

鹏华量化先锋混合型证券投资基金 2021 年中期报告

2021 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：2021 年 8 月 30 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 2021 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 2021 年 01 月 01 日起至 2021 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	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	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	11
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	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50

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	51
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	51
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	51
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	51
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	51
7.12 投资组合报告附注	51
§ 8 基金份额持有人信息.....	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52
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	53
§ 9 开放式基金份额变动.....	53
§ 10 重大事件揭示	53
10.1 基金份额持有人大会决议	53
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	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	53
10.4 基金投资策略的改变	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	54
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	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	54
10.8 其他重大事件	57
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	59
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	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	60
§ 12 备查文件目录	60
12.1 备查文件目录	60
12.2 存放地点	60
12.3 查阅方式	60

§ 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	188,888,815.80 份
基金合同存续期	不定期

注：无。

2.2 基金产品说明

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

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

注：无。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		鹏华基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张戈	李申
	联系电话	0755-82825720	021-60637102
	电子邮箱	zhangge@phfund.com.cn	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		4006788999	021-60637111
传真		0755-82021126	021-60635778

注册地址	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	518048	100033
法定代表人	何如	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
登载基金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(2021年1月1日-2021年6月30日)
本期已实现收益	16,969,907.73
本期利润	38,270,349.07
加权平均基金份额本期利润	0.2091
本期加权平均净值利润率	17.31%
本期基金份额净值增长率	17.96%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)
期末可供分配利润	145,721,013.71
期末可供分配基金份额利润	0.7715
期末基金资产净值	252,609,166.33
期末基金份额净值	1.3373
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
基金份额累计净值增长率	33.73%

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。

(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	6.37%	0.81%	-1.57%	0.64%	7.94%	0.17%
过去三个月	14.31%	0.79%	3.09%	0.78%	11.22%	0.01%
过去六个月	17.96%	1.10%	0.82%	1.05%	17.14%	0.05%
过去一年	31.16%	1.28%	20.99%	1.07%	10.17%	0.21%
过去三年	71.27%	1.30%	43.03%	1.09%	28.24%	0.21%
自基金合同生效起至今	33.73%	1.28%	28.52%	1.07%	5.21%	0.21%

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 9,012.31 亿元，管理 237 只公募基金、13 只全国社保投资组合、4 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		

罗捷	基金经理	2018-03-28	-	9 年	<p>罗捷先生，国籍中国，管理学硕士，9 年证券从业经验。历任联合证券研究员、万得资讯产品经理、阿里巴巴（中国）网络技术有限公司产品经理；2013 年 8 月加盟鹏华基金管理有限公司，历任监察稽核部高级金融工程师、量化及衍生品投资部资深量化研究员、投资经理，现担任量化及衍生品投资部基金经理。2018 年 01 月至 2020 年 06 月担任鹏华深证民营交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2018 年 01 月至 2020 年 06 月担任深证民营交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2018 年 03 月至今担任鹏华量化先锋混合型证券投资基金基金经理，2018 年 03 月至今担任鹏华中证医药卫生指数证券投资基金 (LOF) 基金经理，2018 年 03 月至 2019 年 05 月担任鹏华量化策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2018 年 08 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，2019 年 11 月至 2020 年 12 月担任鹏华中证传媒指数分级证券投资基金基金经理，2020 年 03 月至今担任鹏华中证高股息龙头交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2020 年 04 月至今担任鹏华国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2020 年 06 月至今担任鹏华中证高股息龙头交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2021 年 01 月至 2021 年 01 月担任鹏华中证传媒指数型证券投资基金 (LOF) 基金经理，罗捷先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理发生变动，增聘苏俊杰为本基金基金经理。</p>
苏俊杰	基金经理	2021-03-05	-	9 年	<p>苏俊杰先生，国籍中国，理学硕士，9 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，现担任量化及衍生品投资部副总经理。2018 年 01 月至 2019 年 07 月担任中证财通中国可持续发展 100 (ECPIESG) 指数增强型证券投资基金基金经理，2018 年 09 月至 2019 年 07 月担任财通量化核心优选混合型证券投资基金基金经理，2019 年 01 月至 2019 年 07 月担任财通量化价值优选灵活配置混合型</p>

					证券投资基金基金经理, 2019 年 04 月至 2019 年 07 月担任财通中证香港红利等权投资指数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, 2021 年 03 月至今担任鹏华量化先锋混合型证券投资基金基金经理, 苏俊杰先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理发生变动, 增聘苏俊杰为本基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

注: 1. 任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日; 担任新成立基金基金经理的, 任职日期为基金合同生效日。

2. 证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。
3. 罗捷 2021 年 08 月 24 日离任本基金基金经理。

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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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。

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% 的交易次数为 2 次, 主要原因在于指数基金成分股交易不活跃导致。

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。量化选股模型侧重于长期表现有效的因子类别, 并重视短期市场情绪因子的适度把握, 从而

将模型的短期与长期有效性进行平衡与提高。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期份额净值增长率为 17.96%，同期业绩比较基准增长率为 0.82%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

突发的新冠疫情事件给资本市场从宏观流动性、基本面、资金面方面都带来深刻的影响。2021 年的主基调是经济逐步恢复正常，部分出口受益行业会受到抑制，部分受疫情压制行业会逐渐正常，同时宽松的政策将部分维持但相对疫情期间明显收紧。目前经济并没有恢复正常的结构，货币政策虽相对收紧但仍宽松，未来总体上将表现为价格水平上升与市场流动性感受到较大压力。对于股票市场而言，全面上涨已经结束，但增速高于经济整体的成长股将受益于当前环境。

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、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 145,721,013.71 元，期末基金份额净值 1.3373 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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	17,825,970.83	21,367,851.10
结算备付金		737,677.03	704,958.37
存出保证金		50,388.96	97,559.50
交易性金融资产	6.4.7.2	234,557,864.93	212,830,258.31
其中：股票投资		234,557,864.93	212,830,258.31
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-

买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		793,266.86	199,755.94
应收利息	6.4.7.5	2,180.81	2,884.99
应收股利		-	-
应收申购款		6,335.83	1,148.45
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		253,973,685.25	235,204,416.66
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020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		-	-
应付证券清算款		600,562.19	-
应付赎回款		16,586.18	4,834,396.94
应付管理人报酬		299,853.90	315,372.38
应付托管费		49,975.66	52,562.06
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	315,717.77	371,370.95
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	81,823.22	177,088.83
负债合计		1,364,518.92	5,750,791.16
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	106,888,152.62	114,528,755.85
未分配利润	6.4.7.10	145,721,013.71	114,924,869.65
所有者权益合计		252,609,166.33	229,453,625.50
负债和所有者权益总计		253,973,685.25	235,204,416.66

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.3373 元，基金份额总额 188,888,815.80 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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

一、收入		41,670,363.08	3,244,461.24
1. 利息收入		36,145.65	6,000.72
其中：存款利息收入	6.4.7.11	36,145.65	6,000.72
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		20,317,574.80	2,818,592.40
其中：股票投资收益	6.4.7.12	17,957,653.38	2,630,712.47
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	2,359,921.42	187,879.93
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	21,300,441.34	418,238.53
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	16,201.29	1,629.59
减：二、费用		3,400,014.01	351,599.91
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,647,343.76	138,537.67
2. 托管费	6.4.10.2.2	274,557.29	23,089.68
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	1,392,365.47	169,156.78
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	85,747.49	20,815.78
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		38,270,349.07	2,892,861.33
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		38,270,349.07	2,892,861.33

6.3 所有者权益（基金净值）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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	114,528,755.85	114,924,869.65	229,453,625.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	38,270,349.07	38,270,349.07
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-7,640,603.23	-7,474,205.01	-15,114,808.24
其中：1. 基金申购款	12,957,245.07	14,756,962.39	27,714,207.46
2. 基金赎回款	-20,597,848.30	-22,231,167.40	-42,829,015.70
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	106,888,152.62	145,721,013.71	252,609,166.33
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	11,962,350.42	6,547,408.36	18,509,758.78
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,892,861.33	2,892,861.33
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-747,190.69	-449,254.68	-1,196,445.37

其中：1. 基金申购款	330,632.48	210,818.47	541,450.95
2. 基金赎回款	-1,077,823.17	-660,073.15	-1,737,896.32
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	11,215,159.73	8,991,015.01	20,206,174.74

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

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

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是根据原鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“鹏华沪深 300ETF 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（以下简称“中国证监会”）证监许可[2017]1052 号《关于准予鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金变更注册的批复》核准，由鹏华沪深 300ETF 基金转型而来。原鹏华沪深 300ETF 基金存续期限至 2018 年 2 月 22 日止。自 2018 年 2 月 23 日起，原鹏华沪深 300ETF 基金更名为鹏华量化先锋混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），《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。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。

原鹏华沪深 300ETF 基金失效前的基金资产净值为 32,712,954.49 元，已于本基金的基金合同生效日全部转为本基金的基金资产净值。根据《鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金份额折算和变更登记结果公告》的有关规定，本基金的基金管理人于 2018 年 2 月 22 日日终对投资者持有的鹏华沪深 300ETF 基金基金份额变更登记为本基金基金份额，基金份额总额为 32,712,954.48 份。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华量化先锋混合型证券投资基金基金合同》

的有关规定，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。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。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率*80%+中证全债指数收益率*20%。现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例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。

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”）、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 2021 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 2021 年 06 月 30 日的财务状况以及 2021 年上半年的经营成果和基金净值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。

(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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	17,825,970.83
定期存款	-
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	-
合计	17,825,970.83

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	224,943,013.14	234,557,864.93	9,614,851.79
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	224,943,013.14	234,557,864.93	9,614,851.79

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

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。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	1,826.11
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	332.00
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	22.70
合计	2,180.81

6.4.7.6 其他资产

注：无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	315,717.77
银行间市场应付交易费用	-
合计	315,717.77

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	0.36
应付证券出借违约金	-

预提费用	81,822.86
合计	81,823.22

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	202,389,837.73	114,528,755.85
本期申购	22,898,138.07	12,957,245.07
本期赎回（以“-”号填列）	-36,399,160.00	-20,597,848.30
- 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	188,888,815.80	106,888,152.62

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 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	214,609,168.40	-99,684,298.75	114,924,869.65
本期利润	16,969,907.73	21,300,441.34	38,270,349.07
本期基金份额交易产生的变动数	-13,598,604.44	6,124,399.43	-7,474,205.01
其中：基金申购款	24,532,683.58	-9,775,721.19	14,756,962.39
基金赎回款	-38,131,288.02	15,900,120.62	-22,231,167.40
本期已分配利润	-	-	-
本期末	217,980,471.69	-72,259,457.98	145,721,013.71

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	活期存款利息收入	28,146.85
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	6,136.76	
其他	1,862.04	
合计	36,145.65	

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

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	17,957,653.38
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	17,957,653.38

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	530,228,748.19
减：卖出股票成本总额	512,271,094.81
买卖股票差价收入	17,957,653.38

6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：无。

6.4.7.14 贵金属投资收益**6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

注：无。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.15 衍生工具收益**6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：无。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,359,921.42
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	2,359,921.42

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
------	----

	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	21,300,441.34
股票投资	21,300,441.34
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	21,300,441.34

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	15,849.75
基金转换费收入	351.54
合计	16,201.29

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	1,392,365.47
银行间市场交易费用	-
合计	1,392,365.47

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	22,315.49
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费用	3,924.63
合计	85,747.49

6.4.7.21 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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,647,343.76	138,537.67
其中：支付销售机构的客户维护费	6,720.80	5,891.15

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 1.50%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×1.50%÷当年天数。

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	274,557.29	23,089.68

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费年费率为 0.25%，逐日计提，按月支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷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自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。

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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	17,825,970.83	28,146.85	1,765,358.99	5,311.52

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：张）	总金额
国信证券	300957	贝泰妮	网下申购	1,200	56,796.00
国信证券	300986	志特新材	网下申购	2,395	35,422.05
国信证券	688323	瑞华泰	网下申购	4,513	26,942.61

注：本基金在上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

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(2021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	可流通日	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
300614	百川畅银	2021年5月18日	2021年11月25日	锁定期股票	9.19	40.38	314	2,885.66	12,679.32	-
300919	中伟股份	2020年12月15日	2021年7月2日	锁定期股票	24.60	163.00	284	6,986.40	46,292.00	-
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年7月7日	锁定期股票	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300929	华骐环保	2021年1月12日	2021年07月21日	锁定期股票	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300930	屹通新材	2021年1月13日	2021年7月21日	锁定期股票	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-
300931	通用电梯	2021年1月13日	2021年7月21日	锁定期股票	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300932	三友联众	2021年1月15日	2021年7月22日	锁定期股票	24.69	31.71	409	10,098.21	12,969.39	-
300937	药易购	2021年1月20日	2021年7月27日	锁定期股票	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
300940	南极光	2021年1月27日	2021年8月3日	锁定期股票	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300941	创识科技	2021年2月2日	2021年8月9日	锁定期股票	21.31	49.94	284	6,052.04	14,182.96	-
300942	易瑞生物	2021年2月2日	2021年8月9日	锁定期股票	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300943	春晖智控	2021年2月3日	2021年8月10日	锁定期股票	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300945	曼卡	2021	2021	锁定期	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-

	龙	年 2 月 3 日	年 8 月 10 日	股票						
300948	冠中生态	2021 年 2 月 18 日	2021 年 8 月 25 日	锁定期股票	13.00	27.42	324	2,808.00	8,884.08	冠中生态于 2021 年 6 月 4 日实施权益分派方案, 每 10 股派人民币 0.8 元, 并转增 5 股。
300950	德固特	2021 年 2 月 24 日	2021 年 9 月 3 日	锁定期股票	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
300952	恒辉安防	2021 年 3 月 3 日	2021 年 9 月 13 日	锁定期股票	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
300957	贝泰妮	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 27 日	锁定期股票	47.33	251.96	120	5,679.60	30,235.20	-
300958	建工修复	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 29 日	锁定期股票	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300960	通业科技	2021 年 3 月 22 日	2021 年 9 月 29 日	锁定期股票	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
300961	深水海纳	2021 年 3 月 23 日	2021 年 9 月 30 日	锁定期股票	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300962	中金辐照	2021 年 3 月 29 日	2021 年 10 月 11 日	锁定期股票	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300963	中洲特材	2021 年 3 月 30 日	2021 年 10 月 11 日	锁定期股票	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
300966	共同药业	2021 年 3 月 31 日	2021 年 10 月 11 日	锁定期股票	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300967	晓鸣	2021	2021	锁定期	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-

	股份	年 4 月 2 日	年 10 月 13 日	股票						
300968	格林 精密	2021 年 4 月 6 日	2021 年 10 月 15 日	锁定期 股票	6.87	12.07	797	5,475.39	9,619.79	-
300971	博亚 精工	2021 年 4 月 7 日	2021 年 10 月 15 日	锁定期 股票	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-
300972	万辰 生物	2021 年 4 月 8 日	2021 年 10 月 19 日	锁定期 股票	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300973	立高 食品	2021 年 4 月 8 日	2021 年 10 月 15 日	锁定期 股票	28.28	115.71	168	4,751.04	19,439.28	-
300975	商络 电子	2021 年 4 月 14 日	2021 年 10 月 21 日	锁定期 股票	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300978	东箭 科技	2021 年 4 月 15 日	2021 年 10 月 26 日	锁定期 股票	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300979	华利 集团	2021 年 4 月 15 日	2021 年 10 月 26 日	锁定期 股票	33.22	87.50	232	7,707.04	20,300.00	-
300981	中红 医疗	2021 年 4 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	锁定期 股票	48.59	90.39	155	7,531.45	14,010.45	-
300982	苏文 电能	2021 年 4 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	锁定期 股票	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300985	致远 新能	2021 年 4 月 21 日	2021 年 10 月 29 日	锁定期 股票	24.90	24.81	189	4,706.10	4,689.09	-
300986	志特	2021	2021	锁定期	14.79	30.57	240	3,549.60	7,336.80	-

	新材	年 4 月 21 日	年 11 月 1 日	股票							
300987	川网 传媒	2021 年 4 月 28 日	2021 年 11 月 11 日	锁定期 股票	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-	
300992	泰福 泵业	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 25 日	锁定期 股票	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-	
300993	玉马 遮阳	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 24 日	锁定期 股票	12.10	19.29	395	4,779.50	7,619.55	-	
300995	奇德 新材	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 26 日	锁定期 股票	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-	
300996	普联 软件	2021 年 5 月 26 日	2021 年 12 月 3 日	锁定期 股票	20.81	42.23	238	4,952.78	10,050.74	-	
300997	欢乐 家	2021 年 5 月 26 日	2021 年 12 月 2 日	锁定期 股票	4.94	13.05	875	4,322.50	11,418.75	-	
300998	宁波 方正	2021 年 5 月 25 日	2021 年 12 月 2 日	锁定期 股票	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-	
301002	崧盛 股份	2021 年 5 月 27 日	2021 年 12 月 7 日	锁定期 股票	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-	
301004	嘉益 股份	2021 年 6 月 18 日	2021 年 12 月 27 日	锁定期 股票	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-	
301007	德迈 仕	2021 年 6 月 4 日	2021 年 12 月 16 日	锁定期 股票	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-	
301009	可靠 股份	2021 年 6 月 8 日	2021 年 12 月 17 日	锁定期 股票	12.54	27.89	665	8,339.10	18,546.85	-	
301010	晶雪 节能	2021 年 6 月	2021 年 12	锁定期 股票	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-	

		9 日	月 20 日							
301011	华立科技	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 17 日	锁定期股票	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
301012	扬电科技	2021 年 6 月 15 日	2021 年 12 月 22 日	锁定期股票	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
301015	百洋医药	2021 年 6 月 22 日	2021 年 12 月 30 日	锁定期股票	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
301016	雷尔伟	2021 年 6 月 23 日	2021 年 12 月 30 日	锁定期股票	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
301018	申菱环境	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 7 日	新股未上市	8.29	8.29	7,029	58,270.41	58,270.41	-
301018	申菱环境	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 7 日	锁定期股票	8.29	8.29	782	6,482.78	6,482.78	-
301020	密封科技	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股未上市	10.64	10.64	3,789	40,314.96	40,314.96	-
301020	密封科技	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	锁定期股票	10.64	10.64	421	4,479.44	4,479.44	-
301021	英诺激光	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股未上市	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-
301021	英诺激光	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	锁定期股票	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-
600905	三峡能源	2021 年 6 月 2 日	2021 年 12 月 10 日	锁定期股票	2.65	5.67	907,763	2,405,571.95	5,147,016.21	-
605162	新中港	2021 年 6 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	新股未上市	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
605287	德才	2021	2021	新股未上市	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-

	股份	年 6 月 28 日	年 7 月 6 日	上市						
688087	英科再生	2021 年 6 月 30 日	2021 年 7 月 9 日	新股未上市	21.96	21.96	2,271	49,871.16	49,871.16	-
688191	智洋创新	2021 年 3 月 30 日	2021 年 10 月 8 日	锁定期股票	11.38	17.74	3,096	35,232.48	54,923.04	-
688226	威腾电气	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 7 日	新股未上市	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
688239	航宇科技	2021 年 6 月 25 日	2021 年 7 月 5 日	新股未上市	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	-
688328	深科达	2021 年 3 月 1 日	2021 年 9 月 9 日	锁定期股票	16.49	37.79	1,499	24,718.51	56,647.21	-
688355	明志科技	2021 年 4 月 30 日	2021 年 11 月 12 日	锁定期股票	17.65	23.80	2,649	46,754.85	63,046.20	-
688616	西力科技	2021 年 3 月 10 日	2021 年 9 月 22 日	锁定期股票	7.35	13.78	3,918	28,797.30	53,990.04	-
688677	海泰新光	2021 年 2 月 18 日	2021 年 8 月 26 日	锁定期股票	35.76	103.23	1,464	52,352.64	151,128.72	-

注：1、根据中国证监会《关于修改〈上市公司证券发行管理办法〉的决定》、《关于修改〈创业板上市公司证券发行管理暂行办法〉的决定》以及《关于修改〈上市公司非公开发行股票实施细则〉的决定》，本基金所认购的 2020 年 2 月 14 日(含)后发行完毕的非公开发行股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。此外，本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

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、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的科创板股票，在受让后 6 个月内不得转让。

4、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，本基金参与摇号配售或比例配售方式获配的创业板股票自发行人股票上市之日起在发行人约定的限售期内不得转让。

5、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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

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

本基金为混合型证券投资基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。

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，将风险控制可在承受的范围之内。

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，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 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券（2020 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所持金融工具变现的难易程度。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 2021 年 6 月 30 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（所有者权益）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运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

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

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

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

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

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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2021年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	17,825,970.83	-	-	-	17,825,970.83
结算备付金	737,677.03	-	-	-	737,677.03
存出保证金	50,388.96	-	-	-	50,388.96
交易性金融资产	-	-	-	-234,557,864.93	234,557,864.93
应收利息	-	-	-	2,180.81	2,180.81
应收申购款	-	-	-	6,335.83	6,335.83
应收证券清算款	-	-	-	793,266.86	793,266.86
资产总计	18,614,036.82	-	-	-235,359,648.43	253,973,685.25
负债					
应付赎回款	-	-	-	16,586.18	16,586.18
应付管理人报酬	-	-	-	299,853.90	299,853.90
应付托管费	-	-	-	49,975.66	49,975.66
应付证券清算款	-	-	-	600,562.19	600,562.19
应付交易费用	-	-	-	315,717.77	315,717.77
其他负债	-	-	-	81,823.22	81,823.22
负债总计	-	-	-	1,364,518.92	1,364,518.92
利率敏感度缺口	18,614,036.82	-	-	-233,995,129.51	252,609,166.33
上年度末 2020年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	21,367,851.10	-	-	-	21,367,851.10
结算备付金	704,958.37	-	-	-	704,958.37
存出保证金	97,559.50	-	-	-	97,559.50
交易性金融资产	-	-	-	-212,830,258.31	212,830,258.31
应收利息	-	-	-	2,884.99	2,884.99
应收申购款	-	-	-	1,148.45	1,148.45
应收证券清算款	-	-	-	199,755.94	199,755.94
资产总计	22,170,368.97	-	-	-213,034,047.69	235,204,416.66
负债					
应付赎回款	-	-	-	4,834,396.94	4,834,396.94
应付管理人报酬	-	-	-	315,372.38	315,372.38
应付托管费	-	-	-	52,562.06	52,562.06
应付交易费用	-	-	-	371,370.95	371,370.95
其他负债	-	-	-	177,088.83	177,088.83
负债总计	-	-	-	5,750,791.16	5,750,791.16

利率敏感度缺口	22,170,368.97	-	-207,283,256.53	229,453,625.50
---------	---------------	---	-----------------	----------------

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 2021 年 6 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。

6.4.13.4.3 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股票和债券，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。

本基金对股票资产的投资占基金资产的比例为 60%—95%，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%。

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 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 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	234,557,864.93	92.85	212,830,258.31	92.76
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	234,557,864.93	92.85	212,830,258.31	92.76

注：债券投资为可转换债券、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		
	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（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
分析	业绩比较基准上升5%	10,479,301.41	11,303,069.40
	业绩比较基准下降5%	-10,479,301.41	-11,303,069.40

注：无。

6.4.14 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	234,557,864.93	92.36
	其中：股票	234,557,864.93	92.36
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	18,563,647.86	7.31
8	其他各项资产	852,172.46	0.34
9	合计	253,973,685.25	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	4,151,679.28	1.64
B	采矿业	3,895,858.00	1.54
C	制造业	158,027,471.83	62.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,589,397.40	2.21
E	建筑业	4,879,826.37	1.93
F	批发和零售业	5,398,929.08	2.14
G	交通运输、仓储和邮政业	13,989,936.45	5.54
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,053,777.09	5.17
J	金融业	9,589,340.50	3.80
K	房地产业	7,977,839.00	3.16
L	租赁和商务服务业	3,059,632.50	1.21
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,830,612.63	0.72
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	480,836.20	0.19
Q	卫生和社会工作	1,198,275.00	0.47
R	文化、体育和娱乐业	1,434,453.60	0.57
S	综合	-	-
	合计	234,557,864.93	92.85

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	300639	凯普生物	176,194	5,816,163.94	2.30
2	603599	广信股份	187,018	5,625,501.44	2.23
3	300740	水羊股份	264,400	5,520,672.00	2.19
4	000725	京东方 A	882,270	5,505,364.80	2.18
5	601636	旗滨集团	287,600	5,337,856.00	2.11
6	600905	三峡能源	907,763	5,147,016.21	2.04
7	603444	吉比特	9,300	4,929,000.00	1.95
8	603337	杰克股份	178,325	4,766,627.25	1.89
9	300059	东方财富	122,860	4,028,579.40	1.59
10	300659	中孚信息	117,100	3,931,047.00	1.56
11	002171	楚江新材	444,600	3,881,358.00	1.54
12	300761	立华股份	113,800	3,770,194.00	1.49
13	600426	华鲁恒升	116,719	3,612,453.05	1.43
14	600809	山西汾酒	7,900	3,539,200.00	1.40
15	600019	宝钢股份	428,200	3,271,448.00	1.30
16	600409	三友化工	311,500	3,149,265.00	1.25
17	300327	中颖电子	36,600	3,119,418.00	1.23
18	000671	阳光城	591,394	3,075,248.80	1.22
19	300726	宏达电子	43,228	3,047,141.72	1.21
20	600782	新钢股份	534,000	2,979,720.00	1.18
21	300747	锐科激光	25,400	2,897,124.00	1.15
22	601717	郑煤机	243,000	2,826,090.00	1.12
23	002382	蓝帆医疗	129,465	2,699,345.25	1.07
24	603056	德邦股份	233,900	2,570,561.00	1.02
25	600176	中国巨石	165,621	2,568,781.71	1.02
26	000830	鲁西化工	136,000	2,547,280.00	1.01
27	601668	中国建筑	546,300	2,540,295.00	1.01
28	300769	德方纳米	12,200	2,521,618.00	1.00
29	000921	海信家电	164,200	2,359,554.00	0.93
30	601598	中国外运	466,769	2,357,183.45	0.93
31	000429	粤高速 A	326,200	2,338,854.00	0.93
32	603678	火炬电子	34,600	2,335,500.00	0.92
33	000932	华菱钢铁	346,900	2,289,540.00	0.91
34	600885	宏发股份	36,000	2,257,200.00	0.89
35	603566	普莱柯	98,100	2,236,680.00	0.89
36	601919	中远海控	72,900	2,226,366.00	0.88
37	600383	金地集团	209,755	2,147,891.20	0.85
38	603225	新凤鸣	104,000	2,111,200.00	0.84
39	600060	海信视像	121,015	2,045,153.50	0.81
40	002645	华宏科技	126,600	2,023,068.00	0.80

41	000028	国药一致	52,500	1,986,600.00	0.79
42	601006	大秦铁路	294,600	1,938,468.00	0.77
43	002262	恩华药业	122,200	1,875,770.00	0.74
44	601857	中国石油	352,800	1,866,312.00	0.74
45	603986	兆易创新	9,580	1,800,082.00	0.71
46	600323	瀚蓝环境	82,000	1,786,780.00	0.71
47	300223	北京君正	17,700	1,786,284.00	0.71
48	002138	顺络电子	45,000	1,744,650.00	0.69
49	600884	杉杉股份	67,700	1,578,764.00	0.62
50	002179	中航光电	19,800	1,564,596.00	0.62
51	600998	九州通	100,500	1,544,685.00	0.61
52	600741	华域汽车	58,416	1,534,588.32	0.61
53	000733	振华科技	24,100	1,471,787.00	0.58
54	000799	酒鬼酒	5,700	1,456,920.00	0.58
55	601928	凤凰传媒	198,700	1,418,718.00	0.56
56	601838	成都银行	108,000	1,365,120.00	0.54
57	002078	太阳纸业	101,500	1,355,025.00	0.54
58	002110	三钢闽光	199,200	1,342,608.00	0.53
59	600586	金晶科技	144,200	1,342,502.00	0.53
60	300037	新宙邦	13,272	1,328,527.20	0.53
61	300035	中科电气	54,300	1,327,635.00	0.53
62	002254	泰和新材	64,100	1,299,307.00	0.51
63	601319	中国人保	214,700	1,273,171.00	0.50
64	600057	厦门象屿	200,750	1,254,687.50	0.50
65	603267	鸿远电子	9,800	1,253,616.00	0.50
66	600548	深高速	142,400	1,241,728.00	0.49
67	000498	山东路桥	220,100	1,232,560.00	0.49
68	600012	皖通高速	190,000	1,227,400.00	0.49
69	002572	索菲亚	50,700	1,226,940.00	0.49
70	603882	金域医学	7,500	1,198,275.00	0.47
71	300394	天孚通信	45,540	1,153,072.80	0.46
72	002013	中航机电	112,400	1,131,868.00	0.45
73	600919	江苏银行	157,400	1,117,540.00	0.44
74	600606	绿地控股	198,700	1,082,915.00	0.43
75	300406	九强生物	54,100	1,067,393.00	0.42
76	002833	弘亚数控	27,500	1,065,625.00	0.42
77	300661	圣邦股份	4,200	1,061,466.00	0.42
78	600845	宝信软件	20,540	1,045,486.00	0.41
79	000157	中联重科	111,000	1,025,640.00	0.41
80	600298	安琪酵母	18,800	1,022,344.00	0.40
81	002396	星网锐捷	47,800	1,020,530.00	0.40
82	002158	汉钟精机	37,800	1,014,930.00	0.40

83	601328	交通银行	206,100	1,009,890.00	0.40
84	600138	中青旅	95,900	1,006,950.00	0.40
85	300463	迈克生物	23,300	980,697.00	0.39
86	601208	东材科技	58,800	959,616.00	0.38
87	601666	平煤股份	133,800	951,318.00	0.38
88	688099	晶晨股份	8,343	936,084.60	0.37
89	601186	中国铁建	123,800	919,834.00	0.36
90	688002	睿创微纳	9,020	900,466.60	0.36
91	300377	赢时胜	80,800	900,112.00	0.36
92	600282	南钢股份	249,300	887,508.00	0.35
93	603515	欧普照明	34,000	872,780.00	0.35
94	002507	涪陵榨菜	22,600	851,116.00	0.34
95	000683	远兴能源	177,800	830,326.00	0.33
96	600688	上海石化	220,600	829,456.00	0.33
97	300058	蓝色光标	131,900	797,995.00	0.32
98	601233	桐昆股份	32,700	787,743.00	0.31
99	000933	神火股份	82,900	783,405.00	0.31
100	600746	江苏索普	50,764	778,719.76	0.31
101	002314	南山控股	233,500	777,555.00	0.31
102	603606	东方电缆	36,000	725,040.00	0.29
103	300748	金力永磁	22,560	713,572.80	0.28
104	603867	新化股份	27,000	677,970.00	0.27
105	601689	拓普集团	17,900	669,997.00	0.27
106	002727	一心堂	19,900	658,889.00	0.26
107	000887	中鼎股份	53,200	642,656.00	0.25
108	000656	金科股份	109,500	634,005.00	0.25
109	688208	道通科技	7,277	633,026.23	0.25
110	300443	金雷股份	23,500	621,810.00	0.25
111	603801	志邦家居	19,140	611,714.40	0.24
112	600219	南山铝业	157,700	567,720.00	0.22
113	300755	华致酒行	13,500	550,935.00	0.22
114	603010	万盛股份	25,840	541,864.80	0.21
115	002614	奥佳华	23,700	536,331.00	0.21
116	688311	盟升电子	7,208	526,184.00	0.21
117	002064	华峰化学	37,000	525,400.00	0.21
118	600597	光明乳业	36,100	520,201.00	0.21
119	688029	南微医学	1,600	498,704.00	0.20
120	002484	江海股份	31,400	486,072.00	0.19
121	603377	东方时尚	44,980	480,836.20	0.19
122	002567	唐人神	71,100	469,971.00	0.19
123	603416	信捷电气	7,400	469,678.00	0.19
124	688321	微芯生物	9,916	458,020.04	0.18

125	688088	虹软科技	8,200	457,150.00	0.18
126	601678	滨化股份	56,500	446,915.00	0.18
127	300593	新雷能	10,080	437,976.00	0.17
128	601088	中国神华	22,300	435,296.00	0.17
129	600153	建发股份	52,735	427,153.50	0.17
130	603288	海天味业	3,300	425,535.00	0.17
131	600801	华新水泥	24,200	425,194.00	0.17
132	002487	大金重工	51,300	383,211.00	0.15
133	300750	宁德时代	700	374,360.00	0.15
134	002041	登海种业	24,500	370,195.00	0.15
135	002876	三利谱	5,400	349,380.00	0.14
136	000630	铜陵有色	115,200	313,344.00	0.12
137	600398	海澜之家	42,600	308,424.00	0.12
138	603363	傲农生物	29,900	307,970.00	0.12
139	000898	鞍钢股份	69,200	307,940.00	0.12
140	300119	瑞普生物	9,100	307,762.00	0.12
141	600116	三峡水利	36,700	306,812.00	0.12
142	300573	兴齐眼药	2,100	296,163.00	0.12
143	688063	派能科技	1,460	287,328.00	0.11
144	601168	西部矿业	24,000	286,320.00	0.11
145	002839	张家港行	49,600	269,824.00	0.11
146	600418	江淮汽车	21,300	264,759.00	0.10
147	300623	捷捷微电	6,950	262,918.50	0.10
148	601377	兴业证券	27,200	262,752.00	0.10
149	601231	环旭电子	14,600	245,426.00	0.10
150	002048	宁波华翔	12,400	241,800.00	0.10
151	300633	开立医疗	7,000	221,060.00	0.09
152	002425	凯撒文化	24,800	207,576.00	0.08
153	002743	富煌钢构	34,300	206,143.00	0.08
154	600882	妙可蓝多	2,900	202,420.00	0.08
155	600028	中国石化	46,000	200,560.00	0.08
156	002124	天邦股份	28,280	198,242.80	0.08
157	000961	中南建设	33,400	197,728.00	0.08
158	603728	鸣志电器	11,200	197,008.00	0.08
159	603536	惠发食品	14,500	185,745.00	0.07
160	601669	中国电建	41,800	161,766.00	0.06
161	002511	中顺洁柔	5,700	157,035.00	0.06
162	300768	迪普科技	4,000	154,520.00	0.06
163	002669	康达新材	11,900	151,487.00	0.06
164	688677	海泰新光	1,464	151,128.72	0.06
165	300459	金科文化	44,200	142,766.00	0.06
166	601336	新华保险	3,000	137,730.00	0.05

167	300138	晨光生物	9,000	137,700.00	0.05
168	600446	金证股份	8,700	125,628.00	0.05
169	600110	诺德股份	10,300	125,454.00	0.05
170	600461	洪城环境	16,880	122,548.80	0.05
171	301016	雷尔伟	2,747	115,711.58	0.05
172	300733	西菱动力	5,100	111,792.00	0.04
173	300379	东方通	3,840	109,401.60	0.04
174	600297	广汇汽车	36,100	103,968.00	0.04
175	688608	恒玄科技	297	94,122.27	0.04
176	600717	天津港	22,800	89,376.00	0.04
177	600104	上汽集团	3,900	85,683.00	0.03
178	000063	中兴通讯	2,500	83,075.00	0.03
179	601607	上海医药	3,800	80,294.00	0.03
180	002636	金安国纪	4,900	79,478.00	0.03
181	002392	北京利尔	17,700	77,526.00	0.03
182	600183	生益科技	3,300	77,253.00	0.03
183	000923	河钢资源	4,000	76,280.00	0.03
184	000100	TCL 科技	9,400	71,910.00	0.03
185	000488	晨鸣纸业	8,200	66,748.00	0.03
186	002970	锐明技术	1,500	65,115.00	0.03
187	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.03
188	688355	明志科技	2,649	63,046.20	0.02
189	000069	华侨城 A	8,400	62,496.00	0.02
190	688328	深科达	1,499	56,647.21	0.02
191	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.02
192	688191	智洋创新	3,096	54,923.04	0.02
193	688616	西力科技	3,918	53,990.04	0.02
194	601918	新集能源	11,000	53,790.00	0.02
195	688087	英科再生	2,271	49,871.16	0.02
196	300919	中伟股份	284	46,292.00	0.02
197	603086	先达股份	5,040	46,065.60	0.02
198	300033	同花顺	400	45,112.00	0.02
199	300073	当升科技	800	44,952.00	0.02
200	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.02
201	002402	和而泰	1,850	44,344.50	0.02
202	300894	火星人	566	38,488.00	0.02
203	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01
204	000425	徐工机械	5,400	34,398.00	0.01
205	600030	中信证券	1,300	32,422.00	0.01
206	300957	贝泰妮	120	30,235.20	0.01
207	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01
208	601699	潞安环能	2,200	25,982.00	0.01

209	001207	联科科技	682	22,581.02	0.01
210	300979	华利集团	232	20,300.00	0.01
211	300973	立高食品	168	19,439.28	0.01
212	301009	可靠股份	665	18,546.85	0.01
213	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.01
214	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.01
215	300860	锋尚文化	270	15,735.60	0.01
216	300496	中科创达	99	15,548.94	0.01
217	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.01
218	300941	创识科技	284	14,182.96	0.01
219	300981	中红医疗	155	14,010.45	0.01
220	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.01
221	300940	南极光	307	13,317.66	0.01
222	300937	药易购	244	13,105.24	0.01
223	300932	三友联众	409	12,969.39	0.01
224	300614	百川畅银	314	12,679.32	0.01
225	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.01
226	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
227	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
228	300997	欢乐家	875	11,418.75	0.00
229	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
230	300996	普联软件	238	10,050.74	0.00
231	300968	格林精密	797	9,619.79	0.00
232	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
233	300258	精锻科技	700	9,359.00	0.00
234	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
235	601288	农业银行	3,000	9,090.00	0.00
236	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
237	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
238	000338	潍柴动力	500	8,935.00	0.00
239	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
240	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
241	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
242	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
243	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
244	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
245	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
246	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
247	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
248	300993	玉马遮阳	395	7,619.55	0.00
249	300986	志特新材	240	7,336.80	0.00
250	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00

251	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
252	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
253	688122	西部超导	100	6,487.00	0.00
254	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
255	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
256	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
257	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
258	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
259	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
260	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
261	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
262	600089	特变电工	400	5,140.00	0.00
263	300985	致远新能	189	4,689.09	0.00
264	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
265	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
266	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
267	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
268	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
269	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
270	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00
271	601628	中国人寿	100	3,389.00	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	000725	京东方 A	8,421,118.40	3.67
2	600809	山西汾酒	8,227,996.47	3.59
3	603337	杰克股份	6,470,278.25	2.82
4	300659	中孚信息	5,976,210.00	2.60
5	603566	普莱柯	5,842,227.00	2.55
6	300740	水羊股份	5,772,870.25	2.52
7	601636	旗滨集团	5,446,171.00	2.37
8	603599	广信股份	5,426,292.02	2.36
9	600019	宝钢股份	5,125,354.00	2.23
10	300059	东方财富	4,715,770.00	2.06
11	601231	环旭电子	4,556,026.00	1.99
12	600426	华鲁恒升	4,524,155.28	1.97
13	002138	顺络电子	4,434,920.46	1.93
14	603444	吉比特	4,286,277.00	1.87
15	603678	火炬电子	4,130,985.22	1.80
16	300761	立华股份	4,074,274.00	1.78

17	300073	当升科技	3,973,140.00	1.73
18	300037	新宙邦	3,906,426.60	1.70
19	000921	海信家电	3,818,136.00	1.66
20	300327	中颖电子	3,740,300.11	1.63

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。

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	300119	瑞普生物	6,816,144.00	2.97
2	002027	分众传媒	6,007,528.99	2.62
3	300274	阳光电源	5,838,405.94	2.54
4	600060	海信视像	5,623,391.00	2.45
5	000725	京东方 A	5,273,877.00	2.30
6	600809	山西汾酒	5,107,470.10	2.23
7	603258	电魂网络	4,981,053.75	2.17
8	002641	永高股份	4,962,069.00	2.16
9	002139	拓邦股份	4,906,722.00	2.14
10	300124	汇川技术	4,631,567.21	2.02
11	300624	万兴科技	4,459,939.42	1.94
12	601225	陕西煤业	4,376,946.00	1.91
13	002223	鱼跃医疗	4,304,868.05	1.88
14	000932	华菱钢铁	4,249,112.00	1.85
15	603128	华贸物流	4,210,282.30	1.83
16	002382	蓝帆医疗	4,162,719.55	1.81
17	002539	云图控股	4,161,883.13	1.81
18	000069	华侨城 A	3,969,597.00	1.73
19	603566	普莱柯	3,868,936.08	1.69
20	300073	当升科技	3,727,040.00	1.62

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。

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	512,698,260.09
卖出股票收入（成交）总额	530,228,748.19

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。

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：无。

7.10.2 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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

7.11.3 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

安徽广信农化股份有限公司

2020年11月25日，安徽省统计局针对安徽广信农化股份有限公司的提供不真实统计资料的违法违规行，对公司予以警告。以上证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

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	50,388.96
2	应收证券清算款	793,266.86
3	应收股利	-
4	应收利息	2,180.81
5	应收申购款	6,335.83
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	852,172.46

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600905	三峡能源	5,147,016.21	2.04	锁定期股票

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 (%)
449	420,687.79	171,940,536.65	91.03	16,948,279.15	8.97

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	19,415.78	0.0103

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

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

§ 9 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	202,389,837.73
本报告期基金总申购份额	22,898,138.07
减：本报告期基金总赎回份额	36,399,160.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	188,888,815.80

§ 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：

报告期内，公司原副总经理高阳先生辞去公司副总经理职务，经公司董事会审议通过，于2021年1月16日离任。

报告期内，经公司董事会审议通过，聘任王宗合先生担任公司副总经理，任职日期自2021年1月28日起；聘任梁浩先生担任公司副总经理，任职日期自2021年1月28日起。

本公司已将上述变更事项报相关监管部门备案。

报告期内，经公司股东会审议通过，史际春先生不再担任公司独立董事，于2021年4月22日离任；聘任蒋毅刚先生担任公司独立董事，任职日期自2021年4月22日起。

基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

无。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

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

无。

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	
天风证券	2	937,573,936.85	90.74%	666,896.41	88.44%	-
中金财富	1	65,149,373.67	6.31%	59,375.12	7.87%	-
长江证券	1	22,080,238.50	2.14%	20,124.40	2.67%	-
国泰君安	2	8,402,553.92	0.81%	7,657.13	1.02%	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
东方财富证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
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	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	3	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投证 券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

注：交易单元选择的标准和程序：

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

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

2) 选择交易单元的程序：

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。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例	成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	成交金额	占当期权 证 成交总额的 比例
天风证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
东方财富 证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-

兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投 证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
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	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与东莞农村商业银行股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021年01月04日
2	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国银行股份有限公司定期定额申购和网上银行、手机银行申购费率优惠活动的公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021年01月04日
3	鹏华基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021年01月16日
4	鹏华量化先锋混合型证券投资基金2020年第4季度报告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021年01月22日
5	鹏华基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021年01月28日
6	鹏华基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021年01月28日
7	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021年02月06日
8	鹏华基金管理有限公司关于终止包商银行股份有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021年02月08日
9	鹏华量化先锋混合型证券投资基金更新的招募说明书	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021年02月10日
10	鹏华量化先锋混合型证券投资基金基	《证券日报》、基金管理人	2021年03月05日

	金经理变更公告	人网站及中国证监会基金电子披露网站	
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》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 03 月 06 日
12	鹏华基金管理有限公司关于对旗下基金中基金资产管理计划通过直销渠道申购、赎回、转换旗下公募基金免除相关费用的公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 03 月 09 日
13	鹏华量化先锋混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 03 月 10 日
14	鹏华量化先锋混合型证券投资基金更新的招募说明书（2021 年第 1 号）	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 03 月 10 日
15	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 03 月 10 日
16	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购贝泰妮首次公开发行 A 股的公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 03 月 19 日
17	鹏华基金管理有限公司关于直销渠道相关业务费率优惠活动的公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 03 月 22 日
18	鹏华量化先锋混合型证券投资基金 2020 年年度报告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 03 月 30 日
19	鹏华基金管理有限公司旗下基金 2020 年年度报告提示性公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 03 月 30 日
20	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加珠海盈米基金销售有限公司基金转换业务申购补差费率优惠活动的公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 03 月 30 日
21	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国银行股份有限公司定期定额申购和网上银行、手机银行申购费率优惠活动的公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 04 月 01 日
22	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 04 月 10 日
23	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中泰证券股份有限公司申购（含定期定额投资）费率优惠活动的	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 04 月 13 日

	公告		
24	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与北京展恒基金销售股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 04 月 19 日
25	鹏华基金管理有限公司关于调整旗下部分基金单笔最低申购（含定期定额投资）金额、单笔最低转换份额和账户最低余额限制的公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 04 月 19 日
26	鹏华量化先锋混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 04 月 20 日
27	鹏华量化先锋混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 04 月 21 日
28	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2021 年第 1 季度报告提示性公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 04 月 21 日
29	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购瑞华泰首次公开发行 A 股的公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 04 月 23 日
30	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购志特新材首次公开发行 A 股的公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 04 月 23 日
31	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 04 月 26 日
32	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与宁波银行股份有限公司申购（不含定期定额投资）费率优惠活动的公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 04 月 30 日
33	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与珠海盈米基金销售有限公司相关费率优惠活动的公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 05 月 14 日
34	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 06 月 04 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	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况
------	----------------	------------

别	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	20210101~20210630	104,775,168.08	-	-	104,775,168.08	55.47
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；
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 2021 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

2021 年 8 月 30 日