

鹏华弘鑫灵活配置混合型证券投资基金 2024 年中期报告

2024 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：2024 年 8 月 29 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 2024 年 08 月 28 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 2024 年 01 月 01 日起至 2024 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	8
2.5 其他相关资料	8
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	9
3.3 其他指标	11
§ 4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	16
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	17
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	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
§ 8	基金份额持有人信息	54
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	55
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	55
§ 9	开放式基金份额变动	55
§ 10	重大事件揭示	55
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	56
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
10.4	基金投资策略的改变	56
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	56
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	56
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	57
10.8	其他重大事件	59
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	61
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	61
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	61
§ 12	备查文件目录	61
12.1	备查文件目录	61
12.2	存放地点	61
12.3	查阅方式	61

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华弘鑫灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	鹏华弘鑫混合	
基金主代码	001453	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 6 月 18 日	
基金管理人	鹏华基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	59,838,761.80 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	鹏华弘鑫混合 A	鹏华弘鑫混合 C
下属分级基金的交 易代码	001453	001454
报告期末下属分级 基金的份额总额	34,809,640.25 份	25,029,121.55 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在科学严谨的资产配置框架下，严选安全边际较高的股票、债券等投资标的，力争实现绝对收益的目标。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金将通过跟踪考量通常的宏观经济变量（包括 GDP 增长率、CPI 走势、M2 的绝对水平和增长率、利率水平与走势等）以及各项国家政策（包括财政、税收、货币、汇率政策等），并结合美林时钟等科学严谨的资产配置模型，动态评估不同资产大类在不同时期的投资价值及其风险收益特征，追求股票、债券和货币等大类资产的灵活配置和稳健的绝对收益目标。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘优质的上市公司，严选其中安全边际较高的个股构建投资组合：自上而下地分析行业的成长前景、行业结构、商业模式、竞争要素等分析把握其投资机会；自下而上地评判企业的产品、核心竞争力、管理层、治理结构等；并结合企业基本面和估值水平进行综合的研判，严选安全边际较高的个股，力争实现组合的绝对收益。</p> <p>（1）自上而下的行业遴选</p> <p>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</p>

	<p>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</p> <p>本基金主要从两方面进行自下而上的个股选择：一方面是竞争力分析，通过对公司竞争策略和核心竞争力的分析，选择具有可持续竞争优势的上市公司或未来具有广阔成长空间的公司。就公司竞争策略，基于行业分析的结果判断策略的有效性、策略的 implementation 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。</p> <p>另一方面是管理层分析，在国内监管体系落后、公司治理结构不完善的基础上，上市公司的命运对管理团队的依赖度大大增加。本基金将着重考察公司的管理层以及管理制度。</p> <p>(3) 综合研判</p> <p>本基金在自上而下和自下而上的基础上，结合估值分析，严选安全边际较高的个股，力争实现组合的绝对收益。通过对估值方法的选择和估值倍数的比较，选择股价相对低估的股票。就估值方法而言，基于行业的特点确定对股价最有影响力的关键估值方法（包括 PE、PEG、PB、PS、EV/EBITDA 等）；就估值倍数而言，通过业内比较、历史比较和增长性分析，确定具有上升基础的股价水平。</p> <p>(4) 存托凭证投资策略</p> <p>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</p> <p>本基金债券投资将采取久期策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、个券选择策略、信用策略、中小企业私募债投资策略等积极投资策略，灵活地调整组合的券种搭配，精选安全边际较高的个券，力争实现组合的绝对收益。</p> <p>(1) 久期策略</p> <p>久期管理是债券投资的重要考量因素，本基金将采用以“目标久期”为中心、自上而下的组合久期管理策略。</p> <p>(2) 收益率曲线策略</p> <p>收益率曲线的形状变化是判断市场整体走向的一个重要依据，本基金将据此调整组合长、中、短期债券的搭配，并进行动态调整。</p> <p>(3) 骑乘策略</p> <p>本基金将采用基于收益率曲线分析对债券组合进行适时调整的骑乘策略，以达到增强组合的持有期收益的目的。</p> <p>(4) 息差策略</p> <p>本基金将采用息差策略，以达到更好地利用杠杆放大债券投资的收益的目的。</p> <p>(5) 个券选择策略</p> <p>本基金将根据单个债券到期收益率相对于市场收益率曲线的偏离程度，结合信用等级、流动性、选择权条款、税赋特点等因素，确定其投资价值，选择定价合理或价值被低估的债券进行投资。</p>
--	---

	<p>(6) 信用策略</p> <p>本基金通过主动承担适度的信用风险来获取信用溢价，根据内、外部信用评级结果，结合对类似债券信用利差的分析以及对未来信用利差走势的判断，选择信用利差被高估、未来信用利差可能下降的信用债进行投资。</p> <p>(7) 中小企业私募债投资策略</p> <p>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>4、股指期货、权证等投资策略</p> <p>本基金可投资股指期货、权证和其他经中国证监会允许的金融衍生产品。</p> <p>本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低申购赎回时现金资产对投资组合的影响及投资组合仓位调整的交易成本，达到稳定投资组合资产净值的目的。</p> <p>基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项，同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。</p> <p>本基金通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型及价值挖掘策略、价差策略、双向权证策略等寻求权证的合理估值水平，追求稳定的当期收益。</p>
业绩比较基准	一年期银行定期存款利率（税后）+3%
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，属于证券投资基金里中高风险、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
	联系电话	0755-81395402
	电子邮箱	xxpl@phfund.com.cn
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	张纳沙	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(2024年1月1日-2024年6月30日)	
	鹏华弘鑫混合 A	鹏华弘鑫混合 C
本期已实现收益	-16,875,129.84	-17,970,088.67
本期利润	-14,783,224.23	-16,960,939.78
加权平均基金份额 本期利润	-0.4800	-0.5675
本期加权平均净 值利润率	-36.36%	-43.13%
本期基金份额净 值增长率	1.23%	1.20%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2024年6月30日)	
期末可供分配利 润	-3,573,833.29	-2,862,449.77
期末可供分配基 金份额利润	-0.1027	-0.1144
期末基金资产净 值	42,179,776.20	29,937,985.96
期末基金份额净 值	1.2117	1.1961

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	32.58%	30.68%

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

鹏华弘鑫混合 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	0.11%	0.92%	0.37%	0.01%	-0.26%	0.91%
过去三个月	-15.03%	1.35%	1.12%	0.01%	-16.15%	1.34%
过去六个月	1.23%	1.84%	2.24%	0.02%	-1.01%	1.82%
过去一年	1.38%	1.28%	4.51%	0.01%	-3.13%	1.27%
过去三年	-1.28%	0.77%	13.51%	0.01%	-14.79%	0.76%
自基金合同生效起至今	32.58%	0.59%	40.84%	0.01%	-8.26%	0.58%

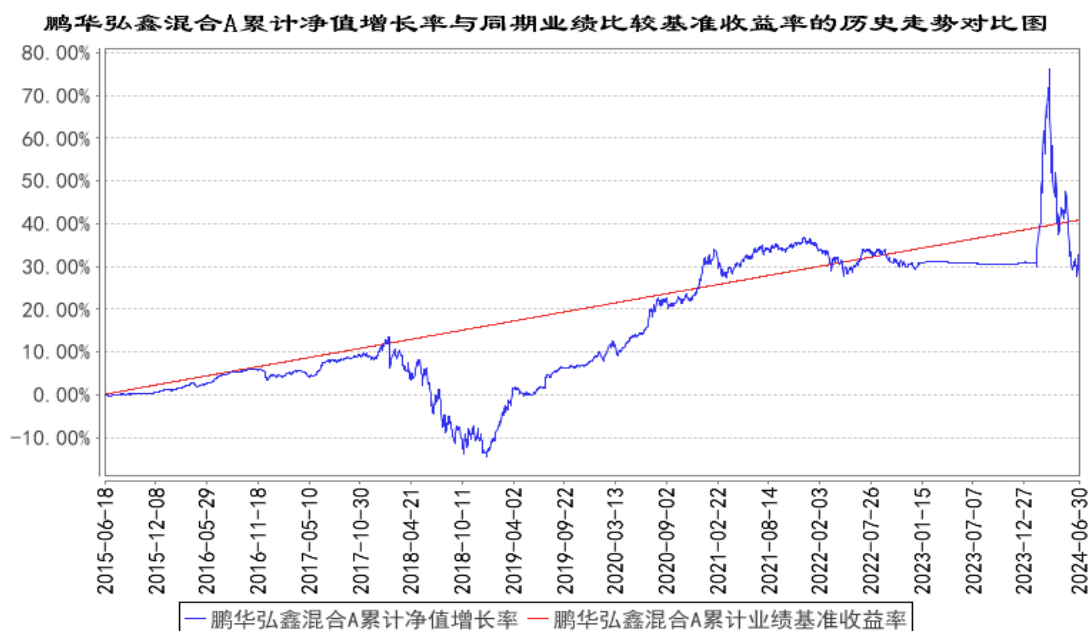
鹏华弘鑫混合 C

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	0.11%	0.92%	0.37%	0.01%	-0.26%	0.91%
过去三个月	-15.04%	1.35%	1.12%	0.01%	-16.16%	1.34%

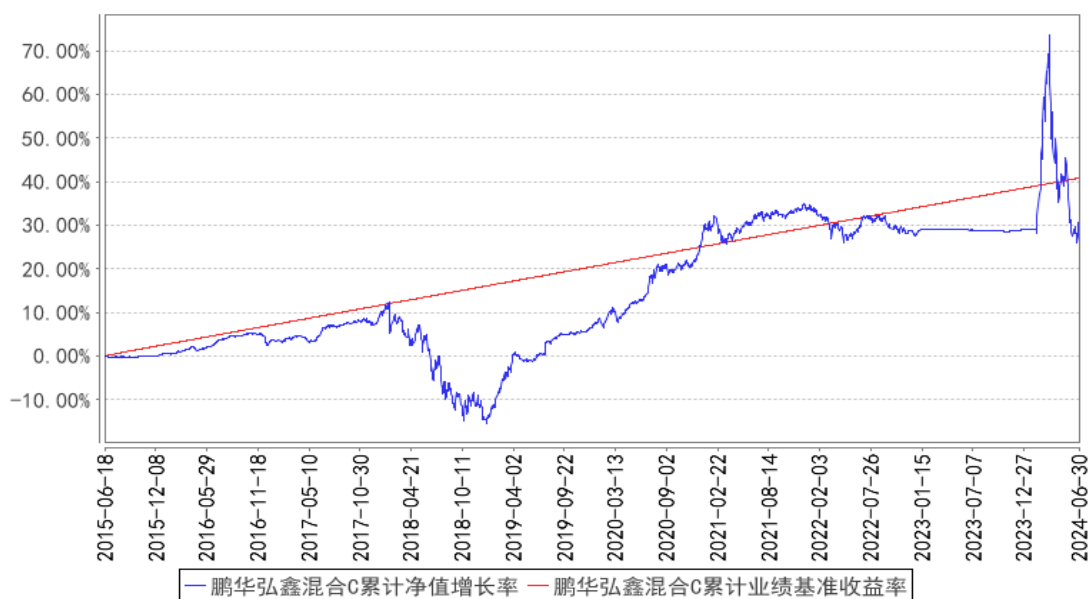
					16.16%	
过去六个月	1.20%	1.84%	2.24%	0.02%	-1.04%	1.82%
过去一年	1.34%	1.28%	4.51%	0.01%	-3.17%	1.27%
过去三年	-1.43%	0.77%	13.51%	0.01%	-	0.76%
					14.94%	
自基金合同生效起至今	30.68%	0.59%	40.84%	0.01%	-	0.58%
					10.16%	

注：业绩比较基准=一年期银行定期存款利率（税后）+3%

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



鹏华弘鑫混合C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 2015 年 06 月 18 日生效。2、截至建仓期结束，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

3.3 其他指标

注：无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

鹏华基金管理有限公司成立于 1998 年 12 月 22 日，业务范围包括基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。截至本报告期末，公司股东由国信证券股份有限公司、意大利欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）、深圳市北融信投资发展有限公司组成，公司性质为中外合资企业，公司注册资本 15,000 万元人民币。截至本报告期末，公司资产管理总规模达到 12,020 亿元（联接基金不折算，不含投顾），公司管理着 324 只公募基金、13 只全国社保投资组合、8 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		
李韵怡	基金经理	2015-07-23	2024-02-08	17 年	李韵怡女士，国籍中国，经济学硕士，17 年证券从业经验。曾任职于广州证券股份

				<p>有限公司投资管理总部，先后担任研究员、交易员和投资经理等职务，从事新股及可转债申购、定增项目等工作；2015 年 6 月加盟鹏华基金管理有限公司，从事投研工作，现担任稳定收益投资部总经理助理/基金经理。2015 年 07 月至 2017 年 01 月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 07 月至 2017 年 01 月担任鹏华弘锐灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015 年 07 月至 2017 年 02 月担任鹏华弘信灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015 年 07 月至 2017 年 03 月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 07 月至 2023 年 09 月担任鹏华弘实灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015 年 07 月至 2023 年 12 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 07 月至 2024 年 02 月担任鹏华弘鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 06 月至 2018 年 07 月担任鹏华兴泽定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 09 月至 2020 年 05 月担任鹏华兴润定期开放灵活配置混合型基金，2016 年 09 月至 2018 年 06 月担任鹏华兴实定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 09 月至 2020 年 05 月担任鹏华兴合定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 09 月至 2023 年 01 月担任鹏华兴安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 2018 年 07 月担任鹏华弘樽灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017 年 01 月至 2024 年 01 月担任鹏华兴惠定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2019 年 06 月至 2022 年 06 月担任鹏华科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2019 年 11 月至 2023 年 12 月担任鹏华金享混合型证券投资基金基金经理，2020 年 04 月至今担任鹏华鑫享稳健混合型证券投资基金基金经理，2022 年 06 月至今担任鹏华创新动力灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金经理，李韵怡女士具备基金从业资</p>
--	--	--	--	---

					格。本报告期内本基金基金经理发生变动，增聘萧嘉倩为本基金基金经理，李韵怡不再担任本基金基金经理。
萧嘉倩	基金经理	2024-02-08	-	13 年	萧嘉倩女士，国籍中国，经济学硕士，13 年证券从业经验。曾任国信证券投资银行项目经理，广发基金金融工程部产品经理，中信证券投资银行部项目经理，南方基金基金经理。2024 年 1 月加盟鹏华基金管理有限公司，现担任稳定收益投资部基金经理。2024 年 02 月至今担任鹏华弘鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2024 年 04 月至今担任鹏华文化传媒娱乐股票型证券投资基金基金经理，2024 年 05 月至今担任鹏华创新动力灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金经理，萧嘉倩女士具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理发生变动，增聘萧嘉倩为本基金基金经理，李韵怡不再担任本基金基金经理。

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

回顾本基金 2024 年上半年操作，正如本基金一季度回顾，年初我们基于对宏观经济和股市复苏的严谨判断下，我们在股市接近 2600 点的时候，加大了权益类资产的比重，并且在一季度获得出色表现，但二季度因为宏观经济的再次触底，使得大盘重新二次探底，由于产品权益类资产比例较高，同时配置的较大弹性标的在上涨过程中及时止盈，因此当大盘回调的时候，基金也迎来较大幅度的回调。对此，我们也在不断思考如何才能更好的提高客户体验，在产品后续运作中，我们会根据宏观经济环境，寻求股票和债券的最优组合，而股票上，我们严格在安全边际较高的股票上，结合自上而下以及自下而上的选股策略。因此二季度，我们提高了债券投资比例，降低了股票仓位，同时在权益类资产投资方向上，选择两类具备较高安全边际的资产：1) 低估值高分红公司；2) 处于景气周期底部、股价和估值均在底部的消费电子领域，包括苹果产业链、PCB、AR、耳机，虽然个股的集中度较高，但是在行业中我们选择较为分散的组合。

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 A 类份额净值增长率为 1.23%，同期业绩比较基准增长率为 2.24%；C 类份额净值增长率为 1.20%，同期业绩比较基准增长率为 2.24%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，我们对大盘和宏观经济保持谨慎乐观态度，谨慎是因为经济触底后，在政府出台相关有力政策背景下，经济仍需要运行一定时间方能摆脱下行惯性，乐观是目前 A 股大部分公司无论是估值、PB、或估价均处于历史极低分位数水平，从中长期投资角度，已经进入击球区，但是为了提高客户体验，我们仍然会保持较为谨慎的态度，在权益和债券中寻求更合理的配置比例，在权益类资产上选择安全边际更高的产品。

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、风控管理部、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，鹏华弘鑫混合 A 期末可供分配利润为-3,573,833.29 元，期末基金份额净值 1.2117 元，不符合利润分配条件；鹏华弘鑫混合 C 期末可供分配利润为-2,862,449.77 元，期末基金份额净值 1.1961 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。

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

本报告期内，本基金存在连续六十个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情形，本基金管理人及相关机构正在就可行的解决方案进行探讨论证。

§ 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 2024 年 01 月 01 日至 2024 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：鹏华弘鑫灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	6,189,519.70	6,740,689.82
结算备付金		1,079,132.91	413,822.46
存出保证金		172,201.80	18.17
交易性金融资产	6.4.7.2	70,687,719.73	32,096.00
其中：股票投资		37,920,033.10	32,096.00
基金投资		-	-
债券投资		32,767,686.63	-
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	-	4,699,546.74
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		2,179,978.99	1,813.04
应收股利		-	-
应收申购款		50,345.85	109.84
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		80,358,898.98	11,888,096.07
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 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		2,149,083.65	10,045.64
应付赎回款		4,821,418.76	743.49
应付管理人报酬		40,164.91	6,063.76
应付托管费		6,694.17	1,010.63
应付销售服务费		1,517.88	202.37
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	1,222,257.45	31,029.36
负债合计		8,241,136.82	49,095.25
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	59,838,761.80	9,941,047.71
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	12,279,000.36	1,897,953.11
净资产合计		72,117,762.16	11,839,000.82
负债和净资产总计		80,358,898.98	11,888,096.07

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额为 59,838,761.80 份，其中鹏华弘鑫混合 A 基金份额总额为 34,809,640.25 份，基金份额净值 1.2117 元；鹏华弘鑫混合 C 基金份额总额为 25,029,121.55 份，基金份额净值 1.1961 元。

6.2 利润表

会计主体：鹏华弘鑫灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-31,419,318.54	397,814.10
1. 利息收入		84,321.08	119,863.15
其中：存款利息收入	6.4.7.13	73,891.62	60,825.67
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		10,429.46	59,037.48
其他利息收入		-	-

2. 投资收益（损失以“-”填列）		-35,296,907.91	239,844.45
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-36,088,911.68	250,394.31
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	5,850.97	-8,948.10
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	786,152.80	-1,601.76
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	3,101,054.50	33,392.70
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	692,213.79	4,713.80
减：二、营业总支出		324,845.47	151,409.15
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	234,974.61	65,353.04
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	39,162.45	10,892.09
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	9,632.28	2,468.68
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		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	41,076.13	72,695.34
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-31,744,164.01	246,404.95
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-31,744,164.01	246,404.95
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-31,744,164.01	246,404.95

6.3 净资产变动表

会计主体：鹏华弘鑫灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	9,941,047.71	-	1,897,953.11	11,839,000.82
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	9,941,047.71	-	1,897,953.11	11,839,000.82
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	49,897,714.09	-	10,381,047.25	60,278,761.34
(一)、综合收益总额	-	-	-31,744,164.01	-31,744,164.01
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	49,897,714.09	-	42,125,211.26	92,022,925.35
其中：1. 基金申购款	174,659,618.09	-	80,527,932.35	255,187,550.44
2. 基金赎回款	- 124,761,904.00	-	-38,402,721.09	-163,164,625.09
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	59,838,761.80	-	12,279,000.36	72,117,762.16
项目	上年度可比期间 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	28,382,270.81	-	5,227,687.10	33,609,957.91

加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	28,382,270.81	-	5,227,687.10	33,609,957.91
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-16,781,731.18	-	-3,031,919.10	-19,813,650.28
(一)、综合收益总额	-	-	246,404.95	246,404.95
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-16,781,731.18	-	-3,278,324.05	-20,060,055.23
其中：1. 基金申购款	15,276,988.53	-	2,787,929.42	18,064,917.95
2. 基金赎回款	-32,058,719.71	-	-6,066,253.47	-38,124,973.18
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	11,600,539.63	-	2,195,768.00	13,796,307.63

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

聂连杰

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

鹏华弘鑫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[2015]1029号《关于准予鹏华弘鑫灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》准予,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《鹏华弘鑫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人民币 293,200,223.54 元,业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(2015)第 729 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华弘鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 6 月 18 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 293,242,263.81 份基金份额,其中认购资金利息折合 42,040.27 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》、《鹏华弘鑫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。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定,开放式基金在基金合同生效后,连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 万元情形的,基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案,如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等,并召开基金份额持有人大会进行表决。于 2024 年上半年内,本基金出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5,000 万元的情形,本基金的基金管理人已向中国证监会报告并在评估后续处理方案,故本财务报表仍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 2024 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 2024 年 06 月 30 日的财务状况以及 2024 年上半年的经营成果和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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	6,189,519.70
等于：本金	6,188,129.54
加：应计利息	1,390.16
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	6,189,519.70

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	34,846,788.60	-	37,920,033.10	3,073,244.50
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券 交易所市	12,421,046.00	155,465.26	12,583,385.26	6,874.00

	场				
	银行间市场	20,076,840.00	86,301.37	20,184,301.37	21,160.00
	合计	32,497,886.00	241,766.63	32,767,686.63	28,034.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		67,344,674.60	241,766.63	70,687,719.73	3,101,278.50

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 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	682.14
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,206,159.91
其中：交易所市场	1,205,389.91
银行间市场	770.00
应付利息	-
预提费用	15,415.40
合计	1,222,257.45

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

鹏华弘鑫混合 A

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,943,940.18	5,943,940.18
本期申购	75,393,084.97	75,393,084.97
本期赎回（以“-”号填列）	-46,527,384.90	-46,527,384.90
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	34,809,640.25	34,809,640.25

鹏华弘鑫混合 C

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
----	----------------------------

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,997,107.53	3,997,107.53
本期申购	99,266,533.12	99,266,533.12
本期赎回（以“-”号填列）	-78,234,519.10	-78,234,519.10
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	25,029,121.55	25,029,121.55

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

鹏华弘鑫混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	875,916.35	295,070.24	1,170,986.59
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	875,916.35	295,070.24	1,170,986.59
本期利润	-16,875,129.84	2,091,905.61	-14,783,224.23
本期基金份额交易产生的变动数	12,425,380.20	8,556,993.39	20,982,373.59
其中：基金申购款	15,549,405.76	20,084,512.20	35,633,917.96
基金赎回款	-3,124,025.56	-11,527,518.81	-14,651,544.37
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,573,833.29	10,943,969.24	7,370,135.95

鹏华弘鑫混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	530,681.38	196,285.14	726,966.52
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	530,681.38	196,285.14	726,966.52
本期利润	-17,970,088.67	1,009,148.89	-16,960,939.78
本期基金份额交易产生的变动数	14,576,957.52	6,565,880.15	21,142,837.67
其中：基金申购款	18,582,896.63	26,311,117.76	44,894,014.39
基金赎回款	-4,005,939.11	-19,745,237.61	-23,751,176.72
本期已分配利润	-	-	-

本期末	-2,862,449.77	7,771,314.18	4,908,864.41
-----	---------------	--------------	--------------

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
活期存款利息收入	63,343.79	
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	10,067.97	
其他	479.86	
合计	73,891.62	

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	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入	-36,088,911.68	
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	-36,088,911.68	

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	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
卖出股票成交总额	993,313,125.70	
减：卖出股票成本总额	1,026,895,051.36	
减：交易费用	2,506,986.02	
买卖股票差价收入	-36,088,911.68	

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
----	----

	2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	60,620.97
债券投资收益——买卖债券(债转股及债券到期兑付)差价收入	-54,770.00
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	5,850.97

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 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券(债转股及债券到期兑付)成交总额	24,211,305.50
减：卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	24,202,800.00
减：应计利息总额	62,505.50
减：交易费用	770.00
买卖债券差价收入	-54,770.00

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
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	786,152.80
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	786,152.80

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	3,101,054.50
股票投资	3,073,020.50
债券投资	28,034.00
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	3,101,054.50

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	666,634.93
基金转换费收入	25,578.86
合计	692,213.79

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	15,415.40
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行汇划费用	7,060.73
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	41,076.13

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 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	234,974.61	65,353.04
其中：应支付销售机构的客户维护费	92,869.93	22,337.08
应支付基金管理人的净管理费	142,104.68	43,015.96

注：1、支付基金管理人鹏华基金公司的管理人报酬年费率为 0.60%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×0.60%÷当年天数。

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	39,162.45	10,892.09

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 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鹏华弘鑫混合 A	鹏华弘鑫混合 C	合计
国信证券	-	2.66	2.66
鹏华基金公司	-	104.70	104.70
中国农业银行	-	287.85	287.85
合计	-	395.21	395.21
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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		
	鹏华弘鑫混合 A	鹏华弘鑫混合 C	合计
中国农业银行	-	225.72	225.72
鹏华基金公司	-	241.81	241.81
合计	-	467.53	467.53

注：鹏华弘鑫混合 A 基金份额不支付销售服务费；支付基金销售机构的鹏华弘鑫混合 C 基金份额的销售服务费年费率为 0.05%，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×0.05%÷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 2024年1月1日至2024年6月 30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	6,189,519.70	63,343.79	8,260,340.78

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

注：无。

6.4.12 期末（2024年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证）、债券（含国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券、中小企业私募债等）、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国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 2024 年 06 月 30 日，本基金未持有信用类债券（2023 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、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。

此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2024 年 06 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上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。

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

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

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值

计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	6,189,519.70	-	-	-	6,189,519.70
结算备付金	1,079,132.91	-	-	-	1,079,132.91
存出保证金	172,201.80	-	-	-	172,201.80
交易性金融资产	20,184,301.37	12,583,385.26	-	37,920,033.10	70,687,719.73
应收申购款	-	-	-	50,345.85	50,345.85
应收清算款	-	-	-	2,179,978.99	2,179,978.99
资产总计	27,625,155.78	12,583,385.26	-	40,150,357.94	80,358,898.98
负债					
应付赎回款	-	-	-	4,821,418.76	4,821,418.76
应付管理人报酬	-	-	-	40,164.91	40,164.91
应付托管费	-	-	-	6,694.17	6,694.17
应付清算款	-	-	-	2,149,083.65	2,149,083.65
应付销售服务费	-	-	-	1,517.88	1,517.88
其他负债	-	-	-	1,222,257.45	1,222,257.45
负债总计	-	-	-	8,241,136.82	8,241,136.82
利率敏感度缺口	27,625,155.78	12,583,385.26	-	31,909,221.12	72,117,762.16
上年度末 2023年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

资产				
货币资金	6,740,689.82	-	-	6,740,689.82
结算备付金	413,822.46	-	-	413,822.46
存出保证金	18.17	-	-	18.17
交易性金融资产	-	-	32,096.00	32,096.00
买入返售金融资产	4,699,546.74	-	-	4,699,546.74
应收申购款	-	-	109.84	109.84
应收清算款	-	-	1,813.04	1,813.04
资产总计	11,854,077.19	-	34,018.88	11,888,096.07
负债				
应付赎回款	-	-	743.49	743.49
应付管理人报酬	-	-	6,063.76	6,063.76
应付托管费	-	-	1,010.63	1,010.63
应付清算款	-	-	10,045.64	10,045.64
应付销售服务费	-	-	202.37	202.37
其他负债	-	-	31,029.36	31,029.36
负债总计	-	-	49,095.25	49,095.25
利率敏感度缺口	11,854,077.19	-	-15,076.37	11,839,000.82

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有债券资产的利率风险状况测算的理论变动值对基金资产净值的影响金额。		
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。		
	此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	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（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	85,563.18	0.00
	市场利率上升 25 个基点	-85,129.06	0.00

注：于 2023 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资和资产支持证券公允价值占基金资产净值的比例为 0.00%，因此当利率发生合理、可能的变动时，对于本基金资产净值无重大影响。

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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR（Value at Risk）指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023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	37,920,033.10	52.58	32,096.00	0.27
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	37,920,033.10	52.58	32,096.00	0.27

注：债券投资为可转债、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。		
分析	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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	比较基准上涨5%资产净值变动	1,340,669.20	-
	比较基准下降5%资产净值变动	-1,340,669.20	-

注：于2023年12月31日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金净资产的比例为0.27%，因此除市场利率和外汇利率以外的市场价格因素的变动对本基金资产净值无重大影响。

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 2024年6月30日
第一层次	37,920,033.10
第二层次	32,767,686.63
第三层次	-
合计	70,687,719.73

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	37,920,033.10	47.19

	其中：股票	37,920,033.10	47.19
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	32,767,686.63	40.78
	其中：债券	32,767,686.63	40.78
	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	7,268,652.61	9.05
8	其他各项资产	2,402,526.64	2.99
9	合计	80,358,898.98	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	-	-
C	制造业	33,856,879.10	46.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	3,138,654.00	4.35
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	924,500.00	1.28
J	金融业	-	-
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	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	37,920,033.10	52.58

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	002600	领益智造	1,086,800	7,738,016.00	10.73
2	002351	漫步者	474,700	6,242,305.00	8.66
3	002384	东山精密	294,100	6,087,870.00	8.44
4	688183	生益电子	183,695	3,560,009.10	4.94
5	300951	博硕科技	104,700	3,261,405.00	4.52
6	002475	立讯精密	72,300	2,842,113.00	3.94
7	600377	宁沪高速	124,700	1,571,220.00	2.18
8	600012	皖通高速	112,200	1,567,434.00	2.17
9	300476	胜宏科技	44,500	1,435,570.00	1.99
10	002045	国光电器	103,200	1,406,616.00	1.95
11	300433	蓝思科技	70,300	1,282,975.00	1.78
12	600941	中国移动	8,600	924,500.00	1.28

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	600661	昂立教育	37,713,621.99	318.55
2	300280	紫天科技	32,583,573.00	275.22
3	603108	润达医疗	25,716,781.21	217.22
4	001330	博纳影业	22,587,647.37	190.79
5	601900	南方传媒	20,756,907.00	175.33
6	002599	盛通股份	19,563,037.00	165.24
7	300559	佳发教育	17,495,350.66	147.78
8	603890	春秋电子	16,224,358.52	137.04
9	300291	百纳千成	16,144,595.00	136.37
10	601168	西部矿业	15,840,354.14	133.80
11	300033	同花顺	14,527,159.00	122.71
12	688095	福昕软件	14,511,529.07	122.57
13	000156	华数传媒	14,100,597.00	119.10
14	301025	读客文化	13,750,681.24	116.15
15	002532	天山铝业	13,353,531.00	112.79
16	300133	华策影视	13,115,509.86	110.78
17	600301	华锡有色	12,498,770.00	105.57
18	000628	高新发展	12,362,336.36	104.42

19	000960	锡业股份	12,194,614.79	103.00
20	300192	科德教育	11,509,228.00	97.21
21	600229	城市传媒	11,446,596.42	96.69
22	603721	中广天择	11,432,133.00	96.56
23	688629	华丰科技	11,308,704.98	95.52
24	300737	科顺股份	10,994,797.00	92.87
25	603993	洛阳钼业	10,690,391.44	90.30
26	300788	中信出版	10,403,117.00	87.87
27	301110	青木股份	9,955,388.48	84.09
28	002378	章源钨业	9,886,265.00	83.51
29	300494	盛天网络	9,871,136.00	83.38
30	300251	光线传媒	9,748,490.00	82.34
31	603737	三棵树	9,744,733.40	82.31
32	600547	山东黄金	8,784,749.00	74.20
33	000657	中钨高新	8,751,063.10	73.92
34	000807	云铝股份	8,746,211.00	73.88
35	000892	欢瑞世纪	8,729,304.00	73.73
36	600988	赤峰黄金	8,716,194.00	73.62
37	600383	金地集团	8,702,685.00	73.51
38	000630	铜陵有色	8,202,489.00	69.28
39	000603	盛达资源	8,105,495.00	68.46
40	603619	中曼石油	7,943,813.42	67.10
41	002351	漫步者	7,758,972.00	65.54
42	300735	光弘科技	7,634,031.30	64.48
43	688668	鼎通科技	7,553,310.98	63.80
44	600765	中航重机	7,405,682.77	62.55
45	603833	欧派家居	6,950,753.00	58.71
46	002558	巨人网络	6,833,687.00	57.72
47	000933	神火股份	6,771,944.49	57.20
48	603979	金诚信	6,670,856.08	56.35
49	000975	银泰黄金	6,604,807.00	55.79
50	688328	深科达	6,572,286.27	55.51
51	000426	兴业银锡	6,548,893.00	55.32
52	300394	天孚通信	6,354,142.39	53.67
53	002605	姚记科技	6,123,154.00	51.72
54	300709	精研科技	6,041,856.00	51.03
55	002600	领益智造	5,986,149.00	50.56
56	300182	捷成股份	5,940,680.00	50.18
57	300476	胜宏科技	5,907,426.00	49.90
58	002273	水晶光电	5,804,124.00	49.03
59	300951	博硕科技	5,796,504.40	48.96
60	603516	淳中科技	5,788,085.15	48.89
61	002384	东山精密	5,726,720.00	48.37

62	601858	中国科传	5,704,064.00	48.18
63	000526	学大教育	5,696,130.00	48.11
64	002572	索菲亚	5,636,227.00	47.61
65	603533	掌阅科技	5,522,376.60	46.65
66	688025	杰普特	5,517,425.65	46.60
67	688599	天合光能	5,488,234.72	46.36
68	600153	建发股份	5,479,291.00	46.28
69	301383	天键股份	5,446,727.00	46.01
70	601600	中国铝业	5,381,626.00	45.46
71	002918	蒙娜丽莎	5,368,324.00	45.34
72	601155	新城控股	5,356,125.00	45.24
73	002984	森麒麟	5,324,803.80	44.98
74	603799	华友钴业	5,233,541.84	44.21
75	605289	罗曼股份	5,213,063.00	44.03
76	000002	万科 A	5,148,786.00	43.49
77	603327	福蓉科技	5,132,590.36	43.35
78	002791	坚朗五金	5,120,873.00	43.25
79	300315	掌趣科技	5,099,449.00	43.07
80	603816	顾家家居	5,012,569.00	42.34
81	603208	江山欧派	5,002,183.18	42.25
82	300634	彩讯股份	4,996,114.00	42.20
83	301567	贝隆精密	4,994,387.00	42.19
84	688183	生益电子	4,971,653.23	41.99
85	688111	金山办公	4,944,335.64	41.76
86	603486	科沃斯	4,916,345.00	41.53
87	603661	恒林股份	4,877,891.00	41.20
88	600993	马应龙	4,754,793.00	40.16
89	002849	威星智能	4,738,085.25	40.02
90	002189	中光学	4,703,160.82	39.73
91	002035	华帝股份	4,396,871.00	37.14
92	603129	春风动力	4,386,188.00	37.05
93	601999	出版传媒	3,992,753.00	33.73
94	600012	皖通高速	3,941,247.00	33.29
95	600377	宁沪高速	3,941,092.00	33.29
96	601138	工业富联	3,898,568.00	32.93
97	002668	TCL 智家	3,850,879.00	32.53
98	600636	国新文化	3,785,840.00	31.98
99	002601	龙佰集团	3,772,665.00	31.87
100	301052	果麦文化	3,770,493.91	31.85
101	002292	奥飞娱乐	3,758,862.00	31.75
102	002043	兔宝宝	3,748,872.00	31.67
103	300570	太辰光	3,669,798.00	31.00
104	603558	健盛集团	3,620,666.00	30.58

105	002943	宇晶股份	3,565,587.00	30.12
106	688676	金盘科技	3,530,519.81	29.82
107	301185	鸥玛软件	3,438,903.00	29.05
108	601069	西部黄金	3,433,839.99	29.00
109	600754	锦江酒店	3,332,160.00	28.15
110	301073	君亭酒店	3,331,652.00	28.14
111	688308	欧科亿	3,325,015.79	28.09
112	300654	世纪天鸿	3,294,920.00	27.83
113	605319	无锡振华	3,245,472.00	27.41
114	301191	菲菱科思	3,064,448.00	25.88
115	688696	极米科技	2,952,883.33	24.94
116	000917	电广传媒	2,834,978.00	23.95
117	603518	锦泓集团	2,814,806.00	23.78
118	000893	亚钾国际	2,712,336.00	22.91
119	601949	中国出版	2,671,147.00	22.56
120	002475	立讯精密	2,667,615.00	22.53
121	601801	皖新传媒	2,661,154.00	22.48
122	601058	赛轮轮胎	2,613,949.88	22.08
123	688223	晶科能源	2,524,284.53	21.32
124	300556	丝路视觉	2,516,760.56	21.26
125	688488	艾迪药业	2,471,204.37	20.87
126	300364	中文在线	2,463,442.00	20.81
127	002343	慈文传媒	2,461,729.00	20.79
128	300308	中际旭创	2,435,538.00	20.57
129	601006	大秦铁路	2,404,545.00	20.31
130	600188	兖矿能源	2,402,873.00	20.30
131	601000	唐山港	2,402,273.00	20.29
132	600011	华能国际	2,401,650.00	20.29
133	600027	华电国际	2,399,905.00	20.27
134	000977	浪潮信息	2,398,521.00	20.26
135	600986	浙文互联	2,286,914.00	19.32
136	603378	亚士创能	2,249,994.00	19.00
137	300413	芒果超媒	2,236,204.00	18.89
138	300715	凯伦股份	2,229,960.00	18.84
139	300662	科锐国际	2,222,138.00	18.77
140	600258	首旅酒店	2,219,938.00	18.75
141	300577	开润股份	2,211,134.00	18.68
142	301004	嘉益股份	2,194,306.00	18.53
143	002463	沪电股份	2,157,913.00	18.23
144	002913	奥士康	2,078,788.00	17.56
145	603556	海兴电力	2,077,704.00	17.55
146	300433	蓝思科技	2,060,356.00	17.40
147	688331	荣昌生物	2,031,424.00	17.16

148	301018	申菱环境	2,017,602.00	17.04
149	603660	苏州科达	1,889,357.00	15.96
150	002843	泰嘉股份	1,882,539.50	15.90
151	603186	华正新材	1,881,480.00	15.89
152	300338	*ST 开元	1,854,945.00	15.67
153	600312	平高电气	1,792,836.00	15.14
154	600875	东方电气	1,790,986.00	15.13
155	300027	华谊兄弟	1,643,637.00	13.88
156	601225	陕西煤业	1,600,743.00	13.52
157	603496	恒为科技	1,597,548.00	13.49
158	002241	歌尔股份	1,579,411.00	13.34
159	601857	中国石油	1,565,550.00	13.22
160	600028	中国石化	1,565,256.00	13.22
161	600941	中国移动	1,556,472.00	13.15
162	600938	中国海油	1,495,364.00	12.63
163	601567	三星医疗	1,475,910.00	12.47
164	300395	菲利华	1,474,087.00	12.45
165	688506	百利天恒-U	1,463,420.70	12.36
166	002045	国光电器	1,412,180.00	11.93
167	688228	开普云	1,360,947.13	11.50
168	688208	道通科技	1,358,561.73	11.48
169	603067	振华股份	1,355,039.00	11.45
170	603408	建霖家居	1,342,504.00	11.34
171	002422	科伦药业	1,327,763.20	11.22
172	688235	百济神州-U	1,290,240.16	10.90
173	603103	横店影视	1,257,989.00	10.63
174	601595	上海电影	1,252,279.00	10.58
175	002659	凯文教育	1,250,003.00	10.56
176	002436	兴森科技	1,234,010.00	10.42
177	688169	石头科技	1,097,250.80	9.27
178	300229	拓尔思	1,054,372.00	8.91
179	300926	博俊科技	807,486.00	6.82
180	603920	世运电路	761,214.00	6.43
181	603228	景旺电子	761,020.00	6.43
182	002837	英维克	759,000.00	6.41
183	603267	鸿远电子	735,656.00	6.21
184	601928	凤凰传媒	702,009.00	5.93
185	603019	中科曙光	680,803.00	5.75
186	603668	天马科技	570,501.00	4.82
187	688192	迪哲医药-U	528,825.95	4.47
188	300136	信维通信	458,140.00	3.87
189	300122	智飞生物	456,475.56	3.86
190	688503	聚和材料	380,450.31	3.21

191	002315	焦点科技	292,107.00	2.47
192	300258	精锻科技	276,751.00	2.34
193	301030	仕净科技	254,187.00	2.15
194	603083	剑桥科技	246,065.00	2.08

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	600661	昂立教育	38,193,738.13	322.61
2	300280	紫天科技	29,820,527.00	251.88
3	603108	润达医疗	24,815,776.88	209.61
4	001330	博纳影业	21,828,257.66	184.38
5	601900	南方传媒	19,806,781.00	167.30
6	002599	盛通股份	19,152,031.00	161.77
7	603890	春秋电子	15,676,695.00	132.42
8	601168	西部矿业	15,545,255.00	131.31
9	300559	佳发教育	15,399,332.60	130.07
10	300291	百纳千成	14,250,333.00	120.37
11	002532	天山铝业	13,764,113.00	116.26
12	300033	同花顺	13,407,177.00	113.25
13	688095	福昕软件	13,151,442.67	111.09
14	301025	读客文化	12,424,239.40	104.94
15	000628	高新发展	12,365,711.00	104.45
16	300133	华策影视	12,273,245.00	103.67
17	000960	锡业股份	12,258,645.00	103.54
18	000156	华数传媒	12,234,332.00	103.34
19	600301	华锡有色	12,098,901.30	102.20
20	300192	科德教育	11,257,528.96	95.09
21	603993	洛阳钼业	10,803,446.00	91.25
22	600229	城市传媒	10,355,633.00	87.47
23	603737	三棵树	9,979,509.40	84.29
24	301110	青木股份	9,972,693.00	84.24
25	603721	中广天择	9,776,531.00	82.58
26	300251	光线传媒	9,766,334.00	82.49
27	002378	章源钨业	9,503,414.70	80.27
28	688629	华丰科技	9,378,279.03	79.22
29	600988	赤峰黄金	9,254,343.00	78.17
30	300737	科顺股份	9,204,559.40	77.75
31	300788	中信出版	9,091,596.00	76.79
32	000807	云铝股份	9,037,732.00	76.34
33	300494	盛天网络	8,977,397.00	75.83
34	600547	山东黄金	8,749,022.00	73.90

35	000657	中钨高新	8,502,659.50	71.82
36	300735	光弘科技	8,481,894.00	71.64
37	000603	盛达资源	8,249,163.00	69.68
38	000892	欢瑞世纪	8,190,740.00	69.18
39	000630	铜陵有色	8,184,459.00	69.13
40	603619	中曼石油	7,835,825.00	66.19
41	600383	金地集团	7,352,075.00	62.10
42	600765	中航重机	7,244,464.00	61.19
43	603833	欧派家居	7,242,000.00	61.17
44	000933	神火股份	6,910,081.06	58.37
45	002558	巨人网络	6,835,385.00	57.74
46	000975	银泰黄金	6,832,632.00	57.71
47	688668	鼎通科技	6,558,470.27	55.40
48	300709	精研科技	6,524,674.06	55.11
49	000426	兴业银锡	6,516,507.00	55.04
50	603979	金诚信	6,490,616.00	54.82
51	688328	深科达	6,362,623.51	53.74
52	603516	淳中科技	6,323,088.80	53.41
53	002605	姚记科技	6,127,521.00	51.76
54	603533	掌阅科技	6,116,044.35	51.66
55	603327	福蓉科技	6,023,499.11	50.88
56	300182	捷成股份	5,992,576.00	50.62
57	002273	水晶光电	5,918,824.00	49.99
58	601858	中国科传	5,790,554.00	48.91
59	000526	学大教育	5,665,919.00	47.86
60	300394	天孚通信	5,545,611.40	46.84
61	688025	杰普特	5,510,555.65	46.55
62	002572	索菲亚	5,489,520.00	46.37
63	605289	罗曼股份	5,405,898.00	45.66
64	301383	天键股份	5,331,983.00	45.04
65	603816	顾家家居	5,329,610.19	45.02
66	002984	森麒麟	5,266,871.60	44.49
67	688599	天合光能	5,250,327.11	44.35
68	002849	威星智能	5,140,542.60	43.42
69	601600	中国铝业	5,115,832.00	43.21
70	300315	掌趣科技	5,109,838.00	43.16
71	603661	恒林股份	5,038,961.00	42.56
72	600153	建发股份	4,996,976.00	42.21
73	301567	贝隆精密	4,976,863.00	42.04
74	603799	华友钴业	4,960,704.00	41.90
75	300634	彩讯股份	4,951,239.00	41.82
76	601155	新城控股	4,938,177.00	41.71
77	603208	江山欧派	4,938,175.00	41.71

78	002918	蒙娜丽莎	4,839,433.00	40.88
79	603486	科沃斯	4,823,229.00	40.74
80	002189	中光学	4,747,031.00	40.10
81	600993	马应龙	4,709,682.00	39.78
82	002791	坚朗五金	4,693,490.00	39.64
83	300476	胜宏科技	4,684,716.81	39.57
84	000002	万科 A	4,415,666.00	37.30
85	002035	华帝股份	4,261,054.00	35.99
86	688111	金山办公	4,221,614.27	35.66
87	603129	春风动力	4,031,674.00	34.05
88	002043	兔宝宝	4,001,063.00	33.80
89	601999	出版传媒	3,963,866.00	33.48
90	601138	工业富联	3,909,575.00	33.02
91	301052	果麦文化	3,876,566.00	32.74
92	002601	龙佰集团	3,734,540.00	31.54
93	600636	国新文化	3,729,918.00	31.51
94	002292	奥飞娱乐	3,718,334.00	31.41
95	002943	宇晶股份	3,562,895.20	30.09
96	300570	太辰光	3,560,570.00	30.07
97	603558	健盛集团	3,516,260.00	29.70
98	301185	鸥玛软件	3,385,022.00	28.59
99	002668	TCL 智家	3,383,534.00	28.58
100	688676	金盘科技	3,368,437.10	28.45
101	600754	锦江酒店	3,274,104.00	27.66
102	301073	君亭酒店	3,186,234.00	26.91
103	301191	菲菱科思	3,084,881.00	26.06
104	601069	西部黄金	3,071,741.00	25.95
105	688308	欧科亿	3,062,466.28	25.87
106	688696	极米科技	3,046,262.83	25.73
107	300654	世纪天鸿	3,022,800.00	25.53
108	605319	无锡振华	2,967,407.00	25.06
109	000917	电广传媒	2,857,192.00	24.13
110	603518	锦泓集团	2,834,733.00	23.94
111	601949	中国出版	2,796,555.00	23.62
112	300308	中际旭创	2,628,365.00	22.20
113	300556	丝路视觉	2,620,506.00	22.13
114	300951	博硕科技	2,612,510.00	22.07
115	601058	赛轮轮胎	2,572,350.00	21.73
116	601801	皖新传媒	2,538,221.00	21.44
117	688223	晶科能源	2,528,004.63	21.35
118	600377	宁沪高速	2,451,497.00	20.71
119	601000	唐山港	2,422,128.00	20.46
120	002343	慈文传媒	2,405,463.00	20.32

121	000893	亚钾国际	2,399,232.00	20.27
122	601006	大秦铁路	2,391,093.00	20.20
123	600188	兖矿能源	2,387,483.00	20.17
124	600012	皖通高速	2,381,914.00	20.12
125	600011	华能国际	2,345,030.00	19.81
126	000977	浪潮信息	2,333,618.00	19.71
127	600027	华电国际	2,273,179.00	19.20
128	688488	艾迪药业	2,261,462.94	19.10
129	600258	首旅酒店	2,232,889.00	18.86
130	300662	科锐国际	2,152,699.00	18.18
131	002913	奥士康	2,147,660.00	18.14
132	300413	芒果超媒	2,145,474.00	18.12
133	301004	嘉益股份	2,124,901.00	17.95
134	300364	中文在线	2,111,474.00	17.83
135	301018	申菱环境	2,088,441.00	17.64
136	002463	沪电股份	2,086,862.00	17.63
137	300577	开润股份	2,018,361.00	17.05
138	688331	荣昌生物	2,002,044.05	16.91
139	600986	浙文互联	1,979,272.00	16.72
140	002843	泰嘉股份	1,948,235.00	16.46
141	300715	凯伦股份	1,946,612.00	16.44
142	603378	亚士创能	1,945,133.00	16.43
143	603556	海兴电力	1,926,080.00	16.27
144	603186	华正新材	1,914,258.00	16.17
145	603660	苏州科达	1,845,749.00	15.59
146	688183	生益电子	1,835,929.35	15.51
147	600875	东方电气	1,771,310.00	14.96
148	600312	平高电气	1,768,425.00	14.94
149	300338	*ST 开元	1,741,136.00	14.71
150	603496	恒为科技	1,691,976.00	14.29
151	601225	陕西煤业	1,598,983.00	13.51
152	002351	漫步者	1,566,257.00	13.23
153	600028	中国石化	1,562,174.00	13.20
154	002241	歌尔股份	1,549,455.00	13.09
155	601857	中国石油	1,522,600.00	12.86
156	300027	华谊兄弟	1,501,065.00	12.68
157	688506	百利天恒-U	1,475,213.80	12.46
158	600938	中国海油	1,475,007.00	12.46
159	300395	菲利华	1,466,633.00	12.39
160	601567	三星医疗	1,407,639.00	11.89
161	603408	建霖家居	1,353,651.00	11.43
162	601595	上海电影	1,312,924.50	11.09
163	688228	开普云	1,299,246.00	10.97

164	688208	道通科技	1,297,937.47	10.96
165	002422	科伦药业	1,297,703.00	10.96
166	603067	振华股份	1,281,851.00	10.83
167	688235	百济神州-U	1,275,555.37	10.77
168	603103	横店影视	1,265,516.00	10.69
169	002436	兴森科技	1,228,660.00	10.38
170	002659	凯文教育	1,147,912.00	9.70
171	300229	拓尔思	1,012,491.00	8.55
172	688169	石头科技	990,300.51	8.36
173	300926	博俊科技	840,433.00	7.10
174	002837	英维克	759,230.00	6.41
175	300433	蓝思科技	754,090.00	6.37
176	603920	世运电路	752,862.00	6.36
177	601928	凤凰传媒	720,106.00	6.08
178	600941	中国移动	713,451.00	6.03
179	603228	景旺电子	709,060.00	5.99
180	603267	鸿远电子	700,262.00	5.91
181	603019	中科曙光	699,634.00	5.91
182	603668	天马科技	572,721.00	4.84
183	688192	迪哲医药-U	513,110.85	4.33
184	300136	信维通信	476,957.00	4.03
185	300122	智飞生物	457,600.00	3.87
186	688503	聚和材料	364,807.39	3.08
187	002315	焦点科技	336,914.00	2.85
188	688197	首药控股-U	265,910.47	2.25
189	603083	剑桥科技	258,311.00	2.18
190	301030	仕净科技	254,996.00	2.15
191	300258	精锻科技	251,164.00	2.12
192	002555	三七互娱	246,004.00	2.08

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,061,709,967.96
卖出股票收入（成交）总额	993,313,125.70

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	12,583,385.26	17.45
2	央行票据	-	-

3	金融债券	20,184,301.37	27.99
	其中：政策性金融债	20,184,301.37	27.99
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	32,767,686.63	45.44

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	200405	20 农发 05	200,000	20,184,301.37	27.99
2	019730	23 国债 27	123,000	12,583,385.26	17.45

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

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

深圳市博硕科技股份有限公司在报告编制日前一年内受到深圳市交通运输局的处罚。

以上证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券备选库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	172,201.80
2	应收清算款	2,179,978.99
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	50,345.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,402,526.64

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 (%)
鹏华弘鑫 混合 A	3,845	9,053.22	592,832.41	1.70	34,216,807.84	98.30
鹏华弘鑫 混合 C	5,843	4,283.61	0.00	0.00	25,029,121.55	100.00
合计	9,688	6,176.59	592,832.41	0.99	59,245,929.39	99.01

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	鹏华弘鑫混合 A	99,222.38	0.2850
	鹏华弘鑫混合 C	9,313.00	0.0372
	合计	108,535.38	0.1814

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

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未持有本基金份额。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	鹏华弘鑫混合 A	鹏华弘鑫混合 C
基金合同生效日（2015年6月18日）基金份额总额	242,811,771.63	50,430,492.18
本报告期期初基金份额总额	5,943,940.18	3,997,107.53
本报告期基金总申购份额	75,393,084.97	99,266,533.12
减：本报告期基金总赎回份额	46,527,384.90	78,234,519.10
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	34,809,640.25	25,029,121.55

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人的重大人事变动：

本报告期内，公司原副总经理王宗合先生辞去本公司副总经理职务，经公司第六届董事会第二百零四次会议审议通过，董事会同意王宗合先生不再担任公司副总经理，离任日期为 2024 年 2 月 6 日。

本报告期内，公司原副总经理邢彪先生辞去本公司副总经理职务，经公司第六届董事会第二百一十七次会议审议通过，董事会同意邢彪先生不再担任公司副总经理，离任日期为 2024 年 4 月 11 日。

本报告期内，公司原董事长何如先生不再担任公司董事长。经公司 2024 年第三次临时股东大会和第六届董事会第二百一十八次会议审议通过，股东会同意聘任张纳沙女士担任公司董事，董事会选举张纳沙女士担任公司董事长，任职日期自 2024 年 4 月 12 日起。

本公司已将上述变更事项报中国证券监督管理委员会深圳监管局备案。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

无。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

12321

10.4 基金投资策略的改变

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

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人及相关责任人员
受到稽查或处罚等措施的时间	2024 年 4 月 19 日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会深圳监管局
受到的具体措施类型	责令改正及警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	个别规定未严格执行，个别业务内控管理不完善
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	管理人高度重视，按照法律法规及相关要求积极落实整改工作。截至报告日，上述事项已整改完毕
其他	-

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 (%)	
长江证券	1	528,698,040.55	25.73	487,094.25	25.93	-
东方证券	1	340,086,332.15	16.55	313,322.68	16.68	-
海通证券	1	250,002,314.44	12.17	230,318.94	12.26	-
申万宏源证券	3	180,113,637.99	8.76	162,770.30	8.66	-
银河证券	1	146,523,650.58	7.13	134,993.14	7.19	-
中信建投证券	1	134,566,177.38	6.55	123,975.94	6.60	-
华泰证券	1	113,181,863.96	5.51	104,276.73	5.55	-
国金证券	1	112,777,963.34	5.49	103,902.34	5.53	-
广发证券	1	78,320,415.66	3.81	72,156.82	3.84	-
信达证券	1	59,214,940.39	2.88	42,186.38	2.25	-
国投证券	1	48,429,836.80	2.36	45,102.97	2.40	-
光大证券	1	28,779,140.27	1.40	26,514.54	1.41	-
东北证券	1	22,450,325.15	1.09	21,011.11	1.12	-
中信证券	1	6,202,352.00	0.30	5,714.22	0.30	-
中金公司	1	5,676,103.00	0.28	5,229.63	0.28	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	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；
- (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；
- (4) 合规风控能力较强，内部管理规范、严格，具备健全的内控制度；
- (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) 交易、研究服务能力较强。

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。我公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、合规风控能力和交易、研究水平等后，向券商租用交易单元作为基金交易单元。

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(%)
长江证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	12,421,046.00	100.00	8,339,000.00	18.70	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

国金证 券	-	-	9,050,000.00	20.30	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-
信达证 券	-	-	-	-	-	-
国投证 券	-	-	-	-	-	-
光大证 券	-	-	27,200,000.0 0	61.00	-	-
东北证 券	-	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-
东兴证 券	-	-	-	-	-	-
太平洋 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	2024年01月18日
2	鹏华弘鑫灵活配置混合型证券投资基金 2023 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	2024年01月19日
3	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	2024年01月23日
4	鹏华基金管理有限公司关于暂停北京中期时代基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	《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	2024年02月02日
5	鹏华基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《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	2024年02月08日
6	鹏华弘鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	《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	2024年02月08日
7	鹏华弘鑫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	2024年02月19日
8	鹏华弘鑫灵活配置混合型证券投资	《中国证券报》、基金	2024年02月19日

	基金更新的招募说明书（2024 年第 1 号）	管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	
9	鹏华弘鑫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	2024 年 02 月 19 日
10	鹏华弘鑫灵活配置混合型证券投资基金恢复大额申购、转换转入和定期定额投资业务的公告	《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	2024 年 02 月 22 日
11	鹏华基金管理有限公司关于终止与北京中期时代基金销售有限公司销售合作关系的公告	《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	2024 年 03 月 04 日
12	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与华福证券有限责任公司申购（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	2024 年 03 月 16 日
13	鹏华弘鑫灵活配置混合型证券投资基金 2023 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	2024 年 03 月 28 日
14	鹏华基金管理有限公司关于旗下证券投资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	2024 年 03 月 30 日
15	鹏华基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《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	2024 年 04 月 13 日
16	鹏华基金管理有限公司关于董事长变更的公告	《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	2024 年 04 月 13 日
17	鹏华弘鑫灵活配置混合型证券投资基金 2024 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	2024 年 04 月 19 日
18	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	2024 年 05 月 10 日
19	鹏华基金管理有限公司关于调整个人投资者开立基金账户证件类型类型的公告	《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	2024 年 05 月 16 日
20	鹏华弘鑫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	2024 年 06 月 07 日
21	鹏华弘鑫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	2024 年 06 月 07 日
22	鹏华弘鑫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	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监	2024 年 06 月 07 日

	概要（更新）	会基金电子披露网站	
23	鹏华基金管理有限公司关于调整旗下部分基金单笔最低赎回份额和账户最低份额余额限制的公告	《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	2024 年 06 月 12 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）《鹏华弘鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- （二）《鹏华弘鑫灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- （三）《鹏华弘鑫灵活配置混合型证券投资基金 2024 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

2024 年 8 月 29 日