

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）  
2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 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。本中期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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 08 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 2022 年 06 月 30 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 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	9
<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	12
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	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 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	13
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	14
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>14</b>
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	19
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>44</b>
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
7.3 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	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	45
7.6 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	45
7.7 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	46

7.8	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	46
7.9	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	46
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	46
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	46
7.12	本报告期投资基金情况	46
7.13	投资组合报告附注	49
<b>§ 8</b>	<b>基金份额持有人信息</b>	<b>50</b>
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	50
8.3	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	50
8.4	发起式基金发起资金持有份额情况	51
<b>§ 9</b>	<b>开放式基金份额变动</b>	<b>51</b>
<b>§ 10</b>	<b>重大事件揭示</b>	<b>51</b>
10.1	基金份额持有人大会决议	51
10.2	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	52
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	52
10.4	基金投资策略的改变	52
10.5	本报告期持有的基金发生的重大影响事件	52
10.6	为基金进行审计的会计师事务所情况	52
10.7	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	52
10.8	基金租用证券公司交易单元的有关情况	52
10.9	其他重大事件	55
<b>§ 11</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息</b>	<b>57</b>
11.1	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	57
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	57
<b>§ 12</b>	<b>备查文件目录</b>	<b>57</b>
12.1	备查文件目录	57
12.2	存放地点	58
12.3	查阅方式	58

## 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	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)
基金简称	鹏华养老 2045 混合发起式 (FOF)
基金主代码	007271
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 4 月 22 日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	209,346,578.57 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	在严格控制风险的前提下，通过资产配置，优选基金力争实现基金资产的稳健增值，为投资者提供稳健的养老理财工具。
投资策略	<p>本基金的投资策略包含资产配置策略和基金投资策略。在严格控制风险的前提下，通过资产配置，优选基金力争实现基金资产的稳健增值，为投资者提供稳健的养老理财工具。</p> <p>1、资产配置策略 本基金属于目标日期基金。目标日期基金资产配置策略的核心是下滑路径 (Glide Path) 设计。下滑路径指：资产配置比例在投资者生命周期上是动态变化的，具体而言，在投资者年轻时，基金将配置较高比例的权益类资产，随着目标日期的临近，权益类资产比例逐步下降，而非权益类资产比例逐步上升。下滑路径设计主要基于两大理念：第一，随着期限拉长，权益类资产风险溢价逐步稳定，通过长期投资，能够获取权益资产长期维度高确定性的收益；第二，随着年龄的增大，人力资本面临贬值，风险承受能力逐步降低，通过增加债券基金、货币基金等非权益类资产的配置，从而获得退休后稳定现金流。具体设计过程中，本基金以实现养老金财富稳健增值为目标，基于谨慎的长期资本市场假设，综合考虑投资者养老金替代率缺口、预期寿命、定投比例以及生命周期上的风险承受能力等因素，在借鉴海外市场成熟经验的同时结合中国实际情况作了大量本土化尝试，通过随机模拟与动态规划的方法得到预设“下滑路径”。在实际投资过程中，为了优化基金组合的风险收益比，本基金根据实际的市场状况对资产配置比例进行战术调整，战术调整的范围受到严格限制，对下滑路径权益类资产比例中枢值向上偏离不能超过 10%，向下偏离不能超过 15%。与此同时，本基金将充分衡量大类资产下子类资产的投资价值，择优配置，力求达到优化资产配置的目的。最后，本基金将根据中国未来资本市场的变化，实时监控下滑路径的有效性，并将在招募说明书及更新招募说明书中披露预设下滑路径及权益类资产比例中枢值。</p> <p>2、基金投</p>

	<p>资策略 在完成资产配置以后,本基金将主要通过优选基金实践资产配置的策略。基金优选策略从定量和定性两大维度展开,对基金及基金公司做出综合性评价。对基金的评价包括风格评价和业绩评价两方面,重点衡量基金风格是否清晰稳定、中长期业绩及风险控制能力是否良好;对基金公司的评价主要从综合实力、管理水平、运作合规等方面进行分析。</p> <p>(1) 基金业绩评价和风格评价 基于投资范围、投资策略以及实际投资组合等维度,对基金进行分类。本基金以同类基金为对象进行评价,并对各类基金进行评级和排序。考虑的主要因素包括: 基金的获利能力: 基金与其业绩比较基准的历史回报对比, 绩效指标分析 (如期间净值增长率、累计净值增长率、分红率等), 风险调整后的绩效指标分析 (如 Sharpe 比率、Trey nor 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。</p> <p>(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。</p> <p>3、股票投资策略 本基金通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘 A 股优质的公司,构建股票投资组合。核心思路在于: 1) 自上而下地分析行业的增长前景、行业结构、商业模式、竞争要素等分析把握其投资机会; 2) 自下而上地评判企业的核心竞争力、管理层、治理结构等以及其所提供的产品和服务是否契合未来行业增长的大趋势,对企业基本面和估值水平进行综合的研判,深度挖掘优质的个股。 本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略,基于对基础证券投资价值的深入研究判断,进行存托凭证的投资。</p> <p>4、债券投资策略 本基金债券投资将采取久期策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、个券选择策略、信用策略等积极投资策略,自上而下地管理组合的久期,灵活地调整组合的券种搭配,同时精选个券,以增强组合的持有期收益。</p> <p>5、资产支持证券的投资策略 本基金将综合运用战略资产配置和战术资产配置进行资产支持证券的投资组合管理,并根据信用风险、利率风险和流动性风险变化积极调整投资策略,严格遵守法律法规和基金合同的约定,在保证本金安全和基金资产流动性的基础上获得稳定收益。</p>
<p>业绩比较基准</p>	<p>时间段 业绩比较基准 基金合同生效日-2029.12.31 中证 800 指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40% 2030.01.01-</p>

	2032.12.31 中证 800 指数收益率×59%+中证全债指数收益率×41% 2033.01.01-2035.12.31 中证 800 指数收益率×54%+中证全债指数收益率×46% 2036.01.01-2038.12.31 中证 800 指数收益率×44%+中证全债指数收益率×56% 2039.01.01-2041.12.31 中证 800 指数收益率×33%+中证全债指数收益率×67% 2042.01.01-2044.12.31 中证 800 指数收益率×25%+中证全债指数收益率×75% 2045.01.01-2045.12.31 中证 800 指数收益率×21%+中证全债指数收益率×79% 2046.1.1 起 中证 800 指数收益率×17%+中证全债指数收益率×83%
风险收益特征	本基金为混合型基金中基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金、股票型基金中基金，高于债券型基金、债券型基金中基金、货币市场基金及货币型基金中基金。本基金属于目标日期基金，随着所设定目标日期的临近，将逐步降低权益类资产的配置比例，风险与收益水平会随着目标日期的临近而逐步降低。

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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	高永杰	许俊
	联系电话	0755-81395402	95566
	电子邮箱	xxpl@phfund.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4006788999	95566
传真		0755-82021126	010-66594942
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	北京市西城区复兴门内大街 1 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	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		518048	100818
法定代表人		何如	刘连舸

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.phfund.com.cn">http://www.phfund.com.cn</a>
基金中期报告备置地点	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
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 主要财务指标和基金净值表现

#### 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	报告期(2022年1月1日-2022年6月30日)
本期已实现收益	5,068,028.38
本期利润	11,661,243.30
加权平均基金份额本期利润	0.0965
本期加权平均净值利润率	7.05%
本期基金份额净值增长率	-2.92%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)
期末可供分配利润	72,245,056.83
期末可供分配基金份额利润	0.3451
期末基金资产净值	300,256,104.50
期末基金份额净值	1.4343
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)
基金份额累计净值增长率	43.43%

注：(1) 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益等未实现收益。

(2) 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(3) 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6月30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

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
过去一个月	3.96%	0.71%	5.33%	0.63%	-1.37%	0.08%
过去三个月	6.73%	0.81%	3.70%	0.88%	3.03%	-0.07%
过去六个月	-2.92%	0.88%	-5.11%	0.88%	2.19%	0.00%

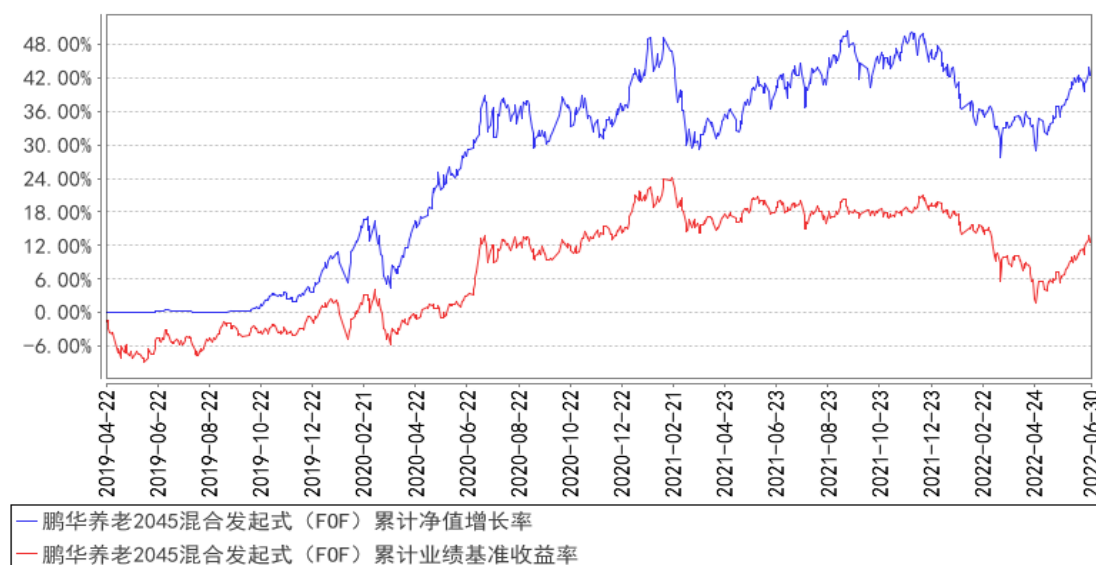


过去一年	0.70%	0.91%	-5.17%	0.73%	5.87%	0.18%
过去三年	42.99%	0.90%	19.38%	0.75%	23.61%	0.15%
自基金合同生效起至今	43.43%	0.87%	13.57%	0.76%	29.86%	0.11%

注：业绩比较基准=时间段 业绩比较基准 基金合同生效日-2029.12.31 中证 800 指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40% 2030.01.01-2032.12.31 中证 800 指数收益率×59%+中证全债指数收益率×41% 2033.01.01-2035.12.31 中证 800 指数收益率×54%+中证全债指数收益率×46% 2036.01.01-2038.12.31 中证 800 指数收益率×44%+中证全债指数收益率×56% 2039.01.01-2041.12.31 中证 800 指数收益率×33%+中证全债指数收益率×67% 2042.01.01-2044.12.31 中证 800 指数收益率×25%+中证全债指数收益率×75% 2045.01.01-2045.12.31 中证 800 指数收益率×21%+中证全债指数收益率×79% 2046.1.1 起 中证 800 指数收益率×17%+中证全债指数收益率×83%

### 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

鹏华养老2045混合发起式 (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 2019 年 04 月 22 日生效。2、截至建仓期结束，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

### 3.3 其他指标

注：无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金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 11946.65 亿元,267 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 多年投资管理基金,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	2019-04-22	2022-05-07	9 年	赵强先生, 国籍中国, 工商管理硕士, 9 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, 曾任资产配置与基金投资部 FOF 投资总监、投资决策委员会成员、基金经理。2019 年 04 月至 2022 年 05 月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 2022 年 05 月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 2022 年 05 月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 2022 年 05 月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 2022 年 05 月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 2022 年 05 月担任鹏华精选群英一年持有期灵活配置混合型管理人中管理人 (MOM) 证券投资基金基金经理, 赵强先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理发生变动, 增聘孙博斐为本基金基金经理, 赵强不再担任本基金基金经理。

孙博斐	基金经理	2022-05-07	-	8 年	孙博斐先生，国籍中国，管理学硕士，8 年证券从业经验。曾任中国民生银行私人银行事业部投资与策略中心策略研究员，嘉实基金管理有限公司 FOF 研究员，建信信托有限责任公司 FOF 投资经理。2022 年 3 月加盟鹏华基金管理有限公司，现担任资产配置与基金投资部基金经理。2022 年 05 月至今担任鹏华养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金 (FOF) 基金经理，2022 年 05 月至今担任鹏华长治稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金 (FOF) 基金经理，2022 年 05 月至今担任鹏华聚合多资产 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 基金经理，2022 年 05 月至今担任鹏华长乐稳健养老目标一年持有期混合发起式基金中基金 (FOF) 基金经理，2022 年 05 月至今担任鹏华养老目标日期 2045 三年持有期混合发起式基金中基金 (FOF) 基金经理，2022 年 05 月至今担任鹏华精选群英一年持有期灵活配置混合型管理人中管理人 (MOM) 证券投资基金基金经理，孙博斐先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理发生变动，增聘孙博斐为本基金基金经理，赵强不再担任本基金基金经理。
-----	------	------------	---	-----	--

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：无。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规、中国证监会的有关规定以及基金合同的约定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合规，因市场波动等被动原因存在本基金投资比例不符合基金合同要求的情形，本基金管理人严格按照基金合同的约定及时进行了调整，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 公平交易制度的执行情况

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

### 4.4 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

报告期内,国内市场的波动由内外部因素交错影响。外部因素方面,俄乌冲突的持续引发全球金融市场对通胀、加息等一系列问题的预期变动。内部因素方面,疫情引发国内市场对于经济增长目标的担忧。受此影响,A 股的整体估值于 4 月下旬调整到历史上非常低的分位数水平,体现了较为悲观的市场预期。与此同时,政策层面展现出稳增长的决心,相关政策陆续出台。随着疫情逐步受控、复工复产提上日程,国内经济迎来短期复苏的预期开始主导市场,权益市场出现较快速的修复。

展望未来,中国可能是全球范围内为数不多的低通胀高增长经济体。基于长期看好国内权益资产投资机会的价值观,本基金在市场较为低迷的时段将权益资产比例提升至基准水平,结构上一方面保持了对于周期资源和大金融等低估值板块的重点配置,同时也开始关注科技制造等方向的长期配置机会。

#### 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-2.92%,同期业绩比较基准增长率为-5.11%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,我们认为对影响国内资产价格的关键因素作如下判断:经济增长方面,国内宏观经济延续年初疫情之后的复苏;宏观流动性方面,宽货币向宽信用的传导初见成效;通胀方面,由于海外衰退预期逐渐强烈叠加美联储收紧流动性,全球定价商品价格可能进入下行周期。

国内资产价格方面,权益资产经过年初下跌,整体估值水平在 4 月达到低位,虽然近期有所修复,但仍然处于较低的分位数水平。综合宏观周期、股债性价比等方面的判断,我们认为权益资产相较于债券资产而言更具吸引力。在权益资产的结构上,我们一方面关注低估值板块的配置价值,一方面关注符合国家经济转型的先进制造方向的投资机会。

#### 4.6 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。

#### 4.7 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 72,245,056.83 元，期末基金份额净值 1.4343 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。

#### 4.8 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

本报告期内，中国银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议

的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：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)

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	17,466,175.14	1,662,907.63
结算备付金		35,612.37	376,003.85
存出保证金		54,202.88	2,289.69
交易性金融资产	6.4.7.2	283,180,773.85	82,078,804.26
其中：股票投资		-	8,361,319.58
基金投资		269,020,929.08	64,259,565.88
债券投资		14,159,844.77	9,457,918.80
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		35.74	10.30
应收申购款		40,149.27	4,097.56
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.7.8	-	86,405.18
资产总计		300,776,949.25	84,210,518.47
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年6月30日</b>	<b>上年度末 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	8,700,000.00
应付清算款		-	21,525.61
应付赎回款		71.21	-
应付管理人报酬		114,210.04	25,865.42
应付托管费		29,953.47	9,592.58
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		319,582.36	10,775.14
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	57,027.67	112,657.52
负债合计		520,844.75	8,880,416.27
<b>净资产:</b>			
实收基金	6.4.7.10	209,346,578.57	50,986,996.92
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	90,909,525.93	24,343,105.28
净资产合计		300,256,104.50	75,330,102.20
负债和净资产总计		300,776,949.25	84,210,518.47

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.4343 元，基金份额总额 209,346,578.57 份。

## 6.2 利润表

会计主体：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 (F0F)

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2022年1月1日至2022年 6月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021 年6月30日
<b>一、营业总收入</b>		12,292,383.49	1,453,957.45
1. 利息收入		24,249.66	37,678.74
其中：存款利息收入	6.4.7.13	24,249.66	5,390.08
债券利息收入		-	32,288.66
资产支持证券利息收入		-	-

买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益 (损失以“-”填列)		5,645,582.09	4,273,550.64
其中: 股票投资收益	6.4.7.14	-1,617,158.02	814,157.49
基金投资收益	6.4.7.15	4,002,726.92	3,184,084.13
债券投资收益	6.4.7.16	22,164.67	-14,548.50
资产支持证券投资	6.4.7.17	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.18	-	-
衍生工具收益	6.4.7.19	-	-
股利收益	6.4.7.20	3,237,848.52	289,857.52
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益 (损失以“-”号填列)	6.4.7.21	6,621,605.89	-2,859,235.18
4. 汇兑收益 (损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入 (损失以“-”号填列)	6.4.7.22	945.85	1,963.25
<b>减: 二、营业总支出</b>		631,140.19	295,627.48
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	393,785.96	68,197.48
2. 托管费	6.4.10.2.2	101,988.30	50,463.88
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费	6.4.10.2.1.1	-	-
5. 利息支出		39,460.23	52,103.13
其中: 卖出回购金融资产支出		39,460.23	52,103.13
6. 信用减值损失	6.4.7.23	-	-
7. 税金及附加		34,626.37	160.53
8. 其他费用	6.4.7.24	61,279.33	124,702.46
<b>三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)</b>		11,661,243.30	1,158,329.97
减: 所得税费用		-	-
<b>四、净利润 (净亏损以“-”号填列)</b>		11,661,243.30	1,158,329.97
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		11,661,243.30	1,158,329.97



### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：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)

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	50,986,996.92	-	24,343,105.28	75,330,102.20
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	50,986,996.92	-	24,343,105.28	75,330,102.20
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	158,359,581.65	-	66,566,420.65	224,926,002.30
（一）、综合收益总额	-	-	11,661,243.30	11,661,243.30
（二）、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）	158,359,581.65	-	54,905,177.35	213,264,759.00
其中：1. 基金申购款	158,369,259.86	-	54,908,450.68	213,277,710.54
2. 基金赎回款	-9,678.21	-	-3,273.33	-12,951.54

(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	209,346,578.57	-	90,909,525.93	300,256,104.50
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	50,606,277.94	-	20,320,854.64	70,927,132.58
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	50,606,277.94	-	20,320,854.64	70,927,132.58
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	230,976.59	-	1,248,031.05	1,479,007.64
(一)、综合收益总额	-	-	1,158,329.97	1,158,329.97
(二)、本期基金份额	230,976.59	-	89,701.08	320,677.67

额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)				
其中: 1. 基金申购款	230,976.59	-	89,701.08	320,677.67
2. 基金赎回款	-	-	-	-
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	50,837,254.53	-	21,568,885.69	72,406,140.22

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

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) (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 [2019] 587 号《关于准予鹏华养老目

标日期 2045 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 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 10,091,053.83 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(2019)第 0256 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《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) 基金合同》于 2019 年 4 月 22 日正式生效, 基金合同生效日的基金份额总额为 10,091,053.83 份基金份额, 无认购资金利息折合基金份额。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司, 基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金为发起式基金, 发起资金认购部分为 10,000,000.00 份基金份额, 发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

本基金设置投资者最短持有期限为三年。对于每份基金份额, 自基金合同生效之日(对认购份额而言, 下同)起或自基金份额申购确认日(对申购份额而言, 下同)起三年内锁定。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、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(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的相关规定)。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(含存托凭证)、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 60%; 本基金投资于商品基金(含商品期货基金和黄金 ETF)的比例不超过基金资产的 10%; 每个交易日日终, 基金保留的现金或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。

根据《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) 基金合同》的相关规定, 本基金采用目标日期投资策略, 随着所设定目标日期的临近, 将逐步降低权益类资产的配置比例。本基金的业绩比较基准为:  $X \times \text{中证 800 指数收益率} + (1-X) \times \text{中证全债指数收益率}$ , 各

时间段的 X 取值与对应时间段的权益类资产比例中枢值一致。

#### 6.4.2 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。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2022 年上半年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 2022 年 06 月 30 日的财务状况以及 2022 年上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

除 6.4.5.1 会计政策变更的说明所声明的变更外, 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 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 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》及《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”), 财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》, 公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外, 中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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>》, 本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年度财务报表, 对本基金财务报表的影响列示如下:

##### (a) 金融工具

新金融工具准则改变了金融工具的分类和计量方式, 确定了三个主要的计量类别: 摊余成本; 以公允价值计量且其变动计入其他综合收益; 以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式, 以及金融工具的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”, 适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、交易性金融资产-债券投资、交易性金融资产-资产支持证券投资、债权投资和卖出回购金融资产款等项目中，不单独列示应收利息或应付利息项目。

信用减值损失项目反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在利息收入项目中。其他项目的利息收入从利息收入项目调整至投资收益项目列示。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具，其投资收益包含期间交易费用的抵减。

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

银行存款、结算备付金、存出保证金、交易性金融资产-债券投资、应收利息、卖出回购金融资产款、应付交易费用、应付利息和其他负债，对其账面价值的影响金额分别为 55.82 元、169.20 元、1.00 元、85,672.48 元、-85,898.50 元、-4,232.90 元、-1,890.42 元、4,232.90 元和 1,890.42 元。

(b) 修订后的《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>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《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>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 6.4.6 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。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末
	2022 年 6 月 30 日
活期存款	17,466,175.14
等于：本金	17,464,887.70
加：应计利息	1,287.44
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	17,466,175.14

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末				
	2022 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	-	-	-	-	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	14,048,039.40	110,891.57	14,159,844.77	913.80
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	14,048,039.40	110,891.57	14,159,844.77	913.80
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	254,694,111.63	-	269,020,929.08	14,326,817.45	
其他	-	-	-	-	
合计	268,742,151.03	110,891.57	283,180,773.85	14,327,731.25	

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。

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无。



**6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况**

注：无。

**6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况**

注：无。

**6.4.7.4 买入返售金融资产****6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

注：无。

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

注：无。

**6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明**

无。

**6.4.7.5 债权投资****6.4.7.5.1 债权投资情况**

注：无。

**6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况**

注：无。

**6.4.7.6 其他债权投资****6.4.7.6.1 其他债权投资情况**

注：无。

**6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况**

注：无。

**6.4.7.7 其他权益工具投资****6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况**

注：无。

**6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况**

注：无。

**6.4.7.8 其他资产**

注：无。

**6.4.7.9 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2022 年 6 月 30 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	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	57,027.67
合计	57,027.67

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	50,986,996.92	50,986,996.92
本期申购	158,369,259.86	158,369,259.86
本期赎回 (以“-”号填列)	-9,678.21	-9,678.21
- 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	209,346,578.57	209,346,578.57

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

注：无。

#### 6.4.7.12 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
本期期初	15,309,462.37	9,033,642.91	24,343,105.28
本期利润	5,068,028.38	6,593,214.92	11,661,243.30
本期基金份额交易产生的变动数	51,867,566.08	3,037,611.27	54,905,177.35
其中：基金申购款	51,870,726.59	3,037,724.09	54,908,450.68
基金赎回款	-3,160.51	-112.82	-3,273.33
本期已分配利润	-	-	-
本期末	72,245,056.83	18,664,469.10	90,909,525.93

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

活期存款利息收入	20,048.92
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	4,006.37
其他	194.37
合计	24,249.66

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

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-1,617,158.02
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	-1,617,158.02

##### 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	8,861,314.47
减：卖出股票成本总额	10,460,211.83
减：交易费用	18,260.66
买卖股票差价收入	-1,617,158.02

##### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

#### 6.4.7.15 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出/赎回基金成交总额	133,243,836.26
减：卖出/赎回基金成本总额	129,026,416.05
减：买卖基金差价收入应缴纳增值 税额	51,804.78
减：交易费用	162,888.51

基金投资收益	4,002,726.92
--------	--------------

#### 6.4.7.16 债券投资收益

##### 6.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	63,307.12
债券投资收益——买卖债券(债转股及债券到期兑付)差价收入	-41,142.45
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	22,164.67

##### 6.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券(债转股及债券到期兑付)成交总额	9,258,358.54
减：卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	9,213,316.03
减：应计利息总额	86,003.60
减：交易费用	181.36
买卖债券差价收入	-41,142.45

##### 6.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

##### 6.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 6.4.7.17 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

##### 6.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

##### 6.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

##### 6.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

## 6.4.7.18 贵金属投资收益

## 6.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

## 6.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

## 6.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

## 6.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

## 6.4.7.19 衍生工具收益

## 6.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

## 6.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

## 6.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30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	3,237,848.52
合计	3,237,848.52

## 6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
1. 交易性金融资产	6,858,197.39
股票投资	702,465.25
债券投资	26,694.43
资产支持证券投资	-
基金投资	6,129,037.71
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	236,591.50
合计	6,621,605.89

#### 6.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	-
销售服务费	945.85
合计	945.85

#### 6.4.7.23 持有基金产生的费用

项目	本期费用 2022年1月1日至2022年6月30日
当期持有基金产生的应支付销售服务费(元)	18,159.65
当期持有基金产生的应支付管理费(元)	542,104.64
当期持有基金产生的应支付托管费(元)	106,548.38

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。

#### 6.4.7.24 信用减值损失

注：无。

#### 6.4.7.25 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
审计费用	17,356.09
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
银行汇划费用	4,251.66
合计	61,279.33

#### 6.4.7.26 分部报告

无。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

## 6.4.9 关联方关系

### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

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。

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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、基金发起人
中国银行股份有限公司 (“中国银行”)	基金托管人、基金代销机构
国信证券股份有限公司 (“国信证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
国信证券	-	-	907,762.62	6.22

#### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	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 成交总额的比例 (%)
国信证券	-	-	1,041,304.60	10.31

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)
国信证券	-	-	78,300,000.00	19.29

## 6.4.10.1.4 基金交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	成交金额	占当期基金 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期基金 成交总额的比例 (%)
国信证券	-	-	6,877,474.00	35.59

## 6.4.10.1.5 权证交易

注：无。

## 6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
国信证券	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
国信证券	736.45	6.22	736.45	10.89

注：（1）佣金的计算公式

上海/深圳证券交易所的交易佣金=股票买(卖)成交金额×佣金比率-买(卖)经手费-买(卖)证管费等由券商承担的费用

(佣金比率按照与一般证券公司签订的协议条款订立。)

(2) 本基金与关联方已按同业统一的基金佣金计算方式和约定的佣金比例签订了《证券交易席位租用协议》。根据协议规定，上述单位定期或不定期地为鹏华基金公司提供研究服务以及其他研究支持。

## 6.4.10.2 关联方报酬

## 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	393,785.96	68,197.48
其中：支付销售机构的客户维护	195,926.19	67,544.55



费		
---	--	--

注：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管理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。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	101,988.30	50,463.88

注：本基金基金财产中投资于本基金托管人中国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。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

#### 6.4.10.4 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

##### 6.4.10.4.1 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。

##### 6.4.10.4.2 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。

## 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

## 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金合同生效日 (2019 年 4 月 22 日) 持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减: 报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	4.7768%	19.6706%

注：本基金管理人投资本基金的费率标准与其他相同条件的投资者适用的费率标准相一致。

## 6.4.10.5.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末		上年度末	
	2022 年 6 月 30 日		2021 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)
国信证券	5,642,682.11	2.70	-	-

注：除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的费率标准与其他相同条件的投资者适用的费率标准相一致。

## 6.4.10.6 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		上年度可比期间	
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	17,466,175.14	20,048.92	514,505.28	3,497.82

## 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

于 2022 年 6 月 30 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 63,491,239.81 元, 占本基金资产净值的比例为 21.15%。(于 2021 年 6 月 30 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 37,573,418.24 元, 占本基金资产净值的比例为 51.89%。)

##### 6.4.10.8.2 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 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)	5,455.79	8,233.12
当期持有基金产生的应支付销售 服务费 (元)	945.85	1,956.84
当期持有基金产生的应支付管理 费 (元)	108,604.55	293,137.68
当期持有基金产生的应支付托管 费 (元)	29,147.60	56,111.46
当期交易基金产生的转换费 (元)	-	4,480.37

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。

#### 6.4.11 利润分配情况

注: 无。

#### 6.4.12 期末(2022 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注: 无。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注: 无。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 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，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(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。

#### 6.4.13.2 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中国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。

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券（2021 年 12 月 31 日：7.86%）。

#### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

注：无。

#### **6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

注：无。

#### **6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

注：无。

#### **6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

注：无。

#### **6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

注：无。

#### **6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

注：无。

### **6.4.13.3 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、组合在短期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 2022 年 6 月 30 日,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。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注:无。

#### 6.4.13.3.2 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期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股票不得超过该上市公司可流通股股票的 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股票,不得超过该上市公司可流通股股票的 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。

#### 6.4.13.4 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。

##### 6.4.13.4.1 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。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等，其余大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	17,466,175.14	-	-	-	17,466,175.14
结算备付金	35,612.37	-	-	-	35,612.37

存出保证金	54,202.88	-	-	-	54,202.88
交易性金融资产	14,159,844.77	-	-	-269,020,929.08	283,180,773.85
应收股利	-	-	-	35.74	35.74
应收申购款	-	-	-	40,149.27	40,149.27
资产总计	31,715,835.16	-	-	-269,061,114.09	300,776,949.25
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	71.21	71.21
应付管理人报酬	-	-	-	114,210.04	114,210.04
应付托管费	-	-	-	29,953.47	29,953.47
应交税费	-	-	-	319,582.36	319,582.36
其他负债	-	-	-	57,027.67	57,027.67
负债总计	-	-	-	520,844.75	520,844.75
利率敏感度缺口	31,715,835.16	-	-	-268,540,269.34	300,256,104.50
上年度末 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	1,662,907.63	-	-	-	1,662,907.63
结算备付金	376,003.85	-	-	-	376,003.85
存出保证金	2,289.69	-	-	-	2,289.69
交易性金融资产	3,534,565.90	4,377,206.00	1,546,146.90	72,620,885.46	82,078,804.26
应收股利	-	-	-	10.30	10.30
应收申购款	-	-	-	4,097.56	4,097.56
其他资产	-	-	-	86,405.18	86,405.18
资产总计	5,575,767.07	4,377,206.00	1,546,146.90	72,711,398.50	84,210,518.47
负债	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	25,865.42	25,865.42
应付托管费	-	-	-	9,592.58	9,592.58
应付清算款	-	-	-	21,525.61	21,525.61
卖出回购金融资产款	8,700,000.00	-	-	-	8,700,000.00
应交税费	-	-	-	10,775.14	10,775.14
其他负债	-	-	-	112,657.52	112,657.52
负债总计	8,700,000.00	-	-	180,416.27	8,880,416.27
利率敏感度缺口	-3,124,232.93	4,377,206.00	1,546,146.90	72,530,982.23	75,330,102.20

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2022 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资和资产支持证券公允价值占基金资产净值的比例为 4.72%。因此当利率发生合理、可能的变动时，对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 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。

#### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无。

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无。

#### 6.4.13.4.3 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。

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(含存托凭证)，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 60%；本基金投资于商品基金(含商品期货基金和黄金 ETF)的比例不超过基金资产的 10%；每个交易日日终，本基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金属于目标日期基金，随着所设定目标日期的临近，将逐步降低权益类资产的配置比例。本基金各个时间段的权益类资产配置比例如下表所示：权益类资产指的是股票型基金，混合型基金及股票(含存托凭证)，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(含存托凭证)资产的实际持仓比例均不低于基金资产的 50%。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。基金合同生效日-2029/12/31，权益类资产上限 60%，权益类资产下限 45%。

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。

## 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日		上年度末 2021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	-	-	8,361,319.58	11.10
交易性金融资产—基金投资	269,020,929.08	89.60	64,259,565.88	85.30
交易性金融资产—债券投资	-	-	5,923,352.90	7.86
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	269,020,929.08	89.60	78,544,238.36	104.26

注：债券投资为可转换债券、可交换债券投资。

## 6.4.13.4.3.2 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 (2022年6月30日)	上年度末 (2021年12月31日)	
分析	业绩比较基准上升 5%	8,264,549.28	2,497,192.89
	业绩比较基准下降 5%	-8,264,549.28	-2,497,192.89

注：无。

## 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

## 6.4.14 公允价值

## 6.4.14.1 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：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。

#### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年6月30日
第一层次	269,020,929.08
第二层次	14,159,844.77
第三层次	-
合计	283,180,773.85

##### 6.4.14.2.2 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；对于定期开放的基金投资，本基金不会于封闭期将相关基金列入第一层次；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、债券和基金的公允价值应属第二层次还是第三层次。

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

##### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	269,020,929.08	89.44
3	固定收益投资	14,159,844.77	4.71
	其中：债券	14,159,844.77	4.71
	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	17,501,787.51	5.82
8	其他各项资产	94,387.89	0.03
9	合计	300,776,949.25	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注：无。

#### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

### 7.3 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

注：无。

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 7.4.1 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	002405	四维图新	698,686.00	0.93
2	300024	机器人	697,741.00	0.93

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。

#### 7.4.2 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	300792	壹网壹创	1,317,268.76	1.75

2	300655	晶瑞电材	836,643.00	1.11
3	002405	四维图新	775,100.00	1.03
4	300525	博思软件	763,193.00	1.01
5	300035	中科电气	716,265.00	0.95
6	002254	泰和新材	652,418.00	0.87
7	300024	机器人	620,165.00	0.82
8	300769	德方纳米	581,014.00	0.77
9	688200	华峰测控	482,878.23	0.64
10	000792	盐湖股份	460,706.00	0.61
11	600096	云天化	440,363.00	0.58
12	600141	兴发集团	407,251.00	0.54
13	688536	思瑞浦	334,589.24	0.44
14	300725	药石科技	257,904.24	0.34
15	002709	天赐材料	215,556.00	0.29

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。

#### 7.4.3 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	1,396,427.00
卖出股票收入（成交）总额	8,861,314.47

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。

#### 7.5 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	14,159,844.77	4.72
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	14,159,844.77	4.72

#### 7.6 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	019629	20 国债 03	115,940	11,703,466.42	3.90

2	019666	22 国债 01	21,560	2,180,197.41	0.73
3	019641	20 国债 11	1,980	202,809.39	0.07
4	019658	21 国债 10	720	73,371.55	0.02

#### 7.7 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。

#### 7.8 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。

#### 7.9 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。

#### 7.10 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。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 7.11.1 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。

##### 7.11.2 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。

#### 7.12 本报告期投资基金情况

##### 7.12.1 投资政策及风险说明

本基金为混合型基金中基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金、股票型基金中基金，高于债券型基金、债券型基金中基金、货币市场基金及货币型基金中基金。

本基金属于目标日期基金，随着所设定目标日期的临近，将逐步降低权益类资产的配置比例，风险与收益水平会随着目标日期的临近而逐步降低。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均不低于基金资产的 50%。

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。

##### 7.12.2 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	206003	鹏华 信用 增利 A	契约 型开 放式	29,353,432.42	38,432,449.07	12.80	是
2	512800	华宝 中证 银行 ETF	交易 型开 放式 (ETF)	22,764,100.00	25,973,838.10	8.65	否
3	000054	鹏华 双债 增利 债券	契约 型开 放式	18,220,599.68	25,058,790.74	8.35	是
4	166301	华商 新趋 势优 选混 合	上市 契约 型开 放式 (LOF)	2,224,800.00	18,886,327.20	6.29	否
5	006551	中庚 价值 领航 混合	契约 型开 放式	7,602,077.20	18,701,109.91	6.23	否
6	512400	南方 中证 申万 有色 金属 ETF	交易 型开 放式 (ETF)	14,125,000.00	18,560,250.00	6.18	否
7	515220	国泰 中证 煤炭 ETF	交易 型开 放式 (ETF)	7,107,400.00	17,711,640.80	5.90	否
8	512880	国泰 中证 全指 证券 公司 ETF	交易 型开 放式 (ETF)	17,468,800.00	17,049,548.80	5.68	否

9	515050	华夏 中证 5G 通信 主题 ETF	交易 型开 放式 (ETF)	14,759,400.00	13,873,836.00	4.62	否
10	420102	天弘 永利 债券 B	契约 型开 放式	9,107,777.29	10,801,823.87	3.60	否
11	450011	国富 研究 精选 混合	契约 型开 放式	2,840,000.00	9,522,520.00	3.17	否
12	001043	工银 美丽 城镇 股票 A	契约 型开 放式	3,340,000.00	9,201,700.00	3.06	否
13	588000	华夏 上证 科创 板 50 成份 ETF	交易 型开 放式 (ETF)	7,678,900.00	8,869,129.50	2.95	否
14	006624	中泰 玉衡 价值 优选 混合	契约 型开 放式	4,006,909.26	8,814,398.99	2.94	否
15	000402	工银 纯债 债券 A	契约 型开 放式	5,754,147.62	6,691,498.27	2.23	否
16	450004	国富 深化	契约 型开	3,140,000.00	6,490,380.00	2.16	否



		价值混合	开放式				
17	110017	易方达增强回报债券 A	契约型开放式	4,073,648.14	5,625,708.08	1.87	否
18	675113	西部利得汇享债券 C	契约型开放式	4,095,000.03	4,834,966.54	1.61	否
19	110008	易方达稳健收益债券 B	契约型开放式	2,826,757.92	3,920,713.24	1.31	否
20	511990	华宝添益货币 A	交易型开放式 (ETF)	3.00	299.97	0.00	否

### 7.13 投资组合报告附注

#### 7.13.1 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

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

#### 7.13.2 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。

#### 7.13.3 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	54,202.88
2	应收清算款	-
3	应收股利	35.74
4	应收利息	-
5	应收申购款	40,149.27

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	94,387.89

#### 7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

#### 7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

#### 7.13.6 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。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 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 (%)
4,763	43,952.67	17,913,893.71	8.56	191,432,684.86	91.44

### 8.2 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	3,019,719.20	1.4424

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。

### 8.3 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	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	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	-

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。

2、截至本报告期末，本基金的基金经理未持有本基金份额。

#### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	4.78	10,000,000.00	4.78	三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,000.00	4.78	10,000,000.00	4.78	-

注：1、本基金自 2019 年 4 月 16 日至 2019 年 4 月 18 日止期间公开发售，于 2019 年 4 月 22 日基金合同正式生效。

2、本基金管理人在募集期间认购本基金份额 10,000,000.00 份。

3、本基金管理人投资本基金的费率标准与其他相同条件的投资者适用的费率标准相一致。

### § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2019 年 4 月 22 日）基金份额总额	10,091,053.83
本报告期期初基金份额总额	50,986,996.92
本报告期基金总申购份额	158,369,259.86
减：本报告期基金总赎回份额	9,678.21
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	209,346,578.57

### § 10 重大事件揭示

#### 10.1 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。

## 10.2 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，公司无重大人事变动。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

无。

## 10.3 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。

## 10.4 基金投资策略的改变

无。

## 10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

工银瑞信基本面量化策略混合型证券投资基金基金经理变更，基金经理游凇峰离任

## 10.6 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。

## 10.7 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。

## 10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.8.1 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 (%)	
天风证券	2	8,592,660.00	83.77	6,971.50	82.12	-
广发证券	3	1,665,081.47	16.23	1,517.44	17.88	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	本报告期

							新增
东方证券	1	-	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-	本报告期新增
国信证券	2	-	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-	-
摩根大通证券	1	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	1	-	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-	-

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

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、及时性以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。

## 10.8.2 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

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	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 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
天风证券	4,142,245.34	21.03	-	-	-	-	-	-
广发证券	3,931,509.20	19.96	206,300,000.00	97.40	-	-	33,297,187.10	16.20
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	11,618,853.20	59.00	5,500,000.00	2.60	-	-	-172,304,213.22	83.80
摩根大通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-

中信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
----------	---	---	---	---	---	---	---	---

### 10.9 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	鹏华基金管理有限公司关于暂停客服电话服务的公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 01 月 01 日
2	鹏华基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 01 月 01 日
3	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	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 01 月 21 日
4	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) 2021 年第 4 季度报告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 01 月 21 日
5	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与民生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	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 01 月 24 日
6	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与第一创业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	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 02 月 10 日
7	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与北京雪球基金销售有限公司申购 (含定期定额申购) 费率优惠活动的公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 02 月 21 日
8	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与财通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	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 03 月 01 日
9	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中信建投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	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 03 月 08 日
10	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与光大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	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 03 月 14 日
11	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与宁波银行股份有限公司易管家平台申购 (不含定期定额申购) 费率优惠活动的公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 03 月 15 日

12	关于结束鹏华养老目标日期 2045 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 在国信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	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 03 月 21 日
13	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) 2021 年年度报告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 03 月 30 日
14	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) 基金产品资料概要 (更新)	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 04 月 13 日
15	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) 更新的招募说明书	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 04 月 13 日
16	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与广发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	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 04 月 19 日
17	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) 2022 年第 1 季度报告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 04 月 21 日
18	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) 开放日常赎回业务的公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 04 月 21 日
19	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与宁波银行股份有限公司易管家平台申购 (不含定期定额申购) 费率优惠活动的公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 04 月 21 日
20	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定期定额申购费率优惠活动的公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 04 月 25 日
21	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	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 04 月 27 日
22	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与江苏张家港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	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 04 月 28 日
23	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	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 04 月 30 日
24	鹏华基金管理有限公司关于终止北京植信基金销售有限公司办理本公司旗下基金相关销售业务的公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 05 月 06 日



25	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) 基金经理变更公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 05 月 07 日
26	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) 基金产品资料概要 (更新)	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 05 月 11 日
27	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) 更新的招募说明书 (2022 年第 1 号)	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 05 月 11 日
28	鹏华基金管理有限公司关于终止北京唐鼎耀华基金销售有限公司办理本公司旗下基金相关销售业务的公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 05 月 13 日
29	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与北京度小满基金销售有限公司相关费率优惠活动的公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 05 月 30 日
30	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与上海好买基金销售有限公司申购 (含定期定额申购) 费率优惠活动的公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 06 月 06 日
31	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中航证券有限公司申购 (含定期定额申购) 费率优惠活动的公告	《证券日报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 06 月 18 日

注：无。

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (一) 《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) 基金合同》；
- (二) 《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) 托管协议》；
- (三) 《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) 2022 年中期报告》(原文)。

## 12.2 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。

## 12.3 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 8 月 30 日