

鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金 2026 年中期报告

2026 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：2026 年 8 月 28 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 月 27 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 2026 年 01 月 01 日起至 2026 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	13
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等内容真实、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	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	42
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
§ 8 基金份额持有人信息	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
8.2 盈利投资者数量占比	57
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	57
§ 9 开放式基金份额变动	57
§ 10 重大事件揭示	58
10.1 基金份额持有人大会决议	58
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	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
10.4 基金投资策略的改变	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	58
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	58
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	59
10.8 其他重大事件	62
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	63
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	63
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	64
§ 12 备查文件目录	64
12.1 备查文件目录	64
12.2 存放地点	64
12.3 查阅方式	64

§ 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	29,545,924.20 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	27,775,800.57 份	1,770,123.63 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	1、资产配置策略 本基金将通过跟踪考量通常的宏观经济变量（包括 GDP 增长率、CPI 走势、M2 的绝对水平和增长率、利率水平与走势等）以及各项国家政策（包括财政、货币、税收、汇率政策等）来判断经济周期目前的位置以及未来将发展的方向，在此基础上对各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估，制定股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。 2、股票投资策略 本基金通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘优质的公司，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。 （1）自上而下的行业遴选 本基金将自上而下地进行行业遴选，重点关注行业增长前景、行业利润前景和行业成功要素。对行业增长前景，主要分析行业的外部发展环境、行业的生命周期以及行业波动与经济周期的关系等；对行业利润前景，主要分析行业结构，特别是业内竞争的方式、业内竞争的激烈程度、以及业内厂商的谈判能力等。基于对

	行业结构的分析形成对业内竞争的关键成功要素的判断，为预测企业经营环境的变化建立起扎实的基础。 (2) 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（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。 (3) 存托凭证投资策略 本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。 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、权证投资策略 本基金通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型及价值挖掘策略、价差策略、双向权证策略等寻求权证的合理估值水平，追求稳定的当期收益。 5、中小企业私募债投资策略 中小企业私募债券是在中国境内以非公开方式发行和转让，约定在一定期限还本付息的公司债券。由于其非公开性及条款可协商性，普遍具有较高收益。本基金将深入研究发行人资信及公司运营情况，合理合规合格地进行中小企业私募债券投资。本基金在投资过程中密切监控债券信用等级或发行人信用等级变化情况，尽力规避风险，并获取超额收益。 6、股指期货投资策略 本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目标，选择流动性
--	--

	好、交易活跃的股指期货合约，充分考虑股指期货的风险收益特征，通过多头或空头的套期保值策略，以改善投资组合的投资效果，实现股票组合的超额收益。 7、国债期货投资策略 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。 8、资产支持证券的投资策略 本基金将综合运用战略资产配置和战术资产配置进行资产支持证券的投资组合管理，并根据信用风险、利率风险和流动性风险变化积极调整投资策略，严格遵守法律法规和基金合同的约定，在保证本金安全和基金资产流动性的基础上获得稳定收益。
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。

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		4006788533	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》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.phfund.com.cn
基金中期报告置备地点	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(2026 年 1 月 1 日-2026 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	32,462,917.72	870,948.58
本期利润	13,408,260.18	277,187.13
加权平均基金份 额本期利润	0.3230	0.1407
本期加权平均净 值利润率	16.15%	10.89%
本期基金份额净 值增长率	11.57%	11.35%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利 润	29,962,377.13	597,786.43
期末可供分配基 金份额利润	1.0787	0.3377
期末基金资产净 值	57,738,177.70	2,367,910.06
期末基金份额净 值	2.0787	1.3377
3.1.3 累计期 末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净 值增长率	144.97%	33.77%

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
过去三个月	8.40%	0.77%	7.66%	0.76%	0.74%	0.01%
过去六个月	11.57%	0.89%	5.56%	0.68%	6.01%	0.21%
过去一年	34.73%	0.89%	16.26%	0.61%	18.47%	0.28%
过去三年	42.02%	1.23%	24.65%	0.66%	17.37%	0.57%
过去五年	29.96%	1.11%	8.53%	0.66%	21.43%	0.45%
过去七年	145.93%	1.09%	36.48%	0.69%	109.45%	0.40%
自基金合同生效起至今	144.97%	1.14%	41.88%	0.73%	103.09%	0.41%

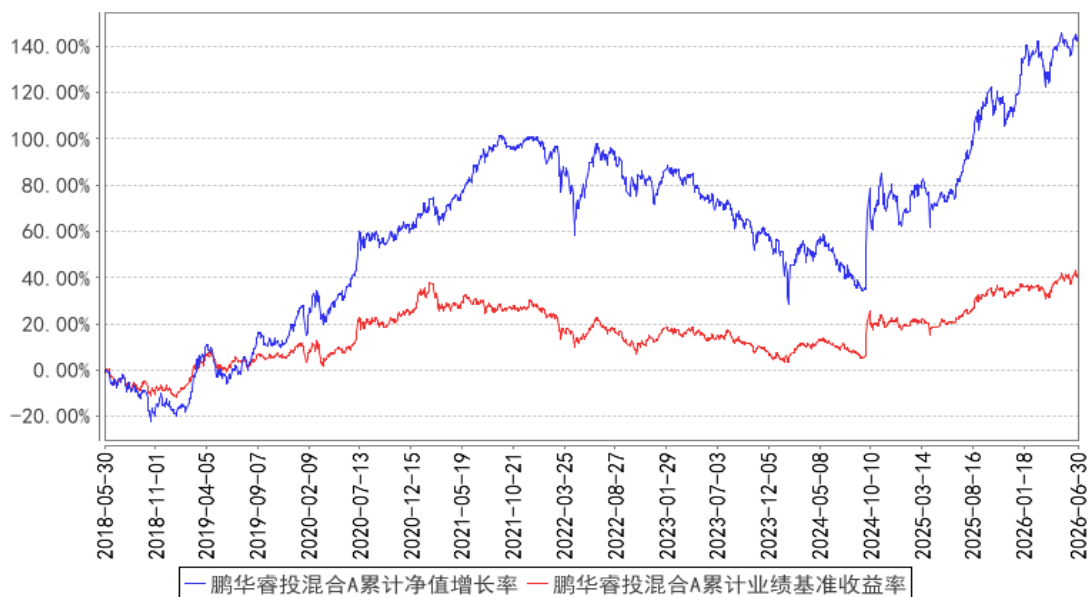
鹏华睿投混合 C

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
过去三个月	8.29%	0.77%	7.66%	0.76%	0.63%	0.01%
过去六个月	11.35%	0.89%	5.56%	0.68%	5.79%	0.21%
过去一年	34.15%	0.89%	16.26%	0.61%	17.89%	0.28%
过去三年	40.28%	1.23%	24.65%	0.66%	15.63%	0.57%
自基金合同生效起至今	33.77%	1.15%	27.45%	0.65%	6.32%	0.50%

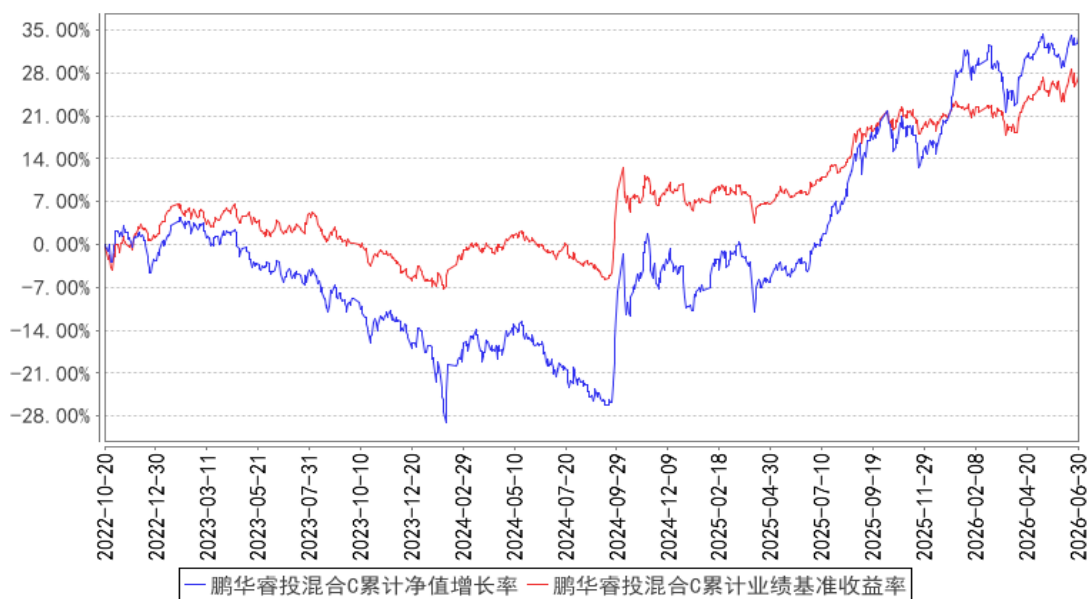
注：业绩比较基准=沪深 300 指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%。

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

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，公司管理资产总规模为 15,047 亿元，公司管理着 410 只公募基金，23 只社保基金、养老基金及划转资本组合。历经二十余年基金投资管理实践，公司在基金投资运作、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	本基金的基金经理	2018-05-30	—	16 年	刘方正先生，国籍中国，理学硕士，16 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 2025 年 07 月担任鹏华前海万科 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 2024 年 11 月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 2024 年 11 月担任鹏华弘实灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2024 年 07 月至今担任鹏华金城灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2024 年 09 月至今担任鹏华弘润灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2024 年 10 月至今担任鹏华丰盛稳固收益债券型证券投资基金基金经理，2025 年 07 月至今担任鹏华丰锐债券型证券投资基金（LOF）基金经理，2025 年 08 月至今担任鹏华宁华一年持有期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。
匡琪	本基金的基金经理助理	2025-06-26	-	11 年	匡琪女士，国籍中国，硕士研究生，11 年证券从业经验。2015 年 6 月加盟鹏华基金管理有限公司，历任登记结算部基金会计、高级基金会计，稳定收益投资部研究员，现从事投资研究工作。匡琪女士具备基金从业资格。

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。

3. 匡琪 2026 年 08 月 25 日离任本基金基金经理助理。

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

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行公平交易制度，确保不同投资组合在研究、交易、分配等各环节得到公平对待。公司对不同投资组合在不同时间窗口下（日内、3 日内、5 日内）的同向交易价差进行专项分析，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，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% 的交易共有 1 次，为投资组合的投资策略需要而发生的同日反向交易。

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

2026 年上半年，宏观经济维系弱复苏走势，经济整体下行压力仍在。结构上，房地产投资和销售仍对经济呈现一定拖累走势，随着年初信贷投放周期的结束，制造业和基建投资也呈现出一定的疲弱走势。高质量发展仍维持较为健康的投融资局面，科技领域的投资需求较好。消费方面，经过了年初的平稳走势以后，临近二季度末消费也有一定下行压力的体现。金融方面，货币整体保持宽松，并调控金融体系杠杆水平，但仍无法解决贷款需求不足问题，二季度的贷款节奏偏弱。

2026 年上半年，权益市场整体震荡上行，除了上证 50 冲高以后有所回落，其他主流股指都有明显的涨幅，以创业板和科创板为代表的科技成长表现非常强势，沪深 300、中证 500 和中证 1000 等指数过程中虽有回调，但整体也表现较好。债券方面，收益率曲线仍维持低位，且震荡幅度较小，中长端都有一定程度收益率回落。

本基金以追求长期与超越权益指数的收益率水平，并同时降低净值波动率。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。

4.4.2 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11.57%，同期业绩比较基准增长率为5.56%；C类份额净值增长率为11.35%，同期业绩比较基准增长率为5.56%。

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，宏观经济总需求偏弱的格局仍在持续，总供给相对充裕，产能和产量在国际市场上仍具备较强的竞争力，出口仍然是重要需求因素之一。总需求需要政策持续的投入和拉动，地产和基建等内需都仍将持续处于偏弱的状态之下。虽然短期看到由于股票市场上涨的财富效应带动消费和部分科技产业的投资活跃度有所回升，但从总量经济来看，居民和企业整体的提升杠杆的意愿和能力都相对有限，经济整体趋势性上行的动力仍显不足。

未来整体的流动性仍将保持充裕，宏观总需求恢复较为缓慢仍将保持低利率和高流动性维持一定时间，汇率上和对外资金流动上也相对风险可控。权益类资产仍将保持受益状况，整体投资机会仍在，目前仍需观察总体增长不足的情况下，是否会出现利润弹性不足以支撑估值弹性的状态，但结构性机会仍处于较强的活跃状态之中。债券方面，收益率曲线进一步上升的压力和空间有限，整体将保持平稳下行趋势。

本基金以追求长期与权益指数相接近的收益率水平，并同时降低净值波动率。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 29,962,377.13 元，期末基金份额净值 2.0787 元；鹏华睿投混合 C 期末可供分配利润为 597,786.43 元，期末基金份额净值 1.3377 元。

2、本基金本报告期内未进行利润分配。

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	12,227,436.91	21,644,427.30
结算备付金		27,097,794.35	19,071,637.61
存出保证金		32,441.66	21,447.55
交易性金融资产	6.4.7.2	20,950,787.09	109,894,111.68
其中：股票投资		20,950,787.09	109,894,111.68
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	-	-
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		-	7,738,894.42
应收股利		-	-
应收申购款		8,268.13	49,821.94
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		60,316,728.14	158,420,340.50
负债和净资产			
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		-	-
应付清算款		0.04	-
应付赎回款		53,989.21	198,254.19

应付管理人报酬		58,568.60	157,845.58
应付托管费		9,761.42	26,307.62
应付销售服务费		764.78	880.00
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	87,556.33	160,687.39
负债合计		210,640.38	543,974.78
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	29,545,924.20	85,525,128.19
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	30,560,163.56	72,351,237.53
净资产合计		60,106,087.76	157,876,365.72
负债和净资产总计		60,316,728.14	158,420,340.50

注： 报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额为 29,545,924.20 份，其中鹏华睿投混合 A 基金份额总额为 27,775,800.57 份，基金份额净值 2.0787 元；鹏华睿投混合 C 基金份额总额为 1,770,123.63 份，基金份额净值 1.3377 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：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		14,363,831.31	10,103,133.02
1. 利息收入		66,498.55	31,483.13
其中：存款利息收入	6.4.7.13	66,498.55	31,347.51
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		-	135.62
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以 “-” 填列）		33,937,065.88	2,588,345.97
其中：股票投资收益	6.4.7.14	33,799,437.08	996,341.11
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	30,408.77
资产支持证券投 资收益	6.4.7.16	-	-

贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	137,628.80	1,561,596.09
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	-19,648,418.99	7,167,551.47
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	8,685.87	315,752.45
减：二、营业总支出		678,384.00	1,654,383.52
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	512,356.40	1,270,884.65
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	85,392.70	211,814.07
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	5,056.07	86,622.42
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	8,428.38
其中：卖出回购金融资产支出		-	8,428.38
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	75,578.83	76,634.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		13,685,447.31	8,448,749.50
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		13,685,447.31	8,448,749.50
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		13,685,447.31	8,448,749.50

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：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 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	85,525,128.19	-	72,351,237.53	157,876,365.72

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	85,525,128.19	-	72,351,237.53	157,876,365.72
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-55,979,203.99	-	-41,791,073.97	-97,770,277.96
(一)、综合收益总额	-	-	13,685,447.31	13,685,447.31
(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)	-55,979,203.99	-	-55,476,521.28	-111,455,725.27
其中：1. 基金申购款	1,164,675.43	-	800,180.76	1,964,856.19
2. 基金赎回款	-57,143,879.42	-	-56,276,702.04	-113,420,581.46
(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	29,545,924.20	-	30,560,163.56	60,106,087.76
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	139,308,119.35	-	56,893,387.90	196,201,507.25
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

二、本期期初净资产	139,308,119.35	-	56,893,387.90	196,201,507.25
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-19,684,553.12	-	-3,883,403.44	-23,567,956.56
(一)、综合收益总额	-	-	8,448,749.50	8,448,749.50
(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)	-19,684,553.12	-	-12,332,152.94	-32,016,706.06
其中：1. 基金申购款	95,839,514.59	-	4,296,965.25	100,136,479.84
2. 基金赎回款	- 115,524,067.71	-	-16,629,118.19	-132,153,185.90
(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	119,623,566.23	-	53,009,984.46	172,633,550.69

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《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号—定期报告的内容与格式》、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《公开募集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》和《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》以及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 2026 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 2026 年 06 月 30 日的财务状况以及 2026 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

根据国务院令 第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》和财政部、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[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》、财税[2025] 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》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，截至 2027 年 12 月 31 日适用简易计税法方法，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，截至 2027 年 12 月 31 日免征增值税；对金融同业往来利息收入，截至 2027 年 12 月 31 日免征增值税；自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。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 2026 年 6 月 30 日
活期存款	12,227,436.91
等于：本金	12,226,295.22
加：应计利息	1,141.69
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	12,227,436.91

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	16,426,357.43	-	20,950,787.09	4,524,429.66
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	16,426,357.43	-	20,950,787.09	4,524,429.66

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

无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

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

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

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

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

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

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	96.89
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	15,555.38
其中：交易所市场	15,555.38
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	71,904.06
合计	87,556.33

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	83,292,292.26	83,292,292.26
本期申购	636,434.17	636,434.17
本期赎回（以“-”号填列）	-56,152,925.86	-56,152,925.86
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	27,775,800.57	27,775,800.57

鹏华睿投混合 C

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,232,835.93	2,232,835.93
本期申购	528,241.26	528,241.26
本期赎回（以“-”号填列）	-990,953.56	-990,953.56
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	1,770,123.63	1,770,123.63

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

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	40,790,016.59	31,111,465.17	71,901,481.76
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	40,790,016.59	31,111,465.17	71,901,481.76
本期利润	32,462,917.72	-19,054,657.54	13,408,260.18
本期基金份额交易产生的变动数	-41,157,948.81	-14,189,416.00	-55,347,364.81
其中：基金申购款	569,836.30	71,526.06	641,362.36
基金赎回款	-41,727,785.11	-14,260,942.06	-55,988,727.17
本期已分配利润	-	-	-
本期末	32,094,985.50	-2,132,608.37	29,962,377.13

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	-163,703.24	613,459.01	449,755.77
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-163,703.24	613,459.01	449,755.77
本期利润	870,948.58	-593,761.45	277,187.13
本期基金份额交易产生的变动数	-82,226.19	-46,930.28	-129,156.47
其中：基金申购款	84,213.64	74,604.76	158,818.40
基金赎回款	-166,439.83	-121,535.04	-287,974.87
本期已分配利润	-	-	-
本期末	625,019.15	-27,232.72	597,786.43

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	44,334.54
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	22,114.99
其他	49.02
合计	66,498.55

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 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	33,799,437.08
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	33,799,437.08

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 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出股票成交总额	146,849,082.77
减：卖出股票成本总额	112,878,142.16
减：交易费用	171,503.53
买卖股票差价收入	33,799,437.08

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

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

无。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

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

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

无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

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

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

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

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	137,628.80
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	137,628.80

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-19,648,418.99
股票投资	-19,648,418.99
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	-19,648,418.99

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	8,667.81
基金转换费收入	18.06
合计	8,685.87

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	12,396.69
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费用	3,660.39
存托服务费	14.38
合计	75,578.83

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、关联关系

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、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

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
----	--	---

当期发生的基金应支付的管理费	512,356.40	1,270,884.65
其中：应支付销售机构的客户维护费	95,556.60	221,169.30
应支付基金管理人的净管理费	416,799.80	1,049,715.35

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	85,392.70	211,814.07

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 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	-	5.76	5.76
招商银行	-	4,518.75	4,518.75
合计	-	4,524.51	4,524.51
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	-	43,936.03	43,936.03
招商银行	-	8,178.88	8,178.88
合计	-	52,114.91	52,114.91

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

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

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

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

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

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025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	12, 227, 436. 91	44, 334. 54	11, 936, 825. 74	19, 126. 07

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

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

无。

6.4.12 期末（2026 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

无。

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

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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 2026 年 06 月 30 日，本基金未持有信用类债券（2025 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

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

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 2026 年 06 月 30 日，本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30% (完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

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

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金持有的利率敏感性资产为银行存款、结算备付金，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 2026 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	12,227,436.91	-	-	-	12,227,436.91
结算备付金	27,097,794.35	-	-	-	27,097,794.35
存出保证金	32,441.66	-	-	-	32,441.66
交易性金融资产	-	-	-	20,950,787.09	20,950,787.09
应收申购款	-	-	-	8,268.13	8,268.13
资产总计	39,357,672.92	-	-	20,959,055.22	60,316,728.14
负债					
应付赎回款	-	-	-	53,989.21	53,989.21
应付管理人报酬	-	-	-	58,568.60	58,568.60
应付托管费	-	-	-	9,761.42	9,761.42
应付清算款	-	-	-	0.04	0.04
应付销售服务费	-	-	-	764.78	764.78
其他负债	-	-	-	87,556.33	87,556.33
负债总计	-	-	-	210,640.38	210,640.38
利率敏感度缺口	39,357,672.92	-	-	20,748,414.84	60,106,087.76
上年度末 2025 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	21,644,427.30	-	-	-	21,644,427.30
结算备付金	19,071,637.61	-	-	-	19,071,637.61
存出保证金	21,447.55	-	-	-	21,447.55
交易性金融资产	-	-	-	109,894,111.68	109,894,111.68
应收申购款	-	-	-	49,821.94	49,821.94
应收清算款	-	-	-	7,738,894.42	7,738,894.42
资产总计	40,737,512.46	-	-	117,682,828.04	158,420,340.50
负债					
应付赎回款	-	-	-	198,254.19	198,254.19
应付管理人报酬	-	-	-	157,845.58	157,845.58
应付托管费	-	-	-	26,307.62	26,307.62
应付销售服务费	-	-	-	880.00	880.00
其他负债	-	-	-	160,687.39	160,687.39
负债总计	-	-	-	543,974.78	543,974.78
利率敏感度缺口	40,737,512.46	-	-	117,138,853.26	157,876,365.72

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

于 2026 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 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

无。

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

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 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 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	20,950,787.09	34.86	109,894,111.68	69.61
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	20,950,787.09	34.86	109,894,111.68	69.61

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（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	比较基准上涨 5% 资产净值变动	2,235,645.93	7,713,049.85
	比较基准下降 5% 资产净值变动	-2,235,645.93	-7,713,049.85

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 2026 年 6 月 30 日
第一层次	20,950,787.09
第二层次	-
第三层次	-
合计	20,950,787.09

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	20,950,787.09	34.73
	其中：股票	20,950,787.09	34.73
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	-	-
	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	39,325,231.26	65.20
8	其他各项资产	40,709.79	0.07
9	合计	60,316,728.14	100.00

注：报告期末本基金投资的存托凭证公允价值为：53,410.00 元，占净值比 0.09%。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	82,054.00	0.14
B	采矿业	848,854.29	1.41
C	制造业	15,267,726.01	25.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	525,558.20	0.87
E	建筑业	131,519.00	0.22
F	批发和零售业	266,238.13	0.44
G	交通运输、仓储和邮政业	232,675.64	0.39
H	住宿和餐饮业	16,191.00	0.03
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,442,824.10	2.40
J	金融业	1,284,364.76	2.14
K	房地产业	109,453.00	0.18
L	租赁和商务服务业	249,433.60	0.41
M	科学研究和技术服务业	131,300.00	0.22
N	水利、环境和公共设施管理业	71,033.36	0.12
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	22,680.00	0.04
Q	卫生和社会工作	53,023.00	0.09
R	文化、体育和娱乐业	111,761.00	0.19
S	综合	104,098.00	0.17
	合计	20,950,787.09	34.86

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
1	300604	长川科技	900	307,278.00	0.51
2	600487	亨通光电	2,600	284,284.00	0.47
3	301308	江波龙	400	281,520.00	0.47
4	688525	佰维存储	500	247,365.00	0.41
5	002008	大族激光	1,600	240,176.00	0.40
6	688347	华虹宏力	700	235,410.00	0.39
7	300136	信维通信	1,900	226,575.00	0.38
8	300857	协创数据	560	190,344.00	0.32
9	002281	光迅科技	700	179,858.00	0.30
10	002156	通富微电	2,300	174,501.00	0.29
11	688120	华海清科	500	161,090.00	0.27
12	002353	杰瑞股份	1,000	152,500.00	0.25
13	002837	英维克	1,800	143,208.00	0.24
14	002851	麦格米特	800	133,744.00	0.22
15	688361	中科飞测	300	129,000.00	0.21
16	002436	兴森科技	2,500	127,375.00	0.21
17	300223	北京君正	500	124,450.00	0.21
18	300757	罗博特科	200	123,800.00	0.21
19	000021	深科技	1,900	122,113.00	0.20
20	002202	金风科技	5,000	119,500.00	0.20
21	000426	兴业银锡	3,600	118,656.00	0.20
22	600988	赤峰黄金	4,500	118,440.00	0.20
23	688702	盛科通信-U	300	116,997.00	0.19
24	300054	鼎龙股份	1,100	116,567.00	0.19
25	300751	迈为股份	400	112,984.00	0.19
26	002185	华天科技	5,000	111,550.00	0.19
27	600549	厦门钨业	1,300	110,760.00	0.18
28	600879	航天电子	5,200	110,708.00	0.18
29	002273	水晶光电	3,100	109,988.00	0.18
30	601168	西部矿业	4,000	108,560.00	0.18
31	300395	菲利华	800	106,984.00	0.18
32	300058	蓝色光标	7,760	106,777.60	0.18
33	688777	中控技术	900	105,750.00	0.18
34	000657	中钨高新	1,100	105,292.00	0.18
35	600673	东阳光	3,100	104,098.00	0.17
36	300390	天华新能	1,080	100,990.80	0.17

37	688027	国盾量子	200	100,802.00	0.17
38	002080	中材科技	1,100	99,000.00	0.16
39	600118	中国卫星	1,200	98,460.00	0.16
40	300450	先导智能	2,400	97,728.00	0.16
41	688469	芯联集成-U	9,200	97,612.00	0.16
42	300567	精测电子	300	95,280.00	0.16
43	600885	宏发股份	2,728	94,088.72	0.16
44	688002	睿创微纳	600	92,814.00	0.15
45	600096	云天化	3,000	91,200.00	0.15
46	688019	安集科技	260	88,259.60	0.15
47	688037	芯源微	200	87,810.00	0.15
48	002738	中矿资源	1,480	87,305.20	0.15
49	688234	天岳先进	500	86,755.00	0.14
50	002126	银轮股份	1,721	85,705.80	0.14
51	688017	绿的谐波	200	83,572.00	0.14
52	000831	中国稀土	1,500	83,235.00	0.14
53	300285	国瓷材料	800	82,544.00	0.14
54	002195	岩山科技	12,592	82,351.68	0.14
55	000783	长江证券	8,400	81,900.00	0.14
56	002138	顺络电子	1,100	80,410.00	0.13
57	600601	方正科技	5,800	80,272.00	0.13
58	300373	扬杰科技	500	78,615.00	0.13
59	000933	神火股份	3,700	78,440.00	0.13
60	300037	新宙邦	840	77,994.00	0.13
61	601555	东吴证券	9,800	77,616.00	0.13
62	601179	中国西电	5,200	77,584.00	0.13
63	002558	巨人网络	2,800	77,168.00	0.13
64	603228	景旺电子	1,048	75,885.68	0.13
65	688629	华丰科技	400	75,004.00	0.12
66	688220	翱捷科技-U	600	74,592.00	0.12
67	002131	利欧股份	15,500	73,625.00	0.12
68	600498	烽火通信	1,000	73,600.00	0.12
69	688099	晶晨股份	700	72,030.00	0.12
70	001389	广合科技	300	71,175.00	0.12
71	600157	永泰能源	44,000	70,840.00	0.12
72	002532	天山铝业	6,600	70,818.00	0.12
73	002340	格林美	10,400	68,744.00	0.11
74	002966	苏州银行	9,830	68,416.80	0.11
75	000960	锡业股份	1,600	68,304.00	0.11
76	600143	金发科技	4,400	67,980.00	0.11
77	002409	雅克科技	300	67,350.00	0.11
78	002261	拓维信息	2,400	67,224.00	0.11
79	688183	生益电子	500	66,200.00	0.11

80	688578	艾力斯	600	65,520.00	0.11
81	002821	凯莱英	400	64,800.00	0.11
82	688213	思特威-W	600	64,242.00	0.11
83	600580	卧龙电驱	1,940	64,214.00	0.11
84	000703	恒逸石化	4,700	63,779.00	0.11
85	300017	网宿科技	4,900	63,749.00	0.11
86	002128	电投能源	2,735	63,233.20	0.11
87	600497	驰宏锌锗	5,200	62,972.00	0.10
88	688122	西部超导	1,000	62,810.00	0.10
89	605358	立昂微	800	62,080.00	0.10
90	002465	海格通信	4,800	61,296.00	0.10
91	300207	欣旺达	3,200	60,768.00	0.10
92	603659	璞泰来	2,100	60,753.00	0.10
93	301358	湖南裕能	800	60,696.00	0.10
94	600352	浙江龙盛	4,900	59,339.00	0.10
95	688676	金盘科技	700	59,248.00	0.10
96	300115	长盈精密	2,100	58,674.00	0.10
97	688172	燕东微	700	58,562.00	0.10
98	002517	恺英网络	3,600	58,500.00	0.10
99	002797	第一创业	8,900	58,473.00	0.10
100	688266	泽璟制药-U	500	58,330.00	0.10
101	000060	中金岭南	7,700	58,289.00	0.10
102	300339	润和软件	1,500	57,765.00	0.10
103	688052	纳芯微	200	57,662.00	0.10
104	600141	兴发集团	1,220	57,303.40	0.10
105	688385	复旦微电	800	57,032.00	0.09
106	002850	科达利	300	56,790.00	0.09
107	002595	豪迈科技	1,205	56,153.00	0.09
108	601615	明阳智能	4,800	55,536.00	0.09
109	600563	法拉电子	291	55,522.80	0.09
110	002155	湖南黄金	2,320	55,378.40	0.09
111	601231	环旭电子	1,700	55,080.00	0.09
112	601108	财通证券	6,300	54,495.00	0.09
113	002472	双环传动	1,300	53,963.00	0.09
114	600392	盛和资源	1,800	53,586.00	0.09
115	689009	九号公司-WD	1,400	53,410.00	0.09
116	300001	特锐德	1,400	52,962.00	0.09
117	300458	全志科技	1,340	52,876.40	0.09
118	688322	奥比中光-W	400	52,220.00	0.09
119	601233	桐昆股份	2,400	51,960.00	0.09
120	601665	齐鲁银行	9,000	51,930.00	0.09
121	002402	和而泰	2,000	51,660.00	0.09
122	002130	沃尔核材	2,700	51,192.00	0.09

123	603129	春风动力	200	51,160.00	0.09
124	002271	东方雨虹	4,300	51,041.00	0.08
125	600909	华安证券	4,590	50,994.90	0.08
126	688235	百济神州	200	50,922.00	0.08
127	605589	圣泉集团	800	50,856.00	0.08
128	003031	中瓷电子	280	50,484.00	0.08
129	002203	海亮股份	2,200	50,270.00	0.08
130	688608	恒玄科技	300	50,157.00	0.08
131	600884	杉杉股份	3,700	50,135.00	0.08
132	002444	巨星科技	1,600	49,760.00	0.08
133	688387	信科移动-U	2,500	49,600.00	0.08
134	002432	九安医疗	700	49,476.00	0.08
135	603606	东方电缆	1,180	48,981.80	0.08
136	601198	东兴证券	3,600	48,924.00	0.08
137	603179	新泉股份	980	48,657.00	0.08
138	601162	天风证券	14,400	48,528.00	0.08
139	300454	深信服	500	48,100.00	0.08
140	002429	兆驰股份	4,600	47,794.00	0.08
141	600060	海信视像	1,700	47,379.00	0.08
142	300012	华测检测	3,400	47,124.00	0.08
143	002078	太阳纸业	3,700	46,213.00	0.08
144	601099	太平洋	13,700	46,169.00	0.08
145	002025	航天电器	600	45,732.00	0.08
146	000893	亚钾国际	1,116	45,633.24	0.08
147	002157	正邦科技	16,200	45,522.00	0.08
148	000034	神州数码	1,640	45,510.00	0.08
149	601128	常熟银行	7,813	45,471.66	0.08
150	002335	科华数据	1,070	45,421.50	0.08
151	000423	东阿阿胶	1,000	45,360.00	0.08
152	300474	景嘉微	750	45,360.00	0.08
153	300763	锦浪科技	500	45,175.00	0.08
154	600109	国金证券	5,100	44,778.00	0.07
155	600171	上海贝岭	1,400	44,716.00	0.07
156	002064	华峰化学	4,700	44,603.00	0.07
157	601577	长沙银行	5,100	44,421.00	0.07
158	603156	养元饮品	900	44,163.00	0.07
159	601958	金钼股份	1,549	43,542.39	0.07
160	600298	安琪酵母	1,200	43,440.00	0.07
161	300073	当升科技	900	43,236.00	0.07
162	603920	世运电路	900	43,236.00	0.07
163	000878	云南铜业	2,700	42,876.00	0.07
164	002056	横店东磁	1,400	42,672.00	0.07
165	300024	机器人	2,200	42,526.00	0.07

166	002414	高德红外	3,200	42,432.00	0.07
167	300724	捷佳伟创	600	42,360.00	0.07
168	688599	天合光能	3,000	42,360.00	0.07
169	300432	富临精工	2,100	42,189.00	0.07
170	688568	中科星图	1,000	41,470.00	0.07
171	603979	金诚信	700	41,321.00	0.07
172	601016	节能风电	10,600	41,128.00	0.07
173	300748	金力永磁	1,320	40,722.00	0.07
174	300623	捷捷微电	900	40,491.00	0.07
175	600699	均胜电子	1,860	40,194.60	0.07
176	002756	永兴材料	700	39,648.00	0.07
177	300919	中伟新材	900	39,375.00	0.07
178	600021	上海电力	2,600	39,182.00	0.07
179	300677	英科医疗	1,000	39,170.00	0.07
180	002294	信立泰	1,200	38,268.00	0.06
181	000728	国元证券	5,100	38,199.00	0.06
182	603379	三美股份	500	37,945.00	0.06
183	600378	昊华科技	500	37,690.00	0.06
184	300142	沃森生物	2,900	37,671.00	0.06
185	000559	万向钱潮	2,900	37,497.00	0.06
186	300383	光环新网	3,000	37,320.00	0.06
187	000039	中集集团	4,600	37,306.00	0.06
188	688180	君实生物-U	1,100	37,202.00	0.06
189	300496	中科创达	600	37,074.00	0.06
190	601696	中银证券	2,900	36,685.00	0.06
191	000729	燕京啤酒	3,600	36,468.00	0.06
192	301200	大族数控	100	36,065.00	0.06
193	301611	珂玛科技	200	36,014.00	0.06
194	688018	乐鑫科技	280	35,817.60	0.06
195	603806	福斯特	2,100	35,259.00	0.06
196	002673	西部证券	5,400	35,046.00	0.06
197	300699	光威复材	1,220	34,953.00	0.06
198	002624	完美世界	2,800	34,776.00	0.06
199	601717	中创智领	2,500	34,775.00	0.06
200	000400	许继电气	1,600	34,720.00	0.06
201	688301	奕瑞科技	280	34,720.00	0.06
202	300972	万辰集团	200	34,682.00	0.06
203	600177	雅戈尔	4,600	34,638.00	0.06
204	603766	隆鑫通用	2,900	34,597.00	0.06
205	600521	华海药业	2,400	34,560.00	0.06
206	600499	科达制造	2,500	34,500.00	0.06
207	603087	甘李药业	600	34,056.00	0.06
208	000683	博源化工	5,900	33,984.00	0.06

209	000733	振华科技	600	33,984.00	0.06
210	601997	贵阳银行	6,600	33,858.00	0.06
211	600873	梅花生物	4,600	33,810.00	0.06
212	688728	格科微	1,600	33,664.00	0.06
213	000155	川能动力	2,800	33,544.00	0.06
214	002223	鱼跃医疗	1,300	33,358.00	0.06
215	300003	乐普医疗	2,800	33,180.00	0.06
216	000750	国海证券	9,000	33,120.00	0.06
217	603688	石英股份	400	33,044.00	0.05
218	600578	京能电力	5,100	32,895.00	0.05
219	002065	东华软件	4,600	32,844.00	0.05
220	601699	潞安环能	2,300	32,844.00	0.05
221	300002	神州泰岳	4,200	32,802.00	0.05
222	002044	美年健康	6,500	32,695.00	0.05
223	002085	万丰奥威	2,900	32,161.00	0.05
224	600707	彩虹股份	1,900	32,091.00	0.05
225	603345	安井食品	400	32,076.00	0.05
226	000623	吉林敖东	1,800	31,914.00	0.05
227	002831	裕同科技	895	31,826.20	0.05
228	600312	平高电气	1,800	31,788.00	0.05
229	600369	西南证券	7,900	31,758.00	0.05
230	600348	华阳股份	4,150	31,747.50	0.05
231	000629	钒钛股份	9,500	31,730.00	0.05
232	688615	合合信息	280	31,668.00	0.05
233	000519	中兵红箭	1,500	31,605.00	0.05
234	601212	白银有色	6,200	31,496.00	0.05
235	688375	国博电子	300	31,290.00	0.05
236	601216	君正集团	7,000	31,220.00	0.05
237	002841	视源股份	900	31,077.00	0.05
238	002318	久立特材	1,300	31,070.00	0.05
239	601918	新集能源	3,600	30,924.00	0.05
240	603160	汇顶科技	500	30,855.00	0.05
241	600637	东方明珠	3,700	30,747.00	0.05
242	603290	斯达半导	200	30,588.00	0.05
243	000887	中鼎股份	1,700	30,413.00	0.05
244	603699	纽威股份	600	30,180.00	0.05
245	600153	建发股份	3,800	30,134.00	0.05
246	600332	白云山	1,500	30,060.00	0.05
247	300679	电连技术	500	29,995.00	0.05
248	603605	珀莱雅	500	29,960.00	0.05
249	688188	柏楚电子	280	29,876.00	0.05
250	002739	儒意电影	3,100	29,760.00	0.05
251	600704	物产中大	6,300	29,736.00	0.05

252	601991	大唐发电	4,200	29,736.00	0.05
253	600985	淮北矿业	2,100	29,505.00	0.05
254	000932	华菱钢铁	8,480	29,425.60	0.05
255	300487	蓝晓科技	500	29,425.00	0.05
256	603650	彤程新材	300	29,394.00	0.05
257	603596	伯特利	1,180	29,311.20	0.05
258	002683	广东宏大	1,000	29,290.00	0.05
259	000738	航发控制	1,600	29,264.00	0.05
260	600765	中航重机	2,260	29,199.20	0.05
261	603077	和邦生物	12,500	29,000.00	0.05
262	601611	中国核建	2,600	28,990.00	0.05
263	601990	南京证券	4,400	28,908.00	0.05
264	000415	渤海租赁	7,100	28,897.00	0.05
265	002410	广联达	3,500	28,560.00	0.05
266	300627	华测导航	1,000	28,400.00	0.05
267	600516	方大炭素	4,600	28,382.00	0.05
268	600995	南网储能	2,300	28,290.00	0.05
269	600536	中国软件	1,006	28,288.72	0.05
270	688166	博瑞医药	800	28,008.00	0.05
271	000528	柳工	3,700	27,935.00	0.05
272	600486	扬农化工	550	27,885.00	0.05
273	002430	杭氧股份	900	27,864.00	0.05
274	600901	江苏金租	4,840	27,830.00	0.05
275	601001	晋控煤业	1,600	27,824.00	0.05
276	688248	南网科技	400	27,672.00	0.05
277	000967	盈峰环境	2,600	27,378.00	0.05
278	601799	星宇股份	300	27,186.00	0.05
279	600862	中航高科	1,500	27,045.00	0.04
280	601000	唐山港	6,500	26,975.00	0.04
281	002007	华兰生物	2,200	26,818.00	0.04
282	002939	长城证券	3,200	26,688.00	0.04
283	688538	和辉光电-U	10,200	26,520.00	0.04
284	000830	鲁西化工	2,200	26,400.00	0.04
285	002266	浙富控股	5,200	26,312.00	0.04
286	600398	海澜之家	5,000	26,150.00	0.04
287	000997	新大陆	1,600	26,080.00	0.04
288	300558	贝达药业	400	26,028.00	0.04
289	603225	新凤鸣	1,320	25,938.00	0.04
290	600166	福田汽车	8,900	25,899.00	0.04
291	600737	中粮糖业	2,100	25,893.00	0.04
292	600170	上海建工	11,600	25,752.00	0.04
293	301536	星辰科技	200	25,742.00	0.04
294	688114	华大智造	500	25,540.00	0.04

295	002603	以岭药业	1,700	25,500.00	0.04
296	603338	浙江鼎力	600	25,500.00	0.04
297	000062	深圳华强	800	25,456.00	0.04
298	603486	科沃斯	500	25,375.00	0.04
299	002926	华西证券	3,100	25,327.00	0.04
300	002958	青农商行	9,200	25,208.00	0.04
301	000009	中国宝安	4,040	25,169.20	0.04
302	600316	洪都航空	900	25,146.00	0.04
303	600363	联创光电	700	25,046.00	0.04
304	600820	隧道股份	4,800	25,008.00	0.04
305	000050	深天马 A	2,500	24,775.00	0.04
306	603939	益丰药房	1,376	24,740.48	0.04
307	600998	九州通	5,270	24,716.30	0.04
308	300570	太辰光	100	24,671.00	0.04
309	002152	广电运通	2,600	24,388.00	0.04
310	603728	鸣志电器	400	24,368.00	0.04
311	600282	南钢股份	5,300	24,327.00	0.04
312	688295	中复神鹰	400	24,216.00	0.04
313	600546	山煤国际	2,200	24,046.00	0.04
314	688065	凯赛生物	500	23,925.00	0.04
315	603298	杭叉集团	1,000	23,860.00	0.04
316	002244	滨江集团	3,100	23,560.00	0.04
317	600435	北方导航	2,102	23,542.40	0.04
318	600863	华能蒙电	5,000	23,500.00	0.04
319	000987	越秀资本	3,000	23,460.00	0.04
320	600008	首创环保	8,610	23,419.20	0.04
321	603568	伟明环保	1,522	23,408.36	0.04
322	600583	海油工程	4,600	23,138.00	0.04
323	600208	衢州发展	8,100	22,923.00	0.04
324	002607	中公教育	12,600	22,680.00	0.04
325	601155	新城控股	2,200	22,572.00	0.04
326	002500	山西证券	4,370	22,549.20	0.04
327	600380	健康元	2,392	22,532.64	0.04
328	002262	恩华药业	1,200	22,500.00	0.04
329	000723	美锦能源	6,700	22,445.00	0.04
330	601880	辽港股份	16,200	22,356.00	0.04
331	002568	百润股份	1,300	21,996.00	0.04
332	000921	海信家电	800	21,856.00	0.04
333	688778	厦钨新能	400	21,760.00	0.04
334	601333	广深铁路	7,900	21,725.00	0.04
335	601156	东航物流	1,347	21,713.64	0.04
336	000513	丽珠集团	751	21,696.39	0.04
337	688772	珠海冠宇	1,100	21,593.00	0.04

338	000951	中国重汽	1,100	21,461.00	0.04
339	601399	国机重装	6,100	21,350.00	0.04
340	600562	国睿科技	1,000	21,220.00	0.04
341	688281	华秦科技	420	21,096.60	0.04
342	300676	华大基因	600	21,036.00	0.03
343	002120	韵达股份	3,300	20,988.00	0.03
344	601567	三星电气	1,400	20,916.00	0.03
345	600801	华新建材	1,340	20,904.00	0.03
346	001696	宗申动力	1,000	20,810.00	0.03
347	688297	中无人机	500	20,775.00	0.03
348	000591	太阳能	4,500	20,700.00	0.03
349	002385	大北农	7,500	20,700.00	0.03
350	600970	中材国际	2,900	20,677.00	0.03
351	600132	重庆啤酒	500	20,650.00	0.03
352	603885	吉祥航空	2,000	20,580.00	0.03
353	000598	兴蓉环境	3,200	20,544.00	0.03
354	600390	五矿资本	4,500	20,520.00	0.03
355	600483	福能股份	2,000	20,380.00	0.03
356	600685	中船防务	800	20,352.00	0.03
357	300144	宋城演艺	3,500	20,335.00	0.03
358	600763	通策医疗	600	20,328.00	0.03
359	600038	中直股份	800	20,232.00	0.03
360	603816	顾家家居	900	20,124.00	0.03
361	000739	普洛药业	1,200	19,992.00	0.03
362	000032	深桑达 A	800	19,960.00	0.03
363	603737	三棵树	825	19,882.50	0.03
364	600535	天士力	1,500	19,845.00	0.03
365	002299	圣农发展	1,300	19,708.00	0.03
366	600967	内蒙一机	1,800	19,530.00	0.03
367	688582	芯动联科	300	19,500.00	0.03
368	600126	杭钢股份	3,180	19,493.40	0.03
369	300100	双林股份	700	19,446.00	0.03
370	600977	中国电影	1,500	19,380.00	0.03
371	600602	云赛智联	1,200	19,296.00	0.03
372	600739	辽宁成大	1,900	19,209.00	0.03
373	601118	海南橡胶	3,900	19,188.00	0.03
374	601608	中信重工	4,000	19,080.00	0.03
375	600131	国网信通	1,300	18,980.00	0.03
376	600329	达仁堂	500	18,610.00	0.03
377	601666	平煤股份	2,600	18,590.00	0.03
378	601866	中远海发	8,400	18,564.00	0.03
379	600511	国药股份	700	18,228.00	0.03
380	688617	惠泰医疗	100	18,156.00	0.03

381	003022	联泓新科	700	18,130.00	0.03
382	600095	湘财股份	2,400	18,072.00	0.03
383	600871	石化油服	8,800	17,864.00	0.03
384	603000	人民网	1,200	17,748.00	0.03
385	002439	启明星辰	1,400	17,710.00	0.03
386	600655	豫园股份	4,300	17,673.00	0.03
387	003021	兆威机电	200	17,470.00	0.03
388	000563	陕国投 A	6,300	17,388.00	0.03
389	601598	中国外运	3,500	17,360.00	0.03
390	600598	北大荒	1,600	17,344.00	0.03
391	000883	湖北能源	4,000	17,280.00	0.03
392	001286	陕西能源	1,700	17,238.00	0.03
393	300146	汤臣倍健	1,900	17,176.00	0.03
394	600816	建元信托	7,000	17,080.00	0.03
395	300601	康泰生物	1,500	17,010.00	0.03
396	603341	龙旗科技	400	16,996.00	0.03
397	002984	森麒麟	1,300	16,991.00	0.03
398	600582	天地科技	3,800	16,910.00	0.03
399	600517	国网英大	3,600	16,848.00	0.03
400	601865	福莱特	1,600	16,816.00	0.03
401	000537	绿发电力	2,300	16,813.00	0.03
402	603589	口子窖	900	16,812.00	0.03
403	600004	白云机场	2,300	16,698.00	0.03
404	603565	中谷物流	1,700	16,677.00	0.03
405	603899	晨光股份	800	16,504.00	0.03
406	000709	河钢股份	8,500	16,490.00	0.03
407	600848	上海临港	2,200	16,478.00	0.03
408	600906	财达证券	2,200	16,412.00	0.03
409	000825	太钢不锈	4,800	16,368.00	0.03
410	002773	康弘药业	800	16,360.00	0.03
411	000958	电投产融	2,900	16,356.00	0.03
412	600663	陆家嘴	2,600	16,328.00	0.03
413	688278	特宝生物	300	16,320.00	0.03
414	601966	玲珑轮胎	1,600	16,304.00	0.03
415	000027	深圳能源	2,620	16,244.00	0.03
416	600754	锦江酒店	900	16,191.00	0.03
417	300957	贝泰妮	500	15,755.00	0.03
418	688336	三生国健	290	15,399.00	0.03
419	688563	航材股份	300	15,369.00	0.03
420	600528	中铁工业	2,300	15,157.00	0.03
421	002423	中粮资本	1,800	14,814.00	0.02
422	601098	中南传媒	1,500	14,760.00	0.02
423	002508	老板电器	1,000	14,620.00	0.02

424	603858	步长制药	1,000	14,600.00	0.02
425	603927	中科软	1,148	14,591.08	0.02
426	603233	大参林	960	14,428.80	0.02
427	688561	奇安信-U	600	14,388.00	0.02
428	300070	碧水源	4,500	14,355.00	0.02
429	600968	海油发展	4,300	14,319.00	0.02
430	688318	财富趋势	200	14,262.00	0.02
431	600959	江苏有线	4,900	14,161.00	0.02
432	600032	浙江新能	2,000	14,100.00	0.02
433	600566	济川药业	630	13,979.70	0.02
434	300529	健帆生物	900	13,860.00	0.02
435	688425	铁建重工	3,400	13,668.00	0.02
436	000429	粤高速 A	1,000	13,650.00	0.02
437	600808	马钢股份	5,400	13,500.00	0.02
438	600062	华润双鹤	840	13,473.60	0.02
439	003035	南网能源	2,300	13,386.00	0.02
440	601928	凤凰传媒	1,500	13,185.00	0.02
441	002670	国盛证券	1,193	13,123.00	0.02
442	600295	鄂尔多斯	1,200	12,864.00	0.02
443	002153	石基信息	1,774	12,826.02	0.02
444	688100	威胜信息	400	12,236.00	0.02
445	300718	长盛轴承	200	12,194.00	0.02
446	603833	欧派家居	400	12,044.00	0.02
447	688192	迪哲医药-U	300	11,979.00	0.02
448	601965	中国汽研	1,000	11,960.00	0.02
449	000959	首钢股份	3,400	11,934.00	0.02
450	002032	苏泊尔	300	11,880.00	0.02
451	601061	中信金属	1,100	11,847.00	0.02
452	600098	广州发展	2,000	11,820.00	0.02
453	000539	粤电力 A	1,700	11,577.00	0.02
454	688709	成都华微	300	11,427.00	0.02
455	600688	上海石化	3,900	11,427.00	0.02
456	300888	稳健医疗	400	11,196.00	0.02
457	002372	伟星新材	1,360	11,138.40	0.02
458	600606	绿地控股	9,200	11,132.00	0.02
459	301301	川宁生物	1,400	11,116.00	0.02
460	688363	华熙生物	300	10,731.00	0.02
461	600764	中国海防	600	10,458.00	0.02
462	600339	中油工程	3,400	10,438.00	0.02
463	002608	江苏国信	1,500	10,350.00	0.02
464	688520	神州细胞	300	10,263.00	0.02
465	600720	中交设计	2,100	10,122.00	0.02
466	000785	居然智家	5,000	10,000.00	0.02

467	688349	三一重能	650	9,867.00	0.02
468	603529	爱玛科技	500	9,755.00	0.02
469	601139	深圳燃气	1,700	9,622.00	0.02
470	000898	鞍钢股份	5,000	9,350.00	0.02
471	000937	冀中能源	2,310	9,193.80	0.02
472	601228	广州港	3,200	9,024.00	0.02
473	603658	安图生物	300	8,706.00	0.01
474	601019	山东出版	1,300	8,320.00	0.01
475	688475	萤石网络	300	8,205.00	0.01
476	603786	科博达	200	8,182.00	0.01
477	301498	乖宝宠物	200	8,118.00	0.01
478	603707	健友股份	1,100	7,777.00	0.01
479	600007	中国国贸	400	7,592.00	0.01
480	002461	珠江啤酒	1,000	7,570.00	0.01
481	600927	永安期货	600	7,470.00	0.01
482	600299	安迪苏	900	7,065.00	0.01
483	300140	节能环境	1,400	6,958.00	0.01
484	002945	华林证券	500	6,715.00	0.01
485	001213	中铁特货	1,900	6,365.00	0.01
486	601921	浙版传媒	900	6,021.00	0.01
487	603049	中策橡胶	100	4,481.00	0.01
488	688819	天能股份	200	4,440.00	0.01
489	688652	京仪装备	16	3,202.72	0.01
490	603376	大明电子	105	2,601.90	0.00
491	603062	麦加芯彩	52	2,087.80	0.00
492	603370	华新精科	56	2,014.88	0.00
493	603334	丰倍生物	55	1,954.15	0.00
494	603092	德力佳	36	1,942.92	0.00
495	603406	天富龙	71	1,842.45	0.00
496	603382	海阳科技	105	1,800.75	0.00
497	603418	友升股份	37	1,634.29	0.00
498	688648	中邮科技	24	877.20	0.00
499	688653	康希通信	41	712.58	0.00
500	600058	五矿发展	1	11.55	0.00
501	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	601988	中国银行	4,498,711.50	2.85
2	601398	工商银行	4,498,237.00	2.85
3	601288	农业银行	4,496,540.00	2.85
4	601939	建设银行	4,496,188.00	2.85

5	000651	格力电器	2,997,087.00	1.90
6	000333	美的集团	2,993,992.00	1.90
7	688347	华虹宏力	646,550.90	0.41
8	002402	和而泰	460,613.00	0.29
9	600601	方正科技	455,115.00	0.29
10	002126	银轮股份	426,337.38	0.27
11	002128	电投能源	387,329.15	0.25
12	002131	利欧股份	383,844.00	0.24
13	600118	中国卫星	372,337.00	0.24
14	688019	安集科技	356,837.00	0.23
15	002271	东方雨虹	347,229.00	0.22
16	000657	中钨高新	310,737.00	0.20
17	300136	信维通信	306,280.00	0.19
18	600879	航天电子	297,043.00	0.19
19	300751	迈为股份	279,695.00	0.18
20	002335	科华数据	274,938.00	0.17

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	601939	建设银行	4,520,337.00	2.86
2	601988	中国银行	4,499,885.00	2.85
3	601398	工商银行	4,485,456.00	2.84
4	601288	农业银行	4,441,890.00	2.81
5	000333	美的集团	2,886,886.00	1.83
6	000651	格力电器	2,809,241.00	1.78
7	300476	胜宏科技	2,106,582.00	1.33
8	300058	蓝色光标	1,058,853.00	0.67
9	600487	亨通光电	1,042,696.00	0.66
10	000988	华工科技	949,528.00	0.60
11	300857	协创数据	817,768.00	0.52
12	688525	佰维存储	788,672.65	0.50
13	600988	赤峰黄金	779,204.00	0.49
14	300136	信维通信	770,728.00	0.49
15	000426	兴业银锡	750,406.00	0.48
16	600549	厦门钨业	739,447.00	0.47
17	688521	芯原股份	734,352.00	0.47
18	300450	先导智能	684,191.00	0.43
19	300751	迈为股份	681,232.00	0.43
20	002156	通富微电	680,450.00	0.43

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	43,583,236.56
卖出股票收入（成交）总额	146,849,082.77

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

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

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

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

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

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

本基金投资的前十名证券中本期没有发行主体被监管部门立案调查的、或在报告编制日前一

年内受到公开谴责、处罚的证券。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

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	32,441.66
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	8,268.13
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	40,709.79

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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 (%)
鹏华睿投 混合 A	1,109	25,045.81	13,771,340.03	49.58	14,004,460.54	50.42
鹏华睿投 混合 C	206	8,592.83	0.00	0.00	1,770,123.63	100.00
合计	1,315	22,468.38	13,771,340.03	46.61	15,774,584.17	53.39

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日）
盈利投资者数量占比（%）	91.92

无。

8.3 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	173,217.32	0.6236
	鹏华睿投混合 C	100.00	0.0056
	合计	173,317.32	0.5866

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

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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	0~10
	鹏华睿投混合 C	—
	合计	0~10

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	83,292,292.26	2,232,835.93

本报告期基金总申购份额	636, 434. 17	528, 241. 26
减：本报告期基金总赎回份额	56, 152, 925. 86	990, 953. 56
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	27, 775, 800. 57	1, 770, 123. 63

§ 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：

报告期内，公司原副总经理李伟先生因个人原因辞职，经公司第六届董事会第三百三十八次会议审议通过，自 2026 年 4 月 3 日起，李伟先生不再担任公司副总经理。

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：

无。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

10.4 基金投资策略的改变

无。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未改聘为本基金审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

无。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

无。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人没有受到监管部门调查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人相关从业人员没有受到监管部门调查或处罚。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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(%)	
广发证券	3	108,227,230.06	56.83	48,800.85	56.83	-
国海证券	2	55,011,324.93	28.89	24,805.51	28.89	-
中泰证券	2	27,193,764.34	14.28	12,261.95	14.28	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方财富证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
高盛中国	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰海通证券	1	-	-	-	-	-
国投证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	3	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
华源证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
摩根大通证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-

天风证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
中信建投 证券	1	-	-	-	-	-

注：交易单元选择的标准和程序：

1. 根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》（以下简称《规定》），基金管理人制定了相应的管理制度规范交易单元选择的标准和程序。基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券公司，选择标准包括：财务状况良好，经营行为规范；有完备的合规管理流程和制度，风险控制能力较强；研究、交易等服务能力较强，交易设施能够为投资组合提供有效的交易执行；中国证监会或有权机关规定的其他条件等。

2. 选择程序如下：

- （1）基金管理人根据上述标准评估并确定选用的证券公司；
- （2）基金管理人与提供证券交易服务的证券公司签订协议，并办理开立交易账户等事宜；
- （3）基金管理人定期对证券公司进行评价，依据评价结果选择交易单元。

3. 根据《规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率；其他类型基金股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍。

10.7.2 基金租用或者通过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 (%)
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-

东北证 券	-	-	-	-	-	-
东方财 富证券	-	-	-	-	-	-
东方证 券	-	-	-	-	-	-
东吴证 券	-	-	-	-	-	-
方正证 券	-	-	-	-	-	-
高盛中 国	-	-	-	-	-	-
光大证 券	-	-	-	-	-	-
国金证 券	-	-	-	-	-	-
国盛证 券	-	-	-	-	-	-
国泰海 通证券	-	-	-	-	-	-
国投证 券	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
华源证 券	-	-	-	-	-	-
开源证 券	-	-	-	-	-	-
民生证 券	-	-	-	-	-	-
摩根大 通证券	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-
瑞银证 券	-	-	-	-	-	-
山西证 券	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-
西南证 券	-	-	-	-	-	-

信达证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
浙商证 券	-	-	-	-	-	-
中信建 投证券	-	-	-	-	-	-

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关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 01 月 17 日
2	鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	《中国证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 01 月 21 日
3	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 01 月 24 日
4	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与东方证券股份有限公司申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 02 月 04 日
5	鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金 2025 年年度报告	《中国证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 03 月 30 日
6	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与海南有知有行基金销售有限公司申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 03 月 31 日
7	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/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 04 月 04 日
8	鹏华基金管理有限公司关于暂停客服电话服务的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 04 月 17 日

9	鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	《中国证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 04 月 21 日
10	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/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 05 月 08 日
11	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/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 05 月 08 日
12	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/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 05 月 08 日
13	鹏华基金管理有限公司关于终止中证金牛(北京)基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 05 月 30 日
14	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 06 月 18 日
15	鹏华基金管理有限公司关于终止浦领基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 06 月 24 日

§ 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	20260101~20260630	64,314,338.10	0.00	50,542,998.07	13,771,340.03	46.61
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 2026 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：400-6788-533。

鹏华基金管理有限公司

2026 年 8 月 28 日