

# 鹏华优质企业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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通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                         | 7         |
| 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              | 10        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 11        |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明             | 11        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 12        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 12        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 13        |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明       | 13        |
| <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 | 13        |
| 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       | 13        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>              | <b>13</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 13        |
| 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                                | 17        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b>                       | <b>43</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 43        |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 43        |
| 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       | 44        |
| 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        |
| <b>§ 8 基金份额持有人信息.....</b>                   | <b>51</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 51        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 51        |
| 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 .....      | 51        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动.....</b>                   | <b>51</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>                    | <b>52</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 52        |
| 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 .....      | 52        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 52        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                        | 52        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 52        |
| 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 .....         | 52        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 52        |
| 10.8 其他重大事件 .....                           | 54        |
| <b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>            | <b>56</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 .....    | 56        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                   | 56        |
| <b>§ 12 备查文件目录 .....</b>                    | <b>57</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                           | 57        |
| 12.2 存放地点 .....                             | 57        |
| 12.3 查阅方式 .....                             | 57        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                  |
|------------|------------------|
| 基金名称       | 鹏华优质企业混合型证券投资基金  |
| 基金简称       | 鹏华优质企业混合         |
| 基金主代码      | 009234           |
| 基金运作方式     | 契约型开放式           |
| 基金合同生效日    | 2020 年 6 月 11 日  |
| 基金管理人      | 鹏华基金管理有限公司       |
| 基金托管人      | 交通银行股份有限公司       |
| 报告期末基金份额总额 | 509,409,733.90 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 | 在严格控制风险的前提下，本基金通过对不同资产类别的动态配置和优质企业的个股精选，力争实现基金资产的长期稳定增值。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 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 本基金所称的优质企业通常具备两方面的特征。第一，优质行业，即企业所处的行业成长确定性较强或发展潜力较高；第二，优质公司，是指企业具备区别于对手的竞争优势、其提供的产品或服务具备良好的应用场景、企业盈利质量优于多数同类企业、现金流及财务状况良好等。</p> <p>（1）自上而下的行业遴选 优质企业所处行业的发展阶段及未来发展空间，将决定该企业未来发展的空间和方向，行业处于确定性成长期及具备较强的发展潜力是优质企业所需具备的行业品质。本基金将在考虑行业生命周期、宏观经济周期不同阶段的行业景气程度以及资本市场行业轮动规律的基础上，结合当前中国经济和资本市场特征，自上而下地进行行业遴选，重点关注行业增长与行业利润等方面具有长期增长潜力的行业。对行业增长方面，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；对行业利润方面，主要分析行业结构，尤其是业内竞争的方式、业内竞争的激烈程度、行业议价能力等对利润影响较大的因素。同时，本基金将根据市场环境的变化，及时对行业配置进行动态调整。</p> <p>（2）自下而上的个股选择 本基金将在行业选择的基础上，充分发挥基金管理人研究团队“自下而上”的主动选股能力，通过定性及定量的方法，对企业进行全面深入的研究、精选具备核心优势且成长性良好的优质企业进行投资，并根据市场波动情况进行动态调整。</p> <p>1） 定性分析 治理结构良</p> |

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
|--------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|        | <p>好、经营管理能力突出。具体体现在：管理层是否专业、正直、诚实和勤奋；公司治理结构是否完善、信息是否透明；公司的战略规划是否理性、符合公司长远利益；公司组织能力是否高效；公司业务流程是否规范等。公司在行业内具备区别于竞争对手的优势。企业的竞争优势一般是指在产品定价能力、技术创新、品牌价值、销售渠道、服务品质、市场占有率等方面具备一个或多个方面的突出优势，这使得公司在所处行业中具备较强的核心竞争力。这类公司在经济增长时能创造持续性的成长，经济不振时亦能度过难关，享有高于行业长期平均水平的盈利能力。公司提供的产品或服务具备持续应用的场景。为客户创造价值是公司提供产品或服务的目的，是公司实现自身价值的工具，而实现的载体即为不同的应用场景。我们将评估新进入者的威胁、替代品的威胁，考察公司提供产品或服务的场景是否具备持续型。</p> <p>2) 定量分析 盈利水平较高，公司能够为股东创造可观的回报。ROE 反映的是单位权益资本产出的利润回报，较高的 ROE 水平往往伴随着较高的利润率或者高速的资产周转，体现了企业通过实体经营创造财富的优秀能力。具体而言，我们要求备选投资企业拥有较高的加权摊薄 ROE，同时，也将重点考察主营业务收入、盈利波动程度等指标。现金流情况良好，财务状况稳健。优质企业往往能够通过产生充沛自由的现金流，实现公司净资产的增厚，并伴随复利效应，股东权益规模持续扩大。具体的，我们要求备选投资企业的年度经营性现金流净额必须为正，且保持较为合理的资产负债水平。估值水平合理。本基金考察企业贴现现金流以及内在价值贴现，结合市盈率（市值/净利润）、市净率（市值/净资产）、市销率（市值/营业收入）等指标衡量股价是否处于合理的估值区间，并且基于公司所属的不同行业，采取不同的估值方法，以此寻找不同行业股票的合理价格区间，并进行动态调整。本基金投资港股通标的股票时，除了适用上述个股投资策略外，本基金还将关注：1) 具有行业稀缺性的香港本地和外资公司；2) 在港股市场上市、具有行业代表性的优质中资公司；3) 港股市场在行业结构、估值、AH 股折溢价、分红率等方面具有吸引力的投资标的。</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、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>5、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%+恒生指数收益率×10%（经汇率估值调                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |

|        |                                                                                                           |
|--------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|        | 整)+中证综合债指数收益率×30%                                                                                         |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型证券投资基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金将投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。 |

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                     | 交通银行股份有限公司              |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 张戈                             | 陆志俊                     |
|             | 联系电话 | 0755-82825720                  | 95559                   |
|             | 电子邮箱 | zhangge@phfund.com.cn          | luzj@bankcomm.com       |
| 客户服务电话      |      | 4006788999                     | 95559                   |
| 传真          |      | 0755-82021126                  | 021-62701216            |
| 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 | 中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 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 | 中国（上海）长宁区仙霞路 18 号       |
| 邮政编码        |      | 518048                         | 200336                  |
| 法定代表人       |      | 何如                             | 任德奇                     |

## 2.4 信息披露方式

|                     |                                                                 |
|---------------------|-----------------------------------------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 《证券时报》                                                          |
| 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       | 219,186,643.76                      |
| 本期利润          | -19,474,586.00                      |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.0300                             |
| 本期加权平均净值利润率   | -2.06%                              |
| 本期基金份额净值增长率   | -3.24%                              |

| 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      | 204,769,798.75        |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.4020                |
| 期末基金资产净值      | 714,179,532.65        |
| 期末基金份额净值      | 1.4020                |
| 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   | 40.20%                |

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

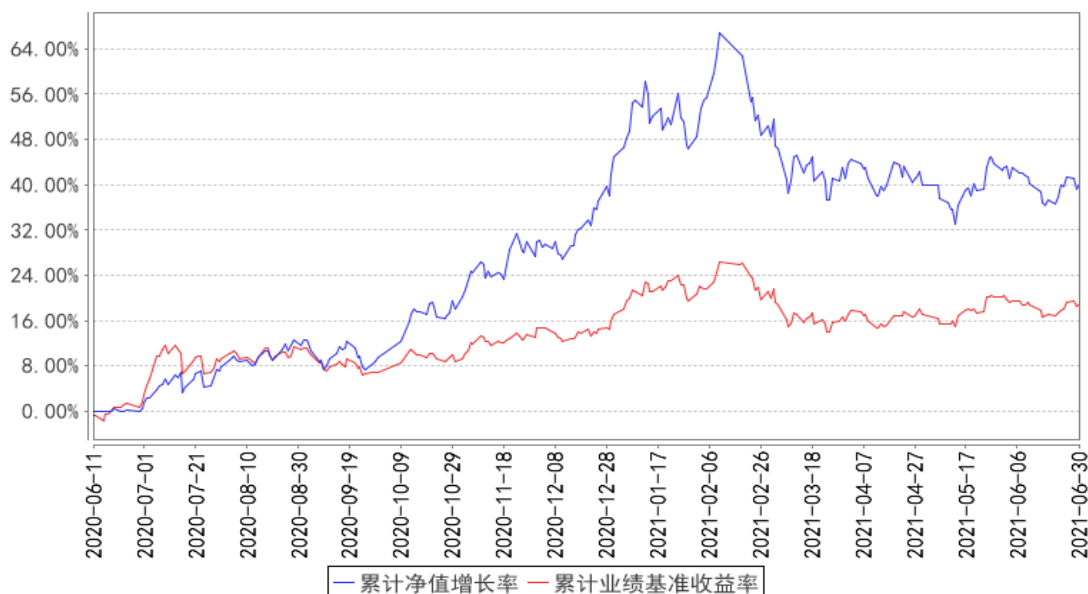
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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      | -1.72%   | 0.89%       | -1.12%     | 0.53%         | -0.60% | 0.36% |
| 过去三个月      | -0.68%   | 1.16%       | 2.52%      | 0.64%         | -3.20% | 0.52% |
| 过去六个月      | -3.24%   | 1.61%       | 1.52%      | 0.86%         | -4.76% | 0.75% |
| 过去一年       | 39.75%   | 1.40%       | 17.02%     | 0.87%         | 22.73% | 0.53% |
| 自基金合同生效起至今 | 40.20%   | 1.37%       | 18.92%     | 0.86%         | 21.28% | 0.51% |

注：业绩比较基准=沪深 300 指数收益率×60%+恒生指数收益率×10%（经汇率估值调整）+中证综合债指数收益率×30%

### 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

鹏华优质企业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 2020 年 06 月 11 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 | 2020-06-11 | - | 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未发生变动。 |
|----|------|------------|---|------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

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

2. 证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

#### 4.2 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，因市场波动等被动原因存在本基金投资比例不符合基金合同要求的情形，本基金管理人严格按照基金合同的约定及时

进行了调整，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

上半年，A 股市场总体仍呈现上涨态势，但波动有所加大，主要指数间出现明显分化，创业板、科创板的表现优于沪深 300 以及上证 50。

组合坚持了过往的选股标准，聚焦公司的品质，聚焦公司业绩的增长和质量，聚焦公司的估值，组合构建的目标是在中长期获得可观的绝对收益，在制定决策中，也更多基于中长期的成长价值和安全边际，而并非基于短期的资金偏好和业绩波动。目前组合持仓集中在消费品、制造业以及金融这三大领域，持有的企业在其所处行业内普遍具备显著的竞争优势。

聚焦公司品质和业绩增长的重要性在市场上已经形成了一定的共识，但在聚焦估值的重要性方面却存在较大分歧。估值因子重要么？我们的看法是，估值因子，在短期未必重要，但中长期必将发挥威力。

估值因子对于短期股价涨跌的解释力极为有限，部份极度低估的资产在短期内可能变得更低，这种情况在 2008 年四季度曾经出现过，部份极度高估的资产在短期内也可能变得更高，这种情况在 2015 年二季度也曾经出现过，股价的短期涨跌像商品一样更取决于背后的供给与需求，股价的短期涨跌也更容易受到资金的影响。

如果立足中长期，估值因子是不应该被忽视的，资金供需的短期影响会在中长期显著降低，企业内在价值的重要性显著提升。一笔股票投资的中长期回报水平，受到两个因素的重要影响：一是标的资产的业绩增长空间，二是买入资产时的成本。标的资产收入利润持续提升，是推动企业内在价值提升的重要途径，也是股价上行的重要推力。买入时成本较低，意味着为获取内在价值支付了较低的兑价水平，也意味着获取了重要的安全边际，有助于在中长期降低风险、提升回报水

平。

未来，我们仍将延续偏重中长期价值的投资体系，通过持有具备安全边际的优质资产，实现组合构建的目标，为投资者创造长期回报，不负投资者的信任和委托。

#### 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-3.24%，同期业绩比较基准增长率为 1.52%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

政策方面，中国的政策取向强调稳定，下半年仍将保持韧性和延续性；和海外主要经济体相比，中国的货币政策具备更为灵活的实施空间，原因是中国本轮的流动性释放较为克制，没有采取大水漫灌的方式应对疫情。

企业盈利方面，下半年 A 股的整体盈利增长速度将会有所放缓，2021 年全年 A 股盈利增速呈现前高后低的趋势；局部赛道和公司，将体现出结构性的业绩加速增长。

资金方面，居民财富借道公募基金进入资本市场，趋势仍将在中长期延续，金融资产在居民财富中的配置比例将继续提升。

总体而言，判断下半年市场以结构性机会为主。从政策、企业盈利、资金以及估值这四大方面来看，政策稳字为先、保持韧性，财富资金进入股市，为市场提供了支撑；但内需转弱、企业盈利增速放缓，部份企业估值高企，也制约了市场的大幅上涨。

#### 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 204,769,798.75 元，期末基金份额净值 1.4020 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

本报告期内，基金托管人在鹏华优质企业混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

#### 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

本报告期内，鹏华基金管理有限公司在鹏华优质企业混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

#### 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

本报告期内，由鹏华基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关鹏华优质企业混合型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

### § 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：鹏华优质企业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<br>2021 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|-------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资 产：  |         |                        |                          |
| 银行存款  | 6.4.7.1 | 65,123,080.63          | 91,463,487.99            |
| 结算备付金 |         | —                      | 49,280.39                |

|                 |            |                                |                                  |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 存出保证金           |            | 2,041,557.51                   | 1,092,693.84                     |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 651,464,780.60                 | 1,097,412,772.21                 |
| 其中：股票投资         |            | 651,464,780.60                 | 1,097,412,772.21                 |
| 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         |            | 4,143,144.72                   | 3,463,963.48                     |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 12,712.35                      | 12,707.84                        |
| 应收股利            |            | 997,248.00                     | -                                |
| 应收申购款           |            | 1,871,337.20                   | 4,473,361.37                     |
| 递延所得税资产         |            | -                              | -                                |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                              | -                                |
| 资产总计            |            | 725,653,861.01                 | 1,197,968,267.12                 |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2021 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2020 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负 债：</b>     |            |                                |                                  |
| 短期借款            |            | -                              | -                                |
| 交易性金融负债         |            | -                              | -                                |
| 衍生金融负债          | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 卖出回购金融资产款       |            | -                              | -                                |
| 应付证券清算款         |            | -                              | -                                |
| 应付赎回款           |            | 9,998,388.23                   | 15,035,869.11                    |
| 应付管理人报酬         |            | 936,207.91                     | 1,422,993.19                     |
| 应付托管费           |            | 156,034.62                     | 237,165.52                       |
| 应付销售服务费         |            | -                              | -                                |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 253,079.60                     | 562,965.74                       |
| 应交税费            |            | -                              | -                                |
| 应付利息            |            | -                              | -                                |
| 应付利润            |            | -                              | -                                |
| 递延所得税负债         |            | -                              | -                                |
| 其他负债            | 6.4.7.8    | 130,618.00                     | 142,131.78                       |
| 负债合计            |            | 11,474,328.36                  | 17,401,125.34                    |
| <b>所有者权益：</b>   |            |                                |                                  |
| 实收基金            | 6.4.7.9    | 509,409,733.90                 | 814,800,631.92                   |
| 未分配利润           | 6.4.7.10   | 204,769,798.75                 | 365,766,509.86                   |
| 所有者权益合计         |            | 714,179,532.65                 | 1,180,567,141.78                 |
| 负债和所有者权益总计      |            | 725,653,861.01                 | 1,197,968,267.12                 |

注： 报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.4020 元，基金份额总额 509,409,733.90 份。

## 6.2 利润表

会计主体：鹏华优质企业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<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 6 月 11 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日 |
|------------------------|------------|---------------------------------------|------------------------------------------------------|
| 一、收入                   |            | -9,331,408.79                         | 7,852,959.93                                         |
| 1. 利息收入                |            | 277,528.48                            | 929,834.86                                           |
| 其中：存款利息收入              | 6.4.7.11   | 277,528.48                            | 408,354.65                                           |
| 债券利息收入                 |            | -                                     | -                                                    |
| 资产支持证券利息收入             |            | -                                     | -                                                    |
| 买入返售金融资产收入             |            | -                                     | 521,480.21                                           |
| 证券出借利息收入               |            | -                                     | -                                                    |
| 其他利息收入                 |            | -                                     | -                                                    |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      |            | 225,946,322.76                        | 997,752.50                                           |
| 其中：股票投资收益              | 6.4.7.12   | 217,539,172.15                        | -                                                    |
| 基金投资收益                 | -          | -                                     | -                                                    |
| 债券投资收益                 | 6.4.7.13   | -                                     | -                                                    |
| 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   | 8,407,150.61                          | 997,752.50                                           |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17   | -238,661,229.76                       | 5,925,372.57                                         |
| 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   | 3,105,969.73                          | -                                                    |
| 减：二、费用                 |            | 10,143,177.21                         | 2,203,556.36                                         |
| 1. 管理人报酬               | 6.4.10.2.1 | 7,083,908.04                          | 1,371,650.10                                         |
| 2. 托管费                 | 6.4.10.2.2 | 1,180,651.33                          | 228,608.34                                           |
| 3. 销售服务费               | 6.4.10.2.3 | -                                     | -                                                    |
| 4. 交易费用                | 6.4.7.19   | 1,749,549.10                          | 593,493.92                                           |
| 5. 利息支出                |            | -                                     | -                                                    |
| 其中：卖出回购金融资产支出          |            | -                                     | -                                                    |
| 6. 税金及附加               |            | -                                     | -                                                    |

|                     |          |                |              |
|---------------------|----------|----------------|--------------|
| 7. 其他费用             | 6.4.7.20 | 129,068.74     | 9,804.00     |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） |          | -19,474,586.00 | 5,649,403.57 |
| 减：所得税费用             |          | -              | -            |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   |          | -19,474,586.00 | 5,649,403.57 |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鹏华优质企业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<br>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）                        | 814,800,631.92                                       | 365,766,509.86  | 1,180,567,141.78  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                                    | -19,474,586.00  | -19,474,586.00    |
| 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）      | -305,390,898.02                                      | -141,522,125.11 | -446,913,023.13   |
| 其中：1. 基金申购款                            | 404,815,356.73                                       | 202,308,755.34  | 607,124,112.07    |
| 2. 基金赎回款                               | -710,206,254.75                                      | -343,830,880.45 | -1,054,037,135.20 |
| 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）                        | 509,409,733.90                                       | 204,769,798.75  | 714,179,532.65    |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2020 年 6 月 11 日（基金合同生效日）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）                        | 1,760,003,108.04                                     | -               | 1,760,003,108.04  |

|                                        |                  |              |                  |
|----------------------------------------|------------------|--------------|------------------|
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                | 5,649,403.57 | 5,649,403.57     |
| 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）      | -                | -            | -                |
| 其中：1. 基金申购款                            | -                | -            | -                |
| 2. 基金赎回款                               | -                | -            | -                |
| 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）                        | 1,760,003,108.04 | 5,649,403.57 | 1,765,652,511.61 |

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

鹏华优质企业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[2020]382号《关于准予鹏华优质企业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》和《鹏华优质企业混合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1,759,366,042.99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(2020)第0497号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华优质企业混合型证券投资基金基金合同》于2020年6月11日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,760,003,108.04份基金份额,其中认购资金利息折合637,065.05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,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华优质企业混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括境内依法发行的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（含国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券）、债券回购、银行存款、货币市场工具、同业存单、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）。本基金的投资组合中股票资产占基金资产的比例为 60%-95%（其中投资于港股通标的股票占股票资产的比例不超过 50%）；投资于优质企业相关证券不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终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。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×60%+恒生指数收益率×10%（经汇率估值调整）+中证综合债指数收益率×30%。

#### 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》、《鹏华优质企业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[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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<br>2021 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 65,123,080.63          |
| 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             | 65,123,080.63          |

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |                |                |
|---------------|------------------------|----------------|----------------|
|               | 成本                     | 公允价值           | 公允价值变动         |
| 股票            | 529,969,911.36         | 651,464,780.60 | 121,494,869.24 |
| 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     |    | 529,969,911.36 | 651,464,780.60 | 121,494,869.24 |

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<br>2021 年 6 月 30 日 |
|------------|------------------------|
| 应收活期存款利息   | 12,644.49              |
| 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  | -                      |
| 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         | 67.86                  |
| 合计         | 12,712.35              |

#### 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<br>2021 年 6 月 30 日 |
|----|------------------------|
|----|------------------------|

|             |            |
|-------------|------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 253,079.60 |
| 银行间市场应付交易费用 | -          |
| 合计          | 253,079.60 |

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                      |
| 应付赎回费       | 21,522.06              |
| 应付证券出借违约金   | -                      |
| 预提费用        | 109,095.94             |
| 合计          | 130,618.00             |

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>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          | 814,800,631.92                        | 814,800,631.92  |
| 本期申购          | 404,815,356.73                        | 404,815,356.73  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -710,206,254.75                       | -710,206,254.75 |
| - 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           | 509,409,733.90                        | 509,409,733.90  |

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           | 121,395,857.33  | 244,370,652.53  | 365,766,509.86  |
| 本期利润           | 219,186,643.76  | -238,661,229.76 | -19,474,586.00  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -95,970,280.10  | -45,551,845.01  | -141,522,125.11 |
| 其中：基金申购款       | 102,085,646.74  | 100,223,108.60  | 202,308,755.34  |
| 基金赎回款          | -198,055,926.84 | -145,774,953.61 | -343,830,880.45 |
| 本期已分配利润        | -               | -               | -               |
| 本期末            | 244,612,220.99  | -39,842,422.24  | 204,769,798.75  |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目       | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入 | 263,050.59                            |

|           |            |
|-----------|------------|
| 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 | 11,562.52  |
| 其他        | 2,915.37   |
| 合计        | 277,528.48 |

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<br>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 | 217,539,172.15             |
| 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               | 217,539,172.15             |

##### 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<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 695,975,753.75             |
| 减：卖出股票成本总额 | 478,436,581.60             |
| 买卖股票差价收入   | 217,539,172.15             |

##### 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<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|----|---------------------------------------|
|----|---------------------------------------|

|               |              |
|---------------|--------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 8,407,150.61 |
| 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            | 8,407,150.61 |

## 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|------------------------|---------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产             | -238,661,229.76                       |
| 股票投资                   | -238,661,229.76                       |
| 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                     | -238,661,229.76                       |

## 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 3,079,452.71                          |
| 基金转换费收入 | 26,517.02                             |
| 合计      | 3,105,969.73                          |

## 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 1,749,549.10                          |
| 银行间市场交易费用 | —                                     |
| 合计        | 1,749,549.10                          |

## 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目    | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|-------|---------------------------------------|
| 审计费用  | 49,588.57                             |
| 信息披露费 | 59,507.37                             |

|         |            |
|---------|------------|
| 证券出借违约金 | -          |
| 银行汇划费用  | 10,972.80  |
| 账户维护费   | 9,000.00   |
| 合计      | 129,068.74 |

#### 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 |
| 交通银行股份有限公司（“交通银行”）   | 基金托管人、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

本基金基金合同于 2020 年 06 月 11 日生效，截至本报告期末不满一年，无上年度可比期间数据。

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

注：无。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

注：无。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

## 6.4.10.1.4 权证交易

注：无。

## 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：无。

## 6.4.10.2 关联方报酬

## 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 6 月 11 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日 |
|-----------------|---------------------------------------|------------------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 7,083,908.04                          | 1,371,650.10                                         |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 2,849,586.67                          | 650,476.40                                           |

注：1、支付基金管理人鹏华基金管理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<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 6 月 11 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日 |
|----------------|---------------------------------------|------------------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,180,651.33                          | 228,608.34                                           |

注：支付基金托管人交通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固有资金投资本基金的情况

注：无。

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |            | 上年度可比期间<br>2020 年 6 月 11 日（基金合同生效日）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     |
| 交通银行  | 65,123,080.63                         | 263,036.51 | 552,352,758.52                                       | 408,354.65 |

#### 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<br>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                                  | 688323 | 瑞华泰  | 网下申购 | 4,513     | 26,942.61  |
| 国信证券                                  | 300957 | 贝泰妮  | 网下申购 | 5,772     | 273,188.76 |
| 国信证券                                  | 300986 | 志特新材 | 网下申购 | 2,632     | 38,927.28  |

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<br>(单位：股) | 期末成本总额        | 期末估值总额        | 备注 |
| 000951               | 中国重汽 | 2021 年 3 月 12 日  | 2021 年 9 月 15 日  | 锁定期股票  | 29.82 | 26.27  | 838,363      | 24,999,984.66 | 22,023,796.01 | -  |
| 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 | 610          | 15,006.00     | 99,430.00     | -  |
| 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 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  | 399          | 8,502.69      | 19,926.06     | -  |
| 300942               | 易瑞   | 2021             | 2021             | 锁定     | 5.31  | 28.52  | 443          | 2,352.33      | 12,634.36     | -  |

|        |      |                       |                           |               |       |        |     |           |            |   |
|--------|------|-----------------------|---------------------------|---------------|-------|--------|-----|-----------|------------|---|
|        | 生物   | 年 2 月<br>2 日          | 年 8 月<br>9 日              | 期股<br>票       |       |        |     |           |            |   |
| 300943 | 春晖智控 | 2021<br>年 2 月<br>3 日  | 2021<br>年 8 月<br>10 日     | 锁定<br>期股<br>票 | 9.79  | 23.01  | 255 | 2,496.45  | 5,867.55   | - |
| 300945 | 曼卡龙  | 2021<br>年 2 月<br>3 日  | 2021<br>年 8 月<br>10 日     | 锁定<br>期股<br>票 | 4.56  | 18.88  | 474 | 2,161.44  | 8,949.12   | - |
| 300948 | 冠中生态 | 2021<br>年 2 月<br>18 日 | 2021<br>年 8 月<br>25 日     | 锁定<br>期股<br>票 | 13.00 | 27.42  | 324 | 2,808.00  | 8,884.08   | - |
| 300950 | 德固特  | 2021<br>年 2 月<br>24 日 | 2021<br>年 9 月<br>3 日      | 锁定<br>期股<br>票 | 8.41  | 39.13  | 219 | 1,841.79  | 8,569.47   | - |
| 300952 | 恒辉安防 | 2021<br>年 3 月<br>3 日  | 2021<br>年 9 月<br>13 日     | 锁定<br>期股<br>票 | 11.72 | 27.08  | 340 | 3,984.80  | 9,207.20   | - |
| 300957 | 贝泰妮  | 2021<br>年 3 月<br>18 日 | 2021<br>年 9 月<br>27 日     | 锁定<br>期股<br>票 | 47.33 | 251.96 | 578 | 27,356.74 | 145,632.88 | - |
| 300958 | 建工修复 | 2021<br>年 3 月<br>18 日 | 2021<br>年 9 月<br>29 日     | 锁定<br>期股<br>票 | 8.53  | 27.22  | 300 | 2,559.00  | 8,166.00   | - |
| 300960 | 通业科技 | 2021<br>年 3 月<br>22 日 | 2021<br>年 9 月<br>29 日     | 锁定<br>期股<br>票 | 12.08 | 23.06  | 234 | 2,826.72  | 5,396.04   | - |
| 300961 | 深水海纳 | 2021<br>年 3 月<br>23 日 | 2021<br>年 9 月<br>30 日     | 锁定<br>期股<br>票 | 8.48  | 22.07  | 394 | 3,341.12  | 8,695.58   | - |
| 300962 | 中金辐照 | 2021<br>年 3 月<br>29 日 | 2021<br>年 10<br>月 11<br>日 | 锁定<br>期股<br>票 | 3.40  | 16.37  | 576 | 1,958.40  | 9,429.12   | - |
| 300963 | 中洲特材 | 2021<br>年 3 月<br>30 日 | 2021<br>年 10<br>月 11<br>日 | 锁定<br>期股<br>票 | 12.13 | 22.49  | 283 | 3,432.79  | 6,364.67   | - |
| 300966 | 共同药业 | 2021<br>年 3 月<br>31 日 | 2021<br>年 10<br>月 11<br>日 | 锁定<br>期股<br>票 | 8.24  | 31.54  | 286 | 2,356.64  | 9,020.44   | - |
| 300967 | 晓鸣股份 | 2021<br>年 4 月<br>2 日  | 2021<br>年 10<br>月 13      | 锁定<br>期股<br>票 | 4.54  | 11.54  | 507 | 2,301.78  | 5,850.78   | - |

|        |      |            |             |               |       |        |       |           |           |   |
|--------|------|------------|-------------|---------------|-------|--------|-------|-----------|-----------|---|
|        |      |            | 日           |               |       |        |       |           |           |   |
| 300968 | 格林精密 | 2021年4月6日  | 2021年10月15日 | 锁定<br>期股<br>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<br>期股<br>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<br>期股<br>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<br>期股<br>票 | 28.28 | 115.71 | 360   | 10,180.80 | 41,655.60 | - |
| 300975 | 商络电子 | 2021年4月14日 | 2021年10月21日 | 锁定<br>期股<br>票 | 5.48  | 13.03  | 492   | 2,696.16  | 6,410.76  | - |
| 300978 | 东箭科技 | 2021年4月15日 | 2021年10月26日 | 锁定<br>期股<br>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<br>期股<br>票 | 33.22 | 87.50  | 925   | 30,728.50 | 80,937.50 | - |
| 300981 | 中红医疗 | 2021年4月19日 | 2021年10月27日 | 锁定<br>期股<br>票 | 48.59 | 90.39  | 601   | 29,202.59 | 54,324.39 | - |
| 300982 | 苏文电能 | 2021年4月19日 | 2021年10月27日 | 锁定<br>期股<br>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<br>期股<br>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<br>期股<br>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<br>定期股<br>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<br>定期股<br>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<br>定期股<br>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<br>定期股<br>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<br>定期股<br>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<br>定期股<br>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<br>定期股<br>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<br>定期股<br>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<br>定期股<br>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<br>定期股<br>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<br>定期股<br>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<br>定期股<br>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<br>定期股<br>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<br>定期股<br>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<br>定期股<br>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<br>定期股<br>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<br>未上<br>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<br>定期股<br>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<br>未上<br>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<br>定期股<br>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<br>未上<br>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<br>定期股<br>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<br>定期股<br>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<br>未上<br>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<br>未上<br>市  | 31.56 | 31.56 | 349     | 11,014.44    | 11,014.44    | - |

|        |      |                       |                           |               |       |        |       |            |            |   |
|--------|------|-----------------------|---------------------------|---------------|-------|--------|-------|------------|------------|---|
| 688087 | 英科再生 | 2021<br>年 6 月<br>30 日 | 2021<br>年 7 月<br>9 日      | 新股<br>未上<br>市 | 21.96 | 21.96  | 2,469 | 54,219.24  | 54,219.24  | - |
| 688131 | 皓元医药 | 2021<br>年 6 月<br>1 日  | 2021<br>年 12<br>月 8 日     | 锁定<br>期股<br>票 | 64.99 | 247.10 | 1,955 | 127,055.45 | 483,080.50 | - |
| 688191 | 智洋创新 | 2021<br>年 3 月<br>30 日 | 2021<br>年 10<br>月 8 日     | 锁定<br>期股<br>票 | 11.38 | 17.74  | 3,203 | 36,450.14  | 56,821.22  | - |
| 688201 | 信安世纪 | 2021<br>年 4 月<br>13 日 | 2021<br>年 10<br>月 21<br>日 | 锁定<br>期股<br>票 | 26.78 | 45.41  | 2,129 | 57,014.62  | 96,677.89  | - |
| 688226 | 威腾电气 | 2021<br>年 6 月<br>28 日 | 2021<br>年 7 月<br>7 日      | 新股<br>未上<br>市 | 6.42  | 6.42   | 2,693 | 17,289.06  | 17,289.06  | - |
| 688239 | 航宇科技 | 2021<br>年 6 月<br>25 日 | 2021<br>年 7 月<br>5 日      | 新股<br>未上<br>市 | 11.48 | 11.48  | 4,926 | 56,550.48  | 56,550.48  | - |
| 688345 | 博力威  | 2021<br>年 6 月<br>3 日  | 2021<br>年 12<br>月 13<br>日 | 锁定<br>期股<br>票 | 25.91 | 55.53  | 2,332 | 60,422.12  | 129,495.96 | - |
| 688533 | 上声电子 | 2021<br>年 4 月<br>9 日  | 2021<br>年 10<br>月 19<br>日 | 锁定<br>期股<br>票 | 7.72  | 19.11  | 3,493 | 26,965.96  | 66,751.23  | - |
| 688616 | 西力科技 | 2021<br>年 3 月<br>10 日 | 2021<br>年 9 月<br>22 日     | 锁定<br>期股<br>票 | 7.35  | 13.78  | 3,918 | 28,797.30  | 53,990.04  | - |
| 688655 | 迅捷兴  | 2021<br>年 4 月<br>28 日 | 2021<br>年 11<br>月 11<br>日 | 锁定<br>期股<br>票 | 7.59  | 15.77  | 3,083 | 23,399.97  | 48,618.91  | - |
| 688677 | 海泰新光 | 2021<br>年 2 月<br>18 日 | 2021<br>年 8 月<br>26 日     | 锁定<br>期股<br>票 | 35.76 | 103.23 | 1,768 | 63,223.68  | 182,510.64 | - |

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票，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，锁定期限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、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。

#### 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、债券投资及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具等。

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交通银行股份有限公司，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约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

#### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上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<br>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                     | 65,123,080.63 | -     | -     | -                | 65,123,080.63    |
| 存出保证金                    | 2,041,557.51  | -     | -     | -                | 2,041,557.51     |
| 交易性金融资产                  | -             | -     | -     | 651,464,780.60   | 651,464,780.60   |
| 应收利息                     | -             | -     | -     | 12,712.35        | 12,712.35        |
| 应收股利                     | -             | -     | -     | 997,248.00       | 997,248.00       |
| 应收申购款                    | -             | -     | -     | 1,871,337.20     | 1,871,337.20     |
| 应收证券清算款                  | -             | -     | -     | 4,143,144.72     | 4,143,144.72     |
| 资产总计                     | 67,164,638.14 | -     | -     | 658,489,222.87   | 725,653,861.01   |
| 负债                       |               |       |       |                  |                  |
| 应付赎回款                    | -             | -     | -     | 9,998,388.23     | 9,998,388.23     |
| 应付管理人报酬                  | -             | -     | -     | 936,207.91       | 936,207.91       |
| 应付托管费                    | -             | -     | -     | 156,034.62       | 156,034.62       |
| 应付交易费用                   | -             | -     | -     | 253,079.60       | 253,079.60       |
| 其他负债                     | -             | -     | -     | 130,618.00       | 130,618.00       |
| 负债总计                     | -             | -     | -     | 11,474,328.36    | 11,474,328.36    |
| 利率敏感度缺口                  | 67,164,638.14 | -     | -     | 647,014,894.51   | 714,179,532.65   |
| 上年度末<br>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                     | 91,463,487.99 | -     | -     | -                | 91,463,487.99    |
| 结算备付金                    | 49,280.39     | -     | -     | -                | 49,280.39        |
| 存出保证金                    | 1,092,693.84  | -     | -     | -                | 1,092,693.84     |
| 交易性金融资产                  | -             | -     | -     | 1,097,412,772.21 | 1,097,412,772.21 |
| 应收利息                     | -             | -     | -     | 12,707.84        | 12,707.84        |
| 应收申购款                    | -             | -     | -     | 4,473,361.37     | 4,473,361.37     |
| 应收证券清算款                  | -             | -     | -     | 3,463,963.48     | 3,463,963.48     |
| 资产总计                     | 92,605,462.22 | -     | -     | 1,105,362,804.90 | 1,197,968,267.12 |
| 负债                       |               |       |       |                  |                  |

|         |               |   |   |                  |                  |
|---------|---------------|---|---|------------------|------------------|
| 应付赎回款   | -             | - | - | 15,035,869.11    | 15,035,869.11    |
| 应付管理人报酬 | -             | - | - | 1,422,993.19     | 1,422,993.19     |
| 应付托管费   | -             | - | - | 237,165.52       | 237,165.52       |
| 应付交易费用  | -             | - | - | 562,965.74       | 562,965.74       |
| 其他负债    | -             | - | - | 142,131.78       | 142,131.78       |
| 负债总计    | -             | - | - | 17,401,125.34    | 17,401,125.34    |
| 利率敏感度缺口 | 92,605,462.22 | - | - | 1,087,961,679.56 | 1,180,567,141.78 |

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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇风险进行监控。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日   |                |                |                |
|---------------|--------------------------|----------------|----------------|----------------|
|               | 美元<br>折合人民币<br>元         | 港币<br>折合人民币元   | 其他币种<br>折合人民币元 | 合计             |
| 以外币计价的资产      |                          |                |                |                |
| 交易性金融资产       | -                        | 128,346,384.61 | -              | 128,346,384.61 |
| 资产合计          | -                        | 128,346,384.61 | -              | 128,346,384.61 |
| 以外币计价的负债      |                          |                |                |                |
| 负债合计          | -                        | -              | -              | -              |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | -                        | 128,346,384.61 | -              | 128,346,384.61 |
| 项目            | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |                |                |                |
|               | 美元                       | 港币             | 其他币种           | 合计             |

|               | 折合人民币元 | 折合人民币元         | 折合人民币元 |                |
|---------------|--------|----------------|--------|----------------|
| 以外币计价的资产      |        |                |        |                |
| 交易性金融资产       | -      | 206,632,585.02 | -      | 206,632,585.02 |
| 资产合计          | -      | 206,632,585.02 | -      | 206,632,585.02 |
| 以外币计价的负债      |        |                |        |                |
| 负债合计          | -      | -              | -      | -              |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | -      | 206,632,585.02 | -      | 206,632,585.02 |

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

| 假设 | 除汇率以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 | 所有外币相对人民币升值 5%   | 6,417,319.23                | 10,331,629.25          |
|    | 所有外币相对人民币贬值 5%   | -6,417,319.23               | -10,331,629.25         |

注：无。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可

能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。

本基金对股票资产的投资比例为 60%—95%(其中, 投资于标的股票占股票资产的比例不超过 50%); 投资于优质企业相关证券不低于非现金基金资产的 80%; 每个交易日日终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%。

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<br>2021 年 6 月 30 日 |               | 上年度末<br>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  | 651,464,780.60         | 91.22         | 1,097,412,772.21         | 92.96         |
| 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            | 651,464,780.60         | 91.22         | 1,097,412,772.21         | 92.96         |

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%         | 28,547,805.80                 | —                       |

|  |                |                |   |
|--|----------------|----------------|---|
|  | 业绩比较基准下降<br>5% | -28,547,805.80 | - |
|  | -              | -              | - |

注：于 2020 年 12 月 31 日，由于本基金运行期间不足一年，尚不存在足够的经验数据，因此，无法对本基金资产净值对于市场价格风险的敏感性作定量分析。

#### 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              | 651,464,780.60 | 89.78         |
|    | 其中：股票             | 651,464,780.60 | 89.78         |
| 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      | 65,123,080.63  | 8.97          |
| 8  | 其他各项资产            | 9,065,999.78   | 1.25          |
| 9  | 合计                | 725,653,861.01 | 100.00        |

注：本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 128,346,384.61 元，占净值比 17.97%。

### 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         | 11,290.28      | 0.00          |
| B  | 采矿业              | -              | -             |
| C  | 制造业              | 317,690,553.31 | 44.48         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 5,160,036.60   | 0.72          |
| E  | 建筑业              | 25,371.37      | 0.00          |

|   |                 |                |       |
|---|-----------------|----------------|-------|
| F | 批发和零售业          | 279,580.90     | 0.04  |
| G | 交通运输、仓储和邮政业     | —              | —     |
| H | 住宿和餐饮业          | —              | —     |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 219,676.81     | 0.03  |
| J | 金融业             | 199,204,367.89 | 27.89 |
| K | 房地产业            | —              | —     |
| L | 租赁和商务服务业        | —              | —     |
| M | 科学研究和技术服务业      | 483,080.50     | 0.07  |
| 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              | —              | —     |
| Q | 卫生和社会工作         | —              | —     |
| R | 文化、体育和娱乐业       | —              | —     |
| S | 综合              | —              | —     |
|   | 合计              | 523,118,395.99 | 73.25 |

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别     | 公允价值（人民币）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----------|----------------|--------------|
| 能源       | —              | —            |
| 原材料      | —              | —            |
| 工业       | 22,174,466.04  | 3.10         |
| 非日常生活消费品 | 91,818,031.01  | 12.86        |
| 日常消费品    | —              | —            |
| 医疗保健     | —              | —            |
| 金融       | 14,353,887.56  | 2.01         |
| 信息技术     | —              | —            |
| 通信服务     | —              | —            |
| 公用事业     | —              | —            |
| 房地产      | —              | —            |
| 合计       | 128,346,384.61 | 17.97        |

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

### 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  | 600036 | 招商银行 | 1,291,325 | 69,976,901.75 | 9.80         |
| 2  | 000001 | 平安银行 | 3,065,900 | 69,350,658.00 | 9.71         |
| 3  | 02333  | 长城汽车 | 3,305,000 | 69,025,612.44 | 9.67         |
| 4  | 600885 | 宏发股份 | 835,581   | 52,390,928.70 | 7.34         |
| 5  | 002311 | 海大集团 | 599,800   | 48,943,680.00 | 6.85         |
| 6  | 601318 | 中国平安 | 732,343   | 47,075,008.04 | 6.59         |

|    |        |      |           |               |      |
|----|--------|------|-----------|---------------|------|
| 7  | 600031 | 三一重工 | 1,524,572 | 44,319,308.04 | 6.21 |
| 8  | 600519 | 贵州茅台 | 20,100    | 41,339,670.00 | 5.79 |
| 9  | 600690 | 海尔智家 | 1,501,703 | 38,909,124.73 | 5.45 |
| 10 | 000333 | 美的集团 | 479,800   | 34,243,326.00 | 4.79 |
| 11 | 600887 | 伊利股份 | 906,302   | 33,379,102.66 | 4.67 |
| 12 | 02238  | 广汽集团 | 3,930,000 | 22,792,418.57 | 3.19 |
| 13 | 02338  | 潍柴动力 | 1,544,000 | 22,174,466.04 | 3.10 |
| 14 | 000951 | 中国重汽 | 838,363   | 22,023,796.01 | 3.08 |
| 15 | 02328  | 中国财险 | 2,516,000 | 14,235,890.30 | 1.99 |
| 16 | 601601 | 中国太保 | 440,700   | 12,767,079.00 | 1.79 |
| 16 | 02601  | 中国太保 | 5,800     | 117,997.26    | 0.02 |
| 17 | 600905 | 三峡能源 | 907,763   | 5,147,016.21  | 0.72 |
| 18 | 688131 | 皓元医药 | 1,955     | 483,080.50    | 0.07 |
| 19 | 688161 | 威高骨科 | 3,069     | 325,467.45    | 0.05 |
| 20 | 301015 | 百洋医药 | 4,614     | 251,115.78    | 0.04 |
| 21 | 688677 | 海泰新光 | 1,768     | 182,510.64    | 0.03 |
| 22 | 300957 | 贝泰妮  | 578       | 145,632.88    | 0.02 |
| 23 | 688345 | 博力威  | 2,332     | 129,495.96    | 0.02 |
| 24 | 301016 | 雷尔伟  | 2,747     | 115,711.58    | 0.02 |
| 25 | 688678 | 福立旺  | 4,198     | 99,492.60     | 0.01 |
| 26 | 300919 | 中伟股份 | 610       | 99,430.00     | 0.01 |
| 27 | 688201 | 信安世纪 | 2,129     | 96,677.89     | 0.01 |
| 28 | 300920 | 润阳科技 | 2,503     | 84,301.04     | 0.01 |
| 29 | 300979 | 华利集团 | 925       | 80,937.50     | 0.01 |
| 30 | 688533 | 上声电子 | 3,493     | 66,751.23     | 0.01 |
| 31 | 301018 | 申菱环境 | 7,811     | 64,753.19     | 0.01 |
| 32 | 688191 | 智洋创新 | 3,203     | 56,821.22     | 0.01 |
| 33 | 688239 | 航宇科技 | 4,926     | 56,550.48     | 0.01 |
| 34 | 300981 | 中红医疗 | 601       | 54,324.39     | 0.01 |
| 35 | 688087 | 英科再生 | 2,469     | 54,219.24     | 0.01 |
| 36 | 688616 | 西力科技 | 3,918     | 53,990.04     | 0.01 |
| 37 | 688655 | 迅捷兴  | 3,083     | 48,618.91     | 0.01 |
| 38 | 301020 | 密封科技 | 4,210     | 44,794.40     | 0.01 |
| 39 | 300894 | 火星人  | 628       | 42,704.00     | 0.01 |
| 40 | 300973 | 立高食品 | 360       | 41,655.60     | 0.01 |
| 41 | 601528 | 瑞丰银行 | 2,230     | 34,721.10     | 0.00 |
| 42 | 301021 | 英诺激光 | 2,899     | 27,424.54     | 0.00 |
| 43 | 001207 | 联科科技 | 682       | 22,581.02     | 0.00 |
| 44 | 301009 | 可靠股份 | 801       | 22,339.89     | 0.00 |
| 45 | 300941 | 创识科技 | 399       | 19,926.06     | 0.00 |
| 46 | 688226 | 威腾电气 | 2,693     | 17,289.06     | 0.00 |
| 47 | 300925 | 法本信息 | 600       | 15,774.00     | 0.00 |

|    |        |      |       |           |      |
|----|--------|------|-------|-----------|------|
| 48 | 300932 | 三友联众 | 492   | 15,601.32 | 0.00 |
| 49 | 300982 | 苏文电能 | 317   | 14,356.93 | 0.00 |
| 50 | 300968 | 格林精密 | 1,162 | 14,025.34 | 0.00 |
| 51 | 001208 | 华菱线缆 | 1,754 | 13,558.42 | 0.00 |
| 52 | 300940 | 南极光  | 307   | 13,317.66 | 0.00 |
| 53 | 300614 | 百川畅银 | 329   | 13,285.02 | 0.00 |
| 54 | 300937 | 药易购  | 244   | 13,105.24 | 0.00 |
| 55 | 300942 | 易瑞生物 | 443   | 12,634.36 | 0.00 |
| 56 | 603171 | 税友股份 | 637   | 12,230.40 | 0.00 |
| 57 | 300997 | 欢乐家  | 928   | 12,110.40 | 0.00 |
| 58 | 301002 | 崧盛股份 | 201   | 11,581.62 | 0.00 |
| 59 | 300918 | 南山智尚 | 1,063 | 11,065.83 | 0.00 |
| 60 | 605287 | 德才股份 | 349   | 11,014.44 | 0.00 |
| 61 | 300996 | 普联软件 | 241   | 10,177.43 | 0.00 |
| 62 | 300922 | 天秦装备 | 287   | 9,996.21  | 0.00 |
| 63 | 300962 | 中金辐照 | 576   | 9,429.12  | 0.00 |
| 64 | 300952 | 恒辉安防 | 340   | 9,207.20  | 0.00 |
| 65 | 300966 | 共同药业 | 286   | 9,020.44  | 0.00 |
| 66 | 300945 | 曼卡龙  | 474   | 8,949.12  | 0.00 |
| 67 | 300948 | 冠中生态 | 324   | 8,884.08  | 0.00 |
| 68 | 300931 | 通用电梯 | 672   | 8,809.92  | 0.00 |
| 69 | 300961 | 深水海纳 | 394   | 8,695.58  | 0.00 |
| 70 | 300950 | 德固特  | 219   | 8,569.47  | 0.00 |
| 71 | 605162 | 新中港  | 1,377 | 8,358.39  | 0.00 |
| 72 | 300958 | 建工修复 | 300   | 8,166.00  | 0.00 |
| 73 | 300986 | 志特新材 | 264   | 8,070.48  | 0.00 |
| 74 | 300987 | 川网传媒 | 301   | 8,069.81  | 0.00 |
| 75 | 300978 | 东箭科技 | 593   | 8,064.80  | 0.00 |
| 76 | 300993 | 玉马遮阳 | 410   | 7,908.90  | 0.00 |
| 77 | 300930 | 屹通新材 | 322   | 7,882.56  | 0.00 |
| 78 | 300985 | 致远新能 | 295   | 7,318.95  | 0.00 |
| 79 | 300971 | 博亚精工 | 245   | 6,931.05  | 0.00 |
| 80 | 301004 | 嘉益股份 | 312   | 6,845.28  | 0.00 |
| 81 | 300975 | 商络电子 | 492   | 6,410.76  | 0.00 |
| 82 | 300963 | 中洲特材 | 283   | 6,364.67  | 0.00 |
| 83 | 301011 | 华立科技 | 175   | 5,922.00  | 0.00 |
| 84 | 300943 | 春晖智控 | 255   | 5,867.55  | 0.00 |
| 85 | 300967 | 晓鸣股份 | 507   | 5,850.78  | 0.00 |
| 86 | 300972 | 万辰生物 | 430   | 5,439.50  | 0.00 |
| 87 | 300929 | 华骐环保 | 183   | 5,407.65  | 0.00 |
| 88 | 300960 | 通业科技 | 234   | 5,396.04  | 0.00 |
| 89 | 605011 | 杭州热电 | 525   | 4,662.00  | 0.00 |

|    |        |      |     |          |      |
|----|--------|------|-----|----------|------|
| 90 | 300995 | 奇德新材 | 191 | 4,454.12 | 0.00 |
| 91 | 301007 | 德迈仕  | 303 | 4,375.32 | 0.00 |
| 92 | 300998 | 宁波方正 | 201 | 4,285.32 | 0.00 |
| 93 | 301012 | 扬电科技 | 170 | 4,124.20 | 0.00 |
| 94 | 300992 | 泰福泵业 | 200 | 4,064.00 | 0.00 |
| 95 | 301010 | 晶雪节能 | 218 | 3,838.98 | 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  | 000001 | 平安银行   | 79,989,310.01 | 6.78           |
| 2  | 600887 | 伊利股份   | 33,835,433.86 | 2.87           |
| 3  | 02338  | 潍柴动力   | 31,633,522.32 | 2.68           |
| 4  | 000951 | 中国重汽   | 24,999,984.66 | 2.12           |
| 5  | 601318 | 中国平安   | 21,859,627.00 | 1.85           |
| 6  | 600036 | 招商银行   | 18,934,252.14 | 1.60           |
| 7  | 02601  | 中国太保   | 18,401,253.98 | 1.56           |
| 8  | 02328  | 中国财险   | 14,961,635.62 | 1.27           |
| 9  | 000338 | 潍柴动力   | 11,051,180.00 | 0.94           |
| 10 | 600905 | 三峡能源   | 3,436,527.95  | 0.29           |
| 11 | 02238  | 广汽集团   | 1,864,055.84  | 0.16           |
| 12 | 600690 | 海尔智家   | 874,662.00    | 0.07           |
| 13 | 688538 | 和辉光电-U | 485,548.90    | 0.04           |
| 14 | 300979 | 华利集团   | 307,152.12    | 0.03           |
| 15 | 300981 | 中红医疗   | 291,685.77    | 0.02           |
| 16 | 688660 | 电气风电   | 278,734.72    | 0.02           |
| 17 | 688083 | 中望软件   | 276,468.50    | 0.02           |
| 18 | 300957 | 贝泰妮    | 273,188.76    | 0.02           |
| 19 | 688425 | 铁建重工   | 264,682.88    | 0.02           |
| 20 | 688317 | 之江生物   | 248,082.80    | 0.02           |

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  | 000858 | 五粮液  | 121,527,879.67 | 10.29          |
| 2  | 600519 | 贵州茅台 | 64,285,627.40  | 5.45           |
| 3  | 600031 | 三一重工 | 57,816,173.00  | 4.90           |
| 4  | 600690 | 海尔智家 | 51,985,425.99  | 4.40           |
| 5  | 02333  | 长城汽车 | 47,769,150.39  | 4.05           |
| 6  | 02238  | 广汽集团 | 46,733,605.51  | 3.96           |

|    |        |       |               |      |
|----|--------|-------|---------------|------|
| 7  | 000157 | 中联重科  | 43,293,166.81 | 3.67 |
| 8  | 600036 | 招商银行  | 43,238,050.00 | 3.66 |
| 9  | 000333 | 美的集团  | 35,705,655.00 | 3.02 |
| 10 | 002311 | 海大集团  | 29,122,042.75 | 2.47 |
| 11 | 601318 | 中国平安  | 24,978,316.76 | 2.12 |
| 12 | 601601 | 中国太保  | 24,965,098.00 | 2.11 |
| 13 | 600885 | 宏发股份  | 21,038,628.00 | 1.78 |
| 14 | 300168 | 万达信息  | 14,116,533.00 | 1.20 |
| 15 | 000001 | 平安银行  | 13,150,265.16 | 1.11 |
| 16 | 02601  | 中国太保  | 12,815,447.46 | 1.09 |
| 17 | 000338 | 潍柴动力  | 8,981,526.00  | 0.76 |
| 18 | 600905 | 三峡能源  | 2,966,884.80  | 0.25 |
| 19 | 688063 | 派能科技  | 1,724,021.00  | 0.15 |
| 20 | 688256 | 寒武纪-U | 1,304,705.38  | 0.11 |

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 | 271,149,819.75 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 695,975,753.75 |

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

平安银行

2021 年 5 月 18 日，深圳银保监局针对平安银行信用卡中心未对申领首张信用卡的客户进行亲访亲签的违法违规行为，对公司处以罚款 40 万元。

2021 年 5 月 28 日，中国银保监会云南监管局针对平安银行股份有限公司利用来源于本行授信的固定资产贷款和黄金租赁融资的资金发放委托贷款，用于承接处置本行其他贷款风险；固定资产授信严重不审慎，贷款用途审查监控不到位，贷款资金挪用于借款人母公司归还股票质押融资；流动资金贷款用途审查监控不到位，贷款资金部分回流借款人用作银行承兑汇票质押存单；固定资产贷款用途审查监控不到位，贷款资金部分回流借款人或借款人关联公司用作银行承兑汇票保证金、购买理财产品的违法违规行为，对公司处以罚款人民币 210 万元。

2020 年 10 月 16 日，宁波银保监局针对平安银行股份有限公司的贷款资金用途管控不到位、借贷搭售、对房地产开发贷及预售资金监管不力等违法违规行为，对公司处以罚款人民币 100 万元。

招商银行

2021 年 5 月 17 日，中国银行保险监督管理委员会针对招商银行股份有限公司的以下违法违规行为一、为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产，二、违规协助无衍生产品交易业务资格的银行发行结构性衍生产品，三、理财产品

之间风险隔离不到位，四、理财资金投资非标准化债权资产认定不准确，实际余额超监管标准，五、同业投资接受第三方金融机构信用担保，六、理财资金池化运作，七、利用理财产品准备金调节收益，八、高净值客户认定不审慎，九、并表管理不到位，通过关联非银机构的内部交易，违规变相降低理财产品销售门槛，十、投资集合资金信托计划的理财产品未执行合格投资者标准，十一、投资集合资金信托计划人数超限，十二、面向不合格个人投资者销售投资高风险资产或权益性资产的理财产品，十三、信贷资产非真实转让，十四、全权委托业务不规范，十五、未按要求向监管机构报告理财投资合作机构，被监管否决后仍未及时停办业务，十六、通过关联机构引入非合格投资者，受让以本行信用卡债权设立的信托次级受益权，十七、“智能投资受托计划业务”通过其他方式规避整改，扩大业务规模，且业务数据和材料缺失，十八、票据转贴现假卖断屡查屡犯，十九、贷款、理财或同业投资资金违规投向土地储备项目，二十、理财资金违规提供棚改项目资本金融资，向地方政府提供融资并要求地方政府提供担保，二十一、同业投资、理财资金等违规投向地价款或四证不全的房地产项目，二十二、理财资金认购商业银行增发的股票，二十三、违规为企业发行短期融资券提供搭桥融资，并用理财产品投资本行主承债券以承接表内类信贷资产，二十四、为定制公募基金提供投资顾问，二十五、为本行承销债券兑付提供资金支持，二十六、协助发行人以非市场化的价格发行债券，二十七、瞒报案件信息，对公司处以罚款 7170 万元。以上证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

### 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   | 2,041,557.51 |
| 2  | 应收证券清算款 | 4,143,144.72 |
| 3  | 应收股利    | 997,248.00   |
| 4  | 应收利息    | 12,712.35    |
| 5  | 应收申购款   | 1,871,337.20 |
| 6  | 其他应收款   | —            |
| 7  | 待摊费用    | —            |
| 8  | 其他      | —            |
| 9  | 合计      | 9,065,999.78 |

### 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<br>(户) | 户均持有的<br>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 (%) |
| 45,873       | 11,104.78     | 1,045,339.68 | 0.21       | 508,364,394.22 | 99.79      |

## 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 | 1,397,689.98 | 0.2744       |

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

| 项目                                 | 持有基金份额总量的数量区间 (万份) |
|------------------------------------|--------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门<br>负责人持有本开放式基金 | -                  |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                    | 50~100             |

注：1、截至本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金份额。

2、截至本报告期末，本基金的基金经理投资、持有本基金符合相关法律法规、中国证监会规定及相关管理制度的规定。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                                     |                  |
|-------------------------------------|------------------|
| 基金合同生效日 (2020 年 6 月 11 日)<br>基金份额总额 | 1,760,003,108.04 |
| 本报告期期初基金份额总额                        | 814,800,631.92   |
| 本报告期基金总申购份额                         | 404,815,356.73   |
| 减：本报告期基金总赎回份额                       | 710,206,254.75   |
| 本报告期基金拆分变动份额 (份额减少<br>以“-”填列)       | -                |

本报告期末基金份额总额

509,409,733.90

## § 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，交通银行托管部负责人由袁庆伟变更为徐铁。

### 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

本基金管理人聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金审计的会计师事务所。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  |   |
|--------|---|----------------|--------|------------|--------|---|
| 海通证券   | 1 | 268,261,381.72 | 28.86% | 244,465.11 | 28.35% | — |
| 长城证券   | 1 | 164,153,058.20 | 17.66% | 149,592.65 | 17.35% | — |
| 银河证券   | 1 | 119,096,070.42 | 12.81% | 111,842.56 | 12.97% | — |
| 中信证券   | 1 | 98,649,486.69  | 10.61% | 95,917.11  | 11.12% | — |
| 广发证券   | 1 | 76,872,899.04  | 8.27%  | 72,916.86  | 8.46%  | — |
| 西部证券   | 1 | 64,900,495.98  | 6.98%  | 60,804.29  | 7.05%  | — |
| 中信建投证券 | 1 | 51,427,008.21  | 5.53%  | 46,862.77  | 5.43%  | — |
| 方正证券   | 1 | 43,802,316.94  | 4.71%  | 39,919.59  | 4.63%  | — |
| 中金财富   | 1 | 22,734,994.49  | 2.45%  | 20,717.91  | 2.40%  | — |
| 安信证券   | 1 | 18,021,491.64  | 1.94%  | 18,021.50  | 2.09%  | — |
| 民生证券   | 1 | 1,461,483.19   | 0.16%  | 1,331.74   | 0.15%  | — |
| 渤海证券   | 1 | —              | —      | —          | —      | — |
| 东莞证券   | 1 | —              | —      | —          | —      | — |
| 华泰证券   | 1 | —              | —      | —          | —      | — |
| 上海证券   | 1 | —              | —      | —          | —      | — |
| 泰阳证券   | 1 | —              | —      | —          | —      | — |
| 西南证券   | 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 & 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

无。

## 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    | 《证券时报》、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 | 《证券时报》、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                                      | 《证券时报》、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  | 鹏华优质企业混合型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告                            | 《证券时报》、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                                      | 《证券时报》、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                                      | 《证券时报》、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 |
| 7  | 鹏华基金管理有限公司澄清公告                                            | 《证券时报》、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                  | 《证券时报》、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                      | 《证券时报》、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   | 《证券时报》、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                      | 《证券时报》、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旗下基金投资非公开发行的公告                                | 《证券时报》、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 13 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                      | 《证券时报》、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                             | 《证券时报》、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 | 鹏华优质企业混合型证券投资基金 2020 年年度报告                                | 《证券时报》、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                            | 《证券时报》、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       | 《证券时报》、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 | 《证券时报》、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                                            | 《证券时报》、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        | 《证券时报》、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 |
| 21 | 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    | 《证券时报》、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          | 《证券时报》、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 |

|    |                                                                  |                              |                  |
|----|------------------------------------------------------------------|------------------------------|------------------|
|    | 户最低余额限制的公告                                                       |                              |                  |
| 23 | 鹏华优质企业混合型证券投资基金<br>2021 年第 1 季度报告                                | 《证券时报》、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 | 鹏华基金管理有限公司旗下部分基金<br>2021 年第 1 季度报告提示性公告                          | 《证券时报》、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 |
| 25 | 关于鹏华基金管理有限公司旗下部分<br>基金申购瑞华泰首次公开发行 A 股的<br>公告                     | 《证券时报》、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 | 关于鹏华基金管理有限公司旗下部分<br>基金申购志特新材首次公开发行 A 股<br>的公告                    | 《证券时报》、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 |
| 27 | 鹏华基金管理有限公司澄清公告                                                   | 《证券时报》、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 |
| 28 | 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分<br>基金参与宁波银行股份有限公司申购<br>(不含定期定额投资) 费率优惠活动的<br>公告 | 《证券时报》、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 |
| 29 | 鹏华优质企业混合型证券投资基金更新<br>的招募说明书                                      | 《证券时报》、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 | 鹏华优质企业混合型证券投资基金基金<br>产品资料概要 (更新)                                 | 《证券时报》、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 | 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分<br>基金参与珠海盈米基金销售有限公司<br>相关费率优惠活动的公告              | 《证券时报》、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 |
| 32 | 鹏华基金管理有限公司澄清公告                                                   | 《证券时报》、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)《鹏华优质企业混合型证券投资基金基金合同》；
- (二)《鹏华优质企业混合型证券投资基金托管协议》；
- (三)《鹏华优质企业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