

鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式  
证券投资基金  
2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：2023 年 3 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 03 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

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

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 2022 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	7
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	9
3.4 过去三年基金的利润分配情况	10
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	17
4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	17
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	17
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>18</b>
6.1 审计报告基本信息	18
6.2 审计报告的基本内容	18
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>19</b>
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	21
7.3 净资产（基金净值）变动表	22
7.4 报表附注	25

<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>62</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	62
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	62
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	63
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	68
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	69
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	70
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	70
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	70
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	70
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	70
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	70
8.12 投资组合报告附注 .....	70
<b>§ 9 基金份额持有人信息</b> .....	<b>71</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	71
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	72
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	73
9.4 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 .....	73
9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 .....	73
9.6 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	73
<b>§ 10 重大事件揭示</b> .....	<b>74</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	74
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 .....	74
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	74
10.4 基金投资策略的改变 .....	74
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	74
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	75
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	75
10.8 其他重大事件 .....	76
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>81</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 .....	81
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	81
<b>§ 12 备查文件目录</b> .....	<b>81</b>
12.1 备查文件目录 .....	81
12.2 存放地点 .....	81
12.3 查阅方式 .....	81

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金
基金简称	鹏华前海万科 REITs
场内简称	鹏华前海 REIT
基金主代码	184801
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	2015 年 7 月 6 日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	29,995,915.35 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2015 年 9 月 30 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过投资于目标公司股权参与前海金融创新，力争分享金融创新的红利。
投资策略	<p>基金合同生效后，本基金根据与目标公司及其股东所签订的增资协议等相关协议约定的程序和时间，通过增资方式持有目标公司股权至 2023 年 7 月 24 日，获取自 2015 年 1 月 1 日起至 2023 年 7 月 24 日期间前海企业公馆项目 100% 的实际或应当取得的除物业管理费收入之外的营业收入，营业收入依据相关协议约定的业绩补偿机制和激励机制进行调整。前述目标公司的概况、增资入股情况、退出安排、交易结构、业绩补偿机制和激励措施等详见招募说明书。本基金投资目标公司之外的基金资产可投资于依法发行或上市的股票（含存托凭证）、债券和货币市场工具等。</p> <p>1、对于目标公司的投资策略 本基金将审慎论证宏观经济因素（就业、利率、人口结构等）、商业地产周期（供需结构、租金和资产价格波动等）、以及其他可比投资资产项目的风险和预期收益率来判断目标公司持有商业物业当前的投资价值以及未来的发展空间。在此基础上，基金将深入调研目标公司所持商业物业的基本面（包括位置、质量、资产价格、出租率、租金价格、租户、租约、现金流等）和运营基本面（包括定位、经营策略、租赁能力、物业管理能力等），通过合适的估值方法评估其收益状况和增值潜力、预测现金流收入的规模和建立合适的估值模型。本基金将根据投资需要参与所投资项目商业运营并代表持有人行使股东权利，并与目标公司服务机构签订相应的股权回购协议以及建立运营绩效保证机制，力争获取稳定的租金收益，具体交易结构详见招募说明书。</p> <p>2、固定收益资产投资策略 本基金投资目标公司前的基金资产以及投资目标公司后的剩余资产、本基金获得的分红款、本基金对目标公司股权的退出款在按照本《基金合同》约定进行分配或支付前，可全部投资于依法发行或</p>

	<p>上市的债券和货币市场工具等固定收益类资产。本基金将采用持有到期策略构建投资组合，以获取相对确定的目标收益。首先对存款利率、回购利率和债券收益率进行比较，并在对封闭运作期内资金面进行判断的基础上，判断是否存在利差套利空间，以确定是否进行杠杆操作；其次对各类固定收益资产在封闭运作期内的持有期收益进行比较，确定优先配置的资产类别，并结合各类固定收益资产的市场容量，确定配置比例。本基金将对整体固定收益组合久期做严格管理和匹配，完全配合基金合同期限内的允许范围。投资决策委员会将定期或不定期召开会议，确定本基金固定收益资产各类属的配置比例、组合的杠杆水平等目标区间。本公司信用评估团队依托基金管理人信用分析系统评估债务人的相对违约率并确定个券的信用评级，为本基金的组合构建和调整提供标的建议。本基金将依据投资决策委员会决议和信用分析团队的建议制定具体的配置和调整计划，进行固定收益投资组合的构建和日常管理。</p> <p>3、权益类资产投资策略 在严格控制风险、保持资产流动性的前提下，本基金将根据发行人的基本面情况，并结合对市场流动性、上市后表现的预期，适当参与股票等权益类投资，以增加基金收益。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>
业绩比较基准	十年期国债收益率+1.5%
风险收益特征	本基金在封闭运作期内投资于目标公司股权，以获取商业物业租金收益为目标，因此与股票型基金和债券型基金有不同的风险收益特征，本基金预期风险和收益高于债券型基金和货币型基金，低于股票型基金。

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	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	高永杰
	联系电话	0755-81395402
	电子邮箱	xxpl@phfund.com.cn
客户服务电话	4006788999	95528
传真	0755-82021126	021-63602540
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	上海市中山东一路 12 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	上海市北京东路 689 号
邮政编码	518048	200001
法定代表人	何如	郑杨

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.phfund.com.cn">http://www.phfund.com.cn</a>

基金年度报告备置地点	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层鹏华基金管理有限公司
------------	--

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号
房地产评估机构	深圳市戴德梁行土地房地产评估有限公司	广东省深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场 2 座 5 楼

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2022 年	2021 年	2020 年
本期已实现收益	69,685,012.32	191,079,855.20	236,133,121.32
本期利润	-6,847,862.39	213,178,147.67	196,827,185.24
加权平均基金份额本期利润	-0.2283	7.1069	6.5618
本期加权平均净值利润率	-0.22%	6.73%	6.18%
本期基金份额净值增长率	-0.25%	6.92%	6.37%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
期末可供分配利润	43,991,468.18	217,327,064.75	262,477,040.30
期末可供分配基金份额利润	1.4666	7.2452	8.7504
期末基金资产净值	3,043,583,025.90	3,246,025,254.06	3,269,076,937.14
期末基金份额净值	101.467	108.216	108.984
3.1.3 累计期末指	2022 年末	2021 年末	2020 年末

标			
基金份额 累计净值 增长率	46.78%	47.14%	37.61%

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，封闭式基金交易佣金等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(3) 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润期末余额和未分配利润中已实现部分的期末余额的孰低数。表中的“期末”均指报告期最后一日，即12月31日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

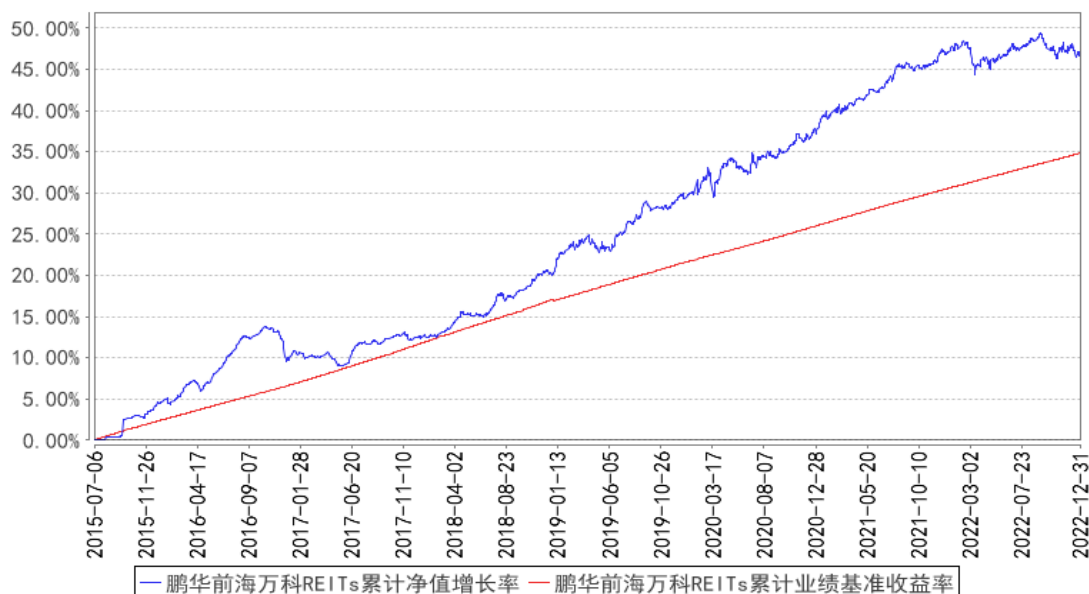
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.62%	0.20%	1.08%	0.02%	-1.70%	0.18%
过去六个月	-0.66%	0.16%	2.14%	0.01%	-2.80%	0.15%
过去一年	-0.25%	0.17%	4.27%	0.01%	-4.52%	0.16%
过去三年	13.46%	0.18%	13.25%	0.01%	0.21%	0.17%
过去五年	30.49%	0.16%	23.06%	0.01%	7.43%	0.15%
自基金合同生效起至今	46.78%	0.15%	34.82%	0.01%	11.96%	0.14%

注：业绩比较基准=十年期国债收益率+1.5%



### 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

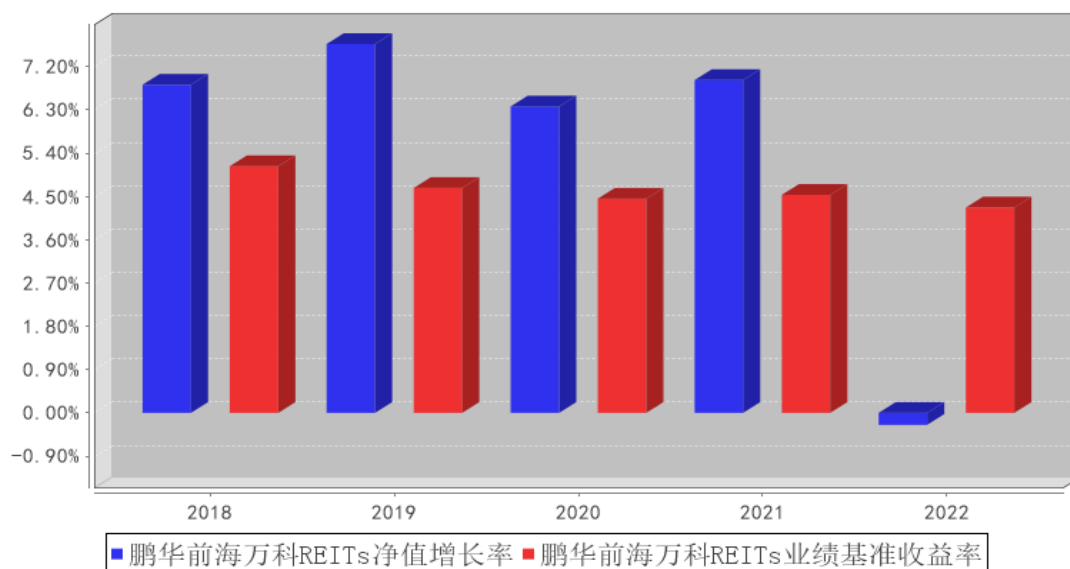
鹏华前海万科REITs累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2015 年 07 月 06 日生效。2、截至建仓期结束，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

鹏华前海万科REITs基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按照实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 其他指标

注：无。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2022 年	65.2070	195,594,365.77	-	195,594,365.77	-
2021 年	78.7540	236,229,830.75	-	236,229,830.75	-
2020 年	79.1200	237,327,683.49	-	237,327,683.49	-
合计	223.0810	669,151,880.01	-	669,151,880.01	-

## § 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 11137.97 亿元，284 只公募基金、13 只全国社保投资组合、6 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		
尤柏年	基金经理	2015-07-06	2022-11-25	18 年	尤柏年先生，国籍中国，经济学博士，18 年证券从业经验。历任澳大利亚 BConnect 公司 Apex 投资咨询团队分析师，华宝兴业基金管理有限公司金融工程部高级数量分析师、海外投资管理部高级分析师、基金经理助理、华宝兴业成熟市场基金和华宝兴业标普油气基金基金经理等职；2014 年 7 月加盟鹏华基金管理有限公司，现担任国际业务部基金经理。2014 年 08 月至 2022 年 07 月担任鹏华全球高收益债债券型证券投资基金基金经理，2014 年 09 月至 2020 年 01 月担任鹏华环球发现证券投资基金基金经理，2015 年 07 月至 2022 年 11 月担任鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金基金经理，2016 年 12 月至 2022 年 03 月担任鹏华沪深港新兴成长灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017 年 11 月至 2022 年 09 月担任鹏华

				香港美国互联网股票型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2017 年 11 月至 2019 年 08 月担任鹏华港股通中证香港银行投资指数证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2017 年 11 月至 2021 年 10 月担任鹏华港股通中证香港中小企业投资主题指数证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2020 年 01 月至 2022 年 07 月担任鹏华全球中短债债券型证券投资基金 (QDII) 基金经理, 2021 年 05 月至 2021 年 09 月担任鹏华红利优选混合型证券投资基金基金经理, 尤柏年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, 尤柏年不再担任本基金基金经理。	
刘方正	基金经理	2015-08-06	-	12 年	刘方正先生, 国籍中国, 理学硕士, 12 年证券从业经验。2010 年 6 月加盟鹏华基金管理有限公司, 从事债券研究工作, 历任固定收益部高级研究员、基金经理助理, 现任稳定收益投资部副总经理/基金经理。2015 年 03 月至 2017 年 01 月担任鹏华弘利灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2015 年 03 月至 2015 年 08 月担任鹏华行业成长证券投资基金基金经理, 2015 年 04 月至 2017 年 01 月担任鹏华弘润灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2015 年 05 月至今担任鹏华弘华灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2015 年 05 月至 2017 年 01 月担任鹏华弘益灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2015 年 05 月至今担任鹏华弘和灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2015 年 06 月至 2017 年 01 月担任鹏华弘鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2015 年 08 月至今担任鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金基金经理, 2015 年 08 月至 2017 年 01 月担任鹏华弘泰灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2016 年 03 月至 2018 年 05 月担任鹏华弘锐灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2016 年 03 月至 2017 年 05 月担任鹏华弘实灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2016 年 03 月至 2022 年 12 月担任鹏华弘信灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2016 年 08 月至今担任鹏华弘达灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2016 年 08 月至 2017 年 12 月担任鹏华弘嘉灵活配置混合型证券投资基金基金经

					理, 2016 年 09 月至 2022 年 08 月担任鹏华弘惠灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2016 年 11 月至 2018 年 01 月担任鹏华兴裕定期开放灵活配置混合型基金基金经理, 2016 年 11 月至今担任鹏华兴泰定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2016 年 12 月至今担任鹏华兴悦定期开放灵活配置混合型基金基金经理, 2017 年 09 月至 2018 年 08 月担任鹏华兴益定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2018 年 05 月至今担任鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 刘方正先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理发生变动, 尤柏年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。

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

本报告期内, 本基金运作合规, 不存在违反基金合同和损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》, 公司制定了《鹏华基金管理有限公司公平交易管理规定》, 将公司所管理的封闭式基金、开放式基金、社保组合、养老组合、特定客户资产管理组合等不同资产组合的授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动均纳入公平交易管理, 在业务流程和岗位职责中制定公平交易的控制规则和控制活动, 建立对公平交易的执行、监督及审核流程, 严禁在不同投资组合之间进行利益输送。

在投资研究环节: 1、公司使用唯一的研究报告发布平台“研究报告管理平台”, 确保各投资

组合在获得投资信息、研究支持、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；2、公司严格按照《股票库管理规定》、《信用债券投资与风险控制管理规定》，执行股票及信用产品出入库及日常维护工作，确保相关证券入库以内容严谨、观点明确的研究报告作为依据；3、在公司股票库基础上，各涉及股票投资的资产组合根据各自的投资目标、投资风格、投资范围和防范关联交易的原则分别建立资产组合股票库，基金经理在股票库基础上根据投资授权以及基金合同择股方式构建具体的投资组合；4、严格执行投资授权制度，明确投资决策委员会、分管投资副总裁、基金经理等各主体的职责和权限划分，合理确定基金经理的投资权限，超过投资权限的操作，应严格履行审批程序。

在交易执行环节：1、所有公司管理的资产组合的交易必须通过集中交易室完成，集中交易室负责建立和执行交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会；2、针对交易所公开竞价交易，集中交易室应严格启用恒生交易系统内的公平交易程序，交易系统则自动启用公平交易功能，由系统按照“未委托数量”的比例对不同资产组合进行委托量的公平分配；如果相关基金经理坚持以不同的价格进行交易，且当前市场价格不能同时满足多个资产组合的指令价格要求时，交易系统自动按照“价格优先”原则进行委托；当市场价格同时满足多个资产组合的指令价格要求时，则交易系统自动按照“同一指令价格下的公平交易”模式，进行公平委托和交易量分配；3、银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易需依据公司《股票投资交易流程》和《固定收益投资管理流程》的规定执行；银行间市场交易、交易所大宗交易等以公司名义进行的交易，各投资组合经理应在交易前独立确定各投资组合的交易价格和数量，公司按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；4、新股、新债申购及非公开定向增发交易需依据公司《新股申购流程》、《固定收益投资管理流程》和《非公开定向增发流程》的规定执行，对新股和新债申购方案和分配过程进行审核和监控。

在交易监控、分析与评估环节：1、为加强对日常投资交易行为的监控和管理，杜绝利益输送、不公平交易等违规交易行为，防范日常交易风险，公司明确了关注类交易的界定及对应的监控和评估措施机制；所监控的交易包括但不限于：交易所公开竞价交易中同日同向交易的交易时机和交易价差、不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差、关联交易、债券交易收益率偏离度、成交量和成交价格异常、银行间债券交易对手交易等；2、将公平交易作为投资组合业绩归因分析和交易绩效评价的重要关注内容，发现的异常情况由投资监察员进行分析；3、风控管理部分别于每季度和每年度编写《公平交易执行情况检查报告》，内容包括关注类交易监控执行情况、不同投资组合的整体收益率差异分析和同向交易价差分析。

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

#### 4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金持有的项目公司物业万科前海企业公馆在 2022 年完成总收入 19,365 万元。其中公馆租赁收入占总收入的 98%，会议中心等其他收入合计占 2%。

2022 年，新冠疫情对人类生活产生的影响在逐步缓慢的退散，奥密克戎及其子毒株的流行对人类健康的影响逐步有所下降，各个经济体分别在不同的时间阶段采取了与病毒共存的政策，这些政策与自然经济规律运行周期一起在宏观经济上产生影响，全社会的总供给和总需求均随之发生显著变化。从国内经济来看，病毒传播力越强管制成本越高，上半年强力管控和年底逐步调整政策过程中，居民的生活行为上都发生了巨大的阶段性冲击，长期的疫情扰动使得服务业等非常依赖于人员互动的需求持续萎缩，政府在扩大自身需求也已经做出了巨大努力，基建等方面的投资起到了支撑性的作用，但也较难对冲房地产和居民生活端的投资生产活动的回落，内需总体震荡下行趋势。社融整体需求偏弱，居民端和企业端的主动融资需求不足，投资收益率的回落带来存款的大幅上行和提前偿还贷款的信用收缩，年底社会的融资需求也随着疫情严厉管控措施的结束有触底企稳的迹象。总体来看，外需高位回落，内需基建和制造业有所支撑，房地产和消费均有持续的压力，年底多重矛盾环节，压制投资消费等因素有所恢复。物价方面，生活端物价伴随需求不足进一步回落，工业品价格震荡回落。

权益市场年初即颓势回落，年中有所反弹，但三季度至四季度初继续萎靡，临近年底有触底企稳走势。结构方面，主流新能源成长方向大幅震荡，总需求相关的价值类标的持续回落，估值接近历史极值区域，上游周期震荡，受俄乌纠纷影响，传统能源类资产大幅领先。债券市场，整体流动性维持宽松，社会主动融资需求不足导致资金在金融系统内堆积，各类债券收益率都在历

史极低水平附近，四季度中后期，随着疫情管控政策放开及经济自身修复趋势逐步显现，债券市场有一轮调整，经济增长预期的转变逐步影响整条收益率曲线以及期限利差、信用利差和条款带来的各种利差。

本基金以追求稳定收益为主要投资策略，控制基金净值回撤幅度。在操作上，保持稳健的中短久期债券资产配置，以固定收益类资产为主要方向，在严格控制整体仓位的前提下，少量参与股票二级市场投资，同时，积极参与新股、可转债、可交换债的网下申购获取增强收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期鹏华前海万科 REITs 份额净值增长率为-0.25%，同期业绩比较基准增长率为 4.27%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，新冠疫情对国内的影响也逐步减弱，逐步进入全民免疫状况，较为严格的管控措施均在解除，供需的影响因素更多回归于经济自身运行规律。未来一段时间，外需压力仍在延续，对国内出口影响仍在持续增加，内需具备企稳和反转的多重因素支撑，服务业和消费相关产业有修复动力，房地产支持政策逐步落地也会在同比的情况下起到支撑作用，同时政府主导的基建和制造业的投资仍将持续支撑总体投资的基础。在信用扩张的初期，主动投资和实体需求缓慢恢复，流动性会保持相对宽松，实体的各个领域较难出现泡沫化的状态，不足以引来央行收紧流动性的危机，因此，未来一段时间将大概率处于投资、消费上的温和舒适阶段，居民、企业、政府都处于积极投资的状态。

目前情况下，流动性仍将在一定时间内维持相对宽松，总需求触底企稳，但从企业报表的修复和盈利趋势的形成仍需有所等待，社融企稳回升后一至两个季度才能逐步有所体现，现在仍处于信用扩张的初期，二季度至三季度才会逐步形成盈利向上的预期共振。考虑到目前的估值水平，我们对权益资产由中性偏空的方向转向中性偏多的趋势，随着时间进行，盈利趋势逐步形成的过程，我们对权益的观点会更加积极。债券方面，经济向上修复的过程中整体不利于债券市场，但信用扩张初期，政策引导的流动性收紧动力不足，中短久期资产本一轮的调整已经相对充分，整体将以震荡趋势为主，中长久期资产将对未来经济向上动力的强弱有一定分歧，有进一步调整的风险。

未来我们仍将坚持稳健的投资策略，保持稳健的固定收益类资产配置，保持中等仓位、短久期的债券资产，严控仓位情况下适当参与股票市场，并通过参与新股、可转债、可交换债网下申购等投资，追求稳定的投资收益。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人继续完善内部控制、提升风险管理水平，着重开展了以下各项工作：

##### 1、继续完善内部控制体系

公司根据法律法规、监管要求及业务发展需求，不断优化现有的标准化业务流程体系，强调业务流程服务于加强风险防范和提升运营效率，通过信息技术手段持续提升业务操作的系统化程度，并不断优化。

##### 2、规范基金销售业务，保证基金销售业务的合法合规性

报告期内，在基金募集和持续营销活动中，公司严格规范基金销售业务，按照《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及相关法规规定审查宣传推介材料，逐步落实反洗钱法律法规各项要求，并督促销售部门做好投资者教育工作。

##### 3、开展以风险为导向的内部稽核

报告期内，监察稽核部开展了对信息技术管理、投资相关流程、员工行为、反洗钱业务、子公司管理和公司日常运作的定期监察稽核与专项监察稽核。监察稽核人员开展了以风险为导向的内部稽核，通过稽核发现提高了公司标准化操作流程手册的执行效力，优化了标准化操作流程手册。报告期内，公司未发生重大风险事件。

此外，在投资日常合规监控工作方面，公司根据法律法规和产品特点进一步完善了投资合规风控制度流程及投资监控系统，加强对投资限制的监控提示；持续完善公平交易、异常交易等监测管控机制，在实现交易价差分析、银行间交易分析、研究报告检查等专项检查工作定期化、日常化的基础上，公司多次开展有关内幕交易、未公开信息等重要内容的合规培训，进一步强化全体投研人员的合规意识。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术。

本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本基金管理人设有估值委员会，由登记结算部、监察稽核部、各投资部门、研究部门负责人、基金经理等成员组成，估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规和基金估值运作等方面的专业能力。基金经理可与估值委员会成员共同商定估值原则和政策，但不参与日常估值的执行。



基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值发生重大变化的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

本基金管理人已与第三方定价服务机构签署服务协议，由其按约定提供相关参考数据。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1、截止本报告期末，本基金期末可供分配利润为 43,991,468.18 元，期末基金份额净值 101.467 元。

2、本基金于 2022 年 01 月 14 日进行利润分配，分配金额为 195,594,365.77 元。

3、本基金于 2023 年 01 月 11 日进行利润分配，分配金额为 39,594,609.55 元。

#### 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

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

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金的托管过程中，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、托管协议的规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人依照《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、托管协议的规定，对鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告期内，由鹏华基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2023)第 23538 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金(以下简称“鹏华前海万科 REITs 基金”)的财务报表,包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表,2022 年度的利润表和净资产(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了鹏华前海万科 REITs 基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于鹏华前海万科 REITs 基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	无。
其他事项	无。
其他信息	无。
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>鹏华前海万科 REITs 基金的基金管理人鹏华基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估鹏华前海万科 REITs 基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算鹏华前海万科 REITs 基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督鹏华前海万科 REITs 基金的</p>

	财务报告过程。	
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对导致对鹏华前海万科 REITs 基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致鹏华前海万科 REITs 基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	单峰	胡莲莲
会计师事务所的地址	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼	
审计报告日期	2023 年 3 月 27 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	16,912,386.88	45,450,235.45
结算备付金		89,942,525.16	72,272,758.17
存出保证金		189,060.09	115,781.27
交易性金融资产	7.4.7.2	4,601,253,125.90	4,099,108,404.80
其中：股票投资		495,214,161.24	295,296,604.80
基金投资		-	-
债券投资		3,937,808,964.66	3,803,811,800.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		168,230,000.00	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		9,067,289.85	3,508,346.73
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	432,879,335.20
资产总计		4,717,364,387.88	4,653,334,861.62
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		1,670,161,847.16	1,376,300,000.00
应付清算款		106,034.10	27,242,251.24
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,685,705.73	1,789,312.67
应付托管费		259,339.38	275,278.85
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		518,678.71	-
应交税费		407,740.83	428,965.72
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	642,016.07	1,273,799.08
负债合计		1,673,781,361.98	1,407,309,607.56
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.10	2,999,591,557.72	2,999,591,557.72
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	43,991,468.18	246,433,696.34
净资产合计		3,043,583,025.90	3,246,025,254.06
负债和净资产总计		4,717,364,387.88	4,653,334,861.62

注：报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额净值 101.467 元，基金份额总额 29,995,915.35 份。

## 7.2 利润表

会计主体：鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		51,866,776.74	289,927,959.53
1. 利息收入		1,358,076.77	161,803,357.06
其中：存款利息收入	7.4.7.13	1,358,076.77	2,016,802.69
债券利息收入		-	159,786,554.37
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）		127,041,574.68	66,909,903.80
其中：股票投资收益	7.4.7.14.2	-19,164,192.32	36,495,538.47
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	144,974,819.58	23,877,232.20
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	8,071,397.33	6,537,133.13
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		-6,840,449.91	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.20	-76,532,874.71	22,098,292.47
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	-	39,116,406.20
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>58,714,639.13</b>	<b>76,749,811.86</b>
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	19,901,327.58	20,587,406.33
2. 托管费	7.4.10.2.2	3,061,742.77	3,167,293.20
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		6,123,485.36	-
5. 利息支出		28,563,254.74	43,503,931.83
其中：卖出回购金融资产支出		28,563,254.74	43,503,931.83
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		488,895.69	569,491.14
8. 其他费用	7.4.7.23	575,932.99	8,921,689.36
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-6,847,862.39</b>	<b>213,178,147.67</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-6,847,862.39</b>	<b>213,178,147.67</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-6,847,862.39</b>	<b>213,178,147.67</b>

### 7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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）	2,999,591,557.72	-	246,433,696.34	3,246,025,254.06
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 )	2,999,591,557.72	-	246,433,696.34	3,246,025,254.06
三、本 期 增 减 变 动 额 ( 减 少 以 “- ” 号 填 列 )	-	-	-202,442,228.16	-202,442,228.16
(一)、 综 合 收 益 总 额	-	-	-6,847,862.39	-6,847,862.39
(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 )	-	-	-	-
其中：1. 基 金 申 购 款	-	-	-	-
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 )	-	-	-195,594,365.77	-195,594,365.77
(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)	2,999,591,557.72	-	43,991,468.18	3,043,583,025.90
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31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)	2,999,591,557.72	-	269,485,379.42	3,269,076,937.14
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)	2,999,591,557.72	-	269,485,379.42	3,269,076,937.14
三、本期 增减变 动额(减 少以“-” 号填列)	-	-	-23,051,683.08	-23,051,683.08
(一)、 综合收 益总额	-	-	213,178,147.67	213,178,147.67
(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)	-	-	-	-



其中:1. 基金申购款	-	-	-	-
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)	-	-	-236,229,830.75	-236,229,830.75
(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)	2,999,591,557.72	-	246,433,696.34	3,246,025,254.06

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

邓召明

邢彪

郝文高

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]1116号《关于准予鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金注册的批复》核准,由鹏华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金基金合同》

负责公开募集。本基金为契约型基金，在基金合同生效后十年内(含十年)封闭运作，在深圳证券交易所(以下简称“深交所”)上市交易，封闭期结束后转为上市开放式基金(LOF)，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 2,998,986,947.73 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(2015)第 878 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2015 年 7 月 6 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,999,591,557.72 份基金份额，其中认购资金利息折合 604,609.99 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，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、《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》、《鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2022 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

新金融工具准则

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

###### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资、资产支持证券投资和基金投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具；即不包含付款的合同义务且享有发行人净资产和剩余收益的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具（主要为股票投资）按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

此外，本基金将对目标公司的投资指定为以公允价值计量且其变动记入当期损益的金融资产，在资产负债表中以交易性金融资产-其他投资列示。

## （2）金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

原金融工具准则（截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则）

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

### 1) 金融资产的分类

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

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

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

此外，本基金将对目标公司的投资指定为以公允价值计量且其变动记入当期损益的金融资产，在资产负债表中以其他资产列示。

## (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

#### 新金融工具准则

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期

信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金在前一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本基金利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认

为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具以及目标公司的投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。每份基金份额面值为 100.00 元。

#### 7.4.4.8 损益平准金

不适用。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

新金融工具准则

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税（和/或）股票交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。对目标公司的投资在持有期间取得的租金收益确认为其他投资收益。本基金定期对目标公司的投资成本进行结转，并相应冲减其他收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

原金融工具准则（截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则）

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税（和/或）股票交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分

属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。对目标公司的投资在持有期间取得的租金收益确认为其他收入。本基金定期对目标公司的投资成本进行结转，并相应冲减其他收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

##### 新金融工具准则

本基金的管理人报酬、托管费、基金投资顾问费和销售服务费(如有)在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

以摊余成本计量的负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

##### 原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

本基金的管理人报酬、托管费、基金投资顾问费和销售服务费(如有)在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。



经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交

易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

(4)本基金通过持有目标公司股权获取商业物业收益的,根据相关合同的约定和当前市场状况等因素,采用包括未来现金流折现法在内的使用的估值技术进行估值。包括未来现金流折现法在内的使用的估值技术在某些极端情况下难以确定公允价值的,本基金的基金管理人与本基金托管人可以协商采用包括成本法在内的最能反映此类投资公允价值的估值技术进行估值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 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,财政部于 2022 年颁布了《关于印发《资产管理产品相关会计处理规定》的通知》(财会[2022]14 号),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

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 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、交易性金融资产-其他投资、应收利息、其它资产、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 5,430.39 元、32,522.70 元、52.10 元、47,671,330.01 元、385,170,000.00 元、-47,709,335.20 元、-385,170,000.00 元、15,068.25 元、-273,173.09 元、-15,068.25 元和 273,173.09 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。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入

应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	16,912,386.88	45,450,235.45
等于：本金	16,909,007.60	45,450,235.45
加：应计利息	3,379.28	-
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	16,912,386.88	45,450,235.45

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	543,925,895.48	-	495,214,161.24	-48,711,734.24	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	3,368,596,801.94	43,085,136.34	3,421,338,990.94	9,657,052.66
	银行间市场	522,469,185.35	2,796,973.72	516,469,973.72	-8,796,185.35

	合计	3,891,065,987.29	45,882,110.06	3,937,808,964.66	860,867.31
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		167,805,376.19	-	168,230,000.00	424,623.81
合计		4,602,797,258.96	45,882,110.06	4,601,253,125.90	-47,426,243.12
项目		上年度末 2021年12月31日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		321,068,116.90	-	295,296,604.80	-25,771,512.10
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	3,521,117,818.49	-	3,571,660,800.00	50,542,981.51
	银行间市场	229,957,773.81	-	232,151,000.00	2,193,226.19
	合计	3,751,075,592.30	-	3,803,811,800.00	52,736,207.70
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		4,072,143,709.20	-	4,099,108,404.80	26,964,695.60

注：1、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。

2、其他为目标公司投资，公允价值根据深圳市戴德梁行土地房地产评估有限公司出具的《前海企业公馆项目收益现金流现值评估报告》确定。

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无。

##### 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

##### 7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

## 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

## 7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

## 7.4.7.5 债权投资

## 7.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

## 7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

## 7.4.7.6 其他债权投资

## 7.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

## 7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

## 7.4.7.7 其他权益工具投资

## 7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

## 7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

## 7.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应收利息	-	47,709,335.20
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
目标公司投资	-	385,170,000.00
合计	-	432,879,335.20

注：目标公司投资公允价值根据深圳市戴德梁行土地房地产评估有限公司出具的《前海企业公馆项目收益现金流现值评估报告》确定。截至 2022 年 12 月 31 日止，目标公司投资列示为交易性金融资产其他投资项下。

## 7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	304,016.07	273,173.09
其中：交易所市场	299,616.07	268,623.09
银行间市场	4,400.00	4,550.00
应付利息	-	15,068.25
预提费用	338,000.00	435,000.00
应付投资顾问费	-	550,557.74
合计	642,016.07	1,273,799.08

## 7.4.7.10 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 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	29,995,915.35	2,999,591,557.72
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	29,995,915.35	2,999,591,557.72

注：根据《鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金招募说明书》的相关规定，本基金合同生效后(2015 年 7 月 6 日)十年之内(含十年)为封闭期，在此期间投资人不能申购、赎回基金份额，但可在本基金上市交易后通过深圳证券交易所买卖基金份额。

## 7.4.7.11 其他综合收益

注：无。

## 7.4.7.12 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	217,327,064.75	29,106,631.59	246,433,696.34
本期利润	69,685,012.32	-76,532,874.71	-6,847,862.39
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-

基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-195,594,365.77	-	-195,594,365.77
本期末	91,417,711.30	-47,426,243.12	43,991,468.18

#### 7.4.7.13 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12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
活期存款利息收入	115,062.36	256,782.23
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	1,240,156.98	1,753,946.46
其他	2,857.43	6,074.00
合计	1,358,076.77	2,016,802.69

注：其他包含认/申购款利息收入、结算保证金利息收入、风控金利息收入等

#### 7.4.7.14 股票投资收益

##### 7.4.7.14.1 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12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-19,164,192.32	36,495,538.47
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	-19,164,192.32	36,495,538.47

##### 7.4.7.14.2 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12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
卖出股票成交总额	549,390,433.93	600,937,081.83
减：卖出股票成本总额	566,720,080.66	564,441,543.36



减：交易费用	1,834,545.59	-
买卖股票差价收入	-19,164,192.32	36,495,538.47

#### 7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

#### 7.4.7.15 债券投资收益

##### 7.4.7.15.1 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12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
债券投资收益——利息收入	142,594,688.83	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	2,380,130.75	23,877,232.20
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	144,974,819.58	23,877,232.20

##### 7.4.7.15.2 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12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,757,641,792.71	1,998,180,918.22
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,724,859,208.82	1,936,639,384.97
减：应计利息总额	30,385,372.62	37,664,301.05
减：交易费用	17,080.52	-
买卖债券差价收入	2,380,130.75	23,877,232.20

##### 7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

##### 7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

## 7.4.7.16 资产支持证券投资收益

## 7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

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

注：无。

## 7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

## 7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

## 7.4.7.17 贵金属投资收益

## 7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

## 7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

## 7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

## 7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

## 7.4.7.18 衍生工具收益

## 7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

## 7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

## 7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月 31日
股票投资产生的股利收益	8,071,397.33	6,537,133.13
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利	-	-

收益		
合计	8,071,397.33	6,537,133.13

#### 7.4.7.20 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 12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021 年12月31日
1. 交易性金融资产	-76,532,874.71	20,334,372.54
股票投资	-22,940,222.14	-41,508,513.02
债券投资	-51,875,340.39	61,842,885.56
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-1,717,312.18	-
2. 衍生工具	-	-
权证投资	-	-
3. 其他	-	1,763,919.93
减：应税金融商品公允价值 变动产生的预估增值税	-	-
合计	-76,532,874.71	22,098,292.47

注：其他为目标公司投资公允价值变动收益。

#### 7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021 年12月31日
基金赎回费收入	-	-
目标公司投资收益	-	39,116,406.20
合计	-	39,116,406.20

注：目标公司投资投资收益为物业收益权收益。根据《鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金招募说明书》，目标公司投资收益为本基金根据与目标公司及其股东所签订的增资协议等相关协议约定的程序和时间，通过增资方式持有目标公司股权至 2023 年 7 月 24 日，获取自 2015 年 1 月 1 日起至 2023 年 7 月 24 日期间前海企业公馆项目 100% 的实际或应当取得的扣除物业管理费收入之外的营业收入，营业收入依据相关协议约定的业绩补偿机制和激励机制进行调整。2022 年度目标公司投资收益在投资收益——其他投资收益项下。

#### 7.4.7.22 信用减值损失

注：无。

## 7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
审计费用	110,000.00	200,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费用	5,138.62	3,974.95
账户维护费	36,000.00	36,000.00
上市年费	-	60,000.00
分红手续费	195,594.37	236,229.83
交易费用	-	1,814,698.02
评估费	108,000.00	115,000.00
其他	1,200.00	1,200.00
投资顾问费	-	6,334,586.56
合计	575,932.99	8,921,689.36

## 7.4.7.24 分部报告

无。

## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

## 7.4.8.1 或有事项

无。

## 7.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金于 2023 年 01 月 11 日进行利润分配，分配金额为 39,594,609.55 元。

## 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
鹏华基金管理有限公司（“鹏华基金公司”）	基金管理人、基金销售机构、基金发起人
上海浦东发展银行股份有限公司（“上海浦东发展银行”）	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
深圳市北融信投资发展有限公司	基金管理人的股东
意大利欧利盛资本资产管理股份公司（“Eurizon Capital SGR S.p.A.”）	基金管理人的股东
鹏华资产管理有限公司（“鹏华资产”）	基金管理人的子公司
深圳市前海金融控股有限公司（“前海金控”）	基金投资顾问、基石投资人、《合作框架协议》其他签订方

注：1. 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

2. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.10.1.1 股票交易

注：无。

#### 7.4.10.1.2 债券交易

注：无。

#### 7.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

#### 7.4.10.1.4 权证交易

注：无。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：无。

### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12 月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	19,901,327.58	20,587,406.33
其中：支付销售机构的客户维护费	1,198,611.01	976,404.67

注：1、支付基金管理人鹏华基金公司的管理人报酬年费率为 0.65%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×0.65%÷当年天数。

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

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12 月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	3,061,742.77	3,167,293.20

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

## 7.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

## 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

## 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

## 7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：无。

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

注：无。

## 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

## 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
基金合同生效日(2015年7月6日)持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	100,027.00	100,027.00
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	100,027.00	100,027.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.3335%	0.3335%

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。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2022年12月31日		上年度末 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(%)
前海金控	3,000,405.00	10.00	3,000,405.00	10.00

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。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
上海浦东发展银行	16,912,386.88	115,062.36	45,450,235.45	256,782.23

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2022年1月1日至2022年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
国信证券	301338	凯格精机	网下申购	2,568	118,975.44
国信证券	688401	路维光电	网下申购	4,947	124,070.76
国信证券	688231	隆达股份	网下申购	7,835	306,191.80
国信证券	301161	唯万密封	网下申购	3,460	64,563.60
国信证券	688244	永信至诚	网下申购	1,506	74,080.14
上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
国信证券	301066	万事利	网下申购	3,436	18,004.64
国信证券	301091	深城交	网下申购	5,240	191,260.00
国信证券	688622	禾信仪器	网下申购	1,204	21,310.80
国信证券	301032	新柴股份	网下申购	5,124	25,466.28
国信证券	688323	瑞华泰	网下申购	4,513	26,942.61
国信证券	300986	志特新材	网下申购	2,632	38,927.28
国信证券	300957	贝泰妮	网下申购	8,523	403,393.59

注：本表包含参与基金托管人的关联方承销证券的情况。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金支付基金投资顾问前海金控的投资顾问费按前一日基金资产净值 0.20% 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：

$$\text{日投资顾问费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

本基金本报告期发生的投资顾问费为人民币 6,123,485.36 元。于 2022 年 12 月 31 日，本基

金需支付的投资顾问费余额为人民币 518,678.71 元。

#### 7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2022 年 1 月 14 日	2022 年 01 月 17 日	2022 年 01 月 14 日	65.2070	195,594,365.77	-	195,594,365.77	-
合计	-	-	-	65.2070	195,594,365.77	-	195,594,365.77	-

注：本基金于 2023 年 01 月 11 日进行利润分配，分配金额为 39,594,609.55 元。

#### 7.4.12 期末（2022 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
301095	广立微	2022 年 7 月 28 日	6 个月	新股流通受限	58.00	86.49	740	42,920.00	64,002.60	-
301115	建科股份	2022 年 8 月 23 日	6 个月	新股流通受限	42.05	24.04	685	28,804.25	16,467.40	-
301132	满坤科技	2022 年 8 月 3 日	6 个月	新股流通受限	26.80	24.48	468	12,542.40	11,456.64	-
301152	天力锂能	2022 年 8 月 19 日	6 个月	新股流通受限	57.00	46.64	433	24,681.00	20,195.12	-
301161	唯万密封	2022 年 9 月 6 日	6 个月	新股流通受限	18.66	21.73	346	6,456.36	7,518.58	-
301171	易点天下	2022 年 8 月 10 日	6 个月	新股流通受限	18.18	17.72	985	17,907.30	17,454.20	-
301175	中科环保	2022 年 6 月 30 日	6 个月	新股流通受限	3.82	6.01	6,370	24,333.40	38,283.70	-



301197	工大科雅	2022年7月29日	6个月	新股流通受限	25.50	20.08	380	9,690.00	7,630.40	-
301231	荣信文化	2022年8月31日	6个月	新股流通受限	25.49	20.38	275	7,009.75	5,604.50	-
301233	盛帮股份	2022年6月24日	6个月	新股流通受限	41.52	34.30	158	6,560.16	5,419.40	-
301239	普瑞眼科	2022年6月22日	6个月	新股流通受限	33.65	69.68	575	19,348.75	40,066.00	-
301265	华新环保	2022年12月8日	6个月	新股流通受限	13.28	11.40	819	10,876.32	9,336.60	-
301267	华夏眼科	2022年10月26日	6个月	新股流通受限	50.88	66.20	1,006	51,185.28	66,597.20	-
301269	华大九天	2022年7月21日	6个月	新股流通受限	32.69	87.94	1,168	38,181.92	102,713.92	-
301270	汉仪股份	2022年8月19日	6个月	新股流通受限	25.68	28.37	210	5,392.80	5,957.70	-
301276	嘉曼服饰	2022年9月1日	6个月	新股流通受限	40.66	22.61	303	12,319.98	6,850.83	-
301277	新天地	2022年11月9日	6个月	新股流通受限	27.00	25.78	439	11,853.00	11,317.42	-
301282	金禄电子	2022年8月18日	6个月	新股流通受限	30.38	25.25	434	13,184.92	10,958.50	-
301283	聚胶股份	2022年8月26日	6个月	新股流通受限	52.69	51.41	235	12,382.15	12,081.35	-
301285	鸿日达	2022年9月21日	6个月	新股流通受限	14.60	12.60	565	8,249.00	7,119.00	-
301290	东星医疗	2022年11月23日	6个月	新股流通受限	44.09	35.13	330	14,549.70	11,592.90	-
301296	新巨丰	2022年8月26日	6个月	新股流通受限	18.19	14.90	1,042	18,953.98	15,525.80	-

		日									
301297	富乐德	2022年12月23日	6个月	新股流通受限	8.48	12.99	1,015	8,607.20	13,184.85		-
301300	远翔新材	2022年8月9日	6个月	新股流通受限	36.15	29.37	211	7,627.65	6,197.07		-
301301	川宁生物	2022年12月20日	6个月	新股流通受限	5.00	7.53	3,574	17,870.00	26,912.22		-
301306	西测测试	2022年7月19日	6个月	新股流通受限	43.23	42.29	255	11,023.65	10,783.95		-
301309	万得凯	2022年9月8日	6个月	新股流通受限	39.00	24.46	228	8,892.00	5,576.88		-
301311	昆船智能	2022年11月23日	6个月	新股流通受限	13.88	15.86	832	11,548.16	13,195.52		-
301313	凡拓数创	2022年9月22日	6个月	新股流通受限	25.25	29.14	247	6,236.75	7,197.58		-
301316	慧博云通	2022年9月29日	6个月	新股流通受限	7.60	14.32	359	2,728.40	5,140.88		-
301318	维海德	2022年8月3日	6个月	新股流通受限	64.68	41.74	206	13,324.08	8,598.44		-
301319	唯特偶	2022年9月22日	6个月	新股流通受限	47.75	53.27	115	5,491.25	6,126.05		-
301327	华宝新能	2022年9月8日	6个月	新股流通受限	237.50	176.97	242	57,475.00	42,826.74		-
301328	维峰电子	2022年8月30日	6个月	新股流通受限	78.80	76.96	191	15,050.80	14,699.36		-
301338	凯格精机	2022年8月8日	6个月	新股流通受限	46.33	48.99	257	11,906.81	12,590.43		-
301339	通行宝	2022年9月2日	6个月	新股流通受限	18.78	15.59	913	17,146.14	14,233.67		-
301349	信德	2022年	6个月	新股流	138.88	103.52	180	24,998.40	18,633.60		-

	新材	8月30日		通受限							
301359	东南电子	2022年11月2日	6个月	新股流通受限	20.84	19.90	328	6,835.52	6,527.20		-
301361	众智科技	2022年11月8日	6个月	新股流通受限	26.44	20.96	517	13,669.48	10,836.32		-
301363	美好医疗	2022年9月28日	6个月	新股流通受限	30.66	37.85	445	13,643.70	16,843.25		-
301367	怡和嘉业	2022年10月21日	6个月	新股流通受限	119.88	175.78	223	26,733.24	39,198.94		-
301368	丰立智能	2022年12月7日	6个月	新股流通受限	22.33	18.52	337	7,525.21	6,241.24		-
301377	鼎泰高科	2022年11月11日	6个月	新股流通受限	22.88	17.63	770	17,617.60	13,575.10		-
301388	欣灵电气	2022年10月26日	6个月	新股流通受限	25.88	21.60	292	7,556.96	6,307.20		-
301398	星源卓镁	2022年12月8日	6个月	新股流通受限	34.40	28.94	255	8,772.00	7,379.70		-
688353	华盛锂电	2022年7月6日	6个月	新股流通受限	98.35	63.86	4,358	428,609.30	278,301.88		-
688480	赛恩斯	2022年11月18日	6个月	新股流通受限	19.18	20.19	2,302	44,152.36	46,477.38		-
688489	三未信安	2022年11月25日	6个月	新股流通受限	78.89	90.62	1,995	157,385.55	180,786.90		-

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

2、基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自

发行结束之日起约定限售期内不得转让。

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

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

5、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 12 月 31 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 1,670,161,847.16 元，于 2023 年 01 月 03 日、2023 年 01 月 04 日、2023 年 01 月 05 日、2023 年 01 月 06 日（先后）到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金。本基金封闭运作期内按照基金合同的约定投资于确定的、单一的目标公司股权。本基金的其他基金资产可以投资于固定收益类资产（具体包括：国债、金融债、企业（公司）债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、资产支持证券、债券回购、银行存款等）、现金，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。本基金同时可参与股票、权证等权益类资产的投资。

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

本基金的基金管理人致力于全面内部控制体系的建设，建立了从董事会层面到各业务部门的风险管理组织架构。本基金的基金管理人在董事会下设风险控制和合规审计委员会，主要负责制定基金管理人风险控制战略和控制政策、协调突发重大风险等事项；督察长负责对基金管理人各业务环节合法合规运作进行监督检查，组织、指导基金管理人内部监察稽核工作，并可向董事会和中国证监会直接报告；在公司内部设立独立的监察稽核部，专职负责对基金管理人各部门、各业务的风险控制情况进行督促和检查，并适时提出整改建议。

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

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行上海浦东发展银行股份有限公司及其他具有基金托管资格的银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。

本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

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

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

**7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

注：无。

**7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

注：无。

**7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
AAA	3,734,180,830.20	3,623,726,700.00
AAA 以下	193,474,989.25	180,085,100.00
未评级	-	-
合计	3,927,655,819.45	3,803,811,800.00

注：上述评级均由经中国证监会核准从事证券市场资信评级业务的评级机构作出。

**7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

注：无。

**7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

注：无。

**7.4.13.3 流动性风险**

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

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理职能部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短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 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款余额 1,670,161,847.16 元将在一个月内到期且计息外，本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（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。

#### 7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

#### 7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。

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

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

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

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，此外还持有银行存款、结算备付金等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	16,912,386.88	-	-	-	16,912,386.88
结算备付金	89,942,525.16	-	-	-	89,942,525.16
存出保证金	189,060.09	-	-	-	189,060.09
交易性金融资产	2,869,357,774.32	916,897,767.34	319,783,423.00	495,214,161.24	4,601,253,125.90
应收清算款	-	-	-	9,067,289.85	9,067,289.85
资产总计	2,976,401,746.45	916,897,767.34	319,783,423.00	504,281,451.09	4,717,364,387.88
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	1,685,705.73	1,685,705.73
应付托管费	-	-	-	259,339.38	259,339.38
应付清算款	-	-	-	106,034.10	106,034.10
卖出回购金融资产款	1,670,161,847.16	-	-	-	1,670,161,847.16
应付投资顾问费	-	-	-	518,678.71	518,678.71
应交税费	-	-	-	407,740.83	407,740.83
其他负债	-	-	-	642,016.07	642,016.07
负债总计	1,670,161,847.16	-	-	3,619,514.82	1,673,781,361.98
利率敏感度缺口	1,306,239,899.29	916,897,767.34	319,783,423.00	500,661,936.27	3,043,583,025.90
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	45,450,235.45	-	-	-	45,450,235.45
结算备付金	72,272,758.17	-	-	-	72,272,758.17
存出保证金	115,781.27	-	-	-	115,781.27
交易性金融资产	309,508,200.00	3,484,103,600.00	10,200,000.00	295,296,604.80	4,099,108,404.80



应收清算款	-	-	-	3,508,346.73	3,508,346.73
其他资产	252,500,000.00	132,670,000.00	-	47,709,335.20	432,879,335.20
资产总计	679,846,974.89	3,616,773,600.00	10,200,000.00	346,514,286.73	4,653,334,861.62
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	1,789,312.67	1,789,312.67
应付托管费	-	-	-	275,278.85	275,278.85
应付清算款	-	-	-	27,242,251.24	27,242,251.24
卖出回购金融资产款	1,376,300,000.00	-	-	-	1,376,300,000.00
应交税费	-	-	-	428,965.72	428,965.72
其他负债	-	-	-	1,273,799.08	1,273,799.08
负债总计	1,376,300,000.00	-	-	31,009,607.56	1,407,309,607.56
利率敏感度缺口	-696,453,025.11	3,616,773,600.00	10,200,000.00	315,504,679.17	3,246,025,254.06

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有债券资产的利率风险状况测算的理论变动值对基金资产净值的影响金额。		
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。		
	此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022 年 12 月 31 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
分析	市场利率下降 25 个基点	11,587,294.93	16,138,132.55
	市场利率上升 25 个基点	-11,500,350.89	-16,026,151.63

注：无。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

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

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无。

#### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券投资品种，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。

基金的投资组合比例为：本基金投资于确定的、单一的目标公司股权的比例不超过基金资产的 50%，投资于固定收益类资产、权益类资产等的比例不低于基金资产的 50%。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。

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

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31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	495,214,161.24	16.27	295,296,604.80	9.10
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	15,034,619.37	0.49	22,836,100.00	0.70
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	510,248,780.61	16.76	318,132,704.80	9.80

注：债券投资为可转换债券、可交换债券投资。

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022年12月31日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	业绩比较基准上升5%	16,907,103.71	5,274,791.04
	业绩比较基准下降5%	-16,907,103.71	-5,274,791.04

注：无。

#### 7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

### 7.4.14 公允价值

#### 7.4.14.1 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。

#### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 7.4.14.2.1 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12月31日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	508,936,258.50	313,641,149.16

第二层次	3,922,774,345.29	3,781,355,929.35
第三层次	169,542,522.11	389,281,326.29
合计	4,601,253,125.90	4,484,278,404.80

#### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

<p>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。</p> <p>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。</p>
--

#### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

##### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日			
	交易性金融资产			合计
	债券投资	股票投资	其他投资	
期初余额	-	4,111,326.29	385,170,000.00	389,281,326.29
当期购买	-	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-	-
转入第三层次	-	4,662,731.69	-	4,662,731.69
转出第三层次	-	10,246,124.90	-	10,246,124.90
当期利得或损失总额	-	2,784,589.03	-216,940,000.00	-214,155,410.97
其中：计入损益的利得或损失	-	2,784,589.03	-216,940,000.00	-214,155,410.97
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-	-
期末余额	-	1,312,522.11	168,230,000.00	169,542,522.11
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-37,287.52	-1,717,312.18	-1,754,599.70
项目	上年度可比同期 2021年1月1日至2021年12月31日			

	交易性金融资产			合计
	债券投资	股票投资	其他投资	
期初余额	-	-	581,070,000.00	581,070,000.00
当期购买	-	3,211,781.89	-	3,211,781.89
当期出售/结算	-	-	-	-
转入第三层次	-	-	-	-
转出第三层次	-	-	-	-
当期利得或损失总额	-	899,544.40	-195,900,000.00	-195,000,455.60
其中：计入损益的利得或损失	-	899,544.40	-195,900,000.00	-195,000,455.60
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-	-
期末余额	-	4,111,326.29	385,170,000.00	389,281,326.29
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	899,544.40	1,763,919.93	2,663,464.33

#### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流通受限股票	1,312,522.11	平均价格 亚式期权模型	预期波动率	0.2063-2.4756	负相关
目标公司投资	168,230,000.00	现金流量折现法	折现率；空置率； 租金增长率	7.50%；25%；0%	负相关；负相关；正相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流通受限股票	4,111,326.29	平均价格 亚式期权模型	预期波动率	0.1717-2.7417	负相关
目标公司投资	385,170,000.00	现金流量折现法	折现率；空置率； 租金增长率	7.50%；15%；3%	负相关；负相关；正相关

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

#### 7.4.14.4 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。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	495,214,161.24	10.50
	其中：股票	495,214,161.24	10.50
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,937,808,964.66	83.47
	其中：债券	3,937,808,964.66	83.47
	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	106,854,912.04	2.27
8	其他各项资产	177,486,349.94	3.76
9	合计	4,717,364,387.88	100.00

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,737,538.00	0.06
B	采矿业	1,521,004.00	0.05
C	制造业	364,521,614.30	11.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,008,170.00	0.10
E	建筑业	2,969,132.00	0.10
F	批发和零售业	796,411.00	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	3,389,210.00	0.11
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,676,621.58	0.25

J	金融业	100,673,578.00	3.31
K	房地产业	581,364.00	0.02
L	租赁和商务服务业	1,333,766.00	0.04
M	科学研究和技术服务业	4,999,032.52	0.16
N	水利、环境和公共设施管理业	176,493.08	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	45,837.00	0.00
Q	卫生和社会工作	1,371,136.26	0.05
R	文化、体育和娱乐业	266,964.50	0.01
S	综合	146,289.00	0.00
	合计	495,214,161.24	16.27

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000333	美的集团	700,000	36,260,000.00	1.19
2	002475	立讯精密	1,000,000	31,750,000.00	1.04
3	600036	招商银行	835,000	31,112,100.00	1.02
4	600031	三一重工	1,800,000	28,440,000.00	0.93
5	600690	海尔智家	1,100,000	26,906,000.00	0.88
6	000651	格力电器	800,000	25,856,000.00	0.85
7	002493	荣盛石化	2,100,000	25,830,000.00	0.85
8	600309	万华化学	240,000	22,236,000.00	0.73
9	601318	中国平安	460,000	21,620,000.00	0.71
10	000001	平安银行	1,600,000	21,056,000.00	0.69
11	002142	宁波银行	556,000	18,042,200.00	0.59
12	600150	中国船舶	800,000	17,824,000.00	0.59
13	002601	龙佰集团	800,000	15,136,000.00	0.50
14	688169	石头科技	60,000	14,865,000.00	0.49
15	000338	潍柴动力	1,200,000	12,216,000.00	0.40
16	688007	光峰科技	400,000	9,944,000.00	0.33
17	688323	瑞华泰	400,000	9,512,000.00	0.31
18	600519	贵州茅台	5,500	9,498,500.00	0.31
19	688235	百济神州-U	50,000	6,622,500.00	0.22
20	688180	君实生物-U	100,000	6,260,000.00	0.21
21	300750	宁德时代	15,300	6,019,326.00	0.20
22	688008	澜起科技	93,428	5,848,592.80	0.19
23	300441	鲍斯股份	1,000,000	5,450,000.00	0.18
24	002222	福晶科技	300,000	4,746,000.00	0.16
25	603259	药明康德	57,600	4,665,600.00	0.15

26	600837	海通证券	470,800	4,091,252.00	0.13
27	000951	中国重汽	234,741	3,483,556.44	0.11
28	002410	广联达	56,100	3,363,195.00	0.11
29	603605	珀莱雅	14,300	2,394,964.00	0.08
30	002466	天齐锂业	29,700	2,346,003.00	0.08
31	600905	三峡能源	389,400	2,200,110.00	0.07
32	600486	扬农化工	19,800	2,057,220.00	0.07
33	601000	唐山港	704,000	1,928,960.00	0.06
34	300866	安克创新	32,000	1,896,640.00	0.06
35	300316	晶盛机电	27,000	1,716,120.00	0.06
36	002714	牧原股份	31,900	1,555,125.00	0.05
37	601601	中国太保	62,000	1,520,240.00	0.05
38	000887	中鼎股份	102,300	1,480,281.00	0.05
39	600606	绿地控股	470,800	1,402,984.00	0.05
40	600438	通威股份	36,000	1,388,880.00	0.05
41	600809	山西汾酒	4,400	1,253,956.00	0.04
42	300033	同花顺	12,100	1,193,181.00	0.04
43	300699	光威复材	16,500	1,192,125.00	0.04
44	000581	威孚高科	67,100	1,189,683.00	0.04
45	688072	拓荆科技-U	5,300	1,148,775.00	0.04
46	603228	景旺电子	55,000	1,113,200.00	0.04
47	601888	中国中免	5,000	1,080,150.00	0.04
48	601669	中国电建	152,100	1,076,868.00	0.04
49	301269	华大九天	11,677	1,049,259.55	0.03
50	688561	奇安信-U	15,400	1,012,858.00	0.03
51	601628	中国人寿	27,000	1,002,240.00	0.03
52	001872	招商港口	56,100	805,596.00	0.03
53	002624	完美世界	60,500	769,560.00	0.03
54	688172	燕东微	40,177	762,559.46	0.03
55	300072	海新能科	171,600	748,176.00	0.02
56	600176	中国巨石	53,900	738,969.00	0.02
57	301267	华夏眼科	10,052	727,950.26	0.02
58	002434	万里扬	86,900	699,545.00	0.02
59	688409	富创精密	6,334	684,768.74	0.02
60	300363	博腾股份	16,500	674,025.00	0.02
61	603267	鸿远电子	6,600	667,656.00	0.02
62	000623	吉林敖东	44,000	659,560.00	0.02
63	601156	东航物流	42,900	654,654.00	0.02
64	600522	中天科技	40,000	646,000.00	0.02
65	601225	陕西煤业	32,900	611,282.00	0.02
66	300244	迪安诊断	24,000	603,120.00	0.02
67	600369	西南证券	157,300	589,875.00	0.02
68	001914	招商积余	37,800	581,364.00	0.02



69	600256	广汇能源	64,000	577,280.00	0.02
70	002240	盛新锂能	15,000	562,350.00	0.02
71	600392	盛和资源	38,500	539,000.00	0.02
72	600025	华能水电	80,300	529,980.00	0.02
73	300474	景嘉微	9,000	491,130.00	0.02
74	600039	四川路桥	44,000	489,280.00	0.02
75	688503	聚和材料	3,277	488,633.47	0.02
76	301367	怡和嘉业	2,229	479,656.36	0.02
77	688141	杰华特	9,946	472,435.00	0.02
78	301327	华宝新能	2,417	452,270.49	0.01
79	600941	中国移动	6,600	446,622.00	0.01
80	600582	天地科技	82,500	429,000.00	0.01
81	000062	深圳华强	34,100	416,361.00	0.01
82	600732	爱旭股份	11,000	416,020.00	0.01
83	000629	钒钛股份	80,000	378,400.00	0.01
84	002756	永兴材料	4,000	368,680.00	0.01
85	601319	中国人保	63,800	333,036.00	0.01
86	600188	兖矿能源	9,900	332,442.00	0.01
87	688371	菲沃泰	16,203	326,814.51	0.01
88	000301	东方盛虹	24,300	316,872.00	0.01
89	002174	游族网络	31,900	295,394.00	0.01
90	000596	古井贡酒	1,100	293,590.00	0.01
91	688381	帝奥微	7,362	292,418.64	0.01
92	688353	华盛锂电	4,358	278,301.88	0.01
93	600167	联美控股	44,000	278,080.00	0.01
94	002372	伟星新材	13,000	277,420.00	0.01
95	300628	亿联网络	4,500	272,655.00	0.01
96	688432	有研硅	20,044	265,382.56	0.01
97	601928	凤凰传媒	33,000	261,360.00	0.01
98	688035	德邦科技	4,981	257,069.41	0.01
99	600415	小商品城	48,400	253,616.00	0.01
100	002078	太阳纸业	22,000	253,440.00	0.01
101	000703	恒逸石化	35,200	247,456.00	0.01
102	688006	杭可科技	5,500	240,735.00	0.01
103	688306	均普智能	47,094	223,696.50	0.01
104	688290	景业智能	3,040	219,123.20	0.01
105	688401	路维光电	4,947	215,639.73	0.01
106	688152	麒麟信安	1,189	203,200.10	0.01
107	600546	山煤国际	13,200	191,268.00	0.01
108	000401	冀东水泥	23,100	190,113.00	0.01
109	301363	美好医疗	4,447	184,567.07	0.01
110	002299	圣农发展	7,700	182,413.00	0.01
111	688489	三未信安	1,995	180,786.90	0.01

112	688362	甬矽电子	7,779	169,504.41	0.01
113	688237	超卓航科	2,891	161,664.72	0.01
114	688147	微导纳米	6,293	157,828.44	0.01
115	003035	南网能源	27,500	155,925.00	0.01
116	688084	晶品特装	1,875	155,025.00	0.01
117	301297	富乐德	10,147	150,256.17	0.00
118	301377	鼎泰高科	7,695	149,789.85	0.00
119	000009	中国宝安	12,100	146,289.00	0.00
120	301311	昆船智能	8,320	145,957.76	0.00
121	002831	裕同科技	4,400	145,508.00	0.00
122	688305	科德数控	1,496	132,396.00	0.00
123	301283	聚胶股份	2,344	125,419.01	0.00
124	301277	新天地	4,384	125,209.57	0.00
125	301290	东星医疗	3,291	122,423.13	0.00
126	301151	冠龙节能	7,025	119,495.25	0.00
127	002191	劲嘉股份	16,500	119,295.00	0.00
128	600177	雅戈尔	18,700	118,371.00	0.00
129	688376	美埃科技	3,713	116,142.64	0.00
130	301361	众智科技	5,169	115,134.16	0.00
131	002416	爱施德	12,100	114,708.00	0.00
132	601187	厦门银行	19,800	113,454.00	0.00
133	688257	新锐股份	2,899	113,292.92	0.00
134	688496	清越科技	12,000	108,960.00	0.00
135	002867	周大生	7,700	108,031.00	0.00
136	688102	斯瑞新材	6,030	99,434.70	0.00
137	301265	华新环保	8,181	99,226.62	0.00
138	688420	美腾科技	2,408	98,294.56	0.00
139	688419	耐科装备	3,039	96,123.57	0.00
140	301259	艾布鲁	4,828	91,732.00	0.00
141	688143	长盈通	1,938	90,349.56	0.00
142	688049	炬芯科技	3,260	88,183.00	0.00
143	688244	永信至诚	1,506	82,077.00	0.00
144	688416	恒烁股份	2,147	81,607.47	0.00
145	301313	凡拓数创	2,464	79,626.97	0.00
146	301398	星源卓镁	2,549	78,837.80	0.00
147	301238	瑞泰新材	3,497	78,647.53	0.00
148	301135	瑞德智能	3,376	77,310.40	0.00
149	301110	青木股份	2,013	76,212.18	0.00
150	301288	清研环境	4,516	75,191.40	0.00
151	688525	佰维存储	4,614	74,100.84	0.00
152	600704	物产中大	15,400	74,074.00	0.00
153	688455	科捷智能	5,277	71,819.97	0.00
154	301359	东南电子	3,271	71,332.06	0.00

155	600195	中牧股份	6,000	69,720.00	0.00
156	301388	欣灵电气	2,920	67,802.40	0.00
157	301316	慧博云通	3,584	67,028.63	0.00
158	301368	丰立智能	3,368	66,558.14	0.00
159	002841	视源股份	1,100	64,944.00	0.00
160	301095	广立微	740	64,002.60	0.00
161	600398	海澜之家	11,000	58,300.00	0.00
162	301309	万得凯	2,271	56,692.74	0.00
163	002032	苏泊尔	1,100	54,406.00	0.00
164	601992	金隅集团	20,900	53,086.00	0.00
165	301217	铜冠铜箔	4,284	53,078.76	0.00
166	688480	赛恩斯	2,302	46,477.38	0.00
167	002607	中公教育	9,900	45,837.00	0.00
168	301153	中科江南	398	42,363.12	0.00
169	301239	普瑞眼科	575	40,066.00	0.00
170	301219	腾远钴业	578	39,841.54	0.00
171	301266	宇邦新材	517	39,085.20	0.00
172	301175	中科环保	6,370	38,283.70	0.00
173	301206	三元生物	945	36,855.00	0.00
174	301268	铭利达	641	32,184.61	0.00
175	301302	华如科技	466	29,837.98	0.00
176	301162	国能日新	334	29,331.88	0.00
177	301301	川宁生物	3,574	26,912.22	0.00
178	301117	佳缘科技	262	20,776.60	0.00
179	301152	天力锂能	433	20,195.12	0.00
180	301286	侨源股份	784	19,372.64	0.00
181	301120	新特电气	1,032	19,205.52	0.00
182	301349	信德新材	180	18,633.60	0.00
183	301171	易点天下	985	17,454.20	0.00
184	603057	紫燕食品	549	17,277.03	0.00
185	301115	建科股份	685	16,467.40	0.00
186	301296	新巨丰	1,042	15,525.80	0.00
187	301187	欧圣电气	876	14,821.92	0.00
188	301328	维峰电子	191	14,699.36	0.00
189	301339	通行宝	913	14,233.67	0.00
190	301160	翔楼新材	392	13,963.04	0.00
191	301100	风光股份	599	13,273.84	0.00
192	301338	凯格精机	257	12,590.43	0.00
193	301112	信邦智能	399	12,404.91	0.00
194	001256	炜冈科技	474	12,390.36	0.00
195	001333	光华股份	426	12,332.70	0.00
196	001300	三柏硕	763	11,826.50	0.00
197	301132	满坤科技	468	11,456.64	0.00

198	301282	金禄电子	434	10,958.50	0.00
199	301306	西测测试	255	10,783.95	0.00
200	301220	亚香股份	285	10,496.55	0.00
201	301116	益客食品	577	9,860.93	0.00
202	301298	东利机械	634	9,605.10	0.00
203	301318	维海德	206	8,598.44	0.00
204	301197	工大科雅	380	7,630.40	0.00
205	301161	唯万密封	346	7,518.58	0.00
206	301163	宏德股份	277	7,282.33	0.00
207	301285	鸿日达	565	7,119.00	0.00
208	301276	嘉曼服饰	303	6,850.83	0.00
209	301300	远翔新材	211	6,197.07	0.00
210	301319	唯特偶	115	6,126.05	0.00
211	301270	汉仪股份	210	5,957.70	0.00
212	301231	荣信文化	275	5,604.50	0.00
213	301233	盛帮股份	158	5,419.40	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000333	美的集团	54,449,991.16	1.68
2	600690	海尔智家	51,260,756.43	1.58
3	600150	中国船舶	41,669,964.48	1.28
4	002493	荣盛石化	38,896,291.47	1.20
5	002475	立讯精密	38,418,994.13	1.18
6	600309	万华化学	37,531,684.00	1.16
7	002142	宁波银行	28,004,958.95	0.86
8	600036	招商银行	25,980,785.00	0.80
9	000338	潍柴动力	22,911,292.36	0.71
10	601318	中国平安	22,423,588.00	0.69
11	600031	三一重工	21,605,520.00	0.67
12	000001	平安银行	21,255,240.00	0.65
13	000651	格力电器	17,846,714.50	0.55
14	688169	石头科技	17,701,299.95	0.55
15	002050	三花智控	17,428,187.70	0.54
16	688298	东方生物	16,137,920.78	0.50
17	002601	龙佰集团	15,634,605.00	0.48
18	601658	邮储银行	15,201,115.42	0.47
19	300441	鲍斯股份	12,517,081.00	0.39
20	601288	农业银行	12,472,000.00	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。

## 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002050	三花智控	38,425,209.71	1.18
2	601398	工商银行	33,400,000.00	1.03
3	601288	农业银行	33,090,000.00	1.02
4	600690	海尔智家	32,816,470.77	1.01
5	600309	万华化学	32,450,933.00	1.00
6	601939	建设银行	32,364,000.00	1.00
7	600150	中国船舶	25,744,537.00	0.79
8	002493	荣盛石化	25,569,535.20	0.79
9	601988	中国银行	24,698,000.00	0.76
10	601318	中国平安	24,284,940.64	0.75
11	601658	邮储银行	20,379,762.70	0.63
12	000338	潍柴动力	18,083,025.00	0.56
13	000002	万科 A	15,775,690.00	0.49
14	688298	东方生物	14,696,437.50	0.45
15	000001	平安银行	14,518,539.44	0.45
16	000333	美的集团	13,330,647.35	0.41
17	600026	中远海能	11,663,608.46	0.36
18	600036	招商银行	11,168,103.82	0.34
19	300441	鲍斯股份	10,281,370.00	0.32
20	002142	宁波银行	9,885,601.10	0.30

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

## 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	789,577,859.24
卖出股票收入（成交）总额	549,390,433.93

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

## 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	631,325,054.82	20.74
	其中：政策性金融债	10,153,145.21	0.33
4	企业债券	3,209,578,903.62	105.45
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	81,870,386.85	2.69

7	可转债（可交换债）	15,034,619.37	0.49
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,937,808,964.66	129.38

### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	163769	20 铁工 Y7	1,500,000	152,945,794.52	5.03
2	175514	20 鲁金 Y1	1,500,000	152,932,643.84	5.02
3	232280003	22 成都银行二级资本债 01	1,300,000	127,193,246.58	4.18
4	163793	20 唐租 Y1	1,200,000	122,156,547.95	4.01
5	163696	20 建二 Y1	1,200,000	122,011,791.78	4.01

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

注：无。

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

注：无。

### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：无。

### 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

#### 8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

### 8.12 投资组合报告附注

#### 8.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

成都银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到中国人民银行成都分行的处罚。

中国建筑第二工程局有限公司在报告编制日前一年内受到北京市海淀区住房和城乡建设委员会、北京市住房和城乡建设委员会、天津市住房和城乡建设委员会的处罚。

中国建筑第二工程局有限公司在报告编制日前一年内受到海口市综合行政执法局、任丘市人力资源和社会保障局、周口市人力资源和社会保障局等监管机构的处罚。

鞍山钢铁集团有限公司在报告编制日前一年内受到鞍山市生态环境局、营口市生态环境局的处罚。

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。

### 8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券备选库。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	189,060.09
2	应收清算款	9,067,289.85
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	168,230,000.00
9	合计	177,486,349.94

注：其他为目标公司投资。

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	128035	大族转债	7,372,662.74	0.24
2	128136	立讯转债	4,140,054.19	0.14

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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 (%)
2,289	13,104.38	23,951,127.41	79.85	6,044,787.94	20.15

## 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	江苏银行股份有限公司—聚宝财富融达1号	1,423,214.00	8.48
2	兴银理财有限责任公司—兴业银行天天万利宝稳利1号净值型理财产品J款	877,325.00	5.23
3	陈建燕	780,680.00	4.65
4	兴银理财有限责任公司—兴业银行天天万利宝稳利1号净值型理财产品F款	779,844.00	4.64
4	兴银理财有限责任公司—兴业银行天天万利宝稳利1号净值型理财产品H款	779,844.00	4.64
6	兴银理财有限责任公司—兴业银行天天万利宝稳利1号净值型理财产品L款	502,697.00	2.99
7	兴银理财有限责任公司—兴业银行天天万利宝稳利1号净值型理财产品E款	487,403.00	2.90
7	兴银理财有限责任公司—兴银理财天天万利宝稳利恒盈7号H款净值型理财产品	487,403.00	2.90
9	陈穗强	400,014.00	2.38
10	兴银理财有限责任公司—兴业银行天天万利宝稳利1号净值型理财产品K款	389,922.00	2.32
10	兴银理财有限责任公司—兴业银行天天万利宝稳利3号净值型理财产品I款	389,922.00	2.32
10	兴银理财有限责任公司—兴银理财天天万	389,922.00	2.32



	利宝稳利恒盈 7 号 N 款 净值型理财产品		
--	---------------------------	--	--

注：持有人为场内持有人。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：截止本报告期末，本基金管理人所有从业人员未持有本基金份额。

### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

### 9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品的情况

注：无。

### 9.6 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	100,027.00	0.33	100,027.00	0.33	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	3,000,405.00	10.00	-	-	二年
合计	3,100,432.00	10.33	100,027.00	0.33	-

注：1、本基金自 2015 年 6 月 26 日至 2015 年 7 月 1 日止期间公开发售，于 2015 年 7 月 6 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 10,002,700.27 份，2015 年 9 月 18 日本基金经折算后的份额为 100,027 份。

3、本基金基石投资人前海金控在募集期间认购本基金份额 300,040,500.13 份，2015 年 9 月 18 日本基金经折算后的份额为 3,000,405 份。

4、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。

## § 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，公司原董事 Andrea Vismara 先生辞去本公司董事职务。经 2022 年第三次临时股东大会会议审议通过，股东会同意由 Sandro Vesprini 先生担任本公司董事，任职日期自 2022 年 3 月 31 日起。

报告期内，公司原监事 Sandro Vesprini 先生辞去本公司监事职务。经 2022 年第三次临时股东大会会议审议通过，股东会同意由 Lorenzo Petracca 先生担任本公司监事，任职日期自 2022 年 3 月 31 日起。

报告期内，刘嵌先生不再担任监事。经民主选举，宁江先生当选为公司职工监事，任职日期自 2022 年 9 月 8 日起。

报告期内，经公司第六届董事会第一百一十次会议审议通过，聘任刘嵌先生担任公司副总经理，任职日期自 2022 年 9 月 7 日起。

本公司已将上述变更事项报中国证券监督管理委员会深圳监管局备案。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

经上海浦东发展银行股份有限公司决定，总行资产托管部原总经理孔建同志自 2022 年 11 月 7 日起不再担任资产托管部总经理职务，由李国光同志担任部门负责人。

### 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

未改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未改聘为本基金审计的会计师事务所。本年度应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用 110,000.00 元，该审计机构已提供审计服务的年限为 8 年。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：无。

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：无。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中信建投证券	1	380,383,701.53	29.23	310,504.49	29.09	-
中金公司	2	310,880,758.45	23.89	254,624.40	23.85	-
广发证券	1	236,992,504.03	18.21	193,962.56	18.17	-
兴业证券	1	145,255,780.58	11.16	118,562.79	11.11	-
招商证券	1	83,542,078.60	6.42	67,912.21	6.36	-
华西证券	1	70,496,150.03	5.42	57,896.26	5.42	-
海通证券	1	37,926,971.98	2.91	31,149.02	2.92	-
国泰君安	2	35,815,460.06	2.75	32,958.08	3.09	-
华泰证券	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

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 & 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。

## 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
中信建投证券	4,876,900.00	0.38	56,916,700.00	31.07	-	-
中金公司	10,604,395.00	0.83	39,887,900.00	21.78	-	-
广发证券	-	-	39,950,000.00	21.81	-	-
兴业证券	292,000.00	0.02	11,269,000.00	6.15	-	-
招商证券	12,125,005.50	0.94	6,500,000.00	3.55	-	-
华西证券	3,519,897.90	0.27	15,413,000.00	8.41	-	-
海通证券	-	-	4,630,300.00	2.53	-	-
国泰君安	1,251,788.950.00	97.55	8,600,000.00	4.70	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	鹏华基金管理有限公司关于暂停客服电话服务的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会	2022年01月01日

		基金电子披露网站	
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	《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	2022 年 01 月 01 日
3	关于鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金已完成第三次股权交割事项的公告	《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	2022 年 01 月 01 日
4	鹏华基金管理有限公司关于鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金 2022 年第 1 次分红公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 01 月 12 日
5	鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金 2021 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	2022 年 01 月 21 日
6	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	2022 年 01 月 21 日
7	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	《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	2022 年 01 月 24 日
8	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	《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	2022 年 02 月 10 日
9	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	《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	2022 年 02 月 21 日
10	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	《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	2022 年 03 月 01 日
11	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	《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	2022 年 03 月 08 日
12	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	《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	2022 年 03 月 14 日
13	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	《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	2022 年 03 月 15 日

14	鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金 2021 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	2022 年 03 月 30 日
15	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	《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	2022 年 04 月 19 日
16	鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金 2022 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	2022 年 04 月 21 日
17	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	《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	2022 年 04 月 21 日
18	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	《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	2022 年 04 月 25 日
19	鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金收到关于深圳市万科前海公馆建设管理股份有限公司 2021 年度业绩补偿款的公告	《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	2022 年 04 月 26 日
20	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	2022 年 04 月 27 日
21	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	《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	2022 年 04 月 28 日
22	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	2022 年 04 月 30 日
23	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	《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	2022 年 05 月 06 日
24	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	《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	2022 年 05 月 13 日
25	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	《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	2022 年 05 月 30 日
26	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	《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	2022 年 06 月 06 日

27	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	《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	2022年06月18日
28	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	2022年07月06日
29	鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金更新的招募说明书	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022年07月12日
30	鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金基金产品资料概要（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	2022年07月12日
31	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购隆达股份首次公开发行 A 股的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022年07月15日
32	鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金关于深惠城际轨道建设进展的公告	《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	2022年07月15日
33	鹏华基金管理有限公司关于暂停喜鹊财富基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022年07月15日
34	鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金 2022 年第 2 季度报告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022年07月20日
35	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与西南证券股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022年07月25日
36	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	2022年08月04日
37	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与长城证券股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022年08月04日
38	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购凯格精机首次公开发行 A 股的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022年08月10日
39	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	2022年08月11日
40	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购路维光电首次公开发行 A 股的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022年08月12日

41	鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金 2022 年中期报告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 08 月 30 日
42	鹏华基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 09 月 07 日
43	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购唯万密封首次公开发行 A 股的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 09 月 08 日
44	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购永信至诚首次公开发行 A 股的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 10 月 14 日
45	鹏华基金管理有限公司关于运用固有资金投资旗下基金的公告	《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	2022 年 10 月 18 日
46	鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金 2022 年第 3 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	2022 年 10 月 25 日
47	鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金基金经理变更公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 11 月 25 日
48	鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金基金产品资料概要（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	2022 年 11 月 30 日
49	鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金更新的招募说明书（2022 年第 1 号）	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 11 月 30 日
50	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	2022 年 12 月 10 日
51	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	2022 年 12 月 14 日
52	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与华泰证券股份有限公司认/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	2022 年 12 月 15 日
53	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与渤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	2022 年 12 月 31 日
54	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与西部证券股份有限公司申购（含定期定额投资）费率优惠活动的	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 12 月 31 日



	公告		
55	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国工商银行股份有限公司个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 12 月 31 日
56	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国工商银行股份有限公司“2023 倾心回馈”基金定期定额申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 12 月 31 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)《鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金基金合同》；
- (二)《鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金托管协议》；
- (三)《鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金 2022 年年度报告》(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 3 月 30 日