

# 鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2022 年 3 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 03 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 2021 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	10
3.4 过去三年基金的利润分配情况	10
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	16
4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	16
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	17
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>17</b>
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>19</b>
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	21
7.4 报表附注	23

<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>55</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	55
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	55
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	56
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	70
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	71
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	72
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	72
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	72
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	72
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	72
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	72
8.12 投资组合报告附注 .....	73
<b>§ 9 基金份额持有人信息</b> .....	<b>74</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	74
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	74
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	74
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 .....	74
<b>§ 10 开放式基金份额变动</b> .....	<b>74</b>
<b>§ 11 重大事件揭示</b> .....	<b>75</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	75
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	75
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	75
11.4 基金投资策略的改变 .....	75
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	75
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	76
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	76
11.8 其他重大事件 .....	79
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>84</b>
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	84
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	84
<b>§ 13 备查文件目录</b> .....	<b>85</b>
13.1 备查文件目录 .....	85
13.2 存放地点 .....	85
13.3 查阅方式 .....	85

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	鹏华睿投混合
基金主代码	005434
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 5 月 30 日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	202,386,382.33 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	在严格控制风险的基础上,力求取得超越基金业绩比较基准的收益。
投资策略	<p>1、资产配置策略 本基金将通过跟踪考量通常的宏观经济变量（包括 GDP 增长率、CPI 走势、M2 的绝对水平和增长率、利率水平与走势等）以及各项国家政策（包括财政、货币、税收、汇率政策等）来判断经济周期目前的位置以及未来将发展的方向，在此基础上对各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估，制定股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。</p> <p>2、股票投资策略 本基金通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘优质的公司，构建股票投资组合。核心思路在于：1）自上而下地分析行业的增长前景、行业结构、商业模式、竞争要素等分析把握其投资机会；2）自下而上地评判企业的核心竞争力、管理层、治理结构等以及其所提供的产品和服务是否契合未来行业增长的大趋势，对企业基本面和估值水平进行综合的研判，深度挖掘优质的个股。（1）自上而下的行业遴选 本基金将自上而下地进行行业遴选，重点关注行业增长前景、行业利润前景和行业成功要素。对行业增长前景，主要分析行业的外部发展环境、行业的生命周期以及行业波动与经济周期的关系等；对行业利润前景，主要分析行业结构，特别是业内竞争的方式、业内竞争的激烈程度、以及业内厂商的谈判能力等。基于对行业结构的分析形成对业内竞争的关键成功要素的判断，为预测企业经营环境的变化建立起扎实的基础。（2）自下而上的个股选择 本基金通过定性和定量相结合的方法进行自下而上的个股选择，对企业基本面和估值水平进行综合的研判，精选优质个股。</p> <p>1) 定性分析 本基金通过以下两方面标准对股票的基本面进行研究分析并筛选出优质的公司：一方面是竞争力分析，通过对公司竞争策略和核心竞争力的分析，选择具有可持续竞争优势的公司或未来具有广阔成长空间的公司。就公司竞争策略，基于行业分析的结果判断策略的有效性、策略的实施支持和策略的执行成果；就核心竞争力，分析公司的现有核心竞争力，并判断公司能否利用</p>

	<p>现有的资源、能力和定位取得可持续竞争优势。另一方面是管理层分析，通过着重考察公司的管理层以及管理制度，选择具有良好治理结构、管理水平较高的优质公司。 2) 定量分析 本基金通过对公司定量的估值分析，挖掘优质的投资标的。通过对估值方法的选择和估值倍数的比较，选择股价相对低估的股票。就估值方法而言，基于行业的特点确定对股价最有影响力的关键估值方法（包括 PE（市盈率）、PEG（市盈率相对盈利增长比率）、PB（市账率）、PS（市销率）、EV/EBITDA（企业价值倍数）等）；就估值倍数而言，通过业内比较、历史比较和增长性分析，确定具有上升基础的股价水平。（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。 3、债券投资策略 本基金债券投资将采取久期策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、个券选择策略、信用策略等积极投资策略，自上而下地管理组合的久期，灵活地调整组合的券种搭配，同时精选个券，以增强组合的持有期收益。 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。 5、中小企业私募债投资策略 中小企业私募债券是在中国境内以非公开方式发行和转让，约定在一定期限还本付息的公司债券。由于其非公开性及条款可协商性，普遍具有较高收益。本基金将深入研究发行人资信及公司运营情况，合理合规合格地进行中小企业私募债券投资。本基金在投资过程中密切监控债券信用等级或发行人信用等级变化情况，尽力规避风险，并获取超额收益。 6、股指期货投资策略 本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目标，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，充分考虑股指期货的风险收益特征，通过多头或空头的套期保值策略，以改善投资组合的投资效果，实现股票组合的超额收益。 7、国债期货投资策略 为有效控制债券投资的系统性风险，本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的，适度运用国债期货，提高投资组合的运作效率。在国债期货投资时，本基金将首先分析国债期货各合约价格与最便宜可交割券的关系，选择定价合理的国债期货合约，其次，考虑国债期货各合约的流动性情况，最终确定与现货组合的合适匹配，以达到风险管理的目标。 8、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×60%+中证全债指数收益率×40%
风险收益特征	本基金属于混合型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金，低于股票型基金。

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	招商银行股份有限公司	
信息披露 负责人	姓名	张戈	张燕
	联系电话	0755-82825720	0755-83199084
	电子邮箱	zhangge@phfund.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话	4006788999	95555	
传真	0755-82021126	0755-83195201	
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦	
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦	
邮政编码	518048	518040	
法定代表人	何如	缪建民	

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
注册登记机构	鹏华基金管理有限公司	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2021 年	2020 年	2019 年
本期已实现收益	63,999,372.23	102,501,143.24	28,153,270.16
本期利润	52,638,233.55	113,230,117.61	70,539,411.62
加权平均基金份额本期利润	0.3303	0.4737	0.4928
本期加权平均净值利润率	17.68%	32.40%	48.30%
本期基金份额净值	21.73%	36.86%	48.41%

增长率			
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
期末可供分配利润	202,337,102.37	108,909,588.28	17,019,496.48
期末可供分配基金份额利润	0.9998	0.5570	0.1586
期末基金资产净值	406,851,800.80	322,893,547.60	129,451,586.88
期末基金份额净值	2.0103	1.6515	1.2067
3.1.3 累计期末指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
基金份额累计净值增长率	101.03%	65.15%	20.67%

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等未实现收益。

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

（3）期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润期末余额和未分配利润中已实现部分的期末余额的孰低数。表中的“期末”均指报告期最后一日，即 12 月 31 日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	2.09%	0.30%	1.51%	0.47%	0.58%	-0.17%
过去六个月	6.65%	0.43%	-1.89%	0.61%	8.54%	-0.18%
过去一年	21.73%	0.58%	-0.60%	0.70%	22.33%	-0.12%

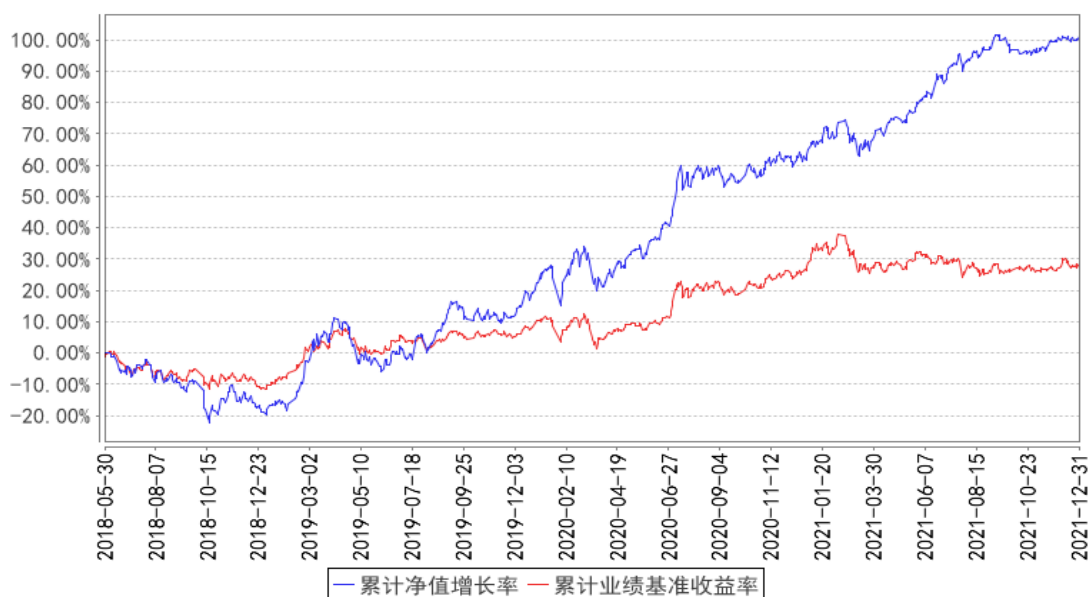


过去三年	147.24%	1.06%	44.13%	0.77%	103.11%	0.29%
自基金合同生效起至今	101.03%	1.12%	28.25%	0.79%	72.78%	0.33%

注：业绩比较基准=沪深 300 指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%

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

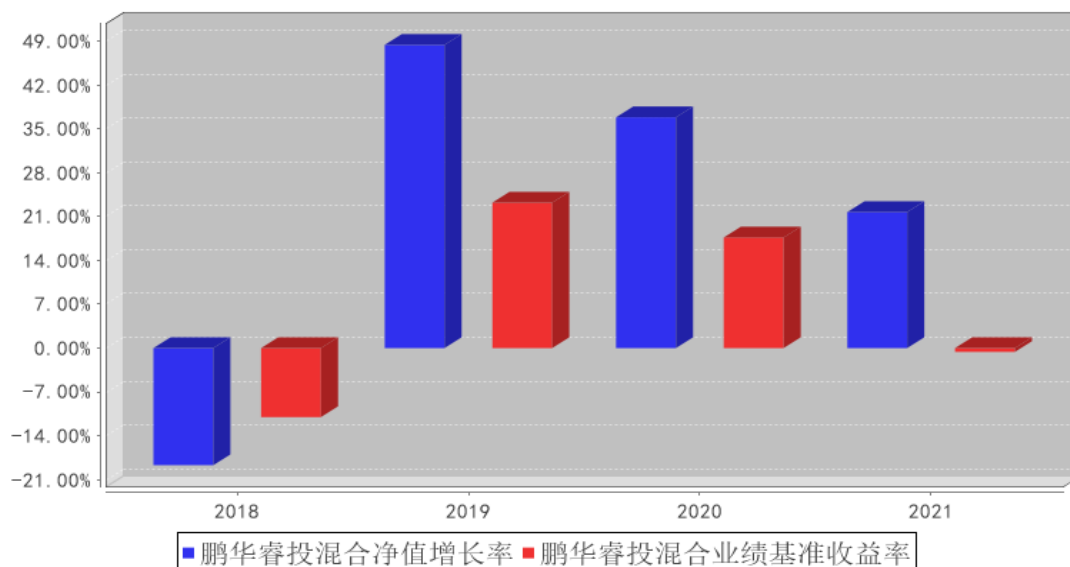
鹏华睿投混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2018 年 05 月 30 日生效。2、截至建仓期结束，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

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

鹏华睿投混合基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按照实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 其他指标

注：无。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

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 10,287.51 亿元，管理 260 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		

刘方正	基金经理	2018-05-30	-	11 年	<p>刘方正先生，国籍中国，理学硕士，11 年证券从业经验。2010 年 6 月加盟鹏华基金管理有限公司，从事债券研究工作，历任固定收益部高级研究员、基金经理助理，现任稳定收益投资部副总经理/基金经理。2015 年 03 月至 2017 年 01 月担任鹏华弘利灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015 年 03 月至 2015 年 08 月担任鹏华行业成长证券投资基金基金经理，2015 年 04 月至 2017 年 01 月担任鹏华弘润灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015 年 05 月至今担任鹏华弘华灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015 年 05 月至 2017 年 01 月担任鹏华弘益灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015 年 05 月至今担任鹏华弘和灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015 年 06 月至 2017 年 01 月担任鹏华弘鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015 年 08 月至今担任鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金基金经理，2015 年 08 月至 2017 年 01 月担任鹏华弘泰灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 03 月至 2018 年 05 月担任鹏华弘锐灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 03 月至 2017 年 05 月担任鹏华弘实灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 03 月至今担任鹏华弘信灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 08 月至今担任鹏华弘达灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 08 月至 2017 年 12 月担任鹏华弘嘉灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 09 月至今担任鹏华弘惠灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 11 月至 2018 年 01 月担任鹏华兴裕定期开放灵活配置混合型基金基金经理，2016 年 11 月至今担任鹏华兴泰定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 12 月至今担任鹏华兴悦定期开放灵活配置混合型基金基金经理，2017 年 09 月至 2018 年 08 月担任鹏华兴益定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2018 年 05 月至今担任鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金基金经理，刘方正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。</p>
-----	------	------------	---	------	--

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：本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作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 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《鹏华基金管理有限公司公平交易管理规定》，将公司所管理的封闭式基金、开放式基金、社保组合、养老组合、特定客户资产管理组合等不同资产组合的授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动均纳入公平交易管理，在业务流程和岗位职责中制定公平交易的控制规则和控制活动，建立对公平交易的执行、监督及审核流程，严禁在不同投资组合之间进行利益输送。在投资研究环节：1、公司使用唯一的研究报告发布平台“研究报告管理平台”，确保各投资组合在获得投资信息、研究支持、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；2、公司严格按照《股票库管理规定》、《信用债券投资与风险控制管理规定》，执行股票及信用产品出入库及日常维护工作，确保相关证券入库以内容严谨、观点明确的研究报告作为依据；3、在公司股票库基础上，各涉及股票投资的资产组合根据各自的投资目标、投资风格、投资范围和防范关联交易的原则分别建立资产组合股票库，基金经理在股票库基础上根据投资授权以及基金合同择股方式构建具体的投资组合；4、严格执行投资授权制度，明确投资决策委员会、分管投资副总裁、基金经理等各主体的职责和权限划分，合理确定基金经理的投资权限，超过投资权限的操作，应严格履行审批程序。在交易执行环节：1、所有公司管理的资产组合的交易必须通过集中交易室完成，集中交易室负责建立和执行交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会；2、针对交易所公开竞价交易，集中交易室应严格启用恒生交易系统内的公平交易程序，交易系统则自动启用公平交易功能，由系

统按照“未委托数量”的比例对不同资产组合进行委托量的公平分配；如果相关基金经理坚持以不同的价格进行交易，且当前市场价格不能同时满足多个资产组合的指令价格要求时，交易系统自动按照“价格优先”原则进行委托；当市场价格同时满足多个资产组合的指令价格要求时，则交易系统自动按照“同一指令价格下的公平交易”模式，进行公平委托和交易量分配；3、银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易需依据公司《股票投资交易流程》和《固定收益投资管理流程》的规定执行；银行间市场交易、交易所大宗交易等以公司名义进行的交易，各投资组合经理应在交易前独立确定各投资组合的交易价格和数量，公司按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；4、新股、新债申购及非公开定向增发交易需依据公司《新股申购流程》、《固定收益投资管理流程》和《非公开定向增发流程》的规定执行，对新股和新债申购方案和分配过程进行审核和监控。在交易监控、分析与评估环节：1、为加强对日常投资交易行为的监控和管理，杜绝利益输送、不公平交易等违规交易行为，防范日常交易风险，公司明确了关注类交易的界定及对应的监控和评估措施机制；所监控的交易包括但不限于：交易所公开竞价交易中同日同向交易的交易时机和交易价差、不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差、关联交易、债券交易收益率偏离度、成交量和成交价格异常、银行间债券交易对手交易等；2、将公平交易作为投资组合业绩归因分析和交易绩效评价的重要关注内容，发现的异常情况由投资监察员进行分析；3、监察稽核部分别于每季度和每年度编写《公平交易执行情况检查报告》，内容包括关注类交易监控执行情况、不同投资组合的整体收益率差异分析和同向交易价差分析；《公平交易执行情况检查报告》需经公司基金经理、督察长和总经理签署。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行公平交易制度，确保不同投资组合在研究、交易、分配等各环节得到公平对待。

##### 4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

##### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年，新冠疫情对人类生活产生的巨大影响仍在持续，无论是国内采取的严防死守还是国

实际上采用的有限管控模式，以及各个经济体对应开展的相关应对措施，都产生了非常巨大的宏观经济上的影响，在全社会的总供给和总需求上都有非常明显的变化。从国内经济来看，强有力的管制措施保证了社会基本运转的流畅和连续，除了旅游等非常依赖于人口流动的行业受疫情影响较大以外，内需方面基本保持稳定，但原材料端受国内外需求扰动造成的供需缺口导致价格持续快速上行，以及同时双控等政策逐步落地以后的影响叠加，导致了价格向下游传导并不顺畅，上游获利丰厚、中游价格压力较大、下游需求逐步萎缩，政府、企业和居民部门的债务扩张趋缓，在经济增长恢复过程中杠杆率有所回调。具体来看，基建保持稳定，制造业维持复苏趋势，房地产受政策严控以至于信用风险频发，消费恢复相对缓慢。价格方面，生活端物价保持低位稳定，工业品价格迭创新高。

权益市场在连续两年上涨以后，进一步冲高至春节附近走出明显的一波调整，其后进入明显的分化之中，茅指数向宁指数交接，受益于碳达峰和双控等强有力政策的影响，新能源产业链走势较强，上游原材料也受益于供给影响大幅上涨，中下游需求前高后低，持续回落。中小盘或成长型方向的标的表现较优，低估值和价值类型的方向变现偏弱。债券市场，整体流动性维持较为宽松，但绝对收益率水平处于历史低位附近，曲线震荡下行，受房地产行业影响信用风险分化显著，民营房地产公司实质性违约风险逐步暴露。

本基金以追求稳定收益为主要投资策略，控制基金净值回撤幅度。在操作上，保持稳健的中短久期债券资产配置，以固定收益类资产为主要方向，在严格控制整体仓位的前提下，少量参与股票二级市场投资，同时，积极参与新股、可转债、可交换债的网下申购获取增强收益。

#### 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 21.73%，同期业绩比较基准增长率为-0.60%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，新冠疫情的影响逐步减弱，虽然最新变种导致各国感染人数创出新高，但各国采用的应对措施逐步趋缓，疫苗的普及率逐步提高也导致了重症率和死亡率的明显回落，部分经济体已经逐步进入全民免疫的状况。国内仍保持对疫情的严控措施，以及对产业链的强有力保护，导致对外出口持续强势，未来出口将有所回落但产业链的完整也保证了出口整体水平维持较高水平。内需在去年三季度至四季度随地产行业的趋冷快速回落，目前政策转向方向较为明确，但政策的实操和落地过程仍有时滞，信用扩张动力随足够，但需求意愿仍然偏弱。降准降息的宽松周期刚刚启动，预计未来需求会随着信用的逐步扩张得到一定支撑。考虑到目前政策上的积极表态和稳增长的实质性需求，未来基建、地产均有扩张的动力，财政上的发力和实体企业部门的杠杆率回升都可以期待。

目前情况下，流动性进一步持续宽松，企业盈利仍在下行周期之中，但可预期在未来需求企稳回升后盈利也将有触底回升动力，信用扩张周期正在逐步开启，权益类资产的利好和利空处于高度博弈之中，考虑到目前的估值水平，我们维持权益类资产的中性判断，未来积极关注盈利触底回升的时机和信用扩张的趋势形成过程和方向。债券方面，收益率已经对需求较弱的情况和流动性宽松给予了充分预期，债券收益率水平仍处于历史低位附近，我们短期维持对债券市场中性判断，谨慎关注信用扩展对债券收益率曲线产生的冲击。

本基金以追求长期与权益指数相接近的收益率水平，并同时降低净值波动率。目前阶段，权益指数处于历史中性分位数区间，操作方面保持相对中性的权益仓位水平，辅之以部分固定收益类资产，同时，积极参与新股、可转债、可交换债的网下申购获取增强收益。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

##### 1、继续完善内部控制体系

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

##### 2、持续改进投资监控的方法与手段，保证基金投资业务的合法合规性

报告期内，在投资日常合规监控工作方面，公司根据法律法规和产品特点进一步完善了投资监控系统以提升投资监控效率；在实现交易价差分析、银行间交易分析、研究报告检查等专项检查工作定期化、日常化的基础上，公司多次开展有关内幕交易、未公开信息等重要内容的合规培训，进一步强化全体投研人员的合规意识。

##### 3、规范基金销售业务，保证基金销售业务的合法合规性

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

##### 4、开展以风险为导向的内部稽核

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1、截止本报告期末，本基金期末可供分配利润为 202,337,102.37 元，期末基金份额净值 2.0103 元。2、本基金本报告期内未进行利润分配。3、根据相关法律法规及本基金基金合同的规定，本基金管理人将会综合考虑各方面因素，在严格遵守规定前提下，对本报告期内可供分配利润适时作出相应安排。

#### 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

#### 4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

#### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，



并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2022)第 24552 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“鹏华睿投混合基金”)的财务报表,包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表,2021 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了鹏华睿投混合基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于鹏华睿投混合基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	无。
其他事项	无。
其他信息	无。

<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>鹏华睿投混合基金的基金管理人鹏华基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估鹏华睿投混合基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算鹏华睿投混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督鹏华睿投混合基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能对鹏华睿投混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致鹏华睿投混合基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容,并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>

会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	单峰	仲文渊
会计师事务所的地址	中国上海市	
审计报告日期	2022 年 3 月 23 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	4,294,742.36	4,472,078.78
结算备付金		8,282,492.81	16,991,832.18
存出保证金		48,893.84	118,640.34
交易性金融资产	7.4.7.2	444,328,613.96	395,047,072.19
其中：股票投资		152,447,114.98	203,320,060.99
基金投资		-	-
债券投资		291,881,498.98	191,727,011.20
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	203,215.46
应收利息	7.4.7.5	4,145,104.24	3,145,643.58
应收股利		-	-
应收申购款		15,512.62	10,640.40
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		461,115,359.83	419,989,122.93
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2020 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		52,100,000.00	95,900,000.00
应付证券清算款		1,259,715.44	235,992.57
应付赎回款		8,281.40	15,175.31
应付管理人报酬		515,876.58	453,254.68
应付托管费		68,783.54	60,433.93

应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	152,552.16	289,126.47
应交税费		12,383.58	6,263.46
应付利息		-24,094.26	-34,714.37
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	170,060.59	170,043.28
负债合计		54,263,559.03	97,095,575.33
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	202,386,382.33	195,516,972.96
未分配利润	7.4.7.10	204,465,418.47	127,376,574.64
所有者权益合计		406,851,800.80	322,893,547.60
负债和所有者权益总计		461,115,359.83	419,989,122.93

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 2.0103 元，基金份额总额 202,386,382.33 份。

## 7.2 利润表

会计主体：鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 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 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		60,766,180.77	124,153,654.67
1. 利息收入		5,955,159.66	5,132,963.48
其中：存款利息收入	7.4.7.11	138,243.36	234,304.63
债券利息收入		5,803,877.10	4,820,931.01
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		13,039.20	77,727.84
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		65,588,328.13	107,421,000.89
其中：股票投资收益	7.4.7.12	63,724,821.45	105,414,189.30
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	179,101.45	-742,685.66
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-

股利收益	7.4.7.16	1,684,405.23	2,749,497.25
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-11,361,138.68	10,728,974.37
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	583,831.66	870,715.93
减：二、费用		8,127,947.22	10,923,537.06
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	4,470,161.30	5,202,634.67
2. 托管费	7.4.10.2.2	596,021.57	693,684.61
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	1,474,296.46	2,678,400.97
5. 利息支出		1,392,864.59	2,153,201.95
其中：卖出回购金融资产支出		1,392,864.59	2,153,201.95
6. 税金及附加		9,935.54	8,905.22
7. 其他费用	7.4.7.20	184,667.76	186,709.64
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		52,638,233.55	113,230,117.61
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		52,638,233.55	113,230,117.61

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 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）	195,516,972.96	127,376,574.64	322,893,547.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	52,638,233.55	52,638,233.55
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）	6,869,409.37	24,450,610.28	31,320,019.65
其中：1. 基金申购款	120,317,469.77	114,267,300.19	234,584,769.96

2. 基金赎回款	-113,448,060.40	-89,816,689.91	-203,264,750.31
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）	202,386,382.33	204,465,418.47	406,851,800.80
项目	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31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）	107,280,282.87	22,171,304.01	129,451,586.88
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	113,230,117.61	113,230,117.61
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）	88,236,690.09	-8,024,846.98	80,211,843.11
其中：1. 基金申购款	252,000,631.13	75,941,024.71	327,941,655.84
2. 基金赎回款	-163,763,941.04	-83,965,871.69	-247,729,812.73
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）	195,516,972.96	127,376,574.64	322,893,547.60

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

邓召明

邢彪

郝文高

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2017] 2061 号《关于准予鹏华睿投灵活配置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》及其配套规则和《鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于 2018 年 5 月 30 日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集规模为 214,008,175.33 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,基金托管人为招商银行股份有限公司(以下简称:招商银行)。本基金于 2018 年 2 月 28 日至 2018 年 5 月 25 日募集。募集期间净认购资金人民币 213,393,912.52 元,认购资金在募集期间产生的利息人民币 614,262.81 元,募集的有效认购份额及利息结转的基金份额合计 214,008,175.33 份。上述募集资金已由普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了普华永道中天验字(2018)第 0256 号验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围主要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(包含国债、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、股指期货、权证、资产支持证券、国债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)。基金的投资组合比例为:股票(含存托凭证)资产占基金资产的比例为 0%—95%;每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%。

本财务报表由本基金的基金管理人鹏华基金管理有限公司于本基金的审计报告日批准报出。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、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》、《鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (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。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比

例计算认列。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占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)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税(和/或)股票交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。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。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

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

#### 7.4.4.13 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股

票估值指引(试行)》(以下简称“指引”),按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国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。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于2017年颁布了修订后的《企业会计准则第14号—收入》,本基金于2021年1月1日起执行。本基金在编制2021年度财务报表时已采用该准则,该准则的采用未对本基金财务报表产生重大影响。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 7.4.6 税项

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

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

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

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

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

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	4,294,742.36	4,472,078.78
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	4,294,742.36	4,472,078.78

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	144,325,125.83	152,447,114.98	8,121,989.15
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	291,536,929.57	291,881,498.98
	银行间市场	-	-
	合计	291,536,929.57	291,881,498.98
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	435,862,055.40	444,328,613.96	8,466,558.56
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	183,149,374.14	203,320,060.99	20,170,686.85
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	192,070,000.81	191,727,011.20
	银行间市场	-	-
	合计	192,070,000.81	191,727,011.20
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	375,219,374.95	395,047,072.19	19,827,697.24

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

## 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

## 7.4.7.4 买入返售金融资产

## 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

## 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

## 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	410.48	1,320.77
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	4,099.81	8,411.04
应收债券利息	4,140,569.75	3,135,853.03
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	24.20	58.74
合计	4,145,104.24	3,145,643.58

#### 7.4.7.6 其他资产

注：无。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	152,552.16	289,126.47
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	152,552.16	289,126.47

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	60.59	43.28
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	170,000.00	170,000.00
合计	170,060.59	170,043.28

#### 7.4.7.9 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 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	195,516,972.96	195,516,972.96
本期申购	120,317,469.77	120,317,469.77
本期赎回（以“-”号填列）	-113,448,060.40	-113,448,060.40
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	202,386,382.33	202,386,382.33

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.10 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	108,909,588.28	18,466,986.36	127,376,574.64
本期利润	63,999,372.23	-11,361,138.68	52,638,233.55
本期基金份额交易产生的变动数	29,428,141.86	-4,977,531.58	24,450,610.28
其中：基金申购款	111,843,444.88	2,423,855.31	114,267,300.19
基金赎回款	-82,415,303.02	-7,401,386.89	-89,816,689.91
本期已分配利润	-	-	-
本期末	202,337,102.37	2,128,316.10	204,465,418.47

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
活期存款利息收入	28,167.73	77,671.71
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	108,883.60	132,498.44
其他	1,192.03	24,134.48
合计	138,243.36	234,304.63

注：其他包含认/申购款利息收入、结算保证金利息收入、风控金利息收入等

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	63,724,821.45	105,414,189.30
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	63,724,821.45	105,414,189.30

#### 7.4.7.12.2 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12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
卖出股票成交总额	526,991,474.64	896,766,252.42
减：卖出股票成本总额	463,266,653.19	791,352,063.12
买卖股票差价收入	63,724,821.45	105,414,189.30

#### 7.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 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12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31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	179,101.45	-742,685.66
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	179,101.45	-742,685.66

##### 7.4.7.13.2 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12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	93,930,223.40	189,776,994.30
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	92,389,380.27	187,571,828.72

减：应收利息总额	1,361,741.68	2,947,851.24
买卖债券差价收入	179,101.45	-742,685.66

#### 7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

#### 7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：无。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

##### 7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

##### 7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

##### 7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

##### 7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

##### 7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

##### 7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,684,405.23	2,749,497.25
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	1,684,405.23	2,749,497.25

## 7.4.7.17 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 12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020 年12月31日
1. 交易性金融资产	-11,361,138.68	10,728,974.37
股票投资	-12,048,697.70	11,089,961.47
债券投资	687,559.02	-360,987.10
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	-11,361,138.68	10,728,974.37

## 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
基金赎回费收入	535,622.44	859,236.90
基金转换费收入	48,209.22	11,479.03
合计	583,831.66	870,715.93

## 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
交易所市场交易费用	1,474,296.46	2,678,400.97
银行间市场交易费用	-	-
合计	1,474,296.46	2,678,400.97

## 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-

银行汇划费用	14,667.76	16,709.64
合计	184,667.76	186,709.64

#### 7.4.7.21 分部报告

无。

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

无。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
鹏华基金管理有限公司(“鹏华基金公司”)	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司(“招商银行”)	基金托管人、基金代销机构
深圳市北融信投资发展有限公司	基金管理人的股东
意大利欧利盛资本资产管理股份公司(“Eurizon Capital SGR S.p.A.”)	基金管理人的股东
国信证券股份有限公司(“国信证券”)	基金管理人的股东
鹏华资产管理有限公司(“鹏华资产”)	基金管理人的子公司

注：1、本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

2、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例(%)
国信证券	163,052,154.11	17.55	777,133.93	0.05

###### 7.4.10.1.2 债券交易

注：无。

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)
国信证券	388,300,000.00	2.86	-	-

#### 7.4.10.1.4 权证交易

注：无。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
国信证券	132,285.72	16.09	58,531.53	38.37
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
国信证券	630.44	0.04	207.54	0.07

注：（1）佣金的计算公式

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

（佣金比率按照与一般证券公司签订的协议条款订立。）

（2）本基金与关联方已按同业统一的基金佣金计算方式和约定的佣金比例签订了《证券交易席位租用协议》。根据协议规定，上述单位定期或不定期地为鹏华基金公司提供研究服务以及其他研究支持。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	4,470,161.30	5,202,634.67
其中：支付销售机构的客户维护费	250,812.49	354,314.70

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。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	596,021.57	693,684.61

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

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：无。

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

注：无。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：无。

##### 7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末		上年度末	
	2021年12月31日		2020年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例(%)	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例(%)
国信证券	7,671,337.97	7.62	-	-

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

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	4,294,742.36	28,167.73	4,472,078.78	77,671.71

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2021年1月1日至2021年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张）	总金额
国信证券	301091	深城交	网下申购	3,449	125,888.50
国信证券	301066	万事利	网下申购	3,436	18,004.64
国信证券	688622	禾信仪器	网下申购	1,204	21,310.80
国信证券	301032	新柴股份	网下申购	5,124	25,466.28
国信证券	688323	瑞华泰	网下申购	4,513	26,942.61
国信证券	300986	志特新材	网下申购	2,632	38,927.28
国信证券	300957	贝泰妮	网下申购	1,433	67,823.89

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。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

注：无。

#### 7.4.12 期末(2021年12月31日)本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	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
001234	泰慕士	2021年12月31日	2022年1月11日	新股未上市	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-

		日								
300774	倍杰特	2021年7月26日	2022年2月16日	锁定期股票	4.57	21.08	444	2,029.08	9,359.52	-
300814	中富电路	2021年8月4日	2022年2月14日	锁定期股票	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64	-
300854	中兰环保	2021年9月8日	2022年3月16日	锁定期股票	9.96	27.29	203	2,021.88	5,539.87	-
300994	久祺股份	2021年8月2日	2022年2月14日	锁定期股票	11.90	45.45	420	4,998.00	19,089.00	-
301018	申菱环境	2021年6月28日	2022年1月7日	锁定期股票	8.29	26.06	782	6,482.78	20,378.92	-
301020	密封科技	2021年6月28日	2022年1月6日	锁定期股票	10.64	30.44	421	4,479.44	12,815.24	-
301021	英诺激光	2021年6月28日	2022年1月6日	锁定期股票	9.46	41.43	290	2,743.40	12,014.70	-
301025	读客文化	2021年7月6日	2022年1月24日	锁定期股票	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	-
301026	浩通科技	2021年7月8日	2022年1月17日	锁定期股票	18.03	62.73	203	3,660.09	12,734.19	-
301027	华蓝集团	2021年7月8日	2022年1月19日	锁定期股票	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	-
301028	东亚机械	2021年7月12日	2022年1月20日	锁定期股票	5.31	13.50	733	3,892.23	9,895.50	-
301029	怡合达	2021年7月14日	2022年1月24日	锁定期股票	14.14	89.87	462	6,532.68	41,519.94	-
301030	仕净科技	2021年7月15日	2022年1月24日	锁定期股票	6.10	31.52	242	1,476.20	7,627.84	-
301032	新柴股份	2021年7月15日	2022年1月24日	锁定期股票	4.97	12.51	513	2,549.61	6,417.63	-
301033	迈普	2021	2022	锁定期	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	-



	医学	年 7 月 15 日	年 1 月 26 日	股票							
301036	双乐 股份	2021 年 7 月 21 日	2022 年 2 月 16 日	锁定期 股票	23.38	29.93	205	4,792.90	6,135.65	-	
301037	保立 佳	2021 年 7 月 21 日	2022 年 2 月 7 日	锁定期 股票	14.82	24.26	193	2,860.26	4,682.18	-	
301039	中集 车辆	2021 年 7 月 1 日	2022 年 1 月 10 日	锁定期 股票	6.96	12.51	1,229	8,553.84	15,374.79	-	
301040	中环 海陆	2021 年 7 月 26 日	2022 年 2 月 7 日	锁定期 股票	13.57	38.51	241	3,270.37	9,280.91	-	
301045	天禄 科技	2021 年 8 月 6 日	2022 年 2 月 17 日	锁定期 股票	15.81	28.37	335	5,296.35	9,503.95	-	
301046	能辉 科技	2021 年 8 月 10 日	2022 年 2 月 17 日	锁定期 股票	8.34	48.99	290	2,418.60	14,207.10	-	
301048	金鹰 重工	2021 年 8 月 11 日	2022 年 2 月 28 日	锁定期 股票	4.13	12.96	843	3,481.59	10,925.28	-	
301049	超越 科技	2021 年 8 月 17 日	2022 年 2 月 24 日	锁定期 股票	19.34	32.92	196	3,790.64	6,452.32	-	
301050	雷电 微力	2021 年 8 月 17 日	2022 年 2 月 24 日	锁定期 股票	60.64	234.74	137	8,307.68	32,159.38	-	
301052	果麦 文化	2021 年 8 月 23 日	2022 年 2 月 28 日	锁定期 股票	8.11	33.64	252	2,043.72	8,477.28	-	
301053	远信 工业	2021 年 8 月 25 日	2022 年 3 月 1 日	锁定期 股票	11.87	28.78	155	1,839.85	4,460.90	-	
301058	中粮 工科	2021 年 9 月 1 日	2022 年 3 月 9 日	锁定期 股票	3.55	18.24	1,386	4,920.30	25,280.64	-	
301062	上海 艾录	2021 年 9 月 7 日	2022 年 3 月 14 日	锁定期 股票	3.31	17.01	523	1,731.13	8,896.23	-	
301063	海锅 股份	2021 年 9 月 9 日	2022 年 3 月 24 日	锁定期 股票	17.40	36.11	153	2,662.20	5,524.83	-	

301066	万事利	2021年9月13日	2022年3月22日	锁定期股票	5.24	22.84	344	1,802.56	7,856.96	-
301068	大地海洋	2021年9月16日	2022年3月28日	锁定期股票	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	-
301069	凯盛新材	2021年9月16日	2022年3月28日	锁定期股票	5.17	44.21	539	2,786.63	23,829.19	-
301072	中捷精工	2021年9月22日	2022年3月29日	锁定期股票	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	-
301073	君亭酒店	2021年9月22日	2022年3月30日	锁定期股票	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	-
301078	孩子王	2021年9月30日	2022年4月14日	锁定期股票	5.77	12.14	756	4,362.12	9,177.84	-
301089	拓新药业	2021年10月20日	2022年4月27日	锁定期股票	19.11	67.93	220	4,204.20	14,944.60	-
301091	深城交	2021年10月20日	2022年4月29日	锁定期股票	36.50	31.31	345	12,592.50	10,801.95	-
301096	百诚医药	2021年12月13日	2022年6月20日	锁定期股票	79.60	78.53	119	9,472.40	9,345.07	-
301098	金埔园林	2021年11月4日	2022年5月12日	锁定期股票	12.36	22.17	307	3,794.52	6,806.19	-
301100	风光股份	2021年12月10日	2022年6月17日	锁定期股票	27.81	31.14	427	11,874.87	13,296.78	-
301101	明月镜片	2021年12月9日	2022年6月16日	锁定期股票	26.91	43.36	371	9,983.61	16,086.56	-
301108	洁雅股份	2021年11月25日	2022年6月6日	锁定期股票	57.27	53.71	196	11,224.92	10,527.16	-

301111	粤万年青	2021年11月30日	2022年6月7日	锁定期股票	10.48	36.68	379	3,971.92	13,901.72	-
301118	恒光股份	2021年11月9日	2022年5月18日	锁定期股票	22.70	49.02	315	7,150.50	15,441.30	-
301126	达嘉维康	2021年11月30日	2022年6月7日	锁定期股票	12.37	19.23	662	8,188.94	12,730.26	-
301127	天源环保	2021年12月23日	2022年6月30日	锁定期股票	12.03	17.12	1,406	16,914.18	24,070.72	-
301133	金钟股份	2021年11月19日	2022年5月26日	锁定期股票	14.33	26.95	286	4,098.38	7,707.70	-
301136	招标股份	2021年12月31日	2022年1月11日	新股未上市	10.52	10.52	7,172	75,449.44	75,449.44	-
301138	华研精机	2021年12月8日	2022年6月15日	锁定期股票	26.17	44.86	285	7,458.45	12,785.10	-
301155	海力风电	2021年11月17日	2022年5月24日	锁定期股票	60.66	96.75	311	18,865.26	30,089.25	-
301166	优宁维	2021年12月21日	2022年6月28日	锁定期股票	86.06	94.50	156	13,425.36	14,742.00	-
301168	通灵股份	2021年12月2日	2022年6月10日	锁定期股票	39.08	52.13	279	10,903.32	14,544.27	-
301177	迪阿股份	2021年12月8日	2022年6月15日	锁定期股票	116.88	116.08	185	21,622.80	21,474.80	-
301179	泽宇智能	2021年12月1日	2022年6月8日	锁定期股票	43.99	50.77	205	9,017.95	10,407.85	-
301180	万祥	2021	2022	锁定期	12.20	22.72	654	7,978.80	14,858.88	-

	科技	年 11 月 9 日	年 5 月 16 日	股票							
301182	凯旺科技	2021 年 12 月 16 日	2022 年 6 月 23 日	锁定期股票	27.12	30.58	294	7,973.28	8,990.52	-	
301185	鸥玛软件	2021 年 11 月 11 日	2022 年 5 月 19 日	锁定期股票	11.88	21.16	578	6,866.64	12,230.48	-	
301190	善水科技	2021 年 12 月 17 日	2022 年 6 月 24 日	锁定期股票	27.85	27.46	436	12,142.60	11,972.56	-	
301193	家联科技	2021 年 12 月 2 日	2022 年 6 月 9 日	锁定期股票	30.73	29.14	297	9,126.81	8,654.58	-	
301198	喜悦智行	2021 年 11 月 25 日	2022 年 6 月 2 日	锁定期股票	21.76	29.20	262	5,701.12	7,650.40	-	
301199	迈赫股份	2021 年 11 月 30 日	2022 年 6 月 7 日	锁定期股票	29.28	32.00	402	11,770.56	12,864.00	-	
301221	光庭信息	2021 年 12 月 15 日	2022 年 6 月 22 日	锁定期股票	69.89	88.72	212	14,816.68	18,808.64	-	
601728	中国电信	2021 年 8 月 11 日	2022 年 2 月 21 日	锁定期股票	4.53	4.27	394,011	1,784,869.83	1,682,426.97	-	
688071	华依科技	2021 年 7 月 21 日	2022 年 2 月 7 日	锁定期股票	13.73	62.31	1,101	15,116.73	68,603.31	-	
688190	云路股份	2021 年 11 月 18 日	2022 年 5 月 26 日	锁定期股票	46.63	92.51	2,006	93,539.78	185,575.06	-	
688226	威腾电气	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 7 日	锁定期股票	6.42	15.76	2,693	17,289.06	42,441.68	-	
688227	品高股份	2021 年 12 月	2022 年 6 月	锁定期股票	37.09	30.76	4,164	154,442.76	128,084.64	-	

		月 23 日	30 日							
688232	新点软件	2021 年 11 月 10 日	2022 年 5 月 17 日	锁定期股票	48.49	41.99	5,275	255,784.75	221,497.25	-
688257	新锐股份	2021 年 10 月 19 日	2022 年 4 月 27 日	锁定期股票	62.30	61.10	2,175	135,502.50	132,892.50	-
688262	国芯科技	2021 年 12 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	新股未上市	41.98	41.98	3,845	161,413.10	161,413.10	-
688285	高铁电气	2021 年 10 月 12 日	2022 年 4 月 20 日	锁定期股票	7.18	9.14	15,159	108,841.62	138,553.26	-
688622	禾信仪器	2021 年 9 月 3 日	2022 年 3 月 14 日	锁定期股票	17.70	56.93	1,204	21,310.80	68,543.72	-
688768	容知日新	2021 年 7 月 16 日	2022 年 1 月 26 日	锁定期股票	18.23	108.54	907	16,534.61	98,445.78	-

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份，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。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002683	宏大爆破	2021年12月20日	重大事项	30.12	2022年1月4日	31.00	3,500	97,275.00	105,420.00	-

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 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 52,100,000.00 元，于 2022 年 01 月 04 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。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的股票(包含中小板，创业板及其他经中国证监会核准上市的股票，存托凭证)，债券(含国债，金融债，企业债，公司债，央行票据，中期票据，短期融资券，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，国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，

使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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

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

#### 7.4.13.2 信用风险

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

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

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

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

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

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

##### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

**7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

注：无。

**7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	271,870,000.00	169,734,000.00
AAA 以下	5,498.98	21,611.20
未评级	-	-
合计	271,875,498.98	169,755,611.20

注：上述评级均由经中国证监会核准从事证券市场资信评级业务的评级机构作出。

**7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

注：无。

**7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

注：无。

**7.4.13.3 流动性风险**

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

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理职能部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短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 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款余额 52,100,000.00 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。

#### 7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

#### 7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

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

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

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

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

情况良好。

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

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

本基金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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 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	4,294,742.36	-	-	-	4,294,742.36
结算备付金	8,282,492.81	-	-	-	8,282,492.81
存出保证金	48,893.84	-	-	-	48,893.84
交易性金融资产	50,437,000.00	241,439,000.00	5,498.98	152,447,114.98	444,328,613.96
应收利息	-	-	-	4,145,104.24	4,145,104.24
应收申购款	-	-	-	15,512.62	15,512.62
资产总计	63,063,129.01	241,439,000.00	5,498.98	156,607,731.84	461,115,359.83
负债					
应付赎回款	-	-	-	8,281.40	8,281.40
应付管理人报酬	-	-	-	515,876.58	515,876.58
应付托管费	-	-	-	68,783.54	68,783.54
应付证券清算款	-	-	-	1,259,715.44	1,259,715.44
卖出回购金融资产款	52,100,000.00	-	-	-	52,100,000.00
应付交易费用	-	-	-	152,552.16	152,552.16
应付利息	-	-	-	-24,094.26	-24,094.26
应交税费	-	-	-	12,383.58	12,383.58
其他负债	-	-	-	170,060.59	170,060.59
负债总计	52,100,000.00	-	-	2,163,559.03	54,263,559.03
利率敏感度缺口	10,963,129.01	241,439,000.00	5,498.98	154,444,172.81	406,851,800.80
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	4,472,078.78	-	-	-	4,472,078.78
结算备付金	16,991,832.18	-	-	-	16,991,832.18
存出保证金	118,640.34	-	-	-	118,640.34
交易性金融资产	21,971,400.00	169,734,000.00	21,611.20	203,320,060.99	395,047,072.19
应收利息	-	-	-	3,145,643.58	3,145,643.58
应收申购款	-	-	-	10,640.40	10,640.40
应收证券清算款	-	-	-	203,215.46	203,215.46
资产总计	43,553,951.30	169,734,000.00	21,611.20	206,679,560.43	419,989,122.93
负债					
应付赎回款	-	-	-	15,175.31	15,175.31
应付管理人报酬	-	-	-	453,254.68	453,254.68
应付托管费	-	-	-	60,433.93	60,433.93
应付证券清算款	-	-	-	235,992.57	235,992.57
卖出回购金融资产款	95,900,000.00	-	-	-	95,900,000.00
应付交易费用	-	-	-	289,126.47	289,126.47
应付利息	-	-	-	-34,714.37	-34,714.37
应交税费	-	-	-	6,263.46	6,263.46
其他负债	-	-	-	170,043.28	170,043.28
负债总计	95,900,000.00	-	-	1,195,575.33	97,095,575.33
利率敏感度缺口	-52,346,048.70	169,734,000.00	21,611.20	205,483,985.10	322,893,547.60

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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。		
	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12月31日）	上年度末（2020年12月31日）
分析	市场利率下降 25 个基点	886,077.57	961,048.41
	市场利率上升 25 个基点	-881,063.75	-953,465.27

注：无。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

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

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无。

##### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。

基金的投资组合比例为：股票（含存托凭证）资产占基金资产的比例为 0%-95%；每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

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

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 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	152,447,114.98	37.47	203,320,060.99	62.97
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	5,498.98	-	21,611.20	0.01
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	152,452,613.96	37.47	203,341,672.19	62.97

注：债券投资为可转换债券、可交换债券投资。

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准外的其他市场变量保持不变		
	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12月31日）	上年度末（2020年12月31日）
分析	业绩比较基准上升5%	7,854,274.01	11,813,885.87
	业绩比较基准下降5%	-7,854,274.01	-11,813,885.87

注：无。

#### 7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 日, 本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 148,580,183.77 元, 属于第二层次的余额为 292,223,787.03 元, 属于第三层次的余额为 3,524,643.16 元(2020 年 12 月 31 日: 第一层次 188,125,480.33 元, 第二层次 206,921,591.86 元, 无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

于 2021 年 12 月 31 日, 本基金持有公允价值归属于第三层次的金融工具为人民币 3,524,643.16 元(2020 年 12 月 31 日: 无), 本基金本年度购买第三层次金融工具金额为 2,983,574.75 元(2020 年度: 无), 无出售第三层次金融工具金额(2020 年度: 无), 无转入第三层次金融工具金额(2020 年度: 无), 无转出第三层次金融工具金额(2020 年度: 无), 计入损益的第三层次的金融工具公允价值变动或当期投资收益为 541,068.41 元(2020 年度: 无)。

于 2021 年 12 月 31 日, 本基金持有第三层级的交易性金融资产(均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资)公允价值为 3,524,643.16 元, 采用平均价格亚式期权模型进行估值, 不可观察输入值为预期波动率, 与公允价值之间为负相关关系。(2020 年 12 月 31 日: 本基金未持有第三层级的交易性金融资产)。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 12 月 31 日, 本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2020 年 12 月 31 日: 同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列

报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定,以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》,公募证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。截至 2021 年 12 月 31 日,本基金已完成了执行新金融工具准则对财务报表潜在影响的评估。鉴于本基金业务的性质,新金融工具准则预期不会对本基金的财务状况和经营成果产生重大影响。 本基金将自 2022

年 1 月 1 日起追溯执行相关新规定,并采用准则允许的实务简便方法,调整期初所有者权益,2021 年的比较数据将不作重述。

(3)除公允价值和执行新金融工具准则外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	152,447,114.98	33.06
	其中:股票	152,447,114.98	33.06
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	291,881,498.98	63.30
	其中:债券	291,881,498.98	63.30
	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	12,577,235.17	2.73
8	其他各项资产	4,209,510.70	0.91
9	合计	461,115,359.83	100.00

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,764,163.00	0.43
B	采矿业	3,367,066.30	0.83
C	制造业	92,957,977.90	22.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,098,012.70	1.25
E	建筑业	4,321,283.99	1.06

F	批发和零售业	6,504,995.62	1.60
G	交通运输、仓储和邮政业	1,778,499.72	0.44
H	住宿和餐饮业	705,639.00	0.17
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,990,713.91	3.19
J	金融业	7,252,897.72	1.78
K	房地产业	3,770,407.20	0.93
L	租赁和商务服务业	1,137,940.60	0.28
M	科学研究和技术服务业	265,306.10	0.07
N	水利、环境和公共设施管理业	525,245.06	0.13
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	24,398.40	0.01
Q	卫生和社会工作	5,978,817.00	1.47
R	文化、体育和娱乐业	3,597,135.56	0.88
S	综合	406,615.20	0.10
	合计	152,447,114.98	37.47

## 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	603077	和邦生物	1,852,600	6,317,366.00	1.55
2	300244	迪安诊断	178,100	5,978,817.00	1.47
3	000988	华工科技	180,700	5,034,302.00	1.24
4	002340	格林美	451,300	4,670,955.00	1.15
5	300474	景嘉微	25,800	3,926,760.00	0.97
6	600884	杉杉股份	111,255	3,645,826.35	0.90
7	600516	方大炭素	295,400	3,196,228.00	0.79
8	603290	斯达半导	8,100	3,086,100.00	0.76
9	600158	中体产业	196,547	2,971,790.64	0.73
10	600392	盛和资源	147,600	2,895,912.00	0.71
11	300168	万达信息	222,100	2,891,742.00	0.71
12	600566	济川药业	99,700	2,825,498.00	0.69
13	000799	酒鬼酒	13,000	2,762,500.00	0.68
14	600536	中国软件	53,600	2,676,248.00	0.66
15	601868	中国能建	954,418	2,605,561.14	0.64
16	001914	招商积余	119,700	2,425,122.00	0.60
17	603486	科沃斯	15,020	2,267,269.00	0.56
18	601099	太平洋	684,300	2,244,504.00	0.55



19	600863	内蒙华电	567,400	2,235,556.00	0.55
20	000581	威孚高科	101,700	2,190,618.00	0.54
21	600153	建发股份	199,300	1,807,651.00	0.44
22	000623	吉林敖东	93,300	1,723,251.00	0.42
23	601636	旗滨集团	98,500	1,684,350.00	0.41
24	601728	中国电信	394,011	1,682,426.97	0.41
25	002085	万丰奥威	301,800	1,656,882.00	0.41
26	002985	北摩高科	13,210	1,591,276.60	0.39
27	603379	三美股份	65,400	1,489,812.00	0.37
28	600167	联美控股	165,160	1,488,091.60	0.37
29	600487	亨通光电	93,200	1,409,184.00	0.35
30	000039	中集集团	81,820	1,404,031.20	0.35
31	600195	中牧股份	102,889	1,344,759.23	0.33
32	002416	爱施德	115,940	1,319,397.20	0.32
33	000062	深圳华强	76,235	1,313,529.05	0.32
34	601233	桐昆股份	61,400	1,300,452.00	0.32
35	600928	西安银行	296,100	1,273,230.00	0.31
36	600640	新国脉	82,600	1,259,650.00	0.31
37	600779	水井坊	10,443	1,253,055.57	0.31
38	002458	益生股份	107,700	1,218,087.00	0.30
39	600881	亚泰集团	365,500	1,187,875.00	0.29
40	600256	广汇能源	154,300	1,009,122.00	0.25
41	002831	裕同科技	27,181	915,727.89	0.23
42	601000	唐山港	332,700	914,925.00	0.22
43	600970	中材国际	68,100	778,383.00	0.19
44	000488	晨鸣纸业	94,200	682,008.00	0.17
45	600089	特变电工	30,600	647,802.00	0.16
46	002242	九阳股份	27,200	631,040.00	0.16
47	601969	海南矿业	52,400	629,324.00	0.15
48	688235	百济神州-U	4,323	624,716.73	0.15
49	600177	雅戈尔	86,200	593,918.00	0.15
50	000877	天山股份	38,400	587,904.00	0.14
51	002709	天赐材料	4,592	526,472.80	0.13
52	600546	山煤国际	61,000	500,810.00	0.12
53	600095	湘财股份	44,100	446,292.00	0.11
54	601187	厦门银行	63,500	438,150.00	0.11
55	002074	国轩高科	7,900	404,875.00	0.10
56	600754	锦江酒店	6,300	369,180.00	0.09
57	002818	富森美	29,060	363,540.60	0.09
58	300207	欣旺达	8,500	358,360.00	0.09
59	002583	海能达	63,500	350,520.00	0.09
60	300316	晶盛机电	4,900	340,550.00	0.08

61	600258	首旅酒店	12,700	331,851.00	0.08
62	600885	宏发股份	4,098	305,874.72	0.08
63	000009	中国宝安	21,040	303,607.20	0.07
64	600219	南山铝业	58,700	276,477.00	0.07
65	000723	美锦能源	17,000	275,910.00	0.07
66	002385	大北农	26,100	273,789.00	0.07
67	002013	中航机电	15,000	272,700.00	0.07
68	600460	士兰微	4,900	265,580.00	0.07
69	300285	国瓷材料	6,100	259,677.00	0.06
70	300088	长信科技	19,400	257,632.00	0.06
71	002268	卫士通	4,600	257,324.00	0.06
72	300037	新宙邦	2,200	248,600.00	0.06
73	601718	际华集团	81,500	242,870.00	0.06
74	002180	纳思达	5,000	238,800.00	0.06
75	002625	光启技术	9,800	235,298.00	0.06
76	601117	中国化学	19,400	232,800.00	0.06
77	600563	法拉电子	1,000	232,400.00	0.06
78	002028	思源电气	4,700	231,287.00	0.06
79	688232	新点软件	5,275	221,497.25	0.05
80	002648	卫星化学	5,520	220,965.60	0.05
81	300253	卫宁健康	13,100	219,556.00	0.05
82	002185	华天科技	17,100	217,341.00	0.05
83	600141	兴发集团	5,720	216,673.60	0.05
84	601168	西部矿业	15,400	209,594.00	0.05
85	688099	晶晨股份	1,600	208,320.00	0.05
86	000630	铜陵有色	59,100	205,668.00	0.05
87	002223	鱼跃医疗	5,400	204,120.00	0.05
88	300699	光威复材	2,400	202,752.00	0.05
89	600765	中航重机	4,000	201,960.00	0.05
90	603589	口子窖	2,800	198,436.00	0.05
91	002797	第一创业	26,700	195,444.00	0.05
92	600862	中航高科	5,400	193,104.00	0.05
93	002138	顺络电子	5,000	190,900.00	0.05
94	601689	拓普集团	3,585	190,005.00	0.05
95	000998	隆平高科	8,100	188,406.00	0.05
96	688097	博众精工	3,983	185,846.78	0.05
97	688190	云路股份	2,006	185,575.06	0.05
98	601615	明阳智能	7,100	185,310.00	0.05
99	601127	小康股份	3,100	184,605.00	0.05
100	600875	东方电气	8,600	184,212.00	0.05
101	002080	中材科技	5,400	183,708.00	0.05
102	600486	扬农化工	1,400	183,680.00	0.05

103	300308	中际旭创	4,300	182,750.00	0.04
104	603868	飞科电器	4,200	182,364.00	0.04
105	600120	浙江东方	40,921	180,870.82	0.04
106	002353	杰瑞股份	4,500	180,000.00	0.04
107	300146	汤臣倍健	6,600	177,936.00	0.04
108	600418	江淮汽车	10,200	177,480.00	0.04
109	600038	中直股份	2,200	176,660.00	0.04
110	002212	天融信	9,130	175,022.10	0.04
111	600733	北汽蓝谷	17,400	174,348.00	0.04
112	300223	北京君正	1,300	174,200.00	0.04
113	000807	云铝股份	15,200	169,784.00	0.04
114	300058	蓝色光标	15,800	169,534.00	0.04
115	600739	辽宁成大	8,600	167,872.00	0.04
116	300296	利亚德	16,300	167,075.00	0.04
117	002422	科伦药业	8,700	164,691.00	0.04
118	603893	瑞芯微	1,200	164,280.00	0.04
119	000636	风华高科	5,500	163,900.00	0.04
120	601016	节能风电	25,000	162,750.00	0.04
121	002439	启明星辰	5,700	162,621.00	0.04
122	000415	渤海租赁	55,800	162,378.00	0.04
123	688262	国芯科技	3,845	161,413.10	0.04
124	002444	巨星科技	5,200	158,652.00	0.04
125	603260	合盛硅业	1,200	158,364.00	0.04
126	600529	山东药玻	3,600	158,040.00	0.04
127	000960	锡业股份	8,000	156,240.00	0.04
128	002030	达安基因	7,766	155,785.96	0.04
129	688538	和辉光电-U	50,571	155,758.68	0.04
130	000547	航天发展	9,300	155,310.00	0.04
131	002465	海格通信	14,200	155,064.00	0.04
132	600643	爱建集团	22,900	154,804.00	0.04
133	600637	东方明珠	16,300	154,035.00	0.04
134	600549	厦门钨业	6,700	151,621.00	0.04
135	000738	航发控制	5,000	151,400.00	0.04
136	002273	水晶光电	8,700	151,293.00	0.04
137	603737	三棵树	1,080	150,282.00	0.04
138	601198	东兴证券	12,800	148,864.00	0.04
139	000563	陕国投 A	45,900	148,257.00	0.04
140	300418	昆仑万维	6,400	148,160.00	0.04
141	002507	涪陵榨菜	3,900	147,420.00	0.04
142	600642	申能股份	19,900	146,663.00	0.04
143	603605	珀莱雅	700	145,817.00	0.04
144	600039	四川路桥	12,100	145,684.00	0.04

145	000830	鲁西化工	9,500	144,970.00	0.04
146	601128	常熟银行	21,800	144,098.00	0.04
147	000519	中兵红箭	5,400	144,018.00	0.04
148	600704	物产中大	24,300	143,856.00	0.04
149	600160	巨化股份	11,120	143,559.20	0.04
150	600201	生物股份	8,742	142,931.70	0.04
151	002078	太阳纸业	12,400	142,476.00	0.04
152	002092	中泰化学	14,900	142,146.00	0.03
153	600027	华电国际	26,400	141,240.00	0.03
154	002299	圣农发展	5,800	140,186.00	0.03
155	600732	爱旭股份	6,000	140,160.00	0.03
156	600901	江苏租赁	27,500	139,975.00	0.03
157	600699	均胜电子	6,360	139,729.20	0.03
158	600369	西南证券	26,300	139,127.00	0.03
159	688285	高铁电气	15,159	138,553.26	0.03
160	000629	攀钢钒钛	35,500	138,095.00	0.03
161	600988	赤峰黄金	9,200	137,080.00	0.03
162	000932	华菱钢铁	26,780	136,845.80	0.03
163	600879	航天电子	16,600	136,784.00	0.03
164	000983	山西焦煤	16,530	136,703.10	0.03
165	300618	寒锐钴业	1,700	136,306.00	0.03
166	002131	利欧股份	54,500	134,070.00	0.03
167	000825	太钢不锈	19,000	133,760.00	0.03
168	688002	睿创微纳	1,700	133,569.00	0.03
169	688257	新锐股份	2,175	132,892.50	0.03
170	601997	贵阳银行	20,300	132,153.00	0.03
171	603198	迎驾贡酒	1,900	131,955.00	0.03
172	600170	上海建工	36,500	131,400.00	0.03
173	002603	以岭药业	6,680	130,928.00	0.03
174	000400	许继电气	5,000	130,500.00	0.03
175	000739	普洛药业	3,700	129,833.00	0.03
176	688227	品高股份	4,164	128,084.64	0.03
177	600372	中航电子	5,700	127,623.00	0.03
178	600166	福田汽车	37,000	127,280.00	0.03
179	600859	王府井	4,700	126,900.00	0.03
180	603444	吉比特	300	126,555.00	0.03
181	000050	深天马 A	9,700	126,294.00	0.03
182	002056	横店东磁	6,600	124,542.00	0.03
183	300070	碧水源	17,300	124,387.00	0.03
184	000887	中鼎股份	5,700	124,317.00	0.03
185	002002	鸿达兴业	20,500	124,230.00	0.03
186	000750	国海证券	30,100	123,711.00	0.03

187	300383	光环新网	8,300	123,172.00	0.03
188	600497	驰宏锌锗	24,600	122,754.00	0.03
189	002926	华西证券	12,400	122,140.00	0.03
190	600867	通化东宝	11,100	121,656.00	0.03
191	600316	洪都航空	3,100	121,086.00	0.03
192	600008	首创环保	35,210	120,066.10	0.03
193	600909	华安证券	22,190	120,047.90	0.03
194	300001	特锐德	4,800	119,376.00	0.03
195	600066	宇通客车	10,800	119,016.00	0.03
196	300251	光线传媒	9,200	118,220.00	0.03
197	002372	伟星新材	4,860	118,195.20	0.03
198	600380	健康元	9,192	118,025.28	0.03
199	600348	华阳股份	9,900	117,315.00	0.03
200	002408	齐翔腾达	11,120	116,760.00	0.03
201	002152	广电运通	9,800	116,620.00	0.03
202	002221	东华能源	9,200	115,828.00	0.03
203	300009	安科生物	8,832	115,610.88	0.03
204	601005	重庆钢铁	55,200	115,368.00	0.03
205	600188	兖矿能源	4,900	115,297.00	0.03
206	600271	航天信息	8,600	115,154.00	0.03
207	002191	劲嘉股份	7,600	114,988.00	0.03
208	000513	丽珠集团	2,851	114,638.71	0.03
209	300357	我武生物	2,000	114,600.00	0.03
210	600535	天士力	7,200	114,120.00	0.03
211	300026	红日药业	14,500	113,535.00	0.03
212	000537	广宇发展	4,700	113,270.00	0.03
213	002065	东华软件	14,500	113,100.00	0.03
214	603568	伟明环保	3,081	112,548.93	0.03
215	002249	大洋电机	12,800	112,512.00	0.03
216	000021	深科技	7,100	112,464.00	0.03
217	002500	山西证券	16,970	112,002.00	0.03
218	600580	卧龙电驱	6,100	111,569.00	0.03
219	300115	长盈精密	5,600	111,104.00	0.03
220	002572	索菲亚	5,000	111,000.00	0.03
221	000975	银泰黄金	12,640	110,979.20	0.03
222	601699	潞安环能	9,800	110,838.00	0.03
223	603156	养元饮品	3,900	110,799.00	0.03
224	002373	千方科技	7,400	110,630.00	0.03
225	600171	上海贝岭	4,300	110,338.00	0.03
226	300024	机器人	9,800	109,466.00	0.03
227	603707	健友股份	2,600	109,200.00	0.03
228	000012	南玻 A	10,946	108,693.78	0.03

229	002127	南极电商	15,700	108,330.00	0.03
230	000878	云南铜业	8,100	108,297.00	0.03
231	002506	协鑫集成	28,300	107,540.00	0.03
232	600998	九州通	7,300	107,456.00	0.03
233	300630	普利制药	1,943	106,942.72	0.03
234	600801	华新水泥	5,540	106,922.00	0.03
235	002195	二三四五	45,592	106,685.28	0.03
236	300315	掌趣科技	21,800	105,948.00	0.03
237	000970	中科三环	6,600	105,930.00	0.03
238	002683	宏大爆破	3,500	105,420.00	0.03
239	000997	新大陆	5,800	105,096.00	0.03
240	300182	捷成股份	16,600	105,078.00	0.03
241	600315	上海家化	2,600	105,066.00	0.03
242	300017	网宿科技	15,700	105,033.00	0.03
243	002557	洽洽食品	1,700	104,312.00	0.03
244	002250	联化科技	5,800	104,226.00	0.03
245	600415	小商品城	21,400	103,790.00	0.03
246	601866	中远海发	31,800	103,350.00	0.03
247	300212	易华录	2,920	103,222.00	0.03
248	688208	道通科技	1,300	103,220.00	0.03
249	600673	东阳光	11,600	103,008.00	0.03
250	000999	华润三九	3,000	102,720.00	0.03
251	600208	新湖中宝	34,000	101,320.00	0.02
252	002019	亿帆医药	5,700	100,434.00	0.02
253	000060	中金岭南	20,400	100,164.00	0.02
254	300002	神州泰岳	15,800	100,014.00	0.02
255	603712	七一二	2,300	99,590.00	0.02
256	002156	通富微电	5,100	99,093.00	0.02
257	688768	容知日新	907	98,445.78	0.02
258	002505	鹏都农牧	25,700	98,174.00	0.02
259	600500	中化国际	11,460	98,097.60	0.02
260	000930	中粮科技	9,000	97,830.00	0.02
261	000686	东北证券	11,000	96,580.00	0.02
262	600839	四川长虹	29,100	96,321.00	0.02
263	600390	五矿资本	18,000	95,760.00	0.02
264	600155	华创阳安	9,600	95,616.00	0.02
265	601717	郑煤机	8,200	95,038.00	0.02
266	601992	金隅集团	33,400	94,856.00	0.02
267	600511	国药股份	3,000	94,590.00	0.02
268	000401	冀东水泥	7,900	94,484.00	0.02
269	600498	烽火通信	5,200	93,496.00	0.02
270	002004	华邦健康	12,900	93,396.00	0.02

271	600895	张江高科	6,200	93,372.00	0.02
272	002266	浙富控股	13,100	93,272.00	0.02
273	000681	视觉中国	3,900	93,210.00	0.02
274	002294	信立泰	3,400	92,888.00	0.02
275	603858	步长制药	4,400	92,796.00	0.02
276	000027	深圳能源	11,420	92,502.00	0.02
277	603225	新凤鸣	6,220	92,367.00	0.02
278	000598	兴蓉环境	14,600	92,272.00	0.02
279	600718	东软集团	6,800	92,208.00	0.02
280	600282	南钢股份	24,900	92,130.00	0.02
281	601179	中国西电	16,600	92,130.00	0.02
282	600667	太极实业	11,400	92,112.00	0.02
283	002128	电投能源	6,200	92,070.00	0.02
284	002701	奥瑞金	13,100	91,700.00	0.02
285	000729	燕京啤酒	10,800	91,476.00	0.02
286	600728	佳都科技	10,900	90,797.00	0.02
287	600216	浙江医药	5,300	90,524.00	0.02
288	300463	迈克生物	3,100	90,489.00	0.02
289	002203	海亮股份	7,200	89,496.00	0.02
290	600985	淮北矿业	8,000	89,440.00	0.02
291	002966	苏州银行	13,200	89,364.00	0.02
292	002745	木林森	5,900	89,267.00	0.02
293	000540	中天金融	33,700	88,968.00	0.02
294	600409	三友化工	10,200	88,740.00	0.02
295	002174	游族网络	5,800	88,392.00	0.02
296	002670	国盛金控	9,193	88,252.80	0.02
297	600297	广汇汽车	32,500	86,775.00	0.02
298	002368	太极股份	3,120	85,924.80	0.02
299	600528	中铁工业	10,400	85,384.00	0.02
300	002396	星网锐捷	3,600	84,852.00	0.02
301	600060	海信视像	6,300	84,735.00	0.02
302	000709	河钢股份	34,400	84,624.00	0.02
303	600021	上海电力	6,600	84,612.00	0.02
304	600803	新奥股份	4,600	84,456.00	0.02
305	002010	传化智联	9,700	84,390.00	0.02
306	000883	湖北能源	16,100	84,364.00	0.02
307	002958	青农商行	21,800	84,148.00	0.02
308	002183	怡亚通	12,700	84,074.00	0.02
309	300072	三聚环保	10,600	84,058.00	0.02
310	600567	山鹰国际	25,500	83,895.00	0.02
311	300271	华宇软件	6,600	83,820.00	0.02
312	000690	宝新能源	14,100	83,472.00	0.02

313	603885	吉祥航空	4,700	83,425.00	0.02
314	600755	厦门国贸	11,500	82,915.00	0.02
315	002075	沙钢股份	14,200	82,786.00	0.02
316	002048	宁波华翔	3,800	82,194.00	0.02
317	002511	中顺洁柔	4,900	81,879.00	0.02
318	000778	新兴铸管	18,900	81,837.00	0.02
319	002382	蓝帆医疗	5,000	81,450.00	0.02
320	600827	百联股份	6,100	81,313.00	0.02
321	603866	桃李面包	2,852	80,996.80	0.02
322	600131	国网信通	3,700	80,845.00	0.02
323	600325	华发股份	13,400	80,668.00	0.02
324	002595	豪迈科技	2,900	80,504.00	0.02
325	600022	山东钢铁	44,900	80,371.00	0.02
326	600820	隧道股份	14,800	79,624.00	0.02
327	300482	万孚生物	2,020	79,547.60	0.02
328	603638	艾迪精密	2,480	79,161.60	0.02
329	000990	诚志股份	5,000	79,100.00	0.02
330	600967	内蒙一机	6,500	77,675.00	0.02
331	300376	易事特	7,600	76,380.00	0.02
332	603927	中科软	2,780	76,060.80	0.02
333	603883	老百姓	1,540	76,045.20	0.02
334	600663	陆家嘴	7,000	76,020.00	0.02
335	600645	中源协和	3,000	75,720.00	0.02
336	301136	招标股份	7,172	75,449.44	0.02
337	002146	荣盛发展	17,300	75,255.00	0.02
338	600737	中粮糖业	8,000	75,200.00	0.02
339	601577	长沙银行	9,600	74,976.00	0.02
340	002390	信邦制药	10,100	74,942.00	0.02
341	002690	美亚光电	2,000	74,920.00	0.02
342	002281	光迅科技	3,200	74,528.00	0.02
343	600598	北大荒	5,100	74,256.00	0.02
344	002124	天邦股份	11,500	74,060.00	0.02
345	000898	鞍钢股份	19,700	73,875.00	0.02
346	600435	北方导航	6,902	73,713.36	0.02
347	002434	万里扬	5,000	73,700.00	0.02
348	600572	康恩贝	14,700	73,500.00	0.02
349	600329	中新药业	2,300	72,243.00	0.02
350	600808	马钢股份	19,400	71,586.00	0.02
351	600804	鹏博士	11,500	71,300.00	0.02
352	601880	辽港股份	41,000	70,930.00	0.02
353	601118	海南橡胶	13,100	69,168.00	0.02
354	600126	杭钢股份	13,480	69,152.40	0.02



355	300166	东方国信	6,400	69,120.00	0.02
356	002387	维信诺	7,400	68,672.00	0.02
357	600782	新钢股份	13,000	68,640.00	0.02
358	688071	华依科技	1,101	68,603.31	0.02
359	600507	方大特钢	8,794	68,593.20	0.02
360	688622	禾信仪器	1,204	68,543.72	0.02
361	600597	光明乳业	4,700	68,244.00	0.02
362	002429	兆驰股份	14,000	68,040.00	0.02
363	600373	中文传媒	5,500	67,980.00	0.02
364	600908	无锡银行	11,900	67,473.00	0.02
365	002155	湖南黄金	6,500	67,340.00	0.02
366	600811	东方集团	22,300	67,123.00	0.02
367	600517	国网英大	9,200	67,068.00	0.02
368	002110	三钢闽光	9,850	66,980.00	0.02
369	600037	歌华有线	7,700	66,836.00	0.02
370	688321	微芯生物	1,900	66,519.00	0.02
371	600026	中远海能	11,200	66,304.00	0.02
372	002081	金螳螂	10,900	66,272.00	0.02
373	000559	万向钱潮	10,400	66,248.00	0.02
374	688088	虹软科技	1,500	66,090.00	0.02
375	601200	上海环境	5,230	65,845.70	0.02
376	601991	大唐发电	20,300	65,772.00	0.02
377	603650	彤程新材	1,300	65,416.00	0.02
378	600398	海澜之家	10,200	65,382.00	0.02
379	600259	广晟有色	1,300	64,012.00	0.02
380	000528	柳工	8,300	63,993.00	0.02
381	603228	景旺电子	1,848	63,811.44	0.02
382	688029	南微医学	300	63,801.00	0.02
383	600064	南京高科	6,800	63,512.00	0.02
384	002317	众生药业	5,200	62,868.00	0.02
385	601611	中国核建	6,300	62,811.00	0.02
386	000961	中南建设	15,000	62,100.00	0.02
387	603000	人民网	4,300	62,006.00	0.02
388	000685	中山公用	7,000	61,950.00	0.02
389	600446	金证股份	4,300	61,576.00	0.02
390	002867	周大生	3,450	61,341.00	0.02
391	000959	首钢股份	10,700	61,311.00	0.02
392	601608	中信重工	13,700	61,102.00	0.02
393	600764	中国海防	1,500	60,990.00	0.01
394	000090	天健集团	10,378	60,918.86	0.01
395	000758	中色股份	11,100	60,606.00	0.01
396	300113	顺网科技	3,700	60,347.00	0.01

397	002233	塔牌集团	5,700	60,306.00	0.01
398	300133	华策影视	8,900	60,253.00	0.01
399	002925	盈趣科技	1,770	60,233.10	0.01
400	600582	天地科技	13,700	60,006.00	0.01
401	600312	平高电气	6,600	59,994.00	0.01
402	002440	闰土股份	6,200	59,458.00	0.01
403	601333	广深铁路	26,500	59,360.00	0.01
404	000089	深圳机场	8,100	59,292.00	0.01
405	002705	新宝股份	2,400	59,280.00	0.01
406	002839	张家港行	10,200	58,752.00	0.01
407	003022	联泓新科	1,600	58,304.00	0.01
408	600410	华胜天成	8,600	58,222.00	0.01
409	600376	首开股份	10,200	57,732.00	0.01
410	000718	苏宁环球	12,200	57,462.00	0.01
411	601598	中国外运	12,700	56,896.00	0.01
412	600307	酒钢宏兴	25,800	56,760.00	0.01
413	601778	晶科科技	6,600	56,298.00	0.01
414	601975	招商南油	27,300	54,873.00	0.01
415	601958	金钼股份	7,900	54,115.00	0.01
416	600062	华润双鹤	4,040	54,014.80	0.01
417	600633	浙数文化	6,100	53,741.00	0.01
418	601098	中南传媒	5,600	53,592.00	0.01
419	000967	盈峰环境	7,300	53,509.00	0.01
420	000402	金融街	9,400	53,204.00	0.01
421	002038	双鹭药业	4,900	52,969.00	0.01
422	000158	常山北明	7,600	52,592.00	0.01
423	000671	阳光城	17,200	51,944.00	0.01
424	600388	龙净环保	6,000	51,720.00	0.01
425	601456	国联证券	3,700	51,689.00	0.01
426	600959	江苏有线	15,700	51,653.00	0.01
427	300257	开山股份	3,200	50,816.00	0.01
428	003035	南网能源	6,000	49,740.00	0.01
429	600056	中国医药	4,200	49,602.00	0.01
430	002399	海普瑞	2,900	49,590.00	0.01
431	002563	森马服饰	6,400	49,472.00	0.01
432	601928	凤凰传媒	6,100	49,349.00	0.01
433	300180	华峰超纤	9,700	48,791.00	0.01
434	002244	滨江集团	10,400	48,464.00	0.01
435	601860	紫金银行	14,400	48,240.00	0.01
436	600266	城建发展	10,704	48,168.00	0.01
437	600968	海油发展	16,400	48,052.00	0.01
438	600717	天津港	11,420	47,849.80	0.01

439	002936	郑州银行	15,070	47,621.20	0.01
440	000717	韶钢松山	9,800	46,550.00	0.01
441	000937	冀中能源	8,300	45,733.00	0.01
442	000078	海王生物	12,700	44,831.00	0.01
443	600094	大名城	12,500	44,250.00	0.01
444	600006	东风汽车	6,400	43,584.00	0.01
445	002468	申通快递	4,700	42,723.00	0.01
446	600776	东方通信	3,700	42,587.00	0.01
447	002424	贵州百灵	5,600	42,560.00	0.01
448	688226	威腾电气	2,693	42,441.68	0.01
449	002815	崇达技术	2,500	42,125.00	0.01
450	600623	华谊集团	4,600	41,860.00	0.01
451	600787	中储股份	6,708	41,857.92	0.01
452	600729	重庆百货	1,600	41,632.00	0.01
453	301029	怡合达	462	41,519.94	0.01
454	600649	城投控股	10,100	41,511.00	0.01
455	600339	中油工程	13,400	41,272.00	0.01
456	000028	国药一致	1,100	40,678.00	0.01
457	300741	华宝股份	850	40,672.50	0.01
458	601139	深圳燃气	4,600	40,618.00	0.01
459	600835	上海机电	2,500	39,800.00	0.01
460	002375	亚厦股份	5,200	38,948.00	0.01
461	600648	外高桥	2,900	38,367.00	0.01
462	603888	新华网	1,600	38,016.00	0.01
463	000501	鄂武商 A	3,600	37,836.00	0.01
464	000031	大悦城	10,000	37,300.00	0.01
465	600556	天下秀	3,000	37,050.00	0.01
466	000156	华数传媒	4,300	36,378.00	0.01
467	605358	立昂微	300	36,003.00	0.01
468	002635	安洁科技	2,100	35,763.00	0.01
469	600377	宁沪高速	3,900	33,618.00	0.01
470	002532	天山铝业	4,100	33,415.00	0.01
471	600639	浦东金桥	2,600	33,202.00	0.01
472	601228	广州港	9,800	32,634.00	0.01
473	301050	雷电微力	137	32,159.38	0.01
474	000061	农产品	5,000	31,950.00	0.01
475	000869	张裕 A	1,000	31,860.00	0.01
476	002302	西部建设	3,900	31,317.00	0.01
477	601298	青岛港	5,500	31,295.00	0.01
478	000826	启迪环境	6,800	30,260.00	0.01
479	301155	海力风电	311	30,089.25	0.01
480	601828	美凯龙	3,400	29,954.00	0.01

481	603708	家家悦	1,800	29,952.00	0.01
482	600823	世茂股份	9,000	29,520.00	0.01
483	601869	长飞光纤	900	29,466.00	0.01
484	000813	德展健康	7,100	28,897.00	0.01
485	001872	招商港口	1,700	28,815.00	0.01
486	000553	安道麦 A	3,400	28,696.00	0.01
487	603317	天味食品	1,044	27,989.64	0.01
488	603355	莱克电气	898	26,329.36	0.01
489	601568	北元集团	3,200	26,016.00	0.01
490	600350	山东高速	5,000	25,800.00	0.01
491	600657	信达地产	6,800	25,364.00	0.01
492	301058	中粮工科	1,386	25,280.64	0.01
493	600466	蓝光发展	12,180	24,847.20	0.01
494	603056	德邦股份	2,400	24,552.00	0.01
495	002653	海思科	1,200	24,480.00	0.01
496	603377	东方时尚	2,720	24,398.40	0.01
497	601801	皖新传媒	4,700	24,393.00	0.01
498	603786	科博达	300	24,090.00	0.01
499	301127	天源环保	1,406	24,070.72	0.01
500	002419	天虹股份	3,800	23,864.00	0.01
501	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.01
502	000046	泛海控股	12,600	23,688.00	0.01
503	300010	豆神教育	5,500	23,045.00	0.01
504	603515	欧普照明	1,080	22,420.80	0.01
505	301177	迪阿股份	185	21,474.80	0.01
506	600917	重庆燃气	2,500	20,975.00	0.01
507	601003	柳钢股份	4,000	20,880.00	0.01
508	601512	中新集团	2,300	20,815.00	0.01
509	002946	新乳业	1,300	20,722.00	0.01
510	301018	申菱环境	782	20,378.92	0.01
511	300994	久祺股份	420	19,089.00	0.00
512	600956	新天绿能	1,100	18,931.00	0.00
513	301221	光庭信息	212	18,808.64	0.00
514	001296	长江材料	310	18,376.80	0.00
515	600903	贵州燃气	1,800	17,424.00	0.00
516	000732	泰禾集团	7,700	17,017.00	0.00
517	603719	良品铺子	400	16,988.00	0.00
518	301101	明月镜片	371	16,086.56	0.00
519	301118	恒光股份	315	15,441.30	0.00
520	301039	中集车辆	1,229	15,374.79	0.00
521	601068	中铝国际	2,500	15,250.00	0.00
522	002901	大博医疗	300	15,186.00	0.00

523	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.00
524	301180	万祥科技	654	14,858.88	0.00
525	301166	优宁维	156	14,742.00	0.00
526	301168	通灵股份	279	14,544.27	0.00
527	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.00
528	301111	粤万年青	379	13,901.72	0.00
529	301100	风光股份	427	13,296.78	0.00
530	301199	迈赫股份	402	12,864.00	0.00
531	301020	密封科技	421	12,815.24	0.00
532	301138	华研精机	285	12,785.10	0.00
533	603983	丸美股份	400	12,748.00	0.00
534	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.00
535	301126	达嘉维康	662	12,730.26	0.00
536	301185	鸥玛软件	578	12,230.48	0.00
537	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.00
538	603256	宏和科技	1,400	11,984.00	0.00
539	301190	善水科技	436	11,972.56	0.00
540	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.00
541	301091	深城交	345	10,801.95	0.00
542	301108	洁雅股份	196	10,527.16	0.00
543	301179	泽宇智能	205	10,407.85	0.00
544	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.00
545	301045	天禄科技	335	9,503.95	0.00
546	300774	倍杰特	444	9,359.52	0.00
547	301096	百诚医药	119	9,345.07	0.00
548	301040	中环海陆	241	9,280.91	0.00
549	301078	孩子王	756	9,177.84	0.00
550	301182	凯旺科技	294	8,990.52	0.00
551	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.00
552	301193	家联科技	297	8,654.58	0.00
553	301052	果麦文化	252	8,477.28	0.00
554	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
555	301066	万事利	344	7,856.96	0.00
556	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
557	301133	金钟股份	286	7,707.70	0.00
558	301198	喜悦智行	262	7,650.40	0.00
559	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00
560	301098	金埔园林	307	6,806.19	0.00
561	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
562	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
563	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00
564	301036	双乐股份	205	6,135.65	0.00

565	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
566	300854	中兰环保	203	5,539.87	0.00
567	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00
568	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
569	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
570	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
571	301037	保立佳	193	4,682.18	0.00
572	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
573	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00
574	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
575	600058	五矿发展	1	9.27	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	688099	晶晨股份	13,655,404.93	4.23
2	300072	三聚环保	11,377,375.36	3.52
3	300274	阳光电源	9,473,160.30	2.93
4	603650	彤程新材	8,141,606.40	2.52
5	300009	安科生物	7,114,429.92	2.20
6	603290	斯达半导	7,104,002.02	2.20
7	600392	盛和资源	7,069,752.00	2.19
8	600885	宏发股份	6,384,373.00	1.98
9	603077	和邦生物	6,270,708.00	1.94
10	002709	天赐材料	6,012,448.45	1.86
11	300244	迪安诊断	5,847,518.00	1.81
12	002568	百润股份	5,783,541.00	1.79
13	603486	科沃斯	5,622,572.00	1.74
14	000988	华工科技	5,449,545.00	1.69
15	300595	欧普康视	5,355,090.71	1.66
16	601988	中国银行	5,170,813.00	1.60
17	601398	工商银行	5,163,210.84	1.60
18	601288	农业银行	5,120,000.00	1.59
19	601939	建设银行	5,002,500.00	1.55
20	002340	格林美	4,770,050.00	1.48

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

##### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 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	300595	欧普康视	16,494,664.10	5.11

2	688099	晶晨股份	14,788,352.73	4.58
3	300072	三聚环保	11,993,014.00	3.71
4	300274	阳光电源	11,960,599.00	3.70
5	002709	天赐材料	11,421,883.00	3.54
6	603650	彤程新材	10,416,081.70	3.23
7	002028	思源电气	9,276,500.73	2.87
8	002030	达安基因	8,050,844.50	2.49
9	600905	三峡能源	7,929,826.66	2.46
10	600885	宏发股份	7,399,341.00	2.29
11	002690	美亚光电	7,054,537.02	2.18
12	689009	九号公司-WD	7,007,110.00	2.17
13	002568	百润股份	6,849,942.00	2.12
14	002925	盈趣科技	6,804,424.00	2.11
15	002056	横店东磁	6,221,135.58	1.93
16	300009	安科生物	5,983,503.60	1.85
17	300558	贝达药业	5,868,636.00	1.82
18	600201	生物股份	5,771,340.00	1.79
19	601398	工商银行	5,284,320.00	1.64
20	601288	农业银行	5,256,000.00	1.63

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

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	424,442,404.88
卖出股票收入（成交）总额	526,991,474.64

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

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	20,006,000.00	4.92
2	央行票据	-	-
3	金融债券	100,998,000.00	24.82
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	170,872,000.00	42.00
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	5,498.98	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	291,881,498.98	71.74

**8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细**

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	143354	17 中车 G2	200,000	20,362,000.00	5.00
2	163711	20 信投 G4	200,000	20,246,000.00	4.98
3	163759	20 平证 03	200,000	20,230,000.00	4.97
4	163731	20 光证 G3	200,000	20,228,000.00	4.97
5	163774	20 中证 15	200,000	20,224,000.00	4.97

**8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细**

注：无。

**8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

注：无。

**8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

注：无。

**8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明****8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

注：无。

**8.10.2 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。

**8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****8.11.1 本期国债期货投资政策**

为有效控制债券投资的系统性风险，本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的，适度运用国债期货，提高投资组合的运作效率。在国债期货投资时，本基金将首先分析国债期货各合约价格与最便宜可交割券的关系，选择定价合理的国债期货合约，其次，考虑国债期货各合约的流动性情况，最终确定与现货组合的合适匹配，以达到风险管理的目标。

**8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

注：无。



### 8.11.3 本期国债期货投资评价

无。

### 8.12 投资组合报告附注

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

海通证券股份有限公司

2021 年 10 月 15 日，中国证券监督管理委员会重庆监管局针对海通证券股份有限公司的如下违规行为：1. 未对奥瑞德违规对外担保事项保持充分关注，出具的文件存在虚假记载；2. 海通证券未保持合理职业怀疑对奥瑞德涉及的民间借贷事项进行充分核查和验证，出具的文件存在虚假记载，责令公司改正，没收财务顾问业务收入 100 万元，并处以 300 万元罚款。

中信证券股份有限公司

2021 年 12 月 7 日，国家外汇管理局深圳市分局针对中信证券股份有限公司的以下违法行为：1. QDII 超额度汇出；2. 国际收支统计漏申报；3. B 股客户非同名账户取款；4. H 股募集资金境外专用账户超范围使用；5. B 股保证金账户超范围支出；6. 未办理境外投资外汇登记；7. 结售汇综合头寸报表迟报等，对公司责令改正，警告，没收违法所得 81 万元人民币，处以罚款 101 万元人民币。

以上证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

#### 8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券备选库

#### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	48,893.84
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,145,104.24
5	应收申购款	15,512.62
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,209,510.70

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例
----	------	------	------	-----------

				(%)
1	123099	普利转债	5,498.98	0.00

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比 例 (%)	持有份额	占总份额比 例 (%)
1,348	150,138.27	179,406,289.19	88.65	22,980,093.14	11.35

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	888,616.39	0.4391

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

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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。

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

注：无。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018年5月30日） 基金份额总额	214,008,175.33
本报告期期初基金份额总额	195,516,972.96
本报告期基金总申购份额	120,317,469.77
减：本报告期基金总赎回份额	113,448,060.40
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	202,386,382.33

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人的重大人事变动：

报告期内，公司原副总经理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。

报告期内，公司原副总经理苏波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 7 月 24 日离任。

报告期内，经公司董事会审议通过，聘任李伟先生担任公司副总经理，任职日期自 2021 年 7 月 24 日起。

本公司已将上述变更事项报中国证券监督管理委员会深圳监管局备案。

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。

基金托管人的重大人事变动：

自 2021 年 10 月 27 日起，刘波先生不再担任招商银行股份有限公司资产托管部总经理职务。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

### 11.4 基金投资策略的改变

无。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未改聘为本基金审计的会计师事务所。本年度应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用 50,000.00 元，该审计机构已提供审计服务的年限为 4 年。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、基金托管人涉及托管业务机构及其高级管理人员在报告期内未受到任何稽查或处罚。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
平安证券	1	269,594,923.42	29.02%	245,683.00	29.89%	-
招商证券	1	175,742,299.52	18.92%	160,151.94	19.49%	-
国信证券	2	163,052,154.11	17.55%	132,285.72	16.09%	-
中泰证券	2	64,268,650.11	6.92%	58,565.91	7.13%	-
天风证券	2	61,390,372.84	6.61%	55,591.11	6.76%	-
国盛证券	2	60,809,231.80	6.55%	49,475.56	6.02%	-
东北证券	1	54,938,913.47	5.91%	50,065.11	6.09%	-
安信证券	2	39,572,455.87	4.26%	36,062.47	4.39%	-
海通证券	1	18,713,679.41	2.01%	15,182.50	1.85%	-
东方证券	2	15,806,190.19	1.70%	14,404.50	1.75%	报告期新增1个
浙商证券	1	4,053,268.18	0.44%	3,693.77	0.45%	-
华西证券	1	312,109.90	0.03%	253.21	0.03%	-
广发证券	1	262,218.60	0.03%	238.97	0.03%	-
东吴证券	1	162,385.35	0.02%	131.73	0.02%	报告期新增
摩根大通证券	1	159,195.59	0.02%	129.16	0.02%	报告期新

						增
爱建证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
东方财富证 券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	报告 期新 增1个
光大证券	1	-	-	-	-	报告 期新 增
国金证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	报告 期新 增
中信建投证 券	1	-	-	-	-	-
中原证券	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。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位: 人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
平安证券	39,812.00	0.02%	79,300,000.00	0.58%	-	-
招商证券	221,427,236.00	84.65%	5,110,800,000.00	37.68%	-	-
国信证券	-	-	388,300,000.00	2.86%	-	-
中泰证券	29,931,200.00	11.44%	2,727,700,000.00	20.11%	-	-
天风证券	-	-	760,200,000.00	5.60%	-	-
国盛证券	-	-	1,780,200,000.00	13.12%	-	-
东北证券	10,185,268.00	3.89%	2,024,800,000.00	14.93%	-	-
安信证券	-	-	508,700,000.00	3.75%	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	127,000,000.00	0.94%	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	57,000,000.00	0.42%	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
摩根大通证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-

光大证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中信建投 证券	-	-	-	-	-	-
中原证券	-	-	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	鹏华基金管理有限公司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	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	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	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	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	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021年01月16日
4	鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	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	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	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	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021年01月28日
7	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	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	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021年02月08日
9	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021年03月06日
10	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	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会	2021年03月09日

	申购、赎回、转换旗下公募基金免除相关费用的公告	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	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 03 月 10 日
12	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	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 03 月 11 日
13	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	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 03 月 19 日
14	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	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 03 月 22 日
15	鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金 2020 年年度报告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 03 月 30 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	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 03 月 30 日
17	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	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 03 月 30 日
18	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	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 04 月 01 日
19	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 04 月 10 日
20	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	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 04 月 19 日
21	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	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 04 月 19 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	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 04 月 21 日
23	鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会	2021 年 04 月 21 日



		基金电子披露网站	
24	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	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 04 月 23 日
25	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	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 04 月 23 日
26	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 04 月 26 日
27	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	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 04 月 30 日
28	鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金更新的招募说明书	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 05 月 14 日
29	鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 05 月 14 日
30	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	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 05 月 14 日
31	鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金托管协议	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 05 月 25 日
32	鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金基金合同	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 05 月 25 日
33	鹏华基金管理有限公司关于修订旗下部分公募基金基金合同和托管协议的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 05 月 25 日
34	鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金更新的招募说明书(2021 年第 1 号)	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 05 月 28 日
35	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 06 月 04 日
36	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行股份有限公司申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 07 月 01 日
37	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国人寿保险股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 07 月 01 日

	动的公告		
38	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（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021年07月12日
39	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与平安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	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021年07月16日
40	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购新柴股份首次公开发行A股的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021年07月17日
41	鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 2 季度报告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021年07月20日
42	鹏华基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021年07月24日
43	鹏华基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021年07月24日
44	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021年07月29日
45	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与华融证券股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021年07月31日
46	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与招商证券股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021年07月31日
47	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与申万宏源证券有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021年08月12日
48	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与申万宏源西部证券有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021年08月12日
49	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与华宝证券股份有限公司认\申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021年08月27日
50	鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基	《中国证券报》、基金管	2021年08月30日

	金 2021 年中期报告	理人网站及中国证监会 基金电子披露网站	
51	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购禾信仪器首次公开发行 A 股的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会 基金电子披露网站	2021 年 09 月 04 日
52	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与新时代证券股份有限公司申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会 基金电子披露网站	2021 年 09 月 10 日
53	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购万事利首次公开发行 A 股的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会 基金电子披露网站	2021 年 09 月 15 日
54	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与江苏银行股份有限公司认购、申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会 基金电子披露网站	2021 年 09 月 17 日
55	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与江苏银行股份有限公司认购、申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会 基金电子披露网站	2021 年 09 月 17 日
56	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与江海证券有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会 基金电子披露网站	2021 年 09 月 22 日
57	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与部分销售机构申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会 基金电子披露网站	2021 年 09 月 29 日
58	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购深城交首次公开发行 A 股的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会 基金电子披露网站	2021 年 10 月 22 日
59	鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 3 季度报告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会 基金电子披露网站	2021 年 10 月 26 日
60	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的债券调整估值的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会 基金电子披露网站	2021 年 10 月 30 日
61	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与新时代证券股份有限公司申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会 基金电子披露网站	2021 年 11 月 10 日
62	鹏华基金管理有限公司关于终止晋城银行股份有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会 基金电子披露网站	2021 年 11 月 12 日
63	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与西部证券股份有限公司申购	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会	2021 年 11 月 18 日

	(不含定期定额申购) 费率优惠活动的公告	基金电子披露网站	
64	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分公开募集证券投资基金可投资于北京证券交易所股票的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 11 月 26 日
65	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与平安证券股份有限公司申购(含定期定额投资) 费率优惠活动的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 11 月 26 日
66	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 12 月 04 日
67	鹏华基金管理有限公司关于暂停客服电话服务的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 12 月 11 日
68	鹏华基金管理有限公司关于新增人民币直销资金专户的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 12 月 27 日
69	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国中金财富证券有限公司申购(含定期定额申购) 费率优惠活动的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 12 月 29 日
70	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国工商银行股份有限公司个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 12 月 31 日
71	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国工商银行股份有限公司“2022 倾心回馈” 基金定期定额申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 12 月 31 日

注：无。

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：无。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- (一)《鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- (二)《鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- (三)《鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金 2021 年年度报告》(原文)。

### 13.2 存放地点

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

### 13.3 查阅方式

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

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

鹏华基金管理有限公司

2022 年 3 月 30 日