

鹏华长治稳健养老目标一年持有期混合型  
基金中基金（FOF）  
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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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。

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

本报告期自 2021 年 08 月 11 日（基金合同生效日）起至 2021 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

|   |           |
|---|-----------|
| <b>§ 1 重要提示及目录</b>                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§ 2 基金简介</b>                         | <b>5</b>  |
| 2.1 基金基本情况                              | 5         |
| 2.2 基金产品说明                              | 5         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 7         |
| 2.4 信息披露方式                              | 7         |
| 2.5 其他相关资料                              | 7         |
| <b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>         | <b>7</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 7         |
| 3.2 基金净值表现                              | 8         |
| 3.3 其他指标                                | 9         |
| 3.4 过去三年基金的利润分配情况                       | 10        |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>10</b> |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 10        |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 11        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 11        |
| 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             | 12        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 13        |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况                 | 14        |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 14        |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 15        |
| 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        | 15        |
| 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      | 15        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>15</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 15        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 15        |
| 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      | 15        |
| <b>§ 6 审计报告</b>                         | <b>16</b> |
| 6.1 审计报告基本信息                            | 16        |
| 6.2 审计报告的基本内容                           | 16        |
| <b>§ 7 年度财务报表</b>                       | <b>18</b> |
| 7.1 资产负债表                               | 18        |
| 7.2 利润表                                 | 19        |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表                      | 20        |
| 7.4 报表附注                                | 21        |

|  |           |
|--|-----------|
| <b>§ 8 投资组合报告</b>                            | <b>47</b> |
| 8.1 期末基金资产组合情况                               | 47        |
| 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                         | 48        |
| 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            | 48        |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动                          | 49        |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                         | 50        |
| 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           | 50        |
| 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        | 50        |
| 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        | 50        |
| 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           | 50        |
| 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明                    | 51        |
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明                    | 51        |
| 8.12 本报告期投资基金情况                              | 51        |
| 8.13 投资组合报告附注                                | 53        |
| <b>§ 9 基金份额持有人信息</b>                         | <b>54</b> |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构                        | 54        |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况                     | 54        |
| 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             | 54        |
| 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 | 55        |
| <b>§ 10 开放式基金份额变动</b>                        | <b>55</b> |
| <b>§ 11 重大事件揭示</b>                           | <b>55</b> |
| 11.1 基金份额持有人大会决议                             | 55        |
| 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             | 55        |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼                  | 56        |
| 11.4 基金投资策略的改变                               | 56        |
| 11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件                      | 56        |
| 11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况                        | 56        |
| 11.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况                | 56        |
| 11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况                       | 56        |
| 11.9 其他重大事件                                  | 62        |
| <b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息</b>                   | <b>65</b> |
| 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况           | 65        |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息                          | 65        |
| <b>§ 13 备查文件目录</b>                           | <b>65</b> |
| 13.1 备查文件目录                                  | 65        |
| 13.2 存放地点                                    | 65        |
| 13.3 查阅方式                                    | 65        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                              |
|------------|------------------------------|
| 基金名称       | 鹏华长治稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF） |
| 基金简称       | 鹏华长治稳健养老一年持有期混合（FOF）         |
| 基金主代码      | 012783                       |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                       |
| 基金合同生效日    | 2021 年 8 月 11 日              |
| 基金管理人      | 鹏华基金管理有限公司                   |
| 基金托管人      | 招商银行股份有限公司                   |
| 报告期末基金份额总额 | 215,368,825.48 份             |
| 基金合同存续期    | 不定期                          |

注：无。

### 2.2 基金产品说明

|      |   |
|------|---|
| 投资目标 | 在控制风险的前提下，通过主动的资产配置、基金优选，力求基金资产稳定增值。  |
| 投资策略 | <p>本基金的投资策略分为两个层面，首先依据大类资产配置策略动态调整基金资产在各大类资产间的分配比例；在做好资产配置比例分配后，本基金将主要通过甄选基金来实现每一部分的投资策略。</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金采用目标风险策略，根据权益类资产的战略配置比例来界定风险水平。本基金为风险收益特征相对稳健的基金，为了保持稳健的风险收益特征，本基金的长期资产配置以非权益类资产为主，权益类资产为辅。本基金的战略资产配置方案为：权益类资产（包括股票、股票型基金、混合型基金）的投资占比为 25%，非权益类资产（包括债券、债券型基金、货币市场基金等）的投资占比为 75%。在基金运作过程中，为了确保资产配置的有效性，本基金采取战术资产配置策略作为有效补充，基于宏观经济发展趋势、政策导向、市场未来的发展趋势以及各大类资产未来的风险收益比等因素，判断权益类资产和非权益类资产之间的相对吸引力，在一定范围内调整大类资产配置的比例，并对权益类资产的向上、向下的战术调整幅度分别不得超过战略配置比例的 5%、10%，即权益类资产占基金资产的比例在 15%-30%之间。</p> <p>2、基金投资策略</p> <p>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评价。</p> <p>（1）基金业绩评价和风格评价</p> |

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、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：基于合同契约和实际比较基准的拟合等考察基金风格是否清晰。

#### （2）基金公司综合评价

对于基金公司的综合评价，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。

对于存托凭证投资，本基金将在深入研究的基础上，通过定性分析和定量分析相结合的方式，精选出具有比较优势的存托凭证。

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。

### 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。   |
| 业绩比较基准 | 中证 800 指数收益率×25%+中证全债指数收益率×75%   |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金中基金，其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。本基金还可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。 |

注：无。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目          | 基金管理人                          | 基金托管人                 |
|-------------|--------------------------------|-----------------------|
| 名称          | 鹏华基金管理有限公司                     | 招商银行股份有限公司            |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名                             | 张戈                    |
|             | 联系电话                           | 0755-82825720         |
|             | 电子邮箱                           | zhangge@phfund.com.cn |
| 客户服务电话      | 4006788999                     | 95555                 |
| 传真          | 0755-82021126                  | 0755-83195201         |
| 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 | 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦  |
| 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 | 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦  |
| 邮政编码        | 518048                         | 518040                |
| 法定代表人       | 何如                             | 缪建民                   |

## 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 | 普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙） | 中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼    |
| 注册登记机构 | 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 8 月 11 日（基金合同生效日）-2021 年 12 月 31 日 |
|---------------|---|

|                      |                |
|----------------------|----------------|
| 本期已实现收益              | 2,165,553.77   |
| 本期利润                 | 2,094,696.28   |
| 加权平均基金份额本期利润         | 0.0097         |
| 本期加权平均净值利润率          | 0.97%          |
| 本期基金份额净值增长率          | 0.97%          |
| <b>3.1.2 期末数据和指标</b> | <b>2021 年末</b> |
| 期末可供分配利润             | 2,096,280.60   |
| 期末可供分配基金份额利润         | 0.0097         |
| 期末基金资产净值             | 217,465,106.08 |
| 期末基金份额净值             | 1.0097         |
| <b>3.1.3 累计期末指标</b>  | <b>2021 年末</b> |
| 基金份额累计净值增长率          | 0.97%          |

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。

（4）本基金合同于 2021 年 08 月 11 日生效，至 2021 年 12 月 31 日未满一年，故 2021 年的数据和指标为非完整会计年度数据。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

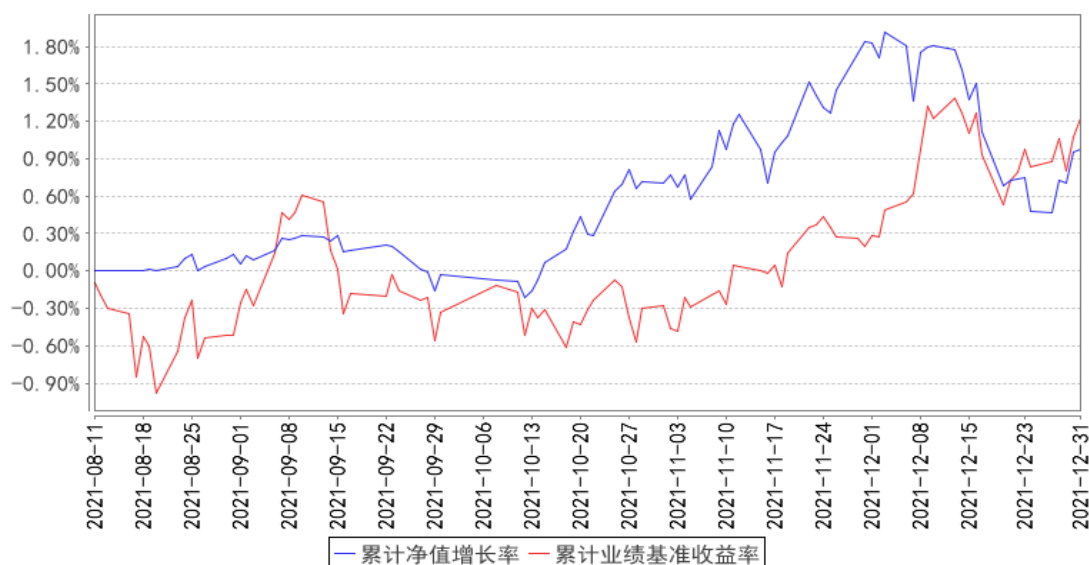
| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月      | 1.00%    | 0.19%       | 1.56%      | 0.18%         | -0.56% | 0.01%  |
| 自基金合同生效起至今 | 0.97%    | 0.16%       | 1.22%      | 0.20%         | -0.25% | -0.04% |

注：业绩比较基准=中证 800 指数收益率×25%+中证全债指数收益率×75%



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

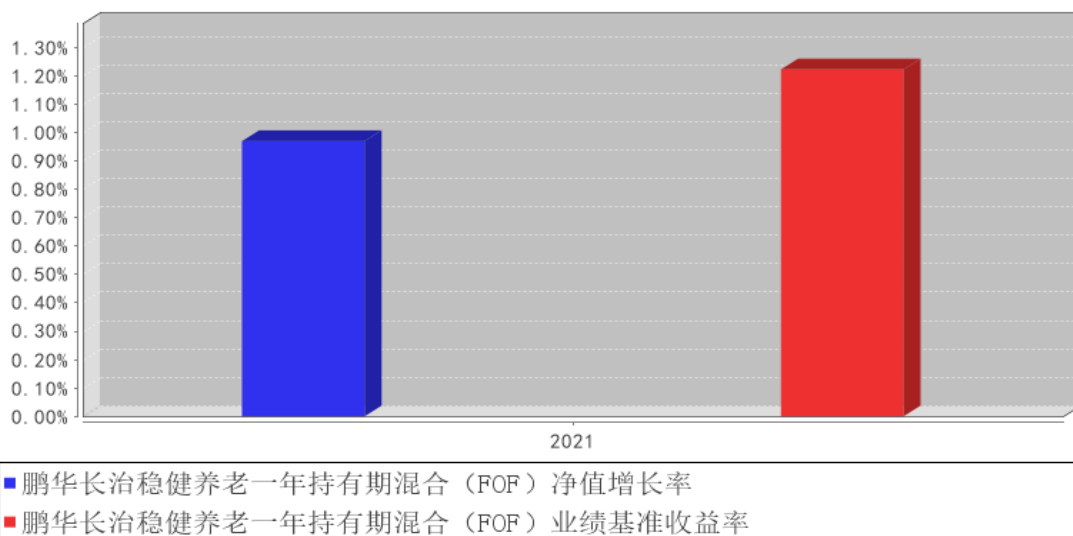
鹏华长治稳健养老一年持有期混合（FOF）累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2021 年 08 月 11 日生效，截至本报告期末本基金基金合同生效未滿一年。2、本基金管理人将严格按照本基金合同的约定，于本基金建仓期届满后确保各项投资比例符合基金合同的约定。

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

鹏华长治稳健养老一年持有期混合（FOF）基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按照实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 其他指标

注：无。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

注：无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

鹏华基金管理有限公司成立于 1998 年 12 月 22 日，业务范围包括基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。截至本报告期末，公司股东由国信证券股份有限公司、意大利欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）、深圳市北融信投资发展有限公司组成，公司性质为中外合资企业，公司注册资本 15,000 万元人民币。截至本报告期末，公司管理资产总规模达到 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 |        |   |
| 赵强 | 基金经理 | 2021-08-11      | -    | 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。本基金为本报告期内新成立基金，聘任赵强为本基金基金经理。 |

注：1. 任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日；担任新成立基金基金经理的，任职日期为基金合同生效日。

2. 证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

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

注：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合规守信情况的说明

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

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《鹏华基金管理有限公司公平交易管理规定》，将公司所管理的封闭式基金、开放式基金、社保组合、养老组合、特定客户资产管理组合等不同资产组合的授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动均纳入公平交易管理，在业务流程和岗位职责中制定公平交易的控制规则和控制活动，建立对公平交易的执行、监督及审核流程，严禁在不同投资组合之间进行利益输送。在投资研究环节：1、公司使用唯一的研究报告发布平台“研究报告管理平台”，确保各投资组合在获得投资信息、研究支持、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；2、公司严格按照《股票库管理规定》、《信用债券投资与风险控制管理规定》，执行股票及信用产品出入库及日常维护工作，确保相关证券入库以内容严谨、观点明确的研究报告作为依据；3、在公司股票库基础上，各涉及股票投资的资产组合根据各自的投资目标、投资风格、投资范围和防范关联交易的原则分别建立资产组合股票库，基金经理在股票库基础上根据投资授权以及基金合同择股方式构建具体的投资组合；4、严格执行投资授权制度，明确投资决策委员会、分管投资副总裁、基金经理等各主体的职责和权限划分，合理确定基金经理的投资权限，超过投资权限的操作，应严格履行审批程序。在交易执行环节：1、所有公司管理的资产组合的交易必须通过集中交易室完成，集中交易室负责建立和执行交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会；2、针对交易所公开竞价交易，集中交易室应严格启用恒生交易系统内的公平交易程序，交易系统则自动启用公平交易功能，由系

统按照“未委托数量”的比例对不同资产组合进行委托量的公平分配；如果相关基金经理坚持以不同的价格进行交易，且当前市场价格不能同时满足多个资产组合的指令价格要求时，交易系统自动按照“价格优先”原则进行委托；当市场价格同时满足多个资产组合的指令价格要求时，则交易系统自动按照“同一指令价格下的公平交易”模式，进行公平委托和交易量分配；3、银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易需依据公司《股票投资交易流程》和《固定收益投资管理流程》的规定执行；银行间市场交易、交易所大宗交易等以公司名义进行的交易，各投资组合经理应在交易前独立确定各投资组合的交易价格和数量，公司按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；4、新股、新债申购及非公开定向增发交易需依据公司《新股申购流程》、《固定收益投资管理流程》和《非公开定向增发流程》的规定执行，对新股和新债申购方案和分配过程进行审核和监控。在交易监控、分析与评估环节：1、为加强对日常投资交易行为的监控和管理，杜绝利益输送、不公平交易等违规交易行为，防范日常交易风险，公司明确了关注类交易的界定及对应的监控和评估措施机制；所监控的交易包括但不限于：交易所公开竞价交易中同日同向交易的交易时机和交易价差、不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差、关联交易、债券交易收益率偏离度、成交量和成交价格异常、银行间债券交易对手交易等；2、将公平交易作为投资组合业绩归因分析和交易绩效评价的重要关注内容，发现的异常情况由投资监察员进行分析；3、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

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。本

基金成立于 2021 年三季度，此时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表现较弱，而新兴产业则由于局部景气，表现出较好的走势。直到 2021 年四季度，中国的经济基本面已经显示出领先于全球的迹象，即上游资源品的冲高回落和经济的下行，而同期欧美经济体还处于高通胀的阶段。随着中国国内通胀的缓解，市场预期政策托底的时机越来越近，宽货币乃至宽信用的预期也越来越强。在宽信用的大背景下，权益总体优于固收，而权益中资产也出现了结构性分化，即顺周期板块会有较好的相对收益。从全年运作看，本基金考虑到养老运作的长期性，重点配置了成长类板块基金资产，并精选不同策略类型的基金进一步分散风险。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期份额净值增长率为 0.97%，同期业绩比较基准增长率为 1.22%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

全球宏观经济在全球一体化的浪潮下已经变得密不可分，管理人结合全球主要发达市场宏观经济和中国具体情况，对宏观基本面以及证券市场进行简要展望。

从增长端来看，中国 2022 年上半年不容乐观，下半年企业盈利会逐步回暖。主要逻辑是投资端房地产产业链虽然政策预期边际向好，但企业会将现金流进行降杠杆的操作，实际新增投资有限；出口在疫情加持下增速也会逐步放缓；而基建的托底有隐性债务的政治约束，放量到体现在企业报表上尚需时日；最终消费会受上述经济部门影响持续疲软。下半年后，由于基数以及经济刺激的见效，预期中国经济会逐步摆脱上半年的颓势。

从流动性来看，美联储缩表加息进程展开后，美元强势回归，对全球流动性会阶段性产生冲击。结合上一次缩表进程，冲击主要发生于缩表至加息前期。今年美国预期加息四次，对新兴市场会是不小的考验。中国的货币政策周期走在了美国前面，预计宽货币后大概率会出现宽信用，可以较好地抵御全球流动性紧缩的风险，对中国股市有较强的支持作用。

展望证券市场，我们相对看好流动性宽松的国内市场，具体而言，权益类资产在年初释放对经济的担忧后，风险相对可控。上半年顺周期资产大概率有相对收益，但博弈氛围浓厚，我们还是期待受益于经济结构调整中的成长性行业资产。我们会继续为投资者不断优化资产配置，适应未来低增长、宽信用、局部景气的经济环境。

#### 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，本基金期末可供分配利润为 2,096,280.60 元，期末基金份额净值 1.0097 元。2、本基金本报告期内未进行利润分配。3、根据相关法律法规及本基金基金合同的规定，本基金管理人将会综合考虑各方面因素，在严格遵守规定前提下，对本报告期内可供分配利润适时作出相应安排。

#### 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

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

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

### 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

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

|            |                         |
|------------|-------------------------|
| 财务报表是否经过审计 | 是                       |
| 审计意见类型     | 标准无保留意见                 |
| 审计报告编号     | 普华永道中天审字(2022)第 24491 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         | 鹏华长治稳健养老目标一年持有期混合型证券投资基金中基金(FOF)全体基金份额持有人  |
| 审计意见            | <p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了鹏华长治稳健养老目标一年持有期混合型证券投资基金中基金(FOF)(以下简称“鹏华长治稳健养老一年持有期混合(FOF)基金”)的财务报表,包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表,2021 年 8 月 11 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了鹏华长治稳健养老一年持有期混合(FOF)基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年 8 月 11 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p> |
| 形成审计意见的基础       | <p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于鹏华长治稳健养老一年持有期混合(FOF)基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>   |
| 强调事项            | 无。   |
| 其他事项            | 无。   |
| 其他信息            | 无。   |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | <p>鹏华长治稳健养老一年持有期混合(FOF)基金的基金管理人鹏华基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估鹏华长治稳健养老一年持有期混合(FOF)基金的持续经营能力,披露</p>   |



|                 |  |
|-----------------|--|
|                 | <p>与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算鹏华长治稳健养老一年持有期混合 (FOF) 基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督鹏华长治稳健养老一年持有期混合 (FOF) 基金的财务报告过程。</p>  |
| 注册会计师对财务报表审计的责任 | <p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对鹏华长治稳健养老一年持有期混合 (FOF) 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长治稳健养老一年持有期混合 (FOF) 基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p> |
| 会计师事务所的名称       | 普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)   |
| 注册会计师的姓名        | 单峰   仲文渊   |
| 会计师事务所的地址       | 中国上海市  |
| 审计报告日期          | 2022 年 3 月 23 日  |

## § 7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：鹏华长治稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）

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<br>2021 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|---------------------------------|
| <b>资产：</b>      |            |                                 |
| 银行存款            | 7.4.7.1    | 2,152,260.19                    |
| 结算备付金           |            | 2,010,831.94                    |
| 存出保证金           |            | 25,412.37                       |
| 交易性金融资产         | 7.4.7.2    | 257,488,750.35                  |
| 其中：股票投资         |            | 1,241,662.14                    |
| 基金投资            |            | 176,489,685.71                  |
| 债券投资            |            | 79,757,402.50                   |
| 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    | -                               |
| 应收证券清算款         |            | 9,916,264.49                    |
| 应收利息            | 7.4.7.5    | 1,017,423.05                    |
| 应收股利            |            | 364.70                          |
| 应收申购款           |            | 5,060.57                        |
| 递延所得税资产         |            | -                               |
| 其他资产            | 7.4.7.6    | -                               |
| 资产总计            |            | 272,616,367.66                  |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2021 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负债：</b>      |            |                                 |
| 短期借款            |            | -                               |
| 交易性金融负债         |            | -                               |
| 衍生金融负债          | 7.4.7.3    | -                               |
| 卖出回购金融资产款       |            | 46,000,000.00                   |
| 应付证券清算款         |            | 9,002,383.32                    |
| 应付赎回款           |            | -                               |
| 应付管理人报酬         |            | 54,465.63                       |
| 应付托管费           |            | 24,000.99                       |
| 应付销售服务费         |            | -                               |
| 应付交易费用          | 7.4.7.7    | 28,049.87                       |
| 应交税费            |            | 28,162.42                       |
| 应付利息            |            | -25,800.65                      |

|               |          |                |
|---------------|----------|----------------|
| 应付利润          |          | -              |
| 递延所得税负债       |          | -              |
| 其他负债          | 7.4.7.8  | 40,000.00      |
| 负债合计          |          | 55,151,261.58  |
| <b>所有者权益：</b> |          |                |
| 实收基金          | 7.4.7.9  | 215,368,825.48 |
| 未分配利润         | 7.4.7.10 | 2,096,280.60   |
| 所有者权益合计       |          | 217,465,106.08 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 272,616,367.66 |

注：（1）报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0097 元，基金份额总额 215,368,825.48 份。

（2）本财务报表的实际编制期间为 2021 年 08 月 11 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日，无上年度末数据。

## 7.2 利润表

会计主体：鹏华长治稳健养老目标一年持有期混合型证券投资基金中基金（FOF）

本报告期：2021 年 8 月 11 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                     | 附注号        | 本期<br>2021 年 8 月 11 日（基金合同<br>生效日）至 2021 年 12 月 31<br>日 |
|------------------------|------------|---|
| 一、收入                   |            | 3,045,404.56  |
| 1. 利息收入                |            | 817,632.44  |
| 其中：存款利息收入              | 7.4.7.11   | 28,908.79   |
| 债券利息收入                 |            | 783,816.07  |
| 资产支持证券利息收入             |            | -   |
| 买入返售金融资产收入             |            | 4,907.58  |
| 证券出借利息收入               |            | -   |
| 其他利息收入                 |            | -   |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      |            | 2,295,690.33  |
| 其中：股票投资收益              | 7.4.7.12   | -702,826.54   |
| 基金投资收益                 | 7.4.7.13   | -4,278.00   |
| 债券投资收益                 | 7.4.7.14   | -   |
| 资产支持证券投资收益             | 7.4.7.14.5 | -   |
| 贵金属投资收益                | 7.4.7.15   | -   |
| 衍生工具收益                 | 7.4.7.16   | -   |
| 股利收益                   | 7.4.7.17   | 3,002,794.87  |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.18   | -67,918.21  |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）     |            | -   |

|                     |            |              |
|---------------------|------------|--------------|
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）  | 7.4.7.19   | -            |
| 减：二、费用              |            | 950,708.28   |
| 1. 管理人报酬            | 7.4.10.2.1 | 261,390.75   |
| 2. 托管费              | 7.4.10.2.2 | 110,164.93   |
| 3. 销售服务费            | 7.4.10.2.3 | -            |
| 4. 交易费用             | 7.4.7.20   | 50,190.78    |
| 5. 利息支出             |            | 481,609.70   |
| 其中：卖出回购金融资产支出       |            | 481,609.70   |
| 6. 税金及附加            |            | 3,276.96     |
| 7. 其他费用             | 7.4.7.21   | 44,075.16    |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） |            | 2,094,696.28 |
| 减：所得税费用             |            | -            |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   |            | 2,094,696.28 |

注：本财务报表的实际编制期间为 2021 年 08 月 11 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日止期间，无上年度可比较期间及可比较数据。

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鹏华长治稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）

本报告期：2021 年 8 月 11 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                                | 本期<br>2021 年 8 月 11 日（基金合同生效日）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）                   | 215,268,449.76                                   | -            | 215,268,449.76 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）          | -  | 2,094,696.28 | 2,094,696.28   |
| 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） | 100,375.72                                       | 1,584.32     | 101,960.04     |
| 其中：1. 基金申购款                       | 100,375.72                                       | 1,584.32     | 101,960.04     |
| 2. 基金赎回款                          | -  | -            | -              |
| 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)      |                |              |                |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 215,368,825.48 | 2,096,280.60 | 217,465,106.08 |

注：本财务报表的实际编制期间为 2021 年 08 月 11 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日止期间，无上年度可比较期间及可比较数据。

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

鹏华长治稳健养老目标一年持有期混合型证券投资基金中基金（FOF）（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[2021]1692 号《关于准予鹏华长治稳健养老目标一年持有期混合型证券投资基金中基金（FOF）注册的批复》核准，由鹏华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华长治稳健养老目标一年持有期混合型证券投资基金中基金（FOF）基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 215,161,906.98 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2021)第 0657 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《鹏华长治稳健养老目标一年持有期混合型证券投资基金中基金（FOF）基金合同》于 2021 年 8 月 11 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 215,268,449.76 份基金份额，其中认购资金利息折合 106,542.78 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，基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金设置投资者最短持有期限为一年。对于每份基金份额，自基金合同生效之日(对认购份额而言)起或自基金份额申购确认日(对申购份额而言)起一年内锁定。在锁定期内，该份额不能赎回。自锁定期结束后第一个工作日(含)起，该份额可以赎回。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华长治稳健养老目标一年持有期混合型证券投资基金中基金（FOF）基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，主要包括经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金（包含 QDII 基金、香港互认基金），以及境内依法发行上市的股票（含主板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期

融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券等）、货币市场工具、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）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。

本基金的投资组合比例为：投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金份额的比例不低于基金资产的 80%；本基金投资于股票、股票型基金、混合型基金和商品基金（含商品期货基金和黄金 ETF）等品种的比例合计不超过基金资产的 30%；本基金投资于港股通标的股票占基金股票资产的 0-50%；在本基金认购份额的最短持有期期满后（含到期日），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，本基金认购份额的最短持有期期满前不受此款限制。本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率×25%+中证全债指数收益率×75%。

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》、《鹏华长治稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）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 08 月 11 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日止期间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 08 月 11 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日止期间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。本期财务报表的实际编制期间为 2021 年 08 月 11 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日。

#### 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、基金投资、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

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基金投资、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) 对于基金投资，根据中基协发[2017]3号《关于发布〈基金中基金估值业务指引（试行）〉的通知》之附件《基金中基金估值业务指引（试行）》，按采用如下方法估值：

(a) 对于交易型开放式指数基金、境内上市定期开放式基金及封闭式基金，按所投资基金估值日的收盘价估值；

(b) 对于境内上市开放式基金（LOF）及其他境内非货币市场基金，按所投资基金估值日的份额净值估值；

(c) 对于境内上市交易型货币市场基金，如所投资基金披露份额净值，则按所投资基金估值日的份额净值估值；如所投资基金披露万份（百份）收益，则按所投资基金前一估值日后至估值日期间（含节假日）的万份（百份）收益计提估值日基金收益；

(d) 对于境内非上市货币市场基金按所投资基金前一估值日后至估值日期间（含节假日）的万份收益计提估值日基金收益。

如遇所投资基金不公布基金份额净值、进行折算或拆分、估值日无交易等特殊情况，本基金根据以下原则进行估值：

(a) 以所投资基金的基金份额净值估值的，若所投资基金与基金中基金估值频率一致但未公布估值日基金份额净值，按其最近公布的基金份额净值为基础估值。

(b)以所投资基金的收盘价估值的，若估值日无交易，且最近交易日后市场环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后市场环境发生了重大变化的，可使用最新的基金份额净值为基础或参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素调整最近交易市价，确定公允价值。

(c)如果所投资基金前一估值日至估值日期间发生分红除权、折算或拆分，基金管理人应根据基金份额净值或收盘价、单位基金份额分红金额、折算拆分比例、持仓份额等因素合理确定公允价值。

(2)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。

(3)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。

(4)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<br>2021 年 12 月 31 日 |
|----------------|-------------------------|
| 活期存款           | 2,152,260.19            |
| 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             | 2,152,260.19            |

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日 |                |               |             |
|---------------|-------------------------|----------------|---------------|-------------|
|               | 成本                      | 公允价值           | 公允价值变动        |             |
| 股票            | 1,203,162.94            | 1,241,662.14   | 38,499.20     |             |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                       | -              | -             |             |
| 债券            | 交易所市场                   | 79,941,721.53  | 79,757,402.50 | -184,319.03 |
|               | 银行间市场                   | -              | -             | -           |
|               | 合计                      | 79,941,721.53  | 79,757,402.50 | -184,319.03 |
| 资产支持证券        | -                       | -              | -             |             |
| 基金            | 176,387,290.07          | 176,489,685.71 | 102,395.64    |             |
| 其他            | -                       | -              | -             |             |
| 合计            | 257,532,174.54          | 257,488,750.35 | -43,424.19    |             |

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

注：无。

## 7.4.7.4 买入返售金融资产

## 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

## 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

## 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2021年12月31日 |
|------------|--------------------|
| 应收活期存款利息   | 234.22             |
| 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  | 995.39             |
| 应收债券利息     | 1,016,180.90       |
| 应收资产支持证券利息 | -                  |
| 应收买入返售证券利息 | -                  |
| 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         | 12.54              |
| 合计         | 1,017,423.05       |

## 7.4.7.6 其他资产

注：无。

## 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021年12月31日 |
|-------------|--------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 28,049.87          |
| 银行间市场应付交易费用 | -                  |
| 合计          | 28,049.87          |

## 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021年12月31日 |
|-------------|--------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                  |
| 应付赎回费       | -                  |
| 应付证券出借违约金   | -                  |
| 预提费用        | 40,000.00          |
| 合计          | 40,000.00          |

## 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2021年8月11日（基金合同生效日）至2021年12月31日 |                |
|---------------|---------------------------------------|----------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额           |
| 基金合同生效日       | 215,268,449.76                        | 215,268,449.76 |
| 本期申购          | 100,375.72                            | 100,375.72     |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -                                     | -              |
| 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           | 215,368,825.48                        | 215,368,825.48 |

注：1、申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

2、本基金自 2021 年 7 月 19 日至 2021 年 8 月 9 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 215,161,906.98 元，折合为 215,161,906.98 份基金份额。根据《鹏华长治稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币 106,542.78 元在本基金成立后，折合为 106,542.78 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

## 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分        | 未实现部分      | 未分配利润合计      |
|----------------|--------------|------------|--------------|
| 基金合同生效日        | -            | -          | -            |
| 本期利润           | 2,165,553.77 | -70,857.49 | 2,094,696.28 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 1,119.00     | 465.32     | 1,584.32     |
| 其中：基金申购款       | 1,119.00     | 465.32     | 1,584.32     |
| 基金赎回款          | -            | -          | -            |
| 本期已分配利润        | -            | -          | -            |
| 本期末            | 2,166,672.77 | -70,392.17 | 2,096,280.60 |

## 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2021年8月11日（基金合同生效日）至2021年12月31日 |           |
|-----------|---------------------------------------|-----------|
|           | 活期存款利息收入                              | 16,894.07 |
| 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 | 11,904.48                             |           |
| 其他        | 110.24                                |           |
| 合计        | 28,908.79                             |           |

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<br>2021年8月11日（基金合同生效日）至2021年12月31日 |
|------------------|---------------------------------------|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | -702,826.54                           |
| 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               | -702,826.54                           |

##### 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<br>2021年8月11日（基金合同生效日）至2021年12月31日 |
|------------|---------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 15,565,227.90                         |
| 减：卖出股票成本总额 | 16,268,054.44                         |
| 买卖股票差价收入   | -702,826.54                           |

##### 7.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

#### 7.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2021年8月11日（基金合同生效日）至2021年12月31日 |
|---------------|---------------------------------------|
| 卖出/赎回基金成交总额   | 36,641,939.60                         |
| 减：卖出/赎回基金成本总额 | 36,646,217.60                         |
| 基金投资收益        | -4,278.00                             |

#### 7.4.7.14 债券投资收益

##### 7.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

注：无。

##### 7.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

##### 7.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。



## 7.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

## 7.4.7.14.5 资产支持证券投资收益

注：无。

## 7.4.7.15 贵金属投资收益

## 7.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

## 7.4.7.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

## 7.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

## 7.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

## 7.4.7.16 衍生工具收益

## 7.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

## 7.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

## 7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

| 项目            | 本期                              |
|---------------|---------------------------------|
|               | 2021年8月11日（基金合同生效日）至2021年12月31日 |
| 股票投资产生的股利收益   | -                               |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | -                               |
| 基金投资产生的股利收益   | 3,002,794.87                    |
| 合计            | 3,002,794.87                    |

## 7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期                              |
|------------|---------------------------------|
|            | 2021年8月11日（基金合同生效日）至2021年12月31日 |
| 1. 交易性金融资产 | -43,424.19                      |
| 股票投资       | 38,499.20                       |
| 债券投资       | -184,319.03                     |

|                        |            |
|------------------------|------------|
| 资产支持证券投资               | -          |
| 基金投资                   | 102,395.64 |
| 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 | 24,494.02  |
| 合计                     | -67,918.21 |

#### 7.4.7.19 其他收入

注：无。

#### 7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2021年8月11日（基金合同生效日）至2021年12月31日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 46,626.06                             |
| 银行间市场交易费用 | -                                     |
| 交易基金产生的费用 | 3,564.72                              |
| 其中：申购费    | 3,000.00                              |
| 赎回费       | -                                     |
| 交易费       | 564.72                                |
| 合计        | 50,190.78                             |

#### 7.4.7.20.1 持有基金产生的费用

| 项目                   | 本期费用<br>2021年8月11日（基金合同生效日）至2021年12月31日 |
|----------------------|---|
| 当期持有基金产生的应支付销售服务费（元） | 19,086.74                               |
| 当期持有基金产生的应支付管理费（元）   | 230,740.54                              |
| 当期持有基金产生的应支付托管费（元）   | 65,644.86                               |

注：上述费用为根据所投资基金的招募说明书列明的计算方法对销售服务费、管理费和托管费进行的估算；上述费用已在本基金所持有基金的净值中体现，不构成本基金的费用项目。

#### 7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

| 项目    | 本期<br>2021年8月11日（基金合同生效日）至2021年12月31日 |
|-------|---------------------------------------|
| 审计费用  | 40,000.00                             |
| 信息披露费 | -                                     |

|         |           |
|---------|-----------|
| 证券出借违约金 | -         |
| 银行汇划费用  | 3,675.16  |
| 其他      | 400.00    |
| 合计      | 44,075.16 |

#### 7.4.7.22 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 |
| 招商银行股份有限公司（“招商银行”）                             | 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

本基金基金合同于 2021 年 08 月 11 日生效，截至本报告期末不满一年，无上年度可比期间数据。

##### 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

注：无。

###### 7.4.10.1.2 债券交易

注：无。

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

**7.4.10.1.4 基金交易**

注：无。

**7.4.10.1.5 权证交易**

注：无。

**7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金**

注：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<br>2021年8月11日（基金合同生效日）至2021年12月31日 |
|-----------------|---------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 261,390.75                            |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 247,743.56                            |

注：1、本基金投资于基金管理人所管理的其他基金部分不收取管理费。支付基金管理人鹏华基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金管理人管理的其他基金部分后的余额的 0.60%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬＝前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金管理人管理的其他基金部分后的余额×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<br>2021年8月11日（基金合同生效日）至2021年12月31日 |
|----------------|---------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 110,164.93                            |

注：本基金基金财产中投资于本基金托管人招商银行托管的其他基金份额的部分不收取托管费。在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值扣除基金资产中本基金托管人托管的其他基金份额所对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取0）的 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费＝前一日基金资产净值扣除基金财产中本基金基金托管人托管的其他基金份额所对应资产净值的剩余部分（若为负数，则取0）×0.15%/当年天数。

**7.4.10.2.3 销售服务费**

注：无。

**7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

注：无。

**7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明****7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

注：无。

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

注：无。

**7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况****7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

注：无。

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

注：本基金本报告期末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<br>2021年8月11日（基金合同生效日）至2021年12月<br>31日 |           |
|-------|---|-----------|
|       | 期末余额                                      | 当期利息收入    |
| 招商银行  | 2,152,260.19                              | 16,894.07 |

**7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

注：本基金在本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。本基金在上年度可比期间未成立。

**7.4.10.8 其他关联交易事项的说明****7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明**

于2021年12月31日，本基金持有基金管理人鹏华基金所管理的公开募集证券投资基金合计111,526,312.94元，占本基金资产净值的比例为51.28%。

**7.4.10.8.2 当期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**

| 项目 | 本期费用<br>2021年8月11日（基金合同生效日）至2021年12月31<br>日 |
|----|---|
|    |   |

|                      |            |
|----------------------|------------|
| 当期交易基金产生的申购费（元）      | -          |
| 当期交易基金产生的赎回费（元）      | -          |
| 当期持有基金产生的应支付销售服务费（元） | -          |
| 当期持有基金产生的应支付管理费（元）   | 122,921.12 |
| 当期持有基金产生的应支付托管费（元）   | 40,973.59  |
| 当期交易基金产生的交易费用（元）     | -          |

注：注：上述费用为本基金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，其中申购费、赎回费是实际产生的费用，销售服务费、管理费和托管费等其他费用为估算费用。

#### 7.4.11 利润分配情况

注：无。

#### 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<br>(单位：股) | 期末成本总额   | 期末估值总额   | 备注 |
| 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 | -  |

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票，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

注：无。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 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 46,000,000.00 元，于 2022 年 01 月 04 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为 FOF 型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，主要包括经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金（包含 QDII 基金，香港互认基金），以及境内依法发行上市的股票（含主板，创业板，存托凭证及其他经中国证监会核准或注册上市的股票），内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”），债券（包括国债，央行票据，金融债券，企业债券，公司债券，中期票据，短期融资券，超短期融资券，次级债券，政府支持机构债，政府支持债券，地方政府债，可转换债券等），货币市场工具，资产支持证券，债券回购，同业存单，银行存款（包括协议存款，定期存款及其他银行存款）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招商银行股份有限公司及其他具有基金托管资格的银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。

本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，本基金以非约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券；以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类，因此违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

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



**7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

注：无。

**7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

注：无。

**7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

注：无。

**7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|
| AAA    | 70,774,000.00           |
| AAA 以下 | -                       |
| 未评级    | -                       |
| 合计     | 70,774,000.00           |

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**

注：无。

**7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

注：无。

**7.4.13.3 流动性风险**

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

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理职能部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短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 46,000,000.00 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同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

注：无。

#### 7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金持有单只基金的市值，不高于本基金资产净值的 20%，且不持有其他基金中基金。本基金的基金管理人管理的全部基金中基金持有单只基金（ETF 联接基金除外）不超过被投资基金净资产的 20%，被投资基金净资产规模以最近定期报告披露的规模为准。本基金投资于一家公司发行的证券（不含本基金所投资的基金份额）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上市公司发行的证券（不含本基金所投资的基金份额）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，其余亦可在基金销售机构申购、赎回，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。在本基金开放日，本基金投资于流通受限基金不高于本基金资产净值的 10%；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。

#### 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<br>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                    | 2,152,260.19  | -             | -     | -               | 2,152,260.19   |
| 结算备付金                   | 2,010,831.94  | -             | -     | -               | 2,010,831.94   |
| 存出保证金                   | 25,412.37     | -             | -     | -               | 25,412.37      |
| 交易性金融资产                 | 8,983,402.50  | 70,774,000.00 | -     | -177,731,347.85 | 257,488,750.35 |
| 应收利息                    | -             | -             | -     | 1,017,423.05    | 1,017,423.05   |
| 应收股利                    | -             | -             | -     | 364.70          | 364.70         |
| 应收申购款                   | -             | -             | -     | 5,060.57        | 5,060.57       |
| 应收证券清算款                 | -             | -             | -     | 9,916,264.49    | 9,916,264.49   |
| 资产总计                    | 13,171,907.00 | 70,774,000.00 | -     | -188,670,460.66 | 272,616,367.66 |
| 负债                      |               |               |       |                 |                |
| 应付管理人报酬                 | -             | -             | -     | 54,465.63       | 54,465.63      |
| 应付托管费                   | -             | -             | -     | 24,000.99       | 24,000.99      |

|           |                |               |   |                 |                |
|-----------|----------------|---------------|---|-----------------|----------------|
| 应付证券清算款   | -              | -             | - | 9,002,383.32    | 9,002,383.32   |
| 卖出回购金融资产款 | 46,000,000.00  | -             | - | -               | 46,000,000.00  |
| 应付交易费用    | -              | -             | - | 28,049.87       | 28,049.87      |
| 应付利息      | -              | -             | - | -25,800.65      | -25,800.65     |
| 应交税费      | -              | -             | - | 28,162.42       | 28,162.42      |
| 其他负债      | -              | -             | - | 40,000.00       | 40,000.00      |
| 负债总计      | 46,000,000.00  | -             | - | 9,151,261.58    | 55,151,261.58  |
| 利率敏感度缺口   | -32,828,093.00 | 70,774,000.00 | - | -179,519,199.08 | 217,465,106.08 |

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）                                     |             |
| 分析        | 市场利率下降 25 个基点   | 272,228.22  |
|           | 市场利率上升 25 个基点   | -270,603.27 |

注：无。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

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

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无。

##### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场

交易的证券投资品种，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。

基金的投资组合比例为：本基金投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金份额的比例不低于基金资产的 80%；本基金投资于股票，股票型基金，混合型基金和商品基金（含商品期货基金和黄金 ETF）等品种的比例合计不超过基金资产的 30%；本基金投资于港股通标的股票占基金股票资产的 0-50%；在本基金认购份额的最短持有期期满后（含到期日），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，本基金认购份额的最短持有期期满前不受此款限制。本基金采用目标风险策略，根据权益类资产的战略配置比例来界定风险水平。本基金权益类资产的战略配置比例为 25%，且权益类资产的向上，向下的战术调整幅度分别不得超过战略配置比例的 5%，10%，即权益类资产占基金资产的比例在 15%-30%之间。此处权益类资产指的是股票型基金，混合型基金及股票，此处混合型基金是在最近连续 4 个季度的季度报告中对股票资产的实际持仓比例不低于基金资产的 60%的基金。如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR（Value at Risk）指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目           | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日 |              |
|--------------|-------------------------|--------------|
|              | 公允价值                    | 占基金资产净值比例（%） |
| 交易性金融资产—股票投资 | 1,241,662.14            | 0.57         |
| 交易性金融资产—基金投资 | 176,489,685.71          | 81.16        |

|               |                |       |
|---------------|----------------|-------|
| 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            | 177,731,347.85 | 81.73 |

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

注：于 2021 年 12 月 31 日，由于本基金运行期间不足一年，尚不存在足够的经验数据，因此，无法对本基金资产净值对于市场价格风险的敏感性作定量分析。

#### 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

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 177,725,843.36 元，属于第二层次的余额为 79,762,906.99 元，无属于第三层次的余额。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

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

(d) 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。

(2) 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。

(3) 除公允价值和执行新金融工具准则外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 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              | 1,241,662.14   | 0.46          |
|    | 其中：股票             | 1,241,662.14   | 0.46          |
| 2  | 基金投资              | 176,489,685.71 | 64.74         |
| 3  | 固定收益投资            | 79,757,402.50  | 29.26         |
|    | 其中：债券             | 79,757,402.50  | 29.26         |
|    | 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      | 4,163,092.13   | 1.53          |
| 8  | 其他各项资产            | 10,964,525.18  | 4.02          |
| 9  | 合计                | 272,616,367.66 | 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         | -            | -            |
| B  | 采矿业              | -            | -            |
| C  | 制造业              | 1,238,714.14 | 0.57         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -            | -            |
| E  | 建筑业              | -            | -            |
| 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  | -            | -            |
| J  | 金融业              | 2,948.00     | 0.00         |
| 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               | 1,241,662.14 | 0.57         |

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）  | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|--------|--------------|--------------|
| 1  | 600487 | 亨通光电 | 73,500 | 1,111,320.00 | 0.51         |
| 2  | 688595 | 芯海科技 | 517    | 64,340.65    | 0.03         |
| 3  | 688617 | 惠泰医疗 | 136    | 38,080.00    | 0.02         |
| 4  | 300035 | 中科电气 | 200    | 6,050.00     | 0.00         |
| 5  | 001234 | 泰慕士  | 333    | 5,504.49     | 0.00         |
| 6  | 300655 | 晶瑞电材 | 100    | 4,178.00     | 0.00         |
| 7  | 002648 | 卫星化学 | 100    | 4,003.00     | 0.00         |



|    |        |      |     |          |      |
|----|--------|------|-----|----------|------|
| 8  | 600884 | 杉杉股份 | 100 | 3,277.00 | 0.00 |
| 9  | 600958 | 东方证券 | 200 | 2,948.00 | 0.00 |
| 10 | 002254 | 泰和新材 | 100 | 1,961.00 | 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末基金资产净值 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     | 占期末基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|--------------|-----------------|
| 1  | 000001 | 平安银行 | 3,632,538.00 | 1.67            |
| 2  | 300035 | 中科电气 | 1,712,837.00 | 0.79            |
| 3  | 002709 | 天赐材料 | 1,654,042.00 | 0.76            |
| 4  | 600884 | 杉杉股份 | 1,623,594.00 | 0.75            |
| 5  | 300390 | 天华超净 | 1,112,466.00 | 0.51            |
| 6  | 600487 | 亨通光电 | 1,073,714.00 | 0.49            |
| 7  | 002648 | 卫星化学 | 1,073,440.00 | 0.49            |
| 8  | 600958 | 东方证券 | 1,071,065.00 | 0.49            |
| 9  | 688617 | 惠泰医疗 | 1,070,209.92 | 0.49            |
| 10 | 605358 | 立昂微  | 1,065,079.00 | 0.49            |
| 11 | 002254 | 泰和新材 | 998,540.00   | 0.46            |
| 12 | 688595 | 芯海科技 | 979,687.77   | 0.45            |
| 13 | 300655 | 晶瑞电材 | 398,500.20   | 0.18            |
| 14 | 001234 | 泰慕士  | 5,504.49     | 0.00            |

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末基金资产净值 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     | 占期末基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|--------------|-----------------|
| 1  | 000001 | 平安银行 | 3,353,207.00 | 1.54            |
| 2  | 300035 | 中科电气 | 1,801,877.00 | 0.83            |
| 3  | 600884 | 杉杉股份 | 1,517,517.00 | 0.70            |
| 4  | 002709 | 天赐材料 | 1,439,292.00 | 0.66            |
| 5  | 688595 | 芯海科技 | 1,157,952.87 | 0.53            |
| 6  | 605358 | 立昂微  | 1,124,161.20 | 0.52            |
| 7  | 002648 | 卫星化学 | 1,088,801.00 | 0.50            |
| 8  | 600958 | 东方证券 | 1,081,561.00 | 0.50            |
| 9  | 002254 | 泰和新材 | 968,085.00   | 0.45            |
| 10 | 300390 | 天华超净 | 857,393.00   | 0.39            |
| 11 | 688617 | 惠泰医疗 | 756,963.83   | 0.35            |
| 12 | 300655 | 晶瑞电材 | 418,417.00   | 0.19            |

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 | 17,471,217.38 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 15,565,227.90 |

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      | 8,983,402.50  | 4.13          |
| 2  | 央行票据      | -             | -             |
| 3  | 金融债券      | 60,706,000.00 | 27.92         |
|    | 其中：政策性金融债 | -             | -             |
| 4  | 企业债券      | 10,068,000.00 | 4.63          |
| 5  | 企业短期融资券   | -             | -             |
| 6  | 中期票据      | -             | -             |
| 7  | 可转债（可交换债） | -             | -             |
| 8  | 同业存单      | -             | -             |
| 9  | 其他        | -             | -             |
| 10 | 合计        | 79,757,402.50 | 36.68         |

## 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  | 163903 | 20 海通 08 | 100,000 | 10,124,000.00 | 4.66          |
| 2  | 163711 | 20 信投 G4 | 100,000 | 10,123,000.00 | 4.65          |
| 3  | 163756 | 20 国君 G4 | 100,000 | 10,122,000.00 | 4.65          |
| 4  | 163731 | 20 光证 G3 | 100,000 | 10,114,000.00 | 4.65          |
| 5  | 163774 | 20 中证 15 | 100,000 | 10,112,000.00 | 4.65          |

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

注：无。

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

注：无。

## 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：无。

## 8.10 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

注：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

注：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 本报告期投资基金情况

### 8.12.1 投资政策及风险说明

本基金采用目标风险策略，根据权益类资产的战略配置比例来界定风险水平。本基金权益类资产的战略配置比例为 25%，且权益类资产的向上、向下的战术调整幅度分别不得超过战略配置比例的 5%、10%，即权益类资产占基金资产的比例在 15%-30%之间。此处权益类资产指的是股票型基金、混合型基金及股票，此处混合型基金是在最近连续 4 个季度的季度报告中对股票资产的实际持仓比例不低于基金资产的 60%的基金。

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。

### 8.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

| 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  | 007321 | 鹏华金利债券 | 契约型开放式 | 28,546,179.67 | 30,435,936.76 | 14.00        | 是                      |
| 2  | 003280 | 鹏华丰恒债券 | 契约型开放式 | 27,466,798.48 | 30,427,719.36 | 13.99        | 是                      |

|    |        |                |              |               |               |       |   |
|----|--------|----------------|--------------|---------------|---------------|-------|---|
| 3  | 003741 | 鹏华丰盈债券         | 契约型开放式       | 29,060,039.25 | 30,292,184.91 | 13.93 | 是 |
| 4  | 004388 | 鹏华丰享债券         | 契约型开放式       | 17,811,027.29 | 20,370,471.91 | 9.37  | 是 |
| 5  | 006626 | 山西证券超短债债券 A    | 契约型开放式       | 11,253,986.12 | 12,159,932.00 | 5.59  | 否 |
| 6  | 007149 | 南方初元中短债债券 A    | 契约型开放式       | 11,163,937.48 | 12,130,734.47 | 5.58  | 否 |
| 7  | 511260 | 上证 10 年期国债 ETF | 交易型开放式 (ETF) | 89,600.00     | 10,411,072.00 | 4.79  | 否 |
| 8  | 511990 | 华宝添益货币 A       | 交易型开放式 (ETF) | 60,828.00     | 6,083,826.10  | 2.80  | 否 |
| 9  | 512660 | 国泰中证军工 ETF     | 交易型开放式 (ETF) | 4,172,100.00  | 6,078,749.70  | 2.80  | 否 |
| 10 | 005794 | 银华心怡灵活配置混合 A   | 契约型开放式       | 1,528,998.77  | 5,224,894.60  | 2.40  | 否 |
| 11 | 510500 | 南方中证 500ETF    | 交易型开放式 (ETF) | 532,100.00    | 4,394,081.80  | 2.02  | 否 |
| 12 | 006594 | 博道中证 500 增强 C  | 契约型开放式       | 1,862,024.02  | 4,116,190.30  | 1.89  | 否 |

|    |        |                 |              |              |              |      |   |
|----|--------|-----------------|--------------|--------------|--------------|------|---|
| 13 | 512760 | 国泰CES 半导体芯片 ETF | 交易型开放式 (ETF) | 1,451,500.00 | 2,229,504.00 | 1.03 | 否 |
| 14 | 512400 | 南方中证申万有色金属 ETF  | 交易型开放式 (ETF) | 1,582,200.00 | 2,134,387.80 | 0.98 | 否 |

## 8.13 投资组合报告附注

### 8.13.1 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。

芯海科技(深圳)股份有限公司

2021 年 7 月 14 日，深圳市公安局招商派出所针对芯海科技网络系统存在可利用的高危安全漏洞的违法违规行为，处以“警告”的行政处罚。

中信证券股份有限公司

2021 年 12 月 7 日，国家外汇管理局深圳市分局针对中信证券股份有限公司的以下违法行为：1. QDII 超额度汇出；2. 国际收支统计漏申报；3. B 股客户非同名账户取款；4. H 股募集资金境外专用账户超范围使用；5. B 股保证金账户超范围支出；6. 未办理境外投资外汇登记；7. 结售汇综合头寸报表迟报等，对公司责令改正，警告，没收违法所得 81 万元人民币，处以罚款 101 万元人民币。

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。

### 8.13.2 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

### 8.13.3 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   | 25,412.37    |
| 2  | 应收证券清算款 | 9,916,264.49 |

|   |       |               |
|---|-------|---------------|
| 3 | 应收股利  | 364.70        |
| 4 | 应收利息  | 1,017,423.05  |
| 5 | 应收申购款 | 5,060.57      |
| 6 | 其他应收款 | -             |
| 7 | 待摊费用  | -             |
| 8 | 其他    | -             |
| 9 | 合计    | 10,964,525.18 |

#### 8.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

#### 8.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值 | 占基金资产净值比例（%） | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|-------------|--------------|----------|
| 1  | 001234 | 泰慕士  | 5,504.49    | 0.00         | 新股未上市    |

#### 8.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

#### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数（户） | 户均持有的基金份额  | 持有人结构        |           |                |           |
|----------|------------|--------------|-----------|----------------|-----------|
|          |            | 机构投资者        |           | 个人投资者          |           |
|          |            | 持有份额         | 占总份额比例（%） | 持有份额           | 占总份额比例（%） |
| 1,006    | 214,084.32 | 6,001,160.00 | 2.79      | 209,367,665.48 | 97.21     |

#### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例（%） |
|------------------|-----------|-------------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 19,810.08 | 0.0092      |

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

注：截止本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人及本基金的基金经理未持有本基金份额。

#### 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

注：无。

### § 10 开放式基金份额变动

单位：份

|  |                |
|--|----------------|
| 基金合同生效日（2021年8月11日）<br>基金份额总额          | 215,268,449.76 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金<br>总申购份额              | 100,375.72     |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基<br>金总赎回份额            | -              |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金<br>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                           | 215,368,825.48 |

### § 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。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

自2021年10月27日起，刘波先生不再担任招商银行股份有限公司资产托管部总经理职务。

### 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 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

山西证券超短债债券型证券投资基金基金经理变更，新任基金经理缪佳。

### 11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金管理人聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金审计的会计师事务所。本年度应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用 40,000.00 元。该审计机构为本基金提供审计服务的期间为本基金基金合同生效日（2021 年 08 月 11 日）起到本报告期末，不满 1 年。

### 11.7 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。

### 11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.8.1 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 |          |
| 兴业证券 | 1      | 10,582,363.20 | 32.04%       | 8,585.42  | 30.61%     | 本报告期内新增。 |
| 华西证券 | 1      | 9,927,072.00  | 30.05%       | 8,053.91  | 28.71%     | 本报告期内新增。 |



|        |   |              |        |          |        |          |
|--------|---|--------------|--------|----------|--------|----------|
| 中泰证券   | 2 | 7,600,794.67 | 23.01% | 6,926.52 | 24.69% | 本报告期内新增。 |
| 招商证券   | 1 | 4,920,710.92 | 14.90% | 4,484.02 | 15.99% | 本报告期内新增。 |
| 爱建证券   | 1 | -            | -      | -        | -      | 本报告期内新增。 |
| 安信证券   | 2 | -            | -      | -        | -      | 本报告期内新增。 |
| 川财证券   | 1 | -            | -      | -        | -      | 本报告期内新增。 |
| 东北证券   | 1 | -            | -      | -        | -      | 本报告期内新增。 |
| 东方财富证券 | 1 | -            | -      | -        | -      | 本报告期内新增。 |
| 东方证券   | 2 | -            | -      | -        | -      | 本报告期内    |

|      |   |   |   |   |   |          |
|------|---|---|---|---|---|----------|
|      |   |   |   |   |   | 内新增。     |
| 东吴证券 | 1 | - | - | - | - | 本报告期内新增。 |
| 方正证券 | 2 | - | - | - | - | 本报告期内新增。 |
| 光大证券 | 1 | - | - | - | - | 本报告期内新增。 |
| 广发证券 | 2 | - | - | - | - | 本报告期内新增。 |
| 国金证券 | 1 | - | - | - | - | 本报告期内新增。 |
| 国盛证券 | 2 | - | - | - | - | 本报告期内新增。 |
| 国信证券 | 2 | - | - | - | - | 本报告期内新增。 |

|        |   |   |   |   |   |          |
|--------|---|---|---|---|---|----------|
| 海通证券   | 1 | - | - | - | - | 本报告期内新增。 |
| 摩根大通证券 | 1 | - | - | - | - | 本报告期内新增。 |
| 平安证券   | 1 | - | - | - | - | 本报告期内新增。 |
| 山西证券   | 1 | - | - | - | - | 本报告期内新增。 |
| 天风证券   | 2 | - | - | - | - | 本报告期内新增。 |
| 西南证券   | 2 | - | - | - | - | 本报告期内新增。 |
| 信达证券   | 1 | - | - | - | - | 本报告期内新增。 |
| 浙商证券   | 1 | - | - | - | - | 本报告期内新增。 |

|        |   |   |   |   |   |          |
|--------|---|---|---|---|---|----------|
|        |   |   |   |   |   | 内新增。     |
| 中信建投证券 | 1 | - | - | - | - | 本报告期内新增。 |
| 中原证券   | 1 | - | - | - | - | 本报告期内新增。 |

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。

### 11.8.2 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 | 债券交易 | 债券回购交易 | 权证交易 | 基金交易 |
|----|------|--------|------|------|
|----|------|--------|------|------|

| 名称             | 成交金额          | 占当期<br>债券<br>成交总<br>额的比例 | 成交金额             | 占当期债<br>券回购<br>成交总<br>额的比例 | 成交金<br>额 | 占当<br>期权<br>证<br>成交<br>总额<br>的比例 | 成交金额          | 占当期<br>基金<br>成交总<br>额的比例 |
|----------------|---------------|--------------------------|------------------|----------------------------|----------|----------------------------------|---------------|--------------------------|
| 兴业<br>证券       | -             | -                        | -                | -                          | -        | -                                | -             | -                        |
| 华西<br>证券       | -             | -                        | -                | -                          | -        | -                                | -             | -                        |
| 中泰<br>证券       | -             | -                        | 1,400,800,000.00 | 55.42%                     | -        | -                                | 22,760,489.10 | 21.96%                   |
| 招商<br>证券       | 79,885,144.00 | 100.00%                  | 1,126,600,000.00 | 44.58%                     | -        | -                                | 80,905,528.00 | 78.04%                   |
| 爱建<br>证券       | -             | -                        | -                | -                          | -        | -                                | -             | -                        |
| 安信<br>证券       | -             | -                        | -                | -                          | -        | -                                | -             | -                        |
| 川财<br>证券       | -             | -                        | -                | -                          | -        | -                                | -             | -                        |
| 东北<br>证券       | -             | -                        | -                | -                          | -        | -                                | -             | -                        |
| 东方<br>财富<br>证券 | -             | -                        | -                | -                          | -        | -                                | -             | -                        |
| 东方<br>证券       | -             | -                        | -                | -                          | -        | -                                | -             | -                        |
| 东吴<br>证券       | -             | -                        | -                | -                          | -        | -                                | -             | -                        |
| 方正<br>证券       | -             | -                        | -                | -                          | -        | -                                | -             | -                        |
| 光大<br>证券       | -             | -                        | -                | -                          | -        | -                                | -             | -                        |
| 广发<br>证券       | -             | -                        | -                | -                          | -        | -                                | -             | -                        |
| 国金<br>证券       | -             | -                        | -                | -                          | -        | -                                | -             | -                        |
| 国盛<br>证券       | -             | -                        | -                | -                          | -        | -                                | -             | -                        |
| 国信<br>证券       | -             | -                        | -                | -                          | -        | -                                | -             | -                        |
| 海通<br>证券       | -             | -                        | -                | -                          | -        | -                                | -             | -                        |

|        |   |   |   |   |   |   |   |   |
|--------|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 摩根大通证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 平安证券   | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 山西证券   | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 天风证券   | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 西南证券   | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 信达证券   | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 浙商证券   | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中原证券   | - | - | - | - | - | - | - | - |

### 11.9 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  | 鹏华长治稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）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07月09日 |
| 2  | 鹏华长治稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）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07月09日 |
| 3  | 鹏华长治稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）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07月09日 |
| 4  | 鹏华长治稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）份额发售公告                 | 《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09日 |
| 5  | 鹏华长治稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）基金产品资料概要               | 《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09日 |
| 6  | 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 |
| 7  | 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   | 《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 |

|    |  |                               |             |
|----|--|-------------------------------|-------------|
|    | 公告   |                               |             |
| 8  | 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 |
| 9  | 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 |
| 10 | 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 |
| 11 | 鹏华长治稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）延长募集期限的公告                | 《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30日 |
| 12 | 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 |
| 13 | 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 |
| 14 | 关于鹏华长治稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）提前结束募集的公告              | 《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10日 |
| 15 | 鹏华长治稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同生效公告                 | 《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 |
| 16 | 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 |
| 17 | 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 |
| 18 | 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告                        | 《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08月26日 |
| 19 | 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 |
| 20 | 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     | 《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10日 |

|    |   |                               |                  |
|----|---|-------------------------------|------------------|
|    | 的公告   |                               |                  |
| 21 | 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 |
| 22 | 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 |
| 23 | 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 |
| 24 | 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与部分销售机构申购（含定期定额申购）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 |
| 25 | 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 |
| 26 | 鹏华长治稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）开放日常申购和定期定额投资业务的公告        | 《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 09 日 |
| 27 | 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 |
| 28 | 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 |
| 29 | 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 |
| 30 | 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 |
| 31 | 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 |
| 32 | 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 |
| 33 | 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         | 2021 年 12 月 11 日 |



|    |  |                               |                  |
|----|--|-------------------------------|------------------|
|    |  | 基金电子披露网站                      |                  |
| 34 | 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 |
| 35 | 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 |
| 36 | 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 |
| 37 | 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“2022 倾心回馈”基金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 31 日 |

注：无。

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

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

注：无。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- （一）《鹏华长治稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》；
- （二）《鹏华长治稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）托管协议》；
- （三）《鹏华长治稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）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