

鹏华兴悦定期开放灵活配置混合型证券投资  
基金  
2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 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 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	9
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>13</b>
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	19
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>39</b>
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	45

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 .....	45
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 .....	45
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 .....	45
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 .....	45
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	46
7.12 投资组合报告附注 .....	46
<b>§ 8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>47</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	47
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 .....	47
<b>§ 9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>47</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>47</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	47
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 .....	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	48
10.4 基金投资策略的改变 .....	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	48
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 .....	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	48
10.8 其他重大事件 .....	51
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>52</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	53
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>53</b>
12.1 备查文件目录 .....	53
12.2 存放地点 .....	53
12.3 查阅方式 .....	53

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华兴悦定期开放灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	鹏华兴悦定期开放混合
基金主代码	003780
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 12 月 13 日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	181,560,522.36 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的基础上，通过定期开放的形式保持适度流动性，力求取得超越基金业绩比较基准的收益。
投资策略	<p>1、资产配置策略 本基金将通过跟踪考量通常的宏观经济变量（包括 GDP 增长率、CPI 走势、M2 的绝对水平和增长率、利率水平与走势等）以及各项国家政策（包括财政、税收、货币、汇率政策等），并结合美林时钟等科学严谨的资产配置模型，动态评估不同资产大类在不同时期的投资价值及其风险收益特征，在股票、债券和货币等资产间进行大类资产的灵活配置。</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上市公司，严选其中安全边际较高的个股构建投资组合：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；自下而上地评判企业的产品、核心竞争力、管理层、治理结构等；并结合企业基本面和估值水平进行综合的研判，严选安全边际较高的个股。</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 本基金主要从两方面进行自下而上的个股选择：一方面是竞争力分析，通过对公司竞争策略和核心竞争力的分析，选择具有可持续竞争优势的上市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，在国内监管体系落后、公司治理结构不完善的基础上，上市公司的命运对管理团队的依赖度大大增加。本基金将着重考察公司的管理层以及管理制度。</p> <p>（3）综合研判 本基金在自上而下和自下而上的基础上，结</p>

	<p>合估值分析, 严选安全边际较高的个股, 力争实现组合的绝对收益。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。 (4) 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、中小企业私募债投资策略等积极投资策略, 灵活地调整组合的券种搭配, 精选安全边际较高的个券。 (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。 (7) 中小企业私募债投资策略 本基金将深入研究发行人资信及公司运营情况, 与中小企业私募债券承销商紧密合作, 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, 力求规避可能存在的债券违约, 并获取超额收益。 4、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。 5、权证投资策略 本基金通过对权证标的证券基本面的研究, 并结合权证定价模型及价值挖掘策略、价差策略、双向权证策略等寻求权证的合理估值水平, 追求稳定的当期收益。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×30%+中证全债指数收益率×70%
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	招商银行股份有限公司	
信息披露 负责人	姓名	高永杰	张姗
	联系电话	0755-81395402	0755-83077987
	电子邮箱	xxpl@phfund.com.cn	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话	4006788999	95555	
传真	0755-82021126	0755-83195201	
注册地址	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦	
办公地址	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦	
邮政编码	518048	518040	
法定代表人	何如	缪建民	

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的互联网网址	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(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	1,420,312.59
本期利润	4,017,266.61
加权平均基金份额本期利润	0.0220
本期加权平均净值利润率	1.84%
本期基金份额净值增长率	2.05%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	30,411,406.92
期末可供分配基金份额利润	0.1675
期末基金资产净值	218,681,255.55
期末基金份额净值	1.2045
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	40.11%

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

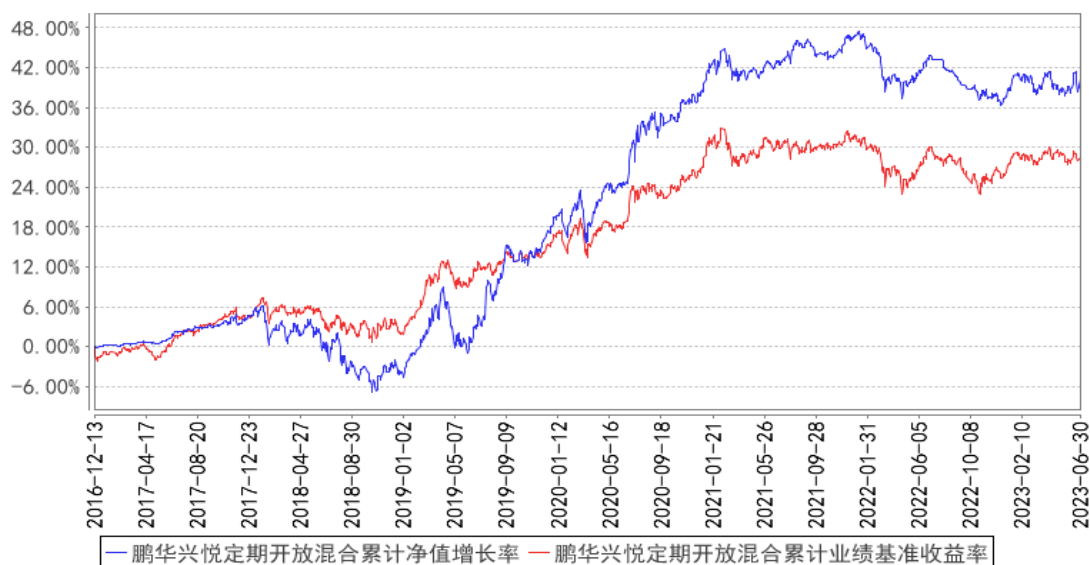
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	1.13%	0.49%	0.75%	0.25%	0.38%	0.24%
过去三个月	0.58%	0.39%	-0.17%	0.24%	0.75%	0.15%
过去六个月	2.05%	0.35%	1.93%	0.25%	0.12%	0.10%
过去一年	-2.61%	0.27%	-1.24%	0.29%	-1.37%	-0.02%
过去三年	12.08%	0.35%	7.65%	0.36%	4.43%	-0.01%
自基金合同生效起至今	40.11%	0.43%	28.43%	0.35%	11.68%	0.08%

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

#### 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

鹏华兴悦定期开放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 2016 年 12 月 13 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 6 月 30 日，公司管理资产总规模达到 11517 亿元，301 只公募基金、13 只全国社保投资组合、7 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		
刘方正	基金经理	2016-12-13	-	13 年	刘方正先生，国籍中国，理学硕士，13 年证券从业经验。2010 年 6 月加盟鹏华基金管理有限公司，从事债券研究工作，历任固定收益部高级研究员、基金经理助理，现任稳定收益投资部副总经理/基金经理。2015 年 03 月至 2017 年 01 月担任鹏华弘利灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015 年 03 月至 2015 年 08 月担任鹏华行业成长证券投资基金基金经理，2015 年 04 月至 2017 年 01 月担任鹏华弘润灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015 年 05 月至今担任鹏华弘华灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015 年 05 月至 2017 年 01 月担任鹏华弘益灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015 年 05 月至今担任鹏华弘和灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015 年 06 月至 2017 年 01 月担任鹏华弘鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015 年 08 月至今担任鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金基金经理，2015 年 08 月至 2017 年 01 月担任鹏华弘泰灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 03 月至 2018 年 05

				月担任鹏华弘锐灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2016 年 03 月至 2017 年 05 月担任鹏华弘实灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2016 年 03 月至 2022 年 12 月担任鹏华弘信灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2016 年 08 月至今担任鹏华弘达灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2016 年 08 月至 2017 年 12 月担任鹏华弘嘉灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2016 年 09 月至 2022 年 08 月担任鹏华弘惠灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2016 年 11 月至 2018 年 01 月担任鹏华兴裕定期开放灵活配置混合型基金基金经理, 2016 年 11 月至今担任鹏华兴泰定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2016 年 12 月至今担任鹏华兴悦定期开放灵活配置混合型基金基金经理, 2017 年 09 月至 2018 年 08 月担任鹏华兴益定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2018 年 05 月至今担任鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2023 年 02 月至今担任鹏华永瑞一年封闭式债券型证券投资基金基金经理, 刘方正先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理未发生变动。
--	--	--	--	---

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

2. 证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

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

注：无。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行公平交易制度，确保不同投资组合在研究、交易、分配等

各环节得到公平对待。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 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

2023 年上半年，宏观经济总需求在 2022 年底触底反弹后略微有所延续，二季度又稍有回落，内需呈现前高后低走势，其中，基建投资仍保持一定稳定节奏，制造业也是政策重点鼓励方向，保持一定动力，但是由于内外需整体的扰动，制造业自发动力有减弱迹象。房地产方面，销售在年初有所好转，但二季度持续有所回落，竣工仍保持一定节奏，新开工和拿地动力偏弱，消费整体也有回落趋势。因此，内需有一定减弱的迹象，外需也受到欧美央行逐步加息产生一定的抑制效果，内外需的不确定性仍然较大。财政政策方面，融资和投资都是支撑经济的重要来源。金融数据方面，社融在逐步确立底部区域以后，一季度有明显反弹，与经济表现一致，但二季度有明显回落。

2023 年上半年，权益市场整体处于底部震荡走势，年初延续去年四季度以来的复苏趋势，但伴随经济复苏动力走弱，市场逐渐趋缓，但并未跌至 2022 年运行的较低区间，在窄幅区间震荡，结构上分化较为明显，2022 年表现较为突出新能源、光伏等行业明显走弱，AI 和中特估等板块较为活跃，且对大盘有明显支撑。债券收益率伴随经济动力走弱和降息趋势的启动，仍在缓慢下行趋势之中，整体处于历史较低水平震荡。

本基金以追求稳定收益为主要投资策略，控制基金净值回撤幅度。在操作上，保持稳健的中短久期债券资产配置，以固定收益类资产为主要方向，在严格控制整体仓位的前提下，少量参与股票二级市场投资，同时，积极参与新股、可转债、可交换债的网下申购获取增强收益。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期鹏华兴悦定开混合份额净值增长率为 2.05%，同期业绩比较基准增长率为 1.93%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，我们认为内外需都具备较大的不确定性，内生增长动力不足逐渐反应在整体宏观经济全部产业链上，房地产重要性逐步降低，但对冲房地产下行的需求仍显不足，基建维持稳定，

但上冲动力有限，制造业跟随需求的扰动压力仍然较大，外需受到加息周期尚未结束的影响，仍有趋势性的回落压力。因此，总趋势上需求偏弱的局面仍将持续，政策大幅度刺激的可能性较低，但需求的低点已经在 2022 年下半年过去，现阶段仍是需求企稳之后的再次回落，经济自发动力修复过程中的一个阶段。流动性上仍保持稳定，较低的利率环境仍然有利于信用环境的积累和信用宽松的扩散。

在此环境下，我们认为权益市场整体的底部区域在 2022 年已经逐步确立完成，流动性环境也持续向有利于权益类资产汇集，但企业盈利的趋势尚未形成，盈利的底部大概率已经逐步确立，且宽基指数的估值也处于历史较为合理较为安全的区间，因此权益市场未来仍将有一定震荡走势，向下空间较为有限，但向上动力仍在积累，等待形成合力。债券方面，目前收益率水平仍处于历史极低区域，与经济所处的客观情况也相对匹配，对未来的预期也并不清晰，在流动性宽松和降息趋势之下，收益率较低仍将在中短期内维持，中长久期资产波动风险仍然存在。

未来我们仍将坚持稳健的投资策略，稳步增加固定收益率资产配置，保持中高仓位、中短久期的债券配置，严控仓位情况下适当参与股票市场，并通过参与新股、可转债、可交换债网下申购等投资，追求稳定的投资收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术。

本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本基金管理人设有估值委员会，由登记结算部、监察稽核部、各投资部门、研究部门负责人、基金经理等成员组成，估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规和基金估值运作等方面的专业能力。基金经理可与估值委员会成员共同商定估值原则和政策，但不参与日常估值的执行。

基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值发生重大变化的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

本基金管理人已与第三方定价服务机构签署服务协议，由其按约定提供相关参考数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1、截止本报告期末，本基金期末可供分配利润为 30,411,406.92 元，期末基金份额净值 1.2045

元。

2、本基金本报告期内未进行利润分配。

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

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

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

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

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

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

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：鹏华兴悦定期开放灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	3,490,764.00	6,426,315.47
结算备付金		4,832,125.43	14,712,871.57
存出保证金		34,860.45	54,006.30

交易性金融资产	6.4.7.2	269,129,699.17	302,360,361.40
其中：股票投资		94,383,802.19	56,927,626.06
基金投资		-	-
债券投资		174,745,896.98	245,432,735.34
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		1,479,212.65	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		278,966,661.70	323,553,554.74
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年6月30日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		59,977,627.40	119,967,854.73
应付清算款		33,558.90	64,290.55
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		125,276.40	129,371.03
应付托管费		17,896.62	18,481.55
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		8,847.58	29,104.49
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	122,199.25	231,571.63
负债合计		60,285,406.15	120,440,673.98
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	181,560,522.36	172,087,278.42
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	37,120,733.19	31,025,602.34
净资产合计		218,681,255.55	203,112,880.76

负债和净资产总计		278,966,661.70	323,553,554.74
----------	--	----------------	----------------

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.2045 元，基金份额总额 181,560,522.36 份。

## 6.2 利润表

会计主体：鹏华兴悦定期开放灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		5,440,460.00	-8,103,951.41
1. 利息收入		354,039.51	89,899.97
其中：存款利息收入	6.4.7.13	94,121.84	89,899.97
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		259,917.67	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,489,466.47	-2,670,907.81
其中：股票投资收益	6.4.7.14	2,475,894.02	-11,281,184.41
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-784,252.68	7,793,102.87
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	797,825.13	817,173.73
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	2,596,954.02	-5,522,943.57
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		1,423,193.39	1,972,151.73
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	757,262.75	1,525,907.26

2. 托管费	6.4.10.2.2	108,180.39	217,986.73
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		445,166.54	105,858.17
其中：卖出回购金融资产支出		445,166.54	105,858.17
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		4,918.48	13,587.86
8. 其他费用	6.4.7.23	107,665.23	108,811.71
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,017,266.61	-10,076,103.14
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,017,266.61	-10,076,103.14
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		4,017,266.61	-10,076,103.14

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：鹏华兴悦定期开放灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 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）	172,087,278.42	-	31,025,602.34	203,112,880.76
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）	172,087,278.42	-	31,025,602.34	203,112,880.76
三、本期增减变动额（减	9,473,243.94	-	6,095,130.85	15,568,374.79



少以“-”号填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	4,017,266.61	4,017,266.61
(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)	9,473,243.94	-	2,077,864.24	11,551,108.18
其中:1.基金申购款	33,827,599.84	-	7,171,451.13	40,999,050.97
2.基金赎回款	-24,354,355.90	-	-5,093,586.89	-29,447,942.79
(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)	181,560,522.36	-	37,120,733.19	218,681,255.55
项目	上年度可比期间 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)	308,766,049.89	-	144,501,401.00	453,267,450.89
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)	308,766,049.89	-	144,501,401.00	453,267,450.89
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-162,881,731.22	-	-80,522,451.88	-243,404,183.10
(一)、综合收益总额	-	-	-10,076,103.14	-10,076,103.14
(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)	-162,881,731.22	-	-70,446,348.74	-233,328,079.96
其中:1.基金申购款	6.97	-	3.02	9.99
2.基金赎回款	-162,881,738.19	-	-70,446,351.76	-233,328,089.95
(三)、本期向基金份额	-	-	-	-

额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	145,884,318.67	-	63,978,949.12	209,863,267.79

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

邓召明

邢彪

郝文高

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

鹏华兴悦定期开放灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于准予鹏华兴悦定期开放灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2016]2378 号文)批准,由鹏华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《鹏华兴悦定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于 2016 年 12 月 13 日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集规模为 1,220,164,308.97 份基金份额。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司(以下简称:招商银行)。

本基金于 2016 年 11 月 21 日至 2016 年 12 月 23 日募集,并提前于 2016 年 12 月 8 日募集完毕。募集期间净认购资金人民币 1,220,010,548.75 元,认购资金在募集期间产生的利息人民币 153,760.22 元,募集的有效认购份额及利息结转的基金份额合计 1,220,164,308.97 份。上述募集资金已由毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了毕马威华振验字第 1600968

号验资报告。

#### 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”)、《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》、《鹏华兴悦定期开放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 2023 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 2023 年 06 月 30 日的财务状况以及 2023 年上半年的经营成果和基金净资产变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值

税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

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

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

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
活期存款	3,490,764.00
等于：本金	3,490,405.71
加：应计利息	358.29
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	3,490,764.00

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	94,740,339.98	-	94,383,802.19	-356,537.79	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	151,654,802.86	2,333,716.16	153,603,716.16	-384,802.86
	银行间市场	20,424,331.50	606,180.82	21,142,180.82	111,668.50
	合计	172,079,134.36	2,939,896.98	174,745,896.98	-273,134.36
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	266,819,474.34	2,939,896.98	269,129,699.17	-629,672.15	

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 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	37,896.69

其中：交易所市场	37,896.69
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	84,302.56
合计	122,199.25

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	172,087,278.42	172,087,278.42
本期申购	33,827,599.84	33,827,599.84
本期赎回（以“-”号填列）	-24,354,355.90	-24,354,355.90
- 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	181,560,522.36	181,560,522.36

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
上年度末	27,553,027.70	3,472,574.64	31,025,602.34
本期利润	1,420,312.59	2,596,954.02	4,017,266.61
本期基金份额交易产生的变动数	1,438,066.63	639,797.61	2,077,864.24
其中：基金申购款	5,084,882.31	2,086,568.82	7,171,451.13
基金赎回款	-3,646,815.68	-1,446,771.21	-5,093,586.89
本期已分配利润	-	-	-
本期末	30,411,406.92	6,709,326.27	37,120,733.19

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
	活期存款利息收入
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	68,856.93
其他	323.72



合计	94,121.84
----	-----------

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 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	2,475,894.02
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	2,475,894.02

##### 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 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	30,352,661.35
减：卖出股票成本总额	27,759,272.57
减：交易费用	117,494.76
买卖股票差价收入	2,475,894.02

##### 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 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	2,144,705.83
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-2,928,958.51
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	-784,252.68

##### 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 2023年1月1日至2023年6月30日
----	----------------------------

卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	246,509,326.31
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	245,780,280.79
减：应计利息总额	3,657,429.03
减：交易费用	575.00
买卖债券差价收入	-2,928,958.51

#### 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**

注：无。

**6.4.7.19 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	797,825.13
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	797,825.13

**6.4.7.20 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1. 交易性金融资产	2,596,954.02
股票投资	-656,192.41
债券投资	3,253,146.43
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	2,596,954.02

**6.4.7.21 其他收入**

注：无。

**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 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费用	4,762.67

账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	107,665.23

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	4,624,645.00	4.82	2,482,288.31	1.17

###### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	30,195,010.00	8.33	35,351,385.00	12.13

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

注：无。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023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	3,798.32	4.77	-	-
关联方名称	上年度可比期间 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	2,013.84	1.05	-	-

注：（1）佣金的计算公式

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

（佣金比率按照与一般证券公司签订的协议条款订立。）

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

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	757,262.75	1,525,907.26
其中：支付销售机构的客户维护费	25,142.14	51,693.41

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 0.70%，逐日计提，按月支付。日管

理费=前一日基金资产净值×0.70%÷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 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	108,180.39	217,986.73

注：支付基金托管人招商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 2023年1月1日至2023年6月30 日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日

	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	3,490,764.00	24,941.19	109,243,112.70	61,463.73

#### 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（2023 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

注：无。

##### 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

截至本报告期末 2023 年 06 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 59,977,627.40 元，于 2023 年 07 月 03 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金。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，地方政府债，中期票据，短期融资券，超短期融资券，次级债，可转换债券，可交换债券，中小企业私募债等），货币市场工具（包含同业存单），债券回购，权证，资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监

会相关规定)。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同责任,或者基金所投资证券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况,导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行招商银行股份有限公司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**

注：无。

**6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

注：无。

**6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

注：无。

**6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	174,745,896.98	184,974,687.11
AAA 以下	-	-
未评级	-	60,458,048.23
合计	174,745,896.98	245,432,735.34

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 2023 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额 59,977,627.40 元将在一个月内到期且计息外，本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（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。

#### 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》及于基金开放期内按照《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%。于开放期内，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，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%。

于开放期内，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。

#### 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 2023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	3,490,764.00	-	-	-	3,490,764.00
结算备付金	4,832,125.43	-	-	-	4,832,125.43
存出保证金	34,860.45	-	-	-	34,860.45
交易性金融资产	61,016,916.16	113,728,980.82	-	94,383,802.19	269,129,699.17
应收清算款	-	-	-	1,479,212.65	1,479,212.65
资产总计	69,374,666.04	113,728,980.82	-	95,863,014.84	278,966,661.70
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	125,276.40	125,276.40
应付托管费	-	-	-	17,896.62	17,896.62
应付清算款	-	-	-	33,558.90	33,558.90
卖出回购金融资产款	59,977,627.40	-	-	-	59,977,627.40
应交税费	-	-	-	8,847.58	8,847.58
其他负债	-	-	-	122,199.25	122,199.25
负债总计	59,977,627.40	-	-	307,778.75	60,285,406.15
利率敏感度缺口	9,397,038.64	113,728,980.82	-	95,555,236.09	218,681,255.55
上年度末 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	6,426,315.47	-	-	-	6,426,315.47
结算备付金	14,712,871.57	-	-	-	14,712,871.57
存出保证金	54,006.30	-	-	-	54,006.30
交易性金融资产	20,416,185.75	225,016,549.59	-	56,927,626.06	302,360,361.40
资产总计	41,609,379.09	225,016,549.59	-	56,927,626.06	323,553,554.74
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	129,371.03	129,371.03
应付托管费	-	-	-	18,481.55	18,481.55
应付清算款	-	-	-	64,290.55	64,290.55
卖出回购金融资产款	119,967,854.73	-	-	-	119,967,854.73
应交税费	-	-	-	29,104.49	29,104.49
其他负债	-	-	-	231,571.63	231,571.63
负债总计	119,967,854.73	-	-	472,819.25	120,440,673.98
利率敏感度缺口	-78,358,475.64	225,016,549.59	-	56,454,806.81	203,112,880.76

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有债券资产的利率风险状况测算的理论变动值对基金资产净值的影响金额。		
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。		
	此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
分析	市场利率下降 25 个基点	445,355.72	879,832.75
	市场利率上升 25 个基点	-443,132.03	-874,340.31

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：封闭期内，股票（含存托凭证）资产占基金资产的比例为 0%-100%；开放期内，股票（含存托凭证）资产占基金资产的比例为 0%-95%，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例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。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

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 2023年6月30日		上年度末 2022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	94,383,802.19	43.16	56,927,626.06	28.03
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-

交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	94,383,802.19	43.16	56,927,626.06	28.03

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（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
分析	业绩比较基准上升5%	2,026,081.83	1,774,191.01
	业绩比较基准下降5%	-2,026,081.83	-1,774,191.01

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 2023年6月30日
---------------	-------------------

第一层次	94,383,802.19
第二层次	174,745,896.98
第三层次	-
合计	269,129,699.17

#### 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	94,383,802.19	33.83
	其中：股票	94,383,802.19	33.83
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	174,745,896.98	62.64
	其中：债券	174,745,896.98	62.64
	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	-	-

	产		
7	银行存款和结算备付金合计	8,322,889.43	2.98
8	其他各项资产	1,514,073.10	0.54
9	合计	278,966,661.70	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	542,560.00	0.25
B	采矿业	1,797,615.20	0.82
C	制造业	64,818,016.25	29.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,088,260.56	0.50
E	建筑业	7,636,760.80	3.49
F	批发和零售业	271,200.00	0.12
G	交通运输、仓储和邮政业	1,471,984.70	0.67
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,794,230.40	2.19
J	金融业	9,082,054.28	4.15
K	房地产业	252,840.00	0.12
L	租赁和商务服务业	371,188.00	0.17
M	科学研究和技术服务业	1,865,728.00	0.85
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	16,920.00	0.01
Q	卫生和社会工作	184,536.00	0.08
R	文化、体育和娱乐业	136,800.00	0.06
S	综合	53,108.00	0.02
	合计	94,383,802.19	43.16

### 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	002475	立讯精密	200,000	6,490,000.00	2.97
2	600031	三一重工	280,000	4,656,400.00	2.13
3	688007	光峰科技	220,000	4,587,000.00	2.10
4	601186	中国铁建	440,000	4,334,000.00	1.98



5	600150	中国船舶	120,000	3,949,200.00	1.81
6	000988	华工科技	98,200	3,732,582.00	1.71
7	600519	贵州茅台	2,000	3,382,000.00	1.55
8	688036	传音控股	20,154	2,962,638.00	1.35
9	002605	姚记科技	60,000	2,785,800.00	1.27
10	002601	龙佰集团	150,000	2,475,000.00	1.13
11	601390	中国中铁	311,300	2,359,654.00	1.08
12	600690	海尔智家	90,000	2,113,200.00	0.97
13	300750	宁德时代	9,180	2,100,292.20	0.96
14	002142	宁波银行	80,000	2,024,000.00	0.93
15	688110	东芯股份	54,618	1,971,709.80	0.90
16	688012	中微公司	12,460	1,949,367.00	0.89
17	000001	平安银行	168,900	1,896,747.00	0.87
18	300806	斯迪克	100,000	1,872,000.00	0.86
19	688981	中芯国际	35,951	1,816,244.52	0.83
20	603259	药明康德	28,800	1,794,528.00	0.82
21	688008	澜起科技	31,200	1,791,504.00	0.82
22	003021	兆威机电	20,000	1,754,600.00	0.80
23	600837	海通证券	171,200	1,578,464.00	0.72
24	300308	中际旭创	10,000	1,474,500.00	0.67
25	601318	中国平安	30,000	1,392,000.00	0.64
26	002185	华天科技	150,000	1,380,000.00	0.63
27	601899	紫金矿业	100,000	1,137,000.00	0.52
28	300866	安克创新	12,800	1,120,000.00	0.51
29	002410	广联达	28,560	927,914.40	0.42
30	601000	唐山港	256,000	903,680.00	0.41
31	000333	美的集团	14,000	824,880.00	0.38
32	603605	珀莱雅	7,280	818,272.00	0.37
33	300033	同花顺	4,400	771,232.00	0.35
34	600905	三峡能源	141,600	760,392.00	0.35
35	600989	宝丰能源	60,000	756,600.00	0.35
36	002466	天齐锂业	10,800	755,028.00	0.35
37	000651	格力电器	20,000	730,200.00	0.33
38	600419	天润乳业	40,000	648,800.00	0.30
39	601601	中国太保	24,800	644,304.00	0.29
40	300316	晶盛机电	9,000	638,100.00	0.29
41	600486	扬农化工	7,200	629,424.00	0.29
42	002913	奥士康	16,000	610,880.00	0.28
43	603228	景旺电子	20,000	513,000.00	0.23
44	600438	通威股份	14,400	494,064.00	0.23
45	002714	牧原股份	11,600	488,940.00	0.22
46	000887	中鼎股份	37,200	486,948.00	0.22
47	600111	北方稀土	20,000	479,600.00	0.22

48	600606	绿地控股	171,200	470,800.00	0.22
49	000581	威孚高科	24,400	384,300.00	0.18
50	002624	完美世界	22,000	371,580.00	0.17
51	001872	招商港口	20,400	352,308.00	0.16
52	601225	陕西煤业	18,800	341,972.00	0.16
53	601628	中国人寿	9,000	314,640.00	0.14
54	300699	光威复材	9,600	296,160.00	0.14
55	600809	山西汾酒	1,600	296,112.00	0.14
56	601669	中国电建	50,700	291,018.00	0.13
57	688561	奇安信-U	5,600	290,136.00	0.13
58	002434	万里扬	31,600	282,820.00	0.13
59	600176	中国巨石	19,600	277,536.00	0.13
60	000623	吉林敖东	16,000	256,640.00	0.12
61	001914	招商积余	16,800	252,840.00	0.12
62	300474	景嘉微	2,700	242,973.00	0.11
63	600941	中国移动	2,400	223,920.00	0.10
64	601888	中国中免	2,000	221,060.00	0.10
65	300072	海新能科	62,400	213,408.00	0.10
66	600369	西南证券	57,200	208,780.00	0.10
67	600025	华能水电	29,200	208,196.00	0.10
68	601156	东航物流	15,600	202,800.00	0.09
69	002174	游族网络	11,600	194,880.00	0.09
70	002240	盛新锂能	6,000	191,220.00	0.09
71	600522	中天科技	12,000	190,920.00	0.09
72	300244	迪安诊断	7,200	184,536.00	0.08
73	600039	四川路桥	18,480	181,288.80	0.08
74	600392	盛和资源	14,000	180,180.00	0.08
75	300363	博腾股份	6,000	177,540.00	0.08
76	600582	天地科技	30,000	174,900.00	0.08
77	600732	爱旭股份	5,600	172,200.00	0.08
78	603267	鸿远电子	2,400	156,720.00	0.07
79	600415	小商品城	17,600	150,128.00	0.07
80	000062	深圳华强	12,400	141,608.00	0.06
81	601928	凤凰传媒	12,000	136,800.00	0.06
82	601319	中国人保	23,200	135,488.00	0.06
83	600256	广汇能源	19,200	131,712.00	0.06
84	600188	兖矿能源	4,400	131,648.00	0.06
85	002756	永兴材料	2,080	130,228.80	0.06
86	000629	钒钛股份	32,000	125,120.00	0.06
87	600167	联美控股	16,000	111,520.00	0.05
88	000596	古井贡酒	400	98,952.00	0.05
89	300628	亿联网络	2,800	98,196.00	0.04
90	000301	东方盛虹	8,100	95,742.00	0.04

91	000703	恒逸石化	12,800	86,784.00	0.04
92	002078	太阳纸业	8,000	85,520.00	0.04
93	688006	杭可科技	2,800	85,316.00	0.04
94	601059	信达证券	5,628	80,255.28	0.04
95	002372	伟星新材	3,900	80,106.00	0.04
96	003035	南网能源	10,000	71,200.00	0.03
97	600546	山煤国际	4,800	69,456.00	0.03
98	000401	冀东水泥	8,400	61,908.00	0.03
99	600925	苏能股份	8,960	55,283.20	0.03
100	002299	圣农发展	2,800	53,620.00	0.02
101	000009	中国宝安	4,400	53,108.00	0.02
102	002867	周大生	2,800	49,784.00	0.02
103	600177	雅戈尔	6,800	42,908.00	0.02
104	002831	裕同科技	1,600	39,024.00	0.02
105	603281	江瀚新材	1,208	37,303.04	0.02
106	001311	多利科技	649	37,272.07	0.02
107	601187	厦门银行	7,200	36,144.00	0.02
108	002191	劲嘉股份	6,000	36,120.00	0.02
109	002416	爱施德	4,400	32,472.00	0.01
110	600704	物产中大	5,600	27,664.00	0.01
111	600398	海澜之家	4,000	27,520.00	0.01
112	002841	视源股份	400	26,736.00	0.01
113	001314	亿道信息	508	21,478.24	0.01
114	600195	中牧股份	1,800	21,024.00	0.01
115	002032	苏泊尔	400	20,000.00	0.01
116	603173	福斯达	588	17,316.60	0.01
117	002607	中公教育	3,600	16,920.00	0.01
118	601992	金隅集团	7,600	16,568.00	0.01
119	603162	海通发展	774	13,196.70	0.01
120	001333	光华股份	426	10,705.38	0.00
121	001256	炜冈科技	474	8,721.60	0.00
122	603291	联合水务	536	8,152.56	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	601186	中国铁建	4,487,036.00	2.21
2	601318	中国平安	4,355,192.00	2.14
3	002185	华天科技	4,253,353.00	2.09
4	000001	平安银行	3,394,578.00	1.67
5	688007	光峰科技	3,025,887.88	1.49
6	300308	中际旭创	2,955,899.00	1.46

7	600031	三一重工	2,940,892.00	1.45
8	002605	姚记科技	2,834,152.58	1.40
9	002142	宁波银行	2,580,710.00	1.27
10	600690	海尔智家	2,475,982.00	1.22
11	600419	天润乳业	2,391,720.00	1.18
12	688110	东芯股份	2,200,690.03	1.08
13	688981	中芯国际	2,191,363.38	1.08
14	688012	中微公司	2,191,323.52	1.08
15	000988	华工科技	2,169,163.00	1.07
16	603444	吉比特	2,167,538.00	1.07
17	688036	传音控股	2,164,891.70	1.07
18	601390	中国中铁	2,160,422.00	1.06
19	300806	斯迪克	1,830,936.95	0.90
20	003021	兆威机电	1,566,012.00	0.77

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	601318	中国平安	3,889,688.00	1.92
2	002185	华天科技	2,977,179.00	1.47
3	600150	中国船舶	2,790,443.00	1.37
4	600690	海尔智家	2,749,669.00	1.35
5	000333	美的集团	2,111,893.00	1.04
6	603444	吉比特	2,107,230.00	1.04
7	600419	天润乳业	1,885,944.00	0.93
8	002222	福晶科技	1,728,433.92	0.85
9	300308	中际旭创	1,480,810.00	0.73
10	600633	浙数文化	1,406,285.79	0.69
11	002493	荣盛石化	1,388,070.00	0.68
12	000032	深桑达 A	1,377,139.00	0.68
13	002142	宁波银行	1,266,392.00	0.62
14	002601	龙佰集团	1,092,880.00	0.54
15	000001	平安银行	993,362.00	0.49
16	002913	奥士康	702,777.00	0.35
17	600111	北方稀土	251,849.00	0.12
18	601121	宝地矿业	26,839.20	0.01
19	001337	四川黄金	24,130.50	0.01
20	603190	亚通精工	17,766.00	0.01

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	65,871,641.11
卖出股票收入（成交）总额	30,352,661.35

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	92,890,270.14	42.48
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	81,855,626.84	37.43
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	174,745,896.98	79.91

## 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	1928021	19 农业银行永续债 01	200,000	21,142,180.82	9.67
2	155613	19 中车 G2	100,000	10,395,835.62	4.75
3	188403	21 中化 01	100,000	10,315,417.53	4.72
4	188458	21 海通 06	100,000	10,294,929.86	4.71
5	188482	21 招证 G7	100,000	10,292,452.60	4.71

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

注：无。

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

注：无。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：无。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

## 7.12 投资组合报告附注

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

国泰君安证券股份有限公司在报告编制日前一年内受到中国人民银行上海分行的处罚。

招商证券股份有限公司在报告编制日前一年内受到中国证监会的处罚。

中国农业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的处罚。

中信证券股份有限公司在报告编制日前一年内受到中国人民银行的处罚。

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。

### 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	34,860.45
2	应收清算款	1,479,212.65
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,514,073.10

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
293	619,660.49	181,442,042.67	99.93	118,479.69	0.07

### 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	5,681.21	0.0031

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、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	-

注：1、截至本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人投资、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。

2、截至本报告期末，本基金的基金经理未持有本基金份额。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2016年12月13日)基金份额总额	1,220,164,308.97
本报告期期初基金份额总额	172,087,278.42
本报告期基金总申购份额	33,827,599.84
减：本报告期基金总赎回份额	24,354,355.90
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	181,560,522.36

## § 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**

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**

本基金本报告期投资策略未改变。

**10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况**

本报告期内未改聘为本基金审计的会计师事务所。

**10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况****10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**

注：无。

**10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**

注：本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

**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 (%)	
国海证券	2	32,399,090.05	33.77	26,610.03	33.43	-
开源证券	2	31,813,079.42	33.16	26,128.18	32.83	-
民生证券	2	13,675,833.53	14.26	11,232.02	14.11	-
东方证券	2	5,618,069.76	5.86	5,174.88	6.50	-
国盛证券	2	5,420,809.00	5.65	4,451.03	5.59	-
国信证券	2	4,624,645.00	4.82	3,798.32	4.77	-
中泰证券	2	2,380,564.00	2.48	2,193.20	2.76	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-



东方财富证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
摩根大通证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	报告期新增一个
中信建投证券	1	-	-	-	-	-
中原证券	1	-	-	-	-	-

注：交易单元选择的标准和程序：

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

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

2) 选择交易单元的程序：

我公司根据上述标准，选定符合条件的证券公司作为租用交易单元的对象。我公司投研部门

定期对所选定证券公司的服务进行综合评比，评比内容包括：提供研究报告质量、数量、及时性  
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 (%)
国海证 券	-	-	3,926,609,00 0.00	55.69	-	-
开源证 券	-	-	753,200,000. 00	10.68	-	-
民生证 券	-	-	-	-	-	-
东方证 券	-	-	1,001,000,00 0.00	14.20	-	-
国盛证 券	-	-	1,369,900,00 0.00	19.43	-	-
国信证 券	30,195,010. 00	8.33	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-
爱建证 券	-	-	-	-	-	-
安信证 券	-	-	-	-	-	-
川财证 券	-	-	-	-	-	-
东北证 券	-	-	-	-	-	-
东方财 富证券	-	-	-	-	-	-
东吴证 券	-	-	-	-	-	-
方正证 券	-	-	-	-	-	-
光大证 券	-	-	-	-	-	-

广发证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
摩根大通证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	332,367,000.00	91.67	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
中原证券	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《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	2023年01月04日
2	关于调整旗下部分基金参与中国工商银行股份有限公司申购、定期定额申购费率优惠活动时间公告	《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	2023年01月05日
3	鹏华兴悦定期开放灵活配置混合型证券投资基金 2022 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	2023年01月20日
4	鹏华兴悦定期开放灵活配置混合型证券投资基金开放申购、赎回和转换业务的公告	《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	2023年01月20日

5	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与东方财富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	2023 年 03 月 14 日
6	鹏华兴悦定期开放灵活配置混合型证券投资基金 2022 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	2023 年 03 月 30 日
7	鹏华基金管理有限公司关于新增人民币直销资金专户的公告	《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	2023 年 04 月 07 日
8	鹏华兴悦定期开放灵活配置混合型证券投资基金 2023 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	2023 年 04 月 21 日
9	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票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	2023 年 05 月 19 日
10	鹏华基金管理有限公司关于注意防范以协助办理贷款为借口进行诈骗活动的风险提示	《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	2023 年 06 月 03 日
11	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与国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	《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	2023 年 06 月 05 日
12	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	2023 年 06 月 06 日
13	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与北京中植基金销售有限公司申购（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	2023 年 06 月 20 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	20230101~20230630	125,732,048.05	0.00	0.00	125,732,048.05	69.25
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资份额；

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）《鹏华兴悦定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- （二）《鹏华兴悦定期开放灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- （三）《鹏华兴悦定期开放灵活配置混合型证券投资基金 2023 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

2023 年 8 月 30 日