

# 鹏华创新升级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>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	9
3.3 其他指标	10
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
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	14
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
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
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>14</b>
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	20
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>49</b>
7.1 期末基金资产组合情况	49
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	49
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	50
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55

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 .....	55
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 .....	55
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 .....	55
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 .....	55
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	55
7.12 投资组合报告附注 .....	55
<b>§ 8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>56</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	56
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 .....	57
<b>§ 9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>57</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>57</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	57
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 .....	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	57
10.4 基金投资策略的改变 .....	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	57
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 .....	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	58
10.8 其他重大事件 .....	60
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>62</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 .....	62
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	62
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>62</b>
12.1 备查文件目录 .....	62
12.2 存放地点 .....	62
12.3 查阅方式 .....	62

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华创新升级混合型证券投资基金	
基金简称	鹏华创新升级混合	
基金主代码	012093	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 6 月 18 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	788,791,659.29 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	鹏华创新升级混合 A	鹏华创新升级混合 C
下属分级基金的交易代码	012093	012094
报告期末下属分级基金的份额总额	662,152,235.61 份	126,639,423.68 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，本基金通过精选创新升级相关的个股，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金将通过跟踪考量宏观经济变量（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</p> <p>本基金通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘 A 股和港股的优质公司，构建股票投资组合。核心思路在于：1) 自上而下地分析行业的增长前景、行业结构、商业模式、竞争要素等分析把握其投资机会；2) 自下而上地评判企业的核心竞争力、管理层、治理结构等以及其所提供的产品和服务是否契合未来行业增长的大趋势，对企业基本面和估值水平进行综合的研判，深度挖掘优质的个股。</p> <p>（1）创新升级主题的定义</p> <p>创新升级主题指在中国经济结构转型及产业升级的进程中，通过技术创新、服务创新、经营模式创新、产品创新、文化创新、流程创新等各类创新形式实现转型或升级、或引领行业发展新方向的优质上市企业。创新升级主题类公司通常具有核心研发实力和技术、较高的行业知名度，以及良好的创新管理和企业文化，在市场竞争中具有核心优势和持续发展能力。 创新升级主题的定义会随着科</p>

学技术的发展不断变化，本基金将持续跟踪国家相关政策和产业发展趋势，密切关注科研成果、技术工艺、商业模式等方面的重大突破和创新，在履行适当程序后可对创新升级主题的界定进行调整。

#### (2) 自上而下的行业遴选

本基金将自上而下地进行行业遴选，重点关注行业增长前景、行业利润前景和行业成功要素。对行业增长前景，主要分析行业的外部发展环境、行业的生命周期以及行业波动与经济周期的关系等；对行业利润前景，主要分析行业结构，特别是业内竞争的方式、业内竞争的激烈程度等。基于对行业结构的分析形成对业内竞争的关键成功要素的判断，为预测企业经营环境的变化建立起扎实的基础。

#### (3) 自下而上的个股选择

本基金通过定性和定量相结合的方法进行自下而上的个股选择，对企业基本面和估值水平进行综合的研判，精选优质个股。

##### 1) 定性分析

本基金通过以下两方面标准对股票的基本面进行研究分析并筛选出优质的公司：

一方面是竞争力分析，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，通过着重考察公司的管理层以及管理制度，选择具有良好治理结构、管理水平较高的优质公司。

##### 2) 定量分析

本基金通过对公司定量的估值分析，挖掘优质的投资标的。通过对估值方法的选择和估值倍数的比较，选择股价相对低估的股票。就估值方法而言，基于行业的特点确定对股价最有影响力的关键估值方法（包括 PE、PEG、PB、PS、EV/EBITDA 等）；就估值倍数而言，通过业内比较、历史比较和增长性分析，确定具有上升基础的股价水平。

#### (4) 港股通标的股票投资策略

本基金所投资港股通标的股票除适用上述个股投资策略外，还需关注：

- 1) 在港股市场上市、具有行业代表性的优质中资公司；
- 2) 具有行业稀缺性的香港本地和外资公司；
- 3) 港股市场在行业结构、估值、AH 股折溢价、分红率等方面具有吸引力的投资标的。

#### 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。

#### 4、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、

	<p>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>5、资产支持证券的投资策略</p> <p>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> <p>6、参与融资业务策略</p> <p>本基金可在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素基础上，参与融资业务。</p> <p>未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，本基金可在履行适当程序后相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书中更新并公告。</p>
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×70%+恒生指数收益率×10%（经汇率估值调整）+中证综合债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金将投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

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
	联系电话	0755-81395402
	电子邮箱	xxpl@phfund.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	《证券时报》
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)	
	鹏华创新升级混合 A	鹏华创新升级混合 C
本期已实现收益	-7,889,360.99	-2,646,481.71
本期利润	-20,708,602.78	-16,851,494.53
加权平均基金份额 本期利润	-0.0311	-0.1346
本期加权平均净 值利润率	-3.43%	-15.05%
本期基金份额净 值增长率	-3.66%	-4.04%
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	-124,731,620.72	-25,517,976.41
期末可供分配基 金份额利润	-0.1884	-0.2015
期末基金资产净 值	537,420,614.89	101,121,447.27
期末基金份额净 值	0.8116	0.7985
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	-18.84%	-20.15%

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

鹏华创新升级混合 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	-9.15%	1.02%	1.50%	0.72%	-10.65%	0.30%
过去三个月	-5.63%	1.50%	-3.47%	0.67%	-2.16%	0.83%
过去六个月	-3.66%	1.48%	0.00%	0.68%	-3.66%	0.80%
过去一年	-8.47%	1.26%	-9.83%	0.82%	1.36%	0.44%
自基金合同生效起至今	-18.84%	1.07%	-18.33%	0.91%	-0.51%	0.16%

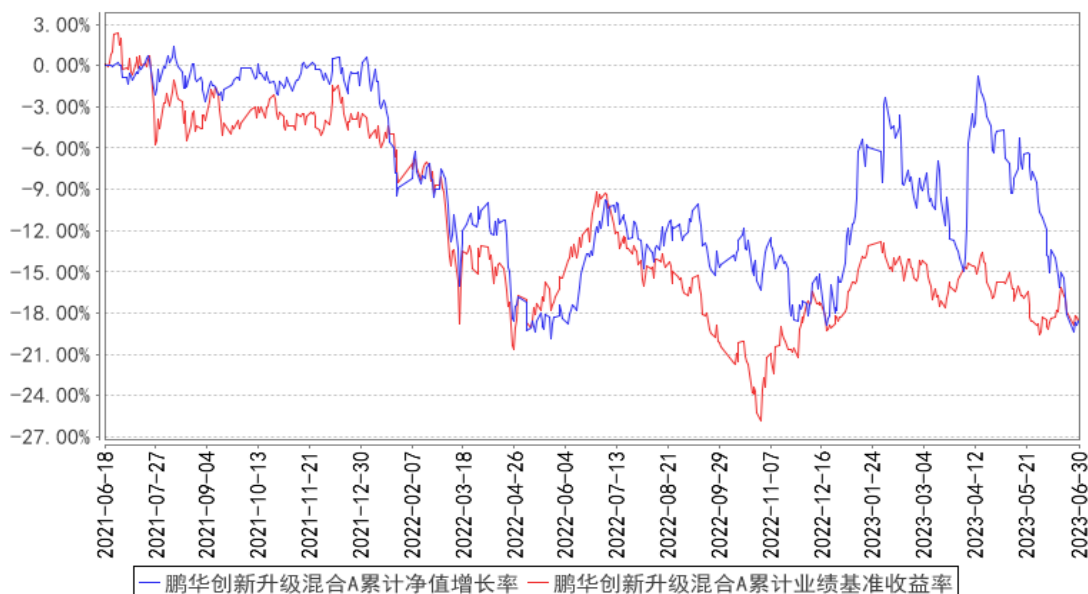
鹏华创新升级混合 C

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	-9.20%	1.02%	1.50%	0.72%	-10.70%	0.30%
过去三个月	-5.82%	1.50%	-3.47%	0.67%	-2.35%	0.83%
过去六个月	-4.04%	1.48%	0.00%	0.68%	-4.04%	0.80%
过去一年	-9.20%	1.26%	-9.83%	0.82%	0.63%	0.44%
自基金合同生效起至今	-20.15%	1.07%	-18.33%	0.91%	-1.82%	0.16%

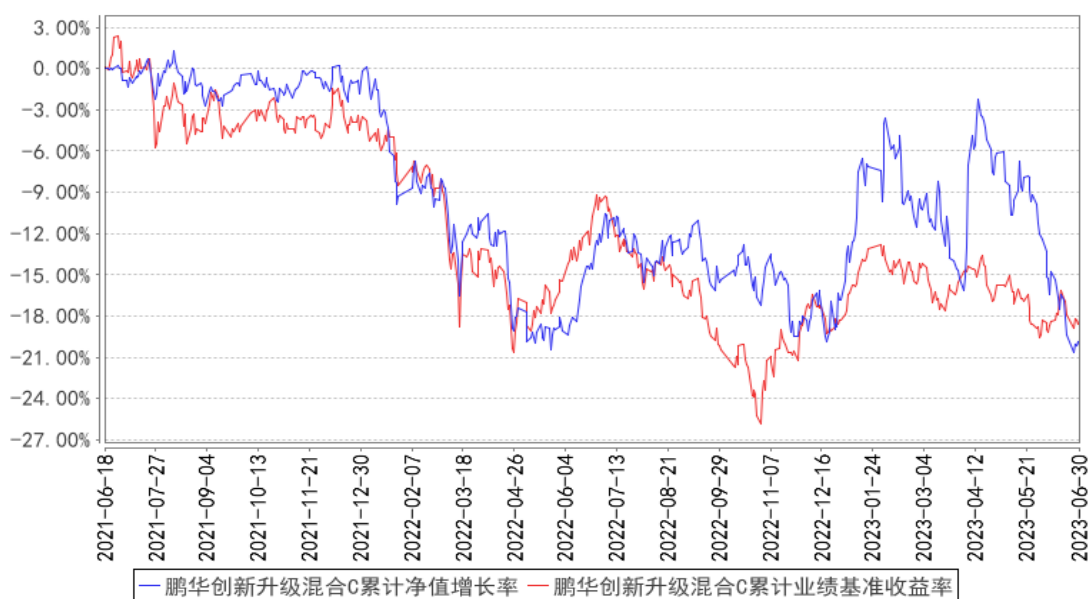
注:业绩比较基准=本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×70%+恒生指数收益率×10%(经汇率估值调整)+中证综合债指数收益率×20%

### 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

鹏华创新升级混合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



鹏华创新升级混合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 2021 年 06 月 18 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的经验。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
金笑非	基金经理	2021-06-18	-	11 年	金笑非先生，国籍中国，经济学硕士，11 年证券从业经验。2012 年 7 月加盟鹏华基金管理有限公司，从事行业研究工作，历任研究部基金经理助理/高级研究员，现任权益投资二部总经理助理/基金经理。2016 年 06 月至今担任鹏华医药科技股票型证券投资基金基金经理，2017 年 07 月至 2020 年 03 月担任鹏华医疗保健股票型证券投资基金基金经理，2019 年 06 月至 2022 年 06 月担任鹏华科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2021 年 06 月至今担任鹏华创新升级混合型证券投资基金基金经理，2022 年 06 月至今担任鹏华创新动力灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金经理，2022 年 06 月至今担任鹏华创新增长一年持有期混合型证券投资基金基金经理，金笑非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

复盘上半年行情，市场维持震荡格局；结构上分化较大，地产链和传统赛道股跌幅较大，而主题投资的 AI 和中特估概念持续火热；

23 年的市场主线主要围绕着提估值的方向展开，不看业绩，主要原因是经济弱复苏，但流动性比较宽裕，市场的风险偏好高，大家愿意相信宏大叙事；

交易层面，我们将中药板块兑现了，一是因为中药 1 季度业绩普遍超预期，后续环比走弱是大概率，二是中药已经成为医药基金的重要持仓，后续增量资金有限，后续中药的投资逻辑从贝塔转向阿尔法。同时，我们将仓位腾挪到了院内刚性的医药板块，包括血制品，仿制药，诊断，耗材等；

创新药我们的持仓没有变动。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期鹏华创新升级混合 A 份额净值增长率为-3.66%，同期业绩比较基准增长率为 0.00%，鹏华创新升级混合 C 份额净值增长率为-4.04%，同期业绩比较基准增长率为 0.00%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，当下 AI 赛道交易的热度和拥挤度很高，但成交量已经明显萎缩，我们判断 AI 进入退潮期。市场后续会寻找新方向，例如展开对经济复苏板块的预期，或者在中报期中也会跑出一些业绩好的新板块，或者进入主题快速轮动的混沌期。

当然，下半年，市场会对有业绩兑现或超预期的方向更青睐，符合机构审美的板块，我们认为可参与度更高。

对于医药，从去年 10 月份反弹至 2 月份高点，此后一直震荡下跌，我们认为是正常的回落阶段，在交换完解套的筹码后，有利于后续健康的持续上涨。当然，因为调整时间过长，使得市场对医药反转的判断不再相信，导致最近创新药，中药等前期强势板块补跌明显，也让我们的净值回撤较大。

从总量上判断，我们仍看好医药板块的反转，这是个长期有稳定需求增长的重要行业，同时场内全市场基金的持仓又回到了低位。

看好的医药细分方向上，一是创新药，二是院内刚性医疗复苏。

#### 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，鹏华创新升级混合 A 期末可供分配利润为-124,731,620.72 元，期末基金份额净值 0.8116 元，不符合利润分配条件；鹏华创新升级混合 C 期末可供分配利润为

-25,517,976.41 元，期末基金份额净值 0.7985 元，不符合利润分配条件。

2、本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

### 5.3 托管人对本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：鹏华创新升级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	41,044,554.99	42,443,708.76
结算备付金		1,496,163.13	12,551,802.90
存出保证金		82,445.08	96,182.32
交易性金融资产	6.4.7.2	552,897,685.27	437,590,662.99
其中：股票投资		552,897,685.27	437,590,662.99
基金投资		-	-

债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-21,905.54	93,615,331.21
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		66,440,858.31	143,650.44
应收股利		-	-
应收申购款		246,820.14	1,661.24
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		662,186,621.38	586,442,999.86
<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		4,778.70	3,713,479.62
应付赎回款		22,133,609.24	114,005.09
应付管理人报酬		858,855.88	731,866.34
应付托管费		143,142.64	121,977.71
应付销售服务费		87,611.02	11,203.70
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	416,561.74	742,539.49
负债合计		23,644,559.22	5,435,071.95
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	788,791,659.29	689,918,671.11
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-150,249,597.13	-108,910,743.20
净资产合计		638,542,062.16	581,007,927.91
负债和净资产总计		662,186,621.38	586,442,999.86

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额为 788,791,659.29 份，其中鹏华创新升级混

合 A 基金份额总额为 662,152,235.61 份,基金份额净值 0.8116 元;鹏华创新升级混合 C 基金份额总额为 126,639,423.68 份,基金份额净值 0.7985 元。

## 6.2 利润表

会计主体:鹏华创新升级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>		-30,830,808.17	-82,900,037.98
1. 利息收入		819,946.83	1,667,606.02
其中:存款利息收入	6.4.7.13	166,401.73	252,161.75
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		653,545.10	1,415,444.27
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益(损失以“-”填列)		-5,075,660.53	-98,074,775.95
其中:股票投资收益	6.4.7.14	-6,617,611.49	-99,920,281.43
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
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	1,541,950.96	1,845,505.48
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	-27,024,254.61	13,505,376.93
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	449,160.14	1,755.02
<b>减:二、营业总支出</b>		6,729,289.14	5,843,272.74
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	5,319,998.10	4,878,623.71
2. 托管费	6.4.10.2.2	886,666.40	813,103.98



3. 销售服务费	6.4.10.2.3	435,986.09	75,707.93
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		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	86,638.55	75,837.12
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-37,560,097.31	-88,743,310.72
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-37,560,097.31	-88,743,310.72
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-37,560,097.31	-88,743,310.72

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：鹏华创新升级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)	689,918,671.11	-	-108,910,743.20	581,007,927.91
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)	689,918,671.11	-	-108,910,743.20	581,007,927.91
三、本期增减变动额(减少以“-”	98,872,988.18	-	-41,338,853.93	57,534,134.25

号填列)				
(一)、 综合收益总额	-	-	-37,560,097.31	-37,560,097.31
(二)、 本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	98,872,988.18	-	-3,778,756.62	95,094,231.56
其中:1. 基金申购款	385,870,057.83	-	-35,389,123.72	350,480,934.11
2 .基金赎回款	-286,997,069.65	-	31,610,367.10	-255,386,702.55
(三)、 本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、 其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	788,791,659.29	-	-150,249,597.13	638,542,062.16
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)	768,772,587.74	-	1,605,403.45	770,377,991.19
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期初净资产(基金净值)	768,772,587.74	-	1,605,403.45	770,377,991.19
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-46,770,075.08	-	-83,553,332.85	-130,323,407.93
(一)、综合收益总额	-	-	-88,743,310.72	-88,743,310.72
(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)	-46,770,075.08	-	5,189,977.87	-41,580,097.21
其中:1.基金申购款	3,877,234.69	-	-455,526.71	3,421,707.98
2.基金赎回款	-50,647,309.77	-	5,645,504.58	-45,001,805.19
(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、本期末净资产(基金净值)	722,002,512.66	-	-81,947,929.40	640,054,583.26

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

邢彪

郝文高

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

鹏华创新升级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”)《关于准予鹏华创新升级混合型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2021]1045号)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《鹏华创新升级混合型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于 2021 年 6 月 18 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 827,842,275.60 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 2021 年 6 月 2 日至 2021 年 6 月 16 日募集,并于 2021 年 6 月 16 日募集完毕。募集期间净认购资金人民币 827,569,768.80 元。认购资金在募集期间产生的利息人民币 272,506.80 元,募集的有效认购份额及利息结转的基金份额合计 827,842,275.60 份。上述募集资金已由毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了毕马威华振验字第 2100301 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》、《鹏华创新升级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[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政

策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

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

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

## 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	41,044,554.99
等于：本金	41,037,071.43
加：应计利息	7,483.56
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	41,044,554.99

## 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	589,627,627.03	-	552,897,685.27	-36,729,941.76
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	589,627,627.03	-	552,897,685.27	-36,729,941.76

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	-21,905.54	-
银行间市场	-	-
合计	-21,905.54	-

**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	428.49
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	331,830.69
其中：交易所市场	331,830.69
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	84,302.56
合计	416,561.74

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

## 鹏华创新升级混合 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	669,823,588.97	669,823,588.97
本期申购	48,895,900.53	48,895,900.53
本期赎回（以“-”号填列）	-56,567,253.89	-56,567,253.89
-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	662,152,235.61	662,152,235.61

## 鹏华创新升级混合 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	20,095,082.14	20,095,082.14
本期申购	336,974,157.30	336,974,157.30

本期赎回（以“-”号填列）	-230,429,815.76	-230,429,815.76
-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	126,639,423.68	126,639,423.68

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

鹏华创新升级混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-99,335,605.98	-6,201,186.41	-105,536,792.39
本期利润	-7,889,360.99	-12,819,241.79	-20,708,602.78
本期基金份额交易产生的变动数	1,204,377.63	309,396.82	1,513,774.45
其中：基金申购款	-6,834,546.76	4,561,452.10	-2,273,094.66
基金赎回款	8,038,924.39	-4,252,055.28	3,786,869.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-106,020,589.34	-18,711,031.38	-124,731,620.72

鹏华创新升级混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-3,184,488.11	-189,462.70	-3,373,950.81
本期利润	-2,646,481.71	-14,205,012.82	-16,851,494.53
本期基金份额交易产生的变动数	-16,153,828.29	10,861,297.22	-5,292,531.07
其中：基金申购款	-51,844,858.23	18,728,829.17	-33,116,029.06
基金赎回款	35,691,029.94	-7,867,531.95	27,823,497.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-21,984,798.11	-3,533,178.30	-25,517,976.41

#### 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	107,137.97
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	58,387.58
其他	876.18
合计	166,401.73

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	-6,617,611.49
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-6,617,611.49

##### 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	269,145,840.97
减：卖出股票成本总额	274,760,992.89
减：交易费用	1,002,459.57
买卖股票差价收入	-6,617,611.49

##### 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

注：无。

##### 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	1,541,950.96
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	1,541,950.96

**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	-27,024,254.61

股票投资	-27,024,254.61
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-27,024,254.61

#### 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	442,552.69
基金转换费收入	6,607.45
合计	449,160.14

#### 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	459.00
证券组合费	1,876.99
合计	86,638.55

#### 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（“中国工商银行”）	基金托管人、基金代销机构
国信证券股份有限公司（“国信证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
国信证券	75,139,850.59	11.14	39,078,092.77	3.05

#### 6.4.10.1.2 债券交易

注：无。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)
国信证券	479,276,000.00	7.46	1,238,605,000.00	8.04

#### 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	69,682.78	11.39	65,346.01	19.69
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	35,662.29	3.16	18,556.82	4.54

注：(1) 佣金的计算公式

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

(佣金比率按照与一般证券公司签订的协议条款订立。)

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

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	5,319,998.10	4,878,623.71
其中:支付销售机构的客户维护费	1,265,077.94	1,242,328.45

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	886,666.40	813,103.98

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

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		
	鹏华创新升级混合 A	鹏华创新升级混合 C	合计
国信证券	-	172.65	172.65
中国工商银行	-	25,202.11	25,202.11
鹏华基金公司	-	210,072.21	210,072.21
合计	-	235,446.97	235,446.97
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		
	鹏华创新升级混合 A	鹏华创新升级混合 C	合计
中国工商银行	-	26,056.29	26,056.29
鹏华基金公司	-	805.45	805.45
合计	-	26,861.74	26,861.74

注：鹏华创新升级混合 A 基金份额不支付销售服务费；支付基金销售机构的鹏华创新升级混合 C 基金份额的销售服务费年费率为 0.8%，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×0.8%÷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固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	41,044,554.99	107,137.97	34,446,051.13	134,267.19

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

注：本表包含参与基金托管人的关联方承销证券的情况。

**6.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

注：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	6个月	新股流通受限	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	-

		日									
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	858	10,193.04	18,035.16	-	
001324	长青科技	2023年5月12日	6个月	新股流通受限	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-	
001328	登康口腔	2023年3月29日	6个月	新股流通受限	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-	
001367	海森药业	2023年3月30日	6个月	新股流通受限	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-	
301141	中科磁业	2023年3月27日	6个月	新股流通受限	41.20	42.69	262	10,794.40	11,184.78	-	
301157	华塑科技	2023年3月1日	6个月	新股流通受限	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-	
301170	锡南科技	2023年6月16日	6个月	新股流通受限	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-	
301202	朗威股份	2023年6月28日	1个月内(含)	新股未上市	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	-	
301202	朗威股份	2023年6月28日	6个月	新股流通受限	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	-	
301261	恒工精密	2023年6月29日	1个月内(含)	新股未上市	36.90	36.90	1,775	65,497.50	65,497.50	-	
301261	恒工精密	2023年6月29日	6个月	新股流通受限	36.90	36.90	198	7,306.20	7,306.20	-	
301262	海看股份	2023年6月13日	6个月	新股流通受限	30.22	25.50	494	14,928.68	12,597.00	-	
301281	科源制药	2023年3月28日	6个月	新股流通受限	44.18	25.10	337	10,647.38	8,458.70	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	553	21,085.89	17,159.59		-
301292	海科新源	2023 年 6 月 29 日	1 个月内(含)	新股未上市	19.99	19.99	5,241	104,767.59	104,767.59		-
301292	海科新源	2023 年 6 月 29 日	6 个月	新股流通受限	19.99	19.99	583	11,654.17	11,654.17		-
301293	三博脑科	2023 年 4 月 25 日	6 个月	新股流通受限	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86		-
301295	美硕科技	2023 年 6 月 19 日	6 个月	新股流通受限	37.40	36.07	215	8,041.00	7,755.05		-
301301	川宁生物	2022 年 12 月 20 日	6 个月	新股流通受限	5.00	8.96	3,574	17,870.00	32,023.04		-
301303	真兰仪表	2023 年 2 月 13 日	6 个月	新股流通受限	26.80	22.32	1,058	28,354.40	23,614.56		-
301315	威士顿	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股流通受限	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12		-
301317	鑫磊股份	2023 年 1 月 12 日	6 个月	新股流通受限	20.67	26.17	694	14,344.98	18,161.98		-
301320	豪江智能	2023 年 6 月 1 日	6 个月	新股流通受限	13.06	20.62	642	8,384.52	13,238.04		-
301322	绿通科技	2023 年 2 月 27 日	6 个月	新股流通受限	131.11	53.24	283	24,779.79	15,066.92		绿通科技于 2023 年 5 月 25 日每 10 股送 5 股
301323	新莱福	2023 年 5 月 29 日	6 个月	新股流通受限	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08		-
301325	曼恩斯特	2023 年 5 月 4 日	6 个月	新股流通受限	76.80	107.95	364	27,955.20	39,293.80		-
301332	德尔玛	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股流通受限	14.81	13.73	1,122	16,616.82	15,405.06		-

		日									
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	239	17,554.55	11,146.96		-
301355	南王科技	2023年6月2日	6个月	新股流通受限	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25		-
301357	北方长龙	2023年4月11日	6个月	新股流通受限	50.00	48.39	190	9,500.00	9,194.10		-
301358	湖南裕能	2023年2月1日	6个月	新股流通受限	23.77	42.89	676	16,068.52	28,993.64		-
301360	荣旗科技	2023年4月17日	6个月	新股流通受限	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40		-
301373	凌玮科技	2023年1月20日	6个月	新股流通受限	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45		-
301376	致欧科技	2023年6月14日	6个月	新股流通受限	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20		-
301382	蜂助手	2023年5月9日	6个月	新股流通受限	23.80	32.84	408	9,710.40	13,398.72		-
301386	未来电器	2023年3月21日	6个月	新股流通受限	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62		-
301399	英特科技	2023年5月16日	6个月	新股流通受限	43.99	51.57	293	12,889.07	15,110.01		-
301408	华人健康	2023年2月22日	6个月	新股流通受限	16.24	16.95	879	14,274.96	14,899.05		-
301419	阿莱德	2023年2月2日	6个月	新股流通受限	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50		-
301428	世纪恒通	2023年5月10日	6个月	新股流通受限	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40		-
301439	泓淋	2023年	6个月	新股流	19.99	16.90	835	16,691.65	14,111.50		-

	电力	3月10日		通受限							
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	2,879	166,003.14	166,003.14		-
301486	致尚科技	2023年6月30日	6个月	新股流通受限	57.66	57.66	320	18,451.20	18,451.20		-
301488	豪恩汽电	2023年6月26日	1个月内(含)	新股未上市	39.78	39.78	2,356	93,721.68	93,721.68		-
301488	豪恩汽电	2023年6月26日	6个月	新股流通受限	39.78	39.78	262	10,422.36	10,422.36		-
601061	中信金属	2023年3月30日	6个月	新股流通受限	6.58	7.58	1,946	12,804.68	14,750.68		-
601065	江盐集团	2023年3月31日	6个月	新股流通受限	10.36	11.84	626	6,485.36	7,411.84		-
601133	柏诚股份	2023年3月31日	6个月	新股流通受限	11.66	12.26	552	6,436.32	6,767.52		-
603125	常青科技	2023年3月30日	6个月	新股流通受限	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80		-
603135	中重科技	2023年3月29日	6个月	新股流通受限	17.80	17.89	628	11,178.40	11,234.92		-
603137	恒尚节能	2023年4月10日	6个月	新股流通受限	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51		-
603172	万丰股份	2023年4月28日	6个月	新股流通受限	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86		-
688146	中船特气	2023年4月13日	6个月	新股流通受限	36.15	38.13	613	22,159.95	23,373.69		-
688249	晶合集成	2023年4月24日	6个月	新股流通受限	19.86	18.06	4,023	79,896.78	72,655.38		-
688334	西高院	2023年6月9日	6个月	新股流通受限	14.16	16.21	888	12,574.08	14,394.48		-

688352	顾中科技	2023年 4月11日	6个月	新股流 通受限	12.10	12.07	1,685	20,388.50	20,337.95	-
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	695	16,402.00	44,945.65	-
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	798	30,228.24	23,533.02	-
688458	美芯 晟	2023年 5月15日	6个月	新股流 通受限	75.00	90.76	221	16,575.00	20,057.96	-
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	7,425	42,248.25	40,169.25	-
688472	阿特 斯	2023年 6月2日	6个月	新股流 通受限	11.10	17.04	2,665	29,581.50	45,411.60	-
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	144	23,819.32	17,583.84	索辰科技于2023年6月20日每10股送4.8股
688523	航天 环宇	2023年 5月26日	6个月	新股流 通受限	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20	-
688531	日联 科技	2023年 3月24日	6个月	新股流 通受限	152.38	135.97	214	32,609.32	29,097.58	-

		日									
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	311	13,581.37	16,498.55		-
688562	航天软件	2023年 5月15 日	6个月	新股流 通受限	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06		-
688570	天玛智控	2023年 5月29 日	6个月	新股流 通受限	30.26	25.33	765	23,148.90	19,377.45		-
688581	安杰思	2023年 5月12 日	6个月	新股流 通受限	125.80	118.03	163	20,505.40	19,238.89		-
688582	芯动联科	2023年 6月21 日	6个月	新股流 通受限	26.74	40.68	423	11,311.02	17,207.64		-
688593	新相微	2023年 5月25 日	6个月	新股流 通受限	11.18	14.59	959	10,721.62	13,991.81		-
688603	天承科技	2023年 6月30 日	1个月 内(含)	新股未 上市	55.00	55.00	1,251	68,805.00	68,805.00		-
688603	天承科技	2023年 6月30 日	6个月	新股流 通受限	55.00	55.00	140	7,700.00	7,700.00		-
688620	安凯微	2023年 6月15 日	6个月	新股流 通受限	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44		-
688629	华丰科技	2023年 6月16 日	6个月	新股流 通受限	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72		-
688631	莱斯信息	2023年 6月19 日	6个月	新股流 通受限	25.28	29.87	323	8,165.44	9,648.01		-

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，包括境内依法发行或上市交易的股票(包含主板，中小板，创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票)，内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通标的股票”)，存托凭证，债券(含国债，金融债，企业债，公司债，央行票据，政府支持机构债，地方政府债，中期票据，短期融资券，超短期融资券，次级债，可转换债券，可交换债券及其他中国证监会允许基金投资的债券)，债券回购，银行存款(包括协议存款，定期存款等)，货币市场工具，同业存单，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)。本基金可根据相关法律法规和基金合同的约定,参与融资业务。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。

于 2023 年 6 月 30 日,本基金未持有信用类债券(2022 年 12 月 31 日:未持有)。

#### 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

注：无。

#### 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期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

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

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

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	41,044,554.99	-	-	-	41,044,554.99
结算备付金	1,496,163.13	-	-	-	1,496,163.13
存出保证金	82,445.08	-	-	-	82,445.08
交易性金融资产	-	-	-	552,897,685.27	552,897,685.27
买入返售金融资产	-21,905.54	-	-	-	-21,905.54
应收申购款	-	-	-	246,820.14	246,820.14
应收清算款	-	-	-	66,440,858.31	66,440,858.31
资产总计	42,601,257.66	-	-	619,585,363.72	662,186,621.38
负债					
应付赎回款	-	-	-	22,133,609.24	22,133,609.24
应付管理人报酬	-	-	-	858,855.88	858,855.88
应付托管费	-	-	-	143,142.64	143,142.64
应付清算款	-	-	-	4,778.70	4,778.70
应付销售服务费	-	-	-	87,611.02	87,611.02
其他负债	-	-	-	416,561.74	416,561.74
负债总计	-	-	-	23,644,559.22	23,644,559.22
利率敏感度缺口	42,601,257.66	-	-	-595,940,804.50	638,542,062.16
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	42,443,708.76	-	-	-	42,443,708.76
结算备付金	12,551,802.90	-	-	-	12,551,802.90
存出保证金	96,182.32	-	-	-	96,182.32
交易性金融资产	-	-	-	437,590,662.99	437,590,662.99

买入返售金融资产	93,615,331.21	-	-	-	93,615,331.21
应收申购款	-	-	-	1,661.24	1,661.24
应收清算款	-	-	-	143,650.44	143,650.44
资产总计	148,707,025.19	-	-	437,735,974.67	586,442,999.86
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	114,005.09	114,005.09
应付管理人报酬	-	-	-	731,866.34	731,866.34
应付托管费	-	-	-	121,977.71	121,977.71
应付清算款	-	-	-	3,713,479.62	3,713,479.62
应付销售服务费	-	-	-	11,203.70	11,203.70
其他负债	-	-	-	742,539.49	742,539.49
负债总计	-	-	-	5,435,071.95	5,435,071.95
利率敏感度缺口	148,707,025.19	-	-	432,300,902.72	581,007,927.91

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

#### 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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇风险进行监控。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	46,355,050.44	-	46,355,050.44
资产合计	-	46,355,050.44	-	46,355,050.44
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇	-	46,355,050.44	-	46,355,050.44

风险敞口净额				
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	22,055,506.25	-	22,055,506.25
资产合计	-	22,055,506.25	-	22,055,506.25
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇 风险敞口净额	-	22,055,506.25	-	22,055,506.25

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以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	所有外币相对人民币 升值 5%	2,317,752.52	1,102,775.31
	所有外币相对人民币 贬值 5%	-2,317,752.52	-1,102,775.31

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：股票资产及存托凭证占基金资产的比例为 60%-95%(其中，投资于港股通标的股票占股票资产的比例不超过 50%)，其中投资于创新升级相关的证券占非现金资产的比例不低于 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金，存出保证金，应收申购款等。如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

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

#### 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	552,897,685.27	86.59	437,590,662.99	75.32
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	552,897,685.27	86.59	437,590,662.99	75.32

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	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额 (单位：人民币元)

	动	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%	15,382,478.28	15,411,235.29
	业绩比较基准下降 5%	-15,382,478.28	-15,411,235.29

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	551,111,401.69
第二层次	633,338.04
第三层次	1,152,945.54
合计	552,897,685.27

###### 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	552,897,685.27	83.50
	其中：股票	552,897,685.27	83.50
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-21,905.54	-0.00
	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	42,540,718.12	6.42
8	其他各项资产	66,770,123.53	10.08
9	合计	662,186,621.38	100.00

注：本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 46,355,050.44 元，占净值比 7.26%。

### 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	-	-

C	制造业	494,422,787.88	77.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.01
E	建筑业	9,143.03	0.00
F	批发和零售业	146,535.49	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	199,408.47	0.03
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	11,651,221.03	1.82
N	水利、环境和公共设施管理业	54,308.60	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	23,782.86	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	506,542,634.83	79.33

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
原材料	-	-
能源	-	-
金融	-	-
非日常生活消费品	-	-
日常消费品	-	-
医疗保健	46,355,050.44	7.26
信息技术	-	-
通信服务	-	-
房地产	-	-
工业	-	-
公用事业	-	-
合计	46,355,050.44	7.26

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

### 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	688235	百济神州-U	457,283	49,894,148.13	7.81
2	688197	首药控股-U	1,012,700	48,265,282.00	7.56
3	688428	诺诚健华-U	3,935,189	45,451,432.95	7.12

4	688331	荣昌生物	800,663	44,636,962.25	6.99
5	688578	艾力斯	1,062,603	28,637,150.85	4.48
6	688302	海创药业-U	493,717	26,226,247.04	4.11
7	002422	科伦药业	874,000	25,940,320.00	4.06
8	688192	迪哲医药-U	734,829	25,498,566.30	3.99
9	000661	长春高新	182,400	24,861,120.00	3.89
10	600161	天坛生物	826,600	22,442,190.00	3.51
11	688266	泽璟制药-U	480,556	22,369,881.80	3.50
12	688029	南微医学	269,794	22,004,398.64	3.45
13	01801	信达生物	708,500	19,335,395.77	3.03
14	09926	康方生物	383,000	12,482,733.32	1.95
15	000404	长虹华意	1,768,100	12,235,252.00	1.92
16	688315	诺禾致源	437,438	11,613,978.90	1.82
17	301101	明月镜片	273,900	11,238,117.00	1.76
18	000513	丽珠集团	279,300	10,867,563.00	1.70
19	688062	迈威生物-U	493,384	10,622,557.52	1.66
20	000521	长虹美菱	1,389,300	10,614,252.00	1.66
21	000333	美的集团	175,700	10,352,244.00	1.62
22	000651	格力电器	278,200	10,157,082.00	1.59
23	00013	和黄医药	554,000	9,418,726.40	1.48
24	002852	道道全	579,066	7,487,323.38	1.17
25	688687	凯因科技	213,463	6,297,158.50	0.99
26	600276	恒瑞医药	117,000	5,604,300.00	0.88
27	01167	加科思-B	944,100	5,118,194.95	0.80
28	000921	海信家电	187,400	5,050,430.00	0.79
29	601163	三角轮胎	274,600	4,357,902.00	0.68
30	002959	小熊电器	10,800	901,800.00	0.14
31	688443	智翔金泰-U	7,972	245,281.36	0.04
32	688582	芯动联科	4,226	195,378.19	0.03
33	301486	致尚科技	3,199	184,454.34	0.03
34	301291	明阳电气	5,529	179,377.19	0.03
35	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.02
36	688631	莱斯信息	3,228	104,234.81	0.02
37	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.02
38	301376	致欧科技	4,192	98,850.60	0.02
39	688429	时创能源	3,452	98,752.08	0.02
40	688420	美腾科技	2,408	93,261.84	0.01
41	301170	锡南科技	2,496	92,283.70	0.01
42	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.01
43	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.01
44	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.01
45	688249	晶合集成	4,023	72,655.38	0.01
46	688485	九州一轨	3,580	54,308.60	0.01

47	688472	阿特斯	2,665	45,411.60	0.01
48	688361	中科飞测-U	695	44,945.65	0.01
49	688469	中芯集成-U	7,425	40,169.25	0.01
50	301325	曼恩斯特	364	39,293.80	0.01
51	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.01
52	301301	川宁生物	3,574	32,023.04	0.01
53	688531	日联科技	214	29,097.58	0.00
54	301358	湖南裕能	676	28,993.64	0.00
55	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
56	301303	真兰仪表	1,058	23,614.56	0.00
57	688146	中船特气	613	23,373.69	0.00
58	301368	丰立智能	337	23,317.03	0.00
59	301297	富乐德	1,015	22,847.65	0.00
60	688352	颀中科技	1,685	20,337.95	0.00
61	688458	美芯晟	221	20,057.96	0.00
62	688570	天玛智控	765	19,377.45	0.00
63	688581	安杰思	163	19,238.89	0.00
64	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.00
65	001287	中电港	858	18,035.16	0.00
66	688507	索辰科技	144	17,583.84	0.00
67	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00
68	688543	国科军工	311	16,498.55	0.00
69	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
70	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
71	301399	英特科技	293	15,110.01	0.00
72	301322	绿通科技	283	15,066.92	0.00
73	301408	华人健康	879	14,899.05	0.00
74	601061	中信金属	1,946	14,750.68	0.00
75	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
76	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
77	301439	泓淋电力	835	14,111.50	0.00
78	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
79	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
80	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
81	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
82	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
83	301262	海看股份	494	12,597.00	0.00
84	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00
85	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
86	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
87	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
88	603135	中重科技	628	11,234.92	0.00
89	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00

90	301345	涛涛车业	239	11,146.96	0.00
91	301290	东星医疗	330	10,576.50	0.00
92	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
93	301398	星源卓镁	255	9,562.50	0.00
94	301265	华新环保	819	9,516.78	0.00
95	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
96	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
97	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
98	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
99	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
100	301281	科源制药	337	8,458.70	0.00
101	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
102	301161	唯万密封	346	7,996.06	0.00
103	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
104	301295	美硕科技	215	7,755.05	0.00
105	601065	江盐集团	626	7,411.84	0.00
106	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
107	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
108	601133	柏诚股份	552	6,767.52	0.00
109	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
110	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
111	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
112	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
113	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
114	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
115	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	002422	科伦药业	25,867,666.03	4.45
2	688029	南微医学	24,425,131.24	4.20
3	600161	天坛生物	21,689,520.20	3.73
4	600030	中信证券	19,599,953.77	3.37
5	688315	诺禾致源	16,553,949.52	2.85
6	600958	东方证券	15,779,030.44	2.72
7	600390	五矿资本	14,417,154.00	2.48
8	09926	康方生物	14,156,902.66	2.44
9	301101	明月镜片	12,324,494.00	2.12
10	000404	长虹华意	12,078,304.75	2.08
11	000513	丽珠集团	10,444,439.00	1.80
12	000651	格力电器	10,303,981.00	1.77

13	000333	美的集团	10,297,571.50	1.77
14	000521	长虹美菱	10,262,124.00	1.77
15	688107	安路科技	9,373,199.06	1.61
16	01801	信达生物	8,922,992.73	1.54
17	002852	道道全	8,329,722.61	1.43
18	688062	迈威生物-U	8,285,584.98	1.43
19	601319	中国人保	7,751,054.00	1.33
20	688235	百济神州-U	7,268,416.87	1.25

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	000423	东阿阿胶	41,510,810.20	7.14
2	600085	同仁堂	41,164,222.75	7.08
3	600030	中信证券	17,589,260.15	3.03
4	688180	君实生物-U	15,997,810.73	2.75
5	600958	东方证券	13,687,763.64	2.36
6	600390	五矿资本	12,715,559.00	2.19
7	300015	爱尔眼科	11,518,362.09	1.98
8	688107	安路科技	8,058,721.97	1.39
9	688276	百克生物	7,677,780.87	1.32
10	601319	中国人保	7,541,935.00	1.30
11	688150	莱特光电	6,427,714.51	1.11
12	688561	奇安信-U	6,411,170.11	1.10
13	300533	冰川网络	6,014,564.50	1.04
14	688981	中芯国际	5,395,430.17	0.93
15	300508	维宏股份	5,009,297.40	0.86
16	688112	鼎阳科技	4,721,058.30	0.81
17	688031	星环科技-U	4,397,453.45	0.76
18	301301	川宁生物	4,008,555.00	0.69
19	301076	新瀚新材	3,951,383.98	0.68
20	06862	海底捞	3,933,869.33	0.68

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	417,092,269.78
卖出股票收入（成交）总额	269,145,840.97

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

注：无。

## 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

注：无。

## 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

上海艾力斯医药科技股份有限公司在报告编制日前一年内受到上海市浦东新区城市管理行政执法局的处罚。

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	82,445.08
2	应收清算款	66,440,858.31

3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	246,820.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	66,770,123.53

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

#### 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 (%)
鹏华创新升级混合 A	6,703	98,784.46	15,416,191.09	2.33	646,736,044.52	97.67
鹏华创新升级混合 C	11,669	10,852.64	82,323,428.89	65.01	44,315,994.79	34.99
合计	18,372	42,934.45	97,739,619.98	12.39	691,052,039.31	87.61

### 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	鹏华创新升级混合 A	1,459,777.96	0.2205
	鹏华创新升级混合 C	11,006.39	0.0087
	合计	1,470,784.35	0.1865

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

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

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	鹏华创新升级混合 A	鹏华创新升级混合 C
基金合同生效日 (2021 年 6 月 18 日) 基金份额总额	792,104,732.90	35,737,542.70
本报告期期初基金份额总额	669,823,588.97	20,095,082.14
本报告期基金总申购份额	48,895,900.53	336,974,157.30
减：本报告期基金总赎回份额	56,567,253.89	230,429,815.76
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	662,152,235.61	126,639,423.68

## § 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 (%)	
兴业证券	1	194,980,666.58	28.91	182,553.51	29.84	-
东吴证券	2	167,997,450.24	24.91	154,775.79	25.30	-
华西证券	2	134,735,715.89	19.98	110,657.00	18.09	-
国泰君安	2	76,446,653.61	11.33	70,429.70	11.51	-
国信证券	2	75,139,850.59	11.14	69,682.78	11.39	-
中信建投证券	1	18,677,965.53	2.77	17,210.27	2.81	-
招商证券	1	6,530,370.65	0.97	6,530.37	1.07	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	本报告期新增
华林证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券	4	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中邮证券	1	-	-	-	-	本报告期新增

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 (%)
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
东吴证 券	-	-	1,802,949,00 0.00	28.05	-	-
华西证 券	-	-	3,851,060,00 0.00	59.91	-	-
国泰君 安	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	479,276,000. 00	7.46	-	-
中信建 投证券	-	-	294,893,000. 00	4.59	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
国元证 券	-	-	-	-	-	-

海通证 券	-	-	-	-	-	-
华林证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源证券	-	-	-	-	-	-
西部证 券	-	-	-	-	-	-
银河证 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	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	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	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 01 月 05 日
3	鹏华创新升级混合型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	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	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	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	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 03 月 14 日
6	鹏华创新升级混合型证券投资基金 2022 年年度报告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	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	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 04 月 07 日
8	鹏华创新升级混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 04 月 21 日
9	鹏华创新升级混合型证券投资基金更新的招募说明书	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 05 月 12 日
10	鹏华创新升级混合型证券投资基金（A 类基金份额）基金产品资料概要（更	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基	2023 年 05 月 12 日

	新)	金电子披露网站	
11	鹏华创新升级混合型证券投资基金(C类基金份额)基金产品资料概要(更新)	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023年05月12日
12	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	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023年05月17日
13	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	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023年05月19日
14	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	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023年06月03日
15	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	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023年06月05日
16	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023年06月06日
17	鹏华创新升级混合型证券投资基金基金合同	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023年06月16日
18	鹏华创新升级混合型证券投资基金托管协议	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023年06月16日
19	鹏华基金管理有限公司关于调整旗下27只基金投资范围并相应修改法律文件的公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023年06月16日
20	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与北京中植基金销售有限公司申购(含定期定额投资)费率优惠活动的公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023年06月20日
21	鹏华创新升级混合型证券投资基金更新的招募说明书(2023年第1号)	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023年06月21日
22	鹏华创新升级混合型证券投资基金(A类基金份额)基金产品资料概要(更新)	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023年06月21日
23	鹏华创新升级混合型证券投资基金(C类基金份额)基金产品资料概要(更新)	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023年06月21日
24	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	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基	2023年06月28日

	的公告	金电子披露网站	
--	-----	---------	--

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)《鹏华创新升级混合型证券投资基金基金合同》；
- (二)《鹏华创新升级混合型证券投资基金托管协议》；
- (三)《鹏华创新升级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