

鹏华价值精选股票型证券投资基金 2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 08 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 2022 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	43
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	44
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	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	54
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	54
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	54

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	54
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	54
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	54
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
7.12	投资组合报告附注	54
§ 8	基金份额持有人信息	55
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
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	55
§ 9	开放式基金份额变动	56
§ 10	重大事件揭示	56
10.1	基金份额持有人大会决议	56
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	56
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
10.4	基金投资策略的改变	56
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	56
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	56
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	56
10.8	其他重大事件	59
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	62
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	62
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	62
§ 12	备查文件目录	62
12.1	备查文件目录	62
12.2	存放地点	62
12.3	查阅方式	62

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华价值精选股票型证券投资基金
基金简称	鹏华价值精选股票
基金主代码	206012
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012 年 4 月 16 日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	87,458,623.22 份
基金合同存续期	不定期

注：无。

2.2 基金产品说明

投资目标	在适度控制风险并保持良好流动性的前提下，精选具备估值优势以及良好基本面的上市公司，力争实现超额收益与长期资本增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金通过对宏观经济、微观经济运行态势、政策环境、利率走势、证券市场走势及证券市场现阶段的系统性风险以及未来一段时期内各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估，运用定量及定性相结合的手段，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</p> <p>本基金通过定性与定量相结合的积极投资策略，自下而上地精选价值被低估并且具有良好基本面的股票构建股票投资组合。</p> <p>（1）定性分析</p> <p>本基金通过以下标准对股票的基本面进行研究分析并筛选出基本面优异的上市公司：</p> <p>第一、根据公司的核心业务竞争力、市场地位、经营管理者能力、人才资源等选择具备良好竞争优势的公司；</p> <p>第二、根据上市公司股权结构、公司组织框架、信息透明度等角度定性分析，选择公司治理结构良好的公司；</p> <p>第三、通过定性的方式分析公司在自身的发展过程中，受国家政策的扶持程度，公司发展方向，核心产品发展前景，公司规模增长及经营效益的趋势。另外还将考察公司在同业中的地位、核心产品的竞争力、市场需求状况及公司的决策体系及其开拓精神等。</p> <p>（2）定量分析</p> <p>本基金通过对上市公司内在价值的深入分析，挖掘具备估值优势的上市公司。本基金将在宏观经济分析、行业分析的基础上，根据公司的基本面以及财务报表信息灵活运用各类估值方法评估公</p>

	<p>司的价值。本基金采用的估值方法及评估指标包括 PE、PEG、PB、PS、EV/EBITDA 等。</p> <p>(3) 存托凭证投资策略</p> <p>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</p> <p>本基金通过久期配置、类属配置、期限结构配置等，采取积极主动的投资策略，在严格控制风险的前提下，发掘和利用市场失衡提供的投资机会，实现债券组合增值。</p> <p>4、权证产品投资策略</p> <p>本基金通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型及价值挖掘策略、价差策略、双向权证策略等寻求权证的合理估值水平，追求稳定的当期收益。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×90%+中证综合债指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为采用高仓位运作的股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金及普通股票型基金，属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种。

注：无。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		鹏华基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	高永杰	李申
	联系电话	0755-81395402	021-60637102
	电子邮箱	xxpl@phfund.com.cn	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		4006788999	021-60637111
传真		0755-82021126	021-60635778
注册地址		深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		518048	100033
法定代表人		何如	田国立

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022年1月1日-2022年6月30日)
本期已实现收益	-31,138,747.59
本期利润	-38,550,690.17
加权平均基金份额本期利润	-0.4305
本期加权平均净值利润率	-13.51%
本期基金份额净值增长率	-11.32%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)
期末可供分配利润	187,506,894.18
期末可供分配基金份额利润	2.1439
期末基金资产净值	286,416,403.66
期末基金份额净值	3.275
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)
基金份额累计净值增长率	227.50%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益等未实现收益。

(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	8.30%	1.30%	8.63%	0.96%	-0.33%	0.34%
过去三个月	3.77%	1.63%	5.74%	1.29%	-1.97%	0.34%
过去六个月	-11.32%	1.58%	-8.07%	1.31%	-3.25%	0.27%

过去一年	0.80%	1.69%	-12.26%	1.12%	13.06%	0.57%
过去三年	153.48%	1.73%	17.46%	1.14%	136.02%	0.59%
自基金合同生效起至今	227.50%	1.61%	75.88%	1.28%	151.62%	0.33%

注：业绩比较基准=沪深 300 指数收益率×90%+中证综合债指数收益率×10%

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



注：1、本基金基金合同于 2012 年 04 月 16 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 11946.65 亿元，267 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 多年投资管理基金，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		
张鹏	基金经理	2021-08-24	-	9 年	张鹏先生，国籍中国，金融学硕士，9 年证券从业经验。曾任鹏华基金管理有限公司研究部助理研究员、研究员，中欧基金管理有限公司研究部研究员，自 2017 年任鹏华基金管理有限公司研究部高级研究员、基金经理助理/研究员，现担任权益投资二部基金经理。2021 年 08 月至今担任鹏华策略回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2021 年 08 月至今担任鹏华价值精选股票型证券投资基金基金经理，张鹏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。本报告期内未发生基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022 年上半年市场呈现先跌后涨行情，4 月份的国内外利空因素频发，海外是俄乌冲突持续、全球经济增长预期下调、通胀高企，联储收紧流动性，国内疫情局部爆发，导致四月份市场加速下跌，大部分前期强势的个股调整幅度达到了 40%-50% 的水平，进入 5 月，风险因素得到了相对充分的释放，联储的政策收紧也已经充分预期，疫情开始得到有效控制，恢复生产和刺激消费的稳经济政策频出，市场开始持续的强势反弹，部分个股重回此前高点。反弹过程中，典型成长板块中，风光新能源和汽车零部件板块涨幅显著，军工、锂电池和半导体板块相对弱势，价值板块中，消费板块表现比较强势。

价值精选的操作上，一、仓位保持在 80%-90% 的仓位区间，秉承中性原则，未做仓位择时；二、在股价大幅波动的过程中，以合理价位逐步加仓长期看好的板块和公司，例如汽车零部件、军工和半导体板块龙头；三是保持了空间大壁垒高的核心成长标的的主体持仓的情况下，边际上继续优化结构，例如根据养殖和消费板块的周期变化节奏，进行了板块的加减仓；

实际上，在本轮反弹之前的下跌过程中，对于经过深度研究真心看好的板块和公司，是谨慎的小幅逆势加仓的，本质上依然是守着价值投资的主线，坚信有价值的公司股价能够回归，非理性下跌是最好的加仓窗口，现在看“逆势加仓”的选择是对的，但是逆势加仓的幅度稍显保守。

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-11.32%，同期业绩比较基准增长率为-8.07%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前时点的思路是：耐心等待经济筑底回暖，细致辨别成长真伪和泡沫，观察寻找经济新动能。20-21 年低碳和能源革命是一条主线，未来还会逐渐有第二条第三条线索清晰起来。

我们目前最看好的是泛制造业。例如在军工和半导体行业的不可逆的自主可控的进程，风光和锂电池行业全供应链各环节在全球市占率的持续提升，汽车自主品牌的持续崛起和出海，大工业领域内的各环节的自主替代，例如高功率激光设备和汽车零部件等。制造业各环节上国内公司的崛起，其本质是在内在多年的积淀与海外环境压力倒逼两个因素的共振。向内可以清晰的看到中国经过多年发展，基础的材料池、技术池和人才池已经完成了底层建设，例如光伏组件产业链

和锂电池产业链，已经是成为全球主要的供应者，大宗品和初级材料如化工品，新建产能的规模和自动化复杂化程度全球遥遥领先，供给成本曲线迅速进入全球最左侧，汽车行业已经可以做到性能较强，成本较低，在外形和功能等消费属性上也已经能够与海外知名车企的产品媲美，华为造车能够做到一年内迭代两款车，其背后是长时间的通信电子工业制造设计各环节的技术和人才的积累，甚至有望形成对传统外资品牌的产品力的降维式的打击。国内的制造业同时背靠这中国先天的成本禀赋优势和工程师红利，各环节的崛起将是不可逆的趋势。向外看，海外环境错综复杂，非商业因素导致的供应链撕裂从客观上给中国制造业公司创造了大量的替代海外公司的机会。

从长期维度看，价值精选的核心思路就是寻找并投资中国泛制造业各环节有崛起潜力的龙头公司。当然，如果看相对短的时间维度，不能排除市场持续震荡的态势，部分成长股估值重回高位，疫情风险仍在，海外经济出现衰退迹象，通胀风险仍在，预计市场较大概率呈现震荡上行的态势。

而在这种长期方向清晰，短期市场可能会有波动的情况下，我们未来的操作思路是利用市场波动和非理性下跌所带来的合理股价，作为加仓窗口期。同时结合对各个板块的资产价格周期所处的位置，我们会进行一定的高低切换，在一定程度上控制回撤风险，保持操作在基金经理和持有人的理性空间内，持有体验相对稳定。

深究内心，基金经理的责任在于实现持有人资产的保值增值，相对市场具有超额收益，同时也要控制风险兼顾持有人的体验，这是价值精选产品目前的核心目标。支持和陪伴最优秀的制造业公司成长，给持有人创造价值，是基金经理坚定的内生驱动力和努力工作的底层逻辑。

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 187,506,894.18 元，期末基金份额净值 3.275 元。

2、本基金本报告期内未进行利润分配。

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：鹏华价值精选股票型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	34,115,081.95	35,674,360.93
结算备付金		641,847.64	1,271,954.41
存出保证金		114,462.73	179,687.91
交易性金融资产	6.4.7.2	260,518,277.98	302,539,882.17
其中：股票投资		260,518,277.98	302,539,882.17
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		255,772.55	138,566.59
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	3,691.53
资产总计		295,645,442.85	339,808,143.54
负债和净资产			
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		7,359,935.74	2,351,076.65
应付赎回款		942,657.10	710,494.13
应付管理人报酬		275,213.75	337,296.00
应付托管费		57,336.19	70,269.99
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	593,896.41	872,338.17
负债合计		9,229,039.19	4,341,474.94
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	87,458,623.22	90,842,808.18
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	198,957,780.44	244,623,860.42
净资产合计		286,416,403.66	335,466,668.60
负债和净资产总计		295,645,442.85	339,808,143.54

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 3.275 元，基金份额总额 87,458,623.22 份。

6.2 利润表

会计主体：鹏华价值精选股票型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-36,409,471.28	38,160,040.22
1. 利息收入		81,560.74	45,828.87
其中：存款利息收入	6.4.7.13	64,068.48	45,658.01
债券利息收入		-	170.86
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		17,492.26	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-29,121,514.18	55,897,825.95
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-30,598,794.25	54,393,590.40
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	453,986.53
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	1,477,280.07	1,050,249.02
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-

3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-7,411,942.58	-18,049,160.40
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	42,424.74	265,545.80
减：二、营业总支出		2,141,218.89	4,417,372.72
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,701,004.38	2,126,709.06
2. 托管费	6.4.10.2.2	354,375.91	443,064.31
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费	6.4.10.2.1.1	-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	0.61
8. 其他费用	6.4.7.23	85,838.60	1,847,598.74
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-38,550,690.17	33,742,667.50
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-38,550,690.17	33,742,667.50
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-38,550,690.17	33,742,667.50

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：鹏华价值精选股票型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	90,842,808.18	-	244,623,860.42	335,466,668.60
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期	90,842,808.18	-	244,623,860.42	335,466,668.60

期初净资产（基金净值）				
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-3,384,184.96	-	-45,666,079.98	-49,050,264.94
（一）、综合收益总额	-	-	-38,550,690.17	-38,550,690.17
（二）、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）	-3,384,184.96	-	-7,115,389.81	-10,499,574.77
其中：1. 基金申购款	9,320,705.31	-	20,824,297.13	30,145,002.44
2. 基金赎回款	-12,704,890.27	-	-27,939,686.94	-40,644,577.21
（三）、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）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产（基金净值）	87,458,623.22	-	198,957,780.44	286,416,403.66
项目	上年度可比期间			

	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	138,175,420.39	-	265,792,877.20	403,968,297.59
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本年期初净资产（基金净值）	138,175,420.39	-	265,792,877.20	403,968,297.59
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-27,622,590.88	-	-17,174,007.20	-44,796,598.08
（一）、综合收益总额	-	-	33,742,667.50	33,742,667.50
（二）、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）	-27,622,590.88	-	-50,916,674.70	-78,539,265.58
其中：1. 基金申购款	46,872,125.91	-	95,229,595.19	142,101,721.10
2. 基金赎回款	-74,494,716.79	-	-146,146,269.89	-220,640,986.68
（三）、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）				
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	110,552,829.51	-	248,618,870.00	359,171,699.51

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

基金管理人负责人

邢彪

主管会计工作负责人

郝文高

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

鹏华价值精选股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2011]1627号《关于核准鹏华价值精选股票型证券投资基金募集的批复》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《鹏华价值精选股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币334,728,307.80元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第090号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华价值精选股票型证券投资基金基金合同》于2012年4月16日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为334,825,290.98份基金份额,其中认购资金利息折合96,983.18份基金份额。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华价值精选股票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,包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券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。本基金的投资组合中股票(含存托凭证)资产占基金资产的85%-95%,债券、货币市场工具、权证及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他资产不高于基金资产的15%,基金持有全部权证的市值不得超过基金资产

净值的 3%，基金保留的现金以及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×90%+中证综合债指数收益率×10%。

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》、《鹏华价值精选股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2022 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 2022 年 06 月 30 日的财务状况以及 2022 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

除 6.4.5.1 会计政策变更的说明所声明的变更外，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

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)，财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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>》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

(a) 金融工具

新金融工具准则改变了金融工具的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融工具的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、交易性金融资产-债券投资、交易性金融资产-资产支持证券投资、债权投资和卖出回购金融资产款等项目中，不单独列示应收利息或应付利息项目。

信用减值损失项目反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在利息收入项目中。其他项目的利息收入从利息收入项目调整至投资收益项目列示。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具，其投资收益包含期间交易费用的抵减。

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息、应付交易费用和其他负债，对其账面价值的影响金额分别为 2,972.90 元、629.64 元、88.99 元、-3,691.53 元、-699,777.53 元和 699,777.53 元。

(b) 修订后的《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>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《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>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

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

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

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

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

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	34,115,081.95
等于：本金	34,112,136.02
加：应计利息	2,945.93
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	34,115,081.95

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	242,664,354.04	-	260,518,277.98	17,853,923.94
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	242,664,354.04	-	260,518,277.98	17,853,923.94

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

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

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。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.8 其他资产

注：无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,861.70
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	507,732.15
其中：交易所市场	507,732.15
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	84,302.56
合计	593,896.41

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	90,842,808.18	90,842,808.18
本期申购	9,320,705.31	9,320,705.31
本期赎回（以“-”号填列）	-12,704,890.27	-12,704,890.27
- 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	87,458,623.22	87,458,623.22

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

注：无。

6.4.7.12 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
本期期初	226,111,316.71	18,512,543.71	244,623,860.42
本期利润	-31,138,747.59	-7,411,942.58	-38,550,690.17
本期基金份额交易产生的变动数	-7,465,674.94	350,285.13	-7,115,389.81
其中：基金申购款	21,319,639.33	-495,342.20	20,824,297.13
基金赎回款	-28,785,314.27	845,627.33	-27,939,686.94

本期已分配利润	-	-	-
本期末	187,506,894.18	11,450,886.26	198,957,780.44

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
活期存款利息收入	56,273.87
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	6,499.42
其他	1,295.19
合计	64,068.48

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

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-30,598,794.25
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	-30,598,794.25

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	560,194,054.23
减：卖出股票成本总额	589,113,259.85
减：交易费用	1,679,588.63
买卖股票差价收入	-30,598,794.25

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,477,280.07
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,477,280.07

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-7,411,942.58
股票投资	-7,411,942.58
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	-7,411,942.58

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	39,469.92
基金转换费收入	2,954.82
合计	42,424.74

6.4.7.22 信用减值损失

注：无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费用	1,536.04
合计	85,838.60

6.4.7.24 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
鹏华基金管理有限公司(“鹏华基金公司”)	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人、基金代销机构
国信证券股份有限公司(“国信证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
国信证券	21,413,254.77	1.93	40,456,862.76	3.58

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
国信证券	19,655.50	1.94	19,655.50	3.87
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
国信证券	36,867.10	3.58	20,913.15	3.81

注：（1）佣金的计算公式

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

(佣金比率按照与一般证券公司签订的协议条款订立。)

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6 月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021 年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,701,004.38	2,126,709.06
其中：支付销售机构的客户维护 费	540,474.87	492,024.49

注：1、支付基金管理人鹏华基金公司的管理人报酬年费率为1.20%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×1.20%÷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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	354,375.91	443,064.31

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：无。

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

注：无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金合同生效日(2012 年 4 月 16 日)持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	7,384,785.82	7,384,785.82
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	7,384,785.82	7,384,785.82
报告期末持有的基金份额	8.4437%	6.6799%

占基金总份额比例		
----------	--	--

注：本基金管理人投资本基金的费率标准与其他相同条件的投资者适用的费率标准相一致。

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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	34,115,081.95	56,273.87	19,751,602.50	38,209.98

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 2022年1月1日至2022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
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张）	总金额
国信证券	300957	贝泰妮	网下申购	2,169	102,658.77
国信证券	688323	瑞华泰	网下申购	4,513	26,942.61
国信证券	300986	志特新材	网下申购	2,632	38,927.28

注：无。

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(2022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	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单	期末成本总额	期末估值总额	备注

							位： 股)			
301110	青木股份	2022年3月4日	6个月	新股流通受限	63.10	39.85	139	8,770.90	5,539.15	-
301112	信邦智能	2022年6月20日	6个月	新股流通受限	27.53	45.04	386	10,626.58	17,385.44	-
301116	益客食品	2022年1月10日	6个月	新股流通受限	11.40	20.46	577	6,577.80	11,805.42	-
301117	佳缘科技	2022年1月7日	6个月	新股流通受限	46.80	54.44	202	9,453.60	10,996.88	-
301120	新特电气	2022年4月11日	6个月	新股流通受限	13.73	15.49	1,032	14,169.36	15,985.68	-
301125	腾亚精工	2022年5月27日	6个月	新股流通受限	22.49	27.42	327	7,354.23	8,966.34	-
301135	瑞德智能	2022年4月1日	6个月	新股流通受限	31.98	26.26	308	9,849.84	8,088.08	-
301151	冠龙节能	2022年3月30日	6个月	新股流通受限	30.82	21.46	370	11,403.40	7,940.20	-
301153	中科江南	2022年5月10日	6个月	新股流通受限	33.68	43.98	259	8,723.12	11,390.82	-
301158	德石股份	2022年1月7日	6个月	新股流通受限	15.64	20.38	379	5,927.56	7,724.02	-
301160	翔楼新材	2022年5月25日	6个月	新股流通受限	31.56	37.66	392	12,371.52	14,762.72	-
301162	国能日新	2022年4月19日	6个月	新股流通受限	45.13	54.11	267	12,049.71	14,447.37	-
301163	宏德股份	2022年4月11日	6个月	新股流通受限	26.27	32.33	277	7,276.79	8,955.41	-
301175	中科环保	2022年6月30日	1个月内(含)	新股未上市	3.82	3.82	26,464	101,092.48	101,092.48	-

301175	中科环保	2022年6月30日	6个月	新股流通受限	3.82	3.82	2,941	11,234.62	11,234.62	-
301187	欧圣电气	2022年4月13日	6个月	新股流通受限	21.33	22.54	561	11,966.13	12,644.94	-
301200	大族数控	2022年2月18日	6个月	新股流通受限	76.56	51.92	166	12,708.96	8,618.72	-
301206	三元生物	2022年1月26日	6个月	新股流通受限	109.30	45.69	228	16,613.60	10,417.32	三元生物于2022年6月17日实施权益分派方案，每10股派人民币10元，并转增5股。
301207	华兰疫苗	2022年2月10日	6个月	新股流通受限	56.88	56.42	193	10,977.84	10,889.06	-
301217	铜冠铜箔	2022年1月20日	6个月	新股流通受限	17.27	14.83	823	14,213.21	12,205.09	-
301219	腾远钴业	2022年3月10日	6个月	新股流通受限	173.98	87.82	94	9,046.96	8,255.08	腾远钴业于2022年5月24日实施权益分派方案，每10股派人民币39.9元，并转增8股。
301220	亚香股份	2022年6月	6个月	新股流通受限	35.98	39.15	285	10,254.30	11,157.75	-

		15 日									
301222	浙江恒威	2022 年 3 月 2 日	6 个月	新股流通受限	33.98	28.96	289	9,820.22	8,369.44		-
301228	实朴检测	2022 年 1 月 21 日	6 个月	新股流通受限	20.08	20.34	373	7,489.84	7,586.82		-
301233	盛帮股份	2022 年 6 月 24 日	1 个月内 (含)	新股未上市	41.52	41.52	1,418	58,875.36	58,875.36		-
301233	盛帮股份	2022 年 6 月 24 日	6 个月	新股流通受限	41.52	41.52	158	6,560.16	6,560.16		-
301238	瑞泰新材	2022 年 6 月 10 日	6 个月	新股流通受限	19.18	32.07	740	14,193.20	23,731.80		-
301239	普瑞眼科	2022 年 6 月 22 日	1 个月内 (含)	新股未上市	33.65	33.65	2,801	94,253.65	94,253.65		-
301239	普瑞眼科	2022 年 6 月 22 日	6 个月	新股流通受限	33.65	33.65	312	10,498.80	10,498.80		-
301259	艾布鲁	2022 年 4 月 18 日	6 个月	新股流通受限	18.39	24.94	483	8,882.37	12,046.02		-
301266	宇邦新材	2022 年 5 月 30 日	6 个月	新股流通受限	26.86	47.07	448	12,033.28	21,087.36		-
301268	铭利达	2022 年 3 月 29 日	6 个月	新股流通受限	28.50	34.87	371	10,573.50	12,936.77		-
301286	侨源股份	2022 年 6 月 6 日	6 个月	新股流通受限	16.91	19.79	750	12,682.50	14,842.50		-
301288	清研环境	2022 年 4 月 14 日	6 个月	新股流通受限	19.09	19.98	452	8,628.68	9,030.96		-
301298	东利机械	2022 年 5 月 27 日	6 个月	新股流通受限	12.68	20.83	634	8,039.12	13,206.22		-
301302	华如科技	2022 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通受限	52.03	56.42	228	11,862.84	12,863.76		-
600938	中国	2022	6 个月	新股流	10.80	15.86	84,004	907,243.20	1,332,303.44		-

	海油	年 4 月 14 日		通受限						
688237	超卓 航科	2022 年 6 月 24 日	1 个月 内 (含)	新股未 上市	41.27	41.27	2,357	97,273.39	97,273.39	-
688306	均普 智能	2022 年 3 月 15 日	6 个月	新股流 通受限	5.08	5.19	16,775	85,217.00	87,062.25	-
688326	经纬 恒润- W	2022 年 4 月 11 日	6 个月	新股流 通受限	121.00	134.07	1,366	165,286.00	183,139.62	-
688400	凌云 光	2022 年 6 月 27 日	1 个月 内 (含)	新股未 上市	21.93	21.93	4,566	100,132.38	100,132.38	-

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

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

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包含中小板，创业板及其他经中国证监会核准上市的股票，存托凭证)，债券，货币市场工具，权证，资产支持证券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的相关规定)。

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

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行股份有限公司及其他具有基金托管资格的银行，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 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券（2021 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在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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或于约定开放日要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理职能部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短期内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2022 年 6 月 30 日，本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注“期末本基金持有的流通受限证券”。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付

能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金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 2022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	34,115,081.95	-	-	-	34,115,081.95
结算备付金	641,847.64	-	-	-	641,847.64
存出保证金	114,462.73	-	-	-	114,462.73
交易性金融资产	-	-	-	-260,518,277.98	260,518,277.98
应收申购款	-	-	-	255,772.55	255,772.55
资产总计	34,871,392.32	-	-	-260,774,050.53	295,645,442.85
负债					
应付赎回款	-	-	-	942,657.10	942,657.10
应付管理人报酬	-	-	-	275,213.75	275,213.75
应付托管费	-	-	-	57,336.19	57,336.19
应付清算款	-	-	-	7,359,935.74	7,359,935.74
其他负债	-	-	-	593,896.41	593,896.41
负债总计	-	-	-	9,229,039.19	9,229,039.19

利率敏感度缺口	34,871,392.32	-	-	-251,545,011.34	286,416,403.66
上年度末 2021 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	35,674,360.93	-	-	-	35,674,360.93
结算备付金	1,271,954.41	-	-	-	1,271,954.41
存出保证金	179,687.91	-	-	-	179,687.91
交易性金融资产	-	-	-	-302,539,882.17	302,539,882.17
应收申购款	-	-	-	138,566.59	138,566.59
其他资产	-	-	-	3,691.53	3,691.53
资产总计	37,126,003.25	-	-	-302,682,140.29	339,808,143.54
负债					
应付赎回款	-	-	-	710,494.13	710,494.13
应付管理人报酬	-	-	-	337,296.00	337,296.00
应付托管费	-	-	-	70,269.99	70,269.99
应付清算款	-	-	-	2,351,076.65	2,351,076.65
其他负债	-	-	-	872,338.17	872,338.17
负债总计	-	-	-	4,341,474.94	4,341,474.94
利率敏感度缺口	37,126,003.25	-	-	-298,340,665.35	335,466,668.60

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2022 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资和资产支持证券公允价值占基金资产净值的比例为 0.00%。因此当利率发生合理、可能的变动时，对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无。

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券投资品种，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。

基金的投资组合比例为：股票（含存托凭证）资产占基金资产的 85%-95%；债券，货币市场工具，权证及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他资产不高于基金资产的 15%；基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；基金保留的现金或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，其它金融工具的投资比例符合相关法律法规和监管机构的规定。若法律法规或监管机构允许，本基金在履行适当程序后，可调整上述投资比例，或将法律法规或监管机构以后允许基金投资的其它品种纳入投资范围。

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 2022年6月30日		上年度末 2021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	260,518,277.98	90.96	302,539,882.17	90.18
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
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	260,518,277.98	90.96	302,539,882.17	90.18
----	----------------	-------	----------------	-------

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（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	业绩比较基准上升 5%	12,009,439.81	16,857,200.10
	业绩比较基准下降 5%	-12,009,439.81	-16,857,200.10

注：无。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年6月30日
第一层次	258,081,974.69
第二层次	479,920.84
第三层次	1,956,382.45

合计	260,518,277.98
----	----------------

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票、债券和基金的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 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	260,518,277.98	88.12
	其中：股票	260,518,277.98	88.12
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	34,756,929.59	11.76
8	其他各项资产	370,235.28	0.13
9	合计	295,645,442.85	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	12,635,010.57	4.41
B	采矿业	8,553,875.11	2.99
C	制造业	209,030,645.68	72.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,611.92	0.00
E	建筑业	6,423,230.69	2.24
F	批发和零售业	4,702,375.56	1.64
G	交通运输、仓储和邮政业	57,306.78	0.02
H	住宿和餐饮业	3,328.32	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,407,653.58	2.24
J	金融业	2,465,174.56	0.86
K	房地产业	7,443,804.00	2.60
L	租赁和商务服务业	23,317.45	0.01
M	科学研究和技术服务业	630,367.01	0.22
N	水利、环境和公共设施管理业	270,614.56	0.09
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	104,752.45	0.04
R	文化、体育和娱乐业	1,755,209.74	0.61
S	综合	-	-
	合计	260,518,277.98	90.96

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	603596	伯特利	188,300	15,097,894.00	5.27
2	002648	卫星化学	496,291	12,829,122.35	4.48
3	600765	中航重机	337,240	10,852,383.20	3.79
4	002371	北方华创	35,400	9,810,048.00	3.43
5	000733	振华科技	58,201	7,913,589.97	2.76
6	603806	福斯特	116,853	7,656,208.56	2.67
7	002100	天康生物	708,984	6,891,324.48	2.41
8	300498	温氏股份	299,540	6,377,206.60	2.23

9	600660	福耀玻璃	124,900	5,222,069.00	1.82
10	002415	海康威视	133,300	4,825,460.00	1.68
11	002493	荣盛石化	312,700	4,812,453.00	1.68
12	600519	贵州茅台	2,200	4,499,000.00	1.57
13	600031	三一重工	235,900	4,496,254.00	1.57
14	002714	牧原股份	77,800	4,300,006.00	1.50
15	300014	亿纬锂能	43,900	4,280,250.00	1.49
16	002459	晶澳科技	52,540	4,145,406.00	1.45
17	300750	宁德时代	7,600	4,058,400.00	1.42
18	002466	天齐锂业	29,000	3,619,200.00	1.26
19	002812	恩捷股份	14,400	3,606,480.00	1.26
20	002176	江特电机	131,800	3,300,272.00	1.15
21	603501	韦尔股份	19,034	3,293,453.02	1.15
22	000683	远兴能源	308,600	3,243,386.00	1.13
23	600438	通威股份	52,300	3,130,678.00	1.09
24	688536	思瑞浦	5,431	3,049,995.29	1.06
25	603348	文灿股份	56,900	3,049,840.00	1.06
26	000568	泸州老窖	12,300	3,032,442.00	1.06
27	600309	万华化学	30,700	2,977,593.00	1.04
28	600406	国电南瑞	108,960	2,941,920.00	1.03
29	603233	大参林	93,400	2,923,420.00	1.02
30	002037	保利联合	300,700	2,868,678.00	1.00
31	603893	瑞芯微	31,500	2,864,610.00	1.00
32	601669	中国电建	362,900	2,856,023.00	1.00
33	600720	祁连山	229,200	2,842,080.00	0.99
34	600988	赤峰黄金	176,800	2,819,960.00	0.98
35	600195	中牧股份	226,852	2,781,205.52	0.97
36	000002	万科A	135,000	2,767,500.00	0.97
37	600399	抚顺特钢	150,600	2,695,740.00	0.94
38	002557	洽洽食品	46,600	2,652,938.00	0.93
39	688019	安集科技	11,949	2,544,181.08	0.89
40	300707	威唐工业	150,400	2,543,264.00	0.89
41	002532	天山铝业	376,100	2,455,933.00	0.86
42	601128	常熟银行	317,600	2,426,464.00	0.85
43	002129	TCL 中环	40,900	2,408,601.00	0.84
44	600383	金地集团	178,000	2,392,320.00	0.84
45	300661	圣邦股份	12,300	2,238,846.00	0.78
46	601800	中国交建	240,200	2,229,056.00	0.78
47	600938	中国海油	130,405	2,142,000.89	0.75
48	002340	格林美	214,900	1,955,590.00	0.68
49	603477	巨星农牧	80,700	1,935,186.00	0.68
50	601012	隆基绿能	28,980	1,930,937.40	0.67

51	300760	迈瑞医疗	5,800	1,816,560.00	0.63
52	000792	盐湖股份	59,200	1,773,632.00	0.62
53	300251	光线传媒	182,500	1,728,275.00	0.60
54	300398	飞凯材料	74,900	1,712,214.00	0.60
55	002271	东方雨虹	32,900	1,693,363.00	0.59
56	002756	永兴材料	11,100	1,689,531.00	0.59
57	601225	陕西煤业	78,200	1,656,276.00	0.58
58	600546	山煤国际	82,000	1,595,720.00	0.56
59	300973	立高食品	15,070	1,566,526.50	0.55
60	688533	上声电子	21,563	1,540,460.72	0.54
61	600690	海尔智家	55,900	1,535,014.00	0.54
62	000983	山西焦煤	114,500	1,533,155.00	0.54
63	688192	迪哲医药-U	55,072	1,472,625.28	0.51
64	300666	江丰电子	24,100	1,470,100.00	0.51
65	688008	澜起科技	24,134	1,462,037.72	0.51
66	600884	杉杉股份	48,100	1,429,532.00	0.50
67	300123	亚光科技	230,200	1,427,240.00	0.50
68	600089	特变电工	51,700	1,416,063.00	0.49
69	002567	唐人神	163,100	1,387,981.00	0.48
70	002865	钧达股份	14,000	1,335,040.00	0.47
71	002011	盾安环境	108,100	1,328,549.00	0.46
72	605333	沪光股份	56,700	1,309,770.00	0.46
73	601668	中国建筑	242,000	1,287,440.00	0.45
74	000933	神火股份	94,100	1,230,828.00	0.43
75	600048	保利发展	69,800	1,218,708.00	0.43
76	000915	华特达因	27,200	1,124,720.00	0.39
77	002304	洋河股份	5,900	1,080,585.00	0.38
78	001979	招商蛇口	77,900	1,046,197.00	0.37
79	688212	澳华内镜	21,168	990,662.40	0.35
80	603517	绝味食品	16,200	936,684.00	0.33
81	002906	华阳集团	19,700	892,607.00	0.31
82	003038	鑫铂股份	14,240	717,696.00	0.25
83	600071	凤凰光学	31,200	666,432.00	0.23
84	603259	药明康德	5,500	571,945.00	0.20
85	601899	紫金矿业	40,700	379,731.00	0.13
86	300782	卓胜微	2,400	324,000.00	0.11
87	688120	华海清科	1,244	309,009.60	0.11
88	603267	鸿远电子	2,100	282,093.00	0.10
89	301238	瑞泰新材	7,396	274,197.08	0.10
90	301112	信邦智能	3,851	206,158.64	0.07
91	688326	经纬恒润-W	1,366	183,139.62	0.06
92	301286	侨源股份	7,493	168,920.05	0.06

93	301175	中科环保	29,405	112,327.10	0.04
94	301239	普瑞眼科	3,113	104,752.45	0.04
95	688400	凌云光	4,566	100,132.38	0.03
96	688237	超卓航科	2,357	97,273.39	0.03
97	688072	拓荆科技-U	583	90,423.30	0.03
98	688306	均普智能	16,775	87,062.25	0.03
99	688032	禾迈股份	97	84,487.00	0.03
100	688456	有研粉材	3,396	82,217.16	0.03
101	688227	品高股份	3,643	78,033.06	0.03
102	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.02
103	600153	建发股份	5,000	65,350.00	0.02
104	688722	同益中	3,687	61,720.38	0.02
105	301110	青木股份	1,390	59,707.45	0.02
106	300274	阳光电源	600	58,950.00	0.02
107	688355	明志科技	2,710	58,021.10	0.02
108	301108	洁雅股份	1,456	57,613.92	0.02
109	688737	中自科技	1,353	55,919.49	0.02
110	688511	天微电子	1,490	55,785.60	0.02
111	688778	厦钨新能	497	55,400.59	0.02
112	688508	芯朋微	742	55,279.00	0.02
113	688268	华特气体	719	50,516.94	0.02
114	600955	维远股份	1,694	48,854.96	0.02
115	300957	贝泰妮	217	47,204.01	0.02
116	301049	超越科技	1,954	46,329.34	0.02
117	688255	凯尔达	1,468	45,361.20	0.02
118	301033	迈普医学	1,076	45,310.36	0.02
119	301063	海锅股份	1,524	42,458.64	0.01
120	002475	立讯精密	1,200	40,548.00	0.01
121	300854	中兰环保	2,026	40,276.88	0.01
122	001227	兰州银行	7,868	38,710.56	0.01
123	301029	怡合达	462	37,653.00	0.01
124	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.01
125	301053	远信工业	1,544	36,067.84	0.01
126	301068	大地海洋	1,436	34,679.40	0.01
127	688190	云路股份	435	33,821.25	0.01
128	688272	富吉瑞	1,263	33,545.28	0.01
129	600845	宝信软件	559	30,521.40	0.01
130	688038	中科通达	2,132	29,911.96	0.01
131	002460	赣锋锂业	200	29,740.00	0.01
132	603071	物产环能	1,627	29,513.78	0.01
133	301050	雷电微力	283	28,741.48	0.01
134	001213	中铁特货	5,818	28,566.38	0.01

135	301089	拓新药业	220	27,636.40	0.01
136	002179	中航光电	435	27,544.20	0.01
137	300979	华利集团	375	27,405.00	0.01
138	603122	合富中国	2,198	27,365.10	0.01
139	688408	中信博	289	26,726.72	0.01
140	603191	望变电气	1,149	26,197.20	0.01
141	001318	阳光乳业	1,142	25,249.62	0.01
142	301058	中粮工科	1,386	24,102.54	0.01
143	603206	嘉环科技	1,210	23,353.00	0.01
144	301155	海力风电	252	22,932.00	0.01
145	301266	宇邦新材	472	22,408.08	0.01
146	301302	华如科技	372	21,696.72	0.01
147	001228	永泰运	383	20,739.45	0.01
148	301162	国能日新	364	20,387.65	0.01
149	603363	傲农生物	1,100	20,361.00	0.01
150	301018	申菱环境	782	20,183.42	0.01
151	001308	康冠科技	667	19,456.39	0.01
152	301101	明月镜片	371	19,043.43	0.01
153	603176	汇通集团	1,924	18,393.44	0.01
154	603132	金徽股份	1,342	17,325.22	0.01
155	001217	华尔泰	1,239	16,776.06	0.01
156	001215	千味央厨	295	16,605.55	0.01
157	301120	新特电气	1,032	15,985.68	0.01
158	301160	翔楼新材	418	15,883.58	0.01
159	000656	金科股份	5,400	15,444.00	0.01
160	001317	三羊马	300	15,222.00	0.01
161	001216	华瓷股份	1,177	15,124.45	0.01
162	001313	粤海饲料	1,232	15,104.32	0.01
163	300982	苏文电能	317	14,886.32	0.01
164	301268	铭利达	406	14,280.77	0.00
165	603230	内蒙新华	1,140	14,261.40	0.00
166	301220	亚香股份	349	13,905.27	0.00
167	301187	欧圣电气	606	13,835.64	0.00
168	300994	久祺股份	420	13,780.20	0.00
169	603097	江苏华辰	577	13,617.20	0.00
170	300986	志特新材	370	13,616.00	0.00
171	301116	益客食品	664	13,615.02	0.00
172	603209	兴通股份	595	13,518.40	0.00
173	301200	大族数控	256	13,478.72	0.00
174	301298	东利机械	640	13,358.92	0.00
175	301135	瑞德智能	480	13,024.48	0.00
176	301207	华兰疫苗	223	12,671.36	0.00

177	301127	天源环保	1,135	12,632.55	0.00
178	300941	创识科技	599	12,608.95	0.00
179	301153	中科江南	282	12,545.19	0.00
180	688320	禾川科技	241	12,435.60	0.00
181	001266	宏英智能	247	12,298.13	0.00
182	301217	铜冠铜箔	824	12,220.30	0.00
183	301163	宏德股份	364	12,210.08	0.00
184	301219	腾远钴业	136	12,139.24	0.00
185	603215	比依股份	575	12,115.25	0.00
186	301259	艾布鲁	483	12,046.02	0.00
187	603213	镇洋发展	799	11,961.03	0.00
188	301117	佳缘科技	218	11,891.76	0.00
189	600801	华新水泥	600	11,706.00	0.00
190	300996	普联软件	386	11,406.30	0.00
191	301222	浙江恒威	386	11,355.10	0.00
192	301126	达嘉维康	662	11,340.06	0.00
193	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
194	688281	华秦科技	43	11,309.00	0.00
195	300981	中红医疗	448	11,298.56	0.00
196	301177	迪阿股份	152	11,278.40	0.00
197	301185	鸥玛软件	578	10,687.22	0.00
198	605599	莱百股份	980	10,662.40	0.00
199	301228	实朴检测	521	10,647.46	0.00
200	301288	清研环境	516	10,587.44	0.00
201	301166	优宁维	179	10,535.94	0.00
202	603219	富佳股份	528	10,517.76	0.00
203	301206	三元生物	228	10,417.32	0.00
204	301111	粤万年青	379	10,392.18	0.00
205	301168	通灵股份	230	10,368.40	0.00
206	301199	迈赫股份	322	10,316.88	0.00
207	301125	腾亚精工	370	10,311.38	0.00
208	300942	易瑞生物	443	10,233.30	0.00
209	688048	长光华芯	83	10,099.44	0.00
210	301046	能辉科技	290	10,036.90	0.00
211	301009	可靠股份	801	9,996.48	0.00
212	605598	上海港湾	553	9,987.18	0.00
213	301015	百洋医药	462	9,969.96	0.00
214	688349	三一重能	244	9,943.00	0.00
215	605566	福莱蒾特	435	9,926.70	0.00
216	001296	长江材料	403	9,905.74	0.00
217	605567	春雪食品	629	9,850.14	0.00
218	605033	美邦股份	423	9,809.37	0.00

219	301190	善水科技	410	9,729.30	0.00
220	603272	联翔股份	443	9,723.85	0.00
221	301020	密封科技	421	9,472.50	0.00
222	300993	玉马遮阳	738	9,431.64	0.00
223	605069	正和生态	608	9,326.72	0.00
224	301048	金鹰重工	843	9,281.43	0.00
225	002738	中矿资源	100	9,261.00	0.00
226	300967	晓鸣股份	507	9,131.07	0.00
227	605138	盛泰集团	723	9,023.04	0.00
228	001234	泰慕士	333	9,017.64	0.00
229	688119	中钢洛耐	1,015	8,952.30	0.00
230	300774	倍杰特	444	8,951.04	0.00
231	605580	恒盛能源	654	8,815.92	0.00
232	301138	华研精机	285	8,763.75	0.00
233	301021	英诺激光	290	8,758.00	0.00
234	300962	中金辐照	576	8,697.60	0.00
235	301151	冠龙节能	399	8,613.58	0.00
236	300966	共同药业	286	8,537.10	0.00
237	300985	致远新能	295	8,466.50	0.00
238	001288	运机集团	537	8,382.57	0.00
239	300614	百川畅银	329	8,277.64	0.00
240	688290	景业智能	159	8,093.10	0.00
241	001219	青岛食品	354	8,088.90	0.00
242	301028	东亚机械	733	7,931.06	0.00
243	301193	家联科技	288	7,819.20	0.00
244	301158	德石股份	383	7,807.42	0.00
245	300978	东箭科技	593	7,738.65	0.00
246	301045	天禄科技	335	7,728.45	0.00
247	301100	风光股份	348	7,509.84	0.00
248	301026	浩通科技	203	7,486.64	0.00
249	301098	金埔园林	307	7,444.75	0.00
250	603150	万朗磁塑	250	7,442.50	0.00
251	301004	嘉益股份	312	7,381.92	0.00
252	301040	中环海陆	241	7,357.73	0.00
253	688295	中复神鹰	187	7,010.63	0.00
254	601952	苏垦农发	500	6,995.00	0.00
255	301182	凯旺科技	294	6,985.44	0.00
256	301012	扬电科技	170	6,971.70	0.00
257	301027	华蓝集团	286	6,944.08	0.00
258	301179	泽宇智能	170	6,937.70	0.00
259	605577	龙版传媒	588	6,703.20	0.00
260	300987	川网传媒	391	6,596.17	0.00

261	301002	崧盛股份	261	6,491.07	0.00
262	300975	商络电子	738	6,472.26	0.00
263	688262	国芯科技	131	6,377.08	0.00
264	002041	登海种业	300	6,327.00	0.00
265	301062	上海艾录	523	6,103.41	0.00
266	301221	光庭信息	94	6,094.02	0.00
267	300998	宁波方正	201	6,080.25	0.00
268	300971	博亚精工	245	6,039.25	0.00
269	300943	春晖智控	383	6,016.93	0.00
270	300958	建工修复	300	5,934.00	0.00
271	300952	恒辉安防	340	5,916.00	0.00
272	002049	紫光国微	31	5,881.32	0.00
273	301011	华立科技	175	5,755.75	0.00
274	603051	鹿山新材	72	5,688.00	0.00
275	301030	仕净科技	242	5,643.44	0.00
276	688234	天岳先进	83	5,561.00	0.00
277	300972	万辰生物	430	5,559.90	0.00
278	301010	晶雪节能	218	5,526.30	0.00
279	300963	中洲特材	283	5,484.54	0.00
280	600508	上海能源	300	5,427.00	0.00
281	300950	德固特	329	5,362.70	0.00
282	300961	深水海纳	394	5,342.64	0.00
283	301025	读客文化	403	5,311.54	0.00
284	300948	冠中生态	324	5,141.88	0.00
285	301016	雷尔伟	275	5,128.75	0.00
286	301032	新柴股份	513	4,770.90	0.00
287	301036	双乐股份	205	4,608.40	0.00
288	301007	德迈仕	303	4,566.21	0.00
289	300960	通业科技	234	4,380.48	0.00
290	688173	希荻微	130	4,361.50	0.00
291	688259	创耀科技	53	4,270.21	0.00
292	300992	泰福泵业	200	4,262.00	0.00
293	301037	保立佳	193	4,215.12	0.00
294	000059	华锦股份	700	4,144.00	0.00
295	300995	奇德新材	191	4,087.40	0.00
296	300929	华骐环保	293	4,028.75	0.00
297	688265	南模生物	61	3,905.83	0.00
298	001323	慕思股份	73	3,581.38	0.00
299	688516	奥特维	13	3,470.35	0.00
300	688283	坤恒顺维	71	3,384.57	0.00
301	301073	君亭酒店	48	3,328.32	0.00
302	600223	鲁商发展	300	3,144.00	0.00

303	688171	纬德信息	131	3,071.95	0.00
304	000932	华菱钢铁	600	3,054.00	0.00
305	600025	华能水电	400	2,796.00	0.00
306	600138	中青旅	200	2,578.00	0.00
307	688718	唯赛勃	142	2,502.04	0.00
308	600746	江苏索普	200	2,316.00	0.00
309	300502	新易盛	84	2,200.80	0.00
310	605555	德昌股份	77	1,961.19	0.00
311	301069	凯盛新材	39	1,798.29	0.00
312	603639	海利尔	80	1,668.00	0.00
313	301133	金钟股份	60	1,666.20	0.00
314	002234	民和股份	100	1,594.00	0.00
315	300814	中富电路	80	1,464.00	0.00
316	301136	招标股份	72	1,436.40	0.00
317	688636	智明达	12	1,360.68	0.00
318	603048	浙江黎明	64	1,272.32	0.00
319	301096	百诚医药	15	1,185.00	0.00
320	301180	万祥科技	54	1,131.30	0.00
321	001319	铭科精技	36	1,039.32	0.00
322	600409	三友化工	100	819.00	0.00
323	301078	孩子王	51	747.66	0.00
324	301066	万事利	50	713.00	0.00
325	002391	长青股份	100	710.00	0.00
326	301052	果麦文化	20	658.60	0.00
327	301118	恒光股份	15	645.45	0.00
328	300968	格林精密	62	561.72	0.00
329	600376	首开股份	100	491.00	0.00
330	300997	欢乐家	28	374.08	0.00
331	002724	海洋王	20	248.60	0.00
332	301091	深城交	6	163.80	0.00
333	301039	中集车辆	11	119.13	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	002371	北方华创	10,441,560.80	3.11
2	002714	牧原股份	8,267,680.62	2.46
3	600765	中航重机	8,125,404.40	2.42
4	603596	伯特利	8,059,377.00	2.40
5	605333	沪光股份	7,469,655.00	2.23
6	603260	合盛硅业	7,413,973.30	2.21

7	601669	中国电建	7,179,501.00	2.14
8	300969	恒帅股份	6,860,832.40	2.05
9	688536	思瑞浦	6,421,126.78	1.91
10	300014	亿纬锂能	5,820,237.00	1.73
11	600025	华能水电	5,756,392.00	1.72
12	688019	安集科技	5,498,895.86	1.64
13	002466	天齐锂业	5,424,412.00	1.62
14	301099	雅创电子	5,397,404.00	1.61
15	002409	雅克科技	5,050,883.00	1.51
16	002532	天山铝业	4,947,346.00	1.47
17	603348	文灿股份	4,932,928.00	1.47
18	000002	万科A	4,916,460.00	1.47
19	600660	福耀玻璃	4,872,848.00	1.45
20	000876	新希望	4,695,232.00	1.40

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	002049	紫光国微	11,084,249.45	3.30
2	300969	恒帅股份	9,861,884.00	2.94
3	300750	宁德时代	9,688,458.00	2.89
4	605333	沪光股份	8,406,498.00	2.51
5	002594	比亚迪	8,105,657.00	2.42
6	603260	合盛硅业	7,881,342.00	2.35
7	002648	卫星化学	7,233,346.20	2.16
8	688636	智明达	6,802,110.37	2.03
9	600025	华能水电	6,204,536.00	1.85
10	688533	上声电子	6,059,450.97	1.81
11	603639	海利尔	6,018,009.86	1.79
12	600521	华海药业	5,960,395.00	1.78
13	603259	药明康德	5,789,522.00	1.73
14	601012	隆基绿能	5,766,803.31	1.72
15	603501	韦尔股份	5,587,465.00	1.67
16	688536	思瑞浦	5,089,406.70	1.52
17	601838	成都银行	5,085,868.00	1.52
18	603032	德新交运	4,772,259.00	1.42
19	603348	文灿股份	4,674,127.00	1.39
20	002179	中航光电	4,673,579.89	1.39

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	554,503,598.24
卖出股票收入（成交）总额	560,194,054.23

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 本基金投资股指期货的投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

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 本期国债期货投资评价

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券备选库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	114,462.73
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	255,772.55
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	370,235.28

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比 例 (%)	持有份额	占总份额比 例 (%)
8,528	10,255.47	7,468,554.79	8.54	79,990,068.43	91.46

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	56,093.32	0.0641

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

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2012 年 4 月 16 日） 基金份额总额	334,825,290.98
本报告期期初基金份额总额	90,842,808.18
本报告期基金总申购份额	9,320,705.31
减：本报告期基金总赎回份额	12,704,890.27
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	87,458,623.22

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人的重大人事变动：

报告期内，公司无重大人事变动。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的，与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本投资期内投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未改聘为本基金审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
光大证券	2	561,885,231.13	50.74	513,705.50	50.74	-
华创证券	1	139,793,900.90	12.62	127,391.79	12.58	-
天风证券	1	66,239,703.24	5.98	60,418.46	5.97	-
长江证券	1	59,965,149.27	5.42	55,019.74	5.43	-
海通证券	1	53,164,946.92	4.80	48,980.73	4.84	-
安信证券	1	44,426,508.09	4.01	40,754.41	4.03	-
招商证券	1	26,980,078.24	2.44	24,637.95	2.43	-
广发证券	1	24,916,340.27	2.25	22,708.72	2.24	-
中信证券	1	24,576,337.00	2.22	22,394.22	2.21	-
中信建投证券	1	23,051,787.85	2.08	21,115.26	2.09	-
国信证券	1	21,413,254.77	1.93	19,655.50	1.94	-
中金公司	1	21,206,850.64	1.92	19,487.78	1.92	-
银河证券	1	19,445,576.16	1.76	17,719.12	1.75	-
兴业证券	1	14,752,283.81	1.33	13,442.83	1.33	-
东方财富证券	1	5,480,789.60	0.49	4,994.49	0.49	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
瑞信方正	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-

上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源 证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
中泰证券	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

的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；

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

2) 选择交易单元的程序：

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
光大证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	21,300,000.00	100.00	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-

长江证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投 证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
东方财富 证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
瑞信方正	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源 证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	鹏华基金管理有限公司关于暂停客服电话服务的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 01 月 01 日
2	鹏华基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监	2022 年 01 月 01 日

	具相关会计准则的公告	会基金电子披露网站	
3	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与浙商银行股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 01 月 17 日
4	鹏华价值精选股票型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 01 月 21 日
5	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 01 月 21 日
6	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与民生证券股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 01 月 24 日
7	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与第一创业证券股份有限公司申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 02 月 10 日
8	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与北京雪球基金销售有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 02 月 21 日
9	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与财通证券股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 03 月 01 日
10	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中信建投证券股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 03 月 08 日
11	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与光大证券股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 03 月 14 日
12	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与宁波银行股份有限公司易管家平台申购（不含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 03 月 15 日
13	鹏华价值精选股票型证券投资基金 2021 年年度报告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 03 月 30 日
14	鹏华价值精选股票型证券投资基金更新的招募说明书	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会	2022 年 04 月 13 日

		会基金电子披露网站	
15	鹏华价值精选股票型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 04 月 13 日
16	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与广发证券股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 04 月 19 日
17	鹏华价值精选股票型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 04 月 21 日
18	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与宁波银行股份有限公司易管家平台申购（不含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 04 月 21 日
19	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与西部证券股份有限公司定期定额申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 04 月 25 日
20	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 04 月 27 日
21	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与江苏张家港农村商业银行股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 04 月 28 日
22	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 04 月 30 日
23	鹏华基金管理有限公司关于终止北京植信基金销售有限公司办理本公司旗下基金相关销售业务的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 05 月 06 日
24	鹏华基金管理有限公司关于终止北京唐鼎耀华基金销售有限公司办理本公司旗下基金相关销售业务的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 05 月 13 日
25	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与北京度小满基金销售有限公司相关费率优惠活动的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 05 月 30 日
26	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与上海好买基金销售有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 06 月 06 日
27	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中航证券有限公司申购	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会	2022 年 06 月 18 日

	(含定期定额申购) 费率优惠活动的公告	会基金电子披露网站	
--	---------------------	-----------	--

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)《鹏华价值精选股票型证券投资基金基金合同》；
- (二)《鹏华价值精选股票型证券投资基金托管协议》；
- (三)《鹏华价值精选股票型证券投资基金 2022 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

2022 年 8 月 30 日