

鹏华量化先锋混合型证券投资基金

2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2025 年 8 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 08 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 01 月 01 日起至 2025 年 06 月 30 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 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
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	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	57
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	57
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	57

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	57
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	57
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	57
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	57
7.12 投资组合报告附注	58
§ 8 基金份额持有人信息.....	58
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	58
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	59
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	59
§ 9 开放式基金份额变动.....	59
§ 10 重大事件揭示	59
10.1 基金份额持有人大会决议	59
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	60
10.4 基金投资策略的改变	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	60
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	60
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	60
10.8 其他重大事件	64
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	65
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况	65
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	65
§ 12 备查文件目录	65
12.1 备查文件目录	65
12.2 存放地点	66
12.3 查阅方式	66

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华量化先锋混合型证券投资基金
基金简称	鹏华量化先锋混合
基金主代码	005632
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 2 月 23 日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	53,886,323.53 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过运用量化选股策略，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>本基金采用数量化模型驱动的选股策略为主导投资策略，结合适当的资产配置策略，并依靠严格的投资纪律和风险控制，以保证在控制风险的前提下实现收益最大化。</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金通过对宏观环境和政策导向的分析等构建数量化模型，以对大类资产风险收益状态、投资者行为、市场情绪、市场风险偏好等进行系统分析和评估。本基金根据基本面分析框架、现代投资组合理论以及风险预算模型对大类资产进行综合评估，确定大类资产配置权重，同时合理使用金融工具实现对组合风险暴露的动态调整。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金对股票的投资采用“自上而下”的行业配置策略以及“自下而上”的量化选股策略，在纪律化模型约束下，根据市场变化趋势，对模型进行动态调整。</p> <p>(1) 行业配置策略</p> <p>本基金的行业配置策略综合考虑行业的基本面、现代投资组合理论以及风险预算模型，结合定性和定量分析作出行业配置决策，在基金整体风险水平可控的前提下，实现各行业的合理配置和优化。</p> <p>(2) 量化选股策略</p> <p>本基金将以多因子选股策略构建股票投资组合。多因子选股策略的信息主要来自于基本面、预期数据、市场交易数据等，每一类信息代表一种选股逻辑。在不同的市场环境下，选股逻辑会有不同的侧重点。基于不同的选股逻辑，构建个股维度的多因子选股策略，包括价值、基本面、市场、成长、预期等，并对因子的有效性进行情景分析和动态监控，筛选出有效因子组合，构建股票资产组合。</p>

	<p>本基金在股票投资组合构建完成后，将根据个股价格波动、风险收益变化的实际情况，定期或不定期调整个股权重，以确保整个股票组合的风险处于可控范围内。</p> <p>(3) 存托凭证投资策略</p> <p>本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>本基金债券投资将采取久期策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、个券选择策略、信用策略、中小企业私募债投资策略等积极投资策略，灵活地调整组合的券种搭配，精选安全边际较高的个券。</p> <p>(1) 久期策略</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>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>(7) 中小企业私募债投资策略</p> <p>本基金将深入研究发行人资信及公司运营情况，与中小企业私募债券承销券商紧密合作，合理合规合格地进行中小企业私募债券投资。本基金在投资过程中密切监控债券信用等级或发行人信用等级变化情况，力求规避可能存在的债券违约，并获取超额收益。</p> <p>4、权证投资策略</p> <p>本基金通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型及价值挖掘策略、价差策略、双向权证策略等寻求权证的合理估值水平，追求稳定的当期收益。</p> <p>5、股指期货投资策略</p> <p>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</p>
--	--

	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。 6、资产支持证券的投资策略 本基金将综合运用战略资产配置和战术资产配置进行资产支持证券的投资组合管理，并根据信用风险、利率风险和流动性风险变化积极调整投资策略，严格遵守法律法规和基金合同的约定，在保证本金安全和基金资产流动性的基础上获得稳定收益。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金属于混合型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。

注：无。

2.3 基金管理人和基金托管人

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

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	鹏华基金管理有限公司	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2025 年 1 月 1 日-2025 年 6 月 30 日)
---------------	-------------------------------------

本期已实现收益	12,401,041.70
本期利润	12,301,392.63
加权平均基金份额本期利润	0.1779
本期加权平均净值利润率	14.62%
本期基金份额净值增长率	14.62%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025年6月30日)
期末可供分配利润	41,278,468.49
期末可供分配基金份额利润	0.7660
期末基金资产净值	71,770,892.78
期末基金份额净值	1.3319
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025年6月30日)
基金份额累计净值增长率	57.31%

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

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

(3) 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润期末余额和未分配利润中已实现部分的期末余额的孰低数。表中的“期末”均指报告期最后一日，即 6 月 30 日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

3.2 基金净值表现

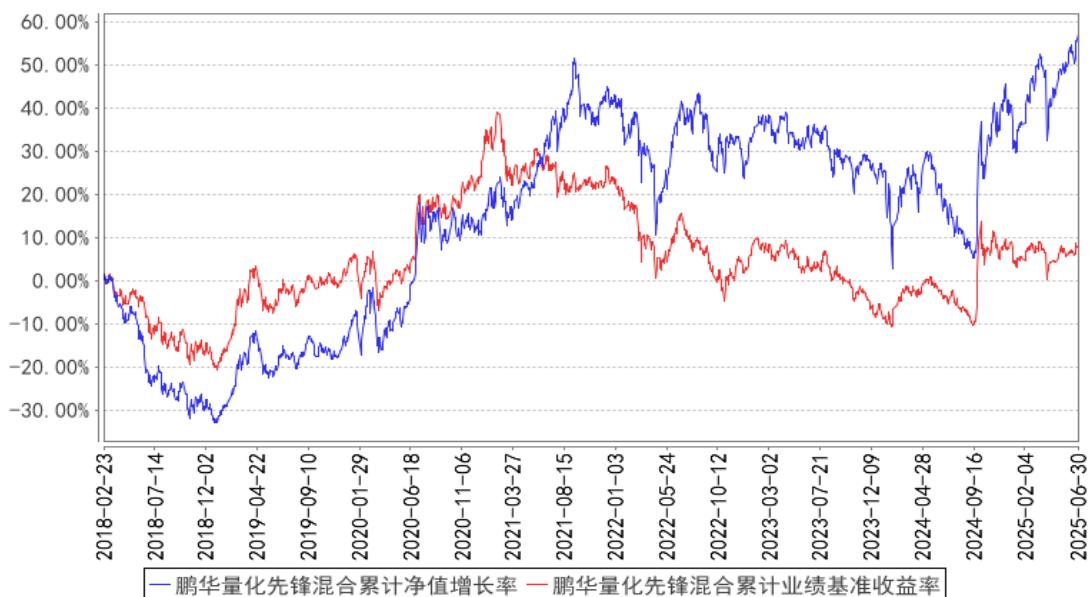
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	5.12%	0.71%	2.12%	0.46%	3.00%	0.25%
过去三个月	6.95%	1.57%	1.46%	0.86%	5.49%	0.71%
过去六个月	14.62%	1.36%	0.36%	0.80%	14.26%	0.56%
过去一年	33.78%	1.58%	12.46%	1.10%	21.32%	0.48%
过去三年	13.09%	1.30%	-6.25%	0.88%	19.34%	0.42%
自基金合同生效起至今	57.31%	1.29%	8.07%	0.99%	49.24%	0.30%

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

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

鹏华量化先锋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 2018 年 02 月 23 日生效。2、截至建仓期结束，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

3.3 其他指标

注：无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

鹏华基金管理有限公司成立于 1998 年 12 月 22 日，业务范围包括基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。截至本报告期末，公司股东由国信证券股份有限公司、意大利欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）、深圳市北融信投资发展有限公司组成，公司性质为中外合资企业，公司注册资本 15,000 万元人民币。截至本报告期末，公司管理资产总规模达到 12,513 亿元，359 只公募基金、12 只全国社保投资组合、8 只基本养老保险投资组合。经过 20 余年投资管理基金，在基金投资、风险控制等方面积累了丰富经验。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理)期限		证券从 业年限	说明
		任职日期	离任日期		
苏俊杰	本基金的基金经理	2021-03-05	2025-01-14	13 年	苏俊杰先生，国籍中国，理学硕士，13 年证券从业经验。曾任 MSCI INC. 分析师，

				华泰柏瑞基金管理有限公司专户投资经理，财通基金管理有限公司基金经理。2019 年 07 月加盟鹏华基金管理有限公司，历任量化及衍生品投资部副总经理，现担任指数与量化投资部总经理/基金经理。2021 年 03 月至 2025 年 01 月担任鹏华量化先锋混合型证券投资基金基金经理，2021 年 03 月至今担任鹏华沪深 300 指数增强型证券投资基金基金经理，2022 年 01 月至今担任鹏华中证 500 指数增强型证券投资基金基金经理，2022 年 08 月至 2023 年 12 月担任鹏华沪深 300 指数证券投资基金(LOF)基金经理，2022 年 08 月至 2023 年 08 月担任鹏华创业板指型证券投资基金(LOF)基金经理，2022 年 08 月至 2023 年 08 月担任鹏华中证 500 指数证券投资基金(LOF)基金经理，2022 年 12 月至今担任鹏华上证科创板 50 成份增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2022 年 12 月至今担任鹏华创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2022 年 12 月至今担任鹏华中证 1000 指数增强型证券投资基金基金经理，2023 年 02 月至今担任鹏华国证 2000 指数增强型证券投资基金基金经理，2023 年 06 月至今担任鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2023 年 08 月至今担任鹏华创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2023 年 09 月至 2024 年 10 月担任鹏华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2023 年 09 月至今担任鹏华上证科创板 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2023 年 12 月至今担任鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2023 年 12 月至今担任鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2024 年 01 月至 2025 年 06 月担任鹏华智投 800 混合型证券投资基金基金经理，2024 年 05 月至今担任鹏华智投数字经济混合型证券投资基金基金经理，2024 年 06 月至今担任鹏华中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2025 年
--	--	--	--	---

					02 月至今担任鹏华沪深 300 指数量化增强型证券投资基金基金经理，2025 年 02 月至今担任鹏华上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2025 年 04 月至今担任鹏华上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2025 年 04 月至今担任鹏华中证 A500 指数增强型证券投资基金基金经理，苏俊杰先生具备基金从业资格。
时贊超	本基金的基金经理	2024-12-28	-	7 年	时贊超先生，国籍中国，工学硕士，7 年证券投资从业经验。曾任财通基金管理有限公司量化投资部研究助理。2019 年 11 月加盟鹏华基金管理有限公司，历任量化及衍生品投资部量化研究员、高级量化研究员、资深量化研究员，现担任指数与量化投资部基金经理。时贊超具备基金从业资格。2024 年 12 月至今担任鹏华量化先锋混合型证券投资基金基金经理，2024 年 12 月至今担任鹏华智投 800 混合型证券投资基金基金经理，2024 年 12 月至今担任鹏华中证 1000 指数增强型证券投资基金基金经理，2025 年 04 月至今担任鹏华安泽混合型证券投资基金基金经理，时贊超先生具备基金从业资格。

注：1. 基金经理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：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。报告期内，本基金运作合规，不存在违反基金合同和损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行公平交易制度，确保不同投资组合在研究、交易、分配等各环节得到公平对待。公司对不同投资组合在不同时间窗口下（日内、3 日内、5 日内）的同向交

易价差进行专项分析，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

我们的量化模型在基本面、量价、另类等因子上采用了相对均衡的配置以此应对各种行情，努力争取相对基准的超额收益。

展望未来，随着市场有效性不断提升，在策略竞争日趋激烈的情况下，尤其是重大突发风险事件影响或者市场成交活跃度不足时，模型的稳定性和适应性仍然可能遇到挑战，我们认为高质量、低相关性的 alpha 因子是模型保持生命力的核心因素，因此我们将持续挖掘新的 alpha 因子，对模型进行优化和迭代。

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 14.62%，同期业绩比较基准增长率为 0.36%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2025年上半年，市场整体呈现震荡上行，市场风格显著分化。年初科技主题热度延续，AI 及人形机器人产业链活跃，推动市场全面走高；3 月中旬后因产业趋势催化减弱叠加海外关税扰动升级，市场风险偏好承压，指数转入高位震荡。4月“对等关税”落地引发剧烈调整，但伴随增量政策持续发力，推动市场快速修复，主要指数逐步回升并创年内新高。

展望未来，2025年下半年，市场有望由前期政策驱动阶段逐步过渡至企业盈利改善与产业趋势深化主导阶段。企业端关注内需、库存与利润率等基本面因素，政策端关注“十五五”规划编制、反内卷及产业目录落地情况，关注政策与产业逻辑共振的方向。海外关注美联储降息预期逐步兑现。资金层面，私募、ETF 等资金活跃度继续提升，中长期资金入市继续加速，机构投资者占比进一步提升，外资在政策与盈利双线驱动下亦有望回流，有利于市场风险偏好进一步修复，但需警惕美国关税政策变动及其他地缘政治风险对市场情绪产生负面影响。投资策略上，短期关注政策

和产业逻辑共振带来的结构性机会，把握行业轮动，长期聚焦核心资产与价值投资。整体来看，随着经济基本面夯实和政策红利持续释放，市场有望延续震荡上行趋势，长线资金配置价值逐步显现。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1、截止本报告期末，本基金期末可供分配利润为 41,278,468.49 元，期末基金份额净值 1.3319 元。

2、本基金本报告期内未进行利润分配。

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽

责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：鹏华量化先锋混合型证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	4,335,926.46	7,668,062.98
结算备付金		306,462.29	736,262.00
存出保证金		51,490.27	177,438.42
交易性金融资产	6.4.7.2	66,956,975.81	113,947,486.39
其中：股票投资		66,956,975.81	113,947,486.39
基金投资		—	—
债券投资		—	—
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
其他投资		—	—
衍生金融资产	6.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	—	—
债权投资	6.4.7.5	—	—
其中：债券投资		—	—
资产支持证券投资		—	—
其他投资		—	—
其他债权投资	6.4.7.6	—	—
其他权益工具投资	6.4.7.7	—	—
应收清算款		597,333.92	—

应收股利		-	-
应收申购款		6,374.39	43,988.26
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		72,254,563.14	122,573,238.05
负债和净资产	附注号	本期末 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		168,667.28	1,858.60
应付赎回款		44,137.60	496,386.00
应付管理人报酬		68,855.70	182,799.95
应付托管费		11,475.94	30,466.66
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	190,533.84	568,498.64
负债合计		483,670.36	1,280,009.85
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	30,492,424.29	59,067,928.74
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	41,278,468.49	62,225,299.46
净资产合计		71,770,892.78	121,293,228.20
负债和净资产总计		72,254,563.14	122,573,238.05

注： 报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.3319 元，基金份额总额 53,886,323.53 份。

6.2 利润表

会计主体：鹏华量化先锋混合型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025年1月1日至2025 年6月30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024 年6月30日
一、营业收入		12,972,269.50	-62,966,264.60
1. 利息收入		12,043.86	165,658.79
其中：存款利息收入	6.4.7.13	12,043.86	165,658.79

债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”号填列）		13,005,569.84	-55,205,549.19
其中：股票投资收益	6. 4. 7. 14	12,225,086.85	-63,298,332.38
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6. 4. 7. 15	-	-
资产支持证券投资收益	6. 4. 7. 16	-	-
贵金属投资收益	6. 4. 7. 17	-	-
衍生工具收益	6. 4. 7. 18	-	-
股利收益	6. 4. 7. 19	780,482.99	8,092,783.19
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6. 4. 7. 20	-99,649.07	-9,488,626.04
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6. 4. 7. 21	54,304.87	1,562,251.84
减：二、营业总支出		670,876.87	6,414,541.72
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	507,613.78	5,420,852.62
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	84,602.25	903,475.44
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6. 4. 7. 22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	78,660.84	90,213.66
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		12,301,392.63	-69,380,806.32
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		12,301,392.63	-69,380,806.32

五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		12,301,392.63	-69,380,806.32

6.3 净资产变动表

会计主体：鹏华量化先锋混合型证券投资基金

本报告期：2025年1月1日至2025年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	59,067,928.74	-	62,225,299.46	121,293,228.20
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	59,067,928.74	-	62,225,299.46	121,293,228.20
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-28,575,504.45	-	-20,946,830.97	-49,522,335.42
(一)、综合收益总额	-	-	12,301,392.63	12,301,392.63
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	-28,575,504.45	-	-33,248,223.60	-61,823,728.05
其中：1.基金申购款	6,325,114.58	-	7,545,312.87	13,870,427.45
2.基金赎回款	-34,900,619.03	-	-40,793,536.47	-75,694,155.50
(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	30,492,424.29	-	41,278,468.49	71,770,892.78
项目	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	627,893,921.98	-	555,025,669.60	1,182,919,591.58
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	627,893,921.98	-	555,025,669.60	1,182,919,591.58
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-365,352,663.17	-	-355,649,192.25	-721,001,855.42
(一)、综合收益总额	-	-	-69,380,806.32	-69,380,806.32
(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)	-365,352,663.17	-	-286,268,385.93	-651,621,049.10
其中：1.基金申购款	169,117,406.70	-	145,087,952.22	314,205,358.92
2.基金赎回款	-534,470,069.87	-	-431,356,338.15	-965,826,408.02
(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	262,541,258.81	-	199,376,477.35	461,917,736.16

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

邓召明

聂连杰

郝文高

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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

鹏华量化先锋混合型证券投资基金是根据原鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会于 2018 年 1 月 8 日决议通过的《关于鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金转型并修改基金合同等相关事项的议案》，经中国证券监督管理委员会证监许可[2017]1052 号《关于准予鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金变更注册的批复》准予，由鹏华沪深 300ETF 基金转型而来。原鹏华沪深 300ETF 基金存续期限至 2018 年 2 月 22 日止。自 2018 年 2 月 23 日起，原鹏华沪深 300ETF 基金更名为鹏华量化先锋混合型证券投资基金，《鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》失效的同时《鹏华量化先锋混合型证券投资基金基金合同》生效。本基金为契约开放式，存续期限不定。原鹏华沪深 300ETF 基金失效前的基金资产净值为 32,712,954.49 元，已于本基金的基金合同生效日全部转为本基金的基金资产净值。根据《鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金份额折算和变更登记结果公告》的有关规定，本基金的基金管理人于 2018 年 2 月 22 日终对投资者持有的鹏华沪深 300ETF 基金基金份额变更登记为本基金基金份额，基金份额总额为 32,712,954.48 份。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关

规定(以下合称“企业会计准则”)、《资产管理产品相关会计处理规定》(财会[2022]14号)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第3号<年度报告和中期报告>}、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《鹏华量化先锋混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2025 年上半年财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2025 年 06 月 30 日的财务状况以及 2025 年上半年的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品

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

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

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
活期存款	4,335,926.46
等于： 本金	4,335,499.22
加： 应计利息	427.24
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	4,335,926.46

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	64,277,568.22	-	66,956,975.81	2,679,407.59
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	64,277,568.22	-	66,956,975.81	2,679,407.59

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

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资**6.4.7.5.1 债权投资情况**

注：无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.6 其他债权投资**6.4.7.6.1 其他债权投资情况**

注：无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.7 其他权益工具投资**6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况**

注：无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.8 其他资产

注：无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	34.06
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	113,685.19
其中：交易所市场	113,685.19
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	76,814.59
合计	190,533.84

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2025年1月1日至2025年6月30日 基金份额(份)	账面金额
上年度末	104,385,531.48	59,067,928.74
本期申购	11,177,840.82	6,325,114.58
本期赎回(以“-”号填列)	-61,677,048.77	-34,900,619.03
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	53,886,323.53	30,492,424.29

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

注：无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	91,129,784.36	-28,904,484.90	62,225,299.46
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	91,129,784.36	-28,904,484.90	62,225,299.46
本期利润	12,401,041.70	-99,649.07	12,301,392.63
本期基金份额交易产生的变动数	-46,379,210.46	13,130,986.86	-33,248,223.60
其中：基金申购款	10,902,353.45	-3,357,040.58	7,545,312.87
基金赎回款	-57,281,563.91	16,488,027.44	-40,793,536.47
本期已分配利润	-	-	-
本期末	57,151,615.60	-15,873,147.11	41,278,468.49

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2025年1月1日至2025年6月30日	
活期存款利息收入		10,970.88
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		798.03
其他		274.95

合计	12,043.86
----	-----------

注：其他包含认/申购款利息收入、结算保证金利息收入、风控金利息收入等。

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	12,225,086.85
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	12,225,086.85

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出股票成交总额	327,875,424.81
减：卖出股票成本总额	315,179,412.82
减：交易费用	470,925.14
买卖股票差价收入	12,225,086.85

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益**6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成**

注：无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.17 贵金属投资收益**6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成**

注：无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.18 衍生工具收益**6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资产生的股利收益	780,482.99
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	780,482.99

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2025年1月1日至2025年6月30日
1. 交易性金融资产	-99,649.07
股票投资	-99,649.07
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-99,649.07

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025年1月1日至2025年6月30日
基金赎回费收入	54,097.57
基金转换费收入	207.30
合计	54,304.87

6.4.7.22 信用减值损失

注：无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2025年1月1日至2025年6月30日
审计费用	17,307.22
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费用	1,846.25
合计	78,660.84

6.4.7.24 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
鹏华基金管理有限公司（“鹏华基金管理公司”）	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金代销机构
国信证券股份有限公司（“国信证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注：无。

6.4.10.1.2 债券交易

注：无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

6.4.10.1.4 权证交易

注：无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6 月30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024 年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	507,613.78	5,420,852.62
其中：应支付销售机构的客户维 护费	96,279.40	288,238.27
应支付基金管理人的净管理费	411,334.38	5,132,614.35

注：1、支付基金管理人鹏华基金公司的管理人报酬年费率率为 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管理规定》，基金管理人依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，客户维护费从基金管理费中列支。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	84,602.25	903,475.44

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

6.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：无。

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

注：无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年6月 30日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	4,335,926.46	10,970.88	30,441,276.79	117,264.26

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

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
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单 位：股/ 张）	总金额
国信证券	603325	博隆技术	网下申购	660	47,823.60

注：本表包含参与基金托管人的关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

注：无。

6.4.12 期末（2025年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证 券 名 称	成功 认 购 日	受 限 期	流 通 受 限 类 型	认 购 价 格	期 末 估 值 单 价	数 量 (单 位: 股)	期 末 成 本 总 额	期 末 估 值 总 额	备注
001356	富 岭 股 份	2025 年1 月16 日	6个月	新股 流通 受限	5.30	14.44	229	1,213.70	3,306.76	-
001395	亚 联	2025 年1	6个月	新股 流通	19.08	47.25	77	1,469.16	3,638.25	-

	机 械	月 20 日		受限						
301458	钧 威 电 子	2025 年 1 月 2 日	6 个 月	新股 流通 受限	10.40	34.11	270	2,808.00	9,209.70	-
301601	惠 通 科 技	2025 年 1 月 8 日	6 个 月	新股 流通 受限	11.80	33.85	257	3,032.60	8,699.45	-
301602	超 研 股 份	2025 年 1 月 15 日	6 个 月	新股 流通 受限	6.70	24.80	323	2,164.10	8,010.40	-
603072	天 和 磁 材	2024 年 12 月 24 日	6 个 月	新股 流通 受限	12.30	54.45	100	1,230.00	5,445.00	-
688411	海 博 思 创	2025 年 1 月 20 日	6 个 月	新股 流通 受限	19.38	83.49	198	3,837.24	16,531.02	-
688545	兴 福 电 子	2025 年 1 月 15 日	6 个 月	新股 流通 受限	11.68	26.95	257	3,001.76	6,926.15	-
688583	思 看 科 技	2025 年 1 月 8 日	6 个 月	新股 流通 受限	33.46	79.68	127	3,279.08	10,119.36	思看科 技于 2025 年 6 月 19 日 每 10 股送 3 股
688758	赛 分 科 技	2025 年 1 月 2 日	6 个 月	新股 流通 受限	4.32	16.97	777	3,356.64	13,185.69	-

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

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

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

4、基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后 6 个月内不得转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300225	金力泰	2025年5月6日	重大事项	4.22	2025年7月3日	4.01	79,100	260,514.00	333,802.00	
688313	仕佳光子	2025年6月30日	重大事项	38.05	2025年7月11日	39.98	2,400	60,655.60	91,320.00	

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证）、债券（含国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券、中小企业私募债等）、货币市场工具（含同业存单等）、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金在日常经营活动面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、

流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

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

于 2025 年 06 月 30 日，本基金未持有信用类债券（2024 年 12 月 31 日：未持有）。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

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

于 2025 年 06 月 30 日，本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金管理办法》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公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30% (完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

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

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025年6月30日	1年内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	4,335,926.46	-	-	-	4,335,926.46
结算备付金	306,462.29	-	-	-	306,462.29
存出保证金	51,490.27	-	-	-	51,490.27
交易性金融资产	-	-	-	66,956,975.81	66,956,975.81
应收申购款	-	-	-	6,374.39	6,374.39
应收清算款	-	-	-	597,333.92	597,333.92
资产总计	4,693,879.02	-	-	67,560,684.12	72,254,563.14
负债					
应付赎回款	-	-	-	44,137.60	44,137.60
应付管理人报酬	-	-	-	68,855.70	68,855.70
应付托管费	-	-	-	11,475.94	11,475.94
应付清算款	-	-	-	168,667.28	168,667.28
其他负债	-	-	-	190,533.84	190,533.84
负债总计	-	-	-	483,670.36	483,670.36
利率敏感度缺口	4,693,879.02	-	-	67,077,013.76	71,770,892.78
上年度末 2024年12月31日	1年内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	7,668,062.98	-	-	-	7,668,062.98
结算备付金	736,262.00	-	-	-	736,262.00
存出保证金	177,438.42	-	-	-	177,438.42
交易性金融资产	-	-	-	113,947,486.39	113,947,486.39
应收申购款	-	-	-	43,988.26	43,988.26
资产总计	8,581,763.40	-	-	113,991,474.65	122,573,238.05
负债					
应付赎回款	-	-	-	496,386.00	496,386.00
应付管理人报酬	-	-	-	182,799.95	182,799.95
应付托管费	-	-	-	30,466.66	30,466.66

应付清算款	-	-	-	1,858.60	1,858.60
其他负债	-	-	-	568,498.64	568,498.64
负债总计	-	-	-	1,280,009.85	1,280,009.85
利率敏感度缺口	8,581,763.40	-	-	112,711,464.80	121,293,228.20

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2025 年 06 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资和资产支持证券公允价值占基金资产净值的比例为 0.00%，因此当利率发生合理、可能的变动时，对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无。

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券投资品种，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

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

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日		上年度末 2024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	66,956,975.81	93.29	113,947,486.39	93.94
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	66,956,975.81	93.29	113,947,486.39	93.94

注：债券投资为可转债、可交换债券投资。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准外的其他市场变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2025年6月30日）	上年度末（2024年12月31日）
	比较基准上涨 5% 资产净值变动	3,650,267.61	6,148,353.74
	比较基准下降 5% 资产净值变动	-3,650,267.61	-6,148,353.74

注：无。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025年6月30日
第一层次	66,446,782.03
第二层次	425,122.00
第三层次	85,071.78
合计	66,956,975.81

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	66,956,975.81	92.67
	其中：股票	66,956,975.81	92.67
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	4,642,388.75	6.43
8	其他各项资产	655,198.58	0.91
9	合计	72,254,563.14	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	121,829.00	0.17
B	采矿业	1,486,349.00	2.07
C	制造业	45,522,067.57	63.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,534,309.00	3.53
E	建筑业	653,264.00	0.91
F	批发和零售业	1,745,898.20	2.43
G	交通运输、仓储和邮政业	1,683,829.40	2.35
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,206,647.87	7.25
J	金融业	4,017,972.20	5.60
K	房地产业	604,236.00	0.84
L	租赁和商务服务业	1,385,304.00	1.93
M	科学研究和技术服务业	698,634.57	0.97
N	水利、环境和公共设施管理业	599,095.60	0.83

0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	108,630.00	0.15
Q	卫生和社会工作	183,028.00	0.26
R	文化、体育和娱乐业	388,895.00	0.54
S	综合	16,986.40	0.02
	合计	66,956,975.81	93.29

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000553	安道麦 A	62,600	451,972.00	0.63
2	300416	苏试试验	30,500	437,065.00	0.61
3	600067	冠城新材	138,500	412,730.00	0.58
4	603187	海容冷链	33,600	395,136.00	0.55
5	603515	欧普照明	21,800	392,182.00	0.55
6	002344	海宁皮城	90,200	391,468.00	0.55
7	002080	中材科技	20,000	390,000.00	0.54
8	300018	中元股份	49,000	389,550.00	0.54
9	002174	游族网络	31,400	380,882.00	0.53
10	601218	吉鑫科技	92,500	380,175.00	0.53
11	603511	爱慕股份	24,700	380,133.00	0.53
12	601566	九牧王	43,000	367,220.00	0.51
13	600742	富维股份	38,500	366,135.00	0.51
14	600704	物产中大	69,300	365,211.00	0.51
15	688122	西部超导	7,000	363,160.00	0.51
16	300041	回天新材	38,200	359,844.00	0.50
17	002010	传化智联	63,800	356,004.00	0.50
18	601857	中国石油	41,600	355,680.00	0.50
19	600298	安琪酵母	10,000	351,700.00	0.49
20	002454	松芝股份	44,700	345,084.00	0.48
21	600819	耀皮玻璃	59,100	343,962.00	0.48
22	001203	大中矿业	36,300	343,035.00	0.48
23	000089	深圳机场	49,200	339,480.00	0.47
24	002054	德美化工	49,200	338,496.00	0.47
25	300225	金力泰	79,100	333,802.00	0.47
26	002939	长城证券	39,600	331,848.00	0.46
27	601003	柳钢股份	94,100	331,232.00	0.46
28	601528	瑞丰银行	56,900	329,451.00	0.46
29	002382	蓝帆医疗	58,800	329,280.00	0.46

30	002913	奥士康	11,000	323,510.00	0.45
31	601319	中国人保	36,900	321,399.00	0.45
32	002666	德联集团	63,100	321,179.00	0.45
33	601236	红塔证券	37,900	321,013.00	0.45
34	002027	分众传媒	43,900	320,470.00	0.45
35	688082	盛美上海	2,800	319,032.00	0.44
36	601958	金钼股份	29,000	317,260.00	0.44
37	600713	南京医药	62,100	314,226.00	0.44
38	603309	维力医疗	24,700	314,184.00	0.44
39	603698	航天工程	17,700	311,874.00	0.43
40	603036	如通股份	18,200	311,766.00	0.43
41	603323	苏农银行	55,220	309,784.20	0.43
42	000055	方大集团	72,000	309,600.00	0.43
43	002953	日丰股份	29,800	309,324.00	0.43
44	688468	科美诊断	41,800	307,648.00	0.43
45	301321	翰博高新	20,100	307,329.00	0.43
46	600908	无锡银行	48,600	306,666.00	0.43
47	601963	重庆银行	28,200	306,252.00	0.43
48	603181	皇马科技	23,700	304,782.00	0.42
49	600167	联美控股	53,800	302,356.00	0.42
50	600351	亚宝药业	49,500	300,465.00	0.42
51	603699	纽威股份	9,600	299,232.00	0.42
52	000789	万年青	54,700	298,662.00	0.42
53	002544	普天科技	12,700	297,815.00	0.41
54	002268	电科网安	16,200	296,298.00	0.41
55	688147	微导纳米	9,800	295,764.00	0.41
56	002142	宁波银行	10,800	295,488.00	0.41
57	601827	三峰环境	35,100	294,840.00	0.41
58	002545	东方铁塔	33,000	293,370.00	0.41
59	600869	远东股份	57,200	290,576.00	0.40
60	600273	嘉化能源	34,300	290,178.00	0.40
61	601991	大唐发电	90,400	286,568.00	0.40
62	301119	正强股份	8,000	282,880.00	0.39
63	600499	科达制造	28,800	282,240.00	0.39
64	300140	节能环保	45,600	281,352.00	0.39
65	600020	中原高速	58,300	278,674.00	0.39
66	300750	宁德时代	1,100	277,442.00	0.39
67	000825	太钢不锈	77,200	277,148.00	0.39
68	002090	金智科技	28,900	276,862.00	0.39
69	601686	友发集团	48,700	276,616.00	0.39
70	600025	华能水电	28,700	274,085.00	0.38
71	603444	吉比特	900	271,755.00	0.38
72	300978	东箭科技	23,800	265,608.00	0.37

73	603659	璞泰来	14,100	264,798.00	0.37
74	002414	高德红外	25,800	264,450.00	0.37
75	603386	骏亚科技	20,800	263,120.00	0.37
76	603858	步长制药	16,200	263,088.00	0.37
77	300247	融捷健康	66,800	260,520.00	0.36
78	002637	赞宇科技	25,900	258,482.00	0.36
79	600011	华能国际	35,900	256,326.00	0.36
80	688168	安博通	3,600	255,132.00	0.36
81	002236	大华股份	15,900	252,492.00	0.35
82	688128	中国电研	10,282	251,909.00	0.35
83	002926	华西证券	27,100	242,274.00	0.34
84	600578	京能电力	53,500	240,215.00	0.33
85	600135	乐凯胶片	31,100	240,092.00	0.33
86	000027	深圳能源	37,600	239,888.00	0.33
87	300241	瑞丰光电	41,900	238,830.00	0.33
88	301270	汉仪股份	5,000	238,300.00	0.33
89	600064	南京高科	30,900	238,239.00	0.33
90	600486	扬农化工	4,100	237,800.00	0.33
91	688029	南微医学	3,468	234,263.40	0.33
92	688668	鼎通科技	3,700	231,102.00	0.32
93	000848	承德露露	24,800	226,424.00	0.32
94	002001	新和成	10,600	225,462.00	0.31
95	002413	雷科防务	38,900	224,842.00	0.31
96	600268	国电南自	28,600	223,652.00	0.31
97	600055	万东医疗	12,900	222,912.00	0.31
98	002624	完美世界	14,500	219,965.00	0.31
99	688150	莱特光电	8,800	217,536.00	0.30
100	003022	联泓新科	13,700	216,871.00	0.30
101	600668	尖峰集团	15,100	213,665.00	0.30
102	603040	新坐标	5,300	212,901.00	0.30
103	600482	中国动力	9,200	212,244.00	0.30
104	002555	三七互娱	12,100	209,209.00	0.29
105	002081	金螳螂	60,900	208,887.00	0.29
106	600380	健康元	18,800	207,364.00	0.29
107	002396	星网锐捷	9,200	206,540.00	0.29
108	301220	亚香股份	4,600	206,540.00	0.29
109	605507	国邦医药	10,400	205,608.00	0.29
110	601107	四川成渝	33,600	202,272.00	0.28
111	002422	科伦药业	5,600	201,152.00	0.28
112	002206	海利得	39,300	200,823.00	0.28
113	000551	创元科技	15,600	200,460.00	0.28
114	000690	宝新能源	43,400	197,470.00	0.28
115	600004	白云机场	21,500	195,650.00	0.27

116	688188	柏楚电子	1, 480	194, 856. 80	0. 27
117	600983	惠而浦	18, 600	193, 068. 00	0. 27
118	000050	深天马 A	22, 600	192, 552. 00	0. 27
119	300236	上海新阳	4, 900	190, 120. 00	0. 26
120	688033	天宜新材	29, 400	188, 454. 00	0. 26
121	002169	智光电气	29, 100	188, 277. 00	0. 26
122	600063	皖维高新	40, 800	186, 864. 00	0. 26
123	300025	华星创业	26, 900	186, 686. 00	0. 26
124	603098	森特股份	18, 300	186, 477. 00	0. 26
125	002294	信立泰	3, 900	184, 587. 00	0. 26
126	600728	佳都科技	33, 800	184, 210. 00	0. 26
127	600153	建发股份	17, 700	183, 549. 00	0. 26
128	603115	海星股份	12, 700	183, 261. 00	0. 26
129	002386	天原股份	36, 900	183, 024. 00	0. 26
130	603203	快克智能	7, 200	179, 064. 00	0. 25
131	000598	兴蓉环境	24, 800	178, 808. 00	0. 25
132	002626	金达威	8, 700	178, 002. 00	0. 25
133	600335	国机汽车	27, 400	176, 730. 00	0. 25
134	600345	长江通信	6, 800	175, 508. 00	0. 24
135	603966	法兰泰克	18, 900	175, 392. 00	0. 24
136	002787	华源控股	21, 200	173, 204. 00	0. 24
137	002226	江南化工	29, 700	172, 260. 00	0. 24
138	688377	迪威尔	7, 200	171, 864. 00	0. 24
139	002008	大族激光	7, 000	170, 590. 00	0. 24
140	000030	富奥股份	28, 700	169, 043. 00	0. 24
141	600166	福田汽车	62, 300	168, 833. 00	0. 24
142	002350	北京科锐	24, 600	168, 756. 00	0. 24
143	300769	德方纳米	5, 100	168, 402. 00	0. 23
144	300682	朗新集团	6, 900	162, 150. 00	0. 23
145	603345	安井食品	2, 000	160, 840. 00	0. 22
146	603565	中谷物流	16, 800	160, 440. 00	0. 22
147	600196	复星医药	6, 300	158, 067. 00	0. 22
148	300623	捷捷微电	5, 300	157, 940. 00	0. 22
149	600626	申达股份	43, 200	156, 816. 00	0. 22
150	600875	东方电气	9, 200	154, 008. 00	0. 21
151	601311	骆驼股份	16, 900	152, 607. 00	0. 21
152	603566	普莱柯	11, 200	152, 432. 00	0. 21
153	000719	中原传媒	12, 200	151, 402. 00	0. 21
154	002950	奥美医疗	17, 600	151, 360. 00	0. 21
155	688396	华润微	3, 200	150, 912. 00	0. 21
156	600237	铜峰电子	20, 800	150, 800. 00	0. 21
157	688065	凯赛生物	3, 200	150, 720. 00	0. 21
158	688549	中巨芯-U	19, 200	148, 608. 00	0. 21

159	603189	网达软件	8,400	145,908.00	0.20
160	600968	海油发展	35,700	145,656.00	0.20
161	300160	秀强股份	25,900	145,558.00	0.20
162	002037	保利联合	15,900	145,326.00	0.20
163	300009	安科生物	17,100	143,127.00	0.20
164	600782	新钢股份	40,300	142,662.00	0.20
165	300712	永福股份	5,900	141,777.00	0.20
166	688558	国盛智科	5,600	141,344.00	0.20
167	688261	东微半导	3,400	140,250.00	0.20
168	603588	高能环境	24,800	139,872.00	0.19
169	000423	东阿阿胶	2,600	135,980.00	0.19
170	000657	中钨高新	11,400	135,204.00	0.19
171	603612	索通发展	7,300	134,174.00	0.19
172	000685	中山公用	15,200	133,456.00	0.19
173	600169	太原重工	55,100	133,342.00	0.19
174	600531	豫光金铅	17,200	133,128.00	0.19
175	600073	光明肉业	18,000	132,840.00	0.19
176	002594	比亚迪	400	132,764.00	0.18
177	688475	萤石网络	4,200	132,384.00	0.18
178	002783	凯龙股份	15,200	131,176.00	0.18
179	002434	万里扬	17,800	130,474.00	0.18
180	603355	莱克电气	5,800	130,036.00	0.18
181	300105	龙源技术	16,800	129,528.00	0.18
182	000776	广发证券	7,700	129,437.00	0.18
183	002283	天润工业	21,600	128,736.00	0.18
184	000726	鲁泰 A	20,200	128,068.00	0.18
185	002668	TCL 智家	13,100	127,987.00	0.18
186	605183	确成股份	7,200	126,000.00	0.18
187	002773	康弘药业	4,300	124,571.00	0.17
188	600104	上汽集团	7,700	123,585.00	0.17
189	002758	浙农股份	13,800	123,234.00	0.17
190	300394	天孚通信	1,540	122,953.60	0.17
191	300512	中亚股份	14,300	122,694.00	0.17
192	603939	益丰药房	5,000	122,350.00	0.17
193	000823	超声电子	10,300	122,055.00	0.17
194	002714	牧原股份	2,900	121,829.00	0.17
195	605162	新中港	16,200	121,662.00	0.17
196	002523	天桥起重	33,300	121,545.00	0.17
197	688005	容百科技	5,400	120,528.00	0.17
198	000739	普洛药业	8,600	120,400.00	0.17
199	603898	好莱客	10,900	119,791.00	0.17
200	000758	中色股份	23,700	119,211.00	0.17
201	001872	招商港口	6,000	119,160.00	0.17

202	300014	亿纬锂能	2,600	119,106.00	0.17
203	002057	中钢天源	12,700	117,983.00	0.16
204	002891	中宠股份	1,900	117,553.00	0.16
205	603687	大胜达	15,800	117,394.00	0.16
206	002661	克明食品	11,700	117,117.00	0.16
207	000957	中通客车	10,700	116,951.00	0.16
208	300510	金冠股份	25,500	116,790.00	0.16
209	688114	华大智造	1,800	116,694.00	0.16
210	600998	九州通	22,700	116,678.00	0.16
211	301215	中汽股份	18,800	116,560.00	0.16
212	603171	税友股份	2,700	115,857.00	0.16
213	688561	奇安信-U	3,300	112,134.00	0.16
214	688039	当虹科技	3,400	111,588.00	0.16
215	002121	科陆电子	22,300	111,500.00	0.16
216	002303	美盈森	31,200	111,072.00	0.15
217	603233	大参林	6,800	110,840.00	0.15
218	002228	合兴包装	31,300	110,489.00	0.15
219	002056	横店东磁	7,800	110,370.00	0.15
220	600866	星湖科技	15,900	109,869.00	0.15
221	000895	双汇发展	4,500	109,845.00	0.15
222	603296	华勤技术	1,360	109,724.80	0.15
223	300219	鸿利智汇	16,300	109,536.00	0.15
224	000783	长江证券	15,800	109,494.00	0.15
225	600808	马钢股份	31,500	108,675.00	0.15
226	600661	昂立教育	10,200	108,630.00	0.15
227	603882	金域医学	3,800	108,528.00	0.15
228	002517	恺英网络	5,600	108,136.00	0.15
229	000959	首钢股份	31,500	107,100.00	0.15
230	688579	山大地纬	9,400	105,186.00	0.15
231	300882	万胜智能	5,800	104,052.00	0.14
232	600267	海正药业	11,100	102,675.00	0.14
233	000901	航天科技	8,200	101,926.00	0.14
234	301626	苏州天脉	957	100,867.80	0.14
235	688223	晶科能源	19,400	100,686.00	0.14
236	001914	招商积余	8,100	100,197.00	0.14
237	002916	深南电路	910	98,107.10	0.14
238	688002	睿创微纳	1,400	97,608.00	0.14
239	605266	健之佳	4,640	97,579.20	0.14
240	601369	陕鼓动力	11,100	97,347.00	0.14
241	002597	金禾实业	4,100	96,555.00	0.13
242	002023	海特高新	8,900	96,298.00	0.13
243	600993	马应龙	3,400	96,152.00	0.13
244	600909	华安证券	16,300	95,029.00	0.13

245	300677	英科医疗	4,000	94,720.00	0.13
246	601377	兴业证券	15,300	94,707.00	0.13
247	301165	锐捷网络	1,540	94,648.40	0.13
248	688777	中控技术	2,100	94,311.00	0.13
249	002558	巨人网络	4,000	94,200.00	0.13
250	002185	华天科技	9,300	93,930.00	0.13
251	688235	百济神州-U	400	93,456.00	0.13
252	000921	海信家电	3,600	92,520.00	0.13
253	601155	新城控股	6,700	91,656.00	0.13
254	688313	仕佳光子	2,400	91,320.00	0.13
255	002399	海普瑞	7,600	90,516.00	0.13
256	600096	云天化	4,100	90,077.00	0.13
257	002643	万润股份	7,700	88,627.00	0.12
258	002402	和而泰	3,800	88,046.00	0.12
259	688055	龙腾光电	23,781	87,989.70	0.12
260	600219	南山铝业	22,900	87,707.00	0.12
261	300308	中际旭创	600	87,516.00	0.12
262	601799	星宇股份	700	87,500.00	0.12
263	603053	成都燃气	9,100	87,451.00	0.12
264	300453	三鑫医疗	10,800	86,940.00	0.12
265	002153	石基信息	10,000	86,600.00	0.12
266	300696	爱乐达	3,800	85,804.00	0.12
267	603380	易德龙	3,200	85,120.00	0.12
268	301536	星宸科技	1,400	84,420.00	0.12
269	002745	木林森	10,700	84,316.00	0.12
270	002273	水晶光电	4,200	83,874.00	0.12
271	600745	闻泰科技	2,500	83,825.00	0.12
272	688007	光峰科技	5,700	82,422.00	0.11
273	002455	百川股份	11,000	82,280.00	0.11
274	600301	华锡有色	4,100	81,877.00	0.11
275	600674	川投能源	5,100	81,804.00	0.11
276	600269	赣粤高速	16,100	81,466.00	0.11
277	000931	中关村	15,000	81,450.00	0.11
278	002928	华夏航空	9,800	81,438.00	0.11
279	688599	天合光能	5,584	81,135.52	0.11
280	300558	贝达药业	1,400	81,130.00	0.11
281	688819	天能股份	2,915	80,920.40	0.11
282	600926	杭州银行	4,800	80,736.00	0.11
283	002337	赛象科技	13,800	80,592.00	0.11
284	300457	赢合科技	3,500	80,500.00	0.11
285	002632	道明光学	8,600	79,980.00	0.11
286	300690	双一科技	3,300	79,893.00	0.11
287	002508	老板电器	4,200	79,842.00	0.11

288	688586	江航装备	7,080	79,650.00	0.11
289	600496	精工钢构	24,500	78,400.00	0.11
290	002516	旷达科技	15,200	78,280.00	0.11
291	605138	盛泰集团	11,600	77,720.00	0.11
292	000042	中洲控股	10,900	77,499.00	0.11
293	002925	盈趣科技	4,300	77,314.00	0.11
294	300821	东岳硅材	9,800	77,028.00	0.11
295	300001	特锐德	3,200	76,704.00	0.11
296	002444	巨星科技	3,000	76,530.00	0.11
297	300292	吴通控股	15,700	76,459.00	0.11
298	600919	江苏银行	6,300	75,222.00	0.10
299	300034	钢研高纳	4,500	74,835.00	0.10
300	603987	康德莱	9,700	74,690.00	0.10
301	601615	明阳智能	6,500	74,685.00	0.10
302	300244	迪安诊断	5,000	74,500.00	0.10
303	603933	睿能科技	4,300	74,046.00	0.10
304	601949	中国出版	11,100	73,704.00	0.10
305	603218	日月股份	5,800	73,602.00	0.10
306	300552	万集科技	2,600	72,384.00	0.10
307	600703	三安光电	5,800	72,036.00	0.10
308	003016	欣贺股份	9,600	72,000.00	0.10
309	300017	网宿科技	6,700	71,824.00	0.10
310	603087	甘李药业	1,300	71,214.00	0.10
311	600210	紫江企业	10,400	71,032.00	0.10
312	002585	双星新材	13,000	70,980.00	0.10
313	300316	晶盛机电	2,600	70,590.00	0.10
314	000900	现代投资	16,600	70,218.00	0.10
315	002598	山东章鼓	6,300	70,056.00	0.10
316	002459	晶澳科技	7,000	69,860.00	0.10
317	300206	理邦仪器	5,800	69,716.00	0.10
318	002788	鹭燕医药	8,100	69,417.00	0.10
319	605589	圣泉集团	2,500	69,375.00	0.10
320	300253	卫宁健康	6,500	68,900.00	0.10
321	002270	华明装备	4,100	68,634.00	0.10
322	300230	永利股份	13,900	67,971.00	0.09
323	600027	华电国际	12,400	67,828.00	0.09
324	600061	国投资本	9,000	67,680.00	0.09
325	300180	华峰超纤	7,100	67,663.00	0.09
326	688120	华海清科	400	67,480.00	0.09
327	601696	中银证券	6,300	67,347.00	0.09
328	600233	圆通速递	5,200	67,028.00	0.09
329	002339	积成电子	8,400	66,528.00	0.09
330	600956	新天绿能	8,600	66,392.00	0.09

331	688516	奥特维	1, 964	65, 283. 36	0. 09
332	000333	美的集团	900	64, 980. 00	0. 09
333	688317	之江生物	3, 600	64, 872. 00	0. 09
334	600988	赤峰黄金	2, 600	64, 688. 00	0. 09
335	603733	仙鹤股份	3, 100	64, 294. 00	0. 09
336	600873	梅花生物	6, 000	64, 140. 00	0. 09
337	603466	风语筑	6, 300	63, 567. 00	0. 09
338	600361	创新新材	15, 800	63, 042. 00	0. 09
339	688248	南网科技	2, 002	62, 982. 92	0. 09
340	002314	南山控股	23, 900	62, 857. 00	0. 09
341	688220	翱捷科技-U	800	62, 640. 00	0. 09
342	600276	恒瑞医药	1, 200	62, 280. 00	0. 09
343	002026	山东威达	5, 100	61, 965. 00	0. 09
344	300357	我武生物	3, 000	61, 920. 00	0. 09
345	000021	深科技	3, 300	61, 842. 00	0. 09
346	301262	海看股份	2, 300	60, 628. 00	0. 08
347	600918	中泰证券	9, 400	60, 442. 00	0. 08
348	603267	鸿远电子	1, 200	60, 324. 00	0. 08
349	002017	东信和平	3, 260	60, 081. 80	0. 08
350	300770	新媒股份	1, 500	59, 985. 00	0. 08
351	000919	金陵药业	8, 700	59, 247. 00	0. 08
352	002281	光迅科技	1, 200	59, 184. 00	0. 08
353	002651	利君股份	4, 900	58, 898. 00	0. 08
354	600079	人福医药	2, 800	58, 744. 00	0. 08
355	002895	川恒股份	2, 600	58, 656. 00	0. 08
356	688334	西高院	3, 400	58, 412. 00	0. 08
357	300059	东方财富	2, 500	57, 825. 00	0. 08
358	300401	花园生物	3, 800	57, 798. 00	0. 08
359	000928	中钢国际	9, 100	57, 148. 00	0. 08
360	300145	南方泵业	16, 300	57, 050. 00	0. 08
361	002472	双环传动	1, 700	56, 933. 00	0. 08
362	688366	昊海生科	1, 106	56, 671. 44	0. 08
363	300578	会畅通讯	2, 700	56, 619. 00	0. 08
364	601601	中国太保	1, 500	56, 265. 00	0. 08
365	688111	金山办公	200	56, 010. 00	0. 08
366	600488	津药药业	13, 400	55, 878. 00	0. 08
367	300687	赛意信息	2, 000	55, 560. 00	0. 08
368	000876	新希望	5, 900	55, 342. 00	0. 08
369	300203	聚光科技	2, 500	55, 325. 00	0. 08
370	000728	国元证券	7, 000	55, 230. 00	0. 08
371	603719	良品铺子	4, 500	54, 675. 00	0. 08
372	300869	康泰医学	3, 800	54, 492. 00	0. 08
373	300634	彩讯股份	2, 000	54, 200. 00	0. 08

374	300366	创意信息	6,700	54,002.00	0.08
375	600787	中储股份	9,200	53,912.00	0.08
376	300400	劲拓股份	3,200	53,888.00	0.08
377	601211	国泰海通	2,800	53,648.00	0.07
378	301358	湖南裕能	1,700	53,023.00	0.07
379	002050	三花智控	2,000	52,760.00	0.07
380	688352	颀中科技	4,694	52,713.62	0.07
381	600109	国金证券	6,000	52,620.00	0.07
382	300413	芒果超媒	2,400	52,368.00	0.07
383	002475	立讯精密	1,500	52,035.00	0.07
384	300420	五洋自控	15,100	51,944.00	0.07
385	000039	中集集团	6,600	51,876.00	0.07
386	601881	中国银河	3,000	51,450.00	0.07
387	601002	晋亿实业	10,400	51,272.00	0.07
388	300232	洲明科技	7,000	50,680.00	0.07
389	002835	同为股份	2,700	50,679.00	0.07
390	000725	京东方 A	12,700	50,673.00	0.07
391	600535	天士力	3,200	50,080.00	0.07
392	002046	国机精工	3,000	50,040.00	0.07
393	603639	海利尔	3,500	49,175.00	0.07
394	002572	索菲亚	3,500	49,035.00	0.07
395	603256	宏和科技	3,300	48,906.00	0.07
396	300303	聚飞光电	7,600	48,184.00	0.07
397	301109	军信股份	3,220	47,913.60	0.07
398	603258	电魂网络	1,900	47,690.00	0.07
399	688582	芯动联科	700	47,040.00	0.07
400	002579	中京电子	3,100	46,965.00	0.07
401	002539	云图控股	5,000	46,900.00	0.07
402	002166	莱茵生物	6,000	46,440.00	0.06
403	603308	应流股份	2,000	46,160.00	0.06
404	600667	太极实业	7,000	46,060.00	0.06
405	002106	莱宝高科	4,400	45,540.00	0.06
406	002876	三利谱	1,800	45,342.00	0.06
407	300824	北鼎股份	3,800	45,334.00	0.06
408	601628	中国人寿	1,100	45,309.00	0.06
409	002851	麦格米特	900	45,126.00	0.06
410	600887	伊利股份	1,600	44,608.00	0.06
411	603039	泛微网络	800	44,560.00	0.06
412	301299	卓创资讯	700	44,513.00	0.06
413	600731	湖南海利	6,100	44,469.00	0.06
414	000156	华数传媒	5,600	44,464.00	0.06
415	301611	珂玛科技	804	44,228.04	0.06
416	300184	力源信息	4,500	44,190.00	0.06

417	300409	道氏技术	2,600	44,044.00	0.06
418	000887	中鼎股份	2,500	43,975.00	0.06
419	002769	普路通	4,500	43,560.00	0.06
420	300455	航天智装	3,000	43,200.00	0.06
421	300088	长信科技	7,200	42,912.00	0.06
422	002068	黑猫股份	4,200	42,882.00	0.06
423	002957	科瑞技术	2,600	42,744.00	0.06
424	600882	妙可蓝多	1,400	42,742.00	0.06
425	000700	模塑科技	5,400	42,390.00	0.06
426	603983	丸美生物	1,000	42,130.00	0.06
427	002376	新北洋	5,400	41,958.00	0.06
428	603118	共进股份	3,700	41,699.00	0.06
429	300070	碧水源	9,200	41,400.00	0.06
430	000999	华润三九	1,300	40,664.00	0.06
431	002407	多氟多	3,300	40,227.00	0.06
432	000935	四川双马	2,200	40,084.00	0.06
433	603568	伟明环保	2,100	40,068.00	0.06
434	688605	先锋精科	638	39,970.70	0.06
435	300199	翰宇药业	2,400	39,720.00	0.06
436	600645	中源协和	1,700	39,440.00	0.05
437	688336	三生国健	719	38,998.56	0.05
438	002739	万达电影	3,400	38,862.00	0.05
439	600729	重庆百货	1,300	38,779.00	0.05
440	000933	神火股份	2,300	38,272.00	0.05
441	600757	长江传媒	4,100	38,048.00	0.05
442	688726	拉普拉斯	881	37,971.10	0.05
443	688278	特宝生物	523	37,713.53	0.05
444	002373	千方科技	4,000	37,200.00	0.05
445	601899	紫金矿业	1,900	37,050.00	0.05
446	002863	今飞凯达	7,200	36,504.00	0.05
447	000963	华东医药	900	36,324.00	0.05
448	603239	浙江仙通	2,400	36,264.00	0.05
449	603916	苏博特	4,000	36,240.00	0.05
450	688750	金天钛业	1,685	36,193.80	0.05
451	300458	全志科技	910	36,117.90	0.05
452	603948	建业股份	1,500	35,775.00	0.05
453	601108	财通证券	4,500	35,595.00	0.05
454	601089	福元医药	2,100	35,028.00	0.05
455	600660	福耀玻璃	600	34,206.00	0.05
456	002065	东华软件	3,500	33,600.00	0.05
457	002096	易普力	2,700	33,507.00	0.05
458	601865	福莱特	2,200	33,462.00	0.05
459	603799	华友钴业	900	33,318.00	0.05

460	603730	岱美股份	5,850	33,286.50	0.05
461	300324	旋极信息	7,600	33,060.00	0.05
462	688031	星环科技-U	700	32,641.00	0.05
463	300702	天宇股份	1,400	32,564.00	0.05
464	688123	聚辰股份	400	32,396.00	0.05
465	600585	海螺水泥	1,500	32,205.00	0.04
466	688588	凌志软件	2,200	32,054.00	0.04
467	600579	中化装备	4,000	31,960.00	0.04
468	300776	帝尔激光	600	31,926.00	0.04
469	603508	思维列控	1,200	31,776.00	0.04
470	300979	华利集团	600	31,542.00	0.04
471	002249	大洋电机	4,700	30,926.00	0.04
472	003015	日久光电	1,800	30,870.00	0.04
473	301069	凯盛新材	1,900	30,609.00	0.04
474	603893	瑞芯微	200	30,372.00	0.04
475	688568	中科星图	840	30,248.40	0.04
476	300207	欣旺达	1,500	30,090.00	0.04
477	688232	新点软件	1,000	30,040.00	0.04
478	301200	大族数控	700	29,729.00	0.04
479	688449	联芸科技	713	29,532.46	0.04
480	600722	金牛化工	4,600	29,302.00	0.04
481	000997	新大陆	900	29,142.00	0.04
482	688403	汇成股份	2,800	29,092.00	0.04
483	300327	中颖电子	1,200	29,064.00	0.04
484	301522	上大股份	816	29,057.76	0.04
485	600031	三一重工	1,600	28,720.00	0.04
486	600580	卧龙电驱	1,440	28,468.80	0.04
487	688158	优刻得-W	1,251	28,297.62	0.04
488	688041	海光信息	200	28,258.00	0.04
489	000686	东北证券	3,700	28,231.00	0.04
490	002204	大连重工	4,700	28,059.00	0.04
491	603786	科博达	500	27,705.00	0.04
492	301260	格力博	1,400	27,608.00	0.04
493	603883	老百姓	1,300	27,313.00	0.04
494	600415	小商品城	1,300	26,884.00	0.04
495	000596	古井贡酒	200	26,630.00	0.04
496	002821	凯莱英	300	26,475.00	0.04
497	600739	辽宁成大	2,400	26,400.00	0.04
498	002138	顺络电子	900	25,308.00	0.04
499	600285	羚锐制药	1,100	24,937.00	0.03
500	002352	顺丰控股	500	24,380.00	0.03
501	600850	电科数字	1,000	24,190.00	0.03
502	002707	众信旅游	3,100	24,180.00	0.03

503	601811	新华文轩	1,600	23,312.00	0.03
504	301556	托普云农	267	23,060.79	0.03
505	300601	康泰生物	1,500	22,785.00	0.03
506	600746	江苏索普	2,900	22,649.00	0.03
507	300031	宝通科技	900	22,527.00	0.03
508	688108	赛诺医疗	2,000	22,440.00	0.03
509	300204	舒泰神	600	22,368.00	0.03
510	600633	浙数文化	1,600	22,144.00	0.03
511	301613	新铝时代	414	22,066.20	0.03
512	003006	百亚股份	800	21,904.00	0.03
513	603993	洛阳钼业	2,600	21,892.00	0.03
514	600563	法拉电子	200	21,818.00	0.03
515	300397	天和防务	1,500	21,765.00	0.03
516	000720	新能泰山	6,200	21,638.00	0.03
517	601100	恒立液压	300	21,600.00	0.03
518	600999	招商证券	1,200	21,108.00	0.03
519	605555	德昌股份	1,258	20,845.06	0.03
520	300739	明阳电路	1,400	20,776.00	0.03
521	688432	有研硅	1,834	20,247.36	0.03
522	301622	英思特	232	20,239.68	0.03
523	002212	天融信	2,600	20,020.00	0.03
524	603198	迎驾贡酒	500	19,715.00	0.03
525	301259	艾布鲁	400	19,552.00	0.03
526	001301	尚太科技	400	19,504.00	0.03
527	002103	广博股份	1,700	19,499.00	0.03
528	002429	兆驰股份	4,400	19,272.00	0.03
529	002676	顺威股份	2,600	18,798.00	0.03
530	000967	盈峰环境	2,700	18,765.00	0.03
531	002030	达安基因	3,100	18,755.00	0.03
532	002609	捷顺科技	1,600	18,688.00	0.03
533	605111	新洁能	600	18,444.00	0.03
534	600664	哈药股份	5,000	18,400.00	0.03
535	002603	以岭药业	1,300	18,330.00	0.03
536	600057	厦门象屿	2,600	18,278.00	0.03
537	603855	华荣股份	800	17,704.00	0.02
538	600933	爱柯迪	1,100	17,611.00	0.02
539	600363	联创光电	300	17,499.00	0.02
540	600066	宇通客车	700	17,402.00	0.02
541	002398	垒知集团	3,500	17,290.00	0.02
542	300456	赛微电子	1,000	17,190.00	0.02
543	002975	博杰股份	500	17,090.00	0.02
544	000833	粤桂股份	1,360	16,986.40	0.02
545	688708	佳驰科技	307	16,974.03	0.02

546	688411	海博思创	198	16,531.02	0.02
547	601077	渝农商行	2,300	16,422.00	0.02
548	300525	博思软件	1,100	16,016.00	0.02
549	002755	奥赛康	1,000	15,980.00	0.02
550	000906	浙商中拓	2,500	15,925.00	0.02
551	002549	凯美特气	1,500	15,450.00	0.02
552	300827	上能电气	500	15,275.00	0.02
553	600420	国药现代	1,400	14,910.00	0.02
554	601058	赛轮轮胎	1,100	14,432.00	0.02
555	002416	爱施德	1,200	14,424.00	0.02
556	300002	神州泰岳	1,200	14,160.00	0.02
557	605006	山东玻纤	2,000	13,440.00	0.02
558	601127	赛力斯	100	13,432.00	0.02
559	300548	长芯博创	200	13,354.00	0.02
560	688758	赛分科技	777	13,185.69	0.02
561	601886	江河集团	2,100	12,915.00	0.02
562	002587	奥拓电子	2,000	12,900.00	0.02
563	603650	彤程新材	400	12,860.00	0.02
564	603025	大豪科技	900	12,618.00	0.02
565	600048	保利发展	1,500	12,150.00	0.02
566	301631	壹连科技	147	12,142.20	0.02
567	002104	恒宝股份	600	11,946.00	0.02
568	600126	杭钢股份	1,300	11,700.00	0.02
569	002393	力生制药	600	11,436.00	0.02
570	002850	科达利	100	11,317.00	0.02
571	600288	大恒科技	1,100	11,308.00	0.02
572	000636	风华高科	800	10,992.00	0.02
573	600100	同方股份	1,500	10,860.00	0.02
574	002242	九阳股份	1,100	10,450.00	0.01
575	605066	天正电气	1,400	10,430.00	0.01
576	000738	航发控制	500	10,375.00	0.01
577	601231	环旭电子	700	10,241.00	0.01
578	688583	思看科技	127	10,119.36	0.01
579	002161	远望谷	1,500	9,900.00	0.01
580	300122	智飞生物	500	9,795.00	0.01
581	300492	华图山鼎	140	9,503.20	0.01
582	300661	圣邦股份	130	9,460.10	0.01
583	300620	光库科技	200	9,422.00	0.01
584	301585	蓝宇股份	273	9,363.90	0.01
585	002372	伟星新材	900	9,324.00	0.01
586	301458	钧崴电子	270	9,209.70	0.01
587	301601	惠通科技	257	8,699.45	0.01
588	301617	博苑股份	209	8,579.45	0.01

589	300787	海能实业	580	8,033.00	0.01
590	301602	超研股份	323	8,010.40	0.01
591	000786	北新建材	300	7,944.00	0.01
592	000709	河钢股份	3,500	7,560.00	0.01
593	000034	神州数码	200	7,528.00	0.01
594	688100	威胜信息	200	7,410.00	0.01
595	603586	金麒麟	400	7,328.00	0.01
596	001391	国货航	1,080	7,268.40	0.01
597	603337	杰克股份	200	7,176.00	0.01
598	600131	国网信通	400	7,080.00	0.01
599	688545	兴福电子	257	6,926.15	0.01
600	603395	红四方	200	6,746.00	0.01
601	600577	精达股份	900	6,696.00	0.01
602	002543	万和电气	600	6,666.00	0.01
603	000519	中兵红箭	300	6,567.00	0.01
604	603194	中力股份	137	6,218.43	0.01
605	603899	晨光股份	200	5,798.00	0.01
606	300638	广和通	200	5,726.00	0.01
607	603072	天和磁材	100	5,445.00	0.01
608	000710	贝瑞基因	400	5,412.00	0.01
609	002025	航天电器	100	5,141.00	0.01
610	000058	深赛格	600	4,986.00	0.01
611	603665	康隆达	200	4,956.00	0.01
612	603205	健尔康	128	4,944.64	0.01
613	603310	巍华新材	254	4,861.56	0.01
614	300358	楚天科技	600	4,680.00	0.01
615	002815	崇达技术	400	4,532.00	0.01
616	603881	数据港	156	3,985.80	0.01
617	603365	水星家纺	200	3,672.00	0.01
618	001395	亚联机械	77	3,638.25	0.01
619	603660	苏州科达	500	3,615.00	0.01
620	300130	新国都	100	3,553.00	0.00
621	002690	美亚光电	200	3,374.00	0.00
622	001356	富岭股份	229	3,306.76	0.00
623	300539	横河精密	200	2,738.00	0.00
624	600575	淮河能源	700	2,443.00	0.00
625	603106	恒银科技	200	2,120.00	0.00
626	600062	华润双鹤	100	1,866.00	0.00
627	603169	兰石重装	200	1,576.00	0.00
628	300968	格林精密	100	1,462.00	0.00
629	600330	天通股份	200	1,434.00	0.00
630	600372	中航机载	100	1,206.00	0.00
631	688469	芯联集成-U	200	954.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300369	绿盟科技	1,181,142.00	0.97
2	300375	鹏翎股份	1,024,160.00	0.84
3	000030	富奥股份	986,345.00	0.81
4	300341	麦克奥迪	983,241.00	0.81
5	600067	冠城新材	957,224.00	0.79
6	688312	燕麦科技	951,174.48	0.78
7	002237	恒邦股份	931,333.00	0.77
8	688030	山石网科	927,083.85	0.76
9	002267	陕天然气	900,279.00	0.74
10	601003	柳钢股份	879,684.00	0.73
11	002962	五方光电	868,834.00	0.72
12	300221	银禧科技	868,667.00	0.72
13	300018	中元股份	846,129.00	0.70
14	002454	松芝股份	839,230.00	0.69
15	002017	东信和平	819,378.20	0.68
16	601899	紫金矿业	815,830.00	0.67
17	605077	华康股份	795,384.00	0.66
18	000553	安道麦 A	776,285.00	0.64
19	300184	力源信息	766,360.00	0.63
20	002226	江南化工	766,005.00	0.63

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300369	绿盟科技	1,293,844.00	1.07
2	300643	万通智控	1,208,059.00	1.00
3	300951	博硕科技	1,125,736.00	0.93
4	601899	紫金矿业	1,095,682.00	0.90
5	601177	杭齿前进	1,093,019.00	0.90
6	300341	麦克奥迪	1,021,760.00	0.84
7	300375	鹏翎股份	997,101.00	0.82
8	688312	燕麦科技	983,638.25	0.81
9	300221	银禧科技	976,248.00	0.80
10	688030	山石网科	956,479.74	0.79
11	605066	天正电气	917,544.00	0.76
12	002267	陕天然气	898,086.00	0.74

13	601886	江河集团	892,393.00	0.74
14	002237	恒邦股份	887,154.00	0.73
15	002206	海利得	878,829.00	0.72
16	002962	五方光电	872,157.00	0.72
17	000030	富奥股份	857,632.00	0.71
18	002017	东信和平	841,328.00	0.69
19	603115	海星股份	836,452.00	0.69
20	002517	恺英网络	815,528.00	0.67

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	268,288,551.31
卖出股票收入（成交）总额	327,875,424.81

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：无。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：无。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券备选库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	51,490.27
2	应收清算款	597,333.92
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	6,374.39
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	655,198.58

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)

2,552	21,115.33	22,374,042.97	41.52	31,512,280.56	58.48
-------	-----------	---------------	-------	---------------	-------

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	546,384.09	1.0140

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

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

注：截至本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人及本基金的基金经理投资、持有本基金符合相关法律法规、中国证监会规定及相关管理制度的规定。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018 年 2 月 23 日） 基金份额总额	32,712,954.48
本报告期期初基金份额总额	104,385,531.48
本报告期基金总申购份额	11,177,840.82
减：本报告期基金总赎回份额	61,677,048.77
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	53,886,323.53

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人的重大人事变动：

无。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）研究决定，聘任陈颖钰为中国建设银行资产托管业务部总经理。

陈颖钰女士曾先后在中国建设银行财务会计、重组改制、资产负债、同业业务、金融科技

等领域工作，并在中国建设银行总行同业业务中心、财务会计部、资产托管业务部以及山东省分行、建信金融科技有限责任公司等机构担任领导职务，具有丰富的财会、科技和资金资产管理经验。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

10.4 基金投资策略的改变

无。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未改聘为本基金审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：无。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单 元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成 交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金 总量的比例 (%)	
国泰君安 证券	2	214,594,937 .03	36.01	96,762.59	36.02	-
华创证券	1	185,790,151 .74	31.18	83,746.51	31.17	-
天风证券	2	83,088,130. 51	13.94	37,468.16	13.95	-
中信证券	1	38,067,564. 95	6.39	17,164.28	6.39	-
华福证券	1	20,291,613. 69	3.41	9,147.20	3.40	-
国海证券	1	19,568,293. 84	3.28	8,816.79	3.28	-
民生证券	1	12,826,190.	2.15	5,783.33	2.15	-

		92				
长江证券	1	11,499,056. 76	1.93	5,183.33	1.93	-
兴业证券	2	10,196,851. 50	1.71	4,598.55	1.71	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
东方财富 证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
高盛中国	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
瑞信方正	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源 证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投 证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

注：交易单元选择的标准和程序：

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

2. 选择程序如下：

（1）基金管理人根据上述标准评估并确定选用的证券公司；

- (2) 基金管理人与提供证券交易服务的证券公司签订协议，并办理开立交易账户等事宜；
 (3) 基金管理人定期对证券公司进行评价，依据评价结果选择交易单元。
3. 根据《规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率；其他类型基金股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍。
4. 国泰海通会商并获得上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所、全国中小企业股份转让系统、中国结算、各签约存管银行及基金管理公司等相关单位的协同支持，拟定于 2025 年 9 月 12 日的日终清算后，于上述单位实施法人切换、客户及业务迁移合并，将原海通证券的客户及业务迁移合并入国泰海通。截止本报告期末，原租用海通证券、国泰君安的交易单元未完成迁移合并，故本表列示的海通证券、国泰君安数据包含本基金在报告期内通过原交易单元交易的情况。

10.7.2 基房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(%)
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
长城证	-	-	-	-	-	-

券						
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
高盛中国	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
瑞信方正	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建	-	-	-	-	-	-

投证券						
中银国际	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	鹏华量化先锋混合型证券投资基金 基金产品资料概要（更新）	《证券日报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025年01月02日
2	鹏华量化先锋混合型证券投资基金 更新的招募说明书（2025年第1号）	《证券日报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025年01月02日
3	鹏华基金管理有限公司关于旗下基 金持有的股票停牌后估值方法变更 的提示性公告	《证券日报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025年01月04日
4	鹏华量化先锋混合型证券投资基金 基金经理变更公告	《证券日报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025年01月14日
5	鹏华基金管理有限公司关于旗下基 金持有的股票停牌后估值方法变更 的提示性公告	《证券日报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025年01月15日
6	鹏华量化先锋混合型证券投资基金 基金产品资料概要（更新）	《证券日报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025年01月17日
7	鹏华量化先锋混合型证券投资基金 更新的招募说明书（2025年第2号）	《证券日报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025年01月17日
8	鹏华量化先锋混合型证券投资基金 2024年第4季度报告	《证券日报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025年01月21日
9	鹏华量化先锋混合型证券投资基金 基金产品资料概要（更新）	《证券日报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025年02月06日
10	鹏华量化先锋混合型证券投资基金 更新的招募说明书	《证券日报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025年02月06日
11	鹏华基金管理有限公司关于旗下基 金持有的股票停牌后估值方法变更 的提示性公告	《证券日报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025年02月08日
12	鹏华量化先锋混合型证券投资基金 2024年年度报告	《证券日报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025年03月28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	《证券日报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025年04月12日

	的提示性公告	监会基金电子披露网站	
14	鹏华量化先锋混合型证券投资基金 2025年第1季度报告	《证券日报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025年04月21日
15	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与招商证券股份有限公司申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告	《证券日报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025年06月30日

注：无。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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	20250101~20250218	31,860,093.34	0.00	31,860,093.34	0.00	0.00
个人	1	20250312~20250423, 20250425~20250630	11,860,550.72	0.00	0.00	11,860,550.72	22.01
产品特有风险							
基金份额持有人持有的基金份额所占比例过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引起基金净值剧烈波动，甚至可能引发基金流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。							

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

2、赎回份额包含基金赎回份额、基金转换出份额、强制调减份额、场内卖出份额。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一) 《鹏华量化先锋混合型证券投资基金基金合同》；
- (二) 《鹏华量化先锋混合型证券投资基金托管协议》；

(三)《鹏华量化先锋混合型证券投资基金 2025 年中期报告》(原文)。

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

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

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

鹏华基金管理有限公司

2025 年 8 月 28 日