

鹏华价值优势混合型证券投资基金（LOF） 2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 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：2023 年 3 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。本年度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 2023 年 03 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。

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）注册会计师对本基金出具了“标准无保留意见”的审计报告。

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 2022 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
3.4 过去三年基金的利润分配情况	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	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	14
4.10 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	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
§ 7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表	16
7.2 利润表	18
7.3 净资产（基金净值）变动表	19
7.4 报表附注	22

§ 8 投资组合报告	56
8.1 期末基金资产组合情况	56
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	57
8.3 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	57
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	64
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	66
8.6 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	66
8.7 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	66
8.8 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	66
8.9 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	66
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	66
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	66
8.12 投资组合报告附注	67
§ 9 基金份额持有人信息	67
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	67
9.2 期末上市基金前十名持有人	68
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	68
9.4 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	68
9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	68
§ 10 开放式基金份额变动	68
§ 11 重大事件揭示	69
11.1 基金份额持有人大会决议	69
11.2 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	69
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	69
11.4 基金投资策略的改变	69
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	69
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	70
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	70
11.8 其他重大事件	74
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	78
12.1 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	78
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	78
§ 13 备查文件目录	78
13.1 备查文件目录	78
13.2 存放地点	78
13.3 查阅方式	78

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华价值优势混合型证券投资基金 (LOF)
基金简称	鹏华价值优势混合 (LOF)
场内简称	鹏华价值优势 LOF
基金主代码	160607
基金运作方式	上市契约型开放式 (LOF)
基金合同生效日	2006 年 7 月 18 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	1,935,044,279.61 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2006 年 9 月 18 日

2.2 基金产品说明

投资目标	依托严格的研究流程和投资纪律，强调运用相对估值分析方法，发掘我国资本市场国际接轨趋势下具备相对价值优势的中国企业，谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	(1) 股票投资：首先按照既有的研究流程和投资纪律进行行业配置和个股选择，再运用相对估值分析方法，进行多维估值比较，分析行业、个股的合理估值区间，深入发掘行业和个股层面由于具备相对价值优势而存在的投资机会，以此作为基金经理的投资线索以及权重调整的重要依据。(2) 债券投资：以降低组合总体波动性从而改善组合风险构成为目的，采取积极主动的投资策略，进而谋取超额收益。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×70%+中证综合债指数收益率×30%
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型基金、债券基金，低于股票型基金，为证券投资基金中具有中高风险、中高收益的投资品种。

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	王小飞
	联系电话	021-60637103
	电子邮箱	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话	4006788999	021-60637228
传真	0755-82021126	021-60635778
注册地址	深圳市福田区福华三路 168 号深	北京市西城区金融大街 25 号

	圳国际商会中心第 43 楼	
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	《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.phfund.com.cn
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2022 年	2021 年	2020 年
本期已实现收益	-55,557,206.10	480,717,189.85	772,996,081.99
本期利润	-356,768,630.55	196,310,829.33	939,643,356.72
加权平均基金份额本期利润	-0.1829	0.0986	0.4187
本期加权平均净值利润率	-22.17%	9.70%	40.40%
本期基金份额净值增长率	-18.56%	9.46%	47.66%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
期末可供分配利润	865,953,115.93	1,331,470,669.08	1,579,178,989.20
期末可供分配基金	0.4475	0.7049	0.8574

份额利润			
期末基金资产净值	1, 533, 199, 149. 34	1, 982, 784, 354. 55	2, 276, 300, 900. 91
期末基金份额净值	0. 792	1. 050	1. 236
3.1.3 累计期末指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
基金份额累计净值增长率	674. 55%	851. 05%	768. 82%

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 12 月 31 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

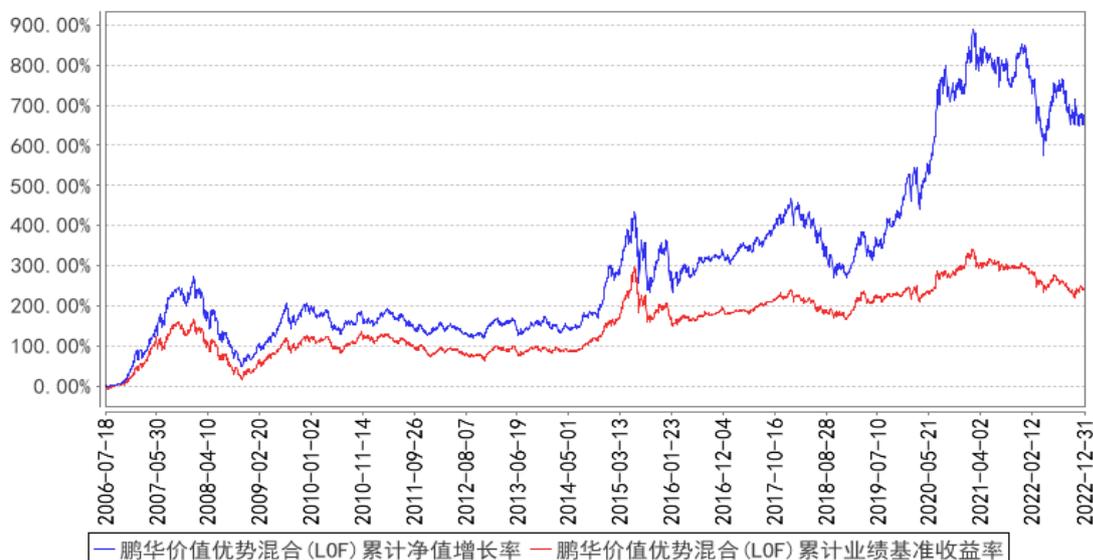
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	0.00%	1.19%	1.32%	0.90%	-1.32%	0.29%
过去六个月	-8.55%	1.17%	-9.23%	0.77%	0.68%	0.40%
过去一年	-18.56%	1.37%	-14.49%	0.90%	-4.07%	0.47%
过去三年	31.64%	1.35%	0.77%	0.91%	30.87%	0.44%
过去五年	44.35%	1.37%	6.71%	0.91%	37.64%	0.46%
自基金合同生效起至今	674.55%	1.51%	242.41%	1.17%	432.14%	0.34%

注：业绩比较基准=沪深 300 指数收益率×70%+中证综合债指数收益率×30%

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

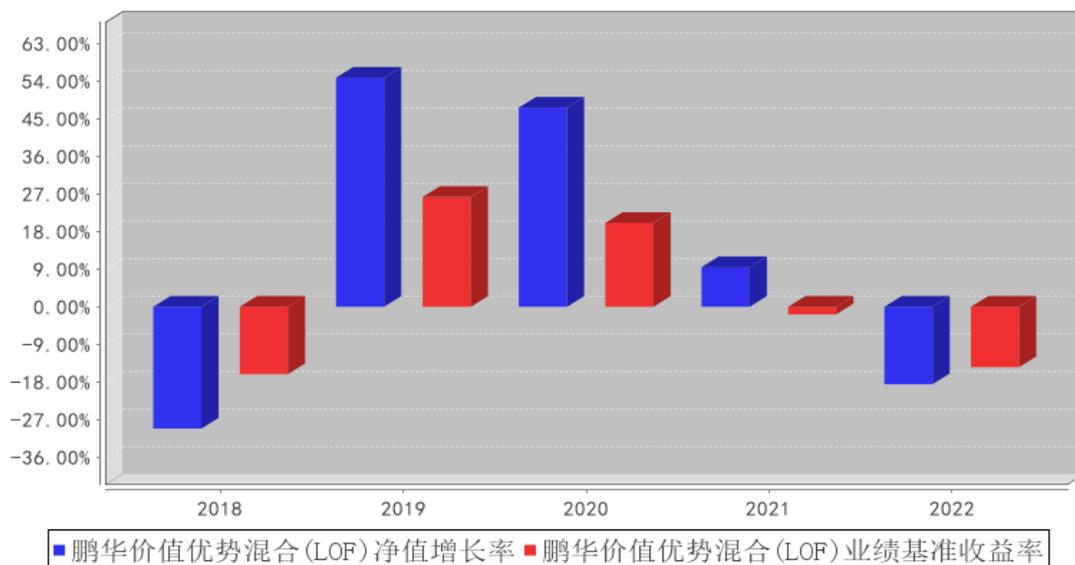
鹏华价值优势混合 (LOF) 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2006 年 07 月 18 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。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

鹏华价值优势混合 (LOF) 基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按照实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 其他指标

注：无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2022 年	0.7280	60,494,927.30	76,949,655.13	137,444,582.43	-
2021 年	2.9380	251,505,929.91	267,411,891.85	518,917,821.76	-
2020 年	0.4650	53,113,253.04	53,730,470.91	106,843,723.95	-
合计	4.1310	365,114,110.25	398,092,017.89	763,206,128.14	-

§ 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 11137.97 亿元，284 只公募基金、13 只全国社保投资组合、6 只基本养老保险投资组合。经过 20 余年投资管理基金，在基金投资、风险控制等方面积累了丰富经验。

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		
张华恩	基金经理	2021-12-11	-	11 年	张华恩先生，国籍中国，经济学硕士，11 年证券从业经验。曾任国泰君安证券股份有限公司分析师、海通证券股份有限公司分析师、平安证券股份有限公司分析师。2017 年 3 月加盟鹏华基金管理有限公司，历任研究部高级研究员、投资经理，现担任研究部基金经理。2020 年 08 月至今担任鹏华价值驱动混合型证券投资基金基金经理，2021 年 12 月至今担任鹏华价值优势混合型证券投资基金 (LOF) 基金经理，张华恩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。

4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

本报告期内，本基金运作合规，不存在违反基金合同和损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《鹏华基金管理有限公司公平交易管理规定》，将公司所管理的封闭式基金、开放式基金、社保组合、养老组合、特定客户资产管理组合等不同资产组合的授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动均纳入公平交易管理，在业务流程和岗位职责中制定公平交易的控制规则和控制活动，建立对公平交易的执行、监督及审核流程，严禁在不同投资组合之间进行利益输送。

在投资研究环节：1、公司使用唯一的研究报告发布平台“研究报告管理平台”，确保各投资组合在获得投资信息、研究支持、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；2、公司严格按照《股票库管理规定》、《信用债券投资与风险控制管理规定》，执行股票及信用产品出入库及日常维护工作，确保相关证券入库以内容严谨、观点明确的研究报告作为依据；3、在公司股票库基础上，各涉及股票投资的资产组合根据各自的投资目标、投资风格、投资范围和防范关联交易的原则分别建立资产组合股票库，基金经理在股票库基础上根据投资授权以及基金合同择股方式构建具体的投资组合；4、严格执行投资授权制度，明确投资决策委员会、分管投资副总裁、基金经理等各主体的职责和权限划分，合理确定基金经理的投资权限，超过投资权限的操作，应严格履行审批程序。

在交易执行环节：1、所有公司管理的资产组合的交易必须通过集中交易室完成，集中交易室负责建立和执行交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会；2、针对交易所公开竞价交易，集中交易室应严格启用恒生交易系统内的公平交易程序，交易系统则自动启用公平交易功能，由系统按照“未委托数量”的比例对不同资产组合进行委托量的公平分配；如果相关基金经理坚持以不同的价格进行交易，且当前市场价格不能同时满足多个资产组合的指令价格要求

时，交易系统自动按照“价格优先”原则进行委托；当市场价格同时满足多个资产组合的指令价格要求时，则交易系统自动按照“同一指令价格下的公平交易”模式，进行公平委托和交易量分配；3、银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易需依据公司《股票投资交易流程》和《固定收益投资管理流程》的规定执行；银行间市场交易、交易所大宗交易等以公司名义进行的交易，各投资组合经理应在交易前独立确定各投资组合的交易价格和数量，公司按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；4、新股、新债申购及非公开定向增发交易需依据公司《新股申购流程》、《固定收益投资管理流程》和《非公开定向增发流程》的规定执行，对新股和新债申购方案和分配过程进行审核和监控。

在交易监控、分析与评估环节：1、为加强对日常投资交易行为的监控和管理，杜绝利益输送、不公平交易等违规交易行为，防范日常交易风险，公司明确了关注类交易的界定及对应的监控和评估措施机制；所监控的交易包括但不限于：交易所公开竞价交易中同日同向交易的交易时机和交易价差、不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差、关联交易、债券交易收益率偏离度、成交量和成交价格异常、银行间债券交易对手交易等；2、将公平交易作为投资组合业绩归因分析和交易绩效评价的重要关注内容，发现的异常情况由投资监察员进行分析；3、风控管理部分别于每季度和每年度编写《公平交易执行情况检查报告》，内容包括关注类交易监控执行情况、不同投资组合的整体收益率差异分析和同向交易价差分析。

4.3.2 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。公司对不同投资组合在不同时间窗口下（日内、3日内、5日内）的同向交易价差进行专项分析，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.3.3 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

回顾2022年，虽然疫情扰动仍然对宏观经济和市场环境带来了重要影响，但跳出疫情之外，经济自身周期性摆动的力量也不容忽视。在地产需求持续回落、信用传导受阻的背景下，宏观总

需求延续了 2021 年以来的下行通道。与此同时，俄乌冲突等外部冲击则在供给端带来了更多的不确定性，使得一些原本需要跟随需求端进行主动或被动收缩的行业，在海外需求拉动下延续了产能的释放，相应的也延缓了产能端的调整节奏。在经济周期性力量之外，国内经济结构性转型在一些行业上仍然在加速突破，如电动车渗透率的进一步提升、汽车零部件和半导体等领域进口替代的加速等，中观产业趋势的发展呈现出更多的多样性。

在组合管理过程中，2022 年我们有过一些痛苦和坚守，但也有一些收获和幸运。基于对全年总需求相对悲观的判断，组合大部分仓位的重心放在了自身具备阿尔法的产业和公司上面，但也保留部分虽有周期性波动，当仍具备稳定增长属性的部分行业龙头。但由于对供给端外部冲击的估计不足，也致使我们错过了上半年部分周期品上涨的机会，这也是我们在既往框架中没有充分考虑的情景。在组合表现上，年初我们在军工、汽车、消费等行业维持了较高仓位，部分公司在一季度遭遇了较大回撤，但基于对公司长期价值和产业趋势的判断，我们坚守的一些行业和公司，如汽车零部件、军工、部分消费品龙头等公司，均在 2-3 季度实现了回追反弹。拉平全年来看，组合依然维持了以消费+制造业+医药为主的均衡配置。

在投资体系迭代上，我们继续坚持了自上而下基于经济发展和周期轮回去选赛道，在中观层面沿着产业链做纵深，从而去寻找强确定性的细分领域和“能干且幸运”的公司。2022 年，我们虽然继续在拓展研究方向扩充能力圈，但也适度放慢了“从少到多”的拓展步伐，希望能够在已经有所沉淀的行业中去做到更深度的研究和思考，从而能为我们的投资带来更少的决策和更高的胜率。展望未来，我们希望能够不断总结具备较高胜率且可复制的投资范式，并在此基础上不断补充和优化。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期鹏华价值优势混合 (LOF) 份额净值增长率为-18.56%，同期业绩比较基准增长率为-14.49%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

过去两年对宏观经济总量和微观主体活力构成压制的三大核心变量——“疫情、地产、监管”，在 2022 年 4 季度均迎来重要拐点，其政策效果有望在 2023 年进一步扩散和显现。受益疫情防控的改变，2023 年将是全社会回归生活常态的起点，受压制的消费、服务需求将逐步释放。地产行业在 2022 年的崩塌脱离了正常的市场规律，在信用分层甚至断层的背景下，政策的助力将促使行业重新回到健康的轨道上来，2023 年房地产销售预计将从 2022 年的大幅下跌转向零增长附近，对经济的负向冲击大幅减弱。监管方面，医药、游戏、教育、互联网金融等行业过去两年的压制性政策正逐步微调，在前期出清之后有望迎来新生机。流动性层面，在实体经济和通胀拐头向上

之前，2023 年国内流动性预计仍将保持相对宽裕的状态，这将为市场整体性的估值抬升提供有利环境。因此，往 2023 年看，在诸多政策影响下，经济周期性力量和市场化的活力大概率将形成共振，市场机会正逐步孕育，2023 年权益投资回报预计将显著好于 2022 年。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人继续完善内部控制、提升风险管理水平，着重开展了以下各项工作：

1、继续完善内部控制体系

公司根据法律法规、监管要求及业务发展需求，不断优化现有的标准化业务流程体系，强调业务流程服务于加强风险防范和提升运营效率，通过信息技术手段持续提升业务操作的系统化程度，并不断优化。

2、规范基金销售业务，保证基金销售业务的合法合规性

报告期内，在基金募集和持续营销活动中，公司严格规范基金销售业务，按照《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及相关法规规定审查宣传推介材料，逐步落实反洗钱法律法规各项要求，并督促销售部门做好投资者教育工作。

3、开展以风险为导向的内部稽核

报告期内，监察稽核部开展了对信息技术管理、投资相关流程、员工行为、反洗钱业务、子公司管理和公司日常运作的定期监察稽核与专项监察稽核。监察稽核人员开展了以风险为导向的内部稽核，通过稽核发现提高了公司标准化操作流程手册的执行效力，优化了标准化操作流程手册。报告期内，公司未发生重大风险事件。

此外，在投资日常合规监控工作方面，公司根据法律法规和产品特点进一步完善了投资合规风控制度流程及投资监控系统，加强对投资限制的监控提示；持续完善公平交易、异常交易等监测管控机制，在实现交易价差分析、银行间交易分析、研究报告检查等专项检查工作定期化、日常化的基础上，公司多次开展有关内幕交易、未公开信息等重要内容的合规培训，进一步强化全体投研人员的合规意识。

4.7 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。

4.8 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 865,953,115.93 元，期末基金份额净值 0.792 元。

2、本基金于 2022 年 01 月 14 日进行利润分配，分配金额为 137,444,582.43 元。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.10 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 托管人对本年度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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2023)第 23958 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	鹏华价值优势混合型证券投资基金 (LOF) 全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了鹏华价值优势混合型证券投资基金 (LOF) (以下简称“鹏华价值优势混合 (LOF) 基金”) 的财务报表, 包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表, 2022 年度的利润表和净资产 (基金净值) 变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为, 后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会 (以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会 (以下简称“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, 公允反映了鹏华价值优势混合 (LOF) 基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信, 我们获取的审计证据是充分、适当的, 为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则, 我们独立于鹏华价值优势混合 (LOF) 基金, 并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	无。
其他事项	无。
其他信息	无。
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>鹏华价值优势混合 (LOF) 基金的基金管理人鹏华基金管理有限公司 (以下简称“基金管理人”) 管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表, 使其实现公允反映, 并设计、执行和维护必要的内部控制, 以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时, 基金管理人管理层负责评估鹏华价值优势混合 (LOF) 基金的持续经营能力, 披露与持续经营相关的事项 (如适用), 并运用持续经营假设, 除非基金管理人管理层计划清算鹏华价值优势混合 (LOF) 基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督鹏华价值优势混合 (LOF) 基</p>

	金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对导致对鹏华价值优势混合 (LOF) 基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致鹏华价值优势混合 (LOF) 基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报 (包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	单峰 胡莲莲
会计师事务所的地址	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
审计报告日期	2023 年 3 月 27 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：鹏华价值优势混合型证券投资基金 (LOF)

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	106,690,080.34	230,482,993.88
结算备付金		1,516,592.76	1,649,332.40
存出保证金		362,396.29	305,587.86
交易性金融资产	7.4.7.2	1,425,298,061.63	1,778,621,842.51
其中：股票投资		1,425,296,067.78	1,777,444,350.60
基金投资		-	-
债券投资		1,993.85	1,177,491.91
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		7,638,531.15	-
应收股利		-	-
应收申购款		38,445.63	1,263,433.50
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	27,434.42
资产总计		1,541,544,107.80	2,012,350,624.57
负债和净资产			
	附注号	本期末 2022年12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		4,605,159.19	23,699,582.29
应付赎回款		247,418.99	580,539.75
应付管理人报酬		1,940,210.88	2,508,320.76
应付托管费		323,368.46	418,053.45
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		165,701.20	165,706.06
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	1,063,099.74	2,194,067.71
负债合计		8,344,958.46	29,566,270.02
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	667,246,033.41	651,313,685.47
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	865,953,115.93	1,331,470,669.08
净资产合计		1,533,199,149.34	1,982,784,354.55
负债和净资产总计		1,541,544,107.80	2,012,350,624.57

注：报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.792 元，基金份额总额 1,935,044,279.61 份。

7.2 利润表

会计主体：鹏华价值优势混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-328,328,365.42	240,290,665.85
1. 利息收入		644,812.38	754,371.86
其中：存款利息收入	7.4.7.13	644,812.38	753,635.54
债券利息收入		-	736.32
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-27,827,898.37	523,398,460.38
其中：股票投资收益	7.4.7.14.2	-40,224,747.91	495,195,283.08
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	159,105.67	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	12,237,743.87	28,203,177.30
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）	7.4.7.20	-301,211,424.45	-284,406,360.52
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	66,145.02	544,194.13
减：二、营业总支出		28,440,265.13	43,979,836.52
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	24,153,866.85	30,339,834.50
2. 托管费	7.4.10.2.2	4,025,644.49	5,056,639.14
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		3.03	2.55
8. 其他费用	7.4.7.23	260,750.76	8,583,360.33
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-356,768,630.55	196,310,829.33
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-356,768,630.55	196,310,829.33
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-356,768,630.55	196,310,829.33

7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：鹏华价值优势混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2022年1月1日至2022年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31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）	651,313,685.47	-	1,331,470,669.08	1,982,784,354.55
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错	-	-	-	-

更正				
其他	-	-	-	-
二、本 期初 净 资 产 (基 金 净 值)	651,313,685.47	-	1,331,470,669.08	1,982,784,354.55
三、本 期 增 减 变 动 额 (减 少 以 “-” 号 填 列)	15,932,347.94	-	-465,517,553.15	-449,585,205.21
(一)、 综 合 收 益 总 额	-	-	-356,768,630.55	-356,768,630.55
(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)	15,932,347.94	-	28,695,659.83	44,628,007.77
其中:1. 基 金 申 购 款	62,282,704.78	-	94,879,957.22	157,162,662.00
2 .基 金 赎 回 款	-46,350,356.84	-	-66,184,297.39	-112,534,654.23
(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)	-	-	-137,444,582.43	-137,444,582.43

(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)	667,246,033.41	-	865,953,115.93	1,533,199,149.34
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31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)	635,141,522.92	-	1,641,159,377.99	2,276,300,900.91
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)	635,141,522.92	-	1,641,159,377.99	2,276,300,900.91
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	16,172,162.55	-	-309,688,708.91	-293,516,546.36
(一)、综合收益总额	-	-	196,310,829.33	196,310,829.33
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以	16,172,162.55	-	12,918,283.52	29,090,446.07

“-”号填列)				
其中:1.基金申购款	196,169,701.26	-	384,668,617.50	580,838,318.76
2.基金赎回款	-179,997,538.71	-	-371,750,333.98	-551,747,872.69
(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)	-	-	-518,917,821.76	-518,917,821.76
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	651,313,685.47	-	1,331,470,669.08	1,982,784,354.55

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

邓召明

邢彪

郝文高

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

鹏华价值优势混合型证券投资基金(LOF)(原名为“鹏华价值优势股票型证券投资基金(LOF)”,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”)证监基金字[2006]第105号《关于同意鹏华价值优势股票型证券投资基金(LOF)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《鹏华价值优势股票型证券投资基金 (LOF) 基金合同》负责公开募集。本基金为上市契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,875,734,450.63 元，业经德勤华永会计师事务所有限公司德师(上海)报验字(06)第 SZ002 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《鹏华价值优势股票型证券投资基金 (LOF) 基金合同》于 2006 年 7 月 18 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,876,753,992.72 份基金份额，其中认购资金利息折合 1,019,542.09 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。

7.4.2 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”)、《资产管理产品相关会计处理规定》(财会[2022]14 号)、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》、《鹏华价值优势混合型证券投资基金 (LOF) 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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2022 年度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 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

新金融工具准则

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类

取决于本基金对金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具；即不包含付款的合同义务且享有发行人净资产和剩余收益的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具（主要为股票投资）按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

（2）金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

原金融工具准则（截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则）

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

（1）金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以

公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

新金融工具准则

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金在上一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本基金利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风

险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、基金投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

新金融工具准则

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税(和/或)股票交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率或者发行价计算的利息及在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税(和/或)股票交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分

属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

新金融工具准则

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费(如有)在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

以摊余成本计量的负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费(如有)在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，其中场外基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资，场内基金份额持有人只能选择现金分红。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指

数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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》，公募基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，财政部于 2022 年颁布了《关于印发《资产管理产品相关会计处理规定》的通知》（财会[2022]14 号），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

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、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 26,168.80 元、816.42 元、151.36 元、297.84 元、-27,434.42 元、-1,972,741.05 元和 1,972,741.05 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。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2022 年 12 月 31 日	2021 年 12 月 31 日
活期存款	106,690,080.34	230,482,993.88
等于：本金	106,678,257.36	230,482,993.88
加：应计利息	11,822.98	-
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	106,690,080.34	230,482,993.88

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末				
	2022 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	1,457,116,029.42	-	1,425,296,067.78	-31,819,961.64	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	1,900.00	6.45	1,993.85	87.40
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	1,900.00	6.45	1,993.85	87.40
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	1,457,117,929.42	6.45	1,425,298,061.63	-31,819,874.24	
项目	上年度末				
	2021 年 12 月 31 日				

	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	1,508,334,492.30	-	1,777,444,350.60	269,109,858.30
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	895,800.00	1,177,491.91	281,691.91
	银行间市场	-	-	-
	合计	895,800.00	1,177,491.91	281,691.91
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,509,230,292.30	-	1,778,621,842.51	269,391,550.21

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。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

7.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
应收利息	-	27,434.42
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	27,434.42

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	543.05	1,326.66
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	842,556.69	1,972,741.05
其中：交易所市场	842,556.69	1,972,741.05
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	220,000.00	220,000.00
合计	1,063,099.74	2,194,067.71

7.4.7.10 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12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,888,845,016.41	651,313,685.47
本期申购	180,612,663.77	62,282,704.78

本期赎回（以“-”号填列）	-134,413,400.57	-46,350,356.84
- 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	1,935,044,279.61	667,246,033.41

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.11 其他综合收益

注：无。

7.4.7.12 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	1,530,065,860.40	-198,595,191.32	1,331,470,669.08
本期利润	-55,557,206.10	-301,211,424.45	-356,768,630.55
本期基金份额交易产生的变动数	36,303,158.75	-7,607,498.92	28,695,659.83
其中：基金申购款	133,273,774.06	-38,393,816.84	94,879,957.22
基金赎回款	-96,970,615.31	30,786,317.92	-66,184,297.39
本期已分配利润	-137,444,582.43	-	-137,444,582.43
本期末	1,373,367,230.62	-507,414,114.69	865,953,115.93

7.4.7.13 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12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
活期存款利息收入	599,103.61	722,330.32
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	38,003.57	22,167.64
其他	7,705.20	9,137.58
合计	644,812.38	753,635.54

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

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 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12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-40,224,747.91	495,195,283.08

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	-40,224,747.91	495,195,283.08

7.4.7.14.2 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12月31 日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12 月31日
卖出股票成交总 额	3,069,753,094.97	2,935,601,274.67
减：卖出股票成本 总额	3,100,861,275.16	2,440,405,991.59
减：交易费用	9,116,567.72	-
买卖股票差价收 入	-40,224,747.91	495,195,283.08

7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 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12月31 日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31 日
债券投资收益——利息 收入	845.39	-
债券投资收益——买卖 债券（债转股及债券到 期兑付）差价收入	158,260.28	-
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	159,105.67	-

7.4.7.15.2 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12月31 日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,053,335.38	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	893,900.00	-
减：应计利息总额	1,150.79	-
减：交易费用	24.31	-
买卖债券差价收入	158,260.28	-

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月 31日
股票投资产生的股利收益	12,237,743.87	28,203,177.30
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	12,237,743.87	28,203,177.30

7.4.7.20 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 12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021 年12月31日
1. 交易性金融资产	-301,211,424.45	-284,406,360.52
股票投资	-300,929,819.94	-284,546,129.14
债券投资	-281,604.51	139,768.62
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	-301,211,424.45	-284,406,360.52

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021 年12月31日
基金赎回费收入	65,027.00	384,581.78

基金转换费收入	1,118.02	159,612.35
合计	66,145.02	544,194.13

7.4.7.22 信用减值损失

注：无。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
审计费用	100,000.00	100,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费用	3,550.76	17,559.46
账户维护费	36,000.00	36,000.00
上市年费	-	60,000.00
交易费用	-	8,248,600.87
其他	1,200.00	1,200.00
合计	260,750.76	8,583,360.33

7.4.7.24 分部报告

无。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

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
深圳市北融信投资发展有限公司	基金管理人的股东
意大利欧利盛资本资产管理股份公司（“Eurizon Capital SGR S.p.A.”）	基金管理人的股东
鹏华资产管理有限公司（“鹏华资产”）	基金管理人的子公司

注：1、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。

2、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31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	30,695,014.94	0.51	89,929,465.06	1.70

7.4.10.1.2 债券交易

注：无。

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

7.4.10.1.4 权证交易

注：无。

7.4.10.1.5 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12月31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	28,110.29	0.51	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31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	81,950.41	1.72	-	-

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12 月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	24,153,866.85	30,339,834.50
其中：支付销售机构的客户维护费	5,817,159.04	7,535,035.89

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

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

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12 月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	4,025,644.49	5,056,639.14

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。

7.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 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。

7.4.10.5.2 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。

7.4.10.6 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12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31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	106,690,080.34	599,103.61	230,482,993.88	722,330.32

7.4.10.7 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12月31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： 股/张）	总金额
国信证券	301161	唯万密封	网下申购	3,460	64,563.60
国信证券	688244	永信至诚	网下申购	1,506	74,080.14
上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31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： 股/张）	总金额
国信证券	301066	万事利	网下申购	3,436	18,004.64
国信证券	301091	深城交	网下申购	5,240	191,260.00
国信证券	688622	禾信仪器	网下申购	1,204	21,310.80
国信证券	301032	新柴股份	网下申购	5,124	25,466.28
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
国信证券	300957	贝泰妮	网下申购	8,523	403,393.59

注：本表包含参与基金托管人的关联方承销证券的情况。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序	权益	除息日	每10	现金形式	再投资形式	本期利润分配合	备
---	----	-----	-----	------	-------	---------	---

号	登记日	场内	场外	基金份额分红数	发放总额	发放总额	计	注
1	2022年1月14日	2022年1月17日	2022年1月14日	0.7280	60,494,927.30	76,949,655.13	137,444,582.43	-
合计	-	-	-	0.7280	60,494,927.30	76,949,655.13	137,444,582.43	-

7.4.12 期末（2022年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
002472	三环传动	2022年10月28日	6个月	非公开发行流通受限	27.35	23.54	1,096,892	29,999,996.20	25,820,837.68	-
301161	唯万密封	2022年9月6日	6个月	新股流通受限	18.66	21.73	346	6,456.36	7,518.58	-
301231	荣信文化	2022年8月31日	6个月	新股流通受限	25.49	20.38	275	7,009.75	5,604.50	-
301265	华新环保	2022年12月8日	6个月	新股流通受限	13.28	11.40	819	10,876.32	9,336.60	-
301267	华夏眼科	2022年10月26日	6个月	新股流通受限	50.88	66.20	1,006	51,185.28	66,597.20	-
301276	嘉曼服饰	2022年9月1日	6个月	新股流通受限	40.66	22.61	303	12,319.98	6,850.83	-
301277	新天地	2022年11月9日	6个月	新股流通受限	27.00	25.78	439	11,853.00	11,317.42	-
301285	鸿日达	2022年9月21日	6个月	新股流通受限	14.60	12.60	565	8,249.00	7,119.00	-

301290	东星医疗	2022年11月23日	6个月	新股流通受限	44.09	35.13	330	14,549.70	11,592.90	-
301297	富乐德	2022年12月23日	6个月	新股流通受限	8.48	12.99	1,015	8,607.20	13,184.85	-
301301	川宁生物	2022年12月20日	6个月	新股流通受限	5.00	7.53	3,574	17,870.00	26,912.22	-
301309	万得凯	2022年9月8日	6个月	新股流通受限	39.00	24.46	228	8,892.00	5,576.88	-
301311	昆船智能	2022年11月23日	6个月	新股流通受限	13.88	15.86	832	11,548.16	13,195.52	-
301313	凡拓数创	2022年9月22日	6个月	新股流通受限	25.25	29.14	247	6,236.75	7,197.58	-
301316	慧博云通	2022年9月29日	6个月	新股流通受限	7.60	14.32	359	2,728.40	5,140.88	-
301319	唯特偶	2022年9月22日	6个月	新股流通受限	47.75	53.27	115	5,491.25	6,126.05	-
301327	华宝新能	2022年9月8日	6个月	新股流通受限	237.50	176.97	242	57,475.00	42,826.74	-
301339	通行宝	2022年9月2日	6个月	新股流通受限	18.78	15.59	913	17,146.14	14,233.67	-
301359	东南电子	2022年11月2日	6个月	新股流通受限	20.84	19.90	328	6,835.52	6,527.20	-
301361	众智科技	2022年11月8日	6个月	新股流通受限	26.44	20.96	517	13,669.48	10,836.32	-
301363	美好医疗	2022年9月28日	6个月	新股流通受限	30.66	37.85	445	13,643.70	16,843.25	-
301367	怡和	2022	6个月	新股	119.88	175.78	223	26,733.24	39,198.94	-

	嘉业	年 10 月 21 日	月	流通受限						
301368	丰立智能	2022 年 12 月 7 日	6 个月	新股流通受限	22.33	18.52	337	7,525.21	6,241.24	-
301377	鼎泰高科	2022 年 11 月 11 日	6 个月	新股流通受限	22.88	17.63	770	17,617.60	13,575.10	-
301388	欣灵电气	2022 年 10 月 26 日	6 个月	新股流通受限	25.88	21.60	292	7,556.96	6,307.20	-
301398	星源卓镁	2022 年 12 月 8 日	6 个月	新股流通受限	34.40	28.94	255	8,772.00	7,379.70	-
688152	麒麟信安	2022 年 10 月 18 日	6 个月	新股流通受限	68.89	130.72	1,189	81,910.21	155,426.08	-
688244	永信至诚	2022 年 10 月 12 日	6 个月	新股流通受限	49.19	50.14	1,506	74,080.14	75,510.84	-
688392	骄成超声	2022 年 9 月 19 日	6 个月	新股流通受限	71.18	134.27	2,745	195,389.10	368,571.15	-
688455	科捷智能	2022 年 9 月 7 日	6 个月	新股流通受限	21.88	13.12	5,277	115,460.76	69,234.24	-
688489	三未信安	2022 年 11 月 25 日	6 个月	新股流通受限	78.89	90.62	1,995	157,385.55	180,786.90	-

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

2、基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自

发行结束之日起约定限售期内不得转让。

3、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的科创板股票，在受让后 6 个月内不得转让。

4、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，本基金参与摇号配售或比例配售方式获配的创业板股票自发行人股票上市之日起在发行人约定的限售期内不得转让。

5、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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各类股票，债券，央行票据，权证，资产证券化产品以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如有投资需要可参与有价值的新股配售和增发。法律法规或中国证监会以后允许本基金投资的其他金融工具或品种，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。

7.4.13.2 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 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券占基金资产净值的比例为 0.00%（2021 年 12 月 31 日：0.06%）。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

7.4.13.2.4 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 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	1,993.85	1,177,491.91
未评级	-	-
合计	1,993.85	1,177,491.91

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。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

7.4.13.3 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 12 月 31 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（净资产）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。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

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

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

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

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

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

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022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	106,690,080.34	-	-	-	106,690,080.34
结算备付金	1,516,592.76	-	-	-	1,516,592.76
存出保证金	362,396.29	-	-	-	362,396.29
交易性金融资产	-	1,993.85	-	1,425,296,067.78	1,425,298,061.63
应收申购款	-	-	-	38,445.63	38,445.63
应收清算款	-	-	-	7,638,531.15	7,638,531.15
资产总计	108,569,069.39	1,993.85	-	1,432,973,044.56	1,541,544,107.80
负债					
应付赎回款	-	-	-	247,418.99	247,418.99
应付管理人报酬	-	-	-	1,940,210.88	1,940,210.88
应付托管费	-	-	-	323,368.46	323,368.46
应付清算款	-	-	-	4,605,159.19	4,605,159.19
应交税费	-	-	-	165,701.20	165,701.20
其他负债	-	-	-	1,063,099.74	1,063,099.74
负债总计	-	-	-	8,344,958.46	8,344,958.46
利率敏感度缺口	108,569,069.39	1,993.85	-	-1,424,628,086.10	1,533,199,149.34
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	230,482,993.88	-	-	-	230,482,993.88
结算备付金	1,649,332.40	-	-	-	1,649,332.40
存出保证金	305,587.86	-	-	-	305,587.86
交易性金融资产	-	661,007.11	516,484.80	1,777,444,350.60	1,778,621,842.51
应收申购款	-	-	-	1,263,433.50	1,263,433.50

其他资产	-	-	-	27,434.42	27,434.42
资产总计	232,437,914.14	661,007.11	516,484.80	1,778,735,218.52	2,012,350,624.57
负债					
应付赎回款	-	-	-	580,539.75	580,539.75
应付管理人报酬	-	-	-	2,508,320.76	2,508,320.76
应付托管费	-	-	-	418,053.45	418,053.45
应付清算款	-	-	-	23,699,582.29	23,699,582.29
应交税费	-	-	-	165,706.06	165,706.06
其他负债	-	-	-	2,194,067.71	2,194,067.71
负债总计	-	-	-	29,566,270.02	29,566,270.02
利率敏感度缺口	232,437,914.14	661,007.11	516,484.80	1,749,168,948.50	1,982,784,354.55

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2022 年 12 月 31 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。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无。

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无。

7.4.13.4.3 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。

正常市场状况下,股票投资比例为 60%~95%,债券投资比例为 0%~35%,权证的投资比例为 0~3%,现金或到期日在 1 年以内的政府债券投资比例不低于 5%,其中现金不包括结算备付金,存出保证金,应收申购款等。

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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位:人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 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	1,425,296,067.78	92.96	1,777,444,350.60	89.64
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	1,993.85	-	1,177,491.91	0.06
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	1,425,298,061.63	92.96	1,778,621,842.51	89.70

注:债券投资为可转换债券、可交换债券投资。

7.4.13.4.3.2 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 12 月 31 日)	上年度末 (2021 年 12 月 31 日)	
分析	业绩比较基准上升 5%	65,022,975.92	75,395,375.08
	业绩比较基准下降	-65,022,975.92	-75,395,375.08

	5%		
--	----	--	--

注：无。

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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12月31日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	1,398,260,454.37	1,771,808,645.10
第二层次	-	380,229.35
第三层次	27,037,607.26	6,432,968.06
合计	1,425,298,061.63	1,778,621,842.51

7.4.14.2.2 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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	6,432,968.06	6,432,968.06
当期购买	-	29,999,996.20	29,999,996.20
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	1,860,307.34	1,860,307.34
转出第三层次	-	6,748,711.33	6,748,711.33
当期利得或损失总额	-	-4,506,953.01	-4,506,953.01
其中：计入损益的利得或损失	-	-4,506,953.01	-4,506,953.01
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	27,037,607.26	27,037,607.26
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-3,947,462.70	-3,947,462.70
项目	上年度可比同期 2021年1月1日至2021年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	3,972,551.82	3,972,551.82
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	2,460,416.24	2,460,416.24
其中：计入损益的利得或损失	-	2,460,416.24	2,460,416.24
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	6,432,968.06	6,432,968.06
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	2,460,416.24	2,460,416.24

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流通受限股票	27,037,607.26	平均价格 亚式期权 模型	预期波动率	0.2127-2.4756	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流通受限股票	6,432,968.06	平均价格 亚式期权 模型	预期波动率	0.1717-2.7417	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

7.4.14.4 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。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	1,425,296,067.78	92.46
	其中：股票	1,425,296,067.78	92.46
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,993.85	0.00
	其中：债券	1,993.85	0.00
	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	108,206,673.10	7.02
8	其他各项资产	8,039,373.07	0.52
9	合计	1,541,544,107.80	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	5,177.20	0.00
B	采矿业	16,063.74	0.00
C	制造业	1,224,034,673.62	79.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	19,528.98	0.00
E	建筑业	91,037.18	0.01
F	批发和零售业	349,814.19	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	86,990.70	0.01
H	住宿和餐饮业	15,141.60	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,309,628.94	0.09
J	金融业	102,579,623.44	6.69
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	45,946,940.33	3.00
M	科学研究和技术服务业	34,530,510.61	2.25
N	水利、环境和公共设施管理业	530,731.42	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	66,597.20	0.00
R	文化、体育和娱乐业	15,713,608.63	1.02
S	综合	-	-
	合计	1,425,296,067.78	92.96

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

8.3 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	601838	成都银行	5,209,100	79,699,230.00	5.20
2	600765	中航重机	2,166,886	67,368,485.74	4.39
3	002472	双环传动	2,666,292	65,762,067.68	4.29
4	600660	福耀玻璃	1,586,418	55,635,679.26	3.63
5	600519	贵州茅台	32,100	55,436,700.00	3.62

6	603345	安井食品	313,989	50,828,539.32	3.32
7	002311	海大集团	766,900	47,340,737.00	3.09
8	600309	万华化学	498,435	46,180,002.75	3.01
9	601888	中国中免	212,600	45,927,978.00	3.00
10	300760	迈瑞医疗	144,100	45,531,277.00	2.97
11	600809	山西汾酒	159,500	45,455,905.00	2.96
12	601567	三星医疗	3,364,731	45,356,573.88	2.96
13	300724	捷佳伟创	373,500	42,586,470.00	2.78
14	688190	云路股份	476,373	41,863,659.24	2.73
15	688800	瑞可达	373,884	39,885,945.12	2.60
16	300737	科顺股份	3,005,500	37,809,190.00	2.47
17	002459	晶澳科技	605,100	36,360,459.00	2.37
18	601636	旗滨集团	3,161,000	36,003,790.00	2.35
19	300416	苏试试验	1,129,810	34,063,771.50	2.22
20	002475	立讯精密	1,027,893	32,635,602.75	2.13
21	600872	中炬高新	873,400	32,202,258.00	2.10
22	002304	洋河股份	200,500	32,180,250.00	2.10
23	300014	亿纬锂能	363,400	31,942,860.00	2.08
24	002011	盾安环境	2,423,950	31,826,463.50	2.08
25	002648	卫星化学	2,035,877	31,556,093.50	2.06
26	300832	新产业	618,500	31,011,590.00	2.02
27	000858	五粮液	169,800	30,681,162.00	2.00
28	600419	天润乳业	1,726,100	27,065,248.00	1.77
29	300896	爱美客	46,400	26,278,640.00	1.71
30	603596	伯特利	318,200	25,392,360.00	1.66
31	601601	中国太保	930,700	22,820,764.00	1.49
32	600132	重庆啤酒	177,600	22,622,688.00	1.48
33	605333	沪光股份	1,020,100	21,748,532.00	1.42
34	688050	爱博医疗	84,966	19,601,656.20	1.28
35	688617	惠泰医疗	51,425	15,783,875.25	1.03
36	300251	光线传媒	1,798,800	15,577,608.00	1.02
37	603027	千禾味业	725,880	15,083,786.40	0.98
38	605499	东鹏饮料	82,795	14,729,230.50	0.96
39	603348	文灿股份	253,400	14,588,238.00	0.95
40	688503	聚和材料	3,277	488,633.47	0.03
41	688392	骄成超声	2,745	368,571.15	0.02
42	301301	川宁生物	35,740	314,797.92	0.02
43	301117	佳缘科技	2,616	207,448.80	0.01
44	688498	源杰科技	1,582	189,096.46	0.01
45	688489	三未信安	1,995	180,786.90	0.01
46	688362	甬矽电子	7,779	169,504.41	0.01
47	000888	峨眉山A	17,288	163,717.36	0.01
48	301091	深城交	6,812	162,125.60	0.01

49	301127	天源环保	16,843	160,850.65	0.01
50	688147	微导纳米	6,293	157,828.44	0.01
51	688152	麒麟信安	1,189	155,426.08	0.01
52	688084	晶品特装	1,875	155,025.00	0.01
53	301339	通行宝	9,127	150,339.65	0.01
54	301297	富乐德	10,147	150,256.17	0.01
55	300750	宁德时代	381	149,893.02	0.01
56	301377	鼎泰高科	7,695	149,789.85	0.01
57	301187	欧圣电气	8,759	148,202.28	0.01
58	301311	昆船智能	8,320	145,957.76	0.01
59	688391	钜泉科技	1,397	140,524.23	0.01
60	600153	建发股份	10,100	137,865.00	0.01
61	688697	纽威数控	5,837	133,141.97	0.01
62	301100	风光股份	5,985	132,627.60	0.01
63	300957	贝泰妮	853	127,301.72	0.01
64	688267	中触媒	3,390	125,565.60	0.01
65	301277	新天地	4,384	125,209.57	0.01
66	301290	东星医疗	3,291	122,423.13	0.01
67	301151	冠龙节能	7,025	119,495.25	0.01
68	688376	美埃科技	3,713	116,142.64	0.01
69	301166	优宁维	2,528	115,605.44	0.01
70	301361	众智科技	5,169	115,134.16	0.01
71	301179	泽宇智能	2,941	112,257.97	0.01
72	688496	清越科技	12,000	108,960.00	0.01
73	301221	光庭信息	2,791	108,597.81	0.01
74	301190	善水科技	5,741	103,223.18	0.01
75	688102	斯瑞新材	6,030	99,434.70	0.01
76	301265	华新环保	8,181	99,226.62	0.01
77	301116	益客食品	5,764	98,506.76	0.01
78	301193	家联科技	2,970	98,336.70	0.01
79	688420	美腾科技	2,408	98,294.56	0.01
80	688419	耐科装备	3,039	96,123.57	0.01
81	688283	坤恒顺维	1,595	92,525.95	0.01
82	301155	海力风电	1,054	92,066.90	0.01
83	301259	艾布鲁	4,828	91,732.00	0.01
84	688143	长盈通	1,938	90,349.56	0.01
85	688049	炬芯科技	3,260	88,183.00	0.01
86	301222	浙江恒威	3,315	83,604.30	0.01
87	688737	中自科技	2,186	82,674.52	0.01
88	688227	品高股份	4,164	81,739.32	0.01
89	301161	唯万密封	3,460	80,697.58	0.01
90	301313	凡拓数创	2,464	79,626.97	0.01
91	301398	星源卓镁	2,549	78,837.80	0.01

92	301135	瑞德智能	3,376	77,310.40	0.01
93	301110	青木股份	2,013	76,212.18	0.00
94	688244	永信至诚	1,506	75,510.84	0.00
95	301288	清研环境	4,516	75,191.40	0.00
96	301111	粤万年青	3,783	74,222.46	0.00
97	688525	佰维存储	4,614	74,100.84	0.00
98	301285	鸿日达	5,643	73,945.48	0.00
99	301163	宏德股份	2,764	72,665.56	0.00
100	301359	东南电子	3,271	71,332.06	0.00
101	301276	嘉曼服饰	3,026	70,269.50	0.00
102	688455	科捷智能	5,277	69,234.24	0.00
103	301388	欣灵电气	2,920	67,802.40	0.00
104	301138	华研精机	2,849	67,720.73	0.00
105	301316	慧博云通	3,584	67,028.63	0.00
106	301267	华夏眼科	1,006	66,597.20	0.00
107	688722	同益中	3,687	66,587.22	0.00
108	301368	丰立智能	3,368	66,558.14	0.00
109	301319	唯特偶	1,149	66,253.15	0.00
110	688509	正元地信	15,433	62,349.32	0.00
111	688071	华依科技	1,101	62,217.51	0.00
112	301158	德石股份	3,783	59,960.55	0.00
113	301231	荣信文化	2,744	57,404.12	0.00
114	301228	实朴检测	3,721	57,377.82	0.00
115	688571	杭华股份	8,200	57,318.00	0.00
116	301309	万得凯	2,271	56,692.74	0.00
117	301052	果麦文化	2,520	56,095.20	0.00
118	301182	凯旺科技	2,932	55,180.24	0.00
119	688480	赛恩斯	2,302	50,920.24	0.00
120	301098	金埔园林	3,069	48,306.06	0.00
121	301327	华宝新能	242	42,826.74	0.00
122	688255	凯尔达	1,648	42,370.08	0.00
123	300811	铂科新材	480	41,505.60	0.00
124	301367	怡和嘉业	223	39,198.94	0.00
125	301029	怡合达	555	36,485.70	0.00
126	600955	维远股份	1,694	35,184.38	0.00
127	001338	永顺泰	1,649	34,826.88	0.00
128	301050	雷电微力	420	32,411.40	0.00
129	688565	力源科技	3,450	30,567.00	0.00
130	600927	永安期货	1,859	29,967.08	0.00
131	001227	兰州银行	7,868	29,662.36	0.00
132	601022	宁波远洋	1,983	26,770.50	0.00
133	603071	物产环能	1,627	26,324.86	0.00
134	600115	中国东航	4,660	25,769.80	0.00

135	603191	望变电气	1,149	25,530.78	0.00
136	603122	合富中国	2,198	24,617.60	0.00
137	600935	华塑股份	4,811	21,649.50	0.00
138	603209	兴通股份	595	21,610.40	0.00
139	301058	中粮科工	1,386	20,720.70	0.00
140	001308	康冠科技	667	20,703.68	0.00
141	300981	中红医疗	1,082	20,319.96	0.00
142	001215	千味央厨	295	19,340.20	0.00
143	001228	永泰运	383	18,962.33	0.00
144	605555	德昌股份	917	18,615.10	0.00
145	603206	嘉环科技	1,210	18,500.90	0.00
146	301363	美好医疗	445	16,843.25	0.00
147	301039	中集车辆	2,064	16,450.08	0.00
148	603051	鹿山新材	272	16,295.52	0.00
149	001217	华尔泰	1,239	16,206.12	0.00
150	001216	华瓷股份	1,177	16,066.05	0.00
151	603132	金徽股份	1,342	16,063.74	0.00
152	300996	普联软件	386	15,845.30	0.00
153	301089	拓新药业	220	15,840.00	0.00
154	300982	苏文电能	317	15,628.10	0.00
155	300902	国安达	551	15,240.66	0.00
156	301073	君亭酒店	216	15,141.60	0.00
157	301069	凯盛新材	539	14,865.62	0.00
158	300986	志特新材	370	14,337.50	0.00
159	605598	上海港湾	553	13,769.70	0.00
160	603070	万控智造	775	13,640.00	0.00
161	603176	汇通集团	1,924	13,333.32	0.00
162	603130	云中马	480	13,176.00	0.00
163	001317	三羊马	300	12,840.00	0.00
164	603230	内蒙新华	1,140	12,574.20	0.00
165	001256	炜冈科技	474	12,390.36	0.00
166	001333	光华股份	426	12,332.70	0.00
167	300997	欢乐家	928	12,064.00	0.00
168	001300	三柏硕	763	11,826.50	0.00
169	001299	美能能源	576	11,635.20	0.00
170	001313	粤海饲料	1,232	11,580.80	0.00
171	300941	创识科技	599	11,416.94	0.00
172	603151	邦基科技	535	11,256.40	0.00
173	301015	百洋医药	462	11,014.08	0.00
174	300908	仲景食品	285	10,929.75	0.00
175	300918	南山智尚	1,063	10,927.64	0.00
176	001319	铭科精技	536	10,843.28	0.00
177	301180	万祥科技	654	10,758.30	0.00

178	603216	梦天家居	772	10,599.56	0.00
179	301030	仕净科技	242	10,093.82	0.00
180	301046	能辉科技	290	10,048.50	0.00
181	605599	菜百股份	980	9,976.40	0.00
182	605566	福莱蒾特	435	9,952.80	0.00
183	301126	达嘉维康	662	9,857.18	0.00
184	301078	孩子王	756	9,790.20	0.00
185	603182	嘉华股份	546	9,778.86	0.00
186	605567	春雪食品	629	9,705.47	0.00
187	301009	可靠股份	801	9,612.00	0.00
188	300993	玉马遮阳	738	9,594.00	0.00
189	301118	恒光股份	315	9,516.15	0.00
190	301108	洁雅股份	280	9,452.80	0.00
191	300968	格林精密	1,162	9,319.24	0.00
192	301004	嘉益股份	312	9,291.36	0.00
193	300940	南极光	491	9,166.97	0.00
194	001266	宏英智能	346	9,155.16	0.00
195	001219	青岛食品	354	9,126.12	0.00
196	603280	南方路机	363	8,893.50	0.00
197	301185	鸥玛软件	578	8,797.16	0.00
198	300962	中金辐照	576	8,784.00	0.00
199	301026	浩通科技	203	8,526.00	0.00
200	603219	富佳股份	528	8,474.40	0.00
201	603215	比依股份	575	8,423.75	0.00
202	300994	久祺股份	420	8,282.40	0.00
203	301198	喜悦智行	341	8,265.84	0.00
204	301199	迈赫股份	402	8,003.82	0.00
205	001288	运机集团	537	7,969.08	0.00
206	605580	恒盛能源	654	7,893.78	0.00
207	605138	盛泰集团	723	7,779.48	0.00
208	300930	屹通新材	322	7,766.64	0.00
209	001296	长江材料	403	7,745.66	0.00
210	300966	共同药业	286	7,722.00	0.00
211	001234	泰慕士	333	7,675.65	0.00
212	300942	易瑞生物	443	7,593.02	0.00
213	301021	英诺激光	290	7,479.10	0.00
214	600276	恒瑞医药	194	7,474.82	0.00
215	300614	百川畅银	329	7,425.53	0.00
216	605033	美邦股份	423	7,241.76	0.00
217	301048	金鹰重工	843	7,182.36	0.00
218	301020	密封科技	421	7,026.49	0.00
219	300978	东箭科技	593	6,617.88	0.00
220	605298	必得科技	508	6,548.12	0.00

221	301028	东亚机械	733	6,545.69	0.00
222	603150	万朗磁塑	250	6,492.50	0.00
223	301011	华立科技	228	6,363.48	0.00
224	300952	恒辉安防	340	6,317.20	0.00
225	300985	致远新能	295	6,177.30	0.00
226	001209	洪兴股份	450	6,102.00	0.00
227	301133	金钟股份	286	5,988.84	0.00
228	301012	扬电科技	170	5,934.70	0.00
229	300814	中富电路	328	5,923.68	0.00
230	301002	崧盛股份	261	5,872.50	0.00
231	605577	龙版传媒	588	5,844.72	0.00
232	300950	德固特	329	5,727.89	0.00
233	300963	中洲特材	368	5,586.24	0.00
234	300922	天秦装备	402	5,515.44	0.00
235	301045	天禄科技	335	5,440.40	0.00
236	301016	雷尔伟	275	5,423.00	0.00
237	301066	万事利	482	5,412.86	0.00
238	301063	海锅股份	153	5,205.06	0.00
239	300972	万辰生物	430	5,177.20	0.00
240	300774	倍杰特	444	5,154.84	0.00
241	300958	建工修复	300	5,106.00	0.00
242	300998	宁波方正	201	5,089.32	0.00
243	300971	博亚精工	245	4,848.55	0.00
244	301040	中环海陆	241	4,607.92	0.00
245	300975	商络电子	738	4,546.08	0.00
246	300931	通用电梯	672	4,428.48	0.00
247	301049	超越科技	196	4,129.72	0.00
248	301025	读客文化	403	4,082.39	0.00
249	301062	上海艾录	523	4,079.40	0.00
250	300961	深水海纳	394	4,034.56	0.00
251	300948	冠中生态	324	3,991.68	0.00
252	300960	通业科技	234	3,987.36	0.00
253	301033	迈普医学	108	3,983.04	0.00
254	301027	华蓝集团	286	3,861.00	0.00
255	301032	新柴股份	513	3,852.63	0.00
256	301010	晶雪节能	218	3,847.70	0.00
257	301072	中捷精工	181	3,710.50	0.00
258	300992	泰福泵业	200	3,590.00	0.00
259	301068	大地海洋	144	3,536.64	0.00
260	301037	保立佳	213	3,422.91	0.00
261	301036	双乐股份	205	3,398.90	0.00
262	300995	奇德新材	191	3,306.21	0.00
263	301007	德迈仕	303	3,296.64	0.00

264	301053	远信工业	155	3,144.95	0.00
265	300854	中兰环保	203	3,101.84	0.00
266	600176	中国巨石	43	589.53	0.00
267	600110	诺德股份	62	492.90	0.00
268	002624	完美世界	28	356.16	0.00
269	600546	山煤国际	15	217.35	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	002472	双环传动	97,185,737.50	4.90
2	601567	三星医疗	82,856,342.37	4.18
3	300014	亿纬锂能	82,193,815.42	4.15
4	002011	盾安环境	75,680,732.05	3.82
5	601838	成都银行	75,316,533.11	3.80
6	300724	捷佳伟创	72,113,676.04	3.64
7	002304	洋河股份	71,080,979.11	3.58
8	002459	晶澳科技	67,167,994.42	3.39
9	601012	隆基绿能	64,858,323.08	3.27
10	300122	智飞生物	60,654,244.78	3.06
11	601888	中国中免	56,424,989.40	2.85
12	300760	迈瑞医疗	53,469,831.00	2.70
13	600660	福耀玻璃	53,352,601.32	2.69
14	600309	万华化学	53,210,505.12	2.68
15	000596	古井贡酒	51,445,286.66	2.59
16	603345	安井食品	49,467,889.95	2.49
17	600031	三一重工	48,921,168.92	2.47
18	600989	宝丰能源	48,796,796.81	2.46
19	002049	紫光国微	48,171,373.20	2.43
20	688599	天合光能	47,698,594.21	2.41
21	002812	恩捷股份	47,250,146.90	2.38
22	002311	海大集团	46,176,076.74	2.33
23	688190	云路股份	44,612,923.13	2.25
24	300274	阳光电源	44,521,044.70	2.25
25	002648	卫星化学	43,529,298.13	2.20
26	600809	山西汾酒	42,919,324.00	2.16
27	688800	瑞可达	42,781,724.47	2.16
28	000049	德赛电池	42,541,242.06	2.15
29	600383	金地集团	42,122,860.08	2.12
30	600519	贵州茅台	40,771,404.07	2.06
31	603260	合盛硅业	40,158,463.90	2.03
32	000568	泸州老窖	39,957,245.36	2.02

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

8.4.2 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	603032	德新科技	115,218,552.66	5.81
2	600690	海尔智家	96,998,059.45	4.89
3	603806	福斯特	80,939,192.23	4.08
4	002049	紫光国微	70,796,735.10	3.57
5	603596	伯特利	62,477,272.56	3.15
6	002179	中航光电	56,768,309.26	2.86
7	601012	隆基绿能	56,579,080.31	2.85
8	603259	药明康德	56,482,000.18	2.85
9	000596	古井贡酒	54,925,809.26	2.77
10	300144	宋城演艺	53,732,988.52	2.71
11	601166	兴业银行	53,590,391.00	2.70
12	600529	山东药玻	51,538,326.40	2.60
13	000049	德赛电池	50,963,095.51	2.57
14	002991	甘源食品	50,491,311.00	2.55
15	002001	新和成	49,814,235.77	2.51
16	002311	海大集团	49,335,830.01	2.49
17	600399	抚顺特钢	48,064,844.90	2.42
18	600521	华海药业	46,898,286.52	2.37
19	601155	新城控股	45,698,768.33	2.30
20	600563	法拉电子	45,315,376.18	2.29
21	300274	阳光电源	44,902,667.22	2.26
22	300628	亿联网络	44,761,062.52	2.26
23	603348	文灿股份	44,273,383.24	2.23
24	002531	天顺风能	44,156,369.84	2.23
25	600966	博汇纸业	43,392,052.90	2.19
26	000568	泸州老窖	43,326,578.00	2.19
27	688599	天合光能	43,154,917.11	2.18
28	600031	三一重工	42,666,877.33	2.15
29	002812	恩捷股份	41,537,159.24	2.09
30	600989	宝丰能源	41,475,144.94	2.09
31	603589	口子窖	40,677,556.26	2.05
32	300122	智飞生物	40,431,520.00	2.04

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。

8.4.3 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	3,049,642,812.28
卖出股票收入（成交）总额	3,069,753,094.97

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。

8.5 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,993.85	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,993.85	0.00

8.6 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	128125	华阳转债	19	1,993.85	0.00

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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

成都银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到中国人民银行成都分行的处罚。

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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	362,396.29
2	应收清算款	7,638,531.15
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	38,445.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,039,373.07

8.12.4 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	128125	华阳转债	1,993.85	0.00

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002472	双环传动	25,820,837.68	1.68	非公开发行流通受限

8.12.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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 (%)
76, 113	25, 423. 31	54, 887, 124. 96	2. 84	1, 880, 157, 154. 65	97. 16

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	徐慧均	4, 000, 000. 00	5. 15
2	张宝林	2, 252, 881. 00	2. 90
3	俞春娇	1, 000, 256. 00	1. 29
4	王春黎	713, 988. 00	0. 92
5	万安科	611, 082. 00	0. 79
6	郭志峰	570, 800. 00	0. 73
7	宋建甫	544, 079. 00	0. 70
8	张礼德	535, 000. 00	0. 69
9	李继民	514, 500. 00	0. 66
10	吴亓	501, 200. 00	0. 65

注：持有人为场内持有人。

9.3 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	64, 492. 10	0. 0033

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。

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

注：无。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2006 年 7 月 18 日) 基金份额总额	1, 876, 753, 992. 72
本报告期期初基金份额总额	1, 888, 845, 016. 41
本报告期基金总申购份额	180, 612, 663. 77
减：本报告期基金总赎回份额	134, 413, 400. 57

本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,935,044,279.61

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人的重大人事变动：

报告期内，公司原董事 AndreaVismara 先生辞去本公司董事职务。经 2022 年第三次临时股东大会会议审议通过，股东会同意由 SandroVesprini 先生担任本公司董事，任职日期自 2022 年 3 月 31 日起。

报告期内，公司原监事 SandroVesprini 先生辞去本公司监事职务。经 2022 年第三次临时股东大会会议审议通过，股东会同意由 LorenzoPetracca 先生担任本公司监事，任职日期自 2022 年 3 月 31 日起。

报告期内，刘崮先生不再担任监事。经民主选举，宁江先生当选为公司职工监事，任职日期自 2022 年 9 月 8 日起。

报告期内，经公司第六届董事会第一百一十次会议审议通过，聘任刘崮先生担任公司副总经理，任职日期自 2022 年 9 月 7 日起。

本公司已将上述变更事项报中国证券监督管理委员会深圳监管局备案。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

无。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

未改变。

11.5 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。本年度应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用 100,000.00 元，该审计机构已提供审计服务的年限为 16 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：无。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：无。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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 (%)	
天风证券	2	1,045,769,285.84	17.23	888,734.44	16.19	-
中信建投证券	1	756,608,823.28	12.47	694,443.67	12.65	-
民生证券	1	690,317,697.70	11.37	642,893.16	11.71	本报告期新增
方正证券	2	624,795,470.24	10.29	570,192.09	10.39	-
长江证券	1	530,267,782.58	8.74	486,238.17	8.86	-
长城证券	1	434,531,148.80	7.16	397,319.39	7.24	-
光大证券	1	372,797,923.00	6.14	341,360.36	6.22	-
华创证券	1	295,476,125.62	4.87	271,049.76	4.94	-
平安证券	2	235,385,644.23	3.88	214,834.00	3.91	-
中金公司	1	184,257,710.96	3.04	168,021.45	3.06	-
银河证券	2	147,505,154.88	2.43	135,899.40	2.48	-
中金财富	1	137,773,002.42	2.27	126,926.56	2.31	-
广发证券	2	121,457,232.08	2.00	111,717.45	2.03	-
兴业证券	3	121,174,448.58	2.00	99,520.31	1.81	-

中信证券	1	96,083,882.31	1.58	88,521.49	1.61	-
国泰君安	2	94,332,551.40	1.55	86,903.44	1.58	-
招商证券	1	92,662,259.87	1.53	84,443.65	1.54	-
国信证券	1	30,695,014.94	0.51	28,110.29	0.51	-
申万宏源证券	1	30,471,112.00	0.50	27,769.50	0.51	-
东方财富证券	1	10,329,458.00	0.17	9,413.47	0.17	-
西部证券	1	10,271,669.00	0.17	9,463.41	0.17	-
华西证券	1	6,658,941.00	0.11	6,134.89	0.11	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
瑞信方正	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

注：交易单元选择的标准和程序：

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

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

2) 选择交易单元的程序:

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

11.7.2 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 (%)
天风证券	596,333.38	56.61	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
银河证券	457,002.00	43.39	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
兴业证	-	-	-	-	-	-

券						
中信证 券	-	-	-	-	-	-
国泰君 安	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源证券	-	-	-	-	-	-
东方财 富证券	-	-	-	-	-	-
西部证 券	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
安信证 券	-	-	-	-	-	-
东莞证 券	-	-	-	-	-	-
高华证 券	-	-	-	-	-	-
国海证 券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
华泰证 券	-	-	-	-	-	-
瑞信方 正	-	-	-	-	-	-
瑞银证 券	-	-	-	-	-	-
上海证 券	-	-	-	-	-	-
湘财证 券	-	-	-	-	-	-
中航证 券	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-
中银国 际	-	-	-	-	-	-

11.8 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	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	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	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022年01月01日
3	鹏华价值优势混合型证券投资基金 (LOF) 暂停大额申购、转换转入和定期定额投资业务的公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022年01月11日
4	鹏华基金管理有限公司关于鹏华价值优势混合型证券投资基金 (LOF) 2022 年第 1 次分红公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022年01月12日
5	鹏华价值优势混合型证券投资基金 (LOF) 恢复大额申购、转换转入和定期定额投资业务的公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022年01月17日
6	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	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022年01月17日
7	鹏华价值优势混合型证券投资基金 (LOF) 2021 年第 4 季度报告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022年01月21日
8	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022年01月21日
9	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	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022年01月24日
10	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	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022年02月10日
11	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	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022年02月21日
12	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	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022年03月01日
13	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分	《证券时报》、基金管理人	2022年03月08日

	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	人网站及中国证监会基金电子披露网站	
14	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	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022年03月14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	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022年03月15日
16	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国光大银行股份有限公司申购(含定期定额申购)费率优惠活动的公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022年03月22日
17	鹏华价值优势混合型证券投资基金(LOF)2021年年度报告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022年03月30日
18	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与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	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022年04月19日
19	鹏华价值优势混合型证券投资基金(LOF)2022年第1季度报告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022年04月21日
20	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	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022年04月21日
21	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	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022年04月25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	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022年04月27日
23	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	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022年04月28日
24	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022年04月30日
25	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	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基	2022年05月06日

	下基金相关销售业务的公告	金电子披露网站	
26	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	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022年05月13日
27	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	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022年05月30日
28	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	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022年06月06日
29	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	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022年06月18日
30	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022年07月06日
31	鹏华价值优势混合型证券投资基金(LOF)更新的招募说明书	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022年07月12日
32	鹏华价值优势混合型证券投资基金(LOF)基金产品资料概要(更新)	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022年07月12日
33	鹏华基金管理有限公司关于暂停喜鹊财富基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022年07月15日
34	鹏华价值优势混合型证券投资基金(LOF) 2022年第2季度报告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022年07月20日
35	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与西南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	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022年07月25日
36	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022年08月04日
37	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与长城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	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022年08月04日
38	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022年08月11日
39	鹏华价值优势混合型证券投资基金	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022年08月30日

	(LOF) 2022 年中期报告	人网站及中国证监会基金电子披露网站	
40	鹏华基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 09 月 07 日
41	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购唯万密封首次公开发行 A 股的公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 09 月 08 日
42	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购永信至诚首次公开发行 A 股的公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 10 月 14 日
43	鹏华基金管理有限公司关于运用固有资金投资旗下基金的公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 10 月 18 日
44	鹏华价值优势混合型证券投资基金 (LOF) 2022 年第 3 季度报告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 10 月 25 日
45	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 11 月 01 日
46	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 12 月 10 日
47	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 12 月 14 日
48	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与华泰证券股份有限公司认/申购 (含定期定额投资) 费率优惠活动的公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 12 月 15 日
49	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与渤海证券股份有限公司申购 (含定期定额投资) 费率优惠活动的公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 12 月 31 日
50	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申购 (含定期定额投资) 费率优惠活动的公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 12 月 31 日
51	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国工商银行股份有限公司个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 12 月 31 日
52	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国工商银行股份有限公司	《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基	2022 年 12 月 31 日

	“2023 倾心回馈”基金定期定额申购费率优惠活动的公告	金电子披露网站	
--	------------------------------	---------	--

注：无。

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- (一)《鹏华价值优势混合型证券投资基金 (LOF) 基金合同》；
- (二)《鹏华价值优势混合型证券投资基金 (LOF) 托管协议》；
- (三)《鹏华价值优势混合型证券投资基金 (LOF) 2022 年年度报告》(原文)。

13.2 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。

13.3 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

2023 年 3 月 30 日