

鹏华聚合多资产 3 个月持有期混合型基金
中基金（FOF）
2021 年第 3 季度报告

2021 年 9 月 30 日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：华夏银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 10 月 26 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。

基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年10月25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07月01日起至2021年09月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	鹏华聚合多资产混合（FOF）
基金主代码	009787
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020年7月21日
报告期末基金份额总额	794,166,569.59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。
投资策略	本基金通过合理判断市场走势，合理配置基金、股票、债券等投资工具的比例，通过定量和定性相结合的方法精选具有不同风险收益特征的基金，力争实现基金资产的稳健增值。 1、资产配置策略 在资产配置上，本基金将结合产品定位、风险收益特征以及管理人的长期资本市场观点确定基金的资产配置方案。 首先，管理人将根据基金业绩基准确定产品的风险收益特征。 其次，本基金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。 最后，结合本基金以及各资产类别的风险收益特征，并依据现代投资组合理论，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。 本基金将密切关注市场风险的变化以及各资产类别的风险收益的相对变化趋势，在业绩比较基准所确定的产品风险收益特征基础上，以收益风险比最大化为原则，通过定性方式适度调整本

基金的资产配置比例。原则上，管理人参考公司投资决策委员会对大类资产进行评估，检视大类资产的市场展望和中长期资本市场观点是否发生改变，根据评估情况决定是否进行资产配置的动态再平衡。当资本市场发生重大变化且管理人认为将影响各类资产的预期时，管理人将根据实际情况调整资产配置比例。

2、基金投资策略 在完成资产配置以后，本基金将主要通过优选基金实践资产配置的策略。基金优选策略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；对基金公司的评价主要从综合实力、管理水平、运作合规等方面进行分析。

（1）基金业绩评价和风格评价 基于投资范围、投资策略以及实际投资组合等维度，对基金进行分类。本基金以同类基金为对象进行评价，并对各类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：基于合同约定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，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：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，挑选出基础库，并在基础库基础上，依据基金管理公司评价结果及基金评价深度报告、尽调报告等，构建优先库。在基础库和优先库中优选标的，构建本基金组合基金库。基金库将进行定期维护和不定期维护，按照出库入库标准，实现基金库的动态调整。

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。

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。

5、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。未来，如果港股通业务规则发生变化或出现法律法规或监管部门允许投资的其他模式，基金管理人可相应调整，不需召开基金份额持有人大会。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并公告。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率*15%+恒生中国企业指数收益率*5%(经汇率估值调整) +中债综合财富指数收益率*80%
风险收益特征	本基金为混合型基金中基金(FOF)，其预期风险水平高于债券型基金、债券型基金中基金、货币市场基金和货币型基金中基金，但低于股票型基金、股票型基金中基金。本基金将投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	华夏银行股份有限公司

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7月1日-2021年9月30日）
1. 本期已实现收益	-4,157,774.76
2. 本期利润	-2,698,231.54
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0045
4. 期末基金资产净值	886,041,585.20
5. 期末基金份额净值	1.1157

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

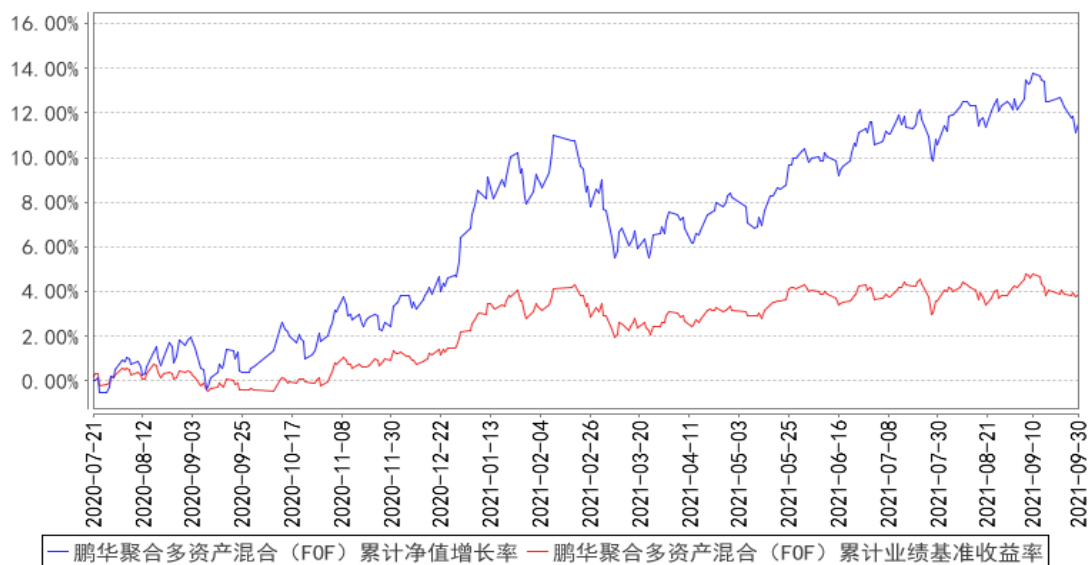
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④

过去三个月	-0.04%	0.39%	-0.26%	0.23%	0.22%	0.16%
过去六个月	4.66%	0.36%	1.23%	0.20%	3.43%	0.16%
过去一年	10.86%	0.43%	4.93%	0.22%	5.93%	0.21%
自基金合同 生效起至今	11.57%	0.42%	3.89%	0.22%	7.68%	0.20%

注：业绩比较基准=中证 800 指数收益率*15%+恒生中国企业指数收益率*5%（经汇率估值调整）+中债综合财富指数收益率*80%

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

鹏华聚合多资产混合（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 2020 年 07 月 21 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	2020-07-21	-	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, 2021 年 08 月至今担任鹏华长治稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金 (FOF) 基金经理, 2021 年 09 月至今担任鹏华精选群英一年持有期灵活配置混合型管理人中管理人 (MOM) 证券投资基金基金经理, 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

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。2021年三季度，全球和中国的经济基本面逐步显示出滞胀的特点，即上游资源品的涨价和经济的下行。虽然美国总统拜登就任后积极推进财政刺激，美国三季度上市公司盈利预期强劲，但未来的经济基本面数据已经开始疲软。在中国，滞胀的特点就更为明显，商品在传统产业供给端压缩以及在新兴产业的局部旺盛需求下，都出现了加速上扬的情形。与此同时，经济数据却一直向下还没有见底的迹象。在滞胀的大背景下，权益总体优于固收，而权益中资产也出现了结构性分化，即受制于宏观经济的大消费板块在整个三季度表现较弱，而新兴产业则由于局部景气，表现出较好的走势。我们在配置时资产以偏债混合基金为主，权益资产内部以成长板块为重点配置对象。

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-0.04%，同期业绩比较基准增长率为-0.26%。

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	26,913,824.49	2.97
	其中：股票	26,913,824.49	2.97
2	基金投资	735,607,277.12	81.18
3	固定收益投资	43,169,408.20	4.76
	其中：债券	43,169,408.20	4.76
	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	76,800,000.00	8.48
	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	23,038,466.73	2.54

8	其他资产	566,399.03	0.06
9	合计	906,095,375.57	100.00

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	-	-
B	采矿业	10,590.00	0.00
C	制造业	19,305,236.82	2.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	2,296.53	0.00
F	批发和零售业	-	-
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	2,572,717.82	0.29
J	金融业	2,870,605.00	0.32
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,400,064.00	0.16
M	科学研究和技术服务业	752,314.32	0.08
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	26,913,824.49	3.04

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

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	600036	招商银行	56,900	2,870,605.00	0.32
2	688536	思瑞浦	3,566	2,275,500.26	0.26
3	600096	云天化	88,600	2,151,208.00	0.24
4	600171	上海贝岭	44,900	1,606,522.00	0.18
5	600966	博汇纸业	133,000	1,525,510.00	0.17

6	688301	奕瑞科技	3,544	1,484,227.20	0.17
7	600176	中国巨石	82,000	1,441,560.00	0.16
8	600057	厦门象屿	182,300	1,400,064.00	0.16
9	688516	奥特维	6,841	1,311,966.98	0.15
10	600500	中化国际	133,400	1,291,312.00	0.15

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	40,051,008.00	4.52
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,822,680.00	0.32
	其中：政策性金融债	2,822,680.00	0.32
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）	295,720.20	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	43,169,408.20	4.87

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	019649	21 国债 01	170,100	17,023,608.00	1.92
2	019641	20 国债 11	100,000	10,025,000.00	1.13
3	019654	21 国债 06	100,000	10,009,000.00	1.13
4	019658	21 国债 10	30,000	2,993,400.00	0.34
5	018006	国开 1702	28,000	2,822,680.00	0.32

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

国家开发银行

国家开发银行旗下分支机构在报告期内受到中国银行保险监督管理委员会大连监管局、陕西监管局、浙江监管局、国家外汇管理局广西壮族自治区分局、海南省分局和中国人民银行南宁中心支行的行政处罚。

2020年12月25日，中国银行保险监督管理委员会对国家开发银行的以下违法违规行为一、为违规的政府购买服务项目提供融资，二、项目资本金管理不到位，棚改贷款项目存在资本金违规抽回情况，三、违规变相发放土地储备贷款，四、设置不合理存款考核要求，以贷转存，虚增存款，五、贷款风险分类不准确，六、向资产管理公司以外的主体批量转让不良信贷资产，七、违规进行信贷资产拆分转让，隐匿信贷资产质量，八、向棚改业务代理结算行强制搭售低收益理财产品，九、扶贫贷款存贷挂钩，十、易地扶贫搬迁贷款“三查”不尽职，部分贷款资金未真正用于扶贫搬迁，十一、未落实同业业务交易对手名单制监管要求，十二、以贷款方式向金融租赁公司提供

同业融资，未纳入同业借款业务管理，十三、以协定存款方式吸收同业存款，未纳入同业存款业务管理，十四、风险隔离不到位，违规开展资金池理财业务，十五、未按规定向投资者充分披露理财产品投资非标准化债权资产情况，十六、逾期未整改，屡查屡犯，违规新增业务，十七、利用集团内部交易进行子公司间不良资产非洁净出表，十八、违规收取小微企业贷款承诺费，十九、收取财务顾问费质价不符，二十、利用银团贷款承诺费浮利分费，二十一、向检查组提供虚假整改说明材料，二十二、未如实提供信贷资产转让台账，二十三、案件信息迟报、瞒报，二十四、对以往监管检查中发现的国别风险管理问题整改不到位，对公司处以罚款 4880 万元。

2020 年 10 月 26 日，国家外汇管理局北京外汇管理部对国家开发银行违反银行交易记录管理规定的违法违规行为，对国家开发银行处以 60 万元人民币罚款，要求该行对直接负责的主管人员和其他直接责任人员给予处分。

招商银行股份有限公司

2021 年 5 月 21 日，中国银行保险监督管理委员会针对招商银行股份有限公司：

- 一、为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产
- 二、违规协助无衍生产品交易业务资格的银行发行结构性衍生产品
- 三、理财产品之间风险隔离不到位
- 四、理财资金投资非标准化债权资产认定不准确，实际余额超监管标准
- 五、同业投资接受第三方金融机构信用担保
- 六、理财资金池化运作
- 七、利用理财产品准备金调节收益
- 八、高净值客户认定不审慎
- 九、并表管理不到位，通过关联非银机构的内部交易，违规变相降低理财产品销售门槛
- 十、投资集合资金信托计划的理财产品未执行合格投资者标准
- 十一、投资集合资金信托计划人数超限
- 十二、面向不合格个人投资者销售投资高风险资产或权益性资产的理财产品
- 十三、信贷资产非真实转让
- 十四、全权委托业务不规范
- 十五、未按要求向监管机构报告理财投资合作机构，被监管否决后仍未及时停办业务
- 十六、通过关联机构引入非合格投资者，受让以本行信用卡债权设立的信托次级受益权
- 十七、“智能投资受托计划业务”通过其他方式规避整改，扩大业务规模，且业务数据和材料缺失

十八、票据转贴现假卖断屡查屡犯

十九、贷款、理财或同业投资资金违规投向土地储备项目

二十、理财资金违规提供棚改项目资本金融资，向地方政府提供融资并要求地方政府提供担保

二十一、同业投资、理财资金等违规投向地价款或四证不全的房地产项目

二十二、理财资金认购商业银行增发的股票

二十三、违规为企业发行短期融资券提供搭桥融资，并用理财产品投资本行主承债券以承接表内类信贷资产

二十四、为定制公募基金提供投资顾问

二十五、为本行承销债券兑付提供资金支持

二十六、协助发行人以非市场化的价格发行债券

二十七、瞒报案件信息

以上违法违规行为，对公司罚款 7170 万元。

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。

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	68,841.22
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	2,248.72
4	应收利息	495,309.09
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	566,399.03

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

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	511990	华宝添益货币 A	交易型开放式(ETF)	400,138.00	40,017,896.80	4.52	否
2	519766	交银荣鑫灵活配置混合	契约型开放式	25,244,011.69	33,953,195.72	3.83	否
3	001747	易方达瑞祺混合 I	契约型开放式	21,443,173.70	32,979,601.15	3.72	否
4	003186	鹏华兴安定期开放混合	契约型开放式	21,825,082.64	32,949,327.26	3.72	是
5	002087	国富新机遇混合 A	契约型开放式	18,898,389.21	29,991,743.68	3.38	否
6	005552	国富新趋势混合 A	契约型开放式	24,166,153.13	29,830,699.42	3.37	否
7	003502	金鹰鑫瑞混合 A	契约型开放式	21,339,708.95	29,028,406.08	3.28	否
8	004720	华夏睿磐泰茂混合 A	契约型开放式	22,541,929.67	28,837,890.63	3.25	否
9	004225	国寿安保稳诚混合 A	契约型开放式	24,512,840.28	27,880,904.53	3.15	否
10	003842	中邮景泰灵活配置混合 A	契约型开放式	22,624,426.84	27,615,375.40	3.12	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 7 月 1 日至 2021 年 9 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)	17,000.00	-
当期交易基金产生的赎回费(元)	53,119.14	-
当期持有基金产生的应支付销售服务费(元)	12,825.18	-

当期持有基金产生的应支付管理费（元）	914,771.02	255,298.06
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	214,265.43	50,156.33
当期交易基金产生的交易费用（元）	5,797.44	-

6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

<p>本报告期内</p> <p>1、信诚至远灵活配置混合型证券投资基金召开基金份额持有人大会。本次大会于2021年9月15日表决通过了《关于信诚至远灵活配置混合型证券投资基金修改基金合同的议案》，基金份额持有人大会的决议自该日起生效。基金名称由“信诚至远灵活配置混合型证券投资基金”变更为“中信保诚至远动力混合型证券投资基金”。提议调整基金的投资范围、投资策略、投资限制、管理费率以及修订《基金合同》等。自转型选择期结束之日的次日即2021年10月23日起，修订后的《中信保诚至远动力混合型证券投资基金基金合同》生效，《信诚至远灵活配置混合型证券投资基金基金合同》自同日起失效。</p> <p>2、2021年9月28日，上投摩根安裕回报混合型证券投资基金发布了以通讯开会方式召开基金份额持有人大会的公告，大会调整本基金管理费率 and 托管费率并相应修改《基金合同》。表决票收取时间：自2021年9月29日起，至2021年10月29日17:00止（以收到表决票的时间为准）。</p> <p>3、汇添富民丰回报混合型证券投资基金基金经理变更，离任基金经理李云鑫、叶盛、赵鹏飞，新任基金经理何彪。</p> <p>4、基金经理刘怡敏因休产假暂停履行职务，富兰克林国海焦点驱动灵活配置混合型证券投资基金由本公司基金经理王莉女士与该基金另外两名基金经理赵晓东先生和刘晓女士共同管理。</p>
--

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	527,490,797.11
报告期期间基金总申购份额	514,104,598.46
减：报告期期间基金总赎回份额	247,428,825.98
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	794,166,569.59

§ 8 基金管理人运用自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 基金管理人运用自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

投资者类别	序号	报告期内持有基金份额变化情况			报告期末持有基金情况		
		持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20210701~20210817, 20210823~20210831	163,515,284.97	98,201,469.57	163,515,284.97	98,201,469.57	12.37
产品特有风险							
基金份额持有人持有的基金份额所占比例过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引起基金净值剧烈波动，甚至可能引发基金流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。							

注：1、申购份额包含基金申购份额、基金转换入份额、强制调增份额、场内买入份额和红利再投；

2、赎回份额包含基金赎回份额、基金转换出份额、强制调减份额、场内卖出份额。

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) 《鹏华聚合多资产 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》；
- (二) 《鹏华聚合多资产 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）托管协议》；
- (三) 《鹏华聚合多资产 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）2021 年第 3 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10月26日