鹏华中证800交易型开放式指数证券投资基金
2024年年度报告

2024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：华泰证券股份有限公司

送出日期：2025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。

基金托管人华泰证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 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。

毕马威华振会计师事务所(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 2024 年 06 月 27 日（基金合同生效日）起至 2024 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 7
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 8

3.1 主要会计数据和财务指标 8
3.2 基金净值表现 8
3.3 其他指标 10
3.4 过去三年基金的利润分配情况 10

§4 管理人报告 10

4.1 基金管理人及基金经理情况 10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 15
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明 15
4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 15

§5 托管人报告 16

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 16

§6 审计报告 16

6.1 审计报告基本信息 16
6.2 审计报告的基本内容 16

§7 年度财务报表 18

7.1 资产负债表 18
7.2 利润表 20
7.3 净资产变动表 21
7.4 报表附注 22

§8 投资组合报告 47

8.1 期末基金资产组合情况 47
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 47
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 48
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 67
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 71
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 71
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 71
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 71
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 71
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 71
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 72
8.12 投资组合报告附注 72

§9 基金份额持有人信息 72

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 72
9.2 期末上市基金前十名持有人 73
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 73
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 73
9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 73

§10 开放式基金份额变动 73

§11 重大事件揭示 74

11.1 基金份额持有人大会决议 74
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 74
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 74
11.4 基金投资策略的改变 74
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 75
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 75
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 75
11.8 其他重大事件 76

§12 影响投资者决策的其他重要信息 78

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 78
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 78

§13 备查文件目录 78

13.1 备查文件目录 78
13.2 存放地点 78
13.3 查阅方式 78

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华中证 800 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	鹏华中证 800ETF
场内简称	中证 800ETF
基金主代码	159800
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2024 年 6 月 27 日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	华泰证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	74,736,802.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2024 年 7 月 12 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争将日均跟踪偏离度控制在 0.2%以内，年跟踪误差控制在 2%以内。
投资策略	本基金采取完全复制策略，即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化对股票投资组合进行相应调整。 当预期成份股发生调整或成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。 本基金力争将日均跟踪偏离度控制在 0.2%以内，年跟踪误差控制在 2%以内。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。 1、股票投资策略 （1）股票投资组合的构建 本基金在建仓期内，将按照标的指数各成份股的基准权重对其逐步买入，在力求跟踪误差最小化的前提下，本基金可采取适当方法，以降低买入成本。当遇到成份股停牌、流动性不足等其他市场因素而无法依指数权重购买某成份股及预期标的指数的成份股即将调整或其他影响指数复制的因素时，本基金可以根据市场情况，结合研究分析，对基金财产进行适当调整，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。 （2）股票投资组合的调整

	本基金所构建的股票投资组合将根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况，对其进行适时调整，以保证基金累计报酬率与标的指数同期累计报酬率间的高度正相关和跟踪误差最小化。基金管理人将对成份股的流动性进行分析，如发现流动性欠佳的个股将可能采用合理方法寻求替代。由于受到各项持股比例限制，基金可能不能按照成份股权重持有成份股，基金将会采用合理方法寻求替代。 1）定期调整 根据标的指数的调整规则和备选股票的预期，对股票投资组合及时进行调整。 2）不定期调整 根据指数编制规则，当标的指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重新调整时，本基金将根据各成份股的权重变化进行相应调整； 根据本基金的申购和赎回情况，对股票投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数； 根据法律、法规规定，成份股在标的指数中的权重因其它特殊原因发生相应变化的，本基金可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。 2、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。 3、债券投资策略 本基金债券投资组合将采用自上而下的投资策略，根据宏观经济分析、资金面动向分析等判断未来利率变化，并利用债券定价技术，进行个券选择。 本基金可投资可转换债券及可交换债券，可转换债券及可交换债券兼具债权和股权双重属性，本基金将通过对目标公司股票的投资价值分析和债券价值分析，结合本基金的产品定位和投资目标综合开展投资决策。 4、股指期货投资策略 本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数，实现投资目标。同时，本基金将力争利用股指期货的杠杆作用，降低申购赎回时现金资产对投资组合的影响及仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，从而达到稳定投资组合资产净值的目的。 基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项，同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。 5、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。 6、融资及转融通投资策略 本基金可在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素基础上，参与融资业务。 为更好地实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎经营原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与转融通证券出借业务。本基金将在分析市场环境、投资者类型与结构、基金历史申赎情况、出借证券流动性情况等因素的基础上，合理确定出借证券的范围、期限和比例。 未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，本基金可在履行适当程序后相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书中更新公告。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。同时本基金为交易型开放式指数基金，具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。

注：无。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		鹏华基金管理有限公司	华泰证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	高永杰	李双均
	联系电话	0755-81395402	025-83389842
	电子邮箱	xxpl@phfund.com.cn	lishuangjun@htsc.com
客户服务电话		4006788999	95597
传真		0755-82021126	025-83387215
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	江苏省南京市江东中路 228 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	江苏省南京市江东中路 228 号
邮政编码		518048	210009
法定代表人		张纳沙	张伟

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金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	毕马威华振会计师事务所(特	中国北京东城区东长安街 1 号东方广场毕马

	殊普通合伙）	威大楼 8 层
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2024 年 6 月 27 日（基金合同生效日）-2024 年 12 月 31 日
本期已实现收益	21,414,846.44
本期利润	28,061,870.20
加权平均基金份额本期利润	0.1430
本期加权平均净值利润率	13.87%
本期基金份额净值增长率	15.45%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末
期末可供分配利润	11,549,616.83
期末可供分配基金份额利润	0.1545
期末基金资产净值	86,286,418.83
期末基金份额净值	1.1545
3.1.3 累计期末指标	2024 年末
基金份额累计净值增长率	15.45%

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。

（4）本基金合同于 2024 年 06 月 27 日生效，至 2024 年 12 月 31 日未满一年，故 2024 年的数据和指标为非完整会计年度数据。

3.2 基金净值表现

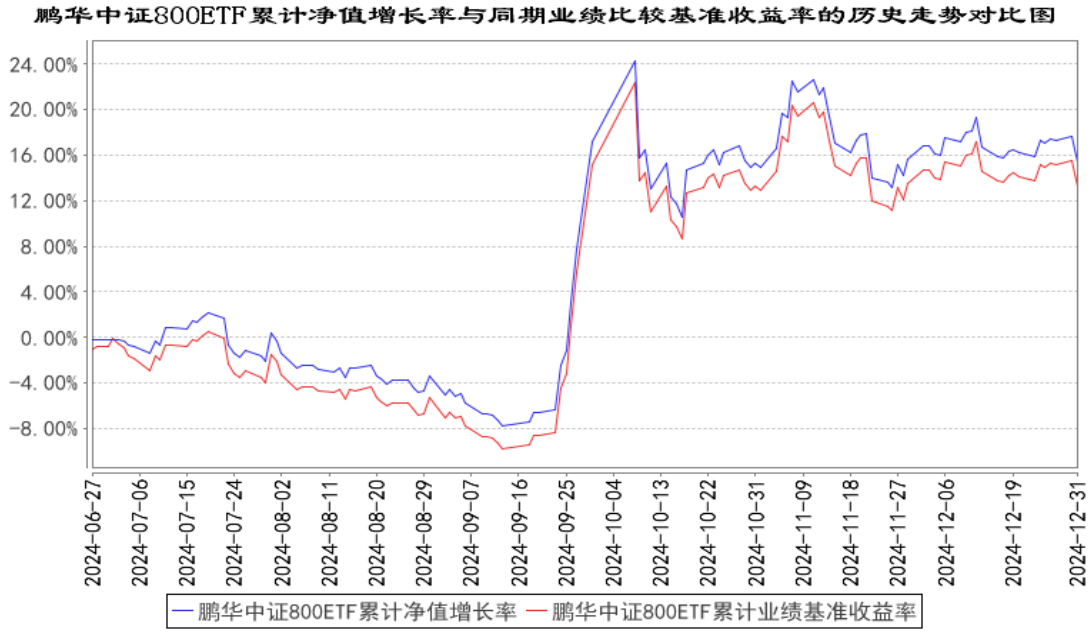
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-1.44%	1.75%	-1.62%	1.78%	0.18%	-0.03%
过去六个月	15.73%	1.69%	14.22%	1.72%	1.51%	-0.03%

自基金合同生效起至今	15.45%	1.67%	13.31%	1.71%	2.14%	-0.04%

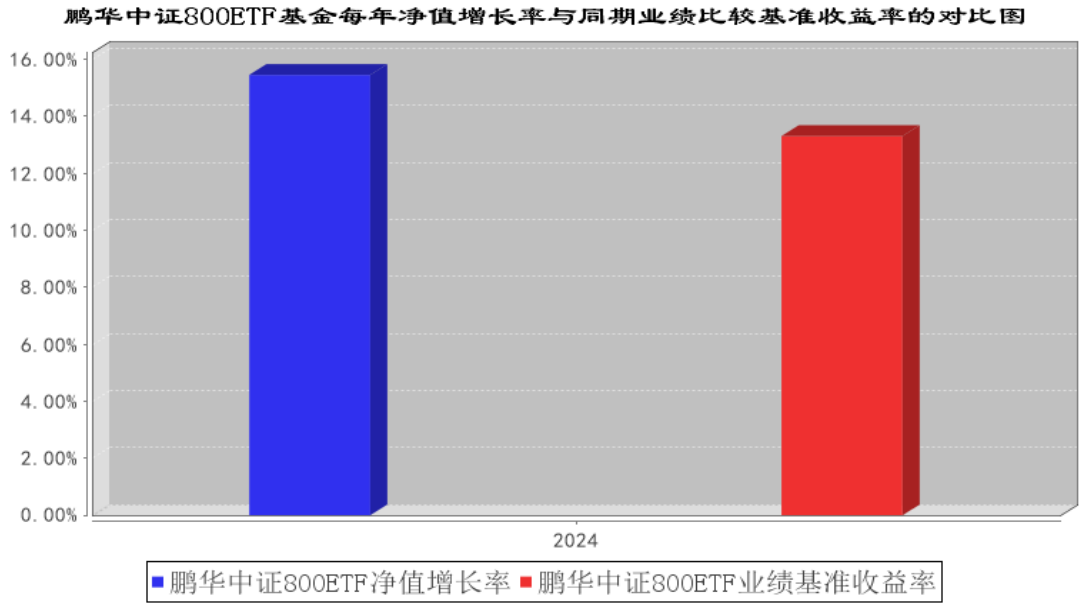
注：业绩比较基准=中证 800 指数收益率。

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



注：1、本基金基金合同于 2024 年 06 月 27 日生效，截至本报告期末本基金基金合同生效未满一年。2、截至建仓期结束，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例

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



注：合同生效当年按照实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 其他指标

注：无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

注：无。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

鹏华基金管理有限公司成立于 1998 年 12 月 22 日，业务范围包括基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。截至本报告期末，公司股东由国信证券股份有限公司、意大利欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）、深圳市北融信投资发展有限公司组成，公司性质为中外合资企业，公司注册资本 15,000 万元人民币。截至本报告期末，公司管理资产总规模达到 12,202 亿元，340 只公募基金、14 只全国社保投资组合、8 只基本养老保险投资组合。经过 20 余年投资管理基金，在基金投资、风险控制等方面积累了丰富经验。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
苏俊杰	基金经理	2024-06-27	-	12 年	苏俊杰先生,国籍中国,理学硕士,12 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，现担任指数与量化投资部总经理/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 月至今担任鹏华创业板 50 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，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 2024 年 10 月担任鹏华中证 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，2024 年 01 月至今担任鹏华智投 800 混合型证券投资基金基金经理，2024 年 05 月至今担任鹏华智投数字经济混合型证券投资基金基金经理，2024 年 06 月至今担任鹏华中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金经理,苏俊杰先生具备基金从业资格。本基金为本报告期内新成立基金，聘任苏俊杰为本基金基金经理。

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

和损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

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

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

在交易监控、分析与评估环节：1、为加强对日常投资交易行为的监控和管理，杜绝利益输送、不公平交易等违规交易行为，防范日常交易风险，公司明确了关注类交易的界定及对应的监控和评估措施机制；所监控的交易包括但不限于：交易所公开竞价交易中同日同向交易的交易时机和交易价差、不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差、关联交易、债券交易收益率偏离度、成交量和成交价格异常、银行间债券交易对手交易等；2、将公平交易作为投资组合业绩归因分析和交易绩效评价的重要关注内容，发现的异常情况由投资监察员进行分析；3、风控管理部分别于每季度和每年度编写《公平交易执行情况检查报告》，内容包括关注类交易监控执行情况、不同投资组合的整体收益率差异分析和同向交易价差分析。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2.1 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

2024年A股市场先抑后扬，三季度末美联储超预期降息50bps，标志着全球流动性边际上趋于宽松；国内政策层面，央行通过降准、降息以及推出证券、基金、保险公司互换便利操作等工具，显著改善了市场流动性，风险偏好迅速回升带动市场大幅反弹。随后12月初的政治局会议定调“适度宽松”的货币政策和更加积极的财政政策，进一步提振了市场信心。风格上来看，9.24之前红利价值占优，9.24之后成长风格回归明显，大盘相对小盘风格整体占优。中证800指数全年上涨12.20%，表现优异。

展望未来，市场表现将主要取决于两大因素：一是经济基本面能否实现实质性改善，二是市场情绪和投资者风险偏好的变化。短期内，政策红利仍是市场的重要支撑；长期来看，经济基本面的改善将是市场持续上涨的关键。中证800指数作为A股核心资产的代表，预计将继续吸引资金流入。

本基金一直以来秉承指数基金的投资策略，致力于通过精细化管理实现跟踪误差的最小化。在基金运作过程中，采用全复制法构建投资组合，即按照标的指数的成分股权重比例进行配置，以确保组合结构与指数的一致性。为应对日常申购赎回的需求，对组合进行适时的动态调整。同时建立了完善的组合再平衡机制，定期根据指数成分股调整和权重变化对投资组合进行优化。

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 15.45%，同期业绩比较基准增长率为 13.31%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，2025 年中国股市的核心矛盾将逐步转向盈利驱动。随着国内经济结构的持续优化和政策的加码，市场将获得更多的支撑。行业层面，聚焦新质生产力落地，这将为相关行业带来新的增长点，科技制造与能源转型将成为双线并行的主要驱动力。

资金层面，中长期资金的入场速度将加快，随着养老金、保险资金等中长期资金占比的提升，机构投资者的比率将进一步增强。这将有助于降低市场的波动率，提升市场的稳定性。然而，市场仍需警惕政策效果滞后及中美博弈升温等内外部风险。政策效果的滞后可能导致市场预期与实际经济表现出现偏差，而中美博弈的升温则可能对市场情绪产生负面影响。

在投资策略上，短期应把握高股息和成长股的轮动节奏。高股息股票在利率下行环境中具有较高的吸引力，而成长股则受益于科技和能源转型的长期趋势。长期来看，投资者应聚焦价值投资，选择那些具有持续盈利能力和良好治理结构的公司，以应对市场的不确定性和波动。

总体而言，2025 年的中国股市将面临新的挑战和机遇，把握政策导向的同时紧跟行业趋势，以应对复杂多变的市场环境。

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。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1、截止本报告期末，本基金期末可供分配利润为11,549,616.83元，期末基金份额净值1.1545元。

2、本基金本报告期内未进行利润分配。

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

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在本报告期内，本基金托管人-华泰证券股份有限公司严格遵守了基金合同和各项法律法规的相关规定，履行了基金托管人应尽的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告期内，华泰证券对基金管理人的投资运作行为依基金合同约定进行了监督，对本基金资产净值计算、利润分配、费用开支等方面进行了复核，未发现基金管理人存在损害本基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

华泰证券作为基金托管人，复核了本基金 2024 年年度报告中的有关财务数据、收益分配、投资组合报告等内容，相关内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第 2502403 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	鹏华中证 800 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了后附的鹏华中证 800 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“该基金”） 财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，自 2024 年 6 月 27 日 （基金合同生效日） 至 2024 年 12 月 31 日止期间的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》 （以下合称“企业会计准则“)及财务报表附注 7.4.2 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”） 和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了该基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2024 年 6 月 27 日 （基金合同生效日） 至 2024 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则 （以下简称“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。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于该基金，并履行了职业道德方面的其他责任。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。
强调事项	无。
其他事项	无。
其他信息	该基金管理人鹏华基金管理有限公司 （以下简称“该基金管理人”） 管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金 2024 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	该基金管理人管理层负责按照企业会计准则及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，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。 在编制财务报表时，该基金管理人管理层负责评估该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，除非该基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。 该基金管理人治理层负责监督该基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	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。 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： (1) 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。 (2) 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。 (3) 评价该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。 (4) 对该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，就可能导致对该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该基金不能持续经营。 (5) 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。 我们与该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。	
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	叶凯韵	叶云晖
会计师事务所的地址	中国北京市	
审计报告日期	2025 年 3 月 25 日	

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：鹏华中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日
资 产：		
货币资金	7.4.7.1	1,890,284.65
结算备付金		13,927.52
存出保证金		-
交易性金融资产	7.4.7.2	84,786,911.96
其中：股票投资		84,786,911.96
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		-
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.8	-
资产总计		86,691,124.13
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2024 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		29,305.30
应付赎回款		-
应付管理人报酬		40,240.47
应付托管费		8,048.10
应付销售服务费		-
应付投资顾问费		-
应交税费		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.9	327,111.43
负债合计		404,705.30
净资产：		
实收基金	7.4.7.10	74,736,802.00
其他综合收益	7.4.7.11	-
未分配利润	7.4.7.12	11,549,616.83
净资产合计		86,286,418.83
负债和净资产总计		86,691,124.13

注：（1）报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.1545 元，基金份额总额 74,736,802.00 份。

（2）本财务报表的实际编制期间为 2024 年 06 月 27 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日，无上年度末数据。

7.2 利润表

会计主体：鹏华中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 6 月 27 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024 年 6 月 27 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
一、营业总收入		28,782,487.53
1.利息收入		127,592.30
其中：存款利息收入	7.4.7.13	127,592.30
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）		21,172,770.02
其中：股票投资收益	7.4.7.14	16,981,883.23
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.15	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.16	-
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	4,190,886.79
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	6,647,023.76
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	835,101.45
减：二、营业总支出		720,617.33
1．管理人报酬	7.4.10.2.1	498,871.26
其中：暂估管理人报酬		-
2．托管费	7.4.10.2.2	99,774.22
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	121,971.85

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		28,061,870.20
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		28,061,870.20
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		28,061,870.20

注：本财务报表的实际编制期间为 2024 年 06 月 27 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日止期间，无上年度可比较期间及可比较数据。

7.3 净资产变动表

会计主体：鹏华中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 6 月 27 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 6 月 27 日（基金合同生效日）至 2024 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	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	590,736,802.00	-	-	590,736,802.00
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	- 516,000,000.00	-	11,549,616.83	-504,450,383.17
（一）、综合收益总额	-	-	28,061,870.20	28,061,870.20
（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）	- 516,000,000.00	-	-16,512,253.37	-532,512,253.37
其中：1.基金申购款	124,000,000.00	-	6,256,613.80	130,256,613.80
2.基金赎回款	- 640,000,000.00	-	-22,768,867.17	-662,768,867.17
（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	74,736,802.00	-	11,549,616.83	86,286,418.83

注：本财务报表的实际编制期间为 2024 年 06 月 27 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日止期间，无上年度可比较期间及可比较数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

邓召明	聂连杰	郝文高
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

鹏华中证 800 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[2024]167 号《关于准予鹏华中证 800 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》准予，由鹏华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式基金，存续期限不定 ，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 590,716,454.00 元，业经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)毕马威华振验字第 2400195 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《鹏华中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2024 年 6 月 27 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 590,736,802.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 20,348.00 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，基金托管人为华泰证券股份有限公司。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的《企业会计准则－基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、《资产管理产品相关会计处理规定》(财会[2022]14 号)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资

基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《鹏华中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2024 年 06 月 27 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年 06 月 27 日(基金合同生效日)至 2024 年 12 月 31 日止期间的经营成果和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。本期财务报表的实际编制期间为 2024 年 06 月 27 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日。

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑在资产负债表日无须付出不必要的额外成本和努力即可获得的有关过去事项、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。

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净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率或者发行价计算的利息及在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价

值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

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

7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，若出现以下情形，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 2024 年 12 月 31 日
活期存款	1,335,828.44
等于：本金	1,335,216.51
加：应计利息	611.93
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	554,456.21
等于：本金	554,448.86
加：应计利息	7.35
减：坏账准备	-
合计	1,890,284.65

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	78,139,888.20	-	84,786,911.96	6,647,023.76
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		78,139,888.20	-	84,786,911.96	6,647,023.76

注：股票投资的公允价值和股票投资的公允价值变动均含可退替代款估值增值。

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

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

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 2024年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	34,453.55
应退替代款	292,657.88
合计	327,111.43

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年6月27日（基金合同生效日）至2024年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	590,736,802.00	590,736,802.00
本期申购	124,000,000.00	124,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-640,000,000.00	-640,000,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	74,736,802.00	74,736,802.00

注：1、本基金自2024年6月11日至2024年6月21日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币590,716,454.00元（含募集股票市值），折合为590,716,454.00份基金份额。根据《鹏华

中证 800 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币 20,348.00 元，在本基金成立后，折合为 20,348.00 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

2、投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购、赎回单位的整数倍。

7.4.7.11 其他综合收益

注：无。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	21,414,846.44	6,647,023.76	28,061,870.20
本期基金份额交易产生的变动数	-9,102,332.96	-7,409,920.41	-16,512,253.37
其中：基金申购款	3,572,564.84	2,684,048.96	6,256,613.80
基金赎回款	-12,674,897.80	-10,093,969.37	-22,768,867.17
本期已分配利润	-	-	-
本期末	12,312,513.48	-762,896.65	11,549,616.83

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 6 月 27 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	88,950.78
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	21,327.43
结算备付金利息收入	13,927.52
其他	3,386.57
合计	127,592.30

注：1、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。

2、其他存款利息收入为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金的利息收入。

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 2024年6月27日（基金合同生效日）至2024年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	9,087,028.53
股票投资收益——赎回差价收入	7,894,854.70
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	16,981,883.23

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 2024 年 6 月 27 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	445,132,288.91
减：卖出股票成本总额	435,532,968.39
减：交易费用	512,291.99
买卖股票差价收入	9,087,028.53

7.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年6月27日（基金合同生效日）至2024年12月31日
赎回基金份额对价总额	662,768,867.17
减：现金支付赎回款总额	406,088,987.17
减：赎回股票成本总额	248,785,025.30
减：交易费用	-
赎回差价收入	7,894,854.70

7.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：无。

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 6 月 27 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日

股票投资产生的股利收益	4,190,886.79
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	4,190,886.79

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 6 月 27 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	6,647,023.76
股票投资	6,647,023.76
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	6,647,023.76

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 6 月 27 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	-
替代损益	834,939.45
其他	162.00
合计	835,101.45

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

7.4.7.22 信用减值损失

注：无。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期

	2024年6月27日（基金合同生效日）至2024年12月31日
审计费用	25,000.00
信息披露费	-
证券出借违约金	-
登记结算费	87,500.00
存托服务费	18.30
IOPV计算和发布费	9,453.55
合计	121,971.85

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、基金销售机构
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金托管人、基金的一级交易商
国信证券股份有限公司(“国信证券”)	基金管理人的股东、基金的一级交易商
深圳市北融信投资发展有限公司	基金管理人的股东
意大利欧利盛资本资产管理股份公司(“Eurizon Capital SGR S.p.A.”)	基金管理人的股东
鹏华资产管理有限公司(“鹏华资产”)	基金管理人的子公司

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

本基金基金合同于2024年06月27日生效，截至本报告期末不满一年，无上年度可比期间数据。

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 2024年6月27日（基金合同生效日）至2024年12月31日

	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
华泰证券	1,113,960,239.80	100.00

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 2024年6月27日（基金合同生效日）至2024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（%）
华泰证券	218,259.16	100.00	-	-

注：1.上述佣金按协议约定的佣金率计算，以扣除证管费、经手费等费用后的净额列示。佣金率由协议签订方参考市场价格确定。佣金协议的服务范围符合《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》相关要求。

2.根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

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 2024 年 6 月 27 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	498,871.26
其中：应支付销售机构的客户维护费	186,901.80

应支付基金管理人的净管理费	311,969.46

注：1、支付基金管理人鹏华基金公司的管理人报酬年费率为0.50%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×0.50%÷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 2024年6月27日（基金合同生效日）至2024年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	99,774.22

注：支付基金托管人华泰证券的托管费按前一日基金资产净值 0.10%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×0.10%/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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例（%）

华泰证券	12,677,661.00	16.96

注：除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的费率标准与其他相同条件的投资者适用的费率标准相一致。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 6 月 27 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
华泰证券	1,890,284.65	110,278.21

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期未在承销期内参与关联方承销证券。本基金在上年度可比期间未成立。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

2024 年 12 月 31 日，本基金持有 15,600.00 股基金托管人华泰证券发行的 A 股普通股，账面价值为人民币 274,404.00 元，占基金资产净值的比例为 0.32%；本基金持有 8,800.00 股国信证券发行的 A 股普通股，账面价值为人民币 98,560.00 元，占基金资产净值的比例为 0.11%。

7.4.11 利润分配情况

注：无。

7.4.12 期末（2024 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

注：无。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002252	上海莱士	2024 年 12 月 23 日	重大事项	7.22	2025 年 1 月 7 日	6.93	15,100	113,691.96	109,022.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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

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

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

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

7.4.13.2 信用风险

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

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

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

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

于 2024 年 12 月 31 日，本基金未持有信用类债券（未满一年）。

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均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，因此除附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2024 年 12 月 31 日，本基金所持有的全部金融负债的合约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。

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率

敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024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	1,890,284.65	-	-	-	1,890,284.65
结算备付金	13,927.52	-	-	-	13,927.52
交易性金融资产	-	-	-	84,786,911.96	84,786,911.96
资产总计	1,904,212.17	-	-	84,786,911.96	86,691,124.13
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	40,240.47	40,240.47
应付托管费	-	-	-	8,048.10	8,048.10
应付清算款	-	-	-	29,305.30	29,305.30
其他负债	-	-	-	327,111.43	327,111.43
负债总计	-	-	-	404,705.30	404,705.30
利率敏感度缺口	1,904,212.17	-	-	84,382,206.66	86,286,418.83

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2024年12月31日，本基金持有的交易性债券投资和资产支持证券公允价值占基金资产净值的比例为0.00%，因此当利率发生合理、可能的变动时，对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注:无。

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以

外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于标的指数成份券和备选成份券，所面临的其他价格风险来源于标的指数成份券和备选成份券证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股（均含存托凭证）的比例不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。

如果法律法规对该比例要求有变更的，可在履行适当程序后以变更后的比例为准。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 2024年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	84,786,911.96	98.26
交易性金融资产－基金投资	-	-
交易性金融资产－贵金属投资	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-
其他	-	-
合计	84,786,911.96	98.26

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

注：于2024年12月31日，由于本基金运行期间不足一年，尚不存在足够的经验数据，因此，无法对本基金资产净值对于市场价格风险的敏感性作定量分析。

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 2024年12月31日
第一层次	84,677,889.96
第二层次	109,022.00
第三层次	-
合计	84,786,911.96

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

注：无。

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

注：无。

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	84,786,911.96	97.80
	其中：股票	84,786,911.96	97.80
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	1,904,212.17	2.20
8	其他各项资产	-	-
9	合计	86,691,124.13	100.00

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

2、报告期末本基金投资的存托凭证公允价值为：76,000.00 元，占净值比 0.09%。本报告所指的“股票”均包含存托凭证。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	712,003.00	0.83
B	采矿业	3,769,626.36	4.37

C	制造业	46,527,088.96	53.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,201,762.00	3.71
E	建筑业	1,515,455.00	1.76
F	批发和零售业	669,406.00	0.78
G	交通运输、仓储和邮政业	2,538,786.00	2.94
H	住宿和餐饮业	68,411.00	0.08
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,994,279.84	5.79
J	金融业	17,719,459.00	20.54
K	房地产业	815,885.00	0.95
L	租赁和商务服务业	716,478.00	0.83
M	科学研究和技术服务业	739,240.00	0.86
N	水利、环境和公共设施管理业	103,973.00	0.12
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	51,340.00	0.06
Q	卫生和社会工作	310,495.80	0.36
R	文化、体育和娱乐业	282,418.00	0.33
S	综合	50,805.00	0.06
	合计	84,786,911.96	98.26

8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

注：无。

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	1,900	2,895,600.00	3.36
2	300750	宁德时代	8,000	2,128,000.00	2.47
3	601318	中国平安	32,800	1,726,920.00	2.00
4	600036	招商银行	37,800	1,485,540.00	1.72

5	000333	美的集团	14,900	1,120,778.00	1.30
6	600900	长江电力	37,400	1,105,170.00	1.28
7	300059	东方财富	38,600	996,652.00	1.16
8	600030	中信证券	29,800	869,266.00	1.01
9	601166	兴业银行	44,400	850,704.00	0.99
10	000858	五粮液	6,000	840,240.00	0.97
11	002594	比亚迪	2,700	763,182.00	0.88
12	601899	紫金矿业	50,300	760,536.00	0.88
13	601398	工商银行	107,000	740,440.00	0.86
14	002475	立讯精密	15,400	627,704.00	0.73
15	600276	恒瑞医药	13,600	624,240.00	0.72
16	000651	格力电器	13,700	622,665.00	0.72
17	600887	伊利股份	19,500	588,510.00	0.68
18	688981	中芯国际	6,100	577,182.00	0.67
19	601328	交通银行	72,000	559,440.00	0.65
20	601816	京沪高铁	90,000	554,400.00	0.64
21	601288	农业银行	97,500	520,650.00	0.60
22	688256	寒武纪-U	778	511,924.00	0.59
23	000725	京东方 A	112,900	495,631.00	0.57
24	300760	迈瑞医疗	1,900	484,500.00	0.56
25	600919	江苏银行	44,800	439,936.00	0.51
26	601088	中国神华	10,000	434,800.00	0.50
27	603259	药明康德	7,700	423,808.00	0.49
28	600309	万华化学	5,800	413,830.00	0.48
29	688041	海光信息	2,700	404,433.00	0.47
30	000063	中兴通讯	9,800	395,920.00	0.46
31	300124	汇川技术	6,600	386,628.00	0.45
32	601668	中国建筑	63,600	381,600.00	0.44
33	600000	浦发银行	35,900	369,411.00	0.43
34	601988	中国银行	64,400	354,844.00	0.41
35	601601	中国太保	10,400	354,432.00	0.41
36	002371	北方华创	900	351,900.00	0.41
37	000001	平安银行	29,700	347,490.00	0.40
38	002415	海康威视	11,300	346,910.00	0.40
39	601728	中国电信	47,400	342,228.00	0.40
40	300308	中际旭创	2,700	333,477.00	0.39
41	600837	海通证券	29,500	328,040.00	0.38
42	300274	阳光电源	4,400	324,852.00	0.38
43	600690	海尔智家	11,400	324,558.00	0.38
44	002714	牧原股份	8,300	319,052.00	0.37
45	600941	中国移动	2,700	319,032.00	0.37
46	603019	中科曙光	4,400	318,208.00	0.37
47	600016	民生银行	75,800	313,054.00	0.36

48	601766	中国中车	37,200	311,736.00	0.36
49	600406	国电南瑞	12,300	310,206.00	0.36
50	601857	中国石油	34,600	309,324.00	0.36
51	601127	赛力斯	2,300	306,797.00	0.36
52	600660	福耀玻璃	4,900	305,760.00	0.35
53	601919	中远海控	19,500	302,250.00	0.35
54	601985	中国核电	28,900	301,427.00	0.35
55	600031	三一重工	18,100	298,288.00	0.35
56	002352	顺丰控股	7,400	298,220.00	0.35
57	600028	中国石化	44,600	297,928.00	0.35
58	600104	上汽集团	14,100	292,716.00	0.34
59	601012	隆基绿能	18,500	290,635.00	0.34
60	000100	TCL科技	57,300	288,219.00	0.33
61	000568	泸州老窖	2,300	287,960.00	0.33
62	603501	韦尔股份	2,700	281,907.00	0.33
63	601229	上海银行	30,500	279,075.00	0.32
64	601169	北京银行	45,200	277,980.00	0.32
65	600809	山西汾酒	1,500	276,315.00	0.32
66	002230	科大讯飞	5,700	275,424.00	0.32
67	601225	陕西煤业	11,800	274,468.00	0.32
68	601688	华泰证券	15,600	274,404.00	0.32
69	300498	温氏股份	16,300	269,113.00	0.31
70	688012	中微公司	1,400	264,824.00	0.31
71	601138	工业富联	12,100	260,150.00	0.30
72	600050	中国联通	48,600	258,066.00	0.30
73	601211	国泰君安	13,700	255,505.00	0.30
74	300502	新易盛	2,200	254,276.00	0.29
75	002142	宁波银行	10,100	245,531.00	0.28
76	600150	中国船舶	6,800	244,528.00	0.28
77	688008	澜起科技	3,500	237,650.00	0.28
78	603288	海天味业	5,100	234,090.00	0.27
79	000338	潍柴动力	16,600	227,420.00	0.26
80	002625	光启技术	4,600	219,880.00	0.25
81	601818	光大银行	56,600	219,042.00	0.25
82	600999	招商证券	11,400	218,424.00	0.25
83	002027	分众传媒	30,900	217,227.00	0.25
84	601628	中国人寿	5,100	213,792.00	0.25
85	603986	兆易创新	2,000	213,600.00	0.25
86	000625	长安汽车	15,100	201,736.00	0.23
87	300033	同花顺	700	201,250.00	0.23
88	601888	中国中免	3,000	201,030.00	0.23
89	000425	徐工机械	25,300	200,629.00	0.23
90	688111	金山办公	700	200,473.00	0.23

91	601390	中国中铁	31,300	200,007.00	0.23
92	600418	江淮汽车	5,300	198,750.00	0.23
93	600089	特变电工	15,400	196,196.00	0.23
94	600048	保利发展	22,000	194,920.00	0.23
95	000938	紫光股份	7,000	194,810.00	0.23
96	601658	邮储银行	34,000	193,120.00	0.22
97	600436	片仔癀	900	193,050.00	0.22
98	002241	歌尔股份	7,400	190,994.00	0.22
99	600905	三峡能源	43,700	190,969.00	0.22
100	000792	盐湖股份	11,600	190,936.00	0.22
101	601006	大秦铁路	27,900	189,162.00	0.22
102	600938	中国海油	6,400	188,864.00	0.22
103	600019	宝钢股份	26,900	188,300.00	0.22
104	300015	爱尔眼科	14,200	188,150.00	0.22
105	600438	通威股份	8,200	181,302.00	0.21
106	601939	建设银行	20,500	180,195.00	0.21
107	600584	长电科技	4,400	179,784.00	0.21
108	601600	中国铝业	24,200	177,870.00	0.21
109	300014	亿纬锂能	3,800	177,612.00	0.21
110	601009	南京银行	16,400	174,660.00	0.20
111	600585	海螺水泥	7,300	173,594.00	0.20
112	600760	中航沈飞	3,400	172,448.00	0.20
113	600893	航发动力	4,100	169,945.00	0.20
114	600958	东方证券	16,000	168,960.00	0.20
115	601989	中国重工	34,900	167,869.00	0.19
116	600111	北方稀土	7,800	165,516.00	0.19
117	688271	联影医疗	1,300	164,320.00	0.19
118	002463	沪电股份	4,100	162,565.00	0.19
119	000538	云南白药	2,700	161,865.00	0.19
120	000977	浪潮信息	3,100	160,828.00	0.19
121	600926	杭州银行	11,000	160,710.00	0.19
122	002050	三花智控	6,800	159,868.00	0.19
123	605499	东鹏饮料	640	159,052.80	0.18
124	300408	三环集团	4,100	157,891.00	0.18
125	600015	华夏银行	19,500	156,195.00	0.18
126	002179	中航光电	3,900	153,270.00	0.18
127	600886	国投电力	9,100	151,242.00	0.18
128	000002	万科 A	20,800	151,008.00	0.18
129	002304	洋河股份	1,800	150,354.00	0.17
130	000776	广发证券	9,100	147,511.00	0.17
131	000166	申万宏源	27,500	147,125.00	0.17
132	603993	洛阳钼业	21,600	143,640.00	0.17
133	601669	中国电建	26,300	143,598.00	0.17

134	002028	思源电气	1,900	138,130.00	0.16
135	688036	传音控股	1,433	136,135.00	0.16
136	300433	蓝思科技	6,200	135,780.00	0.16
137	002049	紫光国微	2,100	135,177.00	0.16
138	601916	浙商银行	46,000	133,860.00	0.16
139	601377	兴业证券	21,100	132,086.00	0.15
140	000988	华工科技	3,000	129,900.00	0.15
141	600009	上海机场	3,800	129,770.00	0.15
142	601186	中国铁建	14,100	129,297.00	0.15
143	600010	包钢股份	69,500	129,270.00	0.15
144	601336	新华保险	2,600	129,220.00	0.15
145	600570	恒生电子	4,600	128,754.00	0.15
146	002311	海大集团	2,600	127,530.00	0.15
147	300339	润和软件	2,500	125,075.00	0.14
148	601901	方正证券	15,000	124,950.00	0.14
149	601838	成都银行	7,300	124,903.00	0.14
150	600547	山东黄金	5,512	124,736.56	0.14
151	600795	国电电力	27,200	124,576.00	0.14
152	603799	华友钴业	4,200	122,892.00	0.14
153	002384	东山精密	4,200	122,640.00	0.14
154	002460	赣锋锂业	3,500	122,535.00	0.14
155	000768	中航西飞	4,300	121,432.00	0.14
156	601995	中金公司	3,600	121,284.00	0.14
157	688617	惠泰医疗	325	121,007.25	0.14
158	002422	科伦药业	3,900	116,727.00	0.14
159	600157	永泰能源	67,200	114,912.00	0.13
160	688169	石头科技	520	114,030.80	0.13
161	601800	中国交建	10,900	113,905.00	0.13
162	001979	招商蛇口	11,100	113,664.00	0.13
163	600989	宝丰能源	6,700	112,828.00	0.13
164	600415	小商品城	8,300	111,303.00	0.13
165	601360	三六零	10,700	110,745.00	0.13
166	000157	中联重科	15,200	109,896.00	0.13
167	300442	润泽科技	2,100	109,116.00	0.13
168	600839	四川长虹	11,300	109,045.00	0.13
169	002252	上海莱士	15,100	109,022.00	0.13
170	601788	光大证券	6,000	108,660.00	0.13
171	600066	宇通客车	4,100	108,158.00	0.13
172	002797	第一创业	12,900	107,715.00	0.12
173	600029	南方航空	16,500	107,085.00	0.12
174	600489	中金黄金	8,900	107,067.00	0.12
175	600487	亨通光电	6,100	105,042.00	0.12
176	600115	中国东航	26,200	104,800.00	0.12

177	603369	今世缘	2,300	104,029.00	0.12
178	600674	川投能源	6,000	103,500.00	0.12
179	002001	新和成	4,700	103,259.00	0.12
180	601066	中信建投	4,000	103,000.00	0.12
181	601689	拓普集团	2,100	102,900.00	0.12
182	601878	浙商证券	8,400	102,816.00	0.12
183	002466	天齐锂业	3,100	102,300.00	0.12
184	002340	格林美	15,600	101,868.00	0.12
185	600160	巨化股份	4,200	101,304.00	0.12
186	600745	闻泰科技	2,600	100,828.00	0.12
187	601881	中国银河	6,600	100,518.00	0.12
188	300207	欣旺达	4,500	100,395.00	0.12
189	601633	长城汽车	3,800	100,054.00	0.12
190	300418	昆仑万维	2,600	100,048.00	0.12
191	301236	软通动力	1,700	99,807.00	0.12
192	003816	中国广核	24,100	99,533.00	0.12
193	002920	德赛西威	900	99,099.00	0.11
194	300782	卓胜微	1,100	98,670.00	0.11
195	002736	国信证券	8,800	98,560.00	0.11
196	600346	恒力石化	6,400	98,240.00	0.11
197	688120	华海清科	600	97,794.00	0.11
198	002236	大华股份	6,100	97,600.00	0.11
199	300122	智飞生物	3,700	97,310.00	0.11
200	600426	华鲁恒升	4,500	97,245.00	0.11
201	600196	复星医药	3,900	96,915.00	0.11
202	002648	卫星化学	5,100	95,829.00	0.11
203	002273	水晶光电	4,300	95,546.00	0.11
204	002156	通富微电	3,200	94,560.00	0.11
205	601162	天风证券	21,100	94,528.00	0.11
206	601555	东吴证券	12,100	94,380.00	0.11
207	688126	沪硅产业	5,000	94,100.00	0.11
208	000786	北新建材	3,100	93,961.00	0.11
209	600460	士兰微	3,600	93,672.00	0.11
210	601117	中国化学	11,200	92,848.00	0.11
211	002966	苏州银行	11,400	92,454.00	0.11
212	002185	华天科技	7,900	91,719.00	0.11
213	300394	天孚通信	1,000	91,360.00	0.11
214	300896	爱美客	500	91,250.00	0.11
215	600372	中航机载	7,400	91,242.00	0.11
216	600011	华能国际	13,400	90,718.00	0.11
217	601868	中国能建	39,600	90,684.00	0.11
218	601111	中国国航	11,400	90,174.00	0.10
219	002601	龙佰集团	5,100	90,117.00	0.10

220	000963	华东医药	2,600	89,960.00	0.10
221	000661	长春高新	900	89,496.00	0.10
222	600096	云天化	4,000	89,200.00	0.10
223	600183	生益科技	3,700	88,985.00	0.10
224	601099	太平洋	20,800	88,608.00	0.10
225	601933	永辉超市	13,900	88,126.00	0.10
226	002129	TCL中环	9,900	87,813.00	0.10
227	000423	东阿阿胶	1,400	87,808.00	0.10
228	002916	深南电路	700	87,500.00	0.10
229	000066	中国长城	6,000	87,420.00	0.10
230	300347	泰格医药	1,600	87,392.00	0.10
231	002202	金风科技	8,400	86,772.00	0.10
232	000596	古井贡酒	500	86,650.00	0.10
233	601021	春秋航空	1,500	86,505.00	0.10
234	001965	招商公路	6,200	86,490.00	0.10
235	688223	晶科能源	12,100	86,031.00	0.10
236	000807	云铝股份	6,300	85,239.00	0.10
237	600085	同仁堂	2,100	85,239.00	0.10
238	300832	新产业	1,200	85,020.00	0.10
239	301269	华大九天	700	84,770.00	0.10
240	600741	华域汽车	4,800	84,528.00	0.10
241	002180	纳思达	3,000	84,510.00	0.10
242	688777	中控技术	1,700	84,439.00	0.10
243	601100	恒立液压	1,600	84,432.00	0.10
244	600176	中国巨石	7,400	84,286.00	0.10
245	002493	荣盛石化	9,300	84,165.00	0.10
246	600536	中国软件	1,800	84,042.00	0.10
247	002459	晶澳科技	6,100	83,875.00	0.10
248	600219	南山铝业	21,300	83,283.00	0.10
249	600482	中国动力	3,400	83,198.00	0.10
250	000895	双汇发展	3,200	83,072.00	0.10
251	601998	中信银行	11,900	83,062.00	0.10
252	600885	宏发股份	2,600	82,732.00	0.10
253	601168	西部矿业	5,100	81,957.00	0.09
254	600079	人福医药	3,500	81,830.00	0.09
255	600352	浙江龙盛	7,900	81,291.00	0.09
256	600600	青岛啤酒	1,000	80,920.00	0.09
257	601108	财通证券	9,900	80,883.00	0.09
258	002709	天赐材料	4,100	80,852.00	0.09
259	688396	华润微	1,700	80,223.00	0.09
260	300759	康龙化成	3,100	79,670.00	0.09
261	600988	赤峰黄金	5,100	79,611.00	0.09
262	300661	圣邦股份	967	79,081.26	0.09

263	600515	海南机场	20,900	79,002.00	0.09
264	002138	顺络电子	2,500	78,700.00	0.09
265	600188	兖矿能源	5,540	78,501.80	0.09
266	000975	山金国际	5,100	78,387.00	0.09
267	300017	网宿科技	7,400	78,218.00	0.09
268	002738	中矿资源	2,200	78,100.00	0.09
269	002271	东方雨虹	6,000	77,880.00	0.09
270	688188	柏楚电子	400	77,700.00	0.09
271	603392	万泰生物	1,100	77,506.00	0.09
272	601877	正泰电器	3,300	77,253.00	0.09
273	603893	瑞芯微	700	77,042.00	0.09
274	300803	指南针	800	76,760.00	0.09
275	002938	鹏鼎控股	2,100	76,608.00	0.09
276	601577	长沙银行	8,600	76,454.00	0.09
277	600845	宝信软件	2,600	76,076.00	0.09
278	689009	九号公司-WD	1,600	76,000.00	0.09
279	002078	太阳纸业	5,100	75,837.00	0.09
280	300476	胜宏科技	1,800	75,762.00	0.09
281	000630	铜陵有色	23,400	75,582.00	0.09
282	600233	圆通速递	5,300	75,207.00	0.09
283	300474	景嘉微	800	74,792.00	0.09
284	688099	晶晨股份	1,088	74,723.84	0.09
285	601319	中国人保	9,700	73,914.00	0.09
286	002085	万丰奥威	3,900	73,905.00	0.09
287	600161	天坛生物	3,600	73,800.00	0.09
288	300136	信维通信	2,900	73,776.00	0.09
289	002555	三七互娱	4,700	73,508.00	0.09
290	002281	光迅科技	1,400	73,038.00	0.08
291	601618	中国中冶	22,000	72,600.00	0.08
292	600879	航天电子	8,100	72,576.00	0.08
293	603160	汇顶科技	900	72,486.00	0.08
294	300058	蓝色光标	7,800	72,384.00	0.08
295	002517	恺英网络	5,300	72,133.00	0.08
296	000983	山西焦煤	8,700	71,688.00	0.08
297	601607	上海医药	3,400	71,400.00	0.08
298	002444	巨星科技	2,200	71,170.00	0.08
299	000999	华润三九	1,600	70,944.00	0.08
300	300002	神州泰岳	6,100	70,699.00	0.08
301	002353	杰瑞股份	1,900	70,281.00	0.08
302	002074	国轩高科	3,300	70,026.00	0.08
303	300024	机器人	3,900	70,005.00	0.08
304	688213	思特威-W	900	69,948.00	0.08
305	600109	国金证券	8,000	69,840.00	0.08

306	601128	常熟银行	9,200	69,644.00	0.08
307	600023	浙能电力	12,300	69,618.00	0.08
308	601615	明阳智能	5,500	69,355.00	0.08
309	000783	长江证券	10,100	68,882.00	0.08
310	688122	西部超导	1,600	68,512.00	0.08
311	600298	安琪酵母	1,900	68,495.00	0.08
312	300866	安克创新	700	68,348.00	0.08
313	002195	岩山科技	17,200	68,284.00	0.08
314	601898	中煤能源	5,600	68,208.00	0.08
315	300223	北京君正	1,000	68,200.00	0.08
316	605117	德业股份	800	67,840.00	0.08
317	603605	珀莱雅	800	67,760.00	0.08
318	601567	三星医疗	2,200	67,672.00	0.08
319	002465	海格通信	6,100	66,978.00	0.08
320	002532	天山铝业	8,500	66,895.00	0.08
321	601799	星宇股份	500	66,740.00	0.08
322	688469	芯联集成-U	13,000	66,690.00	0.08
323	002128	电投能源	3,400	66,572.00	0.08
324	000408	藏格矿业	2,400	66,552.00	0.08
325	600588	用友网络	6,200	66,526.00	0.08
326	688047	龙芯中科	500	66,140.00	0.08
327	300450	先导智能	3,300	66,066.00	0.08
328	600362	江西铜业	3,200	66,048.00	0.08
329	000728	国元证券	7,900	66,044.00	0.08
330	002673	西部证券	8,100	66,015.00	0.08
331	002223	鱼跃医疗	1,800	65,682.00	0.08
332	000301	东方盛虹	8,000	65,680.00	0.08
333	600862	中航高科	2,600	65,676.00	0.08
334	300496	中科创达	1,100	65,516.00	0.08
335	002008	大族激光	2,600	65,000.00	0.08
336	601198	东兴证券	5,900	64,959.00	0.08
337	000831	中国稀土	2,300	64,515.00	0.07
338	600895	张江高科	2,400	64,320.00	0.07
339	002472	双环传动	2,100	64,302.00	0.07
340	603296	华勤技术	900	63,855.00	0.07
341	300316	晶盛机电	2,000	63,800.00	0.07
342	688599	天合光能	3,300	63,690.00	0.07
343	601238	广汽集团	6,800	63,512.00	0.07
344	601872	招商轮船	9,900	63,459.00	0.07
345	600765	中航重机	3,100	63,457.00	0.07
346	301358	湖南裕能	1,400	63,448.00	0.07
347	300012	华测检测	5,100	63,393.00	0.07
348	603606	东方电缆	1,200	63,060.00	0.07

349	300383	光环新网	4,300	62,737.00	0.07
350	600332	白云山	2,200	62,524.00	0.07
351	300699	光威复材	1,800	62,370.00	0.07
352	600177	雅戈尔	7,000	62,300.00	0.07
353	600873	梅花生物	6,200	62,186.00	0.07
354	688525	佰维存储	1,000	61,970.00	0.07
355	000876	新希望	6,900	61,962.00	0.07
356	300413	芒果超媒	2,300	61,847.00	0.07
357	688072	拓荆科技	400	61,468.00	0.07
358	002821	凯莱英	800	60,872.00	0.07
359	600803	新奥股份	2,800	60,704.00	0.07
360	000400	许继电气	2,200	60,566.00	0.07
361	002595	豪迈科技	1,200	60,228.00	0.07
362	601233	桐昆股份	5,100	60,180.00	0.07
363	300395	菲利华	1,600	60,176.00	0.07
364	300037	新宙邦	1,600	59,904.00	0.07
365	300054	鼎龙股份	2,300	59,846.00	0.07
366	600061	国投资本	7,900	59,408.00	0.07
367	300142	沃森生物	4,900	59,192.00	0.07
368	300999	金龙鱼	1,800	58,698.00	0.07
369	000750	国海证券	13,700	58,636.00	0.07
370	002850	科达利	600	58,608.00	0.07
371	600027	华电国际	10,400	58,344.00	0.07
372	600039	四川路桥	8,000	58,240.00	0.07
373	601990	南京证券	6,700	58,022.00	0.07
374	603596	伯特利	1,300	57,967.00	0.07
375	300628	亿联网络	1,500	57,900.00	0.07
376	688521	芯原股份	1,100	57,673.00	0.07
377	000009	中国宝安	6,300	57,645.00	0.07
378	002812	恩捷股份	1,800	57,582.00	0.07
379	688506	百利天恒-U	300	57,519.00	0.07
380	300114	中航电测	800	57,424.00	0.07
381	300604	长川科技	1,300	57,369.00	0.07
382	603345	安井食品	700	57,036.00	0.07
383	600369	西南证券	12,200	56,974.00	0.07
384	600642	申能股份	6,000	56,940.00	0.07
385	601696	中银证券	5,100	56,916.00	0.07
386	300724	捷佳伟创	900	56,889.00	0.07
387	600153	建发股份	5,400	56,808.00	0.07
388	002261	拓维信息	3,100	56,761.00	0.07
389	002436	兴森科技	5,100	56,661.00	0.07
390	688472	阿特斯	4,500	56,520.00	0.07
391	600143	金发科技	6,500	56,160.00	0.07

392	688249	晶合集成	2,400	56,016.00	0.06
393	002007	华兰生物	3,300	55,605.00	0.06
394	603260	合盛硅业	1,000	55,560.00	0.06
395	600398	海澜之家	7,400	55,500.00	0.06
396	600918	中泰证券	8,400	55,188.00	0.06
397	600875	东方电气	3,400	54,026.00	0.06
398	000617	中油资本	7,800	53,742.00	0.06
399	601216	君正集团	10,200	53,652.00	0.06
400	601997	贵阳银行	8,900	53,400.00	0.06
401	000738	航发控制	2,400	53,376.00	0.06
402	000021	深科技	2,800	53,368.00	0.06
403	002558	巨人网络	4,200	53,298.00	0.06
404	601699	潞安环能	3,700	53,132.00	0.06
405	000932	华菱钢铁	12,700	53,086.00	0.06
406	000729	燕京啤酒	4,400	52,976.00	0.06
407	002294	信立泰	1,700	52,581.00	0.06
408	688361	中科飞测	600	52,530.00	0.06
409	000878	云南铜业	4,300	52,417.00	0.06
410	600497	驰宏锌锗	9,400	52,358.00	0.06
411	600025	华能水电	5,500	52,305.00	0.06
412	002409	雅克科技	900	52,155.00	0.06
413	688052	纳芯微	400	52,120.00	0.06
414	600909	华安证券	8,600	52,116.00	0.06
415	600141	兴发集团	2,400	52,080.00	0.06
416	600018	上港集团	8,500	52,020.00	0.06
417	000997	新大陆	2,600	51,870.00	0.06
418	688002	睿创微纳	1,100	51,711.00	0.06
419	603338	浙江鼎力	800	51,616.00	0.06
420	600529	山东药玻	2,000	51,540.00	0.06
421	002607	中公教育	15,100	51,340.00	0.06
422	603659	璞泰来	3,200	50,912.00	0.06
423	600673	东阳光	4,500	50,805.00	0.06
424	000733	振华科技	1,200	50,604.00	0.06
425	300919	中伟股份	1,400	50,568.00	0.06
426	300001	特锐德	2,300	50,485.00	0.06
427	600132	重庆啤酒	800	50,416.00	0.06
428	600155	华创云信	6,800	50,320.00	0.06
429	002065	东华软件	6,900	50,094.00	0.06
430	000623	吉林敖东	2,900	50,083.00	0.06
431	688009	中国通号	8,000	50,080.00	0.06
432	601456	国联证券	3,700	50,024.00	0.06
433	002064	华峰化学	6,100	49,898.00	0.06
434	600026	中远海能	4,300	49,880.00	0.06

435	601665	齐鲁银行	8,900	49,751.00	0.06
436	002318	久立特材	2,100	49,161.00	0.06
437	600118	中国卫星	1,800	49,140.00	0.06
438	000034	神州数码	1,400	49,070.00	0.06
439	002432	九安医疗	1,200	48,936.00	0.06
440	300763	锦浪科技	800	48,856.00	0.06
441	600704	物产中大	9,600	48,576.00	0.06
442	002739	万达电影	4,000	48,560.00	0.06
443	603087	甘李药业	1,100	48,510.00	0.06
444	300073	当升科技	1,200	48,336.00	0.06
445	600549	厦门钨业	2,500	48,175.00	0.06
446	600820	隧道股份	6,700	48,173.00	0.06
447	600312	平高电气	2,500	48,000.00	0.06
448	002841	视源股份	1,300	47,983.00	0.06
449	600060	海信视像	2,400	47,856.00	0.06
450	688180	君实生物-U	1,750	47,827.50	0.06
451	600563	法拉电子	400	47,568.00	0.06
452	600637	东方明珠	6,100	47,336.00	0.05
453	603129	春风动力	300	47,121.00	0.05
454	601179	中国西电	6,200	47,058.00	0.05
455	002410	广联达	4,000	47,040.00	0.05
456	600699	均胜电子	3,000	47,010.00	0.05
457	002984	森麒麟	1,900	46,854.00	0.05
458	600521	华海药业	2,600	46,462.00	0.05
459	600580	卧龙电驱	2,700	46,413.00	0.05
460	600486	扬农化工	800	46,296.00	0.05
461	002262	恩华药业	1,900	46,265.00	0.05
462	603806	福斯特	3,100	45,880.00	0.05
463	603939	益丰药房	1,900	45,847.00	0.05
464	688303	大全能源	1,886	45,528.04	0.05
465	002385	大北农	10,500	45,465.00	0.05
466	603568	伟明环保	2,100	45,423.00	0.05
467	300003	乐普医疗	4,000	45,360.00	0.05
468	601865	福莱特	2,300	45,287.00	0.05
469	601666	平煤股份	4,500	45,090.00	0.05
470	601059	信达证券	3,000	44,940.00	0.05
471	002568	百润股份	1,600	44,816.00	0.05
472	000683	远兴能源	8,000	44,720.00	0.05
473	300144	宋城演艺	4,800	44,592.00	0.05
474	600390	五矿资本	6,900	44,505.00	0.05
475	002152	广电运通	3,800	44,308.00	0.05
476	600392	盛和资源	4,300	44,204.00	0.05
477	002044	美年健康	9,600	44,064.00	0.05

478	300529	健帆生物	1,500	44,010.00	0.05
479	002025	航天电器	900	43,704.00	0.05
480	600008	首创环保	13,300	43,624.00	0.05
481	000039	中集集团	5,600	43,512.00	0.05
482	002624	完美世界	4,200	43,386.00	0.05
483	600863	内蒙华电	10,000	43,300.00	0.05
484	002407	多氟多	3,600	43,200.00	0.05
485	600170	上海建工	16,300	43,195.00	0.05
486	603589	口子窖	1,100	43,164.00	0.05
487	300558	贝达药业	800	43,144.00	0.05
488	601717	郑煤机	3,300	42,834.00	0.05
489	600498	烽火通信	2,200	42,812.00	0.05
490	603179	新泉股份	1,000	42,700.00	0.05
491	300285	国瓷材料	2,500	42,600.00	0.05
492	300251	光线传媒	4,500	42,480.00	0.05
493	601000	唐山港	9,000	42,390.00	0.05
494	000426	兴业银锡	3,800	42,256.00	0.05
495	688385	复旦微电	1,100	42,229.00	0.05
496	603195	公牛集团	600	42,144.00	0.05
497	000960	锡业股份	3,000	42,090.00	0.05
498	300751	迈为股份	400	42,060.00	0.05
499	000723	美锦能源	9,300	41,943.00	0.05
500	688578	艾力斯	700	41,930.00	0.05
501	600872	中炬高新	1,900	41,838.00	0.05
502	000513	丽珠集团	1,100	41,800.00	0.05
503	600316	洪都航空	1,300	41,756.00	0.05
504	600816	建元信托	11,900	41,650.00	0.05
505	002603	以岭药业	2,600	41,626.00	0.05
506	600516	方大炭素	8,600	41,538.00	0.05
507	601966	玲珑轮胎	2,300	41,492.00	0.05
508	000703	恒逸石化	6,600	41,448.00	0.05
509	002500	山西证券	6,600	41,448.00	0.05
510	603816	顾家家居	1,500	41,370.00	0.05
511	603833	欧派家居	600	41,364.00	0.05
512	002958	青农商行	13,600	41,344.00	0.05
513	002939	长城证券	5,000	41,000.00	0.05
514	000830	鲁西化工	3,500	40,915.00	0.05
515	002155	湖南黄金	2,600	40,898.00	0.05
516	688017	绿的谐波	376	40,630.56	0.05
517	000629	钒钛股份	14,100	40,608.00	0.05
518	300390	天华新能	1,760	40,568.00	0.05
519	000921	海信家电	1,400	40,460.00	0.05
520	600021	上海电力	4,400	40,348.00	0.05

521	000893	亚钾国际	2,000	40,320.00	0.05
522	000636	风华高科	2,800	40,180.00	0.05
523	000591	太阳能	8,400	39,984.00	0.05
524	603979	金诚信	1,100	39,930.00	0.05
525	002926	华西证券	4,800	39,888.00	0.05
526	002203	海亮股份	3,700	39,775.00	0.05
527	605358	立昂微	1,600	39,632.00	0.05
528	601880	辽港股份	22,800	39,444.00	0.05
529	600998	九州通	7,700	39,424.00	0.05
530	002414	高德红外	5,300	39,379.00	0.05
531	300979	华利集团	500	39,325.00	0.05
532	002429	兆驰股份	6,800	39,304.00	0.05
533	300373	扬杰科技	900	39,168.00	0.05
534	603927	中科软	1,800	39,060.00	0.05
535	600535	天士力	2,700	39,042.00	0.05
536	600348	华阳股份	5,500	38,995.00	0.05
537	603077	和邦生物	19,100	38,964.00	0.05
538	600970	中材国际	4,100	38,868.00	0.05
539	601698	中国卫通	1,900	38,760.00	0.04
540	600325	华发股份	6,700	38,592.00	0.04
541	300567	精测电子	600	38,580.00	0.04
542	600655	豫园股份	6,000	38,580.00	0.04
543	600208	衢州发展	13,000	38,480.00	0.04
544	688187	时代电气	800	38,336.00	0.04
545	600380	健康元	3,400	38,318.00	0.04
546	300487	蓝晓科技	800	38,296.00	0.04
547	600763	通策医疗	862	38,272.80	0.04
548	601016	节能风电	11,900	37,723.00	0.04
549	600511	国药股份	1,100	37,642.00	0.04
550	600754	锦江酒店	1,400	37,604.00	0.04
551	000519	中兵红箭	2,600	37,570.00	0.04
552	300748	金力永磁	2,100	37,548.00	0.04
553	002423	中粮资本	2,800	37,492.00	0.04
554	603000	人民网	1,700	37,468.00	0.04
555	688114	华大智造	800	37,432.00	0.04
556	601136	首创证券	1,700	37,400.00	0.04
557	300146	汤臣倍健	3,100	37,355.00	0.04
558	002683	广东宏大	1,400	37,072.00	0.04
559	600901	江苏金租	7,100	37,062.00	0.04
560	000060	中金岭南	7,900	37,051.00	0.04
561	688536	思瑞浦	400	37,000.00	0.04
562	600859	王府井	2,400	36,984.00	0.04
563	688278	特宝生物	500	36,685.00	0.04

564	600583	海油工程	6,700	36,649.00	0.04
565	601236	红塔证券	4,300	36,507.00	0.04
566	002439	启明星辰	2,300	36,386.00	0.04
567	600166	福田汽车	14,400	36,144.00	0.04
568	300601	康泰生物	2,100	36,015.00	0.04
569	603290	斯达半导	400	35,928.00	0.04
570	688234	天岳先进	700	35,840.00	0.04
571	000998	隆平高科	3,200	35,744.00	0.04
572	603885	吉祥航空	2,600	35,620.00	0.04
573	601001	晋控煤业	2,600	35,542.00	0.04
574	600546	山煤国际	3,000	35,490.00	0.04
575	300677	英科医疗	1,400	35,392.00	0.04
576	600707	彩虹股份	4,300	35,346.00	0.04
577	002507	涪陵榨菜	2,500	35,325.00	0.04
578	600282	南钢股份	7,500	35,175.00	0.04
579	300212	易华录	1,500	35,100.00	0.04
580	688065	凯赛生物	900	34,920.00	0.04
581	000598	兴蓉环境	4,600	34,914.00	0.04
582	603658	安图生物	800	34,912.00	0.04
583	300573	兴齐眼药	500	34,890.00	0.04
584	688005	容百科技	1,100	34,705.00	0.04
585	600038	中直股份	900	34,704.00	0.04
586	600867	通化东宝	4,300	34,658.00	0.04
587	600004	白云机场	3,600	34,560.00	0.04
588	002373	千方科技	3,400	34,476.00	0.04
589	301308	江波龙	400	34,400.00	0.04
590	688220	翱捷科技-U	635	34,347.15	0.04
591	603156	养元饮品	1,500	34,260.00	0.04
592	000708	中信特钢	3,000	34,230.00	0.04
593	600131	国网信通	1,800	34,038.00	0.04
594	002756	永兴材料	900	33,948.00	0.04
595	300070	碧水源	6,700	33,902.00	0.04
596	600483	福能股份	3,400	33,898.00	0.04
597	002120	韵达股份	4,500	33,840.00	0.04
598	688032	禾迈股份	300	33,792.00	0.04
599	601918	新集能源	4,700	33,746.00	0.04
600	601156	东航物流	2,000	33,740.00	0.04
601	600737	中粮糖业	3,300	33,693.00	0.04
602	300888	稳健医疗	800	33,664.00	0.04
603	002244	滨江集团	3,900	33,579.00	0.04
604	300676	华大基因	800	33,576.00	0.04
605	300118	东方日升	2,800	33,544.00	0.04
606	000563	陕国投 A	9,400	33,464.00	0.04

607	000050	深天马 A	3,700	33,411.00	0.04
608	603899	晨光股份	1,100	33,275.00	0.04
609	002653	海思科	1,000	33,250.00	0.04
610	601098	中南传媒	2,200	33,022.00	0.04
611	601231	环旭电子	2,000	33,000.00	0.04
612	603486	科沃斯	700	32,900.00	0.04
613	603529	爱玛科技	800	32,816.00	0.04
614	002430	杭氧股份	1,500	32,700.00	0.04
615	601611	中国核建	3,600	32,544.00	0.04
616	601991	大唐发电	11,400	32,490.00	0.04
617	000818	航锦科技	1,700	32,470.00	0.04
618	600598	北大荒	2,200	32,450.00	0.04
619	002056	横店东磁	2,500	32,400.00	0.04
620	601155	新城控股	2,700	32,292.00	0.04
621	688297	中无人机	800	32,224.00	0.04
622	688772	珠海冠宇	2,000	32,160.00	0.04
623	600566	济川药业	1,100	31,988.00	0.04
624	300765	新诺威	1,200	31,908.00	0.04
625	688082	盛美上海	317	31,700.00	0.04
626	002240	盛新锂能	2,300	31,694.00	0.04
627	600416	湘电股份	2,800	31,612.00	0.04
628	000987	越秀资本	4,500	31,590.00	0.04
629	601866	中远海发	12,100	31,581.00	0.04
630	000887	中鼎股份	2,400	31,488.00	0.04
631	003031	中瓷电子	600	31,434.00	0.04
632	002670	国盛金控	2,400	31,416.00	0.04
633	688301	奕瑞科技	327	31,251.39	0.04
634	600435	北方导航	3,200	31,232.00	0.04
635	300009	安科生物	3,600	31,104.00	0.04
636	600271	航天信息	3,400	30,974.00	0.04
637	002572	索菲亚	1,800	30,924.00	0.04
638	600582	天地科技	5,000	30,900.00	0.04
639	600258	首旅酒店	2,100	30,807.00	0.04
640	002368	太极股份	1,300	30,784.00	0.04
641	688363	华熙生物	603	30,777.12	0.04
642	603379	三美股份	800	30,704.00	0.04
643	603228	景旺电子	1,100	30,624.00	0.04
644	000958	电投产融	4,900	30,527.00	0.04
645	300595	欧普康视	1,600	30,320.00	0.04
646	601958	金钼股份	3,000	30,180.00	0.03
647	002508	老板电器	1,400	30,002.00	0.03
648	000883	湖北能源	6,000	29,880.00	0.03
649	600755	厦门国贸	4,500	29,880.00	0.03

650	603737	三棵树	700	29,820.00	0.03
651	002831	裕同科技	1,100	29,810.00	0.03
652	600129	太极集团	1,200	29,664.00	0.03
653	600995	南网储能	2,900	29,348.00	0.03
654	600848	上海临港	2,900	29,290.00	0.03
655	000739	普洛药业	1,800	29,268.00	0.03
656	002268	电科网安	1,800	29,250.00	0.03
657	688538	和辉光电-U	12,600	29,232.00	0.03
658	600378	昊华科技	1,000	28,910.00	0.03
659	000155	川能动力	2,700	28,836.00	0.03
660	600517	国网英大	5,200	28,652.00	0.03
661	603298	杭叉集团	1,600	28,624.00	0.03
662	000027	深圳能源	4,400	28,512.00	0.03
663	600685	中船防务	1,200	28,440.00	0.03
664	601118	海南橡胶	5,200	28,132.00	0.03
665	000778	新兴铸管	7,300	28,032.00	0.03
666	603650	彤程新材	800	27,976.00	0.03
667	600739	辽宁成大	2,700	27,945.00	0.03
668	000785	居然智家	7,800	27,846.00	0.03
669	688349	三一重能	900	27,792.00	0.03
670	601928	凤凰传媒	2,400	27,696.00	0.03
671	600906	财达证券	3,900	27,690.00	0.03
672	000709	河钢股份	12,500	27,625.00	0.03
673	600373	中文传媒	2,200	27,610.00	0.03
674	002299	圣农发展	1,900	27,512.00	0.03
675	601636	旗滨集团	4,900	27,489.00	0.03
676	000403	派林生物	1,300	27,469.00	0.03
677	002080	中材科技	2,100	27,468.00	0.03
678	601808	中海油服	1,800	27,450.00	0.03
679	601399	国机重装	8,900	27,412.00	0.03
680	600528	中铁工业	3,400	27,404.00	0.03
681	600606	绿地控股	13,000	27,300.00	0.03
682	600499	科达制造	3,500	27,300.00	0.03
683	603712	七一二	1,400	27,258.00	0.03
684	603728	鸣志电器	500	27,000.00	0.03
685	603858	步长制药	1,700	26,860.00	0.03
686	600977	中国电影	2,300	26,703.00	0.03
687	600968	海油发展	6,200	26,474.00	0.03
688	002557	洽洽食品	900	26,145.00	0.03
689	688516	奥特维	600	25,986.00	0.03
690	603688	石英股份	900	25,857.00	0.03
691	300957	贝泰妮	600	25,614.00	0.03
692	601212	白银有色	9,200	25,576.00	0.03

693	600056	中国医药	2,300	25,530.00	0.03
694	600764	中国海防	900	25,488.00	0.03
695	600959	江苏有线	7,600	25,460.00	0.03
696	600801	华新水泥	2,100	25,410.00	0.03
697	600884	杉杉股份	3,400	25,330.00	0.03
698	600871	石化油服	12,400	25,296.00	0.03
699	002372	伟星新材	2,000	25,260.00	0.03
700	600095	湘财股份	3,500	25,200.00	0.03
701	601598	中国外运	4,700	25,145.00	0.03
702	603882	金域医学	900	24,777.00	0.03
703	000032	深桑达A	1,400	24,696.00	0.03
704	002019	亿帆医药	2,300	24,656.00	0.03
705	002266	浙富控股	7,900	24,648.00	0.03
706	600329	达仁堂	800	24,640.00	0.03
707	000559	万向钱潮	4,000	24,600.00	0.03
708	000800	一汽解放	3,000	24,600.00	0.03
709	688387	信科移动-U	4,100	24,436.00	0.03
710	000825	太钢不锈	7,000	24,360.00	0.03
711	688567	孚能科技	2,100	24,360.00	0.03
712	601106	中国一重	8,300	24,153.00	0.03
713	688561	奇安信-U	900	24,147.00	0.03
714	600062	华润双鹤	1,200	23,760.00	0.03
715	301301	川宁生物	2,000	23,720.00	0.03
716	600663	陆家嘴	2,400	23,616.00	0.03
717	601608	中信重工	5,600	23,520.00	0.03
718	600377	宁沪高速	1,500	22,965.00	0.03
719	600925	苏能股份	4,300	22,790.00	0.03
720	600808	马钢股份	7,300	22,557.00	0.03
721	002487	大金重工	1,100	22,539.00	0.03
722	688778	厦钨新能	492	22,454.88	0.03
723	688563	航材股份	400	22,336.00	0.03
724	603556	海兴电力	600	22,194.00	0.03
725	002408	齐翔腾达	4,400	22,132.00	0.03
726	603456	九洲药业	1,600	21,888.00	0.03
727	603444	吉比特	100	21,884.00	0.03
728	600500	中化国际	5,400	21,708.00	0.03
729	600612	老凤祥	400	21,708.00	0.03
730	600350	山东高速	2,100	21,588.00	0.03
731	601019	山东出版	1,900	21,565.00	0.02
732	600578	京能电力	6,100	21,472.00	0.02
733	002531	天顺风能	2,700	21,357.00	0.02
734	001286	陕西能源	2,300	21,344.00	0.02
735	001227	兰州银行	8,600	21,156.00	0.02

736	601965	中国汽研	1,200	21,144.00	0.02
737	688425	铁建重工	4,800	21,120.00	0.02
738	603233	大参林	1,400	21,084.00	0.02
739	688331	荣昌生物	700	21,077.00	0.02
740	600098	广州发展	3,200	20,544.00	0.02
741	688390	固德威	500	20,450.00	0.02
742	600688	上海石化	6,700	20,234.00	0.02
743	000937	冀中能源	3,200	20,224.00	0.02
744	600126	杭钢股份	4,200	20,076.00	0.02
745	603225	新凤鸣	1,800	20,034.00	0.02
746	603707	健友股份	1,500	19,905.00	0.02
747	601568	北元集团	4,700	19,740.00	0.02
748	603185	弘元绿能	1,200	19,500.00	0.02
749	688520	神州细胞-U	535	19,383.05	0.02
750	000967	盈峰环境	3,900	19,383.00	0.02
751	601139	深圳燃气	2,700	19,062.00	0.02
752	002867	周大生	1,300	18,889.00	0.02
753	688375	国博电子	381	18,806.16	0.02
754	688281	华秦科技	200	18,620.00	0.02
755	600720	中交设计	2,100	18,606.00	0.02
756	603786	科博达	300	18,540.00	0.02
757	601992	金隅集团	10,400	18,512.00	0.02
758	688475	萤石网络	600	18,114.00	0.02
759	603883	老百姓	1,100	18,007.00	0.02
760	600339	中油工程	5,000	17,900.00	0.02
761	002153	石基信息	2,500	17,850.00	0.02
762	000898	鞍钢股份	7,400	17,760.00	0.02
763	002608	江苏国信	2,300	17,641.00	0.02
764	600295	鄂尔多斯	1,800	17,568.00	0.02
765	002563	森马服饰	2,500	17,550.00	0.02
766	300140	节能环境	2,900	17,371.00	0.02
767	000537	中绿电	1,900	17,328.00	0.02
768	600007	中国国贸	700	17,122.00	0.02
769	000401	冀东水泥	3,200	16,736.00	0.02
770	003022	联泓新科	1,200	16,524.00	0.02
771	600032	浙江新能	2,200	16,280.00	0.02
772	688248	南网科技	500	16,045.00	0.02
773	688172	燕东微	800	16,040.00	0.02
774	301498	乖宝宠物	200	15,664.00	0.02
775	601228	广州港	4,600	15,594.00	0.02
776	301267	华厦眼科	800	15,232.00	0.02
777	600928	西安银行	4,200	15,162.00	0.02
778	600299	安迪苏	1,200	15,060.00	0.02

779	002690	美亚光电	1,000	14,820.00	0.02
780	301165	锐捷网络	200	14,440.00	0.02
781	000959	首钢股份	4,700	14,335.00	0.02
782	600361	创新新材	3,700	14,282.00	0.02
783	003035	南网能源	3,400	14,212.00	0.02
784	688819	天能股份	500	13,610.00	0.02
785	600927	永安期货	1,000	13,190.00	0.02
786	603056	德邦股份	900	12,897.00	0.01
787	688276	百克生物	500	12,555.00	0.01
788	601061	中信金属	1,700	12,342.00	0.01
789	002945	华林证券	800	12,264.00	0.01
790	001203	大中矿业	1,400	12,124.00	0.01
791	000539	粤电力 A	2,600	11,778.00	0.01
792	603826	坤彩科技	600	11,550.00	0.01
793	601858	中国科传	500	10,190.00	0.01
794	688153	唯捷创芯	300	10,038.00	0.01
795	603341	龙旗科技	200	9,350.00	0.01
796	601158	重庆水务	1,700	8,330.00	0.01
797	001289	龙源电力	500	7,855.00	0.01
798	600956	新天绿能	900	6,786.00	0.01
799	688295	中复神鹰	300	5,979.00	0.01
800	603868	飞科电器	100	4,152.00	0.00

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

注：无。

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	25,135,121.00	29.13
2	601318	中国平安	14,223,238.00	16.48
3	600036	招商银行	13,459,375.00	15.60
4	300750	宁德时代	12,650,537.04	14.66
5	600900	长江电力	11,175,912.00	12.95
6	601899	紫金矿业	9,223,873.00	10.69
7	601166	兴业银行	7,894,369.00	9.15
8	002594	比亚迪	7,167,876.00	8.31
9	601328	交通银行	6,351,102.00	7.36
10	601398	工商银行	6,103,749.00	7.07
11	000333	美的集团	5,944,586.00	6.89
12	600276	恒瑞医药	5,640,573.00	6.54
13	600030	中信证券	5,446,791.00	6.31

14	002475	立讯精密	5,217,935.00	6.05
15	600887	伊利股份	4,884,571.00	5.66
16	002371	北方华创	4,673,176.00	5.42
17	601088	中国神华	4,593,273.00	5.32
18	000858	五粮液	4,514,960.00	5.23
19	601288	农业银行	4,504,018.00	5.22
20	000651	格力电器	4,421,421.00	5.12
21	300760	迈瑞医疗	4,258,146.00	4.93
22	601816	京沪高铁	4,229,121.00	4.90
23	600309	万华化学	4,179,019.00	4.84
24	300308	中际旭创	4,131,227.00	4.79
25	000725	京东方A	3,863,158.00	4.48
26	600941	中国移动	3,750,700.00	4.35
27	600436	片仔癀	3,633,808.00	4.21
28	601857	中国石油	3,604,743.00	4.18
29	601668	中国建筑	3,533,563.00	4.10
30	600919	江苏银行	3,515,334.00	4.07
31	600809	山西汾酒	3,425,852.00	3.97
32	600690	海尔智家	3,338,730.00	3.87
33	601138	工业富联	3,299,138.00	3.82
34	600000	浦发银行	3,226,723.00	3.74
35	601985	中国核电	3,185,671.00	3.69
36	002714	牧原股份	3,182,333.00	3.69
37	601225	陕西煤业	3,173,414.00	3.68
38	601601	中国太保	3,118,217.00	3.61
39	600406	国电南瑞	3,083,979.00	3.57
40	002415	海康威视	3,022,795.00	3.50
41	601988	中国银行	3,002,364.00	3.48
42	601728	中国电信	2,921,117.00	3.39
43	603259	药明康德	2,909,424.00	3.37
44	600028	中国石化	2,906,910.00	3.37
45	600150	中国船舶	2,819,604.00	3.27
46	688981	中芯国际	2,817,425.08	3.27
47	600050	中国联通	2,814,126.00	3.26
48	601766	中国中车	2,735,317.00	3.17
49	603501	韦尔股份	2,703,401.00	3.13
50	688041	海光信息	2,685,347.86	3.11
51	601169	北京银行	2,656,320.00	3.08
52	300498	温氏股份	2,649,056.00	3.07
53	600031	三一重工	2,613,667.00	3.03
54	300059	东方财富	2,603,401.00	3.02
55	600660	福耀玻璃	2,579,131.00	2.99
56	600016	民生银行	2,535,133.00	2.94

57	601919	中远海控	2,489,381.00	2.89
58	000063	中兴通讯	2,454,237.00	2.84
59	600837	海通证券	2,441,032.00	2.83
60	000568	泸州老窖	2,368,049.00	2.74
61	000792	盐湖股份	2,360,413.00	2.74
62	600938	中国海油	2,319,124.00	2.69
63	000001	平安银行	2,317,820.00	2.69
64	601229	上海银行	2,257,645.00	2.62
65	300274	阳光电源	2,254,954.20	2.61
66	603019	中科曙光	2,223,367.00	2.58
67	601888	中国中免	2,149,770.00	2.49
68	600089	特变电工	2,134,471.48	2.47
69	688008	澜起科技	2,112,496.79	2.45
70	000338	潍柴动力	2,096,165.00	2.43
71	600048	保利发展	2,048,661.00	2.37
72	002352	顺丰控股	2,034,674.00	2.36
73	601390	中国中铁	2,014,371.00	2.33
74	000100	TCL 科技	2,007,016.00	2.33
75	300502	新易盛	1,956,096.00	2.27
76	600019	宝钢股份	1,942,164.00	2.25
77	300124	汇川技术	1,930,310.00	2.24
78	600104	上汽集团	1,929,801.00	2.24
79	601600	中国铝业	1,901,019.00	2.20
80	002142	宁波银行	1,894,956.00	2.20
81	601211	国泰君安	1,876,206.00	2.17
82	002230	科大讯飞	1,865,115.00	2.16
83	601818	光大银行	1,846,762.00	2.14
84	601006	大秦铁路	1,824,834.00	2.11
85	600999	招商证券	1,793,203.00	2.08
86	000625	长安汽车	1,787,818.00	2.07
87	601658	邮储银行	1,761,073.00	2.04
88	603986	兆易创新	1,754,276.00	2.03
89	600585	海螺水泥	1,726,319.00	2.00

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

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	24,563,856.62	28.47
2	601318	中国平安	13,922,746.41	16.14
3	600036	招商银行	12,154,132.00	14.09
4	600900	长江电力	10,199,411.00	11.82
5	601899	紫金矿业	8,131,224.01	9.42

6	601166	兴业银行	7,151,677.00	8.29
7	601398	工商银行	5,937,174.00	6.88
8	600030	中信证券	5,858,137.00	6.79
9	601328	交通银行	5,799,491.80	6.72
10	600276	恒瑞医药	5,586,970.40	6.47
11	600887	伊利股份	4,563,043.05	5.29
12	601288	农业银行	4,215,387.00	4.89
13	601088	中国神华	3,973,903.00	4.61
14	600309	万华化学	3,950,207.00	4.58
15	601816	京沪高铁	3,880,479.00	4.50
16	600436	片仔癀	3,525,832.00	4.09
17	600941	中国移动	3,444,151.00	3.99
18	600919	江苏银行	3,350,136.00	3.88
19	601668	中国建筑	3,294,723.00	3.82
20	600809	山西汾酒	3,104,533.00	3.60
21	600690	海尔智家	3,075,438.00	3.56
22	601857	中国石油	3,047,775.00	3.53
23	600000	浦发银行	3,030,407.57	3.51
24	601985	中国核电	3,015,715.00	3.50
25	601601	中国太保	2,930,897.00	3.40
26	688981	中芯国际	2,883,475.42	3.34
27	601988	中国银行	2,842,274.00	3.29
28	603259	药明康德	2,814,811.00	3.26
29	600406	国电南瑞	2,783,357.00	3.23
30	601225	陕西煤业	2,783,332.00	3.23
31	601138	工业富联	2,783,022.00	3.23
32	601012	隆基绿能	2,763,464.00	3.20
33	688041	海光信息	2,743,217.29	3.18
34	601728	中国电信	2,719,901.00	3.15
35	600028	中国石化	2,709,665.00	3.14
36	600050	中国联通	2,665,870.98	3.09
37	600031	三一重工	2,663,207.00	3.09
38	601766	中国中车	2,626,482.00	3.04
39	600150	中国船舶	2,566,743.00	2.97
40	603501	韦尔股份	2,545,517.20	2.95
41	600660	福耀玻璃	2,425,500.44	2.81
42	600837	海通证券	2,403,066.00	2.78
43	601919	中远海控	2,399,174.00	2.78
44	601169	北京银行	2,332,788.12	2.70
45	600016	民生银行	2,215,260.45	2.57
46	603019	中科曙光	2,209,563.00	2.56
47	601888	中国中免	2,177,237.00	2.52
48	601229	上海银行	2,075,618.00	2.41

49	688008	澜起科技	1,999,621.41	2.32
50	601688	华泰证券	1,995,925.00	2.31
51	600938	中国海油	1,969,409.00	2.28
52	600048	保利发展	1,926,003.00	2.23
53	600089	特变电工	1,916,621.70	2.22
54	600104	上汽集团	1,843,860.00	2.14
55	600905	三峡能源	1,833,384.00	2.12
56	601211	国泰君安	1,826,202.00	2.12
57	603288	海天味业	1,808,477.47	2.10
58	601390	中国中铁	1,805,050.00	2.09
59	601818	光大银行	1,761,837.00	2.04
60	600999	招商证券	1,753,329.00	2.03
61	600019	宝钢股份	1,736,963.00	2.01

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

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	668,827,950.89
卖出股票收入（成交）总额	445,132,288.91

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：无。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：无。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：无。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：无。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：无。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

资产净值的目的。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

8.12 投资组合报告附注

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

兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局福建监管局的处罚。

招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局的处罚。

中信证券股份有限公司在报告编制日前一年内受到中国证券监督管理委员会的处罚。

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

注：无。

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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（%）
1,325	56,405.13	29,212,866.00	39.09	45,523,936.00	60.91

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	华泰证券股份有限公司	12,677,661.00	16.96
2	海通证券股份有限公司	8,273,470.00	11.07
3	广发证券股份有限公司	5,043,908.00	6.75
4	郑凯鹏	1,929,009.00	2.58
5	LI ZHEN	1,277,492.00	1.71
6	格尔木健桥医院有限公司	1,262,700.00	1.69
7	李湘莲	1,069,795.00	1.43
8	干丽华	1,000,048.00	1.34
9	长江养老保险－建设银行－长江养老金色明珠 1 号集合资产管理产品	886,000.00	1.19
10	鲁云	758,301.00	1.01

注：持有人为场内持有人。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：截至本报告期末，本基金管理人所有从业人员未持有本基金份额。

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

注：截至本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人及本基金的基金经理未持有本基金份额。

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

注：无。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2024 年 6 月 27 日）基金份额总额	590,736,802.00

基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	124,000,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	640,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	74,736,802.00

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人的重大人事变动：

报告期内，公司原副总经理王宗合先生因个人身体原因辞职，经公司第六届董事会第二百零四次会议审议通过，自 2024 年 2 月 6 日起，王宗合先生不再担任公司副总经理。

报告期内，公司原副总经理邢彪先生因个人原因辞职，经公司第六届董事会第二百一十七次董事会审议通过，自 2024 年 4 月 11 日起，邢彪先生不再担任公司副总经理。

报告期内，公司原董事长、董事何如先生因退休原因不再担任公司第六届董事会董事长、董事，经公司 2024 年第三次临时股东会会议、第六届董事会第二百一十八次董事会审议通过，聘任张纳沙女士担任公司第六届董事会董事长、董事，任职日期自 2024 年 4 月 12 日起。

报告期内，公司副总经理刘嵚先生不再兼任北京分公司总经理，经公司 2024 年第十五次总裁办公会审议通过，聘任田智勇先生担任北京分公司总经理，任职日期自 2024 年 5 月 7 日起。

本公司已将上述变更事项报中国证券监督管理委员会深圳监管局备案。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

2024 年 3 月 26 日，本基金托管人发布公告，专门基金托管部门联席负责人冯伟到龄退休，变更后的部门负责人为卢小群。

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

本基金管理人聘请毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金审计的会计师事务所。本年度应支付给毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)审计费用 25,000.00 元。该审计机构为本基金提供审计服务的期间为本基金基金合同生效日(2024 年 06 月 27 日)起到本报告期末，不满 1 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

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

注：无。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	
华泰证券	6	1,113,960,239.80	100.00	218,259.16	100.00	本报告期新增

注：交易单元选择的标准和程序：

1.根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》（以下简称《规定》），基金管理人制定了相应的管理制度规范交易单元选择的标准和程序。基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券公司，选择标准包括：财务状况良好，经营行为规范；有完备的合规管理流程和制度，风险控制能力较强；研究、交易等服务能力较强，交易设施能够为投资组合提供有效的交易执行；中国证监会或有权机关规定的其他条件等。

2.选择程序如下：

（1）基金管理人根据上述标准评估并确定选用的证券公司；

（2）基金管理人与提供证券交易服务的证券公司签订协议，并办理开立交易账户等事宜；

（3）基金管理人定期对证券公司进行评价，依据评价结果选择交易单元。

3.根据《规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率；其他类型基金股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍。

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(%)
华泰证券	-	-	-	-	-	-

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	鹏华中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金合同	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 06 月 03 日
2	鹏华中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 06 月 03 日
3	鹏华中证 800 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 06 月 03 日
4	鹏华中证 800 交易型开放式指数证券投资基金托管协议	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 06 月 03 日
5	鹏华中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 06 月 03 日
6	鹏华基金管理有限公司关于调整鹏华中证 800 交易型开放式指数证券投资基金网下股票认购清单的提示性公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 06 月 17 日

7	鹏华中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 06 月 28 日
8	鹏华中证 800 交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 07 月 09 日
9	鹏华中证 800 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 07 月 09 日
10	关于鹏华中证 800 交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 07 月 12 日
11	关于鹏华中证 800 交易型开放式指数证券投资基金上市交易提示性公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 07 月 12 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告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 07 月 13 日
13	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金增加渤海证券股份有限公司为申购赎回代理券商的公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 07 月 17 日
14	关于鹏华中证 800 交易型开放式指数证券投资基金增加部分证券公司为申购赎回代理券商的公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 07 月 17 日
15	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与渤海证券股份有限公司认/申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 07 月 29 日
16	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华鑫证券有限责任公司为申购赎回代理券商的公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 10 月 17 日
17	鹏华中证 800 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年第 3 季度报告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 10 月 24 日
18	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金增加联储证券股份有限公司为申购赎回代理券商的公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 11 月 19 日
19	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金增加西部证券股份有限公司为申购赎回代理券商的公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 12 月 03 日
20	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	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 12 月 18 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	20241011~20241201	31,182.00	39,142,055.00	26,495,576.00	12,677,661.00	16.96
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份额；

2、赎回份额包含基金赎回份额、基金转换出份额、强制调减份额、场内卖出份额。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

（一）《鹏华中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

（二）《鹏华中证 800 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；

（三）《鹏华中证 800 交易型开放式指数证券投资基金 2024 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

2025 年 3 月 28 日