

鹏华安润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：兴业银行股份有限公司

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。

基金托管人兴业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 | 7 |
| 2.4 信息披露方式 | 8 |
| 2.5 其他相关资料 | 8 |
| § 3 主要财务指标和基金净值表现 | 8 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 8 |
| 3.2 基金净值表现 | 9 |
| 3.3 其他指标 | 11 |
| § 4 管理人报告 | 11 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 11 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 | 12 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 12 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 | 13 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 | 13 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 14 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 14 |
| 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 | 14 |
| § 5 托管人报告 | 15 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 15 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 15 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 | 15 |
| § 6 半年度财务会计报告（未经审计） | 15 |
| 6.1 资产负债表 | 15 |
| 6.2 利润表 | 16 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表 | 17 |
| 6.4 报表附注 | 18 |
| § 7 投资组合报告 | 46 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 46 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 46 |
| 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 | 47 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 51 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 53 |

| | |
|---|-----------|
| 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 | 53 |
| 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 | 53 |
| 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 | 53 |
| 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 | 54 |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 | 54 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 54 |
| 7.12 投资组合报告附注 | 54 |
| § 8 基金份额持有人信息..... | 55 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 55 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 56 |
| 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 | 56 |
| § 9 开放式基金份额变动..... | 56 |
| § 10 重大事件揭示 | 57 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 | 57 |
| 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 | 57 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 57 |
| 10.4 基金投资策略的改变 | 57 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 57 |
| 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 | 57 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 57 |
| 10.8 其他重大事件 | 59 |
| § 11 影响投资者决策的其他重要信息 | 61 |
| 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 | 61 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 61 |
| § 12 备查文件目录 | 61 |
| 12.1 备查文件目录 | 61 |
| 12.2 存放地点 | 61 |
| 12.3 查阅方式 | 61 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|------------------|-----------------|
| 基金名称 | 鹏华安润混合型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 鹏华安润混合 | |
| 基金主代码 | 011073 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2020 年 12 月 30 日 | |
| 基金管理人 | 鹏华基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 兴业银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 552,436,046.27 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 鹏华安润混合 A | 鹏华安润混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 011073 | 011074 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 467,557,845.92 份 | 84,878,200.35 份 |

注：无。

2.2 基金产品说明

| | |
|------|---|
| 投资目标 | 本基金在科学严谨的资产配置框架下，严格控制基金资产风险，力争实现基金资产的长期稳健增值。 |
| 投资策略 | <p>本基金的投资策略分为两个层面：首先，依据资产配置策略动态调整基金资产在各类资产间的分配比例；而后，进行各类资产中的个股、个券精选。在严格控制基金资产风险的前提下，动态调整基金资产在各类资产间的分配比例，力争实现基金资产的长期稳健增值。</p> <p>1、资产配置策略 本基金将通过跟踪考量通常的宏观经济变量（包括 GDP 增长率、CPI 走势、M2 的绝对水平和增长率、利率水平与走势等）以及各项国家政策（包括财政、货币、税收、汇率政策等）来判断经济周期目前的位置以及未来将发展的方向，在此基础上对各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估，制定股票（包括 A 股和港股）、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。</p> <p>2、债券投资策略 本基金债券投资将采取久期策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、个券选择策略、信用债投资策略、可转债及可交换债券投资策略，自上而下地管理组合的久期，灵活地调整组合的券种搭配，同时精选个券，以增强组合的持有期收益。</p> <p>（1）久期策略 久期管理是债券投资的重要考量因素，本基金将采用以“目标久期”为中心、自上而下的组合久期管理策略。</p> <p>（2）收益率曲线策略 收益率曲线的形状变化是判断市场整体走向的一个重要依据，本基金将据此调整组合长、中、短期债券的搭配，并进行动态调整。</p> <p>（3）骑乘策略 本基金将采用基于收益率曲线分析对债券组合进行适时调整的骑乘策略，以达到增强组</p> |

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)信用债投资策略 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。其中,本基金投资信用债的评级范围为 AA 至 AAA,投资于各个信用等级信用债资产占基金总资产的大致比例如下: 信用等级 占比 AAA 50%-100% AA+ 0%-50% AA 0%-20% 本基金持有信用债期间,如果其评级下降、不再符合上述约定,应在评级报告发布之日起 3 个月内调整至符合约定。

(7)可转债及可交换债券投资策略 1)传统可转债投资策略 传统可转债即可转换公司债券,兼具债权和股权双重属性。债权属性是指投资者可以选择持有可转债到期,得到本金与利息收益;股权属性即股票期权属性,是指投资者可以在转股期间以约定的转股价格把可转债转换成股票。因此,可转债的价格由债权价格和期权价格两部分组成。 a.个券选择策略。一方面,本基金将对所有可转债对应的标的股票进行深入研究,采用定性分析(行业地位、竞争优势、治理结构、市场开拓、创新能力等)与定量分析(P/B、P/E、PEG、DCF、DDM、NAV 等)相结合的方式挑选成长性好且估值合理的正股;另一方面,本基金将深入研究分析可转债自身的信用评估。综上所述,本基金将结合可转债自身的信用评估和其正股的价值分析,做为选取个券的重要依据。 b.条款价值发现策略。可转债一般均设有一些特殊条款,包括修正转股价条款、回售条款、赎回条款等,这些条款在特定环境下对可转债价值有着较大的影响。本基金将通过有效分析相关信息力争把握各项条款给可转债带来的可能的投资机会。 c.套利策略。可转债可以按照约定的价格转换为股票,因此在日常交易运作过程中会出现可转债与标的股票之间的套利机会。当处于转股期内的可转债市价低于转股价值,即可转债的转换溢价率为负时,买入可转债的同时卖出标的股票可以获得套利价差;反之,买入标的股票的同时卖出可转债也可以获取反向套利价差。在日常交易运作中,本基金将密切关注可转债与标的股票之间价格之间的对比关系,择机实施套利策略,以增强本基金的收益。

2)分离交易可转债投资策略 本基金在对这类债券基本情况进行研究的同时,将重点分析附权部分对债券估值的影响。对于分离交易可转债的债券部分将按照债券投资策略进行管理,权证部分将在可交易之日起不超过 3 个月的时间内卖出。

3)可交换债券投资策略 可交换债券具有股性和债性,其中债性,即选择持有可交换债券至到期以获取票面价值和票面利息;而对于股性的分析则需关注目标公司的股票价值。本基金将通过对目标公司股票的投资价值分析和可交换债券的纯债部分价值分析综合开展投资决策。

4)可转换债券及可交换债券投资比例 可转换债券(含可分离交易可转换债券)及可交换债券的投资比例不高于基金总资产的

| | |
|--------|--|
| | <p>20%。</p> <p>3、股票投资策略 本基金通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘 A 股和港股的优质公司，构建股票投资组合。本基金将重点关注行业增长前景、行业利润前景和行业成功要素等因素进行自上而下的行业遴选；同时结合对上市公司的竞争力分析、管理层分析等定性分析和对上市公司的关键估值方法（包括 PE、PEG、PB、PS、EV/EBITDA 等）等定量分析进行自下而上的个股精选。除适用上述个股投资策略外，本基金投资港股通标的股票还需关注：1）在港股市场上市、具有行业代表性的优质中资公司；2）具有行业稀缺性的香港本地和外资公司；3）港股市场在行业结构、估值、AH 股折溢价、分红率等方面具有吸引力的投资标的。未来，如果港股通业务规则发生变化或出现法律法规或监管部门允许投资的其他模式，基金管理人在履行适当程序后可相应调整。</p> <p>4、国债期货投资策略 本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。</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，力争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。未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，本基金可相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书中更新并公告。</p> |
| 业绩比较基准 | 中证综合债指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×15%+恒生指数收益率×5%（经汇率估值调整） |
| 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。本基金将投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。 |

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 | 兴业银行股份有限公司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 张戈 |
| | 联系电话 | 林兴盛 |
| | 电子邮箱 | 0755-82825720 |
| 客户服务电话 | zhangge@phfund.com.cn | linxingsheng@cib.com.cn |
| | 4006788999 | 95561 |

| | | |
|-------|--------------------------------|----------------------|
| 传真 | 0755-82021126 | 021-62159217 |
| 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 | 福州市湖东路 154 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 | 上海市银城路 167 号兴业大厦 4 楼 |
| 邮政编码 | 518048 | 200120 |
| 法定代表人 | 何如 | 吕家进 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 《证券时报》 |
| 登载基金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) | |
|---------------|---------------------------|---------------|
| | 鹏华安润混合 A | 鹏华安润混合 C |
| 本期已实现收益 | -3,444,619.16 | -2,974,168.35 |
| 本期利润 | -634,842.59 | -2,932,018.79 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0014 | -0.0185 |
| 本期加权平均净值利润率 | -0.14% | -1.87% |
| 本期基金份额净值增长率 | 0.24% | 0.08% |
| 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 | -1,661,496.86 | -432,265.33 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.0036 | -0.0051 |
| 期末基金资产净值 | 468,668,600.40 | 84,948,405.66 |
| 期末基金份额净值 | 1.0024 | 1.0008 |
| 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 | 0.24% | 0.08% |

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

鹏华安润混合 A

| 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 | 1.20% | 0.18% | -0.14% | 0.15% | 1.34% | 0.03% |
| 过去三个月 | 2.34% | 0.17% | 1.55% | 0.18% | 0.79% | -0.01% |
| 过去六个月 | 0.24% | 0.28% | 2.18% | 0.24% | -1.94% | 0.04% |
| 自基金合同生效起至今 | 0.24% | 0.27% | 2.86% | 0.24% | -2.62% | 0.03% |

鹏华安润混合 C

| 阶段 | 份额净 | 份额净值 | 业绩比较基 | 业绩比较基准 | ①-③ | ②-④ |
|----|-----|------|-------|--------|-----|-----|
|----|-----|------|-------|--------|-----|-----|

| | 值增长率① | 增长率标准差② | 准收益率③ | 收益率标准差④ | | |
|------------|-------|---------|--------|---------|--------|--------|
| 过去一个月 | 1.16% | 0.17% | -0.14% | 0.15% | 1.30% | 0.02% |
| 过去三个月 | 2.26% | 0.17% | 1.55% | 0.18% | 0.71% | -0.01% |
| 过去六个月 | 0.08% | 0.28% | 2.18% | 0.24% | -2.10% | 0.04% |
| 自基金合同生效起至今 | 0.08% | 0.27% | 2.86% | 0.24% | -2.78% | 0.03% |

注：业绩比较基准=中证综合债指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×15%+恒生指数收益率×5%
(经汇率估值调整)

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

鹏华安润混合A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



鹏华安润混合C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 2020 年 12 月 30 日生效，截至本报告期末本基金基金合同生效未满一年。2、截至建仓期结束，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例

3.3 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 | | |
| 方昶 | 基金经理 | 2020-12-30 | - | 7 年 | 方昶先生，国籍中国，经济学硕士，7 年证券从业经验。曾任中国工商银行资产管 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|
| | | | | | 理部投资经理；2016 年 12 月加盟鹏华基金管理有限公司，现担任公募债券投资部基金经理。2018 年 07 月至 2020 年 02 月担任鹏华丰腾债券型证券投资基金基金经理，2018 年 10 月至今担任鹏华信用增利债券型证券投资基金基金经理，2018 年 12 月至 2020 年 02 月担任鹏华丰华债券型证券投资基金基金经理，2019 年 01 月至今担任鹏华丰恒债券型证券投资基金基金经理，2019 年 03 月至今担任鹏华安益增强混合型证券投资基金基金经理，2019 年 06 月至今担任鹏华金城灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2019 年 09 月至今担任鹏华丰享债券型证券投资基金基金经理，2019 年 09 月至 2021 年 01 月担任鹏华中短债 3 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理，2020 年 12 月至今担任鹏华安润混合型证券投资基金基金经理，2021 年 06 月至今担任鹏华弘盛灵活配置混合型证券投资基金基金经理，方昶先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理未发生变动。 |
|--|--|--|--|--|--|

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

2. 证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

2021 年以来，债券市场在资金面、供需错位等多种因素的共同影响之下，收益率整体呈现震荡向下格局。从具体节奏来看：2020 年 11 月-2021 年 1 月初，为应对信用风险事件的冲击，金融委定调“维稳”，央行加大流动性投放，资金面维持宽松，收益率小幅回落；1 月下旬-2 月中旬，信用市场情绪修复，权益市场、房地产市场价格快速上涨，进而引发监管层警惕，央行阶段性收紧流动性，市场紧缩预期升温，现券收益率快速上行；2 月中旬-5 月底，资金面持续维持宽松，政府债发行节奏弱于预期，叠加政策监管收紧的背景之下，信用债净融资缩量，非标融资进一步压缩，市场形成阶段性“资产荒”，现券收益率震荡回落；6 月初，政府债供给担忧增加，叠加资金中枢小幅抬升，现券收益率小幅上行；6 月中下旬，基本面数据边际趋弱，叠加美联储议息会议靴子落地，政府债供给边际缩量，现券收益率小幅回落。权益市场方面，2021 年上半年呈现出了较大的市场波动，市场分化严重。春节前，以消费医药为代表的核心资产持续上涨；春节后在美债收益率上行和货币政策趋紧预期带动下，市场出现巨幅回调；4、5 月份，随着流动性收紧预期边际弱化，市场出现较大幅度反弹；6 月以来，市场在新能源车、光伏发电、半导体等高景气成长方向带动下，走出了较强的结构性行情。

本组合上半年债券投资方面，整体以高等级优质信用债投资为主，适度拉长久期参与利率债波段交易；权益投资方面，在春节后市场回调过程中做出来了防守动作，在 4 到 6 月份市场反弹过程中，对于成长方向做出了加仓，结构上均衡配置，努力为投资者创造持续稳健回报。

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 A 类份额净值增长率为 0.24%，同期业绩比较基准增长率为 2.18%，C 类份额净值增长率为 0.08%，同期业绩比较基准增长率为 2.18%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2021 年下半年，宏观经济层面，在疫情内外部反复的大背景下，宏观经济略有边际下行压力，但总体仍然维持韧性。外需层面，随着海外财政补贴的退坡、产能的逐步修复，出口端对于国内经济拉动作用边际趋缓；内需层面，在地产三条红线背景下投资数据高位回落确定性较高，

叠加消费增速恢复面临一定瓶颈，预计经济可能面临一定的下行压力。在此背景下，货币政策整体或维持稳健偏宽松的格局。

整体来看，稳货币紧信用是全年宏观经济主题，作用到债券市场，稳健偏松的流动性环境对债券市场形成支撑，而严防信用风险仍然是债券投资的核心关注点；权益市场方面，考虑到经济基本面整体仍然维持韧性，叠加市场流动性相对宽松，且市场层面除少数行业外估值整体合理，下半年权益市场仍然存在较好的结构性机会；但与此同时，也要认识到，基本面和流动性的持续拉锯、极度分化的市场环境对权益投资带来了更大的挑战。下半年操作上，本组合将更加注重投资的安全边际和风险收益比、更加敬畏市场，在管控好组合回撤的基础上争取为投资者创造持续稳健回报。

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，本基金鹏华安润混合 A 期末可供分配利润为-1,661,496.86 元，期末基金份额净值 1.0024 元，不符合利润分配条件；鹏华安润混合 C 期末可供分配利润为-432,265.33 元，期末基金份额净值 1.0008 元，不符合利润分配条件。

2、本基金本报告期内未进行利润分配。

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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认真复核了中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，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：鹏华安润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 | 3,832,500.59 | 324,096,130.80 |
| 结算备付金 | | 20,207,986.80 | - |
| 存出保证金 | | 241,864.74 | - |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 683,768,684.17 | - |
| 其中：股票投资 | | 141,594,119.87 | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 542,174,564.30 | - |
| 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 | - | 110,000,000.00 |
| 应收证券清算款 | | 23,592,302.84 | - |

| | | | |
|-----------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 7,037,337.80 | 3,150.93 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | - | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 738,680,676.94 | 434,099,281.73 |
| 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 | | 163,000,000.00 | - |
| 应付证券清算款 | | 1,398,406.88 | 110,000,000.00 |
| 应付赎回款 | | 19,883,128.66 | - |
| 应付管理人报酬 | | 281,343.27 | 5,313.05 |
| 应付托管费 | | 46,890.53 | 885.51 |
| 应付销售服务费 | | 20,947.39 | 1,106.62 |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 272,336.66 | - |
| 应交税费 | | 23,879.43 | - |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 136,738.06 | - |
| 负债合计 | | 185,063,670.88 | 110,007,305.18 |
| 所有者权益: | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 552,436,046.27 | 324,096,130.80 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 1,180,959.79 | -4,154.25 |
| 所有者权益合计 | | 553,617,006.06 | 324,091,976.55 |
| 负债和所有者权益总计 | | 738,680,676.94 | 434,099,281.73 |

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额总额为 552,436,046.27 份，其中鹏华安润混合 A 基金份额总额为 467,557,845.92 份，基金份额净值 1.0024 元；鹏华安润混合 C 基金份额总额为 84,878,200.35 份，基金份额净值 1.0008 元。

6.2 利润表

会计主体：鹏华安润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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|------|-----|--|
| 一、收入 | | 943,395.48 |

| | | |
|------------------------|------------|----------------|
| 1. 利息收入 | | 7,206,102.05 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 132,181.83 |
| 债券利息收入 | | 6,665,853.02 |
| 资产支持证券利息收入 | | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 408,067.20 |
| 证券出借利息收入 | | - |
| 其他利息收入 | | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | -9,605,102.01 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | -10,509,790.97 |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | 18,274.96 |
| 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 | 886,414.00 |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | 2,851,926.13 |
| 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 | 490,469.31 |
| 减：二、费用 | | 4,510,256.86 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 1,817,841.50 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 302,973.56 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | 234,991.47 |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.19 | 1,475,337.00 |
| 5. 利息支出 | | 576,487.13 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 576,487.13 |
| 6. 税金及附加 | | 11,088.68 |
| 7. 其他费用 | 6.4.7.20 | 91,537.52 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | -3,566,861.38 |
| 减：所得税费用 | | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | -3,566,861.38 |

注：本基金合同于 2020 年 12 月 30 日生效，无上年度可比较期间及可比较数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鹏华安润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） | 324,096,130.80 | -4,154.25 | 324,091,976.55 |

| | | | |
|--|-----------------|---------------|-----------------|
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | -3,566,861.38 | -3,566,861.38 |
| 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） | 228,339,915.47 | 4,751,975.42 | 233,091,890.89 |
| 其中：1. 基金申购款 | 457,996,222.82 | 2,174,447.24 | 460,170,670.06 |
| 2. 基金赎回款 | -229,656,307.35 | 2,577,528.18 | -227,078,779.17 |
| 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） | 552,436,046.27 | 1,180,959.79 | 553,617,006.06 |

注：本基金合同于 2020 年 12 月 30 日生效，无上年度可比较期间及可比较数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 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

鹏华安润混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2020]3295号《关于准予鹏华安润混合型证券投资基金注册的批复》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《鹏华安润混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币324,087,625.80元,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(2020)第1142号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华安润混合型证券投资基金基金合同》于2020年12月30日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为324,096,130.80份基金份额,其中认购资金利息折合8,505.00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，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《鹏华安润混合型证券投资基金基金合同》和《鹏华安润混合型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购基金时收取认购/申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，并不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，并不收取认购/申购费用的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存，并分别计算基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华安润混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括境内依法发行或上市交易的股票（包含主板、中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（含国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、政府支持机构债、地方政府债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券及其他中国证监会允许基金投资的债券）、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款等）、货币市场工具、同业存单、资产支持证券、国债期货、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金投资于股票资产的比例不超过基金资产的 30%（其中，港股通标的股票占股票资产的比例不超过 50%）；投资同业存单不得超过基金资产的 20%；每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券；前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金业绩比较基准为：中证综合债指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×15%+恒生指数收益率×5%（经汇率估值调整）。

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》、《鹏华安润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 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、基金投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及

基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

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

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

6.4.4.10 费用的确认和计量

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

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类/级别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投

资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

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

6.4.4.13 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

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

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

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 | 3,832,500.59 |
| 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 | 3,832,500.59 |

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 | 139,531,828.08 | 141,594,119.87 | 2,062,291.79 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - |

| | | | | |
|--------|-------|----------------|----------------|--------------|
| 债券 | 交易所市场 | 338,057,220.56 | 338,201,164.30 | 143,943.74 |
| | 银行间市场 | 203,327,709.40 | 203,973,400.00 | 645,690.60 |
| | 合计 | 541,384,929.96 | 542,174,564.30 | 789,634.34 |
| 资产支持证券 | | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - |
| 合计 | | 680,916,758.04 | 683,768,684.17 | 2,851,926.13 |

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 | 335.07 |
| 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 | 5,007.67 |
| 应收债券利息 | 7,031,897.14 |
| 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 | 97.92 |
| 合计 | 7,037,337.80 |

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 | 272,336.66 |
| 银行间市场应付交易费用 | - |
| 合计 | 272,336.66 |

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 | 49,957.61 |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 预提费用 | 86,780.45 |
| 合计 | 136,738.06 |

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

鹏华安润混合 A

| 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 | 189,088,510.80 | 189,088,510.80 |
| 本期申购 | 378,438,683.22 | 378,438,683.22 |
| 本期赎回 (以“-”号填列) | -99,969,348.10 | -99,969,348.10 |
| -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 | 467,557,845.92 | 467,557,845.92 |

鹏华安润混合 C

| 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 | 135,007,620.00 | 135,007,620.00 |
| 本期申购 | 79,557,539.60 | 79,557,539.60 |
| 本期赎回 (以“-”号填列) | -129,686,959.25 | -129,686,959.25 |
| -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 | 84,878,200.35 | 84,878,200.35 |

注：本基金自 2020 年 12 月 28 日至 2020 年 12 月 29 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 324,087,625.80 元。根据《鹏华安润混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金设立

募集期内认购资金产生的利息收入人民币 8,505.00 元在本基金成立后，折算为 8,505.00 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

鹏华安润混合 A

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|---------------|--------------|--------------|
| 上年度末 | -1,778.09 | - | -1,778.09 |
| 本期利润 | -3,444,619.16 | 2,809,776.57 | -634,842.59 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 1,784,900.39 | -37,525.23 | 1,747,375.16 |
| 其中：基金申购款 | 1,482,556.05 | 189,280.79 | 1,671,836.84 |
| 基金赎回款 | 302,344.34 | -226,806.02 | 75,538.32 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | -1,661,496.86 | 2,772,251.34 | 1,110,754.48 |

鹏华安润混合 C

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|---------------|------------|---------------|
| 上年度末 | -2,376.16 | - | -2,376.16 |
| 本期利润 | -2,974,168.35 | 42,149.56 | -2,932,018.79 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 2,544,279.18 | 460,321.08 | 3,004,600.26 |
| 其中：基金申购款 | 342,316.12 | 160,294.28 | 502,610.40 |
| 基金赎回款 | 2,201,963.06 | 300,026.80 | 2,501,989.86 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | -432,265.33 | 502,470.64 | 70,205.31 |

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 | 36,728.99 |
| 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 | 62,140.41 |

| | |
|----|------------|
| 其他 | 33,312.43 |
| 合计 | 132,181.83 |

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 | -10,509,790.97 |
| 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 | -10,509,790.97 |

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 | 437,077,607.34 |
| 减：卖出股票成本总额 | 447,587,398.31 |
| 买卖股票差价收入 | -10,509,790.97 |

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

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021年6月30日 |
|-------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | 18,274.96 |
| 债券投资收益——赎回差价收入 | - |
| 债券投资收益——申购差价收入 | - |
| 合计 | 18,274.96 |

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-------------------------|----------------------|
| | 2021年1月1日至2021年6月30日 |
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额 | 226,405,457.18 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 223,395,968.44 |
| 减：应收利息总额 | 2,991,213.78 |
| 买卖债券差价收入 | 18,274.96 |

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 | 886,414.00 |
| 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 | 886,414.00 |

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 | 2,851,926.13 |
| 股票投资 | 2,062,291.79 |
| 债券投资 | 789,634.34 |
| 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 | 2,851,926.13 |

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 | 479,681.43 |
| 基金转换费收入 | 10,787.88 |
| 合计 | 490,469.31 |

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 | 1,473,029.50 |
| 银行间市场交易费用 | 2,307.50 |
| 合计 | 1,475,337.00 |

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 | 27,273.08 |
| 信息披露费 | 59,507.37 |
| 证券出借违约金 | - |
| 银行汇划费用 | 3,257.07 |
| 账户维护费 | 1,500.00 |
| 合计 | 91,537.52 |

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 |
| 兴业银行股份有限公司（“兴业银行”） | 基金托管人 |

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

本基金基金合同于 2020 年 12 月 30 日生效，截至本报告期末不满一年，无上年度可比期间数据。

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 |
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 1,817,841.50 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 26,065.58 |

注：1、支付基金管理人鹏华基金公司的管理人报酬年费率为 0.60%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×0.60%÷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 |

| | |
|----------------|------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 302,973.56 |
|----------------|------------|

注：支付基金托管人兴业银行的托管费年费率为 0.10%，逐日计提，按月支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.10%÷当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | | |
|----------------|---------------------------------------|------------|------------|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 鹏华安润混合 A | 鹏华安润混合 C | 合计 |
| 鹏华基金公司 | - | 182,662.67 | 182,662.67 |
| 合计 | - | 182,662.67 | 182,662.67 |

注：鹏华安润混合 A 基金份额不支付销售服务费；支付基金销售机构的鹏华安润混合 C 基金份额的销售服务费年费率为 0.30%，逐日计提，按月支付，日销售服务费=前一日分类基金资产净值×0.30%÷当年天数。

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 | |
|-------|---------------------------------------|-----------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 兴业银行 | 3,832,500.59 | 36,728.99 |

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

| 本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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： 张） | 总金额 |
| 国信证券 | 300957 | 贝泰妮 | 网下申购 | 4,958 | 234,662.14 |
| 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成立。

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 | 329 | 3,023.51 | 13,285.02 | - |
| 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 | 496 | 23,475.68 | 124,972.16 | - |
| 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 | - |
| 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 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|-------------|-------|-------|-------|-----|-----------|-----------|---|
| | | | 日 | | | | | | | |
| 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 | 410 | 4,961.00 | 7,908.90 | - |
| 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 | 241 | 5,015.21 | 10,177.43 | - |
| 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 | 928 | 4,584.32 | 12,110.40 | - |
| 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 | 801 | 10,044.54 | 22,339.89 | - |
| 301010 | 晶雪节能 | 2021年6月9日 | 2021年12月20日 | 锁定期股票 | 7.83 | 17.61 | 218 | 1,706.94 | 3,838.98 | - |
| 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 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|-------------|-------|-------|-------|---------|--------------|--------------|---|
| | | | 日 | | | | | | | |
| 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 | 德才股份 | 2021年6月28日 | 2021年7月6日 | 新股未上市 | 31.56 | 31.56 | 349 | 11,014.44 | 11,014.44 | - |
| 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 | 2,469 | 54,219.24 | 54,219.24 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|-------------|-------|-------|-------|-------|-----------|------------|---|
| 688113 | 联测科技 | 2021年4月26日 | 2021年11月8日 | 锁定期股票 | 19.14 | 49.29 | 1,415 | 27,083.10 | 69,745.35 | - |
| 688217 | 睿昂基因 | 2021年5月7日 | 2021年11月17日 | 锁定期股票 | 18.42 | 58.40 | 1,040 | 19,156.80 | 60,736.00 | - |
| 688226 | 威腾电气 | 2021年6月28日 | 2022年1月7日 | 锁定期股票 | 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 | - |
| 688315 | 诺禾致源 | 2021年4月2日 | 2021年10月13日 | 锁定期股票 | 12.76 | 39.20 | 3,711 | 47,352.36 | 145,471.20 | - |
| 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 | - |
| 688676 | 金盘科技 | 2021年3月2日 | 2021年9月9日 | 锁定期股票 | 10.10 | 16.24 | 3,750 | 37,875.00 | 60,900.00 | - |
| 688690 | 纳微科技 | 2021年6月16日 | 2021年12月23日 | 锁定期股票 | 8.07 | 79.89 | 3,477 | 28,059.39 | 277,777.53 | - |
| 688700 | 东威科技 | 2021年6月7日 | 2021年12月15日 | 锁定期股票 | 9.41 | 38.46 | 3,049 | 28,691.09 | 117,264.54 | - |

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

截至本报告期末 2021 年 06 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 163,000,000.00 元，于 2021 年 07 月 07 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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、债券投资及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具等。

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兴业银行股份有限公司，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，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券占基金资产净值的比例为 75.86%。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 2021 年 6 月 30 日 | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| A-1 | 30,087,000.00 | - |
| A-1 以下 | 110,373,000.00 | - |
| 未评级 | 84,947,034.20 | - |
| 合计 | 225,407,034.20 | - |

注：未评级债券包括国债、中央银行票据和政策性金融债；A-1 以下包含未评级的超短期融资券。

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

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2021年6月30日 | 上年度末 2020年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA | 269,384,160.00 | - |
| AAA 以下 | 10,103,000.00 | - |
| 未评级 | 37,280,370.10 | - |
| 合计 | 316,767,530.10 | - |

注：未评级债券包括国债、中央银行票据和政策性金融债。

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，除卖出回购金融资产款余额 163,000,000.00 元将在一个月内到期且计息外，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、流通受限的投资品种比例以及组合在短期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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，此外还持有银行存款、结算备付金等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。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，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

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 | 3,832,500.59 | - | - | - | 3,832,500.59 |
| 结算备付金 | 20,207,986.80 | - | - | - | 20,207,986.80 |
| 存出保证金 | 241,864.74 | - | - | - | 241,864.74 |
| 交易性金融资产 | 300,036,004.30 | 218,959,160.00 | 23,179,400.00 | 141,594,119.87 | 683,768,684.17 |
| 应收利息 | - | - | - | 7,037,337.80 | 7,037,337.80 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 23,592,302.84 | 23,592,302.84 |
| 资产总计 | 324,318,356.43 | 218,959,160.00 | 23,179,400.00 | 172,223,760.51 | 738,680,676.94 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 19,883,128.66 | 19,883,128.66 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 281,343.27 | 281,343.27 |
| 应付托管费 | - | - | - | 46,890.53 | 46,890.53 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 1,398,406.88 | 1,398,406.88 |

| | | | | | |
|--------------------------|----------------|----------------|---------------|-----------------|----------------|
| 卖出回购金融资产款 | 163,000,000.00 | - | - | - | 163,000,000.00 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 20,947.39 | 20,947.39 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 272,336.66 | 272,336.66 |
| 应交税费 | - | - | - | 23,879.43 | 23,879.43 |
| 其他负债 | - | - | - | 136,738.06 | 136,738.06 |
| 负债总计 | 163,000,000.00 | - | - | 22,063,670.88 | 185,063,670.88 |
| 利率敏感度缺口 | 161,318,356.43 | 218,959,160.00 | 23,179,400.00 | 150,160,089.63 | 553,617,006.06 |
| 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 | 324,096,130.80 | - | - | - | 324,096,130.80 |
| 买入返售金融资产 | 110,000,000.00 | - | - | - | 110,000,000.00 |
| 应收利息 | - | - | - | 3,150.93 | 3,150.93 |
| 资产总计 | 434,096,130.80 | - | - | 3,150.93 | 434,099,281.73 |
| 负债 | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 5,313.05 | 5,313.05 |
| 应付托管费 | - | - | - | 885.51 | 885.51 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 110,000,000.00 | 110,000,000.00 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 1,106.62 | 1,106.62 |
| 负债总计 | - | - | - | 110,007,305.18 | 110,007,305.18 |
| 利率敏感度缺口 | 434,096,130.80 | - | - | -110,004,154.25 | 324,091,976.55 |

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

| | | | |
|----|---|-----------------------------|------------------------|
| 假设 | 该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有债券资产的利率风险状况测算的理论变动值对基金资产净值的影响金额。 | | |
| | 假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。 | | |
| | 此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。 | | |
| 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（2021 年 6 月 30 日） | 上年度末（2020 年 12 月 31 日） |
| 分析 | 市场利率下降 25 个基点 | 1,630,548.69 | - |
| | 市场利率上升 25 个基点 | -1,613,107.83 | - |

注：无。

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比例为 0%-30% (其中, 港股通标的股票占股票资产的比例不超过 50%); ; 每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后, 基金保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例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 | 141,594,119.87 | 25.58 | — | — |
| 交易性金融资产—基金投资 | — | — | — | — |
| 交易性金融资产—债券投资 | 8,168,160.00 | 1.48 | — | — |

| | | | | |
|-----------------|----------------|-------|---|---|
| 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 | 149,762,279.87 | 27.05 | - | - |

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

注：于 2021 年 6 月 30 日，由于本基金运行期间不足一年，尚不存在足够的经验数据，因此，无法对本基金资产净值对于市场价格风险的敏感性作定量分析。

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 | 141,594,119.87 | 19.17 |
| | 其中：股票 | 141,594,119.87 | 19.17 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 542,174,564.30 | 73.40 |
| | 其中：债券 | 542,174,564.30 | 73.40 |
| | 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 | 24,040,487.39 | 3.25 |
| 8 | 其他各项资产 | 30,871,505.38 | 4.18 |
| 9 | 合计 | 738,680,676.94 | 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 | 54,204.72 | 0.01 |
| B | 采矿业 | 1,338,027.39 | 0.24 |

| | | | |
|---|------------------|----------------|-------|
| C | 制造业 | 53,249,042.08 | 9.62 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 13,380,460.44 | 2.42 |
| E | 建筑业 | 1,244,429.80 | 0.22 |
| F | 批发和零售业 | 17,939.46 | 0.00 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 7,992,165.35 | 1.44 |
| H | 住宿和餐饮业 | 42,948.00 | 0.01 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 16,179,827.04 | 2.92 |
| J | 金融业 | 33,886,829.91 | 6.12 |
| K | 房地产业 | 10,006,017.40 | 1.81 |
| L | 租赁和商务服务业 | 1,608,927.06 | 0.29 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 183,052.80 | 0.03 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 1,302,412.17 | 0.24 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | 16,262.03 | 0.00 |
| Q | 卫生和社会工作 | 516,818.22 | 0.09 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 574,756.00 | 0.10 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 141,594,119.87 | 25.58 |

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 | 600036 | 招商银行 | 235,500 | 12,761,745.00 | 2.31 |
| 2 | 600519 | 贵州茅台 | 3,600 | 7,404,120.00 | 1.34 |
| 3 | 600900 | 长江电力 | 306,400 | 6,324,096.00 | 1.14 |
| 4 | 601398 | 工商银行 | 1,131,793 | 5,851,369.81 | 1.06 |
| 5 | 000001 | 平安银行 | 251,000 | 5,677,620.00 | 1.03 |
| 6 | 600905 | 三峡能源 | 907,763 | 5,147,016.21 | 0.93 |
| 7 | 601006 | 大秦铁路 | 698,000 | 4,592,840.00 | 0.83 |
| 8 | 000069 | 华侨城 A | 569,300 | 4,235,592.00 | 0.77 |
| 9 | 000002 | 万科 A | 174,700 | 4,159,607.00 | 0.75 |
| 10 | 002352 | 顺丰控股 | 49,800 | 3,371,460.00 | 0.61 |
| 11 | 688029 | 南微医学 | 10,650 | 3,319,498.50 | 0.60 |
| 12 | 002311 | 海大集团 | 40,300 | 3,288,480.00 | 0.59 |
| 13 | 601939 | 建设银行 | 441,800 | 2,937,970.00 | 0.53 |
| 14 | 601601 | 中国太保 | 101,000 | 2,925,970.00 | 0.53 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 15 | 688169 | 石头科技 | 2,240 | 2,824,640.00 | 0.51 |
| 16 | 002271 | 东方雨虹 | 50,800 | 2,810,256.00 | 0.51 |
| 17 | 300674 | 宇信科技 | 145,740 | 2,723,880.60 | 0.49 |
| 18 | 300782 | 卓胜微 | 5,000 | 2,687,500.00 | 0.49 |
| 19 | 000895 | 双汇发展 | 71,800 | 2,283,240.00 | 0.41 |
| 20 | 002555 | 三七互娱 | 91,300 | 2,193,026.00 | 0.40 |
| 21 | 603345 | 安井食品 | 8,600 | 2,184,572.00 | 0.39 |
| 22 | 300369 | 绿盟科技 | 132,400 | 2,111,780.00 | 0.38 |
| 23 | 002008 | 大族激光 | 51,500 | 2,080,085.00 | 0.38 |
| 24 | 300525 | 博思软件 | 112,064 | 1,989,136.00 | 0.36 |
| 25 | 300014 | 亿纬锂能 | 18,500 | 1,922,705.00 | 0.35 |
| 26 | 300408 | 三环集团 | 44,300 | 1,879,206.00 | 0.34 |
| 27 | 300059 | 东方财富 | 55,500 | 1,819,845.00 | 0.33 |
| 28 | 600674 | 川投能源 | 145,600 | 1,795,248.00 | 0.32 |
| 29 | 601012 | 隆基股份 | 19,900 | 1,767,916.00 | 0.32 |
| 30 | 600309 | 万华化学 | 15,300 | 1,664,946.00 | 0.30 |
| 31 | 002511 | 中顺洁柔 | 59,800 | 1,647,490.00 | 0.30 |
| 32 | 300682 | 朗新科技 | 93,300 | 1,569,306.00 | 0.28 |
| 33 | 002127 | 南极电商 | 156,900 | 1,532,913.00 | 0.28 |
| 34 | 603313 | 梦百合 | 50,378 | 1,513,858.90 | 0.27 |
| 35 | 300888 | 稳健医疗 | 11,300 | 1,396,906.00 | 0.25 |
| 36 | 002475 | 立讯精密 | 30,100 | 1,384,600.00 | 0.25 |
| 37 | 300496 | 中科创达 | 8,700 | 1,366,422.00 | 0.25 |
| 38 | 002624 | 完美世界 | 56,300 | 1,346,133.00 | 0.24 |
| 39 | 002568 | 百润股份 | 13,900 | 1,317,581.00 | 0.24 |
| 40 | 601225 | 陕西煤业 | 110,800 | 1,312,980.00 | 0.24 |
| 41 | 601668 | 中国建筑 | 262,900 | 1,222,485.00 | 0.22 |
| 42 | 601318 | 中国平安 | 18,900 | 1,214,892.00 | 0.22 |
| 43 | 603568 | 伟明环保 | 51,397 | 1,173,393.51 | 0.21 |
| 44 | 000661 | 长春高新 | 2,800 | 1,083,600.00 | 0.20 |
| 45 | 600048 | 保利地产 | 88,300 | 1,063,132.00 | 0.19 |
| 46 | 002602 | 世纪华通 | 145,100 | 931,542.00 | 0.17 |
| 47 | 300253 | 卫宁健康 | 55,700 | 906,239.00 | 0.16 |
| 48 | 002043 | 兔宝宝 | 82,300 | 811,478.00 | 0.15 |
| 49 | 002833 | 弘亚数控 | 19,800 | 767,250.00 | 0.14 |
| 50 | 603185 | 上机数控 | 4,100 | 733,695.00 | 0.13 |
| 51 | 300866 | 安克创新 | 4,200 | 703,374.00 | 0.13 |
| 52 | 000783 | 长江证券 | 90,000 | 658,800.00 | 0.12 |
| 53 | 003022 | 联泓新科 | 21,360 | 655,752.00 | 0.12 |
| 54 | 603444 | 吉比特 | 1,200 | 636,000.00 | 0.11 |
| 55 | 002028 | 思源电气 | 19,900 | 612,721.00 | 0.11 |
| 56 | 002739 | 万达电影 | 36,400 | 574,756.00 | 0.10 |

| | | | | | |
|----|--------|------|--------|------------|------|
| 57 | 600383 | 金地集团 | 53,485 | 547,686.40 | 0.10 |
| 58 | 605089 | 味知香 | 5,960 | 518,639.20 | 0.09 |
| 59 | 002044 | 美年健康 | 53,700 | 489,207.00 | 0.09 |
| 60 | 300910 | 瑞丰新材 | 3,700 | 386,835.00 | 0.07 |
| 61 | 300274 | 阳光电源 | 3,100 | 356,686.00 | 0.06 |
| 62 | 300760 | 迈瑞医疗 | 600 | 288,030.00 | 0.05 |
| 63 | 688690 | 纳微科技 | 3,477 | 277,777.53 | 0.05 |
| 64 | 688601 | 力芯微 | 1,174 | 216,133.40 | 0.04 |
| 65 | 300098 | 高新兴 | 27,700 | 167,308.00 | 0.03 |
| 66 | 688315 | 诺禾致源 | 3,711 | 145,471.20 | 0.03 |
| 67 | 003012 | 东鹏控股 | 8,600 | 143,104.00 | 0.03 |
| 68 | 600556 | 天下秀 | 13,200 | 139,392.00 | 0.03 |
| 69 | 300957 | 贝泰妮 | 496 | 124,972.16 | 0.02 |
| 70 | 688700 | 东威科技 | 3,049 | 117,264.54 | 0.02 |
| 71 | 600893 | 航发动力 | 1,900 | 101,061.00 | 0.02 |
| 72 | 002415 | 海康威视 | 1,500 | 96,750.00 | 0.02 |
| 73 | 600019 | 宝钢股份 | 11,400 | 87,096.00 | 0.02 |
| 74 | 605117 | 德业股份 | 627 | 80,005.20 | 0.01 |
| 75 | 688663 | 新风光 | 3,279 | 71,023.14 | 0.01 |
| 76 | 688113 | 联测科技 | 1,415 | 69,745.35 | 0.01 |
| 77 | 688191 | 智洋创新 | 3,203 | 69,184.80 | 0.01 |
| 78 | 688685 | 迈信林 | 2,612 | 67,781.40 | 0.01 |
| 79 | 301018 | 申菱环境 | 7,811 | 64,753.19 | 0.01 |
| 80 | 600323 | 瀚蓝环境 | 2,900 | 63,191.00 | 0.01 |
| 81 | 002601 | 龙佰集团 | 1,800 | 62,244.00 | 0.01 |
| 82 | 688676 | 金盘科技 | 3,750 | 60,900.00 | 0.01 |
| 83 | 688217 | 睿昂基因 | 1,040 | 60,736.00 | 0.01 |
| 84 | 000338 | 潍柴动力 | 3,362 | 60,078.94 | 0.01 |
| 85 | 601888 | 中国中免 | 200 | 60,020.00 | 0.01 |
| 86 | 603529 | 爱玛科技 | 1,019 | 59,224.28 | 0.01 |
| 87 | 002493 | 荣盛石化 | 3,325 | 57,422.75 | 0.01 |
| 88 | 300995 | 奇德新材 | 1,909 | 57,368.52 | 0.01 |
| 89 | 688328 | 深科达 | 1,499 | 56,647.21 | 0.01 |
| 90 | 688239 | 航宇科技 | 4,926 | 56,550.48 | 0.01 |
| 91 | 688087 | 英科再生 | 2,469 | 54,219.24 | 0.01 |
| 92 | 301020 | 密封科技 | 4,210 | 44,794.40 | 0.01 |
| 93 | 688395 | 正弦电气 | 1,627 | 44,465.91 | 0.01 |
| 94 | 688565 | 力源科技 | 2,464 | 44,376.64 | 0.01 |
| 95 | 600258 | 首旅酒店 | 1,800 | 42,948.00 | 0.01 |
| 96 | 003039 | 顺控发展 | 1,024 | 42,813.44 | 0.01 |
| 97 | 600984 | 建设机械 | 3,900 | 41,769.00 | 0.01 |
| 98 | 603259 | 药明康德 | 240 | 37,581.60 | 0.01 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 99 | 605339 | 南侨食品 | 863 | 37,264.34 | 0.01 |
| 100 | 688367 | 工大高科 | 1,717 | 37,035.69 | 0.01 |
| 101 | 605090 | 九丰能源 | 1,090 | 35,326.90 | 0.01 |
| 102 | 601528 | 瑞丰银行 | 2,230 | 34,721.10 | 0.01 |
| 103 | 601100 | 恒立液压 | 400 | 34,368.00 | 0.01 |
| 104 | 603799 | 华友钴业 | 300 | 34,260.00 | 0.01 |
| 105 | 002049 | 紫光国微 | 200 | 30,838.00 | 0.01 |
| 106 | 300015 | 爱尔眼科 | 389 | 27,611.22 | 0.00 |
| 107 | 301021 | 英诺激光 | 2,899 | 27,424.54 | 0.00 |
| 108 | 001201 | 东瑞股份 | 668 | 27,347.92 | 0.00 |
| 109 | 605296 | 神农集团 | 569 | 26,856.80 | 0.00 |
| 110 | 603324 | 盛剑环境 | 732 | 26,630.16 | 0.00 |
| 111 | 600399 | 抚顺特钢 | 1,300 | 23,582.00 | 0.00 |
| 112 | 605080 | 浙江自然 | 374 | 23,487.20 | 0.00 |
| 113 | 603759 | 海天股份 | 1,119 | 22,939.50 | 0.00 |
| 114 | 001207 | 联科科技 | 682 | 22,581.02 | 0.00 |
| 115 | 301009 | 可靠股份 | 801 | 22,339.89 | 0.00 |
| 116 | 605378 | 野马电池 | 473 | 21,729.62 | 0.00 |
| 117 | 000333 | 美的集团 | 300 | 21,411.00 | 0.00 |
| 118 | 601279 | 英利汽车 | 2,004 | 20,901.72 | 0.00 |
| 119 | 605389 | 长龄液压 | 356 | 20,890.08 | 0.00 |
| 120 | 001206 | 依依股份 | 321 | 20,389.92 | 0.00 |
| 121 | 001205 | 盛航股份 | 577 | 18,850.59 | 0.00 |
| 122 | 605122 | 四方新材 | 703 | 18,770.10 | 0.00 |
| 123 | 603511 | 爱慕股份 | 553 | 18,249.00 | 0.00 |
| 124 | 301015 | 百洋医药 | 462 | 17,939.46 | 0.00 |
| 125 | 605208 | 永茂泰 | 801 | 17,485.83 | 0.00 |
| 126 | 688226 | 威腾电气 | 2,693 | 17,289.06 | 0.00 |
| 127 | 605098 | 行动教育 | 289 | 16,262.03 | 0.00 |
| 128 | 605196 | 华通线缆 | 1,172 | 16,079.84 | 0.00 |
| 129 | 605300 | 佳禾食品 | 576 | 16,012.80 | 0.00 |
| 130 | 603836 | 海程邦达 | 733 | 15,994.06 | 0.00 |
| 131 | 601899 | 紫金矿业 | 1,500 | 14,535.00 | 0.00 |
| 132 | 001208 | 华菱线缆 | 1,754 | 13,558.42 | 0.00 |
| 133 | 605133 | 嵘泰股份 | 618 | 13,398.24 | 0.00 |
| 134 | 300614 | 百川畅银 | 329 | 13,285.02 | 0.00 |
| 135 | 603171 | 税友股份 | 637 | 12,230.40 | 0.00 |
| 136 | 605286 | 同力日升 | 597 | 12,208.65 | 0.00 |
| 137 | 300997 | 欢乐家 | 928 | 12,110.40 | 0.00 |
| 138 | 003042 | 中农联合 | 420 | 11,839.80 | 0.00 |
| 139 | 301002 | 崧盛股份 | 201 | 11,581.62 | 0.00 |
| 140 | 605488 | 福莱新材 | 416 | 11,103.04 | 0.00 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 141 | 605287 | 德才股份 | 349 | 11,014.44 | 0.00 |
| 142 | 605289 | 罗曼股份 | 379 | 10,930.36 | 0.00 |
| 143 | 605259 | 绿田机械 | 295 | 10,516.75 | 0.00 |
| 144 | 605086 | 龙高股份 | 443 | 10,512.39 | 0.00 |
| 145 | 003038 | 鑫铂股份 | 383 | 10,463.56 | 0.00 |
| 146 | 300996 | 普联软件 | 241 | 10,177.43 | 0.00 |
| 147 | 605189 | 富春染织 | 422 | 10,165.98 | 0.00 |
| 148 | 003041 | 真爱美家 | 349 | 9,876.70 | 0.00 |
| 149 | 301016 | 雷尔伟 | 275 | 9,069.50 | 0.00 |
| 150 | 001202 | 炬申股份 | 459 | 9,014.76 | 0.00 |
| 151 | 605162 | 新中港 | 1,377 | 8,358.39 | 0.00 |
| 152 | 300958 | 建工修复 | 300 | 8,166.00 | 0.00 |
| 153 | 300987 | 川网传媒 | 301 | 8,069.81 | 0.00 |
| 154 | 300993 | 玉马遮阳 | 410 | 7,908.90 | 0.00 |
| 155 | 605298 | 必得科技 | 391 | 7,847.37 | 0.00 |
| 156 | 301004 | 嘉益股份 | 312 | 6,845.28 | 0.00 |
| 157 | 301011 | 华立科技 | 175 | 5,922.00 | 0.00 |
| 158 | 002158 | 汉钟精机 | 200 | 5,370.00 | 0.00 |
| 159 | 605011 | 杭州热电 | 525 | 4,662.00 | 0.00 |
| 160 | 301007 | 德迈仕 | 303 | 4,375.32 | 0.00 |
| 161 | 300998 | 宁波方正 | 201 | 4,285.32 | 0.00 |
| 162 | 301012 | 扬电科技 | 170 | 4,124.20 | 0.00 |
| 163 | 300992 | 泰福泵业 | 200 | 4,064.00 | 0.00 |
| 164 | 002142 | 宁波银行 | 100 | 3,897.00 | 0.00 |
| 165 | 301010 | 晶雪节能 | 218 | 3,838.98 | 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 | 000001 | 平安银行 | 32,188,678.00 | 9.93 |
| 2 | 600519 | 贵州茅台 | 23,666,220.30 | 7.30 |
| 3 | 002493 | 荣盛石化 | 23,141,021.64 | 7.14 |
| 4 | 601318 | 中国平安 | 21,613,435.00 | 6.67 |
| 5 | 600036 | 招商银行 | 19,804,179.46 | 6.11 |
| 6 | 601939 | 建设银行 | 17,716,990.00 | 5.47 |
| 7 | 601398 | 工商银行 | 17,453,641.32 | 5.39 |
| 8 | 601601 | 中国太保 | 16,443,900.00 | 5.07 |
| 9 | 600660 | 福耀玻璃 | 12,627,185.00 | 3.90 |
| 10 | 002624 | 完美世界 | 10,340,907.00 | 3.19 |
| 11 | 002352 | 顺丰控股 | 10,111,015.00 | 3.12 |
| 12 | 000858 | 五粮液 | 9,343,980.80 | 2.88 |

| | | | | |
|----|--------|-------|--------------|------|
| 13 | 300760 | 迈瑞医疗 | 9,323,975.48 | 2.88 |
| 14 | 000002 | 万科 A | 9,270,725.00 | 2.86 |
| 15 | 000012 | 南玻 A | 9,172,165.07 | 2.83 |
| 16 | 000333 | 美的集团 | 8,595,754.00 | 2.65 |
| 17 | 603313 | 梦百合 | 8,412,825.52 | 2.60 |
| 18 | 600399 | 抚顺特钢 | 8,169,742.50 | 2.52 |
| 19 | 000069 | 华侨城 A | 7,941,920.00 | 2.45 |
| 20 | 600176 | 中国巨石 | 7,578,352.00 | 2.34 |
| 21 | 002028 | 思源电气 | 7,259,607.00 | 2.24 |
| 22 | 601658 | 邮储银行 | 7,236,684.00 | 2.23 |
| 23 | 002555 | 三七互娱 | 7,165,528.00 | 2.21 |
| 24 | 600383 | 金地集团 | 7,123,303.00 | 2.20 |
| 25 | 000895 | 双汇发展 | 6,971,990.00 | 2.15 |
| 26 | 300014 | 亿纬锂能 | 6,961,557.95 | 2.15 |
| 27 | 002044 | 美年健康 | 6,833,984.00 | 2.11 |
| 28 | 601888 | 中国中免 | 6,718,890.56 | 2.07 |
| 29 | 002142 | 宁波银行 | 6,507,444.00 | 2.01 |

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 | 000001 | 平安银行 | 25,148,944.69 | 7.76 |
| 2 | 002493 | 荣盛石化 | 20,791,300.00 | 6.42 |
| 3 | 601318 | 中国平安 | 18,314,638.00 | 5.65 |
| 4 | 601939 | 建设银行 | 15,545,416.00 | 4.80 |
| 5 | 600519 | 贵州茅台 | 15,173,770.00 | 4.68 |
| 6 | 601601 | 中国太保 | 13,333,919.00 | 4.11 |
| 7 | 000012 | 南玻 A | 11,964,035.50 | 3.69 |
| 8 | 601398 | 工商银行 | 11,172,978.00 | 3.45 |
| 9 | 600660 | 福耀玻璃 | 11,145,565.25 | 3.44 |
| 10 | 002624 | 完美世界 | 9,206,473.00 | 2.84 |
| 11 | 600036 | 招商银行 | 8,509,065.95 | 2.63 |
| 12 | 300760 | 迈瑞医疗 | 8,065,243.00 | 2.49 |
| 13 | 000333 | 美的集团 | 7,378,221.39 | 2.28 |
| 14 | 000858 | 五粮液 | 7,302,144.00 | 2.25 |
| 15 | 600399 | 抚顺特钢 | 7,265,192.50 | 2.24 |
| 16 | 601658 | 邮储银行 | 6,953,578.00 | 2.15 |
| 17 | 002028 | 思源电气 | 6,806,877.00 | 2.10 |
| 18 | 002142 | 宁波银行 | 6,550,581.00 | 2.02 |
| 19 | 601888 | 中国中免 | 6,377,032.69 | 1.97 |
| 20 | 603313 | 梦百合 | 6,315,303.70 | 1.95 |

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 | 587,119,226.39 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 437,077,607.34 |

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 84,947,034.20 | 15.34 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 145,211,970.10 | 26.23 |
| | 其中：政策性金融债 | 14,100,970.10 | 2.55 |
| 4 | 企业债券 | 99,874,000.00 | 18.04 |
| 5 | 企业短期融资券 | 140,460,000.00 | 25.37 |
| 6 | 中期票据 | 40,334,000.00 | 7.29 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 8,168,160.00 | 1.48 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | 23,179,400.00 | 4.19 |
| 10 | 合计 | 542,174,564.30 | 97.93 |

注：其他为地方政府债。

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|----------------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 019649 | 21 国债 01 | 352,960 | 35,320,707.20 | 6.38 |
| 2 | 012100807 | 21 农发集 SCP001 | 300,000 | 30,129,000.00 | 5.44 |
| 3 | 042100115 | 21 长电 CP002 | 300,000 | 30,087,000.00 | 5.43 |
| 4 | 012100895 | 21 萧山机场 SCP001 | 300,000 | 30,042,000.00 | 5.43 |
| 5 | 163475 | 20 东航 01 | 300,000 | 29,562,000.00 | 5.34 |

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

本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

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：无。

7.11.3 本期国债期货投资评价

无。

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

中国东方航空股份有限公司

2021年4月9日，中国民用航空华北地区管理局针对中国东方航空股份有限公司的违法违规行为，对中国东方航空股份有限公司处以罚款。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 | 241,864.74 |
| 2 | 应收证券清算款 | 23,592,302.84 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 7,037,337.80 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 30,871,505.38 |

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|----------|--------------|---------------|
| 1 | 132018 | G 三峡 EB1 | 8,168,160.00 | 1.48 |

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 | 0.93 | 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

| 份额级别 | 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 (%) |
| 鹏华安润混合 | 209 | 2,237,118.88 | 467,378,920.46 | 99.96 | 178,925.46 | 0.04 |

| | | | | | | |
|----------|-----|--------------|----------------|-------|------------|------|
| A | | | | | | |
| 鹏华安润混合 C | 27 | 3,143,637.05 | 84,873,603.10 | 99.99 | 4,597.25 | 0.01 |
| 合计 | 236 | 2,340,830.70 | 552,252,523.56 | 99.97 | 183,522.71 | 0.03 |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 份额级别 | 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 | 鹏华安润混合 A | 12,215.83 | 0.0026 |
| | 鹏华安润混合 C | 1,300.00 | 0.0015 |
| | 合计 | 13,515.83 | 0.0024 |

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

| 项目 | 鹏华安润混合 A | 鹏华安润混合 C |
|----------------------------|----------------|----------------|
| 基金合同生效日（2020年12月30日）基金份额总额 | 189,088,510.80 | 135,007,620.00 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 189,088,510.80 | 135,007,620.00 |
| 本报告期基金总申购份额 | 378,438,683.22 | 79,557,539.60 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 99,969,348.10 | 129,686,959.25 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - |

| | | |
|-------------|----------------|---------------|
| 本报告期末基金份额总额 | 467,557,845.92 | 84,878,200.35 |
|-------------|----------------|---------------|

§ 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的重大人事变动：无。

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

本基金管理人聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金审计的会计师事务所。本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 | 股票交易 | 应支付该券商的佣金 | 备注 |
|------|-----|------|-----------|----|
|------|-----|------|-----------|----|

| | 元数量 | 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 | |
|------|-----|------------------|--------------|------------|------------|---|
| 兴业证券 | 2 | 1,015,060,266.72 | 100.00% | 925,027.41 | 100.00% | - |
| 华泰证券 | 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 |
| 兴业证券 | 784,113,968.30 | 100.00% | 9,674,591,000.00 | 100.00% | - | - |
| 华泰证券 | - | - | - | - | - | - |

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 | 《证券时报》、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 | 《证券时报》、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 | 鹏华安润混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告 | 《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021年01月05日 |
| 4 | 鹏华基金管理有限公司高级管理人员变更公告 | 《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021年01月16日 |
| 5 | 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告 | 《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021年01月22日 |
| 6 | 鹏华基金管理有限公司高级管理人员变更公告 | 《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021年01月28日 |
| 7 | 鹏华基金管理有限公司高级管理人员变更公告 | 《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021年01月28日 |
| 8 | 鹏华基金管理有限公司澄清公告 | 《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021年02月06日 |
| 9 | 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 | 《证券时报》、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 |
| 10 | 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 | 《证券时报》、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 |
| 11 | 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 | 《证券时报》、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 |
| 12 | 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 | 《证券时报》、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 |
| 13 | 鹏华基金管理有限公司关于在直销柜台渠道开展旗下部分开放式证券投资基金转换转出费率优惠活动的公告 | 《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021年03月11日 |

| | | | |
|----|--|------------------------------|------------------|
| 14 | 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 | 《证券时报》、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 |
| 15 | 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 | 《证券时报》、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 |
| 16 | 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 | 《证券时报》、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 |
| 17 | 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 | 《证券时报》、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 |
| 18 | 鹏华基金管理有限公司澄清公告 | 《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 04 月 10 日 |
| 19 | 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 | 《证券时报》、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 |
| 20 | 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 | 《证券时报》、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 |
| 21 | 鹏华安润混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告 | 《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 04 月 21 日 |
| 22 | 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 | 《证券时报》、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 |
| 23 | 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 | 《证券时报》、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 |
| 24 | 鹏华基金管理有限公司澄清公告 | 《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 04 月 26 日 |
| 25 | 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 | 《证券时报》、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 |
| 26 | 鹏华基金管理有限公司澄清公告 | 《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 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 | 20210203~20210630 | - | 198,944,593.65 | - | 198,944,593.65 | 36.01 |
| 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；

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)《鹏华安润混合型证券投资基金基金合同》；
- (二)《鹏华安润混合型证券投资基金托管协议》；
- (三)《鹏华安润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