

鹏华聚合多资产 3 个月持有期混合型基金
中基金（FOF）
2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：华夏银行股份有限公司

送出日期：2023 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。

基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 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 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
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
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	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	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	42

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	42
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	42
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	42
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	42
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	42
7.12 本报告期投资基金情况	42
7.13 投资组合报告附注	47
§ 8 基金份额持有人信息	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	48
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	49
§ 9 开放式基金份额变动	49
§ 10 重大事件揭示	49
10.1 基金份额持有人大会决议	49
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	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	49
10.4 基金投资策略的改变	50
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	50
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	50
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	50
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况	50
10.9 其他重大事件	51
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	52
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	52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	53
§ 12 备查文件目录	53
12.1 备查文件目录	53
12.2 存放地点	53
12.3 查阅方式	53

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华聚合多资产 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）
基金简称	鹏华聚合多资产混合（FOF）
基金主代码	009787
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 7 月 21 日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	华夏银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	71,273,905.18 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，通过科学的大类资产配置，优选基金力争实现基金资产的稳健增值。
投资策略	<p>本基金通过合理判断市场走势，合理配置基金、股票、债券等投资工具的比例，通过定量和定性相结合的方法精选具有不同风险收益特征的基金，力争实现基金资产的稳健增值。</p> <p>1、资产配置策略 在资产配置上，本基金将结合产品定位、风险收益特征及管理人的长期资本市场观点确定基金的资产配置方案。首先，管理人将根据基金业绩基准确定产品的风险收益特征。其次，本基金通过跟踪考量通常的宏观经济变量（包括 GDP 增长率、CPI 走势、M2 的绝对水平和增长率、利率水平与走势等）以及各项国家政策（包括财政、货币、税收、汇率政策等）来判断经济周期目前的位置以及未来将发展的方向，在此基础上对各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估。最后，结合本基金以及各资产类别的风险收益特征，并依据现代投资组合理论，制定股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。本基金将密切关注市场风险的变化以及各资产类别的风险收益的相对变化趋势，在业绩比较基准所确定的产品风险收益特征基础上，以收益风险比最大化为原则，通过定性方式适度调整本基金的资产配置比例。原则上，管理人参考公司投资决策委员会对大类资产进行评估，检视大类资产的市场展望和中长期资本市场观点是否发生改变，根据评估情况决定是否进行资产配置的动态再平衡。当资本市场发生重大变化且管理人认为将影响各类资产的预期时，管理人将根据实际情况调整资产配置比例。</p> <p>2、基金投资策略 在完成资产配置以后，本基金将主要通过优选基金实践资产配置的策略。基金优选策略从定量和定性两大维度展开，对基金及基金公司做出综合性评价。对基金的评价包括风格评价和业绩评价两方面，重点衡量基金风格是否清晰稳定、中长期业绩及风险控制能力是否良好；对基金公司的评价主要从综合实力、管理水平、运作合规等方面进行分析。（1）基金业绩评价和风格评价 基于投资范围、投资策略以及实际投资组合等维度，对基金进行分类。本基金以同类基金为对象进行评价，并对各类基金进行评级和排序。考虑的主要因素包括：基金的获利能力；基</p>

	<p>金与其业绩比较基准的历史回报对比，绩效指标分析（如期间净值增长率、累计净值增长率、分红率等），风险调整后的绩效指标分析（如 Sharpe 比率、Treydor 指标和 Jensen 指标等）；基金的风险衡量：主要考察基金净值波动率、最大回撤、风格偏离等维度。基金的风格：基于合同约定和实际比较基准的拟合等考察基金风格是否清晰。（2）基金公司综合评价 对于基金公司的综合评价，依据主要来自于调研、公司刊物和公开信息。考虑的主要因素包括：综合实力：主要包括基金公司的总资产、总资产增长率和加权净值收益率；管理水平：主要包括发起人构成、风险控制机制、高级管理人员素质、基金经理的稳定性及从业经验等、研究人员的稳定性及从业经验等。运作合规：主要考察基金管理人或基金经理近 2 年来运作合规情况。本基金将依据基金评价结果，挑选出基础库，并在基础库基础上，依据基金管理公司评价结果及基金评价深度报告、尽调报告等，构建优先库。在基础库和优先库中优选标的，构建本基金组合基金库。基金库将进行定期维护和不定期维护，按照出库入库标准，实现基金库的动态调整。3、股票投资策略 本基金通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘 A 股和港股的优质公司，构建股票投资组合。核心思路在于：1) 自上而下地分析行业的增长前景、行业结构、商业模式、竞争要素等分析把握其投资机会；2) 自下而上地评判企业的核心竞争力、管理层、治理结构等以及其所提供的产品和服务是否契合未来行业增长的大趋势，对企业基本面和估值水平进行综合的研判，深度挖掘优质的个股。本基金还将关注以下几类港股通标的：1) 在港股市场上市、具有行业代表性的优质中资公司；2) 具有行业稀缺性的香港本地和外资公司；3) 港股市场在行业结构、估值、AH 股折溢价、分红率等方面具有吸引力的投资标的。本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。4、债券投资策略 本基金债券投资将采取久期策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、个券选择策略、信用策略等积极投资策略，自上而下地管理组合的久期，灵活地调整组合的券种搭配，同时精选个券，以增强组合的持有期收益。5、资产支持证券的投资策略 本基金将综合运用战略资产配置和战术资产配置进行资产支持证券的投资组合管理，并根据信用风险、利率风险和流动性风险变化积极调整投资策略，严格遵守法律法规和基金合同的约定，在保证本金安全和基金资产流动性的基础上获得稳定收益。未来，如果港股通业务规则发生变化或出现法律法规或监管部门允许投资的其他模式，基金管理人可相应调整，不需召开基金份额持有人大会。未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，本基金可相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书中更新并公告。</p>
业绩比较基准	<p>中证 800 指数收益率*15%+恒生中国企业指数收益率*5%（经汇率估值调整）+中债综合财富指数收益率*80%</p>
风险收益特征	<p>本基金为混合型基金中基金（FOF），其预期风险水平高于债券型基金、债券型基金中基金、货币市场基金和货币型基金中基金，但低于股票型基金、股票型基金中基金。本基金将投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规</p>

	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	华夏银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	高永杰	郑鹏
	联系电话	0755-81395402	(010)85238667
	电子邮箱	xxpl@phfund.com.cn	zhengpeng@hxb.com.cn
客户服务电话		4006788999	95577
传真		0755-82021126	(010)85238680
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	北京市东城区建国门内大街 22 号（100005）
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	北京市东城区建国门内大街 22 号（100005）
邮政编码		518048	100005
法定代表人		何如	李民吉

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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.phfund.com.cn
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(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-1,665,968.41
本期利润	-762,872.61
加权平均基金份额本期利润	-0.0105
本期加权平均净值利润率	-1.02%
本期基金份额净值增长率	-1.12%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-1,624,512.99
期末可供分配基金份额利润	-0.0228
期末基金资产净值	71,915,806.57
期末基金份额净值	1.0090
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)

基金份额累计净值增长率	2.13%
-------------	-------

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

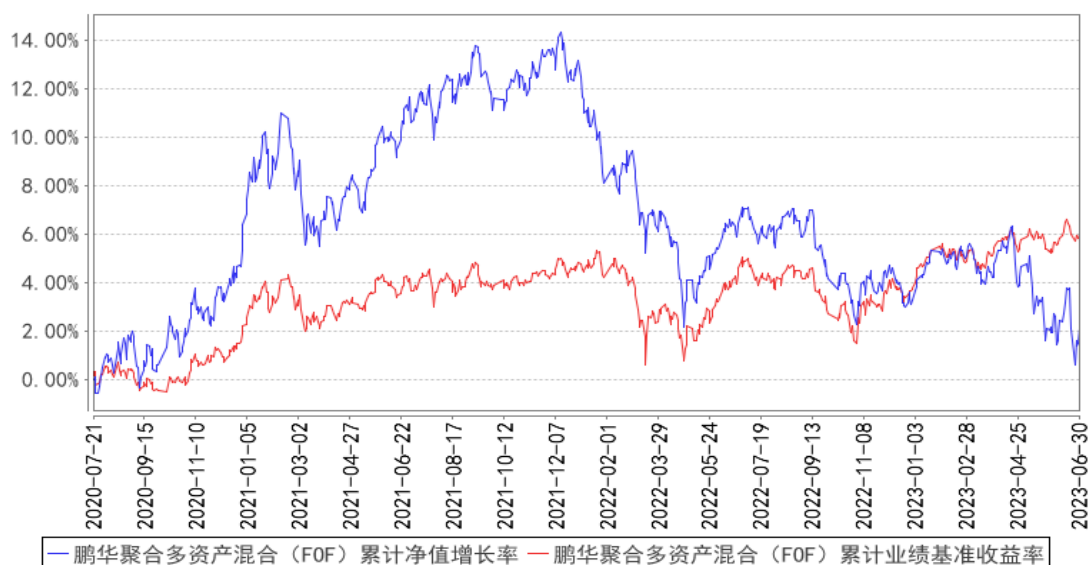
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.17%	0.69%	0.76%	0.19%	-0.59%	0.50%
过去三个月	-2.62%	0.53%	0.43%	0.17%	-3.05%	0.36%
过去六个月	-1.12%	0.41%	2.16%	0.18%	-3.28%	0.23%
过去一年	-4.61%	0.36%	1.03%	0.21%	-5.64%	0.15%
自基金合同生效起至今	2.13%	0.39%	5.99%	0.23%	-3.86%	0.16%

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

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

鹏华聚合多资产混合（FOF）累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2020 年 07 月 21 日生效。2、截至建仓期结束，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

3.3 其他指标

注：无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金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 6 月 30 日，公司管理资产总规模达到 11517 亿元，301 只公募基金、13 只全国社保投资组合、7 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		
孙博斐	基金经理	2022-05-07	-	9 年	孙博斐先生，国籍中国，管理学硕士，9 年证券从业经验。曾任中国民生银行私人

					<p>银行事业部投资与策略中心策略研究员，嘉实基金管理有限公司 FOF 研究员，建信信托有限责任公司 FOF 投资经理。2022 年 3 月加盟鹏华基金管理有限公司，现担任资产配置与基金投资部基金经理。2022 年 05 月至今担任鹏华长乐稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 基金经理, 2022 年 05 月至今担任鹏华长治稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金 (FOF) 基金经理, 2022 年 05 月至今担任鹏华精选群英一年持有期灵活配置混合型管理人中管理人 (MOM) 证券投资基金基金经理, 2022 年 05 月至今担任鹏华养老目标日期 2045 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 基金经理, 2022 年 05 月至今担任鹏华养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金 (FOF) 基金经理, 2022 年 05 月至今担任鹏华聚合多资产 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 基金经理, 2023 年 01 月至今担任鹏华养老目标日期 2040 五年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 基金经理, 孙博斐先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理未发生变动。</p>
--	--	--	--	--	---

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，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。公司对不同投资组合在不同时间窗口下（日内、3 日内、5 日内）的同向交

易价差进行专项分析，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 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，国内基本面波动不大，而政策面变化较大，主要体现在疫情防控政策和地产政策的扭转。而 A 股市场经过 10 月份的再度下跌，市场估值处于历史低位，长期配置的赔率较高。在政策预期不断向“稳增长”好转的催化下，A 股市场在年底出现大金融板块和消费板块估值修复为主的反弹，同时债券收益率出现快速上行。基于对国内经济和权益市场的长期乐观，本基金在四季度适度提高了权益资产的配置比例，结构上维持了大金融板块的重点配置。

2022 年 A 股市场整体表现较差，一方面归因于国内经济下行压力较大，且叠加了美联储加息、新冠疫情等诸多不确定因素的负面影响；另一方面归因于 A 股内部估值分化的矛盾突出，部分高估值板块全年跌幅相对靠前。展望 2023 年，美联储加息和国内疫情防控两大不确定性因素逐渐消退，国内政策强调“大力提振市场信心”和“推动经济运行整体好转”，尽管全球增长和通胀仍然存在不确定性，但国内大概率呈现经济周期性复苏、通胀风险不大的宏观环境，有利于权益资产的配置。目前 A 股估值处于历史较低水平，与宏观经济和内需相关度较高的部分行业板块估值处于历史低位，存在困境反转的可能；此外科技制造方向仍然存在景气度较高的投资机会。本基金将在控制风险的前提下维持权益资产的较高比例配置，积极寻找投资机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期鹏华聚合多资产混合（FOF）份额净值增长率为-1.12%，同期业绩比较基准增长率为 2.16%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

站在当前时点，A 股整体估值再次回到历史低位，股债比价优势明显。短期来看，人民币对美元汇率已经充分反映了市场对于国内经济的悲观预期，随着下半年 PPI 见底回升，国内基本面有望触底，A 股市场也可能迎来预期修正。中期来看，中美各自的库存周期即将见底，并共振复苏，是投资风险资产较为理想的宏观场景。

基于上述判断，我们对国内 A 股资产持乐观态度，组合权益仓位保持超配状态。行业板块上，一方面低估值高分红板块的超配，另一方面保持以 TMT 和高端制造为代表的科技成长板块的超

配。

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-1,624,512.99 元，期末基金份额净值 1.0090 元，不符合利润分配条件。

2、本基金本报告期内未进行利润分配。

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

本基金自 2023 年 04 月 17 日至 2023 年 05 月 25 日期间出现连续二十个（或以上）工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

§ 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

报告期内，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，基金管理人在投资运作、基金资产净值计算、利润分配、基金费用开支等方面，能够遵守有关法律法规，未发现有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

托管人认为，由基金管理人编制并经托管人复核的本基金报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、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：鹏华聚合多资产 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	4,673,696.65	48,527,389.01
结算备付金		33,613.35	15,097.98
存出保证金		31,196.42	61,621.28
交易性金融资产	6.4.7.2	67,633,544.31	46,138,505.52
其中：股票投资		5,338,294.66	-
基金投资		62,295,249.65	46,138,505.52
债券投资		-	-
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		477,154.67	12,606,351.75
应收股利		178.45	391.59
应收申购款		-	14,999,000.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	104.38	-
资产总计		72,849,488.23	122,348,357.13

负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负 债：			
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		-	-
应付清算款		798,314.17	3,131,782.36
应付赎回款		-	63,854,263.42
应付管理人报酬		35,183.28	44,783.67
应付托管费		5,937.12	8,425.73
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	248.66
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	94,247.09	162,000.00
负债合计		933,681.66	67,201,503.84
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	71,273,905.18	54,043,490.35
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	641,901.39	1,103,362.94
净资产合计		71,915,806.57	55,146,853.29
负债和净资产总计		72,849,488.23	122,348,357.13

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0090 元，基金份额总额 71,273,905.18 份。

6.2 利润表

会计主体：鹏华聚合多资产 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-439,497.51	-49,183,572.39
1. 利息收入		15,636.76	47,628.75
其中：存款利息收入	6.4.7.13	15,636.76	47,628.75
债券利息收入		-	-
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）		-1,358,311.19	-4,090,642.79
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-169,278.37	-23,806,167.62
基金投资收益	6.4.7.15	-1,479,516.25	12,494,153.52
债券投资收益	6.4.7.16	-	374,465.63
资产支持证券投资 收益	6.4.7.17	-	-
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	290,483.43	6,846,905.68
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	903,069.16	-45,363,680.94
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	107.76	223,122.59
减：二、营业总支出		323,375.10	1,875,810.78
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	205,796.15	1,427,199.33
2. 托管费	6.4.10.2.2	37,030.85	295,512.94
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	55,200.83
其中：卖出回购金融资产 支出		-	55,200.83
6. 信用减值损失	6.4.7.24	-	-
7. 税金及附加		213.06	1,198.43
8. 其他费用	6.4.7.25	80,335.04	96,699.25
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		-762,872.61	-51,059,383.17
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		-762,872.61	-51,059,383.17
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		-762,872.61	-51,059,383.17

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：鹏华聚合多资产 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 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)	54,043,490.35	-	1,103,362.94	55,146,853.29
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)	54,043,490.35	-	1,103,362.94	55,146,853.29
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	17,230,414.83	-	-461,461.55	16,768,953.28
(一)、综合收益总额	-	-	-762,872.61	-762,872.61
(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)	17,230,414.83	-	301,411.06	17,531,825.89
其中：1. 基金申购款	24,505,068.55	-	596,910.76	25,101,979.31
2	-7,274,653.72	-	-295,499.70	-7,570,153.42

. 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、本期期末净资产(基金净值)	71,273,905.18	-	641,901.39	71,915,806.57
项目	上年度可比期间 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)	805,506,228.21	-	105,740,583.01	911,246,811.22
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)	805,506,228.21	-	105,740,583.01	911,246,811.22
三、本期增减变动额(减)	-457,100,714.40	-	-85,601,793.64	-542,702,508.04

少以“-”号填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	-51,059,383.17	-51,059,383.17
(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)	-457,100,714.40	-	-23,829,139.51	-480,929,853.91
其中:1.基金申购款	2,403,448.89	-	211,640.82	2,615,089.71
2.基金赎回款	-459,504,163.29	-	-24,040,780.33	-483,544,943.62
(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)	-	-	-10,713,270.96	-10,713,270.96
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	348,405,513.81	-	20,138,789.37	368,544,303.18

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

基金管理人负责人

邢彪

主管会计工作负责人

郝文高

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

鹏华聚合多资产 3 个月持有期混合型基金中基金 (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[2020]284 号《关于准予鹏华聚合多资产 3 个月持有期混合型基金中基金 (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《鹏华聚合多资产 3 个月持有期混合型基金中基金 (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 381,741,237.54 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(2020)第 0628 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华聚合多资产 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 基金合同》于 2020 年 7 月 21 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 381,756,163.42 份基金份额,其中认购资金利息折合 14,925.88 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,基金托管人为华夏银行股份有限公司。

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”)、《资产管理产品相关会计处理规定》(财会[2022]14 号)、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》、《鹏华聚合多资产 3 个月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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 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 2023 年 06 月 30 日的财务状况以及 2023 年上半年的经营成果和基金净资产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

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

无。

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 2023 年 6 月 30 日
活期存款	4,673,696.65
等于：本金	4,673,249.82
加：应计利息	446.83
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	4,673,696.65

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	5,461,265.25	-	5,338,294.66	-122,970.59
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券 交易所市场	-	-	-	-

	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
	资产支持证券	-	-	-	-
	基金	62,576,555.24	-	62,295,249.65	-281,305.59
	其他	-	-	-	-
	合计	68,037,820.49	-	67,633,544.31	-404,276.18

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

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应收利息	-
其他应收款	104.38
待摊费用	-
合计	104.38

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023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	13,912.05
其中：交易所市场	13,912.05
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	80,335.04
合计	94,247.09

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	54,043,490.35	54,043,490.35
本期申购	24,505,068.55	24,505,068.55
本期赎回（以“-”号填列）	-7,274,653.72	-7,274,653.72
- 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	71,273,905.18	71,273,905.18

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
上年度末	25,308.98	1,078,053.96	1,103,362.94
本期利润	-1,665,968.41	903,095.80	-762,872.61
本期基金份额交易产生的变动数	16,146.44	285,264.62	301,411.06
其中：基金申购款	7,991.21	588,919.55	596,910.76
基金赎回款	8,155.23	-303,654.93	-295,499.70
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,624,512.99	2,266,414.38	641,901.39

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	14,822.87
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	445.08
其他	368.81
合计	15,636.76

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
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-169,278.37
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	-169,278.37

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
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	6,276,008.16

减：卖出股票成本总额	6,422,666.00
减：交易费用	22,620.53
买卖股票差价收入	-169,278.37

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
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出/赎回基金成交总额	97,505,072.74
减：卖出/赎回基金成本总额	98,860,336.71
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	1,997.63
减：交易费用	122,254.65
基金投资收益	-1,479,516.25

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

注：无。

6.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	35,014.73
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	255,468.70
合计	290,483.43

6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	902,847.14
股票投资	-122,970.59
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	1,025,817.73
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	-222.02
合计	903,069.16

6.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	0.18
销售服务费	107.58
合计	107.76

6.4.7.23 持有基金产生的费用

项目	本期费用 2023年1月1日至2023年6月30日
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	26,201.21
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	270,258.14
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	54,466.89

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 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	20,827.67
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
合计	80,335.04

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
华夏银行股份有限公司（“华夏银行”）	基金托管人

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

注：无。

6.4.10.1.2 债券交易

注：无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

6.4.10.1.4 基金交易

注：无。

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

注：无。

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	205,796.15	1,427,199.33
其中：支付销售机构的客户维护费	10.86	16,342.28

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	37,030.85	295,512.94

注：本基金基金财产中投资于本基金托管人华夏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 0.10%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）×0.10%/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

注：无。

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

注：本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方没有投资及持有本基金份额。

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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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
华夏银行	4,673,696.65	14,822.87	28,557,565.68	42,416.03

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2023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906,149.87元，占本基金资产净值的比例为1.27%。（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59,728,640.30元，占本基金资产净值的比例为16.21%。）

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 2023年1月1日至2023年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022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）	2.30	46.43
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	107.58	-
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	8,450.60	343,523.04
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	2,656.61	67,300.72
当期交易基金产生的转换费（元）	734.67	-

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（2023 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的股票，存托凭证），内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内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，可交换债券等），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华夏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 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券（2022 年 12 月 31 日：未持有）。

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 2023 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（净资产）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。

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 2023 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	4,673,696.65	-	-	-	4,673,696.65
结算备付金	33,613.35	-	-	-	33,613.35
存出保证金	31,196.42	-	-	-	31,196.42
交易性金融资产	-	-	-	67,633,544.31	67,633,544.31
应收股利	-	-	-	178.45	178.45
应收清算款	-	-	-	477,154.67	477,154.67
其他资产	-	-	-	104.38	104.38
资产总计	4,738,506.42	-	-	68,110,981.81	72,849,488.23
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	35,183.28	35,183.28
应付托管费	-	-	-	5,937.12	5,937.12
应付清算款	-	-	-	798,314.17	798,314.17
其他负债	-	-	-	94,247.09	94,247.09
负债总计	-	-	-	933,681.66	933,681.66
利率敏感度缺口	4,738,506.42	-	-	67,177,300.15	71,915,806.57
上年度末 2022 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	48,527,389.01	-	-	-	48,527,389.01
结算备付金	15,097.98	-	-	-	15,097.98
存出保证金	61,621.28	-	-	-	61,621.28
交易性金融资产	-	-	-	46,138,505.52	46,138,505.52
应收股利	-	-	-	391.59	391.59
应收申购款	-	-	-	14,999,000.00	14,999,000.00
应收清算款	-	-	-	12,606,351.75	12,606,351.75
资产总计	48,604,108.27	-	-	73,744,248.86	122,348,357.13
负债					
应付赎回款	-	-	-	63,854,263.42	63,854,263.42
应付管理人报酬	-	-	-	44,783.67	44,783.67
应付托管费	-	-	-	8,425.73	8,425.73
应付清算款	-	-	-	3,131,782.36	3,131,782.36
应交税费	-	-	-	248.66	248.66
其他负债	-	-	-	162,000.00	162,000.00
负债总计	-	-	-	67,201,503.84	67,201,503.84

利率敏感度缺口	48,604,108.27	-	-	6,542,745.02	55,146,853.29
---------	---------------	---	---	--------------	---------------

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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2023 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 0.00%。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。

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%，其中投资于股票型基金的比例不高于基金资产净值的 30%；本基金投资于港股通标的股票占基金股票（含存托凭证）资产的 0-50%；基金保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金，存出保证金，应收申购款等。如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (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 2023年6月30日		上年度末 2022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	5,338,294.66	7.42	-	-
交易性金融资产—基金投资	62,295,249.65	86.62	46,138,505.52	83.66
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
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	67,633,544.31	94.04	46,138,505.52	83.66

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 (2023年6月30日)	上年度末 (2022年12月31日)
分析	业绩比较基准上升5%	1,069,028.46	722,423.78
	业绩比较基准下降5%	-1,069,028.46	-722,423.78

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 2023年6月30日
第一层次	67,633,544.31
第二层次	-
第三层次	-
合计	67,633,544.31

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；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	5,338,294.66	7.33
	其中：股票	5,338,294.66	7.33
2	基金投资	62,295,249.65	85.51
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	4,707,310.00	6.46
8	其他各项资产	508,633.92	0.70
9	合计	72,849,488.23	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

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	370,645.00	0.52
C	制造业	1,811,526.70	2.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	385,937.00	0.54
E	建筑业	74,305.00	0.10
F	批发和零售业	69,930.00	0.10
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	732,801.96	1.02
J	金融业	1,893,149.00	2.63
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	5,338,294.66	7.42

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

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	601328	交通银行	111,200	644,960.00	0.90
2	601658	邮储银行	102,700	502,203.00	0.70
3	601728	中国电信	82,500	464,475.00	0.65
4	300750	宁德时代	1,600	366,064.00	0.51
5	600837	海通证券	38,800	357,736.00	0.50
6	600863	内蒙华电	74,700	310,005.00	0.43
7	688631	莱斯信息	8,241	268,326.96	0.37
8	002409	雅克科技	3,500	255,080.00	0.35
9	600732	爱旭股份	8,000	246,000.00	0.34
10	601288	农业银行	67,400	237,922.00	0.33
11	002371	北方华创	700	222,355.00	0.31
12	603496	恒为科技	11,400	214,092.00	0.30
13	002327	富安娜	21,200	178,504.00	0.25
14	688387	信科移动-U	19,862	165,847.70	0.23
15	601628	中国人寿	4,300	150,328.00	0.21
16	601857	中国石油	16,800	125,496.00	0.17
17	600028	中国石化	19,600	124,656.00	0.17
18	002293	罗莱生活	9,100	104,650.00	0.15
19	600011	华能国际	8,200	75,932.00	0.11
20	000928	中钢国际	7,700	74,305.00	0.10
21	600511	国药股份	1,800	69,930.00	0.10
22	600547	山东黄金	2,800	65,744.00	0.09
23	600489	中金黄金	5,300	54,749.00	0.08
24	601126	四方股份	2,700	41,013.00	0.06
25	600422	昆药集团	300	6,216.00	0.01
26	600129	太极集团	100	5,949.00	0.01
27	600085	同仁堂	100	5,756.00	0.01

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	601328	交通银行	642,614.00	1.17
2	603259	药明康德	612,190.00	1.11
3	601658	邮储银行	566,120.00	1.03
4	601728	中国电信	502,254.00	0.91
5	601628	中国人寿	458,190.00	0.83
6	600028	中国石化	444,305.00	0.81
7	300750	宁德时代	362,657.00	0.66
8	000786	北新建材	360,143.00	0.65
9	301236	软通动力	358,145.00	0.65
10	600837	海通证券	357,348.00	0.65
11	002409	雅克科技	351,927.00	0.64
12	600732	爱旭股份	318,231.00	0.58
13	600863	内蒙华电	314,273.00	0.57
14	688631	莱斯信息	284,607.09	0.52
15	600859	王府井	254,948.58	0.46
16	601288	农业银行	237,358.00	0.43
17	600511	国药股份	234,571.00	0.43
18	002567	唐人神	224,669.00	0.41
19	300068	南都电源	215,260.00	0.39
20	603496	恒为科技	209,974.00	0.38

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	603259	药明康德	570,800.00	1.04
2	000786	北新建材	369,423.00	0.67
3	301236	软通动力	340,122.00	0.62
4	600028	中国石化	303,603.00	0.55
5	601628	中国人寿	283,389.46	0.51
6	600859	王府井	232,761.00	0.42
7	002567	唐人神	210,844.00	0.38
8	300068	南都电源	204,574.00	0.37
9	000063	中兴通讯	161,546.00	0.29
10	600511	国药股份	160,688.00	0.29
11	300251	光线传媒	151,912.00	0.28
12	002460	赣锋锂业	145,320.00	0.26
13	601988	中国银行	145,200.00	0.26
14	601788	光大证券	144,674.00	0.26
15	600129	太极集团	143,664.00	0.26
16	601611	中国核建	141,384.00	0.26
17	002185	华天科技	136,041.00	0.25
18	000938	紫光股份	132,090.00	0.24

19	002518	科士达	128,100.00	0.23
20	688472	阿特斯	118,096.80	0.21

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	11,883,931.25
卖出股票收入（成交）总额	6,276,008.16

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

注：无。

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

注：无。

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

在严格控制风险的前提下，通过科学的大类资产配置，优选基金力争实现基金资产的稳健增值；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%，其中投资于股票型基金的比例不高于基金资产净值的 30%；本基金投资于港股通标的股票占基金股票资产的 0-50%；基金保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例不低

于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金，存出保证金，应收申购款等。如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整；本基金为混合型基金中基金(FOF)，其预期风险水平高于债券型基金、债券型基金中基金、货币市场基金和货币型基金中基金，但低于股票型基金、股票型基金中基金。本基金将投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

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	512800	华宝中证银行 ETF	交易型开放式 (ETF)	4,338,900.00	4,659,978.60	6.48	否
2	008246	圆信永丰致优混合 C	契约型开放式	1,692,468.24	3,317,237.75	4.61	否
3	050011	博时信用债券 A/B	契约型开放式	1,068,037.35	3,190,227.56	4.44	否
4	011066	大成高新技术产业股票 C	契约型开放式	791,778.68	2,977,087.84	4.14	否
5	166301	华商新趋势优选混合	上市契约型开放式 (LOF)	280,160.81	2,701,310.53	3.76	否
6	016313	富国研究精选灵活配置混合 C	契约型开放式	1,001,574.44	2,529,977.04	3.52	否
7	002943	广发多因子混合	契约型开	748,319.90	2,523,484.37	3.51	否

			放式				
8	450009	国富中小盘股票	契约型开放式	961,925.93	2,406,546.29	3.35	否
9	000480	东方红新动力混合	契约型开放式	579,427.18	2,386,660.55	3.32	否
10	360014	光大保德信信用添益债券 C	契约型开放式	2,151,995.47	2,263,899.23	3.15	否
11	012778	中欧养老混合 C	契约型开放式	650,260.45	2,071,144.56	2.88	否
12	014109	融通内需驱动混合 C	契约型开放式	760,366.72	2,067,437.11	2.87	否
13	011125	富国文体健康股票 C	契约型开放式	802,590.82	1,828,301.89	2.54	否
14	014597	华泰柏瑞富利混合 C	契约型开放式	923,596.10	1,808,770.60	2.52	否
15	512880	国泰中证全指证券公司 ETF	交易型开放式 (ETF)	1,918,000.00	1,685,922.00	2.34	否
16	210002	金鹰红利价值混合	契约型开放式	668,690.68	1,676,340.67	2.33	否
17	013500	南方金融主题灵活配置混合 C	契约型开放式	1,130,167.96	1,602,578.17	2.23	否
18	519133	海富通改革驱动混合	契约型开放式	669,655.01	1,462,593.51	2.03	否

19	519772	交银新 活力灵活 配置混合	契约 型开 放式	610,525.27	1,357,808.20	1.89	否
20	008270	大成睿 享混合 C	契约 型开 放式	925,711.34	1,309,974.12	1.82	否
21	013620	华安媒 体互联 混合 C	契约 型开 放式	381,232.23	1,212,318.49	1.69	否
22	588000	华夏上 证科创 板 50 成份 ETF	交易 型开 放式 (ETF)	1,143,300.00	1,202,751.60	1.67	否
23	000893	工银创 新动力 股票	契约 型开 放式	991,847.18	1,060,284.64	1.47	否
24	016069	华商研 究精选 混合 C	契约 型开 放式	324,991.88	991,225.23	1.38	否
25	512400	南方中 证申万 有色金 属 ETF	交易 型开 放式 (ETF)	931,700.00	963,377.80	1.34	否
26	014039	交银启 诚混合 C	契约 型开 放式	857,042.26	956,801.98	1.33	否
27	003166	鹏华弘 嘉混合 C	契约 型开 放式	376,386.24	906,149.87	1.26	是
28	110023	易方达 医疗保 健行业 混合	契约 型开 放式	224,334.66	744,342.40	1.04	否
29	016620	万家颐 和混合 C	契约 型开 放式	407,619.71	683,129.87	0.95	否
30	015690	富国中 小	契约	216,083.01	630,962.39	0.88	否

		盘精选混合 C	型开放式				
31	006038	大成景恒混合 C	契约型开放式	257,317.12	602,379.38	0.84	否
32	015386	中银主题策略混合 C	契约型开放式	133,070.30	582,182.56	0.81	否
33	007574	宝盈新价值混合 C	契约型开放式	212,468.83	577,702.75	0.80	否
34	159819	易方达中证人工智能主题 ETF	交易型开放式 (ETF)	591,800.00	537,354.40	0.75	否
35	008187	淳厚信睿混合 C	契约型开放式	261,261.58	497,520.43	0.69	否
36	512480	国联安中证全指半导体 ETF	交易型开放式 (ETF)	537,800.00	480,793.20	0.67	否
37	017167	景顺长城策略精选灵活配置混合 C	契约型开放式	159,208.93	468,711.09	0.65	否
38	017090	景顺长城能源基建混合 C	契约型开放式	207,367.53	441,900.21	0.61	否
39	001438	易方达瑞享混合 E	契约型开放式	156,393.78	413,192.37	0.57	否
40	159949	华安创业板 50ETF	交易型开放式 (ETF)	423,400.00	396,725.80	0.55	否

41	519197	万家颐达 灵活配置 混合	契约 型开 放式	316,259.99	364,964.03	0.51	否
42	159995	华夏国证 半导体芯 片 ETF	交易 型开 放式 (ETF)	344,200.00	361,754.20	0.50	否
43	014863	建信信息 产业股票 C	契约 型开 放式	136,546.92	361,712.79	0.50	否
44	260112	景顺长城 能源基建 混合	契约 型开 放式	131,497.42	281,141.48	0.39	否
45	510230	金融 ETF	交易 型开 放式 (ETF)	283,800.00	276,705.00	0.38	否
46	513180	华夏恒生 科技 ETF(QDII)	交易 型开 放式 (ETF)	396,000.00	211,860.00	0.29	否
47	015773	招商移动 互联网产 业股票 C	契约 型开 放式	137,185.95	202,088.62	0.28	否
48	015001	工银物流 产业股票 C	契约 型开 放式	16,276.16	56,136.48	0.08	否
49	511990	华宝添益 货币 A	交易 型开 放式 (ETF)	18.00	1,800.00	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

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

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

以上证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

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	31,196.42
2	应收清算款	477,154.67
3	应收股利	178.45
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	104.38
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	508,633.92

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 (%)
207	344,318.38	70,276,161.45	98.60	997,743.73	1.40

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	575,624.49	0.8076

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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

注：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及本基金的基金经理投资、持有本基金符合相关法律法规、中国证监会规定及相关管理制度的规定。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2020年7月21日）基金份额总额	381,756,163.42
本报告期期初基金份额总额	54,043,490.35
本报告期基金总申购份额	24,505,068.55
减：本报告期基金总赎回份额	7,274,653.72
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	71,273,905.18

§ 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：

无。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

本报告期内，本基金托管人 2023 年 2 月 23 日发布公告，胡捷先生自 2023 年 2 月 23 日起不再担任华夏银行股份有限公司资产托管部副总经理。

本报告期内，本基金托管人 2023 年 4 月 7 日发布公告，朱绍刚先生自 2023 年 4 月 4 日起担任华夏银行股份有限公司资产托管部副总经理。

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

本基金本报告期投资策略未改变。

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

华商瑞丰短债债券型证券投资基金基金经理变更，离任基金经理胡中原，新任基金经理杜磊。海富通中证短融交易型开放式指数证券投资基金增聘基金经理陶斐然。国泰纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金离任基金经理徐成城，新任基金经理艾小军。国泰中证煤炭交易型开放式指数证券投资基金离任基金经理徐成城，新任基金经理吴中昊。

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

10.7.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：无。

10.7.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	18,159,939.41	100.00	14,914.46	100.00	-

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。

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	-	-	-	-	-	-	54,793,493.41	100.00

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澄清公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 01 月 04 日
2	关于调整旗下部分基金参与中国工商银行股份有限公司申购、定期定额申购费率优惠活动时间公告	《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	2023 年 01 月 05 日
3	鹏华聚合多资产 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）2022 年第 4 季度报告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 01 月 20 日
4	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与东方财富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	2023 年 03 月 14 日
5	鹏华聚合多资产 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）2022 年年度报告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 03 月 30 日
6	鹏华基金管理有限公司关于新增人民	《上海证券报》、基金管	2023 年 04 月 07 日

	币直销资金专户的公告	理人网站及中国证监会 基金电子披露网站	
7	鹏华聚合多资产 3 个月持有期混合型 基金中基金（FOF）2023 年第 1 季度 报告	《上海证券报》、基金管 理人网站及中国证监会 基金电子披露网站	2023 年 04 月 21 日
8	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金 持有的股票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	2023 年 05 月 19 日
9	鹏华基金管理有限公司关于注意防范 以协助办理贷款为借口进行诈骗活动 的风险提示	《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	2023 年 06 月 03 日
10	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分 基金参与国海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	2023 年 06 月 05 日
11	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金 持有的股票停牌后估值方法变更的提 示性公告	《上海证券报》、基金管 理人网站及中国证监会 基金电子披露网站	2023 年 06 月 06 日
12	鹏华聚合多资产 3 个月持有期混合型 基金中基金（FOF）更新的招募说明书	《上海证券报》、基金管 理人网站及中国证监会 基金电子披露网站	2023 年 06 月 09 日
13	鹏华聚合多资产 3 个月持有期混合型 基金中基金（FOF）基金产品资料概要 （更新）	《上海证券报》、基金管 理人网站及中国证监会 基金电子披露网站	2023 年 06 月 09 日
14	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分 基金参与北京中植基金销售有限公司 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	2023 年 06 月 20 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

投资者 类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额 比例达到或者 超过 20%的时 间区间	期初 份额	申购 份额	赎回 份额	持有份额	份额 占比 (%)
机构	1	20230101~202 30630	29,287,31 8.17	0.00	0.00	29,287,318.17	41.09
	2	20230406~202 30630	0.00	39,098,3 70.58	0.00	39,098,370.58	54.86
产品特有风险							

基金份额持有人持有的基金份额所占比例过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引起基金净值剧烈波动，甚至可能引发基金流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。

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

2、赎回份额包含基金赎回份额、基金转换出份额、强制调减份额、场内卖出份额。

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）《鹏华聚合多资产 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》；
- （二）《鹏华聚合多资产 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）托管协议》；
- （三）《鹏华聚合多资产 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）2023 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

2023 年 8 月 30 日