鹏华弘惠灵活配置混合型证券投资基金
2021年年度报告

2021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：平安银行股份有限公司

送出日期：2022年3月30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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 03 月 29 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。

天健会计师事务所（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 2021 年 01 月 01 日起至 2021 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
§2 基金简介 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 7
2.4 信息披露方式 7
2.5 其他相关资料 7
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 7
3.1 主要会计数据和财务指标 7
3.2 基金净值表现 9
3.3 其他指标 12
3.4 过去三年基金的利润分配情况 12
§4 管理人报告 13
4.1 基金管理人及基金经理情况 13
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 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 16
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
§5 托管人报告 19
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 19
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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
§6 审计报告 20
6.1 审计报告基本信息 20
6.2 审计报告的基本内容 20
§7 年度财务报表 21
7.1 资产负债表 21
7.2 利润表 23
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 24
7.4 报表附注 25

§8 投资组合报告 58
8.1 期末基金资产组合情况 58
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 58
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 59
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 63
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 64
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 64
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 65
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 65
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 65
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 65
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 65
8.12 投资组合报告附注 65
§9 基金份额持有人信息 66
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 66
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 67
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 67
9.4 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 67
§10 开放式基金份额变动 67
§11 重大事件揭示 68
11.1 基金份额持有人大会决议 68
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 68
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 69
11.4 基金投资策略的改变 69
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 69
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 69
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 69
11.8 其他重大事件 70
§12 影响投资者决策的其他重要信息 76
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 76
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 76
§13 备查文件目录 76
13.1 备查文件目录 76
13.2 存放地点 76
13.3 查阅方式 76

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华弘惠灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	鹏华弘惠混合	
基金主代码	003343	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 9 月 27 日	
基金管理人	鹏华基金管理有限公司	
基金托管人	平安银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	823,757,233.11 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	鹏华弘惠混合 A	鹏华弘惠混合 C
下属分级基金的交易代码	003343	003344
报告期末下属分级基金的份额总额	438,296,985.06 份	385,460,248.05 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在科学严谨的资产配置框架下，严选安全边际较高的股票、债券等投资标的，力争基金资产的保值增值。
投资策略	1、资产配置策略　本基金将通过跟踪考量通常的宏观经济变量（包括 GDP 增长率、CPI 走势、M2 的绝对水平和增长率、利率水平与走势等）以及各项国家政策（包括财政、税收、货币、汇率政策等），并结合美林时钟等科学严谨的资产配置模型，动态评估不同资产大类在不同时期的投资价值及其风险收益特征，追求股票、债券和货币等大类资产的灵活配置和稳健收益。　2、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优质的上市公司，严选其中安全边际较高的个股构建投资组合：自上而下地分析行业的增长前景、行业结构、商业模式、竞争要素等分析把握其投资机会；自下而上地评判企业的产品、核心竞争力、管理层、治理结构等；并结合企业基本面和估值水平进行综合的研判，严选安全边际较高的个股，力争实现组合的保值增值。　（1）自上而下的行业遴选　本基金将自上而下地进行行业遴选，重点关注行业增长前景、行业利润前景和行业成功要素。对行业增长前景，主要分析行业的外部发展环境、行业的生命周期以及行业波动与经济周期的关系等；对行业利润前景，主要分析行业结构，特别是业内竞争的方式、业内竞争的激烈程度、以及业内厂商的谈判能力等。基于对行业结构的分析形成对业内竞争的关键成功要素的判断，为预测企业经营环境的变化建立起扎实的基础。　（2）自下而上的个股选择　本基金主要从两方面进行自下而上的个股选择：一方面是竞争力分析，通过对公司竞争策略和核心竞争力的分析，选择具有可持续竞争优势的上

	市公司或未来具有广阔成长空间的公司。就公司竞争策略，基于行业分析的结果判断策略的有效性、策略的实施支持和策略的执行成果；就核心竞争力，分析公司的现有核心竞争力，并判断公司能否利用现有的资源、能力和定位取得可持续竞争优势。 另一方面是管理层分析，在国内监管体系落后、公司治理结构不完善的基础上，上市公司的命运对管理团队的依赖度大大增加。本基金将着重考察公司的管理层以及管理制度。 （3）综合研判 本基金在自上而下和自下而上的基础上，结合估值分析，严选安全边际较高的个股，力争实现组合的保值增值。通过对估值方法的选择和估值倍数的比较，选择股价相对低估的股票。就估值方法而言，基于行业的特点确定对股价最有影响力的关键估值方法（包括 PE、PEG、PB、PS、EV/EBITDA 等）；就估值倍数而言，通过业内比较、历史比较和增长性分析，确定具有上升基础的股价水平。 （4）存托凭证投资策略 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、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、中小企业私募债投资策略等积极投资策略，灵活地调整组合的券种搭配，精选安全边际较高的个券，力争实现组合的保值增值。 （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。 （7)中小企业私募债投资策略 中小企业私募债券是在中国境内以非公开方式发行和转让，约定在一定期限还本付息的公司债券。由于其非公开性及条款可协商性，普遍具有较高收益。本基金将深入研究发行人资信及公司运营情况，合理合规合格地进行中小企业私募债券投资。本基金在投资过程中密切监控债券信用等级或发行人信用等级变化情况，尽力规避风险，并获取超额收益。 4、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	中证综合债指数收益率×50%＋沪深 300 指数收益率×50%

风险收益特征	本基金属于混合型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金，低于股票型基金，属于证券投资基金中中高风险、中高预期收益的品种。

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	平安银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张戈	李帅帅
	联系电话	0755-82825720	0755-25878287
	电子邮箱	zhangge@phfund.com.cn	LISHUAISHUAI130@pingan.com.cn
客户服务电话		4006788999	95511-3
传真		0755-82021126	0755-82080387
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	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 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	深圳市福田区益田路 5023 号平安金融中心 B 座 26 楼
邮政编码		518048	518001
法定代表人		何如	谢永林

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	http://www.phfund.com.cn
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	天健会计师事务所（特殊普通合伙）	广州市黄埔区黄埔大道东鱼珠广场 A-2 栋 4 楼全层
注册登记机构	鹏华基金管理有限公司	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层

§3 主要财务指标、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	2021 年		2020 年		2019 年	
	鹏华弘惠混合 A	鹏华弘惠混合 C	鹏华弘惠混合 A	鹏华弘惠混合 C	鹏华弘惠混合 A	鹏华弘惠混合 C
本期	26,819,080.	33,685,064.	32,488,748.	53,539,107.	8,738,485.9	26,323,929.

已实现收益	27	55	10	31	3	15
本期利润	27,282,401.14	34,744,575.29	33,544,215.97	54,819,806.36	10,021,916.31	32,691,598.59
加权平均基金份额本期利润	0.0709	0.0827	0.1419	0.1454	0.1190	0.1454
本期加权平均净值利润率	5.77%	6.75%	12.51%	12.77%	11.14%	13.72%
本期基金份额净值增长率	7.38%	7.36%	13.60%	13.58%	22.62%	22.60%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末		2020 年末		2019 年末	
期末可供分配利润	50,164,550.10	43,240,914.93	33,463,617.86	50,551,487.72	5,813,941.13	7,884,726.22
期末可供分配基金份额利润	0.1145	0.1122	0.1134	0.1115	0.0277	0.0262
期末基金资产净值	527,920,923.70	463,349,925.07	353,202,649.84	541,857,074.83	231,712,486.43	331,778,917.90
期末基金份额	1.2045	1.2021	1.1974	1.1954	1.1035	1.1019

净值						
3.1.3 累计期末指标	2021 年末		2020 年末		2019 年末	
基金份额累计净值增长率	34.61%	34.37%	25.36%	25.16%	10.35%	10.19%

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

鹏华弘惠混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.89%	0.15%	1.44%	0.39%	-0.55%	-0.24%
过去六个月	1.28%	0.19%	-1.16%	0.51%	2.44%	-0.32%
过去一年	7.38%	0.27%	0.30%	0.59%	7.08%	-0.32%
过去三年	49.59%	0.45%	38.57%	0.64%	11.02%	-0.19%

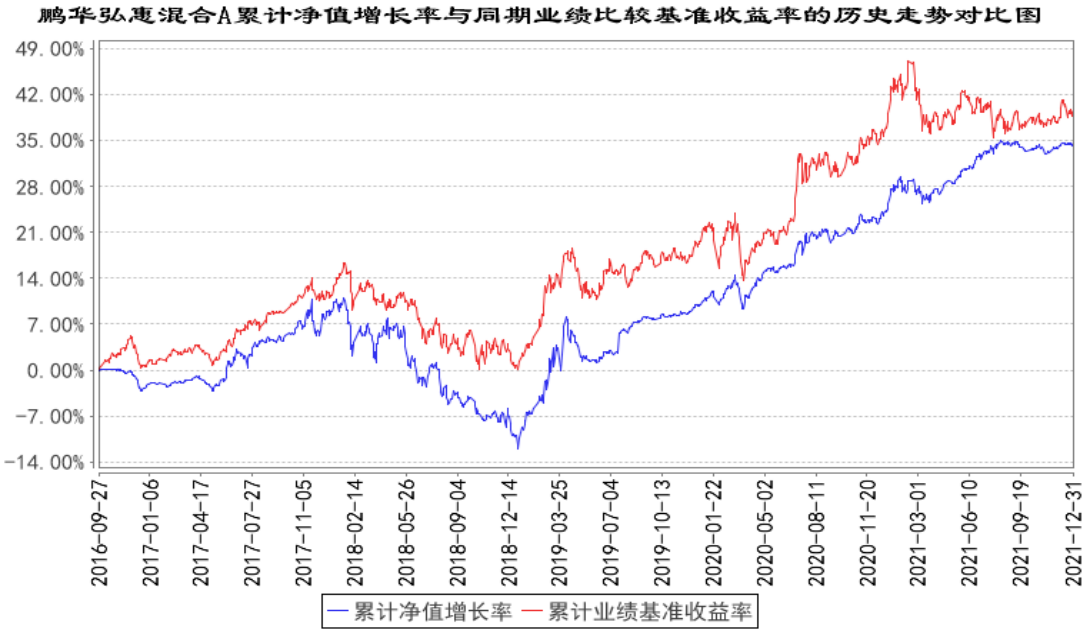
过去五年	37.74%	0.50%	38.56%	0.59%	-0.82%	-0.09%
自基金合同生效起至今	34.61%	0.49%	39.59%	0.59%	-4.98%	-0.10%

鹏华弘惠混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.89%	0.15%	1.44%	0.39%	-0.55%	-0.24%
过去六个月	1.28%	0.19%	-1.16%	0.51%	2.44%	-0.32%
过去一年	7.36%	0.27%	0.30%	0.59%	7.06%	-0.32%
过去三年	49.50%	0.45%	38.57%	0.64%	10.93%	-0.19%
过去五年	37.63%	0.50%	38.56%	0.59%	-0.93%	-0.09%
自基金合同生效起至今	34.37%	0.49%	39.59%	0.59%	-5.22%	-0.10%

注：业绩比较基准=中证综合债指数收益率×50%＋沪深 300 指数收益率×50%

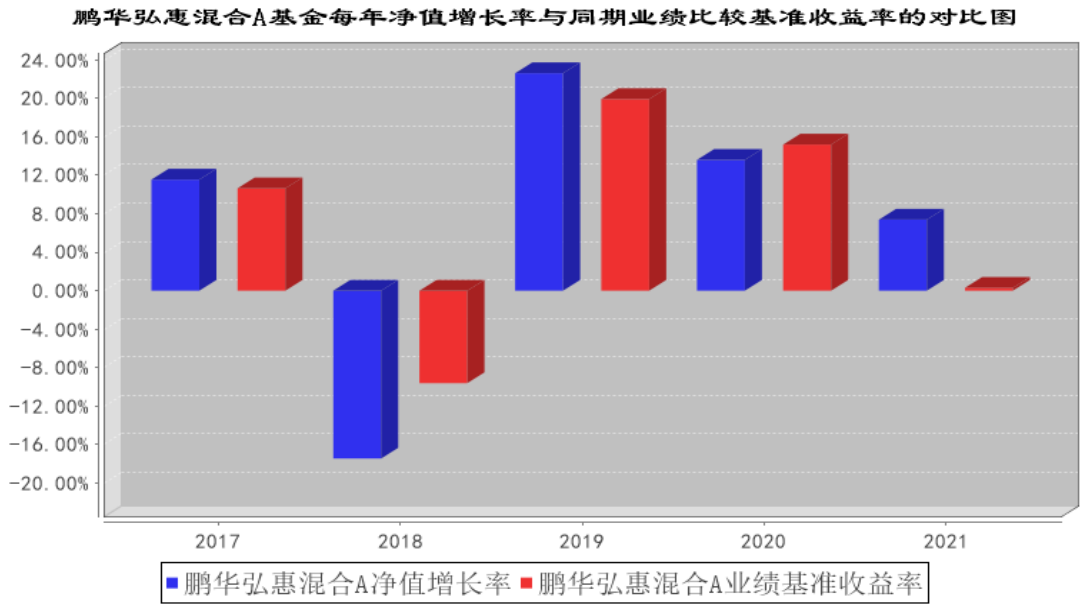
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

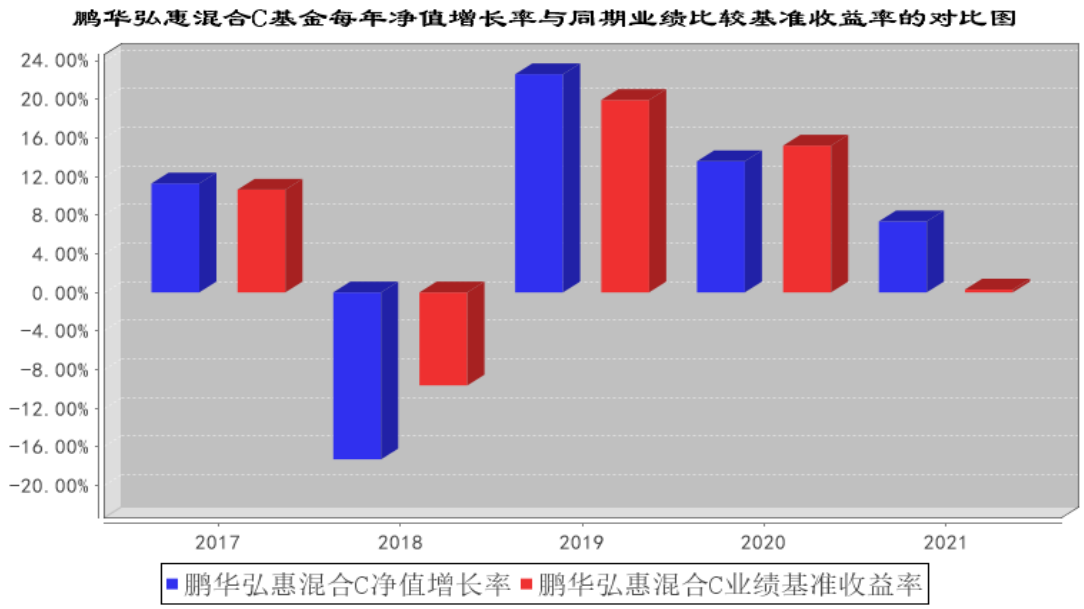


注：1、本基金基金合同于 2016 年 09 月 27 日生效。

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 过去五年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





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

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

鹏华弘惠混合 A

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2021 年	0.8000	21,823,786.55	8,810,811.39	30,634,597.94	-

2020 年	0.4900	9,106,940.46	2,090.12	9,109,030.58	-
2019 年	-	-	-	-	-
合计	1.2900	30,930,727.01	8,812,901.51	39,743,628.52	-

鹏华弘惠混合 C

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2021 年	0.8000	26,143,186.94	4,468,534.84	30,611,721.78	-
2020 年	0.4900	10,687,419.79	27,422.40	10,714,842.19	-
2019 年	-	-	-	-	-
合计	1.2900	36,830,606.73	4,495,957.24	41,326,563.97	-

§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 10,287.51 亿元，管理 260 只公募基金、13 只全国社保投资组合、4 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		
刘 方正	基金经理	2016-09-27	-	11 年	刘方正先生，国籍中国，理学硕士，11 年证券从业经验。2010 年 6 月加盟鹏华基金管理有限公司，从事债券研究工作，历任固定收益部高级研究员、基金经理助理，现任稳定收益投资部副总经理/基金经理。2015 年 03 月至 2017 年 01 月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 03 月至 2015 年 08 月担任鹏华行业成长证券投资基金基金经理,2015 年 04 月至 2017 年 01 月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 月至今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 05 月至 2017 年 01 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 05 月至今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 06 月至 2017 年 01 月担任鹏华弘鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2015 年 08 月至今担任鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金基金经理,2015 年 08 月至 2017 年 01 月担任鹏华弘泰灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2016 年 03 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,2016 年 03 月至 2017 年 05 月担任鹏华弘实灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2016 年 03 月至今担任鹏华弘信灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2016 年 08 月至今担任鹏华弘达灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2016 年 08 月至 2017 年 12 月担任鹏华弘嘉灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2016 年 09 月至今担任鹏华弘惠灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2016 年 11 月至 2018 年 01 月担任鹏华兴裕定期开放灵活配置混合型基金基金经理,2016 年 11 月至今担任鹏华兴泰定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2016 年 12 月至今担任鹏华兴悦定期开放灵活配置混合型基金基金经理,2017 年 09 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,2018 年 05 月至今担任鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金基金经理,刘方正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。
牛 孟艺	基金经理	2020-11-04	-	4 年	牛孟艺先生，国籍中国，管理学硕士，4 年证券从业经验。2017 年 06 月加盟鹏华基金管理有限公司，从事研究分析工作，历任绝对收益投资部研究员，现任稳定收益投资部基金经理，从事投资管理相关工作。2020 年 11 月至今担任鹏华弘惠灵活配置混合型证券投资基金基金经理,牛孟艺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

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

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遵规守信情况的说明

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中的公平交易程序，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、监察稽核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；《公平交易执行情况检查报告》需经公司基金经理、督察长和总经理签署。

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。

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

回顾 2021 年，海外经济运行情况持续回暖，海外总需求持续回升。国内方面，从两年复合的角度来看，房地产投资上半年维持平稳，下半年回落至历史低位；基建投资低位徘徊；制造业投

资稳步抬升；消费维持低位，整体仍未恢复至疫情前；进出口维持高位；名义经济增速较 20220 年有所抬升并维持平稳。国内货币政策整体稳健，债市流动性整体稳定，权益市场流动性更相关的 M1 表现较为疲软。这样的市场环境对于债券市场、权益市场影响中性。全年来看，固收市场整体略涨，权益市场整体平稳。

2021 年中，权益方面，本基金从年初较高的仓位逐渐降至较低水平，以及选股方面表现稍强于中证 800。债券方面，本基金维持较低的组合久期，以赚取票息为主；可转债方面，在四季度中开始执行低价低估券的绝对收益策略，但受限于可转债市场整体估值较高，可以参与的机会不多。新股方面，本基金持续积极参与。整体来看，本基金的整体表现因权益选股不及预期的原因导致稍弱于基金经理的预期。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期 A 类份额净值增长率为 7.38%，同期业绩比较基准增长率为 0.30%，C 类份额净值增长率为 7.36%，同期业绩比较基准增长率为 0.30%。

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 2022 年，疫情方面，奥密克戎病毒虽传播能力较强，但重症率及致死率较低，病毒整体有共存发展为流感化的可能，对经济再次中断的概率不大。经济方面，房地产投资较难有较大起色；基建投资、制造业投资受财政前置的影响大概率大概率先升后落；消费大概率维持弱复苏，在经济全面好转前难言恢复至疫情前增速水平；进出口增速受基数以及海外经济的影响，存在一定下行风险。整体来看，虽然目前市场上对于稳增长的预期较高，但从 3-4 年的一个完整经济周期角度来看，2022 年初大概率仍处经济下行周期的初期阶段，政策托底与自然周期下行力量的角逐难言结果。货币政策方面，在财政前置及宽信用的主基调下，债市资金方面收紧的概率不大，而与权益市场更相关的 M1 等更大概率将出现一个先降后升的过程。

在上述假设下，基金经理认为 2022 年的宏观经济环境将不利于权益资产，下行风险大于潜在机会，组合整体大概率维持低仓位水平运作，尽量少参与把握不大的市场博弈；债券资产在这一宏观环境下大概率将有所受益，但当前的利率水平基本已经处于历史极低的水平，目前也不是大幅抬升组合久期的合理时机，若一季度市场受稳增长预期影响，利率发生快速上行，组合将择机抬升久期；可转债方面，当下可转债市场整体估值过高，组合将持续维持低价低估可转债配置的策略，在出现相关个券机会时及时参与。具体操作将根据最新的市场情况以及相应宏观经济环境进行分析及应对，本文观点仅代表基金经理撰写时的观点。

本基金以追求稳定收益为主要的投资策略，以少量的权益资产匹配适当组合久期的方式，在追求收益的同时控制基金净值的回撤幅度，同时基金参与新股的网下申购获取增强收益，具体执

行思路参见前文。

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、持续改进投资监控的方法与手段，保证基金投资业务的合法合规性

报告期内，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监控系统以提升投资监控效率；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。

3、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，本报告期内没有出现主动违规行为。

4、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手册的执行效力，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。

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、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，本基金鹏华弘惠混合 A 期末可供分配利润为 50,164,550.10 元，期末基金份额净值 1.2045 元;鹏华弘惠混合 C 期末可供分配利润为 43,240,914.93 元，期末基金份额净值 1.2021 元。

2、本基金于 2021 年 06 月 11 日进行利润分配,A 类分配金额为 12,099,578.54 元,C 类分配金额为 15,000,438.90 元;2021 年 11 月 23 日进行利润分配,A 类分配金额为 18,535,019.40 元,C 类分配金额为 15,611,282.88 元。

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，平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有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

本报告期，本托管人复核的财务指标、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真实、准确、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	天健审[2022]7-98 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	鹏华弘惠灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了鹏华弘惠灵活配置混合型证券投资基金(以下简称鹏华弘惠混合基金)财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年度的利润表和持有人权益(基金净值)变动表，以及相关财务报表附注。 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，公允反映了鹏华弘惠混合基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况，以及 2021 年度的经营成果和持有人权益(基金净值)变动情况。
形成审计意见的基础	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。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于鹏华弘惠混合基金及其管理人鹏华基金管理有限公司（以下简称基金管理人），并履行了职业道德方面的其他责任。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。
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	基金管理人管理层（以下简称管理层）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。 在编制财务报表时，管理层负责评估鹏华弘惠混合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，除非管理层计划清算鹏华弘惠混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层（以下简称治理层）负责监督鹏华弘惠混合基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	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。 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： （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。 （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。 （三） 评价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。 （四） 对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，就可能导致对鹏华弘惠混合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弘惠混合基金不能持续经营。 （五） 评价财务报表的总体列报、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。 我们与治理层就基金的审计范围、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。	
会计师事务所的名称	天健会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	燕玉嵩	刘昕
会计师事务所的地址	中国杭州市	
审计报告日期	2022 年 3 月 23 日	

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：鹏华弘惠灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日

资 产：			
银行存款	7.4.7.1	8,027,130.25	10,820,942.15
结算备付金		28,724,375.19	28,206,100.22
存出保证金		243,916.31	269,473.19
交易性金融资产	7.4.7.2	1,080,382,813.57	964,435,995.76
其中：股票投资		124,841,521.57	235,016,895.76
基金投资		-	-
债券投资		955,541,292.00	729,419,100.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	1,400,000.00	90,000,000.00
应收证券清算款		98,100,000.00	203,214.52
应收利息	7.4.7.5	12,081,079.18	9,188,258.19
应收股利		-	-
应收申购款		10,309.45	13,267.10
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,228,969,623.95	1,103,137,251.13
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2021 年 12 月 31 日**	**上年度末 2020 年 12 月 31 日**
负 债：			
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		138,100,000.00	206,200,000.00
应付证券清算款		98,069,542.88	545,811.13
应付赎回款		69,777.91	67,985.02
应付管理人报酬		515,818.97	426,446.33
应付托管费		85,969.81	71,074.38
应付销售服务费		7,936.87	9,463.72
应付交易费用	7.4.7.7	665,368.14	557,583.93
应交税费		46,985.57	35,962.13
应付利息		-32,624.97	-6,903.39
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	170,000.00	170,103.21
负债合计		237,698,775.18	208,077,526.46
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	823,757,233.11	748,266,467.96
未分配利润	7.4.7.10	167,513,615.66	146,793,256.71
所有者权益合计		991,270,848.77	895,059,724.67
负债和所有者权益总计		1,228,969,623.95	1,103,137,251.13

注： 报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额总额为 823,757,233.11 份，其中鹏华弘惠混合 A 基金份额总额为 438,296,985.06 份，基金份额净值 1.2045 元;鹏华弘惠混合 C 基金份额总额为 385,460,248.05 份，基金份额净值 1.2021 元。

7.2 利润表

会计主体：鹏华弘惠灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		75,809,763.45	101,056,762.43
1.利息收入		28,961,677.46	21,605,163.48
其中：存款利息收入	7.4.7.11	273,040.23	564,278.70
债券利息收入		27,775,509.83	20,994,639.62
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		913,127.40	46,245.16
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		45,244,600.76	76,961,186.08
其中：股票投资收益	7.4.7.12	41,902,871.11	75,693,358.49
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	662,229.33	-1,895,653.09
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	2,679,500.32	3,163,480.68
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	1,522,831.61	2,336,166.92
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	80,653.62	154,245.95
减：二、费用		13,782,787.02	12,692,740.10
1．管理人报酬	7.4.10.2.1	5,927,811.04	4,171,859.22
2．托管费	7.4.10.2.2	987,968.41	695,309.86
3．销售服务费	7.4.10.2.3	103,055.51	85,433.15
4．交易费用	7.4.7.19	2,891,170.97	2,419,805.50

5．利息支出		3,600,152.75	5,053,299.54
其中：卖出回购金融资产支出		3,600,152.75	5,053,299.54
6．税金及附加		65,428.34	59,832.83
7．其他费用	7.4.7.20	207,200.00	207,200.00
三、利润总额（亏损总额以"-"号填列）		62,026,976.43	88,364,022.33
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以"-"号填列）		62,026,976.43	88,364,022.33

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鹏华弘惠灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	748,266,467.96	146,793,256.71	895,059,724.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	62,026,976.43	62,026,976.43
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以"-"号填列）	75,490,765.15	19,939,702.24	95,430,467.39
其中：1.基金申购款	641,206,188.51	146,478,598.49	787,684,787.00
2.基金赎回款	-565,715,423.36	-126,538,896.25	-692,254,319.61
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以"-"号填列）	-	-61,246,319.72	-61,246,319.72
五、期末所有者权益(基金净值)	823,757,233.11	167,513,615.66	991,270,848.77
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	511,057,919.50	52,433,484.83	563,491,404.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	88,364,022.33	88,364,022.33
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	237,208,548.46	25,819,622.32	263,028,170.78
其中：1.基金申购款	733,894,754.79	97,341,260.79	831,236,015.58
2.基金赎回款	-496,686,206.33	-71,521,638.47	-568,207,844.80
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-19,823,872.77	-19,823,872.77
五、期末所有者权益(基金净值)	748,266,467.96	146,793,256.71	895,059,724.67

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

鹏华弘惠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[2016]1920 号文《关于准予鹏华弘惠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》、《鹏华弘惠灵活配置混合型证券投资基金基金合同》及其他法律法规公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次募集期间为 2016 年 9 月 12 日至 2016 年 9 月 23 日，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 1,100,039,396.41 元，经瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）瑞华验资[2016]01300025 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《鹏华弘惠灵活配置混合型证券投

资基金基金合同》于 2016 年 9 月 27 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,100,251,921.23 份基金份额，其中认购资金利息折合 212,524.82 份基金份额。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司，本基金托管人为平安银行股份有限公司。

根据《鹏华弘惠灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《鹏华弘惠灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》，本基金根据销售服务费及赎回费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算并公告基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华弘惠灵活配置混合型证券投资基金基金合同》等有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证）、债券（含国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券、中小企业私募债等）、货币市场工具（含同业存单等）、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：股票资产（含存托凭证）占基金资产的比例为 0%～95%；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。本基金的业绩比较基准为：中证综合债指数收益率×50%＋沪深 300 指数收益率×50%。

本财务报表由本基金的基金管理人鹏华基金管理有限公司于本基金的审计报告日批准报出。

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”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《鹏华弘惠灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

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 2021 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 2021 年 12

月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值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

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。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。本基金持有的其他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，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的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。

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。

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值比例计算的金额。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值比例计算的金额。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利息收入。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利息收入。

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逐日确认。

其他金融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

本基金同一类/级别的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，但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。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所有者权益转出。

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《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度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

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 14 号—收入》，本基金于 2021 年 1 月 1 日起执行。本基金在编制 2021 年度财务报表时已采用该准则，该准则的采用未对本基金财务报表产生重大影响。

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。

(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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	8,027,130.25	10,820,942.15
定期存款	-	-
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	-	-
合计	8,027,130.25	10,820,942.15

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日

		成本	公允价值	公允价值变动
股票		120,642,079.50	124,841,521.57	4,199,442.07
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	878,904,199.63	884,487,292.00	5,583,092.37
	银行间市场	71,003,923.29	71,054,000.00	50,076.71
	合计	949,908,122.92	955,541,292.00	5,633,169.08
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,070,550,202.42	1,080,382,813.57	9,832,611.15
项目		上年度末 2020 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		224,628,623.63	235,016,895.76	10,388,272.13
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	706,502,792.59	704,416,600.00	-2,086,192.59
	银行间市场	24,994,800.00	25,002,500.00	7,700.00
	合计	731,497,592.59	729,419,100.00	-2,078,492.59
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		956,126,216.22	964,435,995.76	8,309,779.54

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

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 2021 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	1,400,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	1,400,000.00	-
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	90,000,000.00	-

银行间市场	-	-
合计	90,000,000.00	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	890.02	3,781.02
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	14,218.60	13,961.97
应收债券利息	12,065,849.78	9,159,610.18
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	10,771.59
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	120.78	133.43
合计	12,081,079.18	9,188,258.19

7.4.7.6 其他资产

无。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	663,368.14	556,983.93
银行间市场应付交易费用	2,000.00	600.00
合计	665,368.14	557,583.93

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	103.21
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	170,000.00	170,000.00
合计	170,000.00	170,103.21

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

鹏华弘惠混合 A

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	294,968,515.64	294,968,515.64
本期申购	327,736,872.53	327,736,872.53
本期赎回（以“-”号填列）	-184,408,403.11	-184,408,403.11
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	438,296,985.06	438,296,985.06

鹏华弘惠混合 C

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	453,297,952.32	453,297,952.32
本期申购	313,469,315.98	313,469,315.98
本期赎回（以“-”号填列）	-381,307,020.25	-381,307,020.25
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	385,460,248.05	385,460,248.05

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

鹏华弘惠混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	33,463,617.86	24,770,516.34	58,234,134.20
本期利润	26,819,080.27	463,320.87	27,282,401.14
本期基金份额交易产生的变动数	20,516,449.91	14,225,551.33	34,742,001.24
其中：基金申购款	47,768,911.23	29,882,227.63	77,651,138.86
基金赎回款	-27,252,461.32	-15,656,676.30	-42,909,137.62
本期已分配利润	-30,634,597.94	-	-30,634,597.94
本期末	50,164,550.10	39,459,388.54	89,623,938.64

鹏华弘惠混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	50,551,487.72	38,007,634.79	88,559,122.51
本期利润	33,685,064.55	1,059,510.74	34,744,575.29
本期基金份额交易产生的变动数	-10,383,915.56	-4,418,383.44	-14,802,299.00
其中：基金申购款	40,490,159.21	28,337,300.42	68,827,459.63
基金赎回款	-50,874,074.77	-32,755,683.86	-83,629,758.63
本期已分配利润	-30,611,721.78	-	-30,611,721.78
本期末	43,240,914.93	34,648,762.09	77,889,677.02

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	54,967.16	174,860.32
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	214,998.56	323,379.33
其他	3,074.51	66,039.05
合计	273,040.23	564,278.70

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。

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	41,902,871.11	75,693,358.49
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	41,902,871.11	75,693,358.49

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	1,020,270,085.67	770,221,228.51
减:卖出股票成本总额	978,367,214.56	694,527,870.02
买卖股票差价收入	41,902,871.11	75,693,358.49

7.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	662,229.33	-1,895,653.09
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	662,229.33	-1,895,653.09

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	510,355,224.80	799,625,481.87
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付)成本总额	501,854,750.12	787,886,649.88
减：应收利息总额	7,838,245.35	13,634,485.08
买卖债券差价收入	662,229.33	-1,895,653.09

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

无。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

无。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	2,679,500.32	3,163,480.68
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	2,679,500.32	3,163,480.68

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	1,522,831.61	2,336,166.92
股票投资	-6,188,830.06	3,757,905.80
债券投资	7,711,661.67	-1,421,738.88
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	1,522,831.61	2,336,166.92

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	67,833.26	154,204.85
基金转换费收入	12,820.36	41.10
合计	80,653.62	154,245.95

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	2,887,245.97	2,418,993.00
银行间市场交易费用	3,925.00	812.50
合计	2,891,170.97	2,419,805.50

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
账户维护费	36,000.00	36,000.00
其他	1,200.00	1,200.00

合计	207,200.00	207,200.00

7.4.7.21 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、基金注册登记机构、基金销售机构
平安银行股份有限公司(“平安银行”)	基金托管人、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
国信证券股份有限公司(“国信证券”)	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

无。

7.4.10.1.2 债券交易

无。

7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

7.4.10.1.4 权证交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	5,927,811.04	4,171,859.22
其中：支付销售机构的客户维护费	254,946.50	33,786.01

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

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

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	987,968.41	695,309.86

注：支付基金托管人平安银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。日托管费＝前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鹏华弘惠混合 A	鹏华弘惠混合 C	合计
鹏华基金公司	-	75,854.14	75,854.14
平安银行	-	-	-
合计	-	75,854.14	75,854.14
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鹏华弘惠混合 A	鹏华弘惠混合 C	合计
鹏华基金公司	-	80,693.67	80,693.67

平安银行	-	2.10	2.10
合计	-	80,695.77	80,695.77

注：鹏华弘惠混合 A 基金份额不支付销售服务费;支付基金销售机构的鹏华弘惠混合 C 基金份额的销售服务费年费率为 0.02%，逐日计提，按月支付，日销售服务费=前一日分类基金资产净值×0.02%÷当年天数。

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

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

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

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

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

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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
平安银行	8,027,130.25	54,967.16	10,820,942.15	174,860.32

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 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：张 ）	总金额
国信证券	301066	万事利	网下申购	3,436	18,004.64
国信证券	301091	深城交	网下申购	5,240	191,260.00

国信证券	688622	禾信仪器	网下申购	1,204	21,310.80
国信证券	300957	贝泰妮	网下申购	5,268	249,334.44
国信证券	301032	新柴股份	网下申购	5,124	25,466.28
国信证券	688323	瑞华泰	网下申购	4,513	26,942.61
国信证券	300986	志特新材	网下申购	2,632	38,927.28

上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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：张 ）	总金额
国信证券	-	-	-	-	-

注：本基金在上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

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

单位：人民币元

鹏华弘惠混合 A								
序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2021 年 6 月 11 日	-	2021 年 6 月 11 日	0.4000	7,897,816.63	4,201,761.91	12,099,578.54	-
2	2021 年 11 月 23 日	-	2021 年 11 月 23 日	0.4000	13,925,969.92	4,609,049.48	18,535,019.40	-
合计	-	-	-	0.8000	21,823,786.55	8,810,811.39	30,634,597.94	-

鹏华弘惠混合 C								
序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2021 年 6 月 11 日	-	2021 年 6 月 11 日	0.4000	11,965,651.92	3,034,786.98	15,000,438.90	-
2	2021 年 11 月 23 日	-	2021 年 11 月 23 日	0.4000	14,177,535.02	1,433,747.86	15,611,282.88	-
合计	-	-	-	0.8000	26,143,186.94	4,468,534.84	30,611,721.78	-

7.4.12 期末(2021 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	证券	成功	可流通	流通受	认购	期末估	数量	期末	期末估值总额	备注

代码	名称	认购日	日	限类型	价格	值单价	（单位：股）	成本总额		
001234	泰慕士	2021年12月31日	2022年1月11日	新股未上市	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
300774	倍杰特	2021年7月26日	2022年2月16日	锁定期股票	4.57	21.08	444	2,029.08	9,359.52	-
300814	中富电路	2021年8月4日	2022年2月14日	锁定期股票	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64	-
300854	中兰环保	2021年9月8日	2022年3月16日	锁定期股票	9.96	27.29	203	2,021.88	5,539.87	-
300994	久祺股份	2021年8月2日	2022年2月14日	锁定期股票	11.90	45.45	420	4,998.00	19,089.00	-
301018	申菱环境	2021年6月28日	2022年1月7日	锁定期股票	8.29	26.06	782	6,482.78	20,378.92	-
301020	密封科技	2021年6月28日	2022年1月6日	锁定期股票	10.64	30.44	421	4,479.44	12,815.24	-
301021	英诺激光	2021年6月28日	2022年1月6日	锁定期股票	9.46	41.43	290	2,743.40	12,014.70	-
301025	读客文化	2021年7月6日	2022年1月24日	锁定期股票	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	-
301026	浩通科技	2021年7月8日	2022年1月17日	锁定期股票	18.03	62.73	203	3,660.09	12,734.19	-
301027	华蓝集团	2021年7月8日	2022年1月19日	锁定期股票	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	-
301028	东亚机械	2021年7月12日	2022年1月20日	锁定期股票	5.31	13.50	733	3,892.23	9,895.50	-
301029	怡合达	2021年7月14日	2022年1月24日	锁定期股票	14.14	89.87	462	6,532.68	41,519.94	-
301030	仕净科技	2021年7月	2022年1月	锁定期股票	6.10	31.52	242	1,476.20	7,627.84	-

		15 日	24 日							
301032	新柴股份	2021 年 7 月 15 日	2022 年 1 月 24 日	锁定期股票	4.97	12.51	513	2,549.61	6,417.63	-
301033	迈普医学	2021 年 7 月 15 日	2022 年 1 月 26 日	锁定期股票	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	-
301036	双乐股份	2021 年 7 月 21 日	2022 年 2 月 16 日	锁定期股票	23.38	29.93	205	4,792.90	6,135.65	-
301037	保立佳	2021 年 7 月 21 日	2022 年 2 月 7 日	锁定期股票	14.82	24.26	193	2,860.26	4,682.18	-
301040	中环海陆	2021 年 7 月 26 日	2022 年 2 月 7 日	锁定期股票	13.57	38.51	241	3,270.37	9,280.91	-
301045	天禄科技	2021 年 8 月 6 日	2022 年 2 月 17 日	锁定期股票	15.81	28.37	335	5,296.35	9,503.95	-
301046	能辉科技	2021 年 8 月 10 日	2022 年 2 月 17 日	锁定期股票	8.34	48.99	290	2,418.60	14,207.10	-
301048	金鹰重工	2021 年 8 月 11 日	2022 年 2 月 28 日	锁定期股票	4.13	12.96	843	3,481.59	10,925.28	-
301049	超越科技	2021 年 8 月 17 日	2022 年 2 月 24 日	锁定期股票	19.34	32.92	196	3,790.64	6,452.32	-
301050	雷电微力	2021 年 8 月 17 日	2022 年 2 月 24 日	锁定期股票	60.64	234.74	233	14,129.12	54,694.42	-
301052	果麦文化	2021 年 8 月 23 日	2022 年 2 月 28 日	锁定期股票	8.11	33.64	252	2,043.72	8,477.28	-
301053	远信工业	2021 年 8 月 25 日	2022 年 3 月 1 日	锁定期股票	11.87	28.78	155	1,839.85	4,460.90	-
301058	中粮工科	2021 年 9 月 1 日	2022 年 3 月 9 日	锁定期股票	3.55	18.24	1,386	4,920.30	25,280.64	-
301062	上海艾录	2021 年 9 月 7 日	2022 年 3 月 14 日	锁定期股票	3.31	17.01	523	1,731.13	8,896.23	-
301063	海锅	2021	2022	锁定期	17.40	36.11	153	2,662.20	5,524.83	-

	股份	年 9 月 9 日	年 3 月 24 日	股票						
301066	万事利	2021 年 9 月 13 日	2022 年 3 月 22 日	锁定期股票	5.24	22.84	344	1,802.56	7,856.96	-
301068	大地海洋	2021 年 9 月 16 日	2022 年 3 月 28 日	锁定期股票	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	-
301069	凯盛新材	2021 年 9 月 16 日	2022 年 3 月 28 日	锁定期股票	5.17	44.21	539	2,786.63	23,829.19	-
301072	中捷精工	2021 年 9 月 22 日	2022 年 3 月 29 日	锁定期股票	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	-
301073	君亭酒店	2021 年 9 月 22 日	2022 年 3 月 30 日	锁定期股票	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	-
301078	孩子王	2021 年 9 月 30 日	2022 年 4 月 14 日	锁定期股票	5.77	12.14	756	4,362.12	9,177.84	-
301089	拓新药业	2021 年 10 月 20 日	2022 年 4 月 27 日	锁定期股票	19.11	67.93	220	4,204.20	14,944.60	-
301091	深城交	2021 年 10 月 20 日	2022 年 4 月 29 日	锁定期股票	36.50	31.31	524	19,126.00	16,406.44	-
301098	金埔园林	2021 年 11 月 4 日	2022 年 5 月 12 日	锁定期股票	12.36	22.17	307	3,794.52	6,806.19	-
301108	洁雅股份	2021 年 11 月 25 日	2022 年 6 月 6 日	锁定期股票	57.27	53.71	280	16,035.60	15,038.80	-
301111	粤万年青	2021 年 11 月 30 日	2022 年 6 月 7 日	锁定期股票	10.48	36.68	379	3,971.92	13,901.72	-
301118	恒光股份	2021 年 11 月 9 日	2022 年 5 月 18 日	锁定期股票	22.70	49.02	315	7,150.50	15,441.30	-
301126	达嘉维康	2021 年 11	2022 年 6 月	锁定期股票	12.37	19.23	662	8,188.94	12,730.26	-

		月 30 日	7 日							
301133	金钟股份	2021 年 11 月 19 日	2022 年 5 月 26 日	锁定期股票	14.33	26.95	286	4,098.38	7,707.70	-
301155	海力风电	2021 年 11 月 17 日	2022 年 5 月 24 日	锁定期股票	60.66	96.75	902	54,715.32	87,268.50	-
301168	通灵股份	2021 年 12 月 2 日	2022 年 6 月 10 日	锁定期股票	39.08	52.13	329	12,857.32	17,150.77	-
301179	泽宇智能	2021 年 12 月 1 日	2022 年 6 月 8 日	锁定期股票	43.99	50.77	295	12,977.05	14,977.15	-
301180	万祥科技	2021 年 11 月 9 日	2022 年 5 月 16 日	锁定期股票	12.20	22.72	654	7,978.80	14,858.88	-
301185	鸥玛软件	2021 年 11 月 11 日	2022 年 5 月 19 日	锁定期股票	11.88	21.16	578	6,866.64	12,230.48	-
301198	喜悦智行	2021 年 11 月 25 日	2022 年 6 月 2 日	锁定期股票	21.76	29.20	262	5,701.12	7,650.40	-
301199	迈赫股份	2021 年 11 月 30 日	2022 年 6 月 7 日	锁定期股票	29.28	32.00	402	11,770.56	12,864.00	-
601728	中国电信	2021 年 8 月 11 日	2022 年 2 月 21 日	锁定期股票	4.53	4.27	394,011	1,784,869.83	1,682,426.97	-
688049	炬芯科技-U	2021 年 11 月 22 日	2022 年 5 月 30 日	锁定期股票	42.98	51.71	3,260	140,114.80	168,574.60	-
688206	概伦电子	2021 年 12 月 20 日	2022 年 6 月 28 日	锁定期股票	28.28	33.01	6,000	169,680.00	198,060.00	-
688255	凯尔达	2021 年 10	2022 年 4 月	锁定期股票	47.11	37.87	1,648	77,637.28	62,409.76	-

		月 14 日	25 日							
688262	国芯科技	2021 年 12 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	新股未上市	41.98	41.98	7,129	299,275.42	299,275.42	-
688296	和达科技	2021 年 7 月 19 日	2022 年 1 月 27 日	锁定期股票	12.46	49.67	2,173	27,075.58	107,932.91	-
688303	大全能源	2021 年 7 月 15 日	2022 年 1 月 24 日	锁定期股票	21.49	60.51	24,814	533,252.86	1,501,495.14	-
688728	格科微	2021 年 8 月 11 日	2022 年 2 月 18 日	锁定期股票	14.38	29.31	23,033	331,214.54	675,097.23	-
7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
113052	兴业转债	2021 年 12 月 28 日	2022 年 1 月 14 日	配债未上市	100.00	100.00	5,050	505,000.00	505,000.00	-

注：1、根据中国证监会《关于修改<上市公司证券发行管理办法>的决定》、《关于修改<创业板上市公司证券发行管理暂行办法>的决定》以及《关于修改<上市公司非公开发行股票实施细则>的决定》，本基金所认购的 2020 年 2 月 14 日(含)后发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。此外，本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

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、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的科创板股票，在受让后 6 个月内不得转让。

4、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，本基金参与摇号配售或比例配售方式获配的创业板股票自发行人股票上市之日起在发行人约定的限售期内不得转让。

5、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。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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 2021 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 138,100,000.00 元，于 2022 年 01 月 04 日、2022 年 01 月 05 日（先后）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

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。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的股票(包含中小板，创业板及其他经中国证监会核准上市的股票，存托凭证)，债券(含国债，金融债，企业债，公司债，央行票据，中期票据，短期融资券，次级债，可转换债券，可交换债券，中小企业私募债等)，货币市场工具(含同业存单等)，权证，资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人致力于全面内部控制体系的建设，建立了从董事会层面到各业务部门的风险管理组织架构。本基金的基金管理人在董事会下设风险控制和合规审计委员会，主要负责制定基金管理人风险控制战略和控制政策、协调突发重大风险等事项；督察长负责对基金管理人各业务环节合法合规运作进行监督检查，组织、指导基金管理人内部监察稽核工作，并可向董事会

和中国证监会直接报告；在公司内部设立独立的监察稽核部，专职负责对基金管理人各部门、各业务的风险控制情况进行督促和检查，并适时提出整改建议。

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

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平安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

无。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

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 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	840,572,550.00	681,446,500.00

AAA 以下	12,123,142.00	-
未评级	-	-
合计	852,695,692.00	681,446,500.00

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

无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

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、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2021 年 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款余额 138,100,000.00 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（所有者权益）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

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

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

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

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

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

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 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	8,027,130.25	-	-	-	8,027,130.25
结算备付金	28,724,375.19	-	-	-	28,724,375.19
存出保证金	243,916.31	-	-	-	243,916.31
交易性金融资产	162,581,600.00	741,624,692.00	51,335,000.00	124,841,521.57	1,080,382,813.57
买入返售金融资产	1,400,000.00	-	-	-	1,400,000.00
应收利息	-	-	-	12,081,079.18	12,081,079.18
应收申购款	-	-	-	10,309.45	10,309.45
应收证券清算款	-	-	-	98,100,000.00	98,100,000.00
资产总计	200,977,021.75	741,624,692.00	51,335,000.00	235,032,910.20	1,228,969,623.95
负债					
应付赎回款	-	-	-	69,777.91	69,777.91
应付管理人报酬	-	-	-	515,818.97	515,818.97
应付托管费	-	-	-	85,969.81	85,969.81
应付证券清算款	-	-	-	98,069,542.88	98,069,542.88
卖出回购金融资产款	138,100,000.00	-	-	-	138,100,000.00
应付销售服务费	-	-	-	7,936.87	7,936.87
应付交易费用	-	-	-	665,368.14	665,368.14
应付利息	-	-	-	-32,624.97	-32,624.97
应交税费	-	-	-	46,985.57	46,985.57
其他负债	-	-	-	170,000.00	170,000.00
负债总计	138,100,000.00	-	-	99,598,775.18	237,698,775.18
利率敏感度缺口	62,877,021.75	741,624,692.00	51,335,000.00	135,434,135.02	991,270,848.77
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	10,820,942.15	-	-	-	10,820,942.15
结算备付金	28,206,100.22	-	-	-	28,206,100.22
存出保证金	269,473.19	-	-	-	269,473.19
交易性金融资产	47,972,600.00	681,446,500.00	-	235,016,895.76	964,435,995.76
买入返售金融资产	90,000,000.00	-	-	-	90,000,000.00
应收利息	-	-	-	9,188,258.19	9,188,258.19

应收申购款	-	-	-	13,267.10	13,267.10
应收证券清算款	-	-	-	203,214.52	203,214.52
资产总计	177,269,115.56	681,446,500.00	-	244,421,635.57	1,103,137,251.13
负债					
应付赎回款	-	-	-	67,985.02	67,985.02
应付管理人报酬	-	-	-	426,446.33	426,446.33
应付托管费	-	-	-	71,074.38	71,074.38
应付证券清算款	-	-	-	545,811.13	545,811.13
卖出回购金融资产款	206,200,000.00	-	-	-	206,200,000.00
应付销售服务费	-	-	-	9,463.72	9,463.72
应付交易费用	-	-	-	557,583.93	557,583.93
应付利息	-	-	-	-6,903.39	-6,903.39
应交税费	-	-	-	35,962.13	35,962.13
其他负债	-	-	-	170,103.21	170,103.21
负债总计	206,200,000.00	-	-	1,877,526.46	208,077,526.46
利率敏感度缺口	-28,930,884.44	681,446,500.00	-	242,544,109.11	895,059,724.67

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。		
	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（2021 年 12 月 31 日）	上年度末 （2020 年 12 月 31 日 ）
分析	市场利率下降 25 个基点	3,982,966.69	4,057,019.02
	市场利率上升 25 个基点	-3,940,907.55	-4,022,928.46

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

无。

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

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 0%-95%；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（ValueatRisk）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 2021 年 12 月 31 日		上年度末 2020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	124,841,521.57	12.59	235,016,895.76	26.26
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-

交易性金融资产—债券投资	20,309,192.00	2.05	-	-
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	145,150,713.57	14.64	235,016,895.76	26.26

注：债券投资为可转换债券、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		
	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（2021 年 12 月 31 日）	上年度末 （2020 年 12 月 31 日 ）
分析	业绩比较基准上升 5%	-	9,691,606.75
	业绩比较基准下降 5%	-	-9,691,606.75

注：于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金净资产的比例为 14.64%，因此除市场利率和外汇利率以外的市场价格因素的变动对本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(一) 公允价值

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：在计量日能够取得的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。

2. 持续的以公允价值计量的金融工具

(1) 各层次金融工具公允价值

截至 2021 年 12 月 31 日止，本基金持有公允价值归属于第一层次的余额为 139,265,953.96 元，属于第二层次的余额为 936,041,879.91 元，属于第三层次的余额为 5,074,979.70 元(2020 年 12 月 31 日：第一层次的余额为 228,007,805.30 元，第二层次的余额为 736,428,190.46 元，无第三层次)。

(2) 公允价值所属层次间的重大变动

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，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，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(3) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

权益工具投资

2021 年 1 月 1 日

购买 3,359,751.10

出售

转入第三层次

转出第三层次

当期利得或损失总额 1,715,228.60

计入损益的利得或损失 1,715,228.60

2021 年 12 月 31 日 5,074,979.70

2021 年 12 月 31 日仍持有的资产计入 2021 年度损益的未实现利得或损失的变动—公允价值变动损益 1,715,228.60

截至 2021 年 12 月 31 日止，本基金持有的第三层级的交易性金融资产（均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资）公允价值为 5,074,979.70 元，采用平均价格亚式期权模型进行估值，不可观察输入值为预期波动率，与公允价值之间为负相关关系。

3. 非持续的以公允价值计量的金融工具

截至 2021 年 12 月 31 日止，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

4. 不以公允价值计量的金融工具

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。

（二） 根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号－金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号－金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号－套期会计》和《企业会计准则第 37 号-金融工具列报》(以下合称新金融工具准则)相关衔接规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。截至 2021 年 12 月 31 日，本基金已完成了执行新金融工具准则对财务报表潜在影响的评估。鉴于本基金业务的性质，新金融工具准则预期不会对本基金的财务状况和经营成果产生重大影响。

本基金将自 2022 年 1 月 1 日起追溯执行相关新规定，并采用准则允许的实务简便方法，调整期初所有者权益，2021 年的比较数据将不作重述。

§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	124,841,521.57	10.16
	其中：股票	124,841,521.57	10.16
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	955,541,292.00	77.75
	其中：债券	955,541,292.00	77.75
	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	1,400,000.00	0.11
	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	36,751,505.44	2.99
8	其他各项资产	110,435,304.94	8.99
9	合计	1,228,969,623.95	100.00

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	1,835,844.00	0.19
B	采矿业	4,401,855.00	0.44
C	制造业	69,578,633.48	7.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,790,630.00	0.28

E	建筑业	2,401,088.99	0.24
F	批发和零售业	6,549,666.10	0.66
G	交通运输、仓储和邮政业	2,377,519.00	0.24
H	住宿和餐饮业	77,772.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,950,618.93	1.10
J	金融业	18,823,776.00	1.90
K	房地产业	1,533,682.00	0.15
L	租赁和商务服务业	1,316,460.00	0.13
M	科学研究和技术服务业	216,095.44	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	21,351.71	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	80,958.00	0.01
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,885,570.92	0.19
S	综合	-	-
	合计	124,841,521.57	12.59

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

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	600519	贵州茅台	6,300	12,915,000.00	1.30
2	600436	片仔癀	21,900	9,573,585.00	0.97
3	002142	宁波银行	131,450	5,031,906.00	0.51
4	601166	兴业银行	210,000	3,998,400.00	0.40
5	000988	华工科技	142,400	3,967,264.00	0.40
6	002129	中环股份	94,700	3,953,725.00	0.40
7	688099	晶晨股份	28,800	3,749,760.00	0.38
8	600036	招商银行	67,200	3,273,312.00	0.33
9	002410	广联达	48,700	3,115,826.00	0.31
10	601899	紫金矿业	318,100	3,085,570.00	0.31
11	600739	辽宁成大	139,700	2,726,944.00	0.28
12	603077	和邦生物	780,800	2,662,528.00	0.27
13	600900	长江电力	114,000	2,587,800.00	0.26
14	603290	斯达半导	6,100	2,324,100.00	0.23
15	601127	小康股份	38,700	2,304,585.00	0.23
16	000333	美的集团	30,200	2,229,062.00	0.22
17	002340	格林美	213,500	2,209,725.00	0.22

18	601601	中国太保	77,200	2,093,664.00	0.21
19	000623	吉林敖东	110,700	2,044,629.00	0.21
20	002926	华西证券	192,000	1,891,200.00	0.19
21	600115	中国东航	340,900	1,759,044.00	0.18
22	600884	杉杉股份	53,000	1,736,810.00	0.18
23	601728	中国电信	394,011	1,682,426.97	0.17
24	002714	牧原股份	30,600	1,632,816.00	0.16
25	001914	招商积余	75,700	1,533,682.00	0.15
26	688303	大全能源	24,814	1,501,495.14	0.15
27	300072	三聚环保	186,400	1,478,152.00	0.15
28	300033	同花顺	10,000	1,445,800.00	0.15
29	300316	晶盛机电	19,400	1,348,300.00	0.14
30	601888	中国中免	6,000	1,316,460.00	0.13
31	300699	光威复材	14,400	1,216,512.00	0.12
32	600153	建发股份	133,100	1,207,217.00	0.12
33	000651	格力电器	30,500	1,129,415.00	0.11
34	300474	景嘉微	7,400	1,126,280.00	0.11
35	601868	中国能建	404,300	1,103,739.00	0.11
36	600516	方大炭素	100,200	1,084,164.00	0.11
37	600158	中体产业	70,800	1,070,496.00	0.11
38	000063	中兴通讯	30,400	1,018,400.00	0.10
39	603392	万泰生物	4,500	996,750.00	0.10
40	601800	中国交建	108,300	929,214.00	0.09
41	603486	科沃斯	6,100	920,795.00	0.09
42	000581	威孚高科	42,300	911,142.00	0.09
43	600176	中国巨石	48,100	875,420.00	0.09
44	002493	荣盛石化	45,300	822,648.00	0.08
45	002085	万丰奥威	146,100	802,089.00	0.08
46	600648	外高桥	60,400	799,092.00	0.08
47	300133	华策影视	117,900	798,183.00	0.08
48	000062	深圳华强	45,400	782,242.00	0.08
49	601336	新华保险	19,500	758,160.00	0.08
50	600050	中国联通	180,800	710,544.00	0.07
51	688728	格科微	23,033	675,097.23	0.07
52	600536	中国软件	12,700	634,111.00	0.06
53	603379	三美股份	27,600	628,728.00	0.06
54	601000	唐山港	224,900	618,475.00	0.06
55	000039	中集集团	34,900	598,884.00	0.06
56	600392	盛和资源	28,200	553,284.00	0.06
57	601636	旗滨集团	32,300	552,330.00	0.06
58	601233	桐昆股份	23,200	491,376.00	0.05
59	000799	酒鬼酒	2,300	488,750.00	0.05

60	600566	济川药业	16,700	473,278.00	0.05
61	002985	北摩高科	3,800	457,748.00	0.05
62	601225	陕西煤业	37,500	457,500.00	0.05
63	603260	合盛硅业	3,300	435,501.00	0.04
64	600640	新国脉	27,900	425,475.00	0.04
65	600782	新钢股份	70,500	372,240.00	0.04
66	600256	广汇能源	56,500	369,510.00	0.04
67	600755	厦门国贸	50,000	360,500.00	0.04
68	600970	中材国际	31,200	356,616.00	0.04
69	600132	重庆啤酒	2,300	348,036.00	0.04
70	601138	工业富联	27,700	330,184.00	0.03
71	603899	晨光文具	4,700	303,197.00	0.03
72	688262	国芯科技	7,129	299,275.42	0.03
73	601319	中国人保	59,300	278,710.00	0.03
74	600188	兖矿能源	11,300	265,889.00	0.03
75	600704	物产中大	40,100	237,392.00	0.02
76	601969	海南矿业	18,600	223,386.00	0.02
77	002416	爱施德	19,600	223,048.00	0.02
78	002299	圣农发展	8,400	203,028.00	0.02
79	688206	概伦电子	6,000	198,060.00	0.02
80	000877	天山股份	12,700	194,437.00	0.02
81	301091	深城交	5,240	171,845.80	0.02
82	688049	炬芯科技-U	3,260	168,574.60	0.02
83	002831	裕同科技	5,000	168,450.00	0.02
84	600881	亚泰集团	41,700	135,525.00	0.01
85	000488	晨鸣纸业	17,100	123,804.00	0.01
86	600025	华能水电	18,200	119,938.00	0.01
87	688296	和达科技	2,173	107,932.91	0.01
88	002419	天虹股份	17,000	106,760.00	0.01
89	600177	雅戈尔	13,800	95,082.00	0.01
90	301155	海力风电	902	87,268.50	0.01
91	600195	中牧股份	6,600	86,262.00	0.01
92	600546	山煤国际	10,300	84,563.00	0.01
93	600167	联美控股	9,200	82,892.00	0.01
94	002607	中公教育	10,300	80,958.00	0.01
95	600258	首旅酒店	2,800	73,164.00	0.01
96	688255	凯尔达	1,648	62,409.76	0.01
97	002032	苏 泊 尔	900	56,016.00	0.01
98	301050	雷电微力	233	54,694.42	0.01
99	600095	湘财股份	5,200	52,624.00	0.01
100	600398	海澜之家	6,600	42,306.00	0.00
101	301029	怡合达	462	41,519.94	0.00

102	601718	际华集团	13,800	41,124.00	0.00
103	301058	中粮工科	1,386	25,280.64	0.00
104	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.00
105	301018	申菱环境	782	20,378.92	0.00
106	300994	久祺股份	420	19,089.00	0.00
107	001296	长江材料	310	18,376.80	0.00
108	301168	通灵股份	329	17,150.77	0.00
109	301118	恒光股份	315	15,441.30	0.00
110	301108	洁雅股份	280	15,038.80	0.00
111	301179	泽宇智能	295	14,977.15	0.00
112	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.00
113	301180	万祥科技	654	14,858.88	0.00
114	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.00
115	301111	粤万年青	379	13,901.72	0.00
116	301199	迈赫股份	402	12,864.00	0.00
117	301020	密封科技	421	12,815.24	0.00
118	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.00
119	301126	达嘉维康	662	12,730.26	0.00
120	301185	鸥玛软件	578	12,230.48	0.00
121	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.00
122	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.00
123	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.00
124	301045	天禄科技	335	9,503.95	0.00
125	300774	倍杰特	444	9,359.52	0.00
126	301040	中环海陆	241	9,280.91	0.00
127	301078	孩子王	756	9,177.84	0.00
128	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.00
129	301052	果麦文化	252	8,477.28	0.00
130	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
131	301066	万事利	344	7,856.96	0.00
132	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
133	301133	金钟股份	286	7,707.70	0.00
134	301198	喜悦智行	262	7,650.40	0.00
135	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00
136	301098	金埔园林	307	6,806.19	0.00
137	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
138	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
139	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00
140	301036	双乐股份	205	6,135.65	0.00
141	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
142	300854	中兰环保	203	5,539.87	0.00
143	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00

144	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
145	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
146	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
147	301037	保立佳	193	4,682.18	0.00
148	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
149	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00
150	301068	大地海洋	144	4,086.72	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	002142	宁波银行	34,641,546.57	3.87
2	002415	海康威视	34,352,143.25	3.84
3	600036	招商银行	32,991,812.40	3.69
4	600837	海通证券	30,527,310.58	3.41
5	601398	工商银行	23,725,272.00	2.65
6	601166	兴业银行	20,727,315.00	2.32
7	601318	中国平安	19,328,157.95	2.16
8	600519	贵州茅台	17,051,458.96	1.91
9	601658	邮储银行	16,996,945.00	1.90
10	600919	江苏银行	15,833,355.43	1.77
11	600436	片仔癀	13,331,844.00	1.49
12	601899	紫金矿业	13,133,545.00	1.47
13	600900	长江电力	12,172,987.00	1.36
14	601939	建设银行	11,217,654.00	1.25
15	688036	传音控股	11,173,570.20	1.25
16	000002	万 科 A	10,478,462.64	1.17
17	688099	晶晨股份	10,313,871.27	1.15
18	300285	国瓷材料	9,944,606.84	1.11
19	000988	华工科技	9,876,026.00	1.10
20	601601	中国太保	9,049,832.96	1.01

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	002415	海康威视	50,955,337.75	5.69
2	002142	宁波银行	29,286,452.00	3.27
3	600036	招商银行	28,617,584.00	3.20
4	600837	海通证券	27,026,723.00	3.02
5	601398	工商银行	23,605,628.00	2.64

6	000002	万 科A	19,767,286.56	2.21
7	000776	广发证券	18,279,623.00	2.04
8	601658	邮储银行	17,821,788.00	1.99
9	601166	兴业银行	16,898,303.00	1.89
10	002594	比亚迪	16,407,438.48	1.83
11	601318	中国平安	15,455,186.03	1.73
12	600919	江苏银行	13,743,264.91	1.54
13	601788	光大证券	13,047,794.39	1.46
14	002008	大族激光	12,938,700.60	1.45
15	000333	美的集团	11,988,063.00	1.34
16	300274	阳光电源	11,521,849.50	1.29
17	603799	华友钴业	10,940,846.70	1.22
18	688036	传音控股	10,870,430.12	1.21
19	300124	汇川技术	10,524,537.14	1.18
20	601939	建设银行	10,230,594.30	1.14

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	874,380,670.43
卖出股票收入（成交）总额	1,020,270,085.67

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	102,845,600.00	10.38
2	央行票据	-	-
3	金融债券	262,341,000.00	26.47
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	570,045,500.00	57.51
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	20,309,192.00	2.05
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	955,541,292.00	96.40

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	019654	21 国债 06	520,000	52,015,600.00	5.25
2	210009	21 附息国债 09	500,000	50,830,000.00	5.13
3	149274	20 申证 10	400,000	40,624,000.00	4.10
4	163568	20 海通 06	400,000	39,984,000.00	4.03
5	175299	20 扬子 G3	300,000	30,447,000.00	3.07

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

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

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

无。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 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。

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

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

8.11.2 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。

8.11.3 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。

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

海通证券股份有限公司

2021 年 10 月 15 日，中国证券监督管理委员会重庆监管局针对海通证券股份有限公司的如下违规行为：1. 未对奥瑞德违规对外担保事项保持充分关注，出具的文件存在虚假记载；2. 海通证券未保持合理职业怀疑对奥瑞德涉及的民间借贷事项进行充分核查和验证，出具的文件存在虚假记载，责令公司改正，没收财务顾问业务收入 100 万元，并处以 300 万元罚款。

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	243,916.31
2	应收证券清算款	98,100,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	12,081,079.18
5	应收申购款	10,309.45
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	110,435,304.94

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	110072	广汇转债	9,733,666.80	0.98
2	127018	本钢转债	7,681,050.00	0.77
3	110052	贵广转债	2,389,475.20	0.24

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
鹏华弘惠	630	695,709.50	434,918,280.96	99.23	3,378,704.10	0.77

混合 A						
鹏华弘惠混合 C	10,750	35,856.77	375,500,285.55	97.42	9,959,962.50	2.58
合计	11,380	72,386.40	810,418,566.51	98.38	13,338,666.60	1.62

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	鹏华弘惠混合 A	169,146.41	0.0386
	鹏华弘惠混合 C	-	-
	合计	169,146.41	0.0205

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。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	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	鹏华弘惠混合 A	-
	鹏华弘惠混合 C	-
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	鹏华弘惠混合 A	0~10
	鹏华弘惠混合 C	-
	合计	0~10

注：1、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未持有本基金份额。

2、截至本报告期末，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。

9.4 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

无。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	鹏华弘惠混合 A	鹏华弘惠混合 C
基金合同生效日（2016 年 9 月 27 日）	400,144,353.42	700,107,567.81

基金份额总额		
本报告期期初基金份额总额	294,968,515.64	453,297,952.32
本报告期基金总申购份额	327,736,872.53	313,469,315.98
减：本报告期基金总赎回份额	184,408,403.11	381,307,020.25
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	438,296,985.06	385,460,248.05

§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

基金管理人的重大人事变动：

报告期内，公司原副总经理高阳先生辞去公司副总经理职务，经公司董事会审议通过，于 2021 年 1 月 16 日离任。

报告期内，经公司董事会审议通过，聘任王宗合先生担任公司副总经理，任职日期自 2021 年 1 月 28 日起；聘任梁浩先生担任公司副总经理，任职日期自 2021 年 1 月 28 日起。

报告期内，公司原副总经理苏波先生辞去公司副总经理职务，经公司董事会审议通过，于 2021 年 7 月 24 日离任。

报告期内，经公司董事会审议通过，聘任李伟先生担任公司副总经理，任职日期自 2021 年 7 月 24 日起。

本公司已将上述变更事项报中国证券监督管理委员会深圳监管局备案。

报告期内，经公司股东会审议通过，史际春先生不再担任公司独立董事，于 2021 年 4 月 22 日离任；聘任蒋毅刚先生担任公司独立董事，任职日期自 2021 年 4 月 22 日起。

基金托管人的重大人事变动：

2021 年 1 月 26 日，根据工作安排，陈正涛先生不再担任平安银行股份有限公司资产托管事业部总裁。2021 年 2 月 26 日，平安银行股份有限公司任命黄伟先生担任资产托管事业部副总裁（主持工作）。

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

无。

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。本年度应支付给天健会计师事务所（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 3 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

本基金管理人、基金托管人涉及托管业务机构及其高级管理人员在报告期内未受到任何稽查或处罚。

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	
中信证券	1	792,793,404.27	42.49%	722,474.09	44.51%	-
兴业证券	1	771,899,826.99	41.37%	626,244.38	38.58%	-
国泰君安	1	301,234,463.34	16.14%	274,514.94	16.91%	-

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
中信证券	109,161,064.60	13.28%	9,647,200,000.00	32.48%	-	-
兴业证券	119,751,799.50	14.56%	9,893,200,000.00	33.31%	-	-
国泰君安	593,334,959.20	72.16%	10,157,200,000.00	34.20%	-	-

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关于旗下部分基金参与东莞农村商业银行股份有限公司申购（含定期定额申购）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	2021 年 01 月 04 日
2	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国银行股份有限公司定期定额申购和网上银行、手机银行申购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	2021 年 01 月 04 日
3	鹏华基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《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	2021 年 01 月 16 日
4	鹏华弘惠灵活配置混合型证券投资基金 2020 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	2021 年 01 月 22 日
5	鹏华基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《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	2021 年 01 月 28 日
6	鹏华基金管理有限公司高级管理人员	《上海证券报》、基金管	2021 年 01 月 28 日

	变更公告	理人网站及中国证监会基金电子披露网站	
7	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	2021 年 02 月 06 日
8	鹏华基金管理有限公司关于终止包商银行股份有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	《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	2021 年 02 月 08 日
9	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	2021 年 03 月 06 日
10	鹏华基金管理有限公司关于对旗下基金中基金资产管理计划通过直销渠道申购、赎回、转换旗下公募基金免除相关费用的公告	《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	2021 年 03 月 09 日
11	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	2021 年 03 月 10 日
12	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购贝泰妮首次公开发行 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	2021 年 03 月 19 日
13	鹏华基金管理有限公司关于直销渠道相关业务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	2021 年 03 月 22 日
14	鹏华弘惠灵活配置混合型证券投资基金 2020 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	2021 年 03 月 30 日
15	鹏华基金管理有限公司旗下基金 2020 年年度报告提示性公告	《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	2021 年 03 月 30 日
16	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加珠海盈米基金销售有限公司基金转换业务申购补差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	2021 年 03 月 30 日
17	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国银行股份有限公司定期定额申购和网上银行、手机银行申购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	2021 年 04 月 01 日
18	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	2021 年 04 月 10 日
19	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与北京展恒基金销售股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优	《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	2021 年 04 月 19 日

	惠活动的公告		
20	鹏华基金管理有限公司关于调整旗下部分基金单笔最低申购（含定期定额投资）金额、单笔最低转换份额和账户最低余额限制的公告	《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	2021 年 04 月 19 日
21	鹏华弘惠灵活配置混合型证券投资基金 2021 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	2021 年 04 月 21 日
22	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2021 年第 1 季度报告提示性公告	《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	2021 年 04 月 21 日
23	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购志特新材首次公开发行 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	2021 年 04 月 23 日
24	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购瑞华泰首次公开发行 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	2021 年 04 月 23 日
25	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	2021 年 04 月 26 日
26	鹏华弘惠灵活配置混合型证券投资基金（A 类基金份额）基金产品资料概要（更新）	《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	2021 年 05 月 14 日
27	鹏华弘惠灵活配置混合型证券投资基金（C 类基金份额）基金产品资料概要（更新）	《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	2021 年 05 月 14 日
28	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与珠海盈米基金销售有限公司相关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	2021 年 05 月 14 日
29	鹏华弘惠灵活配置混合型证券投资基金基金合同	《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	2021 年 05 月 25 日
30	鹏华基金管理有限公司关于修订旗下部分公募基金基金合同和托管协议的公告	《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	2021 年 05 月 25 日
31	鹏华弘惠灵活配置混合型证券投资基金托管协议	《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	2021 年 05 月 25 日
32	鹏华弘惠灵活配置混合型证券投资基金更新的招募说明书(2021 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	2021 年 05 月 28 日
33	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	2021 年 06 月 04 日

34	鹏华基金管理有限公司关于鹏华弘惠灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 1 次分红公告	《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	2021 年 06 月 09 日
35	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行股份有限公司申购及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	2021 年 07 月 01 日
36	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国人寿保险股份有限公司申购（含定期定额申购）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	2021 年 07 月 01 日
37	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中泰证券股份有限公司申购（含定期定额申购）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	2021 年 07 月 12 日
38	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与平安银行股份有限公司申购（含定期定额申购）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	2021 年 07 月 16 日
39	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购新柴股份首次公开发行 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	2021 年 07 月 17 日
40	鹏华弘惠灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 2 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	2021 年 07 月 20 日
41	鹏华基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《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	2021 年 07 月 24 日
42	鹏华基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《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	2021 年 07 月 24 日
43	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	2021 年 07 月 29 日
44	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与华融证券股份有限公司申购（含定期定额申购）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	2021 年 07 月 31 日
45	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与招商证券股份有限公司申购（含定期定额申购）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	2021 年 07 月 31 日
46	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与申万宏源证券有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的	《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	2021 年 08 月 12 日

	公告		
47	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与申万宏源西部证券有限公司申购（含定期定额申购）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	2021 年 08 月 12 日
48	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与华宝证券股份有限公司认\申购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	2021 年 08 月 27 日
49	鹏华弘惠灵活配置混合型证券投资基金 2021 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	2021 年 08 月 30 日
50	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购禾信仪器首次公开发行 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	2021 年 09 月 04 日
51	鹏华弘惠灵活配置混合型证券投资基金更新的招募说明书	《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	2021 年 09 月 14 日
52	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购万事利首次公开发行 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	2021 年 09 月 15 日
53	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与江苏银行股份有限公司认购、申购（含定期定额申购）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	2021 年 09 月 17 日
54	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与江苏银行股份有限公司认购、申购（含定期定额申购）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	2021 年 09 月 17 日
55	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与江海证券有限公司申购（含定期定额申购）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	2021 年 09 月 22 日
56	鹏华弘惠灵活配置混合型证券投资基金（A 类基金份额）基金产品资料概要（更新）	《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	2021 年 09 月 23 日
57	鹏华弘惠灵活配置混合型证券投资基金（C 类基金份额）基金产品资料概要（更新）	《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	2021 年 09 月 23 日
58	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（含定期定额申购）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	2021 年 09 月 29 日
59	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购深城交首次公开发行 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	2021 年 10 月 22 日
60	鹏华弘惠灵活配置混合型证券投资基	《上海证券报》、基金管	2021 年 10 月 26 日

	金 2021 年第 3 季度报告	理人网站及中国证监会基金电子披露网站	
61	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的债券调整估值的公告	《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	2021 年 10 月 30 日
62	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与新时代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	2021 年 11 月 10 日
63	鹏华基金管理有限公司关于终止晋城银行股份有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	《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	2021 年 11 月 12 日
64	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与西部证券股份有限公司申购（不含定期定额申购）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	2021 年 11 月 18 日
65	鹏华基金管理有限公司关于鹏华弘惠灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 2 次分红公告	《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	2021 年 11 月 20 日
66	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分公开募集证券投资基金可投资于北京证券交易所股票的公告	《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	2021 年 11 月 26 日
67	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与平安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	2021 年 11 月 26 日
68	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	2021 年 12 月 04 日
69	鹏华基金管理有限公司关于暂停客服电话服务的公告	《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	2021 年 12 月 11 日
70	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	2021 年 12 月 27 日
71	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国中金财富证券有限公司申购（含定期定额申购）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	2021 年 12 月 29 日
72	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国工商银行股份有限公司个人电子银行基金申购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	2021 年 12 月 31 日
73	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分	《上海证券报》、基金管	2021 年 12 月 31 日

	基金参与中国工商银行股份有限公司“2022 倾心回馈”基金定期定额申购费率优惠活动的公告	理人网站及中国证监会基金电子披露网站	

§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

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）《鹏华弘惠灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；

（二）《鹏华弘惠灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；

（三）《鹏华弘惠灵活配置混合型证券投资基金 2021 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

2022 年 3 月 30 日