

鹏华品牌传承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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	11
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	11
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>11</b>
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	13
6.3 净资产（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注	17
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>43</b>
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52

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 .....	53
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 .....	53
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 .....	53
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 .....	53
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	53
7.12 投资组合报告附注 .....	53
<b>§ 8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>54</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	54
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 .....	54
<b>§ 9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>54</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>55</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	55
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 .....	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	55
10.4 基金投资策略的改变 .....	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	55
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	55
10.8 其他重大事件 .....	58
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>59</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 .....	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	59
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>59</b>
12.1 备查文件目录 .....	59
12.2 存放地点 .....	59
12.3 查阅方式 .....	59

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华品牌传承灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	鹏华品牌传承混合
基金主代码	000431
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 1 月 28 日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	122,013,088.40 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过积极灵活的资产配置，并精选优质的品牌类上市公司，在有效控制风险前提下，力求超越业绩比较基准的投资回报，争取实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略 本基金采用自上而下的策略，通过对宏观经济基本面（包括经济运行周期、财政及货币政策、产业政策等）的分析判断，和对流动性水平（包括资金面供需情况、证券市场估值水平等）的深入研究，分析股票市场、债券市场、货币市场三大类资产的预期风险和收益，并据此对本基金资产在股票、债券、现金之间的投资比例进行动态调整。 本基金结合市场主要经济和金融变量的变动情况，综合分析各类金融资产的预期收益和风险特征及其变化方向，在股票和债券等大类资产之间进行灵活地配置，同时兼顾动态资产配置中的风险控制和成本控制。</p> <p>2、股票投资策略 本基金的股票投资策略包括行业配置策略和个股投资策略。核心思路在于：1) 评判行业的增长前景、行业结构、商业模式、竞争要素等分析把握其投资机会；2) 评判企业的核心竞争力、品牌优势、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，深度挖掘具有投资潜力的个股。 本基金中品牌类企业主要指以下两类： 第一类是指在长期的生产经营活动中，沿袭和继承了中华民族优秀的文化传统，具有鲜明的地域文化特征和历史痕迹、具有独特的工艺和经营特色的产品、技艺或服务，已经取得了广泛的社会认同，赢得了良好的商业信誉的企业。 第二类是指企业的品牌进入导入期或成长期，并随着消费习惯的变迁，品牌的影响力在逐渐加强，消费者对该品牌逐步产生认同感和信赖感，并有可能最终成为普遍的社会共识。 品牌类企业涉及行业较广，包括纺织服装、食品饮料、餐饮旅游、农林牧渔、房地产、家用电器、轻工制造、商贸零售、信息服务、金融服务、化工、交运设备和医药生物等等。</p> <p>3、债券投资策略 对于固定收益类资产的选择，本基金将以价值分析为主线，在综合研究的基础上实施积极主动的组合管理，并主要通过类属配置与债券选择两个层次进行投资管理。</p> <p>4、中小企业私募债投资策略</p>

	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，尽力规避可能存在的债券违约，并获取超额收益。 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。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金属于混合型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金，低于股票型基金，属于证券投资基金中中高风险、中高预期收益的品种。

注：无。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		鹏华基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	高永杰	秦一楠
	联系电话	0755-81395402	010-66060069
	电子邮箱	xxpl@phfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4006788999	95599
传真		0755-82021126	010-68121816
注册地址		深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		518048	100031
法定代表人		何如	谷澍

### 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)
本期已实现收益	-29,650,850.84
本期利润	-24,143,640.59
加权平均基金份额本期利润	-0.1917
本期加权平均净值利润率	-6.23%
本期基金份额净值增长率	-6.08%
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	203,610,533.71
期末可供分配基金份额利润	1.6688
期末基金资产净值	361,875,433.29
期末基金份额净值	2.966
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	220.83%

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

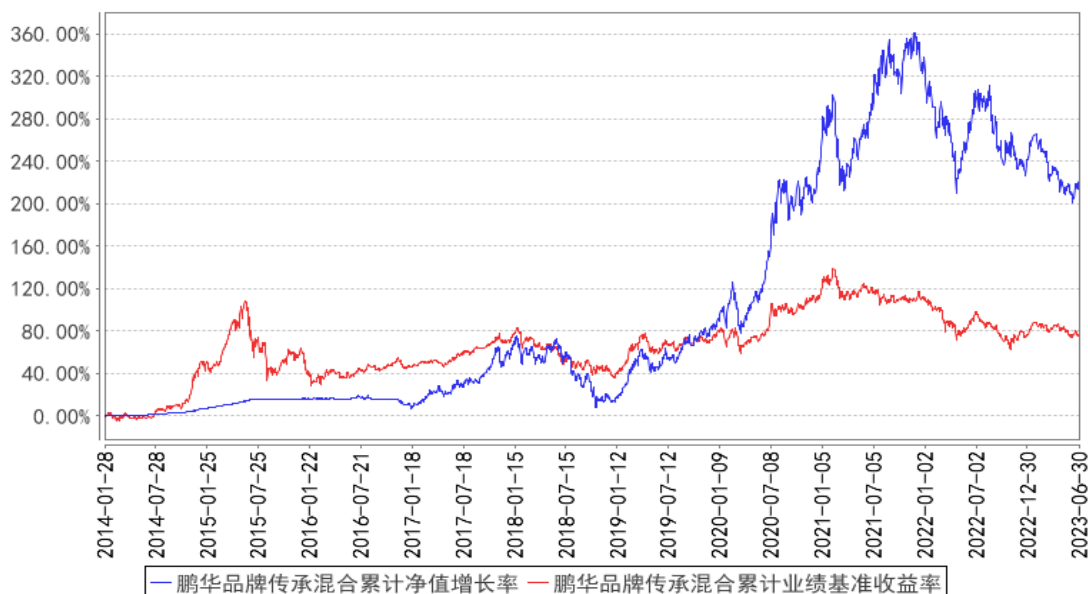
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	3.82%	0.96%	1.04%	0.69%	2.78%	0.27%
过去三个月	-4.23%	0.97%	-3.77%	0.66%	-0.46%	0.31%
过去六个月	-6.08%	0.94%	0.00%	0.67%	-6.08%	0.27%
过去一年	-19.23%	1.23%	-10.72%	0.79%	-8.51%	0.44%
过去三年	25.62%	1.66%	-3.19%	0.96%	28.81%	0.70%
自基金合同生效起至今	220.83%	1.35%	76.41%	1.13%	144.42%	0.22%

注：业绩比较基准=沪深300指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20%

### 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

鹏华品牌传承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 2014 年 01 月 28 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		
孟昊	基金经理	2021-08-24	-	9 年	孟昊先生，国籍中国，理学硕士，9 年证券从业经验。2014 年 7 月加盟鹏华基金管



					理有限公司，历任研究部高级研究员、权益投资二部基金经理，现担任研究部总经理/基金经理。2018年02月至2019年09月担任鹏华新科技传媒灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2018年11月至今担任鹏华消费领先灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2019年07月至今担任鹏华环保产业股票型证券投资基金基金经理，2020年02月至今担任鹏华优选回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2021年08月至今担任鹏华品牌传承灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2021年09月至今担任鹏华品质精选混合型证券投资基金基金经理，2021年12月至今担任鹏华沃鑫混合型证券投资基金基金经理，2022年01月至今担任鹏华成长领航两年持有期混合型证券投资基金基金经理，孟昊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

上半年，宏观经济逐月走弱，市场对复苏链逐步认清现实，复苏或只是疫情后的一次反弹，增长的下台阶是未来投资要长期面临的事实。在组合结构上，我们大幅减仓了白酒，加仓了医药、计算机和半导体。我们看好集采控费缓解下的医药投资机会，增持了具备创新能力的医疗器械公司。我们增配了 TMT 板块中的工业软件和半导体设备，我们认为在数字中国建设的大背景下，工业软件和半导体设备龙头公司将充分受益。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期鹏华品牌传承混合份额净值增长率为-6.08%，同期业绩比较基准增长率为 0.00%。

#### 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，我们认为宏观政策上很难有大的经济刺激。在当下全球紧缩的货币政策环境下，国内流动性也难有大幅宽松的可能，市场整体还是以结构性机会为主。我们仍然看好光伏产业链，并将在医药、TMT 等行业中寻找能长大的公司。

#### 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 203,610,533.71 元,期末基金份额净值 2.966 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

在托管本基金的过程中,本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定,对本基金基金管理人—鹏华基金管理有限公司 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为,鹏华基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

#### 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

本托管人认为,鹏华基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

### § 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：鹏华品牌传承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	55,699,680.33	25,499,052.75
结算备付金		2,123,350.17	3,765,797.70
存出保证金		89,800.45	126,424.25
交易性金融资产	6.4.7.2	306,689,861.06	353,367,011.46
其中：股票投资		306,689,861.06	353,367,011.46
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	32,569,000.00	28,665,923.40
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		85,198.07	76,361.23
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		397,256,890.08	411,500,570.79
<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		-	-
应付清算款		34,052,414.17	794,546.34
应付赎回款		330,605.16	86,215.69
应付管理人报酬		435,883.01	516,209.90
应付托管费		72,647.16	86,034.98
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	4.37
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	489,907.29	403,777.09
负债合计		35,381,456.79	1,886,788.37
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	122,013,088.40	129,705,892.10
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	239,862,344.89	279,907,890.32
净资产合计		361,875,433.29	409,613,782.42
负债和净资产总计		397,256,890.08	411,500,570.79

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 2.966 元，基金份额总额 122,013,088.40 份。

## 6.2 利润表

会计主体：鹏华品牌传承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>		-20,659,866.78	-51,228,530.73
1. 利息收入		343,284.84	798,345.21
其中：存款利息收入	6.4.7.13	114,229.76	172,467.26
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		229,055.08	625,877.95
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-26,532,050.24	-24,978,695.19
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-28,525,517.66	-26,079,078.76
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	73,335.71	123,927.09
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	1,920,131.71	976,456.48
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	5,507,210.25	-27,147,258.97
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	21,688.37	99,078.22
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>3,483,773.81</b>	<b>4,346,755.11</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,891,640.76	3,630,281.08
2. 托管费	6.4.10.2.2	481,940.09	605,046.87
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		0.34	0.28
8. 其他费用	6.4.7.23	110,192.62	111,426.88
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-24,143,640.59</b>	<b>-55,575,285.84</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-24,143,640.59</b>	<b>-55,575,285.84</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-24,143,640.59</b>	<b>-55,575,285.84</b>

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：鹏华品牌传承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)	129,705,892.10	-	279,907,890.32	409,613,782.42
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
二、本 期初 净 资 产(基 金 净 值)	129,705,892.10	-	279,907,890.32	409,613,782.42
三、本 期 增 减 变 动 额(减 少以“-” 号填列)	-7,692,803.70	-	-40,045,545.43	-47,738,349.13
(一)、 综合收 益总额	-	-	-24,143,640.59	-24,143,640.59
(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)	-7,692,803.70	-	-15,901,904.84	-23,594,708.54
其中:1. 基金申 购款	2,660,163.37	-	5,569,095.55	8,229,258.92
2 .基金 赎回 款	-10,352,967.07	-	-21,471,000.39	-31,823,967.46
(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)	122,013,088.40	-	239,862,344.89	361,875,433.29
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)	152,830,876.01	-	465,785,164.27	618,616,040.28
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)	152,830,876.01	-	465,785,164.27	618,616,040.28
三、本期 增减变 动额(减 少以“-” 号填列)	-8,757,077.13	-	-80,859,406.21	-89,616,483.34
(一)、 综合收 益总额	-	-	-55,575,285.84	-55,575,285.84
(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)	-8,757,077.13	-	-25,284,120.37	-34,041,197.50



其中:1. 基金申购款	16,984,144.32	-	41,771,687.40	58,755,831.72
2 .基金赎回款	-25,741,221.45	-	-67,055,807.77	-92,797,029.22
(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)	144,073,798.88	-	384,925,758.06	528,999,556.94

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

鹏华品牌传承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[2013]第 1398 号《关于核准鹏华品牌传承灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》核准,由鹏华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华品牌传承灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。

本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 599,455,227.70 元，经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）普华永道中天验字(2014)第 030 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《鹏华品牌传承灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2014 年 1 月 28 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 599,677,846.59 份基金份额，其中认购资金利息折合 222,618.89 份基金份额。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

#### 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》、《鹏华品牌传承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	55,699,680.33
等于：本金	55,696,048.86
加：应计利息	3,631.47
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	55,699,680.33

#### 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	314,435,336.78	-	306,689,861.06	-7,745,475.72
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	314,435,336.78	-	306,689,861.06	-7,745,475.72

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**

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	32,569,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	32,569,000.00	-

**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	325.46
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	405,279.27
其中：交易所市场	405,279.27
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	84,302.56
合计	489,907.29

## 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	129,705,892.10	129,705,892.10
本期申购	2,660,163.37	2,660,163.37
本期赎回（以“-”号填列）	-10,352,967.07	-10,352,967.07
- 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	122,013,088.40	122,013,088.40

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	246,977,252.72	32,930,637.60	279,907,890.32
本期利润	-29,650,850.84	5,507,210.25	-24,143,640.59
本期基金份额交易产生的变动数	-13,715,868.17	-2,186,036.67	-15,901,904.84
其中：基金申购款	4,760,270.72	808,824.83	5,569,095.55
基金赎回款	-18,476,138.89	-2,994,861.50	-21,471,000.39
本期已分配利润	-	-	-
本期末	203,610,533.71	36,251,811.18	239,862,344.89

## 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	95,381.91
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	18,101.59
其他	746.26
合计	114,229.76

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	-28,525,517.66
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	-28,525,517.66

## 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	376,987,921.73
减：卖出股票成本总额	404,428,848.19
减：交易费用	1,084,591.20
买卖股票差价收入	-28,525,517.66

## 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	92.24
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	73,243.47

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	73,335.71

#### 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	525,359.60
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	452,000.00
减：应计利息总额	95.11
减：交易费用	21.02
买卖债券差价收入	73,243.47

#### 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	1,920,131.71
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,920,131.71

## 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	5,507,210.25
股票投资	5,507,210.25
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	5,507,210.25

## 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	19,172.86
基金转换费收入	2,515.51
合计	21,688.37

#### 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	7,290.06
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	110,192.62

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

注：无。

#### 6.4.10.1.2 债券交易

注：无。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

注：无。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：无。

### 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	2,891,640.76	3,630,281.08
其中：支付销售机构的客户维护费	1,213,078.62	1,430,600.94

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 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	481,940.09	605,046.87

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

**6.4.10.2.3 销售服务费**

注：无。

**6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

注：无。

**6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明****6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

注：无。

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

注：无。

**6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况****6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用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
中国农业银行	55,699,680.33	95,381.91	40,314,099.37	115,995.25

**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	688307	中润光学	网下申购	2,455	58,625.40
国信证券	301488	豪恩汽电	网下申购	1,608	63,966.24
国信证券	688562	航天软件	网下申购	5,832	73,949.76
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

				股/张 )	
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	472	5,607.36	9,921.44	-
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	129	2,667.72	3,288.21	-
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	-
300118	东方日升	2023年2月10日	6个月	非公开发行流通受限	20.15	24.80	248,139	5,000,000.85	6,153,847.20	-
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	2023	6个月	新股	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-

	科技	年 3 月 1 日		流通 受限							
301170	锡南 科技	2023 年 6 月 16 日	6 个月	新股 流通 受限	34.00	34.93	153	5,202.00	5,344.29	-	
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	1,988	51,330.16	51,330.16	-	
301202	朗威 股份	2023 年 6 月 28 日	6 个月	新股 流通 受限	25.82	25.82	221	5,706.22	5,706.22	-	
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	1,420	52,398.00	52,398.00	-	
301261	恒工 精密	2023 年 6 月 29 日	6 个月	新股 流通 受限	36.90	36.90	158	5,830.20	5,830.20	-	
301262	海看 股份	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股 流通 受限	30.22	25.50	268	8,098.96	6,834.00	-	
301281	科源 制药	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股 流通 受限	44.18	25.10	317	9,984.68	7,956.70	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	305	11,629.65	9,464.15	-	
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	4,087	81,699.13	81,699.13	-	
301292	海科 新源	2023 年 6 月 29 日	6 个月	新股 流通 受限	19.99	19.99	455	9,095.45	9,095.45	-	
301293	三博 脑科	2023 年 4 月 25 日	6 个月	新股 流通 受限	29.60	71.42	316	9,353.60	22,568.72	-	
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	6 个月	新股 流通	5.00	8.96	3,195	15,975.00	28,627.20	-	

		月 20 日		受限							
301303	真兰仪表	2023 年 2 月 13 日	6 个月	新股流通受限	26.80	22.32	682	18,277.60	15,222.24	-	
301315	威士顿	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股流通受限	32.29	51.12	173	5,586.17	8,843.76	-	
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	-	
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	162	14,159.88	8,624.88	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	197	7,694.82	7,753.92	-	
301325	曼恩斯特	2023 年 5 月 4 日	6 个月	新股流通受限	76.80	107.95	169	12,979.20	18,243.55	-	
301332	德尔玛	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股流通受限	14.81	13.73	642	9,508.02	8,814.66	-	
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	140	10,283.00	6,529.60	-	
301355	南王科技	2023 年 6 月 2 日	6 个月	新股流通受限	17.55	16.75	518	9,090.90	8,676.50	-	
301357	北方长龙	2023 年 4 月 11 日	6 个月	新股流通受限	50.00	48.39	184	9,200.00	8,903.76	-	
301358	湖南裕能	2023 年 2 月	6 个月	新股流通	23.77	42.89	447	10,625.19	19,171.83	-	

		1 日		受限						
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	255	6,288.30	5,740.05	-
301382	蜂助手	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股流通受限	23.80	32.84	314	7,473.20	10,311.76	-
301386	未来电器	2023 年 3 月 21 日	6 个月	新股流通受限	29.99	23.79	368	11,036.32	8,754.72	-
301399	英特科技	2023 年 5 月 16 日	6 个月	新股流通受限	43.99	51.57	245	10,777.55	12,634.65	-
301408	华人健康	2023 年 2 月 22 日	6 个月	新股流通受限	16.24	16.95	836	13,576.64	14,170.20	-
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	491	9,815.09	8,297.90	-
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	1,616	93,178.56	93,178.56	-
301486	致尚科技	2023 年 6 月 30 日	6 个月	新股流通受限	57.66	57.66	180	10,378.80	10,378.80	-
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	1,447	57,561.66	57,561.66	-
301488	豪恩汽电	2023 年 6 月 26 日	6 个月	新股流通受限	39.78	39.78	161	6,404.58	6,404.58	-
601061	中信	2023	6 个月	新股	6.58	7.58	1,072	7,053.76	8,125.76	-



	金属	年 3 月 30 日		流通 受限							
601065	江盐 集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股 流通 受限	10.36	11.84	350	3,626.00	4,144.00	-	
601133	柏诚 股份	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股 流通 受限	11.66	12.26	308	3,591.28	3,776.08	-	
603125	常青 科技	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股 流通 受限	25.98	24.53	115	2,987.70	2,820.95	-	
603135	中重 科技	2023 年 3 月 29 日	6 个月	新股 流通 受限	17.80	17.89	358	6,372.40	6,404.62	-	
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	342	12,363.30	13,040.46	-	
688249	晶合 集成	2023 年 4 月 24 日	6 个月	新股 流通 受限	19.86	18.06	1,864	37,019.04	33,663.84	-	
688334	西高 院	2023 年 6 月 9 日	6 个月	新股 流通 受限	14.16	16.21	615	8,708.40	9,969.15	-	
688352	硕中 科技	2023 年 4 月 11 日	6 个月	新股 流通 受限	12.10	12.07	949	11,482.90	11,454.43	-	
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	329	7,764.40	21,276.43	-	
688429	时创 能源	2023 年 6 月 20 日	6 个月	新股 流通 受限	19.20	25.53	270	5,184.00	6,893.10	-	
688433	华曙 高科	2023 年 4 月 7 日	6 个月	新股 流通 受限	26.66	31.50	286	7,624.76	9,009.00	-	
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	408	15,455.04	12,031.92	-	

688458	美芯晟	2023年5月15日	6个月	新股流通受限	75.00	90.76	117	8,775.00	10,618.92	-
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	3,361	19,124.09	18,183.01	-
688472	阿特斯	2023年6月2日	6个月	新股流通受限	11.10	17.04	1,280	14,208.00	21,811.20	-
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	219	7,443.81	6,458.31	-
688507	索辰科技	2023年4月10日	6个月	新股流通受限	245.56	122.11	80	13,260.24	9,768.80	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	437	9,552.82	10,422.45	-
688531	日联科技	2023年3月24日	6个月	新股流通受限	152.38	135.97	110	16,761.80	14,956.70	-
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	178	7,773.26	9,442.90	-
688562	航天软件	2023年5月15日	6个月	新股流通受限	12.68	22.31	584	7,405.12	13,029.04	-
688570	天玛智控	2023年5月29日	6个月	新股流通受限	30.26	25.33	354	10,712.04	8,966.82	-
688581	安杰思	2023年5月12日	6个月	新股流通受限	125.80	118.03	82	10,315.60	9,678.46	-
688582	芯动	2023	6个月	新股	26.74	40.68	219	5,856.06	8,908.92	-

	联科	年 6 月 21 日		流通 受限						
688593	新相 微	2023 年 5 月 25 日	6 个月	新股 流通 受限	11.18	14.59	815	9,111.70	11,890.85	-
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	1,125	61,875.00	61,875.00	-
688603	天承 科技	2023 年 6 月 30 日	6 个月	新股 流通 受限	55.00	55.00	126	6,930.00	6,930.00	-
688620	安凯 微	2023 年 6 月 15 日	6 个月	新股 流通 受限	10.68	12.34	592	6,322.56	7,305.28	-
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	176	4,449.28	5,257.12	-

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

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

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

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

5、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不

能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包含中小板，创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)，债券(包括中小企业私募债券)，货币市场工具，权证，资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人可在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

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

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，

及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国农业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发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注“期末本基金持有的流通受限证券”。此外，本基金可

通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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

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

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

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	55,699,680.33	-	-	-	55,699,680.33
结算备付金	2,123,350.17	-	-	-	2,123,350.17
存出保证金	89,800.45	-	-	-	89,800.45
交易性金融资产	-	-	-	306,689,861.06	306,689,861.06
买入返售金融资产	32,569,000.00	-	-	-	32,569,000.00

应收申购款	-	-	-	85,198.07	85,198.07
资产总计	90,481,830.95	-	-	-306,775,059.13	397,256,890.08
负债					
应付赎回款	-	-	-	330,605.16	330,605.16
应付管理人报酬	-	-	-	435,883.01	435,883.01
应付托管费	-	-	-	72,647.16	72,647.16
应付清算款	-	-	-	34,052,414.17	34,052,414.17
其他负债	-	-	-	489,907.29	489,907.29
负债总计	-	-	-	35,381,456.79	35,381,456.79
利率敏感度缺口	90,481,830.95	-	-	-271,393,602.34	361,875,433.29
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	25,499,052.75	-	-	-	25,499,052.75
结算备付金	3,765,797.70	-	-	-	3,765,797.70
存出保证金	126,424.25	-	-	-	126,424.25
交易性金融资产	-	-	-	-353,367,011.46	353,367,011.46
买入返售金融资产	28,665,923.40	-	-	-	28,665,923.40
应收申购款	-	-	-	76,361.23	76,361.23
资产总计	58,057,198.10	-	-	-353,443,372.69	411,500,570.79
负债					
应付赎回款	-	-	-	86,215.69	86,215.69
应付管理人报酬	-	-	-	516,209.90	516,209.90
应付托管费	-	-	-	86,034.98	86,034.98
应付清算款	-	-	-	794,546.34	794,546.34
应交税费	-	-	-	4.37	4.37
其他负债	-	-	-	403,777.09	403,777.09
负债总计	-	-	-	1,886,788.37	1,886,788.37
利率敏感度缺口	58,057,198.10	-	-	-351,556,584.32	409,613,782.42

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 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 0.00%。因此当利率发生合理、可能的变动时，对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无。



#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。

股票资产占基金资产的 0%-95%；投资于品牌类上市公司的股票占非现金资产的比例不低于 80%；债券，货币市场工具及其他资产的占基金资产的比例不低于 5%；其中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%；基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；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	306,689,861.06	84.75	353,367,011.46	86.27
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	306,689,861.06	84.75	353,367,011.46	86.27

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%	12,325,477.26	16,341,541.85
	业绩比较基准下降5%	-12,325,477.26	-16,341,541.85

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	299,354,104.87
第二层次	442,387.76
第三层次	6,893,368.43
合计	306,689,861.06

#### 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	306,689,861.06	77.20
	其中：股票	306,689,861.06	77.20
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	32,569,000.00	8.20
	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	57,823,030.50	14.56
8	其他各项资产	174,998.52	0.04
9	合计	397,256,890.08	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	-	-
B	采矿业	19,820.76	0.01
C	制造业	273,204,753.76	75.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	54,689.56	0.02
E	建筑业	11,848.19	0.00
F	批发和零售业	4,213,164.37	1.16
G	交通运输、仓储和邮政业	13,196.70	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	21,946,147.40	6.06
J	金融业	139,586.48	0.04
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	233,607.91	0.06
N	水利、环境和公共设施管理业	21,174.06	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	6,805,267.57	1.88
R	文化、体育和娱乐业	26,604.30	0.01
S	综合	-	-
	合计	306,689,861.06	84.75

### 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	300750	宁德时代	109,494	25,051,132.26	6.92
2	002459	晶澳科技	587,811	24,511,718.70	6.77
3	603806	福斯特	613,329	22,809,705.51	6.30
4	688617	惠泰医疗	32,381	12,102,398.75	3.34

5	300760	迈瑞医疗	35,900	10,762,820.00	2.97
6	688516	奥特维	55,937	10,538,530.80	2.91
7	300724	捷佳伟创	79,800	8,965,530.00	2.48
8	300014	亿纬锂能	143,900	8,705,950.00	2.41
9	600519	贵州茅台	4,600	7,778,600.00	2.15
10	300525	博思软件	505,260	7,750,688.40	2.14
11	301363	美好医疗	171,945	7,563,860.55	2.09
12	002371	北方华创	22,900	7,274,185.00	2.01
13	300314	戴维医疗	334,800	7,077,672.00	1.96
14	600845	宝信软件	135,836	6,901,827.16	1.91
15	300274	阳光电源	58,300	6,799,529.00	1.88
16	301267	华夏眼科	111,283	6,782,698.85	1.87
17	300118	东方日升	248,139	6,153,847.20	1.70
18	688581	安杰思	49,055	6,008,381.23	1.66
19	301039	中集车辆	450,615	5,961,636.45	1.65
20	301155	海力风电	74,900	5,773,292.00	1.60
21	688503	聚和材料	57,596	5,615,610.00	1.55
22	600276	恒瑞医药	115,700	5,542,030.00	1.53
23	688338	赛科希德	92,394	5,123,247.30	1.42
24	688981	中芯国际	94,722	4,785,355.44	1.32
25	688036	传音控股	32,139	4,724,433.00	1.31
26	688378	奥来德	92,148	4,552,111.20	1.26
27	002851	麦格米特	124,500	4,540,515.00	1.25
28	688029	南微医学	55,511	4,527,477.16	1.25
29	301266	宇邦新材	63,600	4,471,716.00	1.24
30	603233	大参林	147,600	4,134,276.00	1.14
31	603606	东方电缆	83,900	4,113,617.00	1.14
32	001269	欧晶科技	55,760	4,100,032.80	1.13
33	301310	鑫宏业	55,200	3,802,176.00	1.05
34	300996	普联软件	122,500	3,760,750.00	1.04
35	601100	恒立液压	58,200	3,744,006.00	1.03
36	688575	亚辉龙	187,197	3,453,784.65	0.95
37	688223	晶科能源	230,360	3,238,861.60	0.90
38	300360	炬华科技	173,100	3,095,028.00	0.86
39	688580	伟思医疗	42,171	3,048,963.30	0.84
40	688479	友车科技	96,591	3,039,285.15	0.84
41	688472	阿特斯	163,314	2,996,755.44	0.83
42	688800	瑞可达	44,901	2,790,597.15	0.77
43	603345	安井食品	17,400	2,554,320.00	0.71
44	301325	曼恩斯特	16,381	1,874,517.55	0.52
45	001380	华纬科技	49,200	1,603,428.00	0.44
46	002850	科达利	8,900	1,177,025.00	0.33
47	688182	灿勤科技	18,387	463,904.01	0.13

48	688373	盟科药业-U	31,886	272,625.30	0.08
49	688403	汇成股份	18,553	226,717.66	0.06
50	688409	富创精密	2,027	220,943.00	0.06
51	688244	永信至诚	2,229	172,524.60	0.05
52	688146	中船特气	3,420	142,932.06	0.04
53	601916	浙商银行	52,800	139,392.00	0.04
54	688443	智翔金泰-U	4,072	125,286.16	0.03
55	300833	浩洋股份	1,100	120,373.00	0.03
56	301486	致尚科技	1,796	103,557.36	0.03
57	688582	芯动联科	2,181	100,828.62	0.03
58	301291	明阳电气	3,041	98,657.75	0.03
59	301332	德尔玛	6,411	91,253.67	0.03
60	301292	海科新源	4,542	90,794.58	0.03
61	688265	南模生物	2,374	88,835.08	0.02
62	688255	凯尔达	2,309	78,182.74	0.02
63	688509	正元地信	15,433	76,702.01	0.02
64	688171	纬德信息	2,821	68,945.24	0.02
65	688603	天承科技	1,251	68,805.00	0.02
66	301488	豪恩汽电	1,608	63,966.24	0.02
67	301261	恒工精密	1,578	58,228.20	0.02
68	301202	朗威股份	2,209	57,036.38	0.02
69	688631	莱斯信息	1,756	56,701.92	0.02
70	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.01
71	688249	晶合集成	1,864	33,663.84	0.01
72	301095	广立微	365	30,167.25	0.01
73	301301	川宁生物	3,195	28,627.20	0.01
74	301297	富乐德	1,015	22,847.65	0.01
75	301293	三博脑科	316	22,568.72	0.01
76	688361	中科飞测-U	329	21,276.43	0.01
77	603172	万丰股份	1,220	21,138.94	0.01
78	603206	嘉环科技	1,210	20,872.50	0.01
79	601121	宝地矿业	2,532	19,344.48	0.01
80	301358	湖南裕能	447	19,171.83	0.01
81	301185	鸥玛软件	578	19,085.56	0.01
82	688469	中芯集成-U	3,361	18,183.01	0.01
83	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.01
84	603235	天新药业	572	17,937.92	0.00
85	301179	泽宇智能	531	17,894.70	0.00
86	301377	鼎泰高科	770	17,710.00	0.00
87	603173	福斯达	588	17,316.60	0.00
88	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00
89	301030	仕净科技	242	16,722.20	0.00
90	301187	欧圣电气	876	16,179.72	0.00

91	301152	天力锂能	346	15,452.36	0.00
92	301303	真兰仪表	682	15,222.24	0.00
93	688531	日联科技	110	14,956.70	0.00
94	301112	信邦智能	399	14,607.39	0.00
95	301361	众智科技	517	14,574.23	0.00
96	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
97	603190	亚通精工	470	14,382.00	0.00
98	301408	华人健康	836	14,170.20	0.00
99	301338	凯格精机	360	14,004.00	0.00
100	301160	翔楼新材	392	13,778.80	0.00
101	301132	满坤科技	468	13,754.52	0.00
102	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
103	603162	海通发展	774	13,196.70	0.00
104	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
105	603097	江苏华辰	577	13,074.82	0.00
106	301282	金禄电子	434	13,046.04	0.00
107	688562	航天软件	584	13,029.04	0.00
108	301277	新天地	659	12,857.09	0.00
109	301015	百洋医药	462	12,825.12	0.00
110	301199	迈赫股份	402	12,799.68	0.00
111	603051	鹿山新材	272	12,737.76	0.00
112	301399	英特科技	245	12,634.65	0.00
113	301052	果麦文化	252	12,428.64	0.00
114	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
115	301100	风光股份	599	12,375.34	0.00
116	301004	嘉益股份	312	12,105.60	0.00
117	688593	新相微	815	11,890.85	0.00
118	301151	冠龙节能	669	11,821.23	0.00
119	301048	金鹰重工	843	11,776.71	0.00
120	001229	魅视科技	347	11,555.10	0.00
121	603170	宝立食品	542	11,522.92	0.00
122	301180	万祥科技	654	11,464.62	0.00
123	688352	颀中科技	949	11,454.43	0.00
124	001278	一彬科技	473	11,247.94	0.00
125	001319	铭科精技	536	11,234.56	0.00
126	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
127	301115	建科股份	485	11,087.10	0.00
128	301096	百诚医药	180	10,909.80	0.00
129	603130	云中马	480	10,900.80	0.00
130	301190	善水科技	575	10,804.25	0.00
131	001333	光华股份	426	10,705.38	0.00
132	688458	美芯晟	117	10,618.92	0.00
133	301290	东星医疗	330	10,576.50	0.00

134	301313	凡拓数创	247	10,455.51	0.00
135	688523	航天环宇	437	10,422.45	0.00
136	301298	东利机械	634	10,416.62	0.00
137	301138	华研精机	285	10,368.30	0.00
138	301318	维海德	309	10,366.95	0.00
139	301382	蜂助手	314	10,311.76	0.00
140	301135	瑞德智能	376	10,309.92	0.00
141	688234	天岳先进	138	10,203.72	0.00
142	301110	青木股份	202	10,186.86	0.00
143	301108	洁雅股份	280	10,136.00	0.00
144	301125	腾亚精工	327	9,993.12	0.00
145	688334	西高院	615	9,969.15	0.00
146	001366	播恩集团	645	9,945.90	0.00
147	001287	中电港	472	9,921.44	0.00
148	001331	胜通能源	539	9,847.53	0.00
149	301166	优宁维	228	9,790.32	0.00
150	301222	浙江恒威	332	9,777.40	0.00
151	688507	索辰科技	80	9,768.80	0.00
152	301220	亚香股份	285	9,721.35	0.00
153	001300	三柏硕	763	9,690.10	0.00
154	301398	星源卓镁	255	9,562.50	0.00
155	301020	密封科技	421	9,518.81	0.00
156	001268	联合精密	409	9,492.89	0.00
157	688543	国科军工	178	9,442.90	0.00
158	001299	美能能源	576	9,394.56	0.00
159	688728	格科微	592	9,365.44	0.00
160	301231	荣信文化	275	9,251.00	0.00
161	001222	源飞宠物	608	9,199.04	0.00
162	301009	可靠股份	789	9,176.07	0.00
163	301197	工大科雅	380	9,158.00	0.00
164	688433	华曙高科	286	9,009.00	0.00
165	688570	天玛智控	354	8,966.82	0.00
166	603280	南方路机	363	8,922.54	0.00
167	001368	通达创智	351	8,922.42	0.00
168	301357	北方长龙	184	8,903.76	0.00
169	301116	益客食品	577	8,885.80	0.00
170	301045	天禄科技	335	8,870.80	0.00
171	301126	达嘉维康	662	8,870.80	0.00
172	301315	威士顿	173	8,843.76	0.00
173	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
174	001238	浙江正特	374	8,800.22	0.00
175	301386	未来电器	368	8,754.72	0.00
176	603151	邦基科技	535	8,741.90	0.00



177	301163	宏德股份	277	8,739.35	0.00
178	001256	炜冈科技	474	8,721.60	0.00
179	301265	华新环保	750	8,715.00	0.00
180	301355	南王科技	518	8,676.50	0.00
181	603065	宿迁联盛	581	8,656.90	0.00
182	301078	孩子王	756	8,641.08	0.00
183	301322	绿通科技	162	8,624.88	0.00
184	001296	长江材料	403	8,467.03	0.00
185	301259	艾布鲁	628	8,446.60	0.00
186	001231	农心科技	355	8,445.45	0.00
187	301118	恒光股份	315	8,419.95	0.00
188	301359	东南电子	328	8,357.44	0.00
189	301283	聚胶股份	235	8,337.80	0.00
190	301193	家联科技	475	8,326.75	0.00
191	301066	万事利	482	8,309.68	0.00
192	301439	泓淋电力	491	8,297.90	0.00
193	603182	嘉华股份	546	8,255.52	0.00
194	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
195	301316	慧博云通	359	8,203.15	0.00
196	301285	鸿日达	565	8,186.85	0.00
197	301028	东亚机械	733	8,172.95	0.00
198	601061	中信金属	1,072	8,125.76	0.00
199	301161	唯万密封	346	7,996.06	0.00
200	301281	科源制药	317	7,956.70	0.00
201	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
202	300814	中富电路	328	7,901.52	0.00
203	301388	欣灵电气	292	7,840.20	0.00
204	301288	清研环境	452	7,801.52	0.00
205	300994	久祺股份	504	7,781.76	0.00
206	301295	美硕科技	215	7,755.05	0.00
207	301323	新莱福	197	7,753.92	0.00
208	301276	嘉曼服饰	303	7,726.50	0.00
209	301349	信德新材	153	7,671.42	0.00
210	001336	楚环科技	274	7,666.52	0.00
211	301133	金钟股份	286	7,596.16	0.00
212	001234	泰慕士	333	7,592.40	0.00
213	301021	英诺激光	290	7,580.60	0.00
214	603272	联翔股份	443	7,513.28	0.00
215	301111	粤万年青	379	7,420.82	0.00
216	688620	安凯微	592	7,305.28	0.00
217	301026	浩通科技	203	7,251.16	0.00
218	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
219	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00

220	301011	华立科技	296	6,935.28	0.00
221	688429	时创能源	270	6,893.10	0.00
222	301319	唯特偶	115	6,882.75	0.00
223	301233	盛帮股份	158	6,836.66	0.00
224	301262	海看股份	268	6,834.00	0.00
225	688148	芳源股份	554	6,758.80	0.00
226	301182	凯旺科技	294	6,753.18	0.00
227	301198	喜悦智行	443	6,724.74	0.00
228	301300	远翔新材	211	6,667.60	0.00
229	301158	德石股份	383	6,629.73	0.00
230	603150	万朗磁塑	250	6,590.00	0.00
231	301345	涛涛车业	140	6,529.60	0.00
232	603135	中重科技	358	6,404.62	0.00
233	688259	创耀科技	80	6,332.00	0.00
234	301309	万得凯	228	6,279.12	0.00
235	301012	扬电科技	238	6,152.30	0.00
236	300998	宁波方正	201	6,027.99	0.00
237	603005	晶方科技	288	5,817.60	0.00
238	301228	实朴检测	373	5,811.34	0.00
239	301376	致欧科技	255	5,740.05	0.00
240	301098	金埔园林	460	5,543.00	0.00
241	301062	上海艾录	523	5,538.57	0.00
242	301016	雷尔伟	275	5,516.50	0.00
243	301170	锡南科技	153	5,344.29	0.00
244	300774	倍杰特	444	5,168.16	0.00
245	301040	中环海陆	241	4,952.55	0.00
246	301025	读客文化	403	4,924.66	0.00
247	688283	坤恒顺维	73	4,855.96	0.00
248	301068	大地海洋	144	4,839.84	0.00
249	301033	迈普医学	108	4,747.68	0.00
250	301007	德迈仕	303	4,675.29	0.00
251	301032	新柴股份	513	4,591.35	0.00
252	301010	晶雪节能	218	4,423.22	0.00
253	688102	斯瑞新材	360	4,392.00	0.00
254	301049	超越科技	196	4,331.60	0.00
255	601065	江盐集团	350	4,144.00	0.00
256	301053	远信工业	155	3,932.35	0.00
257	300995	奇德新材	191	3,896.40	0.00
258	301036	双乐股份	205	3,839.65	0.00
259	301037	保立佳	212	3,777.84	0.00
260	601133	柏诚股份	308	3,776.08	0.00
261	301027	华蓝集团	286	3,514.94	0.00
262	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00

263	001328	登康口腔	129	3,288.21	0.00
264	300854	中兰环保	203	3,227.70	0.00
265	301046	能辉科技	90	2,943.00	0.00
266	603125	常青科技	115	2,820.95	0.00
267	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
268	002179	中航光电	51	2,312.85	0.00
269	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
270	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
271	301072	中捷精工	81	2,029.05	0.00
272	001266	宏英智能	66	1,917.30	0.00
273	300973	立高食品	22	1,505.24	0.00
274	603070	万控智造	75	1,401.75	0.00
275	603215	比依股份	75	1,345.50	0.00
276	688267	中触媒	63	1,327.41	0.00
277	301069	凯盛新材	39	992.16	0.00
278	301136	招标股份	72	987.84	0.00
279	603122	合富中国	98	803.60	0.00
280	001308	康冠科技	22	604.12	0.00
281	603132	金徽股份	42	476.28	0.00
282	001313	粤海饲料	32	252.80	0.00
283	688173	希荻微	10	228.80	0.00
284	001227	兰州银行	68	194.48	0.00
285	603176	汇通集团	24	153.60	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	600845	宝信软件	10,997,775.80	2.68
2	000858	五粮液	10,616,142.00	2.59
3	000799	酒鬼酒	8,404,006.00	2.05
4	603833	欧派家居	8,013,206.93	1.96
5	688503	聚和材料	7,399,529.09	1.81
6	002371	北方华创	7,127,499.00	1.74
7	688036	传音控股	7,029,320.03	1.72
8	002430	杭氧股份	6,966,476.00	1.70
9	601318	中国平安	6,489,422.00	1.58
10	300314	戴维医疗	6,169,330.00	1.51
11	301155	海力风电	6,072,051.00	1.48
12	688581	安杰思	5,938,838.21	1.45
13	688981	中芯国际	5,837,408.60	1.43
14	603061	金海通	5,571,982.00	1.36
15	600276	恒瑞医药	5,553,606.80	1.36

16	688315	诺禾致源	5,517,547.07	1.35
17	001323	慕思股份	5,440,002.00	1.33
18	688687	凯因科技	5,383,158.78	1.31
19	301367	怡和嘉业	5,357,414.00	1.31
20	688029	南微医学	5,031,506.84	1.23

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	000568	泸州老窖	15,047,392.39	3.67
2	601012	隆基绿能	14,586,325.78	3.56
3	600809	山西汾酒	11,882,322.37	2.90
4	600765	中航重机	11,043,647.00	2.70
5	002557	洽洽食品	10,007,839.00	2.44
6	002011	盾安环境	9,957,456.00	2.43
7	002472	双环传动	8,850,236.65	2.16
8	002304	洋河股份	8,774,387.00	2.14
9	000733	振华科技	8,535,561.70	2.08
10	000858	五粮液	8,044,554.73	1.96
11	600138	中青旅	7,676,541.56	1.87
12	000596	古井贡酒	7,551,394.00	1.84
13	300014	亿纬锂能	7,387,815.16	1.80
14	002311	海大集团	7,280,980.00	1.78
15	000799	酒鬼酒	7,060,341.44	1.72
16	603833	欧派家居	6,702,419.00	1.64
17	600845	宝信软件	6,565,099.20	1.60
18	688599	天合光能	6,493,453.51	1.59
19	002430	杭氧股份	6,426,346.60	1.57
20	603061	金海通	6,318,461.00	1.54

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	352,244,487.54
卖出股票收入（成交）总额	376,987,921.73

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：无。

**7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细**

注：无。

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

注：无。

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

注：无。

**7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

注：无。

**7.10 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

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

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

**7.11.2 本期国债期货投资评价**

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

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

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

**7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库**

本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券备选库。

**7.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	89,800.45
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	85,198.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	174,998.52

**7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

注：无。

**7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

注：无。

**7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

**§ 8 基金份额持有人信息****8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比 例 (%)	持有份额	占总份额比 例 (%)
8,651	14,103.93	-	-	122,013,088.40	100.00

**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	307,839.71	0.2523

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

**8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况**

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	10~50
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、基金投资和研究部门负责人投资、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 (2014 年 1 月 28 日) 基金份额总额	599,677,846.59
本报告期期初基金份额总额	129,705,892.10
本报告期基金总申购份额	2,660,163.37

减：本报告期基金总赎回份额	10,352,967.07
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	122,013,088.40

## § 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 (%)	
东方证券	1	155,760,913.47	21.75	143,500.07	22.13	-
长江证券	1	138,672,064.01	19.36	127,757.95	19.70	-

信达证券	1	113,648,804.83	15.87	93,340.23	14.39	-
光大证券	1	107,935,512.01	15.07	99,438.84	15.34	-
海通证券	1	56,566,813.66	7.90	52,112.25	8.04	-
中信建投证券	1	46,044,679.51	6.43	42,421.03	6.54	-
中信证券	1	42,157,385.35	5.89	38,839.76	5.99	-
国金证券	1	39,744,303.68	5.55	36,618.92	5.65	-
中金公司	1	15,632,585.91	2.18	14,402.70	2.22	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	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(%)
东方证券	-	-	972,953,000.00	43.16	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	525,359.60	100.00	767,212,000.00	34.04	-	-
海通证券	-	-	261,947,000.00	11.62	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	252,059,000.00	11.18	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

## 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	鹏华品牌传承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 01 月 06 日
4	鹏华品牌传承灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 01 月 06 日
5	鹏华品牌传承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
6	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
7	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告	《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 11 日
8	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
9	鹏华品牌传承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基金电子披露网站	2023 年 03 月 30 日
10	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
11	鹏华品牌传承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
12	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
13	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
14	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	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会	2023 年 06 月 03 日

	的风险提示	基金电子披露网站	
15	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
16	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
17	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
18	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）《鹏华品牌传承灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- （二）《鹏华品牌传承灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- （三）《鹏华品牌传承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