

鹏华睿投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：招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。

基金托管人招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	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	46
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	60
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	62
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	62
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	62
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	62
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	63
§ 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	64
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	64
§ 9 开放式基金份额变动.....	64
§ 10 重大事件揭示	64
10.1 基金份额持有人大会决议	64
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	65
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	65
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	65
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	65
10.8 其他重大事件	68
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	70
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	70
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	70
§ 12 备查文件目录	70
12.1 备查文件目录	70
12.2 存放地点	70
12.3 查阅方式	70

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	鹏华睿投混合
基金主代码	005434
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 5 月 30 日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	172,042,333.53 份
基金合同存续期	不定期

注：无。

2.2 基金产品说明

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

	<p>现有的资源、能力和定位取得可持续竞争优势。另一方面是管理层分析，通过着重考察公司的管理层以及管理制度，选择具有良好治理结构、管理水平较高的优质公司。</p> <p>2) 定量分析 本基金通过对公司定量的估值分析，挖掘优质的投资标的。通过对估值方法的选择和估值倍数的比较，选择股价相对低估的股票。就估值方法而言，基于行业的特点确定对股价最有影响力的关键估值方法（包括 PE（市盈率）、PEG（市盈率相对盈利增长比率）、PB（市账率）、PS（市销率）、EV/EBITDA（企业价值倍数）等）；就估值倍数而言，通过业内比较、历史比较和增长性分析，确定具有上升基础的股价水平。</p> <p>（3）存托凭证投资策略 本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。</p> <p>3、债券投资策略 本基金债券投资将采取久期策略、收益率曲线策略、骑乘策略、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>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、国债期货投资策略 为有效控制债券投资的系统性风险，本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的，适度运用国债期货，提高投资组合的运作效率。在国债期货投资时，本基金将首先分析国债期货各合约价格与最便宜可交割券的关系，选择定价合理的国债期货合约，其次，考虑国债期货各合约的流动性情况，最终确定与现货组合的合适匹配，以达到风险管理的目标。</p> <p>8、资产支持证券的投资策略 本基金将综合运用战略资产配置和战术资产配置进行资产支持证券的投资组合管理，并根据信用风险、利率风险和流动性风险变化积极调整投资策略，严格遵守法律法规和基金合同的约定，在保证本金安全和基金资产流动性的基础上获得稳定收益。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%
风险收益特征	本基金属于混合型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金，低于股票型基金。

注：无。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称	鹏华基金管理有限公司	招商银行股份有限公司	
信息披露 负责人	姓名	高永杰	张燕
	联系电话	0755-81395402	0755-83199084
	电子邮箱	xxpl@phfund.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话	4006788999	95555	
传真	0755-82021126	0755-83195201	
注册地址	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦	
办公地址	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦	
邮政编码	518048	518040	
法定代表人	何如	缪建民	

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金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	-18,362,570.61
本期利润	-18,549,995.53
加权平均基金份额本期利润	-0.0980
本期加权平均净值利润率	-5.24%
本期基金份额净值增长率	-2.68%
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	153,229,990.18
期末可供分配基金份额利润	0.8907
期末基金资产净值	336,578,023.24
期末基金份额净值	1.9564
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	95.64%

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

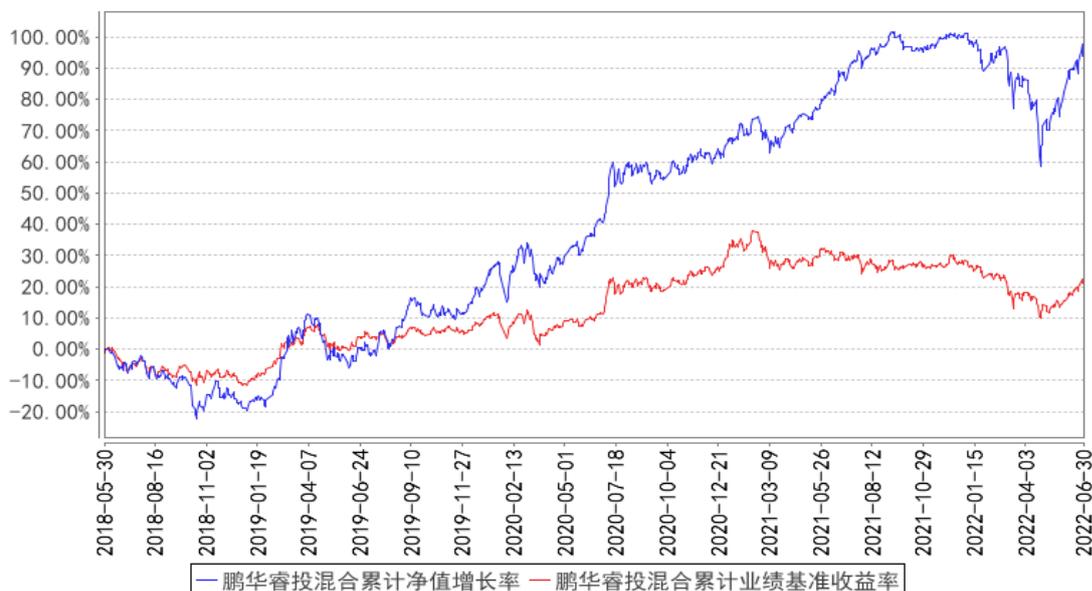
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	7.35%	1.07%	5.69%	0.64%	1.66%	0.43%
过去三个月	5.23%	1.58%	4.30%	0.86%	0.93%	0.72%
过去六个月	-2.68%	1.37%	-4.64%	0.87%	1.96%	0.50%
过去一年	3.79%	1.00%	-6.44%	0.75%	10.23%	0.25%
过去三年	96.41%	1.03%	17.65%	0.76%	78.76%	0.27%
自基金合同生效起至今	95.64%	1.15%	22.30%	0.80%	73.34%	0.35%

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

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

鹏华睿投混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

3.3 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		
刘方正	基金经理	2018-05-30	-	12 年	刘方正先生，国籍中国，理学硕士，12 年证券从业经验。2010 年 6 月加盟鹏华基金

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

注：1. 任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日；担任新成立基金基金经理

的，任职日期为基金合同生效日。

2. 证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：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，因市场波动等被动原因存在在本基金投资比例不符合基金合同要求的情形，本基金管理人严格按照基金合同的约定及时进行了调整，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，新冠疫情奥密克戎变种对全球仍造成较大影响，奥密克戎进入国内以后也对国内的总供需造成了较为明显的扰动，一季度末至二季度过程中，部分大中城市都显著加强了管控措施，居民行为受到了一定限制，导致了收入水平和消费需求等方面都有较为明显的阶段性扰动。国内情况来看，总体延续了去年下半年以来的经济回落趋势，叠加疫情扰动需求大幅回落超出了政府的预期范围，同时启动了较为强烈的刺激总需求回升的相关政策，外需仍是较为稳定的因素，内需上基建投资逐步加码，房地产打压政策的逐步趋缓以及部分城市逐步落地新一轮的刺激购房需求的政策。财政政策方面，中央也在逐步拓展思路，专项债发行节奏和力度相比过往有明显的加强。金融数据方面，社融底部逐步确立，向上过程一波三折，政策仍以引导扩大融资需求为主的引导方向。

2022 年上半年，权益市场整体经历回落探底及快速反弹的过程，年初即开启一轮以创业板和

科创板为主导的回落走势，四月底逐步确立底部开启大幅反弹，上证 50 和沪深 300 等大市值方向虽也有所回落，但相对收益较为明显，光伏、新能源汽车等热点赛道板块经历了大幅波动。债券市场收益率以震荡为主，中短端随流动性宽松有进一步的回落，中长短并未形成明显趋势。

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

4.4.2 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-2.68%，同期业绩比较基准增长率为-4.64%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，我们认为随着稳经济政策的加码和逐步落地，宏观经济将延续目前景气触底回升的趋势，边际上的压力逐步缓解。其中，外需保持稳定，略有回落压力。内需方面，基建短期仍将保持主力，新开工项目和资金配合度较高，且地方政府能力和意愿都相对较强。房地产方面，需要等待刺激政策和改善供需的政策逐步落地，需求随时间逐步发酵。疫情对消费的影响不确定性仍然存在，下半年是否有疫情扰动需求仍有待观察，趋势上，需求逐步探底回升大概率在下半年至明年上半年之间发生。流动性方面，我们预计稳经济仍是下半年的主题的情况下，流动性回收的可能性较小，但进一步放松的可能性也有限，仍以总体温和和局部性缓和和放松为主。信用宽松仍将延续，但此一轮的信用扩张的高点大概率低于 2021 年那一轮，可持续性值得期待。

在此情况下，我们认为整体权益市场较难形成趋势性行情，震荡市仍是下半年的主要趋势，流动性对估值来讲保持中性，但企业盈利的低点和趋势性向上机会仍需等待，大概率会在下半年至明年年初过程中落地。考虑市场估值水平，沪深 300、创业板指等宽基指数基本处于历史估值分位中位附近，中证 500 指数估值仍处于偏低水平，经济基本面驱使估值上升动力不足，仍需等待企业盈利回升同时促进估值上升动力。债券方面，目前收益率绝对水平偏低，收益率进一步下行空间非常有限，但短期流动性难以证伪，仍将维持宽松趋势，中长久期波动风险在逐步加大，暂时保持谨慎。

未来我们仍将坚持以追求长期超越权益指数收益率水平，并同时降低净值波动率的投资策略。目前阶段，操作方面保持相对中性的权益仓位水平，辅之以部分固定收益类资产，同时，积极参与新股、可转债、可交换债的网下申购获取增强收益。

4.6 管理人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 153,229,990.18 元，期末基金份额净值 1.9564 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

托管人声明：

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

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

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

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：鹏华睿投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	58,226,774.64	4,294,742.36
结算备付金		1,612,343.83	8,282,492.81
存出保证金		98,830.56	48,893.84
交易性金融资产	6.4.7.2	277,424,369.90	444,328,613.96
其中：股票投资		262,772,982.35	152,447,114.98
基金投资		-	-
债券投资		14,651,387.55	291,881,498.98
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		104,725.21	-
应收股利		-	-
应收申购款		37,474.61	15,512.62
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	4,145,104.24
资产总计		337,504,518.75	461,115,359.83
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		-	52,100,000.00
应付清算款		-	1,259,715.44
应付赎回款		118,466.29	8,281.40
应付管理人报酬		392,757.96	515,876.58
应付托管费		52,367.73	68,783.54
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		25.44	12,383.58
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	362,878.09	298,518.49
负债合计		926,495.51	54,263,559.03
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	172,042,333.53	202,386,382.33
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	164,535,689.71	204,465,418.47
净资产合计		336,578,023.24	406,851,800.80
负债和净资产总计		337,504,518.75	461,115,359.83

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.9564 元，基金份额总额 172,042,333.53 份。

6.2 利润表

会计主体：鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：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		-14,755,271.79	35,767,174.87
1. 利息收入		88,387.78	2,090,451.08
其中：存款利息收入	6.4.7.13	86,221.93	79,698.70
债券利息收入		-	2,004,884.01
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,165.85	5,868.37
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”		-15,091,897.10	36,313,839.84

填列)			
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-21,274,908.18	35,140,424.17
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	3,166,050.44	105,912.97
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	3,016,960.64	1,067,502.70
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	-187,424.92	-3,009,842.20
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	435,662.45	372,726.15
减：二、营业总支出		3,794,723.74	3,604,370.11
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,642,549.95	1,763,898.93
2. 托管费	6.4.10.2.2	352,339.90	235,186.53
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		704,153.01	743,150.53
其中：卖出回购金融资产支 出		704,153.01	743,150.53
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		4,121.56	3,166.77
8. 其他费用	6.4.7.23	91,559.32	858,967.35
三、利润总额（亏损总额以 “-”号填列）		-18,549,995.53	32,162,804.76
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		-18,549,995.53	32,162,804.76
五、其他综合收益的税后净 额		-	-
六、综合收益总额		-18,549,995.53	32,162,804.76

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：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)	202,386,382.33	-	204,465,418.47	406,851,800.80
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)	202,386,382.33	-	204,465,418.47	406,851,800.80
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-30,344,048.80	-	-39,929,728.76	-70,273,777.56
(一)、综合收益总额	-	-	-18,549,995.53	-18,549,995.53
(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)	-30,344,048.80	-	-21,379,733.23	-51,723,782.03
其中:1. 基金申购款	38,469,440.64	-	35,178,915.75	73,648,356.39
2. 基金赎回款	-68,813,489.44	-	-56,558,648.98	-125,372,138.42

(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)	172,042,333.53	-	164,535,689.71	336,578,023.24
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)	195,516,972.96	-	127,376,574.64	322,893,547.60
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)	195,516,972.96	-	127,376,574.64	322,893,547.60
三、本期 增减变动 额(减少 以“-” 号填列)	-66,200,971.92	-	-12,947,350.99	-79,148,322.91

(一)、 综合收益总额	-	-	32,162,804.76	32,162,804.76
(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)	-66,200,971.92	-	-45,110,155.75	-111,311,127.67
其中:1. 基金申购款	6,429,552.56	-	5,140,618.14	11,570,170.70
2. 基金赎回款	-72,630,524.48	-	-50,250,773.89	-122,881,298.37
(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)	129,316,001.04	-	114,429,223.65	243,745,224.69

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

基金管理人负责人

邢彪

主管会计工作负责人

郝文高

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证)、债券(包含国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券、中小企业私募债等)、货币市场工具、股指期货、权证、资产支持证券、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。基金的投资组合比例为:股票(含存托凭证)资产占基金资产的比例为 0%—95%;每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%。

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》、《鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

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、卖出回购金融资产款、应付交易费用、应付利息和其他负债，对其账面价值的影响金额分别为 410.48 元、4,099.81 元、24.20 元、4,140,569.75 元、-4,145,104.24 元、-24,094.26 元、-152,552.16 元、24,094.26 元和 152,552.16 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	58,226,774.64
等于：本金	58,220,991.55
加：应计利息	5,783.09
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	58,226,774.64

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	254,495,447.17	-	262,772,982.35	8,277,535.18	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	14,513,523.14	136,265.95	14,651,387.55	1,598.46
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	14,513,523.14	136,265.95	14,651,387.55	1,598.46
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	269,008,970.31	136,265.95	277,424,369.90	8,279,133.64	

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	1,022.11
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	277,553.42
其中：交易所市场	277,553.42
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	84,302.56
合计	362,878.09

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	202,386,382.33	202,386,382.33
本期申购	38,469,440.64	38,469,440.64
本期赎回（以“-”号填列）	-68,813,489.44	-68,813,489.44
- 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	172,042,333.53	172,042,333.53

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	202,337,102.37	2,128,316.10	204,465,418.47
本期利润	-18,362,570.61	-187,424.92	-18,549,995.53
本期基金份额交易产生的变动数	-30,744,541.58	9,364,808.35	-21,379,733.23
其中：基金申购款	36,550,636.04	-1,371,720.29	35,178,915.75
基金赎回款	-67,295,177.62	10,736,528.64	-56,558,648.98
本期已分配利润	-	-	-
本期末	153,229,990.18	11,305,699.53	164,535,689.71

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	23,231.37
定期存款利息收入	-	
其他存款利息收入	-	
结算备付金利息收入	62,403.38	
其他	587.18	
合计	86,221.93	

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	-21,274,908.18
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	-21,274,908.18

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	207,961,665.67
减：卖出股票成本总额	228,490,413.86
减：交易费用	746,159.99
买卖股票差价收入	-21,274,908.18

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	1,995,178.78
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,170,871.66
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	3,166,050.44

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	302,990,825.12
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成	297,540,979.57

本总额	
减：应计利息总额	4,278,630.42
减：交易费用	343.47
买卖债券差价收入	1,170,871.66

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	3,016,960.64
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	3,016,960.64

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	-187,424.92
股票投资	155,546.03
债券投资	-342,970.95
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	-187,424.92

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	435,188.58
基金转换费收入	473.87
合计	435,662.45

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	24,795.19
信息披露费	59,507.37

证券出借违约金	-
银行汇划费用	7,254.81
存托服务费	1.95
合计	91,559.32

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
招商银行股份有限公司(“招商银行”)	基金托管人、基金代销机构
国信证券股份有限公司(“国信证券”)	基金管理人的股东

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	-	-	90,906,947.52	19.06

6.4.10.1.2 债券交易

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	占当期债券 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)
国信证券	40,011,500.00	12.57	-	-

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)
国信证券	162,400,000.00	2.31	388,300,000.00	5.34

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	-	-	-	-
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	73,754.19	17.67	73,754.19	35.48

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	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管理费	2,642,549.95	1,763,898.93
其中：支付销售机构的客户维护费	207,635.86	99,947.48

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	352,339.90	235,186.53

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

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例 (%)
国信证券	-	-	7,671,337.97	7.62

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

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
招商银行	58,226,774.64	23,231.37	4,425,399.37	12,832.70

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	688323	瑞华泰	网下申购	4,513	26,942.61
国信证券	300986	志特新材	网下申购	2,632	38,927.28
国信证券	300957	贝泰妮	网下申购	1,433	67,823.89

注：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	198	12,493.80	7,890.30	-
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	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	-
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	483	14,886.06	10,365.18	-
301153	中科江南	2022年5月10日	6个月	新股流通受限	33.68	43.98	303	10,205.04	13,325.94	-
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	31,719	121,166.58	121,166.58	-
301175	中科环保	2022年6月30日	6个月	新股流通受限	3.82	3.82	3,525	13,465.50	13,465.50	-
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	246	18,833.76	12,772.32	-
301206	三元生物	2022年1月26日	6个月	新股流通受限	109.30	45.69	354	25,794.80	16,174.26	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	276	15,698.88	15,571.92	-
301217	铜冠铜箔	2022年1月20日	6个月	新股流通受限	17.27	14.83	1,086	18,755.22	16,105.38	-
301219	腾远钴业	2022年3月10日	6个月	新股流通受限	173.98	87.82	130	12,526.56	11,416.60	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	-
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	787	15,094.66	25,239.09	-
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	3,318	111,650.70	111,650.70	-
301239	普瑞眼科	2022年 6月22日	6个月	新股流 通受限	33.65	33.65	369	12,416.85	12,416.85	-
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	494	13,268.84	23,252.58	-
301268	铭利达	2022年 3月29日	6个月	新股流 通受限	28.50	34.87	481	13,708.50	16,772.47	-
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	2022年	6个月	新股流	52.03	56.42	244	12,695.32	13,766.48	-

	科技	6月16日		通受限							
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		-
688119	中钢洛耐	2022年5月27日	6个月	新股流通受限	5.06	7.01	23,646	119,648.76	165,758.46		-
688223	晶科能源	2022年1月19日	6个月	新股流通受限	5.00	14.47	40,115	200,575.00	580,464.05		-
688234	天岳先进	2022年1月5日	6个月	新股流通受限	82.79	65.19	2,462	203,828.98	160,497.78		-
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	2,802	115,638.54	115,638.54		-
688306	均普智能	2022年3月15日	6个月	新股流通受限	5.08	5.19	24,489	124,404.12	127,097.91		-
688400	凌云光	2022年6月27日	1个月内(含)	新股未上市	21.93	21.93	5,470	119,957.10	119,957.10		-

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

2、基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起约定限售期内不得转让。

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

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

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002670	国盛金控	2022年6月1日	重大事项	9.60	2022年7月14日	9.99	15,593	146,125.10	149,692.80	-

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，超短期融资券，次级债，可转换债券，可交换债券，中小企业私募债等)，货币市场工具(含同业存单等)，权证，资产支持证券，股指期货，国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人致力于全面内部控制体系的建设，建立了从董事会层面到各业务部门的风险管理组织架构。本基金的基金管理人在董事会下设风险控制和合规审计委员会，主要负责制

定基金管理人风险控制战略和控制政策、协调突发重大风险等事项；督察长负责对基金管理人各业务环节合法合规运作进行监督检查，组织、指导基金管理人内部监察稽核工作，并可向董事会和中国证监会直接报告；在公司内部设立独立的监察稽核部，专职负责对基金管理人各部门、各业务的风险控制情况进行督促和检查，并适时提出整改建议。

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

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招商银行股份有限公司及其他具有基金托管资格的银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。

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

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

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

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	-	271,870,000.00
AAA 以下	494,261.52	5,498.98
未评级	-	-
合计	494,261.52	271,875,498.98

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约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股票不得超过该上市公司可流通股股票的 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股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 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	58,226,774.64	-	-	-	58,226,774.64
结算备付金	1,612,343.83	-	-	-	1,612,343.83
存出保证金	98,830.56	-	-	-	98,830.56
交易性金融资产	14,157,126.03	494,261.52	-	-262,772,982.35	277,424,369.90
应收申购款	-	-	-	37,474.61	37,474.61
应收清算款	-	-	-	104,725.21	104,725.21
资产总计	74,095,075.06	494,261.52	-	-262,915,182.17	337,504,518.75
负债					
应付赎回款	-	-	-	118,466.29	118,466.29
应付管理人报酬	-	-	-	392,757.96	392,757.96
应付托管费	-	-	-	52,367.73	52,367.73
应交税费	-	-	-	25.44	25.44
其他负债	-	-	-	362,878.09	362,878.09
负债总计	-	-	-	926,495.51	926,495.51
利率敏感度缺口	74,095,075.06	494,261.52	-	-261,988,686.66	336,578,023.24
上年度末 2021 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	4,294,742.36	-	-	-	4,294,742.36
结算备付金	8,282,492.81	-	-	-	8,282,492.81
存出保证金	48,893.84	-	-	-	48,893.84
交易性金融资产	50,437,000.00	241,439,000.00	5,498.98	152,447,114.98	444,328,613.96
应收申购款	-	-	-	15,512.62	15,512.62
其他资产	-	-	-	4,145,104.24	4,145,104.24
资产总计	63,063,129.01	241,439,000.00	5,498.98	156,607,731.84	461,115,359.83
负债					
应付赎回款	-	-	-	8,281.40	8,281.40
应付管理人报酬	-	-	-	515,876.58	515,876.58
应付托管费	-	-	-	68,783.54	68,783.54
应付清算款	-	-	-	1,259,715.44	1,259,715.44
卖出回购金融资产款	52,100,000.00	-	-	-	52,100,000.00

应交税费	-	-	-	12,383.58	12,383.58
其他负债	-	-	-	298,518.49	298,518.49
负债总计	52,100,000.00	-	-	2,163,559.03	54,263,559.03
利率敏感度缺口	10,963,129.01	241,439,000.00	5,498.98	154,444,172.81	406,851,800.80

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有债券资产的利率风险状况测算的理论变动值对基金资产净值的影响金额。		
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。		
	此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
	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	市场利率下降 25 个基点	18,946.28	886,077.57
	市场利率上升 25 个基点	-18,895.72	-881,063.75

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 4.35%。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%；每个交易日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

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

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	262,772,982.35	78.07	152,447,114.98	37.47
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	494,261.52	0.15	5,498.98	—
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	263,267,243.87	78.22	152,452,613.96	37.47

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%	10,824,349.23	7,854,274.01
	业绩比较基准下降 5%	-10,824,349.23	-7,854,274.01

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	259,788,088.46
第二层次	14,866,549.62
第三层次	2,769,731.82
合计	277,424,369.90

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	262,772,982.35	77.86
	其中：股票	262,772,982.35	77.86
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	14,651,387.55	4.34
	其中：债券	14,651,387.55	4.34
	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	59,839,118.47	17.73
8	其他各项资产	241,030.38	0.07
9	合计	337,504,518.75	100.00

注：报告期末本基金投资的存托凭证公允价值为：209,150.00 元，占净值比 0.06%。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	3,283,510.00	0.98
B	采矿业	11,100,128.74	3.30
C	制造业	156,464,358.78	46.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,888,954.60	2.34
E	建筑业	4,378,189.00	1.30
F	批发和零售业	12,112,592.90	3.60
G	交通运输、仓储和邮政业	8,697,928.72	2.58
H	住宿和餐饮业	1,520,800.00	0.45
I	信息传输、软件和信息技术服务业	24,546,129.35	7.29
J	金融业	9,618,098.61	2.86
K	房地产业	5,292,719.00	1.57
L	租赁和商务服务业	3,433,035.00	1.02
M	科学研究和技术服务业	1,960,441.82	0.58
N	水利、环境和公共设施管理业	915,665.87	0.27
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	6,104,597.55	1.81
R	文化、体育和娱乐业	3,204,328.81	0.95
S	综合	2,251,503.60	0.67
	合计	262,772,982.35	78.07

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	000988	华工科技	439,200	10,176,264.00	3.02
2	300363	博腾股份	129,500	10,099,705.00	3.00
3	600486	扬农化工	60,500	8,063,440.00	2.40
4	688005	容百科技	60,600	7,844,064.00	2.33
5	002268	卫士通	181,700	7,796,747.00	2.32
6	300699	光威复材	107,600	6,334,412.00	1.88
7	300244	迪安诊断	192,300	5,980,530.00	1.78
8	600399	抚顺特钢	334,000	5,978,600.00	1.78

9	600732	爱旭股份	180,200	5,950,204.00	1.77
10	600392	盛和资源	253,800	5,735,880.00	1.70
11	600522	中天科技	242,500	5,601,750.00	1.66
12	688521	芯原股份-U	111,700	5,517,980.00	1.64
13	300474	景嘉微	76,150	5,207,898.50	1.55
14	601000	唐山港	1,737,600	4,483,008.00	1.33
15	000039	中集集团	315,200	4,365,520.00	1.30
16	603198	迎驾贡酒	65,300	4,253,642.00	1.26
17	600739	辽宁成大	271,700	3,961,386.00	1.18
18	600863	内蒙华电	1,081,600	3,947,840.00	1.17
19	600188	兖矿能源	98,700	3,896,676.00	1.16
20	000623	吉林敖东	244,200	3,604,392.00	1.07
21	000960	锡业股份	207,900	3,486,483.00	1.04
22	000961	中南建设	1,088,500	3,319,925.00	0.99
23	600039	四川路桥	303,100	3,191,643.00	0.95
24	300315	掌趣科技	913,700	3,051,758.00	0.91
25	600733	北汽蓝谷	322,500	2,989,575.00	0.89
26	600256	广汇能源	259,900	2,739,346.00	0.81
27	002299	圣农发展	141,900	2,721,642.00	0.81
28	600415	小商品城	452,600	2,520,982.00	0.75
29	603927	中科软	105,420	2,458,394.40	0.73
30	600158	中体产业	286,047	2,354,166.81	0.70
31	600546	山煤国际	119,000	2,315,740.00	0.69
32	002080	中材科技	82,000	2,255,000.00	0.67
33	600167	联美控股	290,860	2,178,541.40	0.65
34	000062	深圳华强	169,735	2,155,634.50	0.64
35	000009	中国宝安	153,440	2,069,905.60	0.61
36	601156	东航物流	103,400	2,047,320.00	0.61
37	000581	威孚高科	104,800	2,017,400.00	0.60
38	600782	新钢股份	381,100	1,920,744.00	0.57
39	688006	杭可科技	27,200	1,905,632.00	0.57
40	002831	裕同科技	57,281	1,692,653.55	0.50
41	600195	中牧股份	122,789	1,505,393.14	0.45
42	002191	劲嘉股份	134,800	1,445,056.00	0.43
43	600938	中国海油	84,004	1,332,303.44	0.40
44	601187	厦门银行	204,400	1,218,224.00	0.36
45	603379	三美股份	51,900	1,154,775.00	0.34
46	000869	张裕A	36,700	1,091,458.00	0.32
47	002396	星网锐捷	42,700	966,728.00	0.29
48	000877	天山股份	78,000	959,400.00	0.29
49	003035	南网能源	150,400	955,040.00	0.28
50	600754	锦江酒店	14,400	905,760.00	0.27

51	601718	际华集团	266,300	825,530.00	0.25
52	600705	中航产融	222,700	770,542.00	0.23
53	601615	明阳智能	22,500	760,500.00	0.23
54	002221	东华能源	68,600	638,666.00	0.19
55	600258	首旅酒店	24,800	615,040.00	0.18
56	300769	德方纳米	1,500	613,020.00	0.18
57	002242	九阳股份	31,800	583,848.00	0.17
58	688223	晶科能源	40,115	580,464.05	0.17
59	603708	家家悦	38,400	546,816.00	0.16
60	600096	云天化	17,200	541,456.00	0.16
61	300012	华测检测	22,500	522,225.00	0.16
62	002497	雅化集团	15,400	502,810.00	0.15
63	002563	森马服饰	84,700	501,424.00	0.15
64	002407	多氟多	10,200	498,882.00	0.15
65	600765	中航重机	15,260	491,066.80	0.15
66	002240	盛新锂能	8,100	488,916.00	0.15
67	002180	纳思达	9,500	480,890.00	0.14
68	300390	天华超净	5,500	480,700.00	0.14
69	600141	兴发集团	10,420	458,375.80	0.14
70	300073	当升科技	4,700	424,598.00	0.13
71	600885	宏发股份	10,077	421,722.45	0.13
72	002384	东山精密	18,300	419,619.00	0.12
73	002756	永兴材料	2,700	410,967.00	0.12
74	603613	国联股份	4,600	407,560.00	0.12
75	600418	江淮汽车	23,400	401,544.00	0.12
76	300285	国瓷材料	10,700	384,344.00	0.11
77	600521	华海药业	16,900	383,630.00	0.11
78	601117	中国化学	40,400	380,164.00	0.11
79	600233	圆通速递	18,400	375,176.00	0.11
80	601555	东吴证券	53,600	371,448.00	0.11
81	601058	赛轮轮胎	32,800	369,656.00	0.11
82	600563	法拉电子	1,800	369,288.00	0.11
83	600487	亨通光电	25,300	367,862.00	0.11
84	000983	山西焦煤	27,330	365,948.70	0.11
85	300037	新宙邦	6,940	364,766.40	0.11
86	603077	和邦生物	82,800	352,728.00	0.10
87	002013	中航机电	28,100	347,035.00	0.10
88	002385	大北农	44,400	346,764.00	0.10
89	688180	君实生物-U	4,600	346,564.00	0.10
90	603456	九洲药业	6,700	346,390.00	0.10
91	601108	财通证券	43,600	343,132.00	0.10
92	688122	西部超导	3,700	341,140.00	0.10

93	600549	厦门钨业	15,500	335,110.00	0.10
94	300088	长信科技	45,000	333,900.00	0.10
95	688099	晶晨股份	3,300	333,300.00	0.10
96	000519	中兵红箭	11,200	326,480.00	0.10
97	000630	铜陵有色	98,900	322,414.00	0.10
98	600298	安琪酵母	6,600	321,750.00	0.10
99	603345	安井食品	1,900	318,953.00	0.09
100	600862	中航高科	11,100	311,910.00	0.09
101	601636	旗滨集团	24,400	311,100.00	0.09
102	002353	杰瑞股份	7,700	310,310.00	0.09
103	000783	长江证券	51,900	307,767.00	0.09
104	601077	渝农商行	83,000	307,100.00	0.09
105	601168	西部矿业	25,500	301,665.00	0.09
106	600095	湘财股份	39,000	299,910.00	0.09
107	600120	浙江东方	73,821	296,022.21	0.09
108	601162	天风证券	93,000	295,740.00	0.09
109	300146	汤臣倍健	13,600	294,440.00	0.09
110	603605	珀莱雅	1,780	294,020.40	0.09
111	002056	横店东磁	10,900	290,158.00	0.09
112	002028	思源电气	8,100	288,846.00	0.09
113	002797	第一创业	45,000	288,450.00	0.09
114	002507	涪陵榨菜	8,300	286,516.00	0.09
115	300724	捷佳伟创	3,200	285,920.00	0.08
116	600988	赤峰黄金	17,800	283,910.00	0.08
117	688777	中控技术	3,900	283,764.00	0.08
118	603517	绝味食品	4,900	283,318.00	0.08
119	000932	华菱钢铁	55,580	282,902.20	0.08
120	002185	华天科技	30,000	281,400.00	0.08
121	603589	口子窖	4,800	281,328.00	0.08
122	601128	常熟银行	36,800	281,152.00	0.08
123	603026	石大胜华	1,900	276,165.00	0.08
124	002439	启明星辰	13,700	273,041.00	0.08
125	002603	以岭药业	11,180	271,674.00	0.08
126	002326	永太科技	8,200	270,026.00	0.08
127	600109	国金证券	29,900	269,100.00	0.08
128	601607	上海医药	14,800	267,584.00	0.08
129	000830	鲁西化工	15,400	266,266.00	0.08
130	002078	太阳纸业	21,600	265,896.00	0.08
131	600153	建发股份	19,900	260,093.00	0.08
132	000563	陕国投 A	82,700	258,024.00	0.08
133	600901	江苏租赁	50,100	257,013.00	0.08
134	605117	德业股份	900	251,901.00	0.07

135	601872	招商轮船	43,500	250,560.00	0.07
136	600348	华阳股份	16,100	248,906.00	0.07
137	002422	科伦药业	13,300	248,710.00	0.07
138	600497	驰宏锌锗	47,700	247,563.00	0.07
139	000738	航发控制	8,800	247,280.00	0.07
140	601990	南京证券	29,600	246,864.00	0.07
141	600177	雅戈尔	37,100	245,973.00	0.07
142	600875	东方电气	14,900	245,105.00	0.07
143	000970	中科三环	13,000	244,140.00	0.07
144	603267	鸿远电子	1,800	241,794.00	0.07
145	603127	昭衍新药	2,100	238,980.00	0.07
146	600160	巨化股份	18,120	238,278.00	0.07
147	600171	上海贝岭	9,500	237,785.00	0.07
148	300676	华大基因	3,300	236,610.00	0.07
149	600859	王府井	9,100	236,418.00	0.07
150	002673	西部证券	36,000	235,440.00	0.07
151	000998	隆平高科	14,100	234,906.00	0.07
152	002138	顺络电子	8,600	234,350.00	0.07
153	000999	华润三九	5,200	234,000.00	0.07
154	601699	潞安环能	16,000	233,920.00	0.07
155	002572	索菲亚	8,500	233,750.00	0.07
156	600516	方大炭素	30,600	232,560.00	0.07
157	600529	山东药玻	8,300	231,985.00	0.07
158	600143	金发科技	24,100	229,432.00	0.07
159	000807	云铝股份	23,200	229,216.00	0.07
160	000415	渤海租赁	105,300	228,501.00	0.07
161	600482	中国动力	14,500	227,795.00	0.07
162	002557	洽洽食品	4,000	227,720.00	0.07
163	601997	贵阳银行	39,100	227,171.00	0.07
164	002030	达安基因	13,166	226,323.54	0.07
165	002273	水晶光电	18,600	225,246.00	0.07
166	002465	海格通信	24,700	224,523.00	0.07
167	688390	固德威	700	219,107.00	0.07
168	000629	攀钢钒钛	57,600	218,880.00	0.07
169	600536	中国软件	5,389	218,739.51	0.06
170	300357	我武生物	4,200	218,526.00	0.06
171	000728	国元证券	35,100	218,322.00	0.06
172	300058	蓝色光标	33,400	218,102.00	0.06
173	000975	银泰黄金	22,340	217,591.60	0.06
174	300136	信维通信	12,900	217,365.00	0.06
175	600170	上海建工	71,500	216,645.00	0.06
176	600704	物产中大	41,800	214,434.00	0.06

177	002092	中泰化学	27,600	214,176.00	0.06
178	601577	长沙银行	26,900	213,317.00	0.06
179	002409	雅克科技	3,800	210,938.00	0.06
180	600079	人福医药	13,100	209,600.00	0.06
181	689009	九号公司-WD	4,700	209,150.00	0.06
182	002294	信立泰	7,400	207,940.00	0.06
183	002372	伟星新材	8,560	205,782.40	0.06
184	002223	鱼跃医疗	8,000	205,280.00	0.06
185	300418	昆仑万维	12,800	204,800.00	0.06
186	002506	协鑫集成	55,000	204,600.00	0.06
187	000547	航天发展	17,100	204,174.00	0.06
188	002739	万达电影	14,900	203,385.00	0.06
189	000636	风华高科	10,800	202,932.00	0.06
190	600699	均胜电子	12,860	202,030.60	0.06
191	300253	卫宁健康	23,000	201,940.00	0.06
192	300558	贝达药业	3,300	200,640.00	0.06
193	600372	中航电子	10,300	199,717.00	0.06
194	300296	利亚德	27,300	199,290.00	0.06
195	300308	中际旭创	6,400	198,720.00	0.06
196	600637	东方明珠	27,500	196,625.00	0.06
197	600867	通化东宝	18,900	195,426.00	0.06
198	002683	广东宏大	7,000	194,810.00	0.06
199	603444	吉比特	500	194,000.00	0.06
200	600985	淮北矿业	13,300	193,648.00	0.06
201	601016	节能风电	40,300	193,440.00	0.06
202	600315	上海家化	4,500	192,375.00	0.06
203	601198	东兴证券	21,600	192,240.00	0.06
204	600026	中远海能	18,600	192,138.00	0.06
205	000887	中鼎股份	10,500	191,520.00	0.06
206	002156	通富微电	12,400	190,960.00	0.06
207	002065	东华软件	30,000	189,600.00	0.06
208	300832	新产业	4,200	189,462.00	0.06
209	600879	航天电子	29,100	188,859.00	0.06
210	600380	健康元	15,292	188,856.20	0.06
211	600642	申能股份	32,800	186,304.00	0.06
212	002408	齐翔腾达	22,920	185,881.20	0.06
213	000750	国海证券	51,200	185,856.00	0.06
214	002936	郑州银行	69,070	185,798.30	0.06
215	300026	红日药业	24,100	185,570.00	0.06
216	000513	丽珠集团	5,051	182,896.71	0.05
217	000729	燕京啤酒	18,900	182,574.00	0.05
218	002203	海亮股份	15,800	182,490.00	0.05

219	600801	华新水泥	9,340	182,223.40	0.05
220	600673	东阳光	20,200	181,598.00	0.05
221	000878	云南铜业	15,900	181,101.00	0.05
222	000400	许继电气	9,400	180,480.00	0.05
223	600820	隧道股份	29,400	179,928.00	0.05
224	688185	康希诺	900	179,172.00	0.05
225	600580	卧龙电驱	12,300	177,366.00	0.05
226	600369	西南证券	44,600	177,062.00	0.05
227	600038	中直股份	3,900	176,280.00	0.05
228	002131	利欧股份	90,800	176,152.00	0.05
229	300383	光环新网	16,900	176,098.00	0.05
230	002183	怡亚通	24,400	175,924.00	0.05
231	300017	网宿科技	32,800	175,808.00	0.05
232	600166	福田汽车	61,700	174,611.00	0.05
233	600848	上海临港	12,800	173,568.00	0.05
234	002195	二三四五	76,992	173,232.00	0.05
235	603568	伟明环保	5,181	172,889.97	0.05
236	600316	洪都航空	5,700	172,368.00	0.05
237	600909	华安证券	37,790	171,944.50	0.05
238	601005	重庆钢铁	90,000	171,900.00	0.05
239	600325	华发股份	22,700	171,839.00	0.05
240	600027	华电国际	43,700	171,741.00	0.05
241	601717	郑煤机	11,900	171,479.00	0.05
242	002444	巨星科技	9,100	171,444.00	0.05
243	600008	首创环保	58,910	170,839.00	0.05
244	600155	华创阳安	20,000	169,600.00	0.05
245	688256	寒武纪-U	2,600	168,220.00	0.05
246	300001	特锐德	9,700	167,907.00	0.05
247	600643	爱建集团	28,300	167,819.00	0.05
248	300024	机器人	16,600	167,328.00	0.05
249	000825	太钢不锈	30,600	166,770.00	0.05
250	002500	山西证券	28,970	166,287.80	0.05
251	688119	中钢洛耐	23,646	165,758.46	0.05
252	002926	华西证券	21,100	165,424.00	0.05
253	603218	日月股份	6,500	165,100.00	0.05
254	002939	长城证券	16,200	164,592.00	0.05
255	002373	千方科技	14,800	164,576.00	0.05
256	000027	深圳能源	25,520	163,583.20	0.05
257	601456	国联证券	13,300	163,191.00	0.05
258	300618	寒锐钴业	2,800	162,176.00	0.05
259	600271	航天信息	14,800	161,912.00	0.05
260	000739	普洛药业	7,800	160,992.00	0.05

261	002212	天融信	15,830	160,674.50	0.05
262	688234	天岳先进	2,462	160,497.78	0.05
263	002250	联化科技	9,800	160,426.00	0.05
264	603233	大参林	5,100	159,630.00	0.05
265	601866	中远海发	53,100	159,300.00	0.05
266	600208	新湖中宝	57,700	159,252.00	0.05
267	600118	中国卫星	7,900	158,632.00	0.05
268	688009	中国通号	34,600	156,738.00	0.05
269	000060	中金岭南	35,100	156,546.00	0.05
270	300009	安科生物	15,432	156,017.52	0.05
271	002249	大洋电机	25,300	155,342.00	0.05
272	601992	金隅集团	55,900	154,843.00	0.05
273	688290	景业智能	3,040	154,736.00	0.05
274	000778	新兴铸管	32,100	154,722.00	0.05
275	300677	英科医疗	6,100	154,696.00	0.05
276	600066	宇通客车	17,800	153,970.00	0.05
277	002985	北摩高科	2,603	152,483.74	0.05
278	603156	养元饮品	6,700	152,224.00	0.05
279	300070	碧水源	29,200	152,132.00	0.05
280	002152	广电运通	16,400	152,028.00	0.05
281	300182	捷成股份	27,600	151,800.00	0.05
282	603658	安图生物	3,100	151,559.00	0.05
283	000401	冀东水泥	14,300	150,436.00	0.04
284	300168	万达信息	15,900	150,096.00	0.04
285	603858	步长制药	7,600	149,796.00	0.04
286	002670	国盛金控	15,593	149,692.80	0.04
287	002966	苏州银行	24,530	149,633.00	0.04
288	600998	九州通	12,500	148,875.00	0.04
289	300251	光线传媒	15,700	148,679.00	0.04
290	600390	五矿资本	30,200	147,678.00	0.04
291	600056	中国医药	9,940	147,310.80	0.04
292	600970	中材国际	15,100	146,319.00	0.04
293	002128	电投能源	10,200	146,064.00	0.04
294	000021	深科技	12,500	145,500.00	0.04
295	000997	新大陆	11,000	145,310.00	0.04
296	002505	鹏都农牧	42,700	144,753.00	0.04
297	002244	滨江集团	16,700	144,455.00	0.04
298	600021	上海电力	14,000	143,500.00	0.04
299	300482	万孚生物	3,520	143,299.20	0.04
300	600528	中铁工业	17,800	143,290.00	0.04
301	000656	金科股份	50,100	143,286.00	0.04
302	600062	华润双鹤	5,540	142,156.40	0.04

303	603885	吉祥航空	7,900	142,121.00	0.04
304	600839	四川长虹	49,300	141,984.00	0.04
305	600297	广汇汽车	54,300	141,723.00	0.04
306	600827	百联股份	10,700	141,347.00	0.04
307	603707	健友股份	5,000	141,000.00	0.04
308	002127	南极电商	26,300	140,442.00	0.04
309	600598	北大荒	9,500	140,220.00	0.04
310	301259	艾布鲁	4,828	139,789.02	0.04
311	002048	宁波华翔	8,700	139,374.00	0.04
312	688002	睿创微纳	3,500	139,020.00	0.04
313	600201	生物股份	15,142	138,700.72	0.04
314	002019	亿帆医药	9,900	138,402.00	0.04
315	002266	浙富控股	28,800	137,952.00	0.04
316	600498	烽火通信	9,500	137,560.00	0.04
317	600259	广晟有色	2,700	136,755.00	0.04
318	000012	南玻 A	18,346	136,127.32	0.04
319	002155	湖南黄金	11,200	135,968.00	0.04
320	600409	三友化工	16,600	135,954.00	0.04
321	000883	湖北能源	26,400	134,904.00	0.04
322	000930	中粮科技	14,900	134,696.00	0.04
323	301175	中科环保	35,244	134,632.08	0.04
324	002153	石基信息	8,480	134,577.60	0.04
325	600511	国药股份	5,000	133,900.00	0.04
326	600718	东软集团	11,600	133,516.00	0.04
327	600755	厦门国贸	17,700	132,750.00	0.04
328	002511	中顺洁柔	10,600	132,712.00	0.04
329	000686	东北证券	18,800	131,412.00	0.04
330	600959	江苏有线	40,300	131,378.00	0.04
331	600060	海信视像	10,500	131,250.00	0.04
332	600282	南钢股份	41,200	129,780.00	0.04
333	600895	张江高科	10,400	129,480.00	0.04
334	603712	七一二	4,100	129,150.00	0.04
335	000709	河钢股份	57,000	128,820.00	0.04
336	601880	辽港股份	75,600	128,520.00	0.04
337	600566	济川药业	4,730	128,466.80	0.04
338	601179	中国西电	27,400	128,232.00	0.04
339	600064	南京高科	11,600	127,600.00	0.04
340	000690	宝新能源	29,100	127,458.00	0.04
341	600022	山东钢铁	73,100	127,194.00	0.04
342	688306	均普智能	24,489	127,097.91	0.04
343	600535	天士力	12,000	126,120.00	0.04
344	300376	易事特	15,500	125,860.00	0.04

345	601778	晶科科技	23,300	125,820.00	0.04
346	002701	奥瑞金	24,100	125,320.00	0.04
347	300630	普利制药	3,543	124,536.45	0.04
348	002002	鸿达兴业	33,500	124,285.00	0.04
349	301239	普瑞眼科	3,687	124,067.55	0.04
350	600500	中化国际	18,560	123,424.00	0.04
351	600216	浙江医药	9,000	122,850.00	0.04
352	600808	马钢股份	32,400	122,796.00	0.04
353	000598	兴蓉环境	23,900	122,129.00	0.04
354	600037	歌华有线	13,000	122,070.00	0.04
355	002468	申通快递	10,200	121,584.00	0.04
356	002532	天山铝业	18,600	121,458.00	0.04
357	600728	佳都科技	18,800	121,448.00	0.04
358	688400	凌云光	5,470	119,957.10	0.04
359	600567	山鹰国际	43,300	119,941.00	0.04
360	600517	国网英大	23,000	119,370.00	0.04
361	688208	道通科技	3,600	118,512.00	0.04
362	002595	豪迈科技	5,300	118,402.00	0.04
363	603866	桃李面包	7,133	118,051.15	0.04
364	603225	新凤鸣	10,220	117,938.80	0.04
365	002004	华邦健康	21,100	117,738.00	0.03
366	300463	迈克生物	5,700	116,793.00	0.03
367	002745	木林森	11,900	116,263.00	0.03
368	600597	光明乳业	9,200	116,196.00	0.03
369	688237	超卓航科	2,802	115,638.54	0.03
370	300115	长盈精密	11,200	115,472.00	0.03
371	601958	金钼股份	13,000	114,920.00	0.03
372	300166	东方国信	12,300	113,406.00	0.03
373	300888	稳健医疗	1,700	113,050.00	0.03
374	601860	紫金银行	39,300	112,791.00	0.03
375	002390	信邦制药	16,300	112,633.00	0.03
376	300072	三聚环保	22,000	111,320.00	0.03
377	301151	冠龙节能	4,823	111,139.98	0.03
378	600572	康恩贝	25,000	110,750.00	0.03
379	600398	海澜之家	23,200	110,200.00	0.03
380	601118	海南橡胶	22,900	109,462.00	0.03
381	301288	清研环境	4,516	107,867.44	0.03
382	600737	中粮糖业	14,300	107,536.00	0.03
383	603883	老百姓	3,172	107,467.36	0.03
384	002867	周大生	6,850	106,380.50	0.03
385	000937	冀中能源	14,200	105,932.00	0.03
386	000089	深圳机场	13,700	105,764.00	0.03

387	600582	天地科技	22,100	105,638.00	0.03
388	002010	传化智联	16,400	105,452.00	0.03
389	000559	万向钱潮	17,700	105,138.00	0.03
390	002368	太极股份	5,420	104,118.20	0.03
391	600967	内蒙一机	11,400	103,968.00	0.03
392	600435	北方导航	12,002	103,457.24	0.03
393	000898	鞍钢股份	32,100	103,362.00	0.03
394	002690	美亚光电	4,760	103,196.80	0.03
395	001914	招商积余	5,700	102,429.00	0.03
396	002110	三钢闽光	16,450	100,180.50	0.03
397	600556	天下秀	12,100	99,583.00	0.03
398	000959	首钢股份	20,900	99,484.00	0.03
399	601333	广深铁路	45,600	99,408.00	0.03
400	002233	塔牌集团	11,200	99,120.00	0.03
401	000156	华数传媒	12,400	98,828.00	0.03
402	002281	光迅科技	5,600	98,448.00	0.03
403	600811	东方集团	34,200	96,786.00	0.03
404	002705	新宝股份	4,400	96,756.00	0.03
405	000050	深天马 A	9,700	96,709.00	0.03
406	000537	广宇发展	7,400	96,126.00	0.03
407	301135	瑞德智能	3,376	96,066.48	0.03
408	600764	中国海防	3,800	95,912.00	0.03
409	002174	游族网络	9,800	95,746.00	0.03
410	600507	方大特钢	13,594	95,022.06	0.03
411	000402	金融街	15,900	94,605.00	0.03
412	603638	艾迪精密	4,580	93,890.00	0.03
413	600329	达仁堂	3,800	93,404.00	0.03
414	002416	爱施德	10,040	93,372.00	0.03
415	600126	杭钢股份	18,180	93,081.60	0.03
416	003022	联泓新科	2,800	93,044.00	0.03
417	300212	易华录	5,320	92,568.00	0.03
418	000488	晨鸣纸业	16,400	92,496.00	0.03
419	002925	盈趣科技	4,270	91,890.40	0.03
420	601200	上海环境	9,030	91,744.80	0.03
421	600446	金证股份	8,800	91,344.00	0.03
422	000990	诚志股份	8,300	90,885.00	0.03
423	000685	中山公用	11,800	90,624.00	0.03
424	601098	中南传媒	9,600	90,624.00	0.03
425	002081	金螳螂	17,800	90,424.00	0.03
426	002382	蓝帆医疗	9,400	89,770.00	0.03
427	000158	常山北明	14,900	89,400.00	0.03
428	601611	中国核建	10,600	88,934.00	0.03

429	601608	中信重工	23,300	88,307.00	0.03
430	002146	荣盛发展	29,100	88,173.00	0.03
431	002399	海普瑞	5,000	87,900.00	0.03
432	001965	招商公路	11,500	87,745.00	0.03
433	002387	维信诺	13,000	87,360.00	0.03
434	688029	南微医学	1,000	87,200.00	0.03
435	603317	天味食品	3,044	86,662.68	0.03
436	000967	盈峰环境	17,100	86,526.00	0.03
437	600131	国网信通	6,400	86,080.00	0.03
438	688088	虹软科技	2,700	85,293.00	0.03
439	600376	首开股份	17,300	84,943.00	0.03
440	301110	青木股份	1,976	84,877.70	0.03
441	000528	柳工	13,000	84,630.00	0.03
442	600667	太极实业	11,400	84,132.00	0.02
443	600373	中文传媒	8,400	83,916.00	0.02
444	600623	华谊集团	10,100	83,830.00	0.02
445	603000	人民网	7,400	82,880.00	0.02
446	600307	酒钢宏兴	42,100	81,674.00	0.02
447	603228	景旺电子	3,448	80,441.84	0.02
448	600006	东风汽车	10,600	80,030.00	0.02
449	300257	开山股份	5,300	79,288.00	0.02
450	603650	彤程新材	2,400	78,192.00	0.02
451	600717	天津港	19,320	77,473.20	0.02
452	002124	天邦食品	11,500	77,280.00	0.02
453	002434	万里扬	8,800	75,240.00	0.02
454	000718	苏宁环球	20,300	74,704.00	0.02
455	601928	凤凰传媒	10,200	72,930.00	0.02
456	000671	阳光城	33,200	72,708.00	0.02
457	600663	陆家嘴	7,000	72,520.00	0.02
458	002958	青农商行	21,800	72,376.00	0.02
459	000553	安道麦 A	5,800	70,238.00	0.02
460	600968	海油发展	27,200	70,176.00	0.02
461	601969	海南矿业	8,100	69,579.00	0.02
462	000031	大悦城	17,200	68,800.00	0.02
463	600648	外高桥	5,000	68,000.00	0.02
464	600787	中储股份	11,808	67,187.52	0.02
465	600928	西安银行	17,900	65,693.00	0.02
466	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.02
467	000540	中天金融	33,700	65,041.00	0.02
468	600339	中油工程	22,300	64,447.00	0.02
469	601228	广州港	16,500	60,555.00	0.02
470	002815	崇达技术	4,700	60,207.00	0.02

471	600835	上海机电	4,300	59,039.00	0.02
472	600657	信达地产	8,500	58,565.00	0.02
473	000717	韶钢松山	16,200	56,700.00	0.02
474	000028	国药一致	1,900	56,601.00	0.02
475	600377	宁沪高速	6,600	56,562.00	0.02
476	688819	天能股份	1,600	55,328.00	0.02
477	603056	德邦股份	4,100	55,063.00	0.02
478	002945	华林证券	3,600	54,900.00	0.02
479	002429	兆驰股份	14,000	53,760.00	0.02
480	601139	深圳燃气	7,600	52,744.00	0.02
481	600299	安迪苏	5,400	51,732.00	0.02
482	601298	青岛港	9,400	51,418.00	0.02
483	601869	长飞光纤	1,600	49,472.00	0.01
484	601991	大唐发电	20,300	49,329.00	0.01
485	601598	中国外运	12,700	49,276.00	0.01
486	688321	微芯生物	1,900	47,861.00	0.01
487	001872	招商港口	3,000	46,800.00	0.01
488	300741	华宝股份	1,650	45,903.00	0.01
489	603868	飞科电器	600	45,450.00	0.01
490	002653	海思科	2,800	45,108.00	0.01
491	600823	世茂股份	15,000	44,700.00	0.01
492	601828	美凯龙	7,200	43,632.00	0.01
493	600350	山东高速	7,800	40,950.00	0.01
494	603355	莱克电气	1,598	40,317.54	0.01
495	603719	良品铺子	1,400	40,082.00	0.01
496	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.01
497	603515	欧普照明	2,080	36,296.00	0.01
498	603786	科博达	500	30,785.00	0.01
499	002946	新乳业	2,300	29,877.00	0.01
500	601003	柳钢股份	6,800	27,540.00	0.01
501	301238	瑞泰新材	787	25,239.09	0.01
502	002901	大博医疗	600	23,484.00	0.01
503	301266	宇邦新材	494	23,252.58	0.01
504	601568	北元集团	3,520	22,316.80	0.01
505	301162	国能日新	334	18,072.74	0.01
506	301112	信邦智能	399	17,970.96	0.01
507	301268	铭利达	481	16,772.47	0.00
508	600917	重庆燃气	2,300	16,606.00	0.00
509	301206	三元生物	354	16,174.26	0.00
510	301217	铜冠铜箔	1,086	16,105.38	0.00
511	603983	丸美股份	600	16,080.00	0.00
512	301120	新特电气	1,032	15,985.68	0.00

513	301207	华兰疫苗	276	15,571.92	0.00
514	301286	侨源股份	784	15,515.36	0.00
515	301187	欧圣电气	684	15,417.36	0.00
516	301160	翔楼新材	392	14,762.72	0.00
517	301117	佳缘科技	262	14,263.28	0.00
518	301302	华如科技	244	13,766.48	0.00
519	600956	新天绿能	1,100	13,552.00	0.00
520	301153	中科江南	303	13,325.94	0.00
521	301298	东利机械	634	13,206.22	0.00
522	301200	大族数控	246	12,772.32	0.00
523	301116	益客食品	577	11,805.42	0.00
524	301219	腾远钴业	130	11,416.60	0.00
525	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
526	301220	亚香股份	285	11,157.75	0.00
527	301222	浙江恒威	332	9,614.72	0.00
528	301100	风光股份	427	9,214.66	0.00
529	301125	腾亚精工	327	8,966.34	0.00
530	301163	宏德股份	277	8,955.41	0.00
531	301158	德石股份	379	7,724.02	0.00
532	301228	实朴检测	373	7,586.82	0.00
533	600058	五矿发展	1	10.24	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	300363	博腾股份	11,196,746.00	2.75
2	688005	容百科技	10,093,482.29	2.48
3	000988	华工科技	9,010,533.00	2.21
4	600486	扬农化工	8,901,282.00	2.19
5	002985	北摩高科	6,861,875.50	1.69
6	002268	卫士通	6,811,182.00	1.67
7	600399	抚顺特钢	6,307,104.00	1.55
8	300244	迪安诊断	6,300,249.55	1.55
9	300699	光威复材	6,276,420.00	1.54
10	600739	辽宁成大	6,210,568.00	1.53
11	600566	济川药业	5,840,802.10	1.44
12	688521	芯原股份-U	5,824,484.97	1.43
13	603290	斯达半导	5,715,034.00	1.40
14	300474	景嘉微	5,705,378.00	1.40
15	600884	杉杉股份	5,605,749.06	1.38
16	603198	迎驾贡酒	5,012,040.00	1.23

17	601000	唐山港	4,885,785.96	1.20
18	600536	中国软件	4,816,933.32	1.18
19	300168	万达信息	4,693,829.00	1.15
20	000961	中南建设	4,573,179.00	1.12

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	603290	斯达半导	8,918,257.00	2.19
2	603077	和邦生物	8,176,239.00	2.01
3	600566	济川药业	7,181,458.00	1.77
4	600884	杉杉股份	6,631,596.90	1.63
5	300244	迪安诊断	6,435,198.00	1.58
6	002985	北摩高科	6,334,577.19	1.56
7	600153	建发股份	5,932,800.35	1.46
8	600536	中国软件	5,676,064.00	1.40
9	300168	万达信息	5,025,681.00	1.24
10	600516	方大炭素	4,879,912.86	1.20
11	002340	格林美	4,738,133.79	1.16
12	001914	招商积余	4,395,384.00	1.08
13	600487	亨通光电	3,728,704.00	0.92
14	688005	容百科技	3,356,432.55	0.82
15	000807	云铝股份	3,283,250.00	0.81
16	600188	兖矿能源	3,194,162.00	0.79
17	002085	万丰奥威	2,875,505.00	0.71
18	000799	酒鬼酒	2,712,450.26	0.67
19	300133	华策影视	2,594,962.00	0.64
20	601868	中国能建	2,281,059.20	0.56

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	338,660,735.20
卖出股票收入（成交）总额	207,961,665.67

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	14,157,126.03	4.21

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）	494,261.52	0.15
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	14,651,387.55	4.35

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	019666	22 国债 01	140,000	14,157,126.03	4.21
2	128114	正邦转债	4,560	494,261.52	0.15

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

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

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

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

重庆博腾制药科技股份有限公司在报告编制日前一年内受到中华人民共和国涪陵海关的处罚。

宁波容百新能源科技股份有限公司在报告编制日前一年内受到余姚市应急管理局的处罚。

抚顺特殊钢股份有限公司在报告编制日前一年内受到抚顺市生态环境局的处罚。

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	98,830.56
2	应收清算款	104,725.21
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	37,474.61
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	241,030.38

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	128114	正邦转债	494,261.52	0.15

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	户均持有的	持有人结构
-------	-------	-------

(户)	基金份额	机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
1,752	98,197.68	147,971,885.26	86.01	24,070,448.27	13.99

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	1,300,339.64	0.7558

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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

注：截至本报告期末，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 (2018 年 5 月 30 日) 基金份额总额	214,008,175.33
本报告期期初基金份额总额	202,386,382.33
本报告期基金总申购份额	38,469,440.64
减：本报告期基金总赎回份额	68,813,489.44
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	172,042,333.53

§ 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。

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，基金托管人无重大人事变动。

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

无。

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 (%)	
天风证券	2	186,869,457.17	34.74	157,059.31	32.89	-
浙商证券	1	177,711,994.35	33.04	163,191.96	34.17	-
中泰证券	2	149,567,621.19	27.81	137,699.97	28.84	-
开源证券	2	20,425,053.91	3.80	16,776.26	3.51	本报告期新增
国海证券	2	2,330,965.93	0.43	1,914.06	0.40	本报告期新增
安信证券	2	660,634.00	0.12	608.64	0.13	-
招商证券	1	321,442.97	0.06	293.00	0.06	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方财富证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-

光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	本报告期新增
摩根大通证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
中信建投证券	1	-	-	-	-	-
中原证券	1	-	-	-	-	-

注：交易单元选择的标准和程序：

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

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

2) 选择交易单元的程序：

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

用交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
天风证券	-	-	5,238,300,000.00	74.53	-	-
浙商证券	510,393.31	0.16	20,100,000.00	0.29	-	-
中泰证券	6,006,000.00	1.89	1,460,400,000.00	20.78	-	-
开源证券	-	-	57,600,000.00	0.82	-	-
国海证券	-	-	31,900,000.00	0.45	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	271,760,400.00	85.38	58,000,000.00	0.83	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	40,011,500.00	12.57	162,400,000.00	2.31	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
摩根大通证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-

信达证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中信建投 证券	-	-	-	-	-	-
中原证券	-	-	-	-	-	-

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	《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
3	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 01 月 20 日
4	鹏华睿投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
6	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
7	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
8	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
9	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
10	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与杭州银行股份有限公司同业代销基金平台认/申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 03 月 04 日

11	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
12	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（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 14 日
13	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
14	鹏华睿投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
15	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
16	鹏华睿投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
17	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
18	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
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 27 日
20	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
21	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
22	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
23	鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金更新的招募说明书	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会	2022 年 05 月 13 日

		基金电子披露网站	
24	鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 05 月 13 日
25	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
26	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
27	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	《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 06 日
28	鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金恢复大额申购、转换转入和定期定额投资业务的公告	《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 06 月 16 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	《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）《鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- （二）《鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- （三）《鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金 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