

鹏华养老目标日期 2035 三年持有期混合型  
基金中基金 (FOF)  
2021 年第 2 季度报告

2021 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 7 月 20 日

## § 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 07 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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 2021 年 04 月 01 日起至 2021 年 06 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	鹏华养老 2035 混合 (F0F)
基金主代码	006296
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 12 月 5 日
报告期末基金份额总额	402,144,333.21 份
投资目标	在严格控制风险的前提下，通过科学的大类资产配置，优选基金力争实现基金资产的稳健增值，为投资者提供稳健的养老理财工具。
投资策略	本基金的投资策略包含目标日期投资策略和基金优选投资策略。在严格的风险管理的基础上，科学的灵活配置各类资产，力争实现资产的稳健增值，为投资者提供一种稳健的养老理财工具。目标日期投资策略是指，随着投资人生命周期的延续和投资目标期限的临近，基金的投资风格相应的从“进取”，转变为“稳健”，高风险资产投资比例逐步下降，而低风险资产比例逐步上升。基金优选投资策略是指，通过优选基金的投资策略聚焦大类资产配置，来获得各类资产的收益，同时避免投资高估值资产，实现基金长期较高的收益风险比。1、目标日期投资策略 目标日期投资策略核心是规划各类资产配置的下滑路径 (Glide Path)。下滑路径是为目标日期基金设计的一种优化的资产配置比例路径。基金早期更多地配置权益类基金、股票等高风险资产，随着目标日期逐步接近，基金开始配置债券型基金、货币类基金等具有稳定收益特点资产；另外，为了达到投资组合的分散化，在科学严谨的风险评估的基础上，对大宗商品类资产进行配置。(1) 下滑路径 下滑路径的设计理念基于两个原则，一是从长期维度上

看, 权益资产体现出稳定的风险溢价; 二是随着年龄的增大, 人力资本逐步贬值, 风险承受能力逐渐降低。本基金以实现养老金财富稳健增值为目标, 基于谨慎的长期资本市场假设, 综合考虑投资者养老金替代率缺口、预期寿命、定投比例以及生命周期上的风险偏好特征等因素, 最终得到权益投资比例随投资者年龄增大而逐渐下滑的资产配置路径, 即“下滑路径”。下滑路径是资产配置在时间轴上的动态规划。基金的下滑路径初始设计完毕后, 会根据资本市场资产变化情况实时监控配置的有效性, 结合战术资产配置方法最终确定调整方式与比例。本基金将在招募说明书及更新招募说明书中披露预设下滑路径及权益类资产比例中枢值。

(2) 战术资产配置 战术资产配置的重点有两方面: 大类资产配置和大类资产下的子类资产配置。大类资产配置, 即确定不同经济周期下各大类资产的最优配置比例。全面分析研究全球经济和中国经济的周期变化, 包括主要经济体货币政策、发达国家和发展中国家经济发展对比、中国经济宏观周期、中国货币政策、财政政策、产业政策等。在此基础上, 确定权益类、固定收益类资产、商品类资产、另类资产的理论最优配置。大类资产下的子类资产配置。在权益资产中, 深入研究分析不同的行业、主题、风格等; 在固定收益资产中, 深入研究分析不同的利率债、信用债、可转债、可交换债等资产; 在商品类资产中, 深入研究分析不同的贵金属、能源、农产品等资产。在大类资产配置完成后, 对各个子类资产进行资产配置, 达到进一步优化被动资产配置的效果。

2、基金优选投资策略 在做好资产配置比例分配后, 本基金将通过甄选各类资产中优秀的基金来实现大类资产配置的理念。基金优选投资策略基于科学严谨的评价体系, 从定量和定性两大维度展开, 对基金及基金公司做出综合性评价。对基金的评价包括风格评价和业绩评价两方面, 重点衡量基金风格是否清晰稳定、中长期业绩及风险控制能力是否良好; 对基金公司的评价则主要对其综合实力、管理水平、运作合规等进行综合评判。基于上述评价体系, 最终挑选出风格清晰稳定、长期收益风险比较高的基金, 在获得资产收益的同时, 力争获得主动管理带来的超额收益, 从而实现基金资产的稳定增值。

(1) 基金业绩评价和风格评价 鹏华基金基金业绩评价体系在传统的基金三级分类基础上, 为深入比较并归因不同风格和类型的基金, 将基金分类扩展至第四层级, 有利于基金中基金建立以资产配置为核心的基金投资方式。本基金将以具体的基金为对象进行评价, 并对各基金进行评级和排序。考虑的主要因素包括: 基金的获利能力: 基金与其业绩比较基准的历史回报对比, 绩效指标分析(如期间净值增长率、累计净值增长率、分红率等), 风险调整后的绩效指标分析(如 Sharpe 比率、Treyner 指标和 Jensen 指标等); 基金的风险衡量: 主要考察基金净值波动率、最大回撤、风格偏离等维度。基金的风格: 基于合同契约和实际比较基准的拟合等考察基金风格是否清晰。

(2) 基金公司综合评价 对于基金公司的综合评价, 将主要从综合实力、管理水平、运作合规等方面进行评价分析, 依据主要来自于调研、公司刊物和公开信息。考虑的主要因素包括: 综合实力: 主要包括基金公司的总资产、总资产增长率和加权净值收益率; 管理水平:

	<p>主要包括发起人构成、风险控制机制、高级管理人员素质、基金经理的稳定性及从业经验等、研究人员的稳定性及从业经验等。 运作合规：主要考察基金管理人或基金经理近 2 年来运作合规情况。 本基金将依据基金评价结果和基金管理公司评价结果，挑选出进入基金备选库的基金名单，按照管理人有关基金池的构建流程，构建备选基金池。</p> <p>3、股票投资策略 本基金通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘 A 股和港股的优质的公司，构建股票投资组合。核心思路在于：1) 自上而下地分析行业的成长前景、行业结构、商业模式、竞争要素等分析把握其投资机会；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。 本基金还将关注以下几类港股通标的：1) 在港股市场上市、具有行业代表性的优质中资公司；2) 具有行业稀缺性的香港本地和外资公司；3) 港股市场在行业结构、估值、AH 股折溢价、分红率等方面具有吸引力的投资标的。 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>4、债券投资策略 本基金债券投资将采取久期策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、个券选择策略、信用策略等积极投资策略，自上而下地管理组合的久期，灵活地调整组合的券种搭配，同时精选个券，以增强组合的持有期收益。</p> <p>5、权证投资策略 本基金通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型及价值挖掘策略、价差策略、双向权证策略等寻求权证的合理估值水平，追求稳定的当期收益。</p> <p>6、中小企业私募债投资策略 本基金将深入研究发行人资信及公司运营情况，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>7、资产支持证券的投资策略 本基金将综合运用战略资产配置和战术资产配置进行资产支持证券的投资组合管理，并根据信用风险、利率风险和流动性风险变化积极调整投资策略，严格遵守法律法规和基金合同的约定，在保证本金安全和基金资产流动性的基础上获得稳定收益。</p>
业绩比较基准	<p>时间段 业绩比较基准 基金合同生效日-2020.12.31 中证 800 指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%</p> <p>2021.01.01-2023.12.31 中证 800 指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%</p> <p>2024.01.01-2026.12.31 中证 800 指数收益率×58%+中证全债指数收益率×42%</p> <p>2027.01.01-2029.12.31 中证 800 指数收益率×54%+中证全债指数收益率×46%</p> <p>2030.01.01-2032.12.31 中证 800 指数收益率×45%+中证全债指数收益率×55%</p> <p>2033.01.01-2035.12.31 中证 800 指数收益率×32%+中证全债指数收益率×68%</p>
风险收益特征	<p>本基金为混合型基金中基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金、股票型基金中基金，高于债券型基金、债券型基金中基金、货币市场基金及货币型基金中基金。本基金采用目标日期投资策略，随着所设定目标日期的临近，将逐步降低权益类资产的配置比例，风险</p>

	与收益水平会随着目标日期的临近而逐步降低。本基金将投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及香港证券市场的风险。
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

注：无。

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2021年4月1日-2021年6月30日）
1. 本期已实现收益	22,051,916.08
2. 本期利润	35,302,271.75
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0882
4. 期末基金资产净值	575,567,034.77
5. 期末基金份额净值	1.4312

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。

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。

#### 3.2 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	净值增长率 ①	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	6.56%	0.75%	3.38%	0.53%	3.18%	0.22%
过去六个月	2.13%	0.95%	2.17%	0.73%	-0.04%	0.22%
过去一年	12.29%	0.88%	15.12%	0.77%	-2.83%	0.11%
自基金合同 生效起至今	43.12%	0.68%	39.01%	0.79%	4.11%	-0.11%

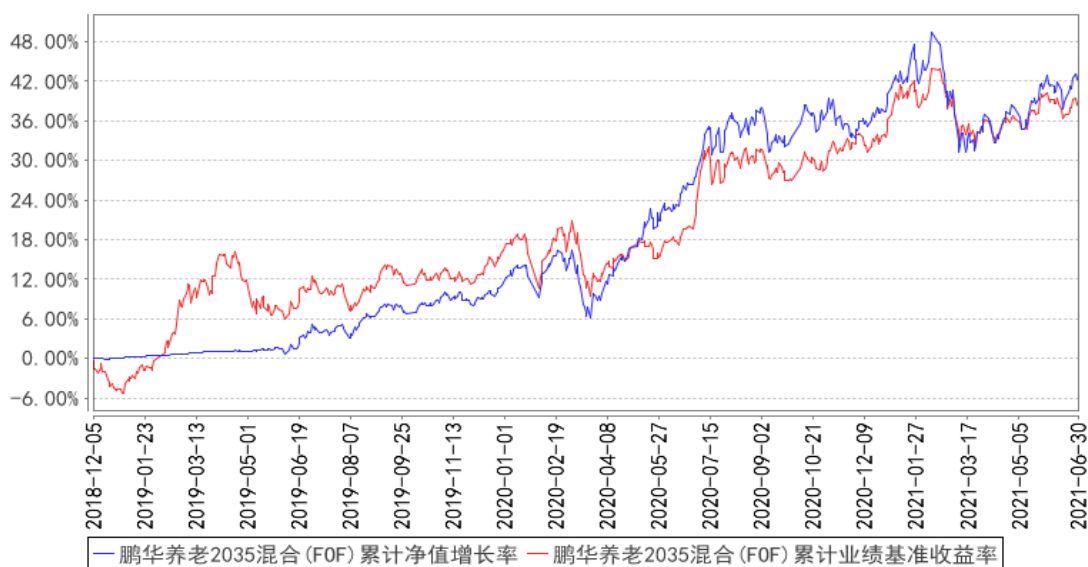
注：业绩比较基准=时间段 业绩比较基准 基金合同生效日-2020.12.31 中证 800 指数收益率 ×60%+中证全债指数收益率×40% 2021.01.01-2023.12.31 中证 800 指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40% 2024.01.01-2026.12.31 中证 800 指数收益率×58%+中证全债指数收益率×42% 2027.01.01-2029.12.31 中证 800 指数收益率×54%+中证全债指数收益率×

46% 2030.01.01-2032.12.31 中证 800 指数收益率×45%+中证全债指数收益率×

55% 2033.01.01-2035.12.31 中证 800 指数收益率×32%+中证全债指数收益率×68%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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

鹏华养老2035混合 (FOF) 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2018 年 12 月 05 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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
赵强	基金经理	2021-01-02	-	8 年	赵强先生，国籍中国，工商管理硕士，8 年证券从业经验。曾任金实国际公司创始人、总经理；2013 年 9 月加盟鹏华基金管理有限公司，曾任国际业务部投资经理，现任资产配置与基金投资部 FOF 投资副总监、投资决策委员会成员、基金经理。2019 年 04 月至今担任鹏华养老目标日期 2045 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 基金经理，2020 年 07 月至今担任鹏华聚合多资产 3 个月持有期混合型基

					金中基金 (FOF) 基金经理, 2021 年 01 月至今担任鹏华养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金 (FOF) 基金经理, 2021 年 01 月至今担任鹏华长乐稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 基金经理, 赵强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。

#### 4.1.1 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 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行公平交易制度，确保不同投资组合在研究、交易、分配等各环节得到公平对待。

##### 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% 的交易次数为 2 次，主要原因在于指数基金成份股交易不活跃导致。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

本基金的长期目标是在严格控制风险的前提下，为投资者提供稳健的养老理财工具。在基金服务于长期养老的目标指引下，本基金的投资策略主要是资产配置策略和基金投资策略，即在严格控制风险的前提下，通过资产配置，优选基金力争实现基金资产的稳健增值。

在报告期内，本基金在兼顾安全的基础上从资产配置和标的优选两方面优化本基金的收益。2020

年二季度，海外新冠疫情继续得到控制，随着疫苗注射进程的加快，主要国家和地区疫情得到了控制，经济复苏逐步展开。美国总统拜登就任后积极推进财政刺激，经济基本面继续向好。而在流动性方面，全球资产定价的锚美国十年期国债继一季度急速上升后，在二季度受到了遏制，重新跌回了 1.5 以下的区间。美联储预期管理继续引导宽松的政策指向，所以总体外围市场良好，海外主要指数继续创历史新高。国内经济继续弱复苏，但在市场流动性收紧的担忧下，权益资产出现了结构性分化。随着股市估值压缩，结合中国较好的经济基本面，权益市场进入了盘整并不断通过业绩增长消化估值的阶段。本基金以长期养老目标为主旨，我们将在市场错杀恐慌时逐步加大权益投资比例，为客户实现长期良好的养老体验。

#### 4.5 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 6.56%，同期业绩比较基准增长率为 3.38%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

### § 5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	85,651,883.49	13.51
	其中：股票	85,651,883.49	13.51
2	基金投资	504,208,934.49	79.54
3	固定收益投资	35,424,380.00	5.59
	其中：债券	35,424,380.00	5.59
	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	7,198,890.57	1.14
8	其他资产	1,397,475.91	0.22
9	合计	633,881,564.46	100.00

注：本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 8,066,516.35 元，占净值比 1.40%。

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合



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	54,204.72	0.01
B	采矿业	-	-
C	制造业	43,023,713.13	7.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	48,347.29	0.01
E	建筑业	25,371.37	0.00
F	批发和零售业	17,939.46	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	26,235,075.05	4.56
J	金融业	34,721.10	0.01
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	8,132,710.00	1.41
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	13,285.02	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	77,585,367.14	13.48

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值 (人民币)	占基金资产净值比例 (%)
能源	-	-
原材料	-	-
工业	-	-
非日常生活消费品	-	-
日常消费品	-	-
医疗保健	-	-
金融	-	-
信息技术	-	-
通信服务	8,066,516.35	1.40
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	8,066,516.35	1.40

注：以上分类采用全球行业分类标准 (GICS)。

### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	300463	迈克生物	270,900	11,402,181.00	1.98
2	300866	安克创新	55,700	9,328,079.00	1.62
3	601888	中国中免	27,100	8,132,710.00	1.41
4	00700	腾讯控股	16,600	8,066,516.35	1.40
5	300348	长亮科技	409,650	7,496,595.00	1.30
6	300792	壹网壹创	143,122	7,303,515.66	1.27
7	300702	天宇股份	193,874	6,867,017.08	1.19
8	300433	蓝思科技	207,000	6,087,870.00	1.06
9	300525	博思软件	323,821	5,747,822.75	1.00
10	300454	深信服	21,800	5,656,664.00	0.98

### 5.3.2 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资明细

注：无。

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	24,618,850.00	4.28
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债 (可交换债)	10,805,530.00	1.88
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	35,424,380.00	6.15

### 5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	019640	20 国债 10	211,170	21,117,000.00	3.67
2	127015	希望转债	50,000	5,442,000.00	0.95
3	113042	上银转债	30,000	3,068,400.00	0.53
4	132018	G 三峡 EB1	17,750	2,132,130.00	0.37
5	019649	21 国债 01	20,000	2,001,400.00	0.35

### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资

## 明细

注：无。

### 5.7 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。

### 5.8 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权证投资明细

注：无。

### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

#### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 5.10.1 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。

#### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

#### 5.10.3 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。

### 5.11 投资组合报告附注

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

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

#### 5.11.2 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。

#### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	30,084.89
2	应收证券清算款	649,499.40
3	应收股利	17.54
4	应收利息	477,663.46
5	应收申购款	240,210.62
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,397,475.91

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	127015	希望转债	5,442,000.00	0.95
2	132018	G 三峡 EB1	2,132,130.00	0.37

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

#### 5.11.6 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。

## §6 基金中基金

#### 6.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	001222	鹏华外延成长混合	契约型开放式	16,940,268.12	43,350,146.12	7.53	是
2	511260	上证 10 年期国债 ETF	交易型开放式(ETF)	336,900.00	37,975,368.00	6.60	否
3	206009	鹏华新兴产业混合	契约型开放式	9,321,754.46	35,870,111.16	6.23	是
4	160621	鹏华丰和债券(LOF)A	上市契约型开放式(LOF)	24,436,429.82	34,137,692.46	5.93	是
5	003095	中欧医疗健康混合 A	契约型开放式	7,767,578.86	32,732,577.32	5.69	否

6	000297	鹏华可转债 债券 A	契约型开放 式	18,927,830.51	28,126,756.14	4.89	是
7	000054	鹏华双债增 利债券	契约型开放 式	20,481,344.55	27,807,521.50	4.83	是
8	206003	鹏华信用增 利 A	契约型开放 式	18,810,698.34	25,093,471.59	4.36	是
9	630109	华商稳定增 利债券 C	契约型开放 式	13,525,537.65	23,088,092.77	4.01	否
10	002158	汇添富安鑫 智选混合 C	契约型开放 式	10,330,578.51	17,324,380.16	3.01	否

## 6.2 当期交易及持有基金产生的费用

项目	本期费用 2021 年 4 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	其中：交易及持有基金管理人 以及管理人关联方所管理基 金产生的费用
当期交易基金产生的申购费(元)	2,000.00	-
当期交易基金产生的赎回费(元)	185,524.23	17,276.70
当期持有基金产生的应支付销售 服务费(元)	39,205.57	-
当期持有基金产生的应支付管理 费(元)	1,225,346.16	655,124.27
当期持有基金产生的应支付托管 费(元)	243,435.62	128,850.80
当期交易基金产生的转换费(元)	92,505.54	-

## 6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本报告期内，广发沪港深新机遇股票型证券投资基金基金经理变更，离任基金经理余昊。
---

注：无

## § 7 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	398,443,507.06
报告期期间基金总申购份额	3,700,826.15
减：报告期期间基金总赎回份额	-
报告期期间基金拆分变动份额（份额减 少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	402,144,333.21

## § 8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 8.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：无。

## 8.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：无。

## § 9 影响投资者决策的其他重要信息

### 9.1 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。

### 9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

- (一) 《鹏华养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金 (FOF) 基金合同》；
- (二) 《鹏华养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金 (FOF) 托管协议》；
- (三) 《鹏华养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金 (FOF) 2021 年第 2 季度报告》（原文）。

### 10.2 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。

### 10.3 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

2021 年 7 月 20 日