

鹏华金城灵活配置混合型证券投资基金 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	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§ 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	8
3.3 其他指标	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	45
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
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	51
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	51

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	51
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	51
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	51
7.12 投资组合报告附注	52
§ 8 基金份额持有人信息	53
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	53
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	53
§ 9 开放式基金份额变动	54
§ 10 重大事件揭示	54
10.1 基金份额持有人大会决议	54
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	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	54
10.4 基金投资策略的改变	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	55
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	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	55
10.8 其他重大事件	57
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	59
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	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	60
§ 12 备查文件目录	60
12.1 备查文件目录	60
12.2 存放地点	60
12.3 查阅方式	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华金城灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	鹏华金城混合
基金主代码	002714
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年6月7日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	566,805,978.54份
基金合同存续期	不定期

注：无。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在科学严谨的资产配置框架下，精选股票、债券等投资标的，力争基金资产长期稳定的增值。
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 本基金通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘优质的公司，构建股票投资组合。核心思路在于：1）自上而下地分析行业的增长前景、行业结构、商业模式、竞争要素等分析把握其投资机会；2）自下而上地评判企业的核心竞争力、管理层、治理结构等以及其所提供的产品和服务是否契合未来行业增长的大趋势，对企业基本面和估值水平进行综合的研判，深度挖掘优质的个股。</p> <p>（1）自上而下的行业遴选 本基金将自上而下地进行行业遴选，重点关注行业增长前景、行业利润前景和行业成功要素。对行业增长前景，主要分析行业的外部发展环境、行业的生命周期以及行业波动与经济周期的关系等；对行业利润前景，主要分析行业结构，特别是业内竞争的方式、业内竞争的激烈程度、以及业内厂商的谈判能力等。基于对行业结构的分析形成对业内竞争的关键成功要素的判断，为预测企业经营环境的变化建立起扎实的基础。</p> <p>（2）自下而上的个股选择 本基金通过定性和定量相结合的方法进行自下而上的个股选择，对企业基本面和估值水平进行综合的研判，精选优质个股。</p> <p>1）定性分析 本基金通过以下两方面标准对股票的基本面进行研究分析并筛选出优质的公司：一方面为竞争力分析，通过对公司竞争策略和核心竞争力的分析，选择具有可持</p>

续竞争优势的公司或未来具有广阔成长空间的公司。就公司竞争策略，基于行业分析的结果判断策略的有效性、策略的实施支持和策略的执行成果；就核心竞争力，分析公司的现有核心竞争力，并判断公司能否利用现有的资源、能力和定位取得可持续竞争优势。另一方面是管理层分析，通过着重考察公司的管理层以及管理制度，选择具有良好治理结构、管理水平较高的优质公司。

2) 定量分析 本基金通过对公司定量的估值分析，挖掘优质的投资标的。通过对估值方法的选择和估值倍数的比较，选择股价相对低估的股票。就估值方法而言，基于行业的特点确定对股价最有影响力的关键估值方法（包括 PE、PEG、PB、PS、EV/EBITDA 等）；就估值倍数而言，通过业内比较、历史比较和增长性分析，确定具有上升基础的股价水平。

（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。

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。

（1）久期策略 久期管理是债券投资的重要考量因素，本基金将采用以“目标久期”为中心、自上而下的组合久期管理策略。

（2）收益率曲线策略 收益率曲线的形状变化是判断市场整体走向的一个重要依据，本基金将据此调整组合长、中、短期债券的搭配，并进行动态调整。

（3）骑乘策略 本基金将采用基于收益率曲线分析对债券组合进行适时调整的骑乘策略，以达到增强组合的持有期收益的目的。

（4）息差策略 本基金将采用息差策略，以达到更好地利用杠杆放大债券投资的收益的目的。

（5）个券选择策略 本基金将根据单个债券到期收益率相对于市场收益率曲线的偏离程度，结合信用等级、流动性、选择权条款、税赋特点等因素，确定其投资价值，选择定价合理或价值被低估的债券进行投资。

（6）信用策略 本基金通过主动承担适度的信用风险来获取信用溢价，根据内、外部信用评级结果，结合对类似债券信用利差的分析以及对未来信用利差走势的判断，选择信用利差被高估、未来信用利差可能下降的信用债进行投资。

4、权证投资策略 本基金通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型及价值挖掘策略、价差策略、双向权证策略等寻求权证的合理估值水平，追求稳定的当期收益。

5、中小企业私募债投资策略 中小企业私募债券是在中国境内以非公开方式发行和转让，约定在一定期限还本付息的公司债券。由于其非公开性及条款可协商性，普遍具有较高收益。本基金将深入研究发行人资信及公司运营情况，合理合规合格地进行中小企业私募债券投资。本基金在投资过程中密切监控债券信用等级或发行人信用等级变化情况，尽力规避风险，并获取超额收益。

6、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。 7、衍生品投资策略为更好地实现投资目标，本基金在注重风险管理的前提下，以套期保值为目的，适度运用股指期货、国债期货等金融衍生品。本基金利用金融衍生品合约流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点，提高投资组合的运作效率。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×55%+中证综合债指数收益率×45%
风险收益特征	本基金属于混合型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金，低于股票型基金，属于证券投资基金中中高风险、中高预期收益的品种。

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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	高永杰	许俊
	联系电话	0755-81395402	95566
	电子邮箱	xxpl@phfund.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4006788999	95566
传真		0755-82021126	010-66594942
注册地址		深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		518048	100818
法定代表人		何如	刘连舸

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
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	-12,145,520.64

本期利润	-3,542,718.63
加权平均基金份额本期利润	-0.0060
本期加权平均净值利润率	-0.46%
本期基金份额净值增长率	-0.30%
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	158,903,374.18
期末可供分配基金份额利润	0.2803
期末基金资产净值	744,161,760.43
期末基金份额净值	1.313
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	28.48%

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

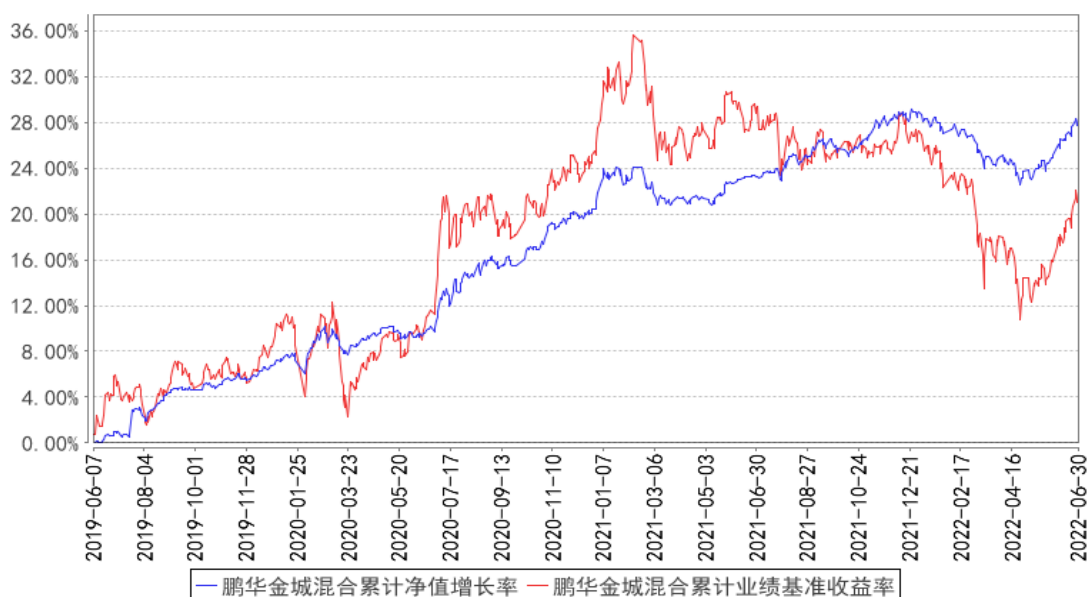
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.82%	0.30%	5.22%	0.59%	-2.40%	-0.29%
过去三个月	3.06%	0.32%	4.02%	0.78%	-0.96%	-0.46%
过去六个月	-0.30%	0.30%	-4.11%	0.80%	3.81%	-0.50%
过去一年	4.20%	0.26%	-5.62%	0.68%	9.82%	-0.42%
过去三年	27.64%	0.27%	17.14%	0.69%	10.50%	-0.42%

自基金合同生效起至今	28.48%	0.27%	22.00%	0.69%	6.48%	-0.42%
------------	--------	-------	--------	-------	-------	--------

注：业绩比较基准=沪深 300 指数收益率×55%+中证综合债指数收益率×45%

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

鹏华金城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 2019 年 06 月 07 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		
方昶	基金经理	2019-06-19	-	8 年	方昶先生，国籍中国，经济学硕士，8 年证券从业经验。曾任中国工商银行资产管理部投资经理；2016 年 12 月加盟鹏华基金管理有限公司，现担任债券投资一部基金经理。2018 年 07 月至 2020 年 02 月担任鹏华丰腾债券型证券投资基金基金经理，2018 年 10 月至今担任鹏华信用增利债券型证券投资基金基金经理，2018 年 12 月至 2020 年 02 月担任鹏华丰华债券型证券投资基金基金经理，2019 年 01 月至今担任鹏华丰恒债券型证券投资基金基金经理，2019 年 03 月至今担任鹏华安益增强混合型证券投资基金基金经理，2019 年 06 月至今担任鹏华金城灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2019 年 09 月至 2021 年 01 月担任鹏华中短债 3 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理，2019 年 09 月至今担任鹏华丰享债券型证券投资基金基金经理，2020 年 12 月至今担任鹏华安润混合型证券投资基金基金经理，2021 年 06 月至今担任鹏华弘盛灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2022 年 07 月至今担任鹏华永泽 18 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理，方昶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。
范晶伟	基金经理	2021-08-07	-	6 年	范晶伟先生，国籍中国，金融硕士，6 年证券从业经验。2016 年 07 月加盟鹏华基金管理有限公司，历任固定收益部助理债券研究员、债券研究员、固定收益研究部高级债券研究员、基金经理助理，现担任混合资产投资部基金经理。2021 年 08 月至今担任鹏华金城灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2021 年 08 月至今担任鹏华弘泰灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2021 年 08 月至今担任鹏华丰盛稳固收益债券型证券投资基金基金经理，2021 年 11 月至今担任鹏华安源 5 个月持有期混合型证券投资基金基金经理，范晶伟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。

弹。从整体上半年来看，主要的宽基指数都出现了明显的下挫。1-4 月市场遇到 3 大风险，第一是海外高通胀带来的加息超预期，整体的加息节奏持续加快；第二是俄乌战争带来的全球政治格局以及通胀的担忧；第三是国内疫情出现超预期的影响，整体经济在 2 季度面临了较为巨大的压力。但是随着 5 月疫情得到管控，国内刺激政策力度明显加大，尤其是汽车领域重新推出购置税减免，同时俄乌战争带动海外的光伏和储能需求大幅提升，新能源和汽车领域出现明显的景气超预期，两大领域带动 A 股出现明显的反弹。组合方面，我们在年初做了一定的风险分散化配置，但是由于整体市场的跌幅相对较为超预期，叠加由于市场出现踩踏，受流动性影响较大的中小盘股跌幅更大，组合在上半年也遇到了较大幅度的回撤。但是在 5 月，我们积极调整持仓，加大了对于新能源和汽车领域的配置，整体组合出现了较大幅度的反弹。

债券市场方面，由于国内疫情的突发以及宽信用不畅，国内债券利率，尤其是短端利率出现了明显的下行。整体债券市场贡献了较好的回报，我们整体保持中性久期，阶段性参与了债券市场的波段交易。

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-0.30%，同期业绩比较基准增长率为-4.11%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从上半年来看，外需明显好于内需，国内受到疫情的冲击以及地产预期的大幅下降，整体的终端需求呈现明显的回落，而海外在疫情放开叠加高通胀的影响下，对国内出口形成较为明显的提振。从下半年来看，我们认为经济继续呈现国内内需持续改善，但外需持续走弱的环境。内需方面，虽然疫情大概率延续反复，但是我们认为国内在疫情防控上经验也在逐步提升，政策层面也会持续发力，经济复苏虽然波澜万丈，但是趋势不变；外需层面，联储大概率 7 月加息 75BP，整体基准利率追赶上经济增速和通胀，后续加息的节奏大概率会明显放缓，但利率上升后对经济的抑制作用也将更加明显，需求回落+供给释放，大宗商品价格很难再出现过去 2 年的暴涨，我们认为在今年 Q4 之后，海外通胀压力也会逐步放缓，因此外需大概率走弱，但流动性快速收缩的预期逐步进入拐点。因此我们可能看到流动性预期改善和国内内需层面基本面改善的环境，整体权益市场还存在结构性机会。我们更多关注下半年内需的恢复，包括线下的消费以及出行，同时也关注大宗商品价格回落下，内需向上带动的先进制造业的结构性机会。我们会继续关注汽车零部件、汽车电子、储能以及半导体国产化的相关制造业机会。

债券市场方面，我们认为经济最差的时间过去，整体债券市场的环境明显弱于上半年，但是我们认为经济的复苏会波动逐步向上，同时本轮经济复苏的速率可能相对偏慢，因此整体货币政策大幅收紧的概率相对不大，我们认为债券市场可能会有调整，但是整体调整空间有限。我们更

多关注严控信用风险下，结构性的信用债机会。

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 158,903,374.18 元，期末基金份额净值 1.313 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，中国银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 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：鹏华金城灵活配置混合型证券投资基金

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	21,817,973.19	11,110,932.50
结算备付金		14,509,822.31	21,776,561.42
存出保证金		108,836.11	3,420,939.64
交易性金融资产	6.4.7.2	665,607,635.27	696,850,562.59
其中：股票投资		159,253,692.00	141,506,131.15
基金投资		-	-
债券投资		506,353,943.27	555,344,431.44
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	-	3,000,000.00
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		62,544,132.51	27,309,078.55

应收股利		-	-
应收申购款		541.22	463.63
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	5,934,421.17
资产总计		764,588,940.61	769,402,959.50
负债和净资产	附注号	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		19,025,605.02	106.02
应付管理人报酬		375,299.61	386,763.84
应付托管费		62,549.94	64,460.62
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		50,701.79	31,997.05
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	913,023.82	959,634.29
负债合计		20,427,180.18	1,442,961.82
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	566,805,978.54	582,969,280.96
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	177,355,781.89	184,990,716.72
净资产合计		744,161,760.43	767,959,997.68
负债和净资产总计		764,588,940.61	769,402,959.50

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.313 元，基金份额总额 566,805,978.54 份。

6.2 利润表

会计主体：鹏华金城灵活配置混合型证券投资基金

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		-733,468.48	10,144,202.28
1. 利息收入		545,339.67	7,458,300.24
其中：存款利息收入	6.4.7.13	163,778.16	204,365.78

债券利息收入		-	6,012,656.26
资产支持证券利息收入		-	203,908.32
买入返售金融资产收入		381,561.51	1,037,369.88
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-10,342,330.23	13,654,428.55
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-22,158,905.41	14,484,985.00
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	10,509,842.65	-1,449,623.41
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	251,951.78
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	167,526.67	-
股利收益	6.4.7.19	1,139,205.86	367,115.18
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	8,602,802.01	-10,977,480.64
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	460,720.07	8,954.13
减：二、营业总支出		2,809,250.15	3,987,419.96
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,273,666.46	1,871,778.16
2. 托管费	6.4.10.2.2	378,944.42	311,963.02
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		-	439,759.35
其中：卖出回购金融资产支出		-	439,759.35
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		26,168.78	16,986.87
8. 其他费用	6.4.7.23	130,470.49	1,346,932.56
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-3,542,718.63	6,156,782.32
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-3,542,718.63	6,156,782.32

五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-3,542,718.63	6,156,782.32

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：鹏华金城灵活配置混合型证券投资基金

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）	582,969,280.96	-	184,990,716.72	767,959,997.68
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	582,969,280.96	-	184,990,716.72	767,959,997.68
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-16,163,302.42	-	-7,634,934.83	-23,798,237.25
（一）、综合收益总额	-	-	-3,542,718.63	-3,542,718.63
（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）	-16,163,302.42	-	-4,092,216.20	-20,255,518.62
其中：1. 基金申购	184,102,562.49	-	55,866,753.68	239,969,316.17

款				
2. 基金赎回款	-200,265,864.91	-	-59,958,969.88	-260,224,834.79
(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)	566,805,978.54	-	177,355,781.89	744,161,760.43
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)	525,422,822.60	-	158,602,280.52	684,025,103.12
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)	525,422,822.60	-	158,602,280.52	684,025,103.12
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-121,081,818.61	-	-29,873,194.68	-150,955,013.29

(一)、综合收益总额	-	-	6,156,782.32	6,156,782.32
(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)	-121,081,818.61	-	-36,029,977.00	-157,111,795.61
其中：1. 基金申购款	388,577,772.32	-	123,641,937.64	512,219,709.96
2. 基金赎回款	-509,659,590.93	-	-159,671,914.64	-669,331,505.57
(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)	404,341,003.99	-	128,729,085.84	533,070,089.83

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

鹏华金城灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)是由鹏华金城保本混合型证券投资基金(以下简称“鹏华金城保本混合基金”)基金转型而来。根据本基金的基金管理人于 2019 年 5 月 27 日发布的《鹏华金城保本混合型证券投资基金保本周期到期安排及转型为鹏华金城灵活配置混合型证券投资基金相关业务规则的公告》和《关于修订〈鹏华金城保本混合型证券投资基金基金合同〉的公告》，鹏华金城保本混合基金的基金管理人经与基金托管人协商一致，自 2019 年 6 月 7 日起，鹏华金城保本混合基金按基金合同的约定转型为“鹏华金城灵活配置混合型证券投资基金”，《鹏华金城保本混合型证券投资基金基金合同》同日失效，《鹏华金城灵活配置混合型证券投资基金基金合同》同日生效，原鹏华金城保本混合基金基金份额转为本基金基金份额，基金份额总额为 648,178,914.75 份。鹏华金城保本混合基金转型后，基金托管人、基金登记机构及基金代码保持不变；转型后基金的投资目标、投资范围、投资策略以及基金费率等按照《鹏华金城灵活配置混合型证券投资基金基金合同》相关条款执行。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华金城灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围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(含国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券、中小企业私募债等)、货币市场工具(包括同业存单、大额存单等)、权证、资产支持证券、国债期货、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)。本基金的投资组合比例为：股票(含存托凭证)资产占基金资产的比例为 0%—95%；每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本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×55%+中证综合债指数收益率×45%。

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》、《鹏华金城灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 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、交易性金融资产-债券投资、买入返售金融资产、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 2,476.62 元、11,416.39 元、38.00 元、5,934,445.09 元、-13,954.93 元、-5,934,421.17 元、-759,634.16 元和 759,634.16 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	21,817,973.19
等于：本金	21,816,565.64
加：应计利息	1,407.55
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	21,817,973.19

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	144,870,421.68	-	159,253,692.00	14,383,270.32	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	85,636,909.66	1,191,558.48	87,415,505.46	587,037.32
	银行间市场	410,725,078.76	5,488,437.81	418,938,437.81	2,724,921.24
	合计	496,361,988.42	6,679,996.29	506,353,943.27	3,311,958.56
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	641,232,410.10	6,679,996.29	665,607,635.27	17,695,228.88	

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	7.52
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	813,837.35

其中：交易所市场	812,462.35
银行间市场	1,375.00
应付利息	-
预提费用	99,178.95
合计	913,023.82

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	582,969,280.96	582,969,280.96
本期申购	184,102,562.49	184,102,562.49
本期赎回（以“-”号填列）	-200,265,864.91	-200,265,864.91
- 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	566,805,978.54	566,805,978.54

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	174,153,915.20	10,836,801.52	184,990,716.72
本期利润	-12,145,520.64	8,602,802.01	-3,542,718.63
本期基金份额交易产生的变动数	-3,105,020.38	-987,195.82	-4,092,216.20
其中：基金申购款	54,774,787.13	1,091,966.55	55,866,753.68
基金赎回款	-57,879,807.51	-2,079,162.37	-59,958,969.88
本期已分配利润	-	-	-
本期末	158,903,374.18	18,452,407.71	177,355,781.89

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	44,199.04
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	118,749.66	
其他	829.46	

合计	163,778.16
----	------------

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	-22,158,905.41
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	-22,158,905.41

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	1,067,553,998.46
减：卖出股票成本总额	1,086,626,240.32
减：交易费用	3,086,663.55
买卖股票差价收入	-22,158,905.41

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

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	7,994,971.14
债券投资收益——买卖债券(债转股及债券到期兑付)差价收入	2,514,871.51
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	10,509,842.65

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	474,076,314.72
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	463,487,620.05
减：应计利息总额	8,064,874.80
减：交易费用	8,948.36
买卖债券差价收入	2,514,871.51

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

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2022年1月1日至2022年6月30日
股指期货投资收益	167,526.67

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	1,139,205.86
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	1,139,205.86

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	8,541,164.28
股票投资	9,478,572.21
债券投资	-937,407.93
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	61,637.73
权证投资	-
期货投资	61,637.73
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	8,602,802.01

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	460,618.33
基金转换费收入	101.74

合计	460,720.07
----	------------

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	39,671.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费用	12,691.54
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	130,470.49

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
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	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	33,153,298.57	1.54	50,327.23	0.01

6.4.10.1.2 债券交易

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	占当期债券 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)
国信证券	2,084,967.73	1.83	-	-

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)
国信证券	136,000,000.00	3.59	-	-

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	26,897.74	1.49	10,733.61	1.32
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	40.82	0.01	40.82	0.01

注：(1) 佣金的计算公式

$$\text{上海/深圳证券交易所的交易佣金} = \text{股票买(卖)成交金额} \times \text{佣金比率} - \text{买(卖)经手费} - \text{买(卖)}$$

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	2,273,666.46	1,871,778.16
其中:支付销售机构的客户维护 费	62,295.39	38,403.84

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0.60%,逐日计提,按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×0.60%÷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	378,944.42	311,963.02

注:支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值0.10%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×0.10%/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 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
中国银行	21,817,973.19	44,199.04	14,215,041.10	102,957.98

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期及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(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 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
301112	信邦智能	2022年6月20	6个月	新股流通受限	27.53	45.04	399	10,984.47	17,970.96	-

		日									
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		-
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	334	15,073.42	18,072.74		-
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	57,324	218,977.68	218,977.68		-
301175	中科环保	2022年 6月30日	6个月	新股流 通受限	3.82	3.82	6,370	24,333.40	24,333.40		-
301187	欧圣电气	2022年 4月13日	6个月	新股流 通受限	21.33	22.54	876	18,685.08	19,745.04		-
301200	大族数控	2022年 2月18日	6个月	新股流 通受限	76.56	51.92	474	36,289.44	24,610.08		-
301206	三元生物	2022年 1月26日	6个月	新股流 通受限	109.30	45.69	464	33,773.70	21,200.16		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	536	30,487.68	30,241.12		-
301217	铜冠铜箔	2022年 1月20日	6个月	新股流 通受限	17.27	14.83	1,954	33,745.58	28,977.82		-

		日									
301220	亚香股份	2022年6月15日	6个月	新股流通受限	35.98	39.15	285	10,254.30	11,157.75		-
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	2,213	42,445.34	70,970.91		-
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	5,172	174,037.80	174,037.80		-
301239	普瑞眼科	2022年6月22日	6个月	新股流通受限	33.65	33.65	575	19,348.75	19,348.75		-
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	517	13,886.62	24,335.19		-
301286	侨源股份	2022年6月6日	6个月	新股流通受限	16.91	19.79	784	13,257.44	15,515.36		-
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	466	24,245.98	26,291.72		-
688052	纳芯微	2022年4月14日	6个月	新股流通受限	230.00	350.81	2,001	460,230.00	701,970.81		-
688237	超卓	2022年	6个月	新股流	41.27	41.27	2,891	119,311.57	119,311.57		-

	航科	6月24日		通受限						
688400	凌云光	2022年6月27日	1个月内(含)	新股未上市	21.93	21.93	13,111	287,524.23	287,524.23	-

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

本基金为混合型基金。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(含国债，金融债，企业债，公司债，央行票据，中期票据，短期融资券，次级债，可转换债券，可交换债券，中小企业私募债等)，货币市场工具(包括同业存单，大额存单等)，权证，资产支持证券，国债期货，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)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。下列表格列示中不含国债、央行票据、政策性金融债券等非信用债券投资。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
A-1	10,194,364.93	20,088,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	183,059,869.03	187,393,500.00
合计	193,254,233.96	207,481,500.00

注：上述评级均由经中国证监会核准从事证券市场资信评级业务的评级机构作出。

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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	38,952,000.00
未评级	-	-
合计	-	38,952,000.00

注：上述评级均由经中国证监会核准从事证券市场资信评级业务的评级机构作出。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	124,645,058.93	118,232,466.40
AAA 以下	55,863,435.57	39,237,465.04
未评级	50,912,343.57	40,337,000.00
合计	231,420,838.07	197,806,931.44

注：上述评级均由经中国证监会核准从事证券市场资信评级业务的评级机构作出。

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 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时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行

持续的监测和分析。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股股票不得超过该上市公司可流通股股票的 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股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注“期末本基金持有的流通受限证券”。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	21,817,973.19	-	-	-	21,817,973.19
结算备付金	14,509,822.31	-	-	-	14,509,822.31
存出保证金	108,836.11	-	-	-	108,836.11
交易性金融资产	245,809,616.15	244,999,146.79	15,545,180.33	159,253,692.00	665,607,635.27
应收申购款	-	-	-	541.22	541.22
应收清算款	-	-	-	62,544,132.51	62,544,132.51
资产总计	282,246,247.76	244,999,146.79	15,545,180.33	221,798,365.73	764,588,940.61
负债					
应付赎回款	-	-	-	19,025,605.02	19,025,605.02
应付管理人报酬	-	-	-	375,299.61	375,299.61
应付托管费	-	-	-	62,549.94	62,549.94
应交税费	-	-	-	50,701.79	50,701.79
其他负债	-	-	-	913,023.82	913,023.82
负债总计	-	-	-	20,427,180.18	20,427,180.18
利率敏感度缺口	282,246,247.76	244,999,146.79	15,545,180.33	201,371,185.55	744,161,760.43
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	11,110,932.50	-	-	-	11,110,932.50
结算备付金	21,776,561.42	-	-	-	21,776,561.42
存出保证金	3,420,939.64	-	-	-	3,420,939.64
交易性金融资产	297,538,500.00	223,354,273.94	34,451,657.50	141,506,131.15	696,850,562.59
买入返售金融资产	3,000,000.00	-	-	-	3,000,000.00
应收申购款	-	-	-	463.63	463.63
应收清算款	-	-	-	27,309,078.55	27,309,078.55
其他资产	-	-	-	5,934,421.17	5,934,421.17
资产总计	336,846,933.56	223,354,273.94	34,451,657.50	174,750,094.50	769,402,959.50
负债					
应付赎回款	-	-	-	106.02	106.02
应付管理人报酬	-	-	-	386,763.84	386,763.84
应付托管费	-	-	-	64,460.62	64,460.62
应交税费	-	-	-	31,997.05	31,997.05
其他负债	-	-	-	959,634.29	959,634.29
负债总计	-	-	-	1,442,961.82	1,442,961.82
利率敏感度缺口	336,846,933.56	223,354,273.94	34,451,657.50	173,307,132.68	767,959,997.68

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有债券资产的利率风险状况测算的理论变动值对基金资产净值的影响金额。		
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。		
	此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
分析	市场利率下降 25 个基点	1,688,242.01	2,296,267.09
	市场利率上升 25 个基点	-1,671,553.14	-2,268,303.33

注：无。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.2.1 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）资产占基金资产的比例为 0%-95%；每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本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。如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

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	159,253,692.00	21.40	141,506,131.15	18.43
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	27,679,403.54	3.72	27,805,931.44	3.62
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	186,933,095.54	25.12	169,312,062.59	22.05

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%	5,815,624.16	5,821,136.78
	业绩比较基准下降 5%	-5,815,624.16	-5,821,136.78

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	183,858,259.64
第二层次	480,647,775.80
第三层次	1,101,599.83
合计	665,607,635.27

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	159,253,692.00	20.83
	其中：股票	159,253,692.00	20.83
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	506,353,943.27	66.23
	其中：债券	506,353,943.27	66.23
	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	36,327,795.50	4.75
8	其他各项资产	62,653,509.84	8.19
9	合计	764,588,940.61	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	2,448,461.00	0.33
B	采矿业	1,244,970.00	0.17
C	制造业	87,004,018.31	11.69

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	4,418,586.00	0.59
F	批发和零售业	4,741,020.80	0.64
G	交通运输、仓储和邮政业	11,777,077.65	1.58
H	住宿和餐饮业	1,780,070.00	0.24
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,264,955.41	0.30
J	金融业	30,055,246.72	4.04
K	房地产业	2,816,298.00	0.38
L	租赁和商务服务业	5,350,048.00	0.72
M	科学研究和技术服务业	76,823.46	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	383,100.10	0.05
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,715,566.55	0.23
R	文化、体育和娱乐业	3,177,450.00	0.43
S	综合	-	-
	合计	159,253,692.00	21.40

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	600031	三一重工	278,800	5,313,928.00	0.71
2	300059	东方财富	169,600	4,307,840.00	0.58
3	000001	平安银行	277,400	4,155,452.00	0.56
4	000776	广发证券	192,700	3,603,490.00	0.48
5	601888	中国中免	14,500	3,377,485.00	0.45
6	000596	古井贡酒	13,400	3,345,444.00	0.45
7	600519	贵州茅台	1,600	3,272,000.00	0.44
8	601628	中国人寿	104,500	3,247,860.00	0.44
9	300144	宋城演艺	207,000	3,177,450.00	0.43
10	600048	保利发展	161,300	2,816,298.00	0.38
11	002594	比亚迪	8,300	2,767,967.00	0.37
12	601111	中国国航	211,400	2,454,354.00	0.33
13	002714	牧原股份	44,300	2,448,461.00	0.33
14	603517	绝味食品	39,900	2,307,018.00	0.31
15	600029	南方航空	313,200	2,289,492.00	0.31
16	000932	华菱钢铁	449,100	2,285,919.00	0.31

17	601318	中国平安	48,200	2,250,458.00	0.30
18	601066	中信建投	76,400	2,208,724.00	0.30
19	000921	海信家电	154,000	2,183,720.00	0.29
20	000568	泸州老窖	8,800	2,169,552.00	0.29
21	002459	晶澳科技	27,020	2,131,878.00	0.29
22	601012	隆基绿能	30,720	2,046,873.60	0.28
23	600702	舍得酒业	10,000	2,039,900.00	0.27
24	600600	青岛啤酒	19,100	1,984,872.00	0.27
25	002027	分众传媒	293,100	1,972,563.00	0.27
26	600004	白云机场	129,900	1,936,809.00	0.26
27	002475	立讯精密	56,500	1,909,135.00	0.26
28	601669	中国电建	237,400	1,868,338.00	0.25
29	002120	韵达股份	108,900	1,857,834.00	0.25
30	605333	沪光股份	79,700	1,841,070.00	0.25
31	600009	上海机场	32,400	1,837,080.00	0.25
32	000733	振华科技	13,100	1,781,207.00	0.24
33	600754	锦江酒店	28,300	1,780,070.00	0.24
34	600958	东方证券	172,032	1,756,446.72	0.24
35	605123	派克新材	12,200	1,716,784.00	0.23
36	603348	文灿股份	31,300	1,677,680.00	0.23
37	603501	韦尔股份	9,600	1,661,088.00	0.22
38	600872	中炬高新	47,800	1,654,358.00	0.22
39	600984	建设机械	250,640	1,624,147.20	0.22
40	601688	华泰证券	112,000	1,590,400.00	0.21
41	601166	兴业银行	78,300	1,558,170.00	0.21
42	000858	五粮液	7,700	1,554,861.00	0.21
43	600036	招商银行	36,800	1,552,960.00	0.21
44	600859	王府井	59,600	1,548,408.00	0.21
45	601100	恒立液压	24,800	1,530,656.00	0.21
46	300015	爱尔眼科	34,000	1,522,180.00	0.20
47	601868	中国能建	639,700	1,516,089.00	0.20
48	603008	喜临门	40,300	1,479,010.00	0.20
49	600660	福耀玻璃	35,300	1,475,893.00	0.20
50	002939	长城证券	144,500	1,468,120.00	0.20
51	600132	重庆啤酒	10,000	1,466,000.00	0.20
52	688518	联赢激光	42,837	1,456,029.63	0.20
53	601021	春秋航空	24,019	1,401,508.65	0.19
54	300750	宁德时代	2,600	1,388,400.00	0.19
55	000786	北新建材	38,400	1,329,408.00	0.18
56	300286	安科瑞	46,800	1,270,620.00	0.17
57	688122	西部超导	13,736	1,266,459.20	0.17
58	600298	安琪酵母	25,700	1,252,875.00	0.17

59	002192	融捷股份	8,100	1,244,970.00	0.17
60	600919	江苏银行	171,400	1,220,368.00	0.16
61	000963	华东医药	26,700	1,205,772.00	0.16
62	600760	中航沈飞	19,900	1,202,955.00	0.16
63	000157	中联重科	193,700	1,193,192.00	0.16
64	002937	兴瑞科技	64,400	1,190,756.00	0.16
65	603596	伯特利	14,800	1,186,664.00	0.16
66	603883	老百姓	34,060	1,153,952.80	0.16
67	601319	中国人保	224,300	1,134,958.00	0.15
68	002371	北方华创	4,000	1,108,480.00	0.15
69	000408	藏格矿业	33,500	1,103,490.00	0.15
70	688777	中控技术	14,821	1,078,375.96	0.14
71	300014	亿纬锂能	11,000	1,072,500.00	0.14
72	688599	天合光能	16,132	1,052,613.00	0.14
73	601117	中国化学	109,900	1,034,159.00	0.14
74	603833	欧派家居	6,800	1,024,624.00	0.14
75	300595	欧普康视	17,200	983,668.00	0.13
76	300760	迈瑞医疗	3,000	939,600.00	0.13
77	600546	山煤国际	42,800	832,888.00	0.11
78	301238	瑞泰新材	22,123	820,184.21	0.11
79	603267	鸿远电子	6,100	819,413.00	0.11
80	601966	玲珑轮胎	31,200	791,544.00	0.11
81	002984	森麒麟	25,200	783,972.00	0.11
82	002271	东方雨虹	15,000	772,050.00	0.10
83	605117	德业股份	2,660	744,507.40	0.10
84	603906	龙蟠科技	20,000	738,800.00	0.10
85	000400	许继电气	37,900	727,680.00	0.10
86	002463	沪电股份	47,800	705,528.00	0.09
87	688667	菱电电控	4,877	704,385.11	0.09
88	688052	纳芯微	2,001	701,970.81	0.09
89	688680	海优新材	3,274	650,543.80	0.09
90	300745	欣锐科技	11,700	583,596.00	0.08
91	002851	麦格米特	18,100	475,306.00	0.06
92	300274	阳光电源	4,100	402,825.00	0.05
93	301207	华兰疫苗	5,352	316,359.68	0.04
94	603032	德新交运	4,000	316,000.00	0.04
95	301217	铜冠铜箔	19,531	296,323.99	0.04
96	688400	凌云光	13,111	287,524.23	0.04
97	301302	华如科技	4,651	282,999.62	0.04
98	301266	宇邦新材	5,161	279,894.51	0.04
99	688668	鼎通科技	3,686	259,273.24	0.03
100	301200	大族数控	4,740	254,974.08	0.03

101	301175	中科环保	63,694	243,311.08	0.03
102	301187	欧圣电气	8,759	228,329.22	0.03
103	301206	三元生物	4,634	218,983.26	0.03
104	301112	信邦智能	3,984	213,281.76	0.03
105	301162	国能日新	3,331	201,609.02	0.03
106	301239	普瑞眼科	5,747	193,386.55	0.03
107	301120	新特电气	10,311	182,450.94	0.02
108	301286	侨源股份	7,839	176,722.11	0.02
109	301160	翔楼新材	3,918	166,768.58	0.02
110	301298	东利机械	6,340	158,423.92	0.02
111	301259	艾布鲁	4,828	139,789.02	0.02
112	301220	亚香股份	2,849	121,230.27	0.02
113	688237	超卓航科	2,891	119,311.57	0.02
114	301288	清研环境	4,516	107,867.44	0.01
115	301163	宏德股份	2,764	101,994.08	0.01
116	301125	腾亚精工	3,270	101,023.38	0.01
117	301228	实朴检测	3,721	76,823.46	0.01
118	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.01
119	300415	伊之密	2,200	40,106.00	0.01
120	001323	慕思股份	573	28,111.38	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	002594	比亚迪	16,545,907.00	2.15
2	000776	广发证券	14,769,507.91	1.92
3	601669	中国电建	14,185,999.00	1.85
4	601166	兴业银行	12,371,152.00	1.61
5	002271	东方雨虹	11,782,700.00	1.53
6	300059	东方财富	11,678,216.00	1.52
7	601155	新城控股	11,288,946.41	1.47
8	600801	华新水泥	11,280,837.00	1.47
9	002484	江海股份	10,884,026.00	1.42
10	300394	天孚通信	10,809,493.00	1.41
11	600048	保利发展	10,781,436.00	1.40
12	605123	派克新材	10,617,184.00	1.38
13	600237	铜峰电子	10,411,983.00	1.36
14	600011	华能国际	10,024,774.00	1.31
15	601699	潞安环能	9,283,901.69	1.21
16	000001	平安银行	8,950,720.00	1.17
17	601800	中国交建	8,877,778.00	1.16

18	600258	首旅酒店	8,580,618.20	1.12
19	601628	中国人寿	8,519,532.68	1.11
20	002881	美格智能	8,375,608.00	1.09

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	002594	比亚迪	17,736,946.28	2.31
2	601669	中国电建	16,675,206.00	2.17
3	002271	东方雨虹	15,168,860.00	1.98
4	600237	铜峰电子	13,503,279.00	1.76
5	601155	新城控股	13,503,002.00	1.76
6	605123	派克新材	12,852,845.00	1.67
7	000776	广发证券	11,671,214.08	1.52
8	601800	中国交建	11,600,067.00	1.51
9	600801	华新水泥	11,342,132.00	1.48
10	300059	东方财富	11,083,683.40	1.44
11	601166	兴业银行	10,787,700.00	1.40
12	000875	吉电股份	10,367,051.00	1.35
13	002484	江海股份	10,366,109.00	1.35
14	600048	保利发展	10,337,296.00	1.35
15	300394	天孚通信	10,177,775.92	1.33
16	002906	华阳集团	10,014,011.00	1.30
17	601699	潞安环能	9,575,628.00	1.25
18	600011	华能国际	9,410,906.00	1.23
19	600765	中航重机	9,075,369.00	1.18
20	000002	万科 A	8,817,979.11	1.15

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	1,094,895,228.96
卖出股票收入（成交）总额	1,067,553,998.46

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	10,190,493.15	1.37
2	央行票据	-	-

3	金融债券	133,559,770.97	17.95
	其中：政策性金融债	71,488,378.09	9.61
4	企业债券	18,476,799.45	2.48
5	企业短期融资券	193,254,233.96	25.97
6	中期票据	123,193,242.20	16.55
7	可转债（可交换债）	27,679,403.54	3.72
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	506,353,943.27	68.04

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	180403	18 农发 03	300,000	31,143,016.44	4.18
2	2120071	21 上海银行	300,000	31,002,583.56	4.17
3	042100465	21 锡产业 CP004	300,000	30,688,750.68	4.12
4	220203	22 国开 03	300,000	30,099,616.44	4.04
5	188340	21 航租 04	200,000	20,908,624.66	2.81

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

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低申购赎回时现金资产对投资组合的影响及投资组合仓位调整的交易成本，达到稳定投资组合资产净值的目的。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

为了更好地实现投资目标本基金在注重风险管理的前提下以套期保值为目的适度运用股指期货、国债期货等金融衍生品本基金利用金融衍生品合约流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点提高投资组合的运作效率

7.11.2 本期国债期货投资评价

无

7.12 投资组合报告附注

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

上海银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到中国银行保险监督管理委员会上海监管局的处罚。

中航国际租赁有限公司在报告编制日前一年内受到中华人民共和国南京海事局的处罚。

国家开发银行在报告编制日前一年内受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。

中国农业发展银行在报告编制日前一年内受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。

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	108,836.11
2	应收清算款	62,544,132.51
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	541.22
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	62,653,509.84

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110076	华海转债	3,417,423.29	0.46
2	128116	瑞达转债	2,216,687.67	0.30
3	113578	全筑转债	2,109,356.16	0.28
4	110056	亨通转债	1,979,578.77	0.27
5	123131	奥飞转债	1,923,002.05	0.26
6	113584	家悦转债	1,836,572.19	0.25
7	113609	永安转债	1,630,380.42	0.22
8	113602	景20转债	1,535,730.94	0.21
9	113599	嘉友转债	1,320,339.73	0.18

10	127049	希望转 2	1,228,156.44	0.17
11	113505	杭电转债	1,182,415.89	0.16
12	110043	无锡转债	1,179,130.96	0.16
13	128072	翔鹭转债	1,120,804.11	0.15
14	132021	19 中电 EB	1,064,267.12	0.14
15	113589	天创转债	986,753.42	0.13
16	123128	首华转债	756,500.41	0.10
17	127033	中装转 2	230,249.54	0.03
18	113593	沪工转债	180,365.77	0.02
19	110073	国投转债	132,679.80	0.02
20	123124	晶瑞转 2	126,599.22	0.02
21	110067	华安转债	104,648.17	0.01
22	128122	兴森转债	100,817.37	0.01
23	110082	宏发转债	78,070.70	0.01
24	127041	弘亚转债	38,966.70	0.01
25	128135	洽洽转债	12,800.40	0.00

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 (%)
663	854,910.98	551,324,198.19	97.27	15,481,780.35	2.73

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	44,845.62	0.0079

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、基金投资和研究人员	-

部门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	0~10

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（2019年6月7日） 基金份额总额	648,178,914.75
本报告期期初基金份额总额	582,969,280.96
本报告期基金总申购份额	184,102,562.49
减：本报告期基金总赎回份额	200,265,864.91
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	566,805,978.54

§ 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：

无。

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

无

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 (%)	
广发证券	3	669,310,405.73	31.12	600,766.05	33.24	-
长江证券	1	414,290,516.40	19.26	336,558.28	18.62	-
华创证券	1	295,244,617.61	13.73	241,514.84	13.36	-
银河证券	1	287,243,935.65	13.36	233,541.17	12.92	-
天风证券	2	127,354,714.88	5.92	104,394.51	5.78	-
招商证券	1	117,718,315.99	5.47	95,770.92	5.30	-
华西证券	1	108,612,077.39	5.05	88,115.72	4.88	-
方正证券	1	52,582,587.58	2.45	43,142.89	2.39	-
海通证券	2	43,444,975.27	2.02	35,329.99	1.95	-
国信证券	2	33,153,298.57	1.54	26,897.74	1.49	-
中信证券	1	1,612,597.00	0.07	1,308.26	0.07	-
德邦证券	2	-	-	-	-	本报告期新增
东方证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	本报告期

						新增
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
摩根大通 证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源 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、及时性以及提供研究服务主动性和质量等情况，并依据评比结果确定交易单元交易的具体情况。我公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向券商租用交易单元作为基金专用交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
广发证券	38,595,095.88	33.80	2,176,800,000.00	57.39	-	-
长江证券	12,093,936.17	10.59	911,500,000.00	24.03	-	-
华创证券	31,957,080.30	27.98	-	-	-	-

银河证券	8,241,444.40	7.22	1,000,000.00	0.03	-	-
天风证券	4,419,551.25	3.87	556,000,000.00	14.66	-	-
招商证券	13,342,323.00	11.68	-	-	-	-
华西证券	2,314,441.50	2.03	-	-	-	-
方正证券	1,150,642.00	1.01	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	2,084,967.73	1.83	136,000,000.00	3.59	-	-
中信证券	-	-	12,000,000.00	0.32	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
摩根大通 证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源 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	《上海证券报》、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具相关会计准则的公告	《上海证券报》、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
3	鹏华金城灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	《上海证券报》、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
4	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《上海证券报》、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	《上海证券报》、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
6	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	《上海证券报》、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
7	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	《上海证券报》、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

	优惠活动的公告		
8	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	《上海证券报》、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
9	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	《上海证券报》、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
10	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	《上海证券报》、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
11	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	《上海证券报》、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
12	鹏华金城灵活配置混合型证券投资基金 2021 年年度报告	《上海证券报》、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
13	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	《上海证券报》、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
14	鹏华金城灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	《上海证券报》、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
15	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	《上海证券报》、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
16	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	《上海证券报》、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
17	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《上海证券报》、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
18	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	《上海证券报》、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
19	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《上海证券报》、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

20	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	《上海证券报》、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
21	鹏华金城灵活配置混合型证券投资基金更新的招募说明书	《上海证券报》、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
22	鹏华金城灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	《上海证券报》、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
23	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	《上海证券报》、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
24	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	《上海证券报》、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
25	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	《上海证券报》、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
26	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（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《上海证券报》、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 18 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比（%）
机构	1	20220112~20220112	74,072,958.39	38,225,535.17	0.00	112,298,493.56	19.81
	2	20220101~20220630	227,616,843.70	53,414,645.25	0.00	281,031,488.95	49.58
产品特有风险							

基金份额持有人持有的基金份额所占比例过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引起基金净值剧烈波动，甚至可能引发基金流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。

注：1、申购份额包含基金申购份额、基金转换入份额、强制调增份额、场内买入份额和红利再投；
2、赎回份额包含基金赎回份额、基金转换出份额、强制调减份额、场内卖出份额。

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）《鹏华金城灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- （二）《鹏华金城灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- （三）《鹏华金城灵活配置混合型证券投资基金 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