

鹏华策略回报灵活配置混合型证券投资基金

金

2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2023 年 3 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 03 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 2022 年 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	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	10
3.4 过去三年基金的利润分配情况	10
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	16
4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	16
§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	16
§ 6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
§ 7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	19
7.3 净资产（基金净值）变动表	21
7.4 报表附注	24

§ 8 投资组合报告	60
8.1 期末基金资产组合情况	60
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	60
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	61
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	76
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	77
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	78
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	78
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	78
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	78
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	78
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	78
8.12 投资组合报告附注	78
§ 9 基金份额持有人信息	79
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	79
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	79
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	79
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	80
§ 10 开放式基金份额变动	80
§ 11 重大事件揭示	80
11.1 基金份额持有人大会决议	80
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	80
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	81
11.4 基金投资策略的改变	81
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	81
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	81
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	81
11.8 其他重大事件	83
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	87
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	87
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	87
§ 13 备查文件目录	87
13.1 备查文件目录	87
13.2 存放地点	87
13.3 查阅方式	87

§ 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	190,440,874.18 份
基金合同存续期	不定期

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</p>

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间 数据和指标	2022 年	2021 年	2020 年
本期已实现 收益	-28,138,376.05	240,784,712.14	223,093,556.92
本期利润	-83,890,376.43	-43,994,089.56	354,725,039.43
加权平均基 金份额本期 利润	-0.4234	-0.1813	0.8130
本期加权平	-24.85%	-8.71%	55.89%

均净值利润率			
本期基金份额净值增长率	-20.69%	-8.91%	83.87%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
期末可供分配利润	109,805,973.15	206,775,265.18	234,087,206.96
期末可供分配基金份额利润	0.5766	0.9879	0.7617
期末基金资产净值	300,246,847.33	416,075,128.75	670,680,462.64
期末基金份额净值	1.5766	1.9879	2.1824
3.1.3 累计期末指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
基金份额累计净值增长率	92.00%	142.09%	165.77%

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 12 月 31 日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

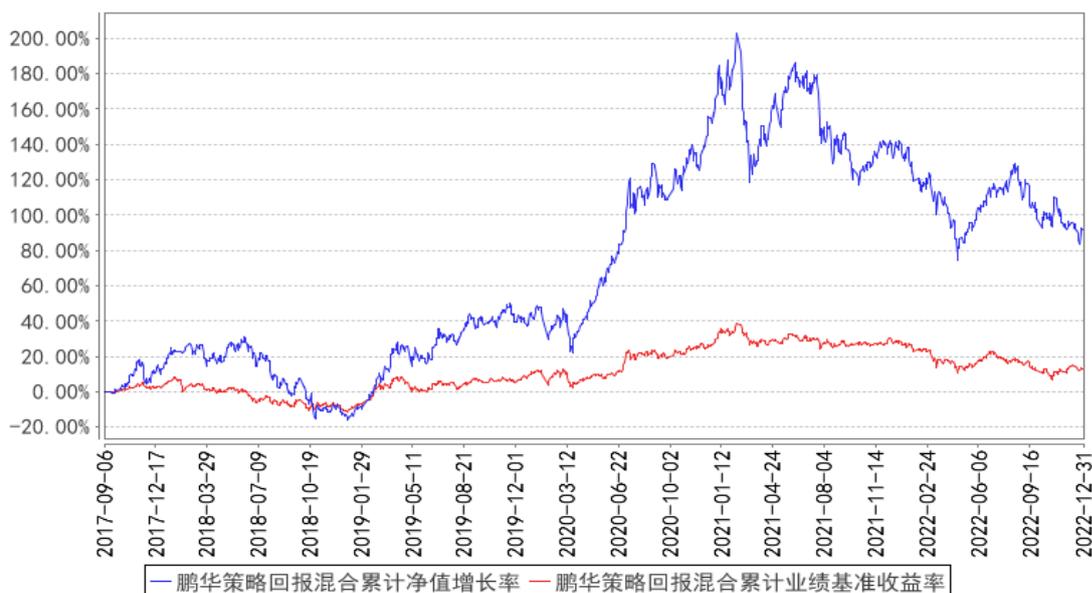
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-3.08%	1.30%	1.16%	0.77%	-4.24%	0.53%
过去六个月	-9.57%	1.30%	-7.73%	0.66%	-1.84%	0.64%
过去一年	-20.69%	1.40%	-12.04%	0.77%	-8.65%	0.63%
过去三年	32.83%	1.67%	2.68%	0.78%	30.15%	0.89%

过去五年	70.56%	1.65%	10.05%	0.78%	60.51%	0.87%
自基金合同生效起至今	92.00%	1.63%	13.04%	0.76%	78.96%	0.87%

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

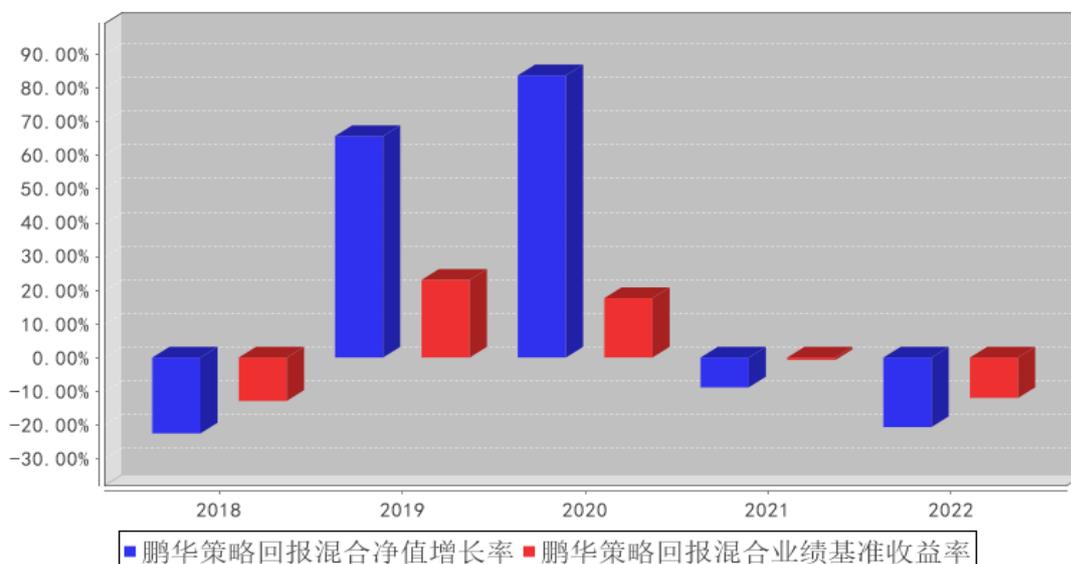
鹏华策略回报混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

鹏华策略回报混合基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按照实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 其他指标

注：无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

注：无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

鹏华基金管理有限公司成立于 1998 年 12 月 22 日，业务范围包括基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。截至本报告期末，公司股东由国信证券股份有限公司、意大利欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）、深圳市北融信投资发展有限公司组成，公司性质为中外合资企业，公司注册资本 15,000 万元人民币。截至本报告期末，公司管理资产总规模达到 11137.97 亿元，284 只公募基金、13 只全国社保投资组合、6 只基本养老保险投资组合。经过 20 余年投资管理基金，在基金投资、风险控制等方面积累了丰富经验。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
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。

4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

本报告期内，本基金运作合规，不存在违反基金合同和损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《鹏华基金管理有限公司公平交易管理规定》，将公司所管理的封闭式基金、开放式基金、社保组合、养老组合、特定客户资产管理组合等不同资产组合的授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动均纳入公平交易管理，在业务流程和岗位职责中制定公平交易的控制规则和控制活动，建立对公平交易的执行、监督及审核流程，严禁在不同投资组合之间进行利益输送。

在投资研究环节：1、公司使用唯一的研究报告发布平台“研究报告管理平台”，确保各投资组合在获得投资信息、研究支持、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；2、公司严格按照《股票库管理规定》、《信用债券投资与风险控制管理规定》，执行股票及信用产品出入库及日常维护工作，确保相关证券入库以内容严谨、观点明确的研究报告作为依据；3、在公司股票库基础上，各涉及股票投资的资产组合根据各自的投资目标、投资风格、投资范围和防范关联交易的原则分别建立资产组合股票库，基金经理在股票库基础上根据投资授权以及基金合同择股方式构建具体的投资组合；4、严格执行投资授权制度，明确投资决策委员会、分管投资副总裁、基金经理等各主体的职责和权限划分，合理确定基金经理的投资权限，超过投资权限的操作，应严格履行审批程序。

在交易执行环节：1、所有公司管理的资产组合的交易必须通过集中交易室完成，集中交易室负责建立和执行交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会；2、针对交易所公开竞价交易，集中交易室应严格启用恒生交易系统内的公平交易程序，交易系统则自动启用公平交易功能，由系统按照“未委托数量”的比例对不同资产组合进行委托量的公平分配；如果相关基金经理坚持以不同的价格进行交易，且当前市场价格不能同时满足多个资产组合的指令价格要求

时，交易系统自动按照“价格优先”原则进行委托；当市场价格同时满足多个资产组合的指令价格要求时，则交易系统自动按照“同一指令价格下的公平交易”模式，进行公平委托和交易量分配；3、银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易需依据公司《股票投资交易流程》和《固定收益投资管理流程》的规定执行；银行间市场交易、交易所大宗交易等以公司名义进行的交易，各投资组合经理应在交易前独立确定各投资组合的交易价格和数量，公司按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；4、新股、新债申购及非公开定向增发交易需依据公司《新股申购流程》、《固定收益投资管理流程》和《非公开定向增发流程》的规定执行，对新股和新债申购方案和分配过程进行审核和监控。

在交易监控、分析与评估环节：1、为加强对日常投资交易行为的监控和管理，杜绝利益输送、不公平交易等违规交易行为，防范日常交易风险，公司明确了关注类交易的界定及对应的监控和评估措施机制；所监控的交易包括但不限于：交易所公开竞价交易中同日同向交易的交易时机和交易价差、不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差、关联交易、债券交易收益率偏离度、成交量和成交价格异常、银行间债券交易对手交易等；2、将公平交易作为投资组合业绩归因分析和交易绩效评价的重要关注内容，发现的异常情况由投资监察员进行分析；3、风控管理部分别于每季度和每年度编写《公平交易执行情况检查报告》，内容包括关注类交易监控执行情况、不同投资组合的整体收益率差异分析和同向交易价差分析。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行公平交易制度，确保不同投资组合在研究、交易、分配各环节得到公平对待。公司对不同投资组合在不同时间窗口下（日内、3日内、5日内）的同向交易价差进行专项分析，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022 年 A 股整体呈下跌趋势，其中年初到 4 月底经历了持续的大幅的调整，各板块普跌，中小成长风格跌幅大于大盘价值风格，5 月到 8 月出现了强劲的反弹，以风光储汽车为代表的的成

长风格占优，8月到10月市场调整，各类风格普跌，最后两个月以疫情政策快速调头为标志，消费复苏线快速反弹，其余风格波动。22年全年呈现很复杂的走势，指数波动较大，风格轮动频繁，除煤炭等少数板块外无全年强势主线，期间夹杂着机器人、信创、元宇宙等多个短周期主题，大趋势向下，结构上无明显主线，风格上多次轮动，对投资带来了较大的挑战。

2022年内外部环境也在发生着剧烈的变化，海外俄乌冲突爆发，疫情进入以应对变异病毒和防范政策剧烈分歧的后疫情时代，美国货币政策经历了强势鹰派的加息周期，并逐步在年底开始放缓，国内经济受疫情影响较大，居民和企业的信心收敛，房地产消费制造业投资等经济的重要引擎放缓，到4季度在政策面发生了重大变化，一是中央经济会议重点强调了稳消费稳增长的思路，二是地产政策和防疫政策快速的调头，回顾整个2022年，是产业政策，防疫政策和流动性主导的一年，这对基金经理对政策的敏感性、对宏观环境的理解深度，操作的灵活性都提出了很高的要求。

在产品的操作上，全年操作未做仓位择时，保持了90%左右的仓位水平。在市场各阶段中，1到4月风光汽车等赛道持续调整，主要操作是在3月份和4月底两个时点，逆势加仓了汽车零部件、军工和新能源等制造业成长板块。5到11月市场结构分化成长占优，操作上保持了均衡偏成长的持仓结构，成长股占比过半，有较显著超额收益。11到12月，疫情和地产政策变化，市场风格切换，消费地产医药占优，期间除了小幅加仓复苏线外，坚持成长风格，跑输市场。结构上，核心仓位以制造业为主，包括汽车智能化、POE材料、风光储、大圆柱电池、半导体等领域，主要围绕着制造业变化最大的最有前景的领域进行投资，边际上的仓位调整主要是加仓消费复苏和医药领域，结构上均衡偏成长。在制造业核心优质标的上，选择了逢低小幅加仓的策略，这些公司本身的逻辑和资质没有变化，大部分的业绩也呈现环比持续提升的趋势，经受住了疫情的考验，股价也有所调整，因此在下跌过程中选择了坚守和小幅加仓。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期鹏华策略回报混合份额净值增长率为-20.69%，同期业绩比较基准增长率为-12.04%。

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2023年，内外部环境上都预示着23年有相对22年好的投资环境。国内需求复苏，供给开工端难以再看到去年四月份大停摆的局面，美国的核心通胀数据的压力边际减弱，加息预期也是阶梯状的向下走。我这边和市场比较一致的预期是，大部分行业都有机会，像广义的复苏线，像资产价格周期偏底部的医药和TMT。

这其中我自己还是比较看好泛制造业，首先复苏条线不只限于消费地产旅游出行等板块，像

通用设备大宗化工品汽车新能源电子等制造业也都直接或者间接受益于复苏，制造业不仅受益于复苏周期，也有持续成长的动能，中期向内替代，远期向外出海，竞争优势的趋势是在加强的，其中存量具有比较优势持续成长的白马，以及增量的新技术和新的产业趋势，都是我比较关注的方向，例如大宗品行业中大规模资本开支的公司，具备成本优势以及向下游拓展的优势，匹配新能源消纳的电网体系改造和储能建设，新材料领域内的芳纶和 OLED 材料，汽车智能化底盘座椅后视镜热管理阀件等零部件，通用自动化领域的国产替代空间比较大，钙钛矿和 4680 电池等新能源新技术等等，在泛制造业领域内具备成长空间和比较优势的板块与个股都是我重点关注的方向。

此外应重点关注通胀风险，通胀最大的问题是供给侧资本开支不够的因素推动，虽然通过需求侧弱势消化或者加息抑制住，但是需求端一旦起来，以及受制于美国经济走弱一旦加息周期停止，通胀的风险依然存在，其实去年的煤炭板块能看到一些端倪。

整体上 23 年比较乐观，同时也要总结 22 年的问题以期待更快的成长和更好的投资收益。

再多说两句自己的底层体系，在过去年、季报中多次提及的不忘初心，这一处处屡见不鲜的概念，于我有独特的心路历程，是逐步形成的理念，所以比较坚定。概括来说是从对个人价值的追求到社会价值社会责任的转变。每天面临各种选择和迷惑的时候，只有想起这份事业的初心，内心才会归于平静。这份事业一边背负数万个家庭日积月累的财富，一边见到的是形形色色的企业和人，有些炒概念赚快钱割韭菜毁灭价值，有些则扎扎实实做研发磨产品数十年如一日创造价值，我的初心是一边感念基民的信任，进而负起被信任的责任，一边把资源优化配置到创造价值的企业家手中，与他们分享成长的成果。只有保持这份初心，才有信心拨开噪音，才能够剥离无效的内耗，每一步都有进步。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

1、继续完善内部控制体系

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

2、规范基金销售业务，保证基金销售业务的合法合规性

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

3、开展以风险为导向的内部稽核

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

此外，在投资日常合规监控工作方面，公司根据法律法规和产品特点进一步完善了投资合规风控制度流程及投资监控系统，加强对投资限制的监控提示；持续完善公平交易、异常交易等监测管控机制，在实现交易价差分析、银行间交易分析、研究报告检查等专项检查工作定期化、日常化的基础上，公司多次开展有关内幕交易、未公开信息等重要内容的合规培训，进一步强化全体投研人员的合规意识。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

- 1、截止本报告期末，本基金期末可供分配利润为 109,805,973.15 元，期末基金份额净值 1.5766 元。
- 2、本基金本报告期内未进行利润分配。
- 3、根据相关法律法规及本基金基金合同的规定，本基金管理人将会综合考虑各方面因素，在严格遵守规定前提下，对本报告期内可供分配利润适时作出相应安排。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本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 年年度报告中财务指标、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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2023)第 23843 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	鹏华策略回报灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了鹏华策略回报灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“鹏华策略回报混合基金”)的财务报表,包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表,2022 年度的利润表和净资产(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会</p>

	<p>计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了鹏华策略回报混合基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于鹏华策略回报混合基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	无。
其他事项	无。
其他信息	无。
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>鹏华策略回报混合基金的基金管理人鹏华基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估鹏华策略回报混合基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算鹏华策略回报混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督鹏华策略回报混合基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p>

	<p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对鹏华策略回报混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致鹏华策略回报混合基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	单峰 胡莲莲
会计师事务所的地址	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
审计报告日期	2023 年 3 月 27 日

§ 7 年度财务报表

7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	26,482,208.83	54,999,766.11
结算备付金		1,019,076.68	1,532,351.36
存出保证金		87,220.82	122,120.77
交易性金融资产	7.4.7.2	257,246,448.82	364,371,229.65
其中：股票投资		257,020,036.52	364,371,229.65
基金投资		-	-
债券投资		226,412.30	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	12,021,405.48	-
债权投资	7.4.7.5	-	-

其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		4,886,458.51	324,772.56
应收股利		-	-
应收申购款		29,065.86	112,927.13
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	4,412.55
资产总计		301,771,885.00	421,467,580.13
负债和净资产	附注号	本期末 2022年12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		243,597.95	3,371,831.10
应付赎回款		103,782.44	535,544.21
应付管理人报酬		383,526.59	525,884.46
应付托管费		63,921.13	87,647.40
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.69	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	730,208.87	871,544.21
负债合计		1,525,037.67	5,392,451.38
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	190,440,874.18	209,299,863.57
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	109,805,973.15	206,775,265.18
净资产合计		300,246,847.33	416,075,128.75
负债和净资产总计		301,771,885.00	421,467,580.13

注：报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.5766 元，基金份额总额 190,440,874.18 份。

7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-77,804,309.47	-32,007,437.51
1. 利息收入		236,283.16	261,452.68
其中：存款利息收入	7.4.7.13	167,225.39	209,497.69
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		69,057.77	51,954.99
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-22,340,891.97	251,666,300.91
其中：股票投资收益	7.4.7.14.2	-24,752,303.99	249,117,734.01
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	50.59	-
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	2,411,361.43	2,548,566.90
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）	7.4.7.20	-55,752,000.38	-284,778,801.70
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	52,299.72	843,610.60
减：二、营业总支出		6,086,066.96	11,986,652.05
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	5,070,076.70	7,615,127.23
2. 托管费	7.4.10.2.2	845,012.75	1,269,187.89
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		0.09	-
8. 其他费用	7.4.7.23	170,977.42	3,102,336.93

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-83,890,376.43	-43,994,089.56
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-83,890,376.43	-43,994,089.56
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-83,890,376.43	-43,994,089.56

7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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）	-18,858,989.39	-	-96,969,292.03	-115,828,281.42
（一）、综合收益总额	-	-	-83,890,376.43	-83,890,376.43
（二）、本期基金份额交易产	-18,858,989.39	-	-13,078,915.60	-31,937,904.99

生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)				
其中:1. 基金申购款	17,024,001.64	-	12,078,110.77	29,102,112.41
2. 基金赎回款	-35,882,991.03	-	-25,157,026.37	-61,040,017.40
(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、本期末净资产(基金净值)	190,440,874.18	-	109,805,973.15	300,246,847.33
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31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)	-98,009,605.82	-	-156,595,728.07	-254,605,333.89
(一)、综合收益总额	-	-	-43,994,089.56	-43,994,089.56
(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)	-98,009,605.82	-	-112,601,638.51	-210,611,244.33
其中:1.基金申购款	97,272,718.17	-	110,242,395.99	207,515,114.16
2.基金赎回款	-195,282,323.99	-	-222,844,034.50	-418,126,358.49
(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)	209,299,863.57	-	206,775,265.18	416,075,128.75

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

邓召明

邢彪

郝文高

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

鹏华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。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、《资产管理产品相关会计处理规定》(财会[2022]14号)、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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2022 年度财务报表符合企业会计准则的要求, 真实、完整地反映了本基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

新金融工具准则

金融工具, 是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时, 确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为: 以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具, 分别采用以下两种方式进行计量:

以摊余成本计量:

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标, 且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致, 即在特定日期产生的现金流量, 仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益:

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具, 以公允价值计量且其变动计入当期损

益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具；即不包含付款的合同义务且享有发行人净资产和剩余收益的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债的分类

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

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

(1) 金融资产的分类

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

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

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

(2) 金融负债的分类

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

7.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

新金融工具准则

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

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金在上一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本基金利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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

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

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公

允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

新金融工具准则

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

人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

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

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

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

新金融工具准则

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

计算方法确认。

以摊余成本计量的负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

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

7.4.4.13 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

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

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

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于2017年颁布了修订后的《企业会计准则第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，财政部于2022年颁布了《关于印发〈资产管理产品相关会计处理规定〉的通知》(财会[2022]14号)，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

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。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 税项

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

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳

增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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

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

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

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

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	26,482,208.83	54,999,766.11
等于：本金	26,478,947.78	54,999,766.11
加：应计利息	3,261.05	-
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	26,482,208.83	54,999,766.11

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	263,082,701.37	-	257,020,036.52	-6,062,664.85	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	181,000.00	51.40	226,412.30	45,360.90
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	181,000.00	51.40	226,412.30	45,360.90
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	263,263,701.37	51.40	257,246,448.82	-6,017,303.95	
项目	上年度末 2021年12月31日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	314,636,533.22	-	364,371,229.65	49,734,696.43	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	-	
	银行间市场	-	-	-	
	合计	-	-	-	
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	314,636,533.22	-	364,371,229.65	49,734,696.43	

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

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	12,021,405.48	-
银行间市场	-	-
合计	12,021,405.48	-
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

7.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应收利息	-	4,412.55
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	4,412.55

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	166.72	1,143.14
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	560,042.15	670,401.07
其中：交易所市场	560,042.15	670,401.07
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	170,000.00	200,000.00
合计	730,208.87	871,544.21

7.4.7.10 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 12 月 31 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	17,024,001.64	17,024,001.64
本期赎回（以“-”号填列）	-35,882,991.03	-35,882,991.03
- 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	190,440,874.18	190,440,874.18

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.11 其他综合收益

注：无。

7.4.7.12 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	-28,138,376.05	-55,752,000.38	-83,890,376.43
本期基金份额交易产生的变动数	-31,395,536.37	18,316,620.77	-13,078,915.60
其中：基金申购款	28,624,666.85	-16,546,556.08	12,078,110.77
基金赎回款	-60,020,203.22	34,863,176.85	-25,157,026.37
本期已分配利润	-	-	-
本期末	310,897,649.44	-201,091,676.29	109,805,973.15

7.4.7.13 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12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
活期存款利息收入	149,068.36	198,530.39
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	16,151.26	10,085.18
其他	2,005.77	882.12
合计	167,225.39	209,497.69

注：其他包含认/申购款利息收入、结算保证金利息收入、风控金利息收入等

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 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12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-24,752,303.99	249,117,734.01
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	-24,752,303.99	249,117,734.01

7.4.7.14.2 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12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
卖出股票成交总额	1,404,724,732.85	1,030,831,494.10
减：卖出股票成本总额	1,425,373,355.16	781,713,760.09
减：交易费用	4,103,681.68	-
买卖股票差价收入	-24,752,303.99	249,117,734.01

7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 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12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
债券投资收益——利息收入	50.59	-
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	50.59	-

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月 31日
股票投资产生的股利收益	2,411,361.43	2,548,566.90
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	2,411,361.43	2,548,566.90

7.4.7.20 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 12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021 年12月31日
1. 交易性金融资产	-55,752,000.38	-284,778,801.70
股票投资	-55,797,361.28	-284,778,801.70
债券投资	45,360.90	-
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	-55,752,000.38	-284,778,801.70

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021 年12月31日
基金赎回费收入	51,743.54	834,705.44
基金转换费收入	556.18	8,905.16
合计	52,299.72	843,610.60

7.4.7.22 信用减值损失

注：无。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12 月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31 日
审计费用	50,000.00	80,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费用	975.00	865.00
交易费用	-	2,901,471.93
存托服务费	2.42	-

合计	170,977.42	3,102,336.93
----	------------	--------------

7.4.7.24 分部报告

无。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

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

注：1、本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

2、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例（%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例（%）
国信证券	237,215,202.55	8.60	659,098,852.25	35.57

7.4.10.1.2 债券交易

注：无。

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)
国信证券	19,203,000.00	4.90	60,000,000.00	35.15

7.4.10.1.4 权证交易

注：无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
国信证券	218,433.52	8.97	38,561.10	6.89
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
国信证券	600,803.89	36.29	97,307.38	14.51

注：（1）佣金的计算公式

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

（佣金比率按照与一般证券公司签订的协议条款订立。）

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

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	5,070,076.70	7,615,127.23
其中：支付销售机构的客户维护费	1,561,962.59	2,026,102.02

注：1、支付基金管理人鹏华基金公司的管理人报酬年费率为1.50%，逐日计提，按月支付。日管

理费=前一日基金资产净值×1.50%÷当年天数。

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

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12 月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	845,012.75	1,269,187.89

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。

7.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：无。

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

注：无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31 日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
-------	---------------------------------	----------------------------------

	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	26,482,208.83	149,068.36	54,999,766.11	198,530.39

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。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
国信证券	301338	凯格精机	网下申购	2,568	118,975.44
国信证券	688231	隆达股份	网下申购	3,047	119,076.76
国信证券	688401	路维光电	网下申购	4,947	124,070.76
国信证券	301161	唯万密封	网下申购	3,460	64,563.60
国信证券	688244	永信至诚	网下申购	1,506	74,080.14
上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
国信证券	301091	深城交	网下申购	3,318	121,107.00
国信证券	300957	贝泰妮	网下申购	2,983	141,185.39
国信证券	301066	万事利	网下申购	3,436	18,004.64
国信证券	688622	禾信仪器	网下申购	1,204	21,310.80
国信证券	301032	新柴股份	网下申购	5,124	25,466.28
国信证券	688323	瑞华泰	网下申购	4,513	26,942.61
国信证券	300986	志特新材	网下申购	2,632	38,927.28

注：本表包含参与基金托管人的关联方承销证券的情况。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

注：无。

7.4.12 期末（2022 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	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

002472	双环传动	2022年10月28日	6个月	非公开发行流通受限	27.35	23.54	109,689	2,999,994.15	2,582,079.06	-
301095	广立微	2022年7月28日	6个月	新股流通受限	58.00	86.49	238	13,804.00	20,584.62	-
301115	建科股份	2022年8月23日	6个月	新股流通受限	42.05	24.04	330	13,876.50	7,933.20	-
301132	满坤科技	2022年8月3日	6个月	新股流通受限	26.80	24.48	405	10,854.00	9,914.40	-
301152	天力锂能	2022年8月19日	6个月	新股流通受限	57.00	46.64	231	13,167.00	10,773.84	-
301161	唯万密封	2022年9月6日	6个月	新股流通受限	18.66	21.73	346	6,456.36	7,518.58	-
301171	易点天下	2022年8月10日	6个月	新股流通受限	18.18	17.72	470	8,544.60	8,328.40	-
301175	中科环保	2022年6月30日	6个月	新股流通受限	3.82	6.01	3,557	13,587.74	21,377.57	-
301197	工大科雅	2022年7月29日	6个月	新股流通受限	25.50	20.08	380	9,690.00	7,630.40	-
301231	荣信文化	2022年8月31日	6个月	新股流通受限	25.49	20.38	275	7,009.75	5,604.50	-
301233	盛帮股份	2022年6月24日	6个月	新股流通受限	41.52	34.30	158	6,560.16	5,419.40	-
301239	普瑞眼科	2022年6月22日	6个月	新股流通受限	33.65	69.68	374	12,585.10	26,060.32	-
301265	华新环保	2022年12月8日	6个月	新股流通受限	13.28	11.40	560	7,436.80	6,384.00	-
301267	华夏眼科	2022年10月26日	6个月	新股流通受限	50.88	66.20	230	11,702.40	15,226.00	-

301269	华大九天	2022年7月21日	6个月	新股流通受限	32.69	87.94	295	9,643.55	25,942.30	-
301270	汉仪股份	2022年8月19日	6个月	新股流通受限	25.68	28.37	210	5,392.80	5,957.70	-
301276	嘉曼服饰	2022年9月1日	6个月	新股流通受限	40.66	22.61	258	10,490.28	5,833.38	-
301277	新天地	2022年11月9日	6个月	新股流通受限	27.00	25.78	387	10,449.00	9,976.86	-
301282	金禄电子	2022年8月18日	6个月	新股流通受限	30.38	25.25	330	10,025.40	8,332.50	-
301283	聚胶股份	2022年8月26日	6个月	新股流通受限	52.69	51.41	196	10,327.24	10,076.36	-
301285	鸿日达	2022年9月21日	6个月	新股流通受限	14.60	12.60	565	8,249.00	7,119.00	-
301290	东星医疗	2022年11月23日	6个月	新股流通受限	44.09	35.13	259	11,419.31	9,098.67	-
301296	新巨丰	2022年8月26日	6个月	新股流通受限	18.19	14.90	673	12,241.87	10,027.70	-
301297	富乐德	2022年12月23日	6个月	新股流通受限	8.48	12.99	1,015	8,607.20	13,184.85	-
301300	远翔新材	2022年8月9日	6个月	新股流通受限	36.15	29.37	211	7,627.65	6,197.07	-
301301	川宁生物	2022年12月20日	6个月	新股流通受限	5.00	7.53	2,395	11,975.00	18,034.35	-
301306	西测测试	2022年7月19日	6个月	新股流通受限	43.23	42.29	237	10,245.51	10,022.73	-
301309	万得凯	2022年9月	6个月	新股流通受限	39.00	24.46	181	7,059.00	4,427.26	-

		8 日									
301311	昆船智能	2022 年 11 月 23 日	6 个月	新股流通受限	13.88	15.86	761	10,562.68	12,069.46		-
301313	凡拓数创	2022 年 9 月 22 日	6 个月	新股流通受限	25.25	29.14	247	6,236.75	7,197.58		-
301316	慧博云通	2022 年 9 月 29 日	6 个月	新股流通受限	7.60	14.32	359	2,728.40	5,140.88		-
301318	维海德	2022 年 8 月 3 日	6 个月	新股流通受限	64.68	41.74	141	9,119.88	5,885.34		-
301319	唯特偶	2022 年 9 月 22 日	6 个月	新股流通受限	47.75	53.27	115	5,491.25	6,126.05		-
301327	华宝新能	2022 年 9 月 8 日	6 个月	新股流通受限	237.50	176.97	121	28,737.50	21,413.37		-
301328	维峰电子	2022 年 8 月 30 日	6 个月	新股流通受限	78.80	76.96	129	10,165.20	9,927.84		-
301338	凯格精机	2022 年 8 月 8 日	6 个月	新股流通受限	46.33	48.99	257	11,906.81	12,590.43		-
301339	通行宝	2022 年 9 月 2 日	6 个月	新股流通受限	18.78	15.59	573	10,760.94	8,933.07		-
301349	信德新材	2022 年 8 月 30 日	6 个月	新股流通受限	138.88	103.52	69	9,582.72	7,142.88		-
301359	东南电子	2022 年 11 月 2 日	6 个月	新股流通受限	20.84	19.90	328	6,835.52	6,527.20		-
301361	众智科技	2022 年 11 月 8 日	6 个月	新股流通受限	26.44	20.96	517	13,669.48	10,836.32		-
301363	美好医疗	2022 年 9 月 28 日	6 个月	新股流通受限	30.66	37.85	308	9,443.28	11,657.80		-
301367	怡和嘉业	2022 年 10 月 21 日	6 个月	新股流通受限	119.88	175.78	89	10,669.32	15,644.42		-

		日								
301368	丰立智能	2022年12月7日	6个月	新股流通受限	22.33	18.52	337	7,525.21	6,241.24	-
301377	鼎泰高科	2022年11月11日	6个月	新股流通受限	22.88	17.63	549	12,561.12	9,678.87	-
301388	欣灵电气	2022年10月26日	6个月	新股流通受限	25.88	21.60	292	7,556.96	6,307.20	-
301398	星源卓镁	2022年12月8日	6个月	新股流通受限	34.40	28.94	255	8,772.00	7,379.70	-
688244	永信至诚	2022年10月12日	6个月	新股流通受限	49.19	50.14	1,506	74,080.14	75,510.84	-
688391	钜泉科技	2022年9月5日	6个月	新股流通受限	115.00	95.83	652	74,980.00	62,481.16	-
688498	源杰科技	2022年12月14日	6个月	新股流通受限	100.66	113.13	844	84,957.04	95,481.72	-
688503	聚和材料	2022年12月2日	6个月	新股流通受限	110.00	136.39	778	85,580.00	106,111.42	-
688525	佰维存储	2022年12月23日	6个月	新股流通受限	13.99	15.27	4,614	64,549.86	70,455.78	-

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

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

3、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期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。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300850	新强联	2022年12月30日	重大事项	53.28	2023年1月10日	56.88	170	18,263.00	9,057.60	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的股票(包含中小板，创业板及其他经中国证监会核准上市的股票，存托凭证)，债券(含国债，金融债，企业债，公司债，央行票据，中期票据，短期融资券，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。

7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行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。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	226,412.30	-
未评级	-	-
合计	226,412.30	-

注：上述评级均由经中国证监会核准从事证券市场资信评级业务的评级机构作出。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

7.4.13.3 流动性风险

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

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理职能部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短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 12 月 31 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（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

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

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：

根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

本基金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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022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	26,482,208.83	-	-	-	26,482,208.83
结算备付金	1,019,076.68	-	-	-	1,019,076.68
存出保证金	87,220.82	-	-	-	87,220.82
交易性金融资产	-	-	226,412.30	257,020,036.52	257,246,448.82
买入返售金融资产	12,021,405.48	-	-	-	12,021,405.48
应收申购款	-	-	-	29,065.86	29,065.86
应收清算款	-	-	-	4,886,458.51	4,886,458.51
资产总计	39,609,911.81	-	226,412.30	261,935,560.89	301,771,885.00
负债					
应付赎回款	-	-	-	103,782.44	103,782.44
应付管理人报酬	-	-	-	383,526.59	383,526.59
应付托管费	-	-	-	63,921.13	63,921.13
应付清算款	-	-	-	243,597.95	243,597.95
应交税费	-	-	-	0.69	0.69
其他负债	-	-	-	730,208.87	730,208.87
负债总计	-	-	-	1,525,037.67	1,525,037.67

利率敏感度缺口	39,609,911.81	-	226,412.30	260,410,523.22	300,246,847.33
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账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2022 年 12 月 31 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 0.08%。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。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无。

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无。

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。

基金的投资组合比例为：股票（含存托凭证）资产占基金资产的比例为 0%-95%；每个交易日日终在扣除股指期货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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 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	257,020,036.52	85.60	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	226,412.30	0.08	-	-
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	257,246,448.82	85.68	364,371,229.65	87.57

注：债券投资为可转换债券、可交换债券投资。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022年12月31日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	业绩比较基准上升 5%	11,954,328.23	24,787,675.80
	业绩比较基准下降 5%	-11,954,328.23	-24,787,675.80

注：无。

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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12月31日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	253,777,585.63	355,775,973.27
第二层次	9,057.60	222,174.65
第三层次	3,459,805.59	8,373,081.73
合计	257,246,448.82	364,371,229.65

7.4.14.2.2 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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	8,373,081.73	8,373,081.73
当期购买	-	2,999,994.15	2,999,994.15
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	2,280,616.69	2,280,616.69
转出第三层次	-	10,318,766.47	10,318,766.47
当期利得或损失总额	-	124,879.49	124,879.49
其中：计入损益的利得或损失	-	124,879.49	124,879.49
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	3,459,805.59	3,459,805.59
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-375,687.84	-375,687.84
项目	上年度可比同期 2021年1月1日至2021年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	6,301,343.81	6,301,343.81
当期出售/结算	-	-	-

转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	2,071,737.92	2,071,737.92
其中：计入损益的利得或损失	-	2,071,737.92	2,071,737.92
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	8,373,081.73	8,373,081.73
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	2,071,737.92	2,071,737.92

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流通受限股票	3,459,805.59	平均价格 亚式期权 模型	预期波动率	0.2063-2.4756	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流通受限股票	8,373,081.73	平均价格 亚式期权 模型	预期波动率	0.1717-2.7417	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

7.4.14.4 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。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	257,020,036.52	85.17
	其中：股票	257,020,036.52	85.17
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	226,412.30	0.08
	其中：债券	226,412.30	0.08
	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	12,021,405.48	3.98
	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	27,501,285.51	9.11
8	其他各项资产	5,002,745.19	1.66
9	合计	301,771,885.00	100.00

注：报告期末本基金投资的存托凭证公允价值为：853.72 元，占净值比 0.00%。本报告所指的“股票”均包含存托凭证。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	7,266,946.64	2.42
B	采矿业	6,816,957.57	2.27
C	制造业	208,600,202.14	69.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,061,389.96	0.35
E	建筑业	944,934.53	0.31
F	批发和零售业	842,926.22	0.28
G	交通运输、仓储和邮政业	168,175.85	0.06
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,304,377.16	3.43
J	金融业	4,221,519.63	1.41
K	房地产业	1,176,501.00	0.39
L	租赁和商务服务业	4,397,107.68	1.46
M	科学研究和技术服务业	8,116,663.45	2.70

N	水利、环境和公共设施管理业	1,273,894.70	0.42
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	11,858.40	0.00
Q	卫生和社会工作	192,039.14	0.06
R	文化、体育和娱乐业	1,620,498.45	0.54
S	综合	4,044.00	0.00
	合计	257,020,036.52	85.60

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	603596	伯特利	189,800	15,146,040.00	5.04
2	002648	卫星化学	933,301	14,466,165.50	4.82
3	002011	盾安环境	865,100	11,358,763.00	3.78
4	002371	北方华创	49,000	11,039,700.00	3.68
5	002459	晶澳科技	180,060	10,819,805.40	3.60
6	300014	亿纬锂能	111,200	9,774,480.00	3.26
7	688279	峰岬科技	64,690	5,569,809.00	1.86
8	300760	迈瑞医疗	17,200	5,434,684.00	1.81
9	603348	文灿股份	88,551	5,097,881.07	1.70
10	300498	温氏股份	256,000	5,025,280.00	1.67
11	688235	百济神州-U	35,945	4,760,915.25	1.59
12	600765	中航重机	149,020	4,633,031.80	1.54
13	603032	德新科技	52,300	4,589,848.00	1.53
14	000733	振华科技	40,000	4,569,200.00	1.52
15	601888	中国中免	20,300	4,385,409.00	1.46
16	301306	西测测试	100,361	4,334,378.29	1.44
17	300724	捷佳伟创	37,100	4,230,142.00	1.41
18	688533	上声电子	73,478	4,217,637.20	1.40
19	002472	双环传动	162,189	3,918,204.06	1.30
20	688617	惠泰医疗	12,258	3,762,347.94	1.25
21	002057	中钢天源	345,700	3,629,850.00	1.21
22	688800	瑞可达	30,058	3,206,587.44	1.07
23	600522	中天科技	196,600	3,175,090.00	1.06
24	603806	福斯特	43,800	2,910,072.00	0.97
25	688385	复旦微电	40,208	2,806,920.48	0.93
26	688032	禾迈股份	2,976	2,788,958.40	0.93
27	688599	天合光能	43,289	2,760,106.64	0.92
28	002493	荣盛石化	219,900	2,704,770.00	0.90
29	600519	贵州茅台	1,564	2,701,028.00	0.90

30	002756	永兴材料	29,300	2,700,581.00	0.90
31	600809	山西汾酒	8,400	2,393,916.00	0.80
32	603997	继峰股份	145,500	2,223,240.00	0.74
33	603477	巨星农牧	85,700	2,090,223.00	0.70
34	688687	凯因科技	87,562	1,992,035.50	0.66
35	300858	科拓生物	61,632	1,905,661.44	0.63
36	300750	宁德时代	4,700	1,849,074.00	0.62
37	688401	路维光电	40,969	1,785,838.71	0.59
38	688192	迪哲医药-U	42,683	1,680,429.71	0.56
39	688503	聚和材料	11,181	1,657,302.75	0.55
40	300049	福瑞股份	67,300	1,644,139.00	0.55
41	601628	中国人寿	43,900	1,629,568.00	0.54
42	603606	东方电缆	23,400	1,587,222.00	0.53
43	601899	紫金矿业	158,500	1,585,000.00	0.53
44	600276	恒瑞医药	39,200	1,510,376.00	0.50
45	300144	宋城演艺	102,000	1,489,200.00	0.50
46	601066	中信建投	61,700	1,465,375.00	0.49
47	688248	南网科技	25,478	1,454,793.80	0.48
48	600132	重庆啤酒	11,400	1,452,132.00	0.48
49	600309	万华化学	15,400	1,426,810.00	0.48
50	002837	英维克	42,800	1,425,668.00	0.47
51	688120	华海清科	6,314	1,417,808.70	0.47
52	688008	澜起科技	22,589	1,414,071.40	0.47
53	300990	同飞股份	14,700	1,350,636.00	0.45
54	600988	赤峰黄金	74,600	1,346,530.00	0.45
55	600547	山东黄金	68,000	1,302,880.00	0.43
56	688052	纳芯微	3,735	1,186,236.00	0.40
57	603259	药明康德	14,400	1,166,400.00	0.39
58	600048	保利发展	76,500	1,157,445.00	0.39
59	300274	阳光电源	10,100	1,129,180.00	0.38
60	300782	卓胜微	9,480	1,083,564.00	0.36
61	000975	银泰黄金	97,200	1,073,088.00	0.36
62	688262	国芯科技	25,453	1,064,189.93	0.35
63	002709	天赐材料	22,400	982,464.00	0.33
64	300416	苏试试验	32,200	970,830.00	0.32
65	300896	爱美客	1,700	962,795.00	0.32
66	688513	苑东生物	15,588	948,373.92	0.32
67	688516	奥特维	4,653	935,253.00	0.31
68	002612	朗姿股份	33,300	924,408.00	0.31
69	603170	宝立食品	32,542	921,914.86	0.31
70	300693	盛弘股份	16,700	906,476.00	0.30
71	603136	天目湖	33,300	904,095.00	0.30
72	002130	沃尔核材	138,700	894,615.00	0.30

73	002831	裕同科技	27,000	892,890.00	0.30
74	001215	千味央厨	13,600	891,616.00	0.30
75	600030	中信证券	44,400	884,004.00	0.29
76	603456	九洲药业	20,600	874,058.00	0.29
77	600487	亨通光电	57,900	871,974.00	0.29
78	605333	沪光股份	40,800	869,856.00	0.29
79	601985	中国核电	143,800	862,800.00	0.29
80	600433	冠豪高新	211,600	861,212.00	0.29
81	600536	中国软件	14,700	857,451.00	0.29
82	688518	联赢激光	29,327	856,641.67	0.29
83	688276	百克生物	12,376	855,305.36	0.28
84	600259	广晟有色	21,200	852,240.00	0.28
85	601117	中国化学	106,700	847,198.00	0.28
86	688680	海优新材	4,533	839,964.90	0.28
87	688536	思瑞浦	2,983	821,548.03	0.27
88	300360	炬华科技	53,400	776,970.00	0.26
89	688981	中芯国际	17,437	717,358.18	0.24
90	000630	铜陵有色	213,600	666,432.00	0.22
91	688236	春立医疗	26,131	622,179.11	0.21
92	688085	三友医疗	21,660	601,065.00	0.20
93	301099	雅创电子	8,500	585,905.00	0.20
94	601808	中海油服	35,100	581,958.00	0.19
95	002078	太阳纸业	50,500	581,760.00	0.19
96	688398	赛特新材	13,340	462,364.40	0.15
97	688213	思特威-W	8,976	348,268.80	0.12
98	000568	泸州老窖	1,400	313,992.00	0.10
99	688428	诺诚健华-U	21,162	298,595.82	0.10
100	002838	道恩股份	14,400	254,592.00	0.08
101	688037	芯源微	1,604	251,026.00	0.08
102	688172	燕东微	8,999	170,801.02	0.06
103	301267	华夏眼科	2,292	165,978.82	0.06
104	300529	健帆生物	5,300	164,141.00	0.05
105	688141	杰华特	3,182	151,145.00	0.05
106	688501	青达环保	5,764	148,999.40	0.05
107	688239	航宇科技	1,843	143,182.67	0.05
108	688362	甬矽电子	5,640	122,895.60	0.04
109	301361	众智科技	5,169	115,134.16	0.04
110	605499	东鹏饮料	632	112,432.80	0.04
111	301277	新天地	3,865	110,386.72	0.04
112	301377	鼎泰高科	5,483	106,730.65	0.04
113	301283	聚胶股份	1,959	104,819.98	0.03
114	301030	仕净科技	2,417	100,813.07	0.03
115	688376	美埃科技	3,139	98,187.92	0.03

116	301290	东星医疗	2,588	96,273.14	0.03
117	688147	微导纳米	3,818	95,755.44	0.03
118	688498	源杰科技	844	95,481.72	0.03
119	688618	三旺通信	1,117	89,248.30	0.03
120	688496	清越科技	9,440	85,715.20	0.03
121	301026	浩通科技	2,027	85,134.00	0.03
122	688143	长盈通	1,800	83,916.00	0.03
123	688203	海正生材	5,178	81,035.70	0.03
124	301398	星源卓镁	2,549	78,837.80	0.03
125	688244	永信至诚	1,506	75,510.84	0.03
126	688226	威腾电气	2,693	70,718.18	0.02
127	688525	佰维存储	4,614	70,455.78	0.02
128	688212	澳华内镜	1,073	70,270.77	0.02
129	300945	曼卡龙	4,731	70,208.04	0.02
130	688789	宏华数科	404	69,742.52	0.02
131	688292	浩瀚深度	4,503	69,121.05	0.02
132	688420	美腾科技	1,685	68,781.70	0.02
133	301265	华新环保	5,596	67,873.56	0.02
134	301368	丰立智能	3,368	66,558.14	0.02
135	300927	江天化学	3,893	64,078.78	0.02
136	300952	恒辉安防	3,398	63,134.84	0.02
137	003035	南网能源	11,046	62,630.82	0.02
138	688391	钜泉科技	652	62,481.16	0.02
139	601702	华峰铝业	4,166	62,281.70	0.02
140	688071	华依科技	1,101	62,217.51	0.02
141	688041	海光信息	1,547	62,065.64	0.02
142	688219	会通股份	7,336	61,695.76	0.02
143	688557	兰剑智能	1,812	61,336.20	0.02
144	300889	爱克股份	4,786	61,260.80	0.02
145	688619	罗普特	5,856	60,551.04	0.02
146	301108	洁雅股份	1,792	60,497.92	0.02
147	688685	迈信林	2,612	60,441.68	0.02
148	301276	嘉曼服饰	2,572	59,726.44	0.02
149	688508	芯朋微	909	58,912.29	0.02
150	301002	崧盛股份	2,601	58,522.50	0.02
151	300987	川网传媒	3,905	58,340.70	0.02
152	688416	恒烁股份	1,519	57,737.19	0.02
153	600906	财达证券	7,597	57,509.29	0.02
154	688669	聚石化学	2,681	57,480.64	0.02
155	688571	杭华股份	8,200	57,318.00	0.02
156	300950	德固特	3,279	57,087.39	0.02
157	688296	和达科技	2,173	56,215.51	0.02
158	688526	科前生物	2,500	56,000.00	0.02

159	300963	中洲特材	3,679	55,847.22	0.02
160	301182	凯旺科技	2,932	55,180.24	0.02
161	300922	天秦装备	4,008	54,989.76	0.02
162	301045	天禄科技	3,350	54,404.00	0.02
163	301016	雷尔伟	2,747	54,170.84	0.02
164	002234	民和股份	2,800	54,152.00	0.02
165	688096	京源环保	4,485	54,133.95	0.02
166	688190	云路股份	612	53,782.56	0.02
167	300883	龙利得	8,911	52,931.34	0.02
168	688314	康拓医疗	1,085	52,047.45	0.02
169	300972	万辰生物	4,300	51,772.00	0.02
170	300774	倍杰特	4,435	51,490.35	0.02
171	688216	气派科技	2,000	51,040.00	0.02
172	300998	宁波方正	2,003	50,715.96	0.02
173	601963	重庆银行	7,472	50,660.16	0.02
174	688072	拓荆科技-U	231	50,069.25	0.02
175	001203	大中矿业	3,809	49,250.37	0.02
176	300971	博亚精工	2,445	48,386.55	0.02
177	301098	金埔园林	3,069	48,306.06	0.02
178	000822	山东海化	6,100	48,129.00	0.02
179	300943	春晖智控	3,813	46,022.91	0.02
180	688656	浩欧博	1,371	45,955.92	0.02
181	301040	中环海陆	2,401	45,907.12	0.02
182	300975	商络电子	7,375	45,430.00	0.02
183	301309	万得凯	1,806	45,084.76	0.02
184	300931	通用电梯	6,713	44,238.67	0.01
185	001330	博纳影业	3,564	42,696.72	0.01
186	002984	森麒麟	1,386	42,674.94	0.01
187	600916	中国黄金	3,371	42,609.44	0.01
188	688511	天微电子	1,490	42,345.80	0.01
189	688350	富淼科技	2,552	41,954.88	0.01
190	688260	昀冢科技	2,990	41,590.90	0.01
191	300886	华业香料	1,903	41,466.37	0.01
192	301049	超越科技	1,954	41,170.78	0.01
193	688616	西力科技	3,918	40,982.28	0.01
194	301025	读客文化	4,027	40,793.51	0.01
195	301062	上海艾录	5,225	40,755.00	0.01
196	688191	智洋创新	3,203	40,614.04	0.01
197	002179	中航光电	700	40,432.00	0.01
198	300961	深水海纳	3,936	40,304.64	0.01
199	688323	瑞华泰	1,694	40,283.32	0.01
200	601568	北元集团	7,095	40,228.65	0.01
201	300948	冠中生态	3,229	39,781.28	0.01

202	300960	通业科技	2,332	39,737.28	0.01
203	301033	迈普医学	1,076	39,682.88	0.01
204	688585	上纬新材	4,922	39,425.22	0.01
205	688622	禾信仪器	1,204	39,130.00	0.01
206	603363	傲农生物	3,000	38,670.00	0.01
207	301027	华蓝集团	2,856	38,556.00	0.01
208	301032	新柴股份	5,124	38,481.24	0.01
209	301162	国能日新	431	37,850.42	0.01
210	688215	瑞晟智能	1,229	37,791.75	0.01
211	301327	华宝新能	208	37,791.12	0.01
212	605589	圣泉集团	1,750	37,432.50	0.01
213	688117	圣诺生物	1,672	37,151.84	0.01
214	688217	睿昂基因	1,040	36,764.00	0.01
215	301029	怡合达	554	36,419.96	0.01
216	688707	振华新材	809	36,364.55	0.01
217	300992	泰福泵业	1,998	35,864.10	0.01
218	688655	迅捷兴	3,083	35,300.35	0.01
219	688596	正帆科技	1,039	35,274.05	0.01
220	301068	大地海洋	1,436	35,268.16	0.01
221	600955	维远股份	1,694	35,184.38	0.01
222	600032	浙江新能	3,045	34,987.05	0.01
223	603565	中谷物流	2,405	34,968.70	0.01
224	001338	永顺泰	1,649	34,826.88	0.01
225	301153	中科江南	323	34,380.12	0.01
226	605399	晨光新材	1,053	34,011.90	0.01
227	301037	保立佳	2,115	33,988.05	0.01
228	301036	双乐股份	2,047	33,939.26	0.01
229	688679	通源环境	3,139	33,932.59	0.01
230	605020	永和股份	850	33,388.00	0.01
231	001258	立新能源	3,188	33,346.48	0.01
232	688517	金冠电气	2,892	33,229.08	0.01
233	300929	华骐环保	2,923	33,176.05	0.01
234	300995	奇德新材	1,909	33,044.79	0.01
235	301007	德迈仕	3,022	32,879.36	0.01
236	003021	兆威机电	680	32,687.60	0.01
237	605338	巴比食品	1,012	32,110.76	0.01
238	601156	东航物流	2,090	31,893.40	0.01
239	002993	奥海科技	936	31,833.36	0.01
240	605507	国邦医药	1,202	31,816.94	0.01
241	301053	远信工业	1,544	31,327.76	0.01
242	688328	深科达	1,499	30,969.34	0.01
243	300854	中兰环保	2,026	30,957.28	0.01
244	688565	力源科技	3,450	30,567.00	0.01

245	605366	宏柏新材	2,064	30,382.08	0.01
246	600927	永安期货	1,859	29,967.08	0.01
247	001227	兰州银行	7,868	29,662.36	0.01
248	301050	雷电微力	383	29,556.11	0.01
249	601187	厦门银行	5,129	29,389.17	0.01
250	688395	正弦电气	1,627	29,383.62	0.01
251	601665	齐鲁银行	6,731	28,068.27	0.01
252	603179	新泉股份	710	27,327.90	0.01
253	605089	味知香	370	27,039.60	0.01
254	601089	福元医药	1,749	26,812.17	0.01
255	603155	新亚强	996	26,762.52	0.01
256	301268	铭利达	530	26,611.30	0.01
257	688092	爱科科技	1,137	26,401.14	0.01
258	603071	物产环能	1,627	26,324.86	0.01
259	605077	华康股份	865	26,244.10	0.01
260	301239	普瑞眼科	374	26,060.32	0.01
261	301269	华大九天	295	25,942.30	0.01
262	605337	李子园	1,103	25,843.29	0.01
263	605377	华旺科技	1,050	25,767.00	0.01
264	603324	盛剑环境	732	25,671.24	0.01
265	603191	望变电气	1,149	25,530.78	0.01
266	003029	吉大正元	716	25,246.16	0.01
267	001213	中铁特货	5,818	25,133.76	0.01
268	605286	同力日升	597	25,115.79	0.01
269	003009	中天火箭	623	24,577.35	0.01
270	688272	富吉瑞	1,263	24,502.20	0.01
271	688681	科汇股份	1,899	24,231.24	0.01
272	301095	广立微	278	24,145.82	0.01
273	688067	爱威科技	1,259	23,581.07	0.01
274	301238	瑞泰新材	1,043	23,457.07	0.01
275	301101	明月镜片	371	23,380.42	0.01
276	601921	浙版传媒	3,154	23,339.60	0.01
277	603171	税友股份	637	23,186.80	0.01
278	001201	东瑞股份	802	23,033.44	0.01
279	603931	格林达	844	22,939.92	0.01
280	605060	联德股份	883	22,790.23	0.01
281	301120	新特电气	1,211	22,536.71	0.01
282	001318	阳光乳业	1,142	21,926.40	0.01
283	603209	兴通股份	595	21,610.40	0.01
284	301175	中科环保	3,562	21,407.92	0.01
285	605167	利柏特	2,471	20,805.82	0.01
286	301286	侨源股份	839	20,731.69	0.01
287	301058	中粮科工	1,386	20,720.70	0.01

288	001308	康冠科技	667	20,703.68	0.01
289	300623	捷捷微电	1,000	20,620.00	0.01
290	001205	盛航股份	808	19,812.16	0.01
291	605339	南侨食品	864	19,656.00	0.01
292	003040	楚天龙	1,101	19,201.44	0.01
293	605296	神农集团	740	18,522.20	0.01
294	603206	嘉环科技	1,210	18,500.90	0.01
295	605388	均瑶健康	1,230	18,499.20	0.01
296	002997	瑞鹄模具	751	18,324.40	0.01
297	003028	振邦智能	432	18,234.72	0.01
298	301301	川宁生物	2,395	18,034.35	0.01
299	605305	中际联合	508	17,983.20	0.01
300	300857	协创数据	934	17,960.82	0.01
301	003012	东鹏控股	2,278	17,905.08	0.01
302	605080	浙江自然	374	17,652.80	0.01
303	301302	华如科技	275	17,608.25	0.01
304	003039	顺控发展	1,024	17,315.84	0.01
305	002999	天禾股份	1,726	17,277.26	0.01
306	603057	紫燕食品	549	17,277.03	0.01
307	001208	华菱线缆	1,754	17,171.66	0.01
308	003002	壶化股份	921	16,946.40	0.01
309	605008	长鸿高科	1,039	16,946.09	0.01
310	603235	天新药业	572	16,656.64	0.01
311	001339	智微智能	812	16,516.08	0.01
312	002979	雷赛智能	725	16,392.25	0.01
313	001217	华尔泰	1,239	16,206.12	0.01
314	603211	晋拓股份	1,287	16,164.72	0.01
315	001216	华瓷股份	1,177	16,066.05	0.01
316	603132	金徽股份	1,342	16,063.74	0.01
317	605116	奥锐特	642	15,850.98	0.01
318	605006	山东玻纤	1,942	15,827.30	0.01
319	301367	怡和嘉业	89	15,644.42	0.01
320	003016	欣贺股份	1,681	15,431.58	0.01
321	603237	五芳斋	325	15,323.75	0.01
322	605050	福然德	1,197	15,321.60	0.01
323	301112	信邦智能	484	15,047.56	0.01
324	301160	翔楼新材	418	14,889.16	0.00
325	605368	蓝天燃气	1,204	14,869.40	0.00
326	688271	联影医疗	84	14,866.32	0.00
327	603759	海天股份	1,656	14,837.76	0.00
328	003019	宸展光电	691	14,725.21	0.00
329	605099	共创草坪	624	14,476.80	0.00
330	605268	王力安防	1,642	14,449.60	0.00

331	301328	维峰电子	185	14,441.44	0.00
332	301152	天力锂能	307	14,437.04	0.00
333	002918	蒙娜丽莎	800	14,384.00	0.00
334	003037	三和管桩	1,274	14,345.24	0.00
335	605169	洪通燃气	1,292	14,315.36	0.00
336	605158	华达新材	2,226	14,246.40	0.00
337	003042	中农联合	546	14,206.92	0.00
338	300853	申昊科技	641	14,127.64	0.00
339	601686	友发集团	2,374	14,101.56	0.00
340	601528	瑞丰银行	2,230	14,071.30	0.00
341	605183	确成股份	741	13,997.49	0.00
342	003030	祖名股份	480	13,977.60	0.00
343	688256	寒武纪-U	255	13,912.80	0.00
344	688320	禾川科技	297	13,899.60	0.00
345	605016	百龙创园	623	13,500.41	0.00
346	000933	神火股份	900	13,464.00	0.00
347	603176	汇通集团	1,924	13,333.32	0.00
348	301127	天源环保	1,385	13,226.75	0.00
349	301297	富乐德	1,015	13,184.85	0.00
350	603130	云中马	480	13,176.00	0.00
351	301338	凯格精机	268	13,150.99	0.00
352	000656	金科股份	6,800	12,988.00	0.00
353	301220	亚香股份	349	12,853.67	0.00
354	001317	三羊马	300	12,840.00	0.00
355	605389	长龄液压	498	12,803.58	0.00
356	301217	铜冠铜箔	1,023	12,674.97	0.00
357	301207	华兰疫苗	283	12,616.14	0.00
358	603230	内蒙新华	1,140	12,574.20	0.00
359	301187	欧圣电气	732	12,385.44	0.00
360	688301	奕瑞科技	27	12,362.76	0.00
361	605088	冠盛股份	716	12,300.88	0.00
362	605136	丽人丽妆	867	12,120.66	0.00
363	301311	昆船智能	761	12,069.46	0.00
364	605179	一鸣食品	939	11,962.86	0.00
365	605098	行动教育	405	11,858.40	0.00
366	605162	新中港	1,377	11,814.66	0.00
367	603836	海程邦达	733	11,698.68	0.00
368	301363	美好医疗	308	11,657.80	0.00
369	301177	迪阿股份	185	11,651.30	0.00
370	001299	美能能源	576	11,635.20	0.00
371	605199	葫芦娃	726	11,630.52	0.00
372	688290	景业智能	161	11,604.88	0.00
373	001313	粤海饲料	1,232	11,580.80	0.00

374	605218	伟时电子	837	11,550.60	0.00
375	605056	咸亨国际	933	11,391.93	0.00
376	301116	益客食品	664	11,347.76	0.00
377	001331	胜通能源	385	11,330.55	0.00
378	605500	森林包装	1,128	11,302.56	0.00
379	300073	当升科技	200	11,280.00	0.00
380	605007	五洲特纸	598	11,272.30	0.00
381	301206	三元生物	287	11,193.00	0.00
382	003013	地铁设计	724	11,185.80	0.00
383	002996	顺博合金	849	11,062.47	0.00
384	301132	满坤科技	449	11,032.88	0.00
385	300918	南山智尚	1,063	10,927.64	0.00
386	001206	依依股份	449	10,919.68	0.00
387	301135	瑞德智能	476	10,900.40	0.00
388	605277	新亚电子	705	10,842.90	0.00
389	001238	浙江正特	374	10,797.38	0.00
390	001222	源飞宠物	434	10,758.86	0.00
391	603112	华翔股份	920	10,718.00	0.00
392	003010	若羽臣	562	10,593.70	0.00
393	603213	镇洋发展	799	10,562.78	0.00
394	301222	浙江恒威	415	10,466.30	0.00
395	605365	立达信	645	10,371.60	0.00
396	605228	神通科技	1,217	10,320.16	0.00
397	605028	世茂能源	615	10,313.55	0.00
398	688677	海泰新光	91	10,283.00	0.00
399	001212	中旗新材	400	10,252.00	0.00
400	605058	澳弘电子	548	10,220.20	0.00
401	605300	佳禾食品	576	10,189.44	0.00
402	605289	罗曼股份	474	10,124.64	0.00
403	605378	野马电池	473	10,065.44	0.00
404	601279	英利汽车	2,004	10,060.08	0.00
405	301296	新巨丰	673	10,027.70	0.00
406	301200	大族数控	255	9,996.00	0.00
407	605599	菜百股份	980	9,976.40	0.00
408	605566	福莱茵特	435	9,952.80	0.00
409	605259	绿田机械	295	9,885.45	0.00
410	605319	无锡振华	764	9,878.52	0.00
411	688439	振华风光	83	9,867.04	0.00
412	603097	江苏华辰	577	9,860.93	0.00
413	301193	家联科技	297	9,833.67	0.00
414	603182	嘉华股份	546	9,778.86	0.00
415	301339	通行宝	624	9,778.14	0.00
416	605567	春雪食品	629	9,705.47	0.00

417	001268	联合精密	409	9,697.39	0.00
418	301298	东利机械	640	9,696.00	0.00
419	003015	日久光电	1,128	9,689.52	0.00
420	001230	劲旅环境	375	9,671.25	0.00
421	003018	金富科技	1,027	9,643.53	0.00
422	605005	合兴股份	634	9,624.12	0.00
423	688375	国博电子	100	9,579.00	0.00
424	605066	天正电气	1,278	9,533.88	0.00
425	001229	魅视科技	347	9,313.48	0.00
426	001207	联科科技	682	9,241.10	0.00
427	301151	冠龙节能	542	9,219.42	0.00
428	301259	艾布鲁	483	9,177.00	0.00
429	003036	泰坦股份	776	9,164.56	0.00
430	001266	宏英智能	346	9,155.16	0.00
431	001219	青岛食品	354	9,126.12	0.00
432	301300	远翔新材	307	9,108.75	0.00
433	300850	新强联	170	9,057.60	0.00
434	688308	欧科亿	119	8,984.50	0.00
435	605100	华丰股份	685	8,966.65	0.00
436	003023	彩虹集团	385	8,958.95	0.00
437	003003	天元股份	756	8,951.04	0.00
438	603280	南方路机	363	8,893.50	0.00
439	002998	优彩资源	1,353	8,875.68	0.00
440	605177	东亚药业	439	8,788.78	0.00
441	301171	易点天下	493	8,758.73	0.00
442	605318	法狮龙	628	8,635.00	0.00
443	603511	爱慕股份	553	8,632.33	0.00
444	300882	万胜智能	572	8,602.88	0.00
445	605018	长华集团	840	8,601.60	0.00
446	301288	清研环境	516	8,591.40	0.00
447	301318	维海德	204	8,562.84	0.00
448	605299	舒华体育	738	8,560.80	0.00
449	605086	龙高股份	443	8,514.46	0.00
450	603219	富佳股份	528	8,474.40	0.00
451	603215	比依股份	575	8,423.75	0.00
452	605118	力鼎光电	667	8,337.50	0.00
453	301282	金禄电子	330	8,332.50	0.00
454	003001	中岩大地	560	8,288.00	0.00
455	301198	喜悦智行	341	8,265.84	0.00
456	605196	华通线缆	1,172	8,180.56	0.00
457	301285	鸿日达	643	8,145.48	0.00
458	688378	奥来德	161	8,130.50	0.00
459	003000	劲仔食品	684	8,064.36	0.00

460	605488	福莱新材	603	8,056.08	0.00
461	301228	实朴检测	521	8,033.82	0.00
462	003004	声迅股份	306	8,020.26	0.00
463	688665	四方光电	81	8,019.00	0.00
464	688237	超卓航科	143	7,996.56	0.00
465	605011	杭州热电	525	7,990.50	0.00
466	001288	运机集团	537	7,969.08	0.00
467	301166	优宁维	174	7,957.02	0.00
468	001210	金房节能	311	7,939.83	0.00
469	301179	泽宇智能	208	7,939.36	0.00
470	301115	建科股份	330	7,933.20	0.00
471	301199	迈赫股份	398	7,924.18	0.00
472	605580	恒盛能源	654	7,893.78	0.00
473	688373	盟科药业-U	887	7,858.82	0.00
474	301197	工大科雅	391	7,855.79	0.00
475	605287	德才股份	349	7,814.11	0.00
476	605189	富春染织	422	7,798.56	0.00
477	605180	华生科技	499	7,789.39	0.00
478	605138	盛泰集团	723	7,779.48	0.00
479	001296	长江材料	403	7,745.66	0.00
480	688119	中钢洛耐	1,228	7,736.40	0.00
481	001234	泰慕士	333	7,675.65	0.00
482	688161	威高骨科	147	7,671.93	0.00
483	603272	联翔股份	443	7,646.18	0.00
484	601012	隆基绿能	180	7,606.80	0.00
485	301190	善水科技	420	7,551.60	0.00
486	301161	唯万密封	346	7,518.58	0.00
487	605255	天普股份	530	7,499.50	0.00
488	688114	华大智造	67	7,444.37	0.00
489	301111	粤万年青	379	7,435.98	0.00
490	003041	真爱美家	419	7,374.40	0.00
491	605069	正和生态	790	7,347.00	0.00
492	688035	德邦科技	142	7,328.62	0.00
493	301163	宏德股份	277	7,282.33	0.00
494	688409	富创精密	67	7,243.37	0.00
495	605033	美邦股份	423	7,241.76	0.00
496	301313	凡拓数创	247	7,197.58	0.00
497	301349	信德新材	69	7,142.88	0.00
498	601952	苏垦农发	600	7,104.00	0.00
499	688663	新风光	161	7,084.00	0.00
500	688359	三孚新科	104	7,018.96	0.00
501	002460	赣锋锂业	100	6,951.00	0.00
502	605055	迎丰股份	1,146	6,921.84	0.00

503	002169	智光电气	900	6,885.00	0.00
504	301138	华研精机	285	6,774.45	0.00
505	688400	凌云光	263	6,714.39	0.00
506	688305	科德数控	75	6,637.50	0.00
507	605303	园林股份	610	6,612.40	0.00
508	001202	炬申股份	459	6,595.83	0.00
509	605298	必得科技	508	6,548.12	0.00
510	301359	东南电子	328	6,527.20	0.00
511	603150	万朗磁塑	250	6,492.50	0.00
512	688697	纽威数控	284	6,478.04	0.00
513	688345	博力威	123	6,453.81	0.00
514	688600	皖仪科技	256	6,394.88	0.00
515	605155	西大门	490	6,374.90	0.00
516	301388	欣灵电气	292	6,307.20	0.00
517	688403	汇成股份	590	6,189.10	0.00
518	301319	唯特偶	115	6,126.05	0.00
519	001209	洪兴股份	450	6,102.00	0.00
520	301158	德石股份	383	6,070.55	0.00
521	301233	盛帮股份	176	6,040.58	0.00
522	301270	汉仪股份	210	5,957.70	0.00
523	301012	扬电科技	170	5,934.70	0.00
524	300866	安克创新	100	5,927.00	0.00
525	688625	呈和科技	120	5,870.40	0.00
526	605577	龙版传媒	588	5,844.72	0.00
527	688095	福昕软件	93	5,782.74	0.00
528	301231	荣信文化	275	5,604.50	0.00
529	688699	明微电子	121	5,552.69	0.00
530	002992	宝明科技	99	5,494.50	0.00
531	688097	博众精工	190	5,434.00	0.00
532	600406	国电南瑞	220	5,368.00	0.00
533	688335	复洁环保	253	5,264.93	0.00
534	688231	隆达股份	145	5,179.40	0.00
535	301316	慧博云通	359	5,140.88	0.00
536	300958	建工修复	300	5,106.00	0.00
537	301100	风光股份	227	5,030.32	0.00
538	688259	创耀科技	66	4,950.66	0.00
539	688253	英诺特	206	4,906.92	0.00
540	688456	有研粉材	141	4,794.00	0.00
541	688353	华盛锂电	73	4,724.56	0.00
542	000915	华特达因	100	4,550.00	0.00
543	688768	容知日新	40	4,518.40	0.00
544	688283	坤恒顺维	77	4,466.77	0.00
545	003038	鑫铂股份	100	4,408.00	0.00

546	002414	高德红外	400	4,400.00	0.00
547	603051	鹿山新材	72	4,313.52	0.00
548	600223	鲁商发展	400	4,236.00	0.00
549	688661	和林微纳	70	4,221.00	0.00
550	688678	福立旺	211	4,049.09	0.00
551	000833	粤桂股份	600	4,044.00	0.00
552	002041	登海种业	200	3,964.00	0.00
553	688127	蓝特光学	248	3,950.64	0.00
554	688160	步科股份	131	3,801.62	0.00
555	688265	南模生物	76	3,724.00	0.00
556	688173	希荻微	163	3,704.99	0.00
557	688049	炬芯科技	134	3,624.70	0.00
558	301219	腾远钴业	52	3,584.36	0.00
559	688689	银河微电	156	3,566.16	0.00
560	688609	九联科技	519	3,420.21	0.00
561	601668	中国建筑	600	3,258.00	0.00
562	002142	宁波银行	100	3,245.00	0.00
563	688268	华特气体	43	3,192.75	0.00
564	002334	英威腾	400	3,180.00	0.00
565	688722	同益中	176	3,178.56	0.00
566	301046	能辉科技	91	3,153.15	0.00
567	688786	悦安新材	71	2,944.37	0.00
568	688683	莱尔科技	146	2,921.46	0.00
569	688313	仕佳光子	322	2,914.10	0.00
570	688718	唯赛勃	142	2,827.22	0.00
571	601600	中国铝业	600	2,682.00	0.00
572	000921	海信家电	200	2,634.00	0.00
573	301021	英诺激光	99	2,553.21	0.00
574	688171	纬德信息	131	2,487.69	0.00
575	001323	慕思股份	73	2,417.76	0.00
576	002068	黑猫股份	200	2,394.00	0.00
577	301069	凯盛新材	86	2,371.88	0.00
578	000932	华菱钢铁	500	2,350.00	0.00
579	002037	保利联合	200	2,306.00	0.00
580	300996	普联软件	55	2,257.75	0.00
581	002101	广东鸿图	100	2,167.00	0.00
582	600096	云天化	100	2,104.00	0.00
583	688255	凯尔达	80	2,056.80	0.00
584	300973	立高食品	20	1,923.60	0.00
585	300994	久祺股份	95	1,873.40	0.00
586	300614	百川畅银	83	1,873.31	0.00
587	001336	楚环科技	74	1,828.54	0.00
588	600746	江苏索普	200	1,624.00	0.00

589	000683	远兴能源	200	1,568.00	0.00
590	300814	中富电路	80	1,444.80	0.00
591	600508	上海能源	100	1,433.00	0.00
592	600418	江淮汽车	100	1,313.00	0.00
593	301118	恒光股份	42	1,268.82	0.00
594	001979	招商蛇口	100	1,263.00	0.00
595	301133	金钟股份	60	1,256.40	0.00
596	001231	农心科技	55	1,245.20	0.00
597	300925	法本信息	95	1,230.25	0.00
598	300932	三友联众	85	1,219.75	0.00
599	002708	光洋股份	200	1,114.00	0.00
600	605358	立昂微	26	1,107.60	0.00
601	300903	科翔股份	95	1,098.20	0.00
602	605208	永茂泰	81	1,080.54	0.00
603	300997	欢乐家	79	1,027.00	0.00
604	300879	大叶股份	60	1,016.40	0.00
605	300993	玉马遮阳	75	975.00	0.00
606	603048	浙江黎明	64	955.52	0.00
607	689009	九号公司-WD	28	853.72	0.00
608	603233	大参林	20	792.00	0.00
609	605555	德昌股份	37	751.10	0.00
610	001319	铭科精技	36	728.28	0.00
611	301078	孩子王	56	725.20	0.00
612	002567	唐人神	100	708.00	0.00
613	600409	三友化工	100	661.00	0.00
614	300864	南大环境	33	610.50	0.00
615	301180	万祥科技	36	592.20	0.00
616	600376	首开股份	100	569.00	0.00
617	301066	万事利	50	561.50	0.00
618	300930	屹通新材	20	482.40	0.00
619	605133	嵘泰股份	18	471.78	0.00
620	301052	果麦文化	20	445.20	0.00
621	301155	海力风电	5	436.75	0.00
622	301015	百洋医药	14	333.76	0.00
623	301091	深城交	14	333.20	0.00
624	301039	中集车辆	40	318.80	0.00
625	688093	世华科技	16	282.56	0.00
626	688569	铁科轨道	16	281.44	0.00
627	300891	惠云钛业	25	240.75	0.00
628	301126	达嘉维康	15	223.35	0.00
629	300940	南极光	9	168.03	0.00
630	301020	密封科技	10	166.90	0.00
631	300968	格林精密	20	160.40	0.00

632	601728	中国电信	11	46.09	0.00
-----	--------	------	----	-------	------

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002371	北方华创	19,255,689.04	4.63
2	603997	继峰股份	17,116,699.00	4.11
3	603596	伯特利	15,502,307.00	3.73
4	603260	合盛硅业	14,721,492.50	3.54
5	603032	德新科技	14,517,144.95	3.49
6	002011	盾安环境	14,244,373.00	3.42
7	605333	沪光股份	13,995,515.97	3.36
8	600660	福耀玻璃	13,520,851.14	3.25
9	688533	上声电子	13,336,172.97	3.21
10	603348	文灿股份	13,215,519.32	3.18
11	300498	温氏股份	12,818,058.65	3.08
12	002738	中矿资源	11,330,700.68	2.72
13	603477	巨星农牧	10,927,645.00	2.63
14	300014	亿纬锂能	10,811,230.25	2.60
15	002459	晶澳科技	10,688,838.60	2.57
16	601838	成都银行	10,628,364.83	2.55
17	300707	威唐工业	10,336,560.00	2.48
18	600988	赤峰黄金	10,328,737.00	2.48
19	002714	牧原股份	10,200,293.02	2.45
20	002648	卫星化学	9,641,675.78	2.32
21	300969	恒帅股份	9,303,247.84	2.24

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

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	605333	沪光股份	17,115,644.00	4.11
2	300498	温氏股份	15,793,265.00	3.80
3	603260	合盛硅业	15,415,914.60	3.71
4	688533	上声电子	14,954,767.18	3.59
5	002594	比亚迪	14,923,366.00	3.59
6	603997	继峰股份	13,752,268.20	3.31
7	002100	天康生物	13,331,037.25	3.20
8	300707	威唐工业	13,160,136.00	3.16
9	600660	福耀玻璃	12,805,047.00	3.08
10	603806	福斯特	12,651,777.20	3.04

11	603348	文灿股份	12,125,396.77	2.91
12	300969	恒帅股份	12,069,860.00	2.90
13	603032	德新科技	11,823,222.00	2.84
14	601012	隆基绿能	11,812,127.80	2.84
15	601838	成都银行	11,370,306.00	2.73
16	300750	宁德时代	10,936,155.00	2.63
17	002738	中矿资源	10,510,439.16	2.53
18	600765	中航重机	10,497,046.55	2.52
19	002714	牧原股份	10,111,998.00	2.43
20	002049	紫光国微	10,042,841.66	2.41
21	603477	巨星农牧	9,803,431.00	2.36
22	600988	赤峰黄金	9,708,825.00	2.33
23	603501	韦尔股份	9,708,018.00	2.33
24	603596	伯特利	9,442,707.00	2.27
25	688008	澜起科技	9,126,724.38	2.19
26	688019	安集科技	9,101,499.89	2.19
27	300068	南都电源	9,013,515.64	2.17
28	603639	海利尔	8,930,529.86	2.15
29	601633	长城汽车	8,888,865.00	2.14

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,373,819,523.31
卖出股票收入（成交）总额	1,404,724,732.85

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
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）	226,412.30	0.08
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	226,412.30	0.08

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113661	福 22 转债	1,660	209,006.51	0.07
2	113059	福莱转债	150	17,405.79	0.01

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：无。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：无。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：无。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

8.11.2 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。

8.12 投资组合报告附注

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

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。

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券备选库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	87,220.82
2	应收清算款	4,886,458.51
3	应收股利	-

4	应收利息	-
5	应收申购款	29,065.86
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,002,745.19

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113059	福莱转债	17,405.79	0.01

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比 例 (%)	持有份额	占总份额比 例 (%)
19,465	9,783.76	54,071.99	0.03	190,386,802.19	99.97

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	728,182.44	0.3824

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

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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、基金投资和研发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	0~10

注：截至本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研发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。

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

注：无。

§ 10 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	17,024,001.64
减：本报告期基金总赎回份额	35,882,991.03
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	190,440,874.18

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人的重大人事变动：

报告期内，公司原董事 AndreaVismara 先生辞去本公司董事职务。经 2022 年第三次临时股东大会会议审议通过，股东会同意由 SandroVesprini 先生担任本公司董事，任职日期自 2022 年 3 月 31 日起。

报告期内，公司原监事 SandroVesprini 先生辞去本公司监事职务。经 2022 年第三次临时股东大会会议审议通过，股东会同意由 LorenzoPetracca 先生担任本公司监事，任职日期自 2022 年 3 月 31 日起。

报告期内，刘崧先生不再担任监事。经民主选举，宁江先生当选为公司职工监事，任职日期自 2022 年 9 月 8 日起。

报告期内，经公司第六届董事会第一百一十次会议审议通过，聘任刘崧先生担任公司副总经理，任职日期自 2022 年 9 月 7 日起。

本公司已将上述变更事项报中国证券监督管理委员会深圳监管局备案。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

无。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

11.4 基金投资策略的改变

未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未改聘为本基金审计的会计师事务所。本年度应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用 50,000.00 元，该审计机构已提供审计服务的年限为 6 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：无。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：无。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中金公司	1	900,616,404.88	32.66	826,622.02	33.96	-
国元证券	1	383,438,582.18	13.90	313,897.07	12.90	-
华西证券	1	335,483,649.74	12.17	274,796.46	11.29	-
国泰君安	1	239,813,875.89	8.70	220,254.48	9.05	-
国信证券	2	237,215,202.55	8.60	218,433.52	8.97	-
兴业证券	1	227,622,586.55	8.25	208,833.48	8.58	-
国盛证券	1	206,456,921.88	7.49	169,396.32	6.96	-
中泰证券	1	117,554,254.99	4.26	107,538.20	4.42	-

申万宏源 证券	2	59,319,831.9 6	2.15	48,329.16	1.99	-
招商证券	1	50,161,514.3 5	1.82	45,832.94	1.88	-
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、及时性以及提供研究服务主动性和质量等情况，并依据评比结果确定交易单元交易的具体情况。我公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向券商租用交易单元作为基金专用交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
中金公司	-	-	327,242,000.00	83.50	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
华西证	-	-	-	-	-	-

券						
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	19,203,000.00	4.90	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	16,095,000.00	4.11	-	-
中泰证券	-	-	29,386,000.00	7.50	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	鹏华基金管理有限公司关于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
4	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
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	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会	2022年02月21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	
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（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
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	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会	2022 年 04 月 30 日

	示性公告	基金电子披露网站	
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
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
25	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 07 月 06 日
26	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购隆达股份首次公开发行 A 股的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 07 月 15 日
27	鹏华基金管理有限公司关于暂停喜鹊财富基金销售有限公司办理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 07 月 15 日
28	鹏华策略回报灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第 2 季度报告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 07 月 20 日
29	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与西南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 07 月 25 日
30	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 08 月 04 日
31	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与长城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 08 月 04 日
32	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购凯格精机首次公开发行 A 股的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 08 月 10 日
33	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《中国证券报》、基金管	2022 年 08 月 11 日

		理人网站及中国证监会基金电子披露网站	
34	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购路维光电首次公开发行 A 股的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 08 月 12 日
35	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	《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 08 月 30 日
36	鹏华基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 09 月 07 日
37	鹏华策略回报灵活配置混合型证券投资基金更新的招募说明书	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 09 月 08 日
38	鹏华策略回报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 09 月 08 日
39	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购唯万密封首次公开发行 A 股的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 09 月 08 日
40	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购永信至诚首次公开发行 A 股的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 10 月 14 日
41	鹏华基金管理有限公司关于运用自有资金投资旗下基金的公告	《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 10 月 18 日
42	鹏华策略回报灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第 3 季度报告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 10 月 25 日
43	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 11 月 01 日
44	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 12 月 10 日
45	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 12 月 14 日
46	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与华泰证券股份有限公司认/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 12 月 15 日
47	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与渤海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 12 月 31 日

	(含定期定额投资)费率优惠活动的公告	基金电子披露网站	
48	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与西部证券股份有限公司申购(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12月31日
49	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国工商银行股份有限公司个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022年12月31日
50	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国工商银行股份有限公司“2023倾心回馈”基金定期定额申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022年12月31日

注：无。

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：无。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- (一)《鹏华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 年年度报告》(原文)。

13.2 存放地点

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

13.3 查阅方式

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

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

鹏华基金管理有限公司

2023 年 3 月 30 日