024年1月4日-2024年1月9日	26.86	8,000	214,880.00
328	603529	爱玛科技	2024年1月9日	25.04	2,500	62,600.00
329	603596	伯特利	2024年1月2日-2024年1月8日	69.30	10,800	748,440.00
330	603606	东方电缆	2024年1月11日	42.75	14,300	611,325.00
331	603650	彤程新材	2024年1月2日-2024年1月12日	33.30	5,000	166,500.00
332	603688	石英股份	2024年1月2日	86.88	6,300	547,344.00
333	603707	健友股份	2024年1月4日	15.00	2,600	39,000.00
334	603737	三棵树	2024年1月2日-2024年1月12日	47.61	9,700	461,817.00
335	603786	科博达	2024年1月3日-2024年1月8日	71.36	2,800	199,808.00
336	603816	顾家家居	2024年1月2日-2024年1月9日	35.00	19,200	672,000.00
337	603826	坤彩科技	2024年1月2日	59.03	5,000	295,150.00
338	603868	飞科电器	2024年1月12日	50.50	2,000	101,000.00
339	603882	金域医学	2024年1月8日-2024年1月11日	62.57	4,700	294,079.00
340	603883	老百姓	2024年1月11日-2024年1月12日	29.89	2,600	77,714.00

341	603885	吉祥航空	2024年1月2日-2024年1月3日	12.00	10,600	127,200.00
342	603927	中科软	2024年1月4日-2024年1月9日	29.98	7,600	227,848.00
343	603939	益丰药房	2024年1月2日-2024年1月10日	40.04	20,600	824,824.00
344	605358	立昂微	2024年1月2日-2024年1月12日	27.39	25,000	684,750.00
345	688002	睿创微纳	2024年1月2日	44.22	5,900	260,898.00
346	688006	杭可科技	2024年1月8日-2024年1月10日	23.48	9,800	230,104.00
347	688029	南微医学	2024年1月9日	96.80	3,000	290,400.00
348	688032	禾迈股份	2024年1月11日	270.00	1,600	432,000.00
349	688052	纳芯微	2024年1月8日	166.85	1,400	233,590.00
350	688063	派能科技	2024年1月9日	106.00	4,000	424,000.00
351	688072	拓荆科技	2024年1月2日-2024年1月4日	231.30	2,400	555,120.00
352	688082	盛美上海	2024年1月11日	104.41	3,500	365,435.00
353	688105	诺唯赞	2024年1月10日	32.02	4,800	153,696.00
354	688107	安路科技	2024年1月4日-2024年1月11日	36.78	6,200	228,036.00
355	688114	华大智造	2024年1月11日	86.02	8,100	696,762.00
356	688120	华海清科	2024年1月4日-2024年1月10日	187.70	3,200	600,640.00
357	688153	唯捷创芯	2024年1月11日	65.50	2,400	157,200.00
358	688169	石头科技	2024年1月2日	282.95	3,200	905,440.00
359	688188	柏楚电子	2024年1月2日	253.11	1,500	379,665.00
360	688208	道通科技	2024年1月11日	23.75	3,000	71,250.00
361	688220	翱捷科技-U	2024年1月2日-2024年1月11日	70.44	9,100	641,004.00
362	688234	天岳先进	2024年1月2日-2024年1月11日	66.07	6,700	442,669.00

363	688248	南网科技	2024年1月2日-2024年1月4日	24.97	3,900	97,383.00
364	688276	百克生物	2024年1月2日-2024年1月8日	54.81	5,200	285,012.00
365	688295	中复神鹰	2024年1月2日-2024年1月3日	30.31	4,200	127,302.00
366	688301	奕瑞科技	2024年1月12日	325.26	2,200	715,572.00
367	688331	荣昌生物	2024年1月9日	62.06	7,000	434,420.00
368	688348	昱能科技	2024年1月11日	122.38	1,000	122,380.00
369	688349	三一重能	2024年1月11日	28.62	9,400	269,028.00
370	688385	复旦微电	2024年1月5日	38.63	12,000	463,560.00
371	688387	信科移动-U	2024年1月10日	7.21	27,900	201,159.00
372	688390	固德威	2024年1月2日-2024年1月8日	130.58	4,700	613,726.00
373	688425	铁建重工	2024年1月9日	3.97	63,000	250,110.00
374	688516	奥特维	2024年1月2日-2024年1月8日	90.50	5,100	461,550.00
375	688520	神州细胞-U	2024年1月2日-2024年1月10日	53.87	5,400	290,898.00
376	688521	芯原股份	2024年1月2日-2024年1月12日	49.96	9,300	464,628.00
377	688536	思瑞浦	2024年1月3日-2024年1月8日	146.30	3,000	438,900.00
378	688538	和辉光电-U	2024年1月10日-2024年1月12日	2.43	169,900	412,857.00
379	688567	孚能科技	2024年1月5日	16.31	6,000	97,860.00
380	688690	纳微科技	2024年1月2日	27.42	1,500	41,130.00
381	688728	格科微	2024年1月9日	20.47	30,000	614,100.00
382	688772	珠海冠宇	2024年1月2日-2024年1月12日	22.01	27,500	605,275.00
383	688778	厦钨新能	2024年1月10日	39.64	6,800	269,552.00
384	688819	天能股份	2024年1月2日	27.92	5,000	139,600.00

385	689009	九号公司-WD	2024年1月4日-2024年 1月12日	29.66	17,600	522,016.0 0
合计	-	-	-	-	13,742,200	140,114,5 15.00

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数型基金。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股（含存托凭证）。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准的股票、存托凭证）、债券（含国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券等）、货币市场工具、同业存单、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可依据法律法规的规定，参与融资及转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，力争实现基金净值增长率与标的指数增长率间的高度正相关，并保持跟踪误差在合同约定的范围内。

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

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

7.4.13.2 信用风险

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

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

本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，本基金以非约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券；以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类，因此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 2023 年 12 月 31 日，本基金未持有信用类债券（2022 年 12 月 31 日：未持有）。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：无。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时或于约定开放日要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

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

于 2023 年 12 月 31 日，本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金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%。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	29,911,463.16	-	-	-	29,911,463.16
结算备付金	14,103,710.79	-	-	-	14,103,710.79
存出保证金	4,156,109.56	-	-	-	4,156,109.56
交易性金融资产	-	-	-	1,311,390,087.66	1,311,390,087.66
应收清算款	-	-	-	2,941,864.11	2,941,864.11
其他资产	-	-	-	66,927.13	66,927.13
资产总计	48,171,283.51	-	-	1,314,398,878.90	1,362,570,162.41
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	192,763.68	192,763.68
应付托管费	-	-	-	64,254.56	64,254.56
应付清算款	-	-	-	550,119.12	550,119.12
应交税费	-	-	-	10,092.54	10,092.54
其他负债	-	-	-	4,268,546.59	4,268,546.59
负债总计	-	-	-	5,085,776.49	5,085,776.49
利率敏感度缺口	48,171,283.51	-	-	1,309,313,102.41	1,357,484,385.92
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	9,213,589.85	-	-	-	9,213,589.85
结算备付金	8,550,735.13	-	-	-	8,550,735.13
存出保证金	1,915,009.33	-	-	-	1,915,009.33
交易性金融资产	-	-	-	332,510,595.62	332,510,595.62
应收股利	-	-	-	1,485.00	1,485.00
应收清算款	-	-	-	217,033.45	217,033.45
其他资产	-	-	-	10,632.64	10,632.64
资产总计	19,679,334.31	-	-	332,739,746.71	352,419,081.02
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	46,139.47	46,139.47

应付托管费	-	-	-	15,379.84	15,379.84
应交税费	-	-	-	1,603.98	1,603.98
其他负债	-	-	-	689,504.70	689,504.70
负债总计	-	-	-	752,627.99	752,627.99
利率敏感度缺口	19,679,334.31	-	-	331,987,118.72	351,666,453.03

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2023 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资和资产支持证券公允价值占基金资产净值的比例为 0.00%，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。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无。

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于标的指数成份券和备选成份券，所面临的其他价格风险来源于标的指数成份券和备选成份券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。

本基金为被动式指数基金，原则上采用完全复制的方法，按照个券在标的指数中的基准权重构建投资组合。基金所构建的指数化投资组合将根据标的指数成份券及其权重的变动而进行相应调整。同时，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、新股增发等变化，对基金投资组合进行相应调整，以保证基金份额净值增长率与标的指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。

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：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股（含存托凭证）的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。

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

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,311,390,087.66	96.60	332,510,595.62	94.55
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	1,311,390,087.66	96.60	332,510,595.62	94.55

注：债券投资为可转债、可交换债券投资。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准外的其他市场变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年12月31日）	上年度末（2022年12月31日）
	比较基准上涨 5% 资产净值变动	66,380,986.47	17,222,864.54
	比较基准下降 5% 资产净值变动	-66,380,986.47	-17,222,864.54

注：无。

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	1,310,454,636.79	330,483,144.01
第二层次	-	1,258,170.00
第三层次	935,450.87	769,281.61
合计	1,311,390,087.66	332,510,595.62

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		合计
	交易性金融资产		
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	769,281.61	769,281.61

当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	1,404,895.36	1,404,895.36
转出第三层次	-	1,799,297.89	1,799,297.89
当期利得或损失总额	-	560,571.79	560,571.79
其中：计入损益的利得或损失	-	560,571.79	560,571.79
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	935,450.87	935,450.87
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-273,604.25	-273,604.25
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	1,983,866.50	1,983,866.50
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	1,232,957.34	1,232,957.34
转出第三层次	-	2,211,620.72	2,211,620.72
当期利得或损失总额	-	-235,921.51	-235,921.51
其中：计入损益的利得或损失	-	-235,921.51	-235,921.51
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	769,281.61	769,281.61
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	31,342.86	31,342.86

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系

流通受限股票	903,935.87	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.1855-2.1988	负相关
停牌股票	31,515.00	净资产法	不适用	不适用	不适用
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流通受限股票	769,281.61	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.2063-2.4756	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,311,390,087.66	96.24
	其中：股票	1,311,390,087.66	96.24
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	44,015,173.95	3.23
8	其他各项资产	7,164,900.80	0.53
9	合计	1,362,570,162.41	100.00

注：1、上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而 8.2 的合计项不含可退替代款估值增值。

2、报告期末，本基金参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为人民币 140,114,515.00 元，

占基金资产净值比为 10.32%。

3、报告期末本基金投资的存托凭证公允价值为：2,627,876.00 元，占净值比 0.19%。本报告所指的“股票”均包含存托凭证。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	8,911,158.00	0.66
B	采矿业	50,705,144.42	3.74
C	制造业	826,657,195.13	60.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	42,716,001.00	3.15
E	建筑业	10,464,743.00	0.77
F	批发和零售业	39,621,052.42	2.92
G	交通运输、仓储和邮政业	24,289,988.12	1.79
H	住宿和餐饮业	2,144,797.82	0.16
I	信息传输、软件和信息技术服务业	99,037,118.20	7.30
J	金融业	118,626,779.61	8.74
K	房地产业	16,380,941.00	1.21
L	租赁和商务服务业	11,663,228.00	0.86
M	科学研究和技术服务业	12,050,710.40	0.89
N	水利、环境和公共设施管理业	6,972,151.00	0.51
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	3,612,840.00	0.27
Q	卫生和社会工作	9,920,561.00	0.73
R	文化、体育和娱乐业	18,753,293.00	1.38
S	综合	7,687,863.32	0.57
	合计	1,310,215,565.44	96.52

8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,012,092.70	0.07
D	电力、热力、燃气	-	-

	及水生产和供应业		
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	44,707.25	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	8,811.72	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	39,691.03	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	31,515.00	0.00
L	租赁和商务服务业	3,058.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	26,037.06	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	8,609.46	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,174,522.22	0.09

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

8.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300502	新易盛	145,600	7,180,992.00	0.53
2	002422	科伦药业	242,000	7,030,100.00	0.52
3	002028	思源电气	126,300	6,572,652.00	0.48
4	300418	昆仑万维	174,500	6,526,300.00	0.48
5	600157	永泰能源	4,556,800	6,242,816.00	0.46
6	000988	华工科技	206,300	6,139,488.00	0.45
7	002463	沪电股份	273,600	6,052,032.00	0.45
8	601058	赛轮轮胎	512,000	6,016,000.00	0.44
9	601555	东吴证券	821,690	6,006,553.90	0.44
10	000975	银泰黄金	398,660	5,979,900.00	0.44
11	600079	人福医药	234,300	5,824,698.00	0.43
12	600418	江淮汽车	358,400	5,788,160.00	0.43

13	002340	格林美	1,053,300	5,751,018.00	0.42
14	601168	西部矿业	391,000	5,579,570.00	0.41
15	000933	神火股份	323,200	5,429,760.00	0.40
16	301236	软通动力	117,300	5,419,260.00	0.40
17	601233	桐昆股份	346,200	5,238,006.00	0.39
18	600161	天坛生物	168,980	5,228,241.20	0.39
19	300394	天孚通信	56,700	5,189,184.00	0.38
20	601077	渝农商行	1,269,700	5,180,376.00	0.38
21	601108	财通证券	666,700	5,173,592.00	0.38
22	000630	铜陵有色	1,558,800	5,112,864.00	0.38
23	002384	东山精密	280,500	5,099,490.00	0.38
24	300037	新宙邦	107,660	5,092,318.00	0.38
25	002156	通富微电	217,318	5,024,392.16	0.37
26	000009	中国宝安	423,268	4,969,166.32	0.37
27	688122	西部超导	93,100	4,955,713.00	0.37
28	002517	恺英网络	441,400	4,930,438.00	0.36
29	300012	华测检测	345,200	4,901,840.00	0.36
30	002966	苏州银行	752,080	4,858,436.80	0.36
31	600109	国金证券	534,740	4,855,439.20	0.36
32	600988	赤峰黄金	341,300	4,781,613.00	0.35
33	600885	宏发股份	171,120	4,729,756.80	0.35
34	300136	信维通信	198,500	4,684,600.00	0.35
35	688169	石头科技	16,228	4,591,712.60	0.34
36	002465	海格通信	356,400	4,579,740.00	0.34
37	002625	光启技术	309,400	4,572,932.00	0.34
38	600160	巨化股份	276,800	4,564,432.00	0.34
39	000423	东阿阿胶	92,400	4,557,168.00	0.34
40	300207	欣旺达	305,600	4,510,656.00	0.33
41	600352	浙江龙盛	533,800	4,483,920.00	0.33
42	002185	华天科技	525,800	4,479,816.00	0.33
43	600536	中国软件	123,502	4,478,182.52	0.33
44	002138	顺络电子	165,400	4,467,454.00	0.33
45	688072	拓荆科技	19,240	4,450,212.00	0.33
46	002738	中矿资源	118,840	4,433,920.40	0.33
47	601162	天风证券	1,421,900	4,393,671.00	0.32
48	600298	安琪酵母	124,800	4,390,464.00	0.32
49	000932	华菱钢铁	850,200	4,378,530.00	0.32
50	300003	乐普医疗	270,000	4,363,200.00	0.32
51	603596	伯特利	62,297	4,317,182.10	0.32
52	688099	晶晨股份	68,400	4,283,892.00	0.32
53	000783	长江证券	794,000	4,271,720.00	0.31
54	002223	鱼跃医疗	123,400	4,267,172.00	0.31
55	300144	宋城演艺	429,800	4,242,126.00	0.31

56	300724	捷佳伟创	57,200	4,233,372.00	0.31
57	002078	太阳纸业	344,000	4,186,480.00	0.31
58	002439	启明星辰	154,900	4,182,300.00	0.31
59	603939	益丰药房	103,700	4,152,148.00	0.31
60	000723	美锦能源	621,200	4,137,192.00	0.30
61	600415	小商品城	562,400	4,116,768.00	0.30
62	600096	云天化	263,400	4,109,040.00	0.30
63	002739	万达电影	312,900	4,073,958.00	0.30
64	300568	星源材质	262,900	4,053,918.00	0.30
65	002385	大北农	678,700	4,045,052.00	0.30
66	600482	中国动力	224,300	4,039,643.00	0.30
67	600765	中航重机	211,360	4,039,089.60	0.30
68	002756	永兴材料	77,300	4,035,833.00	0.30
69	600873	梅花生物	422,600	4,035,830.00	0.30
70	000066	中国长城	397,000	4,017,640.00	0.30
71	002532	天山铝业	667,900	4,014,079.00	0.30
72	600839	四川长虹	757,500	4,007,175.00	0.30
73	002797	第一创业	689,600	4,006,576.00	0.30
74	300474	景嘉微	56,100	3,966,831.00	0.29
75	688180	君实生物-U	94,158	3,938,629.14	0.29
76	300017	网宿科技	499,900	3,924,215.00	0.29
77	300395	菲利华	106,700	3,900,952.00	0.29
78	603160	汇顶科技	56,400	3,897,240.00	0.29
79	002600	领益智造	575,000	3,887,000.00	0.29
80	600155	华创云信	463,901	3,868,934.34	0.29
81	002273	水晶光电	285,200	3,861,608.00	0.28
82	002044	美年健康	642,300	3,860,223.00	0.28
83	300285	国瓷材料	164,700	3,807,864.00	0.28
84	600862	中航高科	171,430	3,797,174.50	0.28
85	002294	信立泰	114,400	3,736,304.00	0.28
86	600177	雅戈尔	569,700	3,731,535.00	0.27
87	300601	康泰生物	137,400	3,730,410.00	0.27
88	600129	太极集团	79,900	3,712,154.00	0.27
89	600497	驰宏锌锗	731,000	3,691,550.00	0.27
90	300866	安克创新	41,600	3,685,760.00	0.27
91	688120	华海清科	19,629	3,684,363.30	0.27
92	000728	国元证券	537,000	3,667,710.00	0.27
93	300058	蓝色光标	510,200	3,663,236.00	0.27
94	688114	华大智造	42,485	3,654,559.70	0.27
95	600699	均胜电子	202,300	3,633,308.00	0.27
96	002472	双环传动	139,500	3,629,790.00	0.27
97	601990	南京证券	453,700	3,620,526.00	0.27
98	603606	东方电缆	84,600	3,616,650.00	0.27

99	002607	中公教育	885,500	3,612,840.00	0.27
100	000831	中国稀土	130,500	3,610,935.00	0.27
101	600348	华阳股份	369,950	3,610,712.00	0.27
102	600066	宇通客车	272,500	3,610,625.00	0.27
103	603882	金城医学	57,700	3,610,289.00	0.27
104	002195	岩山科技	1,174,200	3,604,794.00	0.27
105	601128	常熟银行	562,200	3,592,458.00	0.26
106	002008	大族激光	172,700	3,578,344.00	0.26
107	300146	汤臣倍健	209,300	3,564,379.00	0.26
108	600546	山煤国际	203,300	3,559,783.00	0.26
109	603816	顾家家居	101,200	3,542,000.00	0.26
110	002353	杰瑞股份	125,900	3,539,049.00	0.26
111	601696	中银证券	341,900	3,518,151.00	0.26
112	002673	西部证券	550,100	3,504,137.00	0.26
113	000893	亚钾国际	133,300	3,497,792.00	0.26
114	600529	山东药玻	136,100	3,484,160.00	0.26
115	688301	奕瑞科技	10,496	3,413,928.96	0.25
116	300604	长川科技	89,400	3,396,306.00	0.25
117	600985	淮北矿业	203,600	3,385,868.00	0.25
118	601577	长沙银行	494,900	3,375,218.00	0.25
119	600499	科达制造	319,702	3,372,856.10	0.25
120	300088	长信科技	503,534	3,368,642.46	0.25
121	600060	海信视像	161,000	3,364,900.00	0.25
122	002262	恩华药业	124,000	3,362,880.00	0.25
123	603589	口子窖	73,900	3,347,670.00	0.25
124	600369	西南证券	817,800	3,344,802.00	0.25
125	002444	巨星科技	148,045	3,333,973.40	0.25
126	000997	新大陆	169,400	3,321,934.00	0.24
127	300118	东方日升	187,000	3,300,550.00	0.24
128	002624	完美世界	278,500	3,297,440.00	0.24
129	601666	平煤股份	284,700	3,291,132.00	0.24
130	688728	格科微	160,100	3,277,247.00	0.24
131	601198	东兴证券	397,800	3,273,894.00	0.24
132	002409	雅克科技	58,600	3,265,778.00	0.24
133	688002	睿创微纳	73,483	3,249,418.26	0.24
134	688390	固德威	24,866	3,247,002.28	0.24
135	600642	申能股份	501,900	3,222,198.00	0.24
136	603688	石英股份	37,000	3,214,560.00	0.24
137	000400	许继电气	146,300	3,212,748.00	0.24
138	300699	光威复材	119,420	3,184,931.40	0.23
139	300073	当升科技	83,100	3,174,420.00	0.23
140	603000	人民网	113,400	3,172,932.00	0.23
141	600637	东方明珠	420,200	3,159,904.00	0.23

142	002131	利欧股份	1,385,400	3,158,712.00	0.23
143	002558	巨人网络	283,300	3,155,962.00	0.23
144	600486	扬农化工	49,990	3,155,368.80	0.23
145	600884	杉杉股份	231,600	3,154,392.00	0.23
146	000683	远兴能源	537,000	3,152,190.00	0.23
147	600399	抚顺特钢	323,600	3,145,392.00	0.23
148	600535	天士力	184,500	3,140,190.00	0.23
149	000591	太阳能	561,300	3,132,054.00	0.23
150	600118	中国卫星	121,300	3,131,966.00	0.23
151	000878	云南铜业	287,600	3,131,964.00	0.23
152	600879	航天电子	406,000	3,130,260.00	0.23
153	000629	钒钛股份	953,200	3,126,496.00	0.23
154	002152	广电运通	254,700	3,122,622.00	0.23
155	000021	深科技	192,000	3,112,320.00	0.23
156	600867	通化东宝	286,200	3,099,546.00	0.23
157	002497	雅化集团	236,300	3,093,167.00	0.23
158	601997	贵阳银行	599,900	3,083,486.00	0.23
159	688521	芯原股份	61,590	3,077,036.40	0.23
160	600895	张江高科	158,900	3,066,770.00	0.23
161	600143	金发科技	383,600	3,064,964.00	0.23
162	300390	天华新能	120,250	3,048,337.50	0.22
163	300001	特锐德	151,600	3,047,160.00	0.22
164	000998	隆平高科	216,100	3,047,010.00	0.22
165	688188	柏楚电子	12,023	3,043,141.53	0.22
166	605358	立昂微	111,100	3,043,029.00	0.22
167	688772	珠海冠宇	138,000	3,037,380.00	0.22
168	000703	恒逸石化	451,200	3,032,064.00	0.22
169	600516	方大炭素	577,900	3,028,196.00	0.22
170	600416	湘电股份	190,200	3,020,376.00	0.22
171	300024	机器人	254,400	3,019,728.00	0.22
172	688220	翱捷科技-U	42,800	3,014,832.00	0.22
173	002240	盛新锂能	132,300	3,009,825.00	0.22
174	600549	厦门钨业	174,600	2,999,628.00	0.22
175	002432	九安医疗	79,500	2,994,765.00	0.22
176	603077	和邦生物	1,267,900	2,992,244.00	0.22
177	603712	七一二	94,909	2,990,582.59	0.22
178	600170	上海建工	1,275,800	2,985,372.00	0.22
179	002407	多氟多	195,900	2,981,598.00	0.22
180	600153	建发股份	308,100	2,967,003.00	0.22
181	002430	杭氧股份	101,000	2,950,210.00	0.22
182	688052	纳芯微	17,594	2,935,558.90	0.22
183	600392	盛和资源	287,500	2,926,750.00	0.22
184	600141	兴发集团	159,600	2,912,700.00	0.21

185	601966	玲珑轮胎	151,200	2,907,576.00	0.21
186	000960	锡业股份	202,600	2,901,232.00	0.21
187	000039	中集集团	377,800	2,890,170.00	0.21
188	000623	吉林敖东	190,800	2,888,712.00	0.21
189	300383	光环新网	295,000	2,867,400.00	0.21
190	300748	金力永磁	140,480	2,840,505.60	0.21
191	002065	东华软件	460,200	2,839,434.00	0.21
192	600704	物产中大	639,100	2,831,213.00	0.21
193	600909	华安证券	578,040	2,820,835.20	0.21
194	600998	九州通	400,844	2,809,916.44	0.21
195	300212	易华录	89,000	2,799,050.00	0.21
196	601717	郑煤机	220,700	2,791,855.00	0.21
197	000750	国海证券	785,900	2,782,086.00	0.20
198	300487	蓝晓科技	51,800	2,748,508.00	0.20
199	603658	安图生物	48,000	2,736,480.00	0.20
200	002203	海亮股份	245,200	2,733,980.00	0.20
201	002064	华峰化学	407,200	2,732,312.00	0.20
202	002268	电科网安	121,500	2,728,890.00	0.20
203	600673	东阳光	370,900	2,718,697.00	0.20
204	002025	航天电器	56,300	2,703,526.00	0.20
205	600583	海油工程	453,400	2,693,196.00	0.20
206	600166	福田汽车	985,000	2,689,050.00	0.20
207	000050	深天马 A	252,100	2,684,865.00	0.20
208	000738	航发控制	134,800	2,682,520.00	0.20
209	603456	九洲药业	110,700	2,680,047.00	0.20
210	600521	华海药业	182,400	2,675,808.00	0.20
211	603338	浙江鼎力	52,000	2,660,840.00	0.20
212	601456	国联证券	245,000	2,655,800.00	0.20
213	300558	贝达药业	51,500	2,654,825.00	0.20
214	300114	中航电测	60,639	2,652,956.25	0.20
215	002568	百润股份	107,700	2,650,497.00	0.20
216	002939	长城证券	330,900	2,647,200.00	0.20
217	000513	丽珠集团	75,500	2,643,255.00	0.19
218	002368	太极股份	89,379	2,639,361.87	0.19
219	002299	圣农发展	153,100	2,630,258.00	0.19
220	002506	协鑫集成	959,900	2,630,126.00	0.19
221	600398	海澜之家	354,400	2,629,648.00	0.19
222	689009	九号公司-WD	88,600	2,627,876.00	0.19
223	002128	电投能源	183,800	2,622,826.00	0.19
224	600863	内蒙华电	669,400	2,610,660.00	0.19
225	600859	王府井	163,000	2,603,110.00	0.19
226	600820	隧道股份	451,400	2,600,064.00	0.19
227	000636	风华高科	189,800	2,592,668.00	0.19

228	002092	中泰化学	425,000	2,592,500.00	0.19
229	002429	兆驰股份	464,300	2,590,794.00	0.19
230	601216	君正集团	692,300	2,589,202.00	0.19
231	600739	辽宁成大	219,700	2,588,066.00	0.19
232	002414	高德红外	350,400	2,557,920.00	0.19
233	600563	法拉电子	27,600	2,555,760.00	0.19
234	002373	千方科技	226,800	2,542,428.00	0.19
235	300253	卫宁健康	352,400	2,533,756.00	0.19
236	600435	北方导航	215,100	2,525,274.00	0.19
237	002926	华西证券	323,100	2,507,256.00	0.18
238	000729	燕京啤酒	289,000	2,494,070.00	0.18
239	300595	欧普康视	110,400	2,492,832.00	0.18
240	300296	利亚德	415,023	2,490,138.00	0.18
241	600655	豫园股份	399,500	2,480,895.00	0.18
242	300009	安科生物	240,692	2,459,872.24	0.18
243	300251	光线传媒	300,900	2,452,335.00	0.18
244	300244	迪安诊断	102,900	2,450,049.00	0.18
245	688567	孚能科技	150,100	2,448,131.00	0.18
246	300676	华大基因	51,000	2,448,000.00	0.18
247	300373	扬杰科技	66,700	2,447,890.00	0.18
248	600021	上海电力	288,800	2,443,248.00	0.18
249	600325	华发股份	338,600	2,441,306.00	0.18
250	002595	豪迈科技	82,000	2,441,140.00	0.18
251	600008	首创环保	903,400	2,430,146.00	0.18
252	600498	烽火通信	145,900	2,427,776.00	0.18
253	600271	航天信息	228,000	2,425,920.00	0.18
254	000519	中兵红箭	171,400	2,406,456.00	0.18
255	688536	思瑞浦	16,349	2,391,858.70	0.18
256	601016	节能风电	796,820	2,390,460.00	0.18
257	002500	山西证券	441,820	2,381,409.80	0.18
258	600566	济川药业	75,600	2,376,108.00	0.18
259	600380	健康元	191,000	2,374,130.00	0.17
260	600004	白云机场	242,700	2,373,606.00	0.17
261	688005	容百科技	59,600	2,372,080.00	0.17
262	002507	涪陵榨菜	165,740	2,368,424.60	0.17
263	000830	鲁西化工	235,800	2,365,074.00	0.17
264	002372	伟星新材	163,300	2,362,951.00	0.17
265	600282	南钢股份	632,300	2,339,510.00	0.17
266	002936	郑州银行	1,160,347	2,332,297.47	0.17
267	002850	科达利	27,600	2,331,096.00	0.17
268	600038	中直股份	60,500	2,331,065.00	0.17
269	688234	天岳先进	35,200	2,325,664.00	0.17
270	603233	大参林	93,392	2,325,460.80	0.17

271	002281	光迅科技	81,500	2,322,750.00	0.17
272	688032	禾迈股份	8,596	2,320,920.00	0.17
273	000060	中金岭南	536,600	2,318,112.00	0.17
274	002192	融捷股份	42,600	2,309,346.00	0.17
275	688063	派能科技	21,640	2,293,840.00	0.17
276	002056	横店东磁	166,900	2,259,826.00	0.17
277	601636	旗滨集团	330,200	2,258,568.00	0.17
278	688331	荣昌生物	36,354	2,256,129.24	0.17
279	601880	辽港股份	1,544,700	2,239,815.00	0.16
280	002019	亿帆医药	150,900	2,230,302.00	0.16
281	603225	新凤鸣	156,900	2,227,980.00	0.16
282	300070	碧水源	446,000	2,225,540.00	0.16
283	002670	国盛金控	238,100	2,219,092.00	0.16
284	002120	韵达股份	297,400	2,218,604.00	0.16
285	600511	国药股份	77,300	2,212,326.00	0.16
286	300682	朗新集团	134,900	2,211,011.00	0.16
287	300529	健帆生物	99,400	2,209,662.00	0.16
288	603156	养元饮品	103,900	2,208,914.00	0.16
289	600580	卧龙电驱	188,200	2,207,586.00	0.16
290	300677	英科医疗	94,100	2,198,176.00	0.16
291	000547	航天发展	262,300	2,195,451.00	0.16
292	603927	中科软	73,140	2,192,737.20	0.16
293	002080	中材科技	137,600	2,190,592.00	0.16
294	603444	吉比特	8,900	2,181,568.00	0.16
295	603885	吉祥航空	181,600	2,179,200.00	0.16
296	002557	洽洽食品	62,400	2,172,768.00	0.16
297	603893	瑞芯微	34,200	2,168,280.00	0.16
298	600390	五矿资本	461,300	2,158,884.00	0.16
299	002865	钧达股份	27,800	2,153,944.00	0.16
300	600258	首旅酒店	137,311	2,144,797.82	0.16
301	002531	天顺风能	184,200	2,136,720.00	0.16
302	601000	唐山港	607,700	2,126,950.00	0.16
303	002508	老板电器	97,300	2,119,194.00	0.16
304	688385	复旦微电	54,700	2,113,061.00	0.16
305	601933	永辉超市	744,500	2,099,490.00	0.15
306	002831	裕同科技	76,300	2,099,013.00	0.15
307	000598	兴蓉环境	367,400	2,090,506.00	0.15
308	300026	红日药业	493,000	2,090,320.00	0.15
309	002958	青农商行	797,600	2,089,712.00	0.15
310	688516	奥特维	23,085	2,089,192.50	0.15
311	002572	索菲亚	130,900	2,087,855.00	0.15
312	002487	大金重工	78,400	2,087,008.00	0.15
313	603517	绝味食品	77,600	2,084,336.00	0.15

314	601179	中国西电	420,600	2,073,558.00	0.15
315	688538	和辉光电-U	852,600	2,071,818.00	0.15
316	000970	中科三环	199,475	2,064,566.25	0.15
317	603737	三棵树	43,180	2,055,799.80	0.15
318	601231	环旭电子	135,900	2,053,449.00	0.15
319	688200	华峰测控	16,720	2,053,216.00	0.15
320	601778	晶科科技	586,000	2,051,000.00	0.15
321	300438	鹏辉能源	72,300	2,045,367.00	0.15
322	600970	中材国际	216,800	2,024,912.00	0.15
323	000155	川能动力	151,400	2,012,106.00	0.15
324	000887	中鼎股份	162,100	2,005,177.00	0.15
325	600906	财达证券	266,300	1,997,250.00	0.15
326	600707	彩虹股份	294,400	1,987,200.00	0.15
327	603185	弘元绿能	59,323	1,974,269.44	0.15
328	600848	上海临港	196,400	1,973,820.00	0.15
329	600329	达仁堂	58,500	1,968,525.00	0.15
330	002030	达安基因	201,556	1,951,062.08	0.14
331	600481	双良节能	230,100	1,946,646.00	0.14
332	600995	南网储能	196,700	1,939,462.00	0.14
333	600959	江苏有线	615,400	1,932,356.00	0.14
334	603858	步长制药	113,500	1,930,635.00	0.14
335	002155	湖南黄金	172,653	1,923,354.42	0.14
336	000563	陕国投A	629,300	1,913,072.00	0.14
337	601866	中远海发	812,200	1,900,548.00	0.14
338	600208	新湖中宝	872,600	1,893,542.00	0.14
339	600755	厦门国贸	271,300	1,890,961.00	0.14
340	000027	深圳能源	292,780	1,888,431.00	0.14
341	601958	金钼股份	198,600	1,876,770.00	0.14
342	000778	新兴铸管	491,000	1,875,620.00	0.14
343	600977	中国电影	153,200	1,875,168.00	0.14
344	300357	我武生物	64,500	1,870,500.00	0.14
345	688029	南微医学	19,315	1,869,692.00	0.14
346	600131	国网信通	123,400	1,869,510.00	0.14
347	688082	盛美上海	17,900	1,868,939.00	0.14
348	600316	洪都航空	88,200	1,867,194.00	0.14
349	000739	普洛药业	120,900	1,860,651.00	0.14
350	000987	越秀资本	308,775	1,858,825.50	0.14
351	002244	滨江集团	255,300	1,856,031.00	0.14
352	002683	广东宏大	92,100	1,849,368.00	0.14
353	600582	天地科技	339,500	1,846,880.00	0.14
354	601991	大唐发电	762,800	1,845,976.00	0.14
355	603127	昭衍新药	77,620	1,840,370.20	0.14
356	601665	齐鲁银行	469,800	1,836,918.00	0.14

357	600373	中文传媒	138,900	1,830,702.00	0.13
358	002266	浙富控股	537,800	1,828,520.00	0.13
359	300888	稳健医疗	48,780	1,817,055.00	0.13
360	600737	中粮糖业	219,400	1,807,856.00	0.13
361	000709	河钢股份	848,100	1,806,453.00	0.13
362	603883	老百姓	60,062	1,795,253.18	0.13
363	000825	太钢不锈	469,200	1,750,116.00	0.13
364	002032	苏泊尔	33,000	1,749,330.00	0.13
365	600598	北大荒	145,800	1,745,226.00	0.13
366	002326	永太科技	150,000	1,743,000.00	0.13
367	601611	中国核建	247,700	1,716,561.00	0.13
368	600056	中国医药	153,400	1,713,478.00	0.13
369	600801	华新水泥	137,800	1,712,854.00	0.13
370	600378	昊华科技	56,100	1,709,928.00	0.13
371	603379	三美股份	50,140	1,704,760.00	0.13
372	000785	居然之家	515,800	1,702,140.00	0.13
373	000883	湖北能源	401,300	1,697,499.00	0.13
374	600528	中铁工业	227,800	1,694,832.00	0.12
375	601598	中国外运	323,400	1,694,616.00	0.12
376	603826	坤彩科技	28,700	1,694,161.00	0.12
377	300363	博腾股份	67,300	1,692,595.00	0.12
378	300776	帝尔激光	28,000	1,687,280.00	0.12
379	600901	江苏金租	348,260	1,685,578.40	0.12
380	603568	伟明环保	104,926	1,678,816.00	0.12
381	600517	国网英大	351,900	1,678,563.00	0.12
382	603267	鸿远电子	33,300	1,671,660.00	0.12
383	002511	中顺洁柔	164,300	1,643,000.00	0.12
384	603650	彤程新材	49,200	1,638,360.00	0.12
385	002153	石基信息	167,942	1,635,755.08	0.12
386	003035	南网能源	310,800	1,634,808.00	0.12
387	601992	金隅集团	855,200	1,633,432.00	0.12
388	600500	中化国际	368,100	1,627,002.00	0.12
389	601106	中国一重	562,600	1,620,288.00	0.12
390	002653	海思科	68,600	1,588,090.00	0.12
391	600062	华润双鹤	85,200	1,584,720.00	0.12
392	600827	百联股份	164,600	1,562,054.00	0.12
393	603228	景旺电子	69,120	1,559,347.20	0.11
394	000937	冀中能源	217,500	1,552,950.00	0.11
395	000581	威孚高科	102,200	1,540,154.00	0.11
396	002408	齐翔腾达	291,500	1,539,120.00	0.11
397	600871	石化油服	834,900	1,527,867.00	0.11
398	603026	胜华新材	33,200	1,522,552.00	0.11
399	001227	兰州银行	584,100	1,518,660.00	0.11

400	603305	旭升集团	76,500	1,509,345.00	0.11
401	003022	联泓新科	82,100	1,503,251.00	0.11
402	600022	山东钢铁	1,097,200	1,503,164.00	0.11
403	601098	中南传媒	147,400	1,499,058.00	0.11
404	603707	健友股份	99,517	1,492,755.00	0.11
405	601118	海南橡胶	351,100	1,488,664.00	0.11
406	600126	杭钢股份	277,000	1,476,410.00	0.11
407	688520	神州细胞-U	27,400	1,476,038.00	0.11
408	600315	上海家化	69,400	1,469,892.00	0.11
409	600764	中国海防	58,300	1,454,585.00	0.11
410	688779	长远锂科	198,000	1,445,400.00	0.11
411	601156	东航物流	97,700	1,444,006.00	0.11
412	600967	内蒙一机	174,800	1,443,848.00	0.11
413	002690	美亚光电	72,460	1,423,114.40	0.10
414	688349	三一重能	49,400	1,413,828.00	0.10
415	000559	万向钱潮	271,100	1,407,009.00	0.10
416	000156	华数传媒	190,000	1,400,300.00	0.10
417	000401	冀东水泥	218,100	1,393,659.00	0.10
418	688276	百克生物	25,400	1,392,174.00	0.10
419	601928	凤凰传媒	156,600	1,379,646.00	0.10
420	601608	中信重工	356,000	1,374,160.00	0.10
421	601187	厦门银行	270,700	1,372,449.00	0.10
422	688778	厦钨新能	34,500	1,367,580.00	0.10
423	002867	周大生	89,900	1,364,682.00	0.10
424	000089	深圳机场	210,300	1,352,229.00	0.10
425	600808	马钢股份	493,400	1,342,048.00	0.10
426	600663	陆家嘴	152,300	1,332,625.00	0.10
427	603529	爱玛科技	53,100	1,329,624.00	0.10
428	002518	科士达	48,100	1,327,560.00	0.10
429	688208	道通科技	55,800	1,325,250.00	0.10
430	600095	湘财股份	175,900	1,321,009.00	0.10
431	002010	传化智联	285,800	1,320,396.00	0.10
432	001286	陕西能源	153,900	1,315,845.00	0.10
433	603218	日月股份	105,800	1,308,746.00	0.10
434	300861	美畅股份	39,300	1,308,297.00	0.10
435	000958	电投产融	331,200	1,304,928.00	0.10
436	688425	铁建重工	328,100	1,302,557.00	0.10
437	300257	开山股份	81,500	1,284,440.00	0.09
438	000930	中粮科技	191,200	1,269,568.00	0.09
439	002423	中粮资本	189,000	1,262,520.00	0.09
440	603866	桃李面包	164,144	1,257,343.04	0.09
441	002505	鹏都农牧	784,400	1,255,040.00	0.09
442	002925	盈趣科技	64,100	1,248,027.00	0.09

443	000967	盈峰环境	260,900	1,239,275.00	0.09
444	600597	光明乳业	141,300	1,233,549.00	0.09
445	000898	鞍钢股份	491,500	1,223,835.00	0.09
446	002468	申通快递	157,063	1,223,520.77	0.09
447	688107	安路科技	32,866	1,208,811.48	0.09
448	600968	海油发展	417,000	1,188,450.00	0.09
449	603786	科博达	16,600	1,184,576.00	0.09
450	003031	中瓷电子	13,300	1,173,459.00	0.09
451	688281	华泰科技	8,631	1,170,881.46	0.09
452	300850	新强联	36,700	1,168,161.00	0.09
453	688006	杭可科技	49,540	1,163,199.20	0.09
454	601568	北元集团	244,440	1,158,645.60	0.09
455	002761	浙江建投	110,900	1,137,834.00	0.08
456	688348	昱能科技	9,281	1,135,808.78	0.08
457	688690	纳微科技	41,400	1,135,188.00	0.08
458	000959	首钢股份	319,800	1,106,508.00	0.08
459	000537	中绿电	114,600	1,103,598.00	0.08
460	002791	坚朗五金	26,300	1,064,887.00	0.08
461	600167	联美控股	187,700	1,064,259.00	0.08
462	688297	中无人机	27,561	1,056,413.13	0.08
463	600377	宁沪高速	101,800	1,043,450.00	0.08
464	600339	中油工程	343,600	1,041,108.00	0.08
465	001914	招商积余	86,900	1,039,324.00	0.08
466	002608	江苏国信	155,000	1,018,350.00	0.08
467	688387	信科移动-U	140,200	1,010,842.00	0.07
468	601228	广州港	309,500	968,735.00	0.07
469	600350	山东高速	138,900	963,966.00	0.07
470	002563	森马服饰	165,800	956,666.00	0.07
471	001203	大中矿业	92,700	942,759.00	0.07
472	600927	永安期货	59,800	939,458.00	0.07
473	301029	怡合达	35,520	915,705.60	0.07
474	603056	德邦股份	63,205	914,576.35	0.07
475	600928	西安银行	273,500	910,755.00	0.07
476	002399	海普瑞	76,700	899,691.00	0.07
477	000539	粤电力A	182,600	892,914.00	0.07
478	000402	金融街	245,300	890,439.00	0.07
479	601298	青岛港	143,700	888,066.00	0.07
480	603317	天味食品	65,631	872,235.99	0.06
481	601828	美凯龙	222,400	860,688.00	0.06
482	600925	苏能股份	155,500	856,805.00	0.06
483	688153	唯捷创芯	12,942	847,701.00	0.06
484	002945	华林证券	55,400	836,540.00	0.06
485	601139	深圳燃气	118,000	813,020.00	0.06

486	688105	诺唯赞	24,710	791,214.20	0.06
487	000031	大悦城	263,800	783,486.00	0.06
488	688295	中复神鹰	25,800	781,998.00	0.06
489	688819	天能股份	27,900	778,968.00	0.06
490	601061	中信金属	100,500	774,855.00	0.06
491	001872	招商港口	47,500	758,100.00	0.06
492	601158	重庆水务	118,200	670,194.00	0.05
493	600299	安迪苏	82,500	660,000.00	0.05
494	000553	安道麦 A	89,300	619,742.00	0.05
495	688375	国博电子	7,400	588,522.00	0.04
496	600956	新天绿能	72,300	587,799.00	0.04
497	603355	莱克电气	23,600	526,280.00	0.04
498	603868	飞科电器	9,900	499,950.00	0.04
499	688248	南网科技	17,400	434,478.00	0.03
500	600032	浙江新能	44,300	357,058.00	0.03

8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	301566	达利凯普	5,755	162,891.85	0.01
2	301578	辰奕智能	1,175	89,662.16	0.01
3	301526	国际复材	9,723	43,267.35	0.00
4	301487	盟固利	867	35,512.32	0.00
5	400174	中天3	286,500	31,515.00	0.00
6	301348	蓝箭电子	613	27,321.41	0.00
7	688652	京仪装备	416	21,736.00	0.00
8	300904	威力传动	304	18,705.12	0.00
9	301172	君逸数码	438	16,714.08	0.00
10	301421	波长光电	281	16,682.97	0.00
11	688627	精智达	184	16,140.48	0.00
12	601096	宏盛华源	3,918	15,907.08	0.00
13	301488	豪恩汽电	225	15,545.25	0.00
14	301370	国科恒泰	951	15,225.51	0.00
15	301381	赛维时代	506	15,023.14	0.00
16	301558	三态股份	1,079	14,458.60	0.00
17	688548	广钢气体	1,129	14,394.75	0.00
18	301510	固高科技	396	13,863.96	0.00
19	688549	中巨芯-U	1,696	13,720.64	0.00
20	688563	航材股份	216	13,065.84	0.00
21	688591	泰凌微	439	12,300.78	0.00
22	688582	芯动联科	304	11,755.68	0.00
23	301508	中机认检	419	11,178.92	0.00
24	301291	明阳电气	393	11,145.48	0.00
25	301292	海科新源	571	11,048.85	0.00

26	301486	致尚科技	228	10,773.00	0.00
27	301507	民生健康	678	10,746.30	0.00
28	301499	维科精密	371	10,733.03	0.00
29	688603	天承科技	140	10,379.60	0.00
30	688653	康希通信	648	10,361.52	0.00
31	301528	多浦乐	148	10,198.68	0.00
32	301261	恒工精密	195	9,915.75	0.00
33	603296	华勤技术	127	9,874.25	0.00
34	301413	安培龙	164	9,543.16	0.00
35	301516	中远通	604	9,368.04	0.00
36	301272	英华特	173	9,234.74	0.00
37	301511	德福科技	402	9,113.34	0.00
38	301202	朗威股份	283	8,999.40	0.00
39	301251	威尔高	260	8,993.40	0.00
40	688716	中研股份	243	8,842.77	0.00
41	301418	协昌科技	176	8,835.20	0.00
42	601083	锦江航运	796	8,811.72	0.00
43	301568	思泰克	246	8,752.68	0.00
44	301498	乖宝宠物	222	8,615.82	0.00
45	301519	舜禹股份	426	8,609.46	0.00
46	301550	斯菱股份	194	8,452.58	0.00
47	301393	昊帆生物	141	8,371.17	0.00
48	301518	长华化学	361	8,306.61	0.00
49	688702	盛科通信-U	172	8,286.96	0.00
50	301459	丰茂股份	208	8,286.72	0.00
51	688720	艾森股份	165	8,223.60	0.00
52	688573	信宇人	285	8,208.00	0.00
53	301489	思泉新材	128	8,206.08	0.00
54	688651	盛邦安全	178	8,196.90	0.00
55	688602	康鹏科技	737	8,151.22	0.00
56	301517	陕西华达	185	8,082.65	0.00
57	301520	万邦医药	150	7,911.00	0.00
58	688646	逸飞激光	219	7,899.33	0.00
59	301329	信音电子	354	7,869.42	0.00
60	688671	碧兴物联	226	7,751.80	0.00
61	688693	锆威特	178	7,726.98	0.00
62	301456	盘古智能	251	7,627.89	0.00
63	301533	威马农机	225	7,461.00	0.00
64	688429	时创能源	346	7,331.74	0.00
65	301555	惠柏新材	224	7,266.56	0.00
66	688719	爱科赛博	120	7,212.00	0.00
67	301505	苏州规划	194	6,947.14	0.00
68	301529	福赛科技	182	6,894.16	0.00

69	301559	中集环科	365	6,657.60	0.00
70	301371	敷尔佳	177	6,651.66	0.00
71	688638	誉辰智能	111	6,624.48	0.00
72	688648	中邮科技	303	6,493.29	0.00
73	688657	浩辰软件	83	6,493.09	0.00
74	301515	港通医疗	222	6,275.94	0.00
75	301500	飞南资源	298	6,225.22	0.00
76	688612	威迈斯	163	6,189.11	0.00
77	301525	儒竞科技	75	6,109.50	0.00
78	603004	鼎龙科技	195	6,082.05	0.00
79	301548	崇德科技	102	6,016.98	0.00
80	001378	德冠新材	182	5,691.14	0.00
81	688450	光格科技	139	5,062.38	0.00
82	001306	夏厦精密	64	4,823.04	0.00
83	001326	联域股份	99	4,815.36	0.00
84	603270	金帝股份	155	4,584.90	0.00
85	603119	浙江荣泰	184	4,392.08	0.00
86	001358	兴欣新材	87	3,841.92	0.00
87	001239	永达股份	189	3,764.88	0.00
88	603107	上海汽配	203	3,692.57	0.00
89	603075	热威股份	157	3,659.67	0.00
90	603193	润本股份	211	3,515.26	0.00
91	603062	麦加芯彩	60	3,468.60	0.00
92	603231	索宝蛋白	161	3,466.33	0.00
93	603273	天元智能	178	3,376.66	0.00
94	603276	恒兴新材	134	3,333.92	0.00
95	603373	安邦护卫	88	3,058.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300502	新易盛	9,063,661.00	2.58
2	600418	江淮汽车	7,309,671.87	2.08
3	601555	东吴证券	6,954,022.00	1.98
4	600372	中航机载	6,785,408.32	1.93
5	600157	永泰能源	6,675,678.00	1.90
6	002517	恺英网络	6,533,510.71	1.86
7	600489	中金黄金	6,500,563.12	1.85
8	688256	寒武纪-U	6,467,380.91	1.84
9	600079	人福医药	6,151,832.00	1.75
10	688122	西部超导	6,146,523.95	1.75
11	300394	天孚通信	6,004,908.03	1.71

12	688072	拓荆科技	5,947,402.50	1.69
13	600885	宏发股份	5,893,150.81	1.68
14	600161	天坛生物	5,881,645.72	1.67
15	601058	赛轮轮胎	5,860,730.00	1.67
16	688169	石头科技	5,801,747.61	1.65
17	301236	软通动力	5,764,616.93	1.64
18	601108	财通证券	5,749,566.00	1.63
19	600536	中国软件	5,639,187.00	1.60
20	600563	法拉电子	5,602,470.00	1.59

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

8.4.2 累计卖出金额超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	300308	中际旭创	18,926,695.56	5.38
2	688256	寒武纪-U	9,485,876.99	2.70
3	600489	中金黄金	8,144,571.00	2.32
4	600372	中航机载	6,767,030.57	1.92
5	000807	云铝股份	6,423,241.00	1.83
6	600487	亨通光电	6,386,197.00	1.82
7	300832	新产业	5,722,058.00	1.63
8	688777	中控技术	5,345,194.17	1.52
9	600705	中航产融	4,738,876.00	1.35
10	600027	华电国际	4,673,797.00	1.33
11	600563	法拉电子	3,437,578.00	0.98
12	300182	捷成股份	3,301,012.00	0.94
13	002221	东华能源	3,232,895.00	0.92
14	688009	中国通号	2,988,122.35	0.85
15	600667	太极实业	2,872,400.00	0.82
16	300115	长盈精密	2,861,610.40	0.81
17	688122	西部超导	2,725,358.28	0.77
18	601005	重庆钢铁	2,578,002.00	0.73
19	300482	万孚生物	2,467,964.00	0.70
20	688116	天奈科技	2,461,385.04	0.70

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,024,273,697.50
卖出股票收入（成交）总额	504,246,680.17

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：无。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：无。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：无。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：无。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：无。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数，实现投资目标。同时，本基金将力争利用股指期货的杠杆作用，降低申购赎回时现金资产对投资组合的影响及仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，从而达到稳定投资组合资产净值的目的。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

8.12 投资组合报告附注

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

思源电气股份有限公司在报告编制日前一年内受到中华人民共和国洋山港海事局的处罚。

以上证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券备选库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
----	----	----

1	存出保证金	4,156,109.56
2	应收清算款	2,941,864.11
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	66,927.13
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,164,900.80

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	300418	昆仑万维	1,832,600.00	0.13	转融通流通受限
2	002028	思源电气	1,238,552.00	0.09	转融通流通受限
3	002463	沪电股份	1,203,328.00	0.09	转融通流通受限
4	002422	科伦药业	1,182,335.00	0.09	转融通流通受限
5	000975	银泰黄金	1,110,000.00	0.08	转融通流通受限
6	000988	华工科技	946,368.00	0.07	转融通流通受限
7	601058	赛轮轮胎	862,450.00	0.06	转融通流通受限
8	600157	永泰能源	678,150.00	0.05	转融通流通受限
9	300502	新易盛	246,600.00	0.02	转融通流通受限

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	301526	国际复材	43,267.35	0.00	新股流通受限

2	301487	盟固利	35,512.32	0.00	新股流通受限
3	400174	中天3	31,515.00	0.00	重大事项停牌
4	301566	达利凯普	12,752.64	0.00	新股流通受限
5	301578	辰奕智能	8,061.76	0.00	新股流通受限

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

9.1.1 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 (%)
9,578	106,516.10	850,595,398.00	83.37	169,615,855.00	16.63

9.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额 (份)	占总份额比例 (%)
中国工商银行股份有限公司-鹏华中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金	832,254,037.00	81.58

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	胡小彩	5,500,000.00	0.54
2	招商证券股份有限公司	4,380,373.00	0.43
3	方正证券股份有限公司	3,292,018.00	0.32
4	中信建投证券股份有限公司	2,878,399.00	0.28
5	广发证券股份有限公司	2,468,100.00	0.24
6	魏丽君	2,105,200.00	0.21
7	光大证券股份有限公司	2,087,800.00	0.20
8	王雪有	2,000,000.00	0.20
9	于明中	1,986,700.00	0.19
10	长城基金-兴业银行-长城基金泓湖百世	1,965,600.00	0.19

	自动驾驶 1 号集合资产管理计划		
-	中国工商银行股份有限公司—鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	832,254,037.00	81.58

注：持有人为场内持有人。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：截至本报告期末，本基金管理人所有从业人员未持有本基金份额。

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

注：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及本基金的基金经理未持有本基金份额。

9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

注：无。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2019 年 11 月 21 日） 基金份额总额	490,211,253.00
本报告期期初基金份额总额	252,211,253.00
本报告期基金总申购份额	1,008,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	240,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,020,211,253.00

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

无。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的，与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未改聘为本基金审计的会计师事务所。本年度应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用 46,000.00 元，该审计机构已提供审计服务的年限为 4 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：无。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中金公司	1	816,763,194.51	53.95	752,602.83	53.99	-
国信证券	2	336,565,840.03	22.23	310,129.03	22.25	-
平安证券	1	288,868,063.51	19.08	266,139.20	19.09	-
招商证券	1	56,755,941.33	3.75	52,289.81	3.75	-
国盛证券	1	5,234,288.34	0.35	4,318.75	0.31	-
中泰证券	1	4,147,748.47	0.27	3,881.88	0.28	-
华西证券	1	2,669,136.00	0.18	2,192.08	0.16	-
国元证券	1	2,555,940.60	0.17	2,103.32	0.15	-
国泰君安	1	290,019.76	0.02	267.17	0.02	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	本报告期新增
申万宏源证券	2	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-

西部证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	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，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，最近二年未发生因重大违规行为而受到中国证监会处罚；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；

(6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务。

2) 选择交易单元的程序：

我公司根据上述标准，选定符合条件的证券公司作为租用交易单元的对象。我公司投研部门定期对所选定证券公司的服务进行综合评比，评比内容包括：提供研究报告质量、数量、及时性以及提供研究服务主动性和质量等情况，并依据评比结果确定交易单元交易的具体情况。我公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向券商租用交易单元作为基金专用交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

注：无。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《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	2023 年 01 月 04 日
2	鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2022 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	2023 年 01 月 20 日
3	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购中润光学首次公开发行 A 股的公告	《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	2023 年 02 月 10 日
4	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金增加西南证券股份有限公司为申	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会	2023 年 02 月 20 日

	购赎回代理券商的公告	基金电子披露网站	
5	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中国中金财富证券有限公司为申购赎回代理券商的公告	《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	2023 年 03 月 03 日
6	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金增加东海证券股份有限公司为申购赎回代理券商的公告	《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	2023 年 03 月 17 日
7	鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2022 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	2023 年 03 月 30 日
8	鹏华基金管理有限公司关于新增人民币直销资金专户的公告	《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	2023 年 04 月 07 日
9	鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2023 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	2023 年 04 月 21 日
10	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购航天软件首次公开发行 A 股的公告	《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	2023 年 05 月 17 日
11	鹏华基金管理有限公司关于注意防范以协助办理贷款为借口进行诈骗活动的风险提示	《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	2023 年 06 月 03 日
12	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与国海证券股份有限公司申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告	《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	2023 年 06 月 05 日
13	鹏华基金管理有限公司关于鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金所持停牌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	2023 年 06 月 09 日
14	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华福证券有限责任公司为申购赎回代理券商的公告	《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	2023 年 06 月 12 日
15	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华福证券有限责任公司为申购赎回代理券商的公告	《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	2023 年 06 月 12 日
16	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购豪恩汽电首次公开发行 A 股的公告	《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	2023 年 06 月 28 日
17	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金增加德邦证券股份有限公司为申购赎回代理券商的公告	《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	2023 年 06 月 29 日
18	关于鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会	2023 年 07 月 03 日

		基金电子披露网站	
19	鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2023 年第 2 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	2023 年 07 月 20 日
20	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金增加万联证券股份有限公司为申购赎回代理券商的公告	《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	2023 年 08 月 17 日
21	鹏华基金管理有限公司关于运用固有资金投资旗下基金的公告	《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	2023 年 08 月 21 日
22	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购金帝股份首次公开发行 A 股的公告	《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	2023 年 08 月 26 日
23	鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2023 年中期报告	《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	2023 年 08 月 30 日
24	鹏华中证 500 交易型开放式指数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	2023 年 10 月 12 日
25	鹏华中证 500 交易型开放式指数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	2023 年 10 月 12 日
26	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	2023 年 10 月 13 日
27	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金增加国金证券股份有限公司为申购赎回代理券商的公告	《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	2023 年 10 月 24 日
28	鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2023 年第 3 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	2023 年 10 月 24 日
29	鹏华基金管理有限公司关于运用固有资金投资旗下基金的公告	《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	2023 年 11 月 07 日
30	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金增加金元证券股份有限公司为申购赎回代理券商的公告	《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	2023 年 11 月 22 日
31	关于鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	《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	2023 年 11 月 27 日
32	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华金证券股份有限公司为申购赎回代理券商的公告	《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	2023 年 12 月 12 日

注：无。

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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	20230101~20231231	62,577,637.00	1,001,977,000.00	232,300,600.00	832,254,037.00	81.58
产品特有风险							
基金份额持有人持有的基金份额所占比例过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引起基金净值剧烈波动，甚至可能引发基金流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。							

注：1、申购份额包含基金申购份额、基金转换入份额、强制调增份额、场内买入份额和红利再投资份额；

2、赎回份额包含基金赎回份额、基金转换出份额、强制调减份额、场内卖出份额。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- (一)《鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- (二)《鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- (三)《鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2023 年年度报告》(原文)。

13.2 存放地点

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

13.3 查阅方式

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

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

鹏华基金管理有限公司

2024 年 3 月 28 日