

鹏华策略回报灵活配置混合型证券投资基金  
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	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	9
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>13</b>
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	19
<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	46
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	65
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	67

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 .....	67
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 .....	67
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 .....	67
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 .....	67
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	67
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	68
7.12 投资组合报告附注 .....	68
<b>§ 8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>69</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	69
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	69
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	69
<b>§ 9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>69</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>69</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	69
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 .....	70
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	70
10.4 基金投资策略的改变 .....	70
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	70
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 .....	70
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	70
10.8 其他重大事件 .....	72
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>73</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 .....	73
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	73
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>74</b>
12.1 备查文件目录 .....	74
12.2 存放地点 .....	74
12.3 查阅方式 .....	74

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华策略回报灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	鹏华策略回报混合
基金主代码	004986
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 9 月 6 日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	178,094,697.75 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为混合型基金，在控制风险的前提下灵活地采用多种投资策略，通过精选个股，力争长期稳健超额回报的目标。
投资策略	<p>1、资产配置策略 本基金将通过跟踪考量通常的宏观经济变量（包括 GDP 增长率、CPI 走势、M2 的绝对水平和增长率、利率水平与走势等）以及各项国家政策（包括财政、货币、税收、汇率政策等）来判断经济周期目前的位置以及未来将发展的方向，在此基础上对各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估，制定股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。</p> <p>2、股票投资策略 本基金灵活、务实地采用多种投资策略，包括价值投资、成长投资、主题轮动、趋势投资等，将各种理念和方法兼容并蓄，作为实现收益的工具和手段。本基金将重点关注在中国经济持续转型的过程中，因经济结构优化、产业结构升级、技术创新等制度变革等产生的投资机会，并投资于其中的优质上市公司的股票。</p> <p>（1）价值投资策略 本基金通过寻找价值被低估的股票进行投资，以谋求估值反转带来的收益。通过运用多项指标如 PE、PB、EV/EBITDA 等进行相对估值，通过与国内同行业其它公司估值水平以及国外同行业公司相对估值水平等进行估值比较，找出价值被相对低估的公司。</p> <p>（2）成长投资策略 在充分的行业研究和审慎的公司研究基础上，本基金将关注成长型上市公司，尤其是中小市值股票中具有潜在高成长性和稳健盈利模式的上市公司。在具体操作上，以政策分析、行业分析和公司特质分析等基本面定性分析为主，评估风险，精选投资标的。</p> <p>（3）主题轮动策略 主题轮动策略是基于自上而下的投资主题分析框架，综合运用定量和定性的分析方法，针对经济发展趋势及成长动因进行前瞻性的分析，挖掘市场的长期性和阶段性主题投资机会，并从中发现与投资主题相符的行业和具有核心竞争力的上市公司，力争获取市场超额收益。</p> <p>（4）趋势投资策略 公司的经营业绩成长和公司投资价值的提升具有连续性和延展性，这决定了公司股票价格的长期趋势。同时，在股票市场上，由于受到当期各种外部因素的影响，股票价格还具有中、短期趋势。中期趋势表现为股价相对长期趋势的估值偏离和估值修复过程，而短期</p>

	<p>趋势则表现为外部因素影响短期股价偏离和恢复的过程。由于市场反应不足或反应过度，股票价格的涨跌往往表现出一定的惯性。因此，可通过基本面分析、行为金融分析和事件分析，利用股价中、短期趋势的动态特征，进行股票的买入和卖出操作，从而提高单只股票的投资收益。</p> <p>(5) 存托凭证投资策略 本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。</p> <p>3、债券投资策略 本基金债券投资将采取久期策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、个券选择策略、信用策略等积极投资策略，自上而下地管理组合的久期，灵活地调整组合的券种搭配，同时精选个券，以增强组合的持有期收益。</p> <p>(1) 久期策略 久期管理是债券投资的重要考量因素，本基金将采用以“目标久期”为中心、自上而下的组合久期管理策略。</p> <p>(2) 收益率曲线策略 收益率曲线的形状变化是判断市场整体走向的一个重要依据，本基金将据此调整组合长、中、短期债券的搭配，并进行动态调整。</p> <p>(3) 骑乘策略 本基金将采用基于收益率曲线分析对债券组合进行适时调整的骑乘策略，以达到增强组合的持有期收益的目的。</p> <p>(4) 息差策略 本基金将采用息差策略，以达到更好地利用杠杆放大债券投资的收益的目的。</p> <p>(5) 个券选择策略 本基金将根据单个债券到期收益率相对于市场收益率曲线的偏离程度，结合信用等级、流动性、选择权条款、税赋特点等因素，确定其投资价值，选择定价合理或价值被低估的债券进行投资。</p> <p>(6) 信用策略 本基金通过主动承担适度的信用风险来获取信用溢价，根据内、外部信用评级结果，结合对类似债券信用利差的分析以及对未来信用利差走势的判断，选择信用利差被高估、未来信用利差可能下降的信用债进行投资。</p> <p>4、权证投资策略 本基金通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型及价值挖掘策略、价差策略、双向权证策略等寻求权证的合理估值水平，追求稳定的当期收益。</p> <p>5、中小企业私募债投资策略 中小企业私募债券是在中国境内以非公开方式发行和转让，约定在一定期限还本付息的公司债券。由于其非公开性及条款可协商性，普遍具有较高收益。本基金将深入研究发行人资信及公司运营情况，合理合规合格地进行中小企业私募债券投资。本基金在投资过程中密切监控债券信用等级或发行人信用等级变化情况，尽力规避风险，并获取超额收益。</p> <p>6、股指期货投资策略 本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目标，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，充分考虑股指期货的风险收益特征，通过多头或空头的套期保值策略，以改善投资组合的投资效果，实现股票组合的超额收益。</p> <p>7、融资投资策略 本基金将在充分考虑风险和收益特征的基础上，审慎参与融资交易。本基金将基于对市场行情和组合风险收益的分析，确定投资时机、标的证券以及投资比例。若相关融资业务法律法规发生变化，本基金将从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。</p>
业绩比较基准	本基金业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×60%+中证综合债指数收益率×40%
风险收益特征	本基金属于混合型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、

	债券基金，低于股票型基金，属于证券投资基金中中高风险、中高预期收益的品种。
--	---------------------------------------

注：无。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		鹏华基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	高永杰	郭明
	联系电话	0755-81395402	(010)66105799
	电子邮箱	xxpl@phfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4006788999	95588
传真		0755-82021126	(010)66105798
注册地址		深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		518048	100140
法定代表人		何如	陈四清

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-6,352,910.07
本期利润	567,236.85
加权平均基金份额本期利润	0.0031
本期加权平均净值利润率	0.19%
本期基金份额净值增长率	0.10%
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	102,982,116.73
期末可供分配基金份额利润	0.5782
期末基金资产净值	281,076,814.48
期末基金份额净值	1.5782

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	92.19%

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

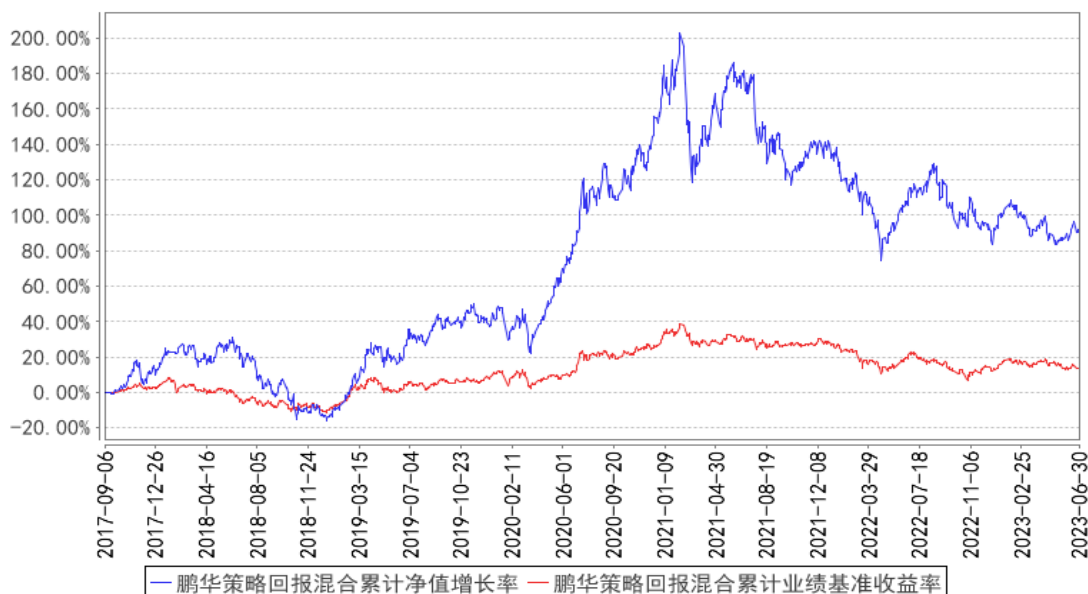
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.79%	0.89%	0.91%	0.52%	1.88%	0.37%
过去三个月	-0.44%	0.88%	-2.38%	0.49%	1.94%	0.39%
过去六个月	0.10%	0.86%	0.73%	0.50%	-0.63%	0.36%
过去一年	-9.48%	1.11%	-7.06%	0.59%	-2.42%	0.52%
过去三年	3.50%	1.54%	1.14%	0.72%	2.36%	0.82%
自基金合同生效起至今	92.19%	1.58%	13.87%	0.74%	78.32%	0.84%

注：业绩比较基准=本基金业绩比较基准：沪深300指数收益率×60%+中证综合债指数收益率×40%



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

鹏华策略回报混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2017 年 09 月 06 日生效。2、截至建仓期结束，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

### 3.3 其他指标

注：无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

鹏华基金管理有限公司成立于 1998 年 12 月 22 日，业务范围包括基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。截至本报告期末，公司股东由国信证券股份有限公司、意大利欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）、深圳市北融信投资发展有限公司组成，公司性质为中外合资企业，公司注册资本 15,000 万元人民币。截至 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		
张鹏	基金经理	2021-08-13	-	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未发生变动。
--	--	--	--	--

注：1. 任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日；担任新成立基金基金经理的，任职日期为基金合同生效日。

2. 证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

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

注：无。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行公平交易制度，确保不同投资组合在研究、交易、分配等各环节得到公平对待。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

上半年，市场剧烈震荡，结构显著分化。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。

增加数据要素链条上进展较快的公司的仓位和泛 AI 线索上的算力、存储、智能驾驶等板块的仓位，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，增仓制造业中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，本报告期鹏华策略回报混合份额净值增长率为 0.10%，同期业绩比较基准增长率为 0.73%。

## 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等各环节的持续推进，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 102,982,116.73 元，期末基金份额净值 1.5782 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：鹏华策略回报灵活配置混合型证券投资基金

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	46,566,437.69	26,482,208.83
结算备付金		911,689.76	1,019,076.68
存出保证金		91,668.93	87,220.82
交易性金融资产	6.4.7.2	239,296,280.85	257,246,448.82
其中：股票投资		239,077,355.63	257,020,036.52
基金投资		-	-
债券投资		218,925.22	226,412.30
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	12,021,405.48
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		-	4,886,458.51
应收股利		-	-
应收申购款		31,843.23	29,065.86

递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		286,897,920.46	301,771,885.00
<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		4,500,187.86	243,597.95
应付赎回款		355,373.43	103,782.44
应付管理人报酬		346,041.13	383,526.59
应付托管费		57,673.54	63,921.13
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.81	0.69
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	561,829.21	730,208.87
负债合计		5,821,105.98	1,525,037.67
<b>净资产:</b>			
实收基金	6.4.7.10	178,094,697.75	190,440,874.18
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	102,982,116.73	109,805,973.15
净资产合计		281,076,814.48	300,246,847.33
负债和净资产总计		286,897,920.46	301,771,885.00

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.5782 元，基金份额总额 178,094,697.75 份。

## 6.2 利润表

会计主体：鹏华策略回报灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：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>		3,210,300.01	-49,150,507.31
1. 利息收入		118,331.58	121,985.56
其中：存款利息收入	6.4.7.13	73,406.80	96,948.95
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		44,924.78	25,036.61
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-3,837,249.51	-26,352,698.74
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-5,425,368.77	-27,942,473.64
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	157.25	4.13
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	1,587,962.01	1,589,770.77
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	6,920,146.92	-22,950,427.62
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	9,071.02	30,633.49
<b>减：二、营业总支出</b>		2,643,063.16	3,136,273.92
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,192,818.15	2,602,840.13
2. 托管费	6.4.10.2.2	365,469.79	433,806.67
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		0.48	-
8. 其他费用	6.4.7.23	84,774.74	99,627.12
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		567,236.85	-52,286,781.23
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		567,236.85	-52,286,781.23
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		567,236.85	-52,286,781.23

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：鹏华策略回报灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：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)	190,440,874.18	-	109,805,973.15	300,246,847.33
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)	190,440,874.18	-	109,805,973.15	300,246,847.33
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-12,346,176.43	-	-6,823,856.42	-19,170,032.85
(一)、综合收益总额	-	-	567,236.85	567,236.85
(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)	-12,346,176.43	-	-7,391,093.27	-19,737,269.70
其中：1. 基金申	4,652,630.20	-	2,778,000.29	7,430,630.49



购款				
2. 基金赎回款	-16,998,806.63	-	-10,169,093.56	-27,167,900.19
(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)	178,094,697.75	-	102,982,116.73	281,076,814.48
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)	209,299,863.57	-	206,775,265.18	416,075,128.75
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	209,299,863.57	-	206,775,265.18	416,075,128.75

三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-11,999,404.49	-	-60,076,216.51	-72,075,621.00
(一)、综合收益总额	-	-	-52,286,781.23	-52,286,781.23
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-11,999,404.49	-	-7,789,435.28	-19,788,839.77
其中:1.基金申购款	10,115,671.07	-	7,301,775.78	17,417,446.85
2.基金赎回款	-22,115,075.56	-	-15,091,211.06	-37,206,286.62
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基	197,300,459.08	-	146,699,048.67	343,999,507.75

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

鹏华策略回报灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于准予鹏华策略回报灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2015]2737号文)和机构部函[2017]1679号《关于鹏华策略回报灵活配置混合型证券投资基金延期募集备案的回函》批准,由鹏华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《鹏华策略回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2017年9月6日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集规模为491,760,953.62份基金份额。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称:工商银行)。本基金于2017年8月7日至2017年9月1日募集。募集期间净认购资金人民币491,532,684.29元,认购资金在募集期间产生的利息人民币228,269.33元,募集的有效认购份额及利息结转的基金份额合计491,760,953.62份。上述募集资金已由普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了普华永道中天验字(2017)第800号验资报告。

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金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	46,566,437.69
等于: 本金	46,562,256.59
加: 应计利息	4,181.10
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	46,566,437.69

##### 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		238,212,270.16	-	239,077,355.63	865,085.47
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	181,000.00	167.72	218,925.22	37,757.50
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	181,000.00	167.72	218,925.22	37,757.50
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		238,393,270.16	167.72	239,296,280.85	902,842.97

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	-
应付赎回费	113.06
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	477,413.59
其中：交易所市场	477,413.59
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	84,302.56
合计	561,829.21

## 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	190,440,874.18	190,440,874.18
本期申购	4,652,630.20	4,652,630.20
本期赎回（以“-”号填列）	-16,998,806.63	-16,998,806.63
- 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	178,094,697.75	178,094,697.75

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	310,897,649.44	-201,091,676.29	109,805,973.15
本期利润	-6,352,910.07	6,920,146.92	567,236.85
本期基金份额交易产生的变动数	-20,035,732.42	12,644,639.15	-7,391,093.27
其中：基金申购款	7,536,941.04	-4,758,940.75	2,778,000.29
基金赎回款	-27,572,673.46	17,403,579.90	-10,169,093.56
本期已分配利润	-	-	-
本期末	284,509,006.95	-181,526,890.22	102,982,116.73

#### 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	63,033.57
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	9,620.79
其他	752.44
合计	73,406.80

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	-5,425,368.77
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	-5,425,368.77

##### 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	573,634,853.08
减：卖出股票成本总额	577,411,945.74
减：交易费用	1,648,276.11
买卖股票差价收入	-5,425,368.77

#### 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	157.25
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	157.25

##### 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	1,587,962.01
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	1,587,962.01

## 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	6,920,146.92
股票投资	6,927,750.32
债券投资	-7,603.40
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	6,920,146.92

#### 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	8,963.34
基金转换费收入	107.68
合计	9,071.02

#### 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	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费用	471.00
存托服务费	1.18
合计	84,774.74

#### 6.4.7.24 分部报告

无。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
鹏华基金管理有限公司（“鹏华基金公司”）	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商”	基金托管人、基金代销机构

银行”)	
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	140,135,122.97	12.52	103,622,099.70	9.03

##### 6.4.10.1.2 债券交易

注：无。

##### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

##### 6.4.10.1.4 权证交易

注：无。

##### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	129,105.25	13.12	85,657.57	17.94
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	95,354.38	9.40	93,919.58	19.77

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	2,192,818.15	2,602,840.13
其中：支付销售机构的客户维护费	673,714.73	802,296.36

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 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托管费	365,469.79	433,806.67

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 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	
	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	46,566,437.69	63,033.57	53,723,876.29	88,881.48

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 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：股/张）	总金额
国信证券	301488	豪恩汽电	网下申购	1,458	57,999.24
国信证券	688562	航天软件	网下申购	4,584	58,125.12
国信证券	688307	中润光学	网下申购	2,455	58,625.40
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	89	2,485.77	2,939.67	-
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	361	4,288.68	7,588.22	-
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	99	2,047.32	2,523.51	-
001367	海森药业	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股流通受限	44.48	39.48	49	2,179.52	1,934.52	-
301141	中科磁业	2023 年 3 月 27 日	6 个月	新股流通受限	41.20	42.69	222	9,146.40	9,477.18	-
301157	华塑科技	2023 年 3 月 1 日	6 个月	新股流通受限	56.50	52.93	129	7,288.50	6,827.97	-
301170	锡南科技	2023 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通受限	34.00	34.93	138	4,692.00	4,820.34	-
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	1,676	43,274.32	43,274.32	-
301202	朗威股份	2023 年 6 月 28 日	6 个月	新股流通受限	25.82	25.82	187	4,828.34	4,828.34	-
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	1,192	43,984.80	43,984.80	-

301261	恒工精密	2023年6月29日	6个月	新股流通受限	36.90	36.90	133	4,907.70	4,907.70	-
301262	海看股份	2023年6月13日	6个月	新股流通受限	30.22	25.50	226	6,829.72	5,763.00	-
301281	科源制药	2023年3月28日	6个月	新股流通受限	44.18	25.10	242	7,643.14	6,074.20	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	255	9,723.15	7,912.65	-
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	3,458	69,125.42	69,125.42	-
301292	海科新源	2023年6月29日	6个月	新股流通受限	19.99	19.99	385	7,696.15	7,696.15	-
301293	三博脑科	2023年4月25日	6个月	新股流通受限	29.60	71.42	250	7,400.00	17,855.00	-
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	2,395	11,975.00	21,459.20	-
301303	真兰仪表	2023年2月13日	6个月	新股流通受限	26.80	22.32	513	13,748.40	11,450.16	-
301315	威士顿	2023年6月13日	6个月	新股流通受限	32.29	51.12	155	5,004.95	7,923.60	-
301317	鑫磊股份	2023年1月12日	6个月	新股流通受限	20.67	26.17	651	13,456.17	17,036.67	-
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	122	10,619.91	6,495.28	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	154	6,015.24	6,061.44		-
301325	曼恩斯特	2023 年 5 月 4 日	6 个月	新股流 通受限	76.80	107.95	132	10,137.60	14,249.40		-
301332	德尔玛	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股流 通受限	14.81	13.73	498	7,375.38	6,837.54		-
301337	亚华电子	2023 年 5 月 16 日	6 个月	新股流 通受限	32.60	30.37	183	5,965.80	5,557.71		-
301345	涛涛车业	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股流 通受限	73.45	46.64	103	7,565.35	4,803.92		-
301355	南王科技	2023 年 6 月 2 日	6 个月	新股流 通受限	17.55	16.75	400	7,020.00	6,700.00		-
301357	北方长龙	2023 年 4 月 11 日	6 个月	新股流 通受限	50.00	48.39	140	7,000.00	6,774.60		-
301358	湖南裕能	2023 年 2 月 1 日	6 个月	新股流 通受限	23.77	42.89	325	7,725.25	13,939.25		-
301360	荣旗科技	2023 年 4 月 17 日	6 个月	新股流 通受限	71.88	92.60	104	7,475.52	9,630.40		-
301373	凌玮科技	2023 年 1 月 20 日	6 个月	新股流 通受限	33.73	31.85	246	8,297.58	7,835.10		-
301376	致欧科技	2023 年 6 月 14 日	6 个月	新股流 通受限	24.66	22.51	228	5,622.48	5,132.28		-
301382	蜂助手	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股流 通受限	23.80	32.84	248	5,902.40	8,144.32		-
301386	未来电器	2023 年 3 月 21 日	6 个月	新股流 通受限	29.99	23.79	272	8,157.28	6,470.88		-
301399	英特科技	2023 年 5 月 16 日	6 个月	新股流 通受限	43.99	51.57	193	8,490.07	9,953.01		-

301408	华人健康	2023年 2月22 日	6个月	新股流 通受限	16.24	16.95	625	10,150.00	10,593.75	-
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	226	5,955.10	6,915.60	-
301439	泓淋电力	2023年 3月10 日	6个月	新股流 通受限	19.99	16.90	364	7,276.36	6,151.60	-
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	1,379	79,513.14	79,513.14	-
301486	致尚科技	2023年 6月30 日	6个月	新股流 通受限	57.66	57.66	154	8,879.64	8,879.64	-
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	1,312	52,191.36	52,191.36	-
301488	豪恩汽电	2023年 6月26 日	6个月	新股流 通受限	39.78	39.78	146	5,807.88	5,807.88	-
601061	中信金属	2023年 3月30 日	6个月	新股流 通受限	6.58	7.58	817	5,375.86	6,192.86	-
601065	江盐集团	2023年 3月31 日	6个月	新股流 通受限	10.36	11.84	267	2,766.12	3,161.28	-
601133	柏诚股份	2023年 3月31 日	6个月	新股流 通受限	11.66	12.26	236	2,751.76	2,893.36	-
601916	浙商银行	2023年 6月27 日	1个月 内(含)	配股未 上市	2.02	2.64	74,310	150,106.20	196,178.40	浙商银行于2023年6月27日每10股配3股
603125	常青科技	2023年 3月30 日	6个月	新股流 通受限	25.98	24.53	88	2,286.24	2,158.64	-
603135	中重科技	2023年 3月29 日	6个月	新股流 通受限	17.80	17.89	272	4,841.60	4,866.08	-

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	259	9,362.85	9,875.67	-
688249	晶合集成	2023年 4月24日	6个月	新股流 通受限	19.86	18.06	1,469	29,174.34	26,530.14	-
688334	西高院	2023年 6月9日	6个月	新股流 通受限	14.16	16.21	487	6,895.92	7,894.27	-
688352	颀中科技	2023年 4月11日	6个月	新股流 通受限	12.10	12.07	721	8,724.10	8,702.47	-
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	260	6,136.00	16,814.20	-
688429	时创能源	2023年 6月20日	6个月	新股流 通受限	19.20	25.53	227	4,358.40	5,795.31	-
688433	华曙高科	2023年 4月7日	6个月	新股流 通受限	26.66	31.50	218	5,811.88	6,867.00	-
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	356	13,485.28	10,498.44	-
688458	美芯晟	2023年 5月15日	6个月	新股流 通受限	75.00	90.76	91	6,825.00	8,259.16	-
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	2,677	15,232.13	14,482.57	-
688472	阿特斯	2023年 6月2日	6个月	新股流 通受限	11.10	17.04	988	10,966.80	16,835.52	-
688478	晶升股份	2023年 4月13日	6个月	新股流 通受限	32.52	42.37	305	9,918.60	12,922.85	-
688479	友车科技	2023年 5月4日	6个月	新股流 通受限	33.99	29.49	172	5,846.28	5,072.28	-

		日									
688523	航天环宇	2023年5月26日	6个月	新股流通受限	21.86	23.85	343	7,497.98	8,180.55		-
688531	日联科技	2023年3月24日	6个月	新股流通受限	152.38	135.97	81	12,342.78	11,013.57		-
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	147	6,419.49	7,798.35		-
688562	航天软件	2023年5月15日	6个月	新股流通受限	12.68	22.31	459	5,820.12	10,240.29		-
688570	天玛智控	2023年5月29日	6个月	新股流通受限	30.26	25.33	277	8,382.02	7,016.41		-
688581	安杰思	2023年5月12日	6个月	新股流通受限	125.80	118.03	64	8,051.20	7,553.92		-
688582	芯动联科	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	26.74	40.68	198	5,294.52	8,054.64		-
688593	新相微	2023年5月25日	6个月	新股流通受限	11.18	14.59	633	7,076.94	9,235.47		-
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	970	53,350.00	53,350.00		-
688603	天承科技	2023年6月30日	6个月	新股流通受限	55.00	55.00	108	5,940.00	5,940.00		-
688620	安凯微	2023年6月15日	6个月	新股流通受限	10.68	12.34	533	5,692.44	6,577.22		-
688629	华丰科技	2023年6月16日	6个月	新股流通受限	9.26	18.59	623	5,768.98	11,581.57		-
688631	莱斯信息	2023年6月19日	6个月	新股流通受限	25.28	29.87	150	3,792.00	4,480.50		-

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  
第 36 页 共 74 页

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。

#### **6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

注：无。

#### **6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

##### **6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

无。

##### **6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

无。

#### **6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券**

注：无。

#### **6.4.13 金融工具风险及管理**

##### **6.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

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

中小企业私募债等), 货币市场工具, 权证, 资产支持证券, 股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金可以依照法律法规参与融资。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种, 基金管理人在履行适当程序后, 可以将其纳入投资范围。

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

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

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

#### 6.4.13.2 信用风险

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

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

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

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

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计

及汇总。下列表格列示中不含国债、央行票据、政策性金融债券等非信用债券投资。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	218,925.22	226,412.30
未评级	-	-
合计	218,925.22	226,412.30

注：上述评级均由经中国证监会核准从事证券市场资信评级业务的评级机构作出。

#### 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。

#### 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、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

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

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

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



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

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

#### 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
<b>资产</b>					
银行存款	46,566,437.69	-	-	-	46,566,437.69
结算备付金	911,689.76	-	-	-	911,689.76
存出保证金	91,668.93	-	-	-	91,668.93
交易性金融资产	-	17,987.40	200,937.82	239,077,355.63	239,296,280.85
应收申购款	-	-	-	31,843.23	31,843.23
<b>资产总计</b>	<b>47,569,796.38</b>	<b>17,987.40</b>	<b>200,937.82</b>	<b>239,109,198.86</b>	<b>286,897,920.46</b>
<b>负债</b>					
应付赎回款	-	-	-	355,373.43	355,373.43
应付管理人报酬	-	-	-	346,041.13	346,041.13
应付托管费	-	-	-	57,673.54	57,673.54
应付清算款	-	-	-	4,500,187.86	4,500,187.86
应交税费	-	-	-	0.81	0.81
其他负债	-	-	-	561,829.21	561,829.21
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>5,821,105.98</b>	<b>5,821,105.98</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>47,569,796.38</b>	<b>17,987.40</b>	<b>200,937.82</b>	<b>233,288,092.88</b>	<b>281,076,814.48</b>

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	26,482,208.83	-	-	-	26,482,208.83
结算备付金	1,019,076.68	-	-	-	1,019,076.68
存出保证金	87,220.82	-	-	-	87,220.82
交易性金融资产	-	-	226,412.30	257,020,036.52	257,246,448.82
买入返售金融资产	12,021,405.48	-	-	-	12,021,405.48
应收申购款	-	-	-	29,065.86	29,065.86
应收清算款	-	-	-	4,886,458.51	4,886,458.51
资产总计	39,609,911.81	-	226,412.30	261,935,560.89	301,771,885.00
负债					
应付赎回款	-	-	-	103,782.44	103,782.44
应付管理人报酬	-	-	-	383,526.59	383,526.59
应付托管费	-	-	-	63,921.13	63,921.13
应付清算款	-	-	-	243,597.95	243,597.95
应交税费	-	-	-	0.69	0.69
其他负债	-	-	-	730,208.87	730,208.87
负债总计	-	-	-	1,525,037.67	1,525,037.67
利率敏感度缺口	39,609,911.81	-	226,412.30	260,410,523.22	300,246,847.33

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 0.08%。因此当利率发生合理、可能的变动时，对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无。

##### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。

基金的投资组合比例为：股票（含存托凭证）资产占基金资产的比例为 0%-95%；每个交易日日终在扣除股指期货合约等金融工具所需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金，存出保证金，应收申购款等。如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

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

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	239,077,355.63	85.06	257,020,036.52	85.60
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	218,925.22	0.08	226,412.30	0.08
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	239,296,280.85	85.14	257,246,448.82	85.68

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%	9,657,799.35	11,954,328.23
	业绩比较基准下降5%	-9,657,799.35	-11,954,328.23

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	238,317,117.88
第二层次	379,498.75
第三层次	599,664.22
合计	239,296,280.85

**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	239,077,355.63	83.33
	其中：股票	239,077,355.63	83.33
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	218,925.22	0.08
	其中：债券	218,925.22	0.08
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	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	47,478,127.45	16.55
8	其他各项资产	123,512.16	0.04
9	合计	286,897,920.46	100.00

注：报告期末本基金投资的存托凭证公允价值为：1,031.80 元，占净值比 0.00%。本报告所指的“股票”均包含存托凭证。

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,619,424.98	0.58
B	采矿业	2,220,106.04	0.79
C	制造业	173,554,358.77	61.75
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,048,570.40	0.73
E	建筑业	2,444,884.31	0.87
F	批发和零售业	2,198,638.96	0.78
G	交通运输、仓储和邮政业	4,042,201.00	1.44
H	住宿和餐饮业	41,690.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	35,239,935.32	12.54
J	金融业	5,716,395.39	2.03
K	房地产业	4,494.00	0.00
L	租赁和商务服务业	2,351,578.21	0.84
M	科学研究和技术服务业	3,456,501.84	1.23
N	水利、环境和公共设施管理业	420,620.30	0.15
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	16,033.95	0.01
Q	卫生和社会工作	78,429.32	0.03
R	文化、体育和娱乐业	3,619,574.84	1.29
S	综合	3,918.00	0.00
	合计	239,077,355.63	85.06

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	603596	伯特利	191,300	15,162,438.00	5.39
2	002648	卫星化学	520,401	7,785,198.96	2.77
3	603997	继峰股份	382,400	5,468,320.00	1.95
4	600845	宝信软件	90,000	4,572,900.00	1.63
5	301039	中集车辆	323,040	4,273,819.20	1.52
6	300760	迈瑞医疗	14,200	4,257,160.00	1.51
7	002371	北方华创	13,000	4,129,450.00	1.47
8	601633	长城汽车	154,600	3,891,282.00	1.38
9	600276	恒瑞医药	80,500	3,855,950.00	1.37

10	688279	峰岹科技	29,117	3,843,444.00	1.37
11	601006	大秦铁路	460,700	3,423,001.00	1.22
12	002459	晶澳科技	78,084	3,256,102.80	1.16
13	603501	韦尔股份	32,000	3,137,280.00	1.12
14	688575	亚辉龙	160,034	2,952,627.30	1.05
15	002430	杭氧股份	81,200	2,790,032.00	0.99
16	688235	百济神州-U	25,133	2,742,261.63	0.98
17	000063	中兴通讯	60,200	2,741,508.00	0.98
18	688008	澜起科技	47,159	2,707,869.78	0.96
19	600519	贵州茅台	1,564	2,644,724.00	0.94
20	688533	上声电子	55,091	2,574,402.43	0.92
21	002709	天赐材料	59,900	2,467,281.00	0.88
22	688800	瑞可达	38,853	2,414,713.95	0.86
23	000651	格力电器	66,100	2,413,311.00	0.86
24	002920	德赛西威	15,400	2,399,474.00	0.85
25	300661	圣邦股份	25,870	2,124,703.10	0.76
26	601636	旗滨集团	245,500	2,116,210.00	0.75
27	001322	箭牌家居	122,400	2,048,976.00	0.73
28	600941	中国移动	21,800	2,033,940.00	0.72
29	688227	品高股份	81,836	2,031,987.88	0.72
30	688581	安杰思	16,352	2,002,671.04	0.71
31	601899	紫金矿业	171,700	1,952,229.00	0.69
32	300724	捷佳伟创	15,900	1,786,365.00	0.64
33	300858	科拓生物	107,298	1,735,008.66	0.62
34	000503	国新健康	144,500	1,732,555.00	0.62
35	002756	永兴材料	27,300	1,709,253.00	0.61
36	688111	金山办公	3,614	1,706,603.08	0.61
37	688017	绿的谐波	10,423	1,692,695.20	0.60
38	688325	赛微微电	42,662	1,665,951.10	0.59
39	688120	华海清科	6,512	1,641,349.60	0.58
40	688192	迪哲医药-U	47,165	1,636,625.50	0.58
41	601318	中国平安	35,100	1,628,640.00	0.58
42	600859	王府井	82,100	1,624,759.00	0.58
43	603208	江山欧派	44,210	1,610,128.20	0.57
44	600809	山西汾酒	8,400	1,554,588.00	0.55
45	002185	华天科技	165,400	1,521,680.00	0.54
46	300458	全志科技	55,500	1,512,375.00	0.54
47	688489	三未信安	23,769	1,503,389.25	0.53
48	001323	慕思股份	44,173	1,500,115.08	0.53
49	300946	恒而达	39,220	1,491,144.40	0.53
50	002850	科达利	11,200	1,481,200.00	0.53
51	688085	三友医疗	56,125	1,473,842.50	0.52
52	688066	航天宏图	23,990	1,460,991.00	0.52

53	600660	福耀玻璃	40,400	1,448,340.00	0.52
54	688590	新致软件	63,270	1,438,127.10	0.51
55	300168	万达信息	126,500	1,433,245.00	0.51
56	002555	三七互娱	40,500	1,412,640.00	0.50
57	600309	万华化学	15,400	1,352,736.00	0.48
58	600584	长电科技	43,200	1,346,544.00	0.48
59	300498	温氏股份	73,000	1,339,550.00	0.48
60	000032	深桑达 A	40,500	1,332,450.00	0.47
61	000425	徐工机械	195,300	1,322,181.00	0.47
62	600373	中文传媒	98,500	1,312,020.00	0.47
63	688338	赛科希德	23,516	1,303,962.20	0.46
64	688029	南微医学	15,861	1,293,623.16	0.46
65	601838	成都银行	105,800	1,291,818.00	0.46
66	001380	华纬科技	38,100	1,241,679.00	0.44
67	002236	大华股份	62,700	1,238,325.00	0.44
68	002351	漫步者	58,900	1,218,052.00	0.43
69	603496	恒为科技	62,500	1,173,750.00	0.42
70	688006	杭可科技	37,892	1,154,569.24	0.41
71	000719	中原传媒	97,600	1,141,920.00	0.41
72	300229	拓尔思	41,900	1,088,143.00	0.39
73	688326	经纬恒润-W	7,523	1,086,245.97	0.39
74	688458	美芯晟	11,285	1,084,786.14	0.39
75	603259	药明康德	16,900	1,053,039.00	0.37
76	300007	汉威科技	46,500	983,475.00	0.35
77	601988	中国银行	251,200	982,192.00	0.35
78	300457	赢合科技	54,700	966,002.00	0.34
79	601801	皖新传媒	102,800	965,292.00	0.34
80	000951	中国重汽	55,500	935,175.00	0.33
81	301121	紫建电子	18,200	921,648.00	0.33
82	000625	长安汽车	70,700	914,151.00	0.33
83	603728	鸣志电器	11,200	899,360.00	0.32
84	688630	芯碁微装	10,568	887,923.36	0.32
85	688387	信科移动-U	106,324	887,805.40	0.32
86	002602	世纪华通	116,400	883,476.00	0.31
87	601916	浙商银行	322,010	850,106.40	0.30
88	600141	兴发集团	37,900	842,138.00	0.30
89	688300	联瑞新材	17,930	838,227.50	0.30
90	301310	鑫宏业	12,100	833,448.00	0.30
91	002368	太极股份	19,900	819,283.00	0.29
92	300662	科锐国际	23,100	817,047.00	0.29
93	300634	彩讯股份	30,900	815,760.00	0.29
94	002463	沪电股份	38,800	812,472.00	0.29
95	600301	华锡有色	44,600	800,570.00	0.28



96	688036	传音控股	5,394	792,918.00	0.28
97	688579	山大地纬	48,058	791,995.84	0.28
98	300750	宁德时代	3,420	782,461.80	0.28
99	601668	中国建筑	136,000	780,640.00	0.28
100	000690	宝新能源	107,100	751,842.00	0.27
101	600138	中青旅	58,100	726,831.00	0.26
102	001270	铖昌科技	8,200	715,860.00	0.25
103	688315	诺禾致源	26,617	706,681.35	0.25
104	688322	奥比中光-UW	16,135	673,152.20	0.24
105	601965	中国汽研	31,500	650,475.00	0.23
106	688536	思瑞浦	2,983	650,294.00	0.23
107	688631	莱斯信息	18,498	601,891.38	0.21
108	688316	青云科技-U	11,946	593,118.90	0.21
109	603000	人民网	20,200	589,840.00	0.21
110	002908	德生科技	37,380	578,268.60	0.21
111	688439	振华风光	5,196	570,624.72	0.20
112	300693	盛弘股份	15,417	569,195.64	0.20
113	002517	恺英网络	35,800	563,492.00	0.20
114	002079	苏州固锴	38,300	559,180.00	0.20
115	000875	吉电股份	102,100	550,319.00	0.20
116	300033	同花顺	3,100	543,368.00	0.19
117	603730	岱美股份	34,200	540,360.00	0.19
118	300118	东方日升	21,000	538,230.00	0.19
119	688131	皓元医药	9,430	537,321.40	0.19
120	601888	中国中免	4,800	530,544.00	0.19
121	002597	金禾实业	21,900	516,840.00	0.18
122	000977	浪潮信息	10,300	499,550.00	0.18
123	688601	力芯微	10,011	471,518.10	0.17
124	601360	三六零	37,400	468,996.00	0.17
125	603885	吉祥航空	30,100	464,443.00	0.17
126	601689	拓普集团	5,600	451,920.00	0.16
127	600132	重庆啤酒	4,600	423,936.00	0.15
128	688037	芯源微	2,374	405,835.30	0.14
129	002415	海康威视	12,200	403,942.00	0.14
130	300782	卓胜微	4,080	394,250.40	0.14
131	001286	陕西能源	37,667	391,397.47	0.14
132	688525	佰维存储	4,614	368,612.46	0.13
133	688052	纳芯微	2,188	346,513.56	0.12
134	688498	源杰科技	1,181	336,585.00	0.12
135	301191	菲菱科思	2,990	309,225.80	0.11
136	300014	亿纬锂能	4,900	296,450.00	0.11
137	300308	中际旭创	2,000	294,900.00	0.10
138	300315	掌趣科技	37,800	294,840.00	0.10

139	301185	鸥玛软件	8,400	277,368.00	0.10
140	688249	晶合集成	14,684	275,897.19	0.10
141	600760	中航沈飞	6,100	274,500.00	0.10
142	002230	科大讯飞	3,800	258,248.00	0.09
143	603598	引力传媒	24,500	256,270.00	0.09
144	688981	中芯国际	4,919	248,507.88	0.09
145	301028	东亚机械	21,519	239,936.85	0.09
146	301368	丰立智能	3,368	233,031.92	0.08
147	002049	紫光国微	2,400	223,800.00	0.08
148	688502	茂莱光学	1,132	217,344.00	0.08
149	688172	燕东微	8,999	213,996.22	0.08
150	688256	寒武纪-U	1,119	210,372.00	0.07
151	688361	中科飞测-U	2,591	210,310.51	0.07
152	688248	南网科技	5,348	205,309.72	0.07
153	688147	微导纳米	3,818	201,514.04	0.07
154	688435	英方软件	2,596	197,399.84	0.07
155	300972	万辰生物	4,300	190,662.00	0.07
156	688362	甬矽电子	5,640	187,755.60	0.07
157	688496	清越科技	9,440	187,667.20	0.07
158	688503	聚和材料	1,897	184,957.50	0.07
159	688472	阿特斯	9,877	180,037.56	0.06
160	301317	鑫磊股份	6,509	175,085.51	0.06
161	301030	仕净科技	2,417	167,014.70	0.06
162	300415	伊之密	8,300	159,360.00	0.06
163	301320	豪江智能	6,416	155,624.88	0.06
164	688486	龙迅股份	1,406	154,730.30	0.06
165	688469	中芯集成-U	26,770	151,089.88	0.05
166	301419	阿莱德	3,292	150,811.36	0.05
167	688539	高华科技	3,147	146,020.80	0.05
168	301361	众智科技	5,169	145,714.11	0.05
169	688478	晶升股份	3,049	143,290.29	0.05
170	301358	湖南裕能	3,243	142,360.43	0.05
171	688629	华丰科技	6,230	141,776.11	0.05
172	601618	中国中冶	33,700	133,789.00	0.05
173	688292	浩瀚深度	4,503	129,236.10	0.05
174	301377	鼎泰高科	5,483	126,109.00	0.04
175	688141	杰华特	3,182	124,416.20	0.04
176	688376	美埃科技	3,139	123,959.11	0.04
177	688562	航天软件	4,584	123,471.54	0.04
178	300529	健帆生物	5,300	122,854.00	0.04
179	688416	恒烁股份	1,519	119,241.50	0.04
180	688531	日联科技	808	118,980.34	0.04
181	301303	真兰仪表	5,128	116,949.06	0.04

182	301277	新天地	5,798	113,118.98	0.04
183	301399	英特科技	1,923	112,888.01	0.04
184	688443	智翔金泰-U	3,552	109,286.80	0.04
185	605499	东鹏饮料	632	109,272.80	0.04
186	301408	华人健康	6,241	108,087.51	0.04
187	688146	中船特气	2,585	108,032.87	0.04
188	301360	荣旗科技	1,038	107,027.92	0.04
189	688593	新相微	6,324	106,608.48	0.04
190	603348	文灿股份	2,351	102,997.31	0.04
191	688041	海光信息	1,503	102,609.81	0.04
192	301141	中科磁业	2,214	101,308.38	0.04
193	688352	颀中科技	7,401	98,481.67	0.04
194	688072	拓荆科技	231	98,399.07	0.04
195	001287	中电港	3,603	97,650.98	0.03
196	688121	卓然股份	2,597	97,127.80	0.03
197	301398	星源卓镁	2,549	95,587.50	0.03
198	301382	蜂助手	2,480	94,388.80	0.03
199	688582	芯动联科	1,977	91,400.79	0.03
200	688523	航天环宇	3,424	91,028.64	0.03
201	301315	威士顿	1,543	90,967.64	0.03
202	688522	纳睿雷达	1,686	90,234.72	0.03
203	600536	中国软件	1,900	89,072.00	0.03
204	301045	天禄科技	3,350	88,708.00	0.03
205	301486	致尚科技	1,533	88,392.78	0.03
206	688143	长盈通	2,340	88,218.00	0.03
207	688619	罗普特	5,856	88,015.68	0.03
208	688334	西高院	4,861	86,451.31	0.03
209	600436	片仔癀	300	85,908.00	0.03
210	688062	迈威生物-U	3,978	85,646.34	0.03
211	301290	东星医疗	2,588	82,945.40	0.03
212	301291	明阳电气	2,543	82,501.45	0.03
213	688543	国科军工	1,467	81,916.35	0.03
214	301295	美硕科技	2,146	81,770.28	0.03
215	601138	工业富联	3,200	80,640.00	0.03
216	688307	中润光学	2,455	80,253.95	0.03
217	300922	天秦装备	4,008	80,119.92	0.03
218	301428	世纪恒通	2,260	79,326.00	0.03
219	301373	凌玮科技	2,453	79,319.83	0.03
220	003035	南网能源	11,046	78,647.52	0.03
221	301292	海科新源	3,843	76,821.57	0.03
222	300952	恒辉安防	3,398	76,658.88	0.03
223	688385	复旦微电	1,525	76,402.50	0.03
224	688687	凯因科技	2,575	75,962.50	0.03

225	688617	惠泰医疗	202	75,497.50	0.03
226	601658	邮储银行	15,200	74,328.00	0.03
227	300987	川网传媒	3,905	73,843.55	0.03
228	688403	汇成股份	6,011	73,454.42	0.03
229	688433	华曙高科	2,175	73,405.00	0.03
230	688570	天玛智控	2,766	73,323.37	0.03
231	601139	深圳燃气	10,000	72,900.00	0.03
232	688212	澳华内镜	1,073	72,856.70	0.03
233	601601	中国太保	2,800	72,744.00	0.03
234	301026	浩通科技	2,027	72,404.44	0.03
235	301357	北方长龙	1,393	72,030.84	0.03
236	688088	虹软科技	1,684	71,991.00	0.03
237	301157	华塑科技	1,289	71,834.37	0.03
238	300889	爱克股份	4,786	71,646.42	0.03
239	301332	德尔玛	4,978	70,856.74	0.03
240	601061	中信金属	8,168	70,734.64	0.03
241	301355	南王科技	3,992	70,637.60	0.03
242	688219	会通股份	7,336	70,058.80	0.02
243	603486	科沃斯	900	69,993.00	0.02
244	603901	永创智能	4,800	69,888.00	0.02
245	300950	德固特	3,279	69,514.80	0.02
246	301283	聚胶股份	1,959	69,505.32	0.02
247	002833	弘亚数控	3,500	68,810.00	0.02
248	600489	中金黄金	6,600	68,178.00	0.02
249	301386	未来电器	2,712	67,910.08	0.02
250	603380	易德龙	3,000	67,860.00	0.02
251	688777	中控技术	1,080	67,802.40	0.02
252	301322	绿通科技	1,212	67,698.78	0.02
253	301182	凯旺科技	2,932	67,348.04	0.02
254	688071	华依科技	1,101	67,326.15	0.02
255	688571	杭华股份	10,660	67,264.60	0.02
256	301323	新莱福	1,537	65,876.19	0.02
257	301276	嘉曼服饰	2,572	65,586.00	0.02
258	688420	美腾科技	1,685	65,260.05	0.02
259	600459	贵研铂业	4,258	65,147.40	0.02
260	301265	华新环保	5,596	65,025.52	0.02
261	688391	钜泉科技	945	64,883.70	0.02
262	688429	时创能源	2,265	64,795.41	0.02
263	300943	春晖智控	3,813	64,668.48	0.02
264	688516	奥特维	343	64,621.20	0.02
265	301439	泓淋电力	3,636	64,524.08	0.02
266	688639	华恒生物	713	64,512.24	0.02
267	300971	博亚精工	2,445	64,181.25	0.02

268	688557	兰剑智能	1,812	63,927.36	0.02
269	688517	金冠电气	2,892	63,508.32	0.02
270	301281	科源制药	2,419	63,503.46	0.02
271	688669	聚石化学	3,485	63,183.05	0.02
272	603029	天鹅股份	3,000	62,850.00	0.02
273	301262	海看股份	2,259	62,178.75	0.02
274	301337	亚华电子	1,825	62,042.51	0.02
275	688096	京源环保	6,279	61,785.36	0.02
276	600297	广汇汽车	29,300	60,944.00	0.02
277	300998	宁波方正	2,003	60,069.97	0.02
278	688603	天承科技	1,078	59,290.00	0.02
279	688191	智洋创新	3,203	59,159.41	0.02
280	601963	重庆银行	7,472	59,103.52	0.02
281	600977	中国电影	4,200	59,010.00	0.02
282	688226	威腾电气	2,693	58,761.26	0.02
283	301117	佳缘科技	900	58,158.00	0.02
284	301488	豪恩汽电	1,458	57,999.24	0.02
285	688595	芯海科技	1,806	57,755.88	0.02
286	688285	高铁电气	5,722	57,220.00	0.02
287	601702	华峰铝业	4,166	56,990.88	0.02
288	688314	康拓医疗	1,519	56,871.36	0.02
289	301098	金埔园林	4,603	55,466.15	0.02
290	301062	上海艾录	5,225	55,332.75	0.02
291	600925	苏能股份	8,960	55,283.20	0.02
292	688685	迈信林	2,612	55,269.92	0.02
293	300883	龙利得	8,911	55,159.09	0.02
294	301016	雷尔伟	2,747	55,104.82	0.02
295	688260	昀冢科技	2,990	54,956.20	0.02
296	688485	九州一轨	3,580	54,917.20	0.02
297	688308	欧科亿	1,372	54,880.00	0.02
298	603135	中重科技	2,718	54,764.48	0.02
299	603722	阿科力	1,100	54,758.00	0.02
300	600906	财达证券	7,597	54,698.40	0.02
301	600761	安徽合力	2,700	53,811.00	0.02
302	301002	崧盛股份	2,601	53,684.64	0.02
303	688479	友车科技	1,714	53,599.02	0.02
304	301376	致欧科技	2,271	53,551.38	0.02
305	300975	商络电子	7,375	52,731.25	0.02
306	688508	芯朋微	909	52,712.91	0.02
307	300931	通用电梯	6,713	52,697.05	0.02
308	688232	新点软件	968	52,088.08	0.02
309	601728	中国电信	9,211	51,857.93	0.02
310	688616	西力科技	3,918	51,835.14	0.02

311	688789	宏华数科	586	51,761.38	0.02
312	600021	上海电力	4,800	51,696.00	0.02
313	300774	倍杰特	4,435	51,623.40	0.02
314	688216	气派科技	2,000	51,540.00	0.02
315	002234	民和股份	2,800	50,988.00	0.02
316	688511	天微电子	1,490	50,809.00	0.02
317	688655	迅捷兴	3,083	50,684.52	0.02
318	688656	浩欧博	1,371	50,260.86	0.02
319	301309	万得凯	1,806	49,737.24	0.02
320	688139	海尔生物	961	49,462.67	0.02
321	301040	中环海陆	2,401	49,340.55	0.02
322	301025	读客文化	4,027	49,209.94	0.02
323	603032	德新科技	1,420	49,046.80	0.02
324	301261	恒工精密	1,325	48,892.50	0.02
325	301345	涛涛车业	1,027	48,887.96	0.02
326	300948	冠中生态	3,229	48,790.19	0.02
327	300960	通业科技	2,332	48,575.56	0.02
328	688215	瑞晟智能	1,229	48,471.76	0.02
329	301068	大地海洋	1,436	48,263.96	0.02
330	301202	朗威股份	1,863	48,102.66	0.02
331	301162	国能日新	603	47,564.64	0.02
332	301033	迈普医学	1,076	47,300.96	0.02
333	603379	三美股份	2,000	47,020.00	0.02
334	688012	中微公司	299	46,778.55	0.02
335	301007	德迈仕	3,022	46,629.46	0.02
336	301032	新柴股份	5,124	45,859.80	0.02
337	688679	通源环境	3,139	45,735.23	0.02
338	688596	正帆科技	1,039	44,988.70	0.02
339	605289	罗曼股份	1,174	44,975.94	0.02
340	688190	云路股份	612	44,676.00	0.02
341	300886	华业香料	1,903	44,206.69	0.02
342	688107	安路科技	798	44,201.22	0.02
343	600418	江淮汽车	3,500	44,065.00	0.02
344	002984	森麒麟	1,386	43,603.56	0.02
345	301153	中科江南	581	43,551.76	0.02
346	688305	科德数控	434	43,512.84	0.02
347	688350	富淼科技	2,552	43,358.48	0.02
348	688395	正弦电气	1,627	43,261.93	0.02
349	301049	超越科技	1,954	43,183.40	0.02
350	688025	杰普特	490	42,801.50	0.02
351	688622	禾信仪器	1,204	42,742.00	0.02
352	300961	深水海纳	3,936	42,390.72	0.02
353	001203	大中矿业	3,809	42,317.99	0.02

354	688217	睿昂基因	1,040	41,756.00	0.01
355	600258	首旅酒店	2,200	41,690.00	0.01
356	000822	山东海化	6,100	41,541.00	0.01
357	002179	中航光电	910	41,268.50	0.01
358	603378	亚士创能	4,500	40,995.00	0.01
359	688323	瑞华泰	1,694	40,554.36	0.01
360	688585	上纬新材	4,922	40,508.06	0.01
361	300992	泰福泵业	1,998	40,199.76	0.01
362	603297	永新光学	500	39,950.00	0.01
363	600916	中国黄金	3,371	39,811.51	0.01
364	688331	荣昌生物	714	39,805.50	0.01
365	301053	远信工业	1,544	39,171.28	0.01
366	300995	奇德新材	1,909	38,943.60	0.01
367	688296	和达科技	2,173	38,788.05	0.01
368	603565	中谷物流	3,559	38,437.20	0.01
369	301036	双乐股份	2,047	38,340.31	0.01
370	600032	浙江新能	3,045	38,245.20	0.01
371	605589	圣泉集团	1,750	38,045.00	0.01
372	601377	兴业证券	6,200	37,944.00	0.01
373	301037	保立佳	2,115	37,689.30	0.01
374	003009	中天火箭	623	37,535.75	0.01
375	601568	北元集团	7,095	37,390.65	0.01
376	603281	江瀚新材	1,208	37,303.04	0.01
377	603035	常熟汽饰	1,900	36,917.00	0.01
378	301239	普瑞眼科	374	36,681.92	0.01
379	688110	东芯股份	1,011	36,497.10	0.01
380	601065	江盐集团	2,668	35,406.71	0.01
381	301027	华蓝集团	2,856	35,100.24	0.01
382	601133	柏诚股份	2,358	34,532.38	0.01
383	688032	禾迈股份	97	34,449.55	0.01
384	688680	海优新材	282	34,353.24	0.01
385	688092	爱科科技	1,137	33,962.19	0.01
386	300929	华骐环保	2,923	33,117.59	0.01
387	001330	博纳影业	3,564	33,073.92	0.01
388	600955	维远股份	1,694	32,914.42	0.01
389	600988	赤峰黄金	2,400	32,304.00	0.01
390	300854	中兰环保	2,026	32,213.40	0.01
391	688518	联赢激光	1,148	31,983.28	0.01
392	603040	新坐标	1,200	31,908.00	0.01
393	002993	奥海科技	936	31,749.12	0.01
394	001328	登康口腔	986	31,608.24	0.01
395	001282	三联锻造	882	31,249.77	0.01
396	603179	新泉股份	710	31,161.90	0.01

397	605020	永和股份	1,190	30,713.90	0.01
398	688681	科汇股份	1,899	30,687.84	0.01
399	688205	德科立	416	30,417.92	0.01
400	001338	永顺泰	1,649	30,407.56	0.01
401	001258	立新能源	3,188	30,254.12	0.01
402	600927	永安期货	1,859	30,227.34	0.01
403	301029	怡合达	665	29,712.20	0.01
404	688608	恒玄科技	237	28,684.11	0.01
405	601089	福元医药	1,749	28,508.70	0.01
406	688067	爱威科技	1,259	27,698.00	0.01
407	301120	新特电气	1,816	27,639.52	0.01
408	603324	盛剑环境	732	27,596.40	0.01
409	603363	傲农生物	3,000	27,510.00	0.01
410	601921	浙版传媒	3,154	27,408.26	0.01
411	605366	宏柏新材	2,890	27,194.90	0.01
412	601156	东航物流	2,090	27,170.00	0.01
413	603071	物产环能	1,627	26,991.93	0.01
414	603137	恒尚节能	1,382	26,502.14	0.01
415	601665	齐鲁银行	6,731	26,385.52	0.01
416	605337	李子园	1,434	26,213.52	0.01
417	601187	厦门银行	5,129	25,747.58	0.01
418	603931	格林达	844	25,699.80	0.01
419	001213	中铁特货	5,818	25,657.38	0.01
420	605507	国邦医药	1,202	25,566.54	0.01
421	605338	巴比食品	1,012	25,553.00	0.01
422	603171	税友股份	637	25,467.26	0.01
423	603155	新亚强	996	25,457.76	0.01
424	603507	振江股份	700	25,382.00	0.01
425	688707	振华新材	809	24,909.11	0.01
426	301050	雷电微力	383	24,868.19	0.01
427	301286	侨源股份	839	24,750.50	0.01
428	600446	金证股份	1,700	24,718.00	0.01
429	688049	炬芯科技	669	24,619.20	0.01
430	001337	四川黄金	795	24,557.55	0.01
431	300857	协创数据	934	24,545.52	0.01
432	603125	常青科技	872	24,463.44	0.01
433	605399	晨光新材	1,369	24,368.20	0.01
434	605060	联德股份	883	24,247.18	0.01
435	301325	曼恩斯特	218	24,096.40	0.01
436	001339	智微智能	812	24,092.04	0.01
437	301269	华大九天	195	23,953.80	0.01
438	605167	利柏特	2,471	23,919.28	0.01
439	301267	华夏眼科	392	23,892.40	0.01



440	601991	大唐发电	7,200	23,832.00	0.01
441	001308	康冠科技	867	23,807.82	0.01
442	001324	长青科技	1,131	23,764.29	0.01
443	603211	晋拓股份	1,287	23,655.06	0.01
444	003029	吉大正元	716	23,234.20	0.01
445	301095	广立微	278	22,976.70	0.01
446	605077	华康股份	865	22,905.20	0.01
447	301297	富乐德	1,015	22,847.65	0.01
448	301101	明月镜片	556	22,812.68	0.01
449	001227	兰州银行	7,868	22,502.48	0.01
450	300853	申昊科技	641	22,499.10	0.01
451	301311	昆船智能	761	22,434.28	0.01
452	603191	望变电气	1,149	22,348.05	0.01
453	002997	瑞鹄模具	751	22,327.23	0.01
454	301175	中科环保	3,562	22,191.26	0.01
455	301268	铭利达	530	22,191.10	0.01
456	001367	海森药业	483	21,716.24	0.01
457	605016	百龙创园	872	21,590.72	0.01
458	301301	川宁生物	2,395	21,459.20	0.01
459	301327	华宝新能	270	21,359.70	0.01
460	301238	瑞泰新材	1,043	21,214.62	0.01
461	688169	石头科技	66	21,164.88	0.01
462	603172	万丰股份	1,220	21,138.94	0.01
463	603206	嘉环科技	1,210	20,872.50	0.01
464	605089	味知香	511	20,082.30	0.01
465	688031	星环科技-U	150	19,986.00	0.01
466	003040	楚天龙	1,101	19,972.14	0.01
467	601121	宝地矿业	2,532	19,344.48	0.01
468	301058	中粮科工	1,386	19,334.70	0.01
469	001201	东瑞股份	802	19,320.18	0.01
470	605377	华旺科技	1,050	18,952.50	0.01
471	003012	东鹏控股	2,278	18,429.02	0.01
472	300623	捷捷微电	1,000	18,120.00	0.01
473	003028	振邦智能	432	18,061.92	0.01
474	688213	思特威-W	353	18,052.42	0.01
475	301293	三博脑科	250	17,855.00	0.01
476	301112	信邦智能	484	17,719.24	0.01
477	605305	中际联合	508	17,708.88	0.01
478	603209	兴通股份	833	17,667.93	0.01
479	003039	顺控发展	1,024	17,367.04	0.01
480	603173	福斯达	588	17,316.60	0.01
481	605286	同力日升	597	17,265.24	0.01
482	002979	雷赛智能	725	17,226.00	0.01

483	605339	南侨食品	864	17,202.24	0.01
484	003016	欣贺股份	1,681	16,978.10	0.01
485	605158	华达新材	2,226	16,917.60	0.01
486	605268	王力安防	1,642	16,797.66	0.01
487	001208	华菱线缆	1,754	16,627.92	0.01
488	688095	福昕软件	130	16,429.40	0.01
489	601686	友发集团	2,374	16,238.16	0.01
490	300882	万胜智能	572	16,233.36	0.01
491	605116	奥锐特	642	16,229.76	0.01
492	605368	蓝天燃气	1,685	16,125.45	0.01
493	605098	行动教育	405	16,033.95	0.01
494	605296	神农集团	740	15,850.80	0.01
495	301328	维峰电子	278	15,829.32	0.01
496	603282	亚光股份	457	15,771.07	0.01
497	605080	浙江自然	524	15,709.52	0.01
498	003037	三和管桩	1,274	15,670.20	0.01
499	605388	均瑶健康	1,230	15,633.30	0.01
500	605277	新亚电子	966	15,610.56	0.01
501	003019	宸展光电	760	15,580.00	0.01
502	001216	华瓷股份	1,177	15,489.32	0.01
503	001318	阳光乳业	1,142	15,451.26	0.01
504	603132	金徽股份	1,342	15,218.28	0.01
505	000988	华工科技	400	15,204.00	0.01
506	603759	海天股份	1,656	15,168.96	0.01
507	301302	华如科技	412	15,161.60	0.01
508	605008	长鸿高科	1,039	14,816.14	0.01
509	605162	新中港	1,377	14,802.75	0.01
510	605050	福然德	1,197	14,782.95	0.01
511	603230	内蒙新华	1,140	14,706.00	0.01
512	301160	翔楼新材	418	14,692.70	0.01
513	300918	南山智尚	1,063	14,594.99	0.01
514	301338	凯格精机	375	14,587.50	0.01
515	003002	壶化股份	921	14,570.22	0.01
516	605006	山东玻纤	1,942	14,565.00	0.01
517	301217	铜冠铜箔	1,023	14,557.29	0.01
518	001217	华尔泰	1,239	14,421.96	0.01
519	603190	亚通精工	470	14,382.00	0.01
520	605389	长龄液压	498	14,377.26	0.01
521	688320	禾川科技	297	14,321.34	0.01
522	002472	双环传动	389	14,120.70	0.01
523	301207	华兰疫苗	424	14,102.24	0.01
524	601528	瑞丰银行	2,899	14,060.15	0.01
525	605099	共创草坪	624	13,933.92	0.00

526	603237	五芳斋	455	13,800.15	0.00
527	603057	紫燕食品	549	13,796.37	0.00
528	301152	天力锂能	307	13,710.62	0.00
529	301127	天源环保	1,385	13,586.85	0.00
530	301187	欧圣电气	732	13,520.04	0.00
531	605183	确成股份	741	13,412.10	0.00
532	605169	洪通燃气	1,292	13,268.84	0.00
533	605028	世茂能源	615	13,222.50	0.00
534	605056	咸亨国际	933	13,220.61	0.00
535	003013	地铁设计	724	13,213.00	0.00
536	301367	怡和嘉业	89	13,202.26	0.00
537	603162	海通发展	774	13,196.70	0.00
538	301132	满坤科技	449	13,196.11	0.00
539	603097	江苏华辰	577	13,074.82	0.00
540	301135	瑞德智能	476	13,051.92	0.00
541	605218	伟时电子	837	12,973.50	0.00
542	605599	菜百股份	980	12,945.80	0.00
543	688290	景业智能	193	12,875.03	0.00
544	301199	迈赫股份	398	12,672.32	0.00
545	002999	天禾股份	1,726	12,634.32	0.00
546	301179	泽宇智能	374	12,603.80	0.00
547	605300	佳禾食品	576	12,522.24	0.00
548	688535	华海诚科	229	12,404.87	0.00
549	605580	恒盛能源	916	12,356.84	0.00
550	002918	蒙娜丽莎	800	12,352.00	0.00
551	603176	汇通集团	1,924	12,313.60	0.00
552	605058	澳弘电子	548	12,302.60	0.00
553	605088	冠盛股份	716	12,279.40	0.00
554	301222	浙江恒威	415	12,221.75	0.00
555	605319	无锡振华	764	12,124.68	0.00
556	605100	华丰股份	685	12,076.55	0.00
557	605066	天正电气	1,278	12,025.98	0.00
558	003010	若羽臣	562	11,948.12	0.00
559	605500	森林包装	1,579	11,779.34	0.00
560	605228	神通科技	1,217	11,646.69	0.00
561	688271	联影医疗	84	11,592.84	0.00
562	003030	祖名股份	480	11,587.20	0.00
563	605118	力鼎光电	667	11,585.79	0.00
564	001229	魅视科技	347	11,555.10	0.00
565	301270	汉仪股份	210	11,468.10	0.00
566	605259	绿田机械	295	11,451.90	0.00
567	001207	联科科技	682	11,403.04	0.00
568	301296	新巨丰	673	11,360.24	0.00

569	003042	中农联合	546	11,313.12	0.00
570	603836	海程邦达	733	11,266.21	0.00
571	001278	一彬科技	473	11,247.94	0.00
572	688378	奥来德	225	11,115.00	0.00
573	601279	英利汽车	2,004	11,102.16	0.00
574	001317	三羊马	300	11,070.00	0.00
575	605378	野马电池	473	11,025.63	0.00
576	605199	葫芦娃	726	10,991.64	0.00
577	603130	云中马	480	10,900.80	0.00
578	301171	易点天下	493	10,895.30	0.00
579	603112	华翔股份	920	10,819.20	0.00
580	605177	东亚药业	439	10,816.96	0.00
581	688301	奕瑞科技	38	10,732.34	0.00
582	300394	天孚通信	100	10,683.00	0.00
583	003015	日久光电	1,128	10,682.16	0.00
584	603219	富佳股份	739	10,530.75	0.00
585	301298	东利机械	640	10,515.20	0.00
586	003036	泰坦股份	776	10,460.48	0.00
587	301313	凡拓数创	247	10,455.51	0.00
588	301138	华研精机	285	10,368.30	0.00
589	603215	比依股份	575	10,315.50	0.00
590	001269	欧晶科技	140	10,294.20	0.00
591	002996	顺博合金	849	10,272.90	0.00
592	301318	维海德	306	10,266.30	0.00
593	301116	益客食品	664	10,225.60	0.00
594	605179	一鸣食品	939	10,216.32	0.00
595	301200	大族数控	255	10,169.40	0.00
596	001288	运机集团	537	10,149.30	0.00
597	300073	当升科技	200	10,066.00	0.00
598	001266	宏英智能	346	10,051.30	0.00
599	301206	三元生物	287	10,042.13	0.00
600	605005	合兴股份	634	10,036.22	0.00
601	605566	福莱蒾特	435	10,005.00	0.00
602	605136	丽人丽妆	867	9,996.51	0.00
603	001366	播恩集团	645	9,945.90	0.00
604	003018	金富科技	1,027	9,931.09	0.00
605	301282	金禄电子	330	9,919.80	0.00
606	001331	胜通能源	539	9,847.53	0.00
607	001313	粤海饲料	1,232	9,732.80	0.00
608	301300	远翔新材	307	9,701.20	0.00
609	605365	立达信	645	9,662.10	0.00
610	300496	中科创达	100	9,635.00	0.00
611	002400	省广集团	2,000	9,620.00	0.00

612	002998	优彩资源	1,353	9,606.30	0.00
613	301151	冠龙节能	542	9,577.14	0.00
614	603213	镇洋发展	799	9,532.07	0.00
615	605488	福莱新材	603	9,461.07	0.00
616	301197	工大科雅	391	9,423.10	0.00
617	001299	美能能源	576	9,394.56	0.00
618	301285	鸿日达	643	9,317.07	0.00
619	001206	依依股份	629	9,309.20	0.00
620	002605	姚记科技	200	9,286.00	0.00
621	301231	荣信文化	275	9,251.00	0.00
622	605086	龙高股份	443	9,205.54	0.00
623	001230	劲旅环境	375	9,191.25	0.00
624	001222	源飞宠物	607	9,183.91	0.00
625	003001	中岩大地	560	9,172.80	0.00
626	605007	五洲特纸	598	9,065.68	0.00
627	603280	南方路机	363	8,922.54	0.00
628	001368	通达创智	351	8,922.42	0.00
629	301288	清研环境	516	8,906.16	0.00
630	300957	贝泰妮	100	8,888.00	0.00
631	605018	长华集团	840	8,878.80	0.00
632	003004	声迅股份	306	8,834.22	0.00
633	001238	浙江正特	374	8,800.22	0.00
634	300866	安克创新	100	8,750.00	0.00
635	301163	宏德股份	277	8,739.35	0.00
636	605318	法狮龙	628	8,704.08	0.00
637	603065	宿迁联盛	581	8,656.90	0.00
638	003000	劲仔食品	684	8,611.56	0.00
639	001296	长江材料	403	8,467.03	0.00
640	301259	艾布鲁	628	8,446.60	0.00
641	688035	德邦科技	142	8,446.16	0.00
642	001219	青岛食品	460	8,390.40	0.00
643	001210	金房能源	373	8,377.58	0.00
644	605255	天普股份	530	8,374.00	0.00
645	301359	东南电子	328	8,357.44	0.00
646	605196	华通线缆	1,172	8,344.64	0.00
647	301193	家联科技	475	8,326.75	0.00
648	605287	德才股份	349	8,271.30	0.00
649	603182	嘉华股份	546	8,255.52	0.00
650	301316	慧博云通	359	8,203.15	0.00
651	603291	联合水务	536	8,152.56	0.00
652	301228	实朴检测	521	8,117.18	0.00
653	605298	必得科技	508	8,107.68	0.00
654	605567	春雪食品	629	8,070.07	0.00

655	605180	华生科技	649	8,028.13	0.00
656	688400	凌云光	263	8,016.24	0.00
657	301161	唯万密封	346	7,996.06	0.00
658	003041	真爱美家	503	7,977.58	0.00
659	688375	国博电子	100	7,920.00	0.00
660	605033	美邦股份	423	7,910.10	0.00
661	003023	彩虹集团	385	7,896.35	0.00
662	301190	善水科技	420	7,891.80	0.00
663	301388	欣灵电气	292	7,840.20	0.00
664	688359	三孚新科	104	7,696.00	0.00
665	301233	盛帮股份	176	7,615.52	0.00
666	001234	泰慕士	333	7,592.40	0.00
667	301115	建科股份	330	7,543.80	0.00
668	688665	四方光电	81	7,542.72	0.00
669	603272	联翔股份	443	7,513.28	0.00
670	301166	优宁维	174	7,471.56	0.00
671	002169	智光电气	900	7,461.00	0.00
672	301111	粤万年青	379	7,420.82	0.00
673	688697	纽威数控	284	7,335.72	0.00
674	688409	富创精密	67	7,303.00	0.00
675	688677	海泰新光	127	7,205.98	0.00
676	605155	西大门	490	7,109.90	0.00
677	003021	兆威机电	80	7,018.40	0.00
678	601952	苏垦农发	600	6,984.00	0.00
679	605069	正和生态	790	6,912.50	0.00
680	688237	超卓航科	143	6,904.04	0.00
681	301319	唯特偶	115	6,882.75	0.00
682	688119	中钢洛耐	1,228	6,852.24	0.00
683	605055	迎丰股份	1,146	6,830.16	0.00
684	000733	振华科技	71	6,805.35	0.00
685	001202	炬申股份	459	6,774.84	0.00
686	605303	园林股份	610	6,771.00	0.00
687	301198	喜悦智行	443	6,724.74	0.00
688	605577	龙版传媒	588	6,697.32	0.00
689	301158	德石股份	383	6,629.73	0.00
690	688148	芳源股份	543	6,624.60	0.00
691	002871	伟隆股份	500	6,600.00	0.00
692	603150	万朗磁塑	250	6,590.00	0.00
693	688620	安凯微	533	6,577.22	0.00
694	688161	威高骨科	147	6,366.57	0.00
695	300850	新强联	170	6,354.60	0.00
696	688600	皖仪科技	256	6,346.24	0.00
697	605138	盛泰集团	723	6,304.56	0.00

698	688335	复洁环保	253	6,208.62	0.00
699	002992	宝明科技	99	6,165.72	0.00
700	002372	伟星新材	300	6,162.00	0.00
701	301012	扬电科技	238	6,152.30	0.00
702	600406	国电南瑞	264	6,098.40	0.00
703	002460	赣锋锂业	100	6,096.00	0.00
704	688699	明微电子	121	6,088.72	0.00
705	300832	新产业	100	5,900.00	0.00
706	688114	华大智造	67	5,799.52	0.00
707	688097	博众精工	190	5,768.40	0.00
708	688313	仕佳光子	322	5,651.10	0.00
709	000921	海信家电	200	5,390.00	0.00
710	300958	建工修复	300	5,322.00	0.00
711	301349	信德新材	104	5,214.56	0.00
712	301099	雅创电子	100	5,206.00	0.00
713	300339	润和软件	216	5,175.36	0.00
714	601012	隆基绿能	180	5,160.60	0.00
715	688283	坤恒顺维	77	5,122.04	0.00
716	688663	新风光	161	5,118.19	0.00
717	688253	英诺特	206	5,005.80	0.00
718	688661	和林微纳	70	4,921.00	0.00
719	301170	锡南科技	138	4,820.34	0.00
720	300604	长川科技	100	4,749.00	0.00
721	688456	有研粉材	141	4,719.27	0.00
722	688768	容知日新	59	4,712.33	0.00
723	301100	风光股份	227	4,689.82	0.00
724	300045	华力创通	400	4,640.00	0.00
725	300855	图南股份	130	4,591.60	0.00
726	688345	博力威	123	4,564.53	0.00
727	603666	亿嘉和	100	4,515.00	0.00
728	688678	福立旺	211	4,483.75	0.00
729	688127	蓝特光学	248	4,372.24	0.00
730	003038	鑫铂股份	100	4,146.00	0.00
731	688231	隆达股份	145	4,136.85	0.00
732	300890	翔丰华	100	4,110.00	0.00
733	600223	福瑞达	400	4,104.00	0.00
734	002414	高德红外	520	4,040.40	0.00
735	688689	银河微电	156	4,024.80	0.00
736	688353	华盛锂电	106	3,919.88	0.00
737	000833	粤桂股份	600	3,918.00	0.00
738	688255	凯尔达	112	3,792.32	0.00
739	688173	希荻微	163	3,729.44	0.00
740	002223	鱼跃医疗	100	3,599.00	0.00

741	000915	华特达因	100	3,529.00	0.00
742	688268	华特气体	43	3,471.39	0.00
743	301307	美利信	100	3,381.00	0.00
744	300252	金信诺	300	3,372.00	0.00
745	688786	悦安新材	71	3,293.69	0.00
746	688722	同益中	176	3,263.04	0.00
747	688683	莱尔科技	146	3,248.50	0.00
748	688171	纬德信息	131	3,201.64	0.00
749	600522	中天科技	200	3,182.00	0.00
750	688425	铁建重工	647	3,112.07	0.00
751	002041	登海种业	200	3,054.00	0.00
752	301046	能辉科技	91	2,975.70	0.00
753	688265	南模生物	76	2,843.92	0.00
754	301021	英诺激光	99	2,587.86	0.00
755	301219	腾远钴业	68	2,540.48	0.00
756	002142	宁波银行	100	2,530.00	0.00
757	688718	唯赛勃	142	2,458.02	0.00
758	000932	华菱钢铁	500	2,385.00	0.00
759	300996	普联软件	77	2,363.90	0.00
760	600316	洪都航空	100	2,345.00	0.00
761	301306	西测测试	59	2,292.15	0.00
762	300614	百川畅银	83	2,273.37	0.00
763	301069	凯盛新材	86	2,187.84	0.00
764	603733	仙鹤股份	100	2,085.00	0.00
765	001336	楚环科技	74	2,070.52	0.00
766	002101	广东鸿图	100	1,958.00	0.00
767	300814	中富电路	80	1,927.20	0.00
768	688208	道通科技	62	1,879.22	0.00
769	002037	保利联合	200	1,770.00	0.00
770	300994	久祺股份	114	1,760.16	0.00
771	605189	富春染织	107	1,755.87	0.00
772	600096	云天化	100	1,707.00	0.00
773	301220	亚香股份	49	1,671.39	0.00
774	001311	多利科技	29	1,665.47	0.00
775	301133	金钟股份	60	1,593.60	0.00
776	002708	光洋股份	200	1,532.00	0.00
777	600508	上海能源	100	1,468.00	0.00
778	002011	盾安环境	100	1,383.00	0.00
779	300973	立高食品	20	1,368.40	0.00
780	300925	法本信息	95	1,342.35	0.00
781	300932	三友联众	85	1,312.40	0.00
782	001231	农心科技	55	1,308.45	0.00
783	600746	江苏索普	200	1,306.00	0.00



784	002334	英威腾	100	1,274.00	0.00
785	300997	欢乐家	79	1,151.03	0.00
786	300879	大叶股份	60	1,141.80	0.00
787	605208	永茂泰	105	1,052.10	0.00
788	600867	通化东宝	100	1,044.00	0.00
789	689009	九号公司-WD	28	1,031.80	0.00
790	603048	浙江黎明	64	1,030.40	0.00
791	301052	果麦文化	20	986.40	0.00
792	605358	立昂微	26	954.98	0.00
793	605555	德昌股份	52	907.92	0.00
794	301066	万事利	50	862.00	0.00
795	001319	铭科精技	36	754.56	0.00
796	300864	南大环境	33	725.34	0.00
797	688569	铁科轨道	16	673.12	0.00
798	603233	大参林	24	672.24	0.00
799	301078	孩子王	56	640.08	0.00
800	301180	万祥科技	36	631.08	0.00
801	605133	嵘泰股份	18	625.68	0.00
802	600409	三友化工	100	545.00	0.00
803	600376	首开股份	100	390.00	0.00
804	301091	深城交	21	388.92	0.00
805	301015	百洋医药	14	388.64	0.00
806	301155	海力风电	5	385.40	0.00
807	001314	亿道信息	8	338.24	0.00
808	688093	世华科技	16	320.96	0.00
809	688609	九联科技	26	309.40	0.00
810	002635	安洁科技	18	248.40	0.00
811	300891	惠云钛业	25	228.50	0.00
812	301020	密封科技	10	226.10	0.00
813	301126	达嘉维康	15	201.00	0.00
814	300968	格林精密	20	177.80	0.00
815	300940	南极光	9	153.09	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	301039	中集车辆	8,474,564.00	2.82
2	601633	长城汽车	7,292,449.00	2.43
3	688006	杭可科技	6,487,499.05	2.16
4	600845	宝信软件	6,196,974.22	2.06
5	002430	杭氧股份	5,607,672.08	1.87
6	603997	继峰股份	5,345,126.00	1.78

7	300661	圣邦股份	5,227,423.00	1.74
8	300858	科拓生物	4,745,875.88	1.58
9	603501	韦尔股份	4,546,851.70	1.51
10	002236	大华股份	4,460,843.00	1.49
11	603507	振江股份	4,454,073.00	1.48
12	301220	亚香股份	4,270,251.43	1.42
13	688008	澜起科技	4,143,253.49	1.38
14	688279	峰昭科技	4,126,426.40	1.37
15	000063	中兴通讯	4,028,888.00	1.34
16	688227	品高股份	3,918,846.23	1.31
17	688325	赛微微电	3,690,856.90	1.23
18	001322	箭牌家居	3,666,790.00	1.22
19	688489	三未信安	3,598,858.00	1.20
20	600941	中国移动	3,478,447.36	1.16

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	002011	盾安环境	13,807,349.31	4.60
2	002371	北方华创	11,567,843.60	3.85
3	688279	峰昭科技	8,711,057.88	2.90
4	002648	卫星化学	8,167,091.26	2.72
5	300014	亿纬锂能	7,815,525.00	2.60
6	002459	晶澳科技	7,538,278.44	2.51
7	300498	温氏股份	6,611,870.00	2.20
8	603348	文灿股份	6,261,458.41	2.09
9	002493	荣盛石化	6,082,983.00	2.03
10	603032	德新科技	6,065,128.84	2.02
11	688617	惠泰医疗	5,531,243.76	1.84
12	002057	中钢天源	5,272,329.00	1.76
13	301039	中集车辆	5,208,406.00	1.73
14	300858	科拓生物	5,182,793.00	1.73
15	688006	杭可科技	4,897,519.20	1.63
16	603507	振江股份	4,503,414.00	1.50
17	000733	振华科技	4,491,486.19	1.50
18	600765	中航重机	4,427,062.00	1.47
19	301306	西测测试	4,338,535.68	1.44
20	002472	双环传动	4,251,969.00	1.42

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	552,541,514.53
卖出股票收入（成交）总额	573,634,853.08

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）	218,925.22	0.08
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	218,925.22	0.08

### 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	113661	福 22 转债	1,660	200,937.82	0.07
2	113059	福莱转债	150	17,987.40	0.01

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

注：无。

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

注：无。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：无。

### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

## 7.12 投资组合报告附注

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

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

### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券备选库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	91,668.93
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	31,843.23
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	123,512.16

### 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	113661	福 22 转债	200,937.82	0.07
2	113059	福莱转债	17,987.40	0.01

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比 例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
18,000	9,894.15	54,071.99	0.03	178,040,625.76	99.97

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	567,895.42	0.3189

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

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

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

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2017 年 9 月 6 日) 基金份额总额	491,760,953.62
本报告期期初基金份额总额	190,440,874.18
本报告期基金总申购份额	4,652,630.20
减：本报告期基金总赎回份额	16,998,806.63
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	178,094,697.75

## § 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**

本基金本报告期投资策略未改变。

**10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况**

本报告期内未改聘为本基金审计的会计师事务所。

**10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况****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 (%)	
国盛证券	1	272,118,859.60	24.31	223,498.38	22.71	-
中金公司	1	231,141,836.58	20.65	212,947.91	21.64	-
华西证券	1	166,460,806.16	14.87	136,714.27	13.89	-
国信证券	2	140,135,122.97	12.52	129,105.25	13.12	-
兴业证券	1	116,444,813.20	10.40	107,280.33	10.90	-
招商证券	1	79,232,314.51	7.08	72,996.39	7.42	-
国泰君安	1	49,049,934.64	4.38	45,190.05	4.59	-

国元证券	1	33,229,626.80	2.97	27,292.38	2.77	-
中泰证券	1	31,639,245.55	2.83	29,150.73	2.96	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	本报告期新增
申万宏源证券	2	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-

注：交易单元选择的标准和程序：

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

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

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

2) 选择交易单元的程序：

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

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

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

国盛证 券	-	-	195,306,000. 00	49.25	-	-
中金公 司	-	-	201,218,000. 00	50.75	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
国泰君 安	-	-	-	-	-	-
国元证 券	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-
东吴证 券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源证券	-	-	-	-	-	-
世纪证 券	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023年01月04日
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活动时间公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023年01月05日
3	鹏华策略回报灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	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	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	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	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023年03月14日



6	鹏华策略回报灵活配置混合型证券投资基金 2022 年年度报告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 03 月 30 日
7	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	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 04 月 07 日
8	鹏华策略回报灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 04 月 21 日
9	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	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 05 月 17 日
10	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	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 05 月 19 日
11	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	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 06 月 03 日
12	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	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 06 月 05 日
13	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 06 月 06 日
14	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	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 06 月 20 日
15	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	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	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)《鹏华策略回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- (二)《鹏华策略回报灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- (三)《鹏华策略回报灵活配置混合型证券投资基金 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