

鹏华量化先锋混合型证券投资基金 2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
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	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
§ 7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	19
7.3 净资产变动表	20
7.4 报表附注	22

§ 8 投资组合报告	59
8.1 期末基金资产组合情况	59
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	59
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	60
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	72
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	82
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	82
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	82
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	82
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	82
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	82
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	82
8.12 投资组合报告附注	82
§ 9 基金份额持有人信息	83
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	83
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	83
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	83
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	84
§ 10 开放式基金份额变动	84
§ 11 重大事件揭示	84
11.1 基金份额持有人大会决议	84
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	84
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	84
11.4 基金投资策略的改变	84
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	84
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	85
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	85
11.8 其他重大事件	89
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	91
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	91
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	92
§ 13 备查文件目录	92
13.1 备查文件目录	92
13.2 存放地点	92
13.3 查阅方式	92

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华量化先锋混合型证券投资基金
基金简称	鹏华量化先锋混合
基金主代码	005632
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年2月23日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,109,621,364.59份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过运用量化选股策略，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>本基金采用数量化模型驱动的选股策略为主导投资策略，结合适当的资产配置策略，并依靠严格的投资纪律和风险控制，以保证在控制风险的前提下实现收益最大化。</p> <p>1、资产配置策略 本基金通过对宏观环境和政策导向的分析等构建数量化模型，以对大类资产风险收益状态、投资者行为、市场情绪、市场风险偏好等进行系统分析和评估。本基金根据基本面分析框架、现代投资组合理论以及风险预算模型对大类资产进行综合评估，确定大类资产配置权重，同时合理使用金融工具实现对组合风险暴露的动态调整。</p> <p>2、股票投资策略 本基金对股票的投资采用“自上而下”的行业配置策略以及“自下而上”的量化选股策略，在纪律化模型约束下，根据市场变化趋势，对模型进行动态调整。</p> <p>(1) 行业配置策略 本基金的行业配置策略综合考虑行业的基本面、现代投资组合理论以及风险预算模型，结合定性和定量分析作出行业配置决策，在基金整体风险水平可控的前提下，实现各行业的合理配置和优化。</p> <p>(2) 量化选股策略 本基金将以多因子选股策略构建股票投资组合。多因子选股策略的信息主要来自于基本面、预期数据、市场交易数据等，每一类信息代表一种选股逻辑。在不同的市场环境下，选股逻辑会有不同的侧重点。基于不同的选股逻辑，构建个股维度的多因子选股策略，包括价值、基本面、市场、成长、预期等，并对因子的有效性进行情景分析和动态监控，筛选出有效因子组合，构建股票资产组合。 本基金在股票投资组合构建完成后，将根据个股价格波动、风险收益变化的实际情况，定期或不定期调整个股权重，以确保整个股票组合的风险处于可控范围内。</p> <p>(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。</p> <p>3、债券投资策略 本基金债券投资将采取久期策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、个券选择策略、信用策略、中小企业私募债投资策略等积极投资策略，灵活地调整组合的券种搭配，精选安全边际较高的</p>

	<p>个券。（1）久期策略 久期管理是债券投资的重要考量因素，本基金将采用以“目标久期”为中心、自上而下的组合久期管理策略。（2）收益率曲线策略 收益率曲线的形状变化是判断市场整体走向的一个重要依据，本基金将据此调整组合长、中、短期债券的搭配，并进行动态调整。（3）骑乘策略 本基金将采用基于收益率曲线分析对债券组合进行适时调整的骑乘策略，以达到增强组合的持有期收益的目的。（4）息差策略 本基金将采用息差策略，以达到更好地利用杠杆放大债券投资的收益的目的。（5）个券选择策略 本基金将根据单个债券到期收益率相对于市场收益率曲线的偏离程度，结合信用等级、流动性、选择权条款、税赋特点等因素，确定其投资价值，选择定价合理或价值被低估的债券进行投资。（6）信用策略 本基金通过主动承担适度的信用风险来获取信用溢价，根据内、外部信用评级结果，结合对类似债券信用利差的分析以及对未来信用利差走势的判断，选择信用利差被高估、未来信用利差可能下降的信用债进行投资。（7）中小企业私募债投资策略 本基金将深入研究发行人资信及公司运营情况，与中小企业私募债承销券商紧密合作，合理合规合格地进行中小企业私募债券投资。本基金在投资过程中密切监控债券信用等级或发行人信用等级变化情况，力求规避可能存在的债券违约，并获取超额收益。</p> <p>4、权证投资策略 本基金通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型及价值挖掘策略、价差策略、双向权证策略等寻求权证的合理估值水平，追求稳定的当期收益。</p> <p>5、股指期货投资策略 本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目标，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，充分考虑股指期货的风险收益特征，通过多头或空头的套期保值策略，以改善投资组合的投资效果，实现股票组合的超额收益。</p> <p>6、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。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金属于混合型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。

注：无。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	鹏华基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	高永杰
	联系电话	0755-81395402
	电子邮箱	xxpl@phfund.com.cn
客户服务电话	4006788999	021-60637228
传真	0755-82021126	021-60635778
注册地址	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	北京市西城区金融大街 25 号

办公地址	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	518048	100033
法定代表人	何如	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	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	鹏华基金管理有限公司	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023 年	2022 年	2021 年
本期已实现收益	-20,115,356.70	-61,507,814.27	37,917,063.92
本期利润	-30,764,325.78	-74,545,104.02	52,753,699.75
加权平均基金份额本期利润	-0.0896	-0.3533	0.2579
本期加权平均净值利润率	-6.98%	-26.57%	19.58%
本期基金份额净值增长率	-1.02%	-11.18%	26.34%
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	555,025,669.60	134,395,045.32	208,190,839.30
期末可供分配基金	0.5002	0.7063	0.8665

份额利润			
期末基金资产净值	1,182,919,591.58	242,066,541.24	344,157,742.04
期末基金份额净值	1.0661	1.2721	1.4323
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	25.91%	27.21%	43.23%

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。

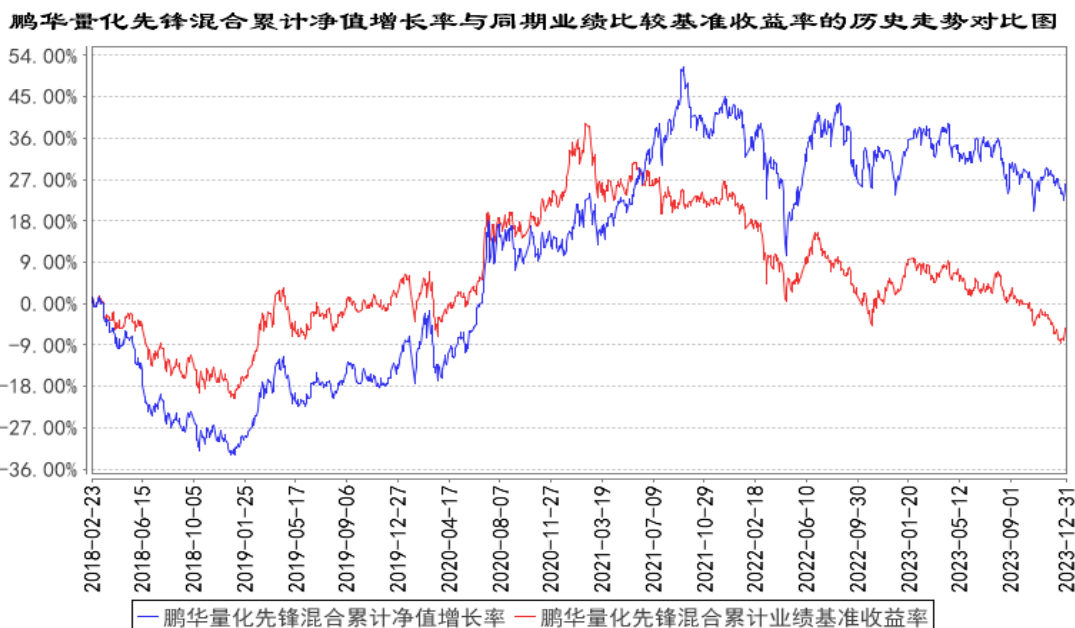
3.2 基金净值表现

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	-2.45%	0.79%	-5.34%	0.63%	2.89%	0.16%
过去六个月	-6.87%	0.85%	-8.19%	0.68%	1.32%	0.17%
过去一年	-1.02%	0.82%	-8.15%	0.68%	7.13%	0.14%
过去三年	11.06%	1.08%	-25.84%	0.89%	36.90%	0.19%
过去五年	84.62%	1.19%	17.71%	0.97%	66.91%	0.22%
自基金合同生效起至今	25.91%	1.20%	-5.46%	0.98%	31.37%	0.22%

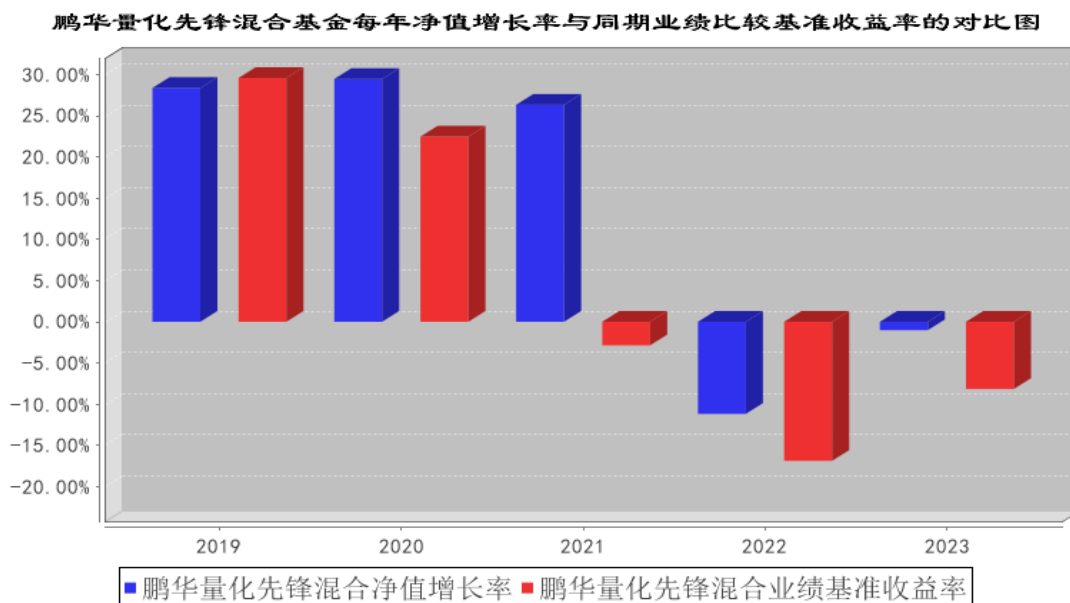
注：业绩比较基准=沪深 300 指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%

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



注：1、本基金基金合同于 2018 年 02 月 23 日生效。2、截至建仓期结束，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

3.2.3 过去五年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



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

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分 红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总 额	年度利润分配合计	备注
2023 年	1.9000	187,452,057.00	19,873,626.63	207,325,683.63	-
2022 年	-	-	-	-	-
2021 年	-	-	-	-	-
合计	1.9000	187,452,057.00	19,873,626.63	207,325,683.63	-

§ 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		
苏俊 杰	基金经理	2021-03- 05	-	11 年	苏俊杰先生，国籍中国，理学硕士，11 年证券从业经验。曾任 MSCI INC. 分析师，华泰柏瑞基金管理有限公司专户投资经理，财通基金管理有限公司基金经理。2019 年 07 月加盟鹏华基金管理有限公司，历任量化及衍生品投资部副总经理，现担任量化及衍生品投资部总经理/基金经理。2021 年 03 月至今担任鹏华沪深 300 指数增强型证券投资基金基金经理，2021 年 03 月至今担任鹏华量化先锋混合型证券投资基金基金经理，2022 年 01 月至今担任鹏华中证 500 指数增强型证券投资基金基金经理，2022 年 08 月至 2023 年 12 月担任鹏华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）基金经理，2022 年 08 月至 2023 年 08 月担任鹏华创业板指数型证券投资基金（LOF）基金经理，2022 年 08 月至 2023 年 08 月担任鹏华中证 500 指数证券投资基金（LOF）基金

				<p>经理, 2022 年 12 月至今担任鹏华上证科创板 50 成份增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2022 年 12 月至今担任鹏华中证 1000 指数增强型证券投资基金基金经理, 2022 年 12 月至今担任鹏华创业板 50 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 2000 指数增强型证券投资基金基金经理, 2023 年 06 月至今担任鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2023 年 08 月至今担任鹏华创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理, 2023 年 09 月至今担任鹏华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2023 年 09 月至今担任鹏华上证科创板 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2023 年 12 月至今担任鹏华上证科创板 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理, 2023 年 12 月至今担任鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 基金经理, 苏俊杰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合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》, 公司制定了《鹏华基金管

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

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

在交易执行环节：1、所有公司管理的资产组合的交易必须通过集中交易室完成，集中交易室负责建立和执行交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会；2、针对交易所公开竞价交易，集中交易室应严格启用恒生交易系统内的公平交易程序，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

报告期内，本基金以稳定增值为主要投资目标。投资策略方面，本基金采用量化方法进行选股。量化选股模型立足于上市公司的基本面信息，侧重于长期表现有效的因子类别，同时结合短期市场情绪、动量等因子，从而将模型的短期与长期有效性进行平衡与提高。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期份额净值增长率为-1.02%，同期业绩比较基准增长率为-8.15%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2024 年，市场当前在估值、情绪、资金等各个维度均处于历史低位状态，在年初市场风险再次释放之后，当前资产价格可能已经隐含过于悲观预期；目前市场底部支撑较强，后续仍有结构性上涨机会，但可能会出现叠加快速风格与行业轮动的震荡上行。尽管还存在诸多的不确定因素，权益市场仍然进入了一个安全边际较高的配置窗口，但具体的节奏需考虑国内宏观经济和企业盈利的边际变化情况、以及国外主要经济体所处周期等因素。

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、风险管理部、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 555,025,669.60 元，期末基金份额净值 1.0661 元。

2、本基金于 2023 年 12 月 25 日进行利润分配，分配金额为 207,325,683.63 元。

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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 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 25683 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	鹏华量化先锋混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了鹏华量化先锋混合型证券投资基金(以下简称“鹏华量化先锋混合基金”)的财务报表,包括2023年12月31日的资产负债表,2023年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了鹏华量化先锋混合基金2023年12月31日的财务状况以及2023年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于鹏华量化先锋混合基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	无。
其他事项	无。
其他信息	无。
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>鹏华量化先锋混合基金的基金管理人鹏华基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估鹏华量化先锋混合基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算鹏华量化先锋混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督鹏华量化先锋混合基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p>

	<p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对导致对鹏华量化先锋混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致鹏华量化先锋混合基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	单峰 仲文渊
会计师事务所的地址	中国上海市
审计报告日期	2024 年 3 月 25 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：鹏华量化先锋混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	79,416,952.61	37,090,491.69
结算备付金		9,434,101.50	1,098,102.59
存出保证金		261,268.89	106,169.23
交易性金融资产	7.4.7.2	1,098,977,666.43	224,317,019.26
其中：股票投资		1,098,977,666.43	224,317,019.26

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		150,374.26	-
应收股利		-	-
应收申购款		93,093.54	58,836.81
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		1,188,333,457.23	262,670,619.58
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		-	19,242,333.61
应付赎回款		39,112.63	24,699.83
应付管理人报酬		1,363,797.90	432,745.37
应付托管费		227,299.65	72,124.24
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	3,783,655.47	832,175.29
负债合计		5,413,865.65	20,604,078.34
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	627,893,921.98	107,671,495.92
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	555,025,669.60	134,395,045.32
净资产合计		1,182,919,591.58	242,066,541.24
负债和净资产总计		1,188,333,457.23	262,670,619.58

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0661 元，基金份额总额 1,109,621,364.59 份。

7.2 利润表

会计主体：鹏华量化先锋混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-24,028,304.97	-69,473,932.64
1. 利息收入		157,932.26	95,534.86
其中：存款利息收入	7.4.7.13	157,932.26	95,534.86
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		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-14,454,774.89	-56,982,937.92
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-19,964,735.90	-59,863,057.74
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	-	-
股利收益	7.4.7.19	5,509,961.01	2,880,119.82
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	-10,648,969.08	-13,037,289.75
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	917,506.74	450,760.17
减：二、营业总支出		6,736,020.81	5,071,171.38
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	5,623,961.44	4,198,746.49
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	937,326.87	699,791.03

3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	7.4.7.23	174,732.50	172,633.86
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-30,764,325.78	-74,545,104.02
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-30,764,325.78	-74,545,104.02
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-30,764,325.78	-74,545,104.02

7.3 净资产变动表

会计主体：鹏华量化先锋混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	107,671,495.92	-	134,395,045.32	242,066,541.24
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	107,671,495.92	-	134,395,045.32	242,066,541.24
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	520,222,426.06	-	420,630,624.28	940,853,050.34
（一）、综合收益总额	-	-	-30,764,325.78	-30,764,325.78
（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）	520,222,426.06	-	658,720,633.69	1,178,943,059.75

其中：1. 基金申购款	638,734,821.78	-	819,405,751.45	1,458,140,573.23
2. 基金赎回款	-118,512,395.72	-	-160,685,117.76	-279,197,513.48
(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)	-	-	-207,325,683.63	-207,325,683.63
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	627,893,921.98	-	555,025,669.60	1,182,919,591.58
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	135,966,902.74	-	208,190,839.30	344,157,742.04
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	135,966,902.74	-	208,190,839.30	344,157,742.04
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-28,295,406.82	-	-73,795,793.98	-102,091,200.80
(一)、综合收益总额	-	-	-74,545,104.02	-74,545,104.02
(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)	-28,295,406.82	-	749,310.04	-27,546,096.78
其中：1. 基金申购款	152,223,729.96	-	210,996,759.94	363,220,489.90
2. 基金赎回款	-180,519,136.7	-	-210,247,449.9	-390,766,586.68

	8		0	
(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	107,671,495.92	-	134,395,045.32	242,066,541.24

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：

<u>邓召明</u>	<u>邢彪</u>	<u>郝文高</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

鹏华量化先锋混合型证券投资基金（原鹏华沪深 300 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[2013]640 号《关于核准鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金募集的批复》核准，由鹏华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,306,495,157.00 元（含募集股票市值），业经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）普华永道中天验字(2013)第 380 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2013 年 7 月 19 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,306,582,851.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 87,694.00 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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

鹏华量化先锋混合型证券投资基金是根据原鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会于 2018 年 1 月 8 日决议通过的《关于鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金转型并修改基金合同等相关事项的议案》，经中国证券监督管理委员会证监许可[2017]1052 号《关于准予鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金变更注册的批复》核准，由鹏华沪深

300ETF 基金转型而来。原鹏华沪深 300ETF 基金存续期限至 2018 年 2 月 22 日止。自 2018 年 2 月 23 日起，原鹏华沪深 300ETF 基金更名为鹏华量化先锋混合型证券投资基金，《鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》失效的同时《鹏华量化先锋混合型证券投资基金基金合同》生效。本基金为契约开放式，存续期限不定。原鹏华沪深 300ETF 基金失效前的基金资产净值为 32,712,954.49 元，已于本基金的基金合同生效日全部转为本基金的基金资产净值。根据《鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金份额折算和变更登记结果公告》的有关规定，本基金的基金管理人于 2018 年 2 月 22 日日终对投资者持有的鹏华沪深 300ETF 基金基金份额变更登记为本基金基金份额，基金份额总额为 32,712,954.48 份。

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》、《鹏华量化先锋混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决

于本基金对金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

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

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产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。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑在资产负债表日无须付出不必要的额外成本和努力即可获得的有关过去事项、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为资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、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，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

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

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

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	79,416,952.61	37,090,491.69
等于：本金	79,406,796.27	37,085,868.74
加：应计利息	10,156.34	4,622.95

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	79,416,952.61	37,090,491.69

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	1,119,512,878.98	-	1,098,977,666.43	-20,535,212.55
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	1,119,512,878.98	-	1,098,977,666.43	-20,535,212.55
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	234,203,262.73	-	224,317,019.26	-9,886,243.47
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	234,203,262.73	-	224,317,019.26	-9,886,243.47

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

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

7.4.7.8 其他资产

注：无。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 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	63.04	8.62
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	3,613,592.43	662,166.67
其中：交易所市场	3,613,592.43	662,166.67
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	170,000.00	170,000.00
合计	3,783,655.47	832,175.29

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	190,284,295.46	107,671,495.92
本期申购	1,128,780,675.70	638,734,821.78
本期赎回（以“-”号填列）	-209,443,606.57	-118,512,395.72
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	1,109,621,364.59	627,893,921.98

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.11 其他综合收益

注：无。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	182,459,042.93	-48,063,997.61	134,395,045.32
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	182,459,042.93	-48,063,997.61	134,395,045.32
本期利润	-20,115,356.70	-10,648,969.08	-30,764,325.78
本期基金份额交易产生的变动数	868,338,632.83	-209,617,999.14	658,720,633.69
其中：基金申购款	1,074,533,459.46	-255,127,708.01	819,405,751.45
基金赎回款	-206,194,826.63	45,509,708.87	-160,685,117.76
本期已分配利润	-207,325,683.63	-	-207,325,683.63
本期末	823,356,635.43	-268,330,965.83	555,025,669.60

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
活期存款利息收入	128,687.05	76,251.30
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	27,334.65	17,700.86
其他	1,910.56	1,582.70
合计	157,932.26	95,534.86

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	-19,964,735.90	-59,863,057.74
股票投资收益——赎回 差价收入	-	-
股票投资收益——申购 差价收入	-	-
股票投资收益——证券	-	-

出借差价收入		
合计	-19,964,735.90	-59,863,057.74

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	2,784,573,611.33	1,620,354,981.24
减：卖出股票成本总额	2,796,789,193.94	1,675,962,261.24
减：交易费用	7,749,153.29	4,255,777.74
买卖股票差价收入	-19,964,735.90	-59,863,057.74

7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

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

注：无。

7.4.7.19 股利收益

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
股票投资产生的股利收益	5,509,961.01	2,880,119.82
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	5,509,961.01	2,880,119.82

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	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
1. 交易性金融资产	-10,648,969.08	-13,037,289.75
股票投资	-10,648,969.08	-13,037,289.75
债券投资	-	-

资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-10,648,969.08	-13,037,289.75

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	906,932.76	450,488.61
基金转换费收入	10,573.98	271.56
合计	917,506.74	450,760.17

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	50,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费用	4,732.50	2,633.86
合计	174,732.50	172,633.86

7.4.7.24 分部报告

无。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
鹏华基金管理有限公司(“鹏华基金公司”)	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“建设银行”)	基金托管人、基金代销机构
国信证券股份有限公司(“国信证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构
深圳市北融信投资发展有限公司	基金管理人的股东
意大利欧利盛资本资产管理股份公司(“Eurizon Capital SGR S.p.A.”)	基金管理人的股东
鹏华资产管理有限公司(“鹏华资产”)	基金管理人的子公司

注：1、本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

2、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)
国信证券	320,678,478.81	4.97	-	-

7.4.10.1.2 债券交易

注：无。

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

7.4.10.1.4 权证交易

注：无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例(%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总量的比例(%)
国信证券	296,167.20	5.41	244,788.92	6.77

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	-	-	-	-

注：（1）佣金的计算公式

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

（佣金比率按照与一般证券公司签订的协议条款订立。）

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

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	5,623,961.44	4,198,746.49
其中：应支付销售机构的客户维护费	574,570.88	197,392.62
应支付基金管理人的净管理费	5,049,390.56	4,001,353.87

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

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

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	937,326.87	699,791.03

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

7.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：无。

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

注：无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	79,416,952.61	128,687.05	37,090,491.69	76,251.30

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2023年1月1日至2023年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位：股/张)	总金额
国信证券	603270	金帝股份	网下申购	1,386	30,173.22
国信证券	688562	航天软件	网下申购	3,540	44,887.20
国信证券	688307	中润光学	网下申购	2,455	58,625.40
国信证券	301488	豪恩汽电	网下申购	1,645	65,438.10
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	2,268	105,076.44
国信证券	688401	路维光电	网下申购	4,799	120,358.92
国信证券	688231	隆达股份	网下申购	1,262	49,318.96
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

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2023年12月25日	-	2023年12月25日	1.9000	187,452,057.00	19,873,626.63	207,325,683.63	-
合计	-	-	-	1.9000	187,452,057.00	19,873,626.63	207,325,683.63	-

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	51	2,735.13	3,843.36	-
001326	联域	2023年11	6个月	新股流通	41.18	48.64	88	3,623.84	4,280.32	-

	股份	月1日		受限						
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	德冠新材	2023年10月23日	6个月	新股流通受限	31.68	31.27	166	5,258.88	5,190.82	-
300904	威力传动	2023年8月2日	6个月	新股流通受限	35.41	61.53	254	8,994.14	15,628.62	-
301172	君逸数码	2023年7月19日	6个月	新股流通受限	31.33	38.16	312	9,774.96	11,905.92	-
301202	朗威股份	2023年6月28日	6个月	新股流通受限	25.82	31.80	208	5,370.56	6,614.40	-
301251	威尔高	2023年8月30日	6个月	新股流通受限	28.88	34.59	225	6,498.00	7,782.75	-
301261	恒工精密	2023年6月29日	6个月	新股流通受限	36.90	50.85	144	5,313.60	7,322.40	-
301272	英华特	2023年7月6日	6个月	新股流通受限	51.39	53.38	125	6,423.75	6,672.50	-
301291	明阳电气	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	38.13	28.36	288	10,981.44	8,167.68	-
301292	海科新源	2023年6月29日	6个月	新股流通受限	19.99	19.35	420	8,395.80	8,127.00	-
301329	信音电子	2023年7月5日	6个月	新股流通受限	21.00	22.23	249	5,229.00	5,535.27	-

301348	蓝箭电子	2023年8月1日	6个月	新股流通受限	18.08	44.57	458	8,280.64	20,413.06	-
301370	国科恒泰	2023年7月3日	6个月	新股流通受限	13.39	16.01	698	9,346.22	11,174.98	-
301371	敷尔佳	2023年7月24日	6个月	新股流通受限	55.68	37.58	124	6,904.32	4,659.92	-
301381	赛维时代	2023年7月5日	6个月	新股流通受限	20.45	29.69	356	7,280.20	10,569.64	-
301393	昊帆生物	2023年7月5日	6个月	新股流通受限	67.68	59.37	101	6,835.68	5,996.37	-
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	158	8,197.04	7,931.60	-
301421	波长光电	2023年8月16日	6个月	新股流通受限	29.38	59.37	257	7,550.66	15,258.09	-
301456	盘古智能	2023年7月6日	6个月	新股流通受限	37.96	30.39	174	6,605.04	5,287.86	-
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	167	9,629.22	7,890.75	-
301487	盟	2023	6个月	新股	5.32	40.96	867	4,612.44	35,512.32	-

	固利	年8月 1日		流通 受限							
301488	豪恩 汽电	2023 年6月 26日	6个月	新股 流通 受限	39.78	69.09	165	6,563.70	11,399.85	-	
301489	思泉 新材	2023 年10 月16 日	6个月	新股 流通 受限	41.66	64.11	128	5,332.48	8,206.08	-	
301498	乖宝 宠物	2023 年8月 9日	6个月	新股 流通 受限	39.99	38.81	200	7,998.00	7,762.00	-	
301499	维科 精密	2023 年7月 13日	6个月	新股 流通 受限	19.50	28.93	321	6,259.50	9,286.53	-	
301500	飞南 资源	2023 年9月 13日	6个月	新股 流通 受限	23.97	20.89	252	6,040.44	5,264.28	-	
301505	苏州 规划	2023 年7月 12日	6个月	新股 流通 受限	26.35	35.81	191	5,032.85	6,839.71	-	
301507	民生 健康	2023 年8月 24日	6个月	新股 流通 受限	10.00	15.85	613	6,130.00	9,716.05	-	
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	365	10,220.00	8,274.55	-	
301515	港通	2023 年7月	6个月	新股 流通	31.16	28.27	155	4,829.80	4,381.85	-	

	医疗	13日		受限						
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	陕西华达	2023年10月9日	6个月	新股流通受限	26.87	43.69	185	4,970.95	8,082.65	-
301518	长华化学	2023年7月26日	6个月	新股流通受限	25.75	23.01	256	6,592.00	5,890.56	-
301519	舜禹股份	2023年7月19日	6个月	新股流通受限	20.93	20.21	306	6,404.58	6,184.26	-
301520	万邦医药	2023年9月18日	6个月	新股流通受限	67.88	52.74	134	9,095.92	7,067.16	-
301525	儒竞科技	2023年8月23日	6个月	新股流通受限	99.57	81.46	69	6,870.33	5,620.74	-
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	138	9,908.40	9,509.58	-
301529	福赛科技	2023年8月31日	6个月	新股流通受限	36.60	37.88	157	5,746.20	5,947.16	-
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	86	5,744.80	5,073.14	-

301550	斯菱股份	2023年9月6日	6个月	新股流通受限	37.56	43.57	156	5,859.36	6,796.92	-
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	959	7,029.47	12,850.60	-
301559	中集环科	2023年9月26日	6个月	新股流通受限	24.22	18.24	320	7,750.40	5,836.80	-
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	539	6,063.75	5,966.73	-
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	52	3,020.16	3,006.12	-

603075	热威股份	2023年9月1日	6个月	新股流通受限	23.10	23.31	135	3,118.50	3,146.85	-
603107	上海汽配	2023年10月25日	6个月	新股流通受限	14.23	18.19	184	2,618.32	3,346.96	-
603119	浙江荣泰	2023年7月21日	6个月	新股流通受限	15.32	23.87	131	2,006.92	3,126.97	-
603193	润本股份	2023年10月9日	6个月	新股流通受限	17.38	16.66	189	3,284.82	3,148.74	-
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	139	3,026.03	4,111.62	-
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	91	7,352.80	7,075.25	-
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	100	5,309.00	3,642.00	-

688548	广钢气体	2023年8月8日	6个月	新股流通受限	9.87	12.75	1,012	9,988.44	12,903.00	-
688549	中巨芯-U	2023年8月30日	6个月	新股流通受限	5.18	8.09	1,464	7,583.52	11,843.76	-
688563	航材股份	2023年7月12日	6个月	新股流通受限	78.99	60.49	151	11,927.49	9,133.99	-
688573	信宇人	2023年8月9日	6个月	新股流通受限	23.68	28.80	285	6,748.80	8,208.00	-
688582	芯动联科	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	26.74	38.67	222	5,936.28	8,584.74	-
688591	泰凌微	2023年8月18日	6个月	新股流通受限	24.98	28.02	397	9,917.06	11,123.94	-
688602	康鹏科技	2023年7月13日	6个月	新股流通受限	8.66	11.06	524	4,537.84	5,795.44	-
688603	天承科技	2023年6月30日	6个月	新股流通受限	55.00	74.14	119	6,545.00	8,822.66	-
688612	威迈斯	2023年7月19日	6个月	新股流通受限	47.29	37.97	116	5,485.64	4,404.52	-
688627	精智达	2023年7月11日	6个月	新股流通受限	46.77	87.72	130	6,080.10	11,403.60	-
688638	誉辰智能	2023年7月4日	6个月	新股流通受限	83.90	59.68	81	6,795.90	4,834.08	-
688646	逸飞激光	2023年7月21日	6个月	新股流通受限	46.80	36.07	155	7,254.00	5,590.85	-

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	156	6,224.40	7,183.80	-
688652	京仪装备	2023年11月22日	6个月	新股流通受限	31.95	52.25	259	8,275.05	13,532.75	-
688653	康希通信	2023年11月10日	6个月	新股流通受限	10.50	15.99	613	6,436.50	9,801.87	-
688657	浩辰软件	2023年9月25日	6个月	新股流通受限	103.40	78.23	74	7,651.60	5,789.02	-
688671	碧兴物联	2023年8月2日	6个月	新股流通受限	36.12	34.30	213	7,693.56	7,305.90	-
688693	锆威特	2023年8月10日	6个月	新股流通受限	40.83	43.41	169	6,900.27	7,336.29	-
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	148	6,313.68	7,130.64	-
688716	中研股份	2023年9月13日	6个月	新股流通受限	29.66	36.39	211	6,258.26	7,678.29	-
688719	爱科赛博	2023年9月20日	6个月	新股流通受限	69.98	60.10	107	7,487.86	6,430.70	-
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

注：无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证）、债券（含国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券、中小企业私募债等）、货币市场工具（含同业存单等）、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人致力于全面内部控制体系的建设，建立了从董事会层面到各业务部门的风险

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

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

7.4.13.2 信用风险

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

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

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

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

于 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、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 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时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行

持续的监测和分析。

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

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

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

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

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

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	79,416,952.61	-	-	-	79,416,952.61
结算备付金	9,434,101.50	-	-	-	9,434,101.50
存出保证金	261,268.89	-	-	-	261,268.89
交易性金融资产	-	-	-	1,098,977,666.43	1,098,977,666.43
应收申购款	-	-	-	93,093.54	93,093.54
应收清算款	-	-	-	150,374.26	150,374.26
资产总计	89,112,323.00	-	-	1,099,221,134.23	1,188,333,457.23
负债					
应付赎回款	-	-	-	39,112.63	39,112.63
应付管理人报酬	-	-	-	1,363,797.90	1,363,797.90
应付托管费	-	-	-	227,299.65	227,299.65
其他负债	-	-	-	3,783,655.47	3,783,655.47
负债总计	-	-	-	5,413,865.65	5,413,865.65
利率敏感度缺口	89,112,323.00	-	-	1,093,807,268.58	1,182,919,591.58
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	37,090,491.69	-	-	-	37,090,491.69
结算备付金	1,098,102.59	-	-	-	1,098,102.59
存出保证金	106,169.23	-	-	-	106,169.23
交易性金融资产	-	-	-	224,317,019.26	224,317,019.26
应收申购款	-	-	-	58,836.81	58,836.81
资产总计	38,294,763.51	-	-	224,375,856.07	262,670,619.58
负债					
应付赎回款	-	-	-	24,699.83	24,699.83
应付管理人报酬	-	-	-	432,745.37	432,745.37
应付托管费	-	-	-	72,124.24	72,124.24
应付清算款	-	-	-	19,242,333.61	19,242,333.61
其他负债	-	-	-	832,175.29	832,175.29
负债总计	-	-	-	20,604,078.34	20,604,078.34
利率敏感度缺口	38,294,763.51	-	-	203,771,777.73	242,066,541.24

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

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。基金的投资组合比例为：股票（含存托凭证）资产占基金资产的比例为 60%—95%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,098,977,666.43	92.90	224,317,019.26	92.67
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	1,098,977,666.43	92.90	224,317,019.26	92.67

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	46,157,522.46	10,487,532.90
	比较基准下降 5% 资产净值变动	-46,157,522.46	-10,487,532.90

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	1,098,203,150.73	221,222,467.26
第二层次	-	2,292,654.00
第三层次	774,515.70	801,898.00
合计	1,098,977,666.43	224,317,019.26

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	801,898.00	801,898.00
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	1,074,293.23	1,074,293.23

转出第三层次	-	1,757,367.91	1,757,367.91
当期利得或损失总额	-	655,692.38	655,692.38
其中：计入损益的利得或损失	-	655,692.38	655,692.38
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	774,515.70	774,515.70
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	-	180,922.60	180,922.60
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	-	3,082,809.94	3,082,809.94
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	2,028,461.91	2,028,461.91
转出第三层次	-	4,980,610.41	4,980,610.41
当期利得或损失总额	-	671,236.56	671,236.56
其中：计入损益的利得或损失	-	671,236.56	671,236.56
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	801,898.00	801,898.00
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	-	56,895.42	56,895.42

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	774,515.70	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.1855-2.1988	负相关
项目	上年度末公	采用的估值	不可观察输入值		

	允价值	技术	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	801,898.00	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	1,098,977,666.43	92.48
	其中：股票	1,098,977,666.43	92.48
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	88,851,054.11	7.48
8	其他各项资产	504,736.69	0.04
9	合计	1,188,333,457.23	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	4,135,374.19	0.35
B	采矿业	13,501,871.60	1.14
C	制造业	708,502,283.84	59.89

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	36,941,631.20	3.12
E	建筑业	51,813,963.06	4.38
F	批发和零售业	42,825,711.72	3.62
G	交通运输、仓储和邮政业	35,367,827.93	2.99
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	34,328,128.88	2.90
J	金融业	105,231,032.56	8.90
K	房地产业	11,448,233.00	0.97
L	租赁和商务服务业	4,493,840.00	0.38
M	科学研究和技术服务业	12,143,554.39	1.03
N	水利、环境和公共设施管理业	22,365,100.06	1.89
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,034,310.00	0.09
R	文化、体育和娱乐业	9,851,693.00	0.83
S	综合	4,993,111.00	0.42
	合计	1,098,977,666.43	92.90

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002035	华帝股份	1,196,800	7,432,128.00	0.63
2	603323	苏农银行	1,756,310	7,306,249.60	0.62
3	000404	长虹华意	1,233,500	7,265,315.00	0.61
4	601668	中国建筑	1,506,500	7,246,265.00	0.61
5	002392	北京利尔	1,906,600	7,206,948.00	0.61
6	600582	天地科技	1,305,500	7,101,920.00	0.60
7	002206	海利得	1,390,300	6,979,306.00	0.59
8	600918	中泰证券	1,014,802	6,961,541.72	0.59
9	603365	水星家纺	483,200	6,948,416.00	0.59
10	000959	首钢股份	2,003,500	6,932,110.00	0.59
11	300349	金卡智能	555,540	6,899,806.80	0.58
12	000338	潍柴动力	504,700	6,889,155.00	0.58
13	601886	江河集团	1,032,400	6,875,784.00	0.58
14	002641	公元股份	1,360,800	6,844,824.00	0.58
15	002479	富春环保	1,432,700	6,833,979.00	0.58
16	002449	国星光电	720,000	6,818,400.00	0.58
17	300296	利亚德	1,128,400	6,770,400.00	0.57

18	002540	亚太科技	1,020,200	6,743,522.00	0.57
19	600717	天津港	1,632,200	6,708,342.00	0.57
20	601618	中国中冶	2,186,800	6,691,608.00	0.57
21	600577	精达股份	1,592,900	6,594,606.00	0.56
22	603508	思维列控	419,696	6,589,227.20	0.56
23	002745	木林森	759,800	6,579,868.00	0.56
24	605066	天正电气	713,000	6,545,340.00	0.55
25	600958	东方证券	751,500	6,538,050.00	0.55
26	600774	汉商集团	653,725	6,445,728.50	0.54
27	600966	博汇纸业	1,037,700	6,444,117.00	0.54
28	600727	鲁北化工	979,100	6,442,478.00	0.54
29	002533	金杯电工	793,800	6,413,904.00	0.54
30	600894	广日股份	867,500	6,376,125.00	0.54
31	600784	鲁银投资	1,022,100	6,285,915.00	0.53
32	601211	国泰君安	421,000	6,264,480.00	0.53
33	603367	辰欣药业	427,400	6,257,136.00	0.53
34	600409	三友化工	1,139,500	6,255,855.00	0.53
35	600801	华新水泥	502,900	6,251,047.00	0.53
36	600901	江苏金租	1,276,640	6,178,937.60	0.52
37	600959	江苏有线	1,965,390	6,171,324.60	0.52
38	600664	哈药股份	1,840,200	6,164,670.00	0.52
39	002563	森马服饰	1,066,800	6,155,436.00	0.52
40	002160	常铝股份	1,467,600	6,149,244.00	0.52
41	002469	三维化学	1,013,200	6,139,992.00	0.52
42	600015	华夏银行	1,090,200	6,126,924.00	0.52
43	600292	远达环保	1,006,600	6,110,062.00	0.52
44	000598	兴蓉环境	1,065,600	6,063,264.00	0.51
45	601233	桐昆股份	394,400	5,967,272.00	0.50
46	000789	万年青	865,100	5,934,586.00	0.50
47	688009	中国通号	1,333,951	5,842,705.38	0.49
48	601368	绿城水务	1,091,100	5,837,385.00	0.49
49	300055	万邦达	945,318	5,832,612.06	0.49
50	300259	新天科技	1,606,400	5,831,232.00	0.49
51	002302	西部建设	891,550	5,777,244.00	0.49
52	002283	天润工业	980,800	5,737,680.00	0.49
53	601163	三角轮胎	397,000	5,720,770.00	0.48
54	601186	中国铁建	746,200	5,678,582.00	0.48
55	601117	中国化学	892,200	5,674,392.00	0.48
56	688660	电气风电	1,100,174	5,654,894.36	0.48
57	002391	长青股份	895,350	5,640,705.00	0.48
58	002443	金洲管道	822,900	5,636,865.00	0.48
59	601577	长沙银行	823,600	5,616,952.00	0.47
60	301223	中荣股份	309,639	5,610,658.68	0.47

61	600637	东方明珠	737,300	5,544,496.00	0.47
62	601101	昊华能源	875,080	5,530,505.60	0.47
63	002016	世荣兆业	875,700	5,508,153.00	0.47
64	601222	林洋能源	861,700	5,506,263.00	0.47
65	688128	中国电研	264,817	5,434,044.84	0.46
66	601228	广州港	1,721,100	5,387,043.00	0.46
67	002067	景兴纸业	1,585,800	5,375,862.00	0.45
68	000528	柳工	796,200	5,366,388.00	0.45
69	601688	华泰证券	383,800	5,354,010.00	0.45
70	600558	大西洋	1,296,700	5,277,569.00	0.45
71	600023	浙能电力	1,138,400	5,248,024.00	0.44
72	003016	欣贺股份	636,500	5,200,205.00	0.44
73	600808	马钢股份	1,896,800	5,159,296.00	0.44
74	601609	金田股份	749,800	5,076,146.00	0.43
75	600880	博瑞传播	1,012,500	5,072,625.00	0.43
76	600016	民生银行	1,352,700	5,059,098.00	0.43
77	000157	中联重科	765,600	4,999,368.00	0.42
78	002398	垒知集团	1,030,700	4,916,439.00	0.42
79	002361	神剑股份	1,234,400	4,851,192.00	0.41
80	002083	孚日股份	962,000	4,848,480.00	0.41
81	002419	天虹股份	865,500	4,786,215.00	0.40
82	002478	常宝股份	874,100	4,763,845.00	0.40
83	000783	长江证券	880,800	4,738,704.00	0.40
84	000967	盈峰环境	995,300	4,727,675.00	0.40
85	002019	亿帆医药	319,600	4,723,688.00	0.40
86	601789	宁波建工	1,140,800	4,722,912.00	0.40
87	000932	华菱钢铁	916,100	4,717,915.00	0.40
88	601766	中国中车	892,600	4,695,076.00	0.40
89	000729	燕京啤酒	540,100	4,661,063.00	0.39
90	002212	天融信	476,500	4,660,170.00	0.39
91	300962	中金辐照	299,451	4,647,479.52	0.39
92	002376	新北洋	604,700	4,607,814.00	0.39
93	600594	益佰制药	799,100	4,546,879.00	0.38
94	600623	华谊集团	704,300	4,535,692.00	0.38
95	600787	中储股份	887,700	4,527,270.00	0.38
96	603020	爱普股份	538,100	4,498,516.00	0.38
97	000680	山推股份	910,100	4,495,894.00	0.38
98	000685	中山公用	612,700	4,478,837.00	0.38
99	603897	长城科技	218,600	4,476,928.00	0.38
100	603916	苏博特	437,776	4,460,937.44	0.38
101	603611	诺力股份	232,000	4,391,760.00	0.37
102	603116	红蜻蜓	696,600	4,360,716.00	0.37
103	603366	日出东方	699,400	4,357,262.00	0.37

104	002706	良信股份	493,400	4,356,722.00	0.37
105	300073	当升科技	110,200	4,209,640.00	0.36
106	601512	中新集团	540,500	4,167,255.00	0.35
107	002130	沃尔核材	550,100	4,153,255.00	0.35
108	600690	海尔智家	197,200	4,141,200.00	0.35
109	600371	万向德农	385,403	4,135,374.19	0.35
110	000559	万向钱潮	795,800	4,130,202.00	0.35
111	002225	濮耐股份	1,088,300	4,113,774.00	0.35
112	002452	长高电新	578,100	4,104,510.00	0.35
113	600019	宝钢股份	691,400	4,100,002.00	0.35
114	002345	潮宏基	601,300	4,094,853.00	0.35
115	601128	常熟银行	634,168	4,052,333.52	0.34
116	002228	合兴包装	1,170,400	4,014,472.00	0.34
117	601319	中国人保	829,100	4,012,844.00	0.34
118	603976	正川股份	203,388	4,008,777.48	0.34
119	600035	楚天高速	1,037,800	3,964,396.00	0.34
120	002381	双箭股份	517,400	3,921,892.00	0.33
121	601607	上海医药	233,200	3,901,436.00	0.33
122	600297	广汇汽车	2,265,100	3,895,972.00	0.33
123	002148	北纬科技	644,800	3,894,592.00	0.33
124	600919	江苏银行	577,100	3,860,799.00	0.33
125	601528	瑞丰银行	777,710	3,849,664.50	0.33
126	002454	松芝股份	508,400	3,818,084.00	0.32
127	600497	驰宏锌锗	755,300	3,814,265.00	0.32
128	600528	中铁工业	512,200	3,810,768.00	0.32
129	300800	力合科技	273,300	3,736,011.00	0.32
130	300440	运达科技	493,900	3,679,555.00	0.31
131	002582	好想你	479,100	3,674,697.00	0.31
132	603010	万盛股份	340,100	3,669,679.00	0.31
133	601089	福元医药	212,600	3,665,224.00	0.31
134	002342	巨力索具	849,400	3,660,914.00	0.31
135	600268	国电南自	525,100	3,659,947.00	0.31
136	601311	骆驼股份	456,530	3,656,805.30	0.31
137	603018	华设集团	474,496	3,606,169.60	0.30
138	002969	嘉美包装	870,100	3,584,812.00	0.30
139	601390	中国中铁	619,200	3,517,056.00	0.30
140	000931	中关村	592,000	3,475,040.00	0.29
141	600819	耀皮玻璃	676,600	3,443,894.00	0.29
142	600741	华域汽车	210,500	3,426,940.00	0.29
143	603166	福达股份	495,900	3,426,669.00	0.29
144	002303	美盈森	969,200	3,401,892.00	0.29
145	600887	伊利股份	126,300	3,378,525.00	0.29
146	000551	创元科技	320,700	3,357,729.00	0.28

147	000910	大亚圣象	418,600	3,348,800.00	0.28
148	600269	赣粤高速	807,000	3,316,770.00	0.28
149	002390	信邦制药	738,100	3,277,164.00	0.28
150	600897	厦门空港	261,180	3,262,138.20	0.28
151	603618	杭电股份	507,700	3,249,280.00	0.27
152	000728	国元证券	475,500	3,247,665.00	0.27
153	600645	中源协和	157,400	3,190,498.00	0.27
154	603983	丸美股份	125,000	3,158,750.00	0.27
155	000921	海信家电	154,700	3,155,880.00	0.27
156	603766	隆鑫通用	609,800	3,146,568.00	0.27
157	601665	齐鲁银行	796,600	3,114,706.00	0.26
158	600865	百大集团	372,600	3,040,416.00	0.26
159	603111	康尼机电	544,900	3,035,093.00	0.26
160	002276	万马股份	295,800	3,023,076.00	0.26
161	002092	中泰化学	493,300	3,009,130.00	0.25
162	002057	中钢天源	373,750	3,004,950.00	0.25
163	601555	东吴证券	410,400	3,000,024.00	0.25
164	300453	三鑫医疗	392,400	2,994,012.00	0.25
165	600278	东方创业	422,900	2,951,842.00	0.25
166	603109	神驰机电	179,700	2,950,674.00	0.25
167	601636	旗滨集团	429,700	2,939,148.00	0.25
168	300215	电科院	549,000	2,904,210.00	0.25
169	603686	福龙马	283,000	2,895,090.00	0.24
170	000589	贵州轮胎	470,800	2,881,296.00	0.24
171	603068	博通集成	96,900	2,824,635.00	0.24
172	300219	鸿利智汇	327,400	2,756,708.00	0.23
173	603630	拉芳家化	179,800	2,750,940.00	0.23
174	002705	新宝股份	184,700	2,691,079.00	0.23
175	603551	奥普家居	253,800	2,687,742.00	0.23
176	601825	沪农商行	465,300	2,670,822.00	0.23
177	000928	中钢国际	453,500	2,643,905.00	0.22
178	600628	新世界	375,700	2,633,657.00	0.22
179	603012	创力集团	444,700	2,628,177.00	0.22
180	601169	北京银行	576,600	2,611,998.00	0.22
181	603948	建业股份	114,100	2,594,634.00	0.22
182	300227	光韵达	330,300	2,589,552.00	0.22
183	603609	禾丰股份	301,600	2,581,696.00	0.22
184	600339	中油工程	851,700	2,580,651.00	0.22
185	300864	南大环境	116,400	2,550,324.00	0.22
186	002048	宁波华翔	195,800	2,547,358.00	0.22
187	600798	宁波海运	693,300	2,537,478.00	0.21
188	300843	胜蓝股份	110,300	2,534,694.00	0.21
189	601086	国芳集团	476,600	2,506,916.00	0.21

190	600643	爱建集团	491,221	2,505,227.10	0.21
191	603558	健盛集团	254,500	2,466,105.00	0.21
192	002483	润邦股份	472,300	2,465,406.00	0.21
193	600581	八一钢铁	680,200	2,441,918.00	0.21
194	002688	金河生物	505,500	2,431,455.00	0.21
195	600757	长江传媒	323,800	2,412,310.00	0.20
196	002546	新联电子	473,900	2,369,500.00	0.20
197	600824	益民集团	617,400	2,364,642.00	0.20
198	002010	传化智联	511,300	2,362,206.00	0.20
199	600970	中材国际	248,300	2,319,122.00	0.20
200	300067	安诺其	744,100	2,314,151.00	0.20
201	000639	西王食品	520,500	2,300,610.00	0.19
202	301093	华兰股份	71,100	2,296,530.00	0.19
203	600390	五矿资本	490,300	2,294,604.00	0.19
204	002088	鲁阳节能	159,510	2,273,017.50	0.19
205	688049	炬芯科技	59,564	2,267,601.48	0.19
206	002154	报喜鸟	395,800	2,248,144.00	0.19
207	000887	中鼎股份	180,900	2,237,733.00	0.19
208	600261	阳光照明	682,300	2,231,121.00	0.19
209	603848	好太太	139,100	2,153,268.00	0.18
210	603368	柳药集团	113,800	2,153,096.00	0.18
211	002027	分众传媒	336,800	2,128,576.00	0.18
212	688176	亚虹医药-U	196,754	2,121,008.12	0.18
213	002879	长缆科技	131,700	2,109,834.00	0.18
214	600572	康恩贝	416,100	2,101,305.00	0.18
215	600033	福建高速	669,800	2,076,380.00	0.18
216	603797	联泰环保	375,500	2,072,760.00	0.18
217	601377	兴业证券	348,230	2,044,110.10	0.17
218	300867	圣元环保	127,700	2,036,815.00	0.17
219	603866	桃李面包	260,200	1,993,132.00	0.17
220	600483	福能股份	239,160	1,977,853.20	0.17
221	600694	大商股份	117,100	1,977,819.00	0.17
222	300632	光莆股份	155,800	1,966,196.00	0.17
223	000823	超声电子	205,100	1,962,807.00	0.17
224	002191	劲嘉股份	361,100	1,939,107.00	0.16
225	600618	氯碱化工	212,921	1,937,581.10	0.16
226	605183	确成股份	131,900	1,929,697.00	0.16
227	600843	上工申贝	335,300	1,917,916.00	0.16
228	000930	中粮科技	281,300	1,867,832.00	0.16
229	000717	中南股份	733,000	1,861,820.00	0.16
230	601200	上海环境	205,500	1,847,445.00	0.16
231	300018	中元股份	300,400	1,835,444.00	0.16
232	002440	闰土股份	293,300	1,789,130.00	0.15

233	300866	安克创新	19,900	1,763,140.00	0.15
234	601717	郑煤机	137,575	1,740,323.75	0.15
235	300891	惠云钛业	177,943	1,726,047.10	0.15
236	002014	永新股份	206,300	1,722,605.00	0.15
237	000881	中广核技	236,700	1,716,075.00	0.15
238	600126	杭钢股份	318,000	1,694,940.00	0.14
239	002441	众业达	174,400	1,651,568.00	0.14
240	000088	盐田港	337,300	1,646,024.00	0.14
241	603351	威尔药业	62,336	1,643,800.32	0.14
242	000009	中国宝安	139,300	1,635,382.00	0.14
243	300758	七彩化学	160,300	1,620,633.00	0.14
244	600979	广安爱众	467,300	1,616,858.00	0.14
245	300957	贝泰妮	23,700	1,615,629.00	0.14
246	603387	基蛋生物	142,700	1,569,700.00	0.13
247	600109	国金证券	168,300	1,528,164.00	0.13
248	300190	维尔利	364,100	1,521,938.00	0.13
249	002462	嘉事堂	106,500	1,513,365.00	0.13
250	002367	康力电梯	200,500	1,507,760.00	0.13
251	002301	齐心集团	210,600	1,497,366.00	0.13
252	600782	新钢股份	426,700	1,489,183.00	0.13
253	300009	安科生物	144,950	1,481,389.00	0.13
254	688788	科思科技	38,081	1,472,973.08	0.12
255	000987	越秀资本	242,700	1,461,054.00	0.12
256	600908	无锡银行	283,700	1,432,685.00	0.12
257	600210	紫江企业	303,600	1,426,920.00	0.12
258	600201	生物股份	131,400	1,415,178.00	0.12
259	601969	海南矿业	210,400	1,386,536.00	0.12
260	600216	浙江医药	128,100	1,374,513.00	0.12
261	688101	三达膜	100,003	1,346,040.38	0.11
262	002803	吉宏股份	65,200	1,340,512.00	0.11
263	603301	振德医疗	54,100	1,325,450.00	0.11
264	600061	国投资本	194,800	1,312,952.00	0.11
265	002286	保龄宝	159,700	1,296,764.00	0.11
266	002266	浙富控股	379,500	1,290,300.00	0.11
267	600169	太原重工	538,900	1,271,804.00	0.11
268	603165	荣晟环保	106,000	1,269,880.00	0.11
269	002588	史丹利	197,900	1,262,602.00	0.11
270	300040	九洲集团	223,375	1,250,900.00	0.11
271	002511	中顺洁柔	125,060	1,250,600.00	0.11
272	603817	海峡环保	194,100	1,238,358.00	0.10
273	600872	中炬高新	42,800	1,202,680.00	0.10
274	003012	东鹏控股	144,500	1,192,125.00	0.10
275	601633	长城汽车	46,400	1,170,208.00	0.10

276	002402	和而泰	81,700	1,167,493.00	0.10
277	600874	创业环保	209,900	1,164,945.00	0.10
278	601158	重庆水务	205,100	1,162,917.00	0.10
279	000069	华侨城 A	371,500	1,155,365.00	0.10
280	601616	广电电气	311,900	1,132,197.00	0.10
281	300381	溢多利	153,500	1,131,295.00	0.10
282	600332	白云山	39,400	1,126,840.00	0.10
283	600886	国投电力	85,300	1,124,254.00	0.10
284	000850	华茂股份	291,300	1,109,853.00	0.09
285	601218	吉鑫科技	276,200	1,104,800.00	0.09
286	300263	隆华科技	156,100	1,098,944.00	0.09
287	300193	佳士科技	139,600	1,084,692.00	0.09
288	600535	天士力	61,800	1,051,836.00	0.09
289	600835	上海机电	88,500	1,050,495.00	0.09
290	002233	塔牌集团	147,700	1,045,716.00	0.09
291	301103	何氏眼科	34,500	1,034,310.00	0.09
292	603699	纽威股份	74,100	1,027,026.00	0.09
293	601098	中南传媒	99,800	1,014,966.00	0.09
294	603859	能科科技	26,600	1,003,618.00	0.08
295	300732	设研院	113,500	1,002,205.00	0.08
296	600104	上汽集团	73,300	991,749.00	0.08
297	002557	洽洽食品	27,800	967,996.00	0.08
298	600693	东百集团	233,100	934,731.00	0.08
299	300409	道氏技术	82,500	919,050.00	0.08
300	601608	中信重工	234,800	906,328.00	0.08
301	300119	瑞普生物	55,000	901,450.00	0.08
302	000156	华数传媒	122,200	900,614.00	0.08
303	688389	普门科技	38,800	873,388.00	0.07
304	002275	桂林三金	59,200	857,808.00	0.07
305	300622	博士眼镜	41,500	822,945.00	0.07
306	600718	东软集团	88,800	821,400.00	0.07
307	300289	利德曼	132,800	816,720.00	0.07
308	601601	中国太保	32,739	778,533.42	0.07
309	002171	楚江新材	102,600	767,448.00	0.06
310	603520	司太立	52,480	738,918.40	0.06
311	603328	依顿电子	89,600	730,240.00	0.06
312	603590	康辰药业	18,100	689,248.00	0.06
313	600429	三元股份	147,900	659,634.00	0.06
314	601111	中国国航	84,700	621,698.00	0.05
315	000901	航天科技	66,600	620,712.00	0.05
316	600067	冠城大通	246,000	617,460.00	0.05
317	002863	今飞凯达	99,200	616,032.00	0.05
318	002054	德美化工	89,500	608,600.00	0.05

319	000429	粤高速 A	70,900	599,814.00	0.05
320	600488	津药药业	122,000	597,800.00	0.05
321	300286	安科瑞	22,400	580,832.00	0.05
322	600308	华泰股份	167,400	579,204.00	0.05
323	300082	奥克股份	82,500	575,025.00	0.05
324	000715	中兴商业	77,500	566,525.00	0.05
325	603556	海兴电力	18,700	542,861.00	0.05
326	002851	麦格米特	21,500	528,900.00	0.04
327	600351	亚宝药业	76,000	524,400.00	0.04
328	600586	金晶科技	77,500	517,700.00	0.04
329	600284	浦东建设	81,500	513,450.00	0.04
330	600926	杭州银行	50,800	508,508.00	0.04
331	300194	福安药业	114,700	502,386.00	0.04
332	688159	有方科技	13,200	496,980.00	0.04
333	603601	再升科技	113,000	485,900.00	0.04
334	002004	华邦健康	101,300	472,058.00	0.04
335	688330	宏力达	16,119	457,940.79	0.04
336	300439	美康生物	38,900	451,629.00	0.04
337	601019	山东出版	48,100	451,178.00	0.04
338	600548	深高速	48,200	433,318.00	0.04
339	002493	荣盛石化	41,600	430,560.00	0.04
340	601002	晋亿实业	87,600	423,984.00	0.04
341	600629	华建集团	79,800	411,768.00	0.03
342	300741	华宝股份	19,100	408,931.00	0.03
343	600655	豫园股份	63,600	394,956.00	0.03
344	600869	远东股份	88,400	388,076.00	0.03
345	300695	兆丰股份	6,900	365,424.00	0.03
346	002773	康弘药业	19,700	363,268.00	0.03
347	688365	光云科技	32,400	352,836.00	0.03
348	002297	博云新材	42,900	341,913.00	0.03
349	601077	渝农商行	83,700	341,496.00	0.03
350	300884	狄耐克	24,200	316,536.00	0.03
351	600060	海信视像	15,100	315,590.00	0.03
352	600691	阳煤化工	97,800	313,938.00	0.03
353	300451	创业慧康	43,900	287,545.00	0.02
354	601006	大秦铁路	39,000	281,190.00	0.02
355	002158	汉钟精机	11,500	255,990.00	0.02
356	600458	时代新材	27,200	250,512.00	0.02
357	002686	亿利达	36,600	247,782.00	0.02
358	300908	仲景食品	6,000	247,620.00	0.02
359	603093	南华期货	19,200	230,400.00	0.02
360	600909	华安证券	46,300	225,944.00	0.02
361	688030	山石网科	10,200	204,204.00	0.02

362	300815	玉禾田	13,808	201,596.80	0.02
363	601857	中国石油	26,900	189,914.00	0.02
364	000876	新希望	17,700	164,964.00	0.01
365	600828	茂业商业	45,100	164,615.00	0.01
366	300248	新开普	17,100	163,989.00	0.01
367	000055	方大集团	35,100	158,652.00	0.01
368	600282	南钢股份	39,000	144,300.00	0.01
369	300324	旋极信息	42,000	141,960.00	0.01
370	300046	台基股份	8,900	141,599.00	0.01
371	300196	长海股份	12,600	137,088.00	0.01
372	601137	博威合金	8,600	133,558.00	0.01
373	002404	嘉欣丝绸	21,500	129,860.00	0.01
374	601700	风范股份	25,900	129,759.00	0.01
375	000531	穗恒运 A	18,100	121,089.00	0.01
376	000682	东方电子	14,900	119,945.00	0.01
377	002408	齐翔腾达	19,200	101,376.00	0.01
378	000521	长虹美菱	18,000	101,340.00	0.01
379	688582	芯动联科	2,215	85,654.05	0.01
380	603101	汇嘉时代	12,600	84,672.00	0.01
381	603236	移远通信	1,500	80,625.00	0.01
382	002061	浙江交科	20,300	74,095.00	0.01
383	000543	皖能电力	11,800	73,868.00	0.01
384	002578	闽发铝业	16,100	72,128.00	0.01
385	000059	华锦股份	13,100	71,919.00	0.01
386	002406	远东传动	9,800	62,524.00	0.01
387	002138	顺络电子	2,300	62,123.00	0.01
388	000538	云南白药	1,100	54,065.00	0.00
389	688277	天智航-U	3,506	46,209.08	0.00
390	301526	国际复材	9,723	43,267.35	0.00
391	301487	盟固利	867	35,512.32	0.00
392	600502	安徽建工	5,200	24,180.00	0.00
393	301348	蓝箭电子	458	20,413.06	0.00
394	601096	宏盛华源	3,918	15,907.08	0.00
395	300904	威力传动	254	15,628.62	0.00
396	301421	波长光电	257	15,258.09	0.00
397	688629	华丰科技	681	14,913.90	0.00
398	301510	固高科技	396	13,863.96	0.00
399	688652	京仪装备	259	13,532.75	0.00
400	688548	广钢气体	1,012	12,903.00	0.00
401	301558	三态股份	959	12,850.60	0.00
402	301566	达利凯普	576	12,752.64	0.00
403	301172	君逸数码	312	11,905.92	0.00
404	688549	中巨芯-U	1,464	11,843.76	0.00

405	688627	精智达	130	11,403.60	0.00
406	301488	豪恩汽电	165	11,399.85	0.00
407	301508	中机认检	419	11,178.92	0.00
408	301370	国科恒泰	698	11,174.98	0.00
409	688591	泰凌微	397	11,123.94	0.00
410	603989	艾华集团	498	10,716.96	0.00
411	301381	赛维时代	356	10,569.64	0.00
412	688653	康希通信	613	9,801.87	0.00
413	301507	民生健康	613	9,716.05	0.00
414	301413	安培龙	164	9,543.16	0.00
415	301528	多浦乐	138	9,509.58	0.00
416	301516	中远通	604	9,368.04	0.00
417	301499	维科精密	321	9,286.53	0.00
418	688563	航材股份	151	9,133.99	0.00
419	688603	天承科技	119	8,822.66	0.00
420	301568	思泰克	246	8,752.68	0.00
421	301459	丰茂股份	208	8,286.72	0.00
422	301511	德福科技	365	8,274.55	0.00
423	688720	艾森股份	165	8,223.60	0.00
424	688573	信宇人	285	8,208.00	0.00
425	301489	思泉新材	128	8,206.08	0.00
426	301291	明阳电气	288	8,167.68	0.00
427	301292	海科新源	420	8,127.00	0.00
428	301517	陕西华达	185	8,082.65	0.00
429	301578	辰奕智能	118	8,061.76	0.00
430	301418	协昌科技	158	7,931.60	0.00
431	301486	致尚科技	167	7,890.75	0.00
432	301251	威尔高	225	7,782.75	0.00
433	301498	乖宝宠物	200	7,762.00	0.00
434	301262	海看股份	249	7,756.35	0.00
435	688716	中研股份	211	7,678.29	0.00
436	301533	威马农机	225	7,461.00	0.00
437	688693	锆威特	169	7,336.29	0.00
438	301261	恒工精密	144	7,322.40	0.00
439	688671	碧兴物联	213	7,305.90	0.00
440	301555	惠柏新材	224	7,266.56	0.00
441	688651	盛邦安全	156	7,183.80	0.00
442	301295	美硕科技	215	7,135.85	0.00
443	688702	盛科通信-U	148	7,130.64	0.00
444	688620	安凯微	599	7,080.18	0.00
445	603296	华勤技术	91	7,075.25	0.00
446	301520	万邦医药	134	7,067.16	0.00
447	301505	苏州规划	191	6,839.71	0.00

448	301550	斯菱股份	156	6,796.92	0.00
449	301272	英华特	125	6,672.50	0.00
450	301202	朗威股份	208	6,614.40	0.00
451	688648	中邮科技	303	6,493.29	0.00
452	688719	爱科赛博	107	6,430.70	0.00
453	301519	舜禹股份	306	6,184.26	0.00
454	603004	鼎龙科技	195	6,082.05	0.00
455	688631	莱斯信息	171	6,027.75	0.00
456	301393	昊帆生物	101	5,996.37	0.00
457	601083	锦江航运	539	5,966.73	0.00
458	301529	福赛科技	157	5,947.16	0.00
459	301518	长华化学	256	5,890.56	0.00
460	301559	中集环科	320	5,836.80	0.00
461	688602	康鹏科技	524	5,795.44	0.00
462	688657	浩辰软件	74	5,789.02	0.00
463	301525	儒竞科技	69	5,620.74	0.00
464	688646	逸飞激光	155	5,590.85	0.00
465	301329	信音电子	249	5,535.27	0.00
466	688429	时创能源	257	5,445.83	0.00
467	301456	盘古智能	174	5,287.86	0.00
468	301500	飞南资源	252	5,264.28	0.00
469	001378	德冠新材	166	5,190.82	0.00
470	301548	崇德科技	86	5,073.14	0.00
471	688638	誉辰智能	81	4,834.08	0.00
472	301371	敷尔佳	124	4,659.92	0.00
473	301170	锡南科技	153	4,655.79	0.00
474	688612	威迈斯	116	4,404.52	0.00
475	301515	港通医疗	155	4,381.85	0.00
476	001326	联域股份	88	4,280.32	0.00
477	600851	海欣股份	600	4,122.00	0.00
478	603270	金帝股份	139	4,111.62	0.00
479	603333	尚纬股份	700	3,997.00	0.00
480	001306	夏厦精密	51	3,843.36	0.00
481	001358	兴欣新材	87	3,841.92	0.00
482	001239	永达股份	189	3,764.88	0.00
483	688450	光格科技	100	3,642.00	0.00
484	603231	索宝蛋白	161	3,466.33	0.00
485	603273	天元智能	178	3,376.66	0.00
486	603107	上海汽配	184	3,346.96	0.00
487	603276	恒兴新材	134	3,333.92	0.00
488	603193	润本股份	189	3,148.74	0.00
489	603075	热威股份	135	3,146.85	0.00
490	603119	浙江荣泰	131	3,126.97	0.00

491	603373	安邦护卫	88	3,058.00	0.00
492	603062	麦加芯彩	52	3,006.12	0.00
493	601108	财通证券	200	1,552.00	0.00
494	000951	中国重汽	40	534.40	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	000921	海信家电	17,817,920.33	7.36
2	601668	中国建筑	13,268,970.00	5.48
3	002478	常宝股份	13,133,475.20	5.43
4	002540	亚太科技	12,655,969.00	5.23
5	688777	中控技术	12,610,933.36	5.21
6	000338	潍柴动力	12,505,168.00	5.17
7	000932	华菱钢铁	12,312,275.00	5.09
8	000729	燕京啤酒	11,471,965.00	4.74
9	601186	中国铁建	11,171,547.00	4.62
10	601155	新城控股	10,910,502.00	4.51
11	603027	千禾味业	10,890,220.00	4.50
12	688036	传音控股	10,552,926.98	4.36
13	300349	金卡智能	10,365,070.51	4.28
14	600582	天地科技	10,144,781.00	4.19
15	603367	辰欣药业	10,135,975.00	4.19
16	600483	福能股份	10,048,245.09	4.15
17	603208	江山欧派	10,002,933.60	4.13
18	002035	华帝股份	9,837,298.00	4.06
19	002301	齐心集团	9,836,877.00	4.06
20	300866	安克创新	9,821,626.00	4.06
21	601137	博威合金	9,608,445.40	3.97
22	002027	分众传媒	9,464,540.00	3.91
23	000528	柳工	9,330,961.00	3.85
24	601607	上海医药	9,208,769.00	3.80
25	688556	高测股份	9,185,697.79	3.79
26	002563	森马服饰	9,031,542.00	3.73
27	600409	三友化工	8,961,532.00	3.70
28	002641	公元股份	8,951,022.00	3.70
29	002768	国恩股份	8,944,505.61	3.70
30	603661	恒林股份	8,933,997.00	3.69
31	601233	桐昆股份	8,919,746.00	3.68
32	603323	苏农银行	8,918,567.00	3.68
33	600210	紫江企业	8,911,860.00	3.68
34	600019	宝钢股份	8,852,384.00	3.66

35	000404	长虹华意	8,828,397.00	3.65
36	600918	中泰证券	8,826,553.78	3.65
37	600339	中油工程	8,808,034.00	3.64
38	601211	国泰君安	8,758,374.00	3.62
39	601618	中国中冶	8,738,237.00	3.61
40	002391	长青股份	8,675,201.00	3.58
41	603508	思维列控	8,539,690.17	3.53
42	000959	首钢股份	8,477,407.00	3.50
43	002206	海利得	8,420,694.00	3.48
44	601688	华泰证券	8,415,928.00	3.48
45	002479	富春环保	8,413,229.00	3.48
46	000923	河钢资源	8,299,862.00	3.43
47	688318	财富趋势	8,297,847.86	3.43
48	603365	水星家纺	8,272,875.00	3.42
49	002392	北京利尔	8,263,144.00	3.41
50	600623	华谊集团	8,259,457.00	3.41
51	002533	金杯电工	8,208,409.00	3.39
52	603983	丸美股份	8,149,712.00	3.37
53	600717	天津港	8,142,477.00	3.36
54	002345	潮宏基	8,128,113.26	3.36
55	600558	大西洋	8,124,140.00	3.36
56	000598	兴蓉环境	8,104,164.00	3.35
57	688006	杭可科技	8,103,239.57	3.35
58	002986	宇新股份	8,079,193.46	3.34
59	605066	天正电气	8,076,481.00	3.34
60	603345	安井食品	8,057,203.00	3.33
61	603018	华设集团	8,029,108.00	3.32
62	600966	博汇纸业	7,997,954.00	3.30
63	600282	南钢股份	7,972,169.00	3.29
64	601117	中国化学	7,957,793.00	3.29
65	002745	木林森	7,939,940.00	3.28
66	301039	中集车辆	7,935,347.00	3.28
67	600704	物产中大	7,935,077.00	3.28
68	000951	中国重汽	7,926,221.60	3.27
69	603739	蔚蓝生物	7,908,524.20	3.27
70	601766	中国中车	7,889,485.00	3.26
71	600398	海澜之家	7,861,835.00	3.25
72	000157	中联重科	7,850,759.00	3.24
73	600958	东方证券	7,848,594.00	3.24
74	600894	广日股份	7,694,597.00	3.18
75	600066	宇通客车	7,693,631.00	3.18
76	600668	尖峰集团	7,685,904.37	3.18
77	002302	西部建设	7,676,616.50	3.17

78	002443	金洲管道	7,637,970.00	3.16
79	601886	江河集团	7,608,382.00	3.14
80	601101	昊华能源	7,483,693.60	3.09
81	603233	大参林	7,479,912.00	3.09
82	300296	利亚德	7,479,417.00	3.09
83	601601	中国太保	7,477,863.20	3.09
84	300259	新天科技	7,444,700.00	3.08
85	000910	大亚圣象	7,439,901.00	3.07
86	600901	江苏金租	7,406,344.00	3.06
87	600664	哈药股份	7,386,266.00	3.05
88	002223	鱼跃医疗	7,383,083.00	3.05
89	300308	中际旭创	7,355,891.00	3.04
90	688009	中国通号	7,339,841.58	3.03
91	002452	长高电新	7,338,667.00	3.03
92	688660	电气风电	7,330,559.59	3.03
93	000783	长江证券	7,318,397.00	3.02
94	002283	天润工业	7,313,484.00	3.02
95	688095	福昕软件	7,299,312.64	3.02
96	002449	国星光电	7,299,115.00	3.02
97	600218	全柴动力	7,286,015.00	3.01
98	002469	三维化学	7,282,065.00	3.01
99	600292	远达环保	7,268,320.00	3.00
100	000990	诚志股份	7,267,062.00	3.00
101	600727	鲁北化工	7,233,462.00	2.99
102	600577	精达股份	7,205,123.00	2.98
103	002083	孚日股份	7,200,094.00	2.97
104	002160	常铝股份	7,147,885.00	2.95
105	000737	北方铜业	7,139,353.00	2.95
106	601163	三角轮胎	7,136,339.00	2.95
107	300638	广和通	7,094,206.00	2.93
108	603639	海利尔	7,059,008.22	2.92
109	600269	赣粤高速	7,050,616.00	2.91
110	000928	中钢国际	7,031,164.00	2.90
111	002016	世荣兆业	7,016,087.00	2.90
112	000521	长虹美菱	7,005,540.00	2.89
113	002611	东方精工	7,002,025.92	2.89
114	603317	天味食品	6,994,700.88	2.89
115	000680	山推股份	6,983,501.00	2.88
116	600774	汉商集团	6,978,829.00	2.88
117	300815	玉禾田	6,976,781.76	2.88
118	601218	吉鑫科技	6,967,936.00	2.88
119	600801	华新水泥	6,963,796.00	2.88
120	603116	红蜻蜓	6,962,279.00	2.88

121	600325	华发股份	6,908,229.60	2.85
122	600959	江苏有线	6,885,926.50	2.84
123	002803	吉宏股份	6,877,687.00	2.84
124	603067	振华股份	6,874,106.52	2.84
125	603017	中衡设计	6,861,457.00	2.83
126	000887	中鼎股份	6,834,957.00	2.82
127	688049	炬芯科技	6,833,490.26	2.82
128	601789	宁波建工	6,812,739.00	2.81
129	603609	禾丰股份	6,760,864.56	2.79
130	601128	常熟银行	6,760,828.28	2.79
131	600015	华夏银行	6,717,666.00	2.78
132	300055	万邦达	6,685,987.28	2.76
133	600061	国投资本	6,679,577.00	2.76
134	002398	垒知集团	6,674,893.00	2.76
135	688772	珠海冠宇	6,651,259.42	2.75
136	601577	长沙银行	6,649,616.00	2.75
137	601377	兴业证券	6,553,656.20	2.71
138	603012	创力集团	6,537,842.00	2.70
139	603366	日出东方	6,493,188.00	2.68
140	688223	晶科能源	6,486,465.75	2.68
141	603916	苏博特	6,465,216.52	2.67
142	002010	传化智联	6,459,490.00	2.67
143	002419	天虹股份	6,456,296.00	2.67
144	603660	苏州科达	6,447,750.00	2.66
145	601222	林洋能源	6,440,331.00	2.66
146	000789	万年青	6,429,702.00	2.66
147	600201	生物股份	6,416,669.00	2.65
148	002912	中新赛克	6,408,066.00	2.65
149	300130	新国都	6,403,482.00	2.65
150	000967	盈峰环境	6,385,889.00	2.64
151	002274	华昌化工	6,345,151.00	2.62
152	600637	东方明珠	6,334,732.00	2.62
153	600741	华域汽车	6,330,559.00	2.62
154	600784	鲁银投资	6,291,978.00	2.60
155	002600	领益智造	6,281,248.00	2.59
156	002303	美盈森	6,266,577.00	2.59
157	600690	海尔智家	6,265,148.00	2.59
158	603590	康辰药业	6,240,181.00	2.58
159	300724	捷佳伟创	6,239,953.00	2.58
160	600104	上汽集团	6,237,990.00	2.58
161	600887	伊利股份	6,231,240.00	2.57
162	600073	上海梅林	6,229,898.00	2.57
163	600820	隧道股份	6,208,478.00	2.56

164	600612	老凤祥	6,193,639.00	2.56
165	002381	双箭股份	6,153,290.00	2.54
166	002458	益生股份	6,117,837.00	2.53
167	601528	瑞丰银行	6,111,753.10	2.52
168	600880	博瑞传播	6,100,836.00	2.52
169	300040	九洲集团	6,090,993.50	2.52
170	002662	京威股份	6,076,020.00	2.51
171	003016	欣贺股份	6,060,815.00	2.50
172	000685	中山公用	6,059,476.00	2.50
173	601512	中新集团	6,021,785.00	2.49
174	002361	神剑股份	5,999,691.00	2.48
175	002588	史丹利	5,981,974.00	2.47
176	002583	海能达	5,977,656.00	2.47
177	601609	金田股份	5,964,823.00	2.46
178	600808	马钢股份	5,929,546.00	2.45
179	603111	康尼机电	5,913,632.00	2.44
180	601368	绿城水务	5,910,148.00	2.44
181	002067	景兴纸业	5,891,633.00	2.43
182	601333	广深铁路	5,886,008.00	2.43
183	603225	新凤鸣	5,880,839.00	2.43
184	002154	报喜鸟	5,872,341.00	2.43
185	002225	濮耐股份	5,851,670.80	2.42
186	603611	诺力股份	5,837,488.00	2.41
187	601319	中国人保	5,783,742.00	2.39
188	605196	华通线缆	5,775,643.00	2.39
189	002282	博深股份	5,763,741.00	2.38
190	601616	广电电气	5,762,149.00	2.38
191	002236	大华股份	5,756,005.00	2.38
192	002991	甘源食品	5,716,986.00	2.36
193	600535	天士力	5,701,762.00	2.36
194	601717	郑煤机	5,700,994.32	2.36
195	601003	柳钢股份	5,698,415.00	2.35
196	002402	和而泰	5,689,439.00	2.35
197	002014	永新股份	5,686,817.00	2.35
198	301223	中荣股份	5,679,126.93	2.35
199	600346	恒力石化	5,670,279.00	2.34
200	603518	锦泓集团	5,668,716.00	2.34
201	600371	万向德农	5,667,274.11	2.34
202	600570	恒生电子	5,659,322.86	2.34
203	600055	万东医疗	5,653,904.72	2.34
204	300624	万兴科技	5,652,977.00	2.34
205	002019	亿帆医药	5,648,530.00	2.33
206	002568	百润股份	5,645,743.00	2.33

207	603897	长城科技	5,610,211.00	2.32
208	002637	赞宇科技	5,598,949.00	2.31
209	603556	海兴电力	5,595,766.00	2.31
210	002870	香山股份	5,557,962.00	2.30
211	603757	大元泵业	5,529,853.00	2.28
212	601228	广州港	5,522,786.00	2.28
213	688608	恒玄科技	5,516,576.66	2.28
214	002965	祥鑫科技	5,511,938.00	2.28
215	000100	TCL 科技	5,485,686.00	2.27
216	600016	民生银行	5,428,909.00	2.24
217	000933	神火股份	5,389,630.00	2.23
218	688389	普门科技	5,359,140.48	2.21
219	600023	浙能电力	5,351,006.00	2.21
220	002091	江苏国泰	5,349,854.00	2.21
221	000543	皖能电力	5,349,646.00	2.21
222	600050	中国联通	5,343,491.00	2.21
223	002688	金河生物	5,342,926.00	2.21
224	000728	国元证券	5,329,729.00	2.20
225	603338	浙江鼎力	5,321,976.00	2.20
226	002969	嘉美包装	5,313,425.00	2.20
227	688128	中国电研	5,310,480.16	2.19
228	600737	中粮糖业	5,296,915.00	2.19
229	603699	纽威股份	5,294,719.00	2.19
230	600594	益佰制药	5,283,015.00	2.18
231	002212	天融信	5,279,317.00	2.18
232	002228	合兴包装	5,277,309.00	2.18
233	688169	石头科技	5,261,710.84	2.17
234	603871	嘉友国际	5,256,548.60	2.17
235	300396	迪瑞医疗	5,233,844.00	2.16
236	601311	骆驼股份	5,231,330.80	2.16
237	600390	五矿资本	5,193,080.00	2.15
238	002233	塔牌集团	5,160,876.00	2.13
239	300232	洲明科技	5,160,333.00	2.13
240	600502	安徽建工	5,159,673.00	2.13
241	002376	新北洋	5,150,727.00	2.13
242	300729	乐歌股份	5,149,087.30	2.13
243	300463	迈克生物	5,131,933.00	2.12
244	002891	中宠股份	5,107,389.00	2.11
245	300861	美畅股份	5,072,217.00	2.10
246	000639	西王食品	5,052,740.00	2.09
247	688127	蓝特光学	5,046,235.56	2.08
248	300719	安达维尔	5,034,826.00	2.08
249	600297	广汇汽车	5,015,546.00	2.07

250	601686	友发集团	5,011,389.00	2.07
251	300009	安科生物	4,984,708.02	2.06
252	688687	凯因科技	4,966,314.30	2.05
253	603020	爱普股份	4,951,883.00	2.05
254	000589	贵州轮胎	4,942,444.00	2.04
255	002706	良信股份	4,939,306.00	2.04
256	600035	楚天高速	4,935,399.00	2.04
257	300082	奥克股份	4,910,444.00	2.03
258	688063	派能科技	4,909,664.59	2.03
259	688176	亚虹医药-U	4,909,267.13	2.03
260	600143	金发科技	4,890,665.98	2.02
261	688510	航亚科技	4,879,482.02	2.02
262	688626	翔宇医疗	4,867,034.14	2.01
263	688520	神州细胞-U	4,865,737.11	2.01
264	688516	奥特维	4,849,341.76	2.00
265	688208	道通科技	4,842,285.79	2.00

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

8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000921	海信家电	16,908,881.76	6.99
2	300308	中际旭创	12,601,032.81	5.21
3	601155	新城控股	11,393,136.00	4.71
4	600060	海信视像	11,169,001.00	4.61
5	603661	恒林股份	11,156,467.20	4.61
6	688777	中控技术	11,121,253.36	4.59
7	601137	博威合金	11,053,667.66	4.57
8	601601	中国太保	10,877,027.00	4.49
9	688036	传音控股	10,414,327.19	4.30
10	603660	苏州科达	10,228,063.94	4.23
11	603208	江山欧派	9,864,977.46	4.08
12	603027	千禾味业	9,488,236.40	3.92
13	688556	高测股份	9,454,512.24	3.91
14	000932	华菱钢铁	9,165,950.00	3.79
15	688318	财富趋势	8,882,063.99	3.67
16	002768	国恩股份	8,857,616.00	3.66
17	300866	安克创新	8,817,785.00	3.64
18	002301	齐心集团	8,663,625.50	3.58
19	603739	蔚蓝生物	8,621,729.40	3.56
20	000923	河钢资源	8,444,387.00	3.49
21	600066	宇通客车	8,385,956.00	3.46
22	600218	全柴动力	8,208,604.11	3.39

23	600398	海澜之家	8,150,870.00	3.37
24	000878	云南铜业	8,103,927.00	3.35
25	688095	福昕软件	8,056,399.82	3.33
26	600284	浦东建设	8,024,881.00	3.32
27	000951	中国重汽	7,992,729.00	3.30
28	002478	常宝股份	7,840,749.60	3.24
29	600282	南钢股份	7,777,659.00	3.21
30	603983	丸美股份	7,769,488.79	3.21
31	600483	福能股份	7,747,939.00	3.20
32	600704	物产中大	7,740,491.10	3.20
33	002986	宇新股份	7,715,210.34	3.19
34	301039	中集车辆	7,681,909.74	3.17
35	600668	尖峰集团	7,674,962.71	3.17
36	002223	鱼跃医疗	7,569,638.00	3.13
37	600570	恒生电子	7,387,938.50	3.05
38	600901	江苏金租	7,358,492.00	3.04
39	601668	中国建筑	7,332,700.20	3.03
40	000737	北方铜业	7,307,880.99	3.02
41	000990	诚志股份	7,283,970.00	3.01
42	000729	燕京啤酒	7,257,693.00	3.00
43	603345	安井食品	7,203,820.92	2.98
44	688006	杭可科技	7,176,097.53	2.96
45	002027	分众传媒	7,096,652.00	2.93
46	603233	大参林	7,088,482.93	2.93
47	002611	东方精工	6,937,792.28	2.87
48	600210	紫江企业	6,924,334.00	2.86
49	002912	中新赛克	6,842,306.00	2.83
50	300910	瑞丰新材	6,805,659.00	2.81
51	603317	天味食品	6,799,077.94	2.81
52	000521	长虹美菱	6,769,752.00	2.80
53	603017	中衡设计	6,750,526.00	2.79
54	600325	华发股份	6,732,148.00	2.78
55	688772	珠海冠宇	6,714,308.91	2.77
56	300815	玉禾田	6,710,306.00	2.77
57	300130	新国都	6,700,787.20	2.77
58	688063	派能科技	6,671,786.53	2.76
59	603067	振华股份	6,622,926.61	2.74
60	600820	隧道股份	6,591,503.00	2.72
61	603871	嘉友国际	6,532,891.00	2.70
62	600566	济川药业	6,515,459.00	2.69
63	300638	广和通	6,510,272.40	2.69
64	002583	海能达	6,479,180.00	2.68
65	300396	迪瑞医疗	6,474,798.48	2.67

66	002384	东山精密	6,377,454.00	2.63
67	000913	钱江摩托	6,361,944.00	2.63
68	002540	亚太科技	6,349,317.00	2.62
69	002274	华昌化工	6,347,800.00	2.62
70	600612	老凤祥	6,320,217.00	2.61
71	603639	海利尔	6,317,020.82	2.61
72	600073	上海梅林	6,186,279.39	2.56
73	000543	皖能电力	6,132,088.90	2.53
74	000933	神火股份	6,126,884.00	2.53
75	000600	建投能源	6,100,147.00	2.52
76	002091	江苏国泰	6,080,453.00	2.51
77	002662	京威股份	6,074,334.00	2.51
78	603518	锦泓集团	6,071,113.00	2.51
79	601231	环旭电子	6,061,339.00	2.50
80	300761	立华股份	6,031,540.63	2.49
81	002282	博深股份	5,993,799.20	2.48
82	603225	新凤鸣	5,992,351.00	2.48
83	002991	甘源食品	5,985,921.00	2.47
84	002600	领益智造	5,977,891.00	2.47
85	002422	科伦药业	5,976,501.00	2.47
86	688608	恒玄科技	5,802,940.39	2.40
87	300724	捷佳伟创	5,800,880.00	2.40
88	688390	固德威	5,787,381.16	2.39
89	002236	大华股份	5,786,273.00	2.39
90	603590	康辰药业	5,753,334.00	2.38
91	002870	香山股份	5,744,237.00	2.37
92	600998	九州通	5,743,933.05	2.37
93	600050	中国联通	5,742,808.00	2.37
94	002803	吉宏股份	5,737,812.00	2.37
95	605196	华通线缆	5,730,766.00	2.37
96	601218	吉鑫科技	5,705,536.00	2.36
97	002458	益生股份	5,703,306.00	2.36
98	601003	柳钢股份	5,699,044.50	2.35
99	600339	中油工程	5,677,635.00	2.35
100	000338	潍柴动力	5,611,505.00	2.32
101	300729	乐歌股份	5,583,674.70	2.31
102	688223	晶科能源	5,546,634.21	2.29
103	688033	天宜上佳	5,521,575.11	2.28
104	002637	赞宇科技	5,506,320.00	2.27
105	688002	睿创微纳	5,472,013.45	2.26
106	300463	迈克生物	5,453,143.00	2.25
107	603556	海兴电力	5,412,165.00	2.24
108	600732	爱旭股份	5,395,284.00	2.23

109	688148	芳源股份	5,378,469.95	2.22
110	002891	中宠股份	5,338,543.15	2.21
111	600055	万东医疗	5,331,870.52	2.20
112	601717	郑煤机	5,331,540.30	2.20
113	000100	TCL 科技	5,321,699.30	2.20
114	600201	生物股份	5,309,772.40	2.19
115	300113	顺网科技	5,302,300.00	2.19
116	600346	恒力石化	5,298,467.00	2.19
117	688687	凯因科技	5,297,740.69	2.19
118	603757	大元泵业	5,279,014.00	2.18
119	600985	淮北矿业	5,275,786.00	2.18
120	300624	万兴科技	5,263,814.00	2.17
121	603609	禾丰股份	5,220,220.36	2.16
122	603338	浙江鼎力	5,218,200.00	2.16
123	300017	网宿科技	5,216,115.00	2.15
124	300168	万达信息	5,211,198.00	2.15
125	601186	中国铁建	5,203,811.00	2.15
126	600535	天士力	5,200,996.00	2.15
127	688626	翔宇医疗	5,197,417.57	2.15
128	600061	国投资本	5,181,859.00	2.14
129	300719	安达维尔	5,163,400.00	2.13
130	601336	新华保险	5,143,789.00	2.12
131	600104	上汽集团	5,132,258.00	2.12
132	002965	祥鑫科技	5,112,252.48	2.11
133	301030	仕净科技	5,104,050.00	2.11
134	600737	中粮糖业	5,095,870.00	2.11
135	688127	蓝特光学	5,094,671.80	2.10
136	002756	永兴材料	5,085,207.96	2.10
137	600312	平高电气	5,023,811.00	2.08
138	601333	广深铁路	5,000,880.00	2.07
139	688169	石头科技	4,962,761.48	2.05
140	003000	劲仔食品	4,871,710.00	2.01
141	002568	百润股份	4,869,844.94	2.01
142	601607	上海医药	4,867,772.00	2.01
143	688389	普门科技	4,861,010.59	2.01
144	601686	友发集团	4,852,933.00	2.00

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	3,682,098,810.19
卖出股票收入（成交）总额	2,784,573,611.33

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

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

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

8.12 投资组合报告附注

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

浙江海利得新材料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嘉兴海关的处罚。

中国建筑股份有限公司在报告编制日前一年内受到衡水市交通运输局的处罚。

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	261,268.89
2	应收清算款	150,374.26
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	93,093.54
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	504,736.69

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

注：无。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比 例 (%)	持有份额	占总份额比 例 (%)
9,967	111,329.52	1,041,113,323.79	93.83	68,508,040.80	6.17

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	623,883.10	0.0562

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

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

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投资、持有本基金符合相关法律法规、中国证监会规定及相关管理制度的规定。

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

注：无。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018年2月23日） 基金份额总额	32,712,954.48
本报告期期初基金份额总额	190,284,295.46
本报告期基金总申购份额	1,128,780,675.70
减：本报告期基金总赎回份额	209,443,606.57
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,109,621,364.59

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人的重大人事变动：

无。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门根据工作需要，任命牛环起、施伟为资产托管业务部副总经理。

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

无。

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 50,000.00 元，该审计机构已提供审计服务的年限为 6 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：根据我行审计报告，本行不存在涉嫌犯罪被依法立案调查的情况，本行的控股股东、实际控制人、董事、监事、高级管理人员不存在涉嫌犯罪被依法采取强制措施、涉嫌严重违纪违法或者职务犯罪被纪检监察机关采取留置措施且影响其履行职责的情况；本行或者本行的控股股东、实际控制人、董事、监事、高级管理人员不存在受到刑事处罚，涉嫌违法违规被中国证监会立案调查或者受到中国证监会行政处罚，或者受到其他有权机关重大行政处罚，或者被中国证监会采取行政监管措施和被证券交易所采取纪律处分的情况；本行董事、监事、高级管理人员不存在因涉嫌违法违规被其他有权机关采取强制措施且影响其履行职责的情况。

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 (%)	
天风证券	2	2,457,571,377.46	38.07	1,777,563.05	32.49	-
国泰君安	2	1,046,760,259.60	16.22	964,820.47	17.63	-
平安证券	2	704,933,981.46	10.92	649,460.57	11.87	-
方正证券	2	378,437,705.21	5.86	353,030.61	6.45	-
长江证券	1	370,731,466.85	5.74	341,537.16	6.24	-
银河证券	2	345,279,454.31	5.35	320,684.29	5.86	-
国信证券	1	320,678,478.81	4.97	296,167.20	5.41	-
中信建投证券	1	203,217,629.38	3.15	187,233.23	3.42	-
招商证券	1	174,855,341.77	2.71	161,090.35	2.94	-

东方财富 证券	1	117,949,497. 48	1.83	109,670.83	2.00	-
西部证券	1	116,359,003. 24	1.80	107,204.13	1.96	-
广发证券	2	89,829,698.8 8	1.39	83,530.61	1.53	-
光大证券	1	72,281,262.9 3	1.12	67,593.10	1.24	-
国投证券	1	38,063,222.8 4	0.59	35,067.24	0.64	-
华创证券	1	10,390,885.4 9	0.16	9,571.91	0.17	-
中金公司	1	7,758,738.90	0.12	7,148.32	0.13	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	本报告期内新增1个
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
瑞信方正	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源 证券	2	-	-	-	-	本报告期内新增1个
湘财证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	3	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	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) 选择交易单位的程序：

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位的对象。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
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

金额单位：人民币元

券商名 称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债 券 成交总额 的比例 (%)	成交金额	占当期债券 回购成交总 额的比例 (%)	成交金额	占当期权 证 成交总额 的比例 (%)
天风证 券	-	-	-	-	-	-
国泰君 安	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-
方正证 券	-	-	-	-	-	-
长江证 券	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
中信建 投证券	-	-	-	-	-	-
招商证	-	-	-	-	-	-

券						
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
瑞信方正	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
中泰证	-	-	-	-	-	-

券						
中信证 券	-	-	-	-	-	-
中银国 际	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 01 月 04 日
2	关于调整旗下部分基金参与中国工商银行股份有限公司申购、定期定额申购费率优惠活动时间的公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 01 月 05 日
3	鹏华量化先锋混合型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 01 月 20 日
4	鹏华量化先锋混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 02 月 08 日
5	鹏华量化先锋混合型证券投资基金更新的招募说明书	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 02 月 08 日
6	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购中润光学首次公开发行 A 股的公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 02 月 10 日
7	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与东方财富证券股份有限公司申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 03 月 14 日
8	鹏华量化先锋混合型证券投资基金 2022 年年度报告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 03 月 30 日
9	鹏华基金管理有限公司关于新增人民币直销资金专户的公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 04 月 07 日
10	鹏华量化先锋混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 04 月 21 日
11	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购航天软件首次公开发行 A 股的公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 05 月 17 日
12	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票估值方法变更的提示性公	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基	2023 年 05 月 19 日

	告	金电子披露网站	
13	鹏华基金管理有限公司关于注意防范以协助办理贷款为借口进行诈骗活动的风险提示	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 06 月 03 日
14	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与国海证券股份有限公司申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 06 月 05 日
15	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 06 月 06 日
16	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与北京中植基金销售有限公司申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 06 月 20 日
17	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购豪恩汽电首次公开发行 A 股的公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 06 月 28 日
18	鹏华量化先锋混合型证券投资基金基金合同	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 07 月 08 日
19	鹏华基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 07 月 08 日
20	鹏华量化先锋混合型证券投资基金托管协议	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 07 月 08 日
21	鹏华量化先锋混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 07 月 12 日
22	鹏华量化先锋混合型证券投资基金更新的招募说明书（2023 年第 1 号）	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 07 月 12 日
23	鹏华量化先锋混合型证券投资基金 2023 年第 2 季度报告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 07 月 20 日
24	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与部分销售机构申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 08 月 07 日
25	鹏华基金管理有限公司关于运用自有资金投资旗下基金的公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 08 月 21 日
26	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基	2023 年 08 月 22 日

	示性公告	金电子披露网站	
27	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购金帝股份首次公开发行 A 股的公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 08 月 26 日
28	鹏华量化先锋混合型证券投资基金 2023 年中期报告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 08 月 30 日
29	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与国金证券股份有限公司申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 09 月 27 日
30	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 10 月 13 日
31	鹏华量化先锋混合型证券投资基金 2023 年第 3 季度报告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 10 月 24 日
32	鹏华基金管理有限公司关于运用自有资金投资旗下基金的公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 11 月 07 日
33	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与南京证券股份有限公司申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 11 月 16 日
34	鹏华量化先锋混合型证券投资基金暂停大额申购、转换转入和定期定额投资业务的公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 11 月 22 日
35	鹏华基金管理有限公司关于鹏华量化先锋混合型证券投资基金 2023 年第 1 次分红公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 12 月 21 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	20230101~20230105, 20230317~20230403,	40,580,994.25	0.00	40,580,994.25	0.00	0.00

		20230417~20230420					
2		20230728~20231031	0.00	60,172,245.20	0.00	60,172,245.20	5.42
3		20230523~20231012, 20231024~20231031	0.00	68,714,469.64	0.00	68,714,469.64	6.19
4		20230101~20230104, 20230109~20230522, 20230620~20230625, 20231123~20231231	39,531,775.21	238,979,391.71	18,691,793.72	259,819,373.20	23.42
5		20231116~20231231	0.00	311,019,727.44	0.00	311,019,727.44	28.03

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)《鹏华量化先锋混合型证券投资基金基金合同》；
- (二)《鹏华量化先锋混合型证券投资基金托管协议》；
- (三)《鹏华量化先锋混合型证券投资基金 2023 年年度报告》(原文)。

13.2 存放地点

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

13.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人鹏华基金管理有限公司，本公司已开通客

户服务系统，咨询电话：4006788999。

鹏华基金管理有限公司

2024 年 3 月 28 日