

鹏华改革红利股票型证券投资基金 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 08 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 2021 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	48
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	48
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	48
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	48
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	49
7.12 投资组合报告附注	49
§ 8 基金份额持有人信息.....	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	50
§ 9 开放式基金份额变动.....	50
§ 10 重大事件揭示	50
10.1 基金份额持有人大会决议	50
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	51
10.4 基金投资策略的改变	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	51
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	51
10.8 其他重大事件	53
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	55
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	56
§ 12 备查文件目录	56
12.1 备查文件目录	56
12.2 存放地点	56
12.3 查阅方式	56

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华改革红利股票型证券投资基金
基金简称	鹏华改革红利股票
基金主代码	001188
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 4 月 28 日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	294,132,750.22 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	本基金为股票型基金，在有效控制风险前提下，精选受益于改革红利的优质上市公司，力求超额收益与长期资本增值。
投资策略	1、资产配置策略 本基金将通过跟踪考量通常的宏观经济变量（包括 GDP 增长率、CPI 走势、M2 的绝对水平和增长率、利率水平与走势等）以及各项国家政策（包括财政、货币、税收、汇率政策等）来判断经济周期目前的位置以及未来将发展的方向，在此基础上对各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估，制定股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。 2、股票投资策略 本基金通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘优质的上市公司，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成长前景、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。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金，属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种。

注：无。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	鹏华基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张戈
	联系电话	0755-82825720
	电子邮箱	zhangge@phfund.com.cn
客户服务电话	4006788999	95588

传真	0755-82021126	010-66105798
注册地址	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	518048	100140
法定代表人	何如	陈四清

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	鹏华基金管理有限公司	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年1月1日-2021年6月30日)
本期已实现收益	81,138,223.76
本期利润	54,125,278.07
加权平均基金份额本期利润	0.1636
本期加权平均净值利润率	11.83%
本期基金份额净值增长率	12.24%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)
期末可供分配利润	129,608,202.41
期末可供分配基金份额利润	0.4406
期末基金资产净值	453,239,487.65
期末基金份额净值	1.541
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
基金份额累计净值增长率	54.10%

注：(1) 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

(3) 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润期末余额和未分配利润中已实现部分

的期末余额的孰低数。表中的“期末”均指报告期最后一日，即 6 月 30 日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	7.39%	1.21%	-1.57%	0.64%	8.96%	0.57%
过去三个月	20.58%	1.32%	3.07%	0.78%	17.51%	0.54%
过去六个月	12.24%	1.83%	0.79%	1.05%	11.45%	0.78%
过去一年	46.62%	1.76%	20.99%	1.07%	25.63%	0.69%
过去三年	91.19%	1.50%	42.79%	1.09%	48.40%	0.41%
自基金合同生效起至今	54.10%	1.64%	15.61%	1.19%	38.49%	0.45%

注：业绩比较基准=沪深 300 指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20%

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



注：1、本基金基金合同于 2015 年 04 月 28 日生效。2、截至建仓期结束，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

3.3 其他指标

注：无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

鹏华基金管理有限公司成立于 1998 年 12 月 22 日，业务范围包括基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。截至本报告期末，公司股东由国信证券股份有限公司、意大利欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）、深圳市北融信投资发展有限公司组成，公司性质为中外合资企业，公司注册资本 15,000 万元人民币。截至本报告期末，公司管理资产总规模达到 9,012.31 亿元，管理 237 只公募基金、13 只全国社保投资组合、4 只基本养老保险投资组合。经过 20 余年投资管理基金，在基金投资、风险控制等方面积累了丰富的经验。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		

袁航	基金经理	2019-12-31	2021-01-16	12 年	袁航先生，国籍中国，经济学硕士，12 年证券从业经验。2009 年 6 月加盟鹏华基金管理有限公司，从事行业研究及投资助理相关工作，担任研究部资深研究员、投资经理助理，现任权益投资一部副总经理、基金经理。2014 年 11 月至今担任鹏华先进制造股票型证券投资基金基金经理，2015 年 02 月至 2017 年 02 月担任鹏华弘盛灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015 年 04 月至 2017 年 02 月担任鹏华弘泽灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015 年 05 月至 2017 年 02 月担任鹏华弘信灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015 年 05 月至 2017 年 02 月担任鹏华弘实灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015 年 06 月至 2017 年 09 月担任鹏华弘锐灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015 年 08 月至今担任鹏华策略优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2018 年 05 月至 2019 年 12 月担任鹏华产业精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2019 年 12 月至 2021 年 01 月担任鹏华改革红利股票型证券投资基金基金经理，2020 年 06 月至今担任鹏华优质企业混合型证券投资基金基金经理，2021 年 02 月至今担任鹏华品质优选混合型证券投资基金基金经理，2021 年 05 月至今担任鹏华鑫远价值一年持有期混合型证券投资基金基金经理，袁航先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理发生变动，袁航不再担任本基金基金经理。
郭盈	基金经理	2020-06-23	-	5 年	郭盈先生，国籍中国，理学博士，5 年证券从业经验。2016 年 7 月加盟鹏华基金管理有限公司，历任研究部助理研究员，研究员，从事电子行业研究分析工作，现任职于权益投资二部，从事投资研究相关工作。2020 年 06 月至今担任鹏华改革红利股票型证券投资基金基金经理，2020 年 08 月至今担任鹏华策略回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理，郭盈先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理发生变动，袁航不再担任本基金基金经理。

注：1. 任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日；担任新成立基金基金经理的，任职日期为基金合同生效日。

2. 证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未发生违法违规且对基金财产造成损失的异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易次数为 2 次，主要原因在于指数基金成分股交易不活跃导致。

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

2021 年上半年，市场整体呈现较高的分化效应，我们认为市场仍然在持续演绎产业周期向上大背景下带来的产业链整体高景气可能产生的后续盈利持续超预期。对于新能源板块，新能源车整体仍然处于高速渗透的中段阶段，可以看到包括国内新势力和欧洲电动整车的月度数据仍然处于环比持续增长、同比高增的状态，终端排产的饱满带来供应链整体的高景气，目前我们仍然看好新能源车产业链业绩的高增长带来的 22 年估值切换，仍然会持有格局最优的龙头电池环节并择机配置部分细分高景气上游环节。半导体板块，全球半导体产业链由于疫情带来的产业链供需错配以及包括新能源车等的需求景气，产生了近 20 年不遇的高景气行情，在该行情中，缺货涨价成为了产业的核心现象。在周期性涨价趋势中，部分量价存在较大弹性的公司股价也会产生较大涨幅，但后续随着周期的回落，该趋势也会结束，对于该部分公司，我们会谨慎的参与并择机兑现收益。我们仍然长期持有内在优质且在这轮景气周期中，客户和市场份额都得以突破的长期优秀企业。我们对于组合构建的底层思路和原则并没有发生变化，始终沿着具有明显全球竞争优势的

创新型产业赛道、具有长期产业观管理层的企业等几个方向选股并构建组合。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期份额净值增长率为 12.24%，同期业绩比较基准增长率为 0.79%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后续，我们认为在高景气赛道中，估值持续的扩张和有悖于产业长期规律的逻辑线性外推将较难继续成为股价驱动因子中的核心因素，更多超额收益将来自于在景气周期中自身核心成长阿尔法仍然在持续形成复利效应的迭代的底层优质企业，该类企业即使在后续行业景气周期回落，也有足够的产品和经营竞争力去持续提升市场份额获得长期成长。因此对公司内生基本面是否能够有足够的韧性去穿越周期甚至盈利超预期的判断将是后续的投资研究重点。我们将投入更多的精力于个股的深入挖掘和内在价值判断上。行业选择上，我们将继续把大部分精力投入于科技、新能源、医药、新兴消费这几个广阔的赛道，注册制背景下快速扩大的赛道容量将足够我们进行个股价值挖掘。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1、截止本报告期末，本基金期末可供分配利润为 129,608,202.41 元，期末基金份额净值 1.541 元。

2、本基金本报告期内未进行利润分配。

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国工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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：鹏华改革红利股票型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	40,617,213.48	29,325,710.13
结算备付金		532,311.94	1,028,974.37
存出保证金		115,034.69	220,573.85
交易性金融资产	6.4.7.2	427,444,050.89	528,162,386.99
其中：股票投资		427,444,050.89	528,162,386.99
基金投资		-	-
债券投资		-	-

资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		1,332,366.68	3,462,287.70
应收利息	6.4.7.5	3,820.32	3,718.88
应收股利		-	-
应收申购款		511,244.45	175,988.98
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		470,556,042.45	562,379,640.90
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		9,961,272.05	-
应付赎回款		6,225,185.30	4,082,868.38
应付管理人报酬		541,193.47	688,395.52
应付托管费		90,198.92	114,732.59
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	394,632.77	582,519.94
应交税费		-	0.77
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	104,072.29	209,241.95
负债合计		17,316,554.80	5,677,759.15
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	294,132,750.22	405,561,912.17
未分配利润	6.4.7.10	159,106,737.43	151,139,969.58
所有者权益合计		453,239,487.65	556,701,881.75
负债和所有者权益总计		470,556,042.45	562,379,640.90

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.541 元，基金份额总额 294,132,750.22 份。

6.2 利润表

会计主体：鹏华改革红利股票型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		59,695,699.00	58,953,682.66
1. 利息收入		90,213.35	423,346.77
其中：存款利息收入	6.4.7.11	90,213.35	423,274.92
债券利息收入		-	71.85
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		86,576,832.32	111,026,814.24
其中：股票投资收益	6.4.7.12	85,352,427.26	104,991,962.01
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	79,941.87
资产支持证券投资	6.4.7.13.5	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	1,224,405.06	5,954,910.36
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-27,012,945.69	-52,657,307.09
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	41,599.02	160,828.74
减：二、费用		5,570,420.93	13,155,476.21
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,428,708.79	7,450,387.45
2. 托管费	6.4.10.2.2	571,451.40	1,241,731.25
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	1,457,203.33	4,344,441.20
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	0.24
7. 其他费用	6.4.7.20	113,057.41	118,916.07
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		54,125,278.07	45,798,206.45
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		54,125,278.07	45,798,206.45

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鹏华改革红利股票型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	405,561,912.17	151,139,969.58	556,701,881.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	54,125,278.07	54,125,278.07
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）	-111,429,161.95	-46,158,510.22	-157,587,672.17
其中：1. 基金申购款	11,546,916.11	4,680,661.60	16,227,577.71
2. 基金赎回款	-122,976,078.06	-50,839,171.82	-173,815,249.88
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）	294,132,750.22	159,106,737.43	453,239,487.65
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,278,278,288.02	-3,483,364.29	1,274,794,923.73
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	45,798,206.45	45,798,206.45
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-465,249,971.53	-579,161.98	-465,829,133.51

(净值减少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	11,831,810.43	-371,475.39	11,460,335.04
2. 基金赎回款	-477,081,781.96	-207,686.59	-477,289,468.55
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)	813,028,316.49	41,735,680.18	854,763,996.67

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

邓召明

邢彪

郝文高

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

鹏华改革红利股票型证券投资基金(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[2015]411号《关于准予鹏华改革红利股票型证券投资基金注册的批复》准予,由鹏华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华改革红利股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币3,683,111,765.79元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第385号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华改革红利股票型证券投资基金基金合同》于2015年4月28日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为3,685,224,044.28份基金份额,其中认购资金利息折合2,112,278.49份基金份额。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华改革红利股票型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票和存托凭证(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票和存托凭证)、债券(含国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、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、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许

基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。基金的投资组合比例为：股票（含存托凭证）资产占基金的比例为 80%—95%，投资收益于改革红利的上市公司发行的股票（含存托凭证）占非现金基金资产的比例不低于 80%；每个交易日日中在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《鹏华改革红利股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年上半年财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 06 月 30 日的财务状况以及 2021 年上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红

利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	40,617,213.48
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	40,617,213.48

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	323,408,900.40	427,444,050.89	104,035,150.49
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	323,408,900.40	427,444,050.89	104,035,150.49

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

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	3,558.15
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	215.64
应收债券利息	-
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	46.53
合计	3,820.32

6.4.7.6 其他资产

注：无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	394,632.77
银行间市场应付交易费用	-
合计	394,632.77

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	429.88
应付证券出借违约金	-
预提费用	103,642.41
合计	104,072.29

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	405,561,912.17	405,561,912.17
本期申购	11,546,916.11	11,546,916.11
本期赎回（以“-”号填列）	-122,976,078.06	-122,976,078.06
- 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	294,132,750.22	294,132,750.22

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	81,206,093.00	69,933,876.58	151,139,969.58
本期利润	81,138,223.76	-27,012,945.69	54,125,278.07
本期基金份额交易产生的变动数	-32,736,114.35	-13,422,395.87	-46,158,510.22
其中：基金申购款	3,652,940.25	1,027,721.35	4,680,661.60
基金赎回款	-36,389,054.60	-14,450,117.22	-50,839,171.82
本期已分配利润	-	-	-
本期末	129,608,202.41	29,498,535.02	159,106,737.43

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	84,721.09
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	4,320.06
其他	1,172.20
合计	90,213.35

注：其他包含认/申购款利息收入、结算保证金利息收入、风控金利息收入等

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	85,352,427.26
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	85,352,427.26

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	536,828,000.98
减：卖出股票成本总额	451,475,573.72
买卖股票差价收入	85,352,427.26

6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,224,405.06
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,224,405.06

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	-27,012,945.69
股票投资	-27,012,945.69
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-27,012,945.69

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	34,238.73
基金转换费收入	7,360.29
合计	41,599.02

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	1,457,203.33
银行间市场交易费用	-
合计	1,457,203.33

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	44,135.04
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费用	415.00
账户维护费	9,000.00
合计	113,057.41

6.4.7.21 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
鹏华基金管理有限公司（“鹏华基金公司”）	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
国信证券	278,736,665.45	30.86	911,138,800.61	33.71

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	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 成交总额的比例 (%)
国信证券	-	-	410,515.76	100.00

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

6.4.10.1.4 权证交易

注：无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
国信证券	254,008.01	31.05	150,321.59	38.09

关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
国信证券	830,321.23	34.09	474,654.11	42.66

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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6 月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,428,708.79	7,450,387.45
其中：支付销售机构的客户维护费	1,663,660.18	3,637,835.34

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

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6 月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	571,451.40	1,241,731.25

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费年费率为 0.25%，逐日计提，按月支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：无。

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

注：无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	40,617,213.48	84,721.09	174,713,132.92	408,791.34

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张）	总金额
国信证券	300957	贝泰妮	网下申购	2,673	126,513.09

国信证券	300986	志特新材	网下申购	2,632	38,927.28
国信证券	688323	瑞华泰	网下申购	4,513	26,942.61
上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位: 张)	总金额
	-	-	-	-	-

注：本基金在上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

注：无。

6.4.12 期末(2021年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300614	百川畅银	2021年5月18日	2021年11月25日	锁定期股票	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300919	中伟股份	2020年12月15日	2021年07月02日	锁定期股票	24.60	163.00	610	15,006.00	99,430.00	-
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年7月7日	锁定期股票	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300929	华骐环保	2021年1月12日	2021年07月21日	锁定期股票	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300930	屹特新材	2021年1月13日	2021年7月21日	锁定期股票	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-
300931	通用电梯	2021年1月	2021年7月	锁定期股票	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-

		13 日	21 日							
300932	三友联众	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 22 日	锁定期股票	24.69	31.71	492	12,147.48	15,601.32	-
300937	药易购	2021 年 1 月 20 日	2021 年 7 月 27 日	锁定期股票	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
300940	南极光	2021 年 1 月 27 日	2021 年 8 月 3 日	锁定期股票	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300941	创识科技	2021 年 2 月 2 日	2021 年 8 月 9 日	锁定期股票	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06	-
300942	易瑞生物	2021 年 2 月 2 日	2021 年 8 月 9 日	锁定期股票	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300943	春晖智控	2021 年 2 月 3 日	2021 年 8 月 10 日	锁定期股票	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300945	曼卡龙	2021 年 2 月 3 日	2021 年 8 月 10 日	锁定期股票	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021 年 2 月 18 日	2021 年 8 月 25 日	锁定期股票	13.00	27.42	324	2,808.00	8,884.08	冠中生态于 2021 年 6 月 4 日实施权益分派方案,每 10 股派人民币 0.8 元,并转增 5 股。
300950	德固特	2021 年 2 月 24 日	2021 年 9 月 3 日	锁定期股票	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
300952	恒辉安防	2021 年 3 月 3 日	2021 年 9 月 13 日	锁定期股票	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
300957	贝泰妮	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 27 日	锁定期股票	47.33	251.96	268	12,684.44	67,525.28	-
300958	建工修复	2021 年 3 月	2021 年 9 月	锁定期股票	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-

		18 日	29 日							
300960	通业科技	2021 年 3 月 22 日	2021 年 9 月 29 日	锁定期股票	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
300961	深水海纳	2021 年 3 月 23 日	2021 年 9 月 30 日	锁定期股票	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300962	中金辐照	2021 年 3 月 29 日	2021 年 10 月 11 日	锁定期股票	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300963	中洲特材	2021 年 3 月 30 日	2021 年 10 月 11 日	锁定期股票	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
300966	共同药业	2021 年 3 月 31 日	2021 年 10 月 11 日	锁定期股票	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300967	晓鸣股份	2021 年 4 月 2 日	2021 年 10 月 13 日	锁定期股票	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300968	格林精密	2021 年 4 月 6 日	2021 年 10 月 15 日	锁定期股票	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-
300971	博亚精工	2021 年 4 月 7 日	2021 年 10 月 15 日	锁定期股票	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-
300972	万辰生物	2021 年 4 月 8 日	2021 年 10 月 19 日	锁定期股票	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300973	立高食品	2021 年 4 月 8 日	2021 年 10 月 15 日	锁定期股票	28.28	115.71	345	9,756.60	39,919.95	-
300975	商络电子	2021 年 4 月 14 日	2021 年 10 月 21 日	锁定期股票	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300978	东箭	2021	2021	锁定期	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-

	科技	年 4 月 15 日	年 10 月 26 日	股票							
300979	华利集团	2021 年 4 月 15 日	2021 年 10 月 26 日	锁定期 股票	33.22	87.50	481	15,978.82	42,087.50	-	
300981	中红医疗	2021 年 4 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	锁定期 股票	48.59	90.39	322	15,645.98	29,105.58	-	
300982	苏文电能	2021 年 4 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	锁定期 股票	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-	
300985	致远新能	2021 年 4 月 21 日	2021 年 10 月 29 日	锁定期 股票	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-	
300986	志特新材	2021 年 4 月 21 日	2021 年 11 月 1 日	锁定期 股票	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-	
300987	川网传媒	2021 年 4 月 28 日	2021 年 11 月 11 日	锁定期 股票	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-	
300992	泰福泵业	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 25 日	锁定期 股票	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-	
300993	玉马遮阳	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 24 日	锁定期 股票	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-	
300995	奇德新材	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 26 日	锁定期 股票	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-	
300996	普联软件	2021 年 5 月 26 日	2021 年 12 月 3 日	锁定期 股票	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-	
300997	欢乐家	2021 年 5 月 26 日	2021 年 12 月 2 日	锁定期 股票	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-	

300998	宁波方正	2021年5月25日	2021年12月2日	锁定期股票	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301002	崧盛股份	2021年5月27日	2021年12月7日	锁定期股票	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
301004	嘉益股份	2021年6月18日	2021年12月27日	锁定期股票	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-
301007	德迈仕	2021年6月4日	2021年12月16日	锁定期股票	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
301009	可靠股份	2021年6月8日	2021年12月17日	锁定期股票	12.54	27.89	801	10,044.54	22,339.89	-
301010	晶雪节能	2021年6月9日	2021年12月20日	锁定期股票	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301011	华立科技	2021年6月9日	2021年12月17日	锁定期股票	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
301012	扬电科技	2021年6月15日	2021年12月22日	锁定期股票	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
301015	百洋医药	2021年6月22日	2021年12月30日	锁定期股票	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
301016	雷尔伟	2021年6月23日	2021年12月30日	锁定期股票	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
301018	申菱环境	2021年6月28日	2021年7月7日	新股未上市	8.29	8.29	7,029	58,270.41	58,270.41	-
301018	申菱环境	2021年6月28日	2022年1月7日	锁定期股票	8.29	8.29	782	6,482.78	6,482.78	-

301020	密封科技	2021年6月28日	2021年7月6日	新股未上市	10.64	10.64	3,789	40,314.96	40,314.96	-
301020	密封科技	2021年6月28日	2022年1月6日	锁定期股票	10.64	10.64	421	4,479.44	4,479.44	-
301021	英诺激光	2021年6月28日	2021年7月6日	新股未上市	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-
301021	英诺激光	2021年6月28日	2022年1月6日	锁定期股票	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-
600905	三峡能源	2021年6月2日	2021年12月10日	锁定期股票	2.65	5.67	907,763	2,405,571.95	5,147,016.21	-
605162	新中港	2021年6月29日	2021年7月7日	新股未上市	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
605287	德才股份	2021年6月28日	2021年7月6日	新股未上市	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
688087	英科再生	2021年6月30日	2021年7月9日	新股未上市	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
688217	睿昂基因	2021年5月7日	2021年11月17日	锁定期股票	18.42	58.40	1,040	19,156.80	60,736.00	-
688226	威腾电气	2021年6月28日	2021年7月7日	新股未上市	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
688239	航宇科技	2021年6月25日	2021年7月5日	新股未上市	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	-
688315	诺禾致源	2021年4月2日	2021年10月13日	锁定期股票	12.76	39.20	3,711	47,352.36	145,471.20	-
688316	青云科技-U	2021年3月5日	2021年9月16日	锁定期股票	63.70	65.00	1,428	90,963.60	92,820.00	-
688597	煜邦电力	2021年6月	2021年12	锁定期股票	5.88	10.16	3,907	22,973.16	39,695.12	-

		9 日	月 17 日							
688609	九联科技	2021 年 3 月 15 日	2021 年 9 月 23 日	锁定期股票	3.99	15.29	10,372	41,384.28	158,587.88	-
688613	奥精医疗	2021 年 5 月 13 日	2021 年 11 月 22 日	锁定期股票	16.43	63.50	2,617	42,997.31	166,179.50	-
688617	惠泰医疗	2020 年 12 月 30 日	2021 年 7 月 7 日	锁定期股票	74.46	373.24	1,673	124,571.58	624,430.52	-
688655	迅捷兴	2021 年 4 月 28 日	2021 年 11 月 11 日	锁定期股票	7.59	15.77	3,083	23,399.97	48,618.91	-
688669	聚石化学	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 26 日	锁定期股票	36.65	32.39	2,681	98,258.65	86,837.59	-
688677	海泰新光	2021 年 2 月 18 日	2021 年 8 月 26 日	锁定期股票	35.76	103.23	1,768	63,223.68	182,510.64	-
688690	纳微科技	2021 年 6 月 16 日	2021 年 12 月 23 日	锁定期股票	8.07	79.89	3,477	28,059.39	277,777.53	-

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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损

失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国工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 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券（2020 年 12 月 31 日：未持有）。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金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、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2021 年 6 月 30 日，本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等，其余大部分金融资产

和金融负债不计息,因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。
本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2021年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	40,617,213.48	-	-	-	40,617,213.48
结算备付金	532,311.94	-	-	-	532,311.94
存出保证金	115,034.69	-	-	-	115,034.69
交易性金融资产	-	-	-	427,444,050.89	427,444,050.89
应收利息	-	-	-	3,820.32	3,820.32
应收申购款	-	-	-	511,244.45	511,244.45
应收证券清算款	-	-	-	1,332,366.68	1,332,366.68
资产总计	41,264,560.11	-	-	429,291,482.34	470,556,042.45
负债					
应付赎回款	-	-	-	6,225,185.30	6,225,185.30
应付管理人报酬	-	-	-	541,193.47	541,193.47
应付托管费	-	-	-	90,198.92	90,198.92
应付证券清算款	-	-	-	9,961,272.05	9,961,272.05
应付交易费用	-	-	-	394,632.77	394,632.77
其他负债	-	-	-	104,072.29	104,072.29
负债总计	-	-	-	17,316,554.80	17,316,554.80
利率敏感度缺口	41,264,560.11	-	-	-411,974,927.54	453,239,487.65
上年度末 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	29,325,710.13	-	-	-	29,325,710.13
结算备付金	1,028,974.37	-	-	-	1,028,974.37
存出保证金	220,573.85	-	-	-	220,573.85
交易性金融资产	-	-	-	528,162,386.99	528,162,386.99
应收利息	-	-	-	3,718.88	3,718.88
应收申购款	-	-	-	175,988.98	175,988.98
应收证券清算款	-	-	-	3,462,287.70	3,462,287.70
资产总计	30,575,258.35	-	-	531,804,382.55	562,379,640.90
负债					
应付赎回款	-	-	-	4,082,868.38	4,082,868.38
应付管理人报酬	-	-	-	688,395.52	688,395.52
应付托管费	-	-	-	114,732.59	114,732.59
应付交易费用	-	-	-	582,519.94	582,519.94
应交税费	-	-	-	0.77	0.77
其他负债	-	-	-	209,241.95	209,241.95

负债总计	-	-	5,677,759.15	5,677,759.15
利率敏感度缺口	30,575,258.35	-	-526,126,623.40	556,701,881.75

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资和资产支持证券公允价值占基金资产净值的比例为 0.00%。因此当利率发生合理、可能的变动时，对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 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。

本基金股票资产占基金资产的比例为 80%—95%；投资于受益于改革红利的上市公司发行的股票占非现金基金资产的比例不低于 80%；基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%。

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 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	427,444,050.89	94.31	528,162,386.99	94.87
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	427,444,050.89	94.31	528,162,386.99	94.87

注：债券投资为可转换债券、可交换债券投资。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
分析	业绩比较基准上升5%	24,551,723.72	25,671,305.04
	业绩比较基准下降5%	-24,551,723.72	-25,671,305.04

注：无。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	427,444,050.89	90.84
	其中：股票	427,444,050.89	90.84
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-

	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	41,149,525.42	8.74
8	其他各项资产	1,962,466.14	0.42
9	合计	470,556,042.45	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	38,147.08	0.01
B	采矿业	87,263.74	0.02
C	制造业	344,586,183.55	76.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,232,390.70	1.15
E	建筑业	36,301.73	0.01
F	批发和零售业	292,060.26	0.06
G	交通运输、仓储和邮政业	27,865.35	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	26,550,655.40	5.86
J	金融业	97,319.40	0.02
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	15,610,644.36	3.44
M	科学研究和技术服务业	34,824,518.96	7.68
N	水利、环境和公共设施管理业	44,438.33	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	16,262.03	0.00
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	427,444,050.89	94.31

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	603259	药明康德	221,464	34,679,047.76	7.65
2	300750	宁德时代	63,100	33,745,880.00	7.45
3	002475	立讯精密	591,651	27,215,946.00	6.00
4	002415	海康威视	406,600	26,225,700.00	5.79
5	000858	五粮液	67,542	20,120,086.38	4.44
6	300782	卓胜微	36,400	19,565,000.00	4.32
7	601012	隆基股份	197,400	17,537,016.00	3.87
8	000661	长春高新	42,614	16,491,618.00	3.64
9	300760	迈瑞医疗	33,000	15,841,650.00	3.50
10	601888	中国中免	51,800	15,545,180.00	3.43
11	603345	安井食品	56,000	14,225,120.00	3.14
12	002179	中航光电	178,640	14,116,132.80	3.11
13	300014	亿纬锂能	121,700	12,648,281.00	2.79
14	688536	思瑞浦	22,754	12,537,454.00	2.77
15	002049	紫光国微	63,500	9,791,065.00	2.16
16	600519	贵州茅台	4,600	9,460,820.00	2.09
17	688002	睿创微纳	85,233	8,508,810.39	1.88
18	002311	海大集团	100,818	8,226,748.80	1.82
19	300866	安克创新	48,100	8,055,307.00	1.78
20	688390	固德威	24,007	8,018,338.00	1.77
21	002851	麦格米特	231,900	7,242,237.00	1.60
22	300454	深信服	27,500	7,135,700.00	1.57
23	603986	兆易创新	37,100	6,971,090.00	1.54
24	600845	宝信软件	131,767	6,706,940.30	1.48
25	300408	三环集团	155,300	6,587,826.00	1.45
26	002791	坚朗五金	30,900	5,996,145.00	1.32
27	605111	新洁能	31,100	5,606,397.00	1.24
28	601799	星宇股份	24,100	5,439,852.00	1.20
29	688076	诺泰生物	77,939	5,316,219.19	1.17
30	600905	三峡能源	907,763	5,147,016.21	1.14
31	688388	嘉元科技	49,097	4,465,863.12	0.99
32	688200	华峰测控	9,301	4,402,442.33	0.97
33	002008	大族激光	92,800	3,748,192.00	0.83
34	688595	芯海科技	36,010	3,167,799.70	0.70
35	600060	海信视像	166,300	2,810,470.00	0.62
36	603899	晨光文具	31,900	2,697,464.00	0.60
37	603737	三棵树	13,700	2,411,200.00	0.53
38	300777	中简科技	43,200	1,951,776.00	0.43
39	688169	石头科技	1,114	1,404,754.00	0.31
40	688617	惠泰医疗	1,673	624,430.52	0.14

41	688690	纳微科技	3,477	277,777.53	0.06
42	301015	百洋医药	4,614	251,115.78	0.06
43	688660	电气风电	26,678	234,766.40	0.05
44	688677	海泰新光	1,768	182,510.64	0.04
45	688613	奥精医疗	2,617	166,179.50	0.04
46	688609	九联科技	10,372	158,587.88	0.03
47	688315	诺禾致源	3,711	145,471.20	0.03
48	688625	呈和科技	2,672	142,764.96	0.03
49	688516	奥特维	872	129,056.00	0.03
50	301016	雷尔伟	2,747	115,711.58	0.03
51	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.02
52	688316	青云科技-U	1,428	92,820.00	0.02
53	301004	嘉益股份	3,115	90,654.98	0.02
54	688669	聚石化学	2,681	86,837.59	0.02
55	301011	华立科技	1,750	79,474.50	0.02
56	688359	三孚新科	2,213	78,561.50	0.02
57	001203	大中矿业	3,809	76,751.35	0.02
58	688685	迈信林	2,612	67,781.40	0.01
59	300957	贝泰妮	268	67,525.28	0.01
60	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.01
61	688260	昀冢科技	2,990	64,105.60	0.01
62	601665	齐鲁银行	6,731	62,598.30	0.01
63	688217	睿昂基因	1,040	60,736.00	0.01
64	301007	德迈仕	3,022	60,305.15	0.01
65	300998	宁波方正	2,003	60,075.24	0.01
66	603529	爱玛科技	1,019	59,224.28	0.01
67	300995	奇德新材	1,909	57,368.52	0.01
68	301012	扬电科技	1,691	56,994.16	0.01
69	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.01
70	300992	泰福泵业	1,998	55,828.42	0.01
71	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
72	301010	晶雪节能	2,172	50,480.96	0.01
73	300910	瑞丰新材	474	49,556.70	0.01
74	601156	东航物流	2,090	49,470.30	0.01
75	688655	迅捷兴	3,083	48,618.91	0.01
76	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.01
77	600702	舍得酒业	200	42,756.00	0.01
78	300894	火星人	628	42,704.00	0.01
79	300979	华利集团	481	42,087.50	0.01
80	688517	金冠电气	2,892	41,095.32	0.01
81	300973	立高食品	345	39,919.95	0.01
82	688597	煜邦电力	3,907	39,695.12	0.01

83	688067	爱威科技	1,259	39,520.01	0.01
84	605339	南侨食品	863	37,264.34	0.01
85	688367	工大高科	1,717	37,035.69	0.01
86	600032	浙江新能	3,045	37,027.20	0.01
87	605090	九丰能源	1,090	35,326.90	0.01
88	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01
89	300900	广联航空	879	32,857.02	0.01
90	300981	中红医疗	322	29,105.58	0.01
91	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01
92	605296	神农集团	569	26,856.80	0.01
93	603324	盛剑环境	732	26,630.16	0.01
94	605080	浙江自然	374	23,487.20	0.01
95	600031	三一重工	800	23,256.00	0.01
96	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
97	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
98	601279	英利汽车	2,004	20,901.72	0.00
99	001206	依依股份	321	20,389.92	0.00
100	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
101	605305	中际联合	368	19,364.16	0.00
102	001205	盛航股份	577	18,850.59	0.00
103	603511	爱慕股份	553	18,249.00	0.00
104	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
105	300908	仲景食品	285	16,983.15	0.00
106	605098	行动教育	289	16,262.03	0.00
107	605196	华通线缆	1,172	16,079.84	0.00
108	605300	佳禾食品	576	16,012.80	0.00
109	603836	海程邦达	733	15,994.06	0.00
110	300925	法本信息	600	15,774.00	0.00
111	300890	翔丰华	286	15,615.60	0.00
112	300932	三友联众	492	15,601.32	0.00
113	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
114	605016	百龙创园	445	14,222.20	0.00
115	605180	华生科技	384	14,208.00	0.00
116	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
117	300907	康平科技	473	13,915.66	0.00
118	605319	无锡振华	764	13,706.16	0.00
119	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
120	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
121	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
122	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
123	300902	国安达	551	12,981.56	0.00
124	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00

125	300892	品渥食品	272	12,479.36	0.00
126	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
127	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
128	003042	中农联合	420	11,839.80	0.00
129	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
130	300876	蒙泰高新	350	11,567.50	0.00
131	300895	铜牛信息	340	11,563.40	0.00
132	605488	福莱新材	416	11,103.04	0.00
133	300918	南山智尚	1,063	11,065.83	0.00
134	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
135	605289	罗曼股份	379	10,930.36	0.00
136	605259	绿田机械	295	10,516.75	0.00
137	605086	龙高股份	443	10,512.39	0.00
138	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
139	605189	富春染织	422	10,165.98	0.00
140	300922	天秦装备	287	9,996.21	0.00
141	300882	万胜智能	572	9,981.40	0.00
142	003041	真爱美家	349	9,876.70	0.00
143	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
144	300893	松原股份	414	9,240.48	0.00
145	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
146	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
147	001202	炬申股份	459	9,014.76	0.00
148	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
149	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
150	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
151	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
152	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
153	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
154	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
155	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
156	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
157	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
158	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
159	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
160	605298	必得科技	391	7,847.37	0.00
161	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
162	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
163	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
164	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
165	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
166	300886	华业香料	191	6,194.13	0.00

167	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
168	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
169	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
170	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
171	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
172	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300782	卓胜微	19,973,418.25	3.59
2	300014	亿纬锂能	17,670,787.00	3.17
3	300408	三环集团	16,909,342.00	3.04
4	688536	思瑞浦	14,063,343.12	2.53
5	002475	立讯精密	13,815,000.00	2.48
6	300750	宁德时代	13,742,442.00	2.47
7	002049	紫光国微	13,389,916.00	2.41
8	300454	深信服	11,389,488.00	2.05
9	603986	兆易创新	11,161,767.00	2.00
10	000858	五粮液	11,016,661.00	1.98
11	605111	新洁能	10,015,262.00	1.80
12	688200	华峰测控	9,681,812.24	1.74
13	300760	迈瑞医疗	9,014,636.64	1.62
14	603338	浙江鼎力	8,581,134.56	1.54
15	002415	海康威视	8,184,410.00	1.47
16	601012	隆基股份	8,032,770.08	1.44
17	300458	全志科技	7,861,910.05	1.41
18	688002	睿创微纳	7,629,396.00	1.37
19	600519	贵州茅台	7,247,321.00	1.30
20	688202	美迪西	7,008,189.54	1.26

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	30,808,977.72	5.53
2	002475	立讯精密	29,838,233.27	5.36
3	300760	迈瑞医疗	23,322,818.40	4.19
4	600519	贵州茅台	23,279,278.00	4.18
5	603259	药明康德	19,406,576.05	3.49
6	603338	浙江鼎力	19,076,793.69	3.43

7	002821	凯莱英	18,615,558.80	3.34
8	000858	五粮液	18,193,941.00	3.27
9	601012	隆基股份	15,082,529.00	2.71
10	002179	中航光电	13,463,881.24	2.42
11	002311	海大集团	13,210,878.38	2.37
12	300782	卓胜微	12,295,217.50	2.21
13	000661	长春高新	11,378,693.00	2.04
14	002410	广联达	10,949,787.02	1.97
15	300014	亿纬锂能	10,866,072.15	1.95
16	300458	全志科技	10,781,574.00	1.94
17	688008	澜起科技	10,727,070.99	1.93
18	300408	三环集团	10,671,862.67	1.92
19	002415	海康威视	10,268,258.00	1.84
20	600399	抚顺特钢	9,397,743.00	1.69

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	377,770,183.31
卖出股票收入（成交）总额	536,828,000.98

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：无。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：无。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：无。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：无。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目标，选择流动性好、交易活跃的股指期货的期货合约，充分考虑股指期货的风险收益特征，通过多头或空头的套期保值策略，以改善投资组合的投资效果，实现股票组合的超额收益。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券中本期没有发行主体被监管部门立案调查的、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券备选库

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	115,034.69
2	应收证券清算款	1,332,366.68
3	应收股利	-
4	应收利息	3,820.32
5	应收申购款	511,244.45
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,962,466.14

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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 (%)
7,472	39,364.66	-	-	294,132,750.22	100.00

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	254.31	0.0001

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

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2015 年 4 月 28 日) 基金份额总额	3,685,224,044.28
本报告期期初基金份额总额	405,561,912.17
本报告期基金总申购份额	11,546,916.11
减：本报告期基金总赎回份额	122,976,078.06
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	294,132,750.22

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人的重大人事变动：

报告期内，公司原副总经理高阳先生辞去公司副总经理职务，经公司董事会审议通过，于 2021 年 1 月 16 日离任。

报告期内，经公司董事会审议通过，聘任王宗合先生担任公司副总经理，任职日期自 2021 年 1 月 28 日起；聘任梁浩先生担任公司副总经理，任职日期自 2021 年 1 月 28 日起。

本公司已将上述变更事项报相关监管部门备案。

报告期内，经公司股东会审议通过，史际春先生不再担任公司独立董事，于 2021 年 4 月 22 日离任；聘任蒋毅刚先生担任公司独立董事，任职日期自 2021 年 4 月 22 日起。

基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动：

中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”）根据工作需要，任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

无。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未改聘为本基金审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

无。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	

中信证券	1	345,507,286.07	38.25%	314,860.76	38.49%	-
国信证券	2	278,736,665.45	30.86%	254,008.01	31.05%	-
招商证券	1	93,898,918.87	10.40%	85,570.45	10.46%	-
东吴证券	1	90,228,884.80	9.99%	82,225.58	10.05%	-
华西证券	1	58,407,810.61	6.47%	47,386.67	5.79%	-
申万宏源	1	36,502,868.11	4.04%	33,995.17	4.16%	-
华林证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-

注：交易单元选择的标准和程序：

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

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

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

2) 选择交易单元的程序：

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券	成交金额	占当期债券	成交金额	占当期权

	成交总额的 比例		回购 成交总额的 比例		证 成交总额的 比例
中信证券	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与东莞农村商业银行股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021年01月04日
2	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国银行股份有限公司定期定额申购和网上银行、手机银行申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021年01月04日
3	鹏华基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021年01月16日
4	鹏华改革红利股票型证券投资基金基金经理变更公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021年01月16日
5	鹏华改革红利股票型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021年01月20日
6	鹏华改革红利股票型证券投资基金更新的招募说明书（2021年第1号）	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021年01月20日
7	鹏华改革红利股票型证券投资基金2020年第4季度报告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021年01月22日
8	鹏华基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021年01月28日
9	鹏华基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会	2021年01月28日

		基金电子披露网站	
10	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 02 月 06 日
11	鹏华基金管理有限公司关于终止包商银行股份有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 02 月 08 日
12	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 03 月 06 日
13	鹏华基金管理有限公司关于对旗下基金中基金资产管理计划通过直销渠道申购、赎回、转换旗下公募基金免除相关费用的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 03 月 09 日
14	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 03 月 10 日
15	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购贝泰妮首次公开发行 A 股的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 03 月 19 日
16	鹏华基金管理有限公司关于直销渠道相关业务费率优惠活动的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 03 月 22 日
17	鹏华改革红利股票型证券投资基金 2020 年年度报告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 03 月 30 日
18	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加珠海盈米基金销售有限公司基金转换业务申购补差费率优惠活动的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 03 月 30 日
19	鹏华基金管理有限公司旗下基金 2020 年年度报告提示性公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 03 月 30 日
20	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国银行股份有限公司定期定额申购和网上银行、手机银行申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 04 月 01 日
21	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 04 月 10 日
22	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中泰证券股份有限公司申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 04 月 13 日

23	鹏华改革红利股票型证券投资基金更新的招募说明书	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 04 月 14 日
24	鹏华改革红利股票型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 04 月 14 日
25	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与北京展恒基金销售股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 04 月 19 日
26	鹏华基金管理有限公司关于调整旗下部分基金单笔最低申购（含定期定额投资）金额、单笔最低转换份额和账户最低余额限制的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 04 月 19 日
27	鹏华改革红利股票型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 04 月 21 日
28	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2021 年第 1 季度报告提示性公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 04 月 21 日
29	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购瑞华泰首次公开发行 A 股的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 04 月 23 日
30	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购志特新材首次公开发行 A 股的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 04 月 23 日
31	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 04 月 26 日
32	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与珠海盈米基金销售有限公司相关费率优惠活动的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 05 月 14 日
33	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 06 月 04 日

注：无。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一)《鹏华改革红利股票型证券投资基金基金合同》；
- (二)《鹏华改革红利股票型证券投资基金托管协议》；
- (三)《鹏华改革红利股票型证券投资基金 2021 年中期报告》(原文)。

12.2 存放地点

深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层鹏华基金管理有限公司。

12.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅，也可按工本费购买复印件，或通过本基金管理人网站 (<http://www.phfund.com.cn>) 查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人鹏华基金管理有限公司，本公司已开通客户服务系统，咨询电话：4006788999。

鹏华基金管理有限公司

2021 年 8 月 30 日