

鹏华策略回报灵活配置混合型证券投资基金

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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	44
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
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	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	59
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	61

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	61
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	61
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	61
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	61
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	62
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	62
7.12 投资组合报告附注	62
§ 8 基金份额持有人信息.....	63
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	63
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	63
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	63
§ 9 开放式基金份额变动.....	63
§ 10 重大事件揭示	63
10.1 基金份额持有人大会决议	63
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	64
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	64
10.4 基金投资策略的改变	64
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	64
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	64
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	64
10.8 其他重大事件	66
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	68
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	68
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	68
§ 12 备查文件目录	68
12.1 备查文件目录	68
12.2 存放地点	68
12.3 查阅方式	68

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华策略回报灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	鹏华策略回报混合
基金主代码	004986
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 9 月 6 日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	197,300,459.08 份
基金合同存续期	不定期

注：无。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为混合型基金，在控制风险的前提下灵活地采用多种投资策略，通过精选个股，力争长期稳健超额回报的目标。
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 本基金灵活、务实地采用多种投资策略，包括价值投资、成长投资、主题轮动、趋势投资等，将各种理念和方法兼容并蓄，作为实现收益的工具和手段。本基金将重点关注在中国经济持续转型的过程中，因经济结构优化、产业结构升级、技术创新等制度变革等产生的投资机会，并投资于其中的优质上市公司的股票。</p> <p>（1）价值投资策略 本基金通过寻找价值被低估的股票进行投资，以谋求估值反转带来的收益。通过运用多项指标如 PE、PB、EV/EBITDA 等进行相对估值，通过与国内同行业其它公司估值水平以及国外同行业公司相对估值水平等进行估值比较，找出价值被相对低估的公司。</p> <p>（2）成长投资策略 在充分的行业研究和审慎的公司研究基础上，本基金将关注成长型上市公司，尤其是中小市值股票中具有潜在高成长性和稳健盈利模式的上市公司。在具体操作上，以政策分析、行业分析和公司特质分析等基本面定性分析为主，评估风险，精选投资标的。</p> <p>（3）主题轮动策略 主题轮动策略是基于自上而下的投资主题分析框架，综合运用定量和定性的分析方法，针对经济发展趋势及成长动因进行前瞻性的分析，挖掘市场的长期性和阶段性主题投资机会，并从中发现与投资主题相符的行业和具有核心竞争力的上市公司，力争获取市场超额收益。</p> <p>（4）趋势投资策略 公司的经营业绩成长和公司投资价值的提升具有连续性和延展性，这决定了公司股票价格的长期趋势。同时，在股票市场上，由于受</p>

	<p>到当期各种外部因素的影响，股票价格还具有中、短期趋势。中期趋势表现为股价相对长期趋势的估值偏离和估值修复过程，而短期趋势则表现为外部因素影响短期股价偏离和恢复的过程。由于市场反应不足或反应过度，股票价格的涨跌往往表现出一定的惯性。因此，可通过基本面分析、行为金融分析和事件分析，利用股价中、短期趋势的动态特征，进行股票的买入和卖出操作，从而提高单只股票的投资收益。</p> <p>(5) 存托凭证投资策略 本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。</p> <p>3、债券投资策略 本基金债券投资将采取久期策略、收益率曲线策略、骑乘策略、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。</p> <p>(1) 久期策略 久期管理是债券投资的重要考量因素，本基金将采用以“目标久期”为中心、自上而下的组合久期管理策略。</p> <p>(2) 收益率曲线策略 收益率曲线的形状变化是判断市场整体走向的一个重要依据，本基金将据此调整组合长、中、短期债券的搭配，并进行动态调整。</p> <p>(3) 骑乘策略 本基金将采用基于收益率曲线分析对债券组合进行适时调整的骑乘策略，以达到增强组合的持有期收益的目的。</p> <p>(4) 息差策略 本基金将采用息差策略，以达到更好地利用杠杆放大债券投资的收益的目的。</p> <p>(5) 个券选择策略 本基金将根据单个债券到期收益率相对于市场收益率曲线的偏离程度，结合信用等级、流动性、选择权条款、税赋特点等因素，确定其投资价值，选择定价合理或价值被低估的债券进行投资。</p> <p>(6) 信用策略 本基金通过主动承担适度的信用风险来获取信用溢价，根据内、外部信用评级结果，结合对类似债券信用利差的分析以及对未来信用利差走势的判断，选择信用利差被高估、未来信用利差可能下降的信用债进行投资。</p> <p>4、权证投资策略 本基金通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型及价值挖掘策略、价差策略、双向权证策略等寻求权证的合理估值水平，追求稳定的当期收益。</p> <p>5、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。</p> <p>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。</p> <p>7、融资投资策略 本基金将在充分考虑风险和收益特征的基础上，审慎参与融资交易。本基金将基于对市场行情和组合风险收益的分析，确定投资时机、标的证券以及投资比例。若相关融资业务法律法规发生变化，本基金将从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。</p>
业绩比较基准	本基金业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×60%+中证综合债指数

	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，属于证券投资基金中中高风险、中高预期收益的品种。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	高永杰	郭明
	联系电话	0755-81395402	010-66105799
	电子邮箱	xxpl@phfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4006788999	95588
传真		0755-82021126	010-66105798
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	北京市西城区复兴门内大街 55 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	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		518048	100140
法定代表人		何如	陈四清

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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.phfund.com.cn
基金中期报告备置地点	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层鹏华基金管理有限公司

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022年1月1日-2022年6月30日)
本期已实现收益	-29,336,353.61
本期利润	-52,286,781.23
加权平均基金份额本期利润	-0.2566
本期加权平均净值利润率	-14.97%
本期基金份额净值增长率	-12.29%
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	146,699,048.67

期末可供分配基金份额利润	0.7435
期末基金资产净值	343,999,507.75
期末基金份额净值	1.7435
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	112.32%

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

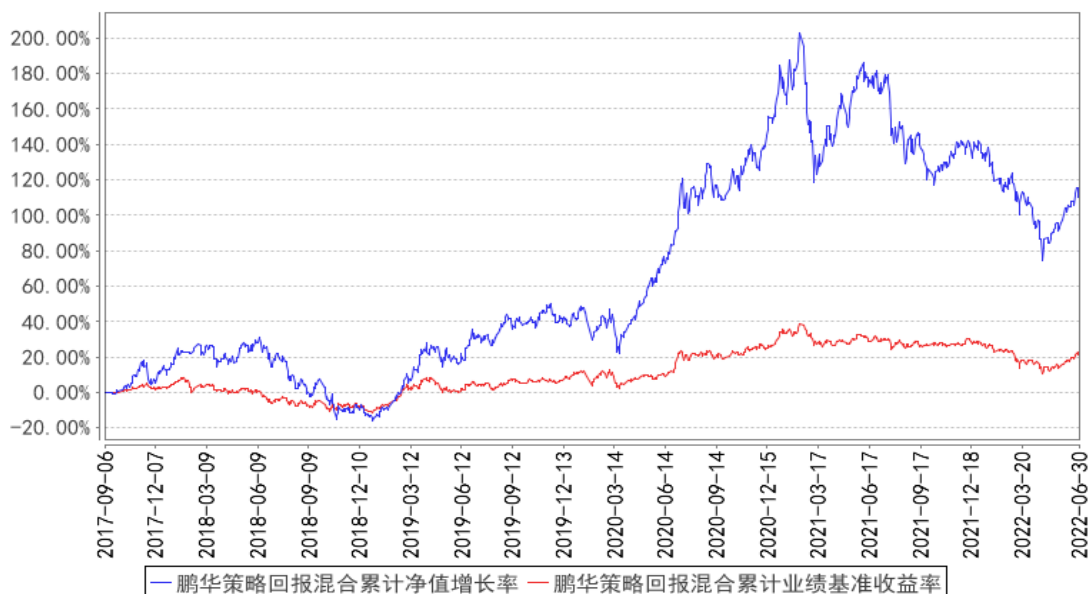
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	7.50%	1.23%	5.70%	0.64%	1.80%	0.59%
过去三个月	2.82%	1.53%	4.27%	0.86%	-1.45%	0.67%
过去六个月	-12.29%	1.51%	-4.67%	0.87%	-7.62%	0.64%
过去一年	-24.39%	1.54%	-6.58%	0.75%	-17.81%	0.79%
过去三年	63.37%	1.66%	17.29%	0.76%	46.08%	0.90%
自基金合同生效起至今	112.32%	1.66%	22.52%	0.77%	89.80%	0.89%

注：业绩比较基准=本基金业绩比较基准：沪深300指数收益率×60%+中证综合债指数收益率×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

鹏华策略回报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 2017 年 09 月 06 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		
张鹏	基金经理	2021-08-13	-	9 年	张鹏先生，国籍中国，金融学硕士，9 年证券从业经验。曾任鹏华基金管理有限公

					司研究部助理研究员、研究员，中欧基金管理有限公司研究部研究员，自 2017 年任鹏华基金管理有限公司研究部高级研究员、基金经理助理/研究员，现担任权益投资二部基金经理。2021 年 08 月至今担任鹏华策略回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2021 年 08 月至今担任鹏华价值精选股票型证券投资基金基金经理，张鹏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

2022 年上半年市场呈现先跌后涨的行情，4 月承接一季度的下跌趋势开始加速下跌，背后是俄乌冲突带来的全球经济增长预期的下调，供应链撕裂导致的通胀高企，联储鹰派政策导致的流动性收紧，内部环境又叠加了疫情的扩散以及对生产生活供应链物流等各环节的严重影响，到四

月底大部分前期强势的个股调整幅度达到了 40-50%的水平，在风险释放相对比较充分的背景下，联储的政策收紧也已经充分预期，疫情开始得到有效控制，生产逐步恢复，稳经济大盘政策频出的情况下，5 月和 6 月，市场迎来了持续的强势反弹，部分个股重回此前高点。反弹过程中，风险偏好提升逻辑下，以光伏新能源和汽车为代表的成长板块涨幅显著，军工、锂电池和半导体板块相对弱势，市场复苏逻辑下，消费板块表现比较强势。

在策略回报操作上，一、仓位保持在 80-90%的仓位区间，秉承中性原则，未做仓位择时；二、主要操作是在价格波动幅度较大的过程中，在合理价格出现时，逐步加仓长期看好的板块和公司，例如汽车零部件、军工和半导体板块龙头；三是保持了空间大壁垒高的核心成长标的的主体持仓的情况下，边际上继续优化结构，例如根据养殖和消费板块的周期变化节奏，进行了板块的加减仓；

实际上，在本轮反弹之前的下跌过程中，对于经过深度研究真心看好的板块和公司，是谨慎的小幅逆势加仓的，本质上依然是守着价值投资的主线，坚信有价值的公司股价能够回归，非理性下跌是最好的加仓窗口，现在看“逆势加仓”的选择是对的，但是逆势加仓的幅度稍显保守，经验和认知上有待进一步的提升。

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-12.29%，同期业绩比较基准增长率为-4.67%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前时点的思路是：耐心等待经济夯实筑底，细致甄别成长泡沫，观察和寻找经济的新动能。20-21 年低碳和能源革命是一条主线，未来还会逐渐有第二条第三条线索清晰起来。

我们目前最看好的是泛制造业、军工和半导体行业的自主化、新能源行业的渗透率提升、汽车行业的产品创新的持续等。在制造业领域，内部环境上，其实可以清晰的看到中国经过多年发展，基础的材料池、技术池和人才池已经完成了底层建设，例如光伏组件产业链和锂电池产业链，已经是成为全球主要的供应者，大宗品和初级材料如化工品，新建产能的规模和自动化复杂化程度全球遥遥领先，供给成本曲线迅速进入全球最左侧，汽车行业已经可以做到性能较强，成本较低，在外形和功能等消费属性上也已经能够与海外知名车企的产品媲美，同时能够做到多款车型多种功能的快速迭代，智能化水平也处于全球领先水平，半导体从材料到设备国产化率快速提升，军工装备快速列装的同时材料和发动机等关键环节快速的实现自主可控等等。因此制造业背靠双碳政策，利用中国先天的成本优势，叠加近几年点亮的基础工艺和材料的科技树，我看好中国广义上的制造业环节，国内的渗透率和国产化率持续提升，海外的市占率持续提升，以及在此基础上的有中国自身特色的创新。外部环境上，海外的环境从客观上给中国制造业公司，创造了从原

材料到终端产品各个环节替代海外公司的机会。

因此从长期维度看，策略回报的核心思路就是中国泛制造业各环节龙头的持续崛起。但是如果看相对短的时间维度，例如看到年底，我认为不排除市场持续震荡的态势，部分强势个股已经重新出现了交易拥挤估值溢价的情况，而疫情依然存在一定的风险，海外经济出现了衰退的迹象，供应链的撕裂和资本开支的缺失导致通胀问题难以短期解决，市场较大概率呈现震荡上行的态势。

在这种长期方向清晰，短期市场可能会有波动的情况下，我们未来的操作思路依然是利用市场波动带来的非理性下跌所带来的合理股价，作为空间大壁垒高的核心制造业公司的加仓窗口，结合对各个板块的资产价格周期所处的位置，我们会进行一定的高低切换，这样能够一定程度上控制回撤风险，保持操作在基金经理和持有人的理性空间内，持有体验相对稳定。

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 146,699,048.67 元，期末基金份额净值 1.7435 元。

2、本基金本报告期内未进行利润分配。

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，本基金的管理人——鹏华基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对鹏华基金管理有限公司编制和披露的本基金 2022 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 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：鹏华策略回报灵活配置混合型证券投资基金

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	53,723,876.29	54,999,766.11
结算备付金		585,321.59	1,532,351.36
存出保证金		122,826.49	122,120.77
交易性金融资产	6.4.7.2	300,826,248.62	364,371,229.65
其中：股票投资		300,807,153.98	364,371,229.65
基金投资		-	-
债券投资		19,094.64	-
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		-	324,772.56
应收股利		-	-
应收申购款		126,711.62	112,927.13
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	4,412.55
资产总计		355,384,984.61	421,467,580.13
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		9,801,274.23	3,371,831.10
应付赎回款		526,810.66	535,544.21
应付管理人报酬		413,296.70	525,884.46
应付托管费		68,882.79	87,647.40
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	575,212.48	871,544.21
负债合计		11,385,476.86	5,392,451.38
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	197,300,459.08	209,299,863.57
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	146,699,048.67	206,775,265.18
净资产合计		343,999,507.75	416,075,128.75
负债和净资产总计		355,384,984.61	421,467,580.13

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.7435 元，基金份额总额 197,300,459.08 份。

6.2 利润表

会计主体：鹏华策略回报灵活配置混合型证券投资基金

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 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
一、营业总收入		-49,150,507.31	36,637,810.47
1. 利息收入		121,985.56	104,629.88
其中：存款利息收入	6.4.7.13	96,948.95	104,629.88
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		25,036.61	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-26,352,698.74	87,348,645.51
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-27,942,473.64	85,503,846.85
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	4.13	-
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
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	1,589,770.77	1,844,798.66
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	-22,950,427.62	-51,493,228.27
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	30,633.49	677,763.35
减：二、营业总支出		3,136,273.92	5,395,272.26
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,602,840.13	4,276,871.33
2. 托管费	6.4.10.2.2	433,806.67	712,811.95
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		-	-
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	99, 627. 12	405, 588. 98
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-52, 286, 781. 23	31, 242, 538. 21
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-52, 286, 781. 23	31, 242, 538. 21
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-52, 286, 781. 23	31, 242, 538. 21

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：鹏华策略回报灵活配置混合型证券投资基金

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、上期期末净资产(基金净值)	209, 299, 863. 57	-	206, 775, 265. 18	416, 075, 128. 75
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)	209, 299, 863. 57	-	206, 775, 265. 18	416, 075, 128. 75
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-11, 999, 404. 49	-	-60, 076, 216. 51	-72, 075, 621. 00
(一)、综合收益总额	-	-	-52, 286, 781. 23	-52, 286, 781. 23

(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)	-11,999,404.49	-	-7,789,435.28	-19,788,839.77
其中:1. 基金申购款	10,115,671.07	-	7,301,775.78	17,417,446.85
2. 基金赎回款	-22,115,075.56	-	-15,091,211.06	-37,206,286.62
(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)	-	-	-	-
(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)	197,300,459.08	-	146,699,048.67	343,999,507.75
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)	307,309,469.39	-	363,370,993.25	670,680,462.64

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)	307,309,469.39	-	363,370,993.25	670,680,462.64
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-64,693,389.40	-	-46,543,899.40	-111,237,288.80
(一)、综合收益总额	-	-	31,242,538.21	31,242,538.21
(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)	-64,693,389.40	-	-77,786,437.61	-142,479,827.01
其中:1.基金申购款	70,179,566.52	-	83,033,849.00	153,213,415.52
2.基金赎回款	-134,872,955.92	-	-160,820,286.61	-295,693,242.53
(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)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末期末净资产(基金净值)	242,616,079.99	-	316,827,093.85	559,443,173.84

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：

<u>邓召明</u>	<u>邢彪</u>	<u>郝文高</u>
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

鹏华策略回报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”)《关于准予鹏华策略回报灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2015]2737号文)和机构部函[2017]1679号《关于鹏华策略回报灵活配置混合型证券投资基金延期募集备案的回函》批准,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《鹏华策略回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2017年9月6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491,760,953.62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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称:工商银行)。

本基金于2017年8月7日至2017年9月1日募集。募集期间净认购资金人民币491,532,684.29元,认购资金在募集期间产生的利息人民币228,269.33元,募集的有效认购份额及利息结转的基金份额合计491,760,953.62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(2017)第800号验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《鹏华策略回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和截至报告期末最新公告的《鹏华策略回报灵活配置混合型证券投资基金招

募说明书》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和存托凭证（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票和存托凭证）、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、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、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可以依照法律法规参与融资。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：股票（含存托凭证）资产占基金资产的比例为 0%—95%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金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。如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×60%+中证综合债指数收益率×40%。

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》、《鹏华策略回报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。

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、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 3,668.15 元、689.50 元、54.90 元、-4,412.55 元、-670,401.07 元和 670,401.07 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	53,723,876.29
等于：本金	53,719,460.28
加：应计利息	4,416.01
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	53,723,876.29

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	274,026,975.67	-	300,807,153.98	26,780,178.31
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	4.14	19,094.64	4,090.50
	银行间市场	-	-	-

	合计	15,000.00	4.14	19,094.64	4,090.50
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
	合计	274,041,975.67	4.14	300,826,248.62	26,784,268.81

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	1,030.20
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	475,003.33
其中：交易所市场	475,003.33
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	99,178.95
合计	575,212.48

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	209,299,863.57	209,299,863.57
本期申购	10,115,671.07	10,115,671.07
本期赎回（以“-”号填列）	-22,115,075.56	-22,115,075.56
- 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	197,300,459.08	197,300,459.08

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	370,431,561.86	-163,656,296.68	206,775,265.18
本期利润	-29,336,353.61	-22,950,427.62	-52,286,781.23
本期基金份额交易产生的变动数	-19,908,630.53	12,119,195.25	-7,789,435.28
其中：基金申购款	17,031,260.84	-9,729,485.06	7,301,775.78
基金赎回款	-36,939,891.37	21,848,680.31	-15,091,211.06
本期已分配利润	-	-	-
本期末	321,186,577.72	-174,487,529.05	146,699,048.67

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	88,881.48
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	6,817.22
其他	1,250.25
合计	96,948.95

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	-27,942,473.64
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	-27,942,473.64

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	585,490,464.28
减：卖出股票成本总额	611,718,829.41
减：交易费用	1,714,108.51
买卖股票差价收入	-27,942,473.64

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	4.13
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
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	4.13

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

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

注：无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,589,770.77
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	1,589,770.77

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	-22,950,427.62
股票投资	-22,954,518.12
债券投资	4,090.50
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	-22,950,427.62

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	30,376.99
基金转换费收入	256.50
合计	30,633.49

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	39,671.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费用	447.00
存托服务费	1.17
合计	99,627.12

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、基金注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	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 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	
	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	103,622,099.70	9.03	19,269,791.40	12.69

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	95,354.38	9.40	93,919.58	19.77
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	17,560.38	13.53	17,560.38	36.68

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	2,602,840.13	4,276,871.33
其中：支付销售机构的客户维护费	802,296.36	1,905,527.19

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 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托管费	433,806.67	712,811.95

注：支付基金托管人中国工商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固有资金投资本基金的情况

注：无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 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
中国工商银行	53,723,876.29	88,881.48	63,102,089.79	104,061.64

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

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
-	-	-	-	-	-
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	300957	贝泰妮	网下申购	2,983	141,185.39
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

注：无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

注：无。

6.4.12 期末(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（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注

301110	青木股份	2022年 3月4日	6个月	新股流 通受限	63.10	39.85	172	10,853.20	6,854.20	-
301112	信邦智能	2022年 6月20日	6个月	新股流 通受限	27.53	45.04	399	10,984.47	17,970.96	-
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	255	11,934.00	13,882.20	-
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	-
301125	腾亚精工	2022年 5月27日	6个月	新股流 通受限	22.49	27.42	327	7,354.23	8,966.34	-
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	455	14,023.10	9,764.30	-
301153	中科江南	2022年 5月10日	6个月	新股流 通受限	33.68	43.98	323	10,878.64	14,205.54	-
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	-
301160	翔楼新材	2022年 5月25日	6个月	新股流 通受限	31.56	37.66	392	12,371.52	14,762.72	-
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	-
301175	中科环保	2022年 6月30日	1个月 内(含)	新股未 上市	3.82	3.82	32,005	122,259.10	122,259.10	-
301175	中科环保	2022年 6月30日	6个月	新股流 通受限	3.82	3.82	3,557	13,587.74	13,587.74	-

		日								
301187	欧圣电气	2022年4月13日	6个月	新股流通受限	21.33	22.54	684	14,589.72	15,417.36	-
301200	大族数控	2022年2月18日	6个月	新股流通受限	76.56	51.92	206	15,771.36	10,695.52	-
301206	三元生物	2022年1月26日	6个月	新股流通受限	109.30	45.69	287	20,876.30	13,113.03	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	239	13,594.32	13,484.38	-
301217	铜冠铜箔	2022年1月20日	6个月	新股流通受限	17.27	14.83	1,023	17,667.21	15,171.09	-
301219	腾远钴业	2022年3月10日	6个月	新股流通受限	173.98	87.82	115	11,134.72	10,099.30	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。
301220	亚香股份	2022年6月15日	6个月	新股流通受限	35.98	39.15	285	10,254.30	11,157.75	-
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	2022年	6个月	新股流	20.08	20.34	373	7,489.84	7,586.82	-

	检测	1月21日		通受限							
301233	盛帮股份	2022年6月24日	1个月内(含)	新股未上市	41.52	41.52	1,418	58,875.36	58,875.36		-
301233	盛帮股份	2022年6月24日	6个月	新股流通受限	41.52	41.52	158	6,560.16	6,560.16		-
301238	瑞泰新材	2022年6月10日	6个月	新股流通受限	19.18	32.07	895	17,166.10	28,702.65		-
301239	普瑞眼科	2022年6月22日	1个月内(含)	新股未上市	33.65	33.65	3,361	113,097.65	113,097.65		-
301239	普瑞眼科	2022年6月22日	6个月	新股流通受限	33.65	33.65	374	12,585.10	12,585.10		-
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		-
301266	宇邦新材	2022年5月30日	6个月	新股流通受限	26.86	47.07	517	13,886.62	24,335.19		-
301268	铭利达	2022年3月29日	6个月	新股流通受限	28.50	34.87	453	12,910.50	15,796.11		-
301286	侨源股份	2022年6月6日	6个月	新股流通受限	16.91	19.79	784	13,257.44	15,515.36		-
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		-
301298	东利机械	2022年5月27日	6个月	新股流通受限	12.68	20.83	634	8,039.12	13,206.22		-
301302	华如科技	2022年6月16日	6个月	新股流通受限	52.03	56.42	275	14,308.25	15,515.50		-
600938	中国海油	2022年4月14日	6个月	新股流通受限	10.80	15.86	84,004	907,243.20	1,332,303.44		-
688234	天岳先进	2022年1月5日	6个月	新股流通受限	82.79	65.19	2,173	179,902.67	141,657.87		-

688237	超卓航科	2022年6月24日	1个月内(含)	新股未上市	41.27	41.27	2,846	117,454.42	117,454.42	-
688400	凌云光	2022年6月27日	1个月内(含)	新股未上市	21.93	21.93	5,515	120,943.95	120,943.95	-

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，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，权证，资产支持证券，股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金可以依照法律法规参与融资。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。

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工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。

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	19,094.64	-
未评级	-	-
合计	19,094.64	-

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、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股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，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	53,723,876.29	-	-	-	53,723,876.29
结算备付金	585,321.59	-	-	-	585,321.59
存出保证金	122,826.49	-	-	-	122,826.49
交易性金融资产	-	-	19,094.64	300,807,153.98	300,826,248.62
应收申购款	-	-	-	126,711.62	126,711.62
资产总计	54,432,024.37	-	19,094.64	300,933,865.60	355,384,984.61
负债					
应付赎回款	-	-	-	526,810.66	526,810.66
应付管理人报酬	-	-	-	413,296.70	413,296.70
应付托管费	-	-	-	68,882.79	68,882.79

应付清算款	-	-	-	9,801,274.23	9,801,274.23
其他负债	-	-	-	575,212.48	575,212.48
负债总计	-	-	-	11,385,476.86	11,385,476.86
利率敏感度缺口	54,432,024.37	-	19,094.64	289,548,388.74	343,999,507.75
上年度末 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	54,999,766.11	-	-	-	54,999,766.11
结算备付金	1,532,351.36	-	-	-	1,532,351.36
存出保证金	122,120.77	-	-	-	122,120.77
交易性金融资产	-	-	-	364,371,229.65	364,371,229.65
应收申购款	-	-	-	112,927.13	112,927.13
应收清算款	-	-	-	324,772.56	324,772.56
其他资产	-	-	-	4,412.55	4,412.55
资产总计	56,654,238.24	-	-	364,813,341.89	421,467,580.13
负债					
应付赎回款	-	-	-	535,544.21	535,544.21
应付管理人报酬	-	-	-	525,884.46	525,884.46
应付托管费	-	-	-	87,647.40	87,647.40
应付清算款	-	-	-	3,371,831.10	3,371,831.10
其他负债	-	-	-	871,544.21	871,544.21
负债总计	-	-	-	5,392,451.38	5,392,451.38
利率敏感度缺口	56,654,238.24	-	-	359,420,890.51	416,075,128.75

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，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 0.01%。因此当利率发生合理、可能的变动时，对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无。

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以

外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券投资品种，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。

基金的投资组合比例为：股票（含存托凭证）资产占基金资产的比例为 0%-95%；每个交易日日终在扣除股指期货合约等金融工具所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。如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	300,807,153.98	87.44	364,371,229.65	87.57
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	19,094.64	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	300,826,248.62	87.45	364,371,229.65	87.57
----	----------------	-------	----------------	-------

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%	15,796,457.40	24,787,675.80
	业绩比较基准下降 5%	-15,796,457.40	-24,787,675.80

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	298,388,610.44
第二层次	565,363.48
第三层次	1,872,274.70

合计	300,826,248.62
----	----------------

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	300,807,153.98	84.64
	其中：股票	300,807,153.98	84.64
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	19,094.64	0.01
	其中：债券	19,094.64	0.01
	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	54,309,197.88	15.28
8	其他各项资产	249,538.11	0.07
9	合计	355,384,984.61	100.00

注：报告期末本基金投资的存托凭证公允价值为：1,246.00 元，占净值比 0.00%。本报告所指的

“股票”均包含存托凭证。

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	15,779,255.56	4.59
B	采矿业	8,024,295.53	2.33
C	制造业	241,824,186.16	70.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,769,321.49	1.10
E	建筑业	7,215,206.58	2.10
F	批发和零售业	6,225,369.45	1.81
G	交通运输、仓储和邮政业	176,391.15	0.05
H	住宿和餐饮业	3,328.32	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,944,202.46	2.31
J	金融业	482,095.43	0.14
K	房地产业	7,875,300.00	2.29
L	租赁和商务服务业	38,049.67	0.01
M	科学研究和技术服务业	494,346.78	0.14
N	水利、环境和公共设施管理业	705,809.57	0.21
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	19,651.90	0.01
Q	卫生和社会工作	125,682.75	0.04
R	文化、体育和娱乐业	99,237.18	0.03
S	综合	5,424.00	0.00
	合计	300,807,153.98	87.44

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	603596	伯特利	206,400	16,549,152.00	4.81
2	002648	卫星化学	583,972	15,095,676.20	4.39
3	600765	中航重机	377,520	12,148,593.60	3.53
4	002371	北方华创	43,000	11,916,160.00	3.46
5	603806	福斯特	135,100	8,851,752.00	2.57
6	000733	振华科技	59,000	8,022,230.00	2.33

7	300498	温氏股份	372,200	7,924,138.00	2.30
8	002100	天康生物	802,013	7,795,566.36	2.27
9	600660	福耀玻璃	150,900	6,309,129.00	1.83
10	600519	贵州茅台	2,664	5,447,880.00	1.58
11	300014	亿纬锂能	55,800	5,440,500.00	1.58
12	600031	三一重工	283,700	5,407,322.00	1.57
13	002714	牧原股份	97,200	5,372,244.00	1.56
14	300750	宁德时代	9,600	5,126,400.00	1.49
15	002459	晶澳科技	59,960	4,730,844.00	1.38
16	002812	恩捷股份	17,700	4,432,965.00	1.29
17	002466	天齐锂业	35,400	4,417,920.00	1.28
18	002415	海康威视	120,700	4,369,340.00	1.27
19	002493	荣盛石化	268,600	4,133,754.00	1.20
20	000683	远兴能源	376,900	3,961,219.00	1.15
21	603501	韦尔股份	22,300	3,858,569.00	1.12
22	600438	通威股份	63,000	3,771,180.00	1.10
23	603348	文灿股份	68,551	3,674,333.60	1.07
24	000002	万科A	177,300	3,634,650.00	1.06
25	600905	三峡能源	568,003	3,572,738.87	1.04
26	603233	大参林	112,820	3,531,266.00	1.03
27	002037	保利联合	361,800	3,451,572.00	1.00
28	603893	瑞芯微	37,800	3,437,532.00	1.00
29	600720	祁连山	275,100	3,411,240.00	0.99
30	600988	赤峰黄金	213,200	3,400,540.00	0.99
31	688536	思瑞浦	5,999	3,368,978.41	0.98
32	600195	中牧股份	272,100	3,335,946.00	0.97
33	002176	江特电机	129,100	3,232,664.00	0.94
34	002557	洽洽食品	56,400	3,210,852.00	0.93
35	688019	安集科技	15,007	3,195,290.44	0.93
36	300707	威唐工业	180,400	3,050,564.00	0.89
37	002532	天山铝业	460,173	3,004,929.69	0.87
38	300661	圣邦股份	16,500	3,003,330.00	0.87
39	600383	金地集团	218,500	2,936,640.00	0.85
40	002129	TCL 中环	49,800	2,932,722.00	0.85
41	601669	中国电建	353,300	2,780,471.00	0.81
42	601800	中国交建	293,600	2,724,608.00	0.79
43	002340	格林美	258,500	2,352,350.00	0.68
44	601012	隆基绿能	35,280	2,350,706.40	0.68
45	603477	巨星农牧	97,100	2,328,458.00	0.68
46	300760	迈瑞医疗	7,000	2,192,400.00	0.64
47	600309	万华化学	22,100	2,143,479.00	0.62
48	000792	盐湖股份	71,000	2,127,160.00	0.62

49	002271	东方雨虹	40,800	2,099,976.00	0.61
50	600938	中国海油	127,105	2,084,415.89	0.61
51	300398	飞凯材料	90,100	2,059,686.00	0.60
52	002756	永兴材料	13,300	2,024,393.00	0.59
53	601225	陕西煤业	94,800	2,007,864.00	0.58
54	000568	泸州老窖	8,000	1,972,320.00	0.57
55	600546	山煤国际	98,900	1,924,594.00	0.56
56	300973	立高食品	18,160	1,887,732.00	0.55
57	688533	上声电子	25,591	1,828,221.04	0.53
58	600406	国电南瑞	67,320	1,817,640.00	0.53
59	688008	澜起科技	29,004	1,757,062.32	0.51
60	688192	迪哲医药-U	65,615	1,754,545.10	0.51
61	600884	杉杉股份	57,800	1,717,816.00	0.50
62	300123	亚光科技	275,700	1,709,340.00	0.50
63	002567	唐人神	196,000	1,667,960.00	0.48
64	601233	桐昆股份	102,800	1,632,464.00	0.47
65	002865	钧达股份	16,800	1,602,048.00	0.47
66	002011	盾安环境	129,900	1,596,471.00	0.46
67	601668	中国建筑	295,300	1,570,996.00	0.46
68	605333	沪光股份	67,700	1,563,870.00	0.45
69	601728	中国电信	394,011	1,469,661.03	0.43
70	600399	抚顺特钢	82,000	1,467,800.00	0.43
71	000915	华特达因	32,700	1,352,145.00	0.39
72	001979	招商蛇口	95,300	1,279,879.00	0.37
73	688212	澳华内镜	27,094	1,267,999.20	0.37
74	603517	绝味食品	19,600	1,133,272.00	0.33
75	002906	华阳集团	23,700	1,073,847.00	0.31
76	003038	鑫铂股份	19,800	997,920.00	0.29
77	300666	江丰电子	11,800	719,800.00	0.21
78	601899	紫金矿业	48,900	456,237.00	0.13
79	300782	卓胜微	2,880	388,800.00	0.11
80	603267	鸿远电子	2,500	335,825.00	0.10
81	301238	瑞泰新材	8,943	331,548.89	0.10
82	688120	华海清科	1,025	254,610.00	0.07
83	601865	福莱特	6,500	247,650.00	0.07
84	301112	信邦智能	3,984	213,281.76	0.06
85	301286	侨源股份	7,839	176,722.11	0.05
86	688345	博力威	2,332	143,348.04	0.04
87	688234	天岳先进	2,173	141,657.87	0.04
88	300994	久祺股份	4,195	137,637.95	0.04
89	301175	中科环保	35,562	135,846.84	0.04
90	688095	福昕软件	1,897	134,687.00	0.04

91	688560	明冠新材	3,832	131,207.68	0.04
92	300932	三友联众	6,885	126,615.15	0.04
93	301239	普瑞眼科	3,735	125,682.75	0.04
94	300903	科翔股份	8,595	121,275.45	0.04
95	688400	凌云光	5,515	120,943.95	0.04
96	688237	超卓航科	2,846	117,454.42	0.03
97	688335	复洁环保	4,076	117,021.96	0.03
98	688625	呈和科技	2,672	116,606.08	0.03
99	300930	屹通新材	3,220	115,662.40	0.03
100	688305	科德数控	1,496	114,249.52	0.03
101	300996	普联软件	3,855	113,915.25	0.03
102	301126	达嘉维康	6,615	113,314.95	0.03
103	688072	拓荆科技-U	718	111,361.80	0.03
104	688032	禾迈股份	126	109,746.00	0.03
105	300879	大叶股份	4,660	108,857.60	0.03
106	605499	东鹏饮料	632	107,983.52	0.03
107	301185	鸥玛软件	5,776	106,798.24	0.03
108	688678	福立旺	4,198	106,503.26	0.03
109	300868	杰美特	5,925	105,939.00	0.03
110	688689	银河微电	3,258	105,233.40	0.03
111	688338	赛科希德	3,041	101,630.22	0.03
112	301046	能辉科技	2,891	100,057.51	0.03
113	301009	可靠股份	8,007	99,927.36	0.03
114	301015	百洋医药	4,614	99,570.12	0.03
115	003022	联泓新科	2,995	99,523.85	0.03
116	300907	康平科技	4,724	97,645.08	0.03
117	601825	沪农商行	15,480	97,059.60	0.03
118	601456	国联证券	7,843	96,233.61	0.03
119	688393	安必平	4,241	96,016.24	0.03
120	688315	诺禾致源	3,711	95,632.47	0.03
121	301006	迈拓股份	5,051	94,958.80	0.03
122	301020	密封科技	4,210	94,725.00	0.03
123	688687	凯因科技	5,354	94,551.64	0.03
124	300993	玉马遮阳	7,375	94,252.50	0.03
125	688359	三孚新科	2,213	93,277.95	0.03
126	301048	金鹰重工	8,424	92,748.24	0.03
127	300774	倍杰特	4,435	89,409.60	0.03
128	688227	品高股份	4,164	89,192.88	0.03
129	688697	纽威数控	5,837	88,372.18	0.03
130	688286	敏芯股份	1,681	88,033.97	0.03
131	301021	英诺激光	2,899	87,549.80	0.03
132	688551	科威尔	2,211	87,157.62	0.03

133	688661	和林微纳	1,452	87,061.92	0.03
134	300962	中金辐照	5,757	86,930.70	0.03
135	688609	九联科技	10,372	86,502.48	0.03
136	300966	共同药业	2,858	85,311.30	0.02
137	605123	派克新材	599	84,291.28	0.02
138	688509	正元地信	15,433	83,183.87	0.02
139	300614	百川畅银	3,283	82,600.28	0.02
140	688456	有研粉材	3,396	82,217.16	0.02
141	688313	仕佳光子	7,151	81,521.40	0.02
142	300892	品渥食品	2,714	81,284.30	0.02
143	688613	奥精医疗	2,617	80,969.98	0.02
144	688619	罗普特	5,856	80,812.80	0.02
145	301028	东亚机械	7,329	79,299.78	0.02
146	688683	莱尔科技	3,296	79,235.84	0.02
147	300880	迦南智能	5,374	79,159.02	0.02
148	300876	蒙泰高新	3,495	78,253.05	0.02
149	300937	药易购	2,434	77,936.68	0.02
150	688160	步科股份	2,771	77,366.32	0.02
151	301045	天禄科技	3,350	77,284.50	0.02
152	600153	建发股份	5,900	77,113.00	0.02
153	300945	曼卡龙	4,731	76,074.48	0.02
154	601689	拓普集团	1,100	75,273.00	0.02
155	301026	浩通科技	2,027	74,755.76	0.02
156	603529	爱玛科技	1,427	74,746.26	0.02
157	688685	迈信林	2,612	74,703.20	0.02
158	688195	腾景科技	2,693	74,649.96	0.02
159	301098	金埔园林	3,069	74,423.25	0.02
160	301110	青木股份	1,720	73,882.60	0.02
161	688129	东来技术	5,033	73,783.78	0.02
162	688056	莱伯泰科	2,010	73,767.00	0.02
163	301004	嘉益股份	3,115	73,700.90	0.02
164	301040	中环海陆	2,401	73,302.53	0.02
165	688633	星球石墨	1,558	72,478.16	0.02
166	300922	天秦装备	4,008	71,983.68	0.02
167	688219	会通股份	7,336	71,305.92	0.02
168	301108	洁雅股份	1,792	70,909.44	0.02
169	688600	皖仪科技	5,468	70,701.24	0.02
170	003035	南网能源	11,046	70,142.10	0.02
171	301182	凯旺科技	2,932	69,664.32	0.02
172	301027	华蓝集团	2,856	69,343.68	0.02
173	605358	立昂微	1,026	69,131.88	0.02
174	688786	悦安新材	1,513	68,992.80	0.02

175	688669	聚石化学	2,681	68,714.03	0.02
176	688768	容知日新	907	68,551.06	0.02
177	688778	厦钨新能	614	68,442.58	0.02
178	300889	爱克股份	4,786	68,344.08	0.02
179	600906	财达证券	7,597	68,297.03	0.02
180	688508	芯朋微	909	67,720.50	0.02
181	300927	江天化学	3,893	67,348.90	0.02
182	688229	博睿数据	1,643	66,541.50	0.02
183	300881	盛德鑫泰	2,906	66,431.16	0.02
184	300987	川网传媒	3,905	65,877.35	0.02
185	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.02
186	301002	崧盛股份	2,601	64,686.87	0.02
187	300975	商络电子	7,375	64,678.75	0.02
188	688113	联测科技	1,415	64,453.25	0.02
189	688319	欧林生物	3,412	64,452.68	0.02
190	688722	同益中	3,687	61,720.38	0.02
191	688577	浙海德曼	1,503	61,713.18	0.02
192	688799	华纳药厂	1,917	61,631.55	0.02
193	300883	龙利得	8,911	61,575.01	0.02
194	688268	华特气体	875	61,477.50	0.02
195	301062	上海艾录	5,225	60,975.75	0.02
196	688096	京源环保	4,485	60,816.60	0.02
197	300998	宁波方正	2,003	60,590.75	0.02
198	300971	博亚精工	2,445	60,269.25	0.02
199	300943	春晖智控	3,813	59,902.23	0.02
200	688329	艾隆科技	1,846	59,718.10	0.02
201	688571	杭华股份	8,200	59,696.00	0.02
202	601963	重庆银行	7,472	59,327.68	0.02
203	300886	华业香料	1,903	59,145.24	0.02
204	300952	恒辉安防	3,398	59,125.20	0.02
205	300274	阳光电源	600	58,950.00	0.02
206	688557	兰剑智能	1,812	58,292.04	0.02
207	688355	明志科技	2,710	58,021.10	0.02
208	688216	气派科技	2,000	57,720.00	0.02
209	301011	华立科技	1,750	57,557.50	0.02
210	688296	和达科技	2,173	57,041.25	0.02
211	688787	海天瑞声	817	56,658.95	0.02
212	301030	仕净科技	2,417	56,364.44	0.02
213	300855	图南股份	1,344	56,165.76	0.02
214	688511	天微电子	1,490	55,785.60	0.02
215	300972	万辰生物	4,300	55,599.00	0.02
216	603363	傲农生物	3,000	55,530.00	0.02

217	688156	路德环境	2,602	55,500.66	0.02
218	301010	晶雪节能	2,172	55,060.20	0.02
219	601702	华峰铝业	4,166	54,991.20	0.02
220	300963	中洲特材	2,830	54,845.40	0.02
221	688191	智洋创新	3,203	54,451.00	0.02
222	688656	浩欧博	1,371	53,647.23	0.02
223	300950	德固特	3,279	53,447.70	0.02
224	300961	深水海纳	3,936	53,372.16	0.02
225	301025	读客文化	4,027	53,075.86	0.02
226	688314	康拓医疗	1,085	52,676.75	0.02
227	300931	通用电梯	6,713	51,891.49	0.02
228	688316	青云科技-U	1,428	51,493.68	0.01
229	300948	冠中生态	3,229	51,244.23	0.01
230	301016	雷尔伟	2,747	51,231.55	0.01
231	688255	凯尔达	1,648	50,923.20	0.01
232	688071	华依科技	1,101	50,910.24	0.01
233	003031	中瓷电子	759	49,031.40	0.01
234	600955	维远股份	1,694	48,854.96	0.01
235	688117	圣诺生物	1,672	48,571.60	0.01
236	688607	康众医疗	1,890	48,535.20	0.01
237	688468	科美诊断	3,919	48,321.27	0.01
238	688260	昀冢科技	2,990	48,079.20	0.01
239	301032	新柴股份	5,124	47,653.20	0.01
240	688190	云路股份	612	47,583.00	0.01
241	688585	上纬新材	4,922	47,546.52	0.01
242	605366	宏柏新材	1,588	47,306.52	0.01
243	002475	立讯精密	1,400	47,306.00	0.01
244	688618	三旺通信	1,117	47,293.78	0.01
245	301049	超越科技	1,954	46,329.34	0.01
246	688616	西力科技	3,918	46,310.76	0.01
247	301036	双乐股份	2,047	46,016.56	0.01
248	688350	富淼科技	2,552	45,910.48	0.01
249	301007	德迈仕	3,022	45,541.54	0.01
250	301033	迈普医学	1,076	45,310.36	0.01
251	601568	北元集团	7,095	44,982.30	0.01
252	605399	晨光新材	1,053	44,805.15	0.01
253	002234	民和股份	2,800	44,632.00	0.01
254	600032	浙江新能	3,045	44,609.25	0.01
255	002179	中航光电	700	44,324.00	0.01
256	300960	通业科技	2,332	43,655.04	0.01
257	605589	圣泉集团	1,750	43,172.50	0.01
258	002984	森麒麟	1,386	43,118.46	0.01

259	001203	大中矿业	3,809	43,041.70	0.01
260	300992	泰福泵业	1,998	42,577.38	0.01
261	301063	海锅股份	1,524	42,458.64	0.01
262	688217	睿昂基因	1,040	42,234.40	0.01
263	301037	保立佳	1,923	41,998.32	0.01
264	601156	东航物流	2,090	41,382.00	0.01
265	688622	禾信仪器	1,204	41,200.88	0.01
266	300995	奇德新材	1,909	40,852.60	0.01
267	300854	中兰环保	2,026	40,276.88	0.01
268	300929	华骐环保	2,923	40,191.25	0.01
269	688655	迅捷兴	3,083	39,585.72	0.01
270	600916	中国黄金	3,371	39,440.70	0.01
271	002993	奥海科技	936	38,900.16	0.01
272	301050	雷电微力	383	38,897.48	0.01
273	001227	兰州银行	7,868	38,710.56	0.01
274	603565	中谷物流	2,405	38,167.35	0.01
275	688328	深科达	1,499	37,699.85	0.01
276	301029	怡合达	462	37,653.00	0.01
277	600927	永安期货	1,859	37,496.03	0.01
278	688215	瑞晟智能	1,229	37,398.47	0.01
279	603155	新亚强	996	37,110.96	0.01
280	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.01
281	301053	远信工业	1,544	36,067.84	0.01
282	688659	元琛科技	3,671	34,764.37	0.01
283	301068	大地海洋	1,436	34,679.40	0.01
284	688395	正弦电气	1,627	34,215.81	0.01
285	688679	通源环境	3,139	34,089.54	0.01
286	688517	金冠电气	2,892	33,662.88	0.01
287	688272	富吉瑞	1,263	33,545.28	0.01
288	688565	力源科技	3,450	33,534.00	0.01
289	688226	威腾电气	2,693	33,527.85	0.01
290	601665	齐鲁银行	6,731	32,847.28	0.01
291	003021	兆威机电	680	32,483.60	0.01
292	001201	东瑞股份	802	30,941.16	0.01
293	605090	九丰能源	1,526	30,932.02	0.01
294	605338	巴比食品	1,012	30,876.12	0.01
295	688348	昱能科技	63	30,744.00	0.01
296	601187	厦门银行	5,129	30,568.84	0.01
297	605337	李子园	1,103	30,531.04	0.01
298	603324	盛剑环境	732	29,924.16	0.01
299	603071	物产环能	1,627	29,513.78	0.01
300	688063	派能科技	94	29,346.80	0.01

301	688092	爱科科技	1,137	29,289.12	0.01
302	003009	中天火箭	623	29,150.17	0.01
303	605507	国邦医药	1,202	29,028.30	0.01
304	605009	豪悦护理	740	28,771.20	0.01
305	001213	中铁特货	5,818	28,566.38	0.01
306	301155	海力风电	305	27,755.00	0.01
307	301089	拓新药业	220	27,636.40	0.01
308	603122	合富中国	2,198	27,365.10	0.01
309	688501	青达环保	1,759	27,071.01	0.01
310	301266	宇邦新材	561	26,756.51	0.01
311	688067	爱威科技	1,259	26,212.38	0.01
312	603191	望变电气	1,149	26,197.20	0.01
313	301302	华如科技	448	26,127.32	0.01
314	688681	科汇股份	1,899	25,313.67	0.01
315	001318	阳光乳业	1,142	25,249.62	0.01
316	605089	味知香	370	24,978.70	0.01
317	003039	顺控发展	1,024	24,729.60	0.01
318	605305	中际联合	508	24,597.36	0.01
319	601921	浙版传媒	3,154	24,538.12	0.01
320	605286	同力日升	597	24,148.65	0.01
321	301058	中粮工科	1,386	24,102.54	0.01
322	301162	国能日新	431	24,013.02	0.01
323	605080	浙江自然	374	23,894.86	0.01
324	605555	德昌股份	917	23,355.99	0.01
325	603206	嘉环科技	1,210	23,353.00	0.01
326	003040	楚天龙	1,101	22,636.56	0.01
327	688083	中望软件	108	22,617.36	0.01
328	605006	山东玻纤	1,942	22,235.90	0.01
329	605339	南侨食品	864	21,919.68	0.01
330	001208	华菱线缆	1,754	21,784.68	0.01
331	605388	均瑶健康	1,230	21,119.10	0.01
332	003028	振邦智能	432	21,107.52	0.01
333	605020	永和股份	850	20,927.00	0.01
334	001228	永泰运	383	20,739.45	0.01
335	603179	新泉股份	710	20,590.00	0.01
336	003012	东鹏控股	2,278	19,909.72	0.01
337	605167	利柏特	2,471	19,595.03	0.01
338	001308	康冠科技	667	19,456.39	0.01
339	000656	金科股份	6,800	19,448.00	0.01
340	301120	新特电气	1,211	19,196.94	0.01
341	300857	协创数据	934	19,137.66	0.01
342	605077	华康股份	865	19,073.25	0.01

343	301101	明月镜片	371	19,043.43	0.01
344	605296	神农集团	740	19,025.40	0.01
345	605377	华旺科技	1,050	18,805.50	0.01
346	301268	铭利达	530	18,752.91	0.01
347	300853	申昊科技	641	18,717.20	0.01
348	605016	百龙创园	445	18,698.90	0.01
349	603176	汇通集团	1,924	18,393.44	0.01
350	601686	友发集团	2,374	18,137.36	0.01
351	605268	王力安防	1,642	18,012.74	0.01
352	601528	瑞丰银行	2,230	17,973.80	0.01
353	603171	税友股份	637	17,823.26	0.01
354	003019	宸展光电	691	17,440.84	0.01
355	603132	金徽股份	1,342	17,325.22	0.01
356	605208	永茂泰	1,081	17,112.23	0.00
357	603931	格林达	844	16,964.40	0.00
358	001212	中旗新材	400	16,852.00	0.00
359	300858	科拓生物	632	16,842.80	0.00
360	605050	福然德	1,197	16,793.91	0.00
361	001217	华尔泰	1,239	16,776.06	0.00
362	603759	海天股份	1,656	16,742.16	0.00
363	301187	欧圣电气	732	16,687.44	0.00
364	001215	千味央厨	295	16,605.55	0.00
365	605099	共创草坪	624	16,592.16	0.00
366	688256	寒武纪-U	255	16,498.50	0.00
367	301207	华兰疫苗	283	16,098.42	0.00
368	605060	联德股份	883	16,026.45	0.00
369	001205	盛航股份	808	15,998.40	0.00
370	301160	翔楼新材	418	15,883.58	0.00
371	003037	三和管桩	1,274	15,581.02	0.00
372	301127	天源环保	1,385	15,415.05	0.00
373	688320	禾川科技	297	15,325.20	0.00
374	001317	三羊马	300	15,222.00	0.00
375	301217	铜冠铜箔	1,023	15,171.09	0.00
376	605368	蓝天燃气	1,204	15,170.40	0.00
377	688052	纳芯微	40	15,158.40	0.00
378	300850	新强联	170	15,135.10	0.00
379	001216	华瓷股份	1,177	15,124.45	0.00
380	001313	粤海饲料	1,232	15,104.32	0.00
381	002979	雷赛智能	725	14,804.50	0.00
382	605008	长鸿高科	1,039	14,566.78	0.00
383	605169	洪通燃气	1,292	14,547.92	0.00
384	003029	吉大正元	716	14,534.80	0.00

385	301153	中科江南	328	14,456.49	0.00
386	605277	新亚电子	705	14,431.35	0.00
387	605158	华达新材	2,226	14,379.96	0.00
388	605183	确成股份	741	14,301.30	0.00
389	603230	内蒙新华	1,140	14,261.40	0.00
390	605056	咸亨国际	933	14,153.61	0.00
391	605133	嵘泰股份	618	14,139.84	0.00
392	003016	欣贺股份	1,681	14,120.40	0.00
393	605116	奥锐特	642	14,046.96	0.00
394	301220	亚香股份	349	13,905.27	0.00
395	301117	佳缘科技	255	13,882.20	0.00
396	301177	迪阿股份	185	13,727.00	0.00
397	603112	华翔股份	920	13,717.20	0.00
398	605136	丽人丽妆	867	13,715.94	0.00
399	601279	英利汽车	2,004	13,687.32	0.00
400	600801	华新水泥	700	13,657.00	0.00
401	603097	江苏华辰	577	13,617.20	0.00
402	301116	益客食品	664	13,615.02	0.00
403	301219	腾远钴业	152	13,521.06	0.00
404	603209	兴通股份	595	13,518.40	0.00
405	603836	海程邦达	733	13,443.22	0.00
406	301298	东利机械	640	13,358.92	0.00
407	301200	大族数控	255	13,341.52	0.00
408	605389	长龄液压	498	13,341.42	0.00
409	605018	长华股份	840	13,339.20	0.00
410	003030	祖名股份	480	13,324.80	0.00
411	605179	一鸣食品	939	13,277.46	0.00
412	002997	瑞鹄模具	751	13,202.58	0.00
413	301206	三元生物	287	13,113.03	0.00
414	003002	壶化股份	921	12,986.10	0.00
415	002992	宝明科技	899	12,954.59	0.00
416	002996	顺博合金	849	12,904.80	0.00
417	301135	瑞德智能	476	12,836.48	0.00
418	605199	葫芦娃	726	12,813.90	0.00
419	003025	思进智能	619	12,807.11	0.00
420	688301	奕瑞科技	27	12,772.08	0.00
421	301168	通灵股份	283	12,757.64	0.00
422	301199	迈赫股份	398	12,751.92	0.00
423	002999	天禾股份	1,726	12,634.32	0.00
424	605162	新中港	1,377	12,461.85	0.00
425	605500	森林包装	762	12,428.22	0.00
426	001266	宏英智能	247	12,298.13	0.00

427	688048	长光华芯	101	12,289.68	0.00
428	605028	世茂能源	615	12,256.95	0.00
429	003013	地铁设计	724	12,206.64	0.00
430	301222	浙江恒威	415	12,169.46	0.00
431	603215	比依股份	575	12,115.25	0.00
432	301259	艾布鲁	483	12,046.02	0.00
433	688665	四方光电	81	11,988.00	0.00
434	603213	镇洋发展	799	11,961.03	0.00
435	688349	三一重能	292	11,899.00	0.00
436	301151	冠龙节能	542	11,784.44	0.00
437	605007	五洲特纸	598	11,625.12	0.00
438	001207	联科科技	682	11,600.82	0.00
439	605066	天正电气	1,278	11,438.10	0.00
440	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
441	688326	经纬恒润-W	77	11,323.62	0.00
442	605098	行动教育	405	11,242.80	0.00
443	605319	无锡振华	764	11,108.56	0.00
444	605005	合兴股份	634	10,993.56	0.00
445	688119	中钢洛耐	1,228	10,830.96	0.00
446	605365	立达信	645	10,687.65	0.00
447	605599	菜百股份	980	10,662.40	0.00
448	003005	竞业达	412	10,650.20	0.00
449	301228	实朴检测	521	10,647.46	0.00
450	001206	依依股份	321	10,641.15	0.00
451	003015	日久光电	1,128	10,614.48	0.00
452	301288	清研环境	516	10,587.44	0.00
453	605058	澳弘电子	548	10,576.40	0.00
454	603219	富佳股份	528	10,517.76	0.00
455	605218	伟时电子	837	10,504.35	0.00
456	301111	粤万年青	379	10,392.18	0.00
457	003001	中岩大地	560	10,315.20	0.00
458	605378	野马电池	473	10,311.40	0.00
459	301125	腾亚精工	370	10,311.38	0.00
460	301166	优宁维	174	10,241.64	0.00
461	605598	上海港湾	553	9,987.18	0.00
462	301190	善水科技	420	9,966.60	0.00
463	605566	福莱蒾特	435	9,926.70	0.00
464	003006	百亚股份	804	9,921.36	0.00
465	001296	长江材料	403	9,905.74	0.00
466	605100	华丰股份	685	9,898.25	0.00
467	605567	春雪食品	629	9,850.14	0.00
468	605033	美邦股份	423	9,809.37	0.00

469	003042	中农联合	546	9,789.78	0.00
470	603272	联翔股份	443	9,723.85	0.00
471	603511	爱慕股份	553	9,660.91	0.00
472	605088	冠盛股份	716	9,651.68	0.00
473	002998	优彩资源	1,353	9,619.83	0.00
474	605300	佳禾食品	576	9,578.88	0.00
475	003018	金富科技	1,027	9,499.75	0.00
476	605118	力鼎光电	667	9,498.08	0.00
477	605488	福莱新材	603	9,491.22	0.00
478	605228	神通科技	1,217	9,407.41	0.00
479	605289	罗曼股份	474	9,375.72	0.00
480	605069	正和生态	608	9,326.72	0.00
481	688232	新点软件	247	9,292.14	0.00
482	605196	华通线缆	1,172	9,235.36	0.00
483	301100	风光股份	427	9,214.66	0.00
484	605177	东亚药业	439	9,148.76	0.00
485	605318	法狮龙	628	9,137.40	0.00
486	003010	若羽臣	562	9,132.50	0.00
487	300918	南山智尚	1,063	9,088.65	0.00
488	605138	盛泰集团	723	9,023.04	0.00
489	001234	泰慕士	333	9,017.64	0.00
490	301163	宏德股份	277	8,955.41	0.00
491	688699	明微电子	82	8,893.72	0.00
492	605086	龙高股份	443	8,877.72	0.00
493	605580	恒盛能源	654	8,815.92	0.00
494	605287	德才股份	349	8,798.29	0.00
495	301138	华研精机	285	8,763.75	0.00
496	605255	天普股份	530	8,718.50	0.00
497	605180	华生科技	499	8,677.61	0.00
498	688295	中复神鹰	230	8,622.70	0.00
499	605011	杭州热电	525	8,526.00	0.00
500	301179	泽宇智能	208	8,488.48	0.00
501	605189	富春染织	422	8,473.76	0.00
502	605259	绿田机械	295	8,425.20	0.00
503	003032	传智教育	586	8,409.10	0.00
504	601952	苏垦农发	600	8,394.00	0.00
505	001288	运机集团	537	8,382.57	0.00
506	688677	海泰新光	91	8,371.09	0.00
507	003036	泰坦股份	776	8,310.96	0.00
508	605258	协和电子	340	8,211.00	0.00
509	688290	景业智能	161	8,194.90	0.00
510	300882	万胜智能	572	8,145.28	0.00

511	001219	青岛食品	354	8,088.90	0.00
512	003033	征和工业	301	8,066.80	0.00
513	301193	家联科技	297	8,063.55	0.00
514	605299	舒华体育	738	8,058.96	0.00
515	688262	国芯科技	165	8,032.20	0.00
516	688308	欧科亿	119	7,920.64	0.00
517	605303	园林股份	610	7,838.50	0.00
518	301158	德石股份	383	7,807.42	0.00
519	001210	金房节能	311	7,790.55	0.00
520	301198	喜悦智行	341	7,689.55	0.00
521	605055	迎丰股份	1,146	7,666.74	0.00
522	603150	万朗磁塑	250	7,442.50	0.00
523	605188	国光连锁	1,003	7,261.72	0.00
524	605155	西大门	490	7,217.70	0.00
525	688161	威高骨科	147	7,083.93	0.00
526	301012	扬电科技	170	6,971.70	0.00
527	003003	天元股份	756	6,917.40	0.00
528	605298	必得科技	508	6,908.80	0.00
529	001209	洪兴股份	450	6,849.00	0.00
530	001202	炬申股份	459	6,742.71	0.00
531	605577	龙版传媒	588	6,703.20	0.00
532	003023	彩虹集团	385	6,622.00	0.00
533	003041	真爱美家	419	6,532.21	0.00
534	688097	博众精工	190	6,469.50	0.00
535	003004	声迅股份	306	6,383.16	0.00
536	688378	奥来德	161	6,280.61	0.00
537	003000	劲仔食品	684	6,087.60	0.00
538	300958	建工修复	300	5,934.00	0.00
539	688626	翔宇医疗	174	5,787.24	0.00
540	603051	鹿山新材	72	5,688.00	0.00
541	688127	蓝特光学	248	5,570.08	0.00
542	688663	新风光	161	5,469.17	0.00
543	688173	希荻微	163	5,468.65	0.00
544	000833	粤桂股份	600	5,424.00	0.00
545	000059	华锦股份	900	5,328.00	0.00
546	688259	创耀科技	66	5,317.62	0.00
547	688049	炬芯科技	134	5,100.04	0.00
548	688265	南模生物	76	4,866.28	0.00
549	688561	奇安信-U	81	4,519.80	0.00
550	002041	登海种业	200	4,218.00	0.00
551	600223	鲁商发展	400	4,192.00	0.00
552	301096	百诚医药	53	4,187.00	0.00

553	601808	中海油服	300	4,185.00	0.00
554	301069	凯盛新材	86	3,965.46	0.00
555	600138	中青旅	300	3,867.00	0.00
556	688283	坤恒顺维	77	3,670.59	0.00
557	001323	慕思股份	73	3,581.38	0.00
558	002142	宁波银行	100	3,581.00	0.00
559	301073	君亭酒店	48	3,328.32	0.00
560	688171	纬德信息	131	3,071.95	0.00
561	000932	华菱钢铁	500	2,545.00	0.00
562	688718	唯赛勃	142	2,502.04	0.00
563	600746	江苏索普	200	2,316.00	0.00
564	002738	中矿资源	20	1,852.20	0.00
565	600508	上海能源	100	1,809.00	0.00
566	301118	恒光股份	42	1,807.26	0.00
567	301133	金钟股份	60	1,666.20	0.00
568	688636	智明达	14	1,587.46	0.00
569	300814	中富电路	80	1,464.00	0.00
570	603048	浙江黎明	64	1,272.32	0.00
571	689009	九号公司-WD	28	1,246.00	0.00
572	300925	法本信息	95	1,135.25	0.00
573	300997	欢乐家	79	1,055.44	0.00
574	001319	铭科精技	36	1,039.32	0.00
575	301078	孩子王	56	820.96	0.00
576	600409	三友化工	100	819.00	0.00
577	301180	万祥科技	36	754.20	0.00
578	301066	万事利	50	713.00	0.00
579	002391	长青股份	100	710.00	0.00
580	300864	南大环境	33	693.00	0.00
581	301052	果麦文化	20	658.60	0.00
582	600376	首开股份	100	491.00	0.00
583	301039	中集车辆	40	433.20	0.00
584	301091	深城交	14	382.20	0.00
585	688093	世华科技	16	309.12	0.00
586	300891	惠云钛业	25	301.75	0.00
587	688569	铁科轨道	16	293.60	0.00
588	688306	均普智能	50	276.50	0.00
589	300940	南极光	9	211.77	0.00
590	300968	格林精密	20	181.20	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	002371	北方华创	12,690,030.04	3.05
2	603596	伯特利	10,531,937.00	2.53
3	002714	牧原股份	10,200,293.02	2.45
4	300969	恒帅股份	9,303,247.84	2.24
5	605333	沪光股份	9,187,166.97	2.21
6	603260	合盛硅业	8,492,621.00	2.04
7	600660	福耀玻璃	7,886,546.14	1.90
8	600765	中航重机	6,826,003.60	1.64
9	688019	安集科技	6,786,925.00	1.63
10	601669	中国电建	6,423,444.10	1.54
11	002532	天山铝业	6,025,747.98	1.45
12	000876	新希望	5,819,048.00	1.40
13	601838	成都银行	5,784,818.83	1.39
14	000792	盐湖股份	5,519,784.27	1.33
15	603348	文灿股份	5,451,640.00	1.31
16	600988	赤峰黄金	5,380,646.00	1.29
17	603032	德新交运	5,379,536.00	1.29
18	000002	万科A	5,348,319.09	1.29
19	600438	通威股份	5,287,882.00	1.27
20	603363	傲农生物	5,221,740.50	1.25

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	300969	恒帅股份	12,069,860.00	2.90
2	002594	比亚迪	11,703,382.00	2.81
3	605333	沪光股份	10,380,910.00	2.49
4	603260	合盛硅业	8,921,387.00	2.14
5	601012	隆基绿能	8,496,490.80	2.04
6	688636	智明达	7,599,129.16	1.83
7	603639	海利尔	7,390,056.86	1.78
8	688533	上声电子	7,283,643.45	1.75
9	600521	华海药业	7,029,525.86	1.69
10	300750	宁德时代	6,929,446.00	1.67
11	603501	韦尔股份	6,507,382.00	1.56
12	601838	成都银行	6,279,909.00	1.51
13	603032	德新交运	5,986,207.00	1.44
14	603348	文灿股份	5,947,439.77	1.43
15	603363	傲农生物	5,708,538.58	1.37
16	603806	福斯特	5,668,404.00	1.36

17	688008	澜起科技	5,589,107.03	1.34
18	603259	药明康德	5,566,035.79	1.34
19	002391	长青股份	5,530,602.00	1.33
20	002234	民和股份	5,313,281.00	1.28

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	571,109,271.86
卖出股票收入（成交）总额	585,490,464.28

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）	19,094.64	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	19,094.64	0.01

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	113059	福莱转债	150	19,094.64	0.01

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目标，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，充分考虑股指期货的风险收益特征，通过多头或空头的套期保值策略，以改善投资组合的投资效果，实现股票组合的超额收益。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券备选库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	122,826.49
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	126,711.62
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	249,538.11

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比 例 (%)	持有份额	占总份额比 例 (%)
21,205	9,304.43	54,071.99	0.03	197,246,387.09	99.97

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	772,347.17	0.3915

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

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2017 年 9 月 6 日) 基 金份额总额	491,760,953.62
本报告期期初基金份额总额	209,299,863.57
本报告期基金总申购份额	10,115,671.07
减：本报告期基金总赎回份额	22,115,075.56
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	197,300,459.08

§ 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

本报告期内本基金管理人、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 (%)	
中金公司	1	363,672,983.92	31.68	331,928.98	32.72	-
华西证券	1	159,874,012.94	13.93	130,567.41	12.87	-
兴业证券	1	133,811,394.16	11.66	122,404.91	12.07	-
国元证券	1	115,088,326.67	10.02	93,500.01	9.22	-
国信证券	2	103,622,099.70	9.03	95,354.38	9.40	-
中泰证券	1	90,905,797.32	7.92	82,987.19	8.18	-
国泰君安	1	68,689,672.75	5.98	62,597.13	6.17	-
申万宏源证券	2	46,840,583.46	4.08	38,079.80	3.75	-
招商证券	1	38,057,660.3	3.32	34,681.88	3.42	-

		5				
国盛证券	1	27,476,154.48	2.39	22,395.44	2.21	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-

注：交易单元选择的标准和程序：

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

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

需要，并能为本基金提供全面的信息服务；

(6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务。

2) 选择交易单元的程序：

我公司根据上述标准，选定符合条件的证券公司作为租用交易单元的对象。我公司投研部门定期对所选定证券公司的服务进行综合评比，评比内容包括：提供研究报告质量、数量、及时性及提供研究服务主动性和质量等情况，并依据评比结果确定交易单元交易的具体情况。我公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向券商租用交易单元作为基金专用交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
中金公司	-	-	30,100,000.00	100.00	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-

国泰君安	-	-	-	-	-	-
申万宏源 证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	鹏华基金管理有限公司关于旗下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	《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	2022 年 01 月 01 日
2	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	2022 年 01 月 01 日
3	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《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	2022 年 01 月 21 日
4	鹏华策略回报灵活配置混合型证券投资基金 2021 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	2022 年 01 月 21 日
5	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	《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	2022 年 01 月 24 日
6	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	《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	2022 年 02 月 10 日
7	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	《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	2022 年 02 月 21 日
8	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	《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	2022 年 03 月 01 日
9	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	《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	2022 年 03 月 08 日
10	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与光大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	2022 年 03 月 14 日

	(含定期定额申购)费率优惠活动的公告	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	《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	2022年03月15日
12	鹏华策略回报灵活配置混合型证券投资基金 2021 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	2022年03月30日
13	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	《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	2022年04月19日
14	鹏华策略回报灵活配置混合型证券投资基金 2022 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基金电子披露网站	2022年04月21日
15	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与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	《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	2022年04月21日
16	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	《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	2022年04月25日
17	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	2022年04月27日
18	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	《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	2022年04月28日
19	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	2022年04月30日
20	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	《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	2022年05月06日
21	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	2022年05月13日
22	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	《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	2022年05月30日
23	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	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会	2022年06月06日

	申购(含定期定额申购)费率优惠活动的公告	基金电子披露网站	
24	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	《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	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)《鹏华策略回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- (二)《鹏华策略回报灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- (三)《鹏华策略回报灵活配置混合型证券投资基金 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