

鹏华沪深港新兴成长灵活配置混合型证券 投资基金 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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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	8
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	9
3.3 其他指标	10
3.4 过去三年基金的利润分配情况	11
§ 4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
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	17
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	17
§ 5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	18
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	18
§ 6 审计报告	18
6.1 审计报告基本信息	18
6.2 审计报告的基本内容	18
§ 7 年度财务报表	20
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	21
7.3 净资产（基金净值）变动表	22
7.4 报表附注	26

§ 8 投资组合报告	62
8.1 期末基金资产组合情况	62
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	62
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	63
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	67
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	80
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	80
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	80
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	80
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	80
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	80
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	80
8.12 投资组合报告附注	81
§ 9 基金份额持有人信息	81
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	81
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	82
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	82
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	82
§ 10 开放式基金份额变动	82
§ 11 重大事件揭示	82
11.1 基金份额持有人大会决议	82
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	82
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	83
11.4 基金投资策略的改变	83
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	83
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	83
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	83
11.8 其他重大事件	87
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	92
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	92
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	93
§ 13 备查文件目录	93
13.1 备查文件目录	93
13.2 存放地点	93
13.3 查阅方式	93

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华沪深港新兴成长灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	鹏华沪深港新兴成长混合
基金主代码	003835
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 12 月 2 日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,187,460,907.36 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，通过积极灵活的资产配置，并精选新兴成长主题股票，在有效控制风险前提下，力求超额收益与长期资本增值。
投资策略	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。 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 A 股和港股的优质公司，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）新兴成长主题的定义 本基金所投资的新兴成长主题企业包括传统产业中具备新的成长动力的企业和新兴产业中业绩显著增长的企业。 1）传统产业是指在历史上曾经高速增长，但目前发展速度趋缓，进入成熟阶段，资源消耗大和环保水平低的产业。随着我国经济模式的主动和被动调整、新技术的产生、新的商业模式的出现、生产方式的不断升级以及行业并购重组整合的加剧，传统产业中也会不断出现具有成长性、未来发展前景好的公司。发展较为成熟的上市公司，因不断更新生产技术、不断完善经营模式等使其具备良好的成长前景，以及传统产业中涌现的具备新技术、新经营理念的新兴上市公司，均属于本基金的投资主题。 2）新兴产业是指以重大技术突破和重大发展需求为基础，对经济社会全局和长远发展具有重大引领带动作用，知识技术密集、物质资源消耗少、成长潜力大、综合效益好的产业。参考国家战略新兴产业选择标准，本基金所指的新兴产业包括但不限于：节能环保、医药生物、新能源材料、军工、互联网、新一代信息技术、医疗健康、新兴消费行业等。 未来如果基金管理人认为有更适当的新兴成长主题的划分

	标准，基金管理人有权对上述界定方法进行变更。本基金由于上述原因变更界定方法不需经基金份额持有人大会通过，但应及时告知基金托管人并公告。若因基金管理人界定方法的调整等原因导致本基金持有的新兴成长主题的证券的比例低于非现金基金资产的 80%，本基金将在三十个交易日之内进行调整。 （2）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。 （3）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。 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：一方面为竞争力分析，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现有的资源、能力和定位取得可持续竞争优势。另一方面为管理层分析，通过着重考察公司的管理层以及管理制度，选择具有良好治理结构、管理水平较高的优质公司。 2）定量分析 本基金通过对公司定量的估值分析，挖掘优质的投资标的。通过对估值方法的选择和估值倍数的比较，选择股价相对低估的股票。就估值方法而言，基于行业的特点确定对股价最有影响力的关键估值方法（包括 PE、PEG、PB、PS、EV/EBITDA 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。 （4）港股通标的投资策略 除新兴成长主题的投资标的之外，本基金还将关注以下几类港股通标的：1）在港股市场上市、具有行业代表性的优质中资公司；2）具有行业稀缺性的香港本地和外资公司；3）港股市场在行业结构、估值、AH 股折溢价、股息率等方面具有吸引力的投资标的。 （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。 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。 （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。 （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。 （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。 （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。（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。（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。4、权证投资策略 本基金通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型及价值挖掘策略、价差策略、双向权证策略等寻求权证的合理估值水平，追求稳定的当期收益。5、中小企业私募债投资策略 中小企业私募债券是在中国境内以非公开方式发行和转让，约定在一定期限还本付息的公司债券。由于其非公开性及条款可协商性，普遍具有较高收益。本基金将深入研究发行人资信及公司运营情况，合理合规合格地进行中小企业私募债券投资。本基金在投资过程中密切监控债券信用等级或发行人信用等级变化情况，尽力规避风险，并获取超额收益。6、股指期货投资策略 本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目标，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，充分考虑股指期货的风险收益特征，通过多头或空头的套期保值策略，以改善投资组合的投资效果，实现股票组合的超额收益。未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，本基金可相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书中更新公告。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×70%+中证综合债指数收益率×30%
风险收益特征	本基金属于混合型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金，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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	高永杰	王小飞
	联系电话	0755-81395402	021-60637103
	电子邮箱	xxpl@phfund.com.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		4006788999	021-60637228
传真		0755-82021126	021-60635778
注册地址		深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		518048	100033
法定代表人		何如	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
----------------	--------

登载基金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	-904,523,311.34	32,344,519.48	63,382,410.89
本期利润	-1,264,345,935.43	-7,871,774.36	91,479,879.07
加权平均基 金份额本期 利润	-0.9644	-0.2173	0.8286
本期加权平 均净值利润 率	-55.41%	-8.88%	41.53%
本期基金份 额净值增长 率	-17.61%	-12.68%	56.52%
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	1,095,462,013.89	10,151,193.43	68,555,385.11
期末可供分 配基金份额 利润	0.3437	1.1283	0.9108
期末基金资 产净值	4,557,552,488.31	19,148,102.15	183,467,392.44
期末基金份 额净值	1.430	2.128	2.437
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	75.32%	112.80%	143.70%

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

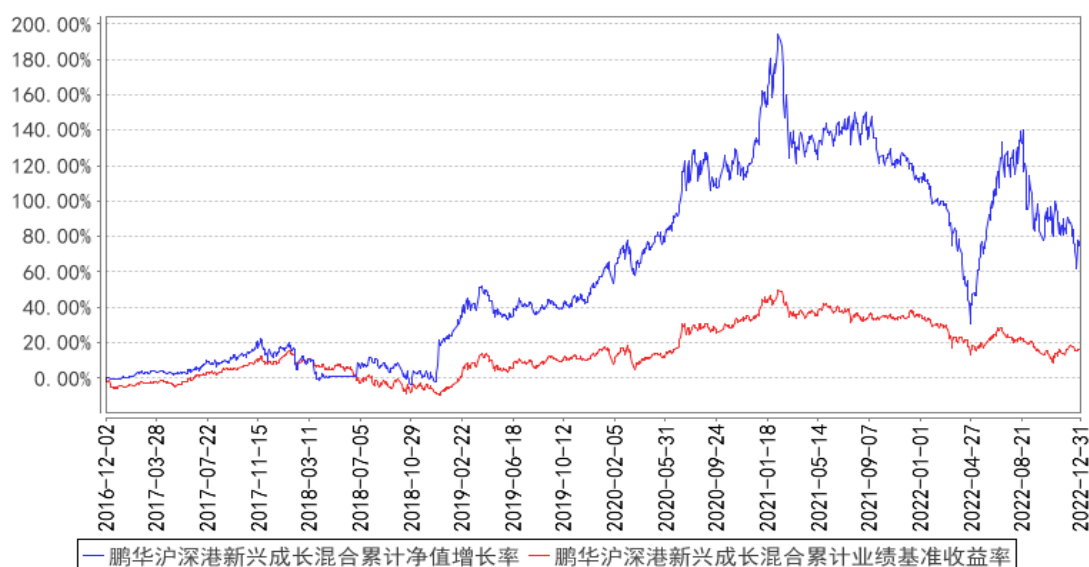
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-4.28%	2.39%	1.32%	0.90%	-5.60%	1.49%
过去六个月	-17.50%	2.65%	-9.23%	0.77%	-8.27%	1.88%
过去一年	-17.61%	2.41%	-14.49%	0.90%	-3.12%	1.51%
过去三年	12.60%	1.92%	0.77%	0.91%	11.83%	1.01%
过去五年	53.38%	1.71%	6.71%	0.91%	46.67%	0.80%
自基金合同生效起至今	75.32%	1.58%	16.14%	0.84%	59.18%	0.74%

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

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

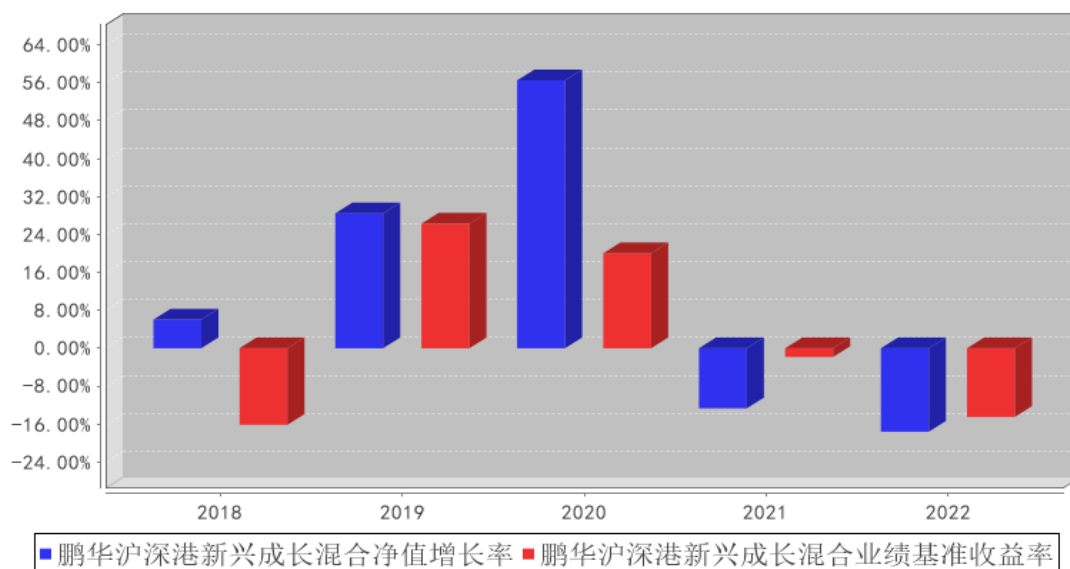
鹏华沪深港新兴成长混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2016 年 12 月 02 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

鹏华沪深港新兴成长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

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分 红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总 额	年度利润分配合计	备注
2022 年	3.6500	782,660,087.66	210,052,436.69	992,712,524.35	-
2021 年	-	-	-	-	-
2020 年	-	-	-	-	-
合计	3.6500	782,660,087.66	210,052,436.69	992,712,524.35	-

§ 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的经验。

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		
尤 柏 年	基金经理	2016-12- 28	2022-03- 05	18 年	尤柏年先生，国籍中国，经济学博士，18 年证券从业经验。历任澳大利亚 BConnect 公司 Apex 投资咨询团队分析师，华宝兴业基金管理有限公司金融工程部高级数量分析师、海外投资管理部高级分析师、基金经理助理、华宝兴业成熟市场基金和华宝兴业标普油气基金基金经理等职；2014 年 7 月加盟鹏华基金管理有限公司，现担任国际业务部基金经理。2014 年 08 月至 2022 年 07 月担任鹏华全球高收益债债券型证券投资基金基金经理，2014 年 09 月至 2020 年 01 月担任鹏华环球发现证券投资基金基金经理，2015 年 07 月至 2022 年 11 月担任鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金基金经理，2016 年 12 月至 2022 年 03 月担任鹏华沪深港新兴成长灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017 年 11 月至 2022 年 09 月担任鹏华

					香港美国互联网股票型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2017 年 11 月至 2019 年 08 月担任鹏华港股通中证香港银行投资指数证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2017 年 11 月至 2021 年 10 月担任鹏华港股通中证香港中小企业投资主题指数证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2020 年 01 月至 2022 年 07 月担任鹏华全球中短债债券型证券投资基金 (QDII) 基金经理, 2021 年 05 月至 2021 年 09 月担任鹏华红利优选混合型证券投资基金基金经理, 尤柏年先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理发生变动, 增聘朱庆恒、闫思倩为本基金基金经理, 尤柏年不再担任本基金基金经理。
朱庆恒	基金经理	2022-03-05	-	11 年	朱庆恒先生, 国籍英国, 房地产金融博士, 11 年证券从业经验。2011 年 7 月加盟鹏华基金管理有限公司, 从事研究分析工作, 历任国际业务部助理研究员、投资经理, 现担任国际业务部基金经理。2014 年 09 月至今担任鹏华美国房地产证券投资基金基金经理, 2022 年 03 月至今担任鹏华沪深港新兴成长灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 朱庆恒先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理发生变动, 增聘朱庆恒、闫思倩为本基金基金经理, 尤柏年不再担任本基金基金经理。
闫思倩	基金经理	2022-05-07	-	12 年	闫思倩女士, 国籍中国, 工程硕士, 12 年证券从业经验。曾任华创证券分析师, 中银国际证券业务经理, 工银瑞信基金研究部基金经理。2022 年 1 月加盟鹏华基金管理有限公司, 现担任权益投资三部总经理/投资总监/基金经理。2022 年 05 月至今担任鹏华沪深港新兴成长灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2022 年 07 月至今担任鹏华新能源汽车主题混合型证券投资基金基金经理, 闫思倩女士具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理发生变动, 增聘朱庆恒、闫思倩为本基金基金经理, 尤柏年不再担任本基金基金经理。

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。

3. 朱庆恒 2023 年 3 月 25 日离任本基金基金经理。

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、分配等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 年沪深 300 下跌 25.85%，鹏华沪深港新兴成长基金下跌 17.61%。2022 年行业受防疫及海外加息、外围摩擦影响，整体表现一般。大盘经历了 4 月和 3 季度的下跌两次回到 3000 点。总

体预期悲观，随着二十大召开，消费、信创、医药防疫板块开始反弹。年底国内疫情即将达峰渡过，展望 2023 年，经济恢复的确定性进一步确认，虽然海外经济衰退仍未结束，但防疫、美联储加息和俄乌局势影响逐步进入尾声。我们看好 2023 年的权益市场表现，2023 年恢复和创新的机会有望超市场预期。2023 年是恢复的第一年，是从 2022 年的滞涨到恢复的一年。一方面，滞代表需求，需求会复苏，消费会复苏；另一方面是涨会缓解，过去 2 年上游油价、能源、大宗产品持续涨价，接下来中下游企业盈利的压制将得到缓解。最后，中长期看好成长和 innovation 的机会。国内经济领先全球恢复增长之后，更长时期的持续增长，还是要回到转型升级和创新成长上来。具体到投资机会，在恢复上，要重视龙头企业的价值，很多是国内各行各业最好的龙头公司。他们都在经历困境反转，不管是从需求角度、盈利角度，还是政策支持角度。比如食品饮料、旅游机场、地产家居、互联网等行业龙头。还有养猪、造纸等盈利恢复的行业龙头。在创新领域，我们持续看好成长，尤其是新能源、智能驾驶、ARVR、工业机器人等。我们认为碳中和板块随着行业快速增长，在行业从 1 到 N 的发展过程中依然具备很大机会，包括储能、光伏、智能汽车等。行业也已经是几万亿价值和市值的大市场，未来创新和技术升级的机会越来越多。随着光伏硅料、碳酸锂等新能源上游价格下跌，终端产品降价会刺激需求更好增长。目前新能源领域技术迭代和升级的速度最快，包括 ADAS 软件、智能驾驶硬件芯片、钠电池、PET 铜箔、光伏 TOPCON、异质结电池等新技术。鉴于大盘回到历史较低点位，以及对困境反转的行业龙头，及新能源等景气行业整体乐观的观点，基金整体仓位较高，超额收益略微回升。对于具体环节配置，继续看好新能源产业链个股、科技创新领域，维持超配；同时中长期看好受益于上游价格见顶的中下游受益标的，对看好的龙头维持超配。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期鹏华沪深港新兴成长混合份额净值增长率为-17.61%，同期业绩比较基准增长率为-14.49%。

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，经济恢复的确定性进一步确认，虽然海外经济衰退仍未结束，但防疫、美联储加息和俄乌局势影响逐步进入尾声。我们看好 2023 年的权益市场表现，2023 年恢复和创新的机会有望超市场预期。2023 年是恢复的第一年，是从 2022 年的滞涨到恢复的一年。一方面，滞代表需求，需求会复苏，消费会复苏；另一方面是涨会缓解，过去 2 年上游油价、能源、大宗产品持续涨价，接下来中下游企业盈利的压制将得到缓解。最后，中长期看好成长和 innovation 的机会。国内经济领先全球恢复增长之后，更长时期的持续增长，还是要回到转型升级和创新成长上来。具体到投资机会，在恢复上，要重视龙头企业的价值，很多是国内各行各业最好的龙头公司。他们

都在经历困境反转，不管是从需求角度、盈利角度，还是政策支持角度。比如食品饮料、旅游机场、地产家居、互联网等行业龙头。还有养猪、造纸等盈利恢复的行业龙头。在创新领域，我们持续看好成长，尤其是新能源、智能驾驶、ARVR、工业机器人等。我们认为碳中和板块随着行业快速增长，在行业从 1 到 N 的发展过程中依然具备很大机会，包括储能、光伏、智能汽车等。行业也已经是几万亿价值和市值的大市场，未来创新和技术升级的机会越来越多。随着光伏硅料、碳酸锂等新能源上游价格下跌，终端产品降价会刺激需求更好增长。目前新能源领域技术迭代和升级的速度最快，包括 ADAS 软件、智能驾驶硬件芯片、钠电池、PET 铜箔、光伏 TOPCON、异质结电池等新技术。鉴于大盘回到历史较低点位，以及对困境反转的行业龙头，及新能源等景气行业整体乐观的观点，基金整体仓位较高，超额收益略微回升。对于具体环节配置，继续看好新能源产业链个股、科技创新领域，维持超配；同时中长期看好受益于上游价格见顶的中下游受益标的，对看好的龙头维持超配。

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 1,095,462,013.89 元，期末基金份额净值 1.430 元。

2、本基金于 2022 年 09 月 27 日进行利润分配，分配金额为 992,712,524.35 元。

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

本报告期内，本基金存在连续六十个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情形，本基金管理人及相关机构正在就可行的解决方案进行探讨论证。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 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 23878 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	鹏华沪深港新兴成长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	(一)我们审计的内容 我们审计了鹏华沪深港新兴成长灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“鹏华沪深港新兴成长混合基金”)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。 (二)我们的意见 我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了鹏华沪深港新兴成长混合基金 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。
形成审计意见的基础	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。 按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于鹏华沪深港新兴成长混合基金,并履行了职业道德方面的其他责任。
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	鹏华沪深港新兴成长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。 在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估鹏华沪深港新兴成长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沪深港新兴成长混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督鹏华沪深港新兴成长混合基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	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。 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: (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。 (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。 (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。 (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,就可能导致对鹏华沪深港新兴成长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沪深港新兴成长混合基金不能持续经营。 (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。 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。	
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：鹏华沪深港新兴成长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	268,403,883.53	3,077,566.58
结算备付金		17,081,484.55	1,741,516.89
存出保证金		2,580,697.59	37,407.32
交易性金融资产	7.4.7.2	4,296,747,155.42	14,161,671.71
其中：股票投资		4,296,747,155.42	14,161,671.71
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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	-	-
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		428,329.45	641,016.30
应收股利		-	-
应收申购款		720,927.42	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	1,272.86
资产总计		4,585,962,477.96	19,660,451.66
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		8,811,609.52	410,992.80
应付赎回款		5,832,268.99	3,628.77
应付管理人报酬		2,361,133.97	10,099.47
应付托管费		983,805.82	4,208.08
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	10,421,171.35	83,420.39
负债合计		28,409,989.65	512,349.51
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	3,187,460,907.36	8,996,908.72
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	1,370,091,580.95	10,151,193.43
净资产合计		4,557,552,488.31	19,148,102.15
负债和净资产总计		4,585,962,477.96	19,660,451.66

注： 报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.430 元，基金份额总额 3,187,460,907.36 份。

7.2 利润表

会计主体：鹏华沪深港新兴成长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		-1,245,292,995.81	-5,629,032.68
1. 利息收入		706,008.18	76,592.11
其中：存款利息收入	7.4.7.13	706,008.18	76,592.11
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”		-890,449,549.16	34,427,067.79

填列)			
其中：股票投资收益	7.4.7.14.2	-892,002,369.04	33,938,213.49
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	-	-
资产支持证券投资 收益	7.4.7.16	-	-
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	1,552,819.88	488,854.30
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	-359,822,624.09	-40,216,293.84
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	4,273,169.26	83,601.26
减：二、营业总支出		19,052,939.62	2,242,741.68
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	13,289,629.47	542,753.38
2. 托管费	7.4.10.2.2	5,537,345.56	226,147.15
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		-	-
8. 其他费用	7.4.7.23	225,964.59	1,473,841.15
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		-1,264,345,935.43	-7,871,774.36
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		-1,264,345,935.43	-7,871,774.36
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		-1,264,345,935.43	-7,871,774.36

7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：鹏华沪深港新兴成长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)	8,996,908.72	-	10,151,193.43	19,148,102.15
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)	8,996,908.72	-	10,151,193.43	19,148,102.15
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	3,178,463,998.64	-	1,359,940,387.52	4,538,404,386.16
(一)、综合收益总额	-	-	-1,264,345,935.43	-1,264,345,935.43
(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)	3,178,463,998.64	-	3,616,998,847.30	6,795,462,845.94
其中:1. 基金申购款	3,688,612,549.41	-	4,063,794,446.69	7,752,406,996.10
2. 基金赎回款	-510,148,550.77	-	-446,795,599.39	-956,944,150.16

(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)	-	-	-992,712,524.35	-992,712,524.35
(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)	3,187,460,907.36	-	1,370,091,580.95	4,557,552,488.31
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)	75,271,065.86	-	108,196,326.58	183,467,392.44
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)	75,271,065.86	-	108,196,326.58	183,467,392.44
三、本期 增减变动 额(减少以“-” 号填列)	-66,274,157.14	-	-98,045,133.15	-164,319,290.29

(一)、综合收益总额	-	-	-7,871,774.36	-7,871,774.36
(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)	-66,274,157.14	-	-90,173,358.79	-156,447,515.93
其中:1.基金申购款	12,967,016.67	-	19,941,069.58	32,908,086.25
2.基金赎回款	-79,241,173.81	-	-110,114,428.37	-189,355,602.18
(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)	8,996,908.72	-	10,151,193.43	19,148,102.15

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

鹏华沪深港新兴成长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[2015]2638号《关于准予鹏华沪深港新兴成长灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》准予,由鹏华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华沪深港新兴成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币430,388,047.00元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第1599号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华沪深港新兴成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2016年12月2日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为430,388,068.84份基金份额,其中认购资金利息折合21.84份基金份额。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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其他相关规定(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》、《鹏华沪深港新兴成长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7.4.4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。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定,开放式基金在基金合同生效后,连续60个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5,000万元情形的,基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案,如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等,并召开基金份额持有人大会进行表决。于2022年内,本基金出现连续60个工作日基金资产净值低于5,000万元的情形,本基金的基金管理人已向中国证监会报告并在评估后续处理方案,故本财务报表仍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业务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业务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。

7.4.4.4 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的，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、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持

的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算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分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

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分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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 349.38 元、899.22 元、24.26 元、-1,272.86 元、-43,415.81 元和 43,415.81 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[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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	268,403,883.53	3,077,566.58
等于：本金	268,378,489.14	3,077,566.58
加：应计利息	25,394.39	-
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	268,403,883.53	3,077,566.58

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		4,657,480,783.47	-	4,296,747,155.42	-360,733,628.05
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		4,657,480,783.47	-	4,296,747,155.42	-360,733,628.05
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		15,072,675.67	-	14,161,671.71	-911,003.96
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	15,072,675.67	-	14,161,671.71	-911,003.96
----	---------------	---	---------------	-------------

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

注：无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

7.4.7.4.3 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	-	1,272.86
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	1,272.86

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	7,041.78	4.58
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	10,194,129.57	43,415.81
其中：交易所市场	10,194,129.57	43,415.81
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	220,000.00	40,000.00
合计	10,421,171.35	83,420.39

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	8,996,908.72	8,996,908.72
本期申购	3,688,612,549.41	3,688,612,549.41
本期赎回（以“-”号填列）	-510,148,550.77	-510,148,550.77
- 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	3,187,460,907.36	3,187,460,907.36

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	13,556,930.92	-3,405,737.49	10,151,193.43
本期利润	-904,523,311.34	-359,822,624.09	-1,264,345,935.43
本期基金份额交易产生的变动数	2,979,140,918.66	637,857,928.64	3,616,998,847.30
其中：基金申购款	3,383,039,158.41	680,755,288.28	4,063,794,446.69
基金赎回款	-403,898,239.75	-42,897,359.64	-446,795,599.39
本期已分配利润	-992,712,524.35	-	-992,712,524.35
本期末	1,095,462,013.89	274,629,567.06	1,370,091,580.95

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	502,736.07	36,722.68
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	190,413.36	34,412.98
其他	12,858.75	5,456.45
合计	706,008.18	76,592.11

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	-892,002,369.04	33,938,213.49
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	-892,002,369.04	33,938,213.49

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	13,058,364,922.36	494,047,770.66
减：卖出股票成本总额	13,905,704,965.49	460,109,557.17
减：交易费用	44,662,325.91	-
买卖股票差价收入	-892,002,369.04	33,938,213.49

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

注：无。

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	1,552,819.88	488,854.30
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	1,552,819.88	488,854.30

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	-359,822,624.09	-40,216,293.84
股票投资	-359,822,624.09	-40,216,293.84
债券投资	-	-
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	-359,822,624.09	-40,216,293.84

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	4,260,150.36	83,601.26
基金转换费收入	13,018.90	-
合计	4,273,169.26	83,601.26

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	100,000.00	40,000.00
信息披露费	120,000.00	-
证券出借违约金	-	-
银行汇划费用	5,944.08	7,061.31
证券组合费	20.51	-
交易费用	-	1,426,779.84
合计	225,964.59	1,473,841.15

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
中国建设银行股份有限公司(“建设银行”)	基金托管人
深圳市北融信投资发展有限公司	基金管理人的股东
意大利欧利盛资本资产管理股份公司(“Eurizon Capital SGR S.p.A.”)	基金管理人的股东
国信证券股份有限公司(“国信证券”)	基金管理人的股东
鹏华资产管理有限公司(“鹏华资产”)	基金管理人的子公司

注：1、本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

2、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	1,174,887,861.94	3.72	2,034,126.79	0.24

7.4.10.1.2 债券交易

注：无。

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

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	1,082,421.22	3.73	580,122.65	5.69
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	1,853.60	0.24	-	-

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	13,289,629.47	542,753.38
其中：支付销售机构的客户维护费	2,291,124.23	56,219.83

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 0.60%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×0.60%÷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	5,537,345.56	226,147.15

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

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

份额单位：份

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
基金合同生效日（2016 年 12 月 2 日）持有的基金份额	—	—
报告期初持有的基金份额	—	—
报告期间申购/买入总份额	6,434,362.93	—
报告期间因拆分变动份额	—	—
减：报告期间赎回/卖出总份额	—	—
报告期末持有的基金份额	6,434,362.93	—
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.2019%	—

注：本基金管理人投资本基金的费率标准与其他相同条件的投资者适用的费率标准相一致。

7.4.10.5.2 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
中国建设银行	268,403,883.53	502,736.07	3,077,566.58	36,722.68

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	688401	路维光电	网下申购	4,947	124,070.76
国信证券	688231	隆达股份	网下申购	7,835	306,191.80
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	688323	瑞华泰	网下申购	2,933	17,510.01

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

单位：人民币元

序号	权益 登记 日	除息日		每 10 份基金 份额分 红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配合 计	备注
		场内	场外					
1	2022 年 9 月 27 日	-	2022 年 9 月 27 日	3.6500	782,660,087.66	210,052,436.69	992,712,524.35	-
合计	-	-	-	3.6500	782,660,087.66	210,052,436.69	992,712,524.35	-

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
002487	大金	2022	6 个	非公	37.35	37.35	1,017,403	38,000,002.05	38,000,002.05	-

	重工	年 12 月 30 日	月	开发 行流 通受 限						
301095	广立微	2022 年 7 月 28 日	6 个月	新股 流通 受限	58.00	86.49	740	42,920.00	64,002.60	-
301115	建科股份	2022 年 8 月 23 日	6 个月	新股 流通 受限	42.05	24.04	685	28,804.25	16,467.40	-
301132	满坤科技	2022 年 8 月 3 日	6 个月	新股 流通 受限	26.80	24.48	468	12,542.40	11,456.64	-
301152	天力锂能	2022 年 8 月 19 日	6 个月	新股 流通 受限	57.00	46.64	433	24,681.00	20,195.12	-
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	985	17,907.30	17,454.20	-
301175	中科环保	2022 年 6 月 30 日	6 个月	新股 流通 受限	3.82	6.01	6,370	24,333.40	38,283.70	-
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	417	14,032.05	29,056.56	-
301265	华新环保	2022 年 12 月 8 日	6 个月	新股 流通 受限	13.28	11.40	819	10,876.32	9,336.60	-
301267	华夏眼科	2022 年 10 月 26 日	6 个月	新股 流通 受限	50.88	66.20	1,006	51,185.28	66,597.20	-

301269	华大九天	2022年7月21日	6个月	新股流通受限	32.69	87.94	1,061	34,684.09	93,304.34	-
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	303	12,319.98	6,850.83	-
301277	新天地	2022年11月9日	6个月	新股流通受限	27.00	25.78	439	11,853.00	11,317.42	-
301282	金禄电子	2022年8月18日	6个月	新股流通受限	30.38	25.25	434	13,184.92	10,958.50	-
301283	聚胶股份	2022年8月26日	6个月	新股流通受限	52.69	51.41	235	12,382.15	12,081.35	-
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	330	14,549.70	11,592.90	-
301296	新巨丰	2022年8月26日	6个月	新股流通受限	18.19	14.90	1,042	18,953.98	15,525.80	-
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	3,574	17,870.00	26,912.22	-
301306	西测测试	2022年7月19日	6个月	新股流通受限	43.23	42.29	255	11,023.65	10,783.95	-
301309	万得凯	2022年9月	6个月	新股流通	39.00	24.46	228	8,892.00	5,576.88	-

		8 日		受限						
301311	昆船智能	2022 年 11 月 23 日	6 个月	新股流通受限	13.88	15.86	832	11,548.16	13,195.52	-
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	206	13,324.08	8,598.44	-
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	242	57,475.00	42,826.74	-
301328	维峰电子	2022 年 8 月 30 日	6 个月	新股流通受限	78.80	76.96	191	15,050.80	14,699.36	-
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	913	17,146.14	14,233.67	-
301349	信德新材	2022 年 8 月 30 日	6 个月	新股流通受限	138.88	103.52	180	24,998.40	18,633.60	-
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	445	13,643.70	16,843.25	-
301367	怡和嘉业	2022 年 10 月 21 日	6 个月	新股流通受限	119.88	175.78	223	26,733.24	39,198.94	-

		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	770	17,617.60	13,575.10	-
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	-
688041	海光信息	2022 年 8 月 5 日	6 个月	新股流通受限	36.00	39.15	40,886	1,471,896.00	1,600,686.90	-
688141	杰华特	2022 年 12 月 16 日	6 个月	新股流通受限	38.26	43.89	9,946	380,533.96	436,529.94	-
688152	麒麟信安	2022 年 10 月 18 日	6 个月	新股流通受限	68.89	130.72	1,189	81,910.21	155,426.08	-

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

注：无。

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），港股通标的股票，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）。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建设银行股份有限公司及其他具有基金托管资格的银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。

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

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

于 2022 年 12 月 31 日，本基金未持有信用类债券（2021 年 12 月 31 日：未持有）。

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

注：无。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

7.4.13.3 流动性风险

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

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

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

于 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、流通受限制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公司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

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	268,403,883.53	-	-	-	268,403,883.53
结算备付金	17,081,484.55	-	-	-	17,081,484.55
存出保证金	2,580,697.59	-	-	-	2,580,697.59
交易性金融资产	-	-	-	4,296,747,155.42	4,296,747,155.42
应收申购款	-	-	-	720,927.42	720,927.42
应收清算款	-	-	-	428,329.45	428,329.45
资产总计	288,066,065.67	-	-	4,297,896,412.29	4,585,962,477.96
负债					
应付赎回款	-	-	-	5,832,268.99	5,832,268.99
应付管理人报酬	-	-	-	2,361,133.97	2,361,133.97
应付托管费	-	-	-	983,805.82	983,805.82
应付清算款	-	-	-	8,811,609.52	8,811,609.52
其他负债	-	-	-	10,421,171.35	10,421,171.35
负债总计	-	-	-	28,409,989.65	28,409,989.65
利率敏感度缺口	288,066,065.67	-	-	4,269,486,422.64	4,557,552,488.31
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	3,077,566.58	-	-	-	3,077,566.58
结算备付金	1,741,516.89	-	-	-	1,741,516.89
存出保证金	37,407.32	-	-	-	37,407.32
交易性金融资产	-	-	-	14,161,671.71	14,161,671.71
应收清算款	-	-	-	641,016.30	641,016.30
其他资产	-	-	-	1,272.86	1,272.86
资产总计	4,856,490.79	-	-	14,803,960.87	19,660,451.66
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,628.77	3,628.77
应付管理人报酬	-	-	-	10,099.47	10,099.47
应付托管费	-	-	-	4,208.08	4,208.08
应付清算款	-	-	-	410,992.80	410,992.80
其他负债	-	-	-	83,420.39	83,420.39
负债总计	-	-	-	512,349.51	512,349.51
利率敏感度缺口	4,856,490.79	-	-	14,291,611.36	19,148,102.15

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 0.00%。因此当利率发生合理、可能的变动时，对于本基金资产净值无重大影响。

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

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
资产合计	-	-	-	-
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇 风险敞口净额	-	-	-	-
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	1,693,658.40	-	1,693,658.40
资产合计	-	1,693,658.40	-	1,693,658.40
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇 风险敞口净额	-	1,693,658.40	-	1,693,658.40

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%（其中投资于国内依法发行的股票的比例占基金资产的 0-95%，投资于港股通标的股票的比例占基金资产的 0-95%）；投资于新兴成长主题的公司发行的证券（含存托凭证）占非现金基金资产的比例不低于 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金，存出保证金，应收申购款等。如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

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	4,296,747,155.42	94.28	14,161,671.71	73.96
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
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	4,296,747,155.42	94.28	14,161,671.71	73.96

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%	210,809,590.35	1,036,678.25
	业绩比较基准下降 5%	-210,809,590.35	-1,036,678.25

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	4,255,767,973.52	14,161,671.71
第二层次	-	-
第三层次	40,979,181.90	-

合计	4,296,747,155.42	14,161,671.71
----	------------------	---------------

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	-	-	-
当期购买	-	38,000,002.05	38,000,002.05
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	2,676,052.38	2,676,052.38
转出第三层次	-	33,872.43	33,872.43
当期利得或损失总额	-	336,999.90	336,999.90
其中：计入损益的利得或损失	-	336,999.90	336,999.90
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	40,979,181.90	40,979,181.90
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	-	333,991.79	333,991.79
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	-	-	-
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	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
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	-	-	-

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	40,979,181.90	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	-	-	-	-	-

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	4,296,747,155.42	93.69
	其中：股票	4,296,747,155.42	93.69
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	285,485,368.08	6.23
8	其他各项资产	3,729,954.46	0.08
9	合计	4,585,962,477.96	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	4,189,002,355.88	91.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	56,312.23	0.00
E	建筑业	48,244,936.80	1.06
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	26,770.50	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,135,529.39	0.24
J	金融业	18,956.45	0.00
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	16,090.75	0.00
M	科学研究和技术服务业	46,714,371.49	1.02
N	水利、环境和公共设施管理业	418,302.87	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	1,014,626.22	0.02
R	文化、体育和娱乐业	98,902.84	0.00
S	综合	-	-
	合计	4,296,747,155.42	94.28

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	300068	南都电源	19,337,567	411,890,177.10	9.04
2	605117	德业股份	897,120	297,126,144.00	6.52
3	002897	意华股份	4,502,042	264,675,049.18	5.81
4	002335	科华数据	5,191,304	258,994,156.56	5.68
5	000821	京山轻机	11,331,375	185,834,550.00	4.08
6	600418	江淮汽车	13,302,088	174,656,415.44	3.83
7	300174	元力股份	7,333,738	146,381,410.48	3.21
8	300438	鹏辉能源	1,871,400	145,950,486.00	3.20
9	002245	蔚蓝锂芯	8,135,029	121,049,231.52	2.66
10	688408	中信博	1,187,937	116,893,000.80	2.56
11	002150	通润装备	5,378,600	110,422,658.00	2.42
12	002837	英维克	3,014,557	100,414,893.67	2.20
13	002324	普利特	6,274,400	100,390,400.00	2.20
14	688048	长光华芯	1,030,978	99,747,121.50	2.19
15	688345	博力威	1,813,834	95,171,869.98	2.09
16	300566	激智科技	3,472,890	92,726,163.00	2.03
17	300835	龙磁科技	2,450,150	88,205,400.00	1.94
18	605589	圣泉集团	4,085,010	87,378,363.90	1.92
19	002121	科陆电子	9,286,902	86,182,450.56	1.89
20	300693	盛弘股份	1,524,501	82,749,914.28	1.82
21	600152	维科技术	5,600,866	82,724,790.82	1.82
22	600586	金晶科技	8,695,100	75,734,321.00	1.66
23	688390	固德威	229,785	74,241,235.65	1.63
24	300428	立中集团	2,545,800	63,008,550.00	1.38
25	300263	隆华科技	8,349,300	59,113,044.00	1.30
26	002866	传艺科技	1,233,600	56,461,872.00	1.24
27	688663	新风光	1,196,209	52,633,196.00	1.15
28	688348	昱能科技	85,606	48,667,011.00	1.07
29	688378	奥来德	847,688	42,808,244.00	0.94
30	300718	长盛轴承	1,837,390	41,947,613.70	0.92
31	002487	大金重工	1,017,403	38,000,002.05	0.83

32	601890	亚星锚链	4,019,800	35,494,834.00	0.78
33	002669	康达新材	2,757,600	35,490,312.00	0.78
34	601886	江河集团	4,207,700	32,567,598.00	0.71
35	301046	能辉科技	891,850	30,902,602.50	0.68
36	002997	瑞鹄模具	1,198,700	29,248,280.00	0.64
37	300890	翔丰华	692,900	28,062,450.00	0.62
38	300861	美畅股份	527,545	25,934,112.20	0.57
39	300827	上能电气	435,060	25,598,930.40	0.56
40	688498	源杰科技	212,606	25,412,795.18	0.56
41	688032	禾迈股份	26,344	24,688,279.60	0.54
42	605286	同力日升	535,300	22,520,071.00	0.49
43	300490	华自科技	1,882,200	21,701,766.00	0.48
44	688170	德龙激光	450,470	21,149,566.50	0.46
45	688033	天宜上佳	950,158	20,684,939.66	0.45
46	600522	中天科技	1,139,800	18,407,770.00	0.40
47	603212	赛伍技术	569,800	18,062,660.00	0.40
48	300095	华伍股份	1,893,400	16,983,798.00	0.37
49	603098	森特股份	555,540	15,677,338.80	0.34
50	300825	阿尔特	1,345,400	14,839,762.00	0.33
51	002254	泰和新材	686,624	14,563,295.04	0.32
52	300990	同飞股份	157,397	14,461,636.36	0.32
53	301268	铭利达	277,316	13,924,036.36	0.31
54	300565	科信技术	550,900	12,813,934.00	0.28
55	688503	聚和材料	70,834	10,562,057.74	0.23
56	000657	中钨高新	629,300	9,968,112.00	0.22
57	600477	杭萧钢构	2,192,600	8,880,030.00	0.19
58	300496	中科创达	84,100	8,435,230.00	0.19
59	300757	罗博特科	122,200	6,402,058.00	0.14
60	301168	通灵股份	66,400	4,805,368.00	0.11
61	002675	东诚药业	275,400	4,560,624.00	0.10
62	688041	海光信息	40,886	1,600,686.90	0.04
63	688271	联影医疗	7,058	1,249,124.84	0.03
64	301269	华大九天	10,005	898,890.42	0.02
65	688439	振华风光	6,798	808,146.24	0.02
66	688172	燕东微	40,177	762,559.46	0.02
67	301267	华夏眼科	10,052	727,950.26	0.02
68	688409	富创精密	6,334	684,768.74	0.02
69	301095	广立微	6,999	621,241.37	0.01
70	688114	华大智造	5,336	592,882.96	0.01
71	301018	申菱环境	16,900	578,825.00	0.01
72	301367	怡和嘉业	2,229	479,656.36	0.01
73	688141	杰华特	9,946	436,529.94	0.01
74	688392	骄成超声	2,745	397,228.95	0.01

75	603348	文灿股份	6,800	391,476.00	0.01
76	301175	中科环保	58,994	357,711.38	0.01
77	301301	川宁生物	35,740	314,797.92	0.01
78	688371	菲沃泰	14,980	302,146.60	0.01
79	688053	思科瑞	4,865	299,489.40	0.01
80	301239	普瑞眼科	4,066	286,675.96	0.01
81	688381	帝奥微	7,053	280,145.16	0.01
82	688231	隆达股份	7,515	268,435.80	0.01
83	688432	有研硅	20,044	265,382.56	0.01
84	688373	盟科药业-U	29,485	261,237.10	0.01
85	688353	华盛锂电	4,031	260,886.32	0.01
86	688035	德邦科技	4,981	257,069.41	0.01
87	688293	奥浦迈	2,452	253,046.40	0.01
88	688400	凌云光	9,449	241,232.97	0.01
89	688205	德科立	4,519	225,407.72	0.00
90	688401	路维光电	4,947	215,639.73	0.00
91	301152	天力锂能	4,226	203,017.72	0.00
92	688489	三未信安	1,995	202,153.35	0.00
93	301349	信德新材	1,798	197,357.88	0.00
94	301363	美好医疗	4,447	184,567.07	0.00
95	688403	汇成股份	17,152	179,924.48	0.00
96	301171	易点天下	9,345	173,869.80	0.00
97	688362	甬矽电子	7,779	169,504.41	0.00
98	301115	建科股份	6,450	159,612.35	0.00
99	688147	微导纳米	6,293	157,828.44	0.00
100	688152	麒麟信安	1,189	155,426.08	0.00
101	688084	晶品特装	1,875	155,025.00	0.00
102	301328	维峰电子	1,910	153,250.76	0.00
103	301296	新巨丰	9,811	151,006.85	0.00
104	301297	富乐德	10,147	150,256.17	0.00
105	301377	鼎泰高科	7,695	149,789.85	0.00
106	301311	昆船智能	8,320	145,957.76	0.00
107	301339	通行宝	8,727	143,711.65	0.00
108	688391	钜泉科技	1,397	140,524.23	0.00
109	301338	凯格精机	2,568	130,358.99	0.00
110	301283	聚胶股份	2,344	125,419.01	0.00
111	301277	新天地	4,384	125,209.57	0.00
112	301290	东星医疗	3,291	122,423.13	0.00
113	301112	信邦智能	3,884	120,753.56	0.00
114	301302	华如科技	1,849	118,391.47	0.00
115	688376	美埃科技	3,713	116,142.64	0.00
116	301132	满坤科技	4,572	115,780.32	0.00
117	301361	众智科技	5,169	115,134.16	0.00

118	688247	宣泰医药	6,858	114,871.50	0.00
119	301282	金禄电子	4,233	110,758.23	0.00
120	301306	西测测试	2,543	109,602.67	0.00
121	688496	清越科技	12,000	108,960.00	0.00
122	301220	亚香股份	2,849	104,928.67	0.00
123	688253	英诺特	4,364	103,950.48	0.00
124	301265	华新环保	8,181	99,226.62	0.00
125	688420	美腾科技	2,408	98,294.56	0.00
126	688419	耐科装备	3,039	96,123.57	0.00
127	688143	长盈通	1,938	90,349.56	0.00
128	688203	海正生材	5,761	90,159.65	0.00
129	301318	维海德	2,052	87,053.44	0.00
130	688244	永信至诚	1,506	82,077.00	0.00
131	688416	恒烁股份	2,147	81,607.47	0.00
132	301313	凡拓数创	2,464	79,626.97	0.00
133	301398	星源卓镁	2,549	78,837.80	0.00
134	301161	唯万密封	3,360	78,347.58	0.00
135	301197	工大科雅	3,691	75,472.79	0.00
136	688525	佰维存储	4,614	74,100.84	0.00
137	688455	科捷智能	5,277	71,819.97	0.00
138	301359	东南电子	3,271	71,332.06	0.00
139	301285	鸿日达	5,443	71,313.48	0.00
140	301276	嘉曼服饰	3,026	70,269.50	0.00
141	688292	浩瀚深度	4,503	69,121.05	0.00
142	301388	欣灵电气	2,920	67,802.40	0.00
143	301316	慧博云通	3,584	67,028.63	0.00
144	301368	丰立智能	3,368	66,558.14	0.00
145	301319	唯特偶	1,149	66,253.15	0.00
146	301300	远翔新材	2,107	63,702.75	0.00
147	301270	汉仪股份	2,095	62,884.70	0.00
148	301231	荣信文化	2,744	57,404.12	0.00
149	301309	万得凯	2,271	56,692.74	0.00
150	301233	盛帮股份	1,576	54,354.58	0.00
151	688480	赛恩斯	2,302	50,920.24	0.00
152	301327	华宝新能	242	42,826.74	0.00
153	001330	博纳影业	3,464	41,498.72	0.00
154	001338	永顺泰	1,649	34,826.88	0.00
155	001258	立新能源	3,188	33,346.48	0.00
156	601089	福元医药	1,749	26,812.17	0.00
157	601022	宁波远洋	1,983	26,770.50	0.00
158	001322	箭牌家居	1,595	24,244.00	0.00
159	601012	隆基绿能	560	23,665.60	0.00
160	603255	鼎际得	488	21,911.20	0.00

161	001323	慕思股份	573	18,977.76	0.00
162	001236	弘业期货	1,399	18,956.45	0.00
163	001318	阳光乳业	971	18,643.20	0.00
164	603057	紫燕食品	549	17,277.03	0.00
165	603235	天新药业	572	16,656.64	0.00
166	001339	智微智能	812	16,516.08	0.00
167	603211	晋拓股份	1,287	16,164.72	0.00
168	001228	永泰运	325	16,090.75	0.00
169	603170	宝立食品	542	15,354.86	0.00
170	603237	五芳斋	325	15,323.75	0.00
171	603130	云中马	480	13,176.00	0.00
172	001256	炜冈科技	474	12,390.36	0.00
173	001333	光华股份	426	12,332.70	0.00
174	603206	嘉环科技	787	12,033.23	0.00
175	001300	三柏硕	763	11,826.50	0.00
176	001299	美能能源	576	11,635.20	0.00
177	001331	胜通能源	385	11,330.55	0.00
178	603151	邦基科技	535	11,256.40	0.00
179	001238	浙江正特	374	10,797.38	0.00
180	001222	源飞宠物	434	10,758.86	0.00
181	603182	嘉华股份	546	9,778.86	0.00
182	001319	铭科精技	482	9,750.86	0.00
183	001268	联合精密	409	9,697.39	0.00
184	001230	劲旅环境	375	9,671.25	0.00
185	001229	魅视科技	347	9,313.48	0.00
186	603280	南方路机	363	8,893.50	0.00
187	603097	江苏华辰	478	8,169.02	0.00
188	001231	农心科技	355	8,037.20	0.00
189	001336	楚环科技	274	6,770.54	0.00
190	603272	联翔股份	360	6,213.60	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	688390	固德威	706,728,485.79	3,690.85
2	300438	鹏辉能源	668,964,840.12	3,493.64
3	300068	南都电源	632,692,294.63	3,304.20
4	605117	德业股份	530,038,574.93	2,768.10
5	003022	联泓新科	446,056,925.09	2,329.51
6	300274	阳光电源	438,254,858.40	2,288.76
7	002897	意华股份	421,247,752.59	2,199.95
8	688063	派能科技	381,616,383.75	1,992.97

9	688408	中信博	372,858,336.99	1,947.23
10	002335	科华数据	366,214,179.49	1,912.54
11	300724	捷佳伟创	362,488,304.43	1,893.08
12	300763	锦浪科技	358,261,182.99	1,871.00
13	600537	亿晶光电	329,371,397.20	1,720.13
14	300014	亿纬锂能	312,933,964.54	1,634.28
15	002487	大金重工	278,268,865.06	1,453.25
16	000301	东方盛虹	277,445,289.94	1,448.94
17	300041	回天新材	269,118,118.41	1,405.46
18	688663	新风光	257,704,363.02	1,345.85
19	600418	江淮汽车	256,708,524.15	1,340.65
20	688345	博力威	245,159,337.90	1,280.33
21	603396	金辰股份	215,879,762.72	1,127.42
22	000821	京山轻机	215,534,096.88	1,125.62
23	603606	东方电缆	212,567,512.46	1,110.12
24	000625	长安汽车	202,198,877.79	1,055.97
25	000049	德赛电池	201,434,653.93	1,051.98
26	300750	宁德时代	199,729,975.00	1,043.08
27	300620	光库科技	181,689,007.30	948.86
28	002518	科士达	177,050,394.00	924.64
29	300174	元力股份	169,211,873.72	883.70
30	002245	蔚蓝锂芯	163,872,687.87	855.82
31	002121	科陆电子	163,788,512.46	855.38
32	688048	长光华芯	157,302,567.28	821.50
33	301155	海力风电	156,496,705.23	817.30
34	300443	金雷股份	145,422,362.22	759.46
35	300827	上能电气	144,845,145.28	756.45
36	300428	立中集团	144,054,605.13	752.32
37	002738	中矿资源	142,925,435.83	746.42
38	002837	英维克	135,609,888.07	708.22
39	300776	帝尔激光	135,302,689.56	706.61
40	002531	天顺风能	132,634,973.25	692.68
41	688032	禾迈股份	132,579,063.39	692.39
42	688533	上声电子	127,276,833.85	664.70
43	300565	科信技术	127,125,322.00	663.91
44	002865	钧达股份	125,756,505.00	656.76
45	002324	普利特	125,518,841.99	655.52
46	688072	拓荆科技-U	125,430,714.04	655.06
47	300125	聆达股份	124,242,989.80	648.85
48	300693	盛弘股份	120,004,709.57	626.72
49	600875	东方电气	119,196,439.40	622.50
50	300566	激智科技	118,386,735.32	618.27
51	002150	通润装备	118,154,872.30	617.06

52	600821	金开新能	117,201,779.90	612.08
53	605589	圣泉集团	116,119,198.93	606.43
54	600152	维科技术	114,797,243.46	599.52
55	300569	天能重工	107,037,840.99	559.00
56	600570	恒生电子	105,511,662.15	551.03
57	600487	亨通光电	100,280,838.26	523.71
58	300835	龙磁科技	90,642,107.40	473.37
59	002068	黑猫股份	89,934,815.02	469.68
60	601311	骆驼股份	87,943,346.58	459.28
61	605305	中际联合	86,479,719.02	451.64
62	688033	天宜上佳	85,509,511.34	446.57
63	688348	昱能科技	85,004,444.01	443.93
64	002466	天齐锂业	84,210,397.02	439.78
65	300990	同飞股份	82,297,209.75	429.79
66	600586	金晶科技	81,952,655.00	427.99
67	300850	新强联	80,947,760.72	422.75
68	603185	上机数控	78,464,335.60	409.78
69	002885	京泉华	77,031,184.00	402.29
70	603297	永新光学	74,272,181.00	387.88
71	002594	比亚迪	73,511,323.00	383.91
72	002101	广东鸿图	73,365,251.70	383.15
73	002254	泰和新材	72,239,692.41	377.27
74	002965	祥鑫科技	71,725,612.75	374.58
75	000546	金圆股份	71,431,090.30	373.05
76	603799	华友钴业	70,645,231.64	368.94
77	688599	天合光能	69,765,531.78	364.35
78	002460	赣锋锂业	69,607,574.64	363.52
79	002623	亚玛顿	68,302,465.04	356.71
80	600522	中天科技	68,251,562.00	356.44
81	300263	隆华科技	65,282,206.05	340.93
82	688375	国博电子	65,250,743.25	340.77
83	603032	德新科技	64,337,072.00	336.00
84	688349	三一重能	64,170,725.70	335.13
85	300118	东方日升	61,762,086.53	322.55
86	688326	经纬恒润-W	59,636,732.65	311.45
87	688223	晶科能源	58,711,460.57	306.62
88	300969	恒帅股份	58,010,738.58	302.96
89	002866	传艺科技	57,710,228.00	301.39
90	688499	利元亨	56,808,234.27	296.68
91	688248	南网科技	56,761,285.79	296.43
92	603985	恒润股份	55,557,164.61	290.14
93	601886	江河集团	54,849,548.76	286.45
94	603688	石英股份	53,748,392.26	280.70

95	300842	帝科股份	52,373,981.66	273.52
96	300393	中来股份	52,228,573.80	272.76
97	601633	长城汽车	50,213,505.80	262.24
98	301327	华宝新能	49,347,203.93	257.71
99	002709	天赐材料	48,546,566.85	253.53
100	605286	同力日升	47,887,225.00	250.09
101	300586	美联新材	46,447,133.87	242.57
102	688378	奥来德	44,359,229.74	231.66
103	300718	长盛轴承	43,852,826.10	229.02
104	002922	伊戈尔	43,714,605.90	228.30
105	603348	文灿股份	43,234,938.00	225.79
106	688700	东威科技	42,807,616.07	223.56
107	300825	阿尔特	39,773,438.90	207.71
108	688359	三孚新科	39,521,103.39	206.40
109	002669	康达新材	39,496,517.00	206.27
110	300890	翔丰华	39,155,429.00	204.49
111	002997	瑞鹄模具	38,370,966.00	200.39
112	601890	亚星锚链	37,809,083.57	197.46
113	301046	能辉科技	35,924,700.43	187.61
114	688772	珠海冠宇	35,093,548.13	183.27
115	002371	北方华创	33,543,458.22	175.18
116	600580	卧龙电驱	33,481,749.96	174.86
117	300712	永福股份	33,363,507.00	174.24
118	688498	源杰科技	32,827,267.17	171.44
119	002050	三花智控	32,720,721.86	170.88
120	002192	融捷股份	31,282,196.92	163.37
121	300861	美畅股份	30,387,530.80	158.70
122	300129	泰胜风能	29,252,276.00	152.77
123	600732	爱旭股份	29,233,229.48	152.67
124	002139	拓邦股份	27,578,837.00	144.03
125	300073	当升科技	27,504,320.42	143.64
126	600699	均胜电子	26,768,783.00	139.80
127	688560	明冠新材	26,713,305.16	139.51
128	300320	海达股份	26,278,933.00	137.24
129	300953	震裕科技	26,278,448.00	137.24
130	603098	森特股份	26,142,638.50	136.53
131	301168	通灵股份	25,415,351.40	132.73
132	300490	华自科技	25,395,975.02	132.63
133	688005	容百科技	25,171,744.63	131.46
134	002920	德赛西威	24,802,135.00	129.53
135	002459	晶澳科技	24,734,649.80	129.18
136	002074	国轩高科	24,614,990.39	128.55
137	002240	盛新锂能	24,547,135.00	128.20

138	300390	天华超净	24,544,781.80	128.18
139	002906	华阳集团	24,479,423.80	127.84
140	002056	横店东磁	23,990,685.65	125.29
141	688170	德龙激光	23,658,629.59	123.56
142	603260	合盛硅业	22,935,134.00	119.78
143	000034	神州数码	22,537,606.00	117.70
144	601689	拓普集团	21,892,610.06	114.33
145	000762	西藏矿业	21,844,845.00	114.08
146	002992	宝明科技	21,110,732.14	110.25
147	688559	海目星	20,651,782.66	107.85
148	688186	广大特材	20,033,530.23	104.62
149	600884	杉杉股份	20,029,493.72	104.60
150	603305	旭升集团	19,946,460.68	104.17
151	688707	振华新材	19,658,128.16	102.66
152	300095	华伍股份	19,371,677.00	101.17
153	300212	易华录	19,112,731.85	99.82
154	603212	赛伍技术	19,078,676.01	99.64
155	688116	天奈科技	19,041,885.83	99.45
156	000155	川能动力	18,377,359.30	95.97
157	002821	凯莱英	17,382,614.13	90.78
158	002126	银轮股份	17,222,509.00	89.94
159	688778	厦钨新能	16,958,238.60	88.56
160	300769	德方纳米	16,426,561.60	85.79
161	300035	中科电气	16,175,316.00	84.47
162	600499	科达制造	15,575,022.20	81.34
163	688680	海优新材	14,916,541.79	77.90
164	301268	铭利达	14,657,070.99	76.55
165	002868	绿康生化	14,381,673.50	75.11
166	000032	深桑达 A	14,377,472.38	75.09
167	603026	胜华新材	14,031,315.26	73.28
168	300496	中科创达	13,899,755.72	72.59
169	300457	赢合科技	13,898,939.88	72.59
170	603398	沐邦高科	12,622,440.00	65.92
171	301018	申菱环境	12,177,701.00	63.60
172	300650	太龙股份	12,046,429.50	62.91
173	300360	炬华科技	11,697,296.00	61.09
174	000009	中国宝安	11,357,239.02	59.31
175	300919	中伟股份	10,979,048.00	57.34
176	300568	星源材质	10,784,572.67	56.32
177	300745	欣锐科技	10,599,066.76	55.35
178	002407	多氟多	10,533,593.30	55.01
179	603876	鼎胜新材	10,298,907.00	53.79
180	002648	卫星化学	10,225,808.50	53.40

181	000657	中钨高新	10,076,678.31	52.62
182	603568	伟明环保	10,016,063.52	52.31
183	002011	盾安环境	10,000,246.00	52.23
184	603659	璞泰来	9,836,825.65	51.37
185	688503	聚和材料	9,708,450.47	50.70
186	600477	杭萧钢构	9,672,695.00	50.52
187	603063	禾望电气	9,533,413.00	49.79
188	002340	格林美	9,500,394.00	49.62
189	603778	乾景园林	9,469,235.00	49.45
190	300037	新宙邦	9,047,976.60	47.25
191	600483	福能股份	8,900,734.40	46.48
192	002824	和胜股份	8,810,260.00	46.01
193	002368	太极股份	7,792,292.56	40.69
194	300450	先导智能	7,727,336.50	40.36
195	601615	明阳智能	7,476,624.32	39.05
196	688659	元琛科技	7,355,102.68	38.41
197	300181	佐力药业	7,231,067.00	37.76
198	300432	富临精工	7,083,444.50	36.99
199	300757	罗博特科	6,820,227.00	35.62
200	603906	龙蟠科技	6,565,646.00	34.29
201	603650	彤程新材	6,562,421.31	34.27
202	000913	钱江摩托	6,347,507.00	33.15
203	002759	天际股份	6,209,750.00	32.43
204	002756	永兴材料	6,109,714.00	31.91
205	688779	长远锂科	6,027,607.26	31.48
206	002850	科达利	5,710,266.00	29.82
207	603612	索通发展	5,536,261.00	28.91
208	300618	寒锐钴业	5,516,642.00	28.81
209	300772	运达股份	5,039,552.74	26.32
210	002782	可立克	4,831,960.00	25.23
211	603858	步长制药	4,803,939.52	25.09
212	605208	永茂泰	4,798,083.25	25.06
213	002607	中公教育	4,708,078.00	24.59
214	603917	合力科技	4,658,026.00	24.33
215	002675	东诚药业	4,453,159.00	23.26
216	300759	康龙化成	4,273,672.00	22.32
217	002812	恩捷股份	3,903,060.00	20.38
218	688598	金博股份	3,856,304.30	20.14
219	002497	雅化集团	3,823,841.00	19.97
220	688037	芯源微	3,817,742.86	19.94
221	002176	江特电机	3,377,242.86	17.64
222	002876	三利谱	2,766,631.00	14.45
223	000002	万 科 A	2,731,466.00	14.26

224	688339	亿华通-U	2,708,121.71	14.14
225	300409	道氏技术	2,440,855.00	12.75
226	600318	新力金融	2,238,133.00	11.69
227	300207	欣旺达	2,072,692.00	10.82
228	600549	厦门钨业	1,996,542.00	10.43
229	300001	特锐德	1,778,956.00	9.29
230	000656	金科股份	1,724,893.00	9.01
231	688006	杭可科技	1,484,893.37	7.75
232	688518	联赢激光	1,476,084.84	7.71
233	688041	海光信息	1,471,896.00	7.69
234	600089	特变电工	1,351,601.53	7.06
235	600973	宝胜股份	1,097,582.00	5.73
236	688111	金山办公	926,498.26	4.84
237	603035	常熟汽饰	917,482.00	4.79
238	01772	赣锋锂业	899,716.18	4.70
239	688172	燕东微	883,090.46	4.61
240	300498	温氏股份	822,066.00	4.29
241	688271	联影医疗	809,266.20	4.23
242	300820	英杰电气	771,375.00	4.03
243	01024	快手-W	765,767.54	4.00
244	601686	友发集团	718,384.00	3.75
245	603179	新泉股份	605,491.80	3.16
246	600808	马钢股份	600,500.00	3.14
247	300648	星云股份	589,138.00	3.08
248	00883	中国海洋石油	566,748.45	2.96
249	002233	塔牌集团	554,700.00	2.90
250	601225	陕西煤业	539,067.00	2.82
251	600536	中国软件	534,730.00	2.79
252	603393	新天然气	527,600.00	2.76
253	301267	华夏眼科	511,445.76	2.67
254	300463	迈克生物	502,600.00	2.62
255	000961	中南建设	492,000.00	2.57
256	000333	美的集团	491,743.00	2.57
257	002741	光华科技	485,599.00	2.54
258	600196	复星医药	485,300.00	2.53
259	688439	振华风光	475,361.04	2.48
260	688114	华大智造	465,192.48	2.43
261	688536	思瑞浦	460,953.85	2.41
262	000876	新希望	458,996.40	2.40
263	601166	兴业银行	447,000.00	2.33
264	300841	康华生物	443,996.00	2.32
265	688409	富创精密	443,316.66	2.32
266	301095	广立微	429,142.00	2.24

267	603893	瑞芯微	407,775.00	2.13
268	000778	新兴铸管	396,800.00	2.07
269	688353	华盛锂电	396,448.85	2.07
270	601600	中国铝业	395,440.00	2.07
271	002567	唐人神	392,025.00	2.05
272	02020	安踏体育	387,868.43	2.03
273	605168	三人行	383,394.00	2.00

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	688390	固德威	574,509,717.83	3,000.35
2	300438	鹏辉能源	492,712,752.95	2,573.17
3	003022	联泓新科	428,711,905.00	2,238.93
4	300274	阳光电源	425,525,789.60	2,222.29
5	688063	派能科技	366,832,590.13	1,915.76
6	300724	捷佳伟创	333,013,521.00	1,739.15
7	300763	锦浪科技	302,602,392.04	1,580.33
8	300014	亿纬锂能	285,242,637.00	1,489.67
9	000301	东方盛虹	281,661,463.94	1,470.96
10	600537	亿晶光电	277,662,572.23	1,450.08
11	688408	中信博	251,442,217.93	1,313.14
12	002487	大金重工	236,651,634.87	1,235.90
13	002518	科士达	231,320,558.45	1,208.06
14	300068	南都电源	223,691,588.86	1,168.22
15	300041	回天新材	211,594,726.75	1,105.04
16	603606	东方电缆	202,232,516.85	1,056.15
17	000049	德赛电池	199,048,741.24	1,039.52
18	300750	宁德时代	193,443,674.82	1,010.25
19	000625	长安汽车	193,152,674.59	1,008.73
20	603396	金辰股份	178,233,812.60	930.82
21	002335	科华数据	172,876,100.09	902.84
22	688663	新风光	170,190,774.62	888.81
23	605117	德业股份	165,742,534.48	865.58
24	300620	光库科技	146,157,818.50	763.30
25	002531	天顺风能	136,653,277.20	713.66
26	300443	金雷股份	136,081,252.13	710.68
27	301155	海力风电	135,661,241.45	708.48
28	002738	中矿资源	135,349,526.00	706.86
29	300827	上能电气	131,737,406.65	687.99
30	300776	帝尔激光	129,049,441.80	673.95
31	002897	意华股份	127,776,888.20	667.31

32	002865	钧达股份	126,994,366.52	663.22
33	300125	聆达股份	118,250,124.00	617.56
34	600875	东方电气	106,927,935.76	558.43
35	688533	上声电子	106,132,706.56	554.27
36	600821	金开新能	104,990,693.69	548.31
37	600570	恒生电子	101,354,299.68	529.32
38	300565	科信技术	98,090,011.84	512.27
39	688072	拓荆科技-U	95,592,379.49	499.23
40	300569	天能重工	95,261,248.84	497.50
41	688032	禾迈股份	94,703,796.35	494.59
42	600487	亨通光电	89,512,177.10	467.47
43	688345	博力威	88,799,106.68	463.75
44	002068	黑猫股份	88,265,134.98	460.96
45	002466	天齐锂业	80,428,771.97	420.04
46	002965	祥鑫科技	79,973,536.63	417.66
47	300850	新强联	79,838,493.05	416.95
48	000546	金圆股份	78,612,373.60	410.55
49	002594	比亚迪	72,347,201.77	377.83
50	002101	广东鸿图	72,177,598.20	376.94
51	603297	永新光学	71,053,984.32	371.08
52	603799	华友钴业	70,586,447.55	368.63
53	002885	京泉华	70,179,243.00	366.51
54	605305	中际联合	68,152,716.60	355.92
55	603032	德新科技	67,717,314.00	353.65
56	002121	科陆电子	67,261,735.80	351.27
57	300428	立中集团	65,231,027.31	340.67
58	603185	上机数控	65,217,864.00	340.60
59	300990	同飞股份	64,934,872.20	339.12
60	688599	天合光能	63,800,321.98	333.19
61	601311	骆驼股份	63,520,325.58	331.73
62	002460	赣锋锂业	62,724,466.60	327.58
63	002623	亚玛顿	62,442,080.00	326.10
64	688349	三一重能	59,592,996.07	311.22
65	688375	国博电子	58,879,171.26	307.49
66	688033	天宜上佳	57,565,874.32	300.63
67	300118	东方日升	56,614,989.29	295.67
68	603985	恒润股份	55,915,814.26	292.02
69	002254	泰和新材	55,772,588.24	291.27
70	688223	晶科能源	53,905,058.60	281.52
71	603688	石英股份	52,497,606.38	274.17
72	300693	盛弘股份	52,111,477.90	272.15
73	300969	恒帅股份	52,087,799.81	272.03
74	688326	经纬恒润-W	52,035,106.04	271.75

75	300842	帝科股份	51,255,796.71	267.68
76	688248	南网科技	50,223,808.23	262.29
77	300393	中来股份	47,508,958.00	248.11
78	600522	中天科技	46,346,290.91	242.04
79	688499	利元亨	44,694,447.06	233.41
80	688700	东威科技	43,911,168.88	229.32
81	601633	长城汽车	43,463,280.00	226.98
82	002709	天赐材料	42,615,085.32	222.56
83	301327	华宝新能	41,942,530.60	219.04
84	300586	美联新材	40,680,593.24	212.45
85	600152	维科技术	40,460,274.00	211.30
86	688348	昱能科技	38,662,980.59	201.92
87	603348	文灿股份	38,639,273.00	201.79
88	688048	长光华芯	38,184,275.68	199.42
89	300712	永福股份	36,887,974.37	192.65
90	688359	三孚新科	36,874,929.69	192.58
91	688772	珠海冠宇	35,407,717.31	184.92
92	002922	伊戈尔	34,540,556.40	180.39
93	600580	卧龙电驱	33,166,474.62	173.21
94	002371	北方华创	32,645,190.00	170.49
95	002837	英维克	30,469,822.00	159.13
96	002192	融捷股份	29,992,719.00	156.64
97	300566	激智科技	29,515,532.55	154.14
98	600732	爱旭股份	28,540,531.00	149.05
99	002050	三花智控	27,946,339.00	145.95
100	300073	当升科技	27,921,341.91	145.82
101	300129	泰胜风能	27,711,689.00	144.72
102	688005	容百科技	27,588,723.83	144.08
103	300320	海达股份	27,243,542.00	142.28
104	000034	神州数码	26,083,539.85	136.22
105	300953	震裕科技	25,426,615.00	132.79
106	002056	横店东磁	25,417,089.96	132.74
107	300390	天华超净	23,968,128.00	125.17
108	688559	海目星	23,669,474.69	123.61
109	301168	通灵股份	23,659,909.00	123.56
110	002240	盛新锂能	23,321,896.00	121.80
111	002459	晶澳科技	23,125,016.22	120.77
112	300825	阿尔特	22,959,107.50	119.90
113	688560	明冠新材	22,880,165.60	119.49
114	603305	旭升集团	22,079,091.20	115.31
115	002324	普利特	22,004,675.70	114.92
116	600699	均胜电子	21,565,114.76	112.62
117	000762	西藏矿业	21,499,318.00	112.28

118	002139	拓邦股份	21,461,383.00	112.08
119	002992	宝明科技	20,985,591.40	109.60
120	002074	国轩高科	20,936,888.00	109.34
121	600884	杉杉股份	20,842,559.38	108.85
122	002920	德赛西威	20,172,412.00	105.35
123	002906	华阳集团	20,024,379.36	104.58
124	300212	易华录	19,777,752.79	103.29
125	601689	拓普集团	19,655,823.45	102.65
126	605286	同力日升	19,208,222.00	100.31
127	603260	合盛硅业	18,765,558.08	98.00
128	000155	川能动力	18,741,649.00	97.88
129	002245	蔚蓝锂芯	18,440,277.63	96.30
130	605589	圣泉集团	18,329,887.40	95.73
131	002821	凯莱英	18,229,798.60	95.20
132	002126	银轮股份	17,115,281.00	89.38
133	688707	振华新材	17,103,453.18	89.32
134	300035	中科电气	16,588,176.00	86.63
135	601886	江河集团	16,133,437.00	84.26
136	688116	天奈科技	15,936,616.96	83.23
137	002868	绿康生化	15,686,118.00	81.92
138	688186	广大特材	15,530,608.97	81.11
139	600499	科达制造	15,349,218.00	80.16
140	300769	德方纳米	15,085,699.00	78.78
141	600418	江淮汽车	14,933,643.00	77.99
142	300457	赢合科技	14,808,062.00	77.33
143	603026	胜华新材	13,769,609.00	71.91
144	000032	深桑达 A	13,698,864.80	71.54
145	688778	厦钨新能	12,995,866.12	67.87
146	603398	沐邦高科	12,482,699.00	65.19
147	688680	海优新材	12,013,667.00	62.74
148	300568	星源材质	12,002,840.50	62.68
149	002407	多氟多	10,857,304.00	56.70
150	300919	中伟股份	10,724,686.02	56.01
151	300360	炬华科技	10,624,886.00	55.49
152	603659	璞泰来	10,623,611.76	55.48
153	603778	乾景园林	10,523,871.00	54.96
154	300745	欣锐科技	10,444,253.28	54.54
155	000009	中国宝安	10,284,034.22	53.71
156	002340	格林美	10,126,074.00	52.88
157	002824	和胜股份	10,105,989.00	52.78
158	002648	卫星化学	10,000,599.97	52.23
159	300650	太龙股份	9,820,829.40	51.29
160	603876	鼎胜新材	9,487,711.00	49.55

161	301018	申菱环境	9,441,283.00	49.31
162	603063	禾望电气	8,667,952.00	45.27
163	603568	伟明环保	8,417,492.04	43.96
164	300037	新宙邦	8,285,141.00	43.27
165	300450	先导智能	8,087,635.00	42.24
166	002368	太极股份	7,945,756.00	41.50
167	002011	盾安环境	7,925,781.00	41.39
168	600483	福能股份	7,739,114.95	40.42
169	300432	富临精工	7,194,990.50	37.58
170	000913	钱江摩托	6,926,677.00	36.17
171	688498	源杰科技	6,826,357.56	35.65
172	603098	森特股份	6,819,837.00	35.62
173	601615	明阳智能	6,677,439.00	34.87
174	603906	龙蟠科技	6,648,378.00	34.72
175	300181	佐力药业	6,531,574.00	34.11
176	002756	永兴材料	6,461,296.00	33.74
177	603650	彤程新材	6,296,485.00	32.88
178	300890	翔丰华	6,108,238.00	31.90
179	688659	元琛科技	5,999,441.59	31.33
180	002850	科达利	5,872,268.00	30.67
181	603612	索通发展	5,703,650.00	29.79
182	688779	长远锂科	5,246,134.92	27.40
183	002759	天际股份	5,201,770.00	27.17
184	300618	寒锐钴业	4,835,397.00	25.25
185	300496	中科创达	4,674,380.00	24.41
186	300759	康龙化成	4,575,400.00	23.89
187	300772	运达股份	4,498,002.00	23.49
188	002782	可立克	4,469,581.00	23.34
189	605208	永茂泰	4,462,579.90	23.31
190	002607	中公教育	4,406,775.00	23.01
191	688598	金博股份	4,077,755.32	21.30
192	603858	步长制药	4,077,636.00	21.30
193	603917	合力科技	3,889,924.00	20.31
194	002176	江特电机	3,857,979.00	20.15
195	002812	恩捷股份	3,767,057.00	19.67
196	002497	雅化集团	3,671,310.90	19.17
197	688037	芯源微	3,014,283.58	15.74
198	002876	三利谱	2,858,648.00	14.93
199	000002	万科A	2,429,353.00	12.69
200	002997	瑞鹄模具	2,403,408.00	12.55
201	600549	厦门钨业	2,054,639.00	10.73
202	688339	亿华通-U	1,964,601.15	10.26
203	300207	欣旺达	1,870,766.00	9.77

204	688518	联赢激光	1,720,327.56	8.98
205	300409	道氏技术	1,671,812.00	8.73
206	300001	特锐德	1,559,474.00	8.14
207	000656	金科股份	1,485,197.00	7.76
208	600089	特变电工	1,439,553.00	7.52
209	300174	元力股份	1,388,503.80	7.25
210	600318	新力金融	1,367,172.00	7.14
211	301046	能辉科技	1,231,804.00	6.43
212	01772	赣锋锂业	1,181,253.39	6.17
213	600973	宝胜股份	1,154,941.00	6.03
214	688006	杭可科技	1,091,541.42	5.70
215	01024	快手-W	1,022,743.24	5.34
216	002475	立讯精密	999,174.00	5.22
217	601225	陕西煤业	934,301.00	4.88
218	300841	康华生物	919,713.00	4.80
219	000333	美的集团	902,348.00	4.71
220	002233	塔牌集团	889,771.00	4.65
221	002714	牧原股份	854,533.00	4.46
222	300820	英杰电气	827,972.00	4.32
223	300498	温氏股份	794,661.00	4.15
224	000681	视觉中国	784,855.00	4.10
225	002241	歌尔股份	758,993.00	3.96
226	603035	常熟汽饰	748,420.00	3.91
227	000932	华菱钢铁	730,075.00	3.81
228	688111	金山办公	700,069.68	3.66
229	603179	新泉股份	660,837.00	3.45
230	300648	星云股份	660,814.00	3.45
231	601618	中国中冶	642,400.00	3.35
232	600808	马钢股份	616,317.00	3.22
233	300122	智飞生物	611,126.00	3.19
234	601686	友发集团	605,802.00	3.16
235	00700	腾讯控股	581,172.16	3.04
236	603393	新天然气	565,056.00	2.95
237	06969	思摩尔国际	535,086.54	2.79
238	00883	中国海洋石油	533,559.73	2.79
239	600196	复星医药	527,112.00	2.75
240	603345	安井食品	504,658.00	2.64
241	601186	中国铁建	503,150.00	2.63
242	688536	思瑞浦	492,064.00	2.57
243	600536	中国软件	447,305.00	2.34
244	000858	五粮液	436,642.47	2.28
245	300463	迈克生物	434,060.00	2.27
246	002741	光华科技	415,991.00	2.17

247	000778	新兴铸管	411,200.00	2.15
248	000876	新希望	408,739.00	2.13
249	000961	中南建设	397,148.00	2.07
250	601166	兴业银行	396,147.00	2.07
251	002567	唐人神	395,600.00	2.07
252	605168	三人行	384,000.00	2.01

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	18,548,113,073.29
卖出股票收入（成交）总额	13,058,364,922.36

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

注：无。

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

注：无。

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	2,580,697.59
2	应收清算款	428,329.45
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	720,927.42
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,729,954.46

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

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 (%)
44,546	71,554.37	2,913,387,727.86	91.40	274,073,179.50	8.60

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	4,912,862.83	0.1541

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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	-

注：1、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。

2、截至本报告期末，本基金的基金经理未持有本基金份额。

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

注：无。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016年12月2日） 基金份额总额	430,388,068.84
本报告期期初基金份额总额	8,996,908.72
本报告期基金总申购份额	3,688,612,549.41
减：本报告期基金总赎回份额	510,148,550.77
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	3,187,460,907.36

§ 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 100,000.00 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 (%)	
国泰君安	2	6,959,452,90	22.06	6,411,974.14	22.07	-

		3.90				
银河证券	2	6,803,332,78 9.50	21.56	6,268,126.89	21.57	-
长江证券	1	4,246,939,45 1.63	13.46	3,912,480.22	13.46	-
方正证券	2	3,923,122,93 7.62	12.43	3,614,377.32	12.44	-
平安证券	2	2,009,287,53 8.65	6.37	1,851,107.05	6.37	-
广发证券	2	1,428,221,40 5.10	4.53	1,315,788.28	4.53	-
国信证券	1	1,174,887,86 1.94	3.72	1,082,421.22	3.73	-
中信建投 证券	1	1,024,011,34 1.40	3.25	943,418.37	3.25	-
光大证券	1	995,535,052. 12	3.16	917,170.97	3.16	-
东方财富 证券	1	880,455,390. 35	2.79	811,169.24	2.79	-
中金财富	1	757,460,039. 67	2.40	697,827.33	2.40	-
中金公司	1	602,054,464. 54	1.91	554,625.56	1.91	-
民生证券	1	163,038,212. 99	0.52	151,838.36	0.52	本报 告期 新增
天风证券	2	143,048,182. 08	0.45	121,429.81	0.42	-
中信证券	1	133,344,720. 98	0.42	122,800.89	0.42	-
招商证券	1	115,914,782. 10	0.37	106,774.66	0.37	-
华西证券	1	78,182,685.0 1	0.25	72,028.30	0.25	-
西部证券	1	55,573,625.2 4	0.18	51,199.58	0.18	-
安信证券	1	30,828,856.3 8	0.10	28,402.72	0.10	-
华创证券	1	12,376,585.7 3	0.04	11,278.51	0.04	-
兴业证券	3	7,100,529.00	0.02	5,760.60	0.02	-
海通证券	1	3,072,833.69	0.01	2,830.99	0.01	-
长城证券	1	2,056,848.42	0.01	1,874.30	0.01	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-

华泰证券	1	-	-	-	-	-
瑞信方正	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源 证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

注：交易单元选择的标准和程序：

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

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

需要，并能为本基金提供全面的信息服务；

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

2) 选择交易单元的程序：

我公司根据上述标准，选定符合条件的证券公司作为租用交易单元的对象。我公司投研部门定期对所选定证券公司的服务进行综合评比，评比内容包括：提供研究报告质量、数量、及时性

及提供研究服务主动性和质量等情况，并依据评比结果确定交易单元交易的具体情况。我公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向券商租用交易单元作为基金专用交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
国泰君安	-	-	-	-	-	-

安						
银河证 券	-	-	-	-	-	-
长江证 券	-	-	-	-	-	-
方正证 券	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
中信建 投证券	-	-	-	-	-	-
光大证 券	-	-	-	-	-	-
东方财 富证券	-	-	-	-	-	-
中金财 富	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-
民生证 券	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
西部证 券	-	-	-	-	-	-
安信证 券	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
长城证	-	-	-	-	-	-

券						
东莞证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
瑞信方正	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

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	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 01 月 01 日
2	鹏华基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 01 月 01 日
3	鹏华沪深港新兴成长灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 01 月 21 日
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	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 01 月 21 日
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	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 01 月 24 日
6	关于鹏华沪深港新兴成长灵活配置混合型证券投资基金暂停申购、赎回和定期定额投资业务的公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 01 月 25 日
7	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分	《证券时报》、基金管理	2022 年 02 月 10 日

	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	人网站及中国证监会基金电子披露网站	
8	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与北京雪球基金销售有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 02 月 21 日
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	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 03 月 01 日
10	鹏华沪深港新兴成长灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 03 月 05 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	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 03 月 08 日
12	鹏华沪深港新兴成长灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 03 月 09 日
13	鹏华沪深港新兴成长灵活配置混合型证券投资基金更新的招募说明书（2022 年第 1 号）	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 03 月 09 日
14	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	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 03 月 14 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	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 03 月 15 日
16	关于鹏华沪深港新兴成长灵活配置混合型证券投资基金暂停申购、赎回和定期定额投资业务的公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 03 月 29 日
17	鹏华沪深港新兴成长灵活配置混合型证券投资基金 2021 年年度报告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 03 月 30 日
18	关于鹏华沪深港新兴成长灵活配置混合型证券投资基金暂停申购、赎回和定期定额投资业务的公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 04 月 13 日
19	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与广发证券股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 04 月 19 日

	公告		
20	鹏华沪深港新兴成长灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 04 月 21 日
21	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与宁波银行股份有限公司易管家平台申购（不含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 04 月 21 日
22	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与西部证券股份有限公司定期定额申购费率优惠活动的公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 04 月 25 日
23	关于鹏华沪深港新兴成长灵活配置混合型证券投资基金暂停申购、赎回和定期定额投资业务的公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 04 月 26 日
24	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 04 月 27 日
25	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与江苏张家港农村商业银行股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 04 月 28 日
26	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 04 月 30 日
27	关于鹏华沪深港新兴成长灵活配置混合型证券投资基金暂停申购、赎回和定期定额投资业务的公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 05 月 05 日
28	鹏华基金管理有限公司关于终止北京植信基金销售有限公司办理本公司旗下基金相关销售业务的公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 05 月 06 日
29	鹏华沪深港新兴成长灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 05 月 07 日
30	鹏华沪深港新兴成长灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 05 月 11 日
31	鹏华沪深港新兴成长灵活配置混合型证券投资基金更新的招募说明书（2022 年第 2 号）	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 05 月 11 日
32	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	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 05 月 13 日
33	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	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基	2022 年 05 月 30 日

	司相关费率优惠活动的公告	金电子披露网站	
34	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与上海好买基金销售有限公司申购(含定期定额申购)费率优惠活动的公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 06 月 06 日
35	鹏华沪深港新兴成长灵活配置混合型证券投资基金开放日常转换业务的公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 06 月 16 日
36	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中航证券有限公司申购(含定期定额申购)费率优惠活动的公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 06 月 18 日
37	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 07 月 06 日
38	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	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 07 月 15 日
39	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	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 07 月 15 日
40	鹏华沪深港新兴成长灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第 2 季度报告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 07 月 20 日
41	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	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 07 月 25 日
42	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 08 月 04 日
43	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	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 08 月 04 日
44	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	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 08 月 10 日
45	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 08 月 11 日
46	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	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 08 月 12 日
47	鹏华沪深港新兴成长灵活配置混合型	《证券时报》、基金管理人	2022 年 08 月 23 日

	证券投资基金暂停大额申购、转换转入和定期定额投资业务的公告	人网站及中国证监会基金电子披露网站	
48	鹏华沪深港新兴成长灵活配置混合型证券投资基金 2022 年中期报告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 08 月 30 日
49	鹏华基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 09 月 07 日
50	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	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 09 月 08 日
51	鹏华基金管理有限公司关于鹏华沪深港新兴成长灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第 1 次分红公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 09 月 24 日
52	鹏华沪深港新兴成长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	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 09 月 27 日
53	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	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 10 月 14 日
54	鹏华基金管理有限公司关于运用固有资金投资旗下基金的公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 10 月 18 日
55	鹏华沪深港新兴成长灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第 3 季度报告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 10 月 25 日
56	鹏华沪深港新兴成长灵活配置混合型证券投资基金更新的招募说明书	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 12 月 09 日
57	鹏华沪深港新兴成长灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 12 月 09 日
58	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 12 月 10 日
59	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 12 月 14 日
60	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	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 12 月 15 日
61	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	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基	2022 年 12 月 31 日

	(含定期定额投资) 费率优惠活动的公告	金电子披露网站	
62	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	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 12 月 31 日
63	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	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 12 月 31 日
64	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	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比(%)
机构	1	20220322~20220425	0.00	16,501,514.30	16,501,514.30	0.00	0.00
	2	20220426~20220515	0.00	12,587,640.13	0.00	12,587,640.13	0.39
	3	20220318~20220321	0.00	13,625,878.91	0.00	13,625,878.91	0.43
	4	20220426~20220522	0.00	125,056,779.32	50,732,396.68	74,324,382.64	2.33
	5	20220729~20220814	0.00	352,817,249.61	0.00	352,817,249.61	11.07
	6	20220718~20220728	0.00	436,522,399.12	0.00	436,522,399.12	13.69
产品特有风险							
基金份额持有人持有的基金份额所占比例过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引起基金净值剧烈波动，甚至可能引发基金流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。							

注：1、申购份额包含基金申购份额、基金转换入份额、强制调增份额、场内买入份额和红利再投；

2、赎回份额包含基金赎回份额、基金转换出份额、强制调减份额、场内卖出份额。

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)《鹏华沪深港新兴成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- (二)《鹏华沪深港新兴成长灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- (三)《鹏华沪深港新兴成长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