

鹏华价值优势混合型证券投资基金
(LOF)
2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年08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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2022年01月01日起至2022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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	11
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	50
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	50

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	50
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	50
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	50
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50
7.12	投资组合报告附注	51
§ 8	基金份额持有人信息	51
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	51
8.2	期末上市基金前十名持有人	52
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52
8.4	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	52
§ 9	开放式基金份额变动	52
§ 10	重大事件揭示	53
10.1	基金份额持有人大会决议	53
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	53
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	53
10.4	基金投资策略的改变	53
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	53
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	53
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	53
10.8	其他重大事件	56
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	59
11.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	59
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	59
§ 12	备查文件目录	59
12.1	备查文件目录	59
12.2	存放地点	59
12.3	查阅方式	59

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华价值优势混合型证券投资基金（LOF）
基金简称	鹏华价值优势混合（LOF）
场内简称	鹏华价值优势 LOF
基金主代码	160607
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2006年7月18日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,952,448,295.85份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2006年9月18日

注：无。

2.2 基金产品说明

投资目标	依托严格的研究流程和投资纪律，强调运用相对估值分析方法，发掘我国资本市场国际接轨趋势下具备相对价值优势的中国企业，谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	（1）股票投资：首先按照既有的研究流程和投资纪律进行行业配置和个股选择，再运用相对估值分析方法，进行多维估值比较，分析行业、个股的合理估值区间，深入发掘行业和个股层面由于具备相对价值优势而存在的投资机会，以此作为基金经理的投资线索以及权重调整的重要依据。（2）债券投资：以降低组合总体波动性从而改善组合风险构成为目的，采取积极主动的投资策略，进而谋取超额收益。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×70%+中证综合债指数收益率×30%
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型基金、债券基金，低于股票型基金，为证券投资基金中具有中高风险、中高收益的投资品种。

注：无。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		鹏华基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	高永杰	李申
	联系电话	0755-81395402	021-60637102
	电子邮箱	xxpl@phfund.com.cn	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		4006788999	021-60637111

传真	0755-82021126	021-60635778
注册地址	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	518048	100033
法定代表人	何如	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 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(2022年1月1日-2022年6月30日)
本期已实现收益	-60,960,116.21
本期利润	-214,352,331.40
加权平均基金份额本期利润	-0.1091
本期加权平均净值利润率	-13.17%
本期基金份额净值增长率	-10.95%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)
期末可供分配利润	1,017,603,342.85
期末可供分配基金份额利润	0.5212
期末基金资产净值	1,690,851,562.84
期末基金份额净值	0.866
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)
基金份额累计净值增长率	746.92%

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

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

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

3.2 基金净值表现

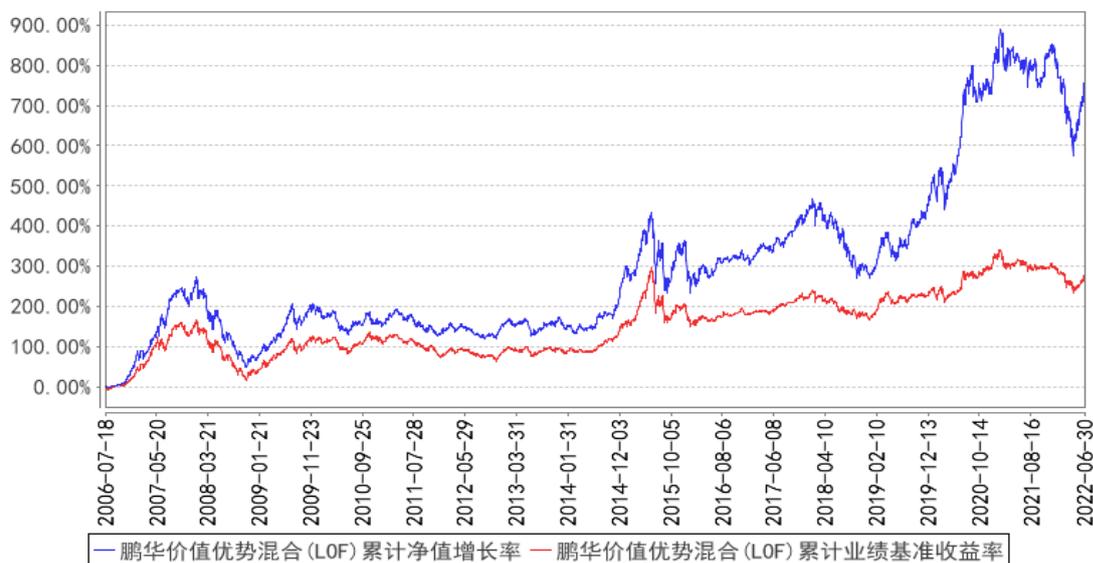
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	9.90%	1.60%	6.67%	0.75%	3.23%	0.85%
过去三个月	9.62%	1.63%	4.77%	1.00%	4.85%	0.63%
过去六个月	-10.95%	1.57%	-5.79%	1.02%	-5.16%	0.55%
过去一年	-6.03%	1.28%	-8.48%	0.87%	2.45%	0.41%
过去三年	86.21%	1.32%	17.49%	0.88%	68.72%	0.44%
自基金合同生效起至今	746.92%	1.52%	277.25%	1.18%	469.67%	0.34%

注: 业绩比较基准=沪深300指数收益率×70%+中证综合债指数收益率×30%

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

鹏华价值优势混合 (LOF) 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 2006 年 07 月 18 日生效。2、截至建仓期结束，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

3.3 其他指标

注：无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

鹏华基金管理有限公司成立于 1998 年 12 月 22 日，业务范围包括基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。截至本报告期末，公司股东由国信证券股份有限公司、意大利欧利盛资本资产管理股份公司 (Eurizon Capital SGR S.p.A.)、深圳市北融信投资发展有限公司组成，公司性质为中外合资企业，公司注册资本 15,000 万元人民币。截至本报告期末，公司管理资产总规模达到 11946.65 亿元，267 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 多年投资管理基金，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		
张华恩	基金经理	2021-12-11	-	11 年	张华恩先生，国籍中国，经济学硕士，11 年证券从业经验。曾任国泰君安证券股份

					有限公司分析师、海通证券股份有限公司分析师、平安证券股份有限公司分析师。2017 年 3 月加盟鹏华基金管理有限公司，历任研究部高级研究员、投资经理，现担任研究部基金经理。2020 年 08 月至今担任鹏华价值驱动混合型证券投资基金基金经理，2021 年 12 月至今担任鹏华价值优势混合型证券投资基金(LOF) 基金经理，张华恩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合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2022 上半年，从年初开始，在外部俄乌冲突升级和内部疫情反复冲击下，市场便迎来系统性调整，而“疫情”和“通胀”的悲观预期则在 4 月发酵到极致。俄乌冲突使得本就高企的上游大宗品进一步空中加油，让原本已看到成本缓解曙光的多数制造业再次遭受重创；同时疫情反

复冲击下，经济自身的恢复进程也受到一定波折。情绪冰点之际，悲观者的声音总是会被不断的传播和放大，市场先生的情绪同样也跟随摆动到低点。但办法总比困难多，市场规律终归要回到他自身的轨道上来，随着5月下旬上海疫情的逐步放松，国内复工复产迅速展开，前期持续累积的货币和财政政策也开始发挥更积极的作用，经济内生的活力重新展现生机，A股市场也在犹豫中走出了跟海外完全不一样的独立行情。

从过去一个季度的组合管理看，1季度组合持仓基本已调整完成。在1-4月的下跌过程中我们并没能摆脱市场的拖累，持有的一些制造业公司在供需两端挤压下遭遇了至暗时刻、股价暴跌。这期间我们能做的就是尽可能的去厘清短期的冲击有多大，并更多着眼长期去看这些领域的产业趋势和基本面到底有没有发生实质性的变化。与此同时，我们也在下跌过程中积极储备了一些着眼未来能走的更远的公司，并为组合增加了更多的活力。庆幸的是，在后续5-6月的上涨过程中，我们也基本跟上了市场节奏，在下跌过程中储备和买入的一些公司同样在反弹中表现不俗。

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-10.95%，同期业绩比较基准增长率为-5.79%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从目前的持仓结构看，我们仍然维持了中游制造业和下游消费品相对平衡的仓位。中游制造业主要集中在汽车、军工等，这其中一些公司虽然短期面临一些困难，但从中长期维度看，他们所面临的产业机遇和行业地位的跃迁是过去历史上所不曾遇到的，我们相信这其中有些公司能够在这种产业变革中抓住机遇走的更快更远。消费品领域，在原有持仓基础上，我们在底部进一步增加了部分消费品仓位。虽然消费品行业过去一年多无论是股价还是基本面都遭遇了大幅调整，但也有一批优秀的公司在逆境中不断修炼内功，去优化自己的研发体系和渠道短板，不断加深竞争壁垒。而且我们也发现，在疫情期间，越来越多的消费品行业在供给端不断优化，龙头公司所处的竞争环境也迎来明显改善，我们相信未来社会生活和经济一旦回归正轨，这些公司“深蹲”之后将迎来新一轮台阶式跃升。

在市场火热的电动车和新能源领域，我们整体持仓要稍微少些，主要原因还是基于从预期回报率的角度出发，很多公司在目前的股价水平下我们很难算出合理的远期回报。与此同时，很多环节的竞争壁垒和潜在的竞争加剧风险，也使得远期回报在兑现的确定性上可能要打一定的折扣，因此在这些环节的持仓上我们会更加的精简和聚焦。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金管理人已制定基金估值

和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术。

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1、截止本报告期末，本基金期末可供分配利润为 1,017,603,342.85 元，期末基金份额净值 0.866 元。

2、本基金于 2022 年 01 月 14 日进行利润分配，分配金额为 137,444,582.43 元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资

组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：鹏华价值优势混合型证券投资基金（L0F）

报告截止日：2022年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	182,693,151.57	230,482,993.88
结算备付金		1,582,597.63	1,649,332.40
存出保证金		520,914.47	305,587.86
交易性金融资产	6.4.7.2	1,523,054,761.28	1,778,621,842.51
其中：股票投资		1,523,052,650.34	1,777,444,350.60
基金投资		-	-
债券投资		2,110.94	1,177,491.91
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		328,347.42	1,263,433.50
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	27,434.42
资产总计		1,708,179,772.37	2,012,350,624.57
负债和净资产	附注号	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-

应付清算款		12,421,647.48	23,699,582.29
应付赎回款		748,669.57	580,539.75
应付管理人报酬		2,005,901.56	2,508,320.76
应付托管费		334,316.91	418,053.45
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		165,705.90	165,706.06
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	1,651,968.11	2,194,067.71
负债合计		17,328,209.53	29,566,270.02
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	673,248,219.99	651,313,685.47
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	1,017,603,342.85	1,331,470,669.08
净资产合计		1,690,851,562.84	1,982,784,354.55
负债和净资产总计		1,708,179,772.37	2,012,350,624.57

注：报告截止日2022年06月30日，基金份额净值0.866元，基金份额总额1,952,448,295.85份。

6.2 利润表

会计主体：鹏华价值优势混合型证券投资基金（L0F）

本报告期：2022年1月1日至2022年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2022年1月1日至2022年6月30日	2021年1月1日至2021年6月30日
一、营业总收入		-200,067,119.20	113,186,139.80
1. 利息收入		367,887.94	354,499.48
其中：存款利息收入	6.4.7.13	367,887.94	354,294.85
债券利息收入		-	204.63
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-47,082,936.15	321,427,980.95
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-56,232,350.55	310,986,865.08
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	159,096.29	-

资产支持证券投资 收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	8,990,318.11	10,441,115.87
以摊余成本计量的 金融资产终止确认产生的 收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.20	-153,392,215.19	-208,980,189.93
4. 汇兑收益（损失以 “-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以 “-”号填列）	6.4.7.21	40,144.20	383,849.30
减：二、营业总支出		14,285,212.20	21,286,131.59
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	12,133,468.19	15,635,182.64
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,022,244.70	2,605,863.81
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费	6.4.10.2.1.1	-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		3.03	0.69
8. 其他费用	6.4.7.23	129,496.28	3,045,084.45
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		-214,352,331.40	91,900,008.21
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以 “-”号填列）		-214,352,331.40	91,900,008.21
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		-214,352,331.40	91,900,008.21

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：鹏华价值优势混合型证券投资基金（L0F）

本报告期：2022年1月1日至2022年6月30日

单位：人民币元

项目	本期			
	2022年1月1日至2022年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期	651,313,685.47	-	1,331,470,669.08	1,982,784,354.55

期末净资产 (基金净值)				
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期末期初净资产 (基金净值)	651,313,685.47	-	1,331,470,669.08	1,982,784,354.55
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	21,934,534.52	-	-313,867,326.23	-291,932,791.71
(一)、综合收益总额	-	-	-214,352,331.40	-214,352,331.40
(二)、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)	21,934,534.52	-	37,929,587.60	59,864,122.12
其中: 1. 基金申购款	48,683,719.41	-	76,508,328.94	125,192,048.35
2. 基金赎回款	-26,749,184.89	-	-38,578,741.34	-65,327,926.23
(三)、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)	-	-	-137,444,582.43	-137,444,582.43

列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	673,248,219.99	-	1,017,603,342.85	1,690,851,562.84
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	635,141,522.92	-	1,641,159,377.99	2,276,300,900.91
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	635,141,522.92	-	1,641,159,377.99	2,276,300,900.91
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	69,674,012.64	-	-312,174,241.86	-242,500,229.22
(一)、综合收益总额	-	-	91,900,008.21	91,900,008.21
(二)、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)	69,674,012.64	-	114,843,571.69	184,517,584.33
其中：1. 基金申购	176,892,731.88	-	348,698,237.27	525,590,969.15

款				
2. 基金赎回款	-107,218,719.24	-	-233,854,665.58	-341,073,384.82
(三)、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)	-	-	-518,917,821.76	-518,917,821.76
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	704,815,535.56	-	1,328,985,136.13	2,033,800,671.69

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

鹏华价值优势混合型证券投资基金(LOF)(原名为“鹏华价值优势股票型证券投资基金(LOF)”,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”)证监基金字[2006]第105号《关于同意鹏华价值优势股票型证券投资基金(LOF)募集的批复》核准,由鹏华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华价值优势股票型证券投资基金(LOF)基金合同》负责公开募集。本基金为上市契约型开放式,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1,875,734,450.63元,业经德勤华永会计师事务所有限公司德师(上海)报验字(06)第SZ002号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华价值优势股票型证券投资基金(LOF)基金合同》于2006年7月18日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为

1,876,753,992.72 份基金份额，其中认购资金利息折合 1,019,542.09 份基金份额。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）。

经深圳证券交易所（以下简称“深交所”）深证上字[2006]第 109 号文审核同意，本基金 237,446,762.00 份基金份额于 2006 年 9 月 18 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人可通过本基金跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《鹏华价值优势股票型证券投资基金招募说明书》和《鹏华价值优势股票型证券投资基金(LOF)实施基金份额拆分和限量持续销售活动及修改基金合同的公告》的有关规定，本基金于 2007 年 8 月 15 日进行了基金份额拆分，拆分比例为 1: 2.900599868，并于 2007 年 8 月 16 日进行了变更登记。

根据 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》，鹏华价值优势股票型证券投资基金(LOF)于 2015 年 7 月 31 日公告后自 2015 年 8 月 3 日起更名为鹏华价值优势混合型证券投资基金(LOF)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华价值优势混合型证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的各类股票（存托凭证）、债券、央行票据、权证、资产证券化产品以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如有投资需要可参与有价值的新股配售和增发。在正常市场状况下，股票（含存托凭证）投资比例为 60%-95%，债券投资比例为 0%-35%，权证的投资比例为 0%-3%。现金或到期日在 1 年以内的政府债券投资比例不低于 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

为符合 2014 年 8 月 8 日起实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》中关于不同基金类别所适用投资比例的规定，根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《关于实施〈公开募集证券投资基金运作管理办法〉有关问题的规定》及相关基金合同的有关规定，经协商相关基金托管人同意，并报中国证监会备案，鹏华基金管理有限公司决定自 2015 年 8 月 3 日起，将“鹏华价值优势股票型证券投资基金(LOF)”更名为“鹏华价值优势混合型证券投资基金(LOF)”，基金类别由股票型证券投资基金变更为混合型证券投资基金，并相应修订基金合同部分条款。

本基金的业绩比较基准为：中信标普 A 股综合指数收益率×70%+中信标普国债指数收益率×30%。根据鹏华基金管理有限公司于 2015 年 9 月 29 日发布的《鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金修订业绩基准条款的公告》，本基金的业绩比较基准自 2015 年 9 月 30 日起将原业绩比较基准“中信标普 A 股综合指数收益率×70%+中信标普国债指数收益率×30%”修订为：“沪深 300 指数收益率×70%+中证综合债指数收益率×30%”。

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》、《鹏华价值优势混合型证券投资基金(LOF)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2022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2022年06月30日的财务状况以及2022年上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

除6.4.5.1会计政策变更的说明所声明的变更外,本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于2017年颁布了修订后的《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》及《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”),财政部、中国银行保险监督管理委员会于2020年12月30日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》,公募证券投资基金自2022年1月1日起执行新金融工具准则。此外,中国证监会于2022年颁布了修订后的《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>》,本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金2022年度财务报表,对本基金财务报表的影响列示如下:

(a) 金融工具

新金融工具准则改变了金融工具的分类和计量方式,确定了三个主要的计量类别:摊余成本;以公允价值计量且其变动计入其他综合收益;以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式,以及金融工具的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”,适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、交易性金融资产-债券投资、交易性金融资产-资产支持证券投资、债权投资和卖出回购金融资产款等项目中，不单独列示应收利息或应付利息项目。

信用减值损失项目反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在利息收入项目中。其他项目的利息收入从利息收入项目调整至投资收益项目列示。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具，其投资收益包含期间交易费用的抵减。

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

银行存款、结算备付金、存出保证金、交易性金融资产-债券投资、应收利息、应付交易费用和其他负债，对其账面价值的影响金额分别为 26,168.80 元、816.42 元、151.36 元、297.84 元、-27,434.42 元、-1,972,741.05 元和 1,972,741.05 元。

(b) 修订后的《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>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《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>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

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 2022年6月30日

活期存款	182,693,151.57
等于：本金	182,676,862.60
加：应计利息	16,288.97
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	182,693,151.57

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	1,407,053,517.86	-	1,523,052,650.34	115,999,132.48	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	1,900.00	8.40	2,110.94	202.54
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	1,900.00	8.40	2,110.94	202.54
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	1,407,055,417.86	8.40	1,523,054,761.28	115,999,335.02	

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

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.8 其他资产

注：无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,461.65

应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,541,410.52
其中：交易所市场	1,541,410.52
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	109,095.94
合计	1,651,968.11

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,888,845,016.41	651,313,685.47
本期申购	141,177,287.02	48,683,719.41
本期赎回（以“-”号填列）	-77,574,007.58	-26,749,184.89
- 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	1,952,448,295.85	673,248,219.99

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

注：无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	1,530,065,860.40	-198,595,191.32	1,331,470,669.08
本期利润	-60,960,116.21	-153,392,215.19	-214,352,331.40
本期基金份额交易产生的变动数	48,695,817.37	-10,766,229.77	37,929,587.60
其中：基金申购款	105,006,775.00	-28,498,446.06	76,508,328.94
基金赎回款	-56,310,957.63	17,732,216.29	-38,578,741.34
本期已分配利润	-137,444,582.43	-	-137,444,582.43
本期末	1,380,356,979.13	-362,753,636.28	1,017,603,342.85

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
	活期存款利息收入
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	22,296.40
其他	4,132.28
合计	367,887.94

注：其他包含认/申购款利息收入、结算保证金利息收入、风控金利息收入等

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-56,232,350.55
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	-56,232,350.55

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	1,821,781,455.00
减：卖出股票成本总额	1,872,619,218.35
减：交易费用	5,394,587.20
买卖股票差价收入	-56,232,350.55

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	836.01
债券投资收益——买卖债券(债转股及债券到期兑付)差价收入	158,260.28
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	159,096.29

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,053,335.38
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	893,900.00
减：应计利息总额	1,150.79
减：交易费用	24.31
买卖债券差价收入	158,260.28

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	8,990,318.11
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	8,990,318.11

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
1. 交易性金融资产	-153,392,215.19
股票投资	-153,110,725.82
债券投资	-281,489.37
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	-153,392,215.19

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	39,245.10
基金转换费收入	899.10
合计	40,144.20

6.4.7.22 信用减值损失

注：无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	49,588.57
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费用	1,800.34
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	129,496.28

6.4.7.24 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 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	30,695,014.94	0.86	46,064,316.46	2.56

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30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	28,110.29	0.87	12,745.75	0.83
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30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	41,976.18	2.62	4,307.00	0.72

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。

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 2022年1月1日至2022年6 月30日	上年度可比期间 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	12,133,468.19	15,635,182.64

其中：支付销售机构的客户维护费	2,910,832.09	4,384,315.34
-----------------	--------------	--------------

注：1、支付基金管理人鹏华基金公司的管理人报酬年费率为1.50%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×1.50%÷当年天数。

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年6月30日	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	2,022,244.70	2,605,863.81

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%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×0.25%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：无。

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

注：无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	182,693,151.57	341,459.26	195,171,182.82	338,989.64

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 2022年1月1日至2022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	-	-	-	-	-
上年度可比期间 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	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	8,523	403,393.59

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

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2022年1月14日	2022年1月17日	2022年1月14日	0.7280	60,494,927.30	76,949,655.13	137,444,582.43	-
合计	-	-	-	0.7280	60,494,927.30	76,949,655.13	137,444,582.43	-

6.4.12 期末(2022年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单	期末成本总额	期末估值总额	备注

							位： 股)			
301110	青木股份	2022年 3月4日	6个月	新股流 通受限	63.10	39.85	202	12,746.20	8,049.70	-
301116	益客食品	2022年 1月10日	6个月	新股流 通受限	11.40	20.46	577	6,577.80	11,805.42	-
301117	佳缘科技	2022年 1月7日	6个月	新股流 通受限	46.80	54.44	262	12,261.60	14,263.28	-
301120	新特电气	2022年 4月11日	6个月	新股流 通受限	13.73	15.49	1,032	14,169.36	15,985.68	-
301135	瑞德智能	2022年 4月1日	6个月	新股流 通受限	31.98	26.26	338	10,809.24	8,875.88	-
301151	冠龙节能	2022年 3月30日	6个月	新股流 通受限	30.82	21.46	703	21,666.46	15,086.38	-
301158	德石股份	2022年 1月7日	6个月	新股流 通受限	15.64	20.38	379	5,927.56	7,724.02	-
301162	国能日新	2022年 4月19日	6个月	新股流 通受限	45.13	54.11	334	15,073.42	18,072.74	-
301163	宏德股份	2022年 4月11日	6个月	新股流 通受限	26.27	32.33	277	7,276.79	8,955.41	-
301187	欧圣电气	2022年 4月13日	6个月	新股流 通受限	21.33	22.54	876	18,685.08	19,745.04	-
301200	大族数控	2022年 2月18日	6个月	新股流 通受限	76.56	51.92	857	65,611.92	44,495.44	-
301206	三元生物	2022年 1月26日	6个月	新股流 通受限	109.30	45.69	945	68,859.00	43,177.05	三元生物于2022年6月17日实施权益分派方案，每10股派人民币10元，并转

											增 5 股。
301207	华兰疫苗	2022 年 2 月 10 日	6 个月	新股流通受限	56.88	56.42	569	32,364.72	32,102.98		-
301217	铜冠铜箔	2022 年 1 月 20 日	6 个月	新股流通受限	17.27	14.83	4,284	73,984.68	63,531.72		-
301219	腾远钴业	2022 年 3 月 10 日	6 个月	新股流通受限	173.98	87.82	542	52,367.98	47,598.44		腾远钴业于 2022 年 5 月 24 日实施权益分派方案, 每 10 股派人民币 39.9 元, 并转增 8 股。
301222	浙江恒威	2022 年 3 月 2 日	6 个月	新股流通受限	33.98	28.96	332	11,281.36	9,614.72		-
301228	实朴检测	2022 年 1 月 21 日	6 个月	新股流通受限	20.08	20.34	373	7,489.84	7,586.82		-
301259	艾布鲁	2022 年 4 月 18 日	6 个月	新股流通受限	18.39	24.94	483	8,882.37	12,046.02		-
301268	铭利达	2022 年 3 月 29 日	6 个月	新股流通受限	28.50	34.87	641	18,268.50	22,351.67		-
301288	清研环境	2022 年 4 月 14 日	6 个月	新股流通受限	19.09	19.98	452	8,628.68	9,030.96		-
688262	国芯科技	2021 年 12 月 28 日	6 个月	新股流通受限	41.98	47.75	7,129	299,275.42	340,409.75		-
688290	景业智能	2022 年 4 月 21 日	6 个月	新股流通受限	33.89	46.87	3,040	103,025.60	142,484.80		-

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

持有的股份，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，锁定期限为自发行人股票上市之日起6个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的科创板股票，在受让后6个月内不得转让。

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

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金。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各类股票，债券，央行票据，权证，资产证券化产品以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如有投资需要可参与有价值的新股配售和增发。法律法规或中国证监会以后允许本基金投资的其他金融工具或品种，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。

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

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

于2022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0.00%（2021年12月31日：0.06%）。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	2,110.94	1,177,491.91
未评级	-	-
合计	2,110.94	1,177,491.91

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。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

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

于2022年6月30日，本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不

计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注“期末本基金持有的流通受限证券”。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022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	182,693,151.57	-	-	-	182,693,151.57
结算备付金	1,582,597.63	-	-	-	1,582,597.63
存出保证金	520,914.47	-	-	-	520,914.47
交易性金融资产	-	2,110.94	-	-1,523,052,650.34	1,523,054,761.28
应收申购款	-	-	-	328,347.42	328,347.42
资产总计	184,796,663.67	2,110.94	-	-1,523,380,997.76	1,708,179,772.37
负债					
应付赎回款	-	-	-	748,669.57	748,669.57
应付管理人报酬	-	-	-	2,005,901.56	2,005,901.56
应付托管费	-	-	-	334,316.91	334,316.91
应付清算款	-	-	-	12,421,647.48	12,421,647.48
应交税费	-	-	-	165,705.90	165,705.90
其他负债	-	-	-	1,651,968.11	1,651,968.11
负债总计	-	-	-	17,328,209.53	17,328,209.53
利率敏感度缺口	184,796,663.67	2,110.94	-	-1,506,052,788.23	1,690,851,562.84
上年度末 2021年12月31日					
资产					
银行存款	230,482,993.88	-	-	-	230,482,993.88
结算备付金	1,649,332.40	-	-	-	1,649,332.40
存出保证金	305,587.86	-	-	-	305,587.86
交易性金融资产	-	661,007.11	516,484.80	1,777,444,350.60	1,778,621,842.51
应收申购款	-	-	-	1,263,433.50	1,263,433.50
其他资产	-	-	-	27,434.42	27,434.42

资产总计	232,437,914.14	661,007.11	516,484.80	1,778,735,218.52	2,012,350,624.57
负债					
应付赎回款	-	-	-	580,539.75	580,539.75
应付管理人报酬	-	-	-	2,508,320.76	2,508,320.76
应付托管费	-	-	-	418,053.45	418,053.45
应付清算款	-	-	-	23,699,582.29	23,699,582.29
应交税费	-	-	-	165,706.06	165,706.06
其他负债	-	-	-	2,194,067.71	2,194,067.71
负债总计	-	-	-	29,566,270.02	29,566,270.02
利率敏感度缺口	232,437,914.14	661,007.11	516,484.80	1,749,168,948.50	1,982,784,354.55

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

注：于 2022 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资和资产支持证券公允价值占基金资产净值的比例为 0.00%。因此当利率发生合理、可能的变动时，对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无。

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。

正常市场状况下,股票投资比例为60%~95%,债券投资比例为0%~35%,权证的投资比例为0~3%,现金或到期日在1年以内的政府债券投资比例不低于5%,其中现金不包括结算备付金,存出保证金,应收申购款等。

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 2022年6月30日		上年度末 2021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	1,523,052,650.34	90.08	1,777,444,350.60	89.64
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	2,110.94	-	1,177,491.91	0.06
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	1,523,054,761.28	90.08	1,778,621,842.51	89.70

注:债券投资为可转换债券、可交换债券投资。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准外的其他市场变量保持不变		
相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币元)		
	本期末(2022年6月30日)	上年度末(2021年12月31日)	
分析	业绩比较基准上升5%	73,374,503.57	75,395,375.08
	业绩比较基准下降	-73,374,503.57	-75,395,375.08

	5%		
--	----	--	--

注：无。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年6月30日
第一层次	1,522,151,767.36
第二层次	-
第三层次	902,993.92
合计	1,523,054,761.28

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,523,052,650.34	89.16
	其中：股票	1,523,052,650.34	89.16
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,110.94	0.00
	其中：债券	2,110.94	0.00
	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	184,275,749.20	10.79
8	其他各项资产	849,261.89	0.05
9	合计	1,708,179,772.37	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	5,559.90	0.00
B	采矿业	17,325.22	0.00
C	制造业	1,252,770,505.45	74.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,815.92	0.00
E	建筑业	27,659,819.19	1.64
F	批发和零售业	387,503.50	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	54,323.80	0.00
H	住宿和餐饮业	14,977.44	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服	1,223,020.72	0.07

	务业		
J	金融业	63,498,022.59	3.76
K	房地产业	26,583,568.00	1.57
L	租赁和商务服务业	72,485,262.45	4.29
M	科学研究和技术服务业	77,673,039.85	4.59
N	水利、环境和公共设施管理业	561,646.57	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	109,259.74	0.01
S	综合	-	-
	合计	1,523,052,650.34	90.08

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	600690	海尔智家	3,280,948	90,094,832.08	5.33
2	603596	伯特利	1,007,600	80,789,368.00	4.78
3	600765	中航重机	2,405,786	77,418,193.48	4.58
4	601888	中国中免	311,100	72,464,523.00	4.29
5	002472	双环传动	2,253,400	71,748,256.00	4.24
6	600519	贵州茅台	32,100	65,644,500.00	3.88
7	600660	福耀玻璃	1,554,656	65,000,167.36	3.84
8	601838	成都银行	3,825,200	63,421,816.00	3.75
9	002304	洋河股份	325,600	59,633,640.00	3.53
10	603032	德新交运	746,753	58,993,487.00	3.49
11	002459	晶澳科技	700,000	55,230,000.00	3.27
12	300628	亿联网络	701,700	53,434,455.00	3.16
13	603806	福斯特	797,098	52,225,860.96	3.09
14	000568	泸州老窖	187,000	46,102,980.00	2.73
15	603259	药明康德	420,040	43,679,959.60	2.58
16	603348	文灿股份	768,900	41,213,040.00	2.44
17	002812	恩捷股份	160,000	40,072,000.00	2.37
18	605333	沪光股份	1,638,100	37,840,110.00	2.24
19	002648	卫星化学	1,454,198	37,591,018.30	2.22
20	002475	立讯精密	1,027,893	34,732,504.47	2.05
21	300416	苏试试验	1,367,210	33,606,021.80	1.99
22	688169	石头科技	51,780	31,932,726.00	1.89
23	601058	赛轮轮胎	2,658,000	29,955,660.00	1.77

24	600309	万华化学	291,700	28,291,983.00	1.67
25	002311	海大集团	469,066	28,148,650.66	1.66
26	300896	爱美客	46,400	27,840,464.00	1.65
27	000596	古井贡酒	111,232	27,770,181.12	1.64
28	601117	中国化学	2,926,900	27,542,129.00	1.63
29	601012	隆基绿能	409,740	27,300,976.20	1.61
30	600223	鲁商发展	2,536,600	26,583,568.00	1.57
31	000733	振华科技	188,400	25,616,748.00	1.52
32	300014	亿纬锂能	240,400	23,439,000.00	1.39
33	002991	甘源食品	246,400	16,999,136.00	1.01
34	688190	云路股份	134,208	10,434,672.00	0.62
35	301217	铜冠铜箔	42,831	649,831.59	0.04
36	301219	腾远钴业	5,402	497,051.24	0.03
37	301200	大族数控	8,566	460,781.44	0.03
38	301206	三元生物	9,438	446,000.04	0.03
39	688262	国芯科技	7,129	340,409.75	0.02
40	301207	华兰疫苗	5,687	336,163.36	0.02
41	301268	铭利达	6,407	243,766.07	0.01
42	301187	欧圣电气	8,759	228,329.22	0.01
43	300750	宁德时代	381	203,454.00	0.01
44	301162	国能日新	3,331	201,609.02	0.01
45	301127	天源环保	16,843	187,462.59	0.01
46	301091	深城交	6,812	185,967.60	0.01
47	300957	贝泰妮	853	185,553.09	0.01
48	301120	新特电气	10,311	182,450.94	0.01
49	301221	光庭信息	2,791	180,940.53	0.01
50	601567	三星医疗	12,900	171,312.00	0.01
51	301151	冠龙节能	7,025	161,883.22	0.01
52	000888	峨眉山 A	17,288	158,530.96	0.01
53	301166	优宁维	2,528	148,798.08	0.01
54	301168	通灵股份	3,281	147,907.48	0.01
55	301117	佳缘科技	2,616	145,922.50	0.01
56	688290	景业智能	3,040	142,484.80	0.01
57	301259	艾布鲁	4,828	139,789.02	0.01
58	301190	善水科技	5,741	136,233.93	0.01
59	600153	建发股份	10,100	132,007.00	0.01
60	301100	风光股份	5,985	129,156.30	0.01
61	688049	炬芯科技	3,260	124,075.60	0.01
62	301179	泽宇智能	2,941	120,022.21	0.01
63	301116	益客食品	5,764	119,695.02	0.01
64	688267	中触媒	3,390	113,327.70	0.01
65	301288	清研环境	4,516	107,867.44	0.01

66	301111	粤万年青	3,783	103,729.86	0.01
67	301163	宏德股份	2,764	101,994.08	0.01
68	301222	浙江恒威	3,315	101,431.46	0.01
69	301135	瑞德智能	3,376	96,066.48	0.01
70	301155	海力风电	1,054	95,914.00	0.01
71	688737	中自科技	2,186	90,347.38	0.01
72	688227	品高股份	4,164	89,192.88	0.01
73	688697	纽威数控	5,837	88,372.18	0.01
74	301138	华研精机	2,849	87,606.75	0.01
75	301110	青木股份	2,013	86,466.00	0.01
76	688509	正元地信	15,433	83,183.87	0.00
77	301052	果麦文化	2,520	82,983.60	0.00
78	301193	家联科技	2,970	80,635.50	0.00
79	301158	德石股份	3,783	78,697.42	0.00
80	688102	斯瑞新材	6,030	77,847.30	0.00
81	301228	实朴检测	3,721	76,823.46	0.00
82	688283	坤恒顺维	1,595	76,033.65	0.00
83	301098	金埔园林	3,069	74,423.25	0.00
84	301182	凯旺科技	2,932	69,664.32	0.00
85	688722	同益中	3,687	61,720.38	0.00
86	688571	杭华股份	8,200	59,696.00	0.00
87	688255	凯尔达	1,648	50,923.20	0.00
88	688071	华依科技	1,101	50,910.24	0.00
89	600955	维远股份	1,694	48,854.96	0.00
90	300811	铂科新材	480	46,713.60	0.00
91	301050	雷电微力	420	42,655.20	0.00
92	001227	兰州银行	7,868	38,710.56	0.00
93	301029	怡合达	462	37,653.00	0.00
94	600927	永安期货	1,859	37,496.03	0.00
95	688565	力源科技	3,450	33,534.00	0.00
96	603071	物产环能	1,627	29,513.78	0.00
97	301089	拓新药业	220	27,636.40	0.00
98	603122	合富中国	2,198	27,365.10	0.00
99	300981	中红医疗	1,082	27,288.04	0.00
100	603191	望变电气	1,149	26,197.20	0.00
101	600115	中国东航	4,660	25,583.40	0.00
102	600935	华塑股份	4,811	25,209.64	0.00
103	301069	凯盛新材	539	24,853.29	0.00
104	301058	中粮工科	1,386	24,102.54	0.00
105	605555	德昌股份	917	23,355.99	0.00
106	603206	嘉环科技	1,210	23,353.00	0.00
107	301039	中集车辆	2,064	22,353.12	0.00

108	603051	鹿山新材	272	21,488.00	0.00
109	001228	永泰运	383	20,739.45	0.00
110	301018	申菱环境	782	20,183.42	0.00
111	300902	国安达	551	19,510.91	0.00
112	001308	康冠科技	667	19,456.39	0.00
113	603176	汇通集团	1,924	18,393.44	0.00
114	603132	金徽股份	1,342	17,325.22	0.00
115	001217	华尔泰	1,239	16,776.06	0.00
116	001215	千味央厨	295	16,605.55	0.00
117	603070	万控智造	775	16,197.50	0.00
118	001319	铭科精技	536	15,474.32	0.00
119	001317	三羊马	300	15,222.00	0.00
120	001216	华瓷股份	1,177	15,124.45	0.00
121	001313	粤海饲料	1,232	15,104.32	0.00
122	301073	君亭酒店	216	14,977.44	0.00
123	300982	苏文电能	317	14,886.32	0.00
124	603230	内蒙新华	1,140	14,261.40	0.00
125	300994	久祺股份	420	13,780.20	0.00
126	301180	万祥科技	654	13,701.30	0.00
127	300986	志特新材	370	13,616.00	0.00
128	301118	恒光股份	315	13,554.45	0.00
129	603209	兴通股份	595	13,518.40	0.00
130	301199	迈赫股份	402	12,880.08	0.00
131	300941	创识科技	599	12,608.95	0.00
132	603216	梦天家居	772	12,498.68	0.00
133	300997	欢乐家	928	12,398.08	0.00
134	001266	宏英智能	247	12,298.13	0.00
135	603215	比依股份	575	12,115.25	0.00
136	300930	屹通新材	322	11,566.24	0.00
137	300940	南极光	491	11,553.23	0.00
138	300996	普联软件	386	11,406.30	0.00
139	301126	达嘉维康	662	11,340.06	0.00
140	301078	孩子王	756	11,082.96	0.00
141	301108	洁雅股份	280	11,079.60	0.00
142	300908	仲景食品	285	10,724.55	0.00
143	301185	鸥玛软件	578	10,687.22	0.00
144	605599	莱百股份	980	10,662.40	0.00
145	300968	格林精密	1,162	10,527.72	0.00
146	603219	富佳股份	528	10,517.76	0.00
147	300942	易瑞生物	443	10,233.30	0.00
148	301046	能辉科技	290	10,036.90	0.00
149	301009	可靠股份	801	9,996.48	0.00

150	605598	上海港湾	553	9,987.18	0.00
151	301015	百洋医药	462	9,969.96	0.00
152	605566	福莱茵特	435	9,926.70	0.00
153	001296	长江材料	403	9,905.74	0.00
154	605567	春雪食品	629	9,850.14	0.00
155	605033	美邦股份	423	9,809.37	0.00
156	301020	密封科技	421	9,472.50	0.00
157	300993	玉马遮阳	738	9,431.64	0.00
158	301048	金鹰重工	843	9,281.43	0.00
159	300918	南山智尚	1,063	9,088.65	0.00
160	605138	盛泰集团	723	9,023.04	0.00
161	001234	泰慕士	333	9,017.64	0.00
162	300774	倍杰特	444	8,951.04	0.00
163	605580	恒盛能源	654	8,815.92	0.00
164	301021	英诺激光	290	8,758.00	0.00
165	300962	中金辐照	576	8,697.60	0.00
166	300966	共同药业	286	8,537.10	0.00
167	300985	致远新能	295	8,466.50	0.00
168	001288	运机集团	537	8,382.57	0.00
169	300614	百川畅银	329	8,277.64	0.00
170	001219	青岛食品	354	8,088.90	0.00
171	301133	金钟股份	286	7,942.22	0.00
172	301028	东亚机械	733	7,931.06	0.00
173	300978	东箭科技	593	7,738.65	0.00
174	301045	天禄科技	335	7,728.45	0.00
175	301198	喜悦智行	341	7,689.55	0.00
176	301026	浩通科技	203	7,486.64	0.00
177	603150	万朗磁塑	250	7,442.50	0.00
178	301004	嘉益股份	312	7,381.92	0.00
179	301040	中环海陆	241	7,357.73	0.00
180	300922	天秦装备	402	7,219.92	0.00
181	600276	恒瑞医药	194	7,195.46	0.00
182	301012	扬电科技	170	6,971.70	0.00
183	301027	华蓝集团	286	6,944.08	0.00
184	605298	必得科技	508	6,908.80	0.00
185	301066	万事利	482	6,873.32	0.00
186	001209	洪兴股份	450	6,849.00	0.00
187	605577	龙版传媒	588	6,703.20	0.00
188	301002	崧盛股份	261	6,491.07	0.00
189	300975	商络电子	738	6,472.26	0.00
190	301062	上海艾录	523	6,103.41	0.00
191	300998	宁波方正	201	6,080.25	0.00

192	300971	博亚精工	245	6,039.25	0.00
193	300814	中富电路	328	6,002.40	0.00
194	300958	建工修复	300	5,934.00	0.00
195	300952	恒辉安防	340	5,916.00	0.00
196	301072	中捷精工	181	5,797.43	0.00
197	301011	华立科技	175	5,755.75	0.00
198	301030	仕净科技	242	5,643.44	0.00
199	300972	万辰生物	430	5,559.90	0.00
200	301010	晶雪节能	218	5,526.30	0.00
201	300963	中洲特材	283	5,484.54	0.00
202	300950	德固特	329	5,362.70	0.00
203	300961	深水海纳	394	5,342.64	0.00
204	301025	读客文化	403	5,311.54	0.00
205	300931	通用电梯	672	5,194.56	0.00
206	300948	冠中生态	324	5,141.88	0.00
207	301016	雷尔伟	275	5,128.75	0.00
208	301032	新柴股份	513	4,770.90	0.00
209	301049	超越科技	196	4,647.16	0.00
210	301036	双乐股份	205	4,608.40	0.00
211	301007	德迈仕	303	4,566.21	0.00
212	301033	迈普医学	108	4,547.88	0.00
213	300960	通业科技	234	4,380.48	0.00
214	301063	海锅股份	153	4,262.58	0.00
215	300992	泰福泵业	200	4,262.00	0.00
216	301037	保立佳	193	4,215.12	0.00
217	300995	奇德新材	191	4,087.40	0.00
218	300854	中兰环保	203	4,035.64	0.00
219	301053	远信工业	155	3,620.80	0.00
220	301068	大地海洋	144	3,477.60	0.00
221	600176	中国巨石	43	748.63	0.00
222	600110	诺德股份	62	720.44	0.00
223	002624	完美世界	28	402.36	0.00
224	600546	山煤国际	15	291.90	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	300122	智飞生物	60,654,244.78	3.06
2	002304	洋河股份	59,087,242.11	2.98
3	002472	双环传动	58,868,773.30	2.97
4	300014	亿纬锂能	56,686,058.20	2.86

5	601888	中国中免	56,424,989.40	2.85
6	601838	成都银行	55,714,230.11	2.81
7	600989	宝丰能源	48,796,796.81	2.46
8	601012	隆基绿能	48,060,003.08	2.42
9	688599	天合光能	47,698,594.21	2.41
10	002459	晶澳科技	46,267,068.14	2.33
11	002648	卫星化学	43,529,298.13	2.20
12	600383	金地集团	42,122,860.08	2.12
13	000596	古井贡酒	41,452,242.04	2.09
14	601567	三星医疗	41,257,338.00	2.08
15	600519	贵州茅台	40,771,404.07	2.06
16	603260	合盛硅业	40,158,463.90	2.03
17	000568	泸州老窖	39,957,245.36	2.02
18	600660	福耀玻璃	39,881,240.32	2.01
19	002812	恩捷股份	38,759,526.90	1.95
20	600905	三峡能源	35,228,354.79	1.78

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	002179	中航光电	56,768,309.26	2.86
2	300144	宋城演艺	53,732,988.52	2.71
3	601166	兴业银行	53,590,391.00	2.70
4	600529	山东药玻	51,538,326.40	2.60
5	603032	德新交运	51,356,414.60	2.59
6	002001	新和成	49,814,235.77	2.51
7	600399	抚顺特钢	48,064,844.90	2.42
8	600521	华海药业	46,898,286.52	2.37
9	601155	新城控股	45,698,768.33	2.30
10	600563	法拉电子	45,315,376.18	2.29
11	002531	天顺风能	44,156,369.84	2.23
12	002049	紫光国微	43,680,766.12	2.20
13	600966	博汇纸业	43,392,052.90	2.19
14	688599	天合光能	43,154,917.11	2.18
15	600989	宝丰能源	41,475,144.94	2.09
16	603589	口子窖	40,677,556.26	2.05
17	300122	智飞生物	40,431,520.00	2.04
18	600383	金地集团	39,233,318.62	1.98
19	600905	三峡能源	37,942,024.75	1.91
20	603260	合盛硅业	37,554,299.42	1.89

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	1,771,338,243.91
卖出股票收入（成交）总额	1,821,781,455.00

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	2,110.94	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,110.94	0.00

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	128125	华阳转债	19	2,110.94	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

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

德力西新疆交通运输集团股份有限公司在报告编制日前一年内受到阿克苏地区交通运输局、克拉玛依市交通运输局、乌鲁木齐市交通运输局、乌鲁木齐市交通运输综合行政执法局、新疆生产建设兵团第八师交通运输局的处罚。

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	520,914.47
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	328,347.42
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	849,261.89

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	128125	华阳转债	2,110.94	0.00

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
77,726	25,119.63	54,927,124.96	2.81	1,897,521,170.89	97.19

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例(%)
1	徐慧均	4,000,000.00	5.23
2	张宝林	2,252,881.00	2.94
3	俞春娇	1,000,256.00	1.31
4	王春黎	713,988.00	0.93
5	万安科	611,082.00	0.80
6	郭志峰	570,800.00	0.75
7	张礼德	535,000.00	0.70
8	李继民	514,500.00	0.67
9	吴亓	501,200.00	0.65
10	高雪莹	448,097.00	0.59

注：持有人为场内持有人。

8.3 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	64,492.10	0.0033

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。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2006年7月18日)基金份额总额	1,876,753,992.72
本报告期期初基金份额总额	1,888,845,016.41
本报告期基金总申购份额	141,177,287.02
减：本报告期基金总赎回份额	77,574,007.58
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,952,448,295.85

§ 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，公司无重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

10.4 基金投资策略的改变

本基金本投资期内投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未改聘为本基金审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
方正证券	2	543,364,353.53	15.17	495,170.77	15.30	-
中信建投证券	1	521,392,939.55	14.56	477,727.55	14.76	-

长江证券	1	448,656,200 .59	12.53	411,062.59	12.70	-
长城证券	1	434,531,148 .80	12.13	397,319.39	12.28	-
天风证券	2	431,706,690 .83	12.05	354,560.61	10.96	-
光大证券	1	238,691,121 .91	6.66	217,804.82	6.73	-
平安证券	2	202,799,243 .03	5.66	184,812.10	5.71	-
中金公司	1	172,729,197 .93	4.82	157,400.49	4.86	-
民生证券	1	158,619,133 .98	4.43	147,720.79	4.56	本报告期新增
银河证券	2	122,562,031 .13	3.42	112,919.71	3.49	-
华创证券	1	116,835,147 .88	3.26	106,467.10	3.29	-
招商证券	1	92,662,259. 87	2.59	84,443.65	2.61	-
国信证券	1	30,695,014. 94	0.86	28,110.29	0.87	-
申万宏源 证券	1	30,471,112. 00	0.85	27,769.50	0.86	-
广发证券	2	17,844,443. 00	0.50	16,263.79	0.50	-
东方财富 证券	1	10,329,458. 00	0.29	9,413.47	0.29	-
中金财富	1	8,100,622.0 0	0.23	7,463.08	0.23	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
瑞信方正	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-

湘财证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	3	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

注：交易单元选择的标准和程序：

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

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

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、及时性以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 (%)
方正证券	-	-	-	-	-	-
中信建投 证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-

天风证券	596,333.38	56.61	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	457,002.00	43.39	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源 证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
东方财富 证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
瑞信方正	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	鹏华基金管理有限公司关于暂停客服电话服务的公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会	2022年01月01日

		基金电子披露网站	
2	鹏华基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	《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	2022 年 01 月 01 日
3	鹏华价值优势混合型证券投资基金 (LOF) 暂停大额申购、转换转入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	2022 年 01 月 11 日
4	鹏华基金管理有限公司关于鹏华价值优势混合型证券投资基金 (LOF) 2022 年第 1 次分红公告	《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	2022 年 01 月 12 日
5	鹏华价值优势混合型证券投资基金 (LOF) 恢复大额申购、转换转入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	2022 年 01 月 17 日
6	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与浙商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	2022 年 01 月 17 日
7	鹏华价值优势混合型证券投资基金 (LOF) 2021 年第 4 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	2022 年 01 月 21 日
8	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	2022 年 01 月 21 日
9	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与民生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	《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	2022 年 01 月 24 日
10	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与第一创业证券股份有限公司申购 (含定期定额投资) 费率优惠活动的公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 02 月 10 日
11	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与北京雪球基金销售有限公司申购 (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	2022 年 02 月 21 日
12	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与财通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	《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	2022 年 03 月 01 日
13	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中信建投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	《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	2022 年 03 月 08 日
14	鹏华基金管理有限公司关于旗下部	《证券时报》、基金管	2022 年 03 月 14 日

	分基金参与光大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	理人网站及中国证监会基金电子披露网站	
15	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易管家平台申购（不含定期定额申购）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	2022 年 03 月 15 日
16	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国光大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	2022 年 03 月 22 日
17	鹏华价值优势混合型证券投资基金 (LOF) 2021 年年度报告	《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	2022 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广发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	《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	2022 年 04 月 19 日
19	鹏华价值优势混合型证券投资基金 (LOF) 2022 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	2022 年 04 月 21 日
20	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易管家平台申购（不含定期定额申购）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	2022 年 04 月 21 日
21	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	2022 年 04 月 25 日
22	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	2022 年 04 月 27 日
23	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与江苏张家港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	2022 年 04 月 28 日
24	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《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	2022 年 04 月 30 日
25	鹏华基金管理有限公司关于终止北京植信基金销售有限公司办理本公司旗下基金相关销售业务的公告	《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	2022 年 05 月 06 日
26	鹏华基金管理有限公司关于终止北京唐鼎耀华基金销售有限公司办理本公司旗下基金相关销售业务的公	《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	2022 年 05 月 13 日

	告		
27	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与北京度小满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	2022年05月30日
28	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与上海好买基金销售有限公司申购(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	2022年06月06日
29	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中航证券有限公司申购(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	2022年06月18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

注：无。

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)《鹏华价值优势混合型证券投资基金(LOF)基金合同》；
- (二)《鹏华价值优势混合型证券投资基金(LOF)托管协议》；
- (三)《鹏华价值优势混合型证券投资基金(LOF)2022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

2022 年 8 月 30 日