

鹏华养老目标日期 2035 三年持有期混合型  
基金中基金 (FOF)  
2023 年第 2 季度报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2023 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 2023 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 2023 年 04 月 01 日起至 2023 年 06 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	鹏华养老 2035 混合 (FOF)
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	192,745,650.78 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、Treydor 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，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：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。

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。

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、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。

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。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。	
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%	
风险收益特征	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	
下属分级基金的基金简称	鹏华养老 2035 混合 (FOF) A	鹏华养老 2035 混合 (FOF) Y
下属分级基金的交易代码	006296	017380
报告期末下属分级基金的份额总额	181,784,981.29 份	10,960,669.49 份
下属分级基金的风险收益特征	风险收益特征同上	风险收益特征同上

### § 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 (2023 年 4 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)	
	鹏华养老 2035 混合 (FOF) A	鹏华养老 2035 混合 (FOF) Y
1. 本期已实现收益	-8,257,132.67	-326,420.11
2. 本期利润	-8,278,935.96	-327,271.82
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0404	-0.0314
4. 期末基金资产净值	222,312,694.10	10,811,768.75

5. 期末基金份额净值	1.2229	0.9864
-------------	--------	--------

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。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

鹏华养老 2035 混合 (FOF) A

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	-3.17%	0.54%	-2.35%	0.48%	-0.82%	0.06%
过去六个月	-0.95%	0.48%	1.29%	0.48%	-2.24%	0.00%
过去一年	-8.53%	0.55%	-5.83%	0.56%	-2.70%	-0.01%
过去三年	-4.06%	0.80%	2.80%	0.69%	-6.86%	0.11%
自基金合同生效起至今	22.29%	0.72%	24.14%	0.73%	-1.85%	-0.01%

鹏华养老 2035 混合 (FOF) Y

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	-3.09%	0.54%	-2.35%	0.48%	-0.74%	0.06%
过去六个月	-0.77%	0.48%	1.29%	0.48%	-2.06%	0.00%
自基金合同生效起至今	-1.36%	0.48%	0.43%	0.48%	-1.79%	0.00%

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

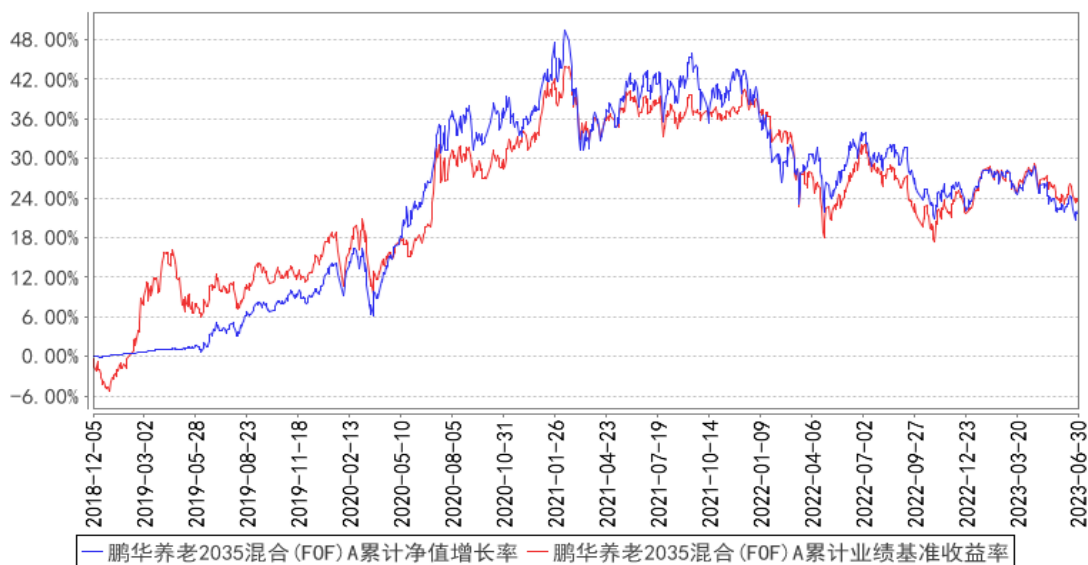
×42% 2027.01.01-2029.12.31 中证 800 指数收益率×54%+中证全债指数收益率×

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×

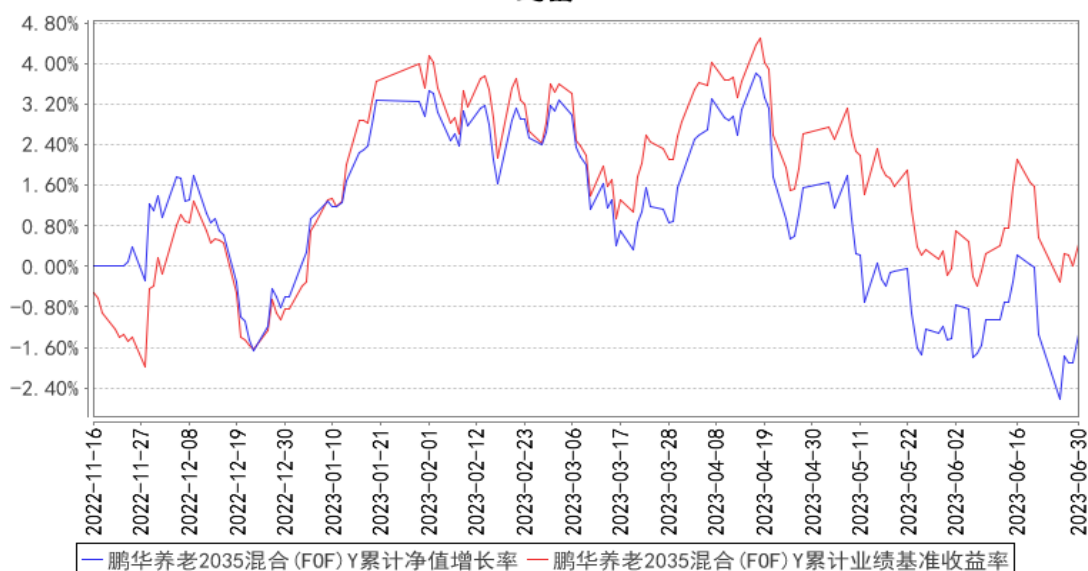
55% 2033.01.01-2035.12.31 中证 800 指数收益率×32%+中证全债指数收益率×68%

### 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) A 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



鹏华养老2035混合 (FOF) Y 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

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		
孙博斐	基金经理	2022-05-07	-	9 年	孙博斐先生，国籍中国，管理学硕士，9 年证券从业经验。曾任中国民生银行私人银行事业部投资与策略中心策略研究员，嘉实基金管理有限公司 FOF 研究员，建信信托有限责任公司 FOF 投资经理。2022 年 3 月加盟鹏华基金管理有限公司，现担任资产配置与基金投资部基金经理。2022 年 05 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，2022 年 05 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，2022 年 05 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，2022 年 05 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，2022 年 05 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，2022 年 05 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，2023 年 01 月至今担任鹏华养老目标日期 2040 五年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 基金经理，孙博斐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

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内，国内基本面呈现低增长、低通胀、低利率的特征。资产价格变动呈现类衰退交易：债券收益率明显下行，权益市场整体下跌，权益资产的结构机会集中在以人工智能为代表的新兴科技成长领域。而人民币兑美元汇率在美元指数阶段走弱的情况下仍然贬值，反映出投资者对于国内基本面和政策面相当程度的悲观预期。与去年底到今年一月相对乐观的复苏预期相对比，预期的摆动可谓剧烈。

从经济周期的角度，国内经济可能在二季度到三季度迎来短周期的复苏。如果说一季度资产价格的表现反映出投资者对短周期复苏力度的分歧，二季度资产价格的表现则反映出投资者对短周期复苏方向的怀疑，乃至对一些更长期基本面因素的踌躇。站在目前时点，基于对经济周期和权益资产估值层面的判断，我们对权益资产的投资机会持乐观态度，并将组合权益资产维持超配状态。

在权益资产的结构上大体保持了一季度的配置方向：

1. 顺周期低估值板块具备长期投资价值，我们对于一带一路、国企改革等政策逻辑持续关注。同时，我们对国内经济短周期复苏并不悲观，随着库存周期的触底回升，资源类板块可能再度迎来配置机会。

2. 消费医药板块方面，医药板块上半年的机会主要来自于中药和医院诊疗的复苏。而医药之外的消费行业上半年缺乏机会，大部分时间以消化估值为主。

3. 科技制造板块，上半年的机会围绕人工智能，我们对下半年国内生成式 AI 的进展，以及算力、半导体相关的投资机会保持重点关注。

上半年国内外资产价格波动都比较大，但波动方向并不一致，也与年初的市场主流预期相反。站在叙事的视角，东西方都在重构各自的产业链，重构的过程可能持续较长时间。站在投资的视角，一旦这种重构引发宏观增长因子的改变，我们可能需要重新审视周期的驱动因素。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期鹏华养老 2035 混合 (FOF) A 份额净值增长率为-3.17%，同期业绩比较基准增长率为-2.35%，鹏华养老 2035 混合 (FOF) Y 份额净值增长率为-3.09%，同期业绩比较基准增长率为-2.35%。

#### 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	14,539,702.55	6.17
	其中：股票	14,539,702.55	6.17
2	基金投资	206,114,521.16	87.53
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	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	13,542,494.79	5.75
8	其他资产	1,294,917.99	0.55
9	合计	235,491,636.49	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	669,066.00	0.29
C	制造业	4,018,687.55	1.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	278,050.00	0.12
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	116,550.00	0.05
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	547,236.00	0.23
J	金融业	8,910,113.00	3.82
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	14,539,702.55	6.24

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

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	601328	交通银行	790,000	4,582,000.00	1.97
2	601658	邮储银行	564,600	2,760,894.00	1.18
3	002371	北方华创	6,400	2,032,960.00	0.87
4	601288	农业银行	225,100	794,603.00	0.34
5	601628	中国人寿	22,100	772,616.00	0.33
6	002409	雅克科技	9,700	706,936.00	0.30
7	300750	宁德时代	2,400	549,096.00	0.24
8	601728	中国电信	97,200	547,236.00	0.23
9	603496	恒为科技	25,300	475,134.00	0.20
10	601857	中国石油	55,000	410,850.00	0.18

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

## 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

无。

## 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

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

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

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

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

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

中国农业银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。

交通银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。

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。

### 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	43,965.37
2	应收证券清算款	1,159,002.70
3	应收股利	69.95
4	应收利息	-
5	应收申购款	91,218.46
6	其他应收款	661.51
7	其他	-
8	合计	1,294,917.99

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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

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	360013	光大保德信信用添益债券 A	契约型开放式	12,017,220.43	12,666,150.33	5.43	否
2	166301	华商新趋势优选混合	上市契约型开放式 (LOF)	1,196,556.02	11,537,193.14	4.95	否

3	006031	南方昌元 可转债债 券 C	契约型开放 式	7,611,861.57	11,365,270.51	4.88	否
4	450002	国富弹性 市值混合	契约型开放 式	10,281,888.63	11,142,482.71	4.78	否
5	002943	广发多因 子混合	契约型开放 式	3,273,520.60	11,038,966.17	4.74	否
6	050011	博时信用 债券 A/B	契约型开放 式	3,435,303.20	10,261,250.66	4.40	否
7	000893	工银创新 动力股票	契约型开放 式	7,782,561.29	8,319,558.02	3.57	否
8	011066	大成高新 技术产业 股票 C	契约型开放 式	2,067,278.15	7,772,965.84	3.33	否
9	002361	国富恒瑞 债券 A	契约型开放 式	5,363,999.71	7,734,887.58	3.32	否
10	110017	易方达增 强回报债 券 A	契约型开放 式	5,000,000.00	6,720,000.00	2.88	否

## 6.2 当期交易及持有基金产生的费用

项目	本期费用 2023 年 4 月 1 日至 2023 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)	10,228.56	-
当期交易基金产生的赎回费(元)	142,686.43	2,164.90
当期持有基金产生的应支付销售服务费(元)	34,207.10	1,013.00
当期持有基金产生的应支付管理费(元)	622,875.19	16,752.85
当期持有基金产生的应支付托管费(元)	118,549.45	3,370.59
当期交易基金产生的交易费用(元)	2,168.71	-
当期交易基金产生的转换费(元)	398,077.25	5,396.84

## 6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。
----

## § 7 开放式基金份额变动

单位：份

项目	鹏华养老 2035 混合 (FOF) A	鹏华养老 2035 混合 (FOF) Y
----	----------------------	----------------------

报告期期初基金份额总额	215,326,444.94	9,959,797.40
报告期期间基金总申购份额	1,267,908.22	1,000,872.09
减:报告期期间基金总赎回份额	34,809,371.87	-
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	181,784,981.29	10,960,669.49

## § 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

无。

### 8.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

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

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) 2023 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

2023 年 7 月 20 日