

鹏华策略回报灵活配置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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 3 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

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

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

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	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	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	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	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	16
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	16
§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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	17
§ 6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§ 7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	20
7.3 净资产变动表	21
7.4 报表附注	23

§ 8 投资组合报告	61
8.1 期末基金资产组合情况	61
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	62
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	63
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	88
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	90
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	90
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	90
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	90
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	90
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	90
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	90
8.12 投资组合报告附注	91
§ 9 基金份额持有人信息	91
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	91
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	92
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	92
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	92
§ 10 开放式基金份额变动	92
§ 11 重大事件揭示	92
11.1 基金份额持有人大会决议	92
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	92
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	92
11.4 基金投资策略的改变	93
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	93
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	93
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	93
11.8 其他重大事件	95
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	98
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	98
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	98
§ 13 备查文件目录	98
13.1 备查文件目录	98
13.2 存放地点	98
13.3 查阅方式	99

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华策略回报灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	鹏华策略回报混合
基金主代码	004986
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 9 月 6 日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	577,492,196.04 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为混合型基金，在控制风险的前提下灵活地采用多种投资策略，通过精选个股，力争长期稳健超额回报的目标。
投资策略	<p>1、资产配置策略 本基金将通过跟踪考量通常的宏观经济变量（包括 GDP 增长率、CPI 走势、M2 的绝对水平和增长率、利率水平与走势等）以及各项国家政策（包括财政、货币、税收、汇率政策等）来判断经济周期目前的位置以及未来将发展的方向，在此基础上对各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估，制定股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。</p> <p>2、股票投资策略 本基金灵活、务实地采用多种投资策略，包括价值投资、成长投资、主题轮动、趋势投资等，将各种理念和方法兼容并蓄，作为实现收益的工具和手段。本基金将重点关注在中国经济持续转型的过程中，因经济结构优化、产业结构升级、技术创新等制度变革等产生的投资机会，并投资于其中的优质上市公司的股票。</p> <p>（1）价值投资策略 本基金通过寻找价值被低估的股票进行投资，以谋求估值反转带来的收益。通过运用多项指标如 PE、PB、EV/EBITDA 等进行相对估值，通过与国内同行业其它公司估值水平以及国外同行业公司相对估值水平等进行估值比较，找出价值被相对低估的公司。</p> <p>（2）成长投资策略 在充分的行业研究和审慎的公司研究基础上，本基金将关注成长型上市公司，尤其是中小市值股票中具有潜在高成长性和稳健盈利模式的上市公司。在具体操作上，以政策分析、行业分析和公司特质分析等基本面定性分析为主，评估风险，精选投资标的。</p> <p>（3）主题轮动策略 主题轮动策略是基于自上而下的投资主题分析框架，综合运用定量和定性的分析方法，针对经济发展趋势及成长动因进行前瞻性的分析，挖掘市场的长期性和阶段性主题投资机会，并从中发现与投资主题相符的行业和具有核心竞争力的上市公司，力争获取市场超额收益。</p> <p>（4）趋势投资策略 公司的经营业绩成长和公司投资价值的提升具有连续性和延展性，这决定了公司股票价格的长期趋势。同时，在股票市场上，由于受到当期各种外部因素的影响，股票价格还具有中、短期趋势。中期趋势表现为股价相对长期趋势的估值偏离和估值修复过程，而短期</p>

	<p>趋势则表现为外部因素影响短期股价偏离和恢复的过程。由于市场反应不足或反应过度，股票价格的涨跌往往表现出一定的惯性。因此，可通过基本面分析、行为金融分析和事件分析，利用股价中、短期趋势的动态特征，进行股票的买入和卖出操作，从而提高单只股票的投资收益。</p> <p>(5) 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、信用策略等积极投资策略，自上而下地管理组合的久期，灵活地调整组合的券种搭配，同时精选个券，以增强组合的持有期收益。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</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、中小企业私募债投资策略 中小企业私募债券是在中国境内以非公开方式发行和转让，约定在一定期限还本付息的公司债券。由于其非公开性及条款可协商性，普遍具有较高收益。本基金将深入研究发行人资信及公司运营情况，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，尽力规避风险，并获取超额收益。</p> <p>6、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>7、融资投资策略 本基金将在充分考虑风险和收益特征的基础上，审慎参与融资交易。本基金将基于对市场行情和组合风险收益的分析，确定投资时机、标的证券以及投资比例。若相关融资业务法律法规发生变化，本基金将从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。</p>
业绩比较基准	本基金业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×60%+中证综合债指数收益率×40%
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、

	债券基金，低于股票型基金，属于证券投资基金中中高风险、中高预期收益的品种。
--	---------------------------------------

注：无。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		鹏华基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	高永杰	郭明
	联系电话	0755-81395402	(010)66105799
	电子邮箱	xxpl@phfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4006788999	95588
传真		0755-82021126	(010)66105798
注册地址		深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		518048	100140
法定代表人		何如	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.phfund.com.cn
基金年度报告备置地点	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层鹏华基金管理有限公司

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
注册登记机构	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	-25,803,426.10	-28,138,376.05	240,784,712.14
本期利润	-39,870,765.89	-83,890,376.43	-43,994,089.56
加权平均基金份额	-0.1811	-0.4234	-0.1813

本期利润			
本期加权平均净值利润率	-11.98%	-24.85%	-8.71%
本期基金份额净值增长率	-8.79%	-20.69%	-8.91%
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	100,705,669.05	109,805,973.15	206,775,265.18
期末可供分配基金份额利润	0.1744	0.5766	0.9879
期末基金资产净值	678,197,865.09	300,246,847.33	416,075,128.75
期末基金份额净值	1.1744	1.5766	1.9879
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	75.11%	92.00%	142.09%

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

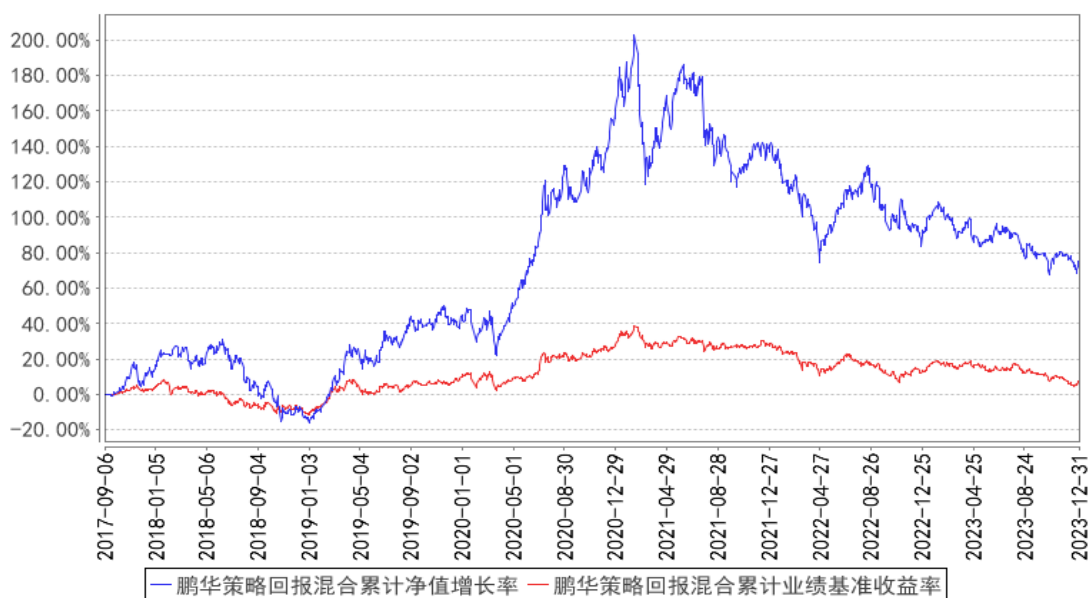
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-2.27%	0.85%	-3.71%	0.47%	1.44%	0.38%

过去六个月	-8.89%	0.90%	-5.71%	0.51%	-3.18%	0.39%
过去一年	-8.79%	0.88%	-5.02%	0.50%	-3.77%	0.38%
过去三年	-34.11%	1.41%	-17.09%	0.67%	-17.02%	0.74%
过去五年	100.92%	1.52%	20.04%	0.72%	80.88%	0.80%
自基金合同生效起至今	75.11%	1.54%	7.37%	0.72%	67.74%	0.82%

注：业绩比较基准=本基金业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×60%+中证综合债指数收益率×40%

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

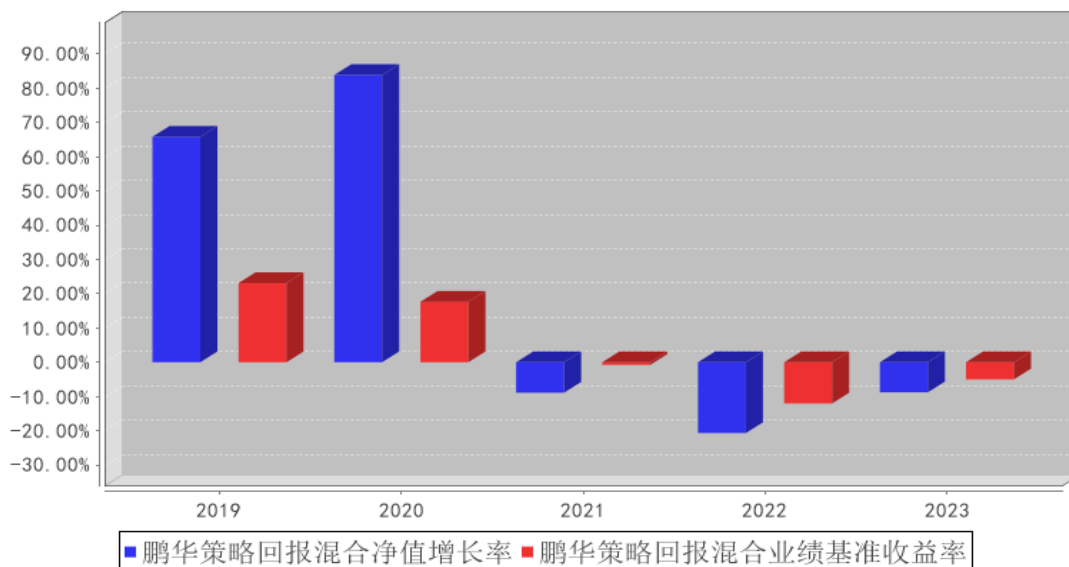
鹏华策略回报混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2017 年 09 月 06 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

鹏华策略回报混合基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按照实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 其他指标

注：无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

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	2.5730	129,902,677.92	15,219,558.60	145,122,236.52	-
2022 年	-	-	-	-	-
2021 年	-	-	-	-	-
合计	2.5730	129,902,677.92	15,219,558.60	145,122,236.52	-

§ 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的经验。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张鹏	基金经理	2021-08-13	-	10 年	张鹏先生，国籍中国，金融学硕士，10 年证券从业经验。曾任鹏华基金管理有限公司研究部助理研究员、研究员，中欧基金管理有限公司研究部研究员，自 2017 年任鹏华基金管理有限公司研究部高级研究员、基金经理助理/研究员，现担任权益投资二部基金经理。2021 年 08 月至今担任鹏华策略回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2021 年 08 月至今担任鹏华价值精选股票型证券投资基金基金经理，2023 年 01 月至今担任鹏华价值共赢两年持有期混合型证券投资基金基金经理，2023 年 03 月至今担任鹏华产业精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2023 年 04 月至今担任鹏华优质治理混合型证券投资基金（LOF）基金经理，张鹏先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理未发生变动。

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

4.1.4 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

回顾 2023 年整年，A 股整体下跌，结构分化剧烈，各板块轮动快。在 1 月短暂的新能源板块反弹之后，整个上半年成长风格中的泛 AI 线索软硬件板块、数据要素线索和部分半导体公司涨幅明显，下半年风格切换，在 A 股下跌的大背景下，汽车的需求率先走出强于其他消费品的趋势，板块差额明显，医药经过长达接近半年的调整，电子板块也在充分调整后迎来了创新和需求修复的双重预期修复，前者以医药反腐阶段性告一段落为起点，后者以白马 3 季度业绩超预期为起点，阶段性超额明显。除了上述阶段性机会之外，还有几个特征，一是房地产链、消费复苏链、新能源链等板块的弱势贯穿全年，二是各类主题层出不穷各领风骚然后迅速调整，如机器人、华为链、卫星链等等，各以主题方式展开，三是具体到个股上，机构筹码集中的白马标的明显弱于筹码较轻的个股，具有一定的筹码驱动的因素；

基金经理个人对去年的市场的理解归纳为——破与立。抱团在破，历史上尤其是近些年主流认可的核心资产的泡沫在破，资金抱团在破，押注赛道的投资方式在破，主流的审美指向在破，甚至是原有的业绩超预期驱动方式、基于对认知惯性带来的趋势投资方式、基于 DCF 估值模型终局价值投资方式等都在破，参与股票投资的资金的固有结构也在破。随之而来的是立，新的投资主体在立，如没有情绪纪律俨然的量化资金等，新的审美指向在立，喝酒还是看 AI 做的短剧？年

轻人和年轻资金追随的方向在立，而不是盲目的去追随历史的话语权，过去的核心资产不一定是未来的优质资产，年轻人自己的定价权在立，整个时代的红利规则都在重建。而破与立的过程中，必然涉及到对原有资产的留恋与反复，以及对新产业趋势的怀疑和分歧，原有的资产必然出现下跌与反弹的波动，而新的产业必然出现试探性的投资与恐惧驱动的回撤，以主题形式展开，其定价期间的大起大落就是愿意尝试前沿产业投资的资金的必然属性。回顾历史莫不如是，可以理解，值得关注，乐见其成。同样在破与立的过程中，对新产业趋势暂时保持观察中立态度，换仓的方向指向就是高确定性低估值的红利板块，因此红利板块与 AI 等新产业趋势双线索，成为去年的核心观察，但是无论如何，底层逻辑都是破与立，只是对立的新方向置信度的不同，带来了双主线。

每个时代有每个时代的局限和主线，基于这个背景和解释，未来的时代级别的主线一定是在变化中诞生，过程一定曲折，主角有待观察，但是必然是新产业，必然是新人，必然符合新一代人的审美，他们接受什么，他们怎么生活和追求，无关对错，就是未来时代的主线。因此基金经理的思路在 2023 年已经逐渐收敛到对变化的观察、研究和学习上，甚至预期会是至少未来两到三年的主要策略思路。

因此，基金经理贯穿全年的操作可以概括为，在自己擅长的泛制造业范畴内，寻找符合新产业趋势的投资标的，边际上出清历史上曾经辉煌如今下跌较多有待反复的投资机会。具体到板块上，我们清仓军工，大幅减仓新能源板块保留部分新技术公司，显著加仓了 TMT 板块和电子板块中和泛 AI 线索有关的公司。在核心板块汽车板块中，用未来有新技术新客户新产业趋势的相关公司平替了部分高增过去业绩平稳的公司。

虽然破与立的过程中必然有混乱和挫折，但是基金经理认为这是个好迹象，历史上从五朵金花切到消费到医药再切到移动互联网再切到新能源等大级别主线的过程中，都有混乱的过程，所谓不破不立，混乱的过程正孕育着新主线的大机会，背后是全社会审美方向的逐渐变化，慢，但是不可逆。

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-8.79%，同期业绩比较基准增长率为-5.02%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

看 2024 年，我们看好几个方向，一是经济企稳需求复苏从居民和市场认知上逐渐落地，预期逐渐修复，工业金属大宗商品由于供给侧的刚性，是比较好的选择；二是制造业中跨越红海蓝海之争论，产品全方位有变化的行业，即使供给过剩但是顺应变化的优质供给依然稀缺的行业，比如汽车板块中的自主企业，比如半导体领域中在创新和国产化上具有竞争优势的公司；三是泛 AI 线索中，能够真的构建自己的产品，能落地并带来实际需求的软硬件公司；四是未来的变化未必

一定是 AI，一些新的产业苗头也可能是未来变化中走出来的黑马主角。

但是实话实说，虽然基金经理对新产业趋势抱有极大的兴趣，对新投资机会保持高敏感，但是遗憾的是并不认为新的投资主线会一蹴而就，或者对于立刻产生巨大的投资机会相对保守。因此 24 年依然会相对均衡的结构，会注意控制回撤，需要经过深度研究才会重仓，在认为过度乐观的时点适当兑现。

再多说两句自己的底层体系，在过去年季报中多次提及的不忘初心，这一处处屡见不鲜的概念，于我有独特的心路历程，从出身草根追求个人价值，到真正追求社会价值，承担起无数个家庭的财富保值增值的责任，是逐步形成的理念，因此比较坚定。我时刻提醒自己，基民背后的家庭和我普通但勤劳有爱的父母亲都是我最坚实的基础，年轻人未来就是我的未来，我会时刻保持这份初心，剥离无效的内耗，每一步都有进步。2024 年，加油！

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

1、继续完善内部控制体系

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

2、规范基金销售业务，保证基金销售业务的合法合规性

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

3、开展以风险为导向的内部稽核

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

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1、截止本报告期末，本基金期末可供分配利润为 100,705,669.05 元，期末基金份额净值 1.1744 元。

2、本基金于 2023 年 12 月 26 日进行利润分配，分配金额为 145,122,236.52 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

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

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

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对鹏华基金管理有限公司编制和披露的本基金 2023 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2024)第 25632 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	鹏华策略回报灵活配置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>我们审计了鹏华策略回报灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“鹏华策略回报混合基金”)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,公允反映了鹏华策略回报混合基金 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,我们独立于鹏华策略回报混合基金,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	鹏华策略回报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

	<p>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策略回报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策略回报混合基金、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策略回报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，就可能导致对鹏华策略回报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策略回报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：鹏华策略回报灵活配置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	153,651,903.04	26,482,208.83
结算备付金		1,888,459.27	1,019,076.68
存出保证金		105,114.43	87,220.82
交易性金融资产	7.4.7.2	529,240,949.98	257,246,448.82
其中：股票投资		529,050,183.27	257,020,036.52
基金投资		-	-
债券投资		190,766.71	226,412.30
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	-	12,021,405.48
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		-	4,886,458.51
应收股利		-	-
应收申购款		30,419.36	29,065.86
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		684,916,846.08	301,771,885.00
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		4,860,465.06	243,597.95
应付赎回款		45,003.40	103,782.44
应付管理人报酬		804,366.74	383,526.59
应付托管费		134,061.14	63,921.13
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1.19	0.69
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	875,083.46	730,208.87
负债合计		6,718,980.99	1,525,037.67
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	577,492,196.04	190,440,874.18
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	100,705,669.05	109,805,973.15
净资产合计		678,197,865.09	300,246,847.33
负债和净资产总计		684,916,846.08	301,771,885.00

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.1744 元，基金份额总额 577,492,196.04 份。

7.2 利润表

会计主体：鹏华策略回报灵活配置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		-34,546,081.25	-77,804,309.47
1. 利息收入		349,426.44	236,283.16
其中：存款利息收入	7.4.7.13	235,853.43	167,225.39
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		113,573.01	69,057.77
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-20,841,144.57	-22,340,891.97
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-23,473,976.16	-24,752,303.99
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	395.51	50.59

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	2,632,436.08	2,411,361.43
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	-14,067,339.79	-55,752,000.38
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	12,976.67	52,299.72
减：二、营业总支出		5,324,684.64	6,086,066.96
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	4,417,534.10	5,070,076.70
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	736,255.84	845,012.75
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		1.28	0.09
8. 其他费用	7.4.7.23	170,893.42	170,977.42
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		-39,870,765.89	-83,890,376.43
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		-39,870,765.89	-83,890,376.43
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		-39,870,765.89	-83,890,376.43

7.3 净资产变动表

会计主体：鹏华策略回报灵活配置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	190,440,874.18	-	109,805,973.15	300,246,847.33
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	190,440,874.18	-	109,805,973.15	300,246,847.33
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	387,051,321.86	-	-9,100,304.10	377,951,017.76
(一)、综合收益总额	-	-	-39,870,765.89	-39,870,765.89
(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)	387,051,321.86	-	175,892,698.31	562,944,020.17
其中：1. 基金申购款	419,092,952.63	-	193,483,000.81	612,575,953.44
2. 基金赎回款	-32,041,630.77	-	-17,590,302.50	-49,631,933.27
(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)	-	-	-145,122,236.52	-145,122,236.52
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	577,492,196.04	-	100,705,669.05	678,197,865.09
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	209,299,863.57	-	206,775,265.18	416,075,128.75
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	209,299,863.57	-	206,775,265.18	416,075,128.75
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-18,858,989.39	-	-96,969,292.03	-115,828,281.42
(一)、综合收益总额	-	-	-83,890,376.43	-83,890,376.43
(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)	-18,858,989.39	-	-13,078,915.60	-31,937,904.99
其中：1. 基金申购款	17,024,001.64	-	12,078,110.77	29,102,112.41
2. 基金赎回款	-35,882,991.03	-	-25,157,026.37	-61,040,017.40
(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	190,440,874.18	-	109,805,973.15	300,246,847.33

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

邢彪

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

鹏华策略回报灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于准予鹏华策略回报灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2015]2737号文)和机构部函[2017]1679号《关于鹏华策略回报灵活配置混合型证券

投资基金延期募集备案的回函》批准，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》及其配套规则和《鹏华策略回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》发售，基金合同于 2017 年 9 月 6 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集规模为 491,760,953.62 份基金份额。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司（以下简称：工商银行）。本基金于 2017 年 8 月 7 日至 2017 年 9 月 1 日募集。募集期间净认购资金人民币 491,532,684.29 元，认购资金在募集期间产生的利息人民币 228,269.33 元，募集的有效认购份额及利息结转的基金份额合计 491,760,953.62 份。上述募集资金已由普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)验证，并出具了普华永道中天验字（2017）第 800 号验资报告。

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》、《鹏华策略回报灵活配置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商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

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

以摊余成本计量：

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

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

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金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 and 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。

本基金在上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	153,651,903.04	26,482,208.83
等于：本金	153,637,349.02	26,478,947.78
加：应计利息	14,554.02	3,261.05
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	153,651,903.04	26,482,208.83

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	549,144,512.91	-	529,050,183.27	-20,094,329.64	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	181,000.00	80.81	190,766.71	9,685.90
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	181,000.00	80.81	190,766.71	9,685.90
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	549,325,512.91	80.81	529,240,949.98	-20,084,643.74	
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	263,082,701.37	-	257,020,036.52	-6,062,664.85	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	181,000.00	51.40	226,412.30	45,360.90
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	181,000.00	51.40	226,412.30	45,360.90
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	

其他	-	-	-	-
合计	263,263,701.37	51.40	257,246,448.82	-6,017,303.95

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

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-
项目	上年度末 2022年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	12,021,405.48	-
银行间市场	-	-
合计	12,021,405.48	-

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	21.98	166.72
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	705,061.48	560,042.15
其中：交易所市场	705,061.48	560,042.15
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	170,000.00	170,000.00
合计	875,083.46	730,208.87

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	190,440,874.18	190,440,874.18
本期申购	419,092,952.63	419,092,952.63
本期赎回（以“-”号填列）	-32,041,630.77	-32,041,630.77
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	577,492,196.04	577,492,196.04

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	310,897,649.44	-201,091,676.29	109,805,973.15
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	310,897,649.44	-201,091,676.29	109,805,973.15
本期利润	-25,803,426.10	-14,067,339.79	-39,870,765.89
本期基金份额交易产生的变动数	580,848,124.67	-404,955,426.36	175,892,698.31
其中：基金申购款	631,778,616.39	-438,295,615.58	193,483,000.81
基金赎回款	-50,930,491.72	33,340,189.22	-17,590,302.50
本期已分配利润	-145,122,236.52	-	-145,122,236.52
本期末	720,820,111.49	-620,114,442.44	100,705,669.05

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	216,309.14	149,068.36
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	18,022.16	16,151.26
其他	1,522.13	2,005.77
合计	235,853.43	167,225.39

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
----	-----------------------------	----------------------------------

	日	31日
股票投资收益——买卖 股票差价收入	-23,473,976.16	-24,752,303.99
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	-23,473,976.16	-24,752,303.99

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	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
卖出股票成交总额	1,134,399,428.77	1,404,724,732.85
减：卖出股票成本总额	1,154,433,844.36	1,425,373,355.16
减：交易费用	3,439,560.57	4,103,681.68
买卖股票差价收入	-23,473,976.16	-24,752,303.99

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

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
债券投资收益——利息收入	395.51	50.59
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-	-
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申	-	-

购差价收入		
合计	395.51	50.59

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 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月 31日
股票投资产生的股利收益	2,632,436.08	2,411,361.43
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	2,632,436.08	2,411,361.43

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
1. 交易性金融资产	-14,067,339.79	-55,752,000.38
股票投资	-14,031,664.79	-55,797,361.28
债券投资	-35,675.00	45,360.90
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	-14,067,339.79	-55,752,000.38

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	12,825.93	51,743.54
基金转换费收入	150.74	556.18
合计	12,976.67	52,299.72

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	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
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	891.00	975.00
存托服务费	2.42	2.42
合计	170,893.42	170,977.42

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
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	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	656,588,520.93	25.61	237,215,202.55	8.60

7.4.10.1.2 债券交易

注：无。

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)
国信证券	581,099,000.00	54.00	19,203,000.00	4.90

7.4.10.1.4 权证交易

注：无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
国信证券	605,826.96	26.54	279,553.74	39.65
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	218,433.52	8.97	38,561.10	6.89

注：(1) 佣金的计算公式

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

(佣金比率按照与一般证券公司签订的协议条款订立。)

(2) 本基金与关联方已按同业统一的基金佣金计算方式和约定的佣金比例签订了《证券交易

席位租用协议》。根据协议规定，上述单位定期或不定期地为鹏华基金公司提供研究服务以及其他研究支持。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	4,417,534.10	5,070,076.70
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,190,950.00	1,561,962.59
应支付基金管理人的净管理费	3,226,584.10	3,508,114.11

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 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	736,255.84	845,012.75

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值0.20%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自有资金投资本基金的情况

注：无。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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
中国工商银行	153,651,903.04	216,309.14	26,482,208.83	149,068.36

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

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	959	20,877.43
国信证券	301488	豪恩汽电	网下申购	1,458	57,999.24
国信证券	688562	航天软件	网下申购	4,584	58,125.12
国信证券	688307	中润光学	网下申购	2,455	58,625.40
上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
国信证券	301338	凯格精机	网下申购	2,568	118,975.44
国信证券	688231	隆达股份	网下申购	3,047	119,076.76
国信证券	688401	路维光电	网下申购	4,947	124,070.76
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 26 日	-	2023 年 12 月 26 日	2.5730	129,902,677.92	15,219,558.60	145,122,236.52	-
合计	-	-	-	2.5730	129,902,677.92	15,219,558.60	145,122,236.52	-

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	33	1,769.79	2,486.88	-
001326	联域股份	2023 年 11 月 1 日	6 个月	新股流通受限	41.18	48.64	59	2,429.62	2,869.76	-
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	109	3,453.12	3,408.43	-

300904	威力传动	2023年8月2日	6个月	新股流通受限	35.41	61.53	223	7,896.43	13,721.19	-
301172	君逸数码	2023年7月19日	6个月	新股流通受限	31.33	38.16	273	8,553.09	10,417.68	-
301202	朗威股份	2023年6月28日	6个月	新股流通受限	25.82	31.80	187	4,828.34	5,946.60	-
301251	威尔高	2023年8月30日	6个月	新股流通受限	28.88	34.59	161	4,649.68	5,568.99	-
301261	恒工精密	2023年6月29日	6个月	新股流通受限	36.90	50.85	133	4,907.70	6,763.05	-
301272	英华特	2023年7月6日	6个月	新股流通受限	51.39	53.38	118	6,064.02	6,298.84	-
301291	明阳电气	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	38.13	28.36	255	9,723.15	7,231.80	-
301292	海科新源	2023年6月29日	6个月	新股流通受限	19.99	19.35	385	7,696.15	7,449.75	-
301329	信音电子	2023年7月5日	6个月	新股流通受限	21.00	22.23	246	5,166.00	5,468.58	-
301348	蓝箭电子	2023年8月1日	6个月	新股流通受限	18.08	44.57	417	7,539.36	18,585.69	-
301370	国科恒泰	2023年7月3日	6个月	新股流通受限	13.39	16.01	634	8,489.26	10,150.34	-

301371	敷尔佳	2023年7月24日	6个月	新股流通受限	55.68	37.58	113	6,291.84	4,246.54	-
301381	赛维时代	2023年7月5日	6个月	新股流通受限	20.45	29.69	347	7,096.15	10,302.43	-
301393	昊帆生物	2023年7月5日	6个月	新股流通受限	67.68	59.37	97	6,564.96	5,758.89	-
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	107	5,551.16	5,371.40	-
301421	波长光电	2023年8月16日	6个月	新股流通受限	29.38	59.37	175	5,141.50	10,389.75	-
301456	盘古智能	2023年7月6日	6个月	新股流通受限	37.96	30.39	163	6,187.48	4,953.57	-
301459	丰茂股份	2023年12月6日	6个月	新股流通受限	31.90	39.84	199	6,348.10	7,928.16	-
301486	致尚科技	2023年6月30日	6个月	新股流通受限	57.66	47.25	154	8,879.64	7,276.50	-
301487	盟固利	2023年8月1日	6个月	新股流通受限	5.32	40.96	867	4,612.44	35,512.32	-
301488	豪恩汽电	2023年6月26日	6个月	新股流通受限	39.78	69.09	146	5,807.88	10,087.14	-

301489	思泉新材	2023年10月16日	6个月	新股流通受限	41.66	64.11	108	4,499.28	6,923.88	-
301498	乖宝宠物	2023年8月9日	6个月	新股流通受限	39.99	38.81	137	5,478.63	5,316.97	-
301499	维科精密	2023年7月13日	6个月	新股流通受限	19.50	28.93	290	5,655.00	8,389.70	-
301500	飞南资源	2023年9月13日	6个月	新股流通受限	23.97	20.89	185	4,434.45	3,864.65	-
301505	苏州规划	2023年7月12日	6个月	新股流通受限	26.35	35.81	168	4,426.80	6,016.08	-
301507	民生健康	2023年8月24日	6个月	新股流通受限	10.00	15.85	417	4,170.00	6,609.45	-
301508	中机认检	2023年11月23日	6个月	新股流通受限	16.82	26.68	254	4,272.28	6,776.72	-
301510	固高科技	2023年8月4日	6个月	新股流通受限	12.00	35.01	370	4,440.00	12,953.70	-
301511	德福科技	2023年8月8日	6个月	新股流通受限	28.00	22.67	243	6,804.00	5,508.81	-
301515	港通医疗	2023年7月13日	6个月	新股流通受限	31.16	28.27	139	4,331.24	3,929.53	-
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	134	3,600.58	5,854.46	-
301518	长华化学	2023年7月26日	6个月	新股流通受限	25.75	23.01	224	5,768.00	5,154.24	-
301519	舜禹股份	2023年7月19日	6个月	新股流通受限	20.93	20.21	270	5,651.10	5,456.70	-
301520	万邦医药	2023年9月18日	6个月	新股流通受限	67.88	52.74	96	6,516.48	5,063.04	-
301525	儒竞科技	2023年8月23日	6个月	新股流通受限	99.57	81.46	45	4,480.65	3,665.70	-
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	96	6,892.80	6,615.36	-
301529	福赛科技	2023年8月31日	6个月	新股流通受限	36.60	37.88	112	4,099.20	4,242.56	-
301533	威马农机	2023年8月7日	6个月	新股流通受限	29.50	33.16	199	5,870.50	6,598.84	-
301548	崇德科技	2023年9月11日	6个月	新股流通受限	66.80	58.99	64	4,275.20	3,775.36	-
301550	斯菱股份	2023年9月6日	6个月	新股流通受限	37.56	43.57	119	4,469.64	5,184.83	-

301555	惠柏新材	2023年10月24日	6个月	新股流通受限	22.88	32.44	179	4,095.52	5,806.76	-
301558	三态股份	2023年9月21日	6个月	新股流通受限	7.33	13.40	674	4,940.42	9,031.60	-
301559	中集环科	2023年9月26日	6个月	新股流通受限	24.22	18.24	222	5,376.84	4,049.28	-
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	142	3,298.66	5,052.36	-
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	268	3,015.00	2,966.76	-
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	35	2,032.80	2,023.35	-
603075	热威股份	2023年9月1日	6个月	新股流通受限	23.10	23.31	97	2,240.70	2,261.07	-

603107	上海汽配	2023年10月25日	6个月	新股流通受限	14.23	18.19	129	1,835.67	2,346.51	-
603119	浙江荣泰	2023年7月21日	6个月	新股流通受限	15.32	23.87	116	1,777.12	2,768.92	-
603193	润本股份	2023年10月9日	6个月	新股流通受限	17.38	16.66	133	2,311.54	2,215.78	-
603231	索宝蛋白	2023年12月6日	6个月	新股流通受限	21.29	21.53	112	2,384.48	2,411.36	-
603270	金帝股份	2023年8月25日	6个月	新股流通受限	21.77	29.58	96	2,089.92	2,839.68	-
603273	天元智能	2023年10月16日	6个月	新股流通受限	9.50	18.97	143	1,358.50	2,712.71	-
603276	恒兴新材	2023年9月18日	6个月	新股流通受限	25.73	24.88	99	2,547.27	2,463.12	-
603296	华勤技术	2023年8月1日	6个月	新股流通受限	80.80	77.75	79	6,383.20	6,142.25	-
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	-
688347	华虹公司	2023年7月27日	6个月	新股流通受限	52.00	42.06	5,783	300,716.00	243,232.98	-
688450	光格科技	2023年7月17日	6个月	新股流通受限	53.09	36.42	89	4,725.01	3,241.38	-

688548	广钢气体	2023年8月8日	6个月	新股流通受限	9.87	12.75	698	6,889.26	8,899.50	-
688549	中巨芯-U	2023年8月30日	6个月	新股流通受限	5.18	8.09	1,044	5,407.92	8,445.96	-
688563	航材股份	2023年7月12日	6个月	新股流通受限	78.99	60.49	137	10,821.63	8,287.13	-
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	198	5,294.52	7,656.66	-
688591	泰凌微	2023年8月18日	6个月	新股流通受限	24.98	28.02	273	6,819.54	7,649.46	-
688602	康鹏科技	2023年7月13日	6个月	新股流通受限	8.66	11.06	474	4,104.84	5,242.44	-
688603	天承科技	2023年6月30日	6个月	新股流通受限	55.00	74.14	108	5,940.00	8,007.12	-
688612	威迈斯	2023年7月19日	6个月	新股流通受限	47.29	37.97	104	4,918.16	3,948.88	-
688627	精智达	2023年7月11日	6个月	新股流通受限	46.77	87.72	114	5,331.78	10,000.08	-
688638	誉辰智能	2023年7月4日	6个月	新股流通受限	83.90	59.68	77	6,460.30	4,595.36	-

688646	逸飞激光	2023年7月21日	6个月	新股流通受限	46.80	36.07	139	6,505.20	5,013.73	-
688648	中邮科技	2023年11月6日	6个月	新股流通受限	15.18	21.43	238	3,612.84	5,100.34	-
688651	盛邦安全	2023年7月19日	6个月	新股流通受限	39.90	46.05	139	5,546.10	6,400.95	-
688652	京仪装备	2023年11月22日	6个月	新股流通受限	31.95	52.25	148	4,728.60	7,733.00	-
688653	康希通信	2023年11月10日	6个月	新股流通受限	10.50	15.99	371	3,895.50	5,932.29	-
688657	浩辰软件	2023年9月25日	6个月	新股流通受限	103.40	78.23	52	5,376.80	4,067.96	-
688671	碧兴物联	2023年8月2日	6个月	新股流通受限	36.12	34.30	185	6,682.20	6,345.50	-
688693	锆威特	2023年8月10日	6个月	新股流通受限	40.83	43.41	116	4,736.28	5,035.56	-
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	107	4,564.62	5,155.26	-
688716	中研股份	2023年9月13日	6个月	新股流通受限	29.66	36.39	152	4,508.32	5,531.28	-
688719	爱科赛	2023年9月20日	6个月	新股流通受限	69.98	60.10	75	5,248.50	4,507.50	-

	博	日								
688720	艾森股份	2023年11月29日	6个月	新股流通受限	28.03	49.84	143	4,008.29	7,127.12	-

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、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、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）。本基金可以依照法律法规参与融资。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工商银行股份有限公司及其他具有基金托管资格的银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。

本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。下列表格列示中不含国债、央行票据、政策性金融债券等非信用债券投资。

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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	190,766.71	226,412.30
未评级	-	-
合计	190,766.71	226,412.30

注：上述评级均由经中国证监会核准从事证券市场资信评级业务的评级机构作出。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

7.4.13.3 流动性风险

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

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理职能部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短期内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，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主要为银行存款、结算备付金及债券投资等，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 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	153,651,903.04	-	-	-	153,651,903.04
结算备付金	1,888,459.27	-	-	-	1,888,459.27
存出保证金	105,114.43	-	-	-	105,114.43
交易性金融资产	-	190,766.71	-	529,050,183.27	529,240,949.98
应收申购款	-	-	-	30,419.36	30,419.36
资产总计	155,645,476.74	190,766.71	-	529,080,602.63	684,916,846.08
负债					
应付赎回款	-	-	-	45,003.40	45,003.40
应付管理人报酬	-	-	-	804,366.74	804,366.74
应付托管费	-	-	-	134,061.14	134,061.14
应付清算款	-	-	-	4,860,465.06	4,860,465.06
应交税费	-	-	-	1.19	1.19
其他负债	-	-	-	875,083.46	875,083.46
负债总计	-	-	-	6,718,980.99	6,718,980.99
利率敏感度缺口	155,645,476.74	190,766.71	-	-522,361,621.64	678,197,865.09
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	26,482,208.83	-	-	-	26,482,208.83

结算备付金	1,019,076.68	-	-	-	1,019,076.68
存出保证金	87,220.82	-	-	-	87,220.82
交易性金融资产	-	-	226,412.30	257,020,036.52	257,246,448.82
买入返售金融资产	12,021,405.48	-	-	-	12,021,405.48
应收申购款	-	-	-	29,065.86	29,065.86
应收清算款	-	-	-	4,886,458.51	4,886,458.51
资产总计	39,609,911.81	-	226,412.30	261,935,560.89	301,771,885.00
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	103,782.44	103,782.44
应付管理人报酬	-	-	-	383,526.59	383,526.59
应付托管费	-	-	-	63,921.13	63,921.13
应付清算款	-	-	-	243,597.95	243,597.95
应交税费	-	-	-	0.69	0.69
其他负债	-	-	-	730,208.87	730,208.87
负债总计	-	-	-	1,525,037.67	1,525,037.67
利率敏感度缺口	39,609,911.81	-	226,412.30	260,410,523.22	300,246,847.33

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 0.03%，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 0%—95%；每个交易日日终在扣除股指期货合约等金融工具所需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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	529,050,183.27	78.01	257,020,036.52	85.60
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	190,766.71	0.03	226,412.30	0.08
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	529,240,949.98	78.04	257,246,448.82	85.68

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	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

	动	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	25,917,331.41	11,954,328.23
	比较基准下降 5%资产净值变动	-25,917,331.41	-11,954,328.23

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	528,348,751.29	253,777,585.63
第二层次	-	9,057.60
第三层次	892,198.69	3,459,805.59
合计	529,240,949.98	257,246,448.82

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	-	3,459,805.59	3,459,805.59
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	1,306,004.07	1,306,004.07
转出第三层次	-	4,788,829.26	4,788,829.26
当期利得或损失总额	-	915,218.29	915,218.29
其中：计入损益的利得或损失	-	915,218.29	915,218.29
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	892,198.69	892,198.69
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	-	103,308.52	103,308.52
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	-	8,373,081.73	8,373,081.73
当期购买	-	2,999,994.15	2,999,994.15
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	2,280,616.69	2,280,616.69
转出第三层次	-	10,318,766.47	10,318,766.47
当期利得或损失总额	-	124,879.49	124,879.49
其中：计入损益的利得或损失	-	124,879.49	124,879.49

计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	3,459,805.59	3,459,805.59
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	-	-375,687.84	-375,687.84

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	892,198.69	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	3,459,805.59	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	529,050,183.27	77.24
	其中：股票	529,050,183.27	77.24
2	基金投资	-	-

3	固定收益投资	190,766.71	0.03
	其中：债券	190,766.71	0.03
	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	155,540,362.31	22.71
8	其他各项资产	135,533.79	0.02
9	合计	684,916,846.08	100.00

注：报告期末本基金投资的存托凭证公允价值为：830.48 元，占净值比 0.00%。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	6,370,273.48	0.94
B	采矿业	8,855,660.43	1.31
C	制造业	413,552,538.69	60.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,174,256.00	0.62
E	建筑业	1,957,064.01	0.29
F	批发和零售业	2,569,577.23	0.38
G	交通运输、仓储和邮政业	4,270,412.07	0.63
H	住宿和餐饮业	64,264.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	66,060,449.63	9.74
J	金融业	8,531,862.80	1.26
K	房地产业	1,641,537.00	0.24
L	租赁和商务服务业	1,816,068.49	0.27
M	科学研究和技术服务业	7,381,727.52	1.09
N	水利、环境和公共设施管理业	505,284.05	0.07
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	112,338.75	0.02
Q	卫生和社会工作	78,131.92	0.01
R	文化、体育和娱乐业	1,105,023.20	0.16
S	综合	3,714.00	0.00
	合计	529,050,183.27	78.01

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	603596	伯特利	373,500	25,883,550.00	3.82
2	002648	卫星化学	1,418,901	20,928,789.75	3.09
3	002371	北方华创	39,800	9,779,258.00	1.44
4	002920	德赛西威	69,300	8,975,043.00	1.32
5	600150	中国船舶	302,300	8,899,712.00	1.31
6	301313	凡拓数创	246,347	8,883,272.82	1.31
7	603728	鸣志电器	122,800	8,086,380.00	1.19
8	301363	美好医疗	208,300	7,665,440.00	1.13
9	688008	澜起科技	128,208	7,533,502.08	1.11
10	688595	芯海科技	166,798	7,222,353.40	1.06
11	688533	上声电子	182,977	6,975,083.24	1.03
12	688737	中自科技	192,780	6,381,018.00	0.94
13	603019	中科曙光	152,800	6,034,072.00	0.89
14	000625	长安汽车	352,100	5,925,843.00	0.87
15	300525	博思软件	386,900	5,772,548.00	0.85
16	688418	震有科技	278,224	5,247,304.64	0.77
17	002180	纳思达	230,700	5,220,741.00	0.77
18	688205	德科立	104,060	5,148,888.80	0.76
19	301191	菲菱科思	50,200	4,628,440.00	0.68
20	300782	卓胜微	31,780	4,480,980.00	0.66
21	600079	人福医药	177,400	4,410,164.00	0.65
22	688270	臻镭科技	63,060	4,312,042.80	0.64
23	688012	中微公司	26,700	4,101,120.00	0.60
24	601989	中国重工	981,500	4,053,595.00	0.60
25	301153	中科江南	50,281	3,935,493.87	0.58
26	002241	歌尔股份	187,000	3,928,870.00	0.58
27	688592	司南导航	72,951	3,786,156.90	0.56
28	600418	江淮汽车	231,000	3,730,650.00	0.55
29	301345	涛涛车业	61,227	3,728,724.30	0.55
30	603000	人民网	129,800	3,631,804.00	0.54
31	603758	秦安股份	316,100	3,616,184.00	0.53
32	688292	浩瀚深度	131,190	3,610,348.80	0.53
33	688120	华海清科	17,785	3,338,244.50	0.49
34	300748	金力永磁	164,660	3,329,425.20	0.49
35	000063	中兴通讯	118,800	3,145,824.00	0.46
36	603997	继峰股份	232,500	3,131,775.00	0.46
37	600938	中国海油	146,500	3,072,105.00	0.45

38	002185	华天科技	358,700	3,056,124.00	0.45
39	000338	潍柴动力	222,100	3,031,665.00	0.45
40	605388	均瑶健康	236,530	2,966,086.20	0.44
41	688066	航天宏图	68,755	2,904,211.20	0.43
42	688326	经纬恒润-W	24,252	2,814,444.60	0.41
43	688099	晶晨股份	44,833	2,807,890.79	0.41
44	601006	大秦铁路	386,800	2,788,828.00	0.41
45	003021	兆威机电	29,616	2,783,607.84	0.41
46	301387	光大同创	40,900	2,768,930.00	0.41
47	688496	清越科技	122,710	2,747,476.90	0.41
48	000426	兴业银锡	302,300	2,744,884.00	0.40
49	600761	安徽合力	150,600	2,742,426.00	0.40
50	688800	瑞可达	67,959	2,730,592.62	0.40
51	002517	恺英网络	243,300	2,717,661.00	0.40
52	688678	福立旺	145,404	2,676,887.64	0.39
53	688116	天奈科技	91,861	2,667,643.44	0.39
54	300761	立华股份	126,900	2,661,093.00	0.39
55	300752	隆利科技	145,900	2,651,003.00	0.39
56	300858	科拓生物	136,098	2,626,691.40	0.39
57	300698	万马科技	71,000	2,591,500.00	0.38
58	688617	惠泰医疗	6,627	2,574,589.50	0.38
59	002011	盾安环境	184,800	2,541,000.00	0.37
60	605128	上海沿浦	43,600	2,530,980.00	0.37
61	688720	艾森股份	42,018	2,530,514.62	0.37
62	600276	恒瑞医药	55,800	2,523,834.00	0.37
63	300498	温氏股份	124,700	2,501,482.00	0.37
64	300499	高澜股份	174,400	2,500,896.00	0.37
65	300601	康泰生物	92,000	2,497,800.00	0.37
66	300310	宜通世纪	564,000	2,492,880.00	0.37
67	688590	新致软件	109,209	2,470,307.58	0.36
68	002555	三七互娱	131,000	2,464,110.00	0.36
69	603992	松霖科技	135,600	2,459,784.00	0.36
70	688728	格科微	119,460	2,445,346.20	0.36
71	603129	春风动力	23,900	2,443,536.00	0.36
72	300812	易天股份	58,600	2,437,174.00	0.36
73	001380	华纬科技	69,800	2,431,832.00	0.36
74	300496	中科创达	29,900	2,393,794.00	0.35
75	688278	特宝生物	44,770	2,343,709.50	0.35
76	688279	峰昭科技	18,567	2,341,670.04	0.35
77	002236	大华股份	126,700	2,337,615.00	0.34
78	688107	安路科技	63,314	2,328,688.92	0.34
79	601965	中国汽研	105,400	2,325,124.00	0.34
80	600733	北汽蓝谷	378,400	2,319,592.00	0.34

81	688213	思特威-W	41,719	2,317,907.64	0.34
82	600803	新奥股份	137,300	2,309,386.00	0.34
83	601838	成都银行	204,000	2,297,040.00	0.34
84	000568	泸州老窖	12,800	2,296,576.00	0.34
85	601901	方正证券	278,400	2,243,904.00	0.33
86	300398	飞凯材料	141,800	2,234,768.00	0.33
87	000887	中鼎股份	178,600	2,209,282.00	0.33
88	688017	绿的谐波	13,937	2,139,329.50	0.32
89	002385	大北农	350,800	2,090,768.00	0.31
90	301306	西测测试	52,459	2,076,851.81	0.31
91	603190	亚通精工	70,670	2,069,217.60	0.31
92	300567	精测电子	23,600	2,067,832.00	0.30
93	300684	中石科技	95,900	2,060,891.00	0.30
94	300757	罗博特科	25,300	2,059,167.00	0.30
95	300571	平治信息	58,000	2,049,140.00	0.30
96	601233	桐昆股份	135,000	2,042,550.00	0.30
97	688256	寒武纪-U	15,067	2,033,442.32	0.30
98	600850	电科数字	91,600	1,992,300.00	0.29
99	300188	国投智能	124,300	1,991,286.00	0.29
100	601636	旗滨集团	290,500	1,987,020.00	0.29
101	688516	奥特维	21,946	1,986,113.00	0.29
102	000933	神火股份	118,100	1,984,080.00	0.29
103	002845	同兴达	110,900	1,968,475.00	0.29
104	688668	鼎通科技	34,804	1,925,357.28	0.28
105	000837	秦川机床	175,200	1,883,400.00	0.28
106	301488	豪恩汽电	26,946	1,876,439.14	0.28
107	688041	海光信息	25,131	1,783,798.38	0.26
108	301397	溯联股份	39,000	1,762,020.00	0.26
109	601633	长城汽车	69,500	1,752,790.00	0.26
110	688362	甬矽电子	66,851	1,750,827.69	0.26
111	002557	洽洽食品	49,700	1,730,554.00	0.26
112	601601	中国太保	72,700	1,728,806.00	0.25
113	603806	福斯特	70,100	1,701,327.00	0.25
114	000700	模塑科技	240,900	1,686,300.00	0.25
115	301159	三维天地	35,900	1,638,117.00	0.24
116	688192	迪哲医药-U	34,205	1,636,709.25	0.24
117	600820	隧道股份	283,800	1,634,688.00	0.24
118	301529	福赛科技	40,312	1,606,212.56	0.24
119	002155	湖南黄金	142,900	1,591,906.00	0.23
120	600201	生物股份	147,800	1,591,806.00	0.23
121	001270	铖昌科技	25,240	1,582,800.40	0.23
122	600422	昆药集团	75,800	1,581,188.00	0.23
123	300479	神思电子	79,900	1,572,432.00	0.23

124	301310	鑫宏业	32,300	1,571,395.00	0.23
125	600933	爱柯迪	71,000	1,557,740.00	0.23
126	605090	九丰能源	54,500	1,522,185.00	0.22
127	600480	凌云股份	166,700	1,518,637.00	0.22
128	600266	城建发展	312,300	1,511,532.00	0.22
129	300928	华安鑫创	29,900	1,508,156.00	0.22
130	603378	亚士创能	177,500	1,501,650.00	0.22
131	603737	三棵树	31,420	1,495,906.20	0.22
132	600519	贵州茅台	864	1,491,264.00	0.22
133	301085	亚康股份	25,665	1,473,427.65	0.22
134	300766	每日互动	94,800	1,462,764.00	0.22
135	688361	中科飞测-U	19,314	1,437,541.02	0.21
136	002459	晶澳科技	68,584	1,421,060.48	0.21
137	300280	紫天科技	33,200	1,418,636.00	0.21
138	688502	茂莱光学	6,429	1,395,028.71	0.21
139	688575	亚辉龙	58,713	1,342,766.31	0.20
140	600584	长电科技	41,900	1,251,134.00	0.18
141	002530	金财互联	143,100	1,246,401.00	0.18
142	301227	森鹰窗业	44,700	1,210,029.00	0.18
143	300760	迈瑞医疗	4,100	1,191,460.00	0.18
144	300570	太辰光	30,400	1,187,120.00	0.18
145	605319	无锡振华	51,564	1,187,003.28	0.18
146	300036	超图软件	55,700	1,164,130.00	0.17
147	600707	彩虹股份	169,700	1,145,475.00	0.17
148	300327	中颖电子	49,900	1,137,720.00	0.17
149	688259	创耀科技	16,409	1,114,663.37	0.16
150	300677	英科医疗	47,100	1,100,256.00	0.16
151	688428	诺诚健华-U	94,545	1,087,267.50	0.16
152	601899	紫金矿业	86,600	1,079,036.00	0.16
153	688025	杰普特	11,290	1,044,889.50	0.15
154	300634	彩讯股份	48,300	988,701.00	0.15
155	601318	中国平安	24,200	975,260.00	0.14
156	301325	曼恩斯特	12,118	939,629.72	0.14
157	603379	三美股份	27,600	938,400.00	0.14
158	603629	利通电子	29,600	931,216.00	0.14
159	600809	山西汾酒	4,000	922,920.00	0.14
160	301517	陕西华达	16,534	922,614.46	0.14
161	601975	招商南油	320,700	897,960.00	0.13
162	688498	源杰科技	5,992	892,688.16	0.13
163	603296	华勤技术	11,090	885,811.04	0.13
164	688325	赛微微电	22,571	884,557.49	0.13
165	300304	云意电气	125,400	851,466.00	0.13
166	301312	智立方	7,800	845,052.00	0.12

167	300750	宁德时代	5,120	835,891.20	0.12
168	603918	金桥信息	44,700	835,890.00	0.12
169	002635	安洁科技	50,618	826,591.94	0.12
170	603501	韦尔股份	7,700	821,667.00	0.12
171	603267	鸿远电子	15,810	793,662.00	0.12
172	688458	美芯晟	10,303	792,918.88	0.12
173	002967	广电计量	51,800	777,518.00	0.11
174	003000	劲仔食品	62,284	761,110.48	0.11
175	600309	万华化学	9,900	760,518.00	0.11
176	002234	民和股份	61,900	748,990.00	0.11
177	688049	炬芯科技	19,540	743,887.80	0.11
178	002567	唐人神	98,900	741,750.00	0.11
179	688484	南芯科技	18,350	731,247.50	0.11
180	300661	圣邦股份	8,200	729,882.00	0.11
181	300803	指南针	11,900	717,094.00	0.11
182	002858	力盛体育	36,200	687,800.00	0.10
183	300832	新产业	8,000	625,600.00	0.09
184	002150	通润装备	34,600	613,804.00	0.09
185	001322	箭牌家居	51,700	613,162.00	0.09
186	002851	麦格米特	24,200	595,320.00	0.09
187	002508	老板电器	26,900	585,882.00	0.09
188	688627	精智达	6,332	564,521.32	0.08
189	301526	国际复材	97,225	527,153.41	0.08
190	688387	信科移动-U	70,185	506,033.85	0.07
191	002126	银轮股份	26,500	494,755.00	0.07
192	000021	深科技	28,400	460,364.00	0.07
193	688197	首药控股-U	8,292	457,635.48	0.07
194	002709	天赐材料	17,700	443,916.00	0.07
195	603170	宝立食品	24,900	421,059.00	0.06
196	300342	天银机电	26,600	408,842.00	0.06
197	301205	联特科技	3,800	398,050.00	0.06
198	603225	新凤鸣	27,700	393,340.00	0.06
199	603713	密尔克卫	6,900	367,149.00	0.05
200	600859	王府井	22,500	359,325.00	0.05
201	688235	百济神州-U	2,392	332,583.68	0.05
202	600801	华新水泥	24,700	307,021.00	0.05
203	688489	三未信安	6,296	296,037.92	0.04
204	002756	永兴材料	5,300	276,713.00	0.04
205	300374	中铁装配	22,600	276,398.00	0.04
206	002657	中科金财	14,500	264,190.00	0.04
207	688719	爱科赛博	4,027	258,304.94	0.04
208	301525	儒竞科技	2,943	248,198.94	0.04
209	688347	华虹公司	5,823	244,943.78	0.04

210	601678	滨化股份	57,600	242,496.00	0.04
211	600415	小商品城	32,300	236,436.00	0.03
212	603801	志邦家居	13,600	228,072.00	0.03
213	688981	中芯国际	4,230	224,274.60	0.03
214	002821	凯莱英	1,800	208,980.00	0.03
215	000798	中水渔业	23,000	204,470.00	0.03
216	600211	西藏药业	4,100	200,080.00	0.03
217	000818	航锦科技	5,900	185,142.00	0.03
218	688358	祥生医疗	4,728	178,623.84	0.03
219	002632	道明光学	17,700	174,876.00	0.03
220	301566	达利凯普	5,755	162,891.85	0.02
221	300972	万辰集团	4,300	161,422.00	0.02
222	688112	鼎阳科技	3,581	143,383.24	0.02
223	688443	智翔金泰-U	3,552	141,902.40	0.02
224	601801	皖新传媒	19,400	134,830.00	0.02
225	688469	芯联集成-U	26,770	134,385.40	0.02
226	600879	航天电子	17,100	131,841.00	0.02
227	688062	迈威生物-U	3,978	130,040.82	0.02
228	301317	鑫磊股份	6,509	127,966.94	0.02
229	688048	长光华芯	2,032	127,345.44	0.02
230	301361	众智科技	5,169	123,228.96	0.02
231	301419	阿莱德	3,292	122,133.20	0.02
232	600563	法拉电子	1,300	120,380.00	0.02
233	301377	鼎泰高科	5,083	120,212.95	0.02
234	688376	美埃科技	3,139	119,250.61	0.02
235	301320	豪江智能	6,416	118,503.52	0.02
236	601799	星宇股份	900	117,999.00	0.02
237	688401	路维光电	3,817	117,258.24	0.02
238	688352	颀中科技	7,401	114,049.41	0.02
239	688562	航天软件	4,584	110,016.00	0.02
240	301172	君逸数码	2,722	105,561.33	0.02
241	601618	中国中冶	33,700	103,122.00	0.02
242	301370	国科恒泰	6,335	102,392.52	0.02
243	688503	聚和材料	1,897	101,679.20	0.01
244	301303	真兰仪表	5,128	100,970.32	0.01
245	301030	仕净科技	2,417	100,788.90	0.01
246	301408	华人健康	6,241	99,543.95	0.01
247	300192	科德教育	9,800	96,726.00	0.01
248	688166	博瑞医药	2,755	96,425.00	0.01
249	688301	奕瑞科技	290	94,325.40	0.01
250	688593	新相微	6,324	93,089.28	0.01
251	688548	广钢气体	7,042	91,752.14	0.01
252	301045	天禄科技	3,350	91,120.00	0.01

253	688260	昀冢科技	2,990	90,597.00	0.01
254	688687	凯因科技	2,575	89,764.50	0.01
255	301578	辰奕智能	1,175	89,662.16	0.01
256	688071	华依科技	1,837	89,480.27	0.01
257	688416	恒烁股份	1,519	88,998.21	0.01
258	688652	京仪装备	1,495	88,889.75	0.01
259	688612	威迈斯	2,278	88,626.18	0.01
260	688146	中船特气	2,585	87,915.85	0.01
261	603496	恒为科技	2,800	87,248.00	0.01
262	688549	中巨芯-U	10,432	87,117.40	0.01
263	301508	中机认检	2,539	85,403.57	0.01
264	688334	西高院	4,861	84,241.13	0.01
265	688563	航材股份	1,370	83,746.73	0.01
266	688143	长盈通	2,340	82,719.00	0.01
267	301281	科源制药	2,419	82,342.76	0.01
268	688619	罗普特	5,856	82,335.36	0.01
269	688543	国科军工	1,467	82,005.30	0.01
270	688531	日联科技	808	81,672.64	0.01
271	301315	威士顿	1,543	81,562.98	0.01
272	688322	奥比中光-UW	2,169	81,511.02	0.01
273	603306	华懋科技	3,000	81,330.00	0.01
274	688088	虹软科技	1,978	81,177.12	0.01
275	688219	会通股份	7,336	80,475.92	0.01
276	300889	爱克股份	4,786	80,404.80	0.01
277	688571	杭华股份	10,660	79,736.80	0.01
278	688029	南微医学	819	79,279.20	0.01
279	688685	迈信林	2,612	77,628.64	0.01
280	301160	翔楼新材	1,818	76,774.14	0.01
281	688307	中润光学	2,455	76,350.50	0.01
282	601456	国联证券	7,000	75,880.00	0.01
283	603979	金诚信	2,000	75,520.00	0.01
284	688031	星环科技-U	1,157	75,285.99	0.01
285	688570	天玛智控	2,766	75,262.86	0.01
286	001287	中电港	3,603	75,050.49	0.01
287	301292	海科新源	3,843	74,880.75	0.01
288	601702	华峰铝业	4,166	74,779.70	0.01
289	300952	恒辉安防	3,398	74,008.44	0.01
290	301399	英特科技	1,923	73,593.21	0.01
291	301486	致尚科技	1,533	73,371.97	0.01
292	301555	惠柏新材	1,788	73,272.13	0.01
293	688653	康希通信	3,710	72,779.07	0.01
294	301373	凌玮科技	2,453	72,731.45	0.01
295	600436	片仔癀	300	72,597.00	0.01

296	301291	明阳电气	2,543	72,119.48	0.01
297	301290	东星医疗	2,588	71,402.92	0.01
298	301295	美硕科技	2,146	71,225.74	0.01
299	301262	海看股份	2,259	70,367.85	0.01
300	301357	北方长龙	1,393	70,318.64	0.01
301	603598	引力传媒	3,400	70,312.00	0.01
302	600941	中国移动	700	69,636.00	0.01
303	301528	多浦乐	952	69,522.80	0.01
304	300987	川网传媒	3,905	69,196.60	0.01
305	603004	鼎龙科技	1,948	69,190.05	0.01
306	301386	未来电器	2,712	68,966.16	0.01
307	601139	深圳燃气	10,000	68,900.00	0.01
308	301182	凯旺科技	2,932	68,550.16	0.01
309	300922	天秦装备	4,008	68,416.56	0.01
310	301261	恒工精密	1,325	68,294.09	0.01
311	688433	华曙高科	2,175	67,968.75	0.01
312	688557	兰剑智能	1,812	66,735.96	0.01
313	601360	三六零	7,400	66,674.00	0.01
314	688212	澳华内镜	1,073	66,558.19	0.01
315	601658	邮储银行	15,200	66,120.00	0.01
316	600489	中金黄金	6,600	65,736.00	0.01
317	300883	龙利得	8,911	65,495.85	0.01
318	603259	药明康德	900	65,484.00	0.01
319	688669	聚石化学	3,485	65,308.90	0.01
320	301283	聚胶股份	1,959	64,411.92	0.01
321	688271	联影医疗	464	63,572.64	0.01
322	688403	汇成股份	6,011	63,416.05	0.01
323	301568	思泰克	1,415	63,126.62	0.01
324	603108	润达医疗	3,100	63,085.00	0.01
325	601061	中信金属	8,168	62,975.28	0.01
326	301276	嘉曼服饰	2,572	62,705.36	0.01
327	002833	弘亚数控	3,500	62,090.00	0.01
328	301026	浩通科技	2,027	61,722.15	0.01
329	688648	中邮科技	2,374	61,341.22	0.01
330	603029	天鹅股份	3,000	61,200.00	0.01
331	688238	和元生物	6,804	61,167.96	0.01
332	300975	商络电子	7,375	60,991.25	0.01
333	301505	苏州规划	1,676	60,907.28	0.01
334	300971	博亚精工	2,445	60,880.50	0.01
335	301332	德尔玛	4,978	60,831.16	0.01
336	301016	雷尔伟	2,747	60,598.82	0.01
337	301355	南王科技	3,992	60,478.80	0.01
338	301202	朗威股份	1,863	59,796.48	0.01

339	688716	中研股份	1,520	59,567.28	0.01
340	603722	阿科力	1,100	59,290.00	0.01
341	688385	复旦微电	1,525	58,910.75	0.01
342	688096	京源环保	6,279	58,834.23	0.01
343	688789	宏华数科	586	58,547.26	0.01
344	688609	九联科技	4,412	58,238.40	0.01
345	003035	南网能源	11,046	58,101.96	0.01
346	301393	昊帆生物	964	57,787.56	0.01
347	301265	华新环保	5,596	57,359.00	0.01
348	600765	中航重机	3,000	57,330.00	0.01
349	301251	威尔高	1,603	57,264.69	0.01
350	603901	永创智能	4,800	57,120.00	0.01
351	600906	财达证券	7,597	56,977.50	0.01
352	301323	新莱福	1,537	56,853.63	0.01
353	600373	中文传媒	4,300	56,674.00	0.01
354	300931	通用电梯	6,713	56,657.72	0.01
355	301062	上海艾录	5,225	56,534.50	0.01
356	301511	德福科技	2,430	56,225.34	0.01
357	301337	亚华电子	1,825	55,863.25	0.01
358	301329	信音电子	2,452	55,544.78	0.01
359	301519	舜禹股份	2,693	55,467.42	0.01
360	600459	贵研铂业	3,858	55,400.88	0.01
361	688216	气派科技	2,000	55,340.00	0.01
362	301157	华塑科技	1,289	55,169.20	0.01
363	300943	春晖智控	3,813	54,678.42	0.01
364	688085	三友医疗	2,798	54,561.00	0.01
365	301098	金埔园林	4,603	54,361.43	0.01
366	301376	致欧科技	2,271	54,322.32	0.01
367	688111	金山办公	171	54,070.20	0.01
368	301002	崧盛股份	2,601	53,944.74	0.01
369	688616	西力科技	3,918	53,441.52	0.01
370	688159	有方科技	1,415	53,274.75	0.01
371	301439	泓淋电力	3,636	53,158.32	0.01
372	688602	康鹏科技	4,734	53,082.24	0.01
373	300950	德固特	3,279	52,890.27	0.01
374	688581	安杰思	423	52,794.63	0.01
375	301520	万邦医药	957	52,676.34	0.01
376	688121	卓然股份	2,597	52,537.31	0.01
377	301518	长华化学	2,240	52,328.64	0.01
378	601963	重庆银行	7,472	52,005.12	0.01
379	301032	新柴股份	5,124	51,906.12	0.01
380	300960	通业科技	2,332	51,723.76	0.01
381	600977	中国电影	4,200	51,408.00	0.01

382	600684	珠江股份	14,800	51,356.00	0.01
383	301007	德迈仕	3,022	51,102.02	0.01
384	688285	高铁电气	5,722	50,811.36	0.01
385	603893	瑞芯微	800	50,720.00	0.01
386	688226	威腾电气	2,693	50,628.40	0.01
387	688646	逸飞激光	1,381	50,520.61	0.01
388	301309	万得凯	1,806	50,477.70	0.01
389	600297	广汇汽车	29,300	50,396.00	0.01
390	688579	山大地纬	3,948	50,139.60	0.01
391	688485	九州一轨	3,580	50,048.40	0.01
392	688314	康拓医疗	1,519	49,990.29	0.01
393	301456	盘古智能	1,624	49,952.37	0.01
394	301322	绿通科技	1,212	49,885.92	0.01
395	601728	中国电信	9,211	49,831.51	0.01
396	603297	永新光学	500	49,675.00	0.01
397	300857	协创数据	934	49,492.66	0.01
398	600925	苏能股份	8,960	49,369.60	0.01
399	688777	中控技术	1,080	48,978.00	0.01
400	601138	工业富联	3,200	48,384.00	0.01
401	688114	华大智造	562	48,343.24	0.01
402	600895	张江高科	2,500	48,250.00	0.01
403	600975	新五丰	4,600	48,070.00	0.01
404	688429	时创能源	2,265	47,995.35	0.01
405	603208	江山欧派	1,610	47,800.90	0.01
406	688656	浩欧博	1,371	47,655.96	0.01
407	300886	华业香料	1,903	47,137.31	0.01
408	688511	天微电子	1,490	46,890.30	0.01
409	688391	钜泉科技	945	46,872.00	0.01
410	301033	迈普医学	1,076	46,849.04	0.01
411	688338	赛科希德	1,386	46,569.60	0.01
412	688655	迅捷兴	3,083	46,553.30	0.01
413	603301	振德医疗	1,900	46,550.00	0.01
414	300948	冠中生态	3,229	46,529.89	0.01
415	300998	宁波方正	2,003	46,229.24	0.01
416	688053	思科瑞	920	45,944.80	0.01
417	688638	誉辰智能	764	45,925.28	0.01
418	301025	读客文化	4,027	45,706.45	0.01
419	688517	金冠电气	2,892	45,664.68	0.01
420	300774	倍杰特	4,435	45,636.15	0.01
421	301040	中环海陆	2,401	45,546.97	0.01
422	301036	双乐股份	2,047	45,381.99	0.01
423	301049	超越科技	1,954	45,254.64	0.01
424	688630	芯碁微装	528	45,075.36	0.01

425	688508	芯朋微	909	44,731.89	0.01
426	603135	中重科技	2,718	44,466.48	0.01
427	688639	华恒生物	352	44,316.80	0.01
428	688331	荣昌生物	714	44,310.84	0.01
429	001239	永达股份	1,887	44,228.22	0.01
430	300961	深水海纳	3,936	44,201.28	0.01
431	688215	瑞晟智能	1,229	44,182.55	0.01
432	688190	云路股份	612	43,837.56	0.01
433	301068	大地海洋	1,436	43,654.40	0.01
434	688420	美腾科技	1,685	43,540.40	0.01
435	300059	东方财富	3,100	43,524.00	0.01
436	688622	禾信仪器	1,204	43,283.80	0.01
437	300992	泰福泵业	1,998	43,116.84	0.01
438	301053	远信工业	1,544	43,015.84	0.01
439	301371	敷尔佳	1,127	42,991.48	0.01
440	688072	拓荆科技	184	42,559.20	0.01
441	688657	浩辰软件	519	42,558.10	0.01
442	688350	富淼科技	2,552	42,184.56	0.01
443	301037	保立佳	2,115	42,151.95	0.01
444	605088	冠盛股份	1,816	41,768.00	0.01
445	000822	山东海化	6,100	41,724.00	0.01
446	688585	上纬新材	4,922	41,689.34	0.01
447	301559	中集环科	2,215	41,637.26	0.01
448	001378	德冠新材	1,090	41,500.66	0.01
449	001358	兴欣新材	867	41,281.92	0.01
450	688596	正帆科技	1,039	41,175.57	0.01
451	603380	易德龙	1,600	40,976.00	0.01
452	603600	永艺股份	3,700	40,848.00	0.01
453	600050	中国联通	9,300	40,734.00	0.01
454	600021	上海电力	4,800	40,608.00	0.01
455	300995	奇德新材	1,909	40,604.43	0.01
456	688679	通源环境	3,139	40,273.37	0.01
457	002984	森麒麟	1,386	39,986.10	0.01
458	688479	友车科技	1,714	39,970.48	0.01
459	301500	飞南资源	1,850	39,945.20	0.01
460	600475	华光环能	3,800	39,520.00	0.01
461	600699	均胜电子	2,200	39,512.00	0.01
462	301515	港通医疗	1,382	39,504.19	0.01
463	605589	圣泉集团	1,750	39,165.00	0.01
464	688582	芯动联科	1,012	39,134.04	0.01
465	688257	新锐股份	1,558	39,012.32	0.01
466	601136	首创证券	2,300	39,008.00	0.01
467	688139	海尔生物	961	38,939.72	0.01

468	601600	中国铝业	6,900	38,916.00	0.01
469	001203	大中矿业	3,809	38,737.53	0.01
470	301548	崇德科技	634	38,596.66	0.01
471	300181	佐力药业	3,600	38,376.00	0.01
472	688308	欧科亿	1,372	38,278.80	0.01
473	600760	中航沈飞	900	37,962.00	0.01
474	688227	品高股份	1,974	37,644.18	0.01
475	603416	信捷电气	1,000	37,560.00	0.01
476	688395	正弦电气	1,627	37,404.73	0.01
477	601555	东吴证券	5,100	37,281.00	0.01
478	688217	睿昂基因	1,040	37,211.20	0.01
479	603373	安邦护卫	876	36,981.40	0.01
480	688522	纳睿雷达	666	36,956.34	0.01
481	603986	兆易创新	400	36,956.00	0.01
482	688300	联瑞新材	697	36,906.15	0.01
483	603040	新坐标	1,400	36,610.00	0.01
484	688032	禾迈股份	135	36,450.00	0.01
485	601377	兴业证券	6,200	36,394.00	0.01
486	688323	瑞华泰	1,694	36,370.18	0.01
487	603730	岱美股份	2,500	36,225.00	0.01
488	603179	新泉股份	710	36,004.10	0.01
489	603035	常熟汽饰	1,900	35,853.00	0.01
490	688550	瑞联新材	903	35,831.04	0.01
491	301027	华蓝集团	2,856	35,728.56	0.01
492	002993	奥海科技	936	35,661.60	0.01
493	688249	晶合集成	2,065	35,621.25	0.01
494	600019	宝钢股份	6,000	35,580.00	0.01
495	300929	华骐环保	2,923	35,572.91	0.01
496	301487	盟固利	867	35,512.32	0.01
497	002179	中航光电	910	35,490.00	0.01
498	300854	中兰环保	2,026	35,353.70	0.01
499	688472	阿特斯	2,787	35,199.81	0.01
500	002493	荣盛石化	3,400	35,190.00	0.01
501	688625	呈和科技	895	35,101.90	0.01
502	688232	新点软件	968	35,041.60	0.01
503	600988	赤峰黄金	2,500	35,025.00	0.01
504	688092	爱科科技	1,137	34,974.12	0.01
505	688110	东芯股份	1,011	34,808.73	0.01
506	600258	首旅酒店	2,200	34,364.00	0.01
507	601128	常熟银行	5,300	33,867.00	0.00
508	603197	保隆科技	600	33,840.00	0.00
509	601568	北元集团	7,095	33,630.30	0.00
510	600916	中国黄金	3,371	33,271.77	0.00

511	601000	唐山港	9,500	33,250.00	0.00
512	688305	科德数控	434	33,179.30	0.00
513	601083	锦江航运	2,673	33,005.21	0.00
514	688439	振华风光	368	32,792.48	0.00
515	688450	光格科技	886	32,634.74	0.00
516	001286	陕西能源	3,767	32,207.85	0.00
517	301239	普瑞眼科	374	32,164.00	0.00
518	001282	三联锻造	882	31,901.94	0.00
519	001326	联域股份	584	31,813.01	0.00
520	000032	深桑达 A	1,500	31,770.00	0.00
521	603281	江瀚新材	1,208	31,758.32	0.00
522	600602	云赛智联	2,700	31,239.00	0.00
523	600984	建设机械	8,300	31,125.00	0.00
524	601133	柏诚股份	2,358	31,054.86	0.00
525	600141	兴发集团	1,700	31,025.00	0.00
526	601156	东航物流	2,090	30,890.20	0.00
527	688315	诺禾致源	1,320	30,808.80	0.00
528	601065	江盐集团	2,668	30,521.92	0.00
529	603739	蔚蓝生物	2,000	30,440.00	0.00
530	600955	维远股份	1,694	30,407.30	0.00
531	002790	瑞尔特	2,900	30,276.00	0.00
532	601089	福元医药	1,749	30,152.76	0.00
533	600536	中国软件	829	30,059.54	0.00
534	688067	爱威科技	1,259	29,976.79	0.00
535	603650	彤程新材	900	29,970.00	0.00
536	600754	锦江酒店	1,000	29,900.00	0.00
537	688651	盛邦安全	638	29,883.89	0.00
538	605020	永和股份	1,190	29,761.90	0.00
539	688036	传音控股	214	29,617.60	0.00
540	688551	科威尔	518	29,577.80	0.00
541	300457	赢合科技	1,600	29,504.00	0.00
542	601865	福莱特	1,100	29,370.00	0.00
543	688681	科汇股份	1,899	29,339.55	0.00
544	603270	金帝股份	959	29,333.78	0.00
545	603565	中谷物流	3,559	29,290.57	0.00
546	603107	上海汽配	1,285	29,235.07	0.00
547	001306	夏厦精密	328	29,228.63	0.00
548	600927	永安期货	1,859	29,204.89	0.00
549	600301	华锡有色	2,300	28,934.00	0.00
550	603032	德新科技	1,420	28,826.00	0.00
551	688603	天承科技	385	28,776.58	0.00
552	003009	中天火箭	623	28,726.53	0.00
553	688131	皓元医药	544	28,320.64	0.00

554	603119	浙江荣泰	1,160	28,033.72	0.00
555	001339	智微智能	812	27,916.56	0.00
556	001328	登康口腔	986	27,913.66	0.00
557	605377	华旺科技	1,450	27,680.50	0.00
558	688507	索辰科技	201	27,486.75	0.00
559	001324	长青科技	1,131	27,449.37	0.00
560	301499	维科精密	930	27,212.10	0.00
561	603137	恒尚节能	1,382	27,114.84	0.00
562	603103	横店影视	1,500	26,670.00	0.00
563	601668	中国建筑	5,500	26,455.00	0.00
564	603799	华友钴业	800	26,344.00	0.00
565	601665	齐鲁银行	6,731	26,318.21	0.00
566	601155	新城控股	2,300	26,243.00	0.00
567	002334	英威腾	3,000	26,190.00	0.00
568	603125	常青科技	872	26,177.44	0.00
569	688169	石头科技	92	26,031.40	0.00
570	601187	厦门银行	5,129	26,004.03	0.00
571	603276	恒兴新材	989	25,887.92	0.00
572	001258	立新能源	3,188	25,759.04	0.00
573	001330	博纳影业	3,564	25,660.80	0.00
574	688409	富创精密	327	25,607.37	0.00
575	688488	艾迪药业	2,020	25,270.20	0.00
576	603348	文灿股份	651	25,258.80	0.00
577	600690	海尔智家	1,200	25,200.00	0.00
578	601888	中国中免	300	25,107.00	0.00
579	603211	晋拓股份	1,287	24,761.88	0.00
580	605016	百龙创园	872	24,756.08	0.00
581	603071	物产环能	1,627	24,730.40	0.00
582	600032	浙江新能	3,045	24,542.70	0.00
583	001213	中铁特货	5,818	24,435.60	0.00
584	600845	宝信软件	500	24,400.00	0.00
585	301286	侨源股份	839	24,381.34	0.00
586	000516	国际医学	3,000	24,330.00	0.00
587	001308	康冠科技	867	24,258.66	0.00
588	601921	浙版传媒	3,154	24,096.56	0.00
589	605499	东鹏饮料	132	24,091.32	0.00
590	603155	新亚强	996	24,013.56	0.00
591	688601	力芯微	457	23,942.23	0.00
592	688682	霍莱沃	501	23,902.71	0.00
593	605366	宏柏新材	2,890	23,900.30	0.00
594	603193	润本股份	1,325	23,886.34	0.00
595	300723	一品红	800	23,864.00	0.00
596	688518	联赢激光	1,148	23,511.04	0.00

597	605167	利柏特	2,471	23,449.79	0.00
598	603075	热威股份	970	23,448.78	0.00
599	301101	明月镜片	556	23,274.16	0.00
600	002819	东方中科	900	23,049.00	0.00
601	688023	安恒信息	207	22,954.23	0.00
602	605296	神农集团	740	22,740.20	0.00
603	600585	海螺水泥	1,000	22,560.00	0.00
604	603171	税友股份	637	22,537.06	0.00
605	688006	杭可科技	954	22,399.92	0.00
606	301050	雷电微力	383	22,313.58	0.00
607	688351	微电生理-U	869	22,289.85	0.00
608	603324	盛剑环境	732	22,230.84	0.00
609	601689	拓普集团	300	22,050.00	0.00
610	600456	宝钛股份	700	21,973.00	0.00
611	001337	四川黄金	795	21,965.85	0.00
612	301039	中集车辆	2,340	21,949.20	0.00
613	605218	伟时电子	837	21,904.29	0.00
614	605338	巴比食品	1,012	21,737.76	0.00
615	603931	格林达	844	21,597.96	0.00
616	688191	智洋创新	1,167	21,589.50	0.00
617	603206	嘉环科技	1,210	21,550.10	0.00
618	003040	楚天龙	1,101	21,524.55	0.00
619	603172	万丰股份	1,220	21,508.60	0.00
620	688478	晶升股份	413	21,476.00	0.00
621	603062	麦加芯彩	346	21,442.19	0.00
622	688535	华海诚科	229	21,246.62	0.00
623	001367	海森药业	483	21,232.68	0.00
624	605507	国邦医药	1,202	21,107.12	0.00
625	301120	新特电气	1,816	21,047.44	0.00
626	301095	广立微	278	20,774.94	0.00
627	300679	电连技术	500	20,750.00	0.00
628	301327	华宝新能	270	20,628.00	0.00
629	601020	华钰矿业	2,000	20,600.00	0.00
630	001227	兰州银行	7,868	20,456.80	0.00
631	605337	李子园	1,434	20,205.06	0.00
632	301301	川宁生物	2,395	20,118.00	0.00
633	600963	岳阳林纸	3,400	20,026.00	0.00
634	600132	重庆啤酒	300	19,935.00	0.00
635	001338	永顺泰	1,649	19,886.94	0.00
636	603383	顶点软件	400	19,720.00	0.00
637	600446	金证股份	1,700	19,669.00	0.00
638	001201	东瑞股份	802	19,360.28	0.00
639	003028	振邦智能	432	19,033.92	0.00

640	688591	泰凌微	660	18,899.55	0.00
641	001319	铭科精技	736	18,819.52	0.00
642	605077	华康股份	865	18,718.60	0.00
643	605089	味知香	511	18,671.94	0.00
644	301348	蓝箭电子	417	18,585.69	0.00
645	605399	晨光新材	1,369	18,563.64	0.00
646	688680	海优新材	282	18,513.30	0.00
647	301311	昆船智能	761	18,492.30	0.00
648	603132	金徽股份	1,342	18,358.56	0.00
649	301238	瑞泰新材	1,043	18,283.79	0.00
650	603363	傲农生物	3,000	18,210.00	0.00
651	605368	蓝天燃气	1,685	18,147.45	0.00
652	603507	振江股份	700	18,137.00	0.00
653	688052	纳芯微	108	18,019.80	0.00
654	001376	百通能源	804	17,897.04	0.00
655	688667	菱电电控	218	17,884.72	0.00
656	601121	宝地矿业	2,532	17,875.92	0.00
657	603191	望变电气	1,149	17,843.97	0.00
658	605286	同力日升	597	17,826.42	0.00
659	301175	中科环保	3,562	17,774.38	0.00
660	688536	思瑞浦	121	17,702.30	0.00
661	603230	内蒙新华	1,140	17,670.00	0.00
662	688359	三孚新科	254	17,498.06	0.00
663	001217	华尔泰	1,239	17,494.68	0.00
664	300853	申昊科技	641	17,435.20	0.00
665	688772	珠海冠宇	789	17,365.89	0.00
666	003019	宸展光电	760	17,176.00	0.00
667	301029	怡合达	665	17,143.70	0.00
668	603220	中贝通信	500	16,980.00	0.00
669	001318	阳光乳业	1,142	16,947.28	0.00
670	605158	华达新材	2,226	16,917.60	0.00
671	688707	振华新材	809	16,584.50	0.00
672	605116	奥锐特	642	16,576.44	0.00
673	603486	科沃斯	400	16,576.00	0.00
674	605060	联德股份	883	16,512.10	0.00
675	605008	长鸿高科	1,039	16,488.93	0.00
676	605305	中际联合	508	16,413.48	0.00
677	001208	华菱线缆	1,754	16,294.66	0.00
678	605339	南侨食品	864	16,269.12	0.00
679	605118	力鼎光电	667	16,134.73	0.00
680	601096	宏盛华源	3,918	15,907.08	0.00
681	300623	捷捷微电	1,000	15,870.00	0.00
682	301268	铭利达	530	15,809.90	0.00

683	002979	雷赛智能	725	15,623.75	0.00
684	605098	行动教育	405	15,612.75	0.00
685	301293	三博脑科	250	15,605.00	0.00
686	003039	顺控发展	1,024	15,523.84	0.00
687	002919	名臣健康	600	15,384.00	0.00
688	001216	华瓷股份	1,177	15,359.85	0.00
689	301127	天源环保	1,385	15,221.15	0.00
690	301058	中粮科工	1,386	15,148.98	0.00
691	605268	王力安防	1,542	15,019.08	0.00
692	688629	华丰科技	682	14,935.80	0.00
693	688435	英方软件	308	14,790.16	0.00
694	605050	福然德	1,197	14,759.01	0.00
695	688045	必易微	344	14,733.52	0.00
696	605169	洪通燃气	1,292	14,638.36	0.00
697	301141	中科磁业	314	14,613.56	0.00
698	601686	友发集团	2,374	14,600.10	0.00
699	605599	菜百股份	980	14,592.20	0.00
700	301187	欧圣电气	732	14,574.12	0.00
701	002840	华统股份	700	14,553.00	0.00
702	605056	咸亨国际	933	14,545.47	0.00
703	301112	信邦智能	484	14,505.48	0.00
704	605277	新亚电子	966	14,432.04	0.00
705	605228	神通科技	1,217	14,372.77	0.00
706	601528	瑞丰银行	2,899	14,350.05	0.00
707	003037	三和管桩	1,274	14,243.32	0.00
708	003029	吉大正元	716	14,112.36	0.00
709	003002	壶化股份	921	13,989.99	0.00
710	300882	万胜智能	572	13,933.92	0.00
711	605333	沪光股份	700	13,930.00	0.00
712	605179	一鸣食品	939	13,897.20	0.00
713	301510	固高科技	395	13,853.45	0.00
714	603305	旭升集团	700	13,811.00	0.00
715	603759	海天股份	1,656	13,761.36	0.00
716	003016	欣贺股份	1,681	13,733.77	0.00
717	688608	恒玄科技	89	13,730.03	0.00
718	300904	威力传动	223	13,721.19	0.00
719	605577	龙版传媒	588	13,718.04	0.00
720	603162	海通发展	774	13,715.28	0.00
721	301328	维峰电子	278	13,610.88	0.00
722	603209	兴通股份	833	13,569.57	0.00
723	688408	中信博	188	13,489.00	0.00
724	605006	山东玻纤	1,942	13,399.80	0.00
725	688152	麒麟信安	191	13,383.37	0.00

726	603237	五芳斋	455	13,331.50	0.00
727	605389	长龄液压	498	13,326.48	0.00
728	003015	日久光电	1,128	13,265.28	0.00
729	603173	福斯达	588	13,241.76	0.00
730	603836	海程邦达	733	12,996.09	0.00
731	002999	天禾股份	1,726	12,945.00	0.00
732	601595	上海电影	500	12,915.00	0.00
733	301132	满坤科技	449	12,890.79	0.00
734	605162	新中港	1,377	12,654.63	0.00
735	605099	共创草坪	624	12,592.32	0.00
736	000425	徐工机械	2,300	12,558.00	0.00
737	605058	澳弘电子	548	12,554.68	0.00
738	605500	森林包装	1,579	12,521.47	0.00
739	001229	魅视科技	347	12,353.20	0.00
740	301222	浙江恒威	415	12,337.95	0.00
741	605086	龙高股份	443	12,310.97	0.00
742	001278	一彬科技	473	12,260.16	0.00
743	688320	禾川科技	297	12,177.00	0.00
744	301217	铜冠铜箔	1,023	12,132.78	0.00
745	605365	立达信	645	12,003.45	0.00
746	605378	野马电池	473	11,981.09	0.00
747	603176	汇通集团	1,924	11,890.32	0.00
748	603231	索宝蛋白	515	11,889.92	0.00
749	003013	地铁设计	724	11,866.36	0.00
750	603057	紫燕食品	549	11,847.42	0.00
751	301489	思泉新材	173	11,837.88	0.00
752	301135	瑞德智能	476	11,814.32	0.00
753	603282	亚光股份	457	11,808.88	0.00
754	301207	华兰疫苗	424	11,787.20	0.00
755	605066	天正电气	1,278	11,732.04	0.00
756	605028	世茂能源	615	11,685.00	0.00
757	601279	英利汽车	2,004	11,683.32	0.00
758	301358	湖南裕能	343	11,644.85	0.00
759	001207	联科科技	682	11,628.10	0.00
760	605177	东亚药业	439	11,624.72	0.00
761	688573	信宇人	397	11,545.60	0.00
762	603097	江苏华辰	477	11,443.23	0.00
763	003010	若羽臣	562	11,386.12	0.00
764	301152	天力锂能	307	11,230.06	0.00
765	603112	华翔股份	920	11,178.00	0.00
766	605005	合兴股份	634	11,120.36	0.00
767	002400	省广集团	2,000	11,100.00	0.00
768	301151	冠龙节能	542	11,094.74	0.00

769	605080	浙江自然	524	11,093.08	0.00
770	605199	葫芦娃	726	11,006.16	0.00
771	300918	南山智尚	1,063	10,980.79	0.00
772	605566	福莱蒾特	435	10,962.00	0.00
773	003018	金富科技	1,027	10,937.55	0.00
774	300996	普联软件	477	10,923.30	0.00
775	605100	华丰股份	685	10,898.35	0.00
776	301298	东利机械	640	10,880.00	0.00
777	605183	确成股份	741	10,840.83	0.00
778	301367	怡和嘉业	89	10,835.75	0.00
779	301318	维海德	306	10,835.46	0.00
780	002918	蒙娜丽莎	800	10,832.00	0.00
781	002998	优彩资源	1,353	10,756.35	0.00
782	001317	三羊马	300	10,695.00	0.00
783	688378	奥来德	225	10,651.50	0.00
784	605580	恒盛能源	916	10,643.92	0.00
785	001366	播恩集团	645	10,623.15	0.00
786	001313	粤海饲料	1,232	10,619.84	0.00
787	001219	青岛食品	460	10,603.00	0.00
788	002843	泰嘉股份	400	10,600.00	0.00
789	301199	迈赫股份	398	10,447.50	0.00
790	301421	波长光电	175	10,389.75	0.00
791	301259	艾布鲁	628	10,380.84	0.00
792	003030	祖名股份	480	10,368.00	0.00
793	601916	浙商银行	4,110	10,357.20	0.00
794	301302	华如科技	412	10,345.32	0.00
795	301381	赛维时代	347	10,302.43	0.00
796	301285	鸿日达	643	10,275.14	0.00
797	003042	中农联合	546	10,144.68	0.00
798	001266	宏英智能	346	10,137.80	0.00
799	002472	双环传动	389	10,121.78	0.00
800	003001	中岩大地	560	10,119.20	0.00
801	688233	神工股份	286	10,092.94	0.00
802	605318	法狮龙	628	10,091.96	0.00
803	301269	华大九天	95	10,055.75	0.00
804	603219	富佳股份	739	10,020.84	0.00
805	605488	福莱新材	603	10,009.80	0.00
806	605289	罗曼股份	174	10,005.00	0.00
807	301516	中远通	633	9,983.13	0.00
808	001206	依依股份	629	9,925.62	0.00
809	301288	清研环境	516	9,793.68	0.00
810	301171	易点天下	493	9,746.61	0.00
811	300045	华力创通	400	9,732.00	0.00

812	301300	远翔新材	307	9,710.41	0.00
813	603280	南方路机	363	9,706.62	0.00
814	301179	泽宇智能	374	9,705.30	0.00
815	301200	大族数控	255	9,631.35	0.00
816	003036	泰坦股份	776	9,622.40	0.00
817	301413	安培龙	164	9,543.16	0.00
818	001296	长江材料	403	9,482.59	0.00
819	001331	胜通能源	539	9,410.94	0.00
820	301272	英华特	175	9,395.08	0.00
821	605259	绿田机械	413	9,375.10	0.00
822	003004	声迅股份	306	9,323.82	0.00
823	301111	粤万年青	379	9,308.24	0.00
824	605018	长华集团	840	9,307.20	0.00
825	605255	天普股份	530	9,301.50	0.00
826	002996	顺博合金	849	9,271.08	0.00
827	688290	景业智能	193	9,219.61	0.00
828	688523	航天环宇	343	9,199.26	0.00
829	300394	天孚通信	100	9,152.00	0.00
830	001238	浙江正特	374	9,114.38	0.00
831	605180	华生科技	649	9,086.00	0.00
832	688095	福昕软件	130	9,080.50	0.00
833	001288	运机集团	537	9,032.34	0.00
834	301558	三态股份	674	9,031.60	0.00
835	605196	华通线缆	1,172	9,024.40	0.00
836	605300	佳禾食品	576	9,020.16	0.00
837	001299	美能能源	576	8,945.28	0.00
838	001222	源飞宠物	607	8,922.90	0.00
839	300866	安克创新	100	8,860.00	0.00
840	301382	蜂助手	248	8,833.76	0.00
841	001368	通达创智	351	8,806.59	0.00
842	001230	劲旅环境	375	8,797.50	0.00
843	605007	五洲特纸	598	8,796.58	0.00
844	688580	伟思医疗	137	8,758.41	0.00
845	301428	世纪恒通	226	8,734.90	0.00
846	301359	东南电子	328	8,728.08	0.00
847	301228	实朴检测	521	8,638.18	0.00
848	603213	镇洋发展	799	8,621.21	0.00
849	605136	丽人丽妆	867	8,591.97	0.00
850	601028	玉龙股份	800	8,568.00	0.00
851	301116	益客食品	664	8,512.48	0.00
852	301297	富乐德	315	8,492.40	0.00
853	003041	真爱美家	503	8,374.95	0.00
854	301270	汉仪股份	210	8,347.50	0.00

855	301316	慧博云通	359	8,343.16	0.00
856	301206	三元生物	287	8,288.56	0.00
857	605287	德才股份	488	8,281.36	0.00
858	301138	华研精机	285	8,265.00	0.00
859	301282	金禄电子	330	8,246.70	0.00
860	605055	迎丰股份	1,146	8,193.90	0.00
861	001234	泰慕士	333	8,145.18	0.00
862	603291	联合水务	536	8,141.84	0.00
863	688172	燕东微	438	8,094.24	0.00
864	301193	家联科技	475	8,065.50	0.00
865	001202	炬申股份	459	8,064.63	0.00
866	603182	嘉华股份	546	8,064.42	0.00
867	603065	宿迁联盛	581	8,006.18	0.00
868	301190	善水科技	420	7,967.40	0.00
869	688375	国博电子	100	7,953.00	0.00
870	605567	春雪食品	629	7,931.69	0.00
871	301459	丰茂股份	199	7,928.16	0.00
872	605298	必得科技	508	7,919.72	0.00
873	301233	盛帮股份	176	7,817.92	0.00
874	003023	彩虹集团	385	7,800.10	0.00
875	001314	亿道信息	108	7,768.44	0.00
876	605069	正和生态	790	7,757.80	0.00
877	688702	盛科通信-U	158	7,753.71	0.00
878	002992	宝明科技	99	7,722.00	0.00
879	300073	当升科技	200	7,640.00	0.00
880	605033	美邦股份	423	7,592.85	0.00
881	605155	西大门	490	7,585.20	0.00
882	688035	德邦科技	142	7,577.12	0.00
883	301163	宏德股份	277	7,506.70	0.00
884	603272	联翔股份	443	7,477.84	0.00
885	605303	园林股份	610	7,442.00	0.00
886	300031	宝通科技	400	7,416.00	0.00
887	001210	金房能源	373	7,366.75	0.00
888	301197	工大科雅	391	7,346.89	0.00
889	603150	万朗磁塑	250	7,262.50	0.00
890	688693	锆威特	163	7,123.77	0.00
891	301388	欣灵电气	292	7,121.88	0.00
892	688400	凌云光	263	7,101.00	0.00
893	301231	荣信文化	275	6,998.75	0.00
894	301161	唯万密封	346	6,996.12	0.00
895	301296	新巨丰	673	6,931.90	0.00
896	688147	微导纳米	175	6,823.25	0.00
897	688677	海泰新光	127	6,760.21	0.00

898	002049	紫光国微	100	6,745.00	0.00
899	002387	维信诺	600	6,726.00	0.00
900	301319	唯特偶	115	6,717.15	0.00
901	301166	优宁维	174	6,685.08	0.00
902	301507	民生健康	417	6,609.45	0.00
903	301533	威马农机	199	6,598.84	0.00
904	301383	天键股份	100	6,500.00	0.00
905	688097	博众精工	190	6,384.00	0.00
906	688671	碧兴物联	185	6,345.50	0.00
907	688620	安凯微	533	6,300.06	0.00
908	601088	中国神华	200	6,270.00	0.00
909	002169	智光电气	900	6,192.00	0.00
910	688539	高华科技	141	6,175.80	0.00
911	301158	德石股份	383	6,162.47	0.00
912	601952	苏垦农发	600	6,144.00	0.00
913	688161	威高骨科	147	6,093.15	0.00
914	301267	华夏眼科	188	6,032.92	0.00
915	688119	中钢洛耐	1,228	5,992.64	0.00
916	688665	四方光电	81	5,974.56	0.00
917	688316	青云科技-U	115	5,955.85	0.00
918	688248	南网科技	237	5,917.89	0.00
919	301115	建科股份	330	5,907.00	0.00
920	600406	国电南瑞	264	5,892.48	0.00
921	688127	蓝特光学	248	5,775.92	0.00
922	300213	佳讯飞鸿	800	5,760.00	0.00
923	300693	盛弘股份	190	5,682.90	0.00
924	688223	晶科能源	635	5,626.10	0.00
925	300339	润和软件	216	5,611.68	0.00
926	605138	盛泰集团	723	5,603.25	0.00
927	002871	伟隆股份	500	5,590.00	0.00
928	300850	新强联	170	5,411.10	0.00
929	688237	超卓航科	143	5,402.54	0.00
930	301198	喜悦智行	443	5,378.02	0.00
931	301418	协昌科技	107	5,371.40	0.00
932	688697	纽威数控	284	5,347.72	0.00
933	301498	乖宝宠物	137	5,316.97	0.00
934	688631	莱斯信息	150	5,287.50	0.00
935	603087	甘李药业	100	5,265.00	0.00
936	300958	建工修复	300	5,217.00	0.00
937	301550	斯菱股份	119	5,184.83	0.00
938	688600	皖仪科技	256	5,171.20	0.00
939	688253	英诺特	206	5,152.06	0.00
940	301349	信德新材	104	4,896.32	0.00

941	688699	明微电子	121	4,882.35	0.00
942	603885	吉祥航空	400	4,800.00	0.00
943	688335	复洁环保	367	4,708.61	0.00
944	301100	风光股份	227	4,603.56	0.00
945	600547	山东黄金	200	4,574.00	0.00
946	688663	新风光	161	4,514.44	0.00
947	300781	因赛集团	100	4,500.00	0.00
948	603052	可川科技	100	4,358.00	0.00
949	688689	银河微电	156	4,347.72	0.00
950	002372	伟星新材	300	4,341.00	0.00
951	002460	赣锋锂业	100	4,280.00	0.00
952	301170	锡南科技	138	4,199.34	0.00
953	000733	振华科技	71	4,177.64	0.00
954	002929	润建股份	100	4,173.00	0.00
955	688148	芳源股份	543	4,164.81	0.00
956	601012	隆基绿能	180	4,122.00	0.00
957	688313	仕佳光子	322	4,092.62	0.00
958	000921	海信家电	200	4,080.00	0.00
959	000920	沃顿科技	400	3,972.00	0.00
960	688456	有研粉材	141	3,971.97	0.00
961	300855	图南股份	130	3,926.00	0.00
962	300884	狄耐克	300	3,924.00	0.00
963	688345	博力威	123	3,869.58	0.00
964	600223	福瑞达	400	3,852.00	0.00
965	300604	长川科技	100	3,799.00	0.00
966	002414	高德红外	520	3,796.00	0.00
967	688683	莱尔科技	146	3,734.68	0.00
968	000833	粤桂股份	600	3,714.00	0.00
969	002876	三利谱	100	3,677.00	0.00
970	301360	荣旗科技	38	3,556.80	0.00
971	301307	美利信	100	3,469.00	0.00
972	300890	翔丰华	100	3,458.00	0.00
973	002223	鱼跃医疗	100	3,458.00	0.00
974	003038	鑫铂股份	100	3,435.00	0.00
975	002601	龙佰集团	200	3,426.00	0.00
976	000977	浪潮信息	100	3,320.00	0.00
977	000651	格力电器	100	3,217.00	0.00
978	688661	和林微纳	70	3,207.40	0.00
979	688231	隆达股份	145	3,191.45	0.00
980	688786	悦安新材	71	3,155.24	0.00
981	603666	亿嘉和	100	3,139.00	0.00
982	688171	纬德信息	131	2,947.50	0.00
983	300926	博俊科技	100	2,933.00	0.00

984	688265	南模生物	76	2,922.20	0.00
985	688353	华盛锂电	106	2,904.40	0.00
986	688268	华特气体	43	2,897.34	0.00
987	000915	华特达因	100	2,896.00	0.00
988	600570	恒生电子	100	2,876.00	0.00
989	300252	金信诺	300	2,769.00	0.00
990	688255	凯尔达	112	2,738.40	0.00
991	603273	天元智能	143	2,712.71	0.00
992	300548	博创科技	100	2,697.00	0.00
993	300814	中富电路	80	2,696.00	0.00
994	688722	同益中	176	2,692.80	0.00
995	688141	杰华特	97	2,683.02	0.00
996	301219	腾远钴业	68	2,677.16	0.00
997	002041	登海种业	200	2,646.00	0.00
998	301021	英诺激光	99	2,604.69	0.00
999	000932	华菱钢铁	500	2,575.00	0.00
1,000	688425	铁建重工	647	2,568.59	0.00
1,001	600522	中天科技	200	2,498.00	0.00
1,002	301046	能辉科技	91	2,467.92	0.00
1,003	688776	国光电气	23	2,239.97	0.00
1,004	002605	姚记科技	100	2,222.00	0.00
1,005	688768	容知日新	59	2,171.79	0.00
1,006	001269	欧晶科技	40	2,138.00	0.00
1,007	001336	楚环科技	74	2,125.28	0.00
1,008	688718	唯赛勃	142	2,121.48	0.00
1,009	600316	洪都航空	100	2,117.00	0.00
1,010	301277	新天地	98	2,039.38	0.00
1,011	002142	宁波银行	100	2,011.00	0.00
1,012	000938	紫光股份	100	1,935.00	0.00
1,013	301069	凯盛新材	86	1,842.12	0.00
1,014	688296	和达科技	99	1,779.03	0.00
1,015	002351	漫步者	100	1,767.00	0.00
1,016	605189	富春染织	107	1,733.40	0.00
1,017	603130	云中马	80	1,724.00	0.00
1,018	002037	保利联合	200	1,722.00	0.00
1,019	002997	瑞鹄模具	51	1,699.32	0.00
1,020	300229	拓尔思	100	1,686.00	0.00
1,021	300994	久祺股份	114	1,675.80	0.00
1,022	002708	光洋股份	200	1,656.00	0.00
1,023	301133	金钟股份	60	1,654.20	0.00
1,024	301220	亚香股份	49	1,619.45	0.00
1,025	603733	仙鹤股份	100	1,614.00	0.00
1,026	300796	贝斯美	100	1,610.00	0.00

1,027	688628	优利德	40	1,576.00	0.00
1,028	600096	云天化	100	1,560.00	0.00
1,029	300614	百川畅银	83	1,554.59	0.00
1,030	002101	广东鸿图	100	1,523.00	0.00
1,031	000948	南天信息	100	1,507.00	0.00
1,032	688208	道通科技	62	1,472.50	0.00
1,033	600746	江苏索普	200	1,464.00	0.00
1,034	001311	多利科技	29	1,435.79	0.00
1,035	000960	锡业股份	100	1,432.00	0.00
1,036	600508	上海能源	100	1,386.00	0.00
1,037	300932	三友联众	85	1,383.80	0.00
1,038	002345	潮宏基	200	1,362.00	0.00
1,039	603048	浙江黎明	64	1,188.48	0.00
1,040	605555	德昌股份	52	1,188.20	0.00
1,041	300611	美力科技	100	1,149.00	0.00
1,042	001231	农心科技	55	1,145.65	0.00
1,043	002908	德生科技	80	1,140.80	0.00
1,044	300925	法本信息	95	1,116.25	0.00
1,045	300997	欢乐家	79	1,103.63	0.00
1,046	600867	通化东宝	100	1,083.00	0.00
1,047	300879	大叶股份	60	1,039.20	0.00
1,048	605208	永茂泰	105	997.50	0.00
1,049	300973	立高食品	20	971.00	0.00
1,050	601991	大唐发电	400	968.00	0.00
1,051	301052	果麦文化	20	875.60	0.00
1,052	689009	九号公司-WD	28	830.48	0.00
1,053	301012	扬电科技	38	767.60	0.00
1,054	601800	中国交建	100	760.00	0.00
1,055	300864	南大环境	33	723.03	0.00
1,056	300253	卫宁健康	100	719.00	0.00
1,057	605358	立昂微	26	712.14	0.00
1,058	301180	万祥科技	36	651.24	0.00
1,059	300946	恒而达	20	645.40	0.00
1,060	301066	万事利	50	644.00	0.00
1,061	603233	大参林	24	597.60	0.00
1,062	600409	三友化工	100	549.00	0.00
1,063	301015	百洋医药	14	502.04	0.00
1,064	605133	嵘泰股份	18	498.06	0.00
1,065	301091	深城交	21	481.95	0.00
1,066	301078	孩子王	56	459.76	0.00
1,067	000690	宝新能源	100	443.00	0.00
1,068	688569	铁科轨道	16	441.76	0.00
1,069	000875	吉电股份	100	440.00	0.00

1,070	600376	首开股份	100	304.00	0.00
1,071	301155	海力风电	5	295.75	0.00
1,072	688093	世华科技	16	291.36	0.00
1,073	300891	惠云钛业	25	242.50	0.00
1,074	300968	格林精密	20	241.60	0.00
1,075	301028	东亚机械	19	222.87	0.00
1,076	301020	密封科技	10	217.30	0.00
1,077	301126	达嘉维康	15	195.45	0.00
1,078	300940	南极光	9	173.52	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	603596	伯特利	20,797,122.96	6.93
2	002648	卫星化学	16,419,557.03	5.47
3	688008	澜起科技	12,009,734.83	4.00
4	688595	芯海科技	11,733,173.81	3.91
5	603728	鸣志电器	11,191,059.10	3.73
6	301191	菲菱科思	10,947,830.86	3.65
7	002920	德赛西威	10,845,540.00	3.61
8	601633	长城汽车	10,620,612.00	3.54
9	000625	长安汽车	9,789,853.31	3.26
10	603000	人民网	9,728,730.23	3.24
11	600418	江淮汽车	9,128,463.00	3.04
12	301039	中集车辆	9,034,456.00	3.01
13	600150	中国船舶	8,306,334.00	2.77
14	301313	凡拓数创	8,258,553.00	2.75
15	002371	北方华创	8,108,371.00	2.70
16	688533	上声电子	8,094,022.04	2.70
17	300858	科拓生物	8,055,778.72	2.68
18	002517	恺英网络	7,983,457.50	2.66
19	301363	美好医疗	7,517,616.00	2.50
20	300782	卓胜微	7,314,412.00	2.44
21	601636	旗滨集团	7,288,138.90	2.43
22	000063	中兴通讯	7,230,394.16	2.41
23	688012	中微公司	7,133,292.87	2.38
24	688006	杭可科技	7,007,883.13	2.33
25	002236	大华股份	6,981,769.00	2.33
26	688737	中自科技	6,865,866.41	2.29
27	601799	星宇股份	6,794,065.64	2.26
28	688205	德科立	6,739,040.23	2.24
29	002180	纳思达	6,589,714.06	2.19

30	688166	博瑞医药	6,567,176.75	2.19
31	002555	三七互娱	6,226,338.77	2.07
32	600845	宝信软件	6,217,692.22	2.07
33	300496	中科创达	6,189,757.00	2.06
34	603997	继峰股份	6,161,517.00	2.05
35	002011	盾安环境	6,091,914.00	2.03
36	688617	惠泰医疗	6,089,689.85	2.03

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	002011	盾安环境	15,788,013.31	5.26
2	688279	峰昭科技	11,607,611.01	3.87
3	002371	北方华创	11,567,843.60	3.85
4	301039	中集车辆	10,186,275.12	3.39
5	002648	卫星化学	8,975,723.26	2.99
6	688617	惠泰医疗	8,434,079.34	2.81
7	601633	长城汽车	8,238,492.00	2.74
8	300014	亿纬锂能	8,103,045.00	2.70
9	002459	晶澳科技	8,099,238.44	2.70
10	300498	温氏股份	8,038,137.00	2.68
11	603348	文灿股份	7,928,862.37	2.64
12	300858	科拓生物	7,817,937.03	2.60
13	002493	荣盛石化	7,640,347.00	2.54
14	688235	百济神州-U	7,316,551.18	2.44
15	600845	宝信软件	7,039,416.40	2.34
16	688006	杭可科技	6,499,702.55	2.16
17	603596	伯特利	6,423,801.00	2.14
18	601799	星宇股份	6,402,304.00	2.13
19	301191	菲菱科思	6,119,948.32	2.04
20	688008	澜起科技	6,096,659.15	2.03
21	603032	德新科技	6,065,128.84	2.02

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,440,495,655.90
卖出股票收入（成交）总额	1,134,399,428.77

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	190,766.71	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	190,766.71	0.03

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113661	福 22 转债	1,660	174,825.06	0.03
2	113059	福莱转债	150	15,941.65	0.00

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

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

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	105,114.43
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	30,419.36
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	135,533.79

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113661	福 22 转债	174,825.06	0.03
2	113059	福莱转债	15,941.65	0.00

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 (%)

16,463	35,078.19	397,721,568.50	68.87	179,770,627.54	31.13
--------	-----------	----------------	-------	----------------	-------

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	649,446.70	0.1125

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（2017年9月6日）基 金份额总额	491,760,953.62
本报告期期初基金份额总额	190,440,874.18
本报告期基金总申购份额	419,092,952.63
减：本报告期基金总赎回份额	32,041,630.77
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	577,492,196.04

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

无。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的，与本基金管理人、基金财产、

基金托管业务相关的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未改聘为本基金审计的会计师事务所。本年度应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用 50,000.00 元，该审计机构已提供审计服务的年限为 7 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：无。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
国信证券	2	656,588,520.93	25.61	605,826.96	26.54	-
国盛证券	1	458,721,114.12	17.90	378,047.74	16.56	-
中金公司	1	355,619,875.56	13.87	328,224.59	14.38	-
华西证券	1	286,338,807.74	11.17	236,921.22	10.38	-
招商证券	1	253,635,308.54	9.89	234,284.44	10.26	-
中泰证券	1	194,066,064.11	7.57	179,523.20	7.87	-
兴业证券	1	126,043,913.11	4.92	116,263.94	5.09	-
国泰君安	1	112,335,252.10	4.38	103,495.02	4.53	-
国元证券	1	92,641,236.85	3.61	76,954.00	3.37	-
东吴证券	1	27,409,175.7	1.07	22,911.49	1.00	-

		2				
海通证券	1	-	-	-	-	本报告期新增
平安证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券	2	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-

注：交易单元选择的标准和程序：

1) 基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其交易单元作为基金的专用交易单元，选择的标准是：

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

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

2) 选择交易单元的程序：

我公司根据上述标准，选定符合条件的证券公司作为租用交易单元的对象。我公司投研部门定期对所选定证券公司的服务进行综合评比，评比内容包括：提供研究报告质量、数量、及时性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(%)
国信证券	-	-	581,099,000.00	54.00	-	-

国盛证 券	-	-	251,373,000. 00	23.36	-	-
中金公 司	-	-	222,087,000. 00	20.64	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	21,574,000.0 0	2.00	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
国泰君 安	-	-	-	-	-	-
国元证 券	-	-	-	-	-	-
东吴证 券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源证券	-	-	-	-	-	-
世纪证 券	-	-	-	-	-	-
西部证 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	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023年01月04日
2	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	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023年01月05日
3	鹏华策略回报灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023年01月20日
4	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购中润光学首次公开发行 A 股的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023年02月10日
5	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	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会	2023年03月14日

	申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告	基金电子披露网站	
6	鹏华策略回报灵活配置混合型证券投资基金 2022 年年度报告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 03 月 30 日
7	鹏华基金管理有限公司关于新增人民币直销资金专户的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 04 月 07 日
8	鹏华策略回报灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 04 月 21 日
9	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购航天软件首次公开发行 A 股的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 05 月 17 日
10	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	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 05 月 19 日
11	鹏华基金管理有限公司关于注意防范以协助办理贷款为借口进行诈骗活动的风险提示	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 06 月 03 日
12	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与国海证券股份有限公司申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 06 月 05 日
13	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 06 月 06 日
14	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	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 06 月 20 日
15	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购豪恩汽电首次公开发行 A 股的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 06 月 28 日
16	鹏华策略回报灵活配置混合型证券投资基金托管协议	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 07 月 08 日
17	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	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 07 月 08 日
18	鹏华策略回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 07 月 08 日
19	鹏华策略回报灵活配置混合型证券投	《中国证券报》、基金管	2023 年 07 月 12 日

	资基金基金产品资料概要（更新）	理人网站及中国证监会 基金电子披露网站	
20	鹏华策略回报灵活配置混合型证券投资 基金更新的招募说明书（2023 年第 1 号）	《中国证券报》、基金管 理人网站及中国证监会 基金电子披露网站	2023 年 07 月 12 日
21	鹏华策略回报灵活配置混合型证券投资 基金 2023 年第 2 季度报告	《中国证券报》、基金管 理人网站及中国证监会 基金电子披露网站	2023 年 07 月 20 日
22	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	《中国证券报》、基金管 理人网站及中国证监会 基金电子披露网站	2023 年 08 月 07 日
23	鹏华基金管理有限公司关于运用固有 资金投资旗下基金的公告	《中国证券报》、基金管 理人网站及中国证监会 基金电子披露网站	2023 年 08 月 21 日
24	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金 持有的股票停牌后估值方法变更的提 示性公告	《中国证券报》、基金管 理人网站及中国证监会 基金电子披露网站	2023 年 08 月 22 日
25	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分 基金申购金帝股份首次公开发行 A 股 的公告	《中国证券报》、基金管 理人网站及中国证监会 基金电子披露网站	2023 年 08 月 26 日
26	鹏华策略回报灵活配置混合型证券投资 基金 2023 年中期报告	《中国证券报》、基金管 理人网站及中国证监会 基金电子披露网站	2023 年 08 月 30 日
27	鹏华策略回报灵活配置混合型证券投资 基金基金产品资料概要（更新）	《中国证券报》、基金管 理人网站及中国证监会 基金电子披露网站	2023 年 09 月 07 日
28	鹏华策略回报灵活配置混合型证券投资 基金更新的招募说明书	《中国证券报》、基金管 理人网站及中国证监会 基金电子披露网站	2023 年 09 月 07 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	《中国证券报》、基金管 理人网站及中国证监会 基金电子披露网站	2023 年 09 月 27 日
30	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《中国证券报》、基金管 理人网站及中国证监会 基金电子披露网站	2023 年 10 月 13 日
31	鹏华策略回报灵活配置混合型证券投资 基金 2023 年第 3 季度报告	《中国证券报》、基金管 理人网站及中国证监会 基金电子披露网站	2023 年 10 月 24 日
32	鹏华基金管理有限公司关于运用固有 资金投资旗下基金的公告	《中国证券报》、基金管 理人网站及中国证监会 基金电子披露网站	2023 年 11 月 07 日
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	《中国证券报》、基金管 理人网站及中国证监会	2023 年 11 月 16 日

	(含定期定额投资)费率优惠活动的公告	基金电子披露网站	
34	鹏华基金管理有限公司关于鹏华策略回报灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第 1 次分红公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 12 月 23 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	20231122~20231231	0.00	135,592,542.37	0.00	135,592,542.37	23.48
	2	20231124~20231231	0.00	136,217,535.03	0.00	136,217,535.03	23.59
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)《鹏华策略回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- (二)《鹏华策略回报灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- (三)《鹏华策略回报灵活配置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