

# 鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金 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：招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。

基金托管人招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

<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 主要财务指标和基金净值表现</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	9
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	14
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>14</b>
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	18
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>44</b>
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
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	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	59
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	60

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	61
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	61
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	61
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	61
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	61
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	61
7.12 投资组合报告附注 .....	62
<b>§ 8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>62</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	62
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	63
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	63
<b>§ 9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>63</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>63</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	63
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 .....	63
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	64
10.4 基金投资策略的改变 .....	64
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	64
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 .....	64
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	64
10.8 其他重大事件 .....	67
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>70</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	70
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	70
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>70</b>
12.1 备查文件目录 .....	70
12.2 存放地点 .....	70
12.3 查阅方式 .....	70

## § 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	129,316,001.04 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。（1）自上而下的行业遴选 本基金将自上而下地进行行业遴选，重点关注行业增长前景、行业利润前景和行业成功要素。对行业增长前景，主要分析行业的外部发展环境、行业的生命周期以及行业波动与经济周期的关系等；对行业利润前景，主要分析行业结构，特别是业内竞争的方式、业内竞争的激烈程度、以及业内厂商的谈判能力等。基于对行业结构的分析形成对业内竞争的关键成功要素的判断，为预测企业经营环境的变化建立起扎实的基础。（2）自下而上的个股选择 本基金通过定性和定量相结合的方法进行自下而上的个股选择，对企业基本面和估值水平进行综合的研判，精选优质个股。</p> <p>1) 定性分析 本基金通过以下两方面标准对股票的基本面进行研究分析并筛选出优质的公司：一方面是竞争力分析，通过对公司竞争策略和核心竞争力的分析，选择具有可持续竞争优势的公司或未来具有广阔成长空间的公司。就公司竞争策略，基于行业分析的结果判断策略的有效性、策略的实施支持和策略的执行成果；就核心竞争力，分析公司的现有核心竞争力，并判断公司能否利用</p>

	<p>现有的资源、能力和定位取得可持续竞争优势。另一方面是管理层分析，通过着重考察公司的管理层以及管理制度，选择具有良好治理结构、管理水平较高的优质公司。</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、历史比较和增长性分析，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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦	
办公地址	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦	
邮政编码	518048	518040	
法定代表人	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》
登载基金中期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	35,172,646.96
本期利润	32,162,804.76
加权平均基金份额本期利润	0.2344
本期加权平均净值利润率	13.58%
本期基金份额净值增长率	14.13%
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	105,866,677.12
期末可供分配基金份额利润	0.8187
期末基金资产净值	243,745,224.69
期末基金份额净值	1.8849
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	88.49%

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

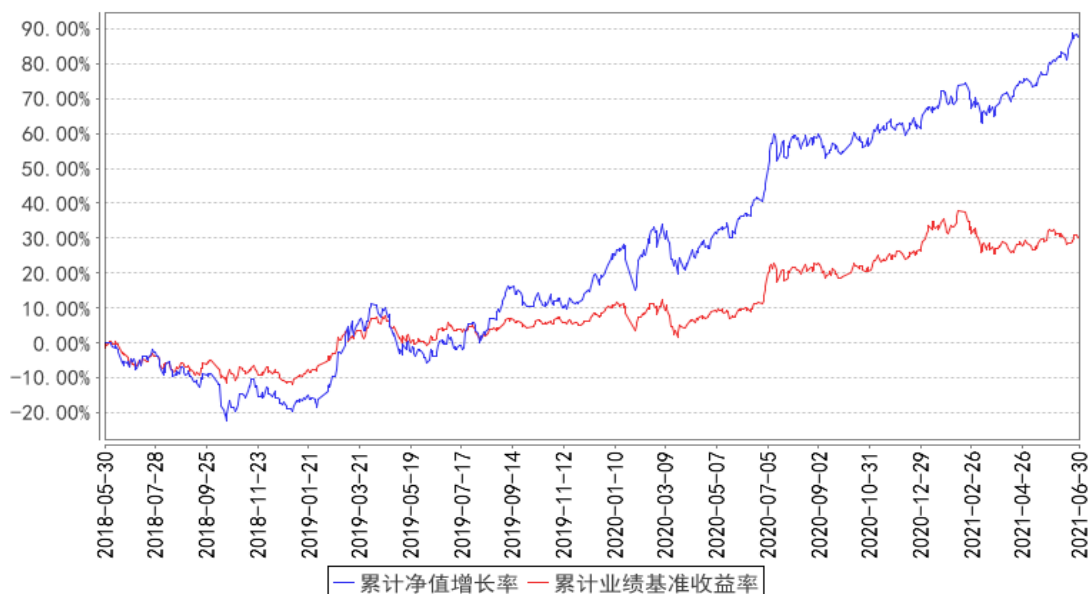
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	4.33%	0.55%	-1.13%	0.48%	5.46%	0.07%
过去三个月	11.71%	0.50%	2.68%	0.59%	9.03%	-0.09%
过去六个月	14.13%	0.71%	1.31%	0.79%	12.82%	-0.08%
过去一年	32.41%	0.82%	16.48%	0.80%	15.93%	0.02%
过去三年	97.08%	1.20%	36.72%	0.81%	60.36%	0.39%
自基金合同生效起至今	88.49%	1.20%	30.72%	0.81%	57.77%	0.39%

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



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

鹏华睿投混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2018 年 05 月 30 日生效。2、截至建仓期结束，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

### 3.3 其他指标

注：无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

刘方正	基金经理	2018-05-30	-	11 年	<p>刘方正先生，国籍中国，理学硕士，11 年证券从业经验。2010 年 6 月加盟鹏华基金管理有限公司，从事债券研究工作，历任固定收益部高级研究员、基金经理助理，现任稳定收益投资部总经理助理、基金经理。2015 年 03 月至 2017 年 01 月担任鹏华弘利灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015 年 03 月至 2015 年 08 月担任鹏华行业成长证券投资基金基金经理，2015 年 04 月至 2017 年 01 月担任鹏华弘润灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015 年 05 月至今担任鹏华弘华灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015 年 05 月至 2017 年 01 月担任鹏华弘益灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015 年 05 月至今担任鹏华弘和灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015 年 06 月至 2017 年 01 月担任鹏华弘鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015 年 08 月至今担任鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金基金经理，2015 年 08 月至 2017 年 01 月担任鹏华弘泰灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 03 月至 2018 年 05 月担任鹏华弘锐灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 03 月至 2017 年 05 月担任鹏华弘实灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 03 月至今担任鹏华弘信灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 08 月至今担任鹏华弘达灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 08 月至 2017 年 12 月担任鹏华弘嘉灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 09 月至今担任鹏华弘惠灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 11 月至 2018 年 01 月担任鹏华兴裕定期开放灵活配置混合型基金基金经理，2016 年 11 月至今担任鹏华兴泰定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 12 月至今担任鹏华兴悦定期开放灵活配置混合型基金基金经理，2017 年 09 月至 2018 年 08 月担任鹏华兴益定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2018 年 05 月至今担任鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金基金经理，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</p>
-----	------	------------	---	------	--

					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。

#### 4.2 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，新冠疫情仍在全球范围内产生巨大影响，随着疫苗接种范围的逐步扩散和新变种 delta 的快速扩张，疫情在逐步可控的过程中仍存在着反复扰动，全球范围内的总供给和总需求都发生了较大波动。国内情况来看，宏观经济形势在去年年底复苏高点附近展现出较强的延续性，上半年整体经济运行情况良好，尤其是外需保持了较好的势头，内需方面，投资整体表现稳定，其中房地产在受政策压制的情况下整体表现较好，制造业延续反弹向上趋势，基建在低位保持稳定。消费方面，也呈现稳步复苏的趋势，居民收入受疫情影响较难消除，因此消费的恢复相比其他部分困难较大。政策方面，货币政策保持了适度的宽松趋势，近期降准继续释放流动性，整体仍维持较为稳定的状况，财政方面，中央层面保持了一定延续性，但地方政府专项债的放缓

也确实超出了初始的预期，同时也未下半年内需的逐步回落预留了一些对冲的空间。金融数据方面，银行体系的信用扩张基本符合预期，伴随着政府融资节奏的调整，整体社融同比呈回落走势，目前处于近年中位数附近。

2021 年上半年，权益市场整体经历冲高回落的过程，春节附近是震荡高点，其后市场整体有所回落，结构上以创业板和科创板为主的板块再次冲高，新能源汽车、光伏和半导体等方向持续强势，上证 50、沪深 300 等大权重大市值方向表现明显偏弱。债券市场整体呈现震荡略有下行的走势，流动性相对充裕，信用利差和期限利差均被明显压缩。

本基金以追求长期与权益指数相接近的收益率水平，并同时降低净值波动率。目前阶段，权益指数处于历史中性估值分位数区间，操作方面保持相对中性的权益仓位水平，辅之以部分固定收益类资产，同时，积极参与新股、可转债、可交换债的网下申购获取增强收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期份额净值增长率为 14.13%，同期业绩比较基准增长率为 1.31%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，我们认为宏观经济仍将延续目前景气程度，边际上存在缓慢回落的压力，同时政策上的对冲也将稳步落地。其中，外需仍然保持较强水平，随着欧美主流经济体疫苗接种比例的进一步提高，产能利用率将进一步逐步回升，需求和供给能力都将继续向上，我国的出口将存在逐步回落的压力，但景气度仍将维持。内需方面，投资仍然是主要动力，制造业投资进一步上行趋势较为明确，基建投资也有伴随专项债放量的过程逐步有所提高的可能，房地产投资存在一定下行压力，消费需求方面，国内仍将逐步推动消费的复苏，但疫情对居民收入方面的影响对消费较长时间内存在抑制作用，但考虑到贫富分化问题，中高端消费的景气程度仍有进一步修复的空间和动力。流动性方面，我们预计也将保持相对稳定，社融同比增速有望在年底前在目前水平保持稳定略有下行，金融体系流动性伴随降准落地和央行的主动呵护，大概率保持稳定。

在此情况下，我们认为整体权益市场处于中性状况，盈利预期随着经济总需求和物价的见顶有缓慢回落的可能，流动性相对宽松也给与市场一定估值上的支撑。目前全市场整体的估值水平中性，结构上中证 500 指数估值偏低，科创板和创业板的估值水平偏高，市场在整体大幅上行和下行可能性不大的情况下，结构上的分化可能有所变化，高估值板块由于市场集中度和充分的预期，存在波动的可能性，低估值板块配置价值的逐步显现，也有企稳的动力。债券方面，目前收益率绝对水平略微偏低，对经济回落和金融流动性的预期相对稳定，收益率水平与目前阶段的物价和经济景气程度存在一定程度的偏离，中长久期收益率进一步回落的空间相对有限，存在一定风险。

未来我们仍将坚持以追求长期与权益指数相接近的收益率水平，并同时降低净值波动率的投资策

略。目前阶段，操作方面保持相对中性的权益仓位水平，辅之以部分固定收益类资产，同时，积极参与新股、可转债、可交换债的网下申购获取增强收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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 105,866,677.12 元，期末基金份额净值 1.8849 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

托管人声明：

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

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

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

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

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

## 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	4,425,399.37	4,472,078.78
结算备付金		5,673,057.37	16,991,832.18
存出保证金		78,730.22	118,640.34
交易性金融资产	6.4.7.2	265,567,974.08	395,047,072.19
其中：股票投资		143,242,372.80	203,320,060.99
基金投资		-	-
债券投资		122,325,601.28	191,727,011.20
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		415,613.62	203,215.46
应收利息	6.4.7.5	2,372,566.16	3,145,643.58
应收股利		-	-
应收申购款		130,075.47	10,640.40
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-

资产总计		278,663,416.29	419,989,122.93
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
<b>负 债:</b>			
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		34,200,000.00	95,900,000.00
应付证券清算款		-	235,992.57
应付赎回款		97,415.58	15,175.31
应付管理人报酬		286,995.28	453,254.68
应付托管费		38,266.04	60,433.93
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	207,879.49	289,126.47
应交税费		2,619.20	6,263.46
应付利息		-	-34,714.37
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	85,016.01	170,043.28
负债合计		34,918,191.60	97,095,575.33
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	129,316,001.04	195,516,972.96
未分配利润	6.4.7.10	114,429,223.65	127,376,574.64
所有者权益合计		243,745,224.69	322,893,547.60
负债和所有者权益总计		278,663,416.29	419,989,122.93

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.8849 元，基金份额总额 129,316,001.04 份。

## 6.2 利润表

会计主体：鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：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		35,767,174.87	50,568,269.18
1. 利息收入		2,090,451.08	848,251.95
其中：存款利息收入	6.4.7.11	79,698.70	68,403.13
债券利息收入		2,004,884.01	736,147.16
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收		5,868.37	43,701.66

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）		36,313,839.84	28,822,405.19
其中：股票投资收益	6.4.7.12	35,140,424.17	26,623,932.95
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	105,912.97	-11,743.07
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	1,067,502.70	2,210,215.31
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-3,009,842.20	20,678,607.20
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	372,726.15	219,004.84
减：二、费用		3,604,370.11	3,589,940.86
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,763,898.93	2,037,779.79
2. 托管费	6.4.10.2.2	235,186.53	271,704.02
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	767,286.82	1,014,536.17
5. 利息支出		743,150.53	177,356.64
其中：卖出回购金融资产支出		743,150.53	177,356.64
6. 税金及附加		3,166.77	1,890.51
7. 其他费用	6.4.7.20	91,680.53	86,673.73
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		32,162,804.76	46,978,328.32
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		32,162,804.76	46,978,328.32

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：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)	195,516,972.96	127,376,574.64	322,893,547.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	32,162,804.76	32,162,804.76
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)	-66,200,971.92	-45,110,155.75	-111,311,127.67
其中：1. 基金申购款	6,429,552.56	5,140,618.14	11,570,170.70
2. 基金赎回款	-72,630,524.48	-50,250,773.89	-122,881,298.37
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)	129,316,001.04	114,429,223.65	243,745,224.69
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)	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)	-	46,978,328.32	46,978,328.32
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	204,744,488.96	62,981,018.22	267,725,507.18
其中：1. 基金申购款	249,584,867.85	74,574,336.92	324,159,204.77
2. 基金赎回款	-44,840,378.89	-11,593,318.70	-56,433,697.59
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金	-	-	-

净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	312,024,771.83	132,130,650.55	444,155,422.38

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%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 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	4,425,399.37
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	4,425,399.37
----	--------------

#### 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	126,922,098.50	143,242,372.80	16,320,274.30
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	121,828,020.54	122,325,601.28
	银行间市场	-	-
	合计	121,828,020.54	122,325,601.28
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	248,750,119.04	265,567,974.08	16,817,855.04

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	569.39
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	2,552.90
应收债券利息	2,369,408.47
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	35.40
合计	2,372,566.16

#### 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	207,879.49
银行间市场应付交易费用	-
合计	207,879.49

#### 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	713.45
应付证券出借违约金	-
预提费用	84,302.56
合计	85,016.01

#### 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	195,516,972.96	195,516,972.96
本期申购	6,429,552.56	6,429,552.56
本期赎回（以“-”号填列）	-72,630,524.48	-72,630,524.48
- 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	129,316,001.04	129,316,001.04

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	108,909,588.28	18,466,986.36	127,376,574.64
本期利润	35,172,646.96	-3,009,842.20	32,162,804.76

本期基金份额交易产生的变动数	-38,215,558.12	-6,894,597.63	-45,110,155.75
其中：基金申购款	4,898,150.42	242,467.72	5,140,618.14
基金赎回款	-43,113,708.54	-7,137,065.35	-50,250,773.89
本期已分配利润	-	-	-
本期末	105,866,677.12	8,562,546.53	114,429,223.65

#### 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	12,832.70
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	66,105.33
其他	760.67
合计	79,698.70

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	35,140,424.17
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	35,140,424.17

##### 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	289,270,631.68
减：卖出股票成本总额	254,130,207.51
买卖股票差价收入	35,140,424.17

##### 6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

## 6.4.7.13 债券投资收益

## 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	105,912.97
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	105,912.97

## 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	71,417,411.40
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	70,422,780.27
减：应收利息总额	888,718.16
买卖债券差价收入	105,912.97

## 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	1,067,502.70
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	1,067,502.70

## 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	-3,009,842.20
股票投资	-3,850,412.55
债券投资	840,570.35
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	-3,009,842.20

#### 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	347,142.24
基金转换费收入	25,583.91
合计	372,726.15

#### 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	767,286.82
银行间市场交易费用	-
合计	767,286.82

#### 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	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费用	7,377.97
合计	91,680.53

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

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	90,906,947.52	19.06	-	-

##### 6.4.10.1.2 债券交易

注：无。

##### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)
国信证券	388,300,000.00	5.34	-	-

##### 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	73,754.19	17.67	73,754.19	35.48
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	-	-	-	-

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	1,763,898.93	2,037,779.79
其中:支付销售机构的客户维护费	99,947.48	207,466.81

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	235,186.53	271,704.02

注：支付基金托管人招商银行的托管费年费率为 0.20%，逐日计提，按月支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.20%÷当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：无。

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

注：无。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用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
招商银行	4,425,399.37	12,832.70	2,290,653.23	31,515.62

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2021年1月1日至2021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
国信证券	300957	贝泰妮	网下申购	1,433	67,823.89
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7月2日	锁定期股票	24.60	163.00	601	14,784.60	97,963.00	-
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	屹通	2021	2021	锁定期	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-

	新材	年 1 月 13 日	年 7 月 21 日	股票						
300931	通用 电梯	2021 年 1 月 13 日	2021 年 7 月 21 日	锁定期 股票	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
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	305	6,499.55	15,231.70	-
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	2021	2021	锁定期	47.33	251.96	144	6,815.52	36,282.24	-

	妮	年 3 月 18 日	年 9 月 27 日	股票						
300958	建工 修复	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 29 日	锁定期 股票	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
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	940	6,457.80	11,345.80	-
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	198	5,599.44	22,910.58	-
300975	商络	2021	2021	锁定期	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-



	电子	年 4 月 14 日	年 10 月 21 日	股票							
300978	东箭科技	2021 年 4 月 15 日	2021 年 10 月 26 日	锁定期 股票	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-	
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	273	9,069.06	23,887.50	-	
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	181	8,794.79	16,360.59	-	
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	227	5,652.30	5,631.87	-	
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	2021 年 12	锁定期 股票	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-	

		26日	月3日							
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	665	8,339.10	18,546.85	-
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	2021年7月	新股未上市	8.29	8.29	7,029	58,270.41	58,270.41	-

		28 日	7 日							
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	-
688079	美迪凯	2021 年 2 月 23 日	2021 年 9 月 2 日	锁定期股票	10.19	18.40	7,376	75,161.44	135,718.40	-
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	2,345	51,496.20	51,496.20	-
688097	博众精工	2021 年 4 月 29 日	2021 年 11 月 12 日	锁定期股票	11.27	28.01	3,983	44,888.41	111,563.83	-
688226	威腾电气	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 7 日	锁定期股票	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	-
688323	瑞华泰	2021 年 4 月	2021 年 10 月	锁定期股票	5.97	22.78	4,513	26,942.61	102,806.14	-

		21 日	月 28 日							
688517	金冠电气	2021 年 6 月 10 日	2021 年 12 月 20 日	锁定期股票	7.71	11.88	2,892	22,297.32	34,356.96	-
688538	和辉光电-U	2021 年 5 月 20 日	2021 年 11 月 29 日	锁定期股票	2.65	3.38	50,571	134,013.15	170,929.98	-
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	-
688619	罗普特	2021 年 2 月 8 日	2021 年 8 月 23 日	锁定期股票	19.31	26.74	4,722	91,181.82	126,266.28	-
688659	元琛科技	2021 年 3 月 24 日	2021 年 10 月 8 日	锁定期股票	6.50	10.46	3,671	23,861.50	38,398.66	-
688661	和林微纳	2021 年 3 月 19 日	2021 年 9 月 29 日	锁定期股票	17.71	84.01	1,452	25,714.92	121,982.52	-

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

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
600460	士兰微	2021年6月30日	重大事项	56.35	2021年7月1日	59.49	5,600	106,790.62	315,560.00	-
600811	东方集团	2021年6月30日	重大事项	3.05	2021年7月14日	3.36	85,400	295,393.02	260,470.00	-

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 06 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 34,200,000.00 元，于 2021 年 07 月 01 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

本基金的基金管理人致力于全面内部控制体系的建设，建立了从董事会层面到各业务部门的风险

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

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

#### 6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行招商银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。

本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券占基金资产净值的比例为 41.16%（2020 年 12 月 31 日：52.57%）。

##### 6.4.13.2.1 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 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	22,000,000.00	21,971,400.00
合计	22,000,000.00	21,971,400.00

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。

**6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

注：无。

**6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

注：无。

**6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	100,320,778.70	169,734,000.00
AAA 以下	4,822.58	21,611.20
未评级	-	-
合计	100,325,601.28	169,755,611.20

注：未评级债券包括国债、中央银行票据和政策性金融债。

**6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

注：无。

**6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

注：无。

**6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理职能部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短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，除卖出回购金融资产款余额 34,200,000.00 元将在一个月内到期且计息外，本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

#### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

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

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及



对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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。

##### 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	4,425,399.37	-	-	-	4,425,399.37
结算备付金	5,673,057.37	-	-	-	5,673,057.37
存出保证金	78,730.22	-	-	-	78,730.22
交易性金融资产	22,000,000.00	100,281,000.00	44,601.28	143,242,372.80	265,567,974.08
应收利息	-	-	-	2,372,566.16	2,372,566.16
应收申购款	-	-	-	130,075.47	130,075.47
应收证券清算款	-	-	-	415,613.62	415,613.62
资产总计	32,177,186.96	100,281,000.00	44,601.28	146,160,628.05	278,663,416.29
负债					
应付赎回款	-	-	-	97,415.58	97,415.58
应付管理人报酬	-	-	-	286,995.28	286,995.28
应付托管费	-	-	-	38,266.04	38,266.04

卖出回购金融资产款	34,200,000.00	-	-	-	34,200,000.00
应付交易费用	-	-	-	207,879.49	207,879.49
应交税费	-	-	-	2,619.20	2,619.20
其他负债	-	-	-	85,016.01	85,016.01
负债总计	34,200,000.00	-	-	718,191.60	34,918,191.60
利率敏感度缺口	-2,022,813.04	100,281,000.00	44,601.28	145,442,436.45	243,745,224.69
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	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

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

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（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月

			31 日 )
分析	市场利率下降 25 个基点	452, 496. 39	961, 048. 41
	市场利率上升 25 个基点	-449, 329. 68	-953, 465. 27

注：无。

#### 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。

本基金对股票资产的投资比例占基金资产的 0%—95%。

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

#### 6. 4. 13. 4. 3. 1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	143,242,372.80	58.77	203,320,060.99	62.97
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	44,601.28	0.02	21,611.20	0.01
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	143,286,974.08	58.79	203,341,672.19	62.97

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%	6,476,797.05	11,813,885.87
	业绩比较基准下降5%	-6,476,797.05	-11,813,885.87

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	143,242,372.80	51.40
	其中：股票	143,242,372.80	51.40
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	122,325,601.28	43.90
	其中：债券	122,325,601.28	43.90

	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	10,098,456.74	3.62
8	其他各项资产	2,996,985.47	1.08
9	合计	278,663,416.29	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	396,548.28	0.16
B	采矿业	1,401,023.70	0.57
C	制造业	94,143,470.24	38.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,539,516.90	2.68
E	建筑业	1,954,734.71	0.80
F	批发和零售业	3,354,372.71	1.38
G	交通运输、仓储和邮政业	3,071,821.04	1.26
H	住宿和餐饮业	732,376.00	0.30
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,681,270.88	5.61
J	金融业	5,750,196.25	2.36
K	房地产业	4,707,136.23	1.93
L	租赁和商务服务业	823,341.60	0.34
M	科学研究和技术服务业	1,143,590.00	0.47
N	水利、环境和公共设施管理业	2,738,591.66	1.12
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	26,938.80	0.01
Q	卫生和社会工作	118,730.00	0.05
R	文化、体育和娱乐业	2,273,323.00	0.93
S	综合	385,390.80	0.16
	合计	143,242,372.80	58.77

### 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	300595	欧普康视	76,920	7,965,066.00	3.27
2	300072	三聚环保	963,100	5,528,194.00	2.27
3	600905	三峡能源	907,763	5,147,016.21	2.11
4	688099	晶晨股份	41,600	4,667,520.00	1.91
5	603650	彤程新材	96,400	4,636,840.00	1.90
6	600885	宏发股份	68,598	4,301,094.60	1.76
7	600392	盛和资源	226,500	3,932,040.00	1.61
8	603486	科沃斯	14,520	3,311,721.60	1.36
9	603290	斯达半导	9,400	3,008,000.00	1.23
10	600132	重庆啤酒	12,500	2,474,375.00	1.02
11	603568	伟明环保	104,481	2,385,301.23	0.98
12	002028	思源电气	75,900	2,336,961.00	0.96
13	600216	浙江医药	145,000	2,321,450.00	0.95
14	300168	万达信息	152,400	2,225,040.00	0.91
15	000738	航发控制	96,300	2,005,929.00	0.82
16	002568	百润股份	20,720	1,964,048.80	0.81
17	000581	威孚高科	94,000	1,958,020.00	0.80
18	300133	华策影视	318,100	1,883,152.00	0.77
19	002056	横店东磁	137,400	1,786,200.00	0.73
20	603927	中科软	41,500	1,782,425.00	0.73
21	002791	坚朗五金	8,700	1,688,235.00	0.69
22	002385	大北农	240,200	1,633,360.00	0.67
23	601099	太平洋	471,200	1,597,368.00	0.66
24	601000	唐山港	659,400	1,589,154.00	0.65
25	000338	潍柴动力	85,700	1,531,459.00	0.63
26	603816	顾家家居	18,336	1,417,006.08	0.58
27	000333	美的集团	19,400	1,384,578.00	0.57
28	002085	万丰奥威	245,200	1,373,120.00	0.56
29	600435	北方导航	170,102	1,350,609.88	0.55
30	000651	格力电器	25,900	1,349,390.00	0.55
31	600507	方大特钢	193,894	1,314,601.32	0.54
32	600782	新钢股份	234,400	1,307,952.00	0.54
33	000002	万科A	54,900	1,307,169.00	0.54
34	001914	招商积余	75,400	1,295,372.00	0.53
35	600909	华安证券	195,390	1,088,322.30	0.45
36	300012	华测检测	34,000	1,083,920.00	0.44
37	600859	王府井	35,500	1,025,240.00	0.42
38	000629	攀钢钒钛	445,600	1,020,424.00	0.42
39	002690	美亚光电	17,700	986,952.00	0.40
40	600640	号百控股	78,200	953,258.00	0.39

41	600466	蓝光发展	322,880	952,496.00	0.39
42	600039	四川路桥	139,800	876,546.00	0.36
43	002839	张家港行	146,300	795,872.00	0.33
44	603056	德邦股份	70,200	771,498.00	0.32
45	000488	晨鸣纸业	92,400	752,136.00	0.31
46	002544	杰赛科技	51,000	680,340.00	0.28
47	688617	惠泰医疗	1,673	624,430.52	0.26
48	600195	中牧股份	45,089	539,264.44	0.22
49	002505	鹏都农牧	237,600	532,224.00	0.22
50	600917	重庆燃气	61,700	504,089.00	0.21
51	601869	长飞光纤	20,400	496,944.00	0.20
52	600546	山煤国际	66,100	474,598.00	0.19
53	600754	锦江酒店	8,000	455,600.00	0.19
54	002242	九阳股份	13,800	448,362.00	0.18
55	002705	新宝股份	17,000	446,250.00	0.18
56	002709	天赐材料	3,992	425,467.36	0.17
57	000799	酒鬼酒	1,600	408,960.00	0.17
58	600120	浙江东方	90,321	386,573.88	0.16
59	002375	亚厦股份	43,900	347,688.00	0.14
60	000009	中国宝安	18,440	336,898.80	0.14
61	600089	特变电工	26,100	335,385.00	0.14
62	601718	际华集团	115,800	326,556.00	0.13
63	002340	格林美	34,200	319,770.00	0.13
64	002074	国轩高科	7,300	317,988.00	0.13
65	002302	西部建设	40,000	316,000.00	0.13
66	600460	士兰微	5,600	315,560.00	0.13
67	688578	艾利斯-U	9,244	304,774.68	0.13
68	000415	渤海租赁	120,200	290,884.00	0.12
69	300285	国瓷材料	5,700	277,875.00	0.11
70	600258	首旅酒店	11,600	276,776.00	0.11
71	601233	桐昆股份	11,400	274,626.00	0.11
72	600811	东方集团	85,400	260,470.00	0.11
73	300207	欣旺达	7,900	257,224.00	0.11
74	002185	华天科技	15,600	240,084.00	0.10
75	300316	晶盛机电	4,600	232,300.00	0.10
76	601636	旗滨集团	11,300	209,728.00	0.09
77	600733	北汽蓝谷	15,300	206,244.00	0.08
78	300146	汤臣倍健	6,100	200,690.00	0.08
79	300037	新宙邦	2,000	200,200.00	0.08
80	300253	卫宁健康	12,200	198,494.00	0.08
81	002625	光启技术	9,200	191,452.00	0.08
82	002223	鱼跃医疗	5,000	190,650.00	0.08

83	002648	卫星石化	4,820	188,895.80	0.08
84	600884	杉杉股份	8,055	187,842.60	0.08
85	600219	南山铝业	51,400	185,040.00	0.08
86	002353	杰瑞股份	4,100	183,270.00	0.08
87	601127	小康股份	2,700	180,009.00	0.07
88	002138	顺络电子	4,600	178,342.00	0.07
89	000547	航天发展	9,200	173,604.00	0.07
90	603737	三棵树	980	172,480.00	0.07
91	002797	第一创业	24,100	172,074.00	0.07
92	688538	和辉光电-U	50,571	170,929.98	0.07
93	600704	物产中大	21,700	170,779.00	0.07
94	600779	水井坊	1,343	169,688.05	0.07
95	000988	华工科技	7,200	169,344.00	0.07
96	603589	口子窖	2,500	169,225.00	0.07
97	300699	光威复材	2,200	167,090.00	0.07
98	002444	巨星科技	4,900	166,992.00	0.07
99	002212	天融信	8,330	164,684.10	0.07
100	601168	西部矿业	13,600	162,248.00	0.07
101	002422	科伦药业	8,100	161,595.00	0.07
102	688425	铁建重工	26,129	159,909.48	0.07
103	000807	云铝股份	13,400	159,460.00	0.07
104	603444	吉比特	300	159,000.00	0.07
105	600739	辽宁成大	7,600	158,156.00	0.06
106	601117	中国化学	17,600	154,176.00	0.06
107	000636	风华高科	5,100	154,122.00	0.06
108	300308	中际旭创	4,000	154,080.00	0.06
109	002439	启明星辰	5,300	153,753.00	0.06
110	603893	瑞芯微	1,100	153,406.00	0.06
111	000830	鲁西化工	8,100	151,713.00	0.06
112	600862	中航高科	4,900	150,822.00	0.06
113	688002	睿创微纳	1,500	149,745.00	0.06
114	002078	太阳纸业	11,200	149,520.00	0.06
115	002030	达安基因	6,966	147,957.84	0.06
116	002250	联化科技	5,300	147,870.00	0.06
117	600068	葛洲坝	19,700	147,553.00	0.06
118	600699	均胜电子	5,760	146,995.20	0.06
119	300088	长信科技	17,600	145,376.00	0.06
120	600486	扬农化工	1,300	145,301.00	0.06
121	600315	上海家化	2,400	144,336.00	0.06
122	002503	搜于特	91,700	143,969.00	0.06
123	000630	铜陵有色	52,800	143,616.00	0.06
124	002507	涪陵榨菜	3,800	143,108.00	0.06



125	600563	法拉电子	900	142,524.00	0.06
126	002013	中航机电	13,900	139,973.00	0.06
127	600201	生物股份	7,942	138,587.90	0.06
128	603605	珀莱雅	700	137,697.00	0.06
129	002075	沙钢股份	12,600	137,466.00	0.06
130	002127	南极电商	14,000	136,780.00	0.06
131	000039	中集集团	7,520	136,713.60	0.06
132	688079	美迪凯	7,376	135,718.40	0.06
133	300001	特锐德	4,400	132,484.00	0.05
134	601997	贵阳银行	18,300	131,028.00	0.05
135	000021	深科技	6,700	128,238.00	0.05
136	601005	重庆钢铁	48,000	128,160.00	0.05
137	002273	水晶光电	8,700	127,803.00	0.05
138	000513	丽珠集团	2,551	127,601.02	0.05
139	600549	厦门钨业	6,100	127,063.00	0.05
140	002511	中顺洁柔	4,600	126,730.00	0.05
141	002299	圣农发展	5,300	126,564.00	0.05
142	688619	罗普特	4,722	126,266.28	0.05
143	002080	中材科技	4,800	125,616.00	0.05
144	002092	中泰化学	12,200	125,294.00	0.05
145	002465	海格通信	13,200	124,872.00	0.05
146	600988	赤峰黄金	8,300	124,417.00	0.05
147	000739	普洛药业	4,200	123,480.00	0.05
148	002603	以岭药业	4,200	122,472.00	0.05
149	000825	太钢不锈	16,300	122,087.00	0.05
150	688661	和林微纳	1,452	121,982.52	0.05
151	600177	雅戈尔	18,500	121,915.00	0.05
152	600867	通化东宝	10,200	121,788.00	0.05
153	600171	上海贝岭	4,000	121,720.00	0.05
154	601128	常熟银行	19,600	121,520.00	0.05
155	600516	方大炭素	16,300	121,272.00	0.05
156	300009	安科生物	8,132	121,166.80	0.05
157	600066	宇通客车	9,700	121,153.00	0.05
158	000983	山西焦煤	14,530	120,744.30	0.05
159	600637	东方明珠	14,700	120,393.00	0.05
160	000998	隆平高科	7,500	120,300.00	0.05
161	600536	中国软件	2,100	119,553.00	0.05
162	300244	迪安诊断	3,100	118,730.00	0.05
163	300618	寒锐钴业	1,500	118,260.00	0.05
164	300482	万孚生物	1,820	117,735.80	0.05
165	600418	江淮汽车	9,400	116,842.00	0.05
166	600879	航天电子	15,500	116,560.00	0.05

167	002152	广电运通	8,900	115,967.00	0.05
168	600369	西南证券	23,800	115,906.00	0.05
169	000750	国海证券	27,300	115,752.00	0.05
170	000723	美锦能源	15,300	115,668.00	0.05
171	300070	碧水源	15,800	115,498.00	0.05
172	601689	拓普集团	3,085	115,471.55	0.05
173	600316	洪都航空	3,000	115,440.00	0.05
174	600529	山东药玻	3,400	115,430.00	0.05
175	300357	我武生物	1,800	115,416.00	0.05
176	000932	华菱钢铁	17,480	115,368.00	0.05
177	600380	健康元	8,392	115,222.16	0.05
178	600487	亨通光电	10,100	115,140.00	0.05
179	600827	百联股份	5,700	114,855.00	0.05
180	600166	福田汽车	33,000	113,850.00	0.05
181	000960	锡业股份	7,100	113,813.00	0.05
182	300463	迈克生物	2,700	113,643.00	0.05
183	300271	华宇软件	5,900	113,575.00	0.05
184	002373	千方科技	6,800	113,560.00	0.05
185	002131	利欧股份	48,500	113,490.00	0.05
186	300296	利亚德	14,500	113,390.00	0.05
187	601615	明阳智能	7,000	113,330.00	0.05
188	002156	通富微电	4,700	112,988.00	0.05
189	000975	银泰黄金	11,840	112,598.40	0.05
190	688097	博众精工	3,983	111,563.83	0.05
191	300383	光环新网	7,700	110,803.00	0.05
192	600038	中直股份	2,100	110,754.00	0.05
193	002572	索菲亚	4,500	108,900.00	0.04
194	600642	申能股份	17,600	108,064.00	0.04
195	002926	华西证券	11,200	107,856.00	0.04
196	601198	东兴证券	9,800	107,114.00	0.04
197	601866	中远海发	28,400	106,500.00	0.04
198	002065	东华软件	13,400	106,262.00	0.04
199	300115	长盈精密	5,100	105,060.00	0.04
200	688208	道通科技	1,200	104,388.00	0.04
201	002500	山西证券	15,370	103,132.70	0.04
202	600998	九州通	6,700	102,979.00	0.04
203	600271	航天信息	7,900	102,937.00	0.04
204	603156	养元饮品	3,600	102,888.00	0.04
205	688323	瑞华泰	4,513	102,806.14	0.04
206	000623	吉林敖东	6,600	102,234.00	0.04
207	603638	艾迪精密	2,380	102,030.60	0.04
208	600895	张江高科	5,500	100,485.00	0.04

209	601699	潞安环能	8,500	100,385.00	0.04
210	603260	合盛硅业	1,300	99,983.00	0.04
211	600415	小商品城	19,400	99,910.00	0.04
212	000012	南玻 A	9,746	99,799.04	0.04
213	600153	建发股份	12,300	99,630.00	0.04
214	300919	中伟股份	601	97,963.00	0.04
215	300474	景嘉微	1,000	97,920.00	0.04
216	600188	兖州煤业	6,300	96,768.00	0.04
217	600256	广汇能源	29,000	96,570.00	0.04
218	600390	五矿资本	16,100	96,278.00	0.04
219	002294	信立泰	2,900	95,410.00	0.04
220	300418	昆仑万维	5,800	95,004.00	0.04
221	300024	机器人	8,900	94,963.00	0.04
222	600535	天士力	6,400	94,784.00	0.04
223	600060	海信视像	5,600	94,640.00	0.04
224	600008	首创环保	31,410	94,544.10	0.04
225	002670	国盛金控	8,293	94,457.27	0.04
226	600497	驰宏锌锗	21,900	94,389.00	0.04
227	002382	蓝帆医疗	4,500	93,825.00	0.04
228	000878	云南铜业	7,300	93,659.00	0.04
229	600208	新湖中宝	30,800	93,632.00	0.04
230	688029	南微医学	300	93,507.00	0.04
231	600155	华创阳安	8,700	93,090.00	0.04
232	002372	伟星新材	4,460	92,188.20	0.04
233	002019	亿帆医药	5,300	91,425.00	0.04
234	300630	普利制药	1,743	91,333.20	0.04
235	600372	中航电子	5,500	91,025.00	0.04
236	300251	光线传媒	8,400	90,804.00	0.04
237	600765	中航重机	4,000	90,600.00	0.04
238	002557	洽洽食品	2,100	90,510.00	0.04
239	000027	深圳能源	9,820	90,049.40	0.04
240	603858	步长制药	4,000	89,960.00	0.04
241	002221	东华能源	8,200	89,790.00	0.04
242	000718	苏宁环球	10,800	89,532.00	0.04
243	600498	烽火通信	4,800	89,424.00	0.04
244	002174	游族网络	5,200	89,284.00	0.04
245	600511	国药股份	2,700	89,262.00	0.04
246	600141	兴发集团	4,720	88,877.60	0.04
247	600170	上海建工	31,900	88,044.00	0.04
248	002146	荣盛发展	15,500	87,420.00	0.04
249	002506	协鑫集成	25,100	87,348.00	0.04
250	002390	信邦制药	8,300	86,984.00	0.04

251	600409	三友化工	8,600	86,946.00	0.04
252	600875	东方电气	7,900	86,663.00	0.04
253	000401	冀东水泥	7,000	86,450.00	0.04
254	000997	新大陆	5,200	86,268.00	0.04
255	601717	郑煤机	7,400	86,062.00	0.04
256	002408	齐翔腾达	6,900	85,698.00	0.04
257	300058	蓝色光标	14,100	85,305.00	0.03
258	600801	华新水泥	4,840	85,038.80	0.03
259	000686	东北证券	10,000	84,500.00	0.03
260	600160	巨化股份	9,520	84,156.80	0.03
261	300315	掌趣科技	19,700	83,725.00	0.03
262	603707	健友股份	2,000	83,500.00	0.03
263	002195	二三四五	40,992	83,213.76	0.03
264	603866	桃李面包	2,652	82,742.40	0.03
265	300017	网宿科技	14,000	81,900.00	0.03
266	002268	卫士通	4,200	81,816.00	0.03
267	600325	华发股份	12,100	81,554.00	0.03
268	600732	爱旭股份	5,800	80,736.00	0.03
269	601992	金隅集团	29,900	80,431.00	0.03
270	601016	节能风电	21,500	80,410.00	0.03
271	600027	华电国际	23,300	80,152.00	0.03
272	000961	中南建设	13,500	79,920.00	0.03
273	600567	山鹰国际	23,100	79,695.00	0.03
274	002831	裕同科技	2,681	79,598.89	0.03
275	603225	新凤鸣	3,920	79,576.00	0.03
276	000060	中金岭南	17,600	79,552.00	0.03
277	603712	七一二	2,200	79,420.00	0.03
278	603077	和邦生物	37,900	78,832.00	0.03
279	600282	南钢股份	22,000	78,320.00	0.03
280	000158	常山北明	6,800	78,132.00	0.03
281	002191	劲嘉股份	7,300	77,672.00	0.03
282	600500	中化国际	9,860	77,499.60	0.03
283	000671	阳光城	14,800	76,960.00	0.03
284	600528	中铁工业	9,500	76,950.00	0.03
285	601577	长沙银行	8,600	76,884.00	0.03
286	600839	四川长虹	26,400	76,824.00	0.03
287	600598	北大荒	5,100	76,296.00	0.03
288	000898	鞍钢股份	17,100	76,095.00	0.03
289	600737	中粮糖业	7,600	76,076.00	0.03
290	002081	金螳螂	9,600	76,032.00	0.03
291	603198	迎驾贡酒	1,700	75,310.00	0.03
292	000709	河钢股份	30,500	75,030.00	0.03

293	000999	华润三九	2,800	74,900.00	0.03
294	002595	豪迈科技	2,800	74,760.00	0.03
295	002203	海亮股份	7,000	74,480.00	0.03
296	600580	卧龙电驱	5,600	74,480.00	0.03
297	600728	佳都科技	10,000	74,100.00	0.03
298	600808	马钢股份	17,100	73,359.00	0.03
299	300182	捷成股份	14,700	73,353.00	0.03
300	002010	传化智联	9,500	73,245.00	0.03
301	300212	易华录	2,720	73,195.20	0.03
302	688088	虹软科技	1,300	72,475.00	0.03
303	000729	燕京啤酒	10,000	72,400.00	0.03
304	000930	中粮科技	8,000	72,080.00	0.03
305	300166	东方国信	5,800	71,688.00	0.03
306	600820	隧道股份	13,500	71,415.00	0.03
307	002281	光迅科技	2,900	71,340.00	0.03
308	002387	维信诺	6,800	70,924.00	0.03
309	603883	老百姓	1,340	70,591.20	0.03
310	002396	星网锐捷	3,300	70,455.00	0.03
311	002004	华邦健康	11,300	70,173.00	0.03
312	002745	木林森	5,200	69,680.00	0.03
313	002048	宁波华翔	3,500	68,250.00	0.03
314	600755	厦门国贸	8,300	68,143.00	0.03
315	002563	森马服饰	5,700	68,115.00	0.03
316	300002	神州泰岳	14,000	67,900.00	0.03
317	600970	中材国际	7,400	67,858.00	0.03
318	600022	山东钢铁	39,200	67,424.00	0.03
319	603000	人民网	3,900	67,041.00	0.03
320	000598	兴蓉环境	12,800	66,688.00	0.03
321	600398	海澜之家	9,200	66,608.00	0.03
322	600881	亚泰集团	23,300	66,405.00	0.03
323	600037	歌华有线	6,900	66,309.00	0.03
324	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.03
325	002002	鸿达兴业	16,400	64,452.00	0.03
326	603885	吉祥航空	4,200	64,092.00	0.03
327	000778	新兴铸管	17,200	63,984.00	0.03
328	601880	辽港股份	37,400	63,954.00	0.03
329	600348	华阳股份	8,600	63,812.00	0.03
330	000883	湖北能源	13,900	63,801.00	0.03
331	000690	宝新能源	12,400	63,364.00	0.03
332	601456	国联证券	4,100	63,140.00	0.03
333	600260	凯乐科技	7,100	63,048.00	0.03
334	000887	中鼎股份	5,200	62,816.00	0.03

335	002701	奥瑞金	12,100	62,194.00	0.03
336	601118	海南橡胶	12,200	62,098.00	0.03
337	600126	杭钢股份	12,080	61,970.40	0.03
338	600597	光明乳业	4,300	61,963.00	0.03
339	002249	大洋电机	11,800	61,950.00	0.03
340	600908	无锡银行	10,600	61,480.00	0.03
341	002925	盈趣科技	1,570	61,088.70	0.03
342	600026	中远海能	9,900	60,984.00	0.03
343	002183	怡亚通	10,600	60,738.00	0.02
344	600967	内蒙一机	6,000	60,720.00	0.02
345	600718	东软集团	6,200	60,636.00	0.02
346	601179	中国西电	14,700	60,564.00	0.02
347	600410	华胜天成	7,800	60,528.00	0.02
348	600985	淮北矿业	4,900	59,829.00	0.02
349	600645	中源协和	2,600	59,670.00	0.02
350	600572	康恩贝	13,300	59,052.00	0.02
351	002867	周大生	2,950	58,321.50	0.02
352	000970	中科三环	6,100	58,255.00	0.02
353	000528	柳工	7,100	58,220.00	0.02
354	600446	金证股份	4,000	57,760.00	0.02
355	600167	联美控股	6,460	57,687.80	0.02
356	002266	浙富控股	11,500	57,385.00	0.02
357	000402	金融街	8,500	57,375.00	0.02
358	000877	天山股份	4,400	57,332.00	0.02
359	002128	露天煤业	5,500	57,255.00	0.02
360	000089	深圳机场	7,300	56,721.00	0.02
361	600064	南京高科	6,100	56,669.00	0.02
362	601200	上海环境	4,730	56,618.10	0.02
363	002368	太极股份	2,820	56,569.20	0.02
364	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.02
365	600329	中新药业	2,000	56,180.00	0.02
366	000990	诚志股份	4,400	56,012.00	0.02
367	002110	三钢闽光	8,250	55,605.00	0.02
368	300026	红日药业	12,900	54,825.00	0.02
369	000400	许继电气	4,300	54,438.00	0.02
370	600158	中体产业	4,747	54,163.27	0.02
371	300376	易事特	6,600	53,064.00	0.02
372	601975	招商南油	24,700	52,858.00	0.02
373	000519	中兵红箭	4,900	52,528.00	0.02
374	002233	塔牌集团	5,100	52,428.00	0.02
375	000959	首钢股份	9,300	52,266.00	0.02
376	600307	酒钢宏兴	22,400	51,968.00	0.02

377	600376	首开股份	9,200	51,520.00	0.02
378	601333	广深铁路	24,300	51,516.00	0.02
379	688087	英科再生	2,345	51,496.20	0.02
380	000685	中山公用	6,300	51,408.00	0.02
381	000090	天健集团	9,278	51,307.34	0.02
382	002440	闰土股份	5,700	50,445.00	0.02
383	000559	万向钱潮	9,400	49,914.00	0.02
384	002985	北摩高科	510	49,725.00	0.02
385	600804	鹏博士	10,200	49,368.00	0.02
386	600643	爱建集团	7,000	48,860.00	0.02
387	600673	东阳光	10,800	48,492.00	0.02
388	601860	紫金银行	13,100	47,553.00	0.02
389	600373	中文传媒	4,800	47,328.00	0.02
390	000967	盈峰环境	6,800	46,716.00	0.02
391	000758	中色股份	9,800	46,550.00	0.02
392	002155	湖南黄金	6,000	46,500.00	0.02
393	002038	双鹭药业	4,400	46,332.00	0.02
394	002936	郑州银行	12,600	46,242.00	0.02
395	600056	中国医药	3,800	46,170.00	0.02
396	600582	天地科技	11,800	46,020.00	0.02
397	601608	中信重工	12,300	46,002.00	0.02
398	603228	景旺电子	1,748	45,797.60	0.02
399	000563	陕国投 A	14,200	45,724.00	0.02
400	600266	城建发展	9,604	45,522.96	0.02
401	000681	视觉中国	3,500	45,255.00	0.02
402	600388	龙净环保	5,300	45,156.00	0.02
403	600131	国网信通	3,400	45,016.00	0.02
404	601098	中南传媒	5,100	44,982.00	0.02
405	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.02
406	600901	江苏租赁	8,600	44,720.00	0.02
407	601958	金钼股份	6,900	44,712.00	0.02
408	600095	湘财股份	3,800	44,498.00	0.02
409	300113	顺网科技	3,400	43,996.00	0.02
410	600959	江苏有线	14,300	43,615.00	0.02
411	300180	华峰超纤	8,800	43,560.00	0.02
412	002416	爱施德	4,340	43,530.20	0.02
413	600062	华润双鹤	3,640	43,352.40	0.02
414	003022	联泓新科	1,400	42,980.00	0.02
415	600094	大名城	11,400	42,978.00	0.02
416	600649	城投控股	9,000	42,840.00	0.02
417	600764	中国海防	1,500	42,450.00	0.02
418	600006	东风汽车	5,700	41,610.00	0.02

419	002399	海普瑞	2,600	41,418.00	0.02
420	601611	中国核建	5,700	41,154.00	0.02
421	300741	华宝股份	800	40,576.00	0.02
422	600259	广晟有色	1,200	40,572.00	0.02
423	600717	天津港	10,320	40,454.40	0.02
424	300257	开山股份	2,800	40,236.00	0.02
425	600556	天下秀	3,800	40,128.00	0.02
426	002317	众生药业	4,600	39,606.00	0.02
427	600633	浙数文化	5,500	39,490.00	0.02
428	000717	韶钢松山	8,600	39,474.00	0.02
429	002434	万里扬	4,800	38,928.00	0.02
430	600863	内蒙华电	16,700	38,911.00	0.02
431	600021	上海电力	5,600	38,696.00	0.02
432	000501	鄂武商 A	3,300	38,610.00	0.02
433	601928	凤凰传媒	5,400	38,556.00	0.02
434	000078	海王生物	11,800	38,468.00	0.02
435	600729	重庆百货	1,400	38,430.00	0.02
436	600648	外高桥	2,600	38,428.00	0.02
437	688659	元琛科技	3,671	38,398.66	0.02
438	000028	国药一致	1,000	37,840.00	0.02
439	600968	海油发展	14,500	37,555.00	0.02
440	600835	上海机电	2,300	37,375.00	0.02
441	002244	滨江集团	8,900	37,291.00	0.02
442	601828	美凯龙	3,100	37,200.00	0.02
443	002424	贵州百灵	5,000	36,800.00	0.02
444	300957	贝泰妮	144	36,282.24	0.01
445	000062	深圳华强	2,135	36,102.85	0.01
446	603355	莱克电气	570	35,471.10	0.01
447	600623	华谊集团	4,000	35,240.00	0.01
448	688681	科汇股份	1,899	34,903.62	0.01
449	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01
450	605358	立昂微	300	34,674.00	0.01
451	688517	金冠电气	2,892	34,356.96	0.01
452	600377	宁沪高速	3,500	34,160.00	0.01
453	600339	中油工程	12,000	34,080.00	0.01
454	600566	济川药业	1,900	34,010.00	0.01
455	600312	平高电气	5,800	33,872.00	0.01
456	002468	申通快递	4,400	33,528.00	0.01
457	000869	张裕 A	900	33,426.00	0.01
458	600787	中储股份	6,208	33,088.64	0.01
459	000031	大悦城	9,100	32,760.00	0.01
460	002583	海能达	6,500	32,760.00	0.01



461	600639	浦东金桥	2,400	32,760.00	0.01
462	000826	启迪环境	6,100	32,635.00	0.01
463	601969	海南矿业	2,800	32,564.00	0.01
464	600823	世茂股份	8,000	32,320.00	0.01
465	002815	崇达技术	2,500	31,200.00	0.01
466	601298	青岛港	5,000	30,900.00	0.01
467	603317	天味食品	1,044	30,724.92	0.01
468	000156	华数传媒	3,900	30,069.00	0.01
469	603888	新华网	1,400	29,638.00	0.01
470	000937	冀中能源	7,500	29,475.00	0.01
471	002635	安洁科技	2,000	29,260.00	0.01
472	000553	安道麦 A	3,100	28,737.00	0.01
473	000813	德展健康	6,300	28,602.00	0.01
474	300010	豆神教育	5,000	28,350.00	0.01
475	603515	欧普照明	1,080	27,723.60	0.01
476	600350	山东高速	4,500	27,675.00	0.01
477	601228	广州港	8,700	27,666.00	0.01
478	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01
479	001872	招商港口	1,600	27,072.00	0.01
480	603377	东方时尚	2,520	26,938.80	0.01
481	601139	深圳燃气	4,100	26,896.00	0.01
482	000061	农产品	4,800	26,496.00	0.01
483	000046	泛海控股	11,100	25,530.00	0.01
484	300979	华利集团	273	23,887.50	0.01
485	002653	海思科	1,100	23,672.00	0.01
486	300973	立高食品	198	22,910.58	0.01
487	603786	科博达	300	22,650.00	0.01
488	002419	天虹股份	3,400	22,304.00	0.01
489	002901	大博医疗	300	21,867.00	0.01
490	600657	信达地产	6,000	20,880.00	0.01
491	000537	广宇发展	3,900	20,397.00	0.01
492	601003	柳钢股份	3,400	20,060.00	0.01
493	601801	皖新传媒	4,200	19,824.00	0.01
494	301009	可靠股份	665	18,546.85	0.01
495	002946	新乳业	1,200	18,180.00	0.01
496	603719	良品铺子	400	18,000.00	0.01
497	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.01
498	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.01
499	300981	中红医疗	181	16,360.59	0.01
500	603983	丸美股份	300	15,633.00	0.01
501	300932	三友联众	492	15,601.32	0.01
502	300941	创识科技	305	15,231.70	0.01

503	000732	泰禾集团	7,000	15,120.00	0.01
504	600903	贵州燃气	1,600	14,720.00	0.01
505	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.01
506	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.01
507	300940	南极光	307	13,317.66	0.01
508	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.01
509	300937	药易购	244	13,105.24	0.01
510	002818	富森美	1,060	12,783.60	0.01
511	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.01
512	603868	飞科电器	300	12,618.00	0.01
513	603171	税友股份	637	12,230.40	0.01
514	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
515	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
516	300968	格林精密	940	11,345.80	0.00
517	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
518	603256	宏和科技	1,200	10,968.00	0.00
519	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
520	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
521	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
522	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
523	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
524	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
525	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
526	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
527	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
528	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
529	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
530	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
531	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
532	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
533	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
534	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
535	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
536	601068	中铝国际	2,200	7,590.00	0.00
537	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
538	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
539	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
540	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
541	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
542	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
543	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
544	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00

545	300985	致远新能	227	5,631.87	0.00
546	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
547	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
548	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
549	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
550	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
551	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
552	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
553	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
554	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
555	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00
556	600058	五矿发展	1	7.88	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	688099	晶晨股份	10,564,997.68	3.27
2	300274	阳光电源	9,473,160.30	2.93
3	300072	三聚环保	7,191,303.48	2.23
4	002709	天赐材料	5,850,705.45	1.81
5	002568	百润股份	5,783,541.00	1.79
6	300595	欧普康视	5,355,090.71	1.66
7	601988	中国银行	5,170,813.00	1.60
8	601398	工商银行	5,163,210.84	1.60
9	601288	农业银行	5,120,000.00	1.59
10	601939	建设银行	5,002,500.00	1.55
11	603650	彤程新材	4,564,503.40	1.41
12	600171	上海贝岭	4,552,664.00	1.41
13	600885	宏发股份	4,263,614.00	1.32
14	600392	盛和资源	3,969,673.00	1.23
15	002791	坚朗五金	3,873,286.17	1.20
16	600905	三峡能源	3,436,527.95	1.06
17	600549	厦门钨业	2,939,096.02	0.91
18	603486	科沃斯	2,699,322.00	0.84
19	603568	伟明环保	2,612,474.25	0.81
20	600216	浙江医药	2,564,881.00	0.79

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	300274	阳光电源	11,960,599.00	3.70
2	002709	天赐材料	11,342,422.00	3.51
3	300595	欧普康视	8,656,925.00	2.68
4	002030	达安基因	7,957,246.50	2.46
5	688099	晶晨股份	7,149,954.81	2.21
6	689009	九号公司-WD	7,007,110.00	2.17
7	002925	盈趣科技	6,773,857.00	2.10
8	300558	贝达药业	5,868,636.00	1.82
9	002028	思源电气	5,773,921.73	1.79
10	601398	工商银行	5,284,320.00	1.64
11	601288	农业银行	5,256,000.00	1.63
12	601939	建设银行	5,243,555.00	1.62
13	601988	中国银行	5,224,000.00	1.62
14	600171	上海贝岭	5,147,969.00	1.59
15	002568	百润股份	5,107,550.00	1.58
16	300271	华宇软件	4,980,612.00	1.54
17	002690	美亚光电	4,793,661.02	1.48
18	603515	欧普照明	4,661,128.60	1.44
19	600166	福田汽车	4,555,004.39	1.41
20	002407	多氟多	4,317,349.65	1.34

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	197,902,931.87
卖出股票收入（成交）总额	289,270,631.68

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	22,000,000.00	9.03
2	央行票据	-	-
3	金融债券	60,400,000.00	24.78
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	39,881,000.00	16.36
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	44,601.28	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	122,325,601.28	50.19
----	----	----------------	-------

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019640	20 国债 10	220,000	22,000,000.00	9.03
2	163711	20 信投 G4	200,000	20,154,000.00	8.27
3	163731	20 光证 G3	200,000	20,136,000.00	8.26
4	163759	20 平证 03	200,000	20,110,000.00	8.25
5	163279	20 电控 01	200,000	20,010,000.00	8.21

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：无。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：无。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：无。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：无。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

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

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：无。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

无。

### 7.12 投资组合报告附注

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

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

#### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券备选库

#### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	78,730.22
2	应收证券清算款	415,613.62
3	应收股利	-
4	应收利息	2,372,566.16
5	应收申购款	130,075.47
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,996,985.47

#### 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

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	600905	三峡能源	5,147,016.21	2.11	锁定期股票

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比 例 (%)	持有份额	占总份额比 例 (%)
519	249,163.78	111,599,209.13	86.30	17,716,791.91	13.70

### 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	869,961.05	0.6727

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、基金投资和研发部门负责人及本基金的基金经理未持有本基金份额。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2018 年 5 月 30 日) 基金份额总额	214,008,175.33
本报告期期初基金份额总额	195,516,972.96
本报告期基金总申购份额	6,429,552.56
减：本报告期基金总赎回份额	72,630,524.48
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	129,316,001.04

## § 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。

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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	
平安证券	1	185,087,763.84	38.81%	168,672.02	40.40%	-
国信证券	2	90,906,947.52	19.06%	73,754.19	17.67%	-
招商证券	1	78,951,012.71	16.55%	71,947.07	17.23%	-
国盛证券	2	60,647,372.69	12.72%	49,344.24	11.82%	-
海通证券	1	17,963,447.70	3.77%	14,573.81	3.49%	-
东方证券	2	15,806,190.19	3.31%	14,404.50	3.45%	本报告期新增 1 个
东北证券	1	10,822,584.40	2.27%	9,862.52	2.36%	-



安信证券	2	10,079,354.81	2.11%	9,185.41	2.20%	-
天风证券	2	4,004,120.02	0.84%	3,302.75	0.79%	-
浙商证券	1	2,061,618.78	0.43%	1,878.81	0.45%	-
中泰证券	2	633,163.86	0.13%	576.97	0.14%	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
东方财富证 券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	本报 告期 新增
方正证券	2	-	-	-	-	本报 告期 新增 1 个
光大证券	1	-	-	-	-	本报 告期 新增
广发证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	本报 告期 新增
中信建投证 券	1	-	-	-	-	-

中原证券	1	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---

注：交易单元选择的标准和程序：

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

- (1) 实力雄厚，信誉良好，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、及时性以及提供研究服务主动性和质量等情况，并依据评比结果确定交易单元交易的具体情况。我公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向券商租用交易单元作为基金专用交易单元。

## 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
平安证券	-	-	10,800,000.00	0.15%	-	-
国信证券	-	-	388,300,000.00	5.34%	-	-
招商证券	50,251,736.00	71.48%	3,493,300,000.00	48.05%	-	-
国盛证券	-	-	1,458,200,000.00	20.06%	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	127,000,000.00	1.75%	-	-
东北证券	158,648.00	0.23%	682,100,000.00	9.38%	-	-
安信证券	-	-	10,500,000.00	0.14%	-	-

天风证券	-	-	572,600,000.00	7.88%	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	19,896,200.00	28.30%	528,000,000.00	7.26%	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
东方财富 证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中信建投 证券	-	-	-	-	-	-
中原证券	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	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	鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金 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
5	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
6	鹏华基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会	2021年01月28日

		基金电子披露网站	
7	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
8	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
9	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
10	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
11	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
12	鹏华基金管理有限公司关于在直销柜台渠道开展旗下部分开放式证券投资基金转换转出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 11 日
13	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
14	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
15	鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金 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
16	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
17	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
18	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
19	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
20	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分	《中国证券报》、基金管	2021 年 04 月 19 日

	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	理人网站及中国证监会 基金电子披露网站	
21	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
22	鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金 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
23	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
24	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
25	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
26	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
27	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与宁波银行股份有限公司申购（不含定期定额投资）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 30 日
28	鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金更新的招募说明书	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会 基金电子披露网站	2021 年 05 月 14 日
29	鹏华睿投灵活配置混合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 05 月 14 日
30	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
31	鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金基金合同	《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 25 日
32	鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金托管协议	《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 25 日
33	鹏华基金管理有限公司关于修订旗下部分公募基金基金合同和托管协议的公告	《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 25 日

34	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(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 05 月 28 日
35	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 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