

鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金 2024 年中期报告

2024 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：招商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 29 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 08 月 28 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 2024 年 01 月 01 日起至 2024 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	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	9
3.3 其他指标	10
§ 4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	17
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	45
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	59
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	61
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	61
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	61

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	61
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	61
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	61
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	61
7.12 投资组合报告附注	62
§ 8 基金份额持有人信息	62
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	62
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	63
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	63
§ 9 开放式基金份额变动	63
§ 10 重大事件揭示	64
10.1 基金份额持有人大会决议	64
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	64
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	64
10.4 基金投资策略的改变	65
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	65
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	65
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	65
10.8 其他重大事件	68
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	70
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	70
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	70
§ 12 备查文件目录	70
12.1 备查文件目录	70
12.2 存放地点	71
12.3 查阅方式	71

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	鹏华睿投混合	
基金主代码	005434	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 5 月 30 日	
基金管理人	鹏华基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	143,298,163.69 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	鹏华睿投混合 A	鹏华睿投混合 C
下属分级基金的交易代码	005434	016950
报告期末下属分级基金的份额总额	131,941,534.98 份	11,356,628.71 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的基础上，力求取得超越基金业绩比较基准的收益。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金将通过跟踪考量通常的宏观经济变量（包括 GDP 增长率、CPI 走势、M2 的绝对水平和增长率、利率水平与走势等）以及各项国家政策（包括财政、货币、税收、汇率政策等）来判断经济周期目前的位置以及未来将发展的方向，在此基础上对各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估，制定股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>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）自上而下的行业遴选</p> <p>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</p>

	<p>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</p> <p>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。</p> <p>1) 定性分析</p> <p>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：</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>2) 定量分析</p> <p>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（市盈率）、PEG（市盈率相对盈利增长比率）、PB（市账率）、PS（市销率）、EV/EBITDA（企业价值倍数）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>(3) 存托凭证投资策略</p> <p>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</p> <p>本基金债券投资将采取久期策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、个券选择策略、信用策略等积极投资策略，自上而下地管理组合的久期，灵活地调整组合的券种搭配，同时精选个券，以增强组合的持有期收益。</p> <p>4、权证投资策略</p> <p>本基金通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型及价值挖掘策略、价差策略、双向权证策略等寻求权证的合理估值水平，追求稳定的当期收益。</p> <p>5、中小企业私募债投资策略</p> <p>中小企业私募债券是在中国境内以非公开方式发行和转让，约定在一定期限还本付息的公司债券。由于其非公开性及条款可协商性，普遍具有较高收益。本基金将深入研究发行人资信及公司运营情况，合理合规合格地进行中小企业私募债券投资。本基金在投资过程中密切监控债券信用等级或发行人信用等级变化情况，尽力规避风险，并获取超额收益。</p> <p>6、股指期货投资策略</p> <p>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</p>
--	--

	<p>好、交易活跃的股指期货合约，充分考虑股指期货的风险收益特征，通过多头或空头的套期保值策略，以改善投资组合的投资效果，实现股票组合的超额收益。</p> <p>7、国债期货投资策略</p> <p>为有效控制债券投资的系统性风险，本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的，适度运用国债期货，提高投资组合的运作效率。在国债期货投资时，本基金将首先分析国债期货各合约价格与最便宜可交割券的关系，选择定价合理的国债期货合约，其次，考虑国债期货各合约的流动性情况，最终确定与现货组合的合适匹配，以达到风险管理的目标。</p> <p>8、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>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%
风险收益特征	本基金属于混合型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金，低于股票型基金。

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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	高永杰	张姗
	联系电话	0755-81395402	400-61-95555
	电子邮箱	xxpl@phfund.com.cn	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		4006788999	400-61-95555
传真		0755-82021126	0755-83195201
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		518048	518040
法定代表人		张纳沙	缪建民

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	鹏华基金管理有限公司	深圳市福田区福华三路 168

号深圳国际商会中心第 43 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指标	报告期(2024年1月1日-2024年6月30日)	
	鹏华睿投混合 A	鹏华睿投混合 C
本期已实现收益	-33,340,331.18	-1,520,426.28
本期利润	-13,490,675.42	-669,886.76
加权平均基金份 额本期利润	-0.0743	-0.0573
本期加权平均净 值利润率	-5.82%	-6.92%
本期基金份额净 值增长率	-6.65%	-6.83%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2024年6月30日)	
期末可供分配利 润	31,448,954.97	-2,230,538.86
期末可供分配基 金份额利润	0.2384	-0.1964
期末基金资产净 值	163,390,489.95	9,126,089.85
期末基金份额净 值	1.2384	0.8036
3.1.3 累计期 末指标	报告期末(2024年6月30日)	
基金份额累计净 值增长率	45.94%	-19.64%

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

鹏华睿投混合 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	-5.10%	0.89%	-1.60%	0.28%	-3.50%	0.61%
过去三个月	-2.37%	1.08%	-0.49%	0.44%	-1.88%	0.64%
过去六个月	-6.65%	1.46%	2.37%	0.53%	-9.02%	0.93%
过去一年	-15.39%	1.19%	-3.42%	0.52%	-	0.67%
					11.97%	
过去三年	-22.57%	1.01%	-15.91%	0.62%	-6.66%	0.39%
自基金合同生效起至今	45.94%	1.11%	9.93%	0.73%	36.01%	0.38%

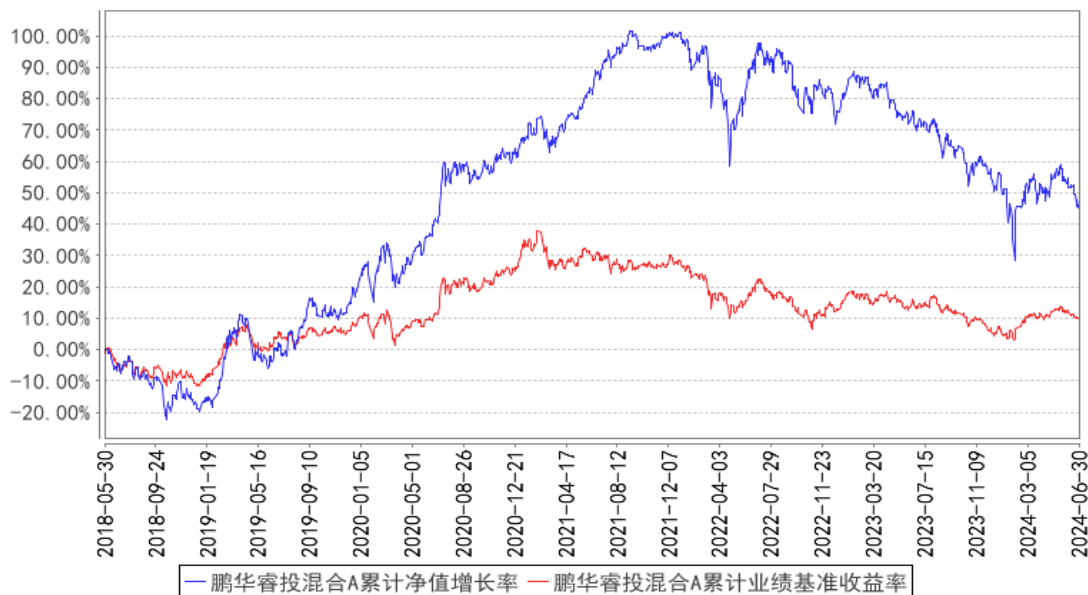
鹏华睿投混合 C

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	-5.14%	0.89%	-1.60%	0.28%	-3.54%	0.61%
过去三个月	-2.46%	1.08%	-0.49%	0.44%	-1.97%	0.64%
过去六个月	-6.83%	1.46%	2.37%	0.53%	-9.20%	0.93%
过去一年	-15.73%	1.19%	-3.42%	0.52%	-	0.67%
					12.31%	
自基金合同生效起至今	-19.64%	1.02%	-1.25%	0.55%	-	0.47%
					18.39%	

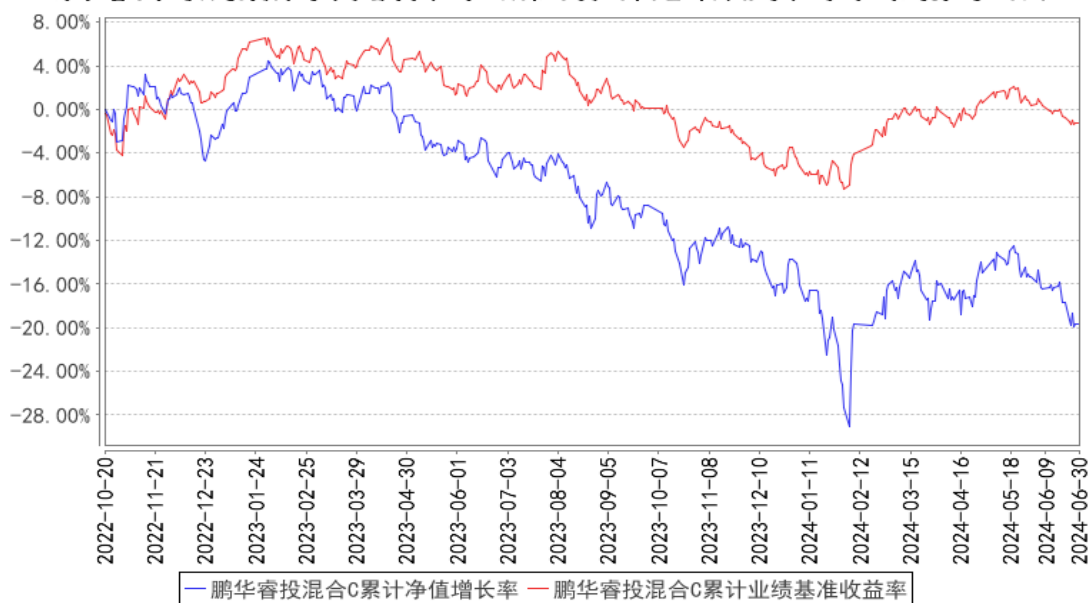
注：业绩比较基准=沪深 300 指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%

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

鹏华睿投混合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



鹏华睿投混合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 2018 年 05 月 30 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。截至本报告期末，公司资产管理总规模达到 12,020 亿元（联接基金不折算，不含投顾），公司管理着 324 只公募基金、13 只全国社保投资组合、8 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		
刘方正	基金经理	2018-05-30	-	14 年	刘方正先生，国籍中国，理学硕士，14 年证券从业经验。2010 年 6 月加盟鹏华基金管理有限公司，从事债券研究工作，历任固定收益部高级研究员、基金经理助理，现任稳定收益投资部副总经理/基金经理。2015 年 03 月至 2017 年 01 月担任鹏华弘利灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015 年 03 月至 2015 年 08 月担任鹏华行业成长证券投资基金基金经理，2015 年 04 月至 2017 年 01 月担任鹏华弘润灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015 年 05 月至今担任鹏华弘和灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015 年 05 月至今担任鹏华弘华灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015 年 05 月至 2017 年 01 月担任鹏华弘益灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015 年 06 月至 2017 年 01 月担任鹏华弘鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015 年 08 月至今担任鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金基金经理，2015 年 08 月至 2017 年 01 月担任鹏华弘泰灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 03 月至 2017 年 05 月担任鹏华弘实灵活配置混合型证

				<p>券投资基金基金经理，2016 年 03 月至 2018 年 05 月担任鹏华弘锐灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 03 月至 2022 年 12 月担任鹏华弘信灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 08 月至 2023 年 12 月担任鹏华弘达灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 08 月至 2017 年 12 月担任鹏华弘嘉灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 09 月至 2022 年 08 月担任鹏华弘惠灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 11 月至 2018 年 01 月担任鹏华兴裕定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 11 月至今担任鹏华兴泰定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 12 月至 2024 年 04 月担任鹏华兴悦定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017 年 09 月至 2018 年 08 月担任鹏华兴益定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2018 年 05 月至今担任鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2023 年 02 月至 2024 年 02 月担任鹏华永瑞一年封闭式债券型证券投资基金基金经理，2023 年 09 月至今担任鹏华弘实灵活配置混合型证券投资基金基金经理，刘方正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。</p>
--	--	--	--	---

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

2024 年上半年，宏观经济总需求延续 2023 年的弱趋势震荡走势，一季度相对较强，二季度略有回落，内需方面，基建投资和房地产投资都呈现偏弱的走势，地方政府化债过程中存在一定投资动力和意愿不足的情况，房地产的弱势趋势在政府适度的政策调整情况之下有一定的趋缓，但整体下行趋势仍然延续，其中随着限购限贷等政策的调整，一二线城市二手房成交量有所提升，但对一级市场的投资带动力量有限。在新质生产力为方向的鼓励和带动下，制造业整体投资仍保持一定韧性，尤其是外需为主的产业展现出一定积极信号，对整体需求有较为明显的支撑。整体来看，外需有一定亮点，内需稳步回落有一定支撑的表现。财政政策并没有明显积极发力的迹象，地方政府债发行节奏偏缓，投融资节奏向下半年有一定压缩。金融数据方面，社融整体也有一定调整，总量相比 2023 年有所控制，同比增速有所回落，投融资需求偏弱。2024 年上半年，权益市场经历了年初快速回落以后的反弹，以及二季度逐步再次走弱的过程，市场结构上来看，红利方向仍是市场集中度较高的方向，且确定性较好，虽有一定交易拥挤，但高分红逻辑仍然较强。其他类似低估值权重股也有较好支撑，在一季度短暂回调以后表现较为突出。成长方向以外需为主，TMT 中 AI 和电子等行业相对突出，内需消费等领域相对落后。债券收益率水平有持续回落的走势，中间虽有小幅上行，但十年以上的中长期利率品种都有较为明显的收益率回落。本基金以追求长期超越权益指数收益率水平，并同时降低净值波动率。目前阶段，权益指数处于历史中性估值分位数区间，操作方面保持相对中性的权益仓位水平，辅之以部分固定收益类资产，同时，积极参与新股、可转债、可交换债的网下申购获取增强收益。

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 A 类份额净值增长率为-6.65%，同期业绩比较基准增长率为 2.37%；

C 类份额净值增长率为-6.83%，同期业绩比较基准增长率为 2.37%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，我们认为内外需都有一定不确定性，外需来讲，高利率持续时间较长，对于投资的抑制逐步体现在经济层面，有一定调整的意愿，但中国制造业整体成本控制良好，具备长期竞争优势。内需生长动力不足，对宏观总需求影响体现在实体经济各个环节。其中，商旅活动出行等仍维持一定景气趋势，但单客消费能力有所回落，中高端消费场景逐步消失，房地产价格下跌带来净资产回落以后对整体消费产生的抑制趋势仍将持续。投资方面，制造业投资仍然稳定，基建方面也以中央项目为主保持一定支撑力量，房地产投资下行趋势会略有缓解，但趋势尚未结束。因此，总需求上仍然面对较弱的走势，政府主导的大规模投资刺激可能性仍然较低。需求不足的情况仍将维持一段时间。经济虽然存在一定自发修复动力，金融环境也将保持宽松，实体和金融体系流动性良好，央行仍会保持一定定力以防资金空转形成泡沫。在此环境下，我们认为权益市场整体趋势性机会较小，但底部区域在经历过去两年调整以后逐步确立，高分红和价值方向仍是值得期待和获取确定性收益机会的领域，成长方向的投资难度较大，依赖于外需和部分内需成长的行业方向仍然存在，但也许持续关注基本面的变化。消费电子、AI 等领域仍有长期耕耘的机会。债券基本面仍维持良好，持有期票息收益虽然为历史较低水平，但伴随美国降息周期临近，国内也存在一定降息空间，收益率有进一步回落的机会。未来我们仍将坚持以追求长期超越权益指数收益率水平，并同时降低净值波动率的投资策略。目前阶段，操作方面保持相对中性的权益仓位水平，辅之以部分固定收益类资产，同时，积极参与新股、可转债、可交换债的网下申购获取增强收益。

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、风控管理部、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，鹏华睿投混合 A 期末可供分配利润为 31,448,954.97 元，期末基金份额净值 1.2384 元；鹏华睿投混合 C 期末可供分配利润为-2,230,538.86 元，期末基金份额净值 0.8036 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。

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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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：鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	2,338,106.21	2,010,989.27
结算备付金		6,401,340.57	346,805.44
存出保证金		33,760.01	28,891.91
交易性金融资产	6.4.7.2	168,064,843.50	278,827,664.01
其中：股票投资		155,877,462.68	260,733,472.23
基金投资		-	-
债券投资		12,187,380.82	18,094,191.78
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	-	-
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		15,579.12	119,618.59
应收股利		-	-
应收申购款		4,662.83	10,326.17
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		176,858,292.24	281,344,295.39
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 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		3,360,000.00	929,904.68
应付清算款		112,563.49	-
应付赎回款		257,582.16	127,795.72

应付管理人报酬		179,292.07	316,138.81
应付托管费		29,882.02	52,689.79
应付销售服务费		3,125.51	1,601.71
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	399,267.19	296,799.34
负债合计		4,341,712.44	1,724,930.05
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	143,298,163.69	212,714,929.61
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	29,218,416.11	66,904,435.73
净资产合计		172,516,579.80	279,619,365.34
负债和净资产总计		176,858,292.24	281,344,295.39

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额为 143,298,163.69 份，其中鹏华睿投混合 A 基金份额总额为 131,941,534.98 份，基金份额净值 1.2384 元；鹏华睿投混合 C 基金份额总额为 11,356,628.71 份，基金份额净值 0.8036 元。

6.2 利润表

会计主体：鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-12,311,253.61	-5,405,586.98
1. 利息收入		30,159.80	853,425.56
其中：存款利息收入	6.4.7.13	30,159.80	612,256.08
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		-	241,169.48
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-33,195,057.51	-1,428,495.46
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-35,601,997.07	-6,356,565.72
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	157,618.94	151,659.59
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	2,249,320.62	4,776,410.67
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	20,700,195.28	-5,338,406.55
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	153,448.82	507,889.47
减：二、营业总支出		1,849,308.57	5,424,145.98
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,443,737.75	4,618,101.45
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	240,622.98	615,746.86
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	19,251.17	82,226.48
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		40,956.13	14,532.57
其中：卖出回购金融资产支出		40,956.13	14,532.57
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	104,740.54	93,538.62
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-14,160,562.18	-10,829,732.96
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-14,160,562.18	-10,829,732.96
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-14,160,562.18	-10,829,732.96

6.3 净资产变动表

会计主体：鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	212,714,929.61	-	66,904,435.73	279,619,365.34

资产				
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	212,714,929.61	-	66,904,435.73	279,619,365.34
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-69,416,765.92	-	-37,686,019.62	-107,102,785.54
(一)、综合收益总额	-	-	-14,160,562.18	-14,160,562.18
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-69,416,765.92	-	-23,525,457.44	-92,942,223.36
其中：1. 基金申购款	7,483,658.90	-	-803,903.50	6,679,755.40
2. 基金赎回款	-76,900,424.82	-	-22,721,553.94	-99,621,978.76
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	143,298,163.69	-	29,218,416.11	172,516,579.80
项目	上年度可比期间			
	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	419,743,913.92	-	198,525,950.20	618,269,864.12
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

二、本期期初净资产	419,743,913.92	-	198,525,950.20	618,269,864.12
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-56,668,225.90	-	-50,887,447.96	-107,555,673.86
(一)、综合收益总额	-	-	-10,829,732.96	-10,829,732.96
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-56,668,225.90	-	-40,057,715.00	-96,725,940.90
其中：1. 基金申购款	51,255,256.09	-	6,317,302.09	57,572,558.18
2. 基金赎回款	- 107,923,481.99	-	-46,375,017.09	-154,298,499.08
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	363,075,688.02	-	147,638,502.24	510,714,190.26

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

聂连杰

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

鹏华睿投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[2017]2061号《关于准予鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》准予,由鹏华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2018年5月30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 214,008,175.33 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，基金托管人为招商银行股份有限公司（以下简称：招商银行）。本基金于 2018 年 2 月 28 日至 2018 年 5 月 25 日募集。募集期间净认购资金人民币 213,393,912.52 元，认购资金在募集期间产生的利息人民币 614,262.81 元，募集的有效认购份额及利息结转的基金份额合计 214,008,175.33 份。上述募集资金已由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）验证，并出具了普华永道中天验字(2018)第 0256 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》、《鹏华睿投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 2024 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 2024 年 06 月 30 日的财务状况以及 2024 年上半年的经营成果和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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
活期存款	2,338,106.21
等于：本金	2,337,890.92
加：应计利息	215.29
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	2,338,106.21

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	180,121,040.60	-	155,877,462.68	- 24,243,577.92
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	11,942,640.00	184,980.82	12,187,380.82 59,760.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	11,942,640.00	184,980.82	12,187,380.82 59,760.00
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	192,063,680.60	184,980.82	168,064,843.50	- 24,183,817.92

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

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.8 其他资产

注：无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	968.27
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	298,845.02
其中：交易所市场	298,845.02
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	99,453.90
合计	399,267.19

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

鹏华睿投混合 A

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	207,189,920.81	207,189,920.81
本期申购	651,223.41	651,223.41
本期赎回（以“-”号填列）	-75,899,609.24	-75,899,609.24
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	131,941,534.98	131,941,534.98

鹏华睿投混合 C

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,525,008.80	5,525,008.80
本期申购	6,832,435.49	6,832,435.49
本期赎回（以“-”号填列）	-1,000,815.58	-1,000,815.58
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	11,356,628.71	11,356,628.71

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

鹏华睿投混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	102,413,448.75	-34,749,212.57	67,664,236.18
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	102,413,448.75	-34,749,212.57	67,664,236.18
本期利润	-33,340,331.18	19,849,655.76	-13,490,675.42
本期基金份额交易产生的变动数	-30,050,971.92	7,326,366.13	-22,724,605.79
其中：基金申购款	288,849.39	-118,312.61	170,536.78
基金赎回款	-30,339,821.31	7,444,678.74	-22,895,142.57
本期已分配利润	-	-	-
本期末	39,022,145.65	-7,573,190.68	31,448,954.97

鹏华睿投混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-341,482.24	-418,318.21	-759,800.45
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-341,482.24	-418,318.21	-759,800.45
本期利润	-1,520,426.28	850,539.52	-669,886.76
本期基金份额交易产生的变动数	-321,831.79	-479,019.86	-800,851.65
其中：基金申购款	-428,192.90	-546,247.38	-974,440.28
基金赎回款	106,361.11	67,227.52	173,588.63
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,183,740.31	-46,798.55	-2,230,538.86

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	7,412.75
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	22,528.27
其他	218.78
合计	30,159.80

注：其他包含认/申购款利息收入、结算保证金利息收入、风控金利息收入等。

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-35,601,997.07
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	-35,601,997.07

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 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	236,482,134.53
减：卖出股票成本总额	271,631,217.21
减：交易费用	452,914.39
买卖股票差价收入	-35,601,997.07

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 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	128,247.94
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	29,371.00
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	157,618.94

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
----	----

	2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	6,074,149.90
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	5,971,320.00
减：应计利息总额	73,458.90
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	29,371.00

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
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,249,320.62
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	2,249,320.62

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	20,700,195.28
股票投资	20,690,475.28
债券投资	9,720.00
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	20,700,195.28

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	153,390.61
基金转换费收入	58.21
合计	153,448.82

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 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	39,781.56
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行汇划费用	5,250.96
存托服务费	35.68
合计	104,740.54

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
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	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

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	4,930,000.00	1.02	-	-

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 2024年1月1日至2024年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,443,737.75	4,618,101.45
其中：应支付销售机构的客户维护费	223,131.48	512,804.31
应支付基金管理人的净管理费	1,220,606.27	4,105,297.14

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 1.20%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×1.20%÷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 2024年1月1日至2024年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	240,622.98	615,746.86

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20%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×0.20%/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		
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鹏华睿投混合 A	鹏华睿投混合 C	合计
鹏华基金公司	-	33.36	33.36
招商银行	-	8,782.92	8,782.92
合计	-	8,816.28	8,816.28
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	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		
	鹏华睿投混合 A	鹏华睿投混合 C	合计
鹏华基金公司	-	25.53	25.53
招商银行	-	10,574.48	10,574.48
合计	-	10,600.01	10,600.01

注：鹏华睿投混合 A 基金份额不支付销售服务费；支付基金销售机构的鹏华睿投混合 C 基金份额的销售服务费年费率为 0.4%，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×0.4%÷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 2024年1月1日至2024年6月 30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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
招商银行	2,338,106.21	7,412.75	3,514,310.69	51,755.85

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 2024年1月1日至2024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	603325	博隆技术	网下申购	303	21,955.38
上年度可比期间 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

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（2024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
001359	平安电工	2024年3月19日	6个月	新股流通受限	17.39	20.60	134	2,330.26	2,760.40	-

001379	腾达科技	2024年1月11日	6个月	新股流通受限	16.98	13.48	130	2,207.40	1,752.40	-
001387	雪祺电气	2024年1月4日	6个月	新股流通受限	15.38	15.25	173	2,045.54	2,638.25	雪祺电气于2024年6月3日每10股送3股
001389	广合科技	2024年3月26日	6个月	新股流通受限	17.43	34.56	142	2,475.06	4,907.52	-
301392	汇成真空	2024年5月28日	6个月	新股流通受限	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
301502	华阳智能	2024年1月26日	6个月	新股流通受限	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-
301536	星辰科技	2024年3月20日	6个月	新股流通受限	16.16	32.27	421	6,803.36	13,585.67	-
301538	骏鼎达	2024年3月13日	6个月	新股流通受限	55.82	91.24	123	4,912.16	11,222.52	骏鼎达于2024年5月22日每10股送4股
301539	宏鑫科技	2024年4月3日	6个月	新股流通受限	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-
301565	中	2024	6个月	新股	11.88	18.98	257	3,053.16	4,877.86	-

	仑新材	年6月13日		流通受限						
301566	达利凯普	2023年12月22日	6个月	新股流通受限	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-
301580	爱迪特	2024年6月19日	6个月	新股流通受限	44.95	65.93	84	3,775.80	5,538.12	-
301587	中瑞股份	2024年3月27日	6个月	新股流通受限	21.73	25.26	233	5,063.09	5,885.58	-
301588	美新科技	2024年3月6日	6个月	新股流通受限	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-
301589	诺瓦星云	2024年2月1日	6个月	新股流通受限	126.89	188.01	427	30,072.93	80,280.27	诺瓦星云于2024年5月30日每10股送8股
301591	肯特股份	2024年2月20日	6个月	新股流通受限	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-
601033	永兴股份	2024年1月11日	6个月	新股流通受限	16.20	15.96	322	5,216.40	5,139.12	-
603082	北自科技	2024年1月23日	6个月	新股流通受限	21.28	29.49	87	1,851.36	2,565.63	-
603285	键邦股	2024年6月28日	1个月内(含)	新股未上市	18.65	18.65	646	12,047.90	12,047.90	-

	份	日								
603285	键邦股份	2024年6月28日	6个月	新股流通受限	18.65	18.65	72	1,342.80	1,342.80	-
603312	西典新能	2024年1月4日	6个月	新股流通受限	29.02	25.36	76	2,205.52	1,927.36	-
603325	博隆技术	2024年1月3日	6个月	新股流通受限	72.46	68.06	31	2,246.26	2,109.86	-
603341	龙旗科技	2024年2月23日	6个月	新股流通受限	26.00	37.49	125	3,250.00	4,686.25	-
603344	星德胜	2024年3月13日	6个月	新股流通受限	19.18	22.66	126	2,416.68	2,855.16	-
603350	安乃达	2024年6月26日	1个月内(含)	新股未上市	20.56	20.56	783	16,098.48	16,098.48	-
603350	安乃达	2024年6月26日	6个月	新股流通受限	20.56	20.56	87	1,788.72	1,788.72	-
603375	盛景微	2024年1月17日	6个月	新股流通受限	38.18	38.90	60	2,290.80	2,334.00	-
603381	永臻股份	2024年6月19日	6个月	新股流通受限	23.35	25.13	62	1,447.70	1,558.06	-
688530	欧莱新材	2024年4月29日	6个月	新股流通受限	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-
688584	上海合	2024年2月1日	6个月	新股流通受限	22.66	15.89	292	6,616.72	4,639.88	-

688691	晶 灿 芯 股 份	2024 年 4 月 2 日	6 个月	新股 流 通 受 限	19.86	42.51	195	3,872.70	8,289.45	-
688692	达 梦 数 据	2024 年 6 月 4 日	6 个月	新股 流 通 受 限	86.96	174.93	67	5,826.32	11,720.31	-
688695	中 创 股 份	2024 年 3 月 6 日	6 个月	新股 流 通 受 限	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
688709	成 都 华 微	2024 年 1 月 31 日	6 个月	新股 流 通 受 限	15.69	18.79	324	5,083.56	6,087.96	-

注：1、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中需要限售的部分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。

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、基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

4、基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后 6 个月内不得转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代 码	股票 名称	停牌 日期	停牌 原因	期末 估值 单价	复牌 日期	复牌 开盘 单价	数量 (股)	期末 成本总额	期末 估值 总额	备注
400174	中天 3	2023 年 08 月 30 日	重大事 项	0.00	-	-	122,400	229,425.32	0.00	-

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 2024 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 3,360,000.00 元,于 2024 年 07 月 01 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、超短期融资券、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、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内,使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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

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

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招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 2024 年 06 月 30 日，本基金未持有信用类债券（2023 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 2024 年 06 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额 3,360,000.00 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 2024 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	2,338,106.21	-	-	-	2,338,106.21
结算备付金	6,401,340.57	-	-	-	6,401,340.57
存出保证金	33,760.01	-	-	-	33,760.01
交易性金融资产	12,187,380.82	-	-	155,877,462.68	168,064,843.50
应收申购款	-	-	-	4,662.83	4,662.83
应收清算款	-	-	-	15,579.12	15,579.12

资产总计	20,960,587.61	-	-	-155,897,704.63	176,858,292.24
负债					
应付赎回款	-	-	-	257,582.16	257,582.16
应付管理人报酬	-	-	-	179,292.07	179,292.07
应付托管费	-	-	-	29,882.02	29,882.02
应付清算款	-	-	-	112,563.49	112,563.49
卖出回购金融资产款	3,360,000.00	-	-	-	3,360,000.00
应付销售服务费	-	-	-	3,125.51	3,125.51
其他负债	-	-	-	399,267.19	399,267.19
负债总计	3,360,000.00	-	-	981,712.44	4,341,712.44
利率敏感度缺口	17,600,587.61	-	-	-154,915,992.19	172,516,579.80
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	2,010,989.27	-	-	-	2,010,989.27
结算备付金	346,805.44	-	-	-	346,805.44
存出保证金	28,891.91	-	-	-	28,891.91
交易性金融资产	18,094,191.78	-	-	-260,733,472.23	278,827,664.01
应收申购款	-	-	-	10,326.17	10,326.17
应收清算款	-	-	-	119,618.59	119,618.59
资产总计	20,480,878.40	-	-	-260,863,416.99	281,344,295.39
负债					
应付赎回款	-	-	-	127,795.72	127,795.72
应付管理人报酬	-	-	-	316,138.81	316,138.81
应付托管费	-	-	-	52,689.79	52,689.79
卖出回购金融资产款	929,904.68	-	-	-	929,904.68
应付销售服务费	-	-	-	1,601.71	1,601.71
其他负债	-	-	-	296,799.34	296,799.34
负债总计	929,904.68	-	-	795,025.37	1,724,930.05
利率敏感度缺口	19,550,973.72	-	-	-260,068,391.62	279,619,365.34

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 2024 年 06 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 7.06%，因此当利率发生合理、可能的变动时，对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无。

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。基金的投资组合比例为：股票（含存托凭证）资产占基金资产的比例为 0%—95%；每个交易日日终在扣除股指期货和国债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%。

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 2024年6月30日		上年度末 2023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	155,877,462.68	90.36	260,733,472.23	93.25
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	155,877,462.68	90.36	260,733,472.23	93.25

注：债券投资为可转债、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。		
分析	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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	比较基准上涨 5% 资产净值变动	9,498,762.88	10,397,646.10
	比较基准下降 5% 资产净值变动	-9,498,762.88	-10,397,646.10

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 2024年6月30日
---------------	-------------------

第一层次	155,602,582.76
第二层次	12,218,658.72
第三层次	243,602.02
合计	168,064,843.50

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	155,877,462.68	88.14
	其中：股票	155,877,462.68	88.14
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	12,187,380.82	6.89
	其中：债券	12,187,380.82	6.89
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-

	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	8,739,446.78	4.94
8	其他各项资产	54,001.96	0.03
9	合计	176,858,292.24	100.00

注：报告期末本基金投资的存托凭证公允价值为：423,315.00 元，占净值比 0.25%。本报告所指的“股票”均包含存托凭证。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,003,950.00	0.58
B	采矿业	7,735,850.69	4.48
C	制造业	98,534,207.27	57.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,877,590.33	3.41
E	建筑业	1,479,689.00	0.86
F	批发和零售业	3,258,526.84	1.89
G	交通运输、仓储和邮政业	3,489,031.13	2.02
H	住宿和餐饮业	224,770.00	0.13
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,193,674.94	5.91
J	金融业	14,915,137.02	8.65
K	房地产业	1,793,333.00	1.04
L	租赁和商务服务业	1,955,586.12	1.13
M	科学研究和技术服务业	1,161,563.92	0.67
N	水利、环境和公共设施管理业	741,967.42	0.43
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	221,850.00	0.13
Q	卫生和社会工作	699,870.00	0.41
R	文化、体育和娱乐业	2,241,681.00	1.30
S	综合	349,184.00	0.20
	合计	155,877,462.68	90.36

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	公允价值（元）	占基金资产净值比例
----	------	------	----	---------	-----------

	码		(股)		(%)
1	300502	新易盛	17,400	1,836,570.00	1.06
2	002463	沪电股份	33,800	1,233,700.00	0.72
3	002028	思源电气	16,150	1,080,435.00	0.63
4	601058	赛轮轮胎	73,500	1,029,000.00	0.60
5	002422	科伦药业	33,700	1,022,121.00	0.59
6	601168	西部矿业	51,200	919,040.00	0.53
7	300394	天孚通信	10,260	907,189.20	0.53
8	600066	宇通客车	35,100	905,580.00	0.52
9	000975	银泰黄金	55,040	896,601.60	0.52
10	000933	神火股份	43,900	888,097.00	0.51
11	002340	格林美	139,100	886,067.00	0.51
12	601077	渝农商行	172,300	864,946.00	0.50
13	600160	巨化股份	34,720	837,793.60	0.49
14	000988	华工科技	27,200	814,096.00	0.47
15	688169	石头科技	2,000	785,200.00	0.46
16	002384	东山精密	37,200	770,040.00	0.45
17	002966	苏州银行	101,730	762,975.00	0.44
18	000630	铜陵有色	210,300	759,183.00	0.44
19	000423	东阿阿胶	12,000	751,200.00	0.44
20	600418	江淮汽车	47,300	749,232.00	0.43
21	600988	赤峰黄金	44,800	732,032.00	0.42
22	300418	昆仑万维	22,700	731,848.00	0.42
23	600157	永泰能源	616,900	727,942.00	0.42
24	601233	桐昆股份	45,200	721,392.00	0.42
25	002532	天山铝业	88,700	719,357.00	0.42
26	002625	光启技术	41,000	711,350.00	0.41
27	002600	领益智造	95,000	676,400.00	0.39
28	600096	云天化	34,800	675,816.00	0.39
29	002156	通富微电	28,800	644,832.00	0.37
30	601555	东吴证券	109,100	643,690.00	0.37
31	002078	太阳纸业	45,600	636,120.00	0.37
32	601128	常熟银行	83,380	631,186.60	0.37
33	002273	水晶光电	36,800	624,864.00	0.36
34	600352	浙江龙盛	71,700	615,903.00	0.36
35	600161	天坛生物	25,200	614,880.00	0.36
36	300207	欣旺达	40,300	611,351.00	0.35
37	002138	顺络电子	22,200	609,612.00	0.35
38	600885	宏发股份	21,877	605,555.36	0.35
39	600398	海澜之家	64,900	599,676.00	0.35
40	601108	财通证券	89,100	588,951.00	0.34
41	002353	杰瑞股份	16,600	582,328.00	0.34
42	000400	许继电气	16,900	581,529.00	0.34

43	600642	申能股份	65,300	576,599.00	0.33
44	002223	鱼跃医疗	15,200	571,520.00	0.33
45	002185	华天科技	70,100	571,315.00	0.33
46	600482	中国动力	29,300	570,764.00	0.33
47	600765	中航重机	27,360	558,144.00	0.32
48	301236	软通动力	15,700	552,797.00	0.32
49	600873	梅花生物	54,900	550,098.00	0.32
50	688099	晶晨股份	9,200	545,744.00	0.32
51	600177	雅戈尔	76,000	541,120.00	0.31
52	601577	长沙银行	66,100	540,698.00	0.31
53	600109	国金证券	71,500	539,825.00	0.31
54	300003	乐普医疗	36,000	534,240.00	0.31
55	603606	东方电缆	10,900	532,029.00	0.31
56	600079	人福医药	30,800	528,836.00	0.31
57	600415	小商品城	71,000	526,820.00	0.31
58	002128	电投能源	24,600	519,060.00	0.30
59	000783	长江证券	107,100	517,293.00	0.30
60	300136	信维通信	26,400	516,912.00	0.30
61	600497	驰宏锌锗	96,500	515,310.00	0.30
62	000932	华菱钢铁	115,480	511,576.40	0.30
63	600060	海信视像	20,500	507,170.00	0.29
64	300017	网宿科技	64,000	505,600.00	0.29
65	002739	万达电影	41,700	504,153.00	0.29
66	300866	安克创新	7,070	503,454.70	0.29
67	603160	汇顶科技	7,300	501,875.00	0.29
68	600985	淮北矿业	29,900	500,526.00	0.29
69	002517	恺英网络	52,100	497,555.00	0.29
70	600536	中国软件	16,506	493,859.52	0.29
71	600348	华阳股份	49,450	492,522.00	0.29
72	000009	中国宝安	56,940	489,684.00	0.28
73	002465	海格通信	47,100	487,956.00	0.28
74	000683	远兴能源	69,800	482,318.00	0.28
75	688122	西部超导	12,500	479,000.00	0.28
76	000878	云南铜业	38,400	478,464.00	0.28
77	002008	大族激光	22,800	474,240.00	0.27
78	002444	巨星科技	19,200	474,240.00	0.27
79	300012	华测检测	46,300	465,778.00	0.27
80	300144	宋城演艺	58,000	465,740.00	0.27
81	002409	雅克科技	7,400	465,534.00	0.27
82	000066	中国长城	53,200	465,500.00	0.27
83	002797	第一创业	91,400	465,226.00	0.27
84	601990	南京证券	60,400	463,872.00	0.27
85	601666	平煤股份	41,100	460,320.00	0.27

86	600839	四川长虹	101,800	457,082.00	0.26
87	000831	中国稀土	18,000	456,300.00	0.26
88	688120	华海清科	2,400	454,992.00	0.26
89	002673	西部证券	73,500	454,965.00	0.26
90	600529	山东药玻	17,900	453,586.00	0.26
91	600298	安琪酵母	16,000	446,880.00	0.26
92	601717	郑煤机	29,800	441,040.00	0.26
93	300474	景嘉微	6,950	439,448.50	0.25
94	002432	九安医疗	10,600	429,724.00	0.25
95	000728	国元证券	70,900	429,654.00	0.25
96	000960	锡业股份	27,700	429,073.00	0.25
97	000703	恒逸石化	60,500	428,945.00	0.25
98	000039	中集集团	46,300	428,738.00	0.25
99	603596	伯特利	11,000	427,900.00	0.25
100	688072	拓荆科技	3,552	426,630.72	0.25
101	002738	中矿资源	15,880	425,584.00	0.25
102	601997	贵阳银行	80,500	424,235.00	0.25
103	689009	九号公司-WD	11,500	423,315.00	0.25
104	603816	顾家家居	13,100	422,999.00	0.25
105	600862	中航高科	22,400	420,672.00	0.24
106	600282	南钢股份	84,100	418,818.00	0.24
107	601162	天风证券	191,900	418,342.00	0.24
108	002155	湖南黄金	23,100	418,110.00	0.24
109	601198	东兴证券	52,500	417,900.00	0.24
110	603338	浙江鼎力	6,900	416,898.00	0.24
111	002595	豪迈科技	10,900	416,053.00	0.24
112	600879	航天电子	53,500	415,695.00	0.24
113	601696	中银证券	45,500	413,140.00	0.24
114	603939	益丰药房	16,776	411,850.80	0.24
115	601179	中国西电	50,800	408,432.00	0.24
116	000723	美锦能源	85,400	406,504.00	0.24
117	688188	柏楚电子	2,200	406,010.00	0.24
118	300395	菲利华	13,200	405,900.00	0.24
119	600863	内蒙华电	87,300	405,072.00	0.23
120	600521	华海药业	23,700	404,085.00	0.23
121	300037	新宙邦	14,140	403,838.40	0.23
122	002472	双环传动	18,200	400,764.00	0.23
123	600546	山煤国际	27,400	400,588.00	0.23
124	600549	厦门钨业	23,200	400,200.00	0.23
125	600895	张江高科	21,600	399,168.00	0.23
126	600141	兴发集团	20,920	399,153.60	0.23
127	600038	中直股份	9,700	398,767.00	0.23
128	002195	岩山科技	158,392	397,563.92	0.23

129	002294	信立泰	14,900	396,787.00	0.23
130	600699	均胜电子	26,760	396,583.20	0.23
131	002281	光迅科技	10,600	396,122.00	0.23
132	300724	捷佳伟创	7,300	394,273.00	0.23
133	600369	西南证券	109,300	391,294.00	0.23
134	300285	国瓷材料	21,800	389,130.00	0.23
135	600820	隧道股份	59,500	388,535.00	0.23
136	300699	光威复材	15,620	387,844.60	0.22
137	002262	恩华药业	16,200	384,588.00	0.22
138	300001	特锐德	19,100	384,292.00	0.22
139	000021	深科技	25,400	384,048.00	0.22
140	002064	华峰化学	53,200	381,444.00	0.22
141	603589	口子窖	9,700	380,143.00	0.22
142	300058	蓝色光标	69,500	378,080.00	0.22
143	300146	汤臣倍健	27,900	378,045.00	0.22
144	601000	唐山港	79,900	375,530.00	0.22
145	600155	华创云信	63,100	372,921.00	0.22
146	601966	玲珑轮胎	20,200	371,074.00	0.22
147	300114	中航电测	8,200	371,050.00	0.22
148	300073	当升科技	10,800	370,548.00	0.21
149	600486	扬农化工	6,550	369,747.50	0.21
150	600153	建发股份	41,200	367,916.00	0.21
151	600704	物产中大	84,600	367,164.00	0.21
152	600118	中国卫星	16,500	366,795.00	0.21
153	600021	上海电力	37,000	365,930.00	0.21
154	002756	永兴材料	10,200	364,956.00	0.21
155	000623	吉林敖东	27,200	364,480.00	0.21
156	600170	上海建工	169,500	364,425.00	0.21
157	000513	丽珠集团	9,751	362,834.71	0.21
158	600499	科达制造	42,800	360,804.00	0.21
159	000598	兴蓉环境	47,900	360,208.00	0.21
160	000591	太阳能	75,800	357,018.00	0.21
161	000830	鲁西化工	30,800	356,972.00	0.21
162	002558	巨人网络	37,800	356,832.00	0.21
163	002152	广电运通	34,000	355,640.00	0.21
164	000738	航发控制	17,600	353,232.00	0.20
165	600583	海油工程	59,600	352,236.00	0.20
166	300529	健帆生物	12,900	351,009.00	0.20
167	002385	大北农	90,800	349,580.00	0.20
168	600673	东阳光	49,600	349,184.00	0.20
169	002439	启明星辰	20,000	345,200.00	0.20
170	605358	立昂微	14,800	342,472.00	0.20
171	600637	东方明珠	56,200	341,696.00	0.20

172	600143	金发科技	51,300	339,093.00	0.20
173	600516	方大炭素	78,300	337,473.00	0.20
174	600998	九州通	68,970	336,573.60	0.20
175	600392	盛和资源	38,900	335,318.00	0.19
176	300251	光线传媒	39,800	334,718.00	0.19
177	688180	君实生物-U	11,500	334,075.00	0.19
178	002372	伟星新材	21,660	333,997.20	0.19
179	300383	光环新网	39,500	333,775.00	0.19
180	300024	机器人	34,200	333,108.00	0.19
181	000519	中兵红箭	22,500	330,075.00	0.19
182	000729	燕京啤酒	37,300	329,359.00	0.19
183	002025	航天电器	7,100	329,298.00	0.19
184	000636	风华高科	25,100	327,806.00	0.19
185	300677	英科医疗	12,200	327,082.00	0.19
186	300373	扬杰科技	8,400	326,760.00	0.19
187	603225	新凤鸣	20,820	324,583.80	0.19
188	000629	钒钛股份	129,400	323,500.00	0.19
189	300088	长信科技	68,800	323,360.00	0.19
190	600909	华安证券	76,790	323,285.90	0.19
191	600008	首创环保	120,610	323,234.80	0.19
192	600970	中材国际	26,800	323,208.00	0.19
193	601665	齐鲁银行	65,400	321,114.00	0.19
194	002044	美年健康	84,600	319,788.00	0.19
195	002407	多氟多	26,080	318,958.40	0.18
196	000997	新大陆	22,900	318,539.00	0.18
197	600867	通化东宝	37,800	316,386.00	0.18
198	601456	国联证券	32,700	315,228.00	0.18
199	300604	长川科技	11,600	315,172.00	0.18
200	601016	节能风电	104,900	313,651.00	0.18
201	000883	湖北能源	51,600	310,116.00	0.18
202	600535	天士力	24,600	309,468.00	0.18
203	000750	国海证券	105,700	307,587.00	0.18
204	600498	烽火通信	19,300	306,870.00	0.18
205	600582	天地科技	44,500	306,605.00	0.18
206	600566	济川药业	9,630	305,367.30	0.18
207	600511	国药股份	9,900	304,821.00	0.18
208	600004	白云机场	31,900	302,412.00	0.18
209	000060	中金岭南	71,300	302,312.00	0.18
210	603000	人民网	15,000	299,850.00	0.17
211	601991	大唐发电	99,600	299,796.00	0.17
212	600166	福田汽车	132,400	297,900.00	0.17
213	600580	卧龙电驱	24,500	297,675.00	0.17
214	002120	韵达股份	38,400	297,216.00	0.17

215	002939	长城证券	44,200	296,140.00	0.17
216	002430	杭氧股份	13,300	295,925.00	0.17
217	300118	东方日升	24,400	295,240.00	0.17
218	601231	环旭电子	18,200	292,110.00	0.17
219	300601	康泰生物	18,700	291,907.00	0.17
220	600131	国网信通	17,300	291,851.00	0.17
221	002958	青农商行	107,800	288,904.00	0.17
222	300568	星源材质	35,200	288,640.00	0.17
223	000998	隆平高科	29,200	287,036.00	0.17
224	603568	伟明环保	13,935	286,782.30	0.17
225	600129	太极集团	9,900	286,308.00	0.17
226	002429	兆驰股份	59,400	285,714.00	0.17
227	000893	亚钾国际	17,616	284,674.56	0.17
228	603228	景旺电子	8,948	284,546.40	0.16
229	002926	华西证券	43,100	284,029.00	0.16
230	002497	雅化集团	31,800	283,656.00	0.16
231	688772	珠海冠宇	19,000	283,100.00	0.16
232	002508	老板电器	12,800	282,880.00	0.16
233	002065	东华软件	62,500	282,500.00	0.16
234	603077	和邦生物	170,900	281,985.00	0.16
235	600380	健康元	25,192	281,394.64	0.16
236	002500	山西证券	59,570	279,979.00	0.16
237	601636	旗滨集团	43,400	279,930.00	0.16
238	002414	高德红外	47,500	279,775.00	0.16
239	000027	深圳能源	38,320	279,736.00	0.16
240	601958	金铂股份	26,849	279,498.09	0.16
241	002653	海思科	9,100	279,370.00	0.16
242	600325	华发股份	42,800	278,200.00	0.16
243	300253	卫宁健康	47,000	277,300.00	0.16
244	603156	养元饮品	13,000	276,510.00	0.16
245	300487	蓝晓科技	6,600	275,616.00	0.16
246	600655	豫园股份	53,500	275,525.00	0.16
247	600563	法拉电子	3,591	273,562.38	0.16
248	300009	安科生物	32,032	273,553.28	0.16
249	002368	太极股份	12,120	273,306.00	0.16
250	002056	横店东磁	21,900	273,093.00	0.16
251	002936	郑州银行	157,397	272,296.81	0.16
252	603893	瑞芯微	4,600	272,182.00	0.16
253	688002	睿创微纳	9,700	271,309.00	0.16
254	002299	圣农发展	19,800	270,072.00	0.16
255	300390	天华新能	15,680	269,382.40	0.16
256	601866	中远海发	104,400	269,352.00	0.16
257	002670	国盛金控	31,593	267,592.71	0.16

258	002850	科达利	3,500	267,330.00	0.15
259	600707	彩虹股份	39,200	266,952.00	0.15
260	002507	涪陵榨菜	21,750	266,437.50	0.15
261	688728	格科微	22,000	266,420.00	0.15
262	600884	杉杉股份	32,800	266,336.00	0.15
263	002203	海亮股份	33,300	265,734.00	0.15
264	601880	辽港股份	214,700	264,081.00	0.15
265	000887	中鼎股份	21,400	261,936.00	0.15
266	600373	中文传媒	17,600	261,184.00	0.15
267	688114	华大智造	5,500	260,755.00	0.15
268	600755	厦门国贸	36,300	260,271.00	0.15
269	601611	中国核建	32,100	259,689.00	0.15
270	688390	固德威	4,620	259,274.40	0.15
271	603885	吉祥航空	23,500	258,265.00	0.15
272	603658	安图生物	5,600	257,992.00	0.15
273	600737	中粮糖业	26,900	257,971.00	0.15
274	300296	利亚德	56,800	255,600.00	0.15
275	002831	裕同科技	9,981	255,413.79	0.15
276	601156	东航物流	12,547	255,331.45	0.15
277	603379	三美股份	6,500	254,410.00	0.15
278	600859	王府井	21,600	253,584.00	0.15
279	600416	湘电股份	25,500	253,470.00	0.15
280	600995	南网储能	26,100	252,126.00	0.15
281	002506	协鑫集成	129,200	250,648.00	0.15
282	600399	抚顺特钢	44,500	250,535.00	0.15
283	300070	碧水源	59,600	249,724.00	0.14
284	002683	广东宏大	12,400	249,612.00	0.14
285	600390	五矿资本	61,500	249,075.00	0.14
286	600739	辽宁成大	29,700	248,589.00	0.14
287	600801	华新水泥	18,040	248,050.00	0.14
288	002373	千方科技	27,300	247,611.00	0.14
289	002019	亿帆医药	20,000	247,200.00	0.14
290	000050	深天马 A	33,900	246,792.00	0.14
291	300748	金力永磁	18,920	245,203.20	0.14
292	601598	中国外运	43,200	243,216.00	0.14
293	002244	滨江集团	33,400	242,484.00	0.14
294	002624	完美世界	31,900	242,440.00	0.14
295	002240	盛新锂能	17,900	240,218.00	0.14
296	002080	中材科技	18,600	239,940.00	0.14
297	603927	中科软	13,248	239,656.32	0.14
298	002131	利欧股份	167,200	239,096.00	0.14
299	002568	百润股份	14,200	238,986.00	0.14
300	300676	华大基因	6,800	238,068.00	0.14

301	601098	中南传媒	19,100	237,222.00	0.14
302	601933	永辉超市	95,500	236,840.00	0.14
303	600329	达仁堂	7,300	236,447.00	0.14
304	688052	纳芯微	2,300	236,394.00	0.14
305	002268	电科网安	16,600	236,218.00	0.14
306	600848	上海临港	25,800	235,038.00	0.14
307	600598	北大荒	18,800	234,812.00	0.14
308	603712	七一二	12,900	234,651.00	0.14
309	002487	大金重工	10,200	233,376.00	0.14
310	600901	江苏金租	46,040	232,502.00	0.13
311	000563	陕国投 A	84,000	231,000.00	0.13
312	001286	陕西能源	20,000	230,600.00	0.13
313	002572	索菲亚	15,000	229,950.00	0.13
314	300595	欧普康视	14,600	228,928.00	0.13
315	002557	洽洽食品	8,100	228,339.00	0.13
316	688538	和辉光电-U	115,300	228,294.00	0.13
317	000778	新兴铸管	65,500	227,940.00	0.13
318	600271	航天信息	30,900	227,424.00	0.13
319	600968	海油发展	54,900	226,188.00	0.13
320	600258	首旅酒店	18,200	224,770.00	0.13
321	000709	河钢股份	115,600	224,264.00	0.13
322	000581	威孚高科	13,700	223,036.00	0.13
323	002607	中公教育	145,000	221,850.00	0.13
324	600977	中国电影	20,600	221,656.00	0.13
325	688234	天岳先进	4,700	220,524.00	0.13
326	002032	苏泊尔	4,400	220,440.00	0.13
327	600959	江苏有线	83,000	219,120.00	0.13
328	603688	石英股份	7,400	219,114.00	0.13
329	600528	中铁工业	29,900	218,868.00	0.13
330	600062	华润双鹤	11,140	218,121.20	0.13
331	600435	北方导航	25,302	218,103.24	0.13
332	300558	贝达药业	6,700	218,085.00	0.13
333	688220	翱捷科技-U	5,800	217,268.00	0.13
334	601928	凤凰传媒	19,800	217,008.00	0.13
335	002408	齐翔腾达	38,720	216,832.00	0.13
336	600378	昊华科技	7,500	216,750.00	0.13
337	688385	复旦微电	6,900	216,522.00	0.13
338	002531	天顺风能	24,200	216,348.00	0.13
339	000547	航天发展	36,900	216,234.00	0.13
340	000825	太钢不锈	63,700	215,306.00	0.12
341	000739	普洛药业	15,700	213,049.00	0.12
342	603882	金域医学	7,800	212,082.00	0.12
343	601118	海南橡胶	46,600	212,030.00	0.12

344	688521	芯原股份	7,900	211,325.00	0.12
345	688301	奕瑞科技	1,820	209,718.60	0.12
346	000970	中科三环	27,300	208,845.00	0.12
347	600056	中国医药	20,340	205,840.80	0.12
348	300212	易华录	12,220	205,662.60	0.12
349	688032	禾迈股份	1,788	205,226.64	0.12
350	600906	财达证券	35,700	204,561.00	0.12
351	603456	九洲药业	14,878	204,126.16	0.12
352	600517	国网英大	47,100	203,943.00	0.12
353	300026	红日药业	66,700	203,435.00	0.12
354	688331	荣昌生物	4,700	203,040.00	0.12
355	000987	越秀资本	40,700	201,872.00	0.12
356	688200	华峰测控	2,200	201,850.00	0.12
357	002266	浙富控股	71,800	200,322.00	0.12
358	600316	洪都航空	12,000	199,560.00	0.12
359	603737	三棵树	5,460	198,034.20	0.11
360	000937	冀中能源	29,300	196,310.00	0.11
361	603444	吉比特	1,100	195,811.00	0.11
362	688536	思瑞浦	2,000	195,620.00	0.11
363	688567	孚能科技	20,300	194,880.00	0.11
364	601187	厦门银行	36,200	192,946.00	0.11
365	603529	爱玛科技	7,000	191,310.00	0.11
366	603883	老百姓	10,364	190,283.04	0.11
367	603650	彤程新材	6,400	189,120.00	0.11
368	688005	容百科技	8,100	188,568.00	0.11
369	001227	兰州银行	78,300	186,354.00	0.11
370	600208	新湖中宝	117,800	186,124.00	0.11
371	688082	盛美上海	2,200	185,922.00	0.11
372	600022	山东钢铁	151,200	184,464.00	0.11
373	003035	南网能源	41,900	184,360.00	0.11
374	601778	晶科科技	80,500	183,540.00	0.11
375	601298	青岛港	19,000	181,640.00	0.11
376	601608	中信重工	47,400	180,594.00	0.10
377	688516	奥特维	4,300	179,783.00	0.10
378	600663	陆家嘴	20,200	178,164.00	0.10
379	603233	大参林	12,360	176,748.00	0.10
380	300438	鹏辉能源	9,600	176,064.00	0.10
381	000089	深圳机场	27,500	175,725.00	0.10
382	600500	中化国际	49,960	174,360.40	0.10
383	002192	融捷股份	5,800	174,116.00	0.10
384	002468	申通快递	20,700	173,880.00	0.10
385	688208	道通科技	7,200	173,808.00	0.10
386	600377	宁沪高速	13,400	168,840.00	0.10

387	300244	迪安诊断	14,000	168,000.00	0.10
388	600967	内蒙一机	23,300	167,760.00	0.10
389	300776	帝尔激光	3,600	165,456.00	0.10
390	300888	稳健医疗	6,500	164,450.00	0.10
391	600350	山东高速	18,500	163,725.00	0.09
392	000559	万向钱潮	36,500	162,790.00	0.09
393	000156	华数传媒	25,900	162,652.00	0.09
394	600315	上海家化	9,100	161,798.00	0.09
395	688349	三一重能	6,500	161,460.00	0.09
396	688425	铁建重工	43,800	161,184.00	0.09
397	603517	绝味食品	10,400	160,160.00	0.09
398	002690	美亚光电	9,660	159,390.00	0.09
399	300682	朗新集团	18,600	158,286.00	0.09
400	603826	坤彩科技	5,460	158,176.20	0.09
401	601992	金隅集团	115,300	157,961.00	0.09
402	000537	中绿电	16,500	157,245.00	0.09
403	600126	杭钢股份	38,180	156,919.80	0.09
404	002511	中顺洁柔	22,600	156,392.00	0.09
405	002608	江苏国信	20,100	155,775.00	0.09
406	688063	派能科技	3,920	155,663.20	0.09
407	002867	周大生	11,850	154,761.00	0.09
408	603707	健友股份	12,900	153,252.00	0.09
409	003022	联泓新科	11,100	152,181.00	0.09
410	603026	石大胜华	4,500	152,100.00	0.09
411	603267	鸿远电子	4,400	150,040.00	0.09
412	600764	中国海防	7,600	149,188.00	0.09
413	600481	双良节能	31,800	148,506.00	0.09
414	688029	南微医学	2,400	147,744.00	0.09
415	000967	盈峰环境	34,900	147,627.00	0.09
416	600339	中油工程	46,100	143,832.00	0.08
417	603218	日月股份	13,800	141,726.00	0.08
418	688520	神州细胞-U	3,600	141,660.00	0.08
419	603786	科博达	2,200	141,130.00	0.08
420	000898	鞍钢股份	66,500	140,980.00	0.08
421	600095	湘财股份	23,600	140,656.00	0.08
422	002030	达安基因	27,966	139,830.00	0.08
423	603127	昭衍新药	10,496	139,281.92	0.08
424	002865	钧达股份	3,600	138,168.00	0.08
425	600808	马钢股份	67,700	136,754.00	0.08
426	600167	联美控股	25,993	135,423.53	0.08
427	002153	石基信息	22,874	131,068.02	0.08
428	000930	中粮科技	26,000	130,780.00	0.08
429	603185	弘元绿能	7,600	129,884.00	0.08

430	601228	广州港	41,500	126,575.00	0.07
431	688779	长远锂科	27,000	125,010.00	0.07
432	688281	华秦科技	1,500	124,980.00	0.07
433	000539	粤电力 A	24,500	124,460.00	0.07
434	002563	森马服饰	21,200	123,172.00	0.07
435	601568	北元集团	32,920	122,133.20	0.07
436	000401	冀东水泥	29,900	121,394.00	0.07
437	600928	西安银行	37,000	120,990.00	0.07
438	001203	大中矿业	12,500	120,125.00	0.07
439	001872	招商港口	6,200	119,350.00	0.07
440	000959	首钢股份	43,700	118,864.00	0.07
441	688006	杭可科技	6,600	115,170.00	0.07
442	001914	招商积余	11,400	114,228.00	0.07
443	300257	开山股份	11,300	114,130.00	0.07
444	000155	川能动力	10,500	113,085.00	0.07
445	603858	步长制药	7,400	112,110.00	0.06
446	603866	桃李面包	22,100	112,047.00	0.06
447	002518	科士达	6,300	111,510.00	0.06
448	003031	中瓷电子	2,380	110,051.20	0.06
449	603056	德邦股份	8,400	110,040.00	0.06
450	002925	盈趣科技	8,670	109,848.90	0.06
451	603305	旭升集团	10,300	108,768.00	0.06
452	300363	博腾股份	9,100	108,745.00	0.06
453	600299	安迪苏	10,800	104,760.00	0.06
454	601139	深圳燃气	15,600	104,208.00	0.06
455	300861	美畅股份	5,320	102,942.00	0.06
456	603317	天味食品	8,641	98,593.81	0.06
457	688690	纳微科技	5,600	97,272.00	0.06
458	688387	信科移动-U	19,200	96,768.00	0.06
459	688276	百克生物	3,400	96,458.00	0.06
460	600827	百联股份	13,000	95,940.00	0.06
461	301029	怡合达	4,860	95,547.60	0.06
462	300357	我武生物	4,600	93,012.00	0.05
463	600927	永安期货	8,200	91,430.00	0.05
464	688819	天能股份	3,800	90,668.00	0.05
465	002399	海普瑞	10,200	88,434.00	0.05
466	688778	厦钨新能	2,700	84,348.00	0.05
467	002326	永太科技	10,400	81,328.00	0.05
468	301589	诺瓦星云	427	80,280.27	0.05
469	000031	大悦城	34,300	80,262.00	0.05
470	000402	金融街	33,900	79,665.00	0.05
471	002791	坚朗五金	3,000	77,610.00	0.04
472	688295	中复神鹰	3,800	77,140.00	0.04

473	300850	新强联	5,100	76,602.00	0.04
474	002010	传化智联	19,800	76,032.00	0.04
475	002945	华林证券	7,300	72,854.00	0.04
476	688348	昱能科技	1,200	70,800.00	0.04
477	603355	莱克电气	3,198	69,076.80	0.04
478	600597	光明乳业	8,700	67,599.00	0.04
479	688153	唯捷创芯	1,800	66,600.00	0.04
480	688105	诺唯赞	3,300	66,033.00	0.04
481	000785	居然之家	26,400	64,152.00	0.04
482	688375	国博电子	900	63,576.00	0.04
483	301580	爱迪特	832	63,283.72	0.04
484	688248	南网科技	2,100	62,223.00	0.04
485	688107	安路科技	2,100	53,382.00	0.03
486	603868	飞科电器	1,200	46,080.00	0.03
487	600032	浙江新能	5,800	42,224.00	0.02
488	601828	美凯龙	16,000	40,800.00	0.02
489	601158	重庆水务	6,800	32,640.00	0.02
490	000553	安道麦 A	6,100	27,694.00	0.02
491	688361	中科飞测	572	27,055.60	0.02
492	600956	新天绿能	3,300	26,961.00	0.02
493	603350	安乃达	870	17,887.20	0.01
494	301536	星辰科技	421	13,585.67	0.01
495	603285	键邦股份	718	13,390.70	0.01
496	688692	达梦数据	67	11,720.31	0.01
497	301516	中远通	604	11,252.52	0.01
498	301538	骏鼎达	123	11,222.52	0.01
499	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.01
500	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.01
501	688652	京仪装备	216	8,443.44	0.00
502	688691	灿芯股份	195	8,289.45	0.00
503	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
504	688653	康希通信	566	7,290.08	0.00
505	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
506	688702	盛科通信-U	165	6,682.50	0.00
507	688648	中邮科技	303	6,617.52	0.00
508	301555	惠柏新材	224	6,345.92	0.00
509	688709	成都华微	324	6,087.96	0.00
510	301587	中瑞股份	233	5,885.58	0.00
511	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
512	301505	苏州规划	194	5,820.00	0.00
513	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
514	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
515	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00

516	601033	永兴股份	322	5,139.12	0.00
517	001389	广合科技	142	4,907.52	0.00
518	301565	中仑新材	257	4,877.86	0.00
519	603341	龙旗科技	125	4,686.25	0.00
520	688584	上海合晶	292	4,639.88	0.00
521	001378	德冠新材	168	4,008.48	0.00
522	601083	锦江航运	403	3,852.68	0.00
523	603193	润本股份	197	3,622.83	0.00
524	603273	天元智能	178	3,266.30	0.00
525	001326	联域股份	90	3,227.40	0.00
526	603107	上海汽配	186	2,955.54	0.00
527	603344	星德胜	126	2,855.16	0.00
528	001359	平安电工	134	2,760.40	0.00
529	001306	夏厦精密	51	2,753.49	0.00
530	001387	雪祺电气	173	2,638.25	0.00
531	603082	北自科技	87	2,565.63	0.00
532	603373	安邦护卫	88	2,419.12	0.00
533	603375	盛景微	60	2,334.00	0.00
534	603325	博隆技术	31	2,109.86	0.00
535	603312	西典新能	76	1,927.36	0.00
536	001379	腾达科技	130	1,752.40	0.00
537	603062	麦加芯彩	52	1,726.92	0.00
538	603381	永臻股份	62	1,558.06	0.00
539	600058	五矿发展	1	6.60	0.00
540	400174	中天 3	122,400	0.00	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	300502	新易盛	2,038,229.00	0.73
2	603737	三棵树	1,601,380.00	0.57
3	300394	天孚通信	1,551,124.00	0.55
4	688029	南微医学	1,451,463.41	0.52
5	688390	固德威	1,391,635.47	0.50
6	600329	达仁堂	1,342,738.00	0.48
7	603267	鸿远电子	1,228,510.00	0.44
8	601058	赛轮轮胎	1,126,119.00	0.40
9	002463	沪电股份	1,101,481.00	0.39
10	601168	西部矿业	1,088,584.00	0.39
11	002422	科伦药业	1,030,152.00	0.37
12	000975	银泰黄金	999,270.40	0.36
13	600399	抚顺特钢	978,914.00	0.35

14	000933	神火股份	976,406.00	0.35
15	002028	思源电气	937,924.50	0.34
16	600066	宇通客车	874,145.00	0.31
17	600160	巨化股份	829,891.00	0.30
18	300418	昆仑万维	819,564.00	0.29
19	301236	软通动力	809,050.00	0.29
20	000630	铜陵有色	807,364.00	0.29

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	603688	石英股份	13,347,858.00	4.77
2	600329	达仁堂	12,565,011.00	4.49
3	300724	捷佳伟创	9,258,415.00	3.31
4	601966	玲珑轮胎	8,945,186.00	3.20
5	002155	湖南黄金	8,655,515.80	3.10
6	603737	三棵树	8,650,450.14	3.09
7	688390	固德威	7,810,404.50	2.79
8	601958	金钼股份	7,542,286.00	2.70
9	688029	南微医学	6,433,371.53	2.30
10	688082	盛美上海	4,930,535.88	1.76
11	603267	鸿远电子	4,843,034.00	1.73
12	600863	内蒙华电	4,699,515.00	1.68
13	603927	中科软	4,692,884.50	1.68
14	000623	吉林敖东	4,620,056.53	1.65
15	688188	柏楚电子	4,493,919.99	1.61
16	600739	辽宁成大	4,284,949.00	1.53
17	688281	华秦科技	4,174,041.03	1.49
18	600487	亨通光电	3,720,281.00	1.33
19	002507	涪陵榨菜	3,386,738.20	1.21
20	600399	抚顺特钢	3,113,613.00	1.11

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	146,084,732.38
卖出股票收入（成交）总额	236,482,134.53

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	12,187,380.82	7.06
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	12,187,380.82	7.06

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	019709	23 国债 16	120,000	12,187,380.82	7.06

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

为有效控制债券投资的系统性风险，本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的，适度运用国债期货，提高投资组合的运作效率。在国债期货投资时，本基金将首先分析国债期货各合约价格与最便宜可交割券的关系，选择定价合理的国债期货合约，其次，考虑国债期货各合约的流动性情况，最终确定与现货组合的合适匹配，以达到风险管理的目标。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

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

思源电气股份有限公司在报告编制日前一年内受到中华人民共和国洋山港海事局的处罚。

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	33,760.01
2	应收清算款	15,579.12
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	4,662.83
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	54,001.96

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	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	(户)		持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
鹏华睿投 混合 A	1,714	76,978.73	91,083,302.71	69.03	40,858,232.27	30.97
鹏华睿投 混合 C	1,189	9,551.41	4,280,184.96	37.69	7,076,443.75	62.31
合计	2,903	49,362.10	95,363,487.67	66.55	47,934,676.02	33.45

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	鹏华睿投混合 A	795,206.43	0.6027
	鹏华睿投混合 C	100.00	0.0009
	合计	795,306.43	0.5550

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	鹏华睿投混合 A	-
	鹏华睿投混合 C	-
	合计	-
本基金基金经理持有 本开放式基金	鹏华睿投混合 A	50~100
	鹏华睿投混合 C	-
	合计	50~100

注：1、截至本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金份额。

2、截至本报告期末，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	鹏华睿投混合 A	鹏华睿投混合 C
----	----------	----------

基金合同生效日 (2018 年 5 月 30 日) 基金份额总额	214,008,175.33	-
本报告期期初基金 份额总额	207,189,920.81	5,525,008.80
本报告期基金总申 购份额	651,223.41	6,832,435.49
减: 本报告期基金 总赎回份额	75,899,609.24	1,000,815.58
本报告期基金拆分 变动份额	-	-
本报告期期末基金 份额总额	131,941,534.98	11,356,628.71

§ 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

基金管理人的重大人事变动:

本报告期内,公司原副总经理王宗合先生辞去本公司副总经理职务,经公司第六届董事会第二百零四次会议审议通过,董事会同意王宗合先生不再担任公司副总经理,离任日期为 2024 年 2 月 6 日。

本报告期内,公司原副总经理邢彪先生辞去本公司副总经理职务,经公司第六届董事会第二百一十七次会议审议通过,董事会同意邢彪先生不再担任公司副总经理,离任日期为 2024 年 4 月 11 日。

本报告期内,公司原董事长何如先生不再担任公司董事长。经公司 2024 年第三次临时股东会 and 第六届董事会第二百一十八次会议审议通过,股东会同意聘任张纳沙女士担任公司董事,董事会选举张纳沙女士担任公司董事长,任职日期自 2024 年 4 月 12 日起。

本公司已将上述变更事项报中国证券监督管理委员会深圳监管局备案。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动:

本报告期内,基金托管人无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

10.4 基金投资策略的改变

无。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未改聘为本基金审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人及相关责任人员
受到稽查或处罚等措施的时间	2024 年 4 月 19 日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会深圳监管局
受到的具体措施类型	责令改正及警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	个别规定未严格执行，个别业务内控管理不完善
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	管理人高度重视，按照法律法规及相关要求积极落实整改工作。截至报告日，上述事项已整改完毕
其他	-

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，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

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 (%)	
民生证券	2	147,397,372.40	38.64	123,210.44	39.72	-
广发证券	3	73,835,911.23	19.36	53,258.02	17.17	本报告期新增一个
东吴证券	1	59,852,367.25	15.69	49,157.96	15.85	-
天风证券	2	47,034,866.25	12.33	38,631.15	12.45	-
浙商证券	2	18,207,147.97	4.77	15,219.47	4.91	-
东方证券	2	16,478,737.	4.32	15,182.11	4.89	-

		05				
方正证券	2	11,804,181.98	3.09	9,868.59	3.18	-
开源证券	2	3,996,378.00	1.05	3,286.31	1.06	-
国海证券	2	2,844,708.76	0.75	2,377.93	0.77	-
信达证券	1	15,587.90	0.00	7.03	0.00	-
东北证券	1	4,494.56	0.00	4.21	0.00	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
东方财富证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国投证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
摩根大通证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投证券	1	-	-	-	-	-
中原证券	1	-	-	-	-	-

注：交易单元选择的标准和程序：

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

- (1) 实力雄厚，信誉良好；
- (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；
- (4) 合规风控能力较强，内部管理规范、严格，具备健全的内控制度；

(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) 交易、研究服务能力较强。

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。我公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、合规风控能力和交易、研究水平等后，向券商租用交易单元作为基金交易单元。

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 (%)
民生证券	1,000,091.00	16.67	10,000,000.00	2.06	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	5,000,600.00	83.33	112,940,000.00	23.30	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	254,890,000.00	52.60	-	-
方正证券	-	-	20,730,000.00	4.28	-	-
开源证券	-	-	41,380,000.00	8.54	-	-
国海证券	-	-	16,960,000.00	3.50	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	21,160,000.00	4.37	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-

光大证 券	-	-	-	-	-	-
国金证 券	-	-	-	-	-	-
国盛证 券	-	-	-	-	-	-
国投证 券	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	4,930,000.00	1.02	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
摩根大 通证券	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-
山西证 券	-	-	-	-	-	-
西南证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	1,630,000.00	0.34	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-
中信建 投证券	-	-	-	-	-	-
中原证 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	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购博隆技术首次公开发行 A 股的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 01 月 04 日
2	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 01 月 18 日
3	鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 01 月 19 日
4	鹏华基金管理有限公司关于旗下基	《中国证券报》、基金	2024 年 01 月 23 日

	金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	
5	鹏华基金管理有限公司关于暂停北京中期时代基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 02 月 02 日
6	鹏华基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 02 月 08 日
7	鹏华基金管理有限公司关于终止与北京中期时代基金销售有限公司销售合作关系的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 03 月 04 日
8	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与华福证券有限责任公司申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 03 月 16 日
9	鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金 2023 年年度报告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 03 月 28 日
10	鹏华基金管理有限公司关于旗下证券投资基金持有的股票估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 03 月 30 日
11	鹏华基金管理有限公司关于董事长变更的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 04 月 13 日
12	鹏华基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 04 月 13 日
13	鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 04 月 19 日
14	鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金更新的招募说明书	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 05 月 10 日
15	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 05 月 10 日
16	鹏华睿投灵活配置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）	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 05 月 10 日
17	鹏华睿投灵活配置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）	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 05 月 10 日
18	鹏华基金管理有限公司关于调整个人投资者开立基金账户证件类型	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会	2024 年 05 月 16 日

	公告	会基金电子披露网站	
19	鹏华基金管理有限公司关于调整旗下部分基金单笔最低赎回份额和账户最低份额余额限制的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 06 月 12 日
20	鹏华睿投灵活配置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）	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 06 月 28 日
21	鹏华睿投灵活配置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）	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 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	20240101~20240516	56,229,177.71	0.00	56,229,177.71	0.00	0.00
	2	20240530~20240630	32,868,274.72	0.00	0.00	32,868,274.72	22.94
	3	20240101~20240630	58,030,379.28	0.00	0.00	58,030,379.28	40.50
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)《鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；

(二)《鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；

(三)《鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金 2024 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

2024 年 8 月 29 日