

鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金 2020 年中期报告

2020 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：2020 年 8 月 31 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 2020 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 2020 年 01 月 01 日起至 2020 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	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
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	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
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	56
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	56
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	56
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	56
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	56
7.12 投资组合报告附注	57
§ 8 基金份额持有人信息.....	58
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	58
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	58
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	58
§ 9 开放式基金份额变动.....	58
§ 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	59
10.4 基金投资策略的改变	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	59
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	59
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	59
10.8 其他重大事件	61
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	65
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	65
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	65
§ 12 备查文件目录	66
12.1 备查文件目录	66
12.2 存放地点	66
12.3 查阅方式	66

§ 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	312,024,771.83 份
基金合同存续期	不定期

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 本基金将通过跟踪考量通常的宏观经济变量(包括 GDP 增长率、CPI 走势、M2 的绝对水平和增长率、利率水平与走势等)以及各项国家政策(包括财政、货币、税收、汇率政策等)来判断经济周期目前的位置以及未来将发展的方向,在此基础上对各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估,制定股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。</p> <p>2、股票投资策略 本基金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 本基金将自上而下地进行行业遴选,重点关注行业增长前景、行业利润前景和行业成功要素。对行业增长前景,主要分析行业的外部发展环境、行业的生命周期以及行业波动与经济周期的关系等;对行业利润前景,主要分析行业结构,特别是业内竞争的方式、业内竞争的激烈程度、以及业内厂商的谈判能力等。基于对行业结构的分析形成对业内竞争的关键成功要素的判断,为预测企业经营环境的变化建立起扎实的基础。</p> <p>(2)自下而上的个股选择 本基金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 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,</p>

	<p>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、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。</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	张戈	张燕
	联系电话	0755-82825720	0755-83199084
	电子邮箱	zhangge@phfund.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com

客户服务电话	4006788999	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	深圳深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	518048	518040
法定代表人	何如	李建红

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 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(2020年1月1日-2020年6月30日)
本期已实现收益	26,299,721.12
本期利润	46,978,328.32
加权平均基金份额本期利润	0.2239
本期加权平均净值利润率	17.17%
本期基金份额净值增长率	17.97%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)
期末可供分配利润	87,992,780.54
期末可供分配基金份额利润	0.2820
期末基金资产净值	444,155,422.38
期末基金份额净值	1.4235
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)
基金份额累计净值增长率	42.35%

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。

（2）所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(3) 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润期末余额和未分配利润中已实现部分的期末余额的孰低数。表中的“期末”均指报告期最后一日，即 6 月 30 日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	7.52%	0.77%	4.20%	0.53%	3.32%	0.24%
过去三个月	17.08%	0.90%	7.48%	0.54%	9.60%	0.36%
过去六个月	17.97%	1.41%	2.35%	0.90%	15.62%	0.51%
过去一年	42.91%	1.23%	7.96%	0.72%	34.95%	0.51%
自基金合同生效起至今	42.35%	1.34%	12.23%	0.82%	30.12%	0.52%

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。截止本报告期末，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，注册资本 15,000 万元人民币。截至 2020 年 6 月，公司管理资产总规模达到 7,014.31 亿元，管理 196 只公募基金、12 只全国社保投资组合、4 只基本养老保险投资组合。经过 22 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	本基金基金经理	2018-05-30	-	10 年	刘方正先生，国籍中国，理学硕士，10 年证券基金从业经验。2010 年 6 月加盟鹏华

				<p>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总经理助理、基金经理。2015 年 03 月至 2017 年 01 月担任鹏华弘利混合基金基金经理，2015 年 03 月至 2015 年 08 月担任鹏华行业成长基金基金经理，2015 年 04 月至 2017 年 01 月担任鹏华弘润混合基金基金经理，2015 年 05 月担任鹏华弘华混合基金基金经理，2015 年 05 月担任鹏华弘和混合基金基金经理，2015 年 05 月至 2017 年 01 月担任鹏华弘益混合基金基金经理，2015 年 06 月至 2017 年 01 月担任鹏华弘鑫混合基金基金经理，2015 年 08 月担任鹏华前海万科 REITs 基金基金经理，2015 年 08 月至 2017 年 01 月担任鹏华弘泰混合基金基金经理，2016 年 03 月担任鹏华弘信混合基金基金经理，2016 年 03 月至 2017 年 05 月担任鹏华弘实混合基金基金经理，2016 年 03 月至 2018 年 05 月担任鹏华弘锐混合基金基金经理，2016 年 08 月担任鹏华弘达混合基金基金经理，2016 年 08 月至 2017 年 12 月担任鹏华弘嘉混合基金基金经理，2016 年 09 月担任鹏华弘惠混合基金基金经理，2016 年 11 月至 2018 年 01 月担任鹏华兴裕定开混合基金基金经理，2016 年 11 月担任鹏华兴泰定期开放混合基金基金经理，2016 年 12 月担任鹏华兴悦定期开放混合基金基金经理，2017 年 09 月至 2018 年 08 月担任鹏华兴益定期开放混合基金基金经理，2018 年 05 月担任鹏华睿投混合基金基金经理。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遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规、中国证监会的有关规定

以及基金合同的约定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合规，不存在违反基金合同和损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

2020 年上半年，受新冠疫情突发因素的影响，宏观经济在去年四季度触底企稳回升的周期被打乱，总需求在春节以后快速冻结，三四月份开始逐步缓解，二季度中后期快速回升。其中，疫情对居民生活行为产生的影响远大于工业层面，需要通过人与人互动形成的需求受抑制非常明显，依赖于服务业的居民收入显著回落，社会零售品销售总额等宏观层面的数据恢复的非常缓慢。另外一方面，为了对冲居民部门需求回落对经济的冲击，政府为主导的经济构成部分有较为强烈的加杠杆动力。货币政策保持一段时间非常宽松的状态，财政政策主导了需求的扩张。基建投资有明显抬升，国有企业的投资也有所提高，制造业投资受民营企业投资的拖累恢复稍显缓慢。货币宽松过程中，房地产市场的需求也有显著扩张，销售和投资都呈现了不错的趋势。金融数据方面，央行引导信用扩张，社融同比增速快速上升，并且辅之以精准投放，信用扩张的趋势较为显著。

2020 年上半年，权益市场经历了较大幅度的震荡，总体指数上行为主，中间受到国内疫情爆发和海外疫情爆发等多次事件冲击，指数均有较大幅度且快速的调整，其后均有一定程度的回升修复。市场风格方面，受益于货币政策的宽松和风险偏好水平的提高，创业板和科创板等科技板块表现相对强势，上涨幅度较大，以上证 50 为代表的大市值股票在经济需求回落过程中表现较弱，市场风格明显向中小市值偏离。债券市场也受到了疫情较大程度的影响，疫情爆发以后，全球进入流动性极度宽松和总需求快速回落的过程中，债券收益率快速大幅度下行，海外收益率维持在极低水平，国内来讲，疫情受到严格控制以后总需求快速回升，极度宽松的货币环境下金融套利较多，因此，国内流动性有所收缩，债券收益率又在二季度经受一波大幅度的调整。

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，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

2020 年上半年睿投灵活配置混合型基金的净值增长率为 17.97%，同期业绩比较基准增长率为 2.35%。

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，我们认为宏观经济仍将延续二季度以来的反弹趋势，但边际增速将有明显回落，一方面，新冠病毒疫苗或特效药研制成功以前，社会活动仍将受到明显抑制，居民收入也将受到明显影响，消费回升将面临较大压力。另一方面，中美关系受美国大选影响越来越严重，外需大概率将面临较大的波动。目前来看，政府代表的基建和国有企业投资确定性最高，对整体投资起到支撑作用，房地产短期来看仍具备一定向上恢复惯性，在房地产限制政策趋严的基础上，持续时间需逐月观察。政府加杠杆仍是确定性最高的方向，外需尤其是科技方向将面临较大不确定性，居民收入和消费将在较长时期内受到抑制。

在此情况下，我们认为，权益市场受政策鼓励且流动性环境舒适的情况下，大概率是利好向上的，但其中部分热门板块也面临估值处于历史偏高水平的风险。在企业盈利温和修复和流动性相对宽松的环境下，市场风格较难出现大幅度的切换，大概率仍利好中小市值方向，部分周期低估值方向或将有部分切换机会。债券方面，近期收益率调整相对充分，金融体系内流动性受金融杠杆抬头的影 响暂时有所收紧，但经济总需求偏弱 的情况下，货币大幅收紧的可能性较低，中短久期资产仍是获得确定性收益的最优资产，中长久期受经济回 暖和信用扩张的抑制较为显著，方向存在较大的不确定性。

未来我们仍将减持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

1、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

(1) 日常估值流程

基金的估值由基金会计负责，基金会计对公司所管理的基金以基金为会计核算主体，独立建账、独立核算，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账簿记录等方面相互独立。基金会计核算独立于公司会计核算。基金会计核算采用专用的财务核算软件系统进行基金核算及

帐务处理；每日按时接收成交数据及权益数据，进行基金估值。基金会计核算采用基金管理公司与托管银行双人同步独立核算、相互核对的方式，每日就基金的会计核算、基金估值等与托管银行进行核对；每日估值结果必须与托管行核对一致后才能对外公告。基金会计除设有专职基金会计核算岗外，还设有基金会计复核岗位，负责基金会计核算的日常事后复核工作，确保基金净值核算无误。

配备的基金会计具备会计资格和基金从业资格，在基金核算与估值方面掌握了丰富的知识和经验，熟悉及了解基金估值法规、政策和方法。

(2) 特殊业务估值流程

根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》的相关规定，本公司成立停牌股票等没有市价的投资品种估值小组，成员由基金经理、行业研究员、监察稽核部、金融工程师、登记结算部相关人员组成。

2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理不参与或决定基金日常估值。

基金经理参与估值小组对停牌股票估值的讨论，发表相关意见和建议，与估值小组成员共同商定估值原则和政策。

3、本公司参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4. 定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1、截止本报告期末，本基金期末可供分配利润为 87,992,780.54 元，期末基金份额净值 1.4235 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合规守信、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：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	2,290,653.23	7,464,079.91
结算备付金		3,132,619.00	366,123.95
存出保证金		110,297.61	72,106.04
交易性金融资产	6.4.7.2	462,492,082.14	122,961,035.34
其中：股票投资		351,868,014.94	118,409,603.04
基金投资		-	-
债券投资		110,624,067.20	4,551,432.30
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	48,000,000.00	-
应收证券清算款		2,006,262.11	-
应收利息	6.4.7.5	2,048,720.52	100,919.17
应收股利		-	-
应收申购款		128,262.76	8,828.41
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		520,208,897.37	130,973,092.82
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 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		74,000,000.00	-
应付证券清算款		891,862.74	-
应付赎回款		60,781.36	1,055,820.39
应付管理人报酬		532,699.42	164,787.23
应付托管费		71,026.60	21,971.63
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	411,666.27	112,559.93
应交税费		5,503.06	0.52
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	79,935.54	166,366.24
负债合计		76,053,474.99	1,521,505.94
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	312,024,771.83	107,280,282.87
未分配利润	6.4.7.10	132,130,650.55	22,171,304.01
所有者权益合计		444,155,422.38	129,451,586.88
负债和所有者权益总计		520,208,897.37	130,973,092.82

注：报告截止日 2020 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.4235 元，基金份额总额 312,024,771.83 份。

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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		50,568,269.18	40,223,357.46
1. 利息收入		848,251.95	379,957.39
其中：存款利息收入	6.4.7.11	68,403.13	24,064.54
债券利息收入		736,147.16	352,705.45
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		43,701.66	3,187.40
证券出借利息收入		-	-

其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		28,822,405.19	6,586,987.20
其中：股票投资收益	6.4.7.12	26,623,932.95	5,656,026.45
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-11,743.07	-33,136.45
资产支持证券投资	6.4.7.13.5	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	2,210,215.31	964,097.20
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	20,678,607.20	32,983,497.91
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	219,004.84	272,914.96
减：二、费用		3,589,940.86	1,858,272.85
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,037,779.79	1,163,494.37
2. 托管费	6.4.10.2.2	271,704.02	155,132.52
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	1,014,536.17	332,456.63
5. 利息支出		177,356.64	105,663.23
其中：卖出回购金融资产支出		177,356.64	105,663.23
6. 税金及附加		1,890.51	276.90
7. 其他费用	6.4.7.20	86,673.73	101,249.20
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		46,978,328.32	38,365,084.61
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		46,978,328.32	38,365,084.61

6.3 所有者权益（基金净值）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：2020年1月1日至2020年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	107,280,282.87	22,171,304.01	129,451,586.88
二、本期经营活	-	46,978,328.32	46,978,328.32

动产生的基金净值变动数（本期利润）			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	204,744,488.96	62,981,018.22	267,725,507.18
其中：1. 基金申购款	249,584,867.85	74,574,336.92	324,159,204.77
2. 基金赎回款	-44,840,378.89	-11,593,318.70	-56,433,697.59
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	312,024,771.83	132,130,650.55	444,155,422.38
项目	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	192,200,063.42	-35,919,814.11	156,280,249.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	38,365,084.61	38,365,084.61
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-53,976,388.03	-2,990,867.52	-56,967,255.55
其中：1. 基金申购款	8,782,025.52	242,055.78	9,024,081.30
2. 基金赎回款	-62,758,413.55	-3,232,923.30	-65,991,336.85
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-

五、期末所有者 权益(基金净值)	138,223,675.39	-545,597.02	137,678,078.37
---------------------	----------------	-------------	----------------

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>邓召明</u>	<u>苏波</u>	<u>郝文高</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

鹏华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》核准,由鹏华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围主要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)、债券(包含国债、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、股指期货、权证、资产支持证券、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)。基金的投资组合比例为:股票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%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、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 2020 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 2020 年 06 月 30 日的财务状况以及 2020 年上半年的经营成果和基金净值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 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

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

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

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

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

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
活期存款	2,290,653.23
定期存款	-
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	-
合计	2,290,653.23

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动

股票		321,687,159.58	351,868,014.94	30,180,855.36
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	111,027,592.49	110,624,067.20	-403,525.29
	银行间市场	-	-	-
	合计	111,027,592.49	110,624,067.20	-403,525.29
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		432,714,752.07	462,492,082.14	29,777,330.07

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	48,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	48,000,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应收活期存款利息	262.83
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,409.70
应收债券利息	2,046,998.39
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	49.60

合计	2,048,720.52
----	--------------

6.4.7.6 其他资产

注：无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	411,666.27
银行间市场应付交易费用	-
合计	411,666.27

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	372.42
应付证券出借违约金	-
预提费用	79,563.12
合计	79,935.54

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	107,280,282.87	107,280,282.87
本期申购	249,584,867.85	249,584,867.85
本期赎回（以“-”号填列）	-44,840,378.89	-44,840,378.89
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	312,024,771.83	312,024,771.83

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	17,019,496.48	5,151,807.53	22,171,304.01
本期利润	26,299,721.12	20,678,607.20	46,978,328.32
本期基金份额交易产生的变动数	44,673,562.94	18,307,455.28	62,981,018.22
其中：基金申购款	54,437,002.41	20,137,334.51	74,574,336.92

基金赎回款	-9,763,439.47	-1,829,879.23	-11,593,318.70
本期已分配利润	-	-	-
本期末	87,992,780.54	44,137,870.01	132,130,650.55

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
活期存款利息收入	31,515.62
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	13,902.41
其他	22,985.10
合计	68,403.13

注：其他包含认/申购款利息收入，结算保证金利息收入等。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	26,623,932.95
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	26,623,932.95

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出股票成交总额	273,954,981.09
减：卖出股票成本总额	247,331,048.14
买卖股票差价收入	26,623,932.95

6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-11,743.07
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	-11,743.07

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	27,327,414.95
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	26,691,571.85
减：应收利息总额	647,586.17
买卖债券差价收入	-11,743.07

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,210,215.31
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	2,210,215.31

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日
1. 交易性金融资产	20,678,607.20
股票投资	21,100,129.98
债券投资	-421,522.78
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	20,678,607.20

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	218,984.81
基金转换费收入	20.03
合计	219,004.84

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	1,014,536.17
银行间市场交易费用	-
合计	1,014,536.17

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	19,890.78
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行汇划费用	7,110.61
合计	86,673.73

6.4.7.21 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”）	基金注册登记机构、基金管理人、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

注：无。

6.4.10.1.4 权证交易

注：无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6 月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,037,779.79	1,163,494.37
其中：支付销售机构的客户维护费	207,466.81	562,342.20

注：1、支付基金管理人鹏华基金管理有限公司的管理人报酬年费率为 1.50%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×1.50%÷当年天数。

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6 月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	271,704.02	155,132.52

注：支付基金托管人招商银行的托管费年费率为 0.20%，逐日计提，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

注：无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：无。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方没有投资及持有本基金份额。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	2,290,653.23	31,515.62	6,030,291.53	16,872.49

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在报告期内未参与关联方承销的证券。

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

注：无。

6.4.12 期末(2020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	可流通日	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
002500	山西证券	2020年6月29日	2020年7月10日	配股未上市	5.00	6.54	11,670	58,350.00	76,321.80	-
300840	酷特智能	2020年6月30日	2020年7月8日	新股未上市	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-
300843	胜蓝股份	2020年6月23日	2020年7月2日	新股未上市	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300845	捷安高科	2020年6月24日	2020年7月3日	新股未上市	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-
300846	首都在线	2020年6月22日	2020年7月1日	新股未上市	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-
300847	中船汉光	2020年6月29日	2020年7月9日	新股未上市	6.94	6.94	1,421	9,861.74	9,861.74	-
601816	京沪高铁	2020年1月	2020年7月	锁定期股票	4.88	6.17	906,536	4,423,895.68	5,593,327.12	-

		8 日	16 日							
688027	国盾量子	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 9 日	新股未上市	36.18	36.18	2,830	102,389.40	102,389.40	-
688080	映翰通	2020 年 2 月 3 日	2020 年 8 月 12 日	锁定期股票	27.63	86.78	2,144	59,238.72	186,056.32	-
688081	兴图新科	2019 年 12 月 26 日	2020 年 7 月 6 日	锁定期股票	28.21	42.01	2,418	68,211.78	101,580.18	-
688090	瑞松科技	2020 年 2 月 7 日	2020 年 8 月 17 日	锁定期股票	27.55	59.45	3,013	83,008.15	179,122.85	-
688100	威胜信息	2020 年 1 月 9 日	2020 年 7 月 21 日	锁定期股票	13.78	25.92	6,483	89,335.74	168,039.36	-
688169	石头科技	2020 年 2 月 13 日	2020 年 8 月 21 日	锁定期股票	271.12	365.14	1,525	413,458.00	556,838.50	-
688222	成都先导	2020 年 4 月 3 日	2020 年 10 月 16 日	锁定期股票	20.52	43.70	7,268	149,139.36	317,611.60	-
688277	天智航-U	2020 年 6 月 24 日	2020 年 7 月 7 日	新股未上市	12.04	12.04	8,810	106,072.40	106,072.40	-
688377	迪威尔	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 8 日	新股未上市	16.42	16.42	7,894	129,619.48	129,619.48	-
688528	秦川物联	2020 年 6 月 19 日	2020 年 7 月 1 日	新股未上市	11.33	11.33	8,337	94,458.21	94,458.21	-
688568	中科星图	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 8 日	新股未上市	16.21	16.21	11,020	178,634.20	178,634.20	-
688600	皖仪科技	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 3 日	新股未上市	15.50	15.50	5,468	84,754.00	84,754.00	-

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。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获

配日至新股上市日之间不能自由转让。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。

2、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。

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
601880	大连港	2020年6月22日	重大事项	1.72	2020年7月8日	1.89	62,600	113,803.84	107,672.00	-
002470	*ST金正	2020年6月30日	重大事项	2.27	2020年7月1日	2.16	40,700	129,653.10	92,389.00	-

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 2020 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 74,000,000.00 元，于 2020 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

本基金为混合型证券投资基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。

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，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 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券占基金资产净值的比例为 20.4%（2019 年 12 月 31 日：0.04%）。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：未评级债券包括国债、中央银行票据和政策性金融债；A-1 以下包含未评级的超短期融资券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
AAA	90,572,790.40	-
AAA 以下	21,276.80	-
未评级	20,030,000.00	-
合计	110,624,067.20	-

注：未评级债券包括国债、中央银行票据和政策性金融债。

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所持金融工具变现的难易程度。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要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理职能部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短期内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注中列示

的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2020 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额 74,000,000.00 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（所有者权益）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现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,290,653.23	-	-	-	2,290,653.23
结算备付金	3,132,619.00	-	-	-	3,132,619.00
存出保证金	110,297.61	-	-	-	110,297.61
交易性金融资产	20,030,000.00	90,526,000.00	68,067.20	351,868,014.94	462,492,082.14
买入返售金融资产	48,000,000.00	-	-	-	48,000,000.00
应收利息	-	-	-	2,048,720.52	2,048,720.52
应收申购款	-	-	-	128,262.76	128,262.76
应收证券清算款	-	-	-	2,006,262.11	2,006,262.11
资产总计	73,563,569.84	90,526,000.00	68,067.20	356,051,260.33	520,208,897.37
负债					
应付赎回款	-	-	-	60,781.36	60,781.36
应付管理人报酬	-	-	-	532,699.42	532,699.42
应付托管费	-	-	-	71,026.60	71,026.60
应付证券清算款	-	-	-	891,862.74	891,862.74

卖出回购金融资产款	74,000,000.00	-	-	-	74,000,000.00
应付交易费用	-	-	-	411,666.27	411,666.27
应交税费	-	-	-	5,503.06	5,503.06
其他负债	-	-	-	79,935.54	79,935.54
负债总计	74,000,000.00	-	-	2,053,474.99	76,053,474.99
利率敏感度缺口	-436,430.16	90,526,000.00	68,067.20	353,997,785.34	444,155,422.38
上年度末 2019 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	7,464,079.91	-	-	-	7,464,079.91
结算备付金	366,123.95	-	-	-	366,123.95
存出保证金	72,106.04	-	-	-	72,106.04
交易性金融资产	4,502,700.00	-	48,732.30	118,409,603.04	122,961,035.34
应收利息	-	-	-	100,919.17	100,919.17
应收申购款	-	-	-	8,828.41	8,828.41
资产总计	12,405,009.90	-	48,732.30	118,519,350.62	130,973,092.82
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,055,820.39	1,055,820.39
应付管理人报酬	-	-	-	164,787.23	164,787.23
应付托管费	-	-	-	21,971.63	21,971.63
应付交易费用	-	-	-	112,559.93	112,559.93
应交税费	-	-	-	0.52	0.52
其他负债	-	-	-	166,366.24	166,366.24
负债总计	-	-	-	1,521,505.94	1,521,505.94
利率敏感度缺口	12,405,009.90	-	48,732.30	116,997,844.68	129,451,586.88

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有债券资产的利率风险状况测算的理论变动值对基金资产净值的影响金额。		
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。		
	此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）		
	本期末（2020 年 6 月 30 日）	上年度末（2019 年 12 月 31 日）	
分析	市场利率下降 25 个基点	433,732.94	524.63

	市场利率上升 25 个基点	-430,386.92	-524.50
--	---------------	-------------	---------

注：于 2019 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 3.52%，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股票和债券，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。

本基金对股票资产的投资比例占基金资产的 0%—95%。

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 2020年6月30日		上年度末 2019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	351,868,014.94	79.22	118,409,603.04	91.47
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	68,067.20	0.02	48,732.30	0.04
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	351,936,082.14	79.24	118,458,335.34	91.51

注：债券投资为可转换债券、可交换债券投资。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2020年6月30日）	上年度末（2019年12月31日）
分析	业绩比较基准上升5%	19,191,892.50	5,640,112.62
	业绩比较基准下降5%	-19,191,892.50	-5,640,112.62

注：无。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 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	351,868,014.94	67.64
	其中：股票	351,868,014.94	67.64
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	110,624,067.20	21.27
	其中：债券	110,624,067.20	21.27
	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	48,000,000.00	9.23
	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	5,423,272.23	1.04
8	其他各项资产	4,293,543.00	0.83
9	合计	520,208,897.37	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	826,895.00	0.19
B	采矿业	7,124,297.50	1.60
C	制造业	171,257,824.64	38.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,959,006.52	1.57
E	建筑业	6,039,892.98	1.36
F	批发和零售业	24,583,630.01	5.53
G	交通运输、仓储和邮政业	20,996,760.24	4.73
H	住宿和餐饮业	9,323,721.00	2.10
I	信息传输、软件和信息技术服务业	36,046,097.60	8.12
J	金融业	14,294,100.01	3.22
K	房地产业	31,609,866.24	7.12
L	租赁和商务服务业	7,412,647.00	1.67
M	科学研究和技术服务业	5,926,513.60	1.33
N	水利、环境和公共设施管理业	5,620,854.20	1.27
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	91,080.00	0.02

Q	卫生和社会工作	875,380.00	0.20
R	文化、体育和娱乐业	1,896,135.00	0.43
S	综合	983,313.40	0.22
	合计	351,868,014.94	79.22

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002030	达安基因	238,208	6,498,314.24	1.46
2	600521	华海药业	186,340	6,322,516.20	1.42
3	600298	安琪酵母	118,368	5,856,848.64	1.32
4	600779	水井坊	92,543	5,776,534.06	1.30
5	002709	天赐材料	168,860	5,705,779.40	1.28
6	600804	鹏博士	632,300	5,678,054.00	1.28
7	603883	老百姓	56,700	5,672,268.00	1.28
8	601816	京沪高铁	906,536	5,593,327.12	1.26
9	002019	亿帆医药	241,100	5,538,067.00	1.25
10	600699	均胜电子	230,560	5,489,633.60	1.24
11	002603	以岭药业	174,900	5,455,131.00	1.23
12	002439	启明星辰	129,600	5,452,272.00	1.23
13	002385	大北农	592,600	5,398,586.00	1.22
14	300012	华测检测	272,700	5,388,552.00	1.21
15	300316	晶盛机电	214,100	5,296,834.00	1.19
16	601717	郑煤机	881,400	5,191,446.00	1.17
17	600649	城投控股	860,000	5,108,400.00	1.15
18	002183	怡亚通	945,500	5,067,880.00	1.14
19	601099	太平洋	1,534,100	4,863,097.00	1.09
20	002371	北方华创	28,400	4,853,844.00	1.09
21	300529	健帆生物	69,640	4,839,980.00	1.09
22	600466	蓝光发展	895,380	4,826,098.20	1.09
23	000564	供销大集	1,073,800	4,821,362.00	1.09
24	603355	莱克电气	193,370	4,812,979.30	1.08
25	000402	金融街	723,600	4,804,704.00	1.08
26	600823	世茂股份	1,056,500	4,722,555.00	1.06
27	600166	福田汽车	2,619,000	4,714,200.00	1.06
28	600881	亚泰集团	1,618,100	4,708,671.00	1.06
29	600639	浦东金桥	294,300	4,702,914.00	1.06
30	300002	神州泰岳	759,200	4,699,448.00	1.06

31	000967	盈峰环境	567,900	4,685,175.00	1.05
32	600008	首创股份	1,553,600	4,676,336.00	1.05
33	002375	亚厦股份	456,700	4,667,474.00	1.05
34	600754	锦江酒店	168,000	4,662,000.00	1.05
35	600258	首旅酒店	303,300	4,661,721.00	1.05
36	600737	中粮糖业	598,100	4,653,218.00	1.05
37	601000	唐山港	2,054,200	4,580,866.00	1.03
38	600125	铁龙物流	820,600	4,578,948.00	1.03
39	002242	九阳股份	122,200	4,554,394.00	1.03
40	000712	锦龙股份	363,400	4,542,500.00	1.02
41	000937	冀中能源	1,503,600	4,540,872.00	1.02
42	300383	光环新网	173,300	4,517,931.00	1.02
43	600787	中储股份	1,023,708	4,494,078.12	1.01
44	603816	顾家家居	99,336	4,471,113.36	1.01
45	002416	爱施德	622,140	4,466,965.20	1.01
46	002491	通鼎互联	870,700	4,457,984.00	1.00
47	600748	上实发展	871,430	4,453,007.30	1.00
48	600704	物产中大	1,041,200	4,383,452.00	0.99
49	600060	海信视像	350,100	4,253,715.00	0.96
50	002280	*ST 联络	2,406,064	3,464,732.16	0.78
51	002127	南极电商	45,400	961,118.00	0.22
52	300253	卫宁健康	40,820	936,410.80	0.21
53	002821	凯莱英	3,200	777,600.00	0.18
54	002185	华天科技	54,200	733,326.00	0.17
55	600201	生物股份	26,142	727,793.28	0.16
56	600529	山东药玻	12,300	713,400.00	0.16
57	300558	贝达药业	5,000	699,900.00	0.16
58	600079	人福医药	25,400	691,388.00	0.16
59	600143	金发科技	47,800	629,526.00	0.14
60	603444	吉比特	1,100	603,911.00	0.14
61	300285	国瓷材料	17,700	593,127.00	0.13
62	688520	神州细胞-U	7,755	585,657.60	0.13
63	002212	南洋股份	21,700	576,786.00	0.13
64	300088	长信科技	51,300	574,560.00	0.13
65	300168	万达信息	26,000	573,820.00	0.13
66	600161	天坛生物	12,536	568,256.88	0.13
67	002131	利欧股份	146,200	564,332.00	0.13
68	688169	石头科技	1,525	556,838.50	0.13
69	000636	风华高科	18,900	551,691.00	0.12
70	002223	鱼跃医疗	14,700	535,080.00	0.12
71	002465	海格通信	41,200	533,128.00	0.12
72	002074	国轩高科	19,600	526,064.00	0.12

73	600739	辽宁成大	27,700	524,361.00	0.12
74	300496	中科创达	6,700	520,590.00	0.12
75	600426	华鲁恒升	29,100	514,488.00	0.12
76	603882	金域医学	5,600	501,200.00	0.11
77	002075	沙钢股份	40,000	500,000.00	0.11
78	000988	华工科技	20,300	495,929.00	0.11
79	603517	绝味食品	7,000	495,180.00	0.11
80	002373	千方科技	20,200	484,598.00	0.11
81	600380	健康元	29,592	480,574.08	0.11
82	300271	华宇软件	16,900	476,749.00	0.11
83	002340	格林美	95,900	476,623.00	0.11
84	000009	中国宝安	55,640	473,496.40	0.11
85	603939	益丰药房	5,180	471,380.00	0.11
86	300212	易华录	8,300	464,800.00	0.10
87	601128	常熟银行	61,800	464,118.00	0.10
88	300315	掌趣科技	62,800	460,324.00	0.10
89	600885	宏发股份	11,437	458,852.44	0.10
90	300207	欣旺达	24,200	457,380.00	0.10
91	000513	丽珠集团	9,451	453,742.51	0.10
92	300482	万孚生物	4,300	447,200.00	0.10
93	002507	涪陵榨菜	12,300	442,923.00	0.10
94	002273	水晶光电	25,800	442,212.00	0.10
95	002797	第一创业	63,600	440,112.00	0.10
96	000547	航天发展	31,800	434,706.00	0.10
97	002414	高德红外	14,610	427,780.80	0.10
98	600315	上海家化	8,900	426,310.00	0.10
99	000021	深科技	19,200	419,136.00	0.09
100	603858	步长制药	14,500	418,325.00	0.09
101	600895	张江高科	20,200	411,474.00	0.09
102	002353	杰瑞股份	13,200	409,200.00	0.09
103	300024	机器人	29,700	405,999.00	0.09
104	600845	宝信软件	6,850	404,698.00	0.09
105	603659	璞泰来	3,900	401,778.00	0.09
106	002138	顺络电子	16,000	399,200.00	0.09
107	002156	通富微电	15,800	395,790.00	0.09
108	300009	安科生物	22,110	395,769.00	0.09
109	300017	网宿科技	46,400	393,936.00	0.09
110	601799	星宇股份	3,100	393,700.00	0.09
111	300357	我武生物	6,300	392,175.00	0.09
112	600486	扬农化工	4,700	387,750.00	0.09
113	600909	华安证券	56,300	384,529.00	0.09
114	002152	广电运通	29,700	384,318.00	0.09

115	002250	联化科技	17,600	383,680.00	0.09
116	002557	洽洽食品	7,000	379,330.00	0.09
117	002396	星网锐捷	10,700	378,031.00	0.09
118	300244	迪安诊断	10,600	374,180.00	0.08
119	600132	重庆啤酒	5,100	372,300.00	0.08
120	002926	华西证券	34,600	367,798.00	0.08
121	002382	蓝帆医疗	12,200	367,342.00	0.08
122	002174	游族网络	14,000	365,120.00	0.08
123	600410	华胜天成	26,700	363,120.00	0.08
124	600801	华新水泥	15,240	361,340.40	0.08
125	000739	普洛药业	15,500	360,995.00	0.08
126	000401	冀东水泥	22,500	360,900.00	0.08
127	000998	隆平高科	21,500	357,975.00	0.08
128	300058	蓝色光标	45,700	356,460.00	0.08
129	600155	华创阳安	29,700	356,103.00	0.08
130	601233	桐昆股份	27,900	356,004.00	0.08
131	000623	吉林敖东	22,600	355,498.00	0.08
132	600859	王府井	7,800	355,290.00	0.08
133	600037	歌华有线	23,100	351,120.00	0.08
134	002572	索菲亚	14,500	350,465.00	0.08
135	300010	立思辰	17,900	350,303.00	0.08
136	603338	浙江鼎力	4,620	350,057.40	0.08
137	002013	中航机电	44,300	349,970.00	0.08
138	000630	铜陵有色	177,500	342,575.00	0.08
139	000975	银泰黄金	21,800	341,824.00	0.08
140	300274	阳光电源	23,600	339,604.00	0.08
141	300070	碧水源	41,800	339,416.00	0.08
142	600535	天士力	20,900	338,998.00	0.08
143	002078	太阳纸业	35,400	337,008.00	0.08
144	002195	二三四五	118,992	334,367.52	0.08
145	600728	佳都科技	36,600	333,426.00	0.08
146	600879	航天电子	51,700	332,948.00	0.07
147	300418	昆仑万维	13,300	331,968.00	0.07
148	002500	山西证券	50,570	330,727.80	0.07
149	300115	长盈精密	14,200	324,470.00	0.07
150	600153	建发股份	39,900	323,190.00	0.07
151	002281	光迅科技	9,800	322,028.00	0.07
152	688222	成都先导	7,268	317,611.60	0.07
153	001914	招商积余	10,100	310,373.00	0.07
154	002690	美亚光电	5,900	310,340.00	0.07
155	600216	浙江医药	16,100	310,086.00	0.07
156	600811	东方集团	69,400	306,748.00	0.07

157	600884	杉杉股份	25,955	306,009.45	0.07
158	600126	杭钢股份	29,380	305,552.00	0.07
159	600256	广汇能源	113,100	305,370.00	0.07
160	600642	申能股份	51,600	304,956.00	0.07
161	600460	士兰微	20,600	302,408.00	0.07
162	000686	东北证券	35,700	301,665.00	0.07
163	002387	维信诺	21,100	301,308.00	0.07
164	000997	新大陆	18,800	300,424.00	0.07
165	603707	健友股份	4,600	297,022.00	0.07
166	002268	卫士通	13,900	296,626.00	0.07
167	300001	特锐德	14,100	295,254.00	0.07
168	600418	江淮汽车	33,100	292,273.00	0.07
169	600415	小商品城	60,000	292,200.00	0.07
170	603233	大参林	3,588	291,417.36	0.07
171	600511	国药股份	7,100	288,757.00	0.07
172	603605	珀莱雅	1,600	288,032.00	0.06
173	600260	凯乐科技	21,300	287,976.00	0.06
174	002028	思源电气	14,000	286,440.00	0.06
175	000932	华菱钢铁	75,580	284,936.60	0.06
176	603866	桃李面包	5,580	283,966.20	0.06
177	000581	威孚高科	13,700	283,316.00	0.06
178	600325	华发股份	40,000	282,400.00	0.06
179	000878	云南铜业	26,600	282,226.00	0.06
180	300251	光线传媒	25,700	280,387.00	0.06
181	600733	北汽蓝谷	43,500	279,705.00	0.06
182	002368	太极股份	6,400	279,616.00	0.06
183	600167	联美控股	19,460	279,056.40	0.06
184	000999	华润三九	9,400	274,386.00	0.06
185	002080	中材科技	17,700	274,350.00	0.06
186	300113	顺网科技	10,800	274,320.00	0.06
187	002081	金螳螂	34,700	272,742.00	0.06
188	600598	北大荒	16,900	272,090.00	0.06
189	600446	金证股份	14,000	271,600.00	0.06
190	002317	众生药业	15,800	271,128.00	0.06
191	600839	四川长虹	93,000	266,910.00	0.06
192	600820	隧道股份	47,000	265,550.00	0.06
193	600959	江苏有线	70,600	265,456.00	0.06
194	300296	利亚德	43,600	264,652.00	0.06
195	600718	东软集团	23,000	264,500.00	0.06
196	002294	信立泰	8,900	263,974.00	0.06
197	600160	巨化股份	38,120	262,646.80	0.06
198	600572	康恩贝	47,200	259,600.00	0.06

199	601689	拓普集团	9,285	259,051.50	0.06
200	601168	西部矿业	44,300	256,940.00	0.06
201	600673	东阳光	37,100	256,361.00	0.06
202	600580	卧龙电驱	22,700	255,148.00	0.06
203	002217	合力泰	48,300	253,575.00	0.06
204	603000	人民网	12,700	251,841.00	0.06
205	000158	常山北明	24,100	251,604.00	0.06
206	300630	普利制药	3,400	251,430.00	0.06
207	600827	百联股份	17,400	251,430.00	0.06
208	603806	福斯特	5,020	250,548.20	0.06
209	000012	南玻A	49,646	249,222.92	0.06
210	300026	红日药业	45,100	248,952.00	0.06
211	601005	重庆钢铁	167,000	248,830.00	0.06
212	600094	大名城	41,600	247,520.00	0.06
213	601928	凤凰传媒	36,400	247,520.00	0.06
214	300166	东方国信	19,600	243,236.00	0.05
215	600528	中铁工业	27,300	240,786.00	0.05
216	600567	山鹰纸业	81,500	240,425.00	0.05
217	600875	东方电气	27,100	239,835.00	0.05
218	000060	中金岭南	64,200	238,824.00	0.05
219	002056	横店东磁	21,100	237,375.00	0.05
220	002221	东华能源	26,600	233,814.00	0.05
221	600597	光明乳业	15,700	233,302.00	0.05
222	603228	景旺电子	6,548	230,424.12	0.05
223	600862	中航高科	13,500	228,420.00	0.05
224	600171	上海贝岭	13,100	227,678.00	0.05
225	600549	厦门钨业	19,200	227,328.00	0.05
226	000877	天山股份	15,000	226,500.00	0.05
227	002807	江阴银行	57,280	225,110.40	0.05
228	002233	塔牌集团	18,600	223,758.00	0.05
229	300618	寒锐钴业	3,600	223,272.00	0.05
230	603712	七一二	5,800	222,604.00	0.05
231	600645	中源协和	7,800	220,350.00	0.05
232	000061	农产品	29,700	220,077.00	0.05
233	600392	盛和资源	31,100	219,255.00	0.05
234	601179	中国西电	45,000	217,800.00	0.05
235	600282	南钢股份	66,900	216,087.00	0.05
236	000778	新兴铸管	62,700	215,061.00	0.05
237	600782	新钢股份	52,400	213,792.00	0.05
238	603568	伟明环保	9,181	212,999.20	0.05
239	000970	中科三环	21,700	212,226.00	0.05
240	600515	海航基础	40,500	210,600.00	0.05

241	000729	燕京啤酒	30,500	208,925.00	0.05
242	600497	驰宏锌锗	60,700	208,808.00	0.05
243	000960	锡业股份	24,300	208,008.00	0.05
244	600064	南京高科	21,400	208,008.00	0.05
245	000090	天健集团	30,078	207,838.98	0.05
246	600039	四川路桥	54,000	206,280.00	0.05
247	600755	厦门国贸	31,200	205,920.00	0.05
248	600026	中远海能	31,800	205,428.00	0.05
249	600507	方大特钢	39,394	204,454.86	0.05
250	002831	裕同科技	7,381	203,051.31	0.05
251	601966	玲珑轮胎	10,000	202,000.00	0.05
252	000738	航发控制	14,700	200,655.00	0.05
253	000400	许继电气	15,200	200,640.00	0.05
254	000690	宝新能源	42,200	199,184.00	0.04
255	600967	内蒙一机	19,000	197,410.00	0.04
256	002038	双鹭药业	15,400	197,274.00	0.04
257	002925	盈趣科技	3,400	196,996.00	0.04
258	601118	海南橡胶	40,500	196,830.00	0.04
259	002920	德赛西威	3,200	196,256.00	0.04
260	601860	紫金银行	46,100	195,003.00	0.04
261	000830	鲁西化工	25,800	192,468.00	0.04
262	000039	中集集团	26,620	192,462.60	0.04
263	002648	卫星石化	11,800	191,986.00	0.04
264	002004	华邦健康	35,400	190,452.00	0.04
265	002839	张家港行	33,000	190,080.00	0.04
266	600376	首开股份	32,400	189,864.00	0.04
267	300324	旋极信息	28,500	189,810.00	0.04
268	600056	中国医药	13,400	189,610.00	0.04
269	000629	攀钢钒钛	94,300	189,543.00	0.04
270	600350	山东高速	30,700	188,498.00	0.04
271	300474	景嘉微	2,800	188,440.00	0.04
272	600373	中文传媒	15,900	187,302.00	0.04
273	002191	劲嘉股份	21,000	187,110.00	0.04
274	600435	北方导航	24,700	186,732.00	0.04
275	688080	映翰通	2,144	186,056.32	0.04
276	002506	协鑫集成	71,200	185,832.00	0.04
277	000983	西山煤电	49,530	185,737.50	0.04
278	600563	法拉电子	3,000	185,400.00	0.04
279	002085	万丰奥威	28,600	185,328.00	0.04
280	600022	山东钢铁	142,900	184,341.00	0.04
281	600729	重庆百货	5,900	184,198.00	0.04
282	300133	华策影视	25,400	184,150.00	0.04

283	600195	中牧股份	11,300	183,399.00	0.04
284	000825	太钢不锈	55,200	183,264.00	0.04
285	603077	和邦生物	138,800	183,216.00	0.04
286	002399	海普瑞	7,300	182,792.00	0.04
287	002048	宁波华翔	11,800	182,192.00	0.04
288	002110	三钢闽光	27,350	182,151.00	0.04
289	000501	鄂武商 A	11,600	181,888.00	0.04
290	002635	安洁科技	7,300	181,770.00	0.04
291	603317	天味食品	3,270	181,746.60	0.04
292	601333	广深铁路	80,300	180,675.00	0.04
293	000519	中兵红箭	19,100	179,922.00	0.04
294	601615	明阳智能	14,400	179,280.00	0.04
295	000089	深圳机场	23,400	179,244.00	0.04
296	688090	瑞松科技	3,013	179,122.85	0.04
297	300180	华峰超纤	20,900	178,904.00	0.04
298	688568	中科星图	11,020	178,634.20	0.04
299	601098	中南传媒	16,800	177,744.00	0.04
300	000681	视觉中国	9,500	176,890.00	0.04
301	300182	捷成股份	44,200	176,358.00	0.04
302	600633	浙数文化	18,000	176,040.00	0.04
303	600266	城建发展	34,704	175,949.28	0.04
304	000598	兴蓉环境	38,200	175,720.00	0.04
305	600120	浙江东方	25,378	174,346.86	0.04
306	600021	上海电力	23,400	173,160.00	0.04
307	000807	云铝股份	39,700	173,092.00	0.04
308	601866	中远海发	93,500	172,040.00	0.04
309	000563	陕国投 A	46,100	171,031.00	0.04
310	600643	爱建集团	21,500	170,925.00	0.04
311	601718	际华集团	51,300	170,316.00	0.04
312	002092	中泰化学	37,500	169,875.00	0.04
313	002203	海亮股份	19,400	169,750.00	0.04
314	601865	福莱特	9,000	169,200.00	0.04
315	000883	湖北能源	47,900	168,608.00	0.04
316	688100	威胜信息	6,483	168,039.36	0.04
317	600566	济川药业	6,600	168,036.00	0.04
318	600908	无锡银行	33,900	166,449.00	0.04
319	600388	龙净环保	18,900	166,320.00	0.04
320	600808	马钢股份	64,300	165,894.00	0.04
321	002010	传化智联	30,300	164,832.00	0.04
322	600863	内蒙华电	66,500	163,590.00	0.04
323	600500	中化国际	32,160	162,729.60	0.04
324	601699	潞安环能	29,200	162,644.00	0.04

325	000046	泛海控股	42,900	161,733.00	0.04
326	002583	海能达	21,200	160,908.00	0.04
327	600777	新潮能源	105,800	160,816.00	0.04
328	002444	巨星科技	13,500	160,380.00	0.04
329	000488	晨鸣纸业	32,200	159,068.00	0.04
330	000528	柳工	25,200	159,012.00	0.04
331	600312	平高电气	21,400	158,788.00	0.04
332	002670	国盛金控	17,293	158,230.95	0.04
333	688558	国盛智科	3,565	157,929.50	0.04
334	000028	国药一致	3,500	157,535.00	0.04
335	002266	浙富控股	40,700	157,509.00	0.04
336	000156	华数传媒	14,500	157,035.00	0.04
337	002407	多氟多	14,700	156,408.00	0.04
338	000078	海王生物	37,300	156,287.00	0.04
339	000826	启迪环境	21,000	155,820.00	0.04
340	002745	木林森	10,100	155,641.00	0.04
341	600316	洪都航空	9,800	154,840.00	0.03
342	000415	渤海租赁	51,700	154,066.00	0.03
343	000559	万向钱潮	31,800	153,912.00	0.03
344	000027	深圳能源	33,120	153,676.80	0.03
345	002701	奥瑞金	36,500	152,935.00	0.03
346	002936	郑州银行	44,000	151,360.00	0.03
347	002155	湖南黄金	19,100	150,508.00	0.03
348	002440	闰土股份	16,400	149,896.00	0.03
349	300459	金科文化	42,983	148,291.35	0.03
350	600073	上海梅林	15,500	147,095.00	0.03
351	000930	中粮科技	21,500	146,845.00	0.03
352	000887	中鼎股份	18,700	146,795.00	0.03
353	600138	中青旅	14,800	146,076.00	0.03
354	600062	华润双鹤	11,040	145,948.80	0.03
355	600970	中材国际	27,600	145,728.00	0.03
356	002815	崇达技术	7,200	145,656.00	0.03
357	300595	欧普康视	2,100	145,614.00	0.03
358	002640	跨境通	22,400	145,376.00	0.03
359	000758	中色股份	34,600	144,628.00	0.03
360	000987	越秀金控	12,400	144,584.00	0.03
361	000813	德展健康	23,200	143,840.00	0.03
362	002372	伟星新材	12,360	143,746.80	0.03
363	002244	滨江集团	33,600	143,472.00	0.03
364	000990	诚志股份	11,300	143,397.00	0.03
365	600751	海航科技	45,300	141,789.00	0.03
366	002505	大康农业	63,000	141,750.00	0.03

367	600478	科力远	30,000	141,300.00	0.03
368	600835	上海机电	8,300	140,519.00	0.03
369	600409	三友化工	30,000	139,800.00	0.03
370	601200	上海环境	11,630	139,560.00	0.03
371	000898	鞍钢股份	56,600	138,670.00	0.03
372	002002	鸿达兴业	38,300	138,263.00	0.03
373	002625	光启技术	19,000	137,750.00	0.03
374	603486	科沃斯	4,520	136,549.20	0.03
375	600158	中体产业	16,647	136,172.46	0.03
376	600557	康缘药业	9,700	135,024.00	0.03
377	002589	瑞康医药	25,100	134,536.00	0.03
378	601958	金钼股份	21,400	132,252.00	0.03
379	000301	东方盛虹	23,700	131,772.00	0.03
380	002390	信邦制药	28,700	130,872.00	0.03
381	000008	神州高铁	44,300	130,242.00	0.03
382	688377	迪威尔	7,894	129,619.48	0.03
383	600291	西水股份	14,300	129,415.00	0.03
384	000031	大悦城	25,400	129,286.00	0.03
385	603885	吉祥航空	14,200	129,220.00	0.03
386	600259	广晟有色	4,300	129,000.00	0.03
387	601608	中信重工	37,700	128,934.00	0.03
388	600765	中航重机	12,500	127,750.00	0.03
389	600640	号百控股	6,400	127,680.00	0.03
390	300072	三聚环保	29,800	127,544.00	0.03
391	300134	大富科技	9,100	127,218.00	0.03
392	002064	华峰氨纶	24,900	126,243.00	0.03
393	002302	西部建设	13,100	125,760.00	0.03
394	000732	泰禾集团	24,700	125,723.00	0.03
395	600648	外高桥	8,800	124,432.00	0.03
396	002434	万里扬	14,300	124,124.00	0.03
397	002249	大洋电机	34,000	122,740.00	0.03
398	601678	滨化股份	28,900	122,536.00	0.03
399	600717	天津港	27,600	121,992.00	0.03
400	002867	周大生	5,500	121,935.00	0.03
401	600277	亿利洁能	36,998	120,613.48	0.03
402	600545	卓郎智能	25,400	120,142.00	0.03
403	002563	森马服饰	17,000	119,850.00	0.03
404	000685	中山公用	15,400	118,580.00	0.03
405	000848	承德露露	16,850	117,950.00	0.03
406	002424	贵州百灵	14,200	117,860.00	0.03
407	002128	露天煤业	15,200	117,800.00	0.03
408	600307	酒钢宏兴	75,200	115,808.00	0.03

409	600901	江苏租赁	22,200	115,662.00	0.03
410	600141	兴发集团	12,920	115,634.00	0.03
411	603198	迎驾贡酒	5,300	115,381.00	0.03
412	000062	深圳华强	7,935	115,374.90	0.03
413	600694	大商股份	4,800	115,152.00	0.03
414	600582	天地科技	39,200	114,856.00	0.03
415	000717	韶钢松山	30,100	114,380.00	0.03
416	603888	新华网	5,100	114,036.00	0.03
417	601801	皖新传媒	20,500	113,980.00	0.03
418	601611	中国核建	18,400	113,712.00	0.03
419	002408	齐翔腾达	18,300	113,643.00	0.03
420	300376	易事特	21,800	113,360.00	0.03
421	600348	阳泉煤业	26,600	112,252.00	0.03
422	002503	搜于特	39,800	111,838.00	0.03
423	002653	海思科	4,200	111,762.00	0.03
424	601016	节能风电	51,900	110,028.00	0.02
425	600338	西藏珠峰	10,960	109,600.00	0.02
426	000718	苏宁环球	35,400	109,386.00	0.02
427	600329	中新药业	6,300	109,116.00	0.02
428	600664	哈药股份	35,400	109,032.00	0.02
429	002665	首航高科	44,400	108,336.00	0.02
430	603087	甘李药业	1,076	107,922.80	0.02
431	601880	大连港	62,600	107,672.00	0.02
432	300257	开山股份	8,200	107,174.00	0.02
433	002093	国脉科技	12,000	106,200.00	0.02
434	688277	天智航-U	8,810	106,072.40	0.02
435	603766	隆鑫通用	27,200	105,264.00	0.02
436	000543	皖能电力	26,000	104,520.00	0.02
437	600869	智慧能源	26,100	104,400.00	0.02
438	002544	杰赛科技	7,900	103,885.00	0.02
439	688027	国盾量子	2,830	102,389.40	0.02
440	600017	日照港	40,900	101,841.00	0.02
441	688081	兴图新科	2,418	101,580.18	0.02
442	002419	天虹股份	10,300	98,365.00	0.02
443	600565	迪马股份	35,200	98,208.00	0.02
444	000869	张裕A	2,800	95,620.00	0.02
445	603328	依顿电子	9,100	94,913.00	0.02
446	688528	秦川物联	8,337	94,458.21	0.02
447	600339	中油工程	41,200	93,524.00	0.02
448	600770	综艺股份	19,300	92,640.00	0.02
449	603515	欧普照明	3,380	92,510.60	0.02
450	002470	*ST金正	40,700	92,389.00	0.02

451	603377	东方时尚	5,500	91,080.00	0.02
452	600053	九鼎投资	3,000	89,520.00	0.02
453	603225	新凤鸣	8,820	88,023.60	0.02
454	300197	铁汉生态	34,600	87,884.00	0.02
455	002051	中工国际	12,000	87,360.00	0.02
456	601869	长飞光纤	2,800	86,268.00	0.02
457	002118	紫鑫药业	19,400	86,136.00	0.02
458	603983	丸美股份	1,000	86,030.00	0.02
459	600428	中远海特	27,900	85,932.00	0.02
460	600985	淮北矿业	11,000	85,690.00	0.02
461	600006	东风汽车	21,200	85,436.00	0.02
462	688600	皖仪科技	5,468	84,754.00	0.02
463	600575	淮河能源	39,800	83,182.00	0.02
464	000553	安道麦 A	9,200	82,984.00	0.02
465	000600	建投能源	16,300	82,967.00	0.02
466	601228	广州港	26,900	81,776.00	0.02
467	600657	信达地产	19,600	80,752.00	0.02
468	601139	深圳燃气	12,400	80,600.00	0.02
469	000959	首钢股份	18,500	79,550.00	0.02
470	603650	彤程新材	3,400	79,118.00	0.02
471	603056	德邦股份	5,700	77,121.00	0.02
472	603786	科博达	1,000	75,350.00	0.02
473	002285	世联行	27,000	75,330.00	0.02
474	002946	新乳业	4,200	72,870.00	0.02
475	600757	长江传媒	14,000	71,260.00	0.02
476	601019	山东出版	11,300	70,625.00	0.02
477	603556	海兴电力	4,730	68,301.20	0.02
478	600874	创业环保	9,800	65,072.00	0.01
479	600996	贵广网络	9,000	64,170.00	0.01
480	600058	五矿发展	10,600	64,024.00	0.01
481	600623	华谊集团	12,300	63,468.00	0.01
482	002941	新疆交建	4,400	62,260.00	0.01
483	600903	贵州燃气	5,900	58,056.00	0.01
484	000537	广宇发展	7,900	57,670.00	0.01
485	603868	飞科电器	1,100	54,263.00	0.01
486	601127	小康股份	6,500	54,015.00	0.01
487	601811	新华文轩	5,200	52,884.00	0.01
488	601003	柳钢股份	11,900	52,717.00	0.01
489	600335	国机汽车	11,400	52,668.00	0.01
490	000025	特力 A	2,835	51,965.55	0.01
491	002818	富森美	4,060	49,938.00	0.01
492	601969	海南矿业	9,600	46,848.00	0.01

493	001872	招商港口	2,400	34,920.00	0.01
494	600917	重庆燃气	4,500	32,130.00	0.01
495	603025	大豪科技	4,230	30,752.10	0.01
496	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.01
497	603256	宏和科技	2,300	26,312.00	0.01
498	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.00
499	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.00
500	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.00
501	601068	中铝国际	2,800	10,948.00	0.00
502	300847	中船汉光	1,421	9,861.74	0.00
503	002957	科瑞技术	400	9,560.00	0.00
504	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
505	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
506	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
507	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.00
508	300308	中际旭创	40	2,520.00	0.00
509	002812	恩捷股份	20	1,316.00	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	002280	*ST 联络	8,371,091.56	6.47
2	600737	中粮糖业	7,799,429.00	6.02
3	600754	锦江酒店	7,074,307.13	5.46
4	600823	世茂股份	6,978,564.00	5.39
5	601816	京沪高铁	6,319,848.88	4.88
6	600704	物产中大	6,055,711.00	4.68
7	002603	以岭药业	5,532,055.98	4.27
8	002385	大北农	5,472,927.00	4.23
9	300012	华测检测	5,455,045.90	4.21
10	002371	北方华创	5,214,480.02	4.03
11	002416	爱施德	5,199,939.29	4.02
12	002439	启明星辰	5,135,168.00	3.97
13	600008	首创股份	5,133,873.00	3.97
14	600699	均胜电子	5,084,183.00	3.93
15	300316	晶盛机电	5,051,572.00	3.90
16	600649	城投控股	5,038,501.00	3.89
17	600881	亚泰集团	5,026,013.00	3.88
18	000712	锦龙股份	4,995,737.86	3.86
19	000402	金融街	4,992,423.59	3.86
20	002030	达安基因	4,918,871.70	3.80

21	600466	蓝光发展	4,898,020.00	3.78
22	601099	太平洋	4,886,992.00	3.78
23	002375	亚厦股份	4,823,319.26	3.73
24	600787	中储股份	4,819,477.46	3.72
25	300383	光环新网	4,793,021.84	3.70
26	002491	通鼎互联	4,766,275.00	3.68
27	600166	福田汽车	4,761,988.00	3.68
28	600875	东方电气	4,715,670.53	3.64
29	601717	郑煤机	4,707,306.20	3.64
30	600804	鹏博士	4,693,985.38	3.63
31	002019	亿帆医药	4,691,023.40	3.62
32	600258	首旅酒店	4,686,362.00	3.62
33	300529	健帆生物	4,686,000.00	3.62
34	600748	上实发展	4,657,945.72	3.60
35	000937	冀中能源	4,652,328.90	3.59
36	600125	铁龙物流	4,643,190.22	3.59
37	603355	莱克电气	4,636,197.70	3.58
38	600779	水井坊	4,623,127.34	3.57
39	300296	利亚德	4,619,710.00	3.57
40	300002	神州泰岳	4,617,999.90	3.57
41	600521	华海药业	4,613,244.82	3.56
42	603883	老百姓	4,608,519.01	3.56
43	600298	安琪酵母	4,597,461.98	3.55
44	600639	浦东金桥	4,590,040.14	3.55
45	002709	天赐材料	4,587,025.40	3.54
46	601000	唐山港	4,581,911.00	3.54
47	002831	裕同科技	4,514,188.84	3.49
48	600060	海信视像	4,494,313.44	3.47
49	603816	顾家家居	4,458,986.40	3.44
50	601928	凤凰传媒	4,405,147.00	3.40
51	000967	盈峰环境	4,273,131.72	3.30
52	000564	供销大集	4,142,959.00	3.20
53	603000	人民网	4,112,000.00	3.18
54	002183	怡亚通	4,042,239.18	3.12
55	601718	际华集团	4,037,868.00	3.12
56	002653	海思科	3,983,199.04	3.08
57	600415	小商品城	3,966,864.00	3.06
58	002242	九阳股份	3,831,768.26	2.96
59	002670	国盛金控	3,384,362.00	2.61
60	600839	四川长虹	3,264,804.00	2.52
61	002797	第一创业	3,210,767.00	2.48
62	002368	太极股份	3,119,997.63	2.41

63	000998	隆平高科	3,114,549.98	2.41
64	600201	生物股份	2,994,631.24	2.31
65	600895	张江高科	2,965,908.00	2.29
66	002048	宁波华翔	2,906,743.00	2.25
67	600158	中体产业	2,869,658.84	2.22
68	600325	华发股份	2,853,620.00	2.20
69	002233	塔牌集团	2,830,120.00	2.19
70	600064	南京高科	2,767,428.00	2.14
71	002028	思源电气	2,756,687.00	2.13
72	601127	小康股份	2,752,931.00	2.13
73	002004	华邦健康	2,711,396.38	2.09
74	600143	金发科技	2,629,581.00	2.03
75	002250	联化科技	2,597,216.00	2.01

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601928	凤凰传媒	5,066,556.14	3.91
2	002831	裕同科技	4,814,774.88	3.72
3	000998	隆平高科	4,599,599.00	3.55
4	002048	宁波华翔	4,524,945.02	3.50
5	600875	东方电气	4,523,914.27	3.49
6	002028	思源电气	4,522,731.00	3.49
7	002368	太极股份	4,365,785.00	3.37
8	600143	金发科技	4,342,710.00	3.35
9	601718	际华集团	4,336,253.00	3.35
10	600839	四川长虹	4,283,743.00	3.31
11	002821	凯莱英	4,247,837.00	3.28
12	600895	张江高科	4,110,663.00	3.18
13	603000	人民网	4,010,987.00	3.10
14	000400	许继电气	3,947,366.00	3.05
15	603939	益丰药房	3,940,610.00	3.04
16	002653	海思科	3,873,685.91	2.99
17	600167	联美控股	3,847,674.68	2.97
18	002280	*ST 联络	3,782,647.00	2.92
19	300134	大富科技	3,782,598.00	2.92
20	002670	国盛金控	3,774,505.00	2.92
21	600823	世茂股份	3,773,644.00	2.92
22	300296	利亚德	3,749,253.00	2.90
23	600158	中体产业	3,617,801.93	2.79
24	600064	南京高科	3,602,945.00	2.78

25	603568	伟明环保	3,589,013.00	2.77
26	600325	华发股份	3,567,918.42	2.76
27	002250	联化科技	3,546,273.00	2.74
28	600062	华润双鹤	3,511,960.25	2.71
29	600754	锦江酒店	3,504,617.62	2.71
30	601127	小康股份	3,431,116.00	2.65
31	600415	小商品城	3,401,809.00	2.63
32	600737	中粮糖业	3,292,982.00	2.54
33	600418	江淮汽车	3,279,997.00	2.53
34	600970	中材国际	3,147,805.00	2.43
35	603766	隆鑫通用	3,123,996.00	2.41
36	601969	海南矿业	3,100,490.00	2.40
37	600021	上海电力	3,073,175.00	2.37
38	600201	生物股份	3,066,218.54	2.37
39	603806	福斯特	3,027,484.00	2.34
40	688126	沪硅产业-U	2,972,098.51	2.30
41	002797	第一创业	2,958,336.00	2.29
42	002004	华邦健康	2,887,615.00	2.23
43	002233	塔牌集团	2,875,046.00	2.22
44	688111	金山办公	2,609,678.48	2.02
45	601816	京沪高铁	2,602,231.55	2.01

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	459,689,330.06
卖出股票收入（成交）总额	273,954,981.09

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,030,000.00	4.51
	其中：政策性金融债	20,030,000.00	4.51
4	企业债券	90,526,000.00	20.38
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	68,067.20	0.02
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	110,624,067.20	24.91

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	163108	20CHNE01	200,000	20,166,000.00	4.54
2	018007	国开 1801	200,000	20,030,000.00	4.51
3	149040	20 深铁 01	200,000	19,962,000.00	4.49
4	143709	18 诚通 01	100,000	10,175,000.00	2.29
5	143867	18 电投 08	100,000	10,162,000.00	2.29

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：无。

7.10.2 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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：无。

7.11.3 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	110,297.61
2	应收证券清算款	2,006,262.11
3	应收股利	-
4	应收利息	2,048,720.52
5	应收申购款	128,262.76
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,293,543.00

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110062	烽火转债	29,930.40	0.01
2	110061	川投转债	16,860.00	0.00

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	601816	京沪高铁	5,593,327.12	1.26	锁定期股票

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比 例 (%)	持有份额	占总份额比 例 (%)
726	429,786.19	279,277,831.17	89.51	32,746,940.66	10.49

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	838,787.97	0.2688

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

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

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	107,280,282.87
本报告期基金总申购份额	249,584,867.85
减：本报告期基金总赎回份额	44,840,378.89
本报告期基金拆分变动份额（份额减少 以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	312,024,771.83

§ 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

报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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

本基金管理人、基金托管人涉及托管业务机构及其高级管理人员在报告期内未受到任何稽查或处罚。

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	
广发证券	1	181,590,785.54	25.25%	165,483.51	25.80%	-
中泰证券	2	160,527,631.48	22.32%	146,288.53	22.80%	-
国盛证券	2	112,345,138.88	15.62%	91,146.03	14.21%	-
安信证券	2	98,679,064.22	13.72%	89,925.79	14.02%	-
天风证券	2	41,699,205.22	5.80%	38,000.45	5.92%	本报告期内新增1个
中信建投	1	36,031,174.06	5.01%	32,835.17	5.12%	-
爱建证券	1	27,539,907.94	3.83%	22,343.56	3.48%	-
东北证券	1	22,112,193.42	3.07%	20,151.22	3.14%	-
国金证券	1	18,634,130.82	2.59%	16,981.70	2.65%	-
西南证券	2	10,362,195.49	1.44%	9,443.13	1.47%	-

招商证券	1	9,780,991.63	1.36%	8,913.63	1.39%	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
东方财富证 券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	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，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，最近二年未发生因重大违规行为而受到中国证监会处罚；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；

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

2) 选择交易单元的程序：

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
广发证券	-	-	197,400,000.00	8.74%	-	-
中泰证券	27,991,610.20	18.05%	1,311,200,000.00	58.03%	-	-
国盛证券	12,065,998.96	7.78%	3,000,000.00	0.13%	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	11,998,800.01	7.74%	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	337,000,000.00	14.91%	-	-
东北证券	-	-	24,000,000.00	1.06%	-	-
国金证券	-	-	92,200,000.00	4.08%	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	103,037,267.50	66.44%	294,800,000.00	13.05%	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
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	鹏华基金管理有限公司关于旗下证券投资基金招募说明书的补充提示	《上海证券报》	2020年01月16日
2	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2020年06月03日
3	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与青岛意才基金销售有限公司认、申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《证券日报》	2020年01月17日
4	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与青岛意才基金销售有限公司认、申购（含定期定额申购）费率优	《上海证券报》	2020年01月17日

	惠活动的公告		
5	鹏华基金管理有限公司关于增加大同证券有限责任公司为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》	2020 年 01 月 20 日
6	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2019 年第 4 季度报告提示性公告	《证券时报》	2020 年 01 月 20 日
7	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2019 年第 4 季度报告提示性公告	《中国证券报》	2020 年 01 月 20 日
8	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2019 年第 4 季度报告提示性公告	《上海证券报》	2020 年 01 月 20 日
9	鹏华基金管理有限公司关于调整旗下基金 2020 年春节假期清算交收安排及申购赎回等交易业务的提示性公告	《上海证券报》	2020 年 02 月 03 日
10	鹏华基金管理有限公司关于调整旗下基金 2020 年春节假期清算交收安排及申购赎回等交易业务的提示性公告	《证券时报》	2020 年 02 月 03 日
11	鹏华基金管理有限公司关于调整旗下基金 2020 年春节假期清算交收安排及申购赎回等交易业务的提示性公告	《证券日报》	2020 年 02 月 03 日
12	鹏华基金管理有限公司关于使用不低于 5000 万元自有资金购买本公司旗下偏股型公募基金的公告	《证券日报》	2020 年 02 月 05 日
13	鹏华基金管理有限公司关于使用不低于 5000 万元自有资金购买本公司旗下偏股型公募基金的公告	《证券时报》	2020 年 02 月 05 日
14	鹏华基金管理有限公司关于使用不低于 5000 万元自有资金购买本公司旗下偏股型公募基金的公告	《上海证券报》	2020 年 02 月 05 日
15	鹏华基金管理有限公司关于使用不低于 5000 万元自有资金购买本公司旗下偏股型公募基金的公告	《中国证券报》	2020 年 02 月 05 日
16	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》、《证券时报》	2020 年 03 月 17 日
17	鹏华基金管理有限公司关于增加珠海盈米基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《证券时报》	2020 年 03 月 25 日
18	鹏华基金管理有限公司关于增加珠海盈米基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》	2020 年 03 月 25 日
19	鹏华基金管理有限公司关于增加珠海盈米基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《上海证券报》	2020 年 03 月 25 日
20	鹏华基金管理有限公司关于延期披露	《证券日报》	2020 年 03 月 28 日

	旗下基金 2019 年年度报告的提示性公告		
21	鹏华基金管理有限公司关于延期披露旗下基金 2019 年年度报告的提示性公告	《证券时报》	2020 年 03 月 28 日
22	鹏华基金管理有限公司关于延期披露旗下基金 2019 年年度报告的提示性公告	《上海证券报》	2020 年 03 月 28 日
23	鹏华基金管理有限公司关于延期披露旗下基金 2019 年年度报告的提示性公告	《中国证券报》	2020 年 03 月 28 日
24	鹏华基金管理有限公司修改旗下 88 只证券投资基金基金合同的公告	《证券日报》	2020 年 04 月 15 日
25	鹏华基金管理有限公司修改旗下 88 只证券投资基金基金合同的公告	《中国证券报》	2020 年 04 月 15 日
26	鹏华基金管理有限公司修改旗下 88 只证券投资基金基金合同的公告	《上海证券报》	2020 年 04 月 15 日
27	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》、《上海证券报》、《证券日报》、《证券时报》	2020 年 04 月 15 日
28	鹏华基金管理有限公司修改旗下 88 只证券投资基金基金合同的公告	《证券时报》	2020 年 04 月 15 日
29	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2019 年年度报告提示性公告	《上海证券报》	2020 年 04 月 18 日
30	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2019 年年度报告提示性公告	《证券时报》	2020 年 04 月 18 日
31	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2019 年年度报告提示性公告	《证券日报》	2020 年 04 月 18 日
32	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2019 年年度报告提示性公告	《中国证券报》	2020 年 04 月 18 日
33	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摘要（2020 年第 1 号）	《中国证券报》	2020 年 04 月 20 日
34	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2020 年第 1 季度报告提示性公告	《证券日报》	2020 年 04 月 22 日
35	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2020 年第 1 季度报告提示性公告	《中国证券报》	2020 年 04 月 22 日
36	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2020 年第 1 季度报告提示性公告	《上海证券报》	2020 年 04 月 22 日
37	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2020 年第 1 季度报告提示性公告	《证券时报》	2020 年 04 月 22 日
38	鹏华基金管理有限公司关于结束旗下基金在中信证券华南股份有限公司（原广州证券股份有限公司）申购费	《上海证券报》	2020 年 04 月 28 日

	率优惠活动的公告		
39	鹏华基金管理有限公司关于结束旗下基金在中信证券华南股份有限公司（原广州证券股份有限公司）申购费率优惠活动的公告	《证券时报》	2020 年 04 月 28 日
40	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与华安证券股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《证券时报》	2020 年 05 月 06 日
41	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与华安证券股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2020 年 05 月 06 日
42	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与华安证券股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《证券日报》	2020 年 05 月 06 日
43	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与华安证券股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《中国证券报》	2020 年 05 月 06 日
44	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摘要	《中国证券报》	2020 年 05 月 15 日
45	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与万联证券股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2020 年 05 月 18 日
46	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金在直销渠道开展赎回费率优惠活动的公告	《中国证券报》	2020 年 05 月 18 日
47	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与万联证券股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《证券时报》	2020 年 05 月 18 日
48	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与万联证券股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《中国证券报》	2020 年 05 月 18 日
49	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与万联证券股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《证券日报》	2020 年 05 月 18 日
50	鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金暂停大额申购、转换转入和定期定	《中国证券报》	2020 年 05 月 19 日

	额投资业务的公告		
51	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金在蒙商银行股份有限公司暂停办理相关销售业务的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2020 年 05 月 23 日
52	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与青岛意才基金销售有限公司认、申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《中国证券报》	2020 年 01 月 17 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	20200116~20200507	13,565,937.91	26,299,277.52	-	39,865,215.43	12.78
	2	20200116~20200507	11,409,603.67	30,488,537.55	-	41,898,141.22	13.43
个人	-	-	-	-	-	-	-
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、指数分级基金合并份额和红利再投；

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、场内卖出份额和指数分级基金拆分份额。

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 2020 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

2020 年 8 月 31 日