

# 鹏华优质治理混合型证券投资基金（LOF） 2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 08 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	11
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>12</b>
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	18
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>45</b>
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	53
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	53
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	53
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	53
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	53
7.12 投资组合报告附注 .....	53
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>54</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	54
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	55
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	55
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	55
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>55</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>55</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	55
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	56
10.4 基金投资策略的改变 .....	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	56
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	56
10.8 其他重大事件 .....	58
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>60</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	60
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>60</b>
12.1 备查文件目录 .....	60
12.2 存放地点 .....	60
12.3 查阅方式 .....	60

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华优质治理混合型证券投资基金（LOF）
基金简称	鹏华优质治理混合（LOF）
场内简称	鹏华优质治理 LOF
基金主代码	160611
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2007 年 4 月 25 日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	751,111,259.27 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2007 年 7 月 18 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	投资于具有相对完善的公司治理结构和良好成长性的优质上市公司，为基金份额持有人谋求长期、稳定的资本增值。
投资策略	（1）股票投资策略：本基金采取“自上而下”的资产配置和“自下而上”的选股策略相结合的主动投资管理策略。整体资产和行业配置主要根据宏观经济、政策环境及行业发展不同阶段、不同特点等情况确定股票投资比例和行业配置比例，个股方面，主要投资于具有相对完善的公司治理结构和良好成长性的优质上市公司，同时关注那些过去基本面较差但正在发生转折的上市公司，采用多种价值评估方法，多视角地进行分析，努力选择最具有投资价值的公司进行投资。（2）债券投资策略：本基金的债券投资采用久期控制下的主动投资策略，本着风险收益匹配最优、兼顾流动性的原则确定债券各类属资产的配置比例。在个券选择上，本基金综合运用利率预期、收益率曲线估值、信用等级分析、流动性评估等方法来评估个券的投资价值。（3）权证投资策略：本基金将权证看作是辅助性投资工具，其投资原则为有利于基金资产增值，有利于加强基金风险控制。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×75%+中证综合债指数收益率×25%
风险收益特征	本基金属于混合型基金，其预期的风险和收益高于货币型基金、债券基金，低于股票型基金，为证券投资基金中具有中高风险、中高收益的投资品种。

注：无。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	鹏华基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 姓名	高永杰	郭明

负责人	联系电话	0755-81395402	(010)66105799
	电子邮箱	xxpl@phfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4006788999	95588
传真		0755-82021126	(010)66105798
注册地址		深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		518048	100140
法定代表人		何如	陈四清

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.phfund.com.cn
基金中期报告备置地点	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层鹏华基金管理有限公司

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	25,602,187.76
本期利润	-17,781,206.91
加权平均基金份额本期利润	-0.0285
本期加权平均净值利润率	-2.47%
本期基金份额净值增长率	-3.26%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	95,070,786.01
期末可供分配基金份额利润	0.1266
期末基金资产净值	846,182,045.28
期末基金份额净值	1.127
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	45.95%

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

(2) 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回

费、基金转换费等)，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

### 3.2 基金净值表现

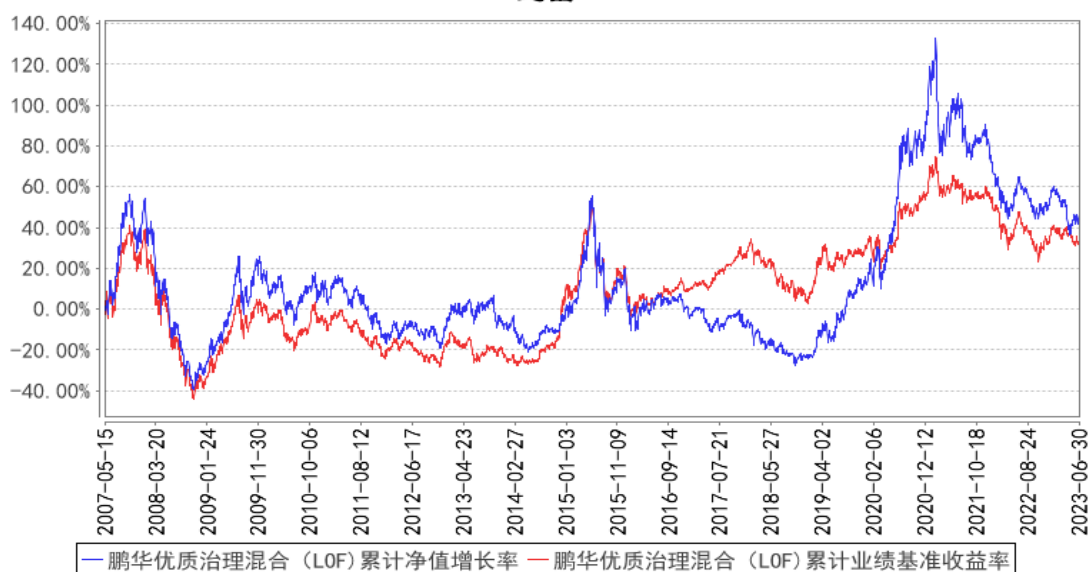
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.62%	0.94%	1.01%	0.65%	0.61%	0.29%
过去三个月	-4.97%	0.97%	-3.42%	0.62%	-1.55%	0.35%
过去六个月	-3.26%	0.83%	0.19%	0.63%	-3.45%	0.20%
过去一年	-11.33%	0.78%	-9.81%	0.74%	-1.52%	0.04%
过去三年	-7.65%	1.32%	-2.09%	0.90%	-5.56%	0.42%
自基金合同生效起至今	45.95%	1.48%	32.85%	1.23%	13.10%	0.25%

注：业绩比较基准=沪深 300 指数收益率×75%+中证综合债指数收益率×25%

#### 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

鹏华优质治理混合 (LOF) 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2007 年 04 月 25 日生效。2、截至建仓期结束，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

### 3.3 其他指标

注：无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

鹏华基金管理有限公司成立于 1998 年 12 月 22 日，业务范围包括基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。截至本报告期末，公司股东由国信证券股份有限公司、意大利欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）、深圳市北融信投资发展有限公司组成，公司性质为中外合资企业，公司注册资本 15,000 万元人民币。截至 6 月 30 日，公司管理资产总规模达到 11517 亿元，301 只公募基金、13 只全国社保投资组合、7 只基本养老保险投资组合。经过 20 余年投资管理基金，在基金投资、风险控制等方面积累了丰富经验。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈璇淼	基金经理	2018-08-01	2023-04-15	11 年	陈璇淼女士，国籍中国，经济学硕士，11 年证券从业经验。2012 年 7 月加盟鹏华基金管理有限公司，从事行业研究工作，历任研究部基金经理助理/高级研究员，权益投资二部基金经理，现担任权益投资二部董事总经理（MD）/副总经理/基金经理。2016 年 03 月至今担任鹏华外延成长灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017 年 11 月至今担任鹏华优势企业股票型证券投资基金基金经理，2018 年 08 月至 2023 年 04 月担任鹏华优质治理混合型证券投资基金（LOF）基金经理，2020 年 02 月至今担任鹏华价值成长混合型证券投资基金基金经理，2021 年 03 月至今担任鹏华远见回报三年持有期混合型证券投资基金基金经理，2023 年 03 月至今担任鹏华匠心精选混合型证券投资基金基金经理，陈璇淼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，增聘张鹏为本基金基金经理，陈璇淼不再担任本基金基金经理。
张鹏	基金经理	2023-04-15	-	10 年	张鹏先生，国籍中国，金融学硕士，10 年证券从业经验。曾任鹏华基金管理有限公司研究部助理研究员、研究员，中欧基金



					管理有限公司研究部研究员，自 2017 年任鹏华基金管理有限公司研究部高级研究员、基金经理助理/研究员，现担任权益投资二部基金经理。2021 年 08 月至今担任鹏华策略回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2021 年 08 月至今担任鹏华价值精选股票型证券投资基金基金经理，2023 年 01 月至今担任鹏华价值共赢两年持有期混合型证券投资基金基金经理，2023 年 03 月至今担任鹏华产业精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2023 年 04 月至今担任鹏华优质治理混合型证券投资基金（LOF）基金经理，张鹏先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理发生变动，增聘张鹏为本基金基金经理，陈璇淼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。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行公平交易制度，确保不同投资组合在研究、交易、分配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 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

23 年上半年，市场剧烈震荡，结构显著分化。沪深 300 下跌 1%，中证 1000 和科创 50 约上涨 5%、3%、6%，中信各一级行业指数头尾涨幅差异较大，前列的 TMT 行业涨幅在 40%水平，而尾部的消费者服务地产等板块跌幅在 20%左右。

1 月份新能源触底反弹为主，2、3、4 月份泛 AI 线索和数据要素在海外出现爆款应用和产业政策驱动下成为市场主线，TMT 及半导体板块涨幅明显，主线外餐饮出行旅游酒店等复苏线板块持续调整，年季报业绩较好的板块（如家电等）录得较大涨幅。5-6 月市场分歧明显加大，TMT 等年初涨幅较大的板块和其他相对底部的板块之间出现了资产价格的再平衡，复苏线整体弱现实的背景下可选消费复苏较好，尤其是汽车价格战趋缓，电车补贴政策落地，渗透率继续向上，同时市场又有新的线索，一是临近中报季，对业绩好甚至有超预期可能得个股和板块的挖掘逐步加深，二是在算力链和应用端预期挖掘比较充分的情况下，海外公司进展和产业政策，催化拓展出了人形机器人和智能驾驶等泛 AI 线上的新线索。

在产品操作上的核心思路，依然是一以贯之的保持了泛制造业的核心持仓。总体仓位水平保持 90%左右未做择时，边际结构上，总体仓位水平保持 90%左右未做择时。边际结构上通过对新兴产业和技术的学习驱动，进行优化，一是愿意容纳和学习 AI 线索等新兴前沿产业的变化，二是结合各类资产价格周期所处的位置进行一定的边际轮动，控制回撤。

增仓如出口链等景气趋势向上的标的，减仓复苏节奏明显低于预期的相关板块，增仓新能源、医药等处于相对较低位置的优质公司。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期鹏华优质治理混合（LOF）份额净值增长率为-3.26%，同期业绩比较基准增长率为 0.19%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

整体上，23 年是疫情放开后的第一年，市场对复苏普遍抱有较高预期，与政府保持高质量增长、优化结构的政策指向和战略定力，存在一定的认知差，我们认为 23 年产业结构的变化方向和产业政策的指向，是强于总量逻辑的投资线索，因此后续的研究和关注重点依然是政策支持、渗透率向上突破的新兴产业和线索，具体如，泛 AI 线索上的算力、存储等硬件环节和办公、智能驾驶等、智能设备等推进快的应用、数据要素从清洗标注到确权交易各环节的持续推进，带来的数据资产的价值重估、半导体产业的国产化和复苏周期。此外还值得观察的线索包括，联储加息边际放缓、可能的经济刺激政策和内生修复、军工订单的恢复等等。整体上依然是围绕着泛制造

业（广义范围包括硬件软件）各环节，寻找变化带来的投资机会。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1、截止本报告期末，本基金期末可供分配利润为 95,070,786.01 元，期末基金份额净值 1.127 元。

2、本基金本报告期内未进行利润分配。

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

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人——鹏华基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

## 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对鹏华基金管理有限公司编制和披露的本基金 2023 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：鹏华优质治理混合型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	44,403,252.46	49,354,052.08
结算备付金		2,327,423.79	8,558,072.63
存出保证金		117,507.56	19,322.20
交易性金融资产	6.4.7.2	802,549,159.75	424,673,267.93
其中：股票投资		802,344,007.11	424,522,346.76
基金投资		-	-
债券投资		205,152.64	150,921.17
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	226,097,814.19
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	143,894.82
应收股利		-	-
应收申购款		50,021,937.60	53,011.67

递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		899,419,281.16	708,899,435.52
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年6月30日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		49,503,241.76	184,981.22
应付赎回款		320,186.24	119,530.66
应付管理人报酬		957,026.71	899,392.32
应付托管费		159,504.43	149,898.71
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1.34	0.71
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	2,297,275.40	551,948.89
负债合计		53,237,235.88	1,905,752.51
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	751,111,259.27	606,714,359.22
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	95,070,786.01	100,279,323.79
净资产合计		846,182,045.28	706,993,683.01
负债和净资产总计		899,419,281.16	708,899,435.52

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.127 元，基金份额总额 751,111,259.27 份。

## 6.2 利润表

会计主体：鹏华优质治理混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年1月1日至2023 年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年6月30日
<b>一、营业总收入</b>		-11,413,248.48	-81,303,127.15
1. 利息收入		759,266.74	1,837,189.93
其中：存款利息收入	6.4.7.13	311,028.35	296,006.12
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		448,238.39	1,541,183.81
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		31,207,634.67	34,722,741.24
其中：股票投资收益	6.4.7.14	25,750,780.30	31,582,449.55
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	232.21	-
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	5,456,622.16	3,140,291.69
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-43,383,394.67	-117,872,110.47
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	3,244.78	9,052.15
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>6,367,958.43</b>	<b>6,792,871.73</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	5,356,925.68	5,712,594.44
2. 托管费	6.4.10.2.2	892,820.94	952,099.07
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
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	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		0.86	-
8. 其他费用	6.4.7.23	118,210.95	128,178.22
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-17,781,206.91</b>	<b>-88,095,998.88</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-17,781,206.91</b>	<b>-88,095,998.88</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-17,781,206.91</b>	<b>-88,095,998.88</b>

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：鹏华优质治理混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	606,714,359.22	-	100,279,323.79	706,993,683.01
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)	606,714,359.22	-	100,279,323.79	706,993,683.01
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	144,396,900.05	-	-5,208,537.78	139,188,362.27
（一）、综合收益总额	-	-	-17,781,206.91	-17,781,206.91
（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）	144,396,900.05	-	12,572,669.13	156,969,569.18
其中：1. 基金申	163,153,765.69	-	15,705,397.34	178,859,163.03

购款				
2. 基金赎回款	-18,756,865.64	-	-3,132,728.21	-21,889,593.85
(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)	751,111,259.27	-	95,070,786.01	846,182,045.28
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	634,619,457.15	-	259,519,667.71	894,139,124.86
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)	634,619,457.15	-	259,519,667.71	894,139,124.86



三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-15,868,486.21	-	-91,680,856.99	-107,549,343.20
(一)、综合收益总额	-	-	-88,095,998.88	-88,095,998.88
(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)	-15,868,486.21	-	-3,584,858.11	-19,453,344.32
其中:1.基金申购款	3,985,059.31	-	904,040.84	4,889,100.15
2.基金赎回款	-19,853,545.52	-	-4,488,898.95	-24,342,444.47
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基	618,750,970.94	-	167,838,810.72	786,589,781.66

金净值)				
------	--	--	--	--

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>邓召明</u>	<u>邢彪</u>	<u>郝文高</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

鹏华优质治理混合型证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）由普润证券投资基金及普华证券投资基金转型而成。根据原普润证券投资基金（“普润基金”）基金份额持有人大会审议通过的《关于普润证券投资基金转换基金运作方式有关事项的议案》和原普华证券投资基金（“普华基金”）基金份额持有人大会审议通过的《关于普华证券投资基金转换基金运作方式有关事项的议案》，并经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监基金字[2007]100号《关于核准普润证券投资基金基金份额持有人大会的批复》、证监基金字[2007]101号《关于核准普华证券投资基金基金份额持有人大会的批复》及上海证券交易所上证债字[2007]25号《关于终止普润证券投资基金上市的决定》、深圳证券交易所深证复[2007]22号《关于同意普华证券投资基金终止上市并转型为上市开放式基金的批复》的同意，基金普润及基金普华于2007年4月25日终止上市。原《普润证券投资基金基金合同》及原《普华证券投资基金基金合同》于终止上市日起失效，《鹏华优质治理混合型证券投资基金（LOF）基金合同》于同日起生效。原普润证券投资基金及原普华证券投资基金于2007年5月15日并入鹏华优质治理混合型证券投资基金，进行资产合并。原基金普润及原基金普华在5月14日基金份额转换基准日经审计的基金净值分别为1,295,520,211.38元和1,204,163,435.07元，原基金普润及原基金普华已将所实现的全部收益在5月14日转换基准日转换成基金份额。基金普润转换比例为1:2.5910404，基金普华转换比例为1:2.4083268。本基金自2007年5月8日至2007年5月9日期间进行集中申购，集中申购资金不包括利息为9,382,669,143.08元，折合9,382,669,143.08份基金份额，申购资金在集中申购期产生的利息为1,571,880.73元，折合1,571,608.08份基金份额，折算差额272.65元计入基金资产，经安永华明会计师事务所有限公司安永华明(2007)验字第60468989\_H01号验资报告予以验证，并已向中国证监会备案。鹏华治理基金的运作方式为上市契约型开放式，存续期限不定。鹏华治理基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、《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》、《鹏华优质治理混合型证券投资基金（LOF）基金合同》和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 年上半年财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2023 年 06 月 30 日的财务状况以及 2023 年上半年的经营成果和基金净资产变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 6.4.6 税项

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

操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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

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

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

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

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

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	44,403,252.46
等于：本金	44,399,583.27
加：应计利息	3,669.19
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	44,403,252.46

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	797,352,593.60	-	802,344,007.11	4,991,413.51
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	260.62	205,152.64	53,992.02
	银行间市场	-	-	-
	合计	260.62	205,152.64	53,992.02
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	797,503,493.60	260.62	802,549,159.75	5,045,405.53

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

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

## 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

## 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

## 6.4.7.5 债权投资

## 6.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

## 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

## 6.4.7.6 其他债权投资

## 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

## 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

## 6.4.7.7 其他权益工具投资

## 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

## 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

## 6.4.7.8 其他资产

注：无。

## 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	250,000.00
应付赎回费	46.70
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,876,549.75
其中：交易所市场	1,876,549.75
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	139,178.95
其他	31,500.00

合计	2,297,275.40
----	--------------

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	606,714,359.22	606,714,359.22
本期申购	163,153,765.69	163,153,765.69
本期赎回（以“-”号填列）	-18,756,865.64	-18,756,865.64
- 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	751,111,259.27	751,111,259.27

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

注：无。

#### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	570,677,970.54	-470,398,646.75	100,279,323.79
本期利润	25,602,187.76	-43,383,394.67	-17,781,206.91
本期基金份额交易产生的变动数	143,982,577.08	-131,409,907.95	12,572,669.13
其中：基金申购款	162,024,019.70	-146,318,622.36	15,705,397.34
基金赎回款	-18,041,442.62	14,908,714.41	-3,132,728.21
本期已分配利润	-	-	-
本期末	740,262,735.38	-645,191,949.37	95,070,786.01

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
	活期存款利息收入
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	28,749.94
其他	325.94
合计	311,028.35

注：其他包含认/申购款利息收入、结算保证金利息收入、风控金利息收入等

## 6.4.7.14 股票投资收益

## 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	25,750,780.30
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	25,750,780.30

## 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	841,738,759.53
减：卖出股票成本总额	813,067,567.57
减：交易费用	2,920,411.66
买卖股票差价收入	25,750,780.30

## 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

## 6.4.7.15 债券投资收益

## 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	232.21
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	232.21

## 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

## 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。



## 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

## 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

## 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

## 6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

## 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

## 6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

## 6.4.7.17 贵金属投资收益

## 6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

## 6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

## 6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

## 6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

## 6.4.7.18 衍生工具收益

## 6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

## 6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

## 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	5,456,622.16
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	5,456,622.16

#### 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1. 交易性金融资产	-43,383,394.67
股票投资	-43,437,386.69
债券投资	53,992.02
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	-43,383,394.67

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	3,130.28
基金转换费收入	114.50
合计	3,244.78

#### 6.4.7.22 信用减值损失

注：无。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	39,671.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费用	432.00
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	118,210.95

#### 6.4.7.24 分部报告

无。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
国信证券	229,826,137.44	11.13	8,147,701.18	3.33

###### 6.4.10.1.2 债券交易

注：无。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)
国信证券	-	-	3,207,126,000.00	18.31

#### 6.4.10.1.4 权证交易

注：无。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
国信证券	214,035.23	11.19	214,035.23	11.41
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
国信证券	7,588.30	3.36	7,588.30	26.77

注：（1）佣金的计算公式

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

（佣金比率按照与一般证券公司签订的协议条款订立。）

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

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	5,356,925.68
其中：支付销售机构的客户维护费	1,342,098.69	1,445,266.56

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

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

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	892,820.94	952,099.07

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

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：无。

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

注：无。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：无。

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	44,403,252.46	281,952.47	72,998,085.84	194,299.17

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期					
2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：）	总金额

				股/张 )	
国信证券	301488	豪恩汽电	网下申购	2,618	104,144.04
国信证券	688307	中润光学	网下申购	2,455	58,625.40
国信证券	688562	航天软件	网下申购	7,254	91,980.72
上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量 (单位: 股/张 )	总金额
国信证券	-	-	-	-	-

注：本表包含参与基金托管人的关联方承销证券的情况。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：无。

#### 6.4.12 期末 (2023 年 6 月 30 日) 本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001282	三联锻造	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	-
001286	陕西能源	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
001287	中电港	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股流通受限	11.88	21.02	922	10,953.36	19,380.44	-
001324	长青科技	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股流通受限	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-
001328	登康口腔	2023 年 3 月 29 日	6 个月	新股流通受限	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-
001367	海森药业	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股流通受限	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-

301141	中科磁业	2023年3月27日	6个月	新股流通受限	41.20	42.69	262	10,794.40	11,184.78	-
301157	华塑科技	2023年3月1日	6个月	新股流通受限	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
301170	锡南科技	2023年6月16日	6个月	新股流通受限	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-
301202	朗威股份	2023年6月28日	1个月内(含)	新股未上市	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	-
301202	朗威股份	2023年6月28日	6个月	新股流通受限	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	-
301261	恒工精密	2023年6月29日	1个月内(含)	新股未上市	36.90	36.90	1,775	65,497.50	65,497.50	-
301261	恒工精密	2023年6月29日	6个月	新股流通受限	36.90	36.90	198	7,306.20	7,306.20	-
301262	海看股份	2023年6月13日	6个月	新股流通受限	30.22	25.50	568	17,164.96	14,484.00	-
301281	科源制药	2023年3月28日	6个月	新股流通受限	44.18	25.10	338	10,647.38	8,483.80	科源制药于2023年5月26日每10股送4股
301291	明阳电气	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	38.13	31.03	636	24,250.68	19,735.08	-
301292	海科新源	2023年6月29日	1个月内(含)	新股未上市	19.99	19.99	5,241	104,767.59	104,767.59	-
301292	海科新源	2023年6月29日	6个月	新股流通受限	19.99	19.99	583	11,654.17	11,654.17	-
301293	三博脑科	2023年4月25日	6个月	新股流通受限	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-
301295	美硕科技	2023年6月19日	6个月	新股流通受限	37.40	36.07	215	8,041.00	7,755.05	-

301301	川宁生物	2022年12月20日	6个月	新股流通受限	5.00	8.96	3,574	17,870.00	32,023.04	-
301303	真兰仪表	2023年2月13日	6个月	新股流通受限	26.80	22.32	1,058	28,354.40	23,614.56	-
301315	威士顿	2023年6月13日	6个月	新股流通受限	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-
301317	鑫磊股份	2023年1月12日	6个月	新股流通受限	20.67	26.17	694	14,344.98	18,161.98	-
301320	豪江智能	2023年6月1日	6个月	新股流通受限	13.06	20.62	642	8,384.52	13,238.04	-
301322	绿通科技	2023年2月27日	6个月	新股流通受限	131.11	53.24	303	26,484.22	16,131.72	绿通科技于2023年5月25日每10股送5股
301323	新莱福	2023年5月29日	6个月	新股流通受限	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	-
301325	曼恩斯特	2023年5月4日	6个月	新股流通受限	76.80	107.95	314	24,115.20	33,896.30	-
301332	德尔玛	2023年5月9日	6个月	新股流通受限	14.81	13.73	1,118	16,557.58	15,350.14	-
301337	亚华电子	2023年5月16日	6个月	新股流通受限	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-
301345	涛涛车业	2023年3月10日	6个月	新股流通受限	73.45	46.64	262	19,243.90	12,219.68	-
301355	南王科技	2023年6月2日	6个月	新股流通受限	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-
301357	北方长龙	2023年4月11日	6个月	新股流通受限	50.00	48.39	190	9,500.00	9,194.10	-
301358	湖南裕能	2023年2月1日	6个月	新股流通受限	23.77	42.89	809	19,229.93	34,698.01	-



301360	荣旗科技	2023年4月17日	6个月	新股流通受限	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40	-
301373	凌玮科技	2023年1月20日	6个月	新股流通受限	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	-
301376	致欧科技	2023年6月14日	6个月	新股流通受限	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-
301382	蜂助手	2023年5月9日	6个月	新股流通受限	23.80	32.84	408	9,710.40	13,398.72	-
301386	未来电器	2023年3月21日	6个月	新股流通受限	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	-
301399	英特科技	2023年5月16日	6个月	新股流通受限	43.99	51.57	293	12,889.07	15,110.01	-
301408	华人健康	2023年2月22日	6个月	新股流通受限	16.24	16.95	879	14,274.96	14,899.05	-
301419	阿莱德	2023年2月2日	6个月	新股流通受限	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50	-
301428	世纪恒通	2023年5月10日	6个月	新股流通受限	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-
301439	泓淋电力	2023年3月10日	6个月	新股流通受限	19.99	16.90	914	18,270.86	15,446.60	-
301486	致尚科技	2023年6月30日	1个月内(含)	新股未上市	57.66	57.66	3,470	200,080.20	200,080.20	-
301486	致尚科技	2023年6月30日	6个月	新股流通受限	57.66	57.66	386	22,256.76	22,256.76	-
301488	豪恩汽电	2023年6月26日	1个月内(含)	新股未上市	39.78	39.78	2,356	93,721.68	93,721.68	-
301488	豪恩汽电	2023年6月26日	6个月	新股流通受限	39.78	39.78	262	10,422.36	10,422.36	-
601061	中信金属	2023年3月30日	6个月	新股流通受限	6.58	7.58	2,093	13,771.94	15,864.94	-

		日									
601065	江盐集团	2023年3月31日	6个月	新股流通受限	10.36	11.84	684	7,086.24	8,098.56		-
601133	柏诚股份	2023年3月31日	6个月	新股流通受限	11.66	12.26	603	7,030.98	7,392.78		-
603125	常青科技	2023年3月30日	6个月	新股流通受限	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80		-
603135	中重科技	2023年3月29日	6个月	新股流通受限	17.80	17.89	628	11,178.40	11,234.92		-
603137	恒尚节能	2023年4月10日	6个月	新股流通受限	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51		-
603172	万丰股份	2023年4月28日	6个月	新股流通受限	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86		-
688146	中船特气	2023年4月13日	6个月	新股流通受限	36.15	38.13	657	23,750.55	25,051.41		-
688249	晶合集成	2023年4月24日	6个月	新股流通受限	19.86	18.06	3,591	71,317.26	64,853.46		-
688334	西高院	2023年6月9日	6个月	新股流通受限	14.16	16.21	888	12,574.08	14,394.48		-
688352	颀中科技	2023年4月11日	6个月	新股流通受限	12.10	12.07	1,826	22,094.60	22,039.82		-
688361	中科飞测-U	2023年5月12日	6个月	新股流通受限	23.60	64.67	578	13,640.80	37,379.26		-
688429	时创能源	2023年6月20日	6个月	新股流通受限	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38		-
688433	华曙高科	2023年4月7日	6个月	新股流通受限	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00		-
688443	智翔金泰-U	2023年6月13日	6个月	新股流通受限	37.88	29.49	919	34,811.72	27,101.31		-
688458	美芯	2023年	6个月	新股流	75.00	90.76	204	15,300.00	18,515.04		-

	晟	5月15日		通受限							
688469	中芯集成-U	2023年4月28日	6个月	新股流通受限	5.69	5.41	6,231	35,454.39	33,709.71		-
688472	阿特斯	2023年6月2日	6个月	新股流通受限	11.10	17.04	2,699	29,958.90	45,990.96		-
688478	晶升股份	2023年4月13日	6个月	新股流通受限	32.52	42.37	402	13,073.04	17,032.74		-
688479	友车科技	2023年5月4日	6个月	新股流通受限	33.99	29.49	332	11,284.68	9,790.68		-
688507	索辰科技	2023年4月10日	6个月	新股流通受限	245.56	122.11	151	25,047.12	18,438.61		索辰科技于2023年6月20日每10股送4.8股
688522	纳睿雷达	2023年2月22日	6个月	新股流通受限	46.68	51.50	4,200	196,056.00	216,300.00		-
688523	航天环宇	2023年5月26日	6个月	新股流通受限	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20		-
688531	日联科技	2023年3月24日	6个月	新股流通受限	152.38	135.97	220	33,523.60	29,913.40		-
688535	华海诚科	2023年3月28日	6个月	新股流通受限	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03		-
688543	国科军工	2023年6月14日	6个月	新股流通受限	43.67	53.05	376	16,419.92	19,946.80		-
688562	航天软件	2023年5月15日	6个月	新股流通受限	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06		-
688570	天玛智控	2023年5月29日	6个月	新股流通受限	30.26	25.33	746	22,573.96	18,896.18		-
688581	安杰思	2023年5月12日	6个月	新股流通受限	125.80	118.03	142	17,863.60	16,760.26		-

688582	芯动联科	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	26.74	40.68	481	12,861.94	19,567.08	-
688593	新相微	2023年5月25日	6个月	新股流通受限	11.18	14.59	959	10,721.62	13,991.81	-
688603	天承科技	2023年6月30日	1个月内(含)	新股未上市	55.00	55.00	1,251	68,805.00	68,805.00	-
688603	天承科技	2023年6月30日	6个月	新股流通受限	55.00	55.00	140	7,700.00	7,700.00	-
688620	安凯微	2023年6月15日	6个月	新股流通受限	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44	-
688629	华丰科技	2023年6月16日	6个月	新股流通受限	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-
688631	莱斯信息	2023年6月19日	6个月	新股流通受限	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-

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

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

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

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

5、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不

能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的各类股票(含存托凭证)，债券，权证，资产证券化产品以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如有投资需要可参与有价值的新股配售和增发。

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

本基金的基金管理人致力于全面内部控制体系的建设，建立了从董事会层面到各业务部门的风险管理组织架构。本基金的基金管理人在董事会下设风险控制和合规审计委员会，主要负责制定基金管理人风险控制战略和控制政策、协调突发重大风险等事项；督察长负责对基金管理人各业务环节合法合规运作进行监督检查，组织、指导基金管理人内部监察稽核工作，并可向董事会和中国证监会直接报告；在公司内部设立独立的监察稽核部，专职负责对基金管理人各部门、各业务的风险控制情况进行督促和检查，并适时提出整改建议。

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

#### 6.4.13.2 信用风险

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

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

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

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

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

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

##### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

##### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	205,152.64	150,921.17
未评级	-	-
合计	205,152.64	150,921.17

注：上述评级均由经中国证监会核准从事证券市场资信评级业务的评级机构作出。

##### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

##### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

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

于 2023 年 6 月 30 日，本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（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。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

#### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上

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。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元



本期末 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	44,403,252.46	-	-	-	44,403,252.46
结算备付金	2,327,423.79	-	-	-	2,327,423.79
存出保证金	117,507.56	-	-	-	117,507.56
交易性金融资产	-	-	205,152.64	802,344,007.11	802,549,159.75
应收申购款	-	-	-	50,021,937.60	50,021,937.60
资产总计	46,848,183.81	-	205,152.64	852,365,944.71	899,419,281.16
负债					
应付赎回款	-	-	-	320,186.24	320,186.24
应付管理人报酬	-	-	-	957,026.71	957,026.71
应付托管费	-	-	-	159,504.43	159,504.43
应付清算款	-	-	-	49,503,241.76	49,503,241.76
应交税费	-	-	-	1.34	1.34
其他负债	-	-	-	2,297,275.40	2,297,275.40
负债总计	-	-	-	53,237,235.88	53,237,235.88
利率敏感度缺口	46,848,183.81	-	205,152.64	799,128,708.83	846,182,045.28
上年度末 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	49,354,052.08	-	-	-	49,354,052.08
结算备付金	8,558,072.63	-	-	-	8,558,072.63
存出保证金	19,322.20	-	-	-	19,322.20
交易性金融资产	-	-	150,921.17	424,522,346.76	424,673,267.93
买入返售金融资产	226,097,814.19	-	-	-	226,097,814.19
应收申购款	-	-	-	53,011.67	53,011.67
应收清算款	-	-	-	143,894.82	143,894.82
资产总计	284,029,261.10	-	150,921.17	424,719,253.25	708,899,435.52
负债					
应付赎回款	-	-	-	119,530.66	119,530.66
应付管理人报酬	-	-	-	899,392.32	899,392.32
应付托管费	-	-	-	149,898.71	149,898.71
应付清算款	-	-	-	184,981.22	184,981.22
应交税费	-	-	-	0.71	0.71
其他负债	-	-	-	551,948.89	551,948.89
负债总计	-	-	-	1,905,752.51	1,905,752.51
利率敏感度缺口	284,029,261.10	-	150,921.17	422,813,500.74	706,993,683.01

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2023 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资和资产支持证券公允价值占基金资产净

值的比例为 0.02%。因此当利率发生合理、可能的变动时，对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无。

##### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。

本基金股票的主要投资方向为具有相对完善的公司治理结构和良好成长性的优质上市公司的股票，该部分股票的投资比例不低于基金股票资产的 80%。本基金股票(含存托凭证)资产占基金资产的比例为 60%~95%，债券资产占基金资产的比例为 0~35%，本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%，现金或到期日在 1 年期以内政府债券的投资比例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。法律法规或中国证监会以后允许基金投资的其他金融工具或品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

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

## 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022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	802,344,007.11	94.82	424,522,346.76	60.05
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	205,152.64	0.02	150,921.17	0.02
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	802,549,159.75	94.84	424,673,267.93	60.07

注：债券投资为可转换债券、可交换债券投资。

## 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准外的其他市场变量保持不变		
相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）		
	本期末（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）	
分析	业绩比较基准上升 5%	25,432,001.37	23,875,176.68
	业绩比较基准下降 5%	-25,432,001.37	-23,875,176.68

注：无。

## 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

## 6.4.14 公允价值

## 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

#### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年6月30日
第一层次	800,561,955.31
第二层次	671,220.66
第三层次	1,315,983.78
合计	802,549,159.75

##### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

##### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	802,344,007.11	89.21
	其中：股票	802,344,007.11	89.21
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	205,152.64	0.02
	其中：债券	205,152.64	0.02
	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	46,730,676.25	5.20
8	其他各项资产	50,139,445.16	5.57
9	合计	899,419,281.16	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,577,435.68	0.19
C	制造业	579,158,355.81	68.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	408,944.59	0.05
E	建筑业	37,441,547.42	4.42
F	批发和零售业	71,597,472.19	8.46
G	交通运输、仓储和邮政业	33,800.07	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	48,541,782.46	5.74
J	金融业	80,255.28	0.01
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	14,034,816.00	1.66
M	科学研究和技术服务业	41,644,215.08	4.92
N	水利、环境和公共设施管理业	134,633.72	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	7,690,748.81	0.91
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	802,344,007.11	94.82

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	002709	天赐材料	746,500	30,748,335.00	3.63
2	300750	宁德时代	126,520	28,946,510.80	3.42
3	300938	信测标准	551,200	24,142,560.00	2.85
4	301035	润丰股份	306,300	24,065,991.00	2.84
5	002871	伟隆股份	1,621,590	21,404,988.00	2.53
6	688458	美芯晟	215,820	20,754,305.76	2.45
7	601886	江河集团	2,305,100	20,492,339.00	2.42
8	002334	英威腾	1,550,900	19,758,466.00	2.34
9	605266	健之佳	234,500	19,658,135.00	2.32
10	603129	春风动力	120,500	19,508,950.00	2.31
11	688125	安达智能	346,603	18,837,873.05	2.23
12	300687	赛意信息	660,600	18,351,468.00	2.17
13	603939	益丰药房	482,200	17,841,400.00	2.11
14	605189	富春染织	1,026,640	16,847,162.40	1.99
15	300760	迈瑞医疗	52,300	15,679,540.00	1.85
16	002727	一心堂	576,500	15,219,600.00	1.80
17	603029	天鹅股份	707,221	14,816,279.95	1.75
18	603163	圣晖集成	310,325	14,222,194.75	1.68
19	300662	科锐国际	396,800	14,034,816.00	1.66
20	000922	佳电股份	1,040,520	13,693,243.20	1.62
21	002255	海陆重工	2,246,900	13,616,214.00	1.61
22	300986	志特新材	485,700	13,599,600.00	1.61
23	001322	箭牌家居	805,795	13,489,008.30	1.59
24	300832	新产业	226,770	13,379,430.00	1.58
25	300791	仙乐健康	451,700	13,117,368.00	1.55
26	002139	拓邦股份	991,620	12,940,641.00	1.53
27	301328	维峰电子	225,587	12,844,923.78	1.52
28	301061	匠心家居	343,520	12,693,064.00	1.50
29	688279	峰昭科技	94,537	12,478,884.00	1.47
30	003012	东鹏控股	1,536,900	12,433,521.00	1.47
31	603876	鼎胜新材	643,720	12,352,986.80	1.46
32	001301	尚太科技	211,864	11,930,061.84	1.41

33	688478	晶升股份	246,571	11,712,521.93	1.38
34	300946	恒而达	306,640	11,658,452.80	1.38
35	301280	珠城科技	315,300	11,275,128.00	1.33
36	003025	思进智能	678,017	10,949,974.55	1.29
37	600861	北京人力	467,100	10,836,720.00	1.28
38	688045	必易微	187,483	10,686,531.00	1.26
39	688376	美埃科技	269,567	10,645,200.83	1.26
40	603173	福斯达	358,300	10,551,935.00	1.25
41	301365	矩阵股份	627,549	10,329,456.54	1.22
42	002756	永兴材料	164,740	10,314,371.40	1.22
43	301338	凯格精机	247,460	9,626,194.00	1.14
44	603586	金麒麟	540,900	8,638,173.00	1.02
45	688352	颀中科技	626,419	8,416,569.74	0.99
46	300037	新宙邦	154,700	8,027,383.00	0.95
47	603101	汇嘉时代	1,225,000	7,497,000.00	0.89
48	688665	四方光电	77,242	7,192,775.04	0.85
49	603882	金域医学	93,800	7,081,900.00	0.84
50	688315	诺禾致源	263,331	6,991,438.05	0.83
51	300371	汇中股份	533,160	6,984,396.00	0.83
52	603739	蔚蓝生物	530,940	6,960,623.40	0.82
53	688595	芯海科技	213,540	6,829,009.20	0.81
54	603102	百合股份	150,700	6,508,733.00	0.77
55	301006	迈拓股份	241,900	6,325,685.00	0.75
56	688008	澜起科技	94,782	5,442,382.44	0.64
57	688108	赛诺医疗	483,178	5,102,359.68	0.60
58	688257	新锐股份	191,586	5,078,944.86	0.60
59	688508	芯朋微	84,941	4,925,728.59	0.58
60	301063	海锅股份	166,200	4,630,332.00	0.55
61	001360	南矿集团	174,800	3,036,276.00	0.36
62	601133	柏诚股份	181,228	2,700,511.53	0.32
63	002387	维信诺	185,400	1,700,118.00	0.20
64	600938	中国海油	84,004	1,522,152.48	0.18
65	688249	晶合集成	35,910	674,712.99	0.08
66	688498	源杰科技	2,215	631,275.00	0.07
67	688172	燕东微	21,776	517,833.28	0.06
68	688472	阿特斯	26,988	491,937.00	0.06
69	688361	中科飞测-U	5,779	469,114.27	0.06
70	688392	骄成超声	3,843	426,534.57	0.05
71	001286	陕西能源	37,667	391,397.47	0.05
72	301358	湖南裕能	8,090	355,134.82	0.04
73	688469	中芯集成-U	62,304	351,643.62	0.04
74	688409	富创精密	3,167	345,203.00	0.04
75	688147	微导纳米	6,293	332,144.54	0.04

76	301267	华夏眼科	5,423	330,531.85	0.04
77	688531	日联科技	2,191	322,626.61	0.04
78	301301	川宁生物	35,740	320,230.40	0.04
79	688432	有研硅	20,044	314,490.36	0.04
80	688320	禾川科技	6,048	291,634.56	0.03
81	688502	茂莱光学	1,509	289,728.00	0.03
82	688443	智翔金泰-U	9,185	282,603.37	0.03
83	301293	三博脑科	3,324	278,316.96	0.03
84	688146	中船特气	6,562	274,242.41	0.03
85	001287	中电港	9,211	249,648.86	0.03
86	688539	高华科技	5,334	247,497.60	0.03
87	301311	昆船智能	8,320	245,273.60	0.03
88	301486	致尚科技	3,856	222,336.96	0.03
89	688582	芯动联科	4,806	222,193.33	0.03
90	688522	纳睿雷达	4,200	216,300.00	0.03
91	688543	国科军工	3,753	209,565.35	0.02
92	688435	英方软件	2,728	207,437.12	0.02
93	301291	明阳电气	6,359	206,304.88	0.02
94	688570	天玛智控	7,454	197,597.30	0.02
95	301363	美好医疗	4,447	195,623.53	0.02
96	688562	航天软件	7,254	195,390.66	0.02
97	688507	索辰科技	1,499	194,527.85	0.02
98	688489	三未信安	2,953	186,777.25	0.02
99	301317	鑫磊股份	6,936	186,571.14	0.02
100	601061	中信金属	20,926	181,218.68	0.02
101	301377	鼎泰高科	7,695	176,985.00	0.02
102	688581	安杰思	1,416	172,812.52	0.02
103	688244	永信至诚	2,229	172,524.60	0.02
104	301399	英特科技	2,925	171,714.01	0.02
105	688152	麒麟信安	1,772	163,520.16	0.02
106	688084	晶品特装	1,875	162,881.25	0.02
107	688593	新相微	9,584	161,565.56	0.02
108	688629	华丰科技	7,073	160,957.02	0.02
109	301332	德尔玛	11,175	159,064.67	0.02
110	688334	西高院	8,879	157,912.84	0.02
111	301262	海看股份	5,672	156,120.00	0.02
112	301320	豪江智能	6,416	155,624.88	0.02
113	301382	蜂助手	4,080	155,284.80	0.02
114	301419	阿莱德	3,292	150,811.36	0.02
115	688433	华曙高科	4,171	140,769.00	0.02
116	688237	超卓航科	2,891	139,577.48	0.02
117	688391	钜泉科技	2,026	139,105.16	0.02
118	301360	荣旗科技	1,340	138,170.08	0.02



119	688620	安凯微	10,157	135,209.66	0.02
120	301315	威士顿	2,253	132,828.53	0.02
121	688419	耐科装备	3,039	129,400.62	0.02
122	603135	中重科技	6,273	126,392.92	0.01
123	688523	航天环宇	4,717	125,405.25	0.01
124	301141	中科磁业	2,617	119,750.28	0.01
125	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.01
126	688631	莱斯信息	3,357	108,400.08	0.01
127	301290	东星医疗	3,291	105,476.55	0.01
128	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.01
129	688479	友车科技	3,318	103,760.10	0.01
130	301355	南王科技	5,624	99,516.05	0.01
131	301376	致欧科技	4,192	98,850.60	0.01
132	688429	时创能源	3,452	98,752.08	0.01
133	301357	北方长龙	1,900	98,250.90	0.01
134	301323	新莱福	2,277	97,593.33	0.01
135	301265	华新环保	8,181	95,063.22	0.01
136	301386	未来电器	3,776	94,554.26	0.01
137	301170	锡南科技	2,496	92,283.70	0.01
138	601065	江盐集团	6,838	90,746.78	0.01
139	301281	科源制药	3,368	88,415.20	0.01
140	603282	亚光股份	2,500	86,275.00	0.01
141	301269	华大九天	682	83,776.88	0.01
142	301295	美硕科技	2,146	81,770.28	0.01
143	301428	世纪恒通	2,289	80,343.40	0.01
144	601059	信达证券	5,628	80,255.28	0.01
145	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.01
146	301337	亚华电子	2,318	78,804.24	0.01
147	301388	欣灵电气	2,920	78,402.00	0.01
148	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.01
149	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.01
150	688480	赛恩斯	2,302	71,269.92	0.01
151	600925	苏能股份	8,960	55,283.20	0.01
152	688485	九州一轨	3,580	54,917.20	0.01
153	301153	中科江南	717	53,746.32	0.01
154	688420	美腾科技	1,208	46,785.84	0.01
155	001328	登康口腔	1,445	46,323.05	0.01
156	603125	常青科技	1,596	44,779.00	0.01
157	001282	三联锻造	1,045	37,026.15	0.00
158	301162	国能日新	468	36,915.84	0.00
159	301266	宇邦新材	517	36,350.27	0.00
160	301325	曼恩斯特	314	33,896.30	0.00
161	301367	怡和嘉业	207	30,706.38	0.00

162	001338	永顺泰	1,649	30,407.56	0.00
163	301268	铭利达	641	26,838.67	0.00
164	603137	恒尚节能	1,382	26,502.14	0.00
165	688143	长盈通	699	26,352.30	0.00
166	001367	海森药业	549	24,687.92	0.00
167	001324	长青科技	1,131	23,764.29	0.00
168	301303	真兰仪表	1,058	23,614.56	0.00
169	301120	新特电气	1,548	23,560.56	0.00
170	301368	丰立智能	337	23,317.03	0.00
171	301286	侨源股份	784	23,128.00	0.00
172	301339	通行宝	913	22,943.69	0.00
173	301297	富乐德	1,015	22,847.65	0.00
174	603172	万丰股份	1,220	21,138.94	0.00
175	601022	宁波远洋	1,983	20,603.37	0.00
176	301152	天力锂能	433	19,337.78	0.00
177	301187	欧圣电气	876	16,179.72	0.00
178	301322	绿通科技	303	16,131.72	0.00
179	301439	泓淋电力	914	15,446.60	0.00
180	301408	华人健康	879	14,899.05	0.00
181	301361	众智科技	517	14,574.23	0.00
182	603057	紫燕食品	549	13,796.37	0.00
183	301132	满坤科技	468	13,754.52	0.00
184	603162	海通发展	774	13,196.70	0.00
185	688503	聚和材料	133	12,967.50	0.00
186	301277	新天地	659	12,857.09	0.00
187	301151	冠龙节能	703	12,422.01	0.00
188	301345	涛涛车业	262	12,219.68	0.00
189	301349	信德新材	227	11,381.78	0.00
190	001278	一彬科技	473	11,247.94	0.00
191	603130	云中马	480	10,900.80	0.00
192	001333	光华股份	426	10,705.38	0.00
193	301298	东利机械	634	10,416.62	0.00
194	301318	维海德	309	10,366.95	0.00
195	301125	腾亚精工	327	9,993.12	0.00
196	001300	三柏硕	763	9,690.10	0.00
197	301398	星源卓镁	255	9,562.50	0.00
198	001299	美能能源	576	9,394.56	0.00
199	301135	瑞德智能	338	9,267.96	0.00
200	001368	通达创智	351	8,922.42	0.00
201	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
202	001238	浙江正特	374	8,800.22	0.00
203	603151	邦基科技	535	8,741.90	0.00
204	301163	宏德股份	277	8,739.35	0.00

205	603065	宿迁联盛	581	8,656.90	0.00
206	301259	艾布鲁	628	8,446.60	0.00
207	301359	东南电子	328	8,357.44	0.00
208	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
209	301316	慧博云通	359	8,203.15	0.00
210	603291	联合水务	536	8,152.56	0.00
211	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
212	301288	清研环境	452	7,801.52	0.00
213	301276	嘉曼服饰	303	7,726.50	0.00
214	600845	宝信软件	109	5,538.29	0.00
215	002049	紫光国微	20	1,865.00	0.00
216	301193	家联科技	93	1,630.29	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	603029	天鹅股份	35,514,688.52	5.02
2	688036	传音控股	33,653,978.77	4.76
3	002709	天赐材料	32,093,567.97	4.54
4	688279	峰岬科技	28,152,102.68	3.98
5	002850	科达利	27,813,787.86	3.93
6	603282	亚光股份	26,339,686.52	3.73
7	001301	尚太科技	25,959,957.66	3.67
8	688010	福光股份	25,645,370.74	3.63
9	300938	信测标准	24,317,526.80	3.44
10	301035	润丰股份	22,863,315.00	3.23
11	688772	珠海冠宇	20,768,073.74	2.94
12	002255	海陆重工	20,275,932.98	2.87
13	000922	佳电股份	19,935,951.00	2.82
14	605266	健之佳	19,934,724.43	2.82
15	300986	志特新材	19,865,084.22	2.81
16	002871	伟隆股份	19,741,956.60	2.79
17	300791	仙乐健康	19,384,064.00	2.74
18	688458	美芯晟	19,195,111.65	2.72
19	601886	江河集团	18,989,863.00	2.69
20	688125	安达智能	18,692,934.36	2.64
21	002555	三七互娱	18,570,588.00	2.63
22	603939	益丰药房	18,211,599.60	2.58
23	002727	一心堂	17,681,743.00	2.50
24	300687	赛意信息	17,666,503.00	2.50
25	688315	诺禾致源	17,475,573.63	2.47
26	002334	英威腾	17,328,131.00	2.45

27	603129	春风动力	17,318,474.00	2.45
28	605189	富春染织	16,956,011.60	2.40
29	600519	贵州茅台	16,650,951.00	2.36
30	300760	迈瑞医疗	15,833,651.00	2.24
31	002139	拓邦股份	15,438,466.60	2.18
32	605589	圣泉集团	15,209,140.00	2.15
33	300832	新产业	14,212,345.24	2.01
34	605196	华通线缆	14,171,354.00	2.00
35	300662	科锐国际	14,166,481.72	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。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000858	五粮液	46,761,611.28	6.61
2	603259	药明康德	40,477,907.61	5.73
3	688036	传音控股	38,497,256.88	5.45
4	000568	泸州老窖	34,625,939.20	4.90
5	600519	贵州茅台	32,007,024.00	4.53
6	002850	科达利	25,732,339.00	3.64
7	603029	天鹅股份	24,304,375.30	3.44
8	603282	亚光股份	23,822,078.49	3.37
9	300628	亿联网络	23,475,417.11	3.32
10	688279	峰昭科技	22,219,017.74	3.14
11	002555	三七互娱	21,792,981.56	3.08
12	688010	福光股份	21,704,894.77	3.07
13	600845	宝信软件	19,852,239.07	2.81
14	688772	珠海冠宇	19,133,258.21	2.71
15	002311	海大集团	16,453,304.00	2.33
16	603899	晨光股份	15,370,685.99	2.17
17	603662	柯力传感	14,451,436.04	2.04
18	301325	曼恩斯特	13,748,336.91	1.94
19	605196	华通线缆	13,663,114.00	1.93
20	688188	柏楚电子	13,304,075.04	1.88

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

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,234,326,614.61
卖出股票收入（成交）总额	841,738,759.53

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

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	205,152.64	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	205,152.64	0.02

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	127079	华亚转债	1,509	205,152.64	0.02

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：无。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：无。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：无。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

## 7.12 投资组合报告附注

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

浙江春风动力股份有限公司在报告编制日前一年内受到中华人民共和国宁波海事局的处罚。

山东潍坊润丰化工股份有限公司在报告编制日前一年内受到石嘴山市应急管理局的处罚。

以上证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券备选库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	117,507.56
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	50,021,937.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	50,139,445.16

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	127079	华亚转债	205,152.64	0.02

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688458	美芯晟	18,515.04	0.00	新股流通受限

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)

38,393	19,563.76	162,297,912.85	21.61	588,813,346.42	78.39
--------	-----------	----------------	-------	----------------	-------

## 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	上海科技教育出版社	5,207,991.00	7.66
2	郑伟业	555,051.00	0.82
3	沈根珠	414,754.00	0.61
4	赵建新	295,300.00	0.43
5	姜艳	265,936.00	0.39
6	闫金来	256,272.00	0.38
7	秦香兰	244,259.00	0.36
8	姜宏山	242,037.00	0.36
8	马慧敏	242,037.00	0.36
8	马韬	242,037.00	0.36
8	许孝璋	242,037.00	0.36

注：持有人为场内持有人。

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	833,133.22	0.1109

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

## 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2007 年 4 月 25 日) 基金份额总额	1,000,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	606,714,359.22
本报告期基金总申购份额	163,153,765.69
减：本报告期基金总赎回份额	18,756,865.64
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	751,111,259.27

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

**10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动**

无。

**10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼**

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

**10.4 基金投资策略的改变**

无

**10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况**

本报告期内未改聘为本基金审计的会计师事务所。

**10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况****10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**

注：无。

**10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**

注：本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

**10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况****10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
东方证券	1	727,487,264.65	35.24	670,233.63	35.04	-
长江证券	2	691,862,120.60	33.52	644,333.23	33.68	-
国信证券	1	229,826,137.44	11.13	214,035.23	11.19	-
海通证券	3	135,715,909.87	6.57	125,035.93	6.54	本报告期新增一个
广发证券	1	134,306,489.45	6.51	125,079.18	6.54	-
光大证券	1	81,510,027.57	3.95	75,095.29	3.93	-



中金公司	1	58,966,339.49	2.86	54,914.87	2.87	-
中信建投证券	1	3,987,651.35	0.19	3,713.58	0.19	-
国泰君安	2	560,636.16	0.03	516.53	0.03	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券	2	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

注：交易单元选择的标准和程序：

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

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

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

2) 选择交易单元的程序：

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

## 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名	债券交易	债券回购交易	权证交易
-----	------	--------	------

称	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(%)
东方证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	1,615,226,000.00	93.10	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	96,778,000.00	5.58	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	22,862,000.00	1.32	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会	2023年01月04日

		基金电子披露网站	
2	关于调整旗下部分基金参与中国工商银行股份有限公司申购、定期定额申购费率优惠时间的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 01 月 05 日
3	鹏华优质治理混合型证券投资基金（LOF）2022 年第 4 季度报告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 01 月 20 日
4	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购中润光学首次公开发行 A 股的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 02 月 10 日
5	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与东方财富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	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 03 月 14 日
6	鹏华基金管理有限公司关于基金经理恢复履行职责的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 03 月 24 日
7	鹏华优质治理混合型证券投资基金（LOF）2022 年年度报告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 03 月 30 日
8	鹏华基金管理有限公司关于新增人民币直销资金专户的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 04 月 07 日
9	鹏华优质治理混合型证券投资基金（LOF）更新的招募说明书	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 04 月 11 日
10	鹏华优质治理混合型证券投资基金（LOF）基金产品资料概要（更新）	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 04 月 11 日
11	鹏华优质治理混合型证券投资基金（LOF）基金经理变更公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 04 月 15 日
12	鹏华优质治理混合型证券投资基金（LOF）更新的招募说明书（2023 年第 1 号）	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 04 月 19 日
13	鹏华优质治理混合型证券投资基金（LOF）基金产品资料概要（更新）	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 04 月 19 日
14	鹏华优质治理混合型证券投资基金（LOF）2023 年第 1 季度报告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 04 月 21 日
15	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购航天软件首次公开发行 A 股的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 05 月 17 日

16	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票估值方法变更的提示性公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 05 月 19 日
17	鹏华基金管理有限公司关于注意防范以协助办理贷款为借口进行诈骗活动的风险提示	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 06 月 03 日
18	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与国海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	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 06 月 05 日
19	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 06 月 06 日
20	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与北京中植基金销售有限公司申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 06 月 20 日
21	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购豪恩汽电首次公开发行 A 股的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 06 月 28 日

注：无。

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：无。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- （一）《鹏华优质治理混合型证券投资基金（LOF）基金合同》；
- （二）《鹏华优质治理混合型证券投资基金（LOF）托管协议》；
- （三）《鹏华优质治理混合型证券投资基金（LOF）2023 年中期报告》（原文）。

### 12.2 存放地点

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

### 12.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅，也可按工本费购买复印件，或通过本基金管理

人网站（<http://www.phfund.com.cn>）查阅。

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

**鹏华基金管理有限公司**

**2023 年 8 月 30 日**