

鹏华弘惠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：平安银行股份有限公司

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。

基金托管人平安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

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	10
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	47
7.1 期末基金资产组合情况	47
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	48
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	52

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
§ 8 基金份额持有人信息.....	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
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	55
§ 9 开放式基金份额变动.....	55
§ 10 重大事件揭示	56
10.1 基金份额持有人大会决议	56
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	57
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	59
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	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	59
§ 12 备查文件目录	59
12.1 备查文件目录	59
12.2 存放地点	59
12.3 查阅方式	59

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华弘惠灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	鹏华弘惠混合	
基金主代码	003343	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 9 月 27 日	
基金管理人	鹏华基金管理有限公司	
基金托管人	平安银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	301, 538, 695. 98 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	鹏华弘惠混合 A	鹏华弘惠混合 C
下属分级基金的交易代码	003343	003344
报告期末下属分级基金的份额总额	81, 008, 973. 42 份	220, 529, 722. 56 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在科学严谨的资产配置框架下，严选安全边际较高的股票、债券等投资标的，力争基金资产的保值增值。
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、税收、货币、汇率政策等），并结合美林时钟等科学严谨的资产配置模型，动态评估不同资产大类在不同时期的投资价值及其风险收益特征，追求股票、债券和货币等大类资产的灵活配置和稳健收益。</p> <p>2、股票投资策略 本基金通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘优质的上市公司，严选其中安全边际较高的个股构建投资组合：自上而下地分析行业的增长前景、行业结构、商业模式、竞争要素等分析把握其投资机会；自下而上地评判企业的产品、核心竞争力、管理层、治理结构等；并结合企业基本面和估值水平进行综合的研判，严选安全边际较高的个股，力争实现组合的保值增值。</p> <p>（1）自上而下的行业遴选 本基金将自上而下地进行行业遴选，重点关注行业增长前景、行业利润前景和行业成功要素。对行业增长前景，主要分析行业的外部发展环境、行业的生命周期以及行业波动与经济周期的关系等；对行业利润前景，主要分析行业结构，特别是业内竞争的方式、业内竞争的激烈程度、以及业内厂商的谈判能力等。基于对行业结构的分析形成对业内竞争的关键成功要素的判断，为预测企业经营环境的变化建立起扎实的基础。</p> <p>（2）自下而上的个股选择 本基金主要从两方面进行自下而上的个股选择：一方面是竞争力分析，通过对公司竞争策略和核心竞争力的分析，选择具有可持续竞争优势的上</p>

	<p>上市公司或未来具有广阔成长空间的公司。就公司竞争策略，基于行业分析的结果判断策略的有效性、策略的实施支持和策略的执行成果；就核心竞争力，分析公司的现有核心竞争力，并判断公司能否利用现有的资源、能力和定位取得可持续竞争优势。另一方面是管理层分析，在国内监管体系落后、公司治理结构不完善的基础上，上市公司的命运对管理团队的依赖度大大增加。本基金将着重考察公司的管理层以及管理制度。</p> <p>(3) 综合研判 本基金在自上而下和自下而上的基础上，结合估值分析，严选安全边际较高的个股，力争实现组合的保值增值。通过对估值方法的选择和估值倍数的比较，选择股价相对低估的股票。就估值方法而言，基于行业的特点确定对股价最有影响力的关键估值方法（包括 PE、PEG、PB、PS、EV/EBITDA 等）；就估值倍数而言，通过业内比较、历史比较和成长性分析，确定具有上升基础的股价水平。</p> <p>(4) 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、中小企业私募债投资策略等积极投资策略，灵活地调整组合的券种搭配，精选安全边际较高的个券，力争实现组合的保值增值。</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>(7) 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>4、资产支持证券的投资策略 本基金将综合运用战略资产配置和战术资产配置进行资产支持证券的投资组合管理，并根据信用风险、利率风险和流动性风险变化积极调整投资策略，严格遵守法律法规和基金合同的约定，在保证本金安全和基金资产流动性的基础上获得稳定收益。</p>
业绩比较基准	<p>中证综合债指数收益率×50%+沪深 300 指数收益率×50%</p>

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	平安银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	高永杰
	联系电话	0755-81395402
	电子邮箱	xxpl@phfund.com.cn
客户服务电话	4006788999	95511-3
传真	0755-82021126	0755-82080387
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	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 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	广东省深圳市福田区益田路 5023 号平安金融中心 B 座
邮政编码	518048	518001
法定代表人	何如	谢永林

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	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)	
	鹏华弘惠混合 A	鹏华弘惠混合 C
本期已实现收益	1,035,371.88	2,611,928.13
本期利润	64,674.45	-1,934,125.63
加权平均基金份额本期利润	0.0006	-0.0059
本期加权平均净	0.05%	-0.51%

值利润率		
本期基金份额净值增长率	-1.02%	-1.04%
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	5,324,629.77	13,901,155.35
期末可供分配基金份额利润	0.0657	0.0630
期末基金资产净值	91,213,595.27	247,700,780.49
期末基金份额净值	1.1260	1.1232
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	34.97%	34.68%

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

鹏华弘惠混合 A

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	0.60%	0.44%	0.85%	0.43%	-0.25%	0.01%
过去三个月	-2.21%	0.37%	-1.69%	0.41%	-0.52%	-0.04%
过去六个月	-1.02%	0.33%	1.08%	0.42%	-2.10%	-0.09%

过去一年	-0.17%	0.28%	-5.21%	0.49%	5.04%	-0.21%
过去三年	16.11%	0.28%	3.20%	0.60%	12.91%	-0.32%
自基金合同生效起至今	34.97%	0.45%	27.61%	0.58%	7.36%	-0.13%

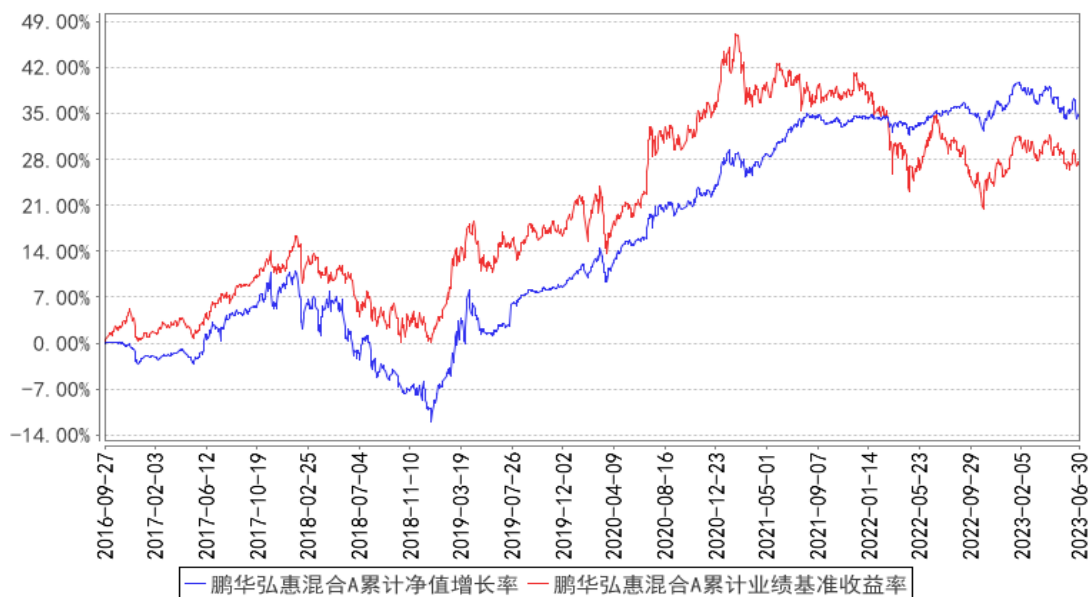
鹏华弘惠混合 C

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	0.59%	0.44%	0.85%	0.43%	-0.26%	0.01%
过去三个月	-2.22%	0.37%	-1.69%	0.41%	-0.53%	-0.04%
过去六个月	-1.04%	0.33%	1.08%	0.42%	-2.12%	-0.09%
过去一年	-0.20%	0.28%	-5.21%	0.49%	5.01%	-0.21%
过去三年	16.04%	0.28%	3.20%	0.60%	12.84%	-0.32%
自基金合同生效起至今	34.68%	0.45%	27.61%	0.58%	7.07%	-0.13%

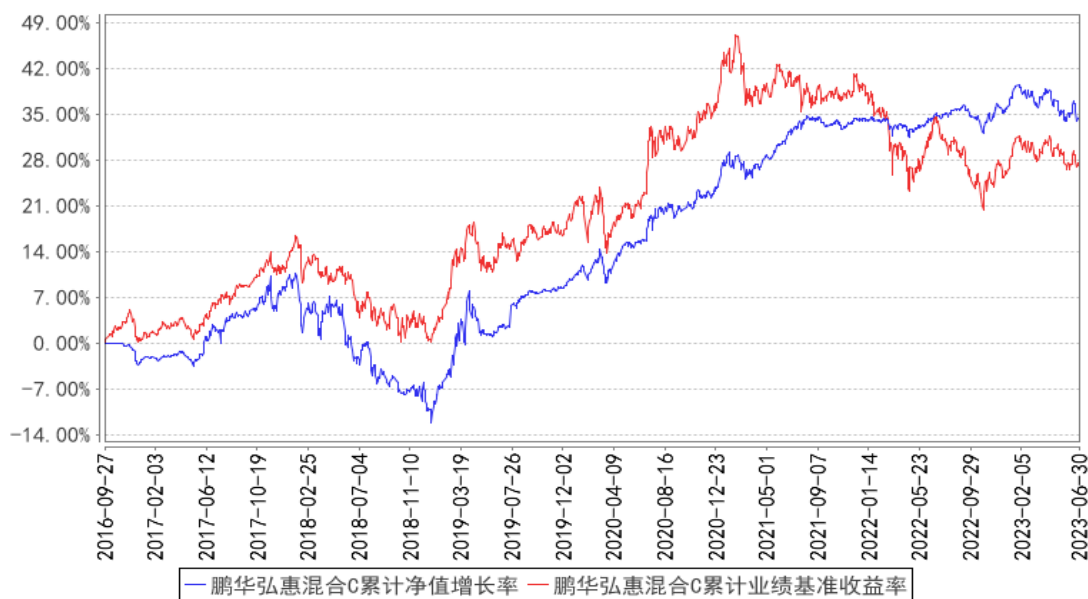
注：业绩比较基准=中证综合债指数收益率×50%+沪深 300 指数收益率×50%

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

鹏华弘惠混合A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



鹏华弘惠混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2016 年 09 月 27 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		
牛孟艺	基金经理	2020-11-04	-	6 年	牛孟艺先生，国籍中国，管理学硕士，6 年证券从业经验。2017 年 06 月加盟鹏华基金管理有限公司，从事研究分析工作，历任绝对收益投资部研究员，现任稳定收

					益投资部基金经理，从事投资管理相关工作。2020 年 11 月至今担任鹏华弘惠灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2022 年 12 月至今担任鹏华兴安定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理，牛孟艺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遵规守信情况的说明

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

回顾上半年，海外经济整体维持回落态势，海外总需求不强。国内方面，受去年基数影响，各类经济数据的表观数据较好，但以两年复合增速的视角来看，房地产投资先上后下大幅回落，基建投资维持较高水平，制造业投资维持较高水平，消费持续回落，进出口持续回落，经济增速有所放缓，整体名义增速先上后下。货币方面，政策先松后紧，二季度中再次降息，债市流动性

维持平稳，权益市场流动性更相关的 M1 同样先升后落。

这样的市场环境对权益、固收类资产均难言好坏。上半年权益市场整体稍有上涨，固收市场表现较好，市场表现略强于宏观经济的情况。

上半年中，权益方面，本基金从中性仓位逐渐提升至较高仓位，但选股方面表现弱于中证 800。债券方面，本基金维持较低的组合久期，以赚取票息为主；可转债方面，考虑到当前转债市场整体估值仍然较高，符合赚取稳健收益条件的个券并不多，因此仅少量参与。新股方面，本基金持续积极参与。整体来看，宏观经济方面，尤其是二季度的宏观经济表现低于基金经理的预期，因此本基金的整体表现较弱。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期鹏华弘惠混合 A 份额净值增长率为-1.02%，同期业绩比较基准增长率为 1.08%，鹏华弘惠混合 C 份额净值增长率为-1.04%，同期业绩比较基准增长率为 1.08%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，经济方面，房地产投资大概率低位回暖；基建投资大概率维持高位；制造业投资仍待观察，维持高位的概率不低；消费大概率缓慢爬坡上行；进出口增速受海外影响，存在一定的下行风险。整体来看，在剔除基数影响后的两年复合增速角度方面，下半年经济较上半年而言，下行的概率不大，好转幅度仍待观察；但基于我们的量化模型显示，中国经济大概率将在今年三四季度逐渐开启新一轮经济上行周期，只是整体上行的幅度尚未可知。因此，我们认为经济大概率即将触底回升，最困难的时刻即将度过。货币政策方面，在前期经济较为疲弱的情况下，流动性收紧与放松的概率均不大，整体大概率维持平稳。与权益市场流动性大概率将维持乐观。

在上述假设下，基金经理对下半年权益资产的观点较为乐观，行情有可能先下后上，亦或维持偏强震荡，大幅上行取决于经济见底回暖的发生证实以及市场对此形成共识，这可能需要不止一个季度的时间；而债券资产在下半年大概率维持中性偏弱的表现，且性价比将越来越低。

整体来看，本基金在权益仓位上将维持偏高的水平仓位附近运行；组合久期方面，则在维持低久期赚取票息的思路为主。具体操作将根据最新的市场情况以及相应宏观经济环境进行分析及应对，本文观点仅代表基金经理撰写时的观点。

本基金以追求稳定收益为主要的投资策略，以少量的权益资产匹配适当组合久期的方式，在追求收益的同时控制基金净值的回撤幅度，同时基金参与新股的网下申购获取增强收益，具体执行思路参见前文。

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，鹏华弘惠混合 A 期末可供分配利润为 5,324,629.77 元，期末基金份额净值 1.1260 元；鹏华弘惠混合 C 期末可供分配利润为 13,901,155.35 元，期末基金份额净值 1.1232 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，平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监

督，未发现基金管理人有关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

本报告期，本托管人复核的财务指标、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真实、准确、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：鹏华弘惠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
资产：			
银行存款	6.4.7.1	9,149,183.58	8,091,077.23
结算备付金		12,765,780.35	12,223,649.01
存出保证金		143,698.15	115,139.19
交易性金融资产	6.4.7.2	420,392,750.17	751,223,421.84
其中：股票投资		142,857,868.43	133,453,999.34
基金投资		-	-
债券投资		277,534,881.74	617,769,422.50
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	499,970.14	-
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		6,562,103.27	-
应收股利		-	-
应收申购款		8,155.97	376.44
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		449,521,641.63	771,653,663.71
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负债：			

短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		103,070,785.15	114,069,427.45
应付清算款		399,955.21	61,145.09
应付赎回款		6,669,642.03	21,352.54
应付管理人报酬		172,954.42	383,997.22
应付托管费		28,825.76	63,999.54
应付销售服务费		4,258.05	8,431.81
应付投资顾问费		-	-
应交税费		8,097.73	21,267.89
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	252,747.52	505,102.98
负债合计		110,607,265.87	115,134,724.52
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	301,538,695.98	578,107,519.23
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	37,375,679.78	78,411,419.96
净资产合计		338,914,375.76	656,518,939.19
负债和净资产总计		449,521,641.63	771,653,663.71

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额为 301,538,695.98 份，其中鹏华弘惠混合 A 基金份额总额为 81,008,973.42 份，基金份额净值 1.1260 元；鹏华弘惠混合 C 基金份额总额为 220,529,722.56 份，基金份额净值 1.1232 元。

6.2 利润表

会计主体：鹏华弘惠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
一、营业总收入		1,410,177.14	7,061,633.06
1. 利息收入		203,413.94	166,021.05
其中：存款利息收入	6.4.7.13	115,670.22	118,850.30
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		87,743.72	47,170.75
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-

2. 投资收益（损失以“-”填列）		6,571,213.29	6,384,989.92
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-1,937,380.04	-15,184,410.93
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	7,195,825.74	20,595,444.00
资产支持证券投资 收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	1,312,767.59	973,956.85
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	-5,516,751.19	508,705.27
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	152,301.10	1,916.82
减：二、营业总支出		3,279,628.32	4,764,946.60
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,506,637.13	2,815,874.53
2. 托管费	6.4.10.2.2	251,106.19	469,312.47
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	37,657.88	46,105.92
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		1,373,035.49	1,298,884.51
其中：卖出回购金融资产 支出		1,373,035.49	1,298,884.51
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		8,289.07	31,866.61
8. 其他费用	6.4.7.23	102,902.56	102,902.56
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		-1,869,451.18	2,296,686.46
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		-1,869,451.18	2,296,686.46
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		-1,869,451.18	2,296,686.46

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：鹏华弘惠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)	578,107,519.23	-	78,411,419.96	656,518,939.19
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)	578,107,519.23	-	78,411,419.96	656,518,939.19
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-276,568,823.25	-	-41,035,740.18	-317,604,563.43
(一)、综合收益总额	-	-	-1,869,451.18	-1,869,451.18
(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)	-276,568,823.25	-	-39,166,289.00	-315,735,112.25
其中:1.基金申购款	106,505,767.00	-	16,438,754.76	122,944,521.76
2.基金赎回款	-383,074,590.25	-	-55,605,043.76	-438,679,634.01

(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)	301,538,695.98	-	37,375,679.78	338,914,375.76
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)	823,757,233.11	-	167,513,615.66	991,270,848.77
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)	823,757,233.11	-	167,513,615.66	991,270,848.77
三、本期 增减变动 额(减少 以“-” 号填列)	-117,962,976.59	-	-62,131,463.65	-180,094,440.24

(一)、 综合收益总额	-	-	2,296,686.46	2,296,686.46
(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)	-117,962,976.59	-	-18,269,877.85	-136,232,854.44
其中:1. 基金申购款	266,695,384.83	-	49,018,034.79	315,713,419.62
2. 基金赎回款	-384,658,361.42	-	-67,287,912.64	-451,946,274.06
(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)	-	-	-46,158,272.26	-46,158,272.26
(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)	705,794,256.52	-	105,382,152.01	811,176,408.53

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

邓召明

基金管理人负责人

邢彪

主管会计工作负责人

郝文高

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

鹏华弘惠灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]1920 号文《关于准予鹏华弘惠灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准,由鹏华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《鹏华弘惠灵活配置混合型证券投资基金基金合同》及其他法律法规公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次募集期间为 2016 年 9 月 12 日至 2016 年 9 月 23 日,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 1,100,039,396.41 元,经瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)瑞华验资[2016]01300025 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华弘惠灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 9 月 27 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,100,251,921.23 份基金份额,其中认购资金利息折合 212,524.82 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,本基金托管人为平安银行股份有限公司。

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》、《鹏华弘惠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	9,149,183.58
等于：本金	9,148,320.44
加：应计利息	863.14
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	9,149,183.58

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	148,528,972.05	-	142,857,868.43	-5,671,103.62
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券 交易所市	222,443,456.44	4,569,797.01	226,081,267.61	-931,985.84

	场				
	银行间市场	50,703,000.00	143,614.13	51,453,614.13	607,000.00
	合计	273,146,456.44	4,713,411.14	277,534,881.74	-324,985.84
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		421,675,428.49	4,713,411.14	420,392,750.17	-5,996,089.46

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

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	499,970.14	-
银行间市场	-	-
合计	499,970.14	-

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	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	168,444.96
其中：交易所市场	168,444.96
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	84,302.56
合计	252,747.52

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

鹏华弘惠混合 A

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	147,291,956.31	147,291,956.31
本期申购	9,975,269.27	9,975,269.27
本期赎回（以“-”号填列）	-76,258,252.16	-76,258,252.16
-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	81,008,973.42	81,008,973.42

鹏华弘惠混合 C

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	430,815,562.92	430,815,562.92
本期申购	96,530,497.73	96,530,497.73
本期赎回（以“-”号填列）	-306,816,338.09	-306,816,338.09
-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	220,529,722.56	220,529,722.56

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

鹏华弘惠混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	8,741,303.07	11,528,504.60	20,269,807.67
本期利润	1,035,371.88	-970,697.43	64,674.45
本期基金份额交易产生的变动数	-4,452,045.18	-5,677,815.09	-10,129,860.27
其中：基金申购款	596,545.34	915,766.46	1,512,311.80
基金赎回款	-5,048,590.52	-6,593,581.55	-11,642,172.07
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,324,629.77	4,879,992.08	10,204,621.85

鹏华弘惠混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	24,470,992.29	33,670,620.00	58,141,612.29
本期利润	2,611,928.13	-4,546,053.76	-1,934,125.63
本期基金份额交易产生的变动数	-13,181,765.07	-15,854,663.66	-29,036,428.73
其中：基金申购款	5,851,930.82	9,074,512.14	14,926,442.96
基金赎回款	-19,033,695.89	-24,929,175.80	-43,962,871.69
本期已分配利润	-	-	-
本期末	13,901,155.35	13,269,902.58	27,171,057.93

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	18,929.56
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	95,466.80
其他	1,273.86
合计	115,670.22

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	-1,937,380.04
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	-1,937,380.04

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	217,987,771.83
减：卖出股票成本总额	219,280,232.23
减：交易费用	644,919.64
买卖股票差价收入	-1,937,380.04

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	6,039,876.24
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,155,949.50
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	7,195,825.74

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	457,410,703.18
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	449,566,063.50
减：应计利息总额	6,687,958.48
减：交易费用	731.70
买卖债券差价收入	1,155,949.50

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	1,312,767.59
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	1,312,767.59

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	-5,516,751.19
股票投资	-6,723,522.95
债券投资	1,206,771.76
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	-5,516,751.19

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	151,692.22
基金转换费收入	608.88
合计	152,301.10

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	-
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	102,902.56

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 股票交易**

注：无。

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

注：无。

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	1,506,637.13	2,815,874.53
其中：支付销售机构的客户维护费	209,459.61	93,544.79

注：1、支付基金管理人鹏华基金公司的管理人报酬年费率为0.60%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×0.60%÷当年天数。

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

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	251,106.19	469,312.47

注：支付基金托管人平安银行的托管费按前一日基金资产净值0.10%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×0.10%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方 名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鹏华弘惠混合 A	鹏华弘惠混合 C	合计
平安银行	-	5.45	5.45

鹏华基金公司	-	20,593.55	20,593.55
合计	-	20,599.00	20,599.00
获得销售服务费的各关联方 名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鹏华弘惠混合 A	鹏华弘惠混合 C	合计
平安银行	-	3.63	3.63
鹏华基金公司	-	29,838.88	29,838.88
合计	-	29,842.51	29,842.51

注：鹏华弘惠混合 A 基金份额不支付销售服务费；支付基金销售机构的鹏华弘惠混合 C 基金份额的销售服务费年费率为 0.02%，逐日计提，按月支付，日销售服务费=前一日分类基金资产净值×0.02%÷当年天数。

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
平安银行	9,149,183.58	18,929.56	8,317,082.68	26,190.84

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	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	7,051	89,406.68
国信证券	301488	豪恩汽电	网下申购	2,356	93,721.68
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	740	8,791.20	15,554.80	-
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	2023 年	6 个月	新股流	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-

	口腔	3月29日		通受限							
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		-
301170	锡南科技	2023年6月16日	6个月	新股流通受限	34.00	34.93	231	7,854.00	8,068.83		-
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	2,563	66,176.66	66,176.66		-
301202	朗威股份	2023年6月28日	6个月	新股流通受限	25.82	25.82	285	7,358.70	7,358.70		-
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	1,750	64,575.00	64,575.00		-
301261	恒工精密	2023年6月29日	6个月	新股流通受限	36.90	36.90	195	7,195.50	7,195.50		-
301262	海看股份	2023年6月13日	6个月	新股流通受限	30.22	25.50	369	11,151.18	9,409.50		-
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	399	15,213.87	12,380.97		-
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	5,066	101,269.34	101,269.34		-
301292	海科新源	2023年6月29日	6个月	新股流通受限	19.99	19.99	563	11,254.37	11,254.37		-
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	2023年	6个月	新股流	37.40	36.07	215	8,041.00	7,755.05		-

	科技	6月19日		通受限							
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		-
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		-
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	255	19,584.00	27,527.25		-
301332	德尔玛	2023年5月9日	6个月	新股流通受限	14.81	13.73	828	12,262.68	11,368.44		-
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	206	15,130.70	9,607.84		-
301355	南王科技	2023年6月2日	6个月	新股流通受限	17.55	16.75	556	9,757.80	9,313.00		-
301357	北方长龙	2023年4月11日	6个月	新股流通受限	50.00	48.39	190	9,500.00	9,194.10		-
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		-
301376	致欧科技	2023年6月14日	6个月	新股流通受限	24.66	22.51	378	9,321.48	8,508.78		-
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		-

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	718	14,352.82	12,134.20	-
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	2,089	120,451.74	120,451.74	-
301486	致尚科技	2023年6月30日	6个月	新股流通受限	57.66	57.66	233	13,434.78	13,434.78	-
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	2,120	84,333.60	84,333.60	-
301488	豪恩汽电	2023年6月26日	6个月	新股流通受限	39.78	39.78	236	9,388.08	9,388.08	-
601061	中信金属	2023年3月30日	6个月	新股流通受限	6.58	7.58	1,680	11,054.40	12,734.40	-
601065	江盐集团	2023年3月31日	6个月	新股流通受限	10.36	11.84	550	5,698.00	6,512.00	-
601133	柏诚股份	2023年3月31日	6个月	新股流通受限	11.66	12.26	485	5,655.10	5,946.10	-
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	550	9,790.00	9,839.50	-
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	517	18,689.55	19,713.21	-
688249	晶合集成	2023年4月24日	6个月	新股流通受限	19.86	18.06	2,765	54,912.90	49,935.90	-

		日									
688334	西高院	2023年 6月9日	6个月	新股流 通受限	14.16	16.21	686	9,713.76	11,120.06	-	
688352	颀中科技	2023年 4月11日	6个月	新股流 通受限	12.10	12.07	1,445	17,484.50	17,441.15	-	
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	399	9,416.40	25,803.33	-	
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	598	22,652.24	17,635.02	-	
688458	美芯晟	2023年 5月15日	6个月	新股流 通受限	75.00	90.76	141	10,575.00	12,797.16	-	
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	5,099	29,013.31	27,585.59	-	
688472	阿特斯	2023年 6月2日	6个月	新股流 通受限	11.10	17.04	1,371	15,218.10	23,361.84	-	
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	-	
688485	九州一轨	2023年 1月11日	6个月	新股流 通受限	17.47	15.17	3,580	62,542.60	54,308.60	-	
688507	索辰科技	2023年 4月10日	6个月	新股流 通受限	245.56	122.11	121	20,135.92	14,775.31	索辰科技于2023年6月20日每10股送4.8股	
688523	航天	2023年	6个月	新股流	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20	-	

	环宇	5月26日		通受限							
688531	日联科技	2023年3月24日	6个月	新股流通受限	152.38	135.97	173	26,361.74	23,522.81		-
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	232	10,131.44	12,307.60		-
688562	航天软件	2023年5月15日	6个月	新股流通受限	12.68	22.31	706	8,952.08	15,750.86		-
688570	天玛智控	2023年5月29日	6个月	新股流通受限	30.26	25.33	423	12,799.98	10,714.59		-
688581	安杰思	2023年5月12日	6个月	新股流通受限	125.80	118.03	100	12,580.00	11,803.00		-
688582	芯动联科	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	26.74	40.68	321	8,583.54	13,058.28		-
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	897	9,579.96	11,068.98		-
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	246	6,218.88	7,348.02		-

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

截至本报告期末 2023 年 06 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 103,070,785.15 元，于 2023 年 07 月 03 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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(含同业存单等),权证,资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

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

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行平安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	198,714,045.12	496,891,662.49
AAA 以下	8,699,185.78	18,180,115.53
未评级	-	-
合计	207,413,230.90	515,071,778.02

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、组合在短时间

内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2023 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额 103,070,785.15 元将在一个月内到期且计息外，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、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，此外还持有银行存款、结算备付金等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。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，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

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	9,149,183.58	-	-	-	9,149,183.58
结算备付金	12,765,780.35	-	-	-	12,765,780.35
存出保证金	143,698.15	-	-	-	143,698.15
交易性金融资产	136,634,286.31	89,446,981.30	51,453,614.13	142,857,868.43	420,392,750.17
买入返售金融资产	499,970.14	-	-	-	499,970.14
应收申购款	-	-	-	8,155.97	8,155.97
应收清算款	-	-	-	6,562,103.27	6,562,103.27
资产总计	159,192,918.53	89,446,981.30	51,453,614.13	149,428,127.67	449,521,641.63
负债					
应付赎回款	-	-	-	6,669,642.03	6,669,642.03
应付管理人报酬	-	-	-	172,954.42	172,954.42
应付托管费	-	-	-	28,825.76	28,825.76
应付清算款	-	-	-	399,955.21	399,955.21

卖出回购金融资产款	103,070,785.15	-	-	-	103,070,785.15
应付销售服务费	-	-	-	4,258.05	4,258.05
应交税费	-	-	-	8,097.73	8,097.73
其他负债	-	-	-	252,747.52	252,747.52
负债总计	103,070,785.15	-	-	7,536,480.72	110,607,265.87
利率敏感度缺口	56,122,133.38	89,446,981.30	51,453,614.13	141,891,646.95	338,914,375.76
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	8,091,077.23	-	-	-	8,091,077.23
结算备付金	12,223,649.01	-	-	-	12,223,649.01
存出保证金	115,139.19	-	-	-	115,139.19
交易性金融资产	412,640,215.47	154,348,212.55	50,780,994.48	133,453,999.34	751,223,421.84
应收申购款	-	-	-	376.44	376.44
资产总计	433,070,080.90	154,348,212.55	50,780,994.48	133,454,375.78	771,653,663.71
负债					
应付赎回款	-	-	-	21,352.54	21,352.54
应付管理人报酬	-	-	-	383,997.22	383,997.22
应付托管费	-	-	-	63,999.54	63,999.54
应付清算款	-	-	-	61,145.09	61,145.09
卖出回购金融资产款	114,069,427.45	-	-	-	114,069,427.45
应付销售服务费	-	-	-	8,431.81	8,431.81
应交税费	-	-	-	21,267.89	21,267.89
其他负债	-	-	-	505,102.98	505,102.98
负债总计	114,069,427.45	-	-	1,065,297.07	115,134,724.52
利率敏感度缺口	319,000,653.45	154,348,212.55	50,780,994.48	132,389,078.71	656,518,939.19

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有债券资产的利率风险状况测算的理论变动值对基金资产净值的影响金额。		
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。		
	此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）		
	本期末（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）	
分析	市场利率下降 25 个	1,191,774.05	2,004,882.55

	基点		
	市场利率上升 25 个基点	-1, 172, 444. 19	-1, 979, 825. 59

注：无。

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%；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	142,857,868.43	42.15	133,453,999.34	20.33
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	17,875,808.14	5.27	32,655,203.22	4.97
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	160,733,676.57	47.42	166,109,202.56	25.30

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）		上年度末（2022年12月31日）
	本期末（2023年6月30日）		
分析	业绩比较基准上升5%	3,985,633.06	4,881,218.31
	业绩比较基准下降5%	-3,985,633.06	-4,881,218.31

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	159,323,879.86
第二层次	260,221,016.37
第三层次	847,853.94
合计	420,392,750.17

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	142,857,868.43	31.78
	其中：股票	142,857,868.43	31.78
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	277,534,881.74	61.74
	其中：债券	277,534,881.74	61.74
	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	499,970.14	0.11
	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	21,914,963.93	4.88
8	其他各项资产	6,713,957.39	1.49
9	合计	449,521,641.63	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	55,283.20	0.02
C	制造业	76,177,205.62	22.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.01
E	建筑业	32,448.24	0.01
F	批发和零售业	2,867,918.58	0.85
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	126,965.00	0.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,898,046.55	4.40
J	金融业	38,476,615.00	11.35
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,679,282.00	0.50
M	科学研究和技术服务业	11,120.06	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	54,308.60	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	7,900,020.11	2.33
R	文化、体育和娱乐业	543,208.00	0.16
S	综合	-	-
	合计	142,857,868.43	42.15

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	002142	宁波银行	659,050	16,673,965.00	4.92
2	600519	贵州茅台	8,600	14,542,600.00	4.29
3	600837	海通证券	1,091,300	10,061,786.00	2.97
4	300015	爱尔眼科	424,595	7,876,237.25	2.32
5	002371	北方华创	23,700	7,528,305.00	2.22
6	000858	五粮液	25,800	4,220,106.00	1.25
7	000333	美的集团	68,300	4,024,236.00	1.19
8	000988	华工科技	96,300	3,660,363.00	1.08
9	002236	大华股份	181,900	3,592,525.00	1.06
10	600570	恒生电子	75,500	3,343,895.00	0.99
11	601601	中国太保	126,000	3,273,480.00	0.97
12	002422	科伦药业	101,900	3,024,392.00	0.89
13	601577	长沙银行	330,200	2,562,352.00	0.76
14	000651	格力电器	68,500	2,500,935.00	0.74
15	601628	中国人寿	65,900	2,303,864.00	0.68
16	002410	广联达	66,332	2,155,126.68	0.64
17	000568	泸州老窖	10,200	2,137,614.00	0.63
18	603688	石英股份	16,700	1,901,128.00	0.56
19	002603	以岭药业	73,300	1,883,077.00	0.56
20	002223	鱼跃医疗	51,300	1,846,287.00	0.54
21	300033	同花顺	10,400	1,822,912.00	0.54
22	000063	中兴通讯	39,500	1,798,830.00	0.53
23	000623	吉林敖东	110,200	1,767,608.00	0.52
24	300474	景嘉微	19,500	1,754,805.00	0.52
25	600739	辽宁成大	128,900	1,695,035.00	0.50
26	002465	海格通信	153,800	1,590,292.00	0.47
27	300866	安克创新	18,100	1,583,750.00	0.47
28	688002	睿创微纳	30,600	1,370,880.00	0.40
29	300454	深信服	11,900	1,347,675.00	0.40
30	002056	横店东磁	73,100	1,331,151.00	0.39
31	000738	航发控制	53,700	1,310,280.00	0.39
32	600809	山西汾酒	6,800	1,258,476.00	0.37

33	002602	世纪华通	156,900	1,190,871.00	0.35
34	600535	天士力	80,300	1,165,153.00	0.34
35	603233	大参林	40,560	1,136,085.60	0.34
36	601888	中国中免	9,900	1,094,247.00	0.32
37	601187	厦门银行	214,400	1,076,288.00	0.32
38	600050	中国联通	220,700	1,059,360.00	0.31
39	601728	中国电信	183,300	1,031,979.00	0.30
40	600329	达仁堂	22,000	987,580.00	0.29
41	603712	七一二	32,600	984,846.00	0.29
42	603228	景旺电子	30,400	779,760.00	0.23
43	603267	鸿远电子	11,900	777,070.00	0.23
44	601319	中国人保	120,200	701,968.00	0.21
45	688029	南微医学	8,600	701,416.00	0.21
46	688561	奇安信-U	13,400	694,254.00	0.20
47	603927	中科软	16,700	643,952.00	0.19
48	002624	完美世界	36,200	611,418.00	0.18
49	600941	中国移动	6,300	587,790.00	0.17
50	300058	蓝色光标	60,500	585,035.00	0.17
51	000596	古井贡酒	2,100	519,498.00	0.15
52	688249	晶合集成	27,642	519,364.89	0.15
53	688188	柏楚电子	2,300	433,688.00	0.13
54	688088	虹软科技	10,100	431,775.00	0.13
55	603000	人民网	14,400	420,480.00	0.12
56	600637	东方明珠	49,700	388,654.00	0.11
57	002131	利欧股份	159,600	367,080.00	0.11
58	600487	亨通光电	23,400	343,044.00	0.10
59	002739	万达电影	27,200	341,088.00	0.10
60	688361	中科飞测-U	3,985	323,477.19	0.10
61	301325	曼恩斯特	2,545	289,732.25	0.09
62	688469	中芯集成-U	50,989	287,781.89	0.08
63	688539	高华科技	5,334	247,497.60	0.07
64	300136	信维通信	11,900	238,952.00	0.07
65	002841	视源股份	3,500	233,940.00	0.07
66	688146	中船特气	5,170	216,069.81	0.06
67	300144	宋城演艺	16,300	202,120.00	0.06
68	688352	颀中科技	14,441	192,107.39	0.06
69	688478	晶升股份	4,013	188,591.35	0.06
70	688443	智翔金泰-U	5,979	183,961.73	0.05
71	600498	烽火通信	9,000	183,330.00	0.05
72	301399	英特科技	2,925	171,714.01	0.05
73	002508	老板电器	6,600	166,914.00	0.05
74	603195	公牛集团	1,628	156,385.68	0.05
75	301360	荣旗科技	1,340	138,170.08	0.04

76	688458	美芯晟	1,403	134,163.70	0.04
77	301486	致尚科技	2,322	133,886.52	0.04
78	301291	明阳电气	3,981	129,154.17	0.04
79	600258	首旅酒店	6,700	126,965.00	0.04
80	688581	安杰思	991	120,941.59	0.04
81	301332	德尔玛	8,274	117,771.78	0.03
82	002032	苏泊尔	2,300	115,000.00	0.03
83	301292	海科新源	5,629	112,523.71	0.03
84	688479	友车科技	3,318	103,760.10	0.03
85	301488	豪恩汽电	2,356	93,721.68	0.03
86	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.02
87	301202	朗威股份	2,848	73,535.36	0.02
88	301261	恒工精密	1,945	71,770.50	0.02
89	601869	长飞光纤	1,500	55,515.00	0.02
90	600925	苏能股份	8,960	55,283.20	0.02
91	688485	九州一轨	3,580	54,308.60	0.02
92	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.01
93	688433	华曙高科	867	28,433.00	0.01
94	603137	恒尚节能	1,382	26,502.14	0.01
95	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.01
96	688531	日联科技	173	23,522.81	0.01
97	688472	阿特斯	1,371	23,361.84	0.01
98	688562	航天软件	706	15,750.86	0.00
99	001287	中电港	740	15,554.80	0.00
100	688507	索辰科技	121	14,775.31	0.00
101	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
102	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
103	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
104	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
105	688582	芯动联科	321	13,058.28	0.00
106	601061	中信金属	1,680	12,734.40	0.00
107	688543	国科军工	232	12,307.60	0.00
108	301439	泓淋电力	718	12,134.20	0.00
109	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
110	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
111	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
112	688334	西高院	686	11,120.06	0.00
113	688620	安凯微	897	11,068.98	0.00
114	688570	天玛智控	423	10,714.59	0.00
115	603135	中重科技	550	9,839.50	0.00
116	301345	涛涛车业	206	9,607.84	0.00
117	301262	海看股份	369	9,409.50	0.00
118	301355	南王科技	556	9,313.00	0.00

119	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
120	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
121	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
122	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
123	301376	致欧科技	378	8,508.78	0.00
124	301281	科源制药	338	8,483.80	0.00
125	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
126	301170	锡南科技	231	8,068.83	0.00
127	301295	美硕科技	215	7,755.05	0.00
128	688631	莱斯信息	246	7,348.02	0.00
129	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
130	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
131	601065	江盐集团	550	6,512.00	0.00
132	601133	柏诚股份	485	5,946.10	0.00
133	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
134	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
135	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
136	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
137	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
138	603172	万丰股份	122	1,967.86	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	002142	宁波银行	17,207,536.25	2.62
2	300015	爱尔眼科	12,771,505.52	1.95
3	600837	海通证券	12,399,065.00	1.89
4	002475	立讯精密	11,506,234.00	1.75
5	002371	北方华创	6,971,681.80	1.06
6	600036	招商银行	6,703,831.00	1.02
7	600739	辽宁成大	6,227,848.00	0.95
8	600519	贵州茅台	6,132,070.00	0.93
9	000623	吉林敖东	4,903,272.00	0.75
10	603259	药明康德	4,861,587.00	0.74
11	300896	爱美客	4,666,314.91	0.71
12	002236	大华股份	4,606,064.00	0.70
13	002670	国盛金控	4,569,594.00	0.70
14	600570	恒生电子	3,854,642.00	0.59
15	002422	科伦药业	3,519,075.00	0.54
16	000988	华工科技	3,267,328.00	0.50
17	002466	天齐锂业	3,227,566.62	0.49
18	002410	广联达	3,205,067.65	0.49

19	601577	长沙银行	3,074,075.00	0.47
20	601156	东航物流	2,773,675.45	0.42

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	600036	招商银行	22,452,591.00	3.42
2	603259	药明康德	12,546,103.60	1.91
3	002475	立讯精密	10,042,608.00	1.53
4	300015	爱尔眼科	9,255,085.14	1.41
5	600999	招商证券	8,762,723.50	1.33
6	000776	广发证券	8,002,546.00	1.22
7	600900	长江电力	7,108,661.00	1.08
8	002466	天齐锂业	6,422,200.20	0.98
9	600519	贵州茅台	5,505,990.00	0.84
10	000623	吉林敖东	5,505,461.00	0.84
11	601000	唐山港	4,923,455.00	0.75
12	600739	辽宁成大	4,554,843.00	0.69
13	300896	爱美客	4,348,546.00	0.66
14	002670	国盛金控	4,297,111.00	0.65
15	000002	万科 A	4,173,614.00	0.64
16	601156	东航物流	4,059,369.00	0.62
17	002460	赣锋锂业	3,170,676.20	0.48
18	601390	中国中铁	2,545,850.00	0.39
19	600399	抚顺特钢	2,441,583.00	0.37
20	600188	兖矿能源	2,344,413.00	0.36

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	235,407,624.27
卖出股票收入（成交）总额	217,987,771.83

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	51,453,614.13	15.18
2	央行票据	-	-
3	金融债券	110,696,250.97	32.66

	其中：政策性金融债	18,668,036.71	5.51
4	企业债券	97,509,208.50	28.77
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	17,875,808.14	5.27
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	277,534,881.74	81.89

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	210009	21 付息国债 09	500,000	51,453,614.13	15.18
2	163701	20 广药 01	300,000	30,801,115.07	9.09
3	188701	国电投 11	300,000	30,790,597.81	9.09
4	152613	20 宜国 04	200,000	20,498,326.58	6.05
5	149274	20 申证 10	200,000	20,484,061.37	6.04

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

招商证券股份有限公司在报告编制日前一年内受到中国证监会的处罚。

宁波银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到中国银行保险监督管理委员会宁波监管局的处罚。

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	143,698.15
2	应收清算款	6,562,103.27
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	8,155.97
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,713,957.39

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	127018	本钢转债	9,176,622.36	2.71
2	110072	广汇转债	7,846,657.01	2.32
3	127047	帝欧转债	852,528.77	0.25

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

份额级别	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 (%)
鹏华弘惠混合 A	274	295,653.19	76,765,116.06	94.76	4,243,857.36	5.24

鹏华弘惠混合 C	3,668	60,122.61	216,279,206.04	98.07	4,250,516.52	1.93
合计	3,942	76,493.83	293,044,322.10	97.18	8,494,373.88	2.82

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	鹏华弘惠混合 A	187,665.29	0.2317
	鹏华弘惠混合 C	86.45	0.0000
	合计	187,751.74	0.0623

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	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	鹏华弘惠混合 A	0~10
	鹏华弘惠混合 C	-
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	鹏华弘惠混合 A	10~50
	鹏华弘惠混合 C	-
	合计	10~50

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

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	鹏华弘惠混合 A	鹏华弘惠混合 C
基金合同生效日 (2016年9月27日) 基金份额总额	400,144,353.42	700,107,567.81
本报告期期初基金份额总额	147,291,956.31	430,815,562.92
本报告期基金总申购份额	9,975,269.27	96,530,497.73
减：本报告期基金总赎回份额	76,258,252.16	306,816,338.09
本报告期基金拆分变动份额	-	-

本报告期末基金份额总额	81,008,973.42	220,529,722.56
-------------	---------------	----------------

§ 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 (%)	
中信证券	1	230,608,893.31	51.88	212,461.98	54.64	-
兴业证券	1	206,840,666.50	46.53	169,876.78	43.68	-
国泰君安	1	7,086,561.55	1.59	6,529.04	1.68	-

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

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
中信证券	63,119,346.00	11.69	443,600,000.00	3.42	-	-
兴业证券	98,086,872.55	18.17	9,086,500,000.00	70.14	-	-
国泰君安	378,535,080.91	70.13	3,425,600,000.00	26.44	-	-

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	《上海证券报》、基金管	2023 年 01 月 05 日

	银行股份有限公司申购、定期定额申购费率优惠活动时间的公告	理人网站及中国证监会基金电子披露网站	
3	鹏华弘惠灵活配置混合型证券投资基金恢复大额申购、转换转入和定期定额投资业务的公告	《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 11 日
4	鹏华弘惠灵活配置混合型证券投资基金 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
5	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
6	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
7	鹏华弘惠灵活配置混合型证券投资基金 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	鹏华弘惠灵活配置混合型证券投资基金 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
10	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
11	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
12	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
13	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
14	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
15	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

16	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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20230412~20230426	91,459,648.53	0.00	65,019,878.13	26,439,770.40	8.77
	2	20230427~20230630	77,670,159.92	0.00	0.00	77,670,159.92	25.76
产品特有风险							
基金份额持有人持有的基金份额所占比例过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引起基金净值剧烈波动，甚至可能引发基金流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。							

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

2、赎回份额包含基金赎回份额、基金转换出份额、强制调减份额、场内卖出份额。

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)《鹏华弘惠灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- (二)《鹏华弘惠灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- (三)《鹏华弘惠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