

鹏华创新动力灵活配置混合型证券投资基  
金(LOF)  
2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 3 月 28 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 03 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

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

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 12 月 31 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	8
2.4 信息披露方式	8
2.5 其他相关资料	9
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>9</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	9
3.2 基金净值表现	10
3.3 其他指标	11
3.4 过去三年基金的利润分配情况	12
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>12</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	15
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	17
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	17
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	18
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	18
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	19
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	19
4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	19
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>19</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	19
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	19
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	19
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>20</b>
6.1 审计报告基本信息	20
6.2 审计报告的基本内容	20
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>21</b>
7.1 资产负债表	21
7.2 利润表	23
7.3 净资产变动表	24
7.4 报表附注	26

<b>§ 8 投资组合报告</b>	<b>65</b>
8.1 期末基金资产组合情况	65
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	65
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	66
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	70
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	71
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	72
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	72
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	72
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	72
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	72
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	72
8.12 投资组合报告附注	73
<b>§ 9 基金份额持有人信息</b>	<b>73</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	73
9.2 期末上市基金前十名持有人	74
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	74
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	74
9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	74
<b>§ 10 开放式基金份额变动</b>	<b>74</b>
<b>§ 11 重大事件揭示</b>	<b>75</b>
11.1 基金份额持有人大会决议	75
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	75
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	75
11.4 基金投资策略的改变	75
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	75
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	75
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	75
11.8 其他重大事件	78
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息</b>	<b>80</b>
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	80
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	80
<b>§ 13 备查文件目录</b>	<b>81</b>
13.1 备查文件目录	81
13.2 存放地点	81
13.3 查阅方式	81

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华创新动力灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)
基金简称	鹏华创新动力混合 (LOF)
场内简称	创新动力 (扩位简称: 鹏华创新动力 LOF)
基金主代码	501076
基金运作方式	上市契约型开放式 (LOF)
基金合同生效日	2019 年 6 月 10 日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	262,438,886.11 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2019 年 12 月 9 日

### 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，研选科创主题的股票、债券等投资标的，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>在封闭运作期内，本基金主要采用资产配置策略、股票投资策略、固定收益策略及其他策略等。</p> <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、货币、税收、汇率政策等）来判断经济周期目前的位置以及未来将发展的方向，在此基础上对各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估，制定股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。</p> <p>本基金在投资股票时，将根据市场整体估值水平评估系统性风险，同时根据个股估值水平（中证 800 指数的市净率 P/B）决定股票资产的投资比例。</p> <p>上月末中证 800 指数市净率 P/B 在过去 10 年每日市净率 P/B 中的分位数 本月股票资产占基金资产的比例下限 本月股票资产占基金资产的比例上限</p> <p>90 分位及以上 0% 45%</p> <p>75 分位（含）至 90 分位 10% 55%</p> <p>25 分位（含）至 75 分位 20% 65%</p> <p>25 分位以下 55% 100%</p> <p>本基金将科学把握建仓节奏，遵守投资策略，适时控制仓位，力求通过仓位控制进一步降低基金资产收益的波动性。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>（1）科创主题的定义</p> <p>科创主题企业主要是指：坚持面向世界科技前沿、面向经济主战场、</p>

面向国家重大需求，符合国家战略、突破关键核心技术、市场认可度高的科技创新企业。本基金重点关注以下领域：

- 1) 新一代信息技术领域，主要包括半导体和集成电路、电子信息、下一代信息网络、人工智能、大数据、云计算、新兴软件、互联网、物联网和智能硬件等；
- 2) 高端装备领域，主要包括智能制造、航空航天、先进轨道交通、海洋工程装备及相关技术服务等；
- 3) 新材料领域，主要包括先进钢铁材料、先进有色金属材料、先进石化化工新材料、先进无机非金属材料、高性能复合材料、前沿新材料及相关技术服务等；
- 4) 新能源领域，主要包括先进核电、大型风电、高效光电光热、高效储能及相关技术服务等；
- 5) 节能环保领域，主要包括高效节能产品及设备、先进环保技术装备、先进环保产品、资源循环利用、新能源汽车整车、新能源汽车关键零部件、动力电池及相关技术服务等；
- 6) 生物医药领域，主要包括生物制品、高端化学药、高端医疗设备与器械及相关技术服务等；
- 7) 符合科创板定位的其他领域。

#### (2) 科创板股票投资策略

设立科创板的目的是落实创新驱动和科技强国战略、推动高质量发展，主动拥抱新经济。

1) 在定性分析方面，本基金通过以下研究方法进行个股筛选：

一是行业研判，我们通过产业调研的方式跟踪各子行业的需求空间、发展阶段和增长速度，选取具有明显成长性的优质赛道内的相关品种。科创板重点支持新一代信息技术、高端装备、新材料、新能源、节能环保以及生物医药等高新技术产业和战略性新兴产业上市，我们将在以上相关领域内挑选具备远期成长性的优质子行业。

二是竞争力分析，我们关注该公司具备的核心技术，以及这种技术的成熟度、易用性和研发壁垒。核心技术开发投入大、周期长、具有研发和应用上的较大不确定性，同时也是企业的核心竞争力所在。

2) 在定量分析方面，传统的 PE、PB、DCF 等估值方法对于许多发展成熟、盈利稳定的高科技公司仍然是最好的估值方法，但对于一些业务模式特殊、业务扩张迅速但仍处亏损期的高科技公司而言，传统的估值方法已不再适用。因此，在科创板企业的定量分析中，本基金将采取特殊高科技企业估值方法进行定量分析，例如，对云计算相关企业采取 PS 估值方法进行估值，对高速成长的萌芽期企业采取 P/FCF 进行估值，对部分互联网公司采取 MAU（月活跃用户数量）和单用户价值量进行估值，对电子商务平台采取 GMV（网站成交金额）作为估值依据等。

综上，本基金将分析科创板相关企业所处产业的发展阶段、企业自身的发展阶段、当前商业模式以及相关业务指标进行综合估值，辅助投资决策。

#### (3) 战略配售策略

本基金将积极关注并深入分析和论证战略配售股票的投资机会，基于对宏观经济与行业发展、资本市场及科技创新发展趋势的深入分

析和理解,结合未来市场走势判断,精选具有估值优势和成长空间的企业,以战略配售方式参与具有长期发展潜力的优质公司,分享公司成长及价值实现的红利,以追求基金资产的长期稳定增值。

本基金从估值水平和发展空间两个角度出发,采取上述定性和定量分析相结合的方法对企业未来的价值进行全面的分析,在严格把握投资组合风险与收益的前提下,进行行业优化配置和动态调整。战略配售策略仅在封闭运作期内使用,且本基金剩余封闭运作期应长于战略配售股票的锁定期及减持期。

#### (4) 其他科创主题股票投资策略

对于其他科创主题的股票,本基金将通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘优质的公司,构建投资组合。核心思路在于:1)自上而下地分析行业的增长前景、行业结构、商业模式、竞争要素等分析把握其投资机会;2)自下而上地评判企业的核心竞争力、管理层、治理结构等以及其所提供的产品和服务是否契合未来行业增长的大趋势,对企业基本面和估值水平进行综合的研判,深度挖掘优质的个股。

本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略,基于对基础证券投资价值的深入研究判断,进行存托凭证的投资。

### 3、固定收益投资策略

本基金债券投资将采取久期策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、个券选择策略、信用策略等积极投资策略,自上而下地管理组合的久期,灵活地调整组合的券种搭配,同时精选个券,以增强组合的持有期收益。

#### (1) 久期策略

久期管理是债券投资的重要考量因素,本基金将采用以“目标久期”为中心、自上而下的组合久期管理策略。

#### (2) 收益率曲线策略

收益率曲线的形状变化是判断市场整体走向的一个重要依据,本基金将据此调整组合长、中、短期债券的搭配,并进行动态调整。

#### (3) 骑乘策略

本基金将采用基于收益率曲线分析对债券组合进行适时调整的骑乘策略,以达到增强组合的持有期收益的目的。

#### (4) 息差策略

本基金将采用息差策略,以达到更好地利用杠杆放大债券投资的收益的目的。

#### (5) 个券选择策略

本基金将根据单个债券到期收益率相对于市场收益率曲线的偏离程度,结合信用等级、流动性、选择权条款、税赋特点等因素,确定其投资价值,选择定价合理或价值被低估的债券进行投资。

#### (6) 信用策略

本基金通过主动承担适度的信用风险来获取信用溢价,根据内、外部信用评级结果,结合对类似债券信用利差的分析以及对未来信用利差走势的判断,选择信用利差被高估、未来信用利差可能下降的信用债进行投资。

### 4、其他策略

	<p>(1) 股指期货投资策略</p> <p>本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为目标,选择流动性好、交易活跃的股指期货合约,充分考虑股指期货的风险收益特征,通过多头或空头的套期保值策略,以改善投资组合的投资效果,实现股票组合的超额收益。</p> <p>(2) 国债期货投资策略</p> <p>本基金根据风险管理的原则,以套期保值为目标,在风险可控的前提下,投资国债期货。本基金将充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征,结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析,对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平等指标进行跟踪监控,在最大限度保证基金资产安全的基础上,力求实现委托财产的长期稳定增值。</p> <p>(3) 资产支持证券的投资策略</p> <p>本基金将综合运用战略资产配置和战术资产配置进行资产支持证券的投资组合管理,并根据信用风险、利率风险和流动性风险变化积极调整投资策略,严格遵守法律法规和基金合同的约定,在保证本金安全和基金资产流动性的基础上获得稳定收益。</p> <p>未来,随着证券市场投资工具的发展和丰富,本基金可相应调整和更新相关投资策略,并在招募说明书中更新公告。</p>
业绩比较基准	中国战略新兴产业成份指数收益率*50%+中债总指数收益率*50%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金,其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金。本基金以战略配售为投资策略,需参与并接受发行人战略配售股票,由此产生的投资风险与价格波动由投资者自行承担。

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	中国工商银行股份有限公司
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	95588
传真	0755-82021126	(010)66105798
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	北京市西城区复兴门内大街55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55号
邮政编码	518048	100140
法定代表人	何如	陈四清

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.phfund.com.cn">http://www.phfund.com.cn</a>



基金年度报告备置地点	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层鹏华基金管理有限公司
------------	--

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023 年	2022 年	2021 年
本期已实现收益	-8,924,147.99	54,989,273.35	304,220,873.78
本期利润	-14,288,365.22	-129,551,712.49	30,243,953.07
加权平均基金份额本期利润	-0.0482	-0.1962	0.0306
本期加权平均净值利润率	-3.27%	-12.64%	1.86%
本期基金份额净值增长率	-3.92%	-11.11%	1.87%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
期末可供分配利润	110,450,079.56	165,415,412.91	480,882,035.97
期末可供分配基金份额利润	0.4209	0.4788	0.4863
期末基金资产净值	372,888,965.67	510,861,629.51	1,645,315,635.33
期末基金份额净值	1.4209	1.4788	1.6637
3.1.3 累计期末指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
基金份额	42.09%	47.88%	66.37%

累计净值 增长率			
-------------	--	--	--

注：(1) 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益等未实现收益。

(2) 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(3) 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润期末余额和未分配利润中已实现部分的期末余额的孰低数。表中的“期末”均指报告期最后一日，即 12 月 31 日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

## 3.2 基金净值表现

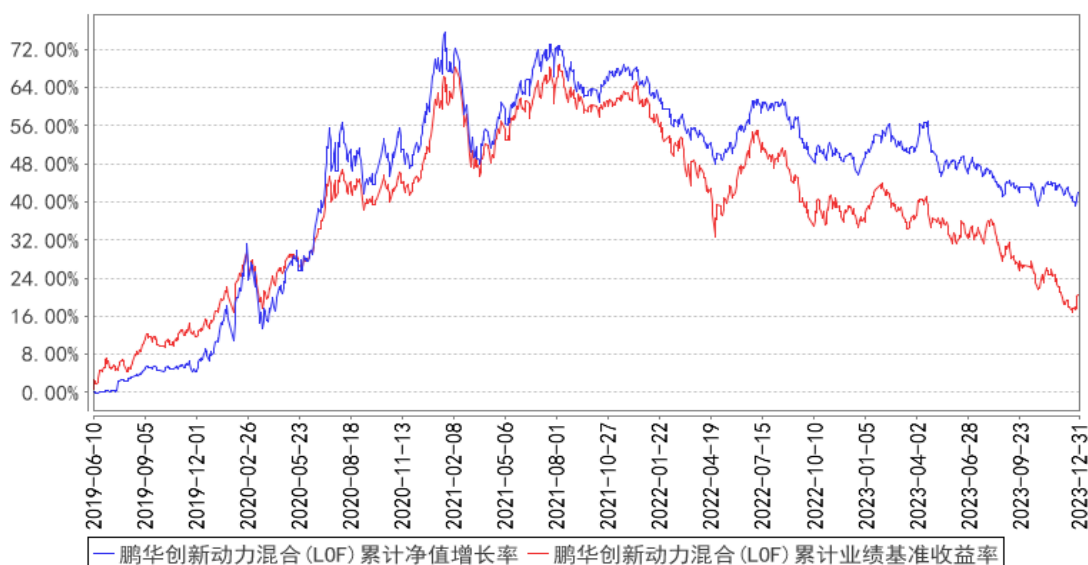
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①—③	②—④
过去三个月	-0.80%	0.48%	-4.93%	0.68%	4.13%	-0.20%
过去六个月	-3.98%	0.47%	-9.71%	0.68%	5.73%	-0.21%
过去一年	-3.92%	0.51%	-11.63%	0.67%	7.71%	-0.16%
过去三年	-12.99%	0.67%	-21.76%	0.82%	8.77%	-0.15%
自基金合同生效起 至今	42.09%	0.82%	20.47%	0.81%	21.62%	0.01%

注：业绩比较基准=中国战略新兴产业成份指数收益率\*50%+中债总指数收益率\*50%

### 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

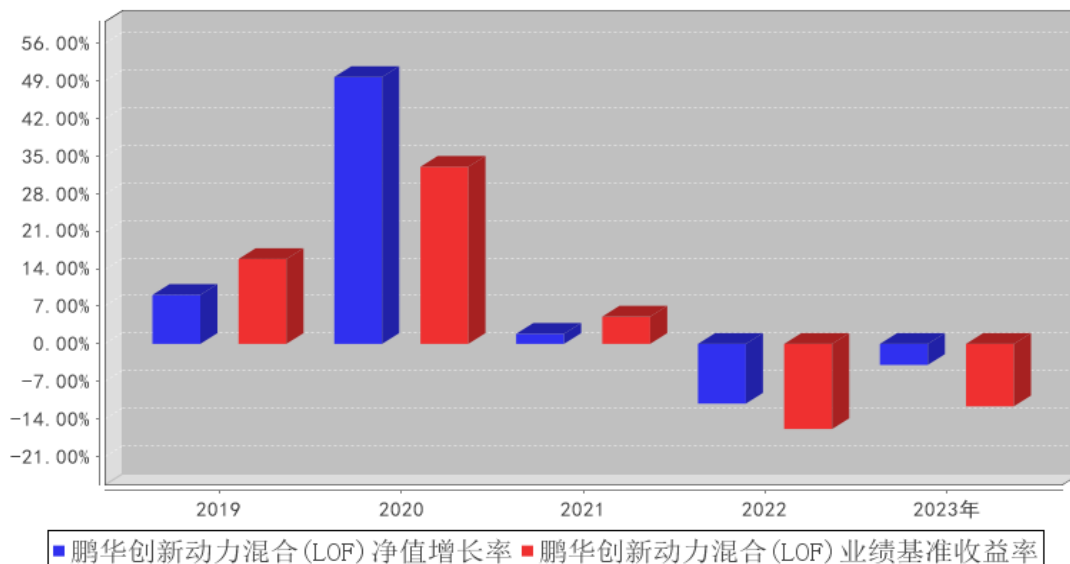
鹏华创新动力混合 (LOF) 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2019 年 06 月 10 日生效。2、截至建仓期结束，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

鹏华创新动力混合 (LOF) 基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按照实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 其他指标

注：无。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

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，公司管理资产总规模达到 11052 亿元，313 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		
李君	基金经理	2022-06-10	-	14 年	李君女士，国籍中国，经济学硕士，14 年证券从业经验。历任平安银行资金交易部银行账户管理岗，从事银行间市场资金交易工作；2010 年 8 月加盟鹏华基金管理有限公司，历任集中交易室债券交易员从事债券研究、交易工作，现担任稳定收益投资部基金经理。2013 年 01 月至 2014 年 05 月担任鹏华货币市场证券投资基金基金经理，2014 年 02 月至 2015 年 05 月担任鹏华增值宝货币市场基金基金经理，2015 年 05 月至今担任鹏华弘利灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015 年 05 月至 2017 年 02 月担任鹏华弘泽灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015 年 05 月至 2017 年 02 月担任鹏华弘盛灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015 年 05 月至今担任鹏华弘润灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015 年 05 月至 2017 年 02 月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，2015 年 11 月至 2022 年 12 月担任鹏华弘安灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 05 月至 2019 年 06 月担任鹏华兴利定期开放灵活配置混合型

					<p>证券投资基金基金经理, 2016年06月至2018年08月担任鹏华兴华定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2016年06月至2018年08月担任鹏华兴益定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2016年08月至2018年05月担任鹏华兴盛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2017年11月担任鹏华兴锐定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2017年02月至2018年06月担任鹏华兴康定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2017年05月至2019年12月担任鹏华聚财通货币市场基金经理, 2017年09月至2018年05月担任鹏华弘锐灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2018年03月至今担任鹏华尊惠18个月定期开放混合型证券投资基金基金经理, 2018年05月至2018年10月担任鹏华兴盛灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2018年06月至2018年08月担任鹏华兴康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06月至2021年12月担任鹏华兴利混合型证券投资基金基金经理, 2019年08月至2021年04月担任鹏华丰登债券型证券投资基金基金经理, 2021年02月至今担任鹏华弘裕一年持有期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, 2023年08月至今担任鹏华安享一年持有期混合型证券投资基金基金经理, 2023年08月至今担任鹏华兴鹏一年持有期混合型证券投资基金基金经理, 2023年12月至今担任鹏华创兴增利债券型证券投资基金基金经理, 李君女士具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理未发生变动。</p>
李韵怡	基金经理	2022-06-10	-	16年	<p>李韵怡女士, 国籍中国, 经济学硕士, 16年证券从业经验。曾任职于广州证券股份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/</p>

				<p>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 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 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 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 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 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 月至今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基金经理, 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 月至今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格。本报告期内本基金基金经理未发生变动。</p>	
金笑非	基金经理	2022-06-10	-	11 年	<p>金笑非先生, 国籍中国, 经济学硕士, 11 年证券从业经验。2012 年 7 月加盟鹏华基金管理有限公司, 从事行业研究工作, 历任研究部基金经理助理/高级研究员, 现任权益投资二部副总经理/基金经理。2016 年 06 月至今担任鹏华医药科技股票型证</p>

					券投资基金基金经理, 2017年07月至2020年03月担任鹏华医疗保健股票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, 2021年06月至今担任鹏华创新升级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, 2022年06月至今担任鹏华创新增长一年持有期混合型证券投资基金基金经理, 金笑非先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理未发生变动。
--	--	--	--	--	--

注：1. 任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日；担任新成立基金基金经理的，任职日期为基金合同生效日。2. 证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

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

注：无。

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

在投资研究环节：1、公司使用唯一的研究报告发布平台“研究报告管理平台”，确保各投资组合在获得投资信息、研究支持、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；2、公司严格按

照《股票库管理规定》、《信用债券投资与风险控制管理规定》，执行股票及信用产品出入库及日常维护工作，确保相关证券入库以内容严谨、观点明确的研究报告作为依据；3、在公司股票库基础上，各涉及股票投资的资产组合根据各自的投资目标、投资风格、投资范围和防范关联交易的原则分别建立资产组合股票库，基金经理在股票库基础上根据投资授权以及基金合同择股方式构建具体的投资组合；4、严格执行投资授权制度，明确投资决策委员会、分管投资副总裁、基金经理等各主体的职责和权限划分，合理确定基金经理的投资权限，超过投资权限的操作，应严格履行审批程序。

在交易执行环节：1、所有公司管理的资产组合的交易必须通过集中交易室完成，集中交易室负责建立和执行交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会；2、针对交易所公开竞价交易，集中交易室应严格启用恒生交易系统内的公平交易程序，交易系统则自动启用公平交易功能，由系统按照“未委托数量”的比例对不同资产组合进行委托量的公平分配；如果相关基金经理坚持以不同的价格进行交易，且当前市场价格不能同时满足多个资产组合的指令价格要求时，交易系统自动按照“价格优先”原则进行委托；当市场价格同时满足多个资产组合的指令价格要求时，则交易系统自动按照“同一指令价格下的公平交易”模式，进行公平委托和交易量分配；3、银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易需依据公司《股票投资交易流程》和《固定收益投资管理流程》的规定执行；银行间市场交易、交易所大宗交易等以公司名义进行的交易，各投资组合经理应在交易前独立确定各投资组合的交易价格和数量，公司按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；4、新股、新债申购及非公开定向增发交易需依据公司《新股申购流程》、《固定收益投资管理流程》和《非公开定向增发流程》的规定执行，对新股和新债申购方案和分配过程进行审核和监控。

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

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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



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

#### 4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未发生违法违规且对基金财产造成损失的异常交易行为。本报告期内未发生基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年随着疫情防控全面放开，市场的乐观预期在一季度有所显现，尤其是在一二月份，随着国内 PMI 数据的显著回升，叠加美国人工智能产业领域的革命性进步，A 股交投逐渐活跃，债券市场承压。但进入 3 月份，随着更多宏观数据的印证，包括房地产市场的趋势性变化，以及不断走弱的居民消费，国内金融市场的风险偏好开始逐步回落，反映到具体市场层面，就是异常显著的“股债跷跷板”效应。2023 年债券市场的“明星”是超长期债券，这在过去很多年都不曾见到，一是成交量持续放大，二是价格大幅上涨，三是国内 10 年与 30 年的期限利差收窄至历史极低，甚至是新低的位置。国内收益率曲线异常平坦，最直接反映了市场的风险厌恶情绪。但同样的收益率曲线平坦情况也发生在美国，2023 年美联储的激进加息使得短债收益率超过 5%，美债收益率曲线出现倒挂，但美国主要科技股并没有受到太多影响，仍然持续攀升。在这种差异下，人民币兑美元汇率，也全年保持弱势运行。

具体操作方面，该基金始终坚持在控制回撤的前提下，追求稳定收益。债券配置以收益相对稳定的中短久期品种为主。股票方面，在控制总仓位的前提下，在估值有安全边际的符合中长期经济和产业发展趋势的板块做深入挖掘。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期份额净值增长率为-3.92%，同期业绩比较基准增长率为-11.63%。

### 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 2024 年，我们认为，无论从实体经济层面，还是金融市场层面，悲观预期的释放已经比较充分，随着特别国债等刺激经济的措施陆续落地，国内的预期有边际改善的倾向，股债跷跷板有可能发生另一种情况变化。需要在资产配置上，再平衡、再优化。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

##### 1、继续完善内部控制体系

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

##### 2、规范基金销售业务，保证基金销售业务的合法合规性

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

##### 3、开展以风险为导向的内部稽核

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本基金管理人设有估值委员会，由登记结算部、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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1、截止本报告期末，本基金期末可供分配利润为 110,450,079.56 元，期末基金份额净值 1.4209 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。

#### 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

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

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人——鹏华基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人依法对鹏华基金管理有限公司编制和披露的本基金 2023 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2024)第 25751 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	鹏华创新动力灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了鹏华创新动力灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) (以下简称“鹏华创新动力混合 (LOF) 基金”) 的财务报表, 包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表, 2023 年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为, 后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会 (以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会 (以下简称“中国基金业协会”) 发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制, 公允反映了鹏华创新动力混合 (LOF) 基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信, 我们获取的审计证据是充分、适当的, 为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则, 我们独立于鹏华创新动力混合 (LOF) 基金, 并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	无。
其他事项	无。
其他信息	无。
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>鹏华创新动力混合 (LOF) 基金的基金管理人鹏华基金管理有限公司 (以下简称“基金管理人”) 管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表, 使其实现公允反映, 并设计、执行和维护必要的内部控制, 以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时, 基金管理人管理层负责评估鹏华创新动力混合 (LOF) 基金的持续经营能力, 披露与持续经营相关的事项 (如适用), 并运用持续经营假设, 除非基金管理人管理层计划清算鹏华创新动力混合 (LOF) 基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督鹏华创新动力混合 (LOF) 基</p>

	金的财务报告过程。	
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对鹏华创新动力混合 (LOF) 基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致鹏华创新动力混合 (LOF) 基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	单峰	仲文渊
会计师事务所的地址	中国上海市	
审计报告日期	2024 年 3 月 25 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：鹏华创新动力灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	7,965,465.49	13,677,204.53
结算备付金		32,007,101.89	37,081,730.67
存出保证金		37,225.63	152,987.60
交易性金融资产	7.4.7.2	371,107,283.74	520,400,767.92
其中：股票投资		187,662,759.80	261,955,870.03
基金投资		-	-
债券投资		183,444,523.94	258,444,897.89
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	3,000,000.00	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		2,084,134.00	143,661.74
应收股利		-	-
应收申购款		15,060.48	5,447.46
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		416,216,271.23	571,461,799.92
<b>负债和净资产</b>			
	<b>附注号</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
		<b>2023年12月31日</b>	<b>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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		37,995,256.24	54,983,752.34
应付清算款		4,136,030.07	3,105,315.14
应付赎回款		632,903.89	1,219,913.54
应付管理人报酬		383,332.83	662,021.20
应付托管费		63,888.80	110,336.86
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		7,125.75	10,668.03
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	108,767.98	508,163.30
负债合计		43,327,305.56	60,600,170.41
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.10	262,438,886.11	345,446,216.60
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	110,450,079.56	165,415,412.91
净资产合计		372,888,965.67	510,861,629.51
负债和净资产总计		416,216,271.23	571,461,799.92

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.4209 元，基金份额总额 262,438,886.11 份。

## 7.2 利润表

会计主体：鹏华创新动力灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		-6,574,986.46	-112,874,774.54
1. 利息收入		331,641.16	949,328.63
其中：存款利息收入	7.4.7.13	254,219.36	383,027.02
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		77,421.80	566,301.61
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-1,592,013.43	70,327,147.78
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-9,273,501.41	44,823,246.27
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	4,923,637.67	20,772,585.84
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	2,757,850.31	4,731,315.67
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-

3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.20	-5,364,217.23	-184,540,985.84
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	49,603.04	389,734.89
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>7,713,378.76</b>	<b>16,676,937.95</b>
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	6,013,926.13	13,613,508.29
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,002,321.01	2,268,918.00
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		475,176.83	460,674.44
其中：卖出回购金融资产支出		475,176.83	460,674.44
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		12,921.59	74,658.70
8. 其他费用	7.4.7.23	209,033.20	259,178.52
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-14,288,365.22</b>	<b>-129,551,712.49</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-14,288,365.22</b>	<b>-129,551,712.49</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>-14,288,365.22</b>	<b>-129,551,712.49</b>

### 7.3 净资产变动表

会计主体：鹏华创新动力灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	345,446,216.60	-	165,415,412.91	510,861,629.51
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	345,446,216.60	-	165,415,412.91	510,861,629.51



三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-83,007,330.49	-	-54,965,333.35	-137,972,663.84
(一)、综合收益总额	-	-	-14,288,365.22	-14,288,365.22
(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)	-83,007,330.49	-	-40,676,968.13	-123,684,298.62
其中：1.基金申购款	2,841,820.75	-	1,379,281.18	4,221,101.93
2.基金赎回款	-85,849,151.24	-	-42,056,249.31	-127,905,400.55
(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	262,438,886.11	-	110,450,079.56	372,888,965.67
项目	上年度可比期间			
	2022年1月1日至2022年12月31日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	988,941,407.16	-	656,374,228.17	1,645,315,635.33
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	988,941,407.16	-	656,374,228.17	1,645,315,635.33
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-643,495,190.56	-	-490,958,815.26	-1,134,454,005.82
(一)、综合收益总额	-	-	-129,551,712.4	-129,551,712.49

			9	
(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)	-643,495,190.56	-	-361,407,102.77	-1,004,902,293.33
其中：1. 基金申购款	4,284,075.15	-	2,408,636.36	6,692,711.51
2. 基金赎回款	-647,779,265.71	-	-363,815,739.13	-1,011,595,004.84
(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	345,446,216.60	-	165,415,412.91	510,861,629.51

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

邓召明

邢彪

郝文高

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

鹏华创新动力灵活配置混合型证券投资基金(LOF) (原鹏华科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金,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[2019]936 号《关于准予鹏华科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准,由鹏华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《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合同》负责公开募集。本基金首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 988,941,407.16 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(2019)第 0347 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《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合同》于 2019 年 6 月 10 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 988,941,407.16 份基金份额，无认购资金利息折合的基金份额。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。根据本基金的基金管理人于 2022 年 6 月 8 日发布的《鹏华基金管理有限公司关于鹏华科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金封闭运作期届满及相关安排的公告》，本基金封闭运作期届满转型后的基金名称由基金合同约定的“鹏华创新成长灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 变更为“鹏华创新动力灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)”。经与基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，《鹏华创新动力灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 基金合同》于 2022 年 6 月 10 日生效，《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合同》同时失效。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、《资产管理产品相关会计处理规定》(财会[2022]14 号)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《鹏华创新动力灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 基金合同》和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和基金净资产变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

#### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

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

##### 以摊余成本计量：

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

##### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

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

#### (2) 金融负债的分类

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

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

费用计入初始确认金额。

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑在资产负债表日无须付出不必要的额外成本和努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

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

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。本基金在上一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形的，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

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

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按

比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4)除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率或者发行价计算的利息及在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况

下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

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

#### 7.4.4.13 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。



#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

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

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通

知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

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

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
活期存款	7,965,465.49	13,677,204.53
等于：本金	7,964,809.85	13,676,067.43
加：应计利息	655.64	1,137.10
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	7,965,465.49	13,677,204.53

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	200,388,500.60	-	187,662,759.80	-12,725,740.80	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	152,398,480.07	2,093,363.28	152,845,163.28	-1,646,680.07
	银行间市场	30,061,590.00	578,360.66	30,599,360.66	-40,590.00
	合计	182,460,070.07	2,671,723.94	183,444,523.94	-1,687,270.07
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	382,848,570.67	2,671,723.94	371,107,283.74	-14,413,010.87	

项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	268,707,954.02	-	261,955,870.03	-6,752,083.99	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	226,689,883.25	3,767,847.85	228,130,481.45	-2,327,249.65
	银行间市场	29,948,460.00	335,416.44	30,314,416.44	30,540.00
	合计	256,638,343.25	4,103,264.29	258,444,897.89	-2,296,709.65
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	525,346,297.27	4,103,264.29	520,400,767.92	-9,048,793.64	

注：股票投资的成本、公允价值及公允价值变动均包含中国存托凭证的成本、公允价值及公允价值变动。

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无。

##### 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

##### 7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	3,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	3,000,000.00	-
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-

合计	-	-
----	---	---

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

#### 7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。
----

#### 7.4.7.5 债权投资

##### 7.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

##### 7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

#### 7.4.7.6 其他债权投资

##### 7.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

##### 7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

#### 7.4.7.7 其他权益工具投资

##### 7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

##### 7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

#### 7.4.7.8 其他资产

注：无。

#### 7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	12.67	1.71
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	58,755.31	288,161.59
其中：交易所市场	58,755.31	288,161.59
银行间市场	-	-
应付利息	-	-

预提费用	50,000.00	220,000.00
合计	108,767.98	508,163.30

#### 7.4.7.10 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12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	345,446,216.60	345,446,216.60
本期申购	2,841,820.75	2,841,820.75
本期赎回（以“-”号填列）	-85,849,151.24	-85,849,151.24
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	262,438,886.11	262,438,886.11

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.11 其他综合收益

注：无。

#### 7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	194,822,149.77	-29,406,736.86	165,415,412.91
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	194,822,149.77	-29,406,736.86	165,415,412.91
本期利润	-8,924,147.99	-5,364,217.23	-14,288,365.22
本期基金份额交易产生的变动数	-46,841,767.14	6,164,799.01	-40,676,968.13
其中：基金申购款	1,602,067.61	-222,786.43	1,379,281.18
基金赎回款	-48,443,834.75	6,387,585.44	-42,056,249.31
本期已分配利润	-	-	-
本期末	139,056,234.64	-28,606,155.08	110,450,079.56

#### 7.4.7.13 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12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
	活期存款利息收入	46,239.37

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	207,003.64	245,863.62
其他	976.35	3,067.17
合计	254,219.36	383,027.02

注：其他包含认/申购款利息收入、结算保证金利息收入、风控金利息收入等

#### 7.4.7.14 股票投资收益

##### 7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-9,273,501.41	44,823,246.27
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	-9,273,501.41	44,823,246.27

##### 7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
卖出股票成交总额	384,676,872.65	1,149,053,961.97
减：卖出股票成本总额	392,908,520.86	1,100,937,163.04
减：交易费用	1,041,853.20	3,293,552.66
买卖股票差价收入	-9,273,501.41	44,823,246.27

##### 7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

#### 7.4.7.15 债券投资收益

##### 7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
债券投资收益——利息收入	6,377,690.81	21,897,725.88
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-1,454,053.14	-1,125,140.04
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	4,923,637.67	20,772,585.84

#### 7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	165,980,609.05	1,013,956,790.93
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	163,045,601.87	987,836,751.62
减：应计利息总额	4,388,594.74	27,244,274.33
减：交易费用	465.58	905.02
买卖债券差价收入	-1,454,053.14	-1,125,140.04

#### 7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

#### 7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 7.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

##### 7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。



**7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入**

注：无。

**7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入**

注：无。

**7.4.7.17 贵金属投资收益****7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成**

注：无。

**7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

注：无。

**7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

注：无。

**7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

注：无。

**7.4.7.18 衍生工具收益****7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：无。

**7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益**

注：无。

**7.4.7.19 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资产生的股利收益	2,757,850.31	4,731,315.67
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	2,757,850.31	4,731,315.67

**7.4.7.20 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日

1. 交易性金融资产	-5,364,217.23	-184,540,985.84
股票投资	-5,973,656.81	-182,859,508.39
债券投资	609,439.58	-1,681,477.45
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	-5,364,217.23	-184,540,985.84

#### 7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
基金赎回费收入	49,391.47	389,702.92
基金转换费收入	211.57	31.97
合计	49,603.04	389,734.89

#### 7.4.7.22 信用减值损失

注：无。

#### 7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
审计费用	50,000.00	100,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费用	1,718.00	1,978.52
账户维护费	36,000.00	36,000.00
存托服务费	115.20	-
其他	1,200.00	1,200.00
合计	209,033.20	259,178.52

#### 7.4.7.24 分部报告

无。

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

无。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
鹏华基金管理有限公司(“鹏华基金公司”)	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人、基金代销机构
国信证券股份有限公司(“国信证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构
深圳市北融信投资发展有限公司	基金管理人的股东
意大利欧利盛资本资产管理股份公司(“Eurizon Capital SGR S.p.A.”)	基金管理人的股东
鹏华资产管理有限公司(“鹏华资产”)	基金管理人的子公司

注：1、本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。 2、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)
国信证券	65,978,178.22	9.52	24,613,723.67	1.17

###### 7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)

国信证券	22,142,394.00	26.30	57,751,483.00	8.09
------	---------------	-------	---------------	------

#### 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)
国信证券	427,610,000.00	12.46	200,000,000.00	2.56

#### 7.4.10.1.4 权证交易

注：无。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
国信证券	61,216.07	9.63	5,693.80	9.69
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
国信证券	22,497.55	1.19	-	-

注：（1）佣金的计算公式

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

(佣金比率按照与一般证券公司签订的协议条款订立。)

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

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年

	月 31 日	12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	6,013,926.13	13,613,508.29
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,573,448.61	3,226,421.80
应支付基金管理人的净管理费	4,440,477.52	10,387,086.49

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 1.20%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×1.20%÷当年天数。

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

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,002,321.01	2,268,918.00

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：无。

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

注：无。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

## 7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方没有投资及持有本基金份额。

## 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	7,965,465.49	46,239.37	13,677,204.53	134,096.23

## 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2023年1月1日至2023年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
国信证券	301488	豪恩汽电	网下申购	2,543	101,160.54
国信证券	603270	金帝股份	网下申购	1,762	38,358.74
国信证券	688307	中润光学	网下申购	2,455	58,625.40
国信证券	688562	航天软件	网下申购	7,254	91,980.72
上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
国信证券	301338	凯格精机	网下申购	2,568	118,975.44
国信证券	688401	路维光电	网下申购	4,947	124,070.76
国信证券	301161	唯万密封	网下申购	3,460	64,563.60
国信证券	688244	永信至诚	网下申购	1,506	74,080.14

注：本表包含参与基金托管人的关联方承销证券的情况。

## 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

## 7.4.11 利润分配情况

注：无。

## 7.4.12 期末（2023年12月31日）本基金持有的流通受限证券

## 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券	证	成功	受	流通	认购	期末	数量	期末	期末估值总	备注

代码	券名称	认购日	限期	受限类型	价格	估值单价	(单位:股)	成本总额	额	
001239	永达股份	2023年12月4日	6个月	新股流通受限	12.05	19.92	189	2,277.45	3,764.88	-
001306	夏厦精密	2023年11月9日	6个月	新股流通受限	53.63	75.36	61	3,271.43	4,596.96	-
001326	联域股份	2023年11月1日	6个月	新股流通受限	41.18	48.64	99	4,076.82	4,815.36	-
001358	兴欣新材	2023年12月14日	6个月	新股流通受限	41.00	44.16	87	3,567.00	3,841.92	-
001378	德冠新材	2023年10月23日	6个月	新股流通受限	31.68	31.27	193	6,114.24	6,035.11	-
300904	威力传动	2023年8月2日	6个月	新股流通受限	35.41	61.53	304	10,764.64	18,705.12	-
301172	君逸数码	2023年7月19日	6个月	新股流通受限	31.33	38.16	438	13,722.54	16,714.08	-
301202	朗威股份	2023年6月28日	6个月	新股流通受限	25.82	31.80	306	7,900.92	9,730.80	-
301251	威尔高	2023年8月30日	6个月	新股流通受限	28.88	34.59	311	8,981.68	10,757.49	-
301261	恒工精密	2023年6月29日	6个月	新股流通受限	36.90	50.85	198	7,306.20	10,068.30	-
301272	英	2023	6个月	新股	51.39	53.38	173	8,890.47	9,234.74	-

	华特	年7月6日		流通受限						
301291	明阳电气	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	38.13	28.36	437	16,662.81	12,393.32	-
301292	海科新源	2023年6月29日	6个月	新股流通受限	19.99	19.35	583	11,654.17	11,281.05	-
301329	信音电子	2023年7月5日	6个月	新股流通受限	21.00	22.23	425	8,925.00	9,447.75	-
301348	蓝箭电子	2023年8月1日	6个月	新股流通受限	18.08	44.57	613	11,083.04	27,321.41	-
301370	国科恒泰	2023年7月3日	6个月	新股流通受限	13.39	16.01	1,043	13,965.77	16,698.43	-
301371	敷尔佳	2023年7月24日	6个月	新股流通受限	55.68	37.58	192	10,690.56	7,215.36	-
301381	赛维时代	2023年7月5日	6个月	新股流通受限	20.45	29.69	571	11,676.95	16,952.99	-
301393	昊帆生物	2023年7月5日	6个月	新股流通受限	67.68	59.37	171	11,573.28	10,152.27	-
301413	安培龙	2023年12月11日	6个月	新股流通受限	33.25	58.19	164	5,453.00	9,543.16	-
301418	协昌科技	2023年8月10日	6个月	新股流通受限	51.88	50.20	189	9,805.32	9,487.80	-
301421	波	2023	6个月	新股	29.38	59.37	322	9,460.36	19,117.14	-



	长光电	年8月16日		流通受限						
301456	盘古智能	2023年7月6日	6个月	新股流通受限	37.96	30.39	274	10,401.04	8,326.86	-
301459	丰茂股份	2023年12月6日	6个月	新股流通受限	31.90	39.84	208	6,635.20	8,286.72	-
301486	致尚科技	2023年6月30日	6个月	新股流通受限	57.66	47.25	255	14,703.30	12,048.75	-
301487	盟固利	2023年8月1日	6个月	新股流通受限	5.32	40.96	867	4,612.44	35,512.32	-
301488	豪恩光电	2023年6月26日	6个月	新股流通受限	39.78	69.09	255	10,143.90	17,617.95	-
301498	乖宝宠物	2023年8月9日	6个月	新股流通受限	39.99	38.81	247	9,877.53	9,586.07	-
301499	维科精密	2023年7月13日	6个月	新股流通受限	19.50	28.93	371	7,234.50	10,733.03	-
301505	苏州规划	2023年7月12日	6个月	新股流通受限	26.35	35.81	194	5,111.90	6,947.14	-
301507	民生健康	2023年8月24日	6个月	新股流通受限	10.00	15.85	755	7,550.00	11,966.75	-
301508	中机认检	2023年11月23日	6个月	新股流通受限	16.82	26.68	419	7,047.58	11,178.92	-
301510	固	2023	6个月	新股	12.00	35.01	396	4,752.00	13,863.96	-

	高科技	年8月4日		流通受限						
301511	德福科技	2023年8月8日	6个月	新股流通受限	28.00	22.67	449	12,572.00	10,178.83	-
301515	港通医疗	2023年7月13日	6个月	新股流通受限	31.16	28.27	230	7,166.80	6,502.10	-
301516	中远通	2023年12月1日	6个月	新股流通受限	6.87	15.51	604	4,149.48	9,368.04	-
301518	长华化学	2023年7月26日	6个月	新股流通受限	25.75	23.01	385	9,913.75	8,858.85	-
301519	舜禹股份	2023年7月19日	6个月	新股流通受限	20.93	20.21	442	9,251.06	8,932.82	-
301525	儒竞科技	2023年8月23日	6个月	新股流通受限	99.57	81.46	89	8,861.73	7,249.94	-
301526	国际复材	2023年12月19日	6个月	新股流通受限	2.66	4.45	4,923	13,095.18	21,907.35	-
301528	多浦乐	2023年8月17日	6个月	新股流通受限	71.80	68.91	148	10,626.40	10,198.68	-
301529	福赛科技	2023年8月31日	6个月	新股流通受限	36.60	37.88	182	6,661.20	6,894.16	-
301533	威马农机	2023年8月7日	6个月	新股流通受限	29.50	33.16	225	6,637.50	7,461.00	-
301555	惠	2023	6个月	新股	22.88	32.44	224	5,125.12	7,266.56	-

	柏新材	年10月24日		流通受限						
301566	达利凯普	2023年12月22日	6个月	新股流通受限	8.90	22.14	576	5,126.40	12,752.64	-
301568	思泰克	2023年11月21日	6个月	新股流通受限	23.23	35.58	246	5,714.58	8,752.68	-
301578	辰奕智能	2023年12月21日	6个月	新股流通受限	48.94	68.32	118	5,774.92	8,061.76	-
601083	锦江航运	2023年11月28日	6个月	新股流通受限	11.25	11.07	478	5,377.50	5,291.46	-
601096	宏盛华源	2023年12月15日	6个月	新股流通受限	1.70	4.06	2,329	3,959.30	9,455.74	-
603004	鼎龙科技	2023年12月20日	6个月	新股流通受限	16.80	31.19	194	3,259.20	6,050.86	-
603062	麦加芯彩	2023年10月31日	6个月	新股流通受限	58.08	57.81	68	3,949.44	3,931.08	-
603075	热威股份	2023年9月1日	6个月	新股流通受限	23.10	23.31	154	3,557.40	3,589.74	-
603107	上海汽配	2023年10月25日	6个月	新股流通受限	14.23	18.19	218	3,102.14	3,965.42	-
603119	浙江荣泰	2023年7月21日	6个月	新股流通受限	15.32	23.87	198	3,033.36	4,726.26	-
603193	润	2023	6个月	新股	17.38	16.66	229	3,980.02	3,815.14	-

	本股份	年10月9日		流通受限						
603231	索宝蛋白	2023年12月6日	6个月	新股流通受限	21.29	21.53	141	3,001.89	3,035.73	-
603270	金帝股份	2023年8月25日	6个月	新股流通受限	21.77	29.58	177	3,853.29	5,235.66	-
603273	天元智能	2023年10月16日	6个月	新股流通受限	9.50	18.97	178	1,691.00	3,376.66	-
603276	恒兴新材	2023年9月18日	6个月	新股流通受限	25.73	24.88	134	3,447.82	3,333.92	-
603296	华勤技术	2023年8月1日	6个月	新股流通受限	80.80	77.75	139	11,231.20	10,807.25	-
603373	安邦护卫	2023年12月13日	6个月	新股流通受限	19.10	34.75	88	1,680.80	3,058.00	-
688347	华虹公司	2023年7月27日	6个月	新股流通受限	52.00	42.06	9,583	498,316.00	403,060.98	-
688450	光格科技	2023年7月17日	6个月	新股流通受限	53.09	36.42	153	8,122.77	5,572.26	-
688548	广钢气体	2023年8月8日	6个月	新股流通受限	9.87	12.75	1,255	12,386.85	16,001.25	-
688549	中巨芯-U	2023年8月30日	6个月	新股流通受限	5.18	8.09	1,902	9,852.36	15,387.18	-
688563	航	2023	6个月	新股	78.99	60.49	235	18,562.65	14,215.15	-

	材股份	年7月12日		流通受限						
688573	信宇人	2023年8月9日	6个月	新股流通受限	23.68	28.80	285	6,748.80	8,208.00	-
688582	芯动联科	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	26.74	38.67	341	9,118.34	13,186.47	-
688591	泰凌微	2023年8月18日	6个月	新股流通受限	24.98	28.02	484	12,090.32	13,561.68	-
688602	康鹏科技	2023年7月13日	6个月	新股流通受限	8.66	11.06	823	7,127.18	9,102.38	-
688603	天承科技	2023年6月30日	6个月	新股流通受限	55.00	74.14	140	7,700.00	10,379.60	-
688612	威迈斯	2023年7月19日	6个月	新股流通受限	47.29	37.97	175	8,275.75	6,644.75	-
688627	精智达	2023年7月11日	6个月	新股流通受限	46.77	87.72	200	9,354.00	17,544.00	-
688638	誉辰智能	2023年7月4日	6个月	新股流通受限	83.90	59.68	136	11,410.40	8,116.48	-
688646	逸飞激光	2023年7月21日	6个月	新股流通受限	46.80	36.07	219	10,249.20	7,899.33	-
688648	中邮科技	2023年11月6日	6个月	新股流通受限	15.18	21.43	303	4,599.54	6,493.29	-
688651	盛	2023	6个月	新股	39.90	46.05	178	7,102.20	8,196.90	-

	邦安全	年7月19日		流通受限						
688652	京仪装备	2023年11月22日	6个月	新股流通受限	31.95	52.25	262	8,370.90	13,689.50	-
688653	康希通信	2023年11月10日	6个月	新股流通受限	10.50	15.99	648	6,804.00	10,361.52	-
688657	浩辰软件	2023年9月25日	6个月	新股流通受限	103.40	78.23	89	9,202.60	6,962.47	-
688671	碧兴物联	2023年8月2日	6个月	新股流通受限	36.12	34.30	226	8,163.12	7,751.80	-
688693	锴威特	2023年8月10日	6个月	新股流通受限	40.83	43.41	178	7,267.74	7,726.98	-
688702	盛科通信-U	2023年9月6日	6个月	新股流通受限	42.66	48.18	192	8,190.72	9,250.56	-
688716	中研股份	2023年9月13日	6个月	新股流通受限	29.66	36.39	235	6,970.10	8,551.65	-
688719	爱科赛博	2023年9月20日	6个月	新股流通受限	69.98	60.10	126	8,817.48	7,572.60	-
688720	艾森股份	2023年11月29日	6个月	新股流通受限	28.03	49.84	165	4,624.95	8,223.60	-

注：1、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中需要限售的部分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。

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、基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

4、基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后 6 个月内不得转让。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 37,995,256.24 元，于 2024 年 01 月 02 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金。本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板、科创板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货以及经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，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间

取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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

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

#### 7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行股份有限公司及其他具有基金托管资格的银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。

本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。下列表格列示中不含国债、央行票据、政策性金融债券等非信用债券投资。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

##### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。



**7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

注：无。

**7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	152,845,163.28	228,130,481.45
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	152,845,163.28	228,130,481.45

注：上述评级均由经中国证监会核准从事证券市场资信评级业务的评级机构作出。

**7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

注：无。

**7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

注：无。

**7.4.13.3 流动性风险**

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

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

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

于 2023 年 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款余额 37,995,256.24 元将在一个月内到期且计

息外，本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

#### 7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家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股票不得超过该上市公司可流通股股票的 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股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。

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

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

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

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

动性情况良好。

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

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

本基金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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	7,965,465.49	-	-	-	7,965,465.49
结算备付金	32,007,101.89	-	-	-	32,007,101.89
存出保证金	37,225.63	-	-	-	37,225.63
交易性金融资产	180,214,547.23	3,229,976.71	-	187,662,759.80	371,107,283.74
买入返售金融资产	3,000,000.00	-	-	-	3,000,000.00
应收申购款	-	-	-	15,060.48	15,060.48
应收清算款	-	-	-	2,084,134.00	2,084,134.00
资产总计	223,224,340.24	3,229,976.71	-	189,761,954.28	416,216,271.23
负债					
应付赎回款	-	-	-	632,903.89	632,903.89
应付管理人报酬	-	-	-	383,332.83	383,332.83
应付托管费	-	-	-	63,888.80	63,888.80
应付清算款	-	-	-	4,136,030.07	4,136,030.07
卖出回购金融资产款	37,995,256.24	-	-	-	37,995,256.24
应交税费	-	-	-	7,125.75	7,125.75
其他负债	-	-	-	108,767.98	108,767.98
负债总计	37,995,256.24	-	-	5,332,049.32	43,327,305.56
利率敏感度缺口	185,229,084.00	3,229,976.71	-	-184,429,904.96	372,888,965.67
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					
货币资金	13,677,204.53	-	-	-	13,677,204.53

结算备付金	37,081,730.67	-	-	-	37,081,730.67
存出保证金	152,987.60	-	-	-	152,987.60
交易性金融资产	145,654,636.11	112,523,832.34	266,429.44	261,955,870.03	520,400,767.92
应收申购款	-	-	-	5,447.46	5,447.46
应收清算款	-	-	-	143,661.74	143,661.74
资产总计	196,566,558.91	112,523,832.34	266,429.44	262,104,979.23	571,461,799.92
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,219,913.54	1,219,913.54
应付管理人报酬	-	-	-	662,021.20	662,021.20
应付托管费	-	-	-	110,336.86	110,336.86
应付清算款	-	-	-	3,105,315.14	3,105,315.14
卖出回购金融资产款	54,983,752.34	-	-	-	54,983,752.34
应交税费	-	-	-	10,668.03	10,668.03
其他负债	-	-	-	508,163.30	508,163.30
负债总计	54,983,752.34	-	-	5,616,418.07	60,600,170.41
利率敏感度缺口	141,582,806.57	112,523,832.34	266,429.44	256,488,561.16	510,861,629.51

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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（2023 年 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	196,102.07	509,029.13
	市场利率上升 25 个基点	-195,575.61	-506,473.37

注：无。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注:无。

#### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注:无。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。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30%-95%,且投资于港股通标的股票占股票资产的比例不超过50%,每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%,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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位:人民币元

项目	本期末 2023年12月31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	187,662,759.80	50.33	261,955,870.03	51.28
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-

交易性金融资产—债券投资	3,229,976.71	0.87	266,429.44	0.05
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	190,892,736.51	51.20	262,222,299.47	51.33

注：债券投资为可转债、可交换债券投资。

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准外的其他市场变量保持不变。		
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（2023年12月31日）	上年度末（2022年12月31日）
	比较基准上涨 5% 资产净值变动	7,754,226.04	8,352,587.64
比较基准下降 5% 资产净值变动	-7,754,226.04	-8,352,587.64	

注：无。

#### 7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	189,651,073.89	261,437,867.75
第二层次	180,214,547.23	258,178,468.45
第三层次	1,241,662.62	784,431.72
合计	371,107,283.74	520,400,767.92

#### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票、债券和基金的公允价值应属第二层次还是第三层次。

#### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

##### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	784,431.72	784,431.72
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	1,946,569.08	1,946,569.08
转出第三层次	-	1,806,892.39	1,806,892.39
当期利得或损失总额	-	317,554.21	317,554.21
其中：计入损益的利得或损失	-	317,554.21	317,554.21
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,241,662.62	1,241,662.62
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动一	-	80,541.13	80,541.13

一公允价值变动损益			
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	15,968,555.61	15,968,555.61
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	2,867,330.58	2,867,330.58
转出第三层次	-	18,816,178.55	18,816,178.55
当期利得或损失总额	-	764,724.08	764,724.08
其中：计入损益的利得或损失	-	764,724.08	764,724.08
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	784,431.72	784,431.72
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	77,907.00	77,907.00

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流通受限股票	1,241,662.62	平均价格 亚式期权 模型	预期波动率	0.1855-2.1988	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流通受限股票	784,431.72	平均价格 亚式期权 模型	预期波动率	0.2127-2.4756	负相关

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。



#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	187,662,759.80	45.09
	其中：股票	187,662,759.80	45.09
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	183,444,523.94	44.07
	其中：债券	183,444,523.94	44.07
	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	3,000,000.00	0.72
	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	39,972,567.38	9.60
8	其他各项资产	2,136,420.11	0.51
9	合计	416,216,271.23	100.00

注：报告期末本基金投资的存托凭证公允价值为：593,200.00 元，占净值比 0.16%。本报告所指的“股票”均包含存托凭证。

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	5,297,846.00	1.42
B	采矿业	1,775,556.00	0.48
C	制造业	120,588,341.78	32.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,436,000.00	2.26
E	建筑业	2,515,187.18	0.67
F	批发和零售业	33,651.42	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	2,413,061.50	0.65

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,836,942.14	5.05
J	金融业	24,610,128.90	6.60
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,657,496.00	0.44
M	科学研究和技术服务业	1,489,616.06	0.40
N	水利、环境和公共设施管理业	8,932.82	0.00
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	187,662,759.80	50.33

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688279	峰昭科技	58,169	7,336,274.28	1.97
2	688192	迪哲医药-U	145,139	6,944,901.15	1.86
3	600707	彩虹股份	929,600	6,274,800.00	1.68
4	688008	澜起科技	94,446	5,549,646.96	1.49
5	000651	格力电器	170,100	5,472,117.00	1.47
6	688361	中科飞测-U	73,398	5,463,013.14	1.47
7	300498	温氏股份	264,100	5,297,846.00	1.42
8	002540	亚太科技	800,000	5,288,000.00	1.42
9	603160	汇顶科技	75,000	5,182,500.00	1.39
10	688235	百济神州-U	34,784	4,836,367.36	1.30
11	002185	华天科技	533,100	4,542,012.00	1.22
12	601318	中国平安	108,100	4,356,430.00	1.17
13	002371	北方华创	16,800	4,127,928.00	1.11
14	601939	建设银行	624,700	4,066,797.00	1.09
15	688227	品高股份	199,970	3,813,427.90	1.02
16	002430	杭氧股份	129,000	3,768,090.00	1.01
17	601288	农业银行	1,000,000	3,640,000.00	0.98
18	601158	重庆水务	640,000	3,628,800.00	0.97
19	601988	中国银行	907,900	3,622,521.00	0.97
20	688428	诺诚健华-U	311,242	3,579,283.00	0.96
21	601128	常熟银行	539,400	3,446,766.00	0.92
22	001309	德明利	34,900	3,311,661.00	0.89

23	601139	深圳燃气	480,000	3,307,200.00	0.89
24	000717	中南股份	1,200,000	3,048,000.00	0.82
25	688331	荣昌生物	48,382	3,002,586.92	0.81
26	688478	晶升股份	53,731	2,794,012.00	0.75
27	601601	中国太保	117,405	2,791,890.90	0.75
28	688169	石头科技	9,800	2,772,910.00	0.74
29	688107	安路科技	70,805	2,604,207.90	0.70
30	688387	信科移动-U	357,342	2,576,435.82	0.69
31	002241	歌尔股份	122,200	2,567,422.00	0.69
32	688316	青云科技-U	48,618	2,517,926.22	0.68
33	600970	中材国际	269,000	2,512,460.00	0.67
34	301101	明月镜片	60,000	2,511,600.00	0.67
35	688789	宏华数科	24,200	2,417,822.00	0.65
36	603871	嘉友国际	151,814	2,407,770.04	0.65
37	002387	维信诺	202,200	2,266,662.00	0.61
38	688009	中国通号	497,666	2,179,777.08	0.58
39	301122	采纳股份	63,700	2,156,882.00	0.58
40	603062	麦加芯彩	34,068	2,126,891.08	0.57
41	601628	中国人寿	63,000	1,786,050.00	0.48
42	600028	中国石化	318,200	1,775,556.00	0.48
43	301525	儒竞科技	20,886	1,762,100.80	0.47
44	301272	英华特	30,729	1,669,036.66	0.45
45	300662	科锐国际	59,900	1,654,438.00	0.44
46	688702	盛科通信-U	31,920	1,625,792.16	0.44
47	688150	莱特光电	72,259	1,560,071.81	0.42
48	688682	霍莱沃	32,476	1,549,429.96	0.42
49	601985	中国核电	200,000	1,500,000.00	0.40
50	300938	信测标准	41,000	1,471,490.00	0.39
51	002572	索菲亚	87,100	1,389,245.00	0.37
52	688496	清越科技	59,802	1,338,966.78	0.36
53	688569	铁科轨道	41,256	1,139,078.16	0.31
54	688065	凯赛生物	20,000	1,099,600.00	0.29
55	300181	佐力药业	100,000	1,066,000.00	0.29
56	002236	大华股份	56,300	1,038,735.00	0.28
57	301269	华大九天	9,700	1,026,745.00	0.28
58	000898	鞍钢股份	400,000	996,000.00	0.27
59	301276	嘉曼服饰	40,000	975,200.00	0.26
60	301011	华立科技	40,950	958,230.00	0.26
61	301360	荣旗科技	10,000	936,000.00	0.25
62	688025	杰普特	10,000	925,500.00	0.25
63	601838	成都银行	79,900	899,674.00	0.24
64	002601	龙佰集团	50,000	856,500.00	0.23
65	300508	维宏股份	30,000	849,000.00	0.23

66	600760	中航沈飞	19,960	841,912.80	0.23
67	300796	贝斯美	50,000	805,000.00	0.22
68	605007	五洲特纸	50,000	735,500.00	0.20
69	689009	九号公司-WD	20,000	593,200.00	0.16
70	001326	联域股份	10,099	556,115.36	0.15
71	688347	华虹公司	9,583	403,060.98	0.11
72	688592	司南导航	5,000	259,500.00	0.07
73	002271	东方雨虹	13,400	257,280.00	0.07
74	688652	京仪装备	2,617	155,578.25	0.04
75	688720	艾森股份	1,644	97,348.14	0.03
76	688657	浩辰软件	886	72,651.21	0.02
77	301487	盟固利	867	35,512.32	0.01
78	301348	蓝箭电子	613	27,321.41	0.01
79	301526	国际复材	4,923	21,907.35	0.01
80	301421	波长光电	322	19,117.14	0.01
81	300904	威力传动	304	18,705.12	0.01
82	301377	鼎泰高科	770	18,210.50	0.00
83	301488	豪恩汽电	255	17,617.95	0.00
84	688627	精智达	200	17,544.00	0.00
85	301381	赛维时代	571	16,952.99	0.00
86	301172	君逸数码	438	16,714.08	0.00
87	301370	国科恒泰	1,043	16,698.43	0.00
88	688548	广钢气体	1,255	16,001.25	0.00
89	688549	中巨芯-U	1,902	15,387.18	0.00
90	688535	华海诚科	161	14,937.58	0.00
91	688563	航材股份	235	14,215.15	0.00
92	301510	固高科技	396	13,863.96	0.00
93	688507	索辰科技	101	13,811.75	0.00
94	301317	鑫磊股份	694	13,644.04	0.00
95	688591	泰凌微	484	13,561.68	0.00
96	688581	安杰思	107	13,354.67	0.00
97	688582	芯动联科	341	13,186.47	0.00
98	301566	达利凯普	576	12,752.64	0.00
99	688719	爱科赛博	205	12,645.98	0.00
100	301291	明阳电气	437	12,393.32	0.00
101	301361	众智科技	517	12,325.28	0.00
102	301419	阿莱德	330	12,243.00	0.00
103	301486	致尚科技	255	12,048.75	0.00
104	301507	民生健康	755	11,966.75	0.00
105	688458	美芯晟	154	11,851.84	0.00
106	301292	海科新源	583	11,281.05	0.00
107	301508	中机认检	419	11,178.92	0.00
108	603296	华勤技术	139	10,807.25	0.00

109	301251	威尔高	311	10,757.49	0.00
110	301499	维科精密	371	10,733.03	0.00
111	688603	天承科技	140	10,379.60	0.00
112	688653	康希通信	648	10,361.52	0.00
113	301528	多浦乐	148	10,198.68	0.00
114	301511	德福科技	449	10,178.83	0.00
115	301393	昊帆生物	171	10,152.27	0.00
116	301261	恒工精密	198	10,068.30	0.00
117	301202	朗威股份	306	9,730.80	0.00
118	301357	北方长龙	190	9,591.20	0.00
119	301498	乖宝宠物	247	9,586.07	0.00
120	301413	安培龙	164	9,543.16	0.00
121	301418	协昌科技	189	9,487.80	0.00
122	601096	宏盛华源	2,329	9,455.74	0.00
123	301329	信音电子	425	9,447.75	0.00
124	301516	中远通	604	9,368.04	0.00
125	688602	康鹏科技	823	9,102.38	0.00
126	301519	舜禹股份	442	8,932.82	0.00
127	301518	长华化学	385	8,858.85	0.00
128	301568	思泰克	246	8,752.68	0.00
129	688716	中研股份	235	8,551.65	0.00
130	301456	盘古智能	274	8,326.86	0.00
131	301459	丰茂股份	208	8,286.72	0.00
132	301373	凌玮科技	277	8,213.05	0.00
133	688573	信宇人	285	8,208.00	0.00
134	688651	盛邦安全	178	8,196.90	0.00
135	688638	誉辰智能	136	8,116.48	0.00
136	301578	辰奕智能	118	8,061.76	0.00
137	688646	逸飞激光	219	7,899.33	0.00
138	688671	碧兴物联	226	7,751.80	0.00
139	688693	锆威特	178	7,726.98	0.00
140	301533	威马农机	225	7,461.00	0.00
141	301555	惠柏新材	224	7,266.56	0.00
142	301371	敷尔佳	192	7,215.36	0.00
143	688479	友车科技	299	6,972.68	0.00
144	301505	苏州规划	194	6,947.14	0.00
145	301529	福赛科技	182	6,894.16	0.00
146	688612	威迈斯	175	6,644.75	0.00
147	301515	港通医疗	230	6,502.10	0.00
148	688648	中邮科技	303	6,493.29	0.00
149	603004	鼎龙科技	194	6,050.86	0.00
150	001378	德冠新材	193	6,035.11	0.00
151	688450	光格科技	153	5,572.26	0.00

152	601083	锦江航运	478	5,291.46	0.00
153	603270	金帝股份	177	5,235.66	0.00
154	603119	浙江荣泰	198	4,726.26	0.00
155	001306	夏厦精密	61	4,596.96	0.00
156	603107	上海汽配	218	3,965.42	0.00
157	001358	兴欣新材	87	3,841.92	0.00
158	603193	润本股份	229	3,815.14	0.00
159	001239	永达股份	189	3,764.88	0.00
160	603075	热威股份	154	3,589.74	0.00
161	603273	天元智能	178	3,376.66	0.00
162	603276	恒兴新材	134	3,333.92	0.00
163	603373	安邦护卫	88	3,058.00	0.00
164	603231	索宝蛋白	141	3,035.73	0.00
165	001324	长青科技	114	2,766.78	0.00
166	603137	恒尚节能	139	2,727.18	0.00
167	001367	海森药业	55	2,417.80	0.00
168	603172	万丰股份	122	2,150.86	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601939	建设银行	13,126,751.18	2.57
2	601988	中国银行	12,102,802.00	2.37
3	000651	格力电器	9,008,032.00	1.76
4	601288	农业银行	7,979,500.00	1.56
5	601318	中国平安	7,826,279.00	1.53
6	600707	彩虹股份	5,780,036.00	1.13
7	600266	城建发展	5,116,082.44	1.00
8	601628	中国人寿	5,093,100.00	1.00
9	002185	华天科技	5,089,569.00	1.00
10	002430	杭氧股份	5,080,925.00	0.99
11	688361	中科飞测-U	4,964,199.54	0.97
12	002540	亚太科技	4,865,430.00	0.95
13	601888	中国中免	4,729,789.00	0.93
14	603160	汇顶科技	4,590,469.00	0.90
15	601601	中国太保	4,582,657.94	0.90
16	601158	重庆水务	4,580,299.05	0.90
17	300938	信测标准	4,449,737.00	0.87
18	601139	深圳燃气	4,292,727.00	0.84
19	600030	中信证券	4,041,031.15	0.79
20	000717	中南股份	3,556,000.00	0.70

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

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601939	建设银行	12,544,930.00	2.46
2	601288	农业银行	11,126,000.00	2.18
3	601888	中国中免	8,496,869.00	1.66
4	601988	中国银行	8,451,185.00	1.65
5	300059	东方财富	8,145,329.60	1.59
6	688617	惠泰医疗	6,131,278.75	1.20
7	688687	凯因科技	6,094,710.13	1.19
8	688017	绿的谐波	5,996,647.30	1.17
9	300181	佐力药业	5,878,370.00	1.15
10	688536	思瑞浦	5,862,120.59	1.15
11	688498	源杰科技	5,682,165.73	1.11
12	301363	美好医疗	5,469,453.46	1.07
13	601128	常熟银行	5,329,251.00	1.04
14	688052	纳芯微	5,317,998.51	1.04
15	603170	宝立食品	5,149,945.80	1.01
16	300014	亿纬锂能	5,137,934.00	1.01
17	300015	爱尔眼科	5,051,536.61	0.99
18	300938	信测标准	4,760,263.50	0.93
19	688316	青云科技-U	4,693,129.92	0.92
20	300786	国林科技	4,656,803.00	0.91

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

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	324,589,067.44
卖出股票收入（成交）总额	384,676,872.65

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

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	83,571,389.15	22.41
	其中：政策性金融债	30,599,360.66	8.21
4	企业债券	96,643,158.08	25.92

5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	3,229,976.71	0.87
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	183,444,523.94	49.20

## 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	230301	23 进出 01	300,000	30,599,360.66	8.21
2	111106	21SZMC05	300,000	30,355,734.25	8.14
3	175765	21 中证 04	200,000	20,516,893.15	5.50
4	149426	21 南网 02	200,000	20,484,394.52	5.49
5	155566	19 中交 G2	200,000	20,430,703.56	5.48

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

注：无。

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

注：无。

## 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：无。

## 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目标，在风险可控的前提下，投资国债期货。本基金将充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现委托财产的长期稳定增值。

### 8.11.2 本期国债期货投资评价

无。



## 8.12 投资组合报告附注

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

国泰君安证券股份有限公司在报告编制日前一年内受到中国人民银行上海市分行的处罚。  
中国交通建设股份有限公司在报告编制日前一年内受到国家外汇管理局北京外汇管理部的处罚。  
中信证券股份有限公司在报告编制日前一年内受到中国人民银行的处罚。

以上证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

### 8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券备选库。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	37,225.63
2	应收清算款	2,084,134.00
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	15,060.48
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,136,420.11

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110059	浦发转债	3,229,976.71	0.87

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构	
		机构投资者	个人投资者

		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
18,250	14,380.21	5,698,936.49	2.17	256,739,949.62	97.83

## 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	厦门鑫然能源开发有限公司	4,000,000.00	8.53
2	温韞	649,580.00	1.39
3	陈福梅	616,513.00	1.31
4	朱文霞	550,000.00	1.17
5	叶士旻	487,335.00	1.04
6	陆洋	449,184.00	0.96
7	李菁	392,177.00	0.84
8	贾敏	355,694.00	0.76
9	冯晨华	324,790.00	0.69
9	王碧秋	324,790.00	0.69
9	浙江大众进出口有限公司	324,790.00	0.69

注：持有人为场内持有人。

## 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	208,387.64	0.0794

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

## 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

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

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

注：无。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2019年6月10日)	988,941,407.16
----------------------	----------------

基金份额总额	
本报告期期初基金份额总额	345,446,216.60
本报告期基金总申购份额	2,841,820.75
减：本报告期基金总赎回份额	85,849,151.24
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	262,438,886.11

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

无。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的，与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

未改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未改聘为本基金审计的会计师事务所。本年度应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用 50,000.00 元，该审计机构已提供审计服务的年限为 5 年。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：无。

#### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：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。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	

长江证券	1	153,205,295.02	22.11	143,087.28	22.51	-
广发证券	1	151,659,979.08	21.88	141,294.81	22.23	-
兴业证券	1	92,744,792.26	13.38	85,607.92	13.47	-
国信证券	2	65,978,178.22	9.52	61,216.07	9.63	-
中金公司	1	57,886,478.79	8.35	54,397.16	8.56	-
国元证券	1	48,007,255.43	6.93	39,428.68	6.20	-
华西证券	2	40,753,374.80	5.88	33,772.60	5.31	-
国泰君安	2	32,916,725.90	4.75	30,515.63	4.80	-
招商证券	2	23,879,600.39	3.45	22,112.43	3.48	-
海通证券	2	20,716,953.23	2.99	19,293.77	3.04	本报告期新增1个
中信建投证券	1	5,255,070.51	0.76	4,893.98	0.77	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券	3	-	-	-	-	本报告期新增1个
西部证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	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。

## 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
长江证券	3,177,200.00	3.77	582,400,000.00	16.96	-	-
广发证券	-	-	451,200,000.00	13.14	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	22,142,394.00	26.30	427,610,000.00	12.46	-	-
中金公司	-	-	468,600,000.00	13.65	-	-
国元证券	-	-	16,000,000.00	0.47	-	-
华西证券	-	-	105,600,000.00	3.08	-	-
国泰君安	-	-	188,000,000.00	5.48	-	-
招商证券	-	-	401,800,000.00	11.70	-	-
海通证券	-	-	530,000,000.00	15.44	-	-
中信建	338,472.93	0.40	261,800,000.00	7.63	-	-

投证券			00			
东吴证 券	-	-	-	-	-	-
高华证 券	58,537,780. 00	69.53	-	-	-	-
华鑫证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源证券	-	-	-	-	-	-
西部证 券	-	-	-	-	-	-
湘财证 券	-	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023年01月04日
2	关于调整旗下部分基金参与中国工商银行股份有限公司申购、定期定额申购费率优惠活动时间的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023年01月05日
3	鹏华创新动力灵活配置混合型证券投资基金(LOF)2022年第4季度报告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023年01月20日
4	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	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023年02月10日
5	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与东方财富证券股份有限公司申购(含定期定额投资)费率优惠活动的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023年03月14日
6	鹏华创新动力灵活配置混合型证券投资基金(LOF)2022年年度报告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023年03月30日
7	鹏华基金管理有限公司关于新增人民币直销资金专户的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023年04月07日
8	鹏华创新动力灵活配置混合型证券投资基金(LOF)2023年第1季度报告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023年04月21日
9	鹏华创新动力灵活配置混合型证券投	《上海证券报》、基金管	2023年05月12日

	资基金（LOF）更新的招募说明书	理人网站及中国证监会 基金电子披露网站	
10	鹏华创新动力灵活配置混合型证券投资 基金（LOF）基金产品资料概要（更 新）	《上海证券报》、基金管 理人网站及中国证监会 基金电子披露网站	2023年05月12日
11	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	《上海证券报》、基金管 理人网站及中国证监会 基金电子披露网站	2023年05月17日
12	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金 持有的股票估值方法变更的提示性公 告	《上海证券报》、基金管 理人网站及中国证监会 基金电子披露网站	2023年05月19日
13	鹏华基金管理有限公司关于注意防范 以协助办理贷款为借口进行诈骗活动 的风险提示	《上海证券报》、基金管 理人网站及中国证监会 基金电子披露网站	2023年06月03日
14	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分 基金参与国海证券股份有限公司申购 （含定期定额投资）费率优惠活动的 公告	《上海证券报》、基金管 理人网站及中国证监会 基金电子披露网站	2023年06月05日
15	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金 持有的股票停牌后估值方法变更的提 示性公告	《上海证券报》、基金管 理人网站及中国证监会 基金电子披露网站	2023年06月06日
16	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分 基金参与北京中植基金销售有限公司申 购（含定期定额投资）费率优惠活 动的公告	《上海证券报》、基金管 理人网站及中国证监会 基金电子披露网站	2023年06月20日
17	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	《上海证券报》、基金管 理人网站及中国证监会 基金电子披露网站	2023年06月28日
18	鹏华创新动力灵活配置混合型证券投 资基金（LOF）基金合同	《上海证券报》、基金管 理人网站及中国证监会 基金电子披露网站	2023年07月08日
19	鹏华创新动力灵活配置混合型证券投 资基金（LOF）托管协议	《上海证券报》、基金管 理人网站及中国证监会 基金电子披露网站	2023年07月08日
20	鹏华基金管理有限公司关于调低旗下 部分基金费率并修订基金合同的公告	《上海证券报》、基金管 理人网站及中国证监会 基金电子披露网站	2023年07月08日
21	鹏华创新动力灵活配置混合型证券投 资基金(LOF)更新的招募说明书(2023 年第1号)	《上海证券报》、基金管 理人网站及中国证监会 基金电子披露网站	2023年07月12日
22	鹏华创新动力灵活配置混合型证券投 资基金（LOF）基金产品资料概要（更 新）	《上海证券报》、基金管 理人网站及中国证监会 基金电子披露网站	2023年07月12日
23	鹏华创新动力灵活配置混合型证券投	《上海证券报》、基金管	2023年07月20日

	资基金 (LOF) 2023 年第 2 季度报告	理人网站及中国证监会 基金电子披露网站	
24	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与部分销售机构申购 (含定期定额投资) 费率优惠活动的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会 基金电子披露网站	2023 年 08 月 07 日
25	鹏华基金管理有限公司关于运用固有资金投资旗下基金的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会 基金电子披露网站	2023 年 08 月 21 日
26	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会 基金电子披露网站	2023 年 08 月 22 日
27	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购金帝股份首次公开发行 A 股的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会 基金电子披露网站	2023 年 08 月 26 日
28	鹏华创新动力灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 2023 年中期报告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会 基金电子披露网站	2023 年 08 月 30 日
29	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与国金证券股份有限公司申购 (含定期定额投资) 费率优惠活动的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会 基金电子披露网站	2023 年 09 月 27 日
30	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会 基金电子披露网站	2023 年 10 月 13 日
31	鹏华创新动力灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 2023 年第 3 季度报告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会 基金电子披露网站	2023 年 10 月 24 日
32	鹏华基金管理有限公司关于运用固有资金投资旗下基金的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会 基金电子披露网站	2023 年 11 月 07 日
33	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与南京证券股份有限公司申购 (含定期定额投资) 费率优惠活动的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会 基金电子披露网站	2023 年 11 月 16 日

注：无。

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

注：无。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。



## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- (一)《鹏华创新动力灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 基金合同》；
- (二)《鹏华创新动力灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 托管协议》；
- (三)《鹏华创新动力灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 2023 年年度报告》(原文)。

### 13.2 存放地点

深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层鹏华基金管理有限公司。

### 13.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅，也可按工本费购买复印件，或通过本基金管理人网站 (<http://www.phfund.com.cn>) 查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人鹏华基金管理有限公司，本公司已开通客户服务系统，咨询电话：4006788999。

鹏华基金管理有限公司

2024 年 3 月 28 日