

# 鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金 2020 年年度报告

2020 年 12 月 31 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：2021 年 3 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度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 2021 年 03 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）注册会计师对本基金出具了“标准无保留意见”的审计报告。

本报告期自 2020 年 01 月 01 日起至 2020 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	10
3.4 过去三年基金的利润分配情况	10
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	16
4.10 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	16
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	16
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>16</b>
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>18</b>
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	20
7.4 报表附注	22

<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>53</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	53
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	53
8.3 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 .....	54
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	67
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	73
8.6 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 .....	73
8.7 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 .....	74
8.8 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 .....	74
8.9 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 .....	74
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	74
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	74
8.12 投资组合报告附注 .....	74
<b>§ 9 基金份额持有人信息</b> .....	<b>79</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	79
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	79
9.3 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 .....	80
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 .....	80
<b>§ 10 开放式基金份额变动</b> .....	<b>80</b>
<b>§ 11 重大事件揭示</b> .....	<b>80</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	80
11.2 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 .....	80
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	80
11.4 基金投资策略的改变 .....	80
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	81
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	81
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	81
11.8 其他重大事件 .....	84
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>91</b>
12.1 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 .....	91
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	92
<b>§ 13 备查文件目录</b> .....	<b>92</b>
13.1 备查文件目录 .....	92
13.2 存放地点 .....	92
13.3 查阅方式 .....	92

## § 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	195,516,972.96 份
基金合同存续期	不定期

注：无。

### 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：一方面为竞争力分析，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</p>

	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>（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。</p> <p>3、债券投资策略 本基金债券投资将采取久期策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、个券选择策略、信用策略等积极投资策略，自上而下地管理组合的久期，灵活地调整组合的券种搭配，同时精选个券，以增强组合的持有期收益。</p> <p>4、权证投资策略 本基金通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型及价值挖掘策略、价差策略、双向权证策略等寻求权证的合理估值水平，追求稳定的当期收益。</p> <p>5、中小企业私募债投资策略 中小企业私募债券是在中国境内以非公开方式发行和转让，约定在一定期限还本付息的公司债券。由于其非公开性及条款可协商性，普遍具有较高收益。本基金将深入研究发行人资信及公司运营情况，合理合规合格地进行中小企业私募债券投资。本基金在投资过程中密切监控债券信用等级或发行人信用等级变化情况，尽力规避风险，并获取超额收益。</p> <p>6、股指期货投资策略 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。</p> <p>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。</p> <p>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	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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.phfund.com.cn">http://www.phfund.com.cn</a>
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	上海市湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2020 年	2019 年	2018 年 5 月 30 日(基金合同生效日)-2018 年 12 月 31 日
本期已实现收益	102,501,143.24	28,153,270.16	-4,208,909.98
本期利润	113,230,117.61	70,539,411.62	-37,496,328.57
加权平均基金份额本期利润	0.4737	0.4928	-0.1875
本期加权平均净值利润率	32.40%	48.30%	-20.78%
本期基金份额净值增长率	36.86%	48.41%	-18.69%

3.1.2 期末数据和指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
期末可供分配利润	108,909,588.28	17,019,496.48	-35,919,814.11
期末可供分配基金份额利润	0.5570	0.1586	-0.1869
期末基金资产净值	322,893,547.60	129,451,586.88	156,280,249.31
期末基金份额净值	1.6515	1.2067	0.8131
3.1.3 累计期末指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
基金份额累计净值增长率	65.15%	20.67%	-18.69%

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 12 月 31 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
过去三个月	6.86%	0.77%	8.59%	0.59%	-1.73%	0.18%
过去六个月	16.02%	0.92%	14.97%	0.80%	1.05%	0.12%
过去一年	36.86%	1.18%	17.68%	0.85%	19.18%	0.33%

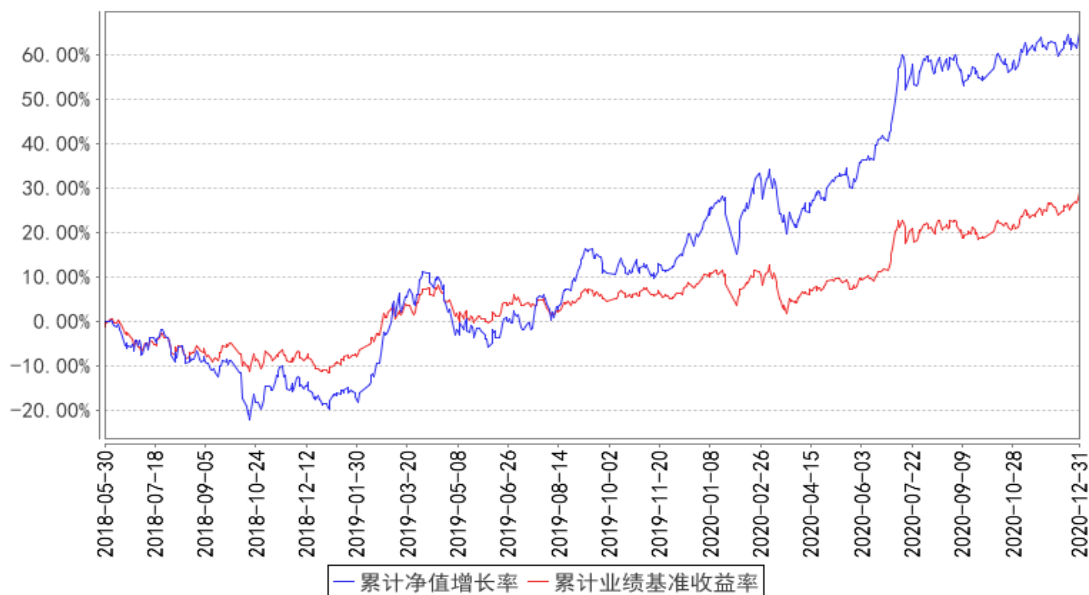


自基金合同生效起至今	65.15%	1.27%	29.03%	0.82%	36.12%	0.45%
------------	--------	-------	--------	-------	--------	-------

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

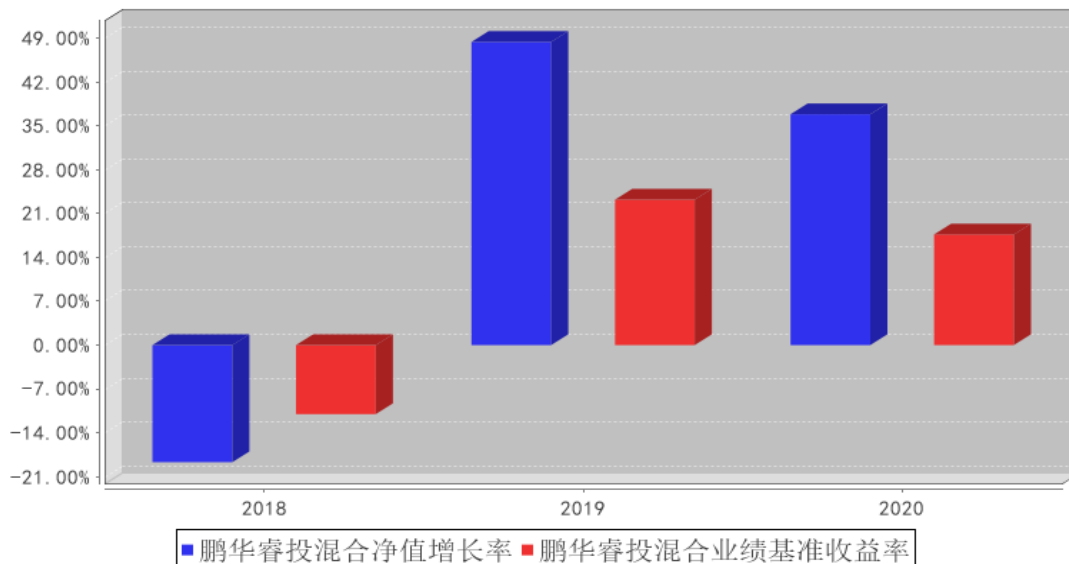
鹏华睿投混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

鹏华睿投混合基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按照实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 其他指标

注：无。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

注：无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

鹏华基金管理有限公司成立于 1998 年 12 月 22 日，业务范围包括基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。截至本报告期末，公司股东由国信证券股份有限公司、意大利欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）、深圳市北融信投资发展有限公司组成，公司性质为中外合资企业，公司注册资本 15,000 万元人民币。截至本报告期末，公司管理资产总规模达到 7,940.70 亿元，管理 213 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的经验。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
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 月担任鹏华弘和混合基金基金经理，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 月至 2018 年 05 月担任鹏华弘锐混合基金基金经理，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 月担任鹏华弘信混合基金基金经理，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。
--	--	--	--	--	---

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。

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

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 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《鹏华基金管理有限公司公平交易管理规定》，将公司所管理的封闭式基金、开放式基金、社保组合、养老组合、特定客户资产管理组合等不同资产组合的授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投

资产管理活动均纳入公平交易管理，在业务流程和岗位职责中制定公平交易的控制规则和控制活动，建立对公平交易的执行、监督及审核流程，严禁在不同投资组合之间进行利益输送。在投资研究环节：1、公司使用唯一的研究报告发布平台“研究报告管理平台”，确保各投资组合在获得投资信息、研究支持、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；2、公司严格按照《股票库管理规定》、《信用债券投资与风险控制管理规定》，执行股票及信用产品出入库及日常维护工作，确保相关证券入库以内容严谨、观点明确的研究报告作为依据；3、在公司股票库基础上，各涉及股票投资的资产组合根据各自的投资目标、投资风格、投资范围和防范关联交易的原则分别建立资产组合股票库，基金经理在股票库基础上根据投资授权以及基金合同择股方式构建具体的投资组合；4、严格执行投资授权制度，明确投资决策委员会、分管投资副总裁、基金经理等各主体的职责和权限划分，合理确定基金经理的投资权限，超过投资权限的操作，应严格履行审批程序。在交易执行环节：1、所有公司管理的资产组合的交易必须通过集中交易室完成，集中交易室负责建立和执行交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会；2、针对交易所公开竞价交易，集中交易室应严格启用恒生交易系统中的公平交易程序，交易系统则自动启用公平交易功能，由系统按照“未委托数量”的比例对不同资产组合进行委托量的公平分配；如果相关基金经理坚持以不同的价格进行交易，且当前市场价格不能同时满足多个资产组合的指令价格要求时，交易系统自动按照“价格优先”原则进行委托；当市场价格同时满足多个资产组合的指令价格要求时，则交易系统自动按照“同一指令价格下的公平交易”模式，进行公平委托和交易量分配；3、银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易需依据公司《股票投资交易流程》和《固定收益投资管理流程》的规定执行；银行间市场交易、交易所大宗交易等以公司名义进行的交易，各投资组合经理应在交易前独立确定各投资组合的交易价格和数量，公司按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；4、新股、新债申购及非公开定向增发交易需依据公司《新股申购流程》、《固定收益投资管理流程》和《非公开定向增发流程》的规定执行，对新股和新债申购方案和分配过程进行审核和监控。在交易监控、分析与评估环节：1、为加强对日常投资交易行为的监控和管理，杜绝利益输送、不公平交易等违规交易行为，防范日常交易风险，公司明确了关注类交易的界定及对应的监控和评估措施机制；所监控的交易包括但不限于：交易所公开竞价交易中同日同向交易的交易时机和交易价差、不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差、关联交易、债券交易收益率偏离度、成交量和成交价格异常、银行间债券交易对手交易等；2、将公平交易作为投资组合业绩归因分析和交易绩效评价的重要关注内容，发现的异常情况由投资监察员进行分析；3、监察稽核部分别于每季度和每年度编写《公平交易执行情况检查报告》，内容包括关注类交易监控执行情况、不同投资组合的整体收益率差异分析和同向交易价差

分析；《公平交易执行情况检查报告》需经公司基金经理、督察长和总经理签署。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行公平交易制度，确保不同投资组合在研究、交易、分配各环节得到公平对待。同时，根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求，公司对所管理组合的不同时间窗的同向交易进行了价差专项分析，未发现存在违反公平交易原则的现象。

##### 4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

无。

#### 4.3.3 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 年是极其特殊的一年，百年不遇的新冠疫情对经济供给和需求上都造成非常大的扰动，宏观经济一季度快速回落，其后逐季回升。政府采用强有力的政策控制疫情的同时调配宏观经济总量上的供给和需求，政府部门增加负债直接创造部分需求，适度放宽企业部门杠杆压制，企业部门杠杆率也有所回升，居民部门保持房地产负债相对稳定的情况下也在加杠杆上有所助力。具体来看，基建稳中有升、房地产保持稳定偏向积极、制造业也有复苏迹象，消费方面恢复相对偏缓。价格方面，生活品端受猪肉价格冲高回落带动趋势性下行，工业品价格受疫情全球扩散以后供需两方面的多重扰动有所上行。

权益市场在疫情冲击下出现几次显著调整，但最终回到了 2019 年以来的上行趋势之中。上半年疫情爆发后流动性进入宽松状况，市场交易热情稳步提升，进入下半年以后，海外供给显著受抑制，出口带动国内生产端加速复苏，企业盈利伴随工业价格上行逐步改善。上半年创业板指和科创板指表现相对较强，高估值与低估值表现差异进一步拉大，下半年市场相比较而言更加均衡。债券市场，受疫情大幅释放流动性影响收益率曲线整体快速下行，其后伴随生产恢复和流动性向均衡调整，债券市场也恢复至 2019 年下半年的调整趋势，下半年伴随部分信用风险的暴露，市场扰动进一步加大。

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

鹏华睿投灵活配置混合组合净值增长率 36.86%；鹏华睿投灵活配置混合业绩比较基准增长率 17.68%。

#### 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，新冠疫情的影响仍将持续，但已经从快速扩张阶段逐步进入到防治阶段，疫苗已经在主流较大经济体开始接种，其他国家预计也将在未来一至两年逐步接种。海外进行了大规模的财政刺激计划，直接补贴至居民端，在需求上保持相对稳定，供给上受到抑制相对较大，因此，在疫情明显控制之前，国内强大的产能供给仍可以支撑出口的持续增长。内需在社融增速仍处于同比近年较高水平的情况下，基建和地产仍可以保持稳定，制造业投资有向上动力，消费端仍有概率延续稳步复苏趋势。伴随信用扩张逐步趋缓，融资需求在进入下半年以后压力逐步增大，届时海外供给也将伴随疫苗接种有所恢复，宏观经济压力逐步显现。

在此情况下，流动性收缩之前，盈利改善的趋势仍对权益类资产起到积极正面的作用，但信用扩张的顶部区域大概率在 2020 年四季度，信用收缩过程中的预期扰动相对较大，我们短期仍然对权益类资产中性偏积极。债券方面，收益率已经有一定程度的回升，但全球需求扩张和经济顺周期改善趋势仍在的情况下，较难对债券过于乐观，因此，我们短期对债券类资产中性偏悲观，稍长时间来看，对债券类资产不悲观。

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。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人继续完善内部控制、提升风险管理水平，着重开展了以下各项工作：

##### 1、继续完善内部控制体系

公司根据法律法规、监管要求及业务发展需求，不断优化现有的标准化业务流程体系，强调业务流程服务于加强风险防范和提升运营效率，通过信息技术手段持续提升业务操作的系统化程度，并不断优化。

##### 2、持续改进投资监控的方法与手段，保证基金投资业务的合法合规性

报告期内，在投资日常合规监控工作方面，公司根据法律法规和产品特点进一步完善了投资监控系统以提升投资监控效率；在实现交易价差分析、银行间交易分析、研究报告检查等专项检查工作定期化、日常化的基础上，公司多次开展有关内幕交易、未公开信息等重要内容的合规培

训，进一步强化全体投研人员的合规意识。

### 3、规范基金销售业务，保证基金销售业务的合法合规性

报告期内，在基金募集和持续营销活动中，公司严格规范基金销售业务，按照《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及相关法规规定审查宣传推介材料，逐步落实反洗钱法律法规各项要求，并督促销售部门做好投资者教育工作，本报告期内没有出现主动违规行为。

### 4、开展以风险为导向的内部稽核

报告期内，监察稽核部开展了对信息技术管理、投资相关流程、员工行为、反洗钱业务、子公司管理和公司日常运作的定期监察稽核与专项监察稽核。监察稽核人员开展了以风险为导向的内部稽核，通过稽核发现，提高了公司标准化操作流程手册的执行效力，优化了标准化操作流程手册。报告期内，公司未发生重大风险事件。

## 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术。

本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本基金管理人设有估值委员会，由登记结算部、监察稽核部、各投资部门、研究部门负责人、基金经理等成员组成，估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规和基金估值运作等方面的专业能力。基金经理可与估值委员会成员共同商定估值原则和政策，但不参与日常估值的执行。

基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值发生重大变化的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

本基金管理人已与第三方定价服务机构签署服务协议，由其按约定提供相关参考数据。

## 4.8 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 108,909,588.28 元，期末基金份额净值 1.6515 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。

**4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明**

无。

**4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

无。

**§ 5 托管人报告****5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明**

本报告期，招商银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

**5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见**

本托管人复核审查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。

**§ 6 审计报告****6.1 审计报告基本信息**

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2021)第 21904 号

**6.2 审计报告的基本内容**

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“鹏华睿投混合基金”)的财务报表,包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表,2020 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会</p>



	(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了鹏华睿投混合基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于鹏华睿投混合基金,并履行了职业道德方面的其他责任。
强调事项	无。
其他事项	无。
其他信息	无。
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>鹏华睿投混合基金的基金管理人鹏华基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估鹏华睿投混合基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算鹏华睿投混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督鹏华睿投混合基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p>

	<p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时, 根据获取的审计证据, 就可能对导致对鹏华睿投混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性, 审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露; 如果披露不充分, 我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而, 未来的事项或情况可能导致鹏华睿投混合基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容, 并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通, 包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	单峰	肖菊
会计师事务所的地址	中国上海市	
审计报告日期	2021 年 3 月 24 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 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 12 月 31 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
<b>资产:</b>			
银行存款	7.4.7.1	4,472,078.78	7,464,079.91
结算备付金		16,991,832.18	366,123.95
存出保证金		118,640.34	72,106.04
交易性金融资产	7.4.7.2	395,047,072.19	122,961,035.34
其中: 股票投资		203,320,060.99	118,409,603.04
基金投资		-	-
债券投资		191,727,011.20	4,551,432.30
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		203,215.46	-
应收利息	7.4.7.5	3,145,643.58	100,919.17
应收股利		-	-
应收申购款		10,640.40	8,828.41

递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		419,989,122.93	130,973,092.82
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020年12月31日</b>	<b>上年度末 2019年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		95,900,000.00	-
应付证券清算款		235,992.57	-
应付赎回款		15,175.31	1,055,820.39
应付管理人报酬		453,254.68	164,787.23
应付托管费		60,433.93	21,971.63
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	289,126.47	112,559.93
应交税费		6,263.46	0.52
应付利息		-34,714.37	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	170,043.28	166,366.24
负债合计		97,095,575.33	1,521,505.94
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	195,516,972.96	107,280,282.87
未分配利润	7.4.7.10	127,376,574.64	22,171,304.01
所有者权益合计		322,893,547.60	129,451,586.88
负债和所有者权益总计		419,989,122.93	130,973,092.82

注：报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.6515 元，基金份额总额 195,516,972.96 份。

## 7.2 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 12 月 31 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 12 月 31 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
一、收入		124,153,654.67	74,319,728.46
1. 利息收入		5,132,963.48	498,327.28
其中：存款利息收入	7.4.7.11	234,304.63	65,432.89
债券利息收入		4,820,931.01	417,674.76
资产支持证券利息收		-	-

入			
买入返售金融资产收入		77,727.84	15,219.63
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		107,421,000.89	29,913,270.52
其中：股票投资收益	7.4.7.12	105,414,189.30	28,360,793.78
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-742,685.66	37,004.32
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	2,749,497.25	1,515,472.42
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	10,728,974.37	42,386,141.46
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	870,715.93	1,521,989.20
减：二、费用		10,923,537.06	3,780,316.84
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	5,202,634.67	2,182,816.27
2. 托管费	7.4.10.2.2	693,684.61	291,042.15
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	2,678,400.97	1,004,277.12
5. 利息支出		2,153,201.95	121,677.36
其中：卖出回购金融资产支出		2,153,201.95	121,677.36
6. 税金及附加		8,905.22	277.06
7. 其他费用	7.4.7.20	186,709.64	180,226.88
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		113,230,117.61	70,539,411.62
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		113,230,117.61	70,539,411.62

### 7.3 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12月31日

单位：人民币元

项目	本期
	2020年1月1日至2020年12月31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、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	113,230,117.61	113,230,117.61
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)	88,236,690.09	-8,024,846.98	80,211,843.11
其中: 1. 基金申购款	252,000,631.13	75,941,024.71	327,941,655.84
2. 基金赎回款	-163,763,941.04	-83,965,871.69	-247,729,812.73
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)	195,516,972.96	127,376,574.64	322,893,547.60
项目	上年度可比期间		
	2019年1月1日至2019年12月31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)	-	70,539,411.62	70,539,411.62
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)	-84,919,780.55	-12,448,293.50	-97,368,074.05
其中: 1. 基金申购款	128,119,484.76	2,783,287.13	130,902,771.89
2. 基金赎回款	-213,039,265.31	-15,231,580.63	-228,270,845.94
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）	107,280,282.87	22,171,304.01	129,451,586.88

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

邓召明

苏波

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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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、存托凭证）、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（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%，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%。

本财务报表由本基金的基金管理人鹏华基金管理有限公司于本基金的审计报告日批准报出。

#### 7.4.2 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。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年度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 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

###### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、基金投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。



(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件,应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的;且 2) 交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税(和/或)股票交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。资产支持证券在持有期间收到的款项,根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分,将本金部分冲减资产支持证券投资成本,并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收

益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费(如有)在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股

票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金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》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，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》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 7.4.6 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。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日

活期存款	4,472,078.78	7,464,079.91
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	4,472,078.78	7,464,079.91

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	183,149,374.14	203,320,060.99	20,170,686.85
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	192,070,000.81	191,727,011.20
	银行间市场	-	-
	合计	192,070,000.81	191,727,011.20
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	375,219,374.95	395,047,072.19	19,827,697.24
项目	上年度末 2019 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	109,328,877.66	118,409,603.04	9,080,725.38
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	4,533,434.81	4,551,432.30
	银行间市场	-	-
	合计	4,533,434.81	4,551,432.30
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	113,862,312.47	122,961,035.34	9,098,722.87

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。

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应收活期存款利息	1,320.77	1,302.56
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	8,411.04	181.17
应收债券利息	3,135,853.03	99,399.80
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	58.74	35.64
合计	3,145,643.58	100,919.17

#### 7.4.7.6 其他资产

注：无。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
交易所市场应付交易费用	289,126.47	112,559.93
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	289,126.47	112,559.93

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	43.28	6,366.24
应付证券出借违约金	-	-

预提费用	170,000.00	160,000.00
合计	170,043.28	166,366.24

#### 7.4.7.9 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12月31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	252,000,631.13	252,000,631.13
本期赎回（以“-”号填列）	-163,763,941.04	-163,763,941.04
- 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	195,516,972.96	195,516,972.96

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.10 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	102,501,143.24	10,728,974.37	113,230,117.61
本期基金份额交易产生的变动数	-10,611,051.44	2,586,204.46	-8,024,846.98
其中：基金申购款	55,493,678.86	20,447,345.85	75,941,024.71
基金赎回款	-66,104,730.30	-17,861,141.39	-83,965,871.69
本期已分配利润	-	-	-
本期末	108,909,588.28	18,466,986.36	127,376,574.64

#### 7.4.7.11 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12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
	活期存款利息收入	77,671.71
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	132,498.44	13,024.37
其他	24,134.48	8,690.63
合计	234,304.63	65,432.89

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

## 7.4.7.12 股票投资收益

## 7.4.7.12.1 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12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	105,414,189.30	28,360,793.78
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	105,414,189.30	28,360,793.78

## 7.4.7.12.2 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12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
卖出股票成交总额	896,766,252.42	355,499,423.44
减：卖出股票成本总额	791,352,063.12	327,138,629.66
买卖股票差价收入	105,414,189.30	28,360,793.78

## 7.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

## 7.4.7.13 债券投资收益

## 7.4.7.13.1 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12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券	-742,685.66	37,004.32



到期兑付) 差价收入		
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	-742,685.66	37,004.32

#### 7.4.7.13.2 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12月31 日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月 31日
卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成交总额	189,776,994.30	55,729,406.84
减：卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额	187,571,828.72	54,315,846.98
减：应收利息总额	2,947,851.24	1,376,555.54
买卖债券差价收入	-742,685.66	37,004.32

#### 7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

#### 7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：无。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

##### 7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

##### 7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

## 7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

## 7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

## 7.4.7.15 衍生工具收益

## 7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

## 7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

## 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
股票投资产生的股利收益	2,749,497.25	1,515,472.42
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	2,749,497.25	1,515,472.42

## 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
1. 交易性金融资产	10,728,974.37	42,386,141.46
股票投资	11,089,961.47	42,379,143.97
债券投资	-360,987.10	6,997.49
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	10,728,974.37	42,386,141.46

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
基金赎回费收入	859,236.90	1,520,558.41
基金转换费收入	11,479.03	1,430.79
合计	870,715.93	1,521,989.20

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
交易所市场交易费用	2,678,400.97	1,004,277.12
银行间市场交易费用	-	-
合计	2,678,400.97	1,004,277.12

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
审计费用	50,000.00	40,000.00
信息披露费	120,000.00	129,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费用	16,709.64	11,226.88
合计	186,709.64	180,226.88

#### 7.4.7.21 分部报告

无。

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

无。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 7.4.9 关联方关系

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
深圳市北融信投资发展有限公司	基金管理人的股东
意大利欧利盛资本资产管理股份公司(“Eurizon Capital SGR S.p.A.”)	基金管理人的股东
国信证券股份有限公司(“国信证券”)	基金管理人的股东
鹏华资产管理有限公司(“鹏华资产”)	基金管理人的子公司

注：1、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。

2、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2020年1月1日至2020年12月31日		2019年1月1日至2019年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)
国信证券	777,133.93	0.05	-	-

###### 7.4.10.1.2 债券交易

注：无。

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

###### 7.4.10.1.4 权证交易

注：无。

###### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期			
	2020年1月1日至2020年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例(%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例(%)

国信证券	630.44	0.04	207.54	0.07
关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
-	-	-	-	-

注：（1）佣金的计算公式

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

(佣金比率按照与一般证券公司签订的协议条款订立。)

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

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12 月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	5,202,634.67	2,182,816.27
其中: 支付销售机构的客户维护费	354,314.70	946,018.06

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

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

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12 月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	693,684.61	291,042.15

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。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

#### 7.4.10.4 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

##### 7.4.10.4.1 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。

##### 7.4.10.4.2 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。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 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

##### 7.4.10.5.2 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。

#### 7.4.10.6 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12月31日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31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	4,472,078.78	77,671.71	7,464,079.91	43,717.89

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间内未参与本基金管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司承销期内承销的证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

## 7.4.11 利润分配情况

注：无。

## 7.4.12 期末(2020年12月31日)本基金持有的流通受限证券

## 7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
003030	祖名股份	2020年12月25日	2021年1月6日	新股未上市	15.18	15.18	480	7,286.40	7,286.40	-
003031	中瓷电子	2020年12月24日	2021年1月4日	新股未上市	15.27	15.27	387	5,909.49	5,909.49	-
300860	锋尚文化	2020年8月6日	2021年2月24日	锁定期股票	138.02	126.67	266	36,713.32	33,694.22	-
300861	美畅股份	2020年8月6日	2021年2月24日	锁定期股票	43.76	51.10	782	34,220.32	39,960.20	-
300862	蓝盾光电	2020年8月7日	2021年3月4日	锁定期股票	33.95	38.54	5,843	198,369.85	225,189.22	-
300864	南大环境	2020年8月13日	2021年2月25日	锁定期股票	71.71	90.85	166	11,903.86	15,081.10	-
300867	圣元环保	2020年8月12日	2021年3月3日	锁定期股票	19.34	31.97	1,498	28,971.32	47,891.06	-
300868	杰美特	2020年8月12日	2021年2月24日	锁定期股票	41.26	43.28	593	24,467.18	25,665.04	-
300869	康泰医学	2020年8月12日	2021年2月24日	锁定期股票	10.16	110.88	862	8,757.92	95,578.56	-
300870	欧陆通	2020年8月13日	2021年2月24日	锁定期股票	36.81	65.67	478	17,595.18	31,390.26	-
300871	回盛生物	2020年8月	2021年2月	锁定期股票	33.61	38.70	618	20,770.98	23,916.60	-

		13 日	24 日							
300872	天阳科技	2020年8月14日	2021年2月25日	锁定期股票	21.34	37.84	871	18,587.14	32,958.64	-
300873	海晨股份	2020年8月14日	2021年3月2日	锁定期股票	30.72	41.32	484	14,868.48	19,998.88	-
300876	蒙泰高新	2020年8月14日	2021年2月25日	锁定期股票	20.09	36.62	350	7,031.50	12,817.00	-
300879	大叶股份	2020年8月25日	2021年3月1日	锁定期股票	10.58	27.12	466	4,930.28	12,637.92	-
300881	盛德鑫泰	2020年8月25日	2021年3月5日	锁定期股票	14.17	32.31	291	4,123.47	9,402.21	-
300882	万胜智能	2020年8月27日	2021年3月10日	锁定期股票	10.33	25.79	440	4,545.20	11,347.60	-
300886	华业香料	2020年9月8日	2021年3月16日	锁定期股票	18.59	45.67	147	2,732.73	6,713.49	-
300889	爱克股份	2020年9月9日	2021年3月16日	锁定期股票	27.97	30.12	479	13,397.63	14,427.48	-
300890	翔丰华	2020年9月10日	2021年3月18日	锁定期股票	14.69	48.85	286	4,201.34	13,971.10	-
300891	惠云钛业	2020年9月10日	2021年3月17日	锁定期股票	3.64	16.40	1,143	4,160.52	18,745.20	-
300892	品渥食品	2020年9月11日	2021年3月30日	锁定期股票	26.66	60.01	272	7,251.52	16,322.72	-
300893	松原股份	2020年9月17日	2021年3月24日	锁定期股票	13.47	35.08	276	3,717.72	9,682.08	-
300894	火星人	2020年12月24日	2021年6月30日	锁定期股票	14.07	36.97	628	8,835.96	23,217.16	-
300895	铜牛信息	2020年9月17日	2021年3月24日	锁定期股票	12.65	45.30	283	3,579.95	12,819.90	-



300896	爱美客	2020年9月21日	2021年3月29日	锁定期股票	118.27	603.36	227	26,847.29	136,962.72	-
300900	广联航空	2020年10月19日	2021年4月29日	锁定期股票	17.87	33.16	879	15,707.73	29,147.64	-
300902	国安达	2020年10月22日	2021年4月29日	锁定期股票	15.38	24.26	551	8,474.38	13,367.26	-
300903	科翔股份	2020年10月29日	2021年5月6日	锁定期股票	13.06	30.47	4,775	62,361.50	145,494.25	-
300907	康平科技	2020年11月11日	2021年5月18日	锁定期股票	14.30	26.85	473	6,763.90	12,700.05	-
300908	仲景食品	2020年11月13日	2021年5月24日	锁定期股票	39.74	60.44	285	11,325.90	17,225.40	-
300910	瑞丰新材	2020年11月20日	2021年5月27日	锁定期股票	30.26	47.87	474	14,343.24	22,690.38	-
300918	南山智尚	2020年12月15日	2021年6月22日	锁定期股票	4.97	8.94	1,063	5,283.11	9,503.22	-
300919	中伟股份	2020年12月15日	2021年6月23日	锁定期股票	24.60	61.51	601	14,784.60	36,967.51	-
300920	润阳科技	2020年12月17日	2021年6月25日	锁定期股票	26.93	34.13	2,503	67,405.79	85,427.39	-
300922	天秦装备	2020年12月18日	2021年6月25日	锁定期股票	16.05	31.58	287	4,606.35	9,063.46	-
300925	法本	2020	2021	锁定期	20.08	37.33	353	7,088.24	13,177.49	-

	信息	年 12 月 21 日	年 6 月 30 日	股票						
300927	江天化学	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 7 日	新股未上市	13.39	13.39	1,946	26,056.94	26,056.94	-
300927	江天化学	2020 年 12 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	锁定期股票	13.39	13.39	217	2,905.63	2,905.63	-
300999	金龙鱼	2020 年 9 月 29 日	2021 年 4 月 15 日	锁定期股票	25.70	88.29	3,332	85,632.40	294,182.28	-
601995	中金公司	2020 年 10 月 22 日	2021 年 5 月 6 日	锁定期股票	28.78	68.71	24,951	718,089.78	1,714,383.21	-
605277	新亚电子	2020 年 12 月 25 日	2021 年 1 月 6 日	新股未上市	16.95	16.95	507	8,593.65	8,593.65	-
688060	云涌科技	2020 年 7 月 3 日	2021 年 1 月 11 日	锁定期股票	44.47	81.69	2,400	106,728.00	196,056.00	-
688185	康希诺-U	2020 年 8 月 4 日	2021 年 2 月 18 日	锁定期股票	209.71	355.68	2,426	508,756.46	862,879.68	-
688286	敏芯股份	2020 年 7 月 31 日	2021 年 2 月 10 日	锁定期股票	62.67	117.33	1,681	105,348.27	197,231.73	-
688289	圣湘生物	2020 年 8 月 20 日	2021 年 3 月 1 日	锁定期股票	50.48	109.84	6,522	329,230.56	716,376.48	-
688339	亿华通-U	2020 年 7 月 31 日	2021 年 2 月 10 日	锁定期股票	76.65	257.95	2,761	211,630.65	712,199.95	-
688386	泛亚微透	2020 年 10 月 9 日	2021 年 4 月 16 日	锁定期股票	16.28	47.41	3,217	52,372.76	152,517.97	-
688561	奇安信-U	2020 年 7 月 16 日	2021 年 1 月 22 日	锁定期股票	56.10	122.83	7,606	426,696.60	934,244.98	-
688578	艾力	2020	2021	锁定期	22.73	24.79	9,244	210,116.12	229,158.76	-

	斯-U	年 11 月 23 日	年 6 月 2 日	股票						
688617	惠泰医疗	2020 年 12 月 30 日	2021 年 7 月 7 日	锁定期股票	74.46	74.46	1,673	124,571.58	124,571.58	-
689009	九号公司-UWD	2020 年 10 月 21 日	2021 年 4 月 29 日	锁定期股票	18.94	69.74	109,928	2,082,036.32	7,666,378.72	-

注：1、根据中国证监会《关于修改〈上市公司证券发行管理办法〉的决定》、《关于修改〈创业板上市公司证券发行管理暂行办法〉的决定》以及《关于修改〈上市公司非公开发行股票实施细则〉的决定》，本基金所认购的 2020 年 2 月 14 日(含)后发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。此外，本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

2、基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起约定限售期内不得转让。

3、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的科创板股票，在受让后 6 个月内不得转让。

4、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，本基金参与摇号配售或比例配售方式获配的创业板股票自发行人股票上市之日起在发行人约定的限售期内不得转让。

5、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 7.4.12.2 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
300182	捷成股份	2020 年 12 月 30 日	重大事项	3.23	2021 年 1 月 7 日	3.40	24,800	124,088.87	80,104.00	-

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 12 月 31 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 95,900,000.00 元，于 2021 年 01 月 04 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。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 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。

#### 7.4.13.2 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 12 月 31 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 52.57%（2019 年 12 月 31 日：0.04%）。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	21,971,400.00	4,502,700.00
合计	21,971,400.00	4,502,700.00

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。

##### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

##### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

## 7.4.13.2.4 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12月31日	上年度末 2019年12月31日
AAA	169,734,000.00	48,732.30
AAA 以下	21,611.20	-
未评级	-	-
合计	169,755,611.20	48,732.30

注：未评级债券包括国债、中央银行票据和政策性金融债。

## 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

## 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

## 7.4.13.3 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 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款余额 95,900,000.00 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。

#### 7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

#### 7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

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

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：

根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

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

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

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020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	4,472,078.78	-	-	-	4,472,078.78
结算备付金	16,991,832.18	-	-	-	16,991,832.18
存出保证金	118,640.34	-	-	-	118,640.34
交易性金融资产	21,971,400.00	169,734,000.00	21,611.20	203,320,060.99	395,047,072.19
应收利息	-	-	-	3,145,643.58	3,145,643.58
应收申购款	-	-	-	10,640.40	10,640.40
应收证券清算款	-	-	-	203,215.46	203,215.46
资产总计	43,553,951.30	169,734,000.00	21,611.20	206,679,560.43	419,989,122.93
负债					
应付赎回款	-	-	-	15,175.31	15,175.31
应付管理人报酬	-	-	-	453,254.68	453,254.68
应付托管费	-	-	-	60,433.93	60,433.93



应付证券清算款	-	-	-	235,992.57	235,992.57
卖出回购金融资产款	95,900,000.00	-	-	-	95,900,000.00
应付交易费用	-	-	-	289,126.47	289,126.47
应付利息	-	-	-	-34,714.37	-34,714.37
应交税费	-	-	-	6,263.46	6,263.46
其他负债	-	-	-	170,043.28	170,043.28
负债总计	95,900,000.00	-	-	1,195,575.33	97,095,575.33
利率敏感度缺口	-52,346,048.70	169,734,000.00	21,611.20	205,483,985.10	322,893,547.60
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，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 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 12 月 31 日）	上年度末（2019 年 12 月 31 日）	
分析	市场利率下降 25 个	961,048.41	524.63

	基点		
	市场利率上升 25 个基点	-953, 465. 27	-524. 50

注：于 2019 年 12 月 31 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 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。

#### 7.4.13.4.2 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。

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无。

##### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无。

#### 7.4.13.4.3 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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31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	203,320,060.99	62.97	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	21,611.20	0.01	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	203,341,672.19	62.97	118,458,335.34	91.51

注：债券投资为可转换债券、可交换债券投资。

#### 7.4.13.4.3.2 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12月31日）	上年度末（2019年12月31日）
分析	业绩比较基准上升5%	11,813,885.87	5,640,112.62
	业绩比较基准下降5%	-11,813,885.87	-5,640,112.62

注：无。

#### 7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 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。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 188,125,480.33 元，属于第二层次的余额为 206,921,591.86 元，无属于第三层次的余额(2019 年 12 月 31 日：第一层次 112,613,227.71 元，第二层次 10,347,807.63 元，无第三层次)。

##### (ii) 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，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

##### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2019 年 12 月 31 日：同)。

##### (d) 不以公允价值计量的金融工具

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。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	203,320,060.99	48.41
	其中：股票	203,320,060.99	48.41
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	191,727,011.20	45.65
	其中：债券	191,727,011.20	45.65
	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	21,463,910.96	5.11
8	其他各项资产	3,478,139.78	0.83
9	合计	419,989,122.93	100.00

注：报告期末本基金投资的存托凭证公允价值为 7,666,378.72 元，占净值比 2.37%。本报告所指的“股票”均包含存托凭证。

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 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	616,931.00	0.19
B	采矿业	2,243,408.40	0.69
C	制造业	136,583,049.33	42.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,442,017.10	1.69
E	建筑业	2,468,293.32	0.76
F	批发和零售业	5,572,600.75	1.73
G	交通运输、仓储和邮政业	4,700,665.76	1.46
H	住宿和餐饮业	994,863.00	0.31
I	信息传输、软件和信息技术服务业	19,147,825.14	5.93
J	金融业	11,075,245.24	3.43
K	房地产业	6,485,353.24	2.01

L	租赁和商务服务业	3,772,422.80	1.17
M	科学研究和技术服务业	1,636,936.00	0.51
N	水利、环境和公共设施管理业	646,306.49	0.20
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	48,400.00	0.01
Q	卫生和社会工作	545,476.00	0.17
R	文化、体育和娱乐业	539,112.22	0.17
S	综合	801,155.20	0.25
	合计	203,320,060.99	62.97

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

### 8.3 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	689009	九号公司-UWD	109,928	7,666,378.72	2.37
2	002709	天赐材料	71,960	7,469,448.00	2.31
3	002925	盈趣科技	112,400	7,230,692.00	2.24
4	002030	达安基因	192,704	6,609,747.20	2.05
5	300558	贝达药业	57,600	6,184,512.00	1.92
6	002028	思源电气	305,200	6,122,312.00	1.90
7	300595	欧普康视	72,300	5,922,816.00	1.83
8	300271	华宇软件	204,900	4,890,963.00	1.51
9	002690	美亚光电	102,600	4,543,128.00	1.41
10	002407	多氟多	206,385	4,133,891.55	1.28
11	002131	利欧股份	1,287,900	3,902,337.00	1.21
12	603515	欧普照明	119,580	3,612,511.80	1.12
13	601099	太平洋	871,800	3,556,944.00	1.10
14	600201	生物股份	165,642	3,460,261.38	1.07
15	002268	卫士通	205,500	3,431,850.00	1.06
16	002465	海格通信	310,500	3,362,715.00	1.04
17	002056	横店东磁	215,200	3,268,888.00	1.01
18	600166	福田汽车	1,012,800	3,190,320.00	0.99
19	001914	招商积余	143,700	3,093,861.00	0.96
20	300058	蓝色光标	478,900	2,873,400.00	0.89
21	000685	中山公用	331,100	2,748,130.00	0.85
22	601975	招商南油	996,500	2,501,215.00	0.77
23	000564	供销大集	927,600	2,402,484.00	0.74
24	603317	天味食品	28,770	2,366,044.80	0.73
25	002085	万丰奥威	346,700	2,274,352.00	0.70

26	603816	顾家家居	29,536	2,082,583.36	0.64
27	600804	鹏博士	299,100	2,009,952.00	0.62
28	002285	世联行	386,400	1,901,088.00	0.59
29	002203	海亮股份	256,400	1,894,796.00	0.59
30	002372	伟星新材	100,160	1,872,992.00	0.58
31	000848	承德露露	260,950	1,852,745.00	0.57
32	601995	中金公司	24,951	1,714,383.21	0.53
33	600782	新钢股份	365,000	1,675,350.00	0.52
34	600507	方大特钢	240,494	1,669,028.36	0.52
35	300012	华测检测	57,300	1,568,301.00	0.49
36	601139	深圳燃气	202,400	1,465,376.00	0.45
37	600435	北方导航	157,502	1,417,518.00	0.44
38	000488	晨鸣纸业	188,700	1,211,454.00	0.38
39	603056	德邦股份	93,800	1,190,322.00	0.37
40	600039	四川路桥	259,900	1,172,149.00	0.36
41	600195	中牧股份	86,589	1,109,205.09	0.34
42	000987	越秀金控	68,262	993,894.72	0.31
43	600058	五矿发展	127,801	936,781.33	0.29
44	688561	奇安信-U	7,606	934,244.98	0.29
45	000629	攀钢钒钛	419,600	910,532.00	0.28
46	002242	九阳股份	27,700	887,508.00	0.27
47	688185	康希诺-U	2,426	862,879.68	0.27
48	002807	江阴银行	195,880	838,366.40	0.26
49	300274	阳光电源	11,100	802,308.00	0.25
50	688063	派能科技	2,878	744,308.36	0.23
51	000009	中国宝安	95,440	718,663.20	0.22
52	688289	圣湘生物	6,522	716,376.48	0.22
53	002491	通鼎互联	175,200	714,816.00	0.22
54	688339	亿华通-U	2,761	712,199.95	0.22
55	002839	张家港行	111,000	677,100.00	0.21
56	600754	锦江酒店	12,100	623,513.00	0.19
57	600339	中油工程	191,300	589,204.00	0.18
58	002302	西部建设	66,800	586,504.00	0.18
59	002375	亚厦股份	77,200	574,368.00	0.18
60	603025	大豪科技	20,330	554,399.10	0.17
61	600120	浙江东方	84,278	503,139.66	0.16
62	000415	渤海租赁	200,800	481,920.00	0.15
63	600426	华鲁恒升	12,400	462,520.00	0.14
64	002074	国轩高科	11,200	438,144.00	0.14
65	000547	航天发展	15,400	423,500.00	0.13
66	600089	特变电工	40,600	412,090.00	0.13
67	600079	人福医药	11,800	399,784.00	0.12

68	603882	金域医学	3,000	384,360.00	0.12
69	300285	国瓷材料	8,400	378,924.00	0.12
70	300496	中科创达	3,200	374,400.00	0.12
71	600258	首旅酒店	17,500	371,350.00	0.12
72	300207	欣旺达	12,000	368,520.00	0.11
73	002385	大北农	37,700	364,182.00	0.11
74	002563	森马服饰	34,100	341,682.00	0.11
75	600885	宏发股份	6,298	341,477.56	0.11
76	600143	金发科技	19,700	337,658.00	0.10
77	601233	桐昆股份	16,300	335,617.00	0.10
78	603806	福斯特	3,820	326,228.00	0.10
79	002185	华天科技	23,900	325,518.00	0.10
80	600739	辽宁成大	13,300	323,456.00	0.10
81	002797	第一创业	32,200	320,390.00	0.10
82	601718	际华集团	103,600	313,908.00	0.10
83	600132	重庆啤酒	2,600	309,374.00	0.10
84	002568	百润股份	2,900	302,441.00	0.09
85	601799	星宇股份	1,500	300,750.00	0.09
86	300999	金龙鱼	3,332	294,182.28	0.09
87	002340	格林美	41,800	292,182.00	0.09
88	603589	口子窖	4,000	275,600.00	0.09
89	600219	南山铝业	86,300	272,708.00	0.08
90	600316	洪都航空	4,700	267,289.00	0.08
91	688002	睿创微纳	2,400	266,400.00	0.08
92	600486	扬农化工	2,000	264,000.00	0.08
93	601966	玲珑轮胎	7,500	263,775.00	0.08
94	000636	风华高科	7,800	262,860.00	0.08
95	300357	我武生物	3,400	260,780.00	0.08
96	600529	山东药玻	5,200	260,780.00	0.08
97	002625	光启技术	11,700	260,325.00	0.08
98	601168	西部矿业	20,800	257,504.00	0.08
99	002507	涪陵榨菜	6,000	253,800.00	0.08
100	300699	光威复材	2,800	249,340.00	0.08
101	600884	杉杉股份	13,755	248,002.65	0.08
102	002078	太阳纸业	17,000	245,310.00	0.08
103	000750	国海证券	41,600	243,776.00	0.08
104	002013	中航机电	21,200	242,740.00	0.08
105	603868	飞科电器	5,100	238,578.00	0.07
106	300088	长信科技	26,700	237,363.00	0.07
107	603345	安井食品	1,200	231,444.00	0.07
108	688578	艾力斯-U	9,244	229,158.76	0.07
109	600862	中航高科	7,600	228,760.00	0.07



110	600699	均胜电子	8,960	227,225.60	0.07
111	300862	蓝盾光电	5,843	225,189.22	0.07
112	601997	贵阳银行	28,100	223,395.00	0.07
113	000988	华工科技	9,600	222,624.00	0.07
114	601128	常熟银行	29,900	220,662.00	0.07
115	002353	杰瑞股份	6,200	217,000.00	0.07
116	600460	士兰微	8,600	215,000.00	0.07
117	002212	天融信	10,230	214,932.30	0.07
118	603338	浙江鼎力	2,120	214,522.80	0.07
119	603486	科沃斯	2,420	214,145.80	0.07
120	002500	山西证券	23,570	210,951.50	0.07
121	002075	沙钢股份	19,200	210,624.00	0.07
122	300316	晶盛机电	7,000	210,560.00	0.07
123	300146	汤臣倍健	8,600	207,690.00	0.06
124	600867	通化东宝	15,500	207,390.00	0.06
125	600516	方大炭素	29,300	207,151.00	0.06
126	000630	铜陵有色	80,500	206,885.00	0.06
127	600563	法拉电子	1,900	204,345.00	0.06
128	600511	国药股份	4,100	202,171.00	0.06
129	600038	中直股份	3,200	200,672.00	0.06
130	600733	北汽蓝谷	22,900	198,543.00	0.06
131	000998	隆平高科	10,000	198,100.00	0.06
132	688286	敏芯股份	1,681	197,231.73	0.06
133	002572	索菲亚	7,600	196,840.00	0.06
134	300482	万孚生物	2,200	196,262.00	0.06
135	688060	云涌科技	2,400	196,056.00	0.06
136	300463	迈克生物	4,200	195,720.00	0.06
137	601689	拓普集团	5,085	195,416.55	0.06
138	300168	万达信息	9,000	195,210.00	0.06
139	002250	联化科技	8,000	191,920.00	0.06
140	300001	特锐德	6,500	190,840.00	0.06
141	600909	华安证券	23,700	189,600.00	0.06
142	300070	碧水源	24,200	185,130.00	0.06
143	300024	机器人	15,000	184,500.00	0.06
144	002223	鱼跃医疗	6,500	183,365.00	0.06
145	000021	深科技	9,600	182,496.00	0.06
146	002156	通富微电	7,200	181,728.00	0.06
147	002299	圣农发展	6,800	180,472.00	0.06
148	002444	巨星科技	5,800	180,438.00	0.06
149	002926	华西证券	14,300	178,464.00	0.06
150	600879	航天电子	23,800	178,024.00	0.06
151	600380	健康元	12,792	177,936.72	0.06

152	600779	水井坊	2,143	177,911.86	0.06
153	002557	洽洽食品	3,300	177,705.00	0.06
154	300418	昆仑万维	8,900	177,555.00	0.05
155	600418	江淮汽车	14,500	177,335.00	0.05
156	002080	中材科技	7,300	176,514.00	0.05
157	603866	桃李面包	2,980	176,118.00	0.05
158	600155	华创阳安	13,300	175,427.00	0.05
159	002670	国盛金控	12,693	174,528.75	0.05
160	000039	中集集团	11,620	174,183.80	0.05
161	002138	顺络电子	7,000	171,640.00	0.05
162	603444	吉比特	400	170,400.00	0.05
163	600801	华新水泥	8,140	167,928.20	0.05
164	603737	三棵树	1,100	166,650.00	0.05
165	000623	吉林敖东	10,100	166,347.00	0.05
166	002603	以岭药业	6,500	165,750.00	0.05
167	002081	金螳螂	17,600	165,264.00	0.05
168	600372	中航电子	8,400	165,060.00	0.05
169	002373	千方科技	8,600	164,432.00	0.05
170	000513	丽珠集团	4,051	164,065.50	0.05
171	600415	小商品城	29,700	163,647.00	0.05
172	300244	迪安诊断	4,700	161,116.00	0.05
173	000878	云南铜业	11,100	160,617.00	0.05
174	002705	新宝股份	3,800	160,550.00	0.05
175	300115	长盈精密	6,500	160,225.00	0.05
176	000975	银泰黄金	18,240	157,046.40	0.05
177	601615	明阳智能	8,200	155,636.00	0.05
178	600549	厦门钨业	9,200	155,020.00	0.05
179	002273	水晶光电	13,300	154,147.00	0.05
180	688088	虹软科技	2,200	153,824.00	0.05
181	300315	掌趣科技	30,100	153,811.00	0.05
182	600153	建发股份	18,700	153,527.00	0.05
183	002064	华峰化学	15,200	153,368.00	0.05
184	300009	安科生物	10,410	152,818.80	0.05
185	688386	泛亚微透	3,217	152,517.97	0.05
186	600765	中航重机	6,100	152,500.00	0.05
187	300618	寒锐钴业	1,600	151,856.00	0.05
188	002920	德赛西威	1,800	151,452.00	0.05
189	002019	亿帆医药	8,000	151,440.00	0.05
190	000686	东北证券	15,300	150,246.00	0.05
191	000739	普洛药业	6,400	148,992.00	0.05
192	600598	北大荒	7,700	148,225.00	0.05
193	002511	中顺洁柔	7,100	148,177.00	0.05

194	300017	网宿科技	21,400	147,446.00	0.05
195	600170	上海建工	48,700	146,587.00	0.05
196	600535	天士力	9,900	146,421.00	0.05
197	002831	裕同科技	4,781	146,394.22	0.05
198	000401	冀东水泥	10,300	145,745.00	0.05
199	300903	科翔股份	4,775	145,494.25	0.05
200	002281	光迅科技	5,000	145,200.00	0.04
201	000830	鲁西化工	11,200	143,136.00	0.04
202	600895	张江高科	8,400	143,136.00	0.04
203	603858	步长制药	6,200	143,034.00	0.04
204	000738	航发控制	6,200	142,166.00	0.04
205	002195	二三四五	62,692	141,683.92	0.04
206	002506	协鑫集成	33,300	141,525.00	0.04
207	000807	云铝股份	18,700	140,811.00	0.04
208	603883	老百姓	2,240	140,739.20	0.04
209	002152	广电运通	13,100	139,908.00	0.04
210	600642	申能股份	26,800	139,896.00	0.04
211	000581	威孚高科	6,000	139,140.00	0.04
212	000690	宝新能源	19,000	138,700.00	0.04
213	002648	卫星石化	5,300	138,436.00	0.04
214	600409	三友化工	13,500	138,375.00	0.04
215	300896	爱美客	227	136,962.72	0.04
216	600859	王府井	4,200	136,836.00	0.04
217	600008	首创股份	48,210	136,434.30	0.04
218	600392	盛和资源	15,300	136,017.00	0.04
219	601992	金隅集团	45,600	135,432.00	0.04
220	600291	西水股份	23,700	134,379.00	0.04
221	600580	卧龙电驱	8,600	134,160.00	0.04
222	600497	驰宏锌锗	27,800	133,440.00	0.04
223	002382	蓝帆医疗	6,300	132,867.00	0.04
224	000060	中金岭南	27,300	131,586.00	0.04
225	603638	艾迪精密	1,900	130,986.00	0.04
226	000729	燕京啤酒	15,300	130,356.00	0.04
227	300212	易华录	4,220	129,343.00	0.04
228	601866	中远海发	43,400	128,898.00	0.04
229	600315	上海家化	3,700	128,501.00	0.04
230	002221	东华能源	12,600	127,764.00	0.04
231	002294	信立泰	4,500	127,485.00	0.04
232	600827	百联股份	8,700	127,020.00	0.04
233	600528	中铁工业	14,500	126,730.00	0.04
234	000983	山西焦煤	22,330	125,941.20	0.04
235	600256	广汇能源	44,200	125,086.00	0.04

236	601717	郑煤机	11,400	124,602.00	0.04
237	688617	惠泰医疗	1,673	124,571.58	0.04
238	300296	利亚德	19,400	123,384.00	0.04
239	000997	新大陆	8,000	122,240.00	0.04
240	000960	锡业股份	10,900	122,080.00	0.04
241	600704	物产中大	27,700	121,049.00	0.04
242	600875	东方电气	12,100	120,637.00	0.04
243	603290	斯达半导	500	120,450.00	0.04
244	600160	巨化股份	14,720	119,379.20	0.04
245	300630	普利制药	2,843	119,093.27	0.04
246	600260	凯乐科技	10,900	118,810.00	0.04
247	600811	东方集团	32,400	118,260.00	0.04
248	002745	木林森	8,100	118,179.00	0.04
249	002396	星网锐捷	5,100	117,606.00	0.04
250	600839	四川长虹	40,400	117,160.00	0.04
251	600728	佳都科技	15,300	116,127.00	0.04
252	002368	太极股份	4,420	115,406.20	0.04
253	002092	中泰化学	18,700	115,005.00	0.04
254	600515	海航基础	17,000	114,750.00	0.04
255	600325	华发股份	18,400	114,264.00	0.04
256	600167	联美控股	10,060	114,181.00	0.04
257	600737	中粮糖业	11,700	113,256.00	0.04
258	600967	内蒙一机	9,200	111,872.00	0.03
259	300474	景嘉微	1,600	111,856.00	0.03
260	600820	隧道股份	20,600	111,446.00	0.03
261	000012	南玻A	15,046	111,039.48	0.03
262	600881	亚泰集团	35,500	110,050.00	0.03
263	300002	神州泰岳	21,400	109,354.00	0.03
264	002390	信邦制药	12,700	107,696.00	0.03
265	600597	光明乳业	6,600	107,316.00	0.03
266	603605	珀莱雅	600	106,800.00	0.03
267	600398	海澜之家	16,600	106,572.00	0.03
268	600410	华胜天成	12,000	106,320.00	0.03
269	600567	山鹰国际	35,200	106,304.00	0.03
270	600446	金证股份	6,500	105,365.00	0.03
271	002174	游族网络	8,000	105,280.00	0.03
272	600755	厦门国贸	15,700	104,876.00	0.03
273	600282	南钢股份	33,600	104,832.00	0.03
274	000999	华润三九	4,200	104,748.00	0.03
275	000709	河钢股份	46,500	104,160.00	0.03
276	603712	七一二	2,500	104,125.00	0.03
277	601179	中国西电	22,400	103,264.00	0.03

278	000930	中粮科技	12,200	102,724.00	0.03
279	000877	天山股份	6,800	102,680.00	0.03
280	002387	维信诺	8,900	101,460.00	0.03
281	603000	人民网	6,000	101,400.00	0.03
282	600026	中远海能	15,100	100,868.00	0.03
283	300166	东方国信	9,200	100,740.00	0.03
284	000301	东方盛虹	10,500	99,540.00	0.03
285	002233	塔牌集团	7,800	99,372.00	0.03
286	600216	浙江医药	7,300	99,280.00	0.03
287	000027	深圳能源	16,220	98,779.80	0.03
288	600158	中体产业	8,047	98,656.22	0.03
289	600908	无锡银行	16,100	97,888.00	0.03
290	600718	东软集团	9,400	97,854.00	0.03
291	600188	兖州煤业	9,700	97,679.00	0.03
292	600060	海信视像	8,500	97,580.00	0.03
293	600037	歌华有线	10,600	97,520.00	0.03
294	600064	南京高科	9,400	96,538.00	0.03
295	600572	康恩贝	20,400	96,084.00	0.03
296	000778	新兴铸管	26,100	96,048.00	0.03
297	000932	华菱钢铁	20,080	95,982.40	0.03
298	002004	华邦健康	17,300	95,842.00	0.03
299	300869	康泰医学	862	95,578.56	0.03
300	000400	许继电气	6,600	95,436.00	0.03
301	601005	重庆钢铁	64,200	95,016.00	0.03
302	000598	兴蓉环境	19,600	94,080.00	0.03
303	000887	中鼎股份	8,000	93,680.00	0.03
304	002048	宁波华翔	6,000	93,420.00	0.03
305	603568	伟明环保	4,881	92,397.33	0.03
306	688029	南微医学	500	92,005.00	0.03
307	002701	奥瑞金	18,500	91,390.00	0.03
308	002128	露天煤业	8,300	90,802.00	0.03
309	603198	迎驾贡酒	2,600	90,740.00	0.03
310	000089	深圳机场	11,100	90,687.00	0.03
311	601118	海南橡胶	18,700	90,134.00	0.03
312	000825	太钢不锈	24,900	89,889.00	0.03
313	002110	三钢闽光	13,350	89,845.50	0.03
314	300026	红日药业	19,600	89,768.00	0.03
315	002191	劲嘉股份	9,600	88,608.00	0.03
316	000970	中科三环	9,300	87,885.00	0.03
317	300072	三聚环保	15,400	87,472.00	0.03
318	600171	上海贝岭	6,100	85,522.00	0.03
319	300920	润阳科技	2,503	85,427.39	0.03

320	000090	天健集团	14,378	85,405.32	0.03
321	600022	山东钢铁	59,700	85,371.00	0.03
322	002936	郑州银行	19,100	85,186.00	0.03
323	601699	潞安环能	13,100	85,150.00	0.03
324	000559	万向钱潮	15,900	85,065.00	0.03
325	002217	合力泰	20,500	84,050.00	0.03
326	000402	金融街	13,000	83,850.00	0.03
327	000967	盈峰环境	10,300	83,842.00	0.03
328	601860	紫金银行	19,900	83,779.00	0.03
329	600056	中国医药	5,800	83,114.00	0.03
330	603228	景旺电子	2,748	82,852.20	0.03
331	300133	华策影视	13,400	82,812.00	0.03
332	600376	首开股份	14,100	82,767.00	0.03
333	000883	湖北能源	21,300	82,644.00	0.03
334	002867	周大生	3,100	82,615.00	0.03
335	601333	广深铁路	37,200	82,584.00	0.03
336	600673	东阳光	16,400	82,492.00	0.03
337	000528	柳工	11,200	82,432.00	0.03
338	601016	节能风电	24,000	82,320.00	0.03
339	603077	和邦生物	57,900	82,218.00	0.03
340	600006	东风汽车	8,700	82,128.00	0.03
341	000563	陕国投A	21,700	81,809.00	0.03
342	600021	上海电力	11,400	81,168.00	0.03
343	000990	诚志股份	6,800	80,648.00	0.02
344	300376	易事特	10,100	80,396.00	0.02
345	300182	捷成股份	24,800	80,104.00	0.02
346	601000	唐山港	32,300	80,104.00	0.02
347	601200	上海环境	7,330	79,897.00	0.02
348	600500	中化国际	15,160	79,893.20	0.02
349	000898	鞍钢股份	26,100	79,344.00	0.02
350	002266	浙富控股	17,600	79,200.00	0.02
351	300180	华峰超纤	13,400	79,194.00	0.02
352	600970	中材国际	11,400	78,432.00	0.02
353	002317	众生药业	7,100	78,242.00	0.02
354	600126	杭钢股份	14,780	78,186.20	0.02
355	002505	鹏都农牧	30,700	77,671.00	0.02
356	002244	滨江集团	16,900	77,571.00	0.02
357	002155	湖南黄金	9,100	77,441.00	0.02
358	002985	北摩高科	400	77,320.00	0.02
359	600466	蓝光发展	16,680	77,228.40	0.02
360	300113	顺网科技	4,500	77,175.00	0.02
361	000758	中色股份	15,100	76,708.00	0.02

362	000519	中兵红箭	7,600	76,152.00	0.02
363	601865	福莱特	1,900	75,810.00	0.02
364	601608	中信重工	19,000	75,240.00	0.02
365	600266	城建发展	14,804	75,204.32	0.02
366	600649	城投控股	13,800	74,934.00	0.02
367	601098	中南传媒	7,800	74,334.00	0.02
368	300010	豆神教育	7,600	74,176.00	0.02
369	600348	华阳股份	13,200	74,052.00	0.02
370	600373	中文传媒	7,300	73,657.00	0.02
371	000028	国药一致	1,600	73,280.00	0.02
372	600546	山煤国际	8,600	73,186.00	0.02
373	600073	上海梅林	7,100	73,059.00	0.02
374	600388	龙净环保	8,200	72,816.00	0.02
375	603885	吉祥航空	6,400	72,768.00	0.02
376	600959	江苏有线	21,800	72,158.00	0.02
377	000078	海王生物	17,900	71,779.00	0.02
378	600901	江苏租赁	13,000	71,630.00	0.02
379	002183	怡亚通	16,100	70,196.00	0.02
380	600094	大名城	17,400	69,948.00	0.02
381	002440	闰土股份	7,500	69,900.00	0.02
382	002640	跨境通	13,500	69,390.00	0.02
383	600729	重庆百货	2,400	69,360.00	0.02
384	002249	大洋电机	15,400	69,300.00	0.02
385	600633	浙数文化	8,500	69,190.00	0.02
386	600808	马钢股份	26,000	69,160.00	0.02
387	002399	海普瑞	4,000	68,880.00	0.02
388	600062	华润双鹤	5,740	68,822.60	0.02
389	600645	中源协和	3,500	68,635.00	0.02
390	600835	上海机电	3,500	68,110.00	0.02
391	002038	双鹭药业	6,700	67,670.00	0.02
392	002468	申通快递	6,700	67,536.00	0.02
393	002010	传化智联	14,200	66,882.00	0.02
394	600141	兴发集团	6,020	66,400.60	0.02
395	000959	首钢股份	17,300	66,259.00	0.02
396	600643	爱建集团	8,800	66,176.00	0.02
397	601880	大连港	34,000	65,620.00	0.02
398	601958	金钼股份	10,500	65,205.00	0.02
399	002434	万里扬	7,300	65,116.00	0.02
400	600863	内蒙华电	25,300	65,021.00	0.02
401	000158	常山北明	10,400	64,480.00	0.02
402	002408	齐翔腾达	7,700	64,372.00	0.02
403	600312	平高电气	8,900	63,546.00	0.02

404	000826	启迪环境	9,300	62,868.00	0.02
405	600717	天津港	13,100	62,618.00	0.02
406	601611	中国核建	8,600	62,608.00	0.02
407	002544	杰赛科技	3,700	62,086.00	0.02
408	000031	大悦城	14,100	62,040.00	0.02
409	002583	海能达	10,100	62,014.00	0.02
410	300459	金科文化	19,283	61,512.77	0.02
411	000869	张裕A	1,400	61,040.00	0.02
412	600582	天地科技	19,800	60,984.00	0.02
413	002424	贵州百灵	7,700	60,291.00	0.02
414	002589	瑞康医药	11,500	60,145.00	0.02
415	002002	鸿达兴业	19,800	59,400.00	0.02
416	603650	彤程新材	1,900	58,900.00	0.02
417	600566	济川药业	2,900	58,667.00	0.02
418	002635	安洁科技	3,400	58,582.00	0.02
419	000681	视觉中国	4,500	58,500.00	0.02
420	000501	鄂武商A	5,000	58,250.00	0.02
421	600259	广晟有色	1,900	57,323.00	0.02
422	600648	外高桥	4,100	57,277.00	0.02
423	600823	世茂股份	12,300	56,703.00	0.02
424	300324	旋极信息	13,400	56,682.00	0.02
425	000718	苏宁环球	16,500	56,595.00	0.02
426	600307	酒钢宏兴	34,200	56,430.00	0.02
427	000717	韶钢松山	13,200	56,364.00	0.02
428	000046	泛海控股	17,000	55,760.00	0.02
429	002416	爱施德	7,440	55,502.40	0.02
430	600131	国网信通	3,900	55,497.00	0.02
431	002815	崇达技术	3,800	54,872.00	0.02
432	600329	中新药业	3,100	54,312.00	0.02
433	000008	神州高铁	21,300	54,102.00	0.02
434	600968	海油发展	22,300	53,297.00	0.02
435	000156	华数传媒	6,200	53,072.00	0.02
436	600985	淮北矿业	4,700	52,593.00	0.02
437	601928	凤凰传媒	8,300	52,539.00	0.02
438	600664	哈药股份	16,400	52,316.00	0.02
439	000061	农产品	7,400	52,170.00	0.02
440	600338	西藏珠峰	4,960	51,980.80	0.02
441	000543	皖能电力	12,400	51,832.00	0.02
442	300257	开山股份	3,700	50,505.00	0.02
443	603260	合盛硅业	1,500	50,160.00	0.02
444	600748	上实发展	10,130	49,738.30	0.02
445	601298	青岛港	7,700	49,511.00	0.02



446	600556	天下秀	3,900	49,335.00	0.02
447	603377	东方时尚	2,500	48,400.00	0.01
448	600869	远东股份	12,100	48,279.00	0.01
449	300867	圣元环保	1,498	47,891.06	0.01
450	000937	冀中能源	11,500	47,840.00	0.01
451	603225	新凤鸣	3,420	47,538.00	0.01
452	300134	大富科技	4,600	47,518.00	0.01
453	600640	号百控股	3,800	46,550.00	0.01
454	000813	德展健康	10,500	46,515.00	0.01
455	601127	小康股份	2,700	46,116.00	0.01
456	600639	浦东金桥	3,700	45,880.00	0.01
457	002503	搜于特	20,300	45,472.00	0.01
458	601228	广州港	13,500	45,360.00	0.01
459	600277	亿利洁能	14,998	44,844.02	0.01
460	600787	中储股份	9,508	43,831.88	0.01
461	000600	建投能源	7,800	43,758.00	0.01
462	600545	卓郎智能	12,400	43,400.00	0.01
463	000062	深圳华强	3,435	42,731.40	0.01
464	600350	山东高速	6,800	42,024.00	0.01
465	603888	新华网	2,200	41,800.00	0.01
466	601828	美凯龙	4,800	40,752.00	0.01
467	002093	国脉科技	5,500	40,095.00	0.01
468	300861	美畅股份	782	39,960.20	0.01
469	002419	天虹股份	5,200	39,728.00	0.01
470	600575	淮河能源	16,900	39,208.00	0.01
471	002051	中工国际	5,400	38,286.00	0.01
472	600657	信达地产	9,300	37,665.00	0.01
473	000537	广宇发展	6,000	37,620.00	0.01
474	300919	中伟股份	601	36,967.51	0.01
475	000553	安道麦 A	4,700	36,754.00	0.01
476	600623	华谊集团	6,100	35,380.00	0.01
477	000732	泰禾集团	10,800	35,316.00	0.01
478	601869	长飞光纤	1,300	35,152.00	0.01
479	603328	依顿电子	4,300	34,185.00	0.01
480	300860	锋尚文化	266	33,694.22	0.01
481	300872	天阳科技	871	32,958.64	0.01
482	002946	新乳业	1,800	31,698.00	0.01
483	300870	欧陆通	478	31,390.26	0.01
484	600903	贵州燃气	2,400	30,480.00	0.01
485	601801	皖新传媒	6,400	30,400.00	0.01
486	002653	海思科	1,700	29,784.00	0.01
487	300900	广联航空	879	29,147.64	0.01

488	300927	江天化学	2,163	28,962.57	0.01
489	601003	柳钢股份	5,500	28,545.00	0.01
490	600053	九鼎投资	1,400	27,370.00	0.01
491	603786	科博达	400	27,048.00	0.01
492	603355	莱克电气	870	26,300.10	0.01
493	603983	丸美股份	500	26,105.00	0.01
494	300868	杰美特	593	25,665.04	0.01
495	601969	海南矿业	4,200	25,116.00	0.01
496	300871	回盛生物	618	23,916.60	0.01
497	603719	良品铺子	400	23,468.00	0.01
498	002818	富森美	1,660	23,455.80	0.01
499	300894	火星人	628	23,217.16	0.01
500	300910	瑞丰新材	474	22,690.38	0.01
501	002941	新疆交建	2,000	22,000.00	0.01
502	003026	中晶科技	461	21,740.76	0.01
503	300873	海晨股份	484	19,998.88	0.01
504	300891	惠云钛业	1,143	18,745.20	0.01
505	003029	吉大正元	716	18,716.24	0.01
506	003028	振邦智能	432	18,010.08	0.01
507	001872	招商港口	1,100	17,512.00	0.01
508	300908	仲景食品	285	17,225.40	0.01
509	603256	宏和科技	1,900	16,777.00	0.01
510	605179	一鸣食品	939	16,582.74	0.01
511	300892	品渥食品	272	16,322.72	0.01
512	300864	南大环境	166	15,081.10	0.00
513	300889	爱克股份	479	14,427.48	0.00
514	300890	翔丰华	286	13,971.10	0.00
515	600917	重庆燃气	2,000	13,720.00	0.00
516	300902	国安达	551	13,367.26	0.00
517	300925	法本信息	353	13,177.49	0.00
518	300895	铜牛信息	283	12,819.90	0.00
519	300876	蒙泰高新	350	12,817.00	0.00
520	300907	康平科技	473	12,700.05	0.00
521	300879	大叶股份	466	12,637.92	0.00
522	601068	中铝国际	3,300	11,748.00	0.00
523	300882	万胜智能	440	11,347.60	0.00
524	300893	松原股份	276	9,682.08	0.00
525	300918	南山智尚	1,063	9,503.22	0.00
526	300881	盛德鑫泰	291	9,402.21	0.00
527	300922	天秦装备	287	9,063.46	0.00
528	605277	新亚电子	507	8,593.65	0.00
529	002957	科瑞技术	400	8,180.00	0.00

530	003030	祖名股份	480	7,286.40	0.00
531	603939	益丰药房	80	7,215.20	0.00
532	300886	华业香料	147	6,713.49	0.00
533	003031	中瓷电子	387	5,909.49	0.00
534	600298	安琪酵母	68	3,472.76	0.00
535	600845	宝信软件	50	3,449.00	0.00
536	603707	健友股份	90	3,161.70	0.00
537	002812	恩捷股份	20	2,835.60	0.00
538	600161	天坛生物	63	2,627.10	0.00
539	002414	高德红外	50	2,087.50	0.00
540	300308	中际旭创	40	2,034.40	0.00
541	600521	华海药业	40	1,352.40	0.00
542	000025	特力A	35	591.50	0.00
543	603556	海兴电力	30	412.50	0.00
544	300253	卫宁健康	20	350.00	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 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	300558	贝达药业	25,277,043.00	19.53
2	002028	思源电气	15,874,181.06	12.26
3	002030	达安基因	15,017,764.06	11.60
4	002414	高德红外	12,914,550.50	9.98
5	000988	华工科技	11,049,507.14	8.54
6	600216	浙江医药	10,920,876.27	8.44
7	002212	天融信	10,844,240.97	8.38
8	603882	金域医学	9,451,526.73	7.30
9	300002	神州泰岳	9,321,369.45	7.20
10	002925	盈趣科技	9,287,277.00	7.17
11	601099	太平洋	9,213,065.67	7.12
12	600166	福田汽车	9,158,150.00	7.07
13	002131	利欧股份	8,844,136.00	6.83
14	002709	天赐材料	8,762,224.40	6.77
15	300595	欧普康视	8,757,874.99	6.77
16	002465	海格通信	8,725,714.94	6.74
17	600699	均胜电子	8,606,658.00	6.65
18	002690	美亚光电	8,544,091.52	6.60
19	001914	招商积余	8,427,109.00	6.51
20	002280	*ST 联络	8,371,091.56	6.47
21	002407	多氟多	8,194,957.59	6.33
22	600804	鹏博士	8,005,819.38	6.18

23	600737	中粮糖业	7,823,846.00	6.04
24	002385	大北农	7,726,904.00	5.97
25	603816	顾家家居	7,239,579.40	5.59
26	600201	生物股份	7,230,870.24	5.59
27	002797	第一创业	7,109,174.00	5.49
28	600754	锦江酒店	7,108,569.13	5.49
29	300271	华宇软件	7,100,222.00	5.48
30	002268	卫士通	7,050,767.60	5.45
31	600823	世茂股份	7,001,161.00	5.41
32	000685	中山公用	6,993,871.00	5.40
33	601816	京沪高铁	6,319,848.88	4.88
34	000564	供销大集	6,242,991.00	4.82
35	600704	物产中大	6,092,592.00	4.71
36	000598	兴蓉环境	5,899,381.00	4.56
37	300012	华测检测	5,806,850.90	4.49
38	300058	蓝色光标	5,726,207.00	4.42
39	002491	通鼎互联	5,705,723.00	4.41
40	002635	安洁科技	5,595,560.07	4.32
41	002603	以岭药业	5,582,370.98	4.31
42	002056	横店东磁	5,431,442.00	4.20
43	002375	亚厦股份	5,300,116.26	4.09
44	002416	爱施德	5,215,890.29	4.03
45	002371	北方华创	5,214,480.02	4.03
46	600008	首创股份	5,208,558.90	4.02
47	002439	启明星辰	5,203,422.00	4.02
48	002242	九阳股份	5,183,811.26	4.00
49	600909	华安证券	5,132,706.00	3.96
50	300316	晶盛机电	5,113,110.00	3.95
51	603355	莱克电气	5,112,798.70	3.95
52	000089	深圳机场	5,106,005.98	3.94
53	600649	城投控股	5,061,475.00	3.91
54	600881	亚泰集团	5,059,049.00	3.91
55	000402	金融街	5,018,794.59	3.88
56	000712	锦龙股份	5,016,388.86	3.88
57	002372	伟星新材	5,014,207.00	3.87
58	000937	冀中能源	4,923,012.90	3.80
59	600466	蓝光发展	4,922,585.00	3.80
60	600787	中储股份	4,831,716.46	3.73
61	601689	拓普集团	4,793,820.00	3.70
62	300383	光环新网	4,793,021.84	3.70
63	603515	欧普照明	4,767,290.79	3.68
64	600258	首旅酒店	4,759,974.00	3.68

65	600875	东方电气	4,754,007.53	3.67
66	002019	亿帆医药	4,744,575.40	3.67
67	601717	郑煤机	4,743,254.20	3.66
68	000848	承德露露	4,700,038.70	3.63
69	600521	华海药业	4,692,007.82	3.62
70	300529	健帆生物	4,686,000.00	3.62
71	600298	安琪酵母	4,676,538.98	3.61
72	600748	上实发展	4,672,429.72	3.61
73	300296	利亚德	4,661,748.00	3.60
74	600125	铁龙物流	4,658,628.22	3.60
75	600779	水井坊	4,657,536.34	3.60
76	603883	老百姓	4,650,820.01	3.59
77	601000	唐山港	4,604,863.00	3.56
78	600639	浦东金桥	4,604,195.14	3.56
79	601718	际华集团	4,577,993.00	3.54
80	002831	裕同科技	4,555,811.84	3.52
81	600060	海信视像	4,525,713.44	3.50
82	600885	宏发股份	4,459,993.63	3.45
83	601928	凤凰传媒	4,422,877.00	3.42
84	000967	盈峰环境	4,283,067.72	3.31
85	000970	中科三环	4,204,269.00	3.25
86	603000	人民网	4,142,732.00	3.20
87	002183	怡亚通	4,065,821.18	3.14
88	600415	小商品城	4,013,685.00	3.10
89	002653	海思科	3,994,338.04	3.09
90	300474	景嘉微	3,969,885.00	3.07
91	600782	新钢股份	3,719,412.00	2.87
92	002203	海亮股份	3,558,963.21	2.75
93	002670	国盛金控	3,499,435.00	2.70
94	603317	天味食品	3,418,304.25	2.64
95	600839	四川长虹	3,297,824.00	2.55
96	002085	万丰奥威	3,208,511.76	2.48
97	000998	隆平高科	3,167,469.98	2.45
98	002368	太极股份	3,146,005.63	2.43
99	600507	方大特钢	3,097,625.51	2.39
100	002191	劲嘉股份	3,046,231.00	2.35
101	600895	张江高科	3,011,787.00	2.33
102	000877	天山股份	2,979,234.95	2.30
103	002048	宁波华翔	2,933,045.00	2.27
104	600158	中体产业	2,894,994.84	2.24
105	600325	华发股份	2,888,270.80	2.23
106	002505	鹏都农牧	2,887,268.00	2.23

107	000519	中兵红箭	2,882,930.74	2.23
108	002233	塔牌集团	2,860,498.00	2.21
109	601975	招商南油	2,834,092.00	2.19
110	600064	南京高科	2,795,043.00	2.16
111	601127	小康股份	2,760,069.00	2.13
112	002004	华邦健康	2,740,494.38	2.12
113	600143	金发科技	2,718,276.00	2.10
114	002285	世联行	2,700,062.60	2.09
115	002821	凯莱英	2,665,882.00	2.06
116	002250	联化科技	2,649,657.00	2.05
117	002572	索菲亚	2,626,055.86	2.03

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。

#### 8.4.2 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	002414	高德红外	17,025,762.47	13.15
2	300558	贝达药业	16,494,325.74	12.74
3	002709	天赐材料	14,597,208.45	11.28
4	002028	思源电气	12,634,932.08	9.76
5	600699	均胜电子	11,156,509.00	8.62
6	600216	浙江医药	11,009,232.00	8.50
7	000988	华工科技	10,826,597.76	8.36
8	002212	天融信	10,002,625.00	7.73
9	300002	神州泰岳	9,423,436.00	7.28
10	002030	达安基因	9,032,184.86	6.98
11	603882	金域医学	9,018,166.00	6.97
12	600754	锦江酒店	8,637,761.68	6.67
13	600823	世茂股份	8,533,573.80	6.59
14	601816	京沪高铁	8,388,440.15	6.48
15	002407	多氟多	7,904,510.00	6.11
16	600737	中粮糖业	7,869,242.00	6.08
17	002385	大北农	7,390,219.50	5.71
18	600779	水井坊	7,268,228.98	5.61
19	600166	福田汽车	7,076,638.00	5.47
20	002280	*ST 联络	7,033,437.26	5.43
21	300383	光环新网	6,934,565.30	5.36
22	002797	第一创业	6,926,174.00	5.35
23	002416	爱施德	6,834,412.00	5.28
24	600649	城投控股	6,812,041.00	5.26
25	002371	北方华创	6,768,914.00	5.23
26	603355	莱克电气	6,761,236.67	5.22

27	600804	鹏博士	6,453,808.00	4.99
28	002375	亚厦股份	6,396,854.90	4.94
29	600521	华海药业	6,374,424.50	4.92
30	600298	安琪酵母	6,332,944.60	4.89
31	601099	太平洋	6,255,666.96	4.83
32	300012	华测检测	6,173,144.91	4.77
33	600909	华安证券	6,147,550.00	4.75
34	000598	兴蓉环境	6,134,902.99	4.74
35	601689	拓普集团	6,027,693.34	4.66
36	002183	怡亚通	6,007,896.48	4.64
37	603816	顾家家居	5,922,860.60	4.58
38	000937	冀中能源	5,816,793.53	4.49
39	300529	健帆生物	5,714,094.40	4.41
40	603883	老百姓	5,598,676.50	4.32
41	002635	安洁科技	5,584,444.50	4.31
42	000564	供销大集	5,567,001.00	4.30
43	600704	物产中大	5,542,832.00	4.28
44	002465	海格通信	5,537,319.00	4.28
45	000712	锦龙股份	5,481,290.03	4.23
46	600787	中储股份	5,473,705.00	4.23
47	000089	深圳机场	5,452,418.78	4.21
48	000967	盈峰环境	5,422,108.11	4.19
49	002439	启明星辰	5,400,392.00	4.17
50	600466	蓝光发展	5,393,417.80	4.17
51	002603	以岭药业	5,333,975.00	4.12
52	002019	亿帆医药	5,330,936.00	4.12
53	601000	唐山港	5,284,714.00	4.08
54	601928	凤凰传媒	5,277,045.14	4.08
55	601717	郑煤机	5,197,016.00	4.01
56	300316	晶盛机电	5,194,848.00	4.01
57	002821	凯莱英	5,193,515.00	4.01
58	600258	首旅酒店	5,188,035.00	4.01
59	002242	九阳股份	5,186,127.24	4.01
60	000402	金融街	5,135,357.00	3.97
61	600639	浦东金桥	5,027,803.00	3.88
62	002831	裕同科技	4,934,009.88	3.81
63	600748	上实发展	4,926,011.80	3.81
64	600881	亚泰集团	4,892,796.00	3.78
65	600143	金发科技	4,862,231.00	3.76
66	000998	隆平高科	4,857,519.00	3.75
67	600125	铁龙物流	4,850,807.55	3.75
68	600060	海信视像	4,814,565.00	3.72

69	000685	中山公用	4,809,263.65	3.72
70	601718	际华集团	4,718,457.00	3.64
71	600875	东方电气	4,709,358.27	3.64
72	600008	首创股份	4,661,739.00	3.60
73	002048	宁波华翔	4,650,484.02	3.59
74	600885	宏发股份	4,633,749.18	3.58
75	002491	通鼎互联	4,581,953.00	3.54
76	002368	太极股份	4,539,440.00	3.51
77	300595	欧普康视	4,530,803.00	3.50
78	600839	四川长虹	4,479,063.00	3.46
79	603939	益丰药房	4,450,810.00	3.44
80	000970	中科三环	4,420,330.11	3.41
81	600895	张江高科	4,397,974.00	3.40
82	603000	人民网	4,180,681.00	3.23
83	001914	招商积余	4,180,605.18	3.23
84	600201	生物股份	4,150,442.54	3.21
85	000400	许继电气	4,107,312.97	3.17
86	600167	联美控股	4,029,856.68	3.11
87	002131	利欧股份	3,998,157.00	3.09
88	002670	国盛金控	3,963,581.00	3.06
89	300296	利亚德	3,952,301.00	3.05
90	002653	海思科	3,945,104.91	3.05
91	300134	大富科技	3,862,608.00	2.98
92	002250	联化科技	3,829,854.00	2.96
93	600325	华发股份	3,761,842.42	2.91
94	600064	南京高科	3,758,835.00	2.90
95	002372	伟星新材	3,743,470.44	2.89
96	600158	中体产业	3,731,309.93	2.88
97	603568	伟明环保	3,709,835.00	2.87
98	600415	小商品城	3,626,554.00	2.80
99	002690	美亚光电	3,620,839.34	2.80
100	600062	华润双鹤	3,610,951.25	2.79
101	603025	大豪科技	3,553,194.80	2.74
102	600418	江淮汽车	3,513,695.00	2.71
103	002056	横店东磁	3,501,908.00	2.71
104	601127	小康股份	3,484,287.00	2.69
105	300474	景嘉微	3,456,303.76	2.67
106	002191	劲嘉股份	3,410,891.00	2.63
107	600970	中材国际	3,262,745.00	2.52
108	600021	上海电力	3,244,487.00	2.51
109	603766	隆鑫通用	3,237,776.00	2.50
110	603806	福斯特	3,156,846.00	2.44



111	601969	海南矿业	3,138,340.00	2.42
112	002583	海能达	3,056,633.00	2.36
113	002233	塔牌集团	3,045,139.00	2.35
114	000848	承德露露	3,030,287.50	2.34
115	002004	华邦健康	3,022,882.00	2.34
116	688126	沪硅产业-U	2,972,098.51	2.30
117	002572	索菲亚	2,804,489.98	2.17
118	002925	盈趣科技	2,686,282.00	2.08
119	688111	金山办公	2,609,678.48	2.02

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。

#### 8.4.3 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	865,172,559.60
卖出股票收入（成交）总额	896,766,252.42

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。

#### 8.5 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	21,971,400.00	6.80
2	央行票据	-	-
3	金融债券	90,220,000.00	27.94
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	79,514,000.00	24.63
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	21,611.20	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	191,727,011.20	59.38

#### 8.6 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	163731	20 光证 G3	300,000	30,072,000.00	9.31
2	019640	20 国债 10	220,000	21,971,400.00	6.80
3	163707	20 中证 13	200,000	20,082,000.00	6.22
4	163711	20 信投 G4	200,000	20,056,000.00	6.21
5	163108	20CHNE01	200,000	20,030,000.00	6.20

## 8.7 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。

## 8.8 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。

## 8.9 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。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：无。

### 8.10.2 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。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 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。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：无。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

无。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 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

中信证券

关于对中信证券股份有限公司北京紫竹院路证券营业部采取责令改正措施的决定，具体如下：

中信证券股份有限公司北京紫竹院路证券营业部：

经查，你营业部存在以下违规行为：

1. 存在多名客户开户资料重要信息填写缺失、未对高龄客户职业信息填写异常进行核实、同

一客户同日填写的两份信息登记材料内容不一致、测评打分加总错误导致评级结果出现偏差等问题，违反了《中国证监会关于加强证券经纪业务管理的规定》第三条第（一）项、第（二）项及《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》第六条第（一）项、第（二）项的规定。

2. 未按规定向我局报告营业部负责人孙丽丽任职情况，违反了《证券公司董事、监事和高级管理人员任职资格监管办法》第三十四条的规定。

3. 无法提供营业场所计算机设备及对应媒介访问控制地址（MAC 地址）的登记记录变更及历史登记数据，违反了《证券公司内部控制指引》第七条第（一）项的规定。

上述行为反映出你营业部内部控制不完善。根据《证券公司监督管理条例》第七十条及《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》第三十二条，我局决定责令你营业部限期改正，你营业部应当对存在的问题予以整改，完善内部控制机制，做好开户审核、人员任免备案、客户适当性管理工作，切实加强异常交易监控，防止营销人员在执业过程中从事违法违规或者超越代理权限、损害客户合法权益的行为。你营业部应于 2020 年 6 月 30 日前向我局报送书面整改报告。

如果对本监督管理措施不服，可在收到本决定书之日起 60 日内向中国证券监督管理委员会提出行政复议申请，也可以在收到本决定书之日起 6 个月内向有管辖权的人民法院提起诉讼。复议与诉讼期间，上述监督管理措施不停止执行。

对该证券的投资决策程序的说明：本基金管理人长期跟踪研究该公司，认为公司的上述违规行为对公司并不产生实质性影响。上述通告对该公司证券的投资价值不产生重大影响。该证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

交易商协会自律处分信息，具体如下：

中信证券股份有限公司（以下简称“中信证券”）作为债务融资工具主承销商，在部分债务融资工具选聘主承销商的投标过程中，中标承销费率远低于市场正常水平，预估承销费收入远低于其业务开展平均成本。

依据相关自律规定，经 2020 年第 5 次自律处分会议审议，对中信证券予以警告，责令其针对本次事件中暴露出的问题进行全面深入的整改。

对该证券的投资决策程序的说明：本基金管理人长期跟踪研究该公司，认为公司的上述违规行为对公司并不产生实质性影响。上述通告对该公司证券的投资价值不产生重大影响。该证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

中信建投

关于对中信建投证券股份有限公司采取责令改正措施的决定，具体如下：

中信建投证券股份有限公司：

经查，你公司发布的某研究报告存在以下问题：一是研究依据不充分，研究报告参考资料为电子平台个人账户上传文章，未进行规范信息源确认，关键数据交叉验证不足，数据基础不扎实；二是研究方法不够专业谨慎，分析逻辑客观性不足，以预测数据和假设条件主观推定结论。

上述问题反映出你公司对该份研究报告的质量控制和合规审查不到位，违反了《发布证券研究报告暂行规定》（证监会公告〔2010〕28号）第九条、第十条规定。根据《发布证券研究报告暂行规定》第二十二条规定，我局决定对你公司采取责令改正的行政监管措施，你公司应进一步加强对研究报告的质量控制和合规审查，切实提升制作、发布研究报告的质量。你公司应于收到本决定书之日起30日内向我局提交书面整改报告。

如果对本监督管理措施不服，可以在收到本决定书之日起60日内向中国证券监督管理委员会提出行政复议申请，也可以在收到本决定书之日起6个月内向有管辖权的人民法院提起诉讼。复议与诉讼期间，上述监督管理措施不停止执行。

对该证券的投资决策程序的说明：本基金管理人长期跟踪研究该公司，认为公司的上述违规行为对公司并不产生实质性影响。上述通告对该公司证券的投资价值不产生重大影响。该证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

关于对中信建投证券股份有限公司上海分公司采取责令改正措施的决定，具体如下：

中信建投证券股份有限公司上海分公司：

经查，你分公司（统一社会信用代码：91310000590394387G）在尚未取得换发经营证券业务许可证的情况下，关闭了原营业场所；上海营口路证券营业部变更营业场所后，未及时向我局申请换发经营证券业务许可证。上述行为违反了《证券公司分支机构监管规定》（证监会公告〔2013〕17号）第十二条第一款的规定，反映出你分公司存在内部控制不完善的问题。

根据《证券公司监督管理条例》第七十条第一款和《证券公司分支机构监管规定》第二十条的规定，我局决定对你分公司采取责令改正的行政监管措施。你分公司应在收到本决定书之日起3个月内完成整改，并向我局提交书面整改报告。

如果对本监督管理措施不服，可以在收到本决定书之日起60日内向中国证监会提出行政复议申请，也可以在收到本决定书之日起6个月内向有管辖权的人民法院提起诉讼。复议与诉讼期间，上述监督管理措施不停止执行。

对该证券的投资决策程序的说明：本基金管理人长期跟踪研究该公司，认为公司的上述违规行为对公司并不产生实质性影响。上述通告对该公司证券的投资价值不产生重大影响。该证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定

平安证券

关于对平安证券股份有限公司宁波海晏北路证券营业部采取责令改正措施的决定，具体如下：  
平安证券股份有限公司宁波海晏北路证券营业部：

经查，你营业部存在以下问题：一是在为客户开立股票期权账户过程中，营业部员工替客户完成股票期权模拟交易和投资者知识测试，且开立股票期权账户后，未对客户进行回访。二是在开展股票期权业务期间，相关人员均不具备期货从业资格。三是向新开融资融券信用账户和股票期权账户的客户赠送礼品。四是未及时配备专职合规人员。五是未对合作机构的营销行为进行有效管控。

上述行为违反了《证券期货投资者适当性管理办法》（证监会令第 130 号）第二十九条、《证券期货经营机构参与股票期权交易试点指引》（证监会公告〔2015〕1 号）第五条、《关于加强证券经纪业务管理的规定》（证监会公告〔2010〕11 号）第二条、《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》（证监会令第 166 号）第二十三条、《证券公司监督管理条例》第三十三条和第三十八条的规定。根据《证券公司监督管理条例》第七十条的规定，我局决定对你营业部采取责令改正的行政监管措施。你营业部应采取有效措施，健全内部控制，加强合规管理，切实规范展业行为。你营业部应于收到本决定书之日起 30 日内完成整改，并向我局提交整改报告。我局将视情组织检查验收。

如果对本监管措施不服的，可自收到本决定书之日起 60 日内向中国证监会提出行政复议申请，也可以在收到本决定书之日起 6 个月内向有管辖权的人民法院提起诉讼。复议与诉讼期间，上述监管措施不停止执行。

对该证券的投资决策程序的说明：本基金管理人长期跟踪研究该公司，认为公司的上述违规行为对公司并不产生实质性影响。上述通告对该公司证券的投资价值不产生重大影响。该证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

光大证券

关于对光大证券股份有限公司及有关责任人予以通报批评的决定，具体如下：

经查明，2019 年 1 月 26 日，光大证券股份有限公司（以下简称光大证券或公司）披露 2018 年年度业绩预减公告，预计公司 2018 年全年归属于上市公司股东的净利润为 134,711 万元，同比减少 166,936 万元左右，同比下降约 55.34%。业绩预减的主要原因包括市场波动对营业收入的影响、信用风险事件频发、公司对存在减值迹象的资产计提重大单项资产减值准备等。3 月 20 日，公司披露业绩预告更正公告，预计 2018 年全年实现归属于上市公司股东的净利润为 10,332 万元，同比下降 96.6%。业绩预告更正的原因为公司下属孙公司光大浸辉投资管理（上海）有限公司担任执行事务合伙人的上海浸鑫投资咨询合伙企业（有限合伙）投资项目（以下简称 MPS 项目）出

现风险，未能按原计划实现退出，公司相应计提了大额预计负债和资产减值准备。3月28日，公司披露2018年年度报告，实现归属于上市公司股东的净利润为10,332万元。

公司年度业绩是投资者关注的重大事项，可能对公司股价及投资者决策产生重大影响，公司理应根据会计准则对当期业绩进行客观、谨慎的估计，准确预告业绩。公司2018年度业绩预减公告中预计2018年度归属于上市公司股东的净利润同比下降约55%，但更正后的业绩为归属于上市公司股东的净利润同比下降约96.6%，与预告业绩相比差异幅度达到92.33%，差异的绝对金额高达12亿元。公司在业绩预减公告中也未对可能导致变更的不确定事项进行相应的风险提示。同时，公司迟至2019年3月20日才发布业绩预告更正公告。

公司业绩预告信息披露不准确，差异绝对值金额巨大且未及时更正，违反了《上海证券交易所股票上市规则》（以下简称《股票上市规则》）第2.1条、第2.6条、第11.3.3条等有关规定。公司时任董事长薛峰作为公司主要负责人和信息披露第一责任人，时任执行总裁兼主管会计工作负责人周健男作为公司经营管理主要人员、财务负责人，时任独立董事兼董事会审计委员会召集人徐经长作为财务会计事项的主要督导人员，时任董事会秘书朱勤作为公司信息披露事务具体负责人，未能勤勉尽责，对公司的违规行为负有责任。上述责任人的行为违反了《股票上市规则》第2.2条、第3.1.4条、第3.1.5条和第3.2.2条的规定及其在《董事（监事、高级管理人员）声明及承诺书》中做出的承诺。

鉴于上述事实 and 情节，根据《股票上市规则》第17.2条、第17.3条、第17.4条和《上海证券交易所纪律处分和监管措施实施办法》等有关规定，本所作出如下纪律处分决定：对光大证券股份有限公司及时任董事长薛峰、时任执行总裁兼主管会计工作负责人周健男、时任独立董事兼董事会审计委员会召集人徐经长、时任董事会秘书朱勤予以通报批评。

对于上述纪律处分，本所将通报中国证监会，并记入上市公司诚信档案。

公司应当引以为戒，严格按照法律、法规和《股票上市规则》的规定规范运作，认真履行信息披露义务；董事、监事、高级管理人员应当履行忠实勤勉义务，促使公司规范运作，并保证公司及时、公平、真实、准确和完整地披露所有重大信息。

对该证券的投资决策程序的说明：本基金管理人长期跟踪研究该公司，认为公司的上述违规行为对公司并不产生实质性影响。上述通告对该公司证券的投资价值不产生重大影响。该证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

## 8.12.2 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。

## 8.12.3 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	118,640.34
2	应收证券清算款	203,215.46
3	应收股利	-
4	应收利息	3,145,643.58
5	应收申购款	10,640.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,478,139.78

## 8.12.4 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	113583	益丰转债	21,611.20	0.01

## 8.12.5 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	689009	九号公司-UWD	7,666,378.72	2.37	锁定期股票

## 8.12.6 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。

## § 9 基金份额持有人信息

## 9.1 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 (%)
534	366,136.65	175,098,427.27	89.56	20,418,545.69	10.44

## 9.2 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	866,289.18	0.4431

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。

### 9.3 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。

### 9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产 品情况

注：无。

## § 10 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	252,000,631.13
减：本报告期基金总赎回份额	163,763,941.04
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	195,516,972.96

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

无。

### 11.2 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，基金管理人无重大人事变动。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：自2020年8月28日起，刘波先生担任招商银行股份有限公司资产托管部总经理职务。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

无。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《存托凭证发行与交易管理办法（试行）》、《基金合同》以及中国证监会的规定，在本基金的投资范围中新增存托凭证，并补充存托凭证相关投资策略。详见《鹏华基金管理有限公



司关于调整旗下部分基金投资范围并相应修改法律文件的公告》。

### 11.5 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。本年度应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用 50,000.00 元，该审计机构已提供审计服务的年限为 3 年。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

无。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中泰证券	2	256,945,123.56	14.89%	234,154.45	15.37%	-
国盛证券	2	245,736,467.02	14.24%	199,366.97	13.09%	-
招商证券	1	239,787,576.91	13.90%	218,520.86	14.35%	-
爱建证券	1	230,807,264.49	13.38%	187,254.31	12.29%	-
广发证券	1	199,926,865.55	11.59%	182,193.52	11.96%	-
天风证券	2	148,281,293.56	8.59%	133,577.81	8.77%	本报告期内新增1个
中信建投	1	138,495,017.76	8.03%	126,210.67	8.29%	-
安信证券	2	106,203,725.81	6.16%	96,783.05	6.35%	-
浙商证券	1	66,657,936.13	3.86%	60,745.45	3.99%	-
东方证券	1	29,860,136.90	1.73%	27,212.78	1.79%	-
东北证券	1	23,799,163.90	1.38%	21,688.59	1.42%	-
国金证券	1	20,023,027.89	1.16%	18,247.39	1.20%	-
西南证券	2	10,362,195.49	0.60%	9,443.13	0.62%	-

平安证券	1	7,693,958.66	0.45%	7,010.46	0.46%	-
国信证券	2	777,133.93	0.05%	630.44	0.04%	本报告期内新增
华西证券	1	18,691.40	0.00%	15.16	0.00%	本报告期内新增
川财证券	1	-	-	-	-	-
东方财富证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	本报告期内新增
山西证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
中原证券	1	-	-	-	-	-

注：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。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中泰证券	67,698,810.20	17.97%	2,775,200,000.00	12.98%	-	-
国盛证券	12,113,602.96	3.22%	3,637,600,000.00	17.02%	-	-
招商证券	284,874,867.50	75.63%	5,460,100,000.00	25.54%	-	-
爱建证券	-	-	337,000,000.00	1.58%	-	-
广发证券	-	-	852,400,000.00	3.99%	-	-
天风证券	11,998,800.01	3.19%	1,256,000,000.00	5.88%	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	259,000,000.00	1.21%	-	-
东方证券	-	-	2,963,800,000.00	13.86%	-	-
东北证券	-	-	1,624,000,000.00	7.60%	-	-
国金证券	-	-	2,212,200,000.00	10.35%	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-

信达证券	-	-	-	-	-	-
中原证券	-	-	-	-	-	-

### 11.8 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
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	《中国证券报》	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）费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2020年01月17日
5	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
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	《中国证券报》	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	《上海证券报》	2020年01月20日
8	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
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	《证券日报》	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	《证券时报》	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	《上海证券报》	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	《证券日报》	2020年02月05日

	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		
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	《中国证券报》	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	《上海证券报》	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	《证券时报》	2020 年 03 月 25 日
20	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
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	《中国证券报》	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	《证券日报》	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	《中国证券报》	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	《证券时报》	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	《证券日报》	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	《上海证券报》	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	《证券日报》	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	《中国证券报》	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	《证券时报》	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	《证券时报》	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	《中国证券报》	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）申购费率优惠活动的公告	《证券时报》	2020 年 04 月 28 日
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	《上海证券报》	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	《中国证券报》	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	《证券时报》	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	《上海证券报》	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	《证券日报》	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	《证券日报》	2020 年 05 月 18 日

	公告		
46	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
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	《上海证券报》	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
50	鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金暂停大额申购、转换转入和定期定额投资业务的公告	《中国证券报》	2020年05月19日
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
53	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》	2020年07月17日
54	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》	2020年07月17日
55	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》	2020年07月17日
56	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金2020年第2季度报告提示性公告	《证券时报》	2020年07月17日
57	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券日报》	2020年07月17日
58	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金2020年第2季度报告提示性公告	《中国证券报》	2020年07月21日
59	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金2020年第2季度报告提示性公告	《证券日报》	2020年07月21日
60	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金	《上海证券报》	2020年07月21日

	2020 年第 2 季度报告提示性公告		
61	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2020 年第 2 季度报告提示性公告	《证券时报》	2020 年 07 月 21 日
62	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分 基金参与阳光人寿保险股份有限公司 认\申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》	2020 年 07 月 22 日
63	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分 基金参与阳光人寿保险股份有限公司 认\申购费率优惠活动的公告	《证券时报》	2020 年 07 月 22 日
64	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分 基金参与阳光人寿保险股份有限公司 认\申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2020 年 07 月 22 日
65	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分 基金参与阳光人寿保险股份有限公司 认\申购费率优惠活动的公告	《证券日报》	2020 年 07 月 22 日
66	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分 基金参与中信银行股份有限公司认\ 申购费率优惠活动的公告	《证券日报》	2020 年 08 月 03 日
67	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分 基金参与中信银行股份有限公司认\ 申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2020 年 08 月 03 日
68	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分 基金参与中信银行股份有限公司认\ 申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》	2020 年 08 月 03 日
69	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分 基金参与中信银行股份有限公司认\ 申购费率优惠活动的公告	《证券时报》	2020 年 08 月 03 日
70	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2020 年中期报告提示性公告	《中国证券报》、《证券 时报》、《上海证券报》、 《证券日报》	2020 年 08 月 31 日
71	鹏华基金关于旗下部分基金在直销渠 道开展申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》	2020 年 09 月 03 日
72	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分 基金在青岛意才基金销售有限公司调 整认\申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2020 年 09 月 18 日
73	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分 基金在青岛意才基金销售有限公司调 整认\申购费率优惠活动的公告	《证券日报》	2020 年 09 月 18 日
74	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分 基金在青岛意才基金销售有限公司调 整认\申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》	2020 年 09 月 18 日
75	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分 基金在青岛意才基金销售有限公司调 整认\申购费率优惠活动的公告	《证券时报》	2020 年 09 月 18 日



76	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金在直销柜台开展费率优惠活动的公告	《中国证券报》	2020 年 09 月 22 日
77	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金在直销柜台开展费率优惠活动的公告	《证券时报》	2020 年 09 月 22 日
78	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金在直销柜台开展费率优惠活动的公告	《证券日报》	2020 年 09 月 22 日
79	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金在直销柜台开展费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2020 年 09 月 22 日
80	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金在成都华羿恒信基金销售有限公司暂停办理相关销售业务的公告	《证券时报》	2020 年 09 月 29 日
81	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金在成都华羿恒信基金销售有限公司暂停办理相关销售业务的公告	《证券日报》	2020 年 09 月 29 日
82	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金在成都华羿恒信基金销售有限公司暂停办理相关销售业务的公告	《上海证券报》	2020 年 09 月 29 日
83	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金在成都华羿恒信基金销售有限公司暂停办理相关销售业务的公告	《中国证券报》	2020 年 09 月 29 日
84	鹏华基金管理有限公司关于调整旗下部分基金投资范围并相应修改法律文件的公告	《证券时报》	2020 年 10 月 14 日
85	鹏华基金管理有限公司关于调整旗下部分基金投资范围并相应修改法律文件的公告	《证券日报》	2020 年 10 月 14 日
86	鹏华基金管理有限公司关于调整旗下部分基金投资范围并相应修改法律文件的公告	《中国证券报》	2020 年 10 月 14 日
87	鹏华基金管理有限公司关于调整旗下部分基金投资范围并相应修改法律文件的公告	《上海证券报》	2020 年 10 月 14 日
88	鹏华基金管理有限公司旗下基金 2020 年第 3 季度报告提示性公告	《证券时报》	2020 年 10 月 28 日
89	鹏华基金管理有限公司旗下基金 2020 年第 3 季度报告提示性公告	《中国证券报》	2020 年 10 月 28 日
90	鹏华基金管理有限公司旗下基金 2020 年第 3 季度报告提示性公告	《上海证券报》	2020 年 10 月 28 日
91	鹏华基金管理有限公司旗下基金 2020 年第 3 季度报告提示性公告	《证券日报》	2020 年 10 月 28 日
92	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与腾安基金销售（深圳）有限公司申购（含定期定额申购）、赎回费率优惠活动的公告	《证券时报》	2020 年 11 月 16 日

93	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与腾安基金销售（深圳）有限公司申购（含定期定额申购）、赎回费率优惠活动的公告	《中国证券报》	2020 年 11 月 16 日
94	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与腾安基金销售（深圳）有限公司申购（含定期定额申购）、赎回费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2020 年 11 月 16 日
95	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与腾安基金销售（深圳）有限公司申购（含定期定额申购）、赎回费率优惠活动的公告	《证券日报》	2020 年 11 月 16 日
96	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2020 年 11 月 25 日
97	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与信达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 12 月 15 日
98	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与信达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 12 月 15 日
99	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与信达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 12 月 15 日
100	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与信达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 12 月 15 日
101	鹏华基金管理有限公司关于终止成都华羿恒信基金销售有限公司办理相关销售业务并为投资者办理转托管业务的提示性公告	《中国证券报》	2020 年 12 月 23 日
102	鹏华基金管理有限公司关于终止成都华羿恒信基金销售有限公司办理相关销售业务并为投资者办理转托管业务的提示性公告	《证券时报》	2020 年 12 月 23 日
103	鹏华基金管理有限公司关于终止成都华羿恒信基金销售有限公司办理相关销售业务并为投资者办理转托管业务的提示性公告	《证券日报》	2020 年 12 月 23 日
104	鹏华基金管理有限公司关于终止成都	《上海证券报》	2020 年 12 月 23 日

	华羿恒信基金销售有限公司办理相关销售业务并为投资者办理转托管业务的提示性公告		
105	鹏华基金管理有限公司关于旗下证券投资基金持有的股票估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2020 年 12 月 29 日
106	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国工商银行股份有限公司个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	《证券日报》	2020 年 12 月 31 日
107	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国工商银行股份有限公司个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》	2020 年 12 月 31 日
108	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国工商银行股份有限公司个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2020 年 12 月 31 日
109	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国工商银行股份有限公司个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	《证券时报》	2020 年 12 月 31 日

注：无。

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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	15,666,892.11	24,198,323.32	12.38
	2	20200116~20200507	11,409,603.67	30,488,537.55	15,162,574.05	26,735,567.17	13.67
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。

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 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 年年度报告》(原文)。

### 13.2 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。

### 13.3 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

2021 年 3 月 30 日