

鹏华睿投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

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	10
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	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 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	21
§ 7 投资组合报告	48
7.1 期末基金资产组合情况	48
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	49
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	50
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	65
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	66

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	66
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	67
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	67
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	67
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	67
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	67
7.12 投资组合报告附注	67
§ 8 基金份额持有人信息.....	68
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	68
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	68
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	68
§ 9 开放式基金份额变动.....	69
§ 10 重大事件揭示	69
10.1 基金份额持有人大会决议	69
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	69
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	69
10.4 基金投资策略的改变	70
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	70
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	70
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	70
10.8 其他重大事件	73
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	75
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	75
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	75
§ 12 备查文件目录	75
12.1 备查文件目录	75
12.2 存放地点	75
12.3 查阅方式	75

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	鹏华睿投混合	
基金主代码	005434	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 5 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	
报告期末基金份额总额	363, 075, 688. 02 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	鹏华睿投混合 A	鹏华睿投混合 C
下属分级基金的交易代码	005434	016950
报告期末下属分级基金的份额总额	322, 439, 172. 66 份	40, 636, 515. 36 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的基础上,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、货币、税收、汇率政策等)来判断经济周期目前的位置以及未来将发展的方向,在此基础上对各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估,制定股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。</p> <p>2、股票投资策略 本基金通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘优质的公司,构建股票投资组合。核心思路在于:1)自上而下地分析行业的增长前景、行业结构、商业模式、竞争要素等分析把握其投资机会;2)自下而上地评判企业的核心竞争力、管理层、治理结构等以及其所提供的产品和服务是否契合未来行业增长的大趋势,对企业基本面和估值水平进行综合的研判,深度挖掘优质的个股。</p> <p>(1) 自上而下的行业遴选 本基金将自上而下地进行行业遴选,重点关注行业增长前景、行业利润前景和行业成功要素。对行业增长前景,主要分析行业的外部发展环境、行业的生命周期以及行业波动与经济周期的关系等;对行业利润前景,主要分析行业结构,特别是业内竞争的方式、业内竞争的激烈程度、以及业内厂商的谈判能力等。基于对行业结构的分析形成对业内竞争的关键成功要素的判断,为预测企业经营环境的变化建立起扎实的基础。</p> <p>(2) 自下而上的个股选择 本基金通过定性和定量相结合的方法进行自下而上的个股选择,对企业基本面和估值水平进行综合的研判,精选优质个股。</p> <p>1) 定性分析 本基金通过以下两方面标准对股票的基本面进</p>

	<p>行研究分析并筛选出优质的公司：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公司或未来具有广阔成长空间的公司。就公司竞争策略，基于行业分析的结果判断策略的有效性、策略的实施支持和策略的执行成果；就核心竞争力，分析公司的现有核心竞争力，并判断公司能否利用现有的资源、能力和定位取得可持续竞争优势。另一方面是管理层分析，通过着重考察公司的管理层以及管理制度，选择具有良好治理结构、管理水平较高的优质公司。</p> <p>2) 定量分析 本基金通过对公司定量的估值分析，挖掘优质的投资标的。通过对估值方法的选择和估值倍数的比较，选择股价相对低估的股票。就估值方法而言，基于行业的特点确定对股价最有影响力的关键估值方法（包括 PE（市盈率）、PEG（市盈率相对盈利增长比率）、PB（市账率）、PS（市销率）、EV/EBITDA（企业价值倍数）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。</p> <p>（3）存托凭证投资策略 本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。</p> <p>3、债券投资策略 本基金债券投资将采取久期策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、个券选择策略、信用策略等积极投资策略，自上而下地管理组合的久期，灵活地调整组合的券种搭配，同时精选个券，以增强组合的持有期收益。</p> <p>4、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> <p>5、中小企业私募债投资策略 中小企业私募债券是在中国境内以非公开方式发行和转让，约定在一定期限还本付息的公司债券。由于其非公开性及条款可协商性，普遍具有较高收益。本基金将深入研究发行人资信及公司运营情况，合理合规合格地进行中小企业私募债券投资。本基金在投资过程中密切监控债券信用等级或发行人信用等级变化情况，尽力规避风险，并获取超额收益。</p> <p>6、股指期货投资策略 本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目标，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，充分考虑股指期货的风险收益特征，通过多头或空头的套期保值策略，以改善投资组合的投资效果，实现股票组合的超额收益。</p> <p>7、国债期货投资策略 为有效控制债券投资的系统性风险，本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的，适度运用国债期货，提高投资组合的运作效率。在国债期货投资时，本基金将首先分析国债期货各合约价格与最便宜可交割券的关系，选择定价合理的国债期货合约，其次，考虑国债期货各合约的流动性情况，最终确定与现货组合的合适匹配，以达到风险管理的目标。</p> <p>8、资产支持证券的投资策略 本基金将综合运用战略资产配置和战术资产配置进行资产支持证券的投资组合管理，并根据信用风险、利率风险和流动性风险变化积极调整投资策略，严格遵守法律法规和基金合同的约定，在保证本金安全和基金资产流动性的基础上获得稳定收益。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%
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。
--	---------------

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023年1月1日-2023年6月30日)	
	鹏华睿投混合 A	鹏华睿投混合 C
本期已实现收益	-5,025,402.97	-465,923.44
本期利润	-8,497,521.62	-2,332,211.34
加权平均基金份额本期利润	-0.0225	-0.0554
本期加权平均净值利润率	-1.47%	-5.54%

本期基金份额净值增长率	-1.94%	-2.13%
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	149,523,584.91	-1,885,082.67
期末可供分配基金份额利润	0.4637	-0.0464
期末基金资产净值	471,962,757.57	38,751,432.69
期末基金份额净值	1.4637	0.9536
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	72.49%	-4.64%

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

鹏华睿投混合 A

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	-0.78%	0.77%	0.93%	0.51%	-1.71%	0.26%
过去三个月	-5.26%	0.69%	-2.31%	0.49%	-2.95%	0.20%
过去六个月	-1.94%	0.66%	0.83%	0.50%	-2.77%	0.16%
过去一年	-11.83%	0.79%	-6.94%	0.59%	-4.89%	0.20%

过去三年	21.17%	0.88%	1.42%	0.72%	19.75%	0.16%
自基金合同生效起至今	72.49%	1.09%	13.82%	0.76%	58.67%	0.33%

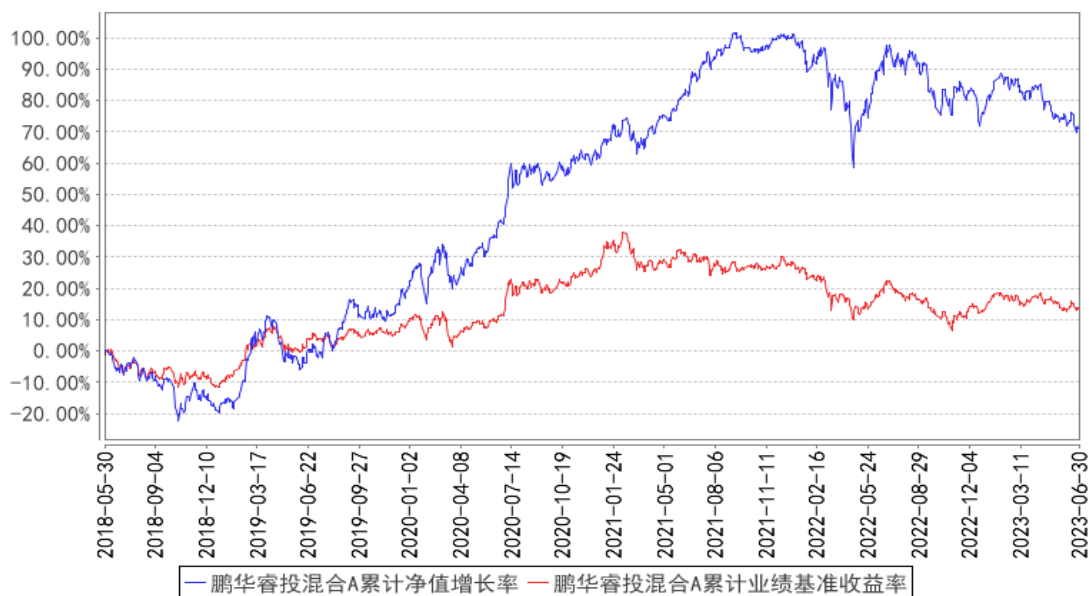
鹏华睿投混合 C

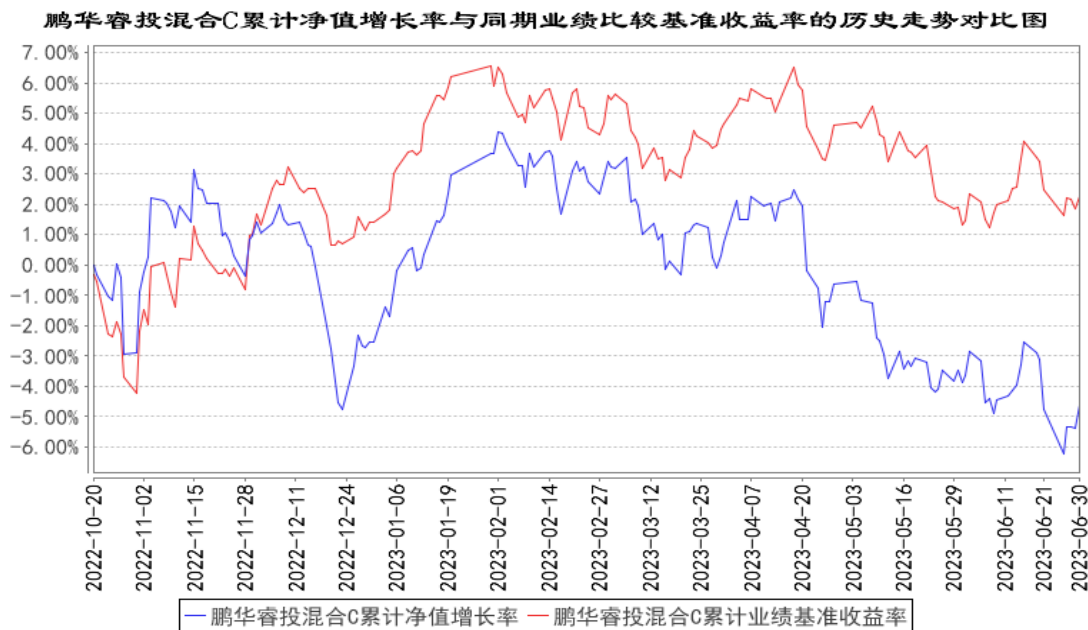
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-0.81%	0.77%	0.93%	0.51%	-1.74%	0.26%
过去三个月	-5.36%	0.69%	-2.31%	0.49%	-3.05%	0.20%
过去六个月	-2.13%	0.66%	0.83%	0.50%	-2.96%	0.16%
自基金合同生效起至今	-4.64%	0.72%	2.24%	0.59%	-6.88%	0.13%

注：业绩比较基准=沪深 300 指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%

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

鹏华睿投混合A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 2018 年 05 月 30 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	2018-05-30	-	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，

				<p>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。</p>
--	--	--	--	--

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。

本基金以追求长期超越权益指数收益率水平，并同时降低净值波动率。目前阶段，权益指数处于历史中性估值分位数区间，操作方面保持相对中性的权益仓位水平，辅之以部分固定收益类资产，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，本报告期鹏华睿投混合 A 份额净值增长率为-1.94%，同期业绩比较基准增长率为 0.83%，鹏华睿投混合 C 份额净值增长率为-2.13%，同期业绩比较基准增长率为 0.83%。

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，我们认为内外需的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。

未来我们仍将坚持以追求长期超越权益指数收益率水平，并同时降低净值波动率的投资策略。目前阶段，操作方面保持相对中性的权益仓位水平，辅之以部分固定收益类资产，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。

4.6 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，鹏华睿投混合 A 期末可供分配利润为 149,523,584.91 元，期末基金份额净值 1.4637 元；鹏华睿投混合 C 期末可供分配利润为-1,885,082.67 元，期末基金份额净值 0.9536 元，不符合利润分配条件。

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：鹏华睿投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
资产：			
银行存款	6.4.7.1	3,514,310.69	23,206,305.88
结算备付金		64,856,785.39	50,287,306.70
存出保证金		76,265.92	85,113.15
交易性金融资产	6.4.7.2	442,448,764.72	526,062,560.63
其中：股票投资		407,057,023.63	511,779,626.38
基金投资		-	-
债券投资		35,391,741.09	14,282,934.25
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	-	19,994,642.44
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		1,037,096.07	470,572.41
应收股利		-	-
应收申购款		11,357.59	221,162.03
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		511,944,580.38	620,327,663.24
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负债：			

短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		0.24	-
应付赎回款		27,606.32	122,120.77
应付管理人报酬		633,559.94	859,942.31
应付托管费		84,474.66	114,658.99
应付销售服务费		12,812.53	4,210.51
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	9.74
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	471,936.43	956,856.80
负债合计		1,230,390.12	2,057,799.12
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	363,075,688.02	419,743,913.92
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	147,638,502.24	198,525,950.20
净资产合计		510,714,190.26	618,269,864.12
负债和净资产总计		511,944,580.38	620,327,663.24

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额为 363,075,688.02 份，其中鹏华睿投混合 A 基金份额总额为 322,439,172.66 份，基金份额净值 1.4637 元；鹏华睿投混合 C 基金份额总额为 40,636,515.36 份，基金份额净值 0.9536 元。

6.2 利润表

会计主体：鹏华睿投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
一、营业总收入		-5,405,586.98	-14,755,271.79
1. 利息收入		853,425.56	88,387.78
其中：存款利息收入	6.4.7.13	612,256.08	86,221.93
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		241,169.48	2,165.85
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-

2. 投资收益（损失以“-”填列）		-1,428,495.46	-15,091,897.10
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-6,356,565.72	-21,274,908.18
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	151,659.59	3,166,050.44
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	4,776,410.67	3,016,960.64
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	-5,338,406.55	-187,424.92
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	507,889.47	435,662.45
减：二、营业总支出		5,424,145.98	3,794,723.74
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	4,618,101.45	2,642,549.95
2. 托管费	6.4.10.2.2	615,746.86	352,339.90
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	82,226.48	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		14,532.57	704,153.01
其中：卖出回购金融资产支出		14,532.57	704,153.01
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	4,121.56
8. 其他费用	6.4.7.23	93,538.62	91,559.32
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-10,829,732.96	-18,549,995.53
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-10,829,732.96	-18,549,995.53
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-10,829,732.96	-18,549,995.53

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：鹏华睿投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)	419,743,913.92	-	198,525,950.20	618,269,864.12
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)	419,743,913.92	-	198,525,950.20	618,269,864.12
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-56,668,225.90	-	-50,887,447.96	-107,555,673.86
(一)、综合收益总额	-	-	-10,829,732.96	-10,829,732.96
(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)	-56,668,225.90	-	-40,057,715.00	-96,725,940.90
其中:1.基金申购款	51,255,256.09	-	6,317,302.09	57,572,558.18
2.基金赎回款	-107,923,481.99	-	-46,375,017.09	-154,298,499.08

(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)	363,075,688.02	-	147,638,502.24	510,714,190.26
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)	202,386,382.33	-	204,465,418.47	406,851,800.80
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)	202,386,382.33	-	204,465,418.47	406,851,800.80
三、本期 增减变动 额(减少 以“-” 号填列)	-30,344,048.80	-	-39,929,728.76	-70,273,777.56

(一)、综合收益总额	-	-	-18,549,995.53	-18,549,995.53
(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)	-30,344,048.80	-	-21,379,733.23	-51,723,782.03
其中:1.基金申购款	38,469,440.64	-	35,178,915.75	73,648,356.39
2.基金赎回款	-68,813,489.44	-	-56,558,648.98	-125,372,138.42
(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)	172,042,333.53	-	164,535,689.71	336,578,023.24

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

邓召明

基金管理人负责人

邢彪

主管会计工作负责人

郝文高

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

鹏华睿投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”)证监许可[2017]2061号《关于准予鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准,由鹏华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2018年5月30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214,008,175.33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2018年2月28日至2018年5月25日募集。募集期间净认购资金人民币213,393,912.52元,认购资金在募集期间产生的利息人民币614,262.81元,募集的有效认购份额及利息结转的基金份额合计214,008,175.33份。上述募集资金已由普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了普华永道中天验字(2018)第0256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》、《鹏华睿投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	3,514,310.69
等于：本金	3,513,962.93
加：应计利息	347.76
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	3,514,310.69

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	424,634,542.48	-	407,057,023.63	-17,577,518.85
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	34,909,700.00	398,741.09	35,391,741.09	83,300.00
交易所市				

	场				
	银行间市 场	-	-	-	-
	合计	34,909,700.00	398,741.09	35,391,741.09	83,300.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		459,544,242.48	398,741.09	442,448,764.72	-17,494,218.85

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	206.94
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	387,426.93
其中：交易所市场	387,426.93
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	84,302.56
合计	471,936.43

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

鹏华睿投混合 A

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	403,794,053.72	403,794,053.72
本期申购	9,119,482.10	9,119,482.10
本期赎回（以“-”号填列）	-90,474,363.16	-90,474,363.16
-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	322,439,172.66	322,439,172.66

鹏华睿投混合 C

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	15,949,860.20	15,949,860.20
本期申购	42,135,773.99	42,135,773.99
本期赎回（以“-”号填列）	-17,449,118.83	-17,449,118.83
-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	40,636,515.36	40,636,515.36

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

鹏华睿投混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	223,210,044.08	-24,275,664.39	198,934,379.69
本期利润	-5,025,402.97	-3,472,118.65	-8,497,521.62
本期基金份额交易产生的变动数	-44,045,118.01	3,131,844.85	-40,913,273.16
其中：基金申购款	5,072,873.15	109,592.83	5,182,465.98
基金赎回款	-49,117,991.16	3,022,252.02	-46,095,739.14
本期已分配利润	-	-	-
本期末	174,139,523.10	-24,615,938.19	149,523,584.91

鹏华睿投混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-317,346.81	-91,082.68	-408,429.49
本期利润	-465,923.44	-1,866,287.90	-2,332,211.34
本期基金份额交易产生的变动数	-442,410.69	1,297,968.85	855,558.16
其中：基金申购款	-730,897.73	1,865,733.84	1,134,836.11
基金赎回款	288,487.04	-567,764.99	-279,277.95
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,225,680.94	-659,401.73	-1,885,082.67

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	51,755.85
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	559,656.69
其他	843.54
合计	612,256.08

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	-6,356,565.72
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	-6,356,565.72

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	429,392,830.81
减：卖出股票成本总额	434,632,937.68
减：交易费用	1,116,458.85
买卖股票差价收入	-6,356,565.72

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	161,109.59
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-9,450.00
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	151,659.59

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	14,294,000.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	14,009,450.00
减：应计利息总额	294,000.00
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-9,450.00

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	4,776,410.67
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	4,776,410.67

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	-5,338,406.55
股票投资	-5,432,556.55
债券投资	94,150.00
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	-5,338,406.55

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	443,077.74
基金转换费收入	64,811.73
合计	507,889.47

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	9,183.97
存托服务费	52.09
合计	93,538.62

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

注：无。

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	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	-	-	40,011,500.00	12.57

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)
国信证券	-	-	162,400,000.00	2.31

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	-	-	-	-
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	-	-	-	-

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	上年度可比期间
----	----	---------

	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	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	4,618,101.45	2,642,549.95
其中：支付销售机构的客户维护费	512,804.31	207,635.86

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	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	615,746.86	352,339.90

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 0.20%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×0.20%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鹏华睿投混合 A	鹏华睿投混合 C	合计
鹏华基金公司	-	25.53	25.53
招商银行	-	10,574.48	10,574.48
合计	-	10,600.01	10,600.01
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鹏华睿投混合 A	鹏华睿投混合 C	合计
合计	-	-	-

注：鹏华睿投混合 A 基金份额不支付销售服务费；支付基金销售机构的鹏华睿投混合 C 基金份额的销售服务费年费率为 0.4%，逐日计提，按月支付，日销售服务费=前一日分类基金资产净值×0.4%÷当年天数。

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	3,514,310.69	51,755.85	58,226,774.64	23,231.37

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2023年1月1日至2023年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位: 股/张)	总金额
国信证券	301488	豪恩汽电	网下申购	2,618	104,144.04
国信证券	688307	中润光学	网下申购	2,455	58,625.40
国信证券	688562	航天软件	网下申购	7,254	91,980.72
上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位: 股/张)	总金额
国信证券	-	-	-	-	-

注：本表包含参与基金托管人的关联方承销证券的情况。

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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001282	三联锻造	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	-
001286	陕西能源	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
001287	中电港	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股流通受限	11.88	21.02	858	10,193.04	18,035.16	-
001324	长青科技	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股流通受限	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-
001328	登康口腔	2023 年 3 月 29 日	6 个月	新股流通受限	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-
001367	海森药业	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股流通受限	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
301141	中科磁业	2023 年 3 月 27 日	6 个月	新股流通受限	41.20	42.69	262	10,794.40	11,184.78	-
301157	华塑科技	2023 年 3 月 1 日	6 个月	新股流通受限	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
301170	锡南科技	2023 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通受限	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-
301202	朗威股份	2023 年 6 月 28 日	1 个月内（含）	新股未上市	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	-

		日									
301202	朗威股份	2023年6月28日	6个月	新股流通受限	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92		-
301261	恒工精密	2023年6月29日	1个月内(含)	新股未上市	36.90	36.90	1,775	65,497.50	65,497.50		-
301261	恒工精密	2023年6月29日	6个月	新股流通受限	36.90	36.90	198	7,306.20	7,306.20		-
301262	海看股份	2023年6月13日	6个月	新股流通受限	30.22	25.50	466	14,082.52	11,883.00		-
301281	科源制药	2023年3月28日	6个月	新股流通受限	44.18	25.10	337	10,647.38	8,458.70	科源制药于2023年5月26日每10股送4股	-
301291	明阳电气	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	38.13	31.03	509	19,408.17	15,794.27		-
301292	海科新源	2023年6月29日	1个月内(含)	新股未上市	19.99	19.99	5,241	104,767.59	104,767.59		-
301292	海科新源	2023年6月29日	6个月	新股流通受限	19.99	19.99	583	11,654.17	11,654.17		-
301293	三博脑科	2023年4月25日	6个月	新股流通受限	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86		-
301295	美硕科技	2023年6月19日	6个月	新股流通受限	37.40	36.07	215	8,041.00	7,755.05		-
301301	川宁生物	2022年12月20日	6个月	新股流通受限	5.00	8.96	3,574	17,870.00	32,023.04		-
301303	真兰仪表	2023年2月13日	6个月	新股流通受限	26.80	22.32	1,058	28,354.40	23,614.56		-
301315	威士顿	2023年6月13日	6个月	新股流通受限	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12		-
301317	鑫磊股份	2023年1月12日	6个月	新股流通受限	20.67	26.17	694	14,344.98	18,161.98		-

		日								
301320	豪江智能	2023年6月1日	6个月	新股流通受限	13.06	20.62	642	8,384.52	13,238.04	-
301322	绿通科技	2023年2月27日	6个月	新股流通受限	131.11	53.24	270	23,599.80	14,374.80	绿通科技于2023年5月25日每10股送5股
301323	新莱福	2023年5月29日	6个月	新股流通受限	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	-
301325	曼恩斯特	2023年5月4日	6个月	新股流通受限	76.80	107.95	310	23,808.00	33,464.50	-
301332	德尔玛	2023年5月9日	6个月	新股流通受限	14.81	13.73	1,107	16,394.67	15,199.11	-
301337	亚华电子	2023年5月16日	6个月	新股流通受限	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-
301345	涛涛车业	2023年3月10日	6个月	新股流通受限	73.45	46.64	239	17,554.55	11,146.96	-
301355	南王科技	2023年6月2日	6个月	新股流通受限	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-
301357	北方长龙	2023年4月11日	6个月	新股流通受限	50.00	48.39	190	9,500.00	9,194.10	-
301358	湖南裕能	2023年2月1日	6个月	新股流通受限	23.77	42.89	695	16,520.15	29,808.55	-
301360	荣旗科技	2023年4月17日	6个月	新股流通受限	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40	-
301373	凌玮科技	2023年1月20日	6个月	新股流通受限	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	-
301376	致欧科技	2023年6月14日	6个月	新股流通受限	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-
301382	蜂助手	2023年5月9日	6个月	新股流通受限	23.80	32.84	408	9,710.40	13,398.72	-

		日									
301386	未来电器	2023年3月21日	6个月	新股流通受限	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62		-
301399	英特科技	2023年5月16日	6个月	新股流通受限	43.99	51.57	293	12,889.07	15,110.01		-
301408	华人健康	2023年2月22日	6个月	新股流通受限	16.24	16.95	879	14,274.96	14,899.05		-
301419	阿莱德	2023年2月2日	6个月	新股流通受限	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50		-
301428	世纪恒通	2023年5月10日	6个月	新股流通受限	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40		-
301439	泓淋电力	2023年3月10日	6个月	新股流通受限	19.99	16.90	838	16,751.62	14,162.20		-
301486	致尚科技	2023年6月30日	1个月内(含)	新股未上市	57.66	57.66	2,682	154,644.12	154,644.12		-
301486	致尚科技	2023年6月30日	6个月	新股流通受限	57.66	57.66	298	17,182.68	17,182.68		-
301488	豪恩汽电	2023年6月26日	1个月内(含)	新股未上市	39.78	39.78	2,356	93,721.68	93,721.68		-
301488	豪恩汽电	2023年6月26日	6个月	新股流通受限	39.78	39.78	262	10,422.36	10,422.36		-
601061	中信金属	2023年3月30日	6个月	新股流通受限	6.58	7.58	1,946	12,804.68	14,750.68		-
601065	江盐集团	2023年3月31日	6个月	新股流通受限	10.36	11.84	636	6,588.96	7,530.24		-
601133	柏诚股份	2023年3月31日	6个月	新股流通受限	11.66	12.26	562	6,552.92	6,890.12		-
603125	常青科技	2023年3月30日	6个月	新股流通受限	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80		-
603135	中重	2023年	6个月	新股流	17.80	17.89	628	11,178.40	11,234.92		-

	科技	3月29日		通受限							
603137	恒尚节能	2023年4月10日	6个月	新股流通受限	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51		-
603172	万丰股份	2023年4月28日	6个月	新股流通受限	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86		-
688146	中船特气	2023年4月13日	6个月	新股流通受限	36.15	38.13	613	22,159.95	23,373.69		-
688249	晶合集成	2023年4月24日	6个月	新股流通受限	19.86	18.06	3,345	66,431.70	60,410.70		-
688334	西高院	2023年6月9日	6个月	新股流通受限	14.16	16.21	888	12,574.08	14,394.48		-
688352	顾中科技	2023年4月11日	6个月	新股流通受限	12.10	12.07	1,689	20,436.90	20,386.23		-
688361	中科飞测-U	2023年5月12日	6个月	新股流通受限	23.60	64.67	572	13,499.20	36,991.24		-
688429	时创能源	2023年6月20日	6个月	新股流通受限	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38		-
688433	华曙高科	2023年4月7日	6个月	新股流通受限	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00		-
688443	智翔金泰-U	2023年6月13日	6个月	新股流通受限	37.88	29.49	746	28,258.48	21,999.54		-
688458	美芯晟	2023年5月15日	6个月	新股流通受限	75.00	90.76	204	15,300.00	18,515.04		-
688469	中芯集成-U	2023年4月28日	6个月	新股流通受限	5.69	5.41	6,189	35,215.41	33,482.49		-
688472	阿特斯	2023年6月2日	6个月	新股流通受限	11.10	17.04	1,990	22,089.00	33,909.60		-
688478	晶升股份	2023年4月13日	6个月	新股流通受限	32.52	42.37	402	13,073.04	17,032.74		-

688479	友车科技	2023年5月4日	6个月	新股流通受限	33.99	29.49	332	11,284.68	9,790.68	-
688485	九州一轨	2023年1月11日	6个月	新股流通受限	17.47	15.17	3,580	62,542.60	54,308.60	-
688502	茂莱光学	2023年2月28日	6个月	新股流通受限	69.72	178.59	1,509	105,207.48	269,492.31	-
688507	索辰科技	2023年4月10日	6个月	新股流通受限	245.56	122.11	144	23,819.32	17,583.84	索辰科技于2023年6月20日每10股送4.8股
688523	航天环宇	2023年5月26日	6个月	新股流通受限	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20	-
688531	日联科技	2023年3月24日	6个月	新股流通受限	152.38	135.97	202	30,780.76	27,465.94	-
688535	华海诚科	2023年3月28日	6个月	新股流通受限	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-
688543	国科军工	2023年6月14日	6个月	新股流通受限	43.67	53.05	297	12,969.99	15,755.85	-
688562	航天软件	2023年5月15日	6个月	新股流通受限	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	-
688570	天玛智控	2023年5月29日	6个月	新股流通受限	30.26	25.33	565	17,096.90	14,311.45	-
688581	安杰思	2023年5月12日	6个月	新股流通受限	125.80	118.03	142	17,863.60	16,760.26	-
688582	芯动联科	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	26.74	40.68	396	10,589.04	16,109.28	-
688593	新相微	2023年5月25日	6个月	新股流通受限	11.18	14.59	959	10,721.62	13,991.81	-
688603	天承科技	2023年6月30日	1个月内(含)	新股未上市	55.00	55.00	1,251	68,805.00	68,805.00	-

		日								
688603	天承科技	2023年6月30日	6个月	新股流通受限	55.00	55.00	140	7,700.00	7,700.00	-
688620	安凯微	2023年6月15日	6个月	新股流通受限	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44	-
688629	华丰科技	2023年6月16日	6个月	新股流通受限	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-
688631	莱斯信息	2023年6月19日	6个月	新股流通受限	25.28	29.87	305	7,710.40	9,110.35	-

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，锁定期为自发行人股票上市之日起6个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的科创板股票，在受让后6个月内不得转让。

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

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	-----	------	------	--------	-----	--------	-------	--------	--------	----

	称				期					
601298	青岛港	2023年6月28日	重大事项	6.97	2023年7月3日	7.40	16,200	90,939.01	112,914.00	-
000540	*ST中天	2023年5月19日	退市	0.11	-	-	122,400	229,425.32	13,464.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的股票（包含中小板，创业板及其他经中国证监会核准上市的股票，存托凭证），债券（含国债，金融债，企业债，公司债，央行票据，中期票据，短期融资券，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（含同业存单等），权证，资产支持证券，股指期货，国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

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

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

业务的风险控制情况进行督促和检查，并适时提出整改建议。

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券（2022 年 12 月 31 日：未持有）。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时或于约定开放日要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

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

于 2023 年 6 月 30 日，本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（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《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上

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

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

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等，其余大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	3,514,310.69	-	-	-	3,514,310.69
结算备付金	64,856,785.39	-	-	-	64,856,785.39
存出保证金	76,265.92	-	-	-	76,265.92
交易性金融资产	35,391,741.09	-	-	-407,057,023.63	442,448,764.72
应收申购款	-	-	-	11,357.59	11,357.59
应收清算款	-	-	-	1,037,096.07	1,037,096.07
资产总计	103,839,103.09	-	-	-408,105,477.29	511,944,580.38
负债					
应付赎回款	-	-	-	27,606.32	27,606.32
应付管理人报酬	-	-	-	633,559.94	633,559.94
应付托管费	-	-	-	84,474.66	84,474.66
应付清算款	-	-	-	0.24	0.24
应付销售服务费	-	-	-	12,812.53	12,812.53
其他负债	-	-	-	471,936.43	471,936.43
负债总计	-	-	-	1,230,390.12	1,230,390.12
利率敏感度缺口	103,839,103.09	-	-	-406,875,087.17	510,714,190.26
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	23,206,305.88	-	-	-	23,206,305.88
结算备付金	50,287,306.70	-	-	-	50,287,306.70
存出保证金	85,113.15	-	-	-	85,113.15
交易性金融资产	14,282,934.25	-	-	-511,779,626.38	526,062,560.63
买入返售金融资产	19,994,642.44	-	-	-	19,994,642.44
应收申购款	-	-	-	221,162.03	221,162.03
应收清算款	-	-	-	470,572.41	470,572.41
资产总计	107,856,302.42	-	-	-512,471,360.82	620,327,663.24
负债					
应付赎回款	-	-	-	122,120.77	122,120.77
应付管理人报酬	-	-	-	859,942.31	859,942.31
应付托管费	-	-	-	114,658.99	114,658.99
应付销售服务费	-	-	-	4,210.51	4,210.51
应交税费	-	-	-	9.74	9.74
其他负债	-	-	-	956,856.80	956,856.80
负债总计	-	-	-	2,057,799.12	2,057,799.12
利率敏感度缺口	107,856,302.42	-	-	-510,413,561.70	618,269,864.12

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2023 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资和资产支持证券公允价值占基金资产净值的比例为 6.93%。因此当利率发生合理、可能的变动时，对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无。

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。

基金的投资组合比例为：股票（含存托凭证）资产占基金资产的比例为 0%-95%；每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	407,057,023.63	79.70	511,779,626.38	82.78
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	407,057,023.63	79.70	511,779,626.38	82.78

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%	15,985,354.16	23,416,971.10
	业绩比较基准下降 5%	-15,985,354.16	-23,416,971.10

注：无。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年6月30日
第一层次	404,948,168.32
第二层次	36,125,365.59
第三层次	1,375,230.81
合计	442,448,764.72

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	407,057,023.63	79.51
	其中：股票	407,057,023.63	79.51
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	35,391,741.09	6.91
	其中：债券	35,391,741.09	6.91
	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	68,371,096.08	13.36
8	其他各项资产	1,124,719.58	0.22
9	合计	511,944,580.38	100.00

注：报告期末本基金投资的存托凭证公允价值为：320,595.00 元，占净值比 0.06%。本报告所指的“股票”均包含存托凭证。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	2,910,295.00	0.57
B	采矿业	27,281,663.70	5.34
C	制造业	248,799,126.21	48.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,092,154.83	2.56
E	建筑业	3,389,056.26	0.66
F	批发和零售业	19,619,879.54	3.84
G	交通运输、仓储和邮政业	10,868,120.82	2.13
H	住宿和餐饮业	820,535.00	0.16
I	信息传输、软件和信息技术服务业	30,753,065.34	6.02
J	金融业	18,289,466.42	3.58
K	房地产业	5,197,023.40	1.02
L	租赁和商务服务业	13,456,582.00	2.63
M	科学研究和技术服务业	2,768,611.91	0.54
N	水利、环境和公共设施管理业	809,625.20	0.16
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	565,020.68	0.11
R	文化、体育和娱乐业	6,830,538.52	1.34

S	综合	1,606,258.80	0.31
	合计	407,057,023.63	79.70

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	603737	三棵树	229,460	15,011,273.20	2.94
2	600329	达仁堂	327,200	14,688,008.00	2.88
3	603688	石英股份	110,700	12,602,088.00	2.47
4	603927	中科软	292,520	11,279,571.20	2.21
5	300724	捷佳伟创	98,300	11,044,005.00	2.16
6	688029	南微医学	134,300	10,953,508.00	2.14
7	688002	睿创微纳	226,100	10,129,280.00	1.98
8	300474	景嘉微	109,750	9,876,402.50	1.93
9	002155	湖南黄金	726,200	8,859,640.00	1.73
10	601958	金钼股份	779,300	8,689,195.00	1.70
11	000623	吉林敖东	513,600	8,238,144.00	1.61
12	300058	蓝色光标	820,600	7,935,202.00	1.55
13	688390	固德威	46,900	7,825,734.00	1.53
14	600739	辽宁成大	565,700	7,438,955.00	1.46
15	002507	涪陵榨菜	391,950	7,176,604.50	1.41
16	600863	内蒙华电	1,527,500	6,339,125.00	1.24
17	601872	招商轮船	1,082,200	6,265,938.00	1.23
18	688188	柏楚电子	33,200	6,260,192.00	1.23
19	603650	彤程新材	186,800	6,127,040.00	1.20
20	600399	抚顺特钢	545,400	5,563,080.00	1.09
21	002531	天顺风能	339,900	5,176,677.00	1.01
22	603267	鸿远电子	76,200	4,975,860.00	0.97
23	600415	小商品城	537,000	4,580,610.00	0.90
24	601577	长沙银行	583,600	4,528,736.00	0.89
25	002739	万达电影	328,100	4,114,374.00	0.81
26	600487	亨通光电	264,800	3,881,968.00	0.76
27	601699	潞安环能	236,500	3,859,680.00	0.76
28	601233	桐昆股份	275,800	3,654,350.00	0.72
29	600297	广汇汽车	1,554,800	3,233,984.00	0.63
30	002385	大北农	471,300	3,110,580.00	0.61
31	000961	中南建设	1,816,600	2,852,062.00	0.56
32	000062	深圳华强	234,635	2,679,531.70	0.52
33	600167	联美控股	382,760	2,667,837.20	0.52
34	002434	万里扬	291,900	2,612,505.00	0.51
35	300136	信维通信	128,600	2,582,288.00	0.51

36	600782	新钢股份	660,900	2,451,939.00	0.48
37	002508	老板电器	91,600	2,316,564.00	0.45
38	002372	伟星新材	111,560	2,291,442.40	0.45
39	600170	上海建工	815,300	2,193,157.00	0.43
40	002831	裕同科技	85,381	2,082,442.59	0.41
41	002299	圣农发展	108,500	2,077,775.00	0.41
42	301029	怡合达	43,960	1,964,132.80	0.38
43	000869	张裕 A	63,100	1,934,646.00	0.38
44	601187	厦门银行	375,200	1,883,504.00	0.37
45	601156	东航物流	144,500	1,878,500.00	0.37
46	002701	奥瑞金	401,479	1,810,670.29	0.35
47	600398	海澜之家	232,200	1,597,536.00	0.31
48	002867	周大生	79,450	1,412,621.00	0.28
49	000012	南玻 A	235,546	1,403,854.16	0.27
50	000009	中国宝安	114,740	1,384,911.80	0.27
51	300144	宋城演艺	105,900	1,313,160.00	0.26
52	002221	东华能源	149,500	1,293,175.00	0.25
53	000937	冀中能源	194,300	1,239,634.00	0.24
54	003035	南网能源	172,200	1,226,064.00	0.24
55	600705	中航产融	312,600	1,197,258.00	0.23
56	002705	新宝股份	57,400	1,034,922.00	0.20
57	300308	中际旭创	7,000	1,032,150.00	0.20
58	300418	昆仑万维	23,100	930,468.00	0.18
59	000988	华工科技	23,400	889,434.00	0.17
60	600258	首旅酒店	43,300	820,535.00	0.16
61	002563	森马服饰	131,400	817,308.00	0.16
62	002340	格林美	102,700	709,657.00	0.14
63	600489	中金黄金	67,800	700,374.00	0.14
64	688256	寒武纪-U	3,700	695,600.00	0.14
65	300003	乐普医疗	30,700	694,127.00	0.14
66	600372	中航电子	44,800	680,064.00	0.13
67	600079	人福医药	24,100	649,254.00	0.13
68	300012	华测检测	33,200	647,400.00	0.13
69	002384	东山精密	24,700	639,730.00	0.13
70	002422	科伦药业	21,500	638,120.00	0.12
71	600157	永泰能源	449,000	637,580.00	0.12
72	688249	晶合集成	33,442	628,341.09	0.12
73	300146	汤臣倍健	25,600	613,888.00	0.12
74	601555	东吴证券	84,500	586,430.00	0.11
75	000807	云铝股份	45,300	576,669.00	0.11
76	688172	燕东微	23,142	550,316.76	0.11
77	002028	思源电气	11,600	541,952.00	0.11
78	601058	赛轮轮胎	47,300	538,747.00	0.11

79	688777	中控技术	8,555	537,082.90	0.11
80	603345	安井食品	3,600	528,480.00	0.10
81	600885	宏发股份	16,277	518,422.45	0.10
82	002738	中矿资源	10,080	513,475.20	0.10
83	002966	苏州银行	78,330	513,061.50	0.10
84	600536	中国软件	10,906	511,273.28	0.10
85	300037	新宙邦	9,840	510,597.60	0.10
86	601607	上海医药	22,500	504,225.00	0.10
87	601168	西部矿业	47,300	497,123.00	0.10
88	002625	光启技术	32,500	495,950.00	0.10
89	600352	浙江龙盛	52,700	492,745.00	0.10
90	603444	吉比特	1,000	491,110.00	0.10
91	601108	财通证券	67,800	490,872.00	0.10
92	300832	新产业	8,300	489,700.00	0.10
93	002409	雅克科技	6,600	481,008.00	0.09
94	600482	中国动力	20,400	478,176.00	0.09
95	300285	国瓷材料	17,300	474,020.00	0.09
96	002603	以岭药业	18,280	469,613.20	0.09
97	600096	云天化	27,500	469,425.00	0.09
98	000999	华润三九	7,700	467,082.00	0.09
99	603605	珀莱雅	4,132	464,436.80	0.09
100	000630	铜陵有色	160,600	464,134.00	0.09
101	688361	中科飞测-U	5,712	463,662.64	0.09
102	000783	长江证券	79,900	463,420.00	0.09
103	688122	西部超导	8,260	460,329.80	0.09
104	601077	渝农商行	128,000	459,520.00	0.09
105	600765	中航重机	17,260	457,562.60	0.09
106	002568	百润股份	12,400	450,740.00	0.09
107	300253	卫宁健康	41,400	447,948.00	0.09
108	600161	天坛生物	16,300	442,545.00	0.09
109	601162	天风证券	148,400	442,232.00	0.09
110	688099	晶晨股份	5,200	438,464.00	0.09
111	600418	江淮汽车	34,500	434,355.00	0.09
112	002185	华天科技	47,200	434,240.00	0.09
113	603613	国联股份	11,745	433,742.85	0.08
114	600027	华电国际	64,400	430,836.00	0.08
115	600901	江苏金租	103,040	425,555.20	0.08
116	300017	网宿科技	59,300	421,623.00	0.08
117	600066	宇通客车	28,500	420,090.00	0.08
118	002223	鱼跃医疗	11,600	417,484.00	0.08
119	000975	银泰黄金	35,640	416,988.00	0.08
120	600109	国金证券	47,900	415,293.00	0.08
121	600060	海信视像	16,700	413,325.00	0.08

122	300073	当升科技	8,200	412,706.00	0.08
123	002368	太极股份	9,920	408,406.40	0.08
124	000932	华菱钢铁	85,480	407,739.60	0.08
125	002497	雅化集团	22,900	407,162.00	0.08
126	002407	多氟多	20,280	402,760.80	0.08
127	600160	巨化股份	29,220	402,651.60	0.08
128	601128	常熟银行	58,800	401,016.00	0.08
129	600862	中航高科	15,800	399,898.00	0.08
130	002797	第一创业	69,800	399,256.00	0.08
131	002439	启明星辰	13,400	398,784.00	0.08
132	002273	水晶光电	32,500	388,050.00	0.08
133	600298	安琪酵母	10,700	387,447.00	0.08
134	600026	中远海能	30,500	385,520.00	0.08
135	603816	顾家家居	10,100	385,315.00	0.08
136	000563	陕国投 A	125,200	381,860.00	0.07
137	600873	梅花生物	42,500	379,525.00	0.07
138	000683	远兴能源	52,700	378,913.00	0.07
139	600141	兴发集团	17,020	378,184.40	0.07
140	600988	赤峰黄金	28,000	376,880.00	0.07
141	002465	海格通信	36,100	373,274.00	0.07
142	603939	益丰药房	10,080	372,960.00	0.07
143	000729	燕京啤酒	29,900	372,853.00	0.07
144	603589	口子窖	7,500	370,125.00	0.07
145	601990	南京证券	45,100	368,918.00	0.07
146	688525	佰维存储	4,614	368,612.46	0.07
147	600325	华发股份	37,400	368,390.00	0.07
148	600497	驰宏锌锗	73,100	366,962.00	0.07
149	600637	东方明珠	46,600	364,412.00	0.07
150	000728	国元证券	55,800	363,816.00	0.07
151	688472	阿特斯	19,893	362,608.68	0.07
152	600392	盛和资源	28,100	361,647.00	0.07
153	002078	太阳纸业	33,700	360,253.00	0.07
154	600704	物产中大	72,900	360,126.00	0.07
155	605358	立昂微	9,800	359,954.00	0.07
156	300568	星源材质	20,900	359,271.00	0.07
157	603000	人民网	12,300	359,160.00	0.07
158	300866	安克创新	4,100	358,750.00	0.07
159	300390	天华新能	9,980	357,284.00	0.07
160	002850	科达利	2,700	357,075.00	0.07
161	688063	派能科技	1,800	356,850.00	0.07
162	002195	二三四五	123,292	356,313.88	0.07
163	600563	法拉电子	2,591	355,744.30	0.07
164	300024	机器人	21,300	355,071.00	0.07

165	002673	西部证券	55,900	354,965.00	0.07
166	600879	航天电子	41,800	354,882.00	0.07
167	600177	雅戈尔	56,200	354,622.00	0.07
168	002065	东华软件	50,200	354,412.00	0.07
169	600839	四川长虹	69,900	352,995.00	0.07
170	301325	曼恩斯特	3,091	351,889.00	0.07
171	002025	航天电器	5,500	350,900.00	0.07
172	002373	千方科技	25,700	350,548.00	0.07
173	688469	中芯集成-U	61,890	349,307.16	0.07
174	603596	伯特利	4,400	348,744.00	0.07
175	002138	顺络电子	14,500	346,695.00	0.07
176	000831	中国稀土	11,700	346,320.00	0.07
177	002294	信立泰	11,100	346,209.00	0.07
178	688521	芯原股份	4,800	345,216.00	0.07
179	000629	钒钛股份	88,000	344,080.00	0.07
180	600166	福田汽车	101,200	344,080.00	0.07
181	300168	万达信息	30,100	341,033.00	0.07
182	000998	隆平高科	22,200	340,770.00	0.07
183	002131	利欧股份	148,100	340,630.00	0.07
184	600642	申能股份	48,500	339,015.00	0.07
185	603606	东方电缆	6,900	338,307.00	0.07
186	002156	通富微电	14,900	336,740.00	0.07
187	600118	中国卫星	11,800	332,878.00	0.07
188	600486	扬农化工	3,800	332,196.00	0.07
189	688147	微导纳米	6,293	332,144.54	0.07
190	002268	电科网安	11,900	331,653.00	0.06
191	688009	中国通号	57,100	331,180.00	0.06
192	600153	建发股份	30,300	330,573.00	0.06
193	600859	王府井	16,700	330,493.00	0.06
194	600521	华海药业	17,900	329,539.00	0.06
195	000997	新大陆	17,400	328,860.00	0.06
196	603077	和邦生物	135,000	328,050.00	0.06
197	600549	厦门钨业	17,200	327,316.00	0.06
198	300383	光环新网	30,400	326,800.00	0.06
199	300182	捷成股份	51,700	326,227.00	0.06
200	000703	恒逸石化	48,000	325,440.00	0.06
201	000400	许继电气	14,100	325,005.00	0.06
202	601198	东兴证券	40,500	324,810.00	0.06
203	600143	金发科技	37,200	324,756.00	0.06
204	000960	锡业股份	20,700	321,885.00	0.06
205	688567	孚能科技	14,900	321,691.00	0.06
206	002192	融捷股份	4,800	320,784.00	0.06
207	689009	九号公司-WD	8,700	320,595.00	0.06

208	600271	航天信息	23,400	320,346.00	0.06
209	600699	均胜电子	18,060	318,578.40	0.06
210	600511	国药股份	8,200	318,570.00	0.06
211	300604	长川科技	6,700	318,183.00	0.06
212	000738	航发控制	13,000	317,200.00	0.06
213	000415	渤海租赁	150,500	316,050.00	0.06
214	300699	光威复材	10,220	315,287.00	0.06
215	688432	有研硅	20,044	314,490.36	0.06
216	600546	山煤国际	21,700	313,999.00	0.06
217	600499	科达制造	27,600	313,536.00	0.06
218	000591	太阳能	46,200	313,236.00	0.06
219	688392	骄成超声	2,818	312,769.82	0.06
220	601997	贵阳银行	60,000	309,600.00	0.06
221	002430	杭氧股份	9,000	309,240.00	0.06
222	600528	中铁工业	31,200	308,256.00	0.06
223	601636	旗滨集团	35,600	306,872.00	0.06
224	600820	隧道股份	51,000	306,510.00	0.06
225	300676	华大基因	5,100	305,949.00	0.06
226	688141	杰华特	7,807	305,253.70	0.06
227	301358	湖南裕能	6,945	304,871.05	0.06
228	600970	中材国际	23,900	304,725.00	0.06
229	600516	方大炭素	49,100	304,420.00	0.06
230	600021	上海电力	28,200	303,714.00	0.06
231	600998	九州通	29,204	303,137.52	0.06
232	002532	天山铝业	50,400	301,896.00	0.06
233	002152	广电运通	25,600	300,032.00	0.06
234	002444	巨星科技	13,700	299,756.00	0.06
235	000021	深科技	14,900	297,851.00	0.06
236	002683	广东宏大	10,100	297,344.00	0.06
237	000878	云南铜业	26,900	297,245.00	0.06
238	688531	日联科技	2,018	297,160.10	0.06
239	000519	中兵红箭	16,400	296,676.00	0.06
240	002056	横店东磁	16,100	293,181.00	0.06
241	600348	华阳股份	37,050	293,065.50	0.06
242	600655	豫园股份	42,300	290,178.00	0.06
243	600498	烽火通信	14,200	289,254.00	0.06
244	300088	长信科技	47,800	288,234.00	0.06
245	002203	海亮股份	23,900	287,039.00	0.06
246	601016	节能风电	77,400	284,058.00	0.06
247	688503	聚和材料	2,910	283,725.00	0.06
248	002080	中材科技	13,700	281,124.00	0.06
249	600867	通化东宝	26,800	279,792.00	0.05
250	301293	三博脑科	3,324	278,316.96	0.05

251	300682	朗新科技	11,900	277,032.00	0.05
252	300212	易华录	8,320	276,473.60	0.05
253	002926	华西证券	33,000	274,230.00	0.05
254	600909	华安证券	58,590	273,615.30	0.05
255	600380	健康元	21,492	273,163.32	0.05
256	300357	我武生物	8,100	272,403.00	0.05
257	300070	碧水源	50,800	272,288.00	0.05
258	688502	茂莱光学	1,509	269,492.31	0.05
259	300001	特锐德	12,900	268,062.00	0.05
260	000060	中金岭南	56,400	267,900.00	0.05
261	000513	丽珠集团	6,851	266,572.41	0.05
262	002092	中泰化学	41,300	266,385.00	0.05
263	000750	国海证券	79,300	265,655.00	0.05
264	600529	山东药玻	9,700	264,034.00	0.05
265	600580	卧龙电驱	18,000	262,980.00	0.05
266	603233	大参林	9,360	262,173.60	0.05
267	603517	绝味食品	7,000	260,050.00	0.05
268	600008	首创环保	89,910	258,940.80	0.05
269	600535	天士力	17,800	258,278.00	0.05
270	300251	光线传媒	31,900	258,071.00	0.05
271	000547	航天发展	25,800	258,000.00	0.05
272	002557	洽洽食品	6,200	257,610.00	0.05
273	600390	五矿资本	47,800	257,164.00	0.05
274	000039	中集集团	37,300	256,997.00	0.05
275	002244	滨江集团	29,100	256,662.00	0.05
276	300296	利亚德	39,300	256,629.00	0.05
277	688146	中船特气	6,124	255,937.89	0.05
278	601333	广深铁路	64,300	254,628.00	0.05
279	603160	汇顶科技	5,500	254,375.00	0.05
280	688301	奕瑞科技	900	254,187.00	0.05
281	600369	西南证券	69,600	254,040.00	0.05
282	601717	郑煤机	20,300	252,735.00	0.05
283	600827	百联股份	18,800	251,356.00	0.05
284	603456	九洲药业	9,178	251,293.64	0.05
285	002019	亿帆医药	17,200	251,120.00	0.05
286	002572	索菲亚	14,400	250,848.00	0.05
287	002212	天融信	25,730	249,581.00	0.05
288	002595	豪迈科技	7,100	249,423.00	0.05
289	000830	鲁西化工	23,600	249,216.00	0.05
290	000636	风华高科	16,200	248,508.00	0.05
291	600755	厦门国贸	32,100	248,454.00	0.05
292	002500	山西证券	44,470	248,142.60	0.05
293	688539	高华科技	5,334	247,497.60	0.05

294	002506	协鑫集成	84,000	246,120.00	0.05
295	300244	迪安诊断	9,600	246,048.00	0.05
296	000027	深圳能源	37,320	245,938.80	0.05
297	601000	唐山港	69,400	244,982.00	0.05
298	603156	养元饮品	9,900	244,530.00	0.05
299	002936	郑州银行	106,270	244,421.00	0.05
300	002353	杰瑞股份	9,700	243,761.00	0.05
301	600728	佳都科技	35,100	243,243.00	0.05
302	600038	中直股份	6,100	242,902.00	0.05
303	601880	辽港股份	155,600	242,736.00	0.05
304	000970	中科三环	18,900	242,298.00	0.05
305	301303	真兰仪表	10,574	241,150.32	0.05
306	002281	光迅科技	6,500	241,085.00	0.05
307	688385	复旦微电	4,800	240,480.00	0.05
308	300009	安科生物	24,032	240,320.00	0.05
309	300363	博腾股份	8,100	239,679.00	0.05
310	603712	七一二	7,900	238,659.00	0.05
311	688496	清越科技	12,000	238,560.00	0.05
312	002153	石基信息	16,874	236,236.00	0.05
313	600435	北方导航	20,502	235,567.98	0.05
314	600959	江苏有线	69,200	233,896.00	0.05
315	600208	新湖中宝	94,100	233,368.00	0.05
316	601179	中国西电	43,100	233,171.00	0.05
317	600985	淮北矿业	20,200	232,704.00	0.05
318	002128	电投能源	17,600	232,672.00	0.05
319	002408	齐翔腾达	36,520	232,632.40	0.05
320	600895	张江高科	16,700	232,464.00	0.05
321	603885	吉祥航空	15,000	231,450.00	0.05
322	688205	德科立	3,163	231,278.56	0.05
323	002429	兆驰股份	41,900	230,450.00	0.05
324	688443	智翔金泰-U	7,452	229,282.00	0.04
325	301297	富乐德	10,147	228,408.97	0.04
326	603658	安图生物	4,400	227,612.00	0.04
327	600131	国网信通	11,200	226,128.00	0.04
328	688352	颀中科技	16,881	224,566.71	0.04
329	601456	国联证券	24,400	222,040.00	0.04
330	002958	青农商行	81,600	221,952.00	0.04
331	600673	东阳光	30,700	221,347.00	0.04
332	600848	上海临港	18,500	221,075.00	0.04
333	300558	贝达药业	4,600	220,938.00	0.04
334	603858	步长制药	10,700	220,313.00	0.04
335	000739	普洛药业	12,400	219,976.00	0.04
336	600373	中文传媒	16,400	218,448.00	0.04

337	600566	济川药业	7,430	215,767.20	0.04
338	000778	新兴铸管	52,700	215,016.00	0.04
339	600201	生物股份	22,542	214,374.42	0.04
340	300026	红日药业	39,500	214,090.00	0.04
341	000155	川能动力	14,800	213,120.00	0.04
342	601666	平煤股份	28,200	212,628.00	0.04
343	000050	深天马 A	22,900	210,222.00	0.04
344	601928	凤凰传媒	18,400	209,760.00	0.04
345	002670	国盛金控	23,793	208,902.54	0.04
346	600667	太极实业	28,700	208,362.00	0.04
347	002396	星网锐捷	9,200	207,828.00	0.04
348	688486	龙迅股份	1,887	207,664.35	0.04
349	688435	英方软件	2,728	207,437.12	0.04
350	600282	南钢股份	61,400	206,918.00	0.04
351	300373	扬杰科技	5,100	206,907.00	0.04
352	600171	上海贝岭	11,300	206,225.00	0.04
353	601991	大唐发电	62,100	205,551.00	0.04
354	002939	长城证券	25,200	204,876.00	0.04
355	600718	东软集团	19,200	204,672.00	0.04
356	600316	洪都航空	8,700	204,015.00	0.04
357	603893	瑞芯微	2,800	203,980.00	0.04
358	688522	纳睿雷达	3,803	203,536.56	0.04
359	601005	重庆钢铁	144,000	201,600.00	0.04
360	002183	怡亚通	39,200	199,920.00	0.04
361	301367	怡和嘉业	1,345	199,517.30	0.04
362	600582	天地科技	34,200	199,386.00	0.04
363	601866	中远海发	80,600	199,082.00	0.04
364	002030	达安基因	19,866	198,064.02	0.04
365	000887	中鼎股份	15,100	197,659.00	0.04
366	601098	中南传媒	17,000	197,200.00	0.04
367	601992	金隅集团	90,300	196,854.00	0.04
368	600378	昊华科技	5,200	195,728.00	0.04
369	688562	航天软件	7,254	195,390.66	0.04
370	600056	中国医药	15,040	195,219.20	0.04
371	688458	美芯晟	2,039	194,986.99	0.04
372	600315	上海家化	6,700	194,367.00	0.04
373	603127	昭衍新药	4,740	193,866.00	0.04
374	600517	国网英大	33,900	193,230.00	0.04
375	600598	北大荒	14,400	191,952.00	0.04
376	600906	财达证券	26,600	191,520.00	0.04
377	300677	英科医疗	8,700	191,400.00	0.04
378	603883	老百姓	6,372	190,204.20	0.04
379	000709	河钢股份	84,000	189,840.00	0.04

380	002326	永太科技	12,400	189,596.00	0.04
381	688478	晶升股份	4,013	188,591.35	0.04
382	601665	齐鲁银行	48,100	188,552.00	0.04
383	301317	鑫磊股份	6,936	186,571.14	0.04
384	600801	华新水泥	15,040	185,744.00	0.04
385	000598	兴蓉环境	34,200	185,706.00	0.04
386	601231	环旭电子	12,400	185,504.00	0.04
387	688507	索辰科技	1,429	185,443.39	0.04
388	002249	大洋电机	32,500	185,250.00	0.04
389	600737	中粮糖业	23,000	185,150.00	0.04
390	002690	美亚光电	7,160	184,370.00	0.04
391	603218	日月股份	9,700	184,203.00	0.04
392	000156	华数传媒	21,100	183,570.00	0.04
393	688116	天奈科技	4,000	183,000.00	0.04
394	688582	芯动联科	3,954	182,801.58	0.04
395	000930	中粮科技	22,500	182,250.00	0.04
396	600663	陆家嘴	18,200	179,634.00	0.04
397	603568	伟明环保	10,235	179,214.85	0.04
398	000825	太钢不锈	46,100	178,407.00	0.03
399	601611	中国核建	21,100	178,295.00	0.03
400	002468	申通快递	16,300	176,366.00	0.03
401	300115	长盈精密	14,700	175,077.00	0.03
402	300376	易事特	26,100	174,870.00	0.03
403	601778	晶科科技	35,300	174,382.00	0.03
404	002266	浙富控股	42,100	173,873.00	0.03
405	603228	景旺电子	6,748	173,086.20	0.03
406	688581	安杰思	1,416	172,812.52	0.03
407	600967	内蒙一机	17,100	172,710.00	0.03
408	000401	冀东水泥	23,400	172,458.00	0.03
409	301486	致尚科技	2,980	171,826.80	0.03
410	301399	英特科技	2,925	171,714.01	0.03
411	603225	新凤鸣	15,320	169,286.00	0.03
412	000883	湖北能源	37,100	169,176.00	0.03
413	002511	中顺洁柔	15,100	168,365.00	0.03
414	600064	南京高科	25,440	168,158.40	0.03
415	002985	北摩高科	3,803	167,788.36	0.03
416	688208	道通科技	5,500	166,705.00	0.03
417	600500	中化国际	29,860	166,021.60	0.03
418	688543	国科军工	2,968	165,732.50	0.03
419	688779	长远锂科	14,700	165,669.00	0.03
420	000581	威孚高科	10,500	165,375.00	0.03
421	600339	中油工程	40,600	165,242.00	0.03
422	301291	明阳电气	5,087	165,037.07	0.03

423	002081	金螳螂	36,500	164,615.00	0.03
424	601718	际华集团	55,000	163,350.00	0.03
425	600022	山东钢铁	114,100	162,022.00	0.03
426	002127	南极电商	42,200	161,626.00	0.03
427	688593	新相微	9,584	161,565.56	0.03
428	688629	华丰科技	7,073	160,957.02	0.03
429	603026	胜华新材	2,700	159,975.00	0.03
430	002250	联化科技	15,100	157,946.00	0.03
431	688334	西高院	8,879	157,912.84	0.03
432	600927	永安期货	9,700	157,722.00	0.03
433	601118	海南橡胶	35,200	157,696.00	0.03
434	301332	德尔玛	11,068	157,541.80	0.03
435	002745	木林森	17,100	157,320.00	0.03
436	300861	美畅股份	3,620	156,999.40	0.03
437	300776	帝尔激光	2,400	155,760.00	0.03
438	600062	华润双鹤	8,940	155,734.80	0.03
439	301320	豪江智能	6,416	155,624.88	0.03
440	600155	华创云信	25,000	155,500.00	0.03
441	301382	蜂助手	4,080	155,284.80	0.03
442	600126	杭钢股份	35,380	153,549.20	0.03
443	301408	华人健康	8,784	152,129.85	0.03
444	600567	山鹰国际	66,300	151,827.00	0.03
445	002010	传化智联	28,400	151,088.00	0.03
446	000089	深圳机场	21,700	150,815.00	0.03
447	301419	阿莱德	3,292	150,811.36	0.03
448	301322	绿通科技	2,694	150,482.40	0.03
449	688570	天玛智控	5,648	149,722.57	0.03
450	600216	浙江医药	13,600	148,920.00	0.03
451	301439	泓淋电力	8,379	148,693.64	0.03
452	601598	中国外运	31,800	148,188.00	0.03
453	600259	广晟有色	4,100	148,174.00	0.03
454	688376	美埃科技	3,713	146,626.37	0.03
455	000559	万向钱潮	26,900	146,605.00	0.03
456	601608	中信重工	34,700	146,087.00	0.03
457	300888	稳健医疗	3,500	145,845.00	0.03
458	300850	新强联	3,900	145,782.00	0.03
459	600556	天下秀	20,300	143,927.00	0.03
460	000898	鞍钢股份	51,400	142,892.00	0.03
461	002124	天邦食品	31,300	142,102.00	0.03
462	002505	鹏都农牧	74,800	141,372.00	0.03
463	688433	华曙高科	4,171	140,769.00	0.03
464	600409	三友化工	25,800	140,610.00	0.03
465	600507	方大特钢	29,894	138,409.22	0.03

466	600597	光明乳业	13,300	138,320.00	0.03
467	301360	荣旗科技	1,340	138,170.08	0.03
468	688088	虹软科技	3,200	136,800.00	0.03
469	603866	桃李面包	13,500	136,620.00	0.03
470	600968	海油发展	44,500	136,615.00	0.03
471	300482	万孚生物	5,120	136,345.60	0.03
472	300618	寒锐钴业	4,200	136,122.00	0.03
473	001914	招商积余	9,000	135,450.00	0.03
474	688620	安凯微	10,157	135,209.66	0.03
475	600095	湘财股份	17,300	134,940.00	0.03
476	603707	健友股份	9,900	133,650.00	0.03
477	603638	艾迪精密	6,480	132,969.60	0.03
478	301315	威士顿	2,253	132,828.53	0.03
479	000537	广宇发展	11,200	130,704.00	0.03
480	000967	盈峰环境	25,700	129,785.00	0.03
481	300257	开山股份	8,500	128,945.00	0.03
482	002048	宁波华翔	9,600	128,640.00	0.03
483	600808	马钢股份	50,000	128,500.00	0.03
484	301262	海看股份	4,658	128,211.00	0.03
485	002191	劲嘉股份	21,200	127,624.00	0.02
486	002002	鸿达兴业	56,200	125,888.00	0.02
487	601568	北元集团	23,820	125,531.40	0.02
488	688523	航天环宇	4,717	125,405.25	0.02
489	603379	三美股份	5,300	124,603.00	0.02
490	002416	爱施德	16,640	122,803.20	0.02
491	688690	纳微科技	3,100	120,435.00	0.02
492	301141	中科磁业	2,617	119,750.28	0.02
493	300463	迈克生物	7,900	119,448.00	0.02
494	688006	杭可科技	3,920	119,442.40	0.02
495	600195	中牧股份	10,189	119,007.52	0.02
496	600764	中国海防	4,300	117,046.00	0.02
497	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.02
498	688185	康希诺	1,400	114,100.00	0.02
499	000402	金融街	25,200	113,904.00	0.02
500	301345	涛涛车业	2,386	113,580.33	0.02
501	000959	首钢股份	32,300	113,050.00	0.02
502	601298	青岛港	16,200	112,914.00	0.02
503	600376	首开股份	28,900	112,710.00	0.02
504	300072	海新能科	32,800	112,176.00	0.02
505	601828	美凯龙	23,400	112,086.00	0.02
506	002110	三钢闽光	25,650	108,243.00	0.02
507	002925	盈趣科技	5,470	106,118.00	0.02
508	300630	普利制药	5,343	104,455.65	0.02

509	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.02
510	688479	友车科技	3,318	103,760.10	0.02
511	600787	中储股份	19,108	102,992.12	0.02
512	603317	天味食品	6,941	101,408.01	0.02
513	600307	酒钢宏兴	64,700	100,285.00	0.02
514	000031	大悦城	27,400	100,284.00	0.02
515	301355	南王科技	5,624	99,516.05	0.02
516	600377	宁沪高速	10,100	99,283.00	0.02
517	301376	致欧科技	4,192	98,850.60	0.02
518	688429	时创能源	3,452	98,752.08	0.02
519	603056	德邦股份	6,400	98,688.00	0.02
520	001872	招商港口	5,700	98,439.00	0.02
521	688631	莱斯信息	3,047	98,389.87	0.02
522	301357	北方长龙	1,900	98,250.90	0.02
523	001203	大中矿业	8,800	97,768.00	0.02
524	301323	新莱福	2,277	97,593.33	0.02
525	688535	华海诚科	1,607	96,642.01	0.02
526	600623	华谊集团	15,300	95,319.00	0.02
527	600006	东风汽车	16,100	95,151.00	0.02
528	301386	未来电器	3,776	94,554.26	0.02
529	002653	海思科	4,000	94,400.00	0.02
530	600928	西安银行	26,700	93,984.00	0.02
531	000990	诚志股份	12,300	93,726.00	0.02
532	301170	锡南科技	2,496	92,283.70	0.02
533	688819	天能股份	2,500	92,100.00	0.02
534	600350	山东高速	14,400	91,728.00	0.02
535	002242	九阳股份	6,100	91,195.00	0.02
536	301373	凌玮科技	2,764	89,376.38	0.02
537	301281	科源制药	3,367	88,390.10	0.02
538	002399	海普瑞	7,600	87,172.00	0.02
539	600648	外高桥	7,700	87,087.00	0.02
540	601869	长飞光纤	2,300	85,123.00	0.02
541	301157	华塑科技	1,498	83,481.42	0.02
542	601969	海南矿业	12,600	82,908.00	0.02
543	301295	美硕科技	2,146	81,770.28	0.02
544	601139	深圳燃气	11,100	80,919.00	0.02
545	301428	世纪恒通	2,289	80,343.40	0.02
546	601059	信达证券	5,628	80,255.28	0.02
547	688307	中润光学	2,455	80,253.95	0.02
548	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.02
549	301337	亚华电子	2,318	78,804.24	0.02
550	002146	荣盛发展	51,100	78,694.00	0.02
551	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.01

552	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.01
553	601228	广州港	22,500	72,675.00	0.01
554	000553	安道麦 A	8,500	71,740.00	0.01
555	002945	华林证券	5,200	71,136.00	0.01
556	603719	良品铺子	2,700	67,527.00	0.01
557	600299	安迪苏	7,900	62,963.00	0.01
558	601158	重庆水务	11,300	62,828.00	0.01
559	603355	莱克电气	2,298	58,392.18	0.01
560	603868	飞科电器	900	56,781.00	0.01
561	600925	苏能股份	8,960	55,283.20	0.01
562	688485	九州一轨	3,580	54,308.60	0.01
563	300741	华宝股份	2,450	52,479.00	0.01
564	600956	新天绿能	5,800	50,576.00	0.01
565	603786	科博达	700	45,990.00	0.01
566	600032	浙江新能	3,600	45,216.00	0.01
567	688772	珠海冠宇	2,200	44,330.00	0.01
568	600917	重庆燃气	6,000	40,800.00	0.01
569	001227	兰州银行	13,100	37,466.00	0.01
570	603281	江瀚新材	1,208	37,303.04	0.01
571	001311	多利科技	649	37,272.07	0.01
572	001282	三联锻造	1,045	37,026.15	0.01
573	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.01
574	002901	大博医疗	1,100	34,188.00	0.01
575	301267	华夏眼科	556	33,888.20	0.01
576	301301	川宁生物	3,574	32,023.04	0.01
577	603137	恒尚节能	1,382	26,502.14	0.01
578	301311	昆船智能	832	24,527.36	0.00
579	001324	长青科技	1,131	23,764.29	0.00
580	301368	丰立智能	337	23,317.03	0.00
581	001314	亿道信息	508	21,478.24	0.00
582	603172	万丰股份	1,220	21,138.94	0.00
583	301095	广立微	233	19,257.45	0.00
584	001287	中电港	858	18,035.16	0.00
585	301377	鼎泰高科	770	17,710.00	0.00
586	603173	福斯达	588	17,316.60	0.00
587	301339	通行宝	629	15,806.77	0.00
588	301363	美好医疗	340	14,956.60	0.00
589	601061	中信金属	1,946	14,750.68	0.00
590	301361	众智科技	517	14,574.23	0.00
591	301338	凯格精机	360	14,004.00	0.00
592	301327	华宝新能	173	13,686.03	0.00
593	000540	*ST 中天	122,400	13,464.00	0.00
594	603162	海通发展	774	13,196.70	0.00

595	301277	新天地	659	12,857.09	0.00
596	301296	新巨丰	721	12,170.48	0.00
597	301132	满坤科技	413	12,138.07	0.00
598	301328	维峰电子	209	11,900.46	0.00
599	301270	汉仪股份	210	11,468.10	0.00
600	603135	中重科技	628	11,234.92	0.00
601	301269	华大九天	88	10,809.92	0.00
602	301290	东星医疗	330	10,576.50	0.00
603	301152	天力锂能	236	10,539.76	0.00
604	301313	凡拓数创	247	10,455.51	0.00
605	301171	易点天下	473	10,453.30	0.00
606	301282	金禄电子	334	10,040.04	0.00
607	301398	星源卓镁	255	9,562.50	0.00
608	301265	华新环保	819	9,516.78	0.00
609	301231	荣信文化	275	9,251.00	0.00
610	301197	工大科雅	380	9,158.00	0.00
611	301359	东南电子	328	8,357.44	0.00
612	301316	慧博云通	359	8,203.15	0.00
613	301285	鸿日达	565	8,186.85	0.00
614	603291	联合水务	536	8,152.56	0.00
615	301115	建科股份	350	8,001.00	0.00
616	301161	唯万密封	346	7,996.06	0.00
617	301388	欣灵电气	292	7,840.20	0.00
618	601065	江盐集团	636	7,530.24	0.00
619	301283	聚胶股份	207	7,344.36	0.00
620	301276	嘉曼服饰	280	7,140.00	0.00
621	301318	维海德	211	7,079.05	0.00
622	601133	柏诚股份	562	6,890.12	0.00
623	301319	唯特偶	115	6,882.75	0.00
624	301239	普瑞眼科	69	6,767.52	0.00
625	301300	远翔新材	211	6,667.60	0.00
626	301220	亚香股份	185	6,310.35	0.00
627	301309	万得凯	203	5,590.62	0.00
628	301349	信德新材	108	5,415.12	0.00
629	301117	佳缘科技	62	4,006.44	0.00
630	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
631	301110	青木股份	76	3,832.68	0.00
632	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
633	301233	盛帮股份	58	2,509.66	0.00
634	301302	华如科技	66	2,428.80	0.00
635	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
636	301206	三元生物	54	1,889.46	0.00
637	301238	瑞泰新材	87	1,769.58	0.00

638	301217	铜冠铜箔	86	1,223.78	0.00
639	301116	益客食品	77	1,185.80	0.00
640	301306	西测测试	26	1,010.10	0.00
641	301100	风光股份	27	557.82	0.00
642	600158	中体产业	47	477.52	0.00
643	301175	中科环保	25	155.75	0.00
644	600058	五矿发展	1	9.83	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	603737	三棵树	24,824,201.44	4.02
2	600329	达仁堂	21,240,932.06	3.44
3	603688	石英股份	15,075,634.00	2.44
4	688029	南微医学	13,929,823.65	2.25
5	688002	睿创微纳	12,693,657.59	2.05
6	002738	中矿资源	12,110,150.58	1.96
7	300474	景嘉微	11,278,183.00	1.82
8	002155	湖南黄金	11,077,715.66	1.79
9	688063	派能科技	10,986,819.02	1.78
10	002192	融捷股份	10,258,818.12	1.66
11	300058	蓝色光标	10,024,370.00	1.62
12	601958	金铂股份	9,822,132.00	1.59
13	601231	环旭电子	8,963,115.96	1.45
14	600739	辽宁成大	8,668,919.00	1.40
15	688188	柏楚电子	7,915,107.27	1.28
16	002507	涪陵榨菜	6,857,687.88	1.11
17	601872	招商轮船	6,789,772.60	1.10
18	002555	三七互娱	6,666,931.00	1.08
19	603719	良品铺子	6,645,865.00	1.07
20	002531	天顺风能	6,549,001.00	1.06

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	603456	九洲药业	21,900,816.95	3.54
2	300009	安科生物	16,216,795.40	2.62
3	603650	彤程新材	15,286,530.00	2.47
4	600563	法拉电子	13,005,145.68	2.10
5	002056	横店东磁	12,085,096.00	1.95

6	601000	唐山港	12,051,610.96	1.95
7	002738	中矿资源	10,775,508.58	1.74
8	600369	西南证券	10,754,315.73	1.74
9	600732	爱旭股份	10,664,349.00	1.72
10	002240	盛新锂能	10,648,506.00	1.72
11	000831	中国稀土	10,175,002.00	1.65
12	688088	虹软科技	9,053,086.74	1.46
13	603198	迎驾贡酒	8,923,093.00	1.44
14	002465	海格通信	8,891,864.00	1.44
15	688063	派能科技	8,790,074.16	1.42
16	002555	三七互娱	8,359,677.00	1.35
17	600522	中天科技	8,185,248.00	1.32
18	300699	光威复材	8,043,687.80	1.30
19	603927	中科软	7,795,398.12	1.26
20	002624	完美世界	7,781,009.00	1.26

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	335,342,891.48
卖出股票收入（成交）总额	429,392,830.81

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	35,391,741.09	6.93
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	35,391,741.09	6.93

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	019688	22 国债 23	350,000	35,391,741.09	6.93

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

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目标，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，充分考虑股指期货的风险收益特征，通过多头或空头的套期保值策略，以改善投资组合的投资效果，实现股票组合的超额收益。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**7.11.1 本期国债期货投资政策**

为有效控制债券投资的系统性风险，本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的，适度运用国债期货，提高投资组合的运作效率。在国债期货投资时，本基金将首先分析国债期货各合约价格与最便宜可交割券的关系，选择定价合理的国债期货合约，其次，考虑国债期货各合约的流动性情况，最终确定与现货组合的合适匹配，以达到风险管理的目标。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券备选库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	76,265.92
2	应收清算款	1,037,096.07
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	11,357.59

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,124,719.58

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

份额级别	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（%）
鹏华睿投混合 A	2,467	130,700.92	275,777,570.05	85.53	46,661,602.61	14.47
鹏华睿投混合 C	212	191,681.68	34,731,792.93	85.47	5,904,722.43	14.53
合计	2,679	135,526.57	310,509,362.98	85.52	52,566,325.04	14.48

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	鹏华睿投混合 A	1,693,641.73	0.5253
	鹏华睿投混合 C	166.11	0.0004
	合计	1,693,807.84	0.4665

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	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
----	------	-------------------

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	鹏华睿投混合 A	10~50
	鹏华睿投混合 C	-
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	鹏华睿投混合 A	50~100
	鹏华睿投混合 C	-
	合计	50~100

注：截至本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人及本基金的基金经理投资、持有本基金符合相关法律法规、中国证监会规定及相关管理制度的规定。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	鹏华睿投混合 A	鹏华睿投混合 C
基金合同生效日 (2018 年 5 月 30 日) 基金份额总额	214,008,175.33	-
本报告期期初基金份额总额	403,794,053.72	15,949,860.20
本报告期基金总申购份额	9,119,482.10	42,135,773.99
减：本报告期基金总赎回份额	90,474,363.16	17,449,118.83
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	322,439,172.66	40,636,515.36

§ 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 (%)	
开源证券	2	444,153,884.56	58.94	364,781.40	58.40	-
浙商证券	2	153,971,067.18	20.43	126,456.50	20.25	报告期新增一个
兴业证券	1	53,777,863.52	7.14	44,168.02	7.07	-
天风证券	2	49,027,969.23	6.51	45,169.59	7.23	-
国海证券	2	44,562,460.83	5.91	36,599.33	5.86	-
东方证券	2	7,792,463.96	1.03	7,180.41	1.15	-
西南证券	2	263,916.00	0.04	243.16	0.04	-
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	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
摩根大通 证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
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、及时性以及提供研究服务主动性和质量等情况，并依据评比结果确定交易单元交易的具体情况。我公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向券商租用交易单元作为基金专用交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
开源证券	34,909,700.00	100.00	819,300,000.00	33.97	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	1,030,000,000.00	42.70	-	-
东方证券	-	-	80,000,000.00	3.32	-	-
西南证券	-	-	200,000,000.00	8.29	-	-
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	-	-	121,000,000.00	5.02	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国信证	-	-	-	-	-	-

券						
海通证 券	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
民生证 券	-	-	101,600,000.00	4.21	-	-
摩根大 通证券	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-
山西证 券	-	-	-	-	-	-
信达证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	60,000,000.00	2.49	-	-
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	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	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	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023年01月05日
3	鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023年01月20日
4	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购中润光学首次公开发行 A 股的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023年02月10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	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023年03月14日
6	鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金 2022 年年度报告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会	2023年03月30日

		基金电子披露网站	
7	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与南京证券股份有限公司申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 03 月 31 日
8	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	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 04 月 07 日
9	鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 04 月 21 日
10	鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金更新的招募说明书	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 05 月 12 日
11	鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金（A 类基金份额）基金产品资料概要（更新）	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 05 月 12 日
12	鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金（C 类基金份额）基金产品资料概要（更新）	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 05 月 12 日
13	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购航天软件首次公开发行 A 股的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 05 月 17 日
14	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	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 05 月 19 日
15	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	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 06 月 03 日
16	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	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 06 月 05 日
17	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 06 月 06 日
18	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	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 06 月 20 日
19	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购豪恩汽电首次公开发行 A 股的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 06 月 28 日

注：无。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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