

鹏华优质企业混合型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 1 月 21 日

§ 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 01 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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 2021 年 10 月 01 日起至 2021 年 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	鹏华优质企业混合
基金主代码	009234
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 6 月 11 日
报告期末基金份额总额	368,608,510.65 份
投资目标	在严格控制风险的前提下，本基金通过对不同资产类别的动态配置和优质企业的个股精选，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	1、资产配置策略 本基金将通过跟踪考量通常的宏观经济变量（包括 GDP 增长率、CPI 走势、M2 的绝对水平和增长率、利率水平与走势等）以及各项国家政策（包括财政、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，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。 2、股票投资策略 本基金所称的优质企业通常具备两方面的特征。第一，优质行业，即企业所处的行业成长确定性较强或发展潜力较高；第二，优质公司，是指企业具备区别于对手的竞争优势、其提供的产品或服务具备良好的应用场景、企业盈利质量优于多数同类企业、现金流及财务状况良好等。 （1）自上而下的行业遴选 优质企业所处行业的发展阶段及未来发展空间，将决定该企业未来发展的空间和方向，行业处于确定性成长期及具备较强的发展潜力是优质企业所需具备的行业品质。本基金将在考虑行业生命周期、宏观经济周期不同阶段的行业景气程度以及资本市场行业轮动规律的基础上，结合当前中国经济和资本市

市场特征，自上而下地进行行业遴选，重点关注行业增长与行业利润等方面具有长期增长潜力的行业。对行业增长方面，主要分析行业的外部发展环境、行业生命周期以及行业波动与经济周期的关系等；对行业利润方面，主要分析行业结构，尤其是业内竞争的方式、业内竞争的激烈程度、行业议价能力等对利润影响较大的因素。同时，本基金将根据市场环境的变化，及时对行业配置进行动态调整。

(2) 自下而上的个股选择 本基金将在行业选择的基础上，充分发挥基金管理人研究团队“自下而上”的主动选股能力，通过定性及定量的方法，对企业进行全面深入的研究、精选具备核心优势且成长性良好的优质企业进行投资，并根据市场波动情况进行动态调整。

1) 定性分析 治理结构良好、经营管理能力突出。具体体现在：管理层是否专业、正直、诚实和勤奋；公司治理结构是否完善、信息是否透明；公司的战略规划是否理性、符合公司长远利益；公司组织能力是否高效；公司业务流程是否规范等。公司在行业内具备区别于竞争对手的优势。企业的竞争优势一般是指在产品定价能力、技术创新、品牌价值、销售渠道、服务品质、市场占有率等方面具备一个或多个方面的突出优势，这使得公司在所处行业中具备较强的核心竞争力。这类公司在经济增长时能创造持续性的成长，经济不振时亦能度过难关，享有高于行业长期平均水平的盈利能力。公司提供的产品或服务具备持续应用的场景。为客户创造价值是公司提供产品或服务的目的，是公司实现自身价值的工具，而实现的载体即为不同的应用场景。我们将评估新进入者的威胁、替代品的威胁，考察公司提供产品或服务的场景是否具备持续型。

2) 定量分析 盈利水平较高，公司能够为股东创造可观的回报。ROE 反映的是单位权益资本产出的利润回报，较高的 ROE 水平往往伴随着较高的利润率或者高速的资产周转，体现了企业通过实体经济创造财富的优秀能力。具体而言，我们要求备选投资企业拥有较高的加权摊薄 ROE，同时，也将重点考察主营业务收入、盈利波动程度等指标。现金流情况良好，财务状况稳健。优质企业往往能够通过产生充沛自由的现金流，实现公司净资产的增厚，并伴随复利效应，股东权益规模持续扩大。具体的，我们要求备选投资企业的年度经营性现金流净额必须为正，且保持较为合理的资产负债水平。估值水平合理。本基金考察企业贴现现金流以及内在价值贴现，结合市盈率（市值/净利润）、市净率（市值/净资产）、市销率（市值/营业收入）等指标衡量股价是否处于合理的估值区间，并且基于公司所属的不同行业，采取不同的估值方法，以此寻找不同行业股票的合理价格区间，并进行动态调整。本基金投资港股通标的股票时，除了适用上述个股投资策略外，本基金还将关注：1) 具有行业稀缺性的香港本地和外资公司；2) 在港股市场上市、具有行业代表性的优质中资公司；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。

(3) 存托凭证投资策略 本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。

3、债券投资策略 本基金债券投资将采取久期策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、个券选择策略、信用策略等积极投资策略，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。 4、股指期货投资策略 本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目标，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，充分考虑股指期货的风险收益特征，通过多头或空头的套期保值策略，以改善投资组合的投资效果，实现股票组合的超额收益。 5、资产支持证券的投资策略 本基金将综合运用战略资产配置和战术资产配置进行资产支持证券的投资组合管理，并根据信用风险、利率风险和流动性风险变化积极调整投资策略，严格遵守法律法规和基金合同的约定，在保证本金安全和基金资产流动性的基础上获得稳定收益。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+恒生指数收益率×10%(经汇率估值调整)+中证综合债指数收益率×30%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。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。
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司

注：无。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2021 年 10 月 1 日-2021 年 12 月 31 日）
1. 本期已实现收益	34,967,570.24
2. 本期利润	16,159,332.12
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0412
4. 期末基金资产净值	510,094,042.46
5. 期末基金份额净值	1.3838

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

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

3.2 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

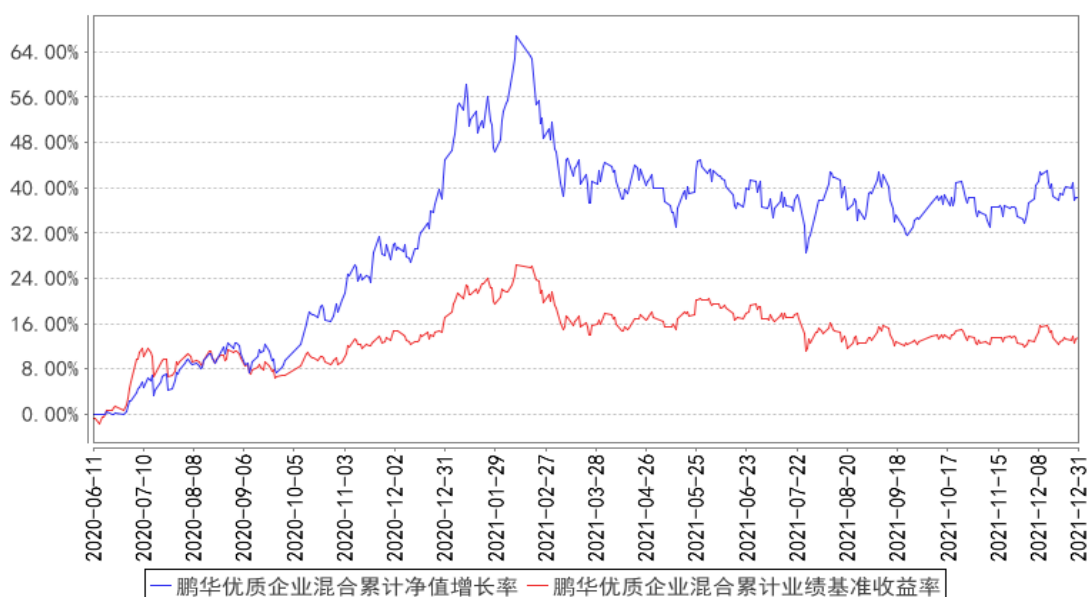
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标	①—③	②—④
----	------------	---------------	----------------	----------------	-----	-----

				准差④		
过去三个月	2.83%	0.97%	0.66%	0.53%	2.17%	0.44%
过去六个月	-1.30%	1.22%	-4.45%	0.70%	3.15%	0.52%
过去一年	-4.49%	1.42%	-2.99%	0.78%	-1.50%	0.64%
自基金合同 生效起至今	38.38%	1.32%	13.63%	0.81%	24.75%	0.51%

注：业绩比较基准=沪深 300 指数收益率×60%+恒生指数收益率×10%（经汇率估值调整）+中证综合债指数收益率×30%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

鹏华优质企业混合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 06 月 11 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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
袁航	基金经理	2020-06-11	-	12 年	袁航先生，国籍中国，经济学硕士，12

				<p>年证券从业经验。2009 年 6 月加盟鹏华基金管理有限公司，从事行业研究及投资助理相关工作，担任研究部资深研究员、投资经理助理，现任权益投资一部副总经理、基金经理。2014 年 11 月至今担任鹏华先进制造股票型证券投资基金基金经理，2015 年 02 月至 2017 年 02 月担任鹏华弘盛灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015 年 04 月至 2017 年 02 月担任鹏华弘泽灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015 年 05 月至 2017 年 02 月担任鹏华弘信灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015 年 05 月至 2017 年 02 月担任鹏华弘实灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015 年 06 月至 2017 年 09 月担任鹏华弘锐灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015 年 08 月至今担任鹏华策略优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2018 年 05 月至 2019 年 12 月担任鹏华产业精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2019 年 12 月至 2021 年 01 月担任鹏华改革红利股票型证券投资基金基金经理，2020 年 06 月至今担任鹏华优质企业混合型证券投资基金基金经理，2021 年 02 月至今担任鹏华品质优选混合型证券投资基金基金经理，2021 年 05 月至今担任鹏华鑫远价值一年持有期混合型证券投资基金基金经理，2021 年 08 月至今担任鹏华品质成长混合型证券投资基金基金经理，袁航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。

4.1.1 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遵规守信情况的说明

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

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

4.3 公平交易专项说明

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、分配各环节得到公平对待。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内，组合构建的核心目标并未发生改变，即追求风险调整后的长期收益最大化。围绕这一核心目标，组合开展了以下几个方面的工作：包括优选高品质企业、寻找高质量增长、构建安全边际、回避重大不确定性和泡沫化估值，组合通过中长期持有具备潜在上行空间的股票，实现基金资产的保值增值。

站在 2022 年的年初，我们的判断和前期相类似，目前市场上存在着这么两类投资标的，一类标的，短期是机会，中长期是风险；另一类标的，短期可能是风险，中长期却是机会。组合将毫不迟疑地把主要精力放在后一类投资标的的研究上，通过审慎分析、合理推断、低估价格买入、耐心持有的方式，获取中长期的收益，可能这一选择在短周期内会面临挑战，但我们相信，长期坚持做正确的事情，有助于我们把握更确定、更充分的机遇，最终会让我们领略到投资路上的怡人风景。报告期内，基金经理对组合结构进行了小幅的优化调整，增持了银行、家电；四季度末，组合持仓主要集中在金融、消费品以及制造业，总体风格和前期相比没有发生显著变化。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期份额净值增长率为 2.83%，同期业绩比较基准增长率为 0.66%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	472,164,982.35	92.06
	其中：股票	472,164,982.35	92.06
2	基金投资	-	-
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	40,416,760.44	7.88
8	其他资产	302,193.61	0.06
9	合计	512,883,936.40	100.00

注：本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 73,160,941.05 元，占净值比 14.34%。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	252,139,672.21	49.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	11,519.99	0.00
F	批发和零售业	252,604.70	0.05
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,277,209.04	0.45
J	金融业	143,322,215.20	28.10
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	593,892.67	0.12
N	水利、环境和公共设施管理业	355,935.77	0.07
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	46,383.72	0.01

S	综合	-	-
	合计	399,004,041.30	78.22

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
能源	-	-
原材料	-	-
工业	13,038,021.92	2.56
非日常生活消费品	20,861,407.39	4.09
日常消费品	-	-
医疗保健	-	-
金融	34,219,536.06	6.71
信息技术	-	-
通信服务	5,041,975.68	0.99
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	73,160,941.05	14.34

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	600036	招商银行	998,359	48,630,066.89	9.53
2	000001	平安银行	2,822,800	46,519,744.00	9.12
3	600690	海尔智家	1,466,803	43,842,741.67	8.60
4	600887	伊利股份	1,056,886	43,818,493.56	8.59
5	600519	贵州茅台	19,300	39,565,000.00	7.76
6	601658	邮储银行	5,233,600	26,691,360.00	5.23
6	01658	邮储银行	2,276,000	10,178,891.07	2.00
7	000333	美的集团	460,700	34,004,267.00	6.67
8	002311	海大集团	443,400	32,501,220.00	6.37
9	600031	三一重工	1,091,072	24,876,441.60	4.88
10	02328	中国财险	4,616,000	24,040,644.99	4.71

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：无。

5.5 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债券投资明细

注：无。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资

明细

注：无。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

注：无。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：无。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目标，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，充分考虑股指期货的风险收益特征，通过多头或空头的套期保值策略，以改善投资组合的投资效果，实现股票组合的超额收益。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本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

平安银行股份有限公司

2021 年 5 月 18 日，中国银行保险监督管理委员会深圳监管局针对平安银行股份有限公司信用卡中心未对申领首张信用卡的客户进行亲访亲签的违法违规行为，对公司罚款 40 万元。

2021 年 9 月 29 日，国家外汇管理局深圳市分局针对平安银行股份有限公司 1. 违规办理转口贸易收付汇 2. 违规办理个人财产对外转移 3. 违规办理个人结售汇业务 4. 违规为境外个人购买境内理财产品 5. 未按规定进行国际收支统计申报 6. 未按照规定报送财务会计报告、统计报告的等资料 7. 违反外汇登记管理规定 8. 违规开展外汇市场交易的违法违规行为，对公司决定责令改正、给予警告，处罚款人民币 187 万元，没收违法所得 1.58 万元。

2021 年 5 月 10 日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局针对平安银行股份有限公司资金运营中心 1. 2016 年 5 月，该中心违规向未取得土地使用权证的房地产项目提供融资。2. 2017 年 3 月，该中心违规向土地储备项目提供融资。3. 2017 年 3 月，该中心违规提供政府性融资。4. 2016 年 5 月至 2018 年 5 月，该中心黄金份额租赁款违规用于证券交易所股票质押回购。5. 2018 年 1 月，该中心虚增存款。6. 2016 年 1 月至 2019 年 8 月，该中心向黄金产业链外企业提供实物黄金租赁的违法违规行为，对公司责令改正，并处罚款共计 300 万元。

2021 年 5 月 28 日，中国银行保险监督管理委员会云南监管局针对平安银行股份有限公司利用来源于本行授信的固定资产贷款和黄金租赁融资的资金发放委托贷款，用于承接处置本行其他贷款风险；固定资产授信严重不审慎，贷款用途审查监控不到位，贷款资金挪用于借款人母公司归还股票质押融资；流动资金贷款用途审查监控不到位，贷款资金部分回流借款人用作银行承兑汇票质押存单；固定资产贷款用途审查监控不到位，贷款资金部分回流借款人或借款人关联公司用作银行承兑汇票保证金、购买理财产品的违法违规行为，对公司罚款人民币 210 万元。

招商银行股份有限公司

2021 年 5 月 17 日，中国银行保险监督管理委员会针对招商银行股份有限公司的如下的违法违规行为，依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十五条、第四十六条和相关审慎经营规则，处罚款 7170 万元。 主要违法行为： 一、为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产 二、违规协助无衍生产品交易业务资格的银行发行结构性衍生产品 三、理财产品之间风险隔离不到位 四、理财资金投资非标准化债权资产认定不准确，实际余额超监管标准 五、同业投资接受第三方金融机构信用担保 六、理财资金池化运作 七、利用理财产品准备金调节收益 八、高净值客户认定不审慎 九、并表管理不到位，通过关联非银机构的内部交易，违规变相降低理财产品销售门槛 十、投资集合资金信托计划的理财产品未执行合格投资者标准 十一、投资集合资金信托计划人数超限 十二、面向不合格个人投资者销售投资高风险资产或权益性资产的理财产品 十三、信贷资产非真

实转让 十四、全权委托业务不规范 十五、未按要求向监管机构报告理财投资合作机构，被监管否决后仍未及时停办业务 十六、通过关联机构引入非合格投资者，受让以本行信用卡债权设立的信托次级受益权 十七、“智能投资受托计划业务”通过其他方式规避整改，扩大业务规模，且业务数据和材料缺失 十八、票据转贴现假卖断屡查屡犯 十九、贷款、理财或同业投资资金违规投向土地储备项目 二十、理财资金违规提供棚改项目资本金融资，向地方政府提供融资并要求地方政府提供担保 二十一、同业投资、理财资金等违规投向地价款或四证不全的房地产项目 二十二、理财资金认购商业银行增发的股票 二十三、违规为企业发行短期融资券提供搭桥融资，并用理财产品投资本行主承债券以承接表内类信贷资产 二十四、为定制公募基金提供投资顾问 二十五、为本行承销债券兑付提供资金支持 二十六、协助发行人以非市场化的价格发行债券 二十七、瞒报案件信息

2021 年 11 月 18 日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局针对招商银行信用卡中心的主要违法违规事实：未按照保险公司提供的销售合同条款全面、客观揭示所代销保险产品风险，依据《中国银保监会关于规范商业银行代理销售业务的通知》（银监发〔2016〕24 号）第二十四条、《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条及第四十六条责令改正，并处罚款 20 万元。

招商银行股份有限公司上海分行

2021 年 8 月 23 日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局针对招商银行股份有限公司上海分行的主要违法违规事实：2020 年 7 月至 10 月，该分行及长阳支行部分个人贷款变相用于购房，依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第（五）项、《个人贷款管理暂行办法》第四十二条第（七）项责令改正，并处罚款 75 万元。

2021 年 7 月 19 日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局针对招商银行股份有限公司上海分行的主要违法违规事实：2019 年 12 月，该分行部分流动资金贷款违规流入房地产市场，依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第（五）项、《流动资金贷款管理暂行办法》第三十九条第（四）项责令改正，并处罚款 100 万元。

中国人民财产保险股份有限公司

2021 年 8 月 25 日，中国银行保险监督管理委员会针对中国人民财产保险股份有限公司 1、修改后的保险条款和保险费率经批准或者备案后，在新订立的保险合同中使用原保险条款和保险费率；2、未严格执行经中国银保监会批准或者备案的保险费率；3、未严格执行经中国银保监会批准或者备案的保险条款的违法违规行为，对公司罚款 50 万元。

中国邮政储蓄银行股份有限公司

2021 年 8 月 13 日，中国人民银行针对中国邮政储蓄银行股份有限公司违反账户管理相关规定的违法违规行为，对公司警告，并处罚款 600 万元。

2021 年 11 月 9 日，国家外汇管理局北京外汇管理部针对中国邮政储蓄银行股份有限公司办理经常项目资金收付，未对交易单证的真实性及其与外汇收支的一致性进行合理审查的；违反规定办理资本项目资金收付；违反规定办理结汇、售汇业务；违反外汇市场交易管理；未按照规定进行国际收支统计申报；未按照规定报送财务会计报告、统计报表等资料的违法违规行为，对公司给予警告，没收违法所得 673625.55 元人民币，并处 444 万元人民币罚款。

2021 年 6 月 22 日，中国银行保险监督管理委员会针对中国邮政储蓄银行股份有限公司一、违规向部分客户收取唯一账户年费和小额账户管理费二、未经客户同意违规办理短信收费业务三、信息系统相关功能在开发、投产、维护、后评估等方面存在缺陷及不足四、向监管机构报送材料内容不实五、未在监管要求时限内报送材料六、未按监管要求提供保存业务办理相关凭证的违法违规行为，对公司没收违法所得 11.401116 万元，罚款 437.677425 万元，罚没合计 449.078541 万元。

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。

5.11.2 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

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	65,477.01
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,094.85
5	应收申购款	228,621.75
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	302,193.61

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

5.11.6 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。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	407,203,500.62
报告期期间基金总申购份额	24,368,443.60
减：报告期期间基金总赎回份额	62,963,433.57
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	368,608,510.65

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：无。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- （一）《鹏华优质企业混合型证券投资基金基金合同》；
- （二）《鹏华优质企业混合型证券投资基金托管协议》；
- （三）《鹏华优质企业混合型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告》（原文）。

9.2 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。

9.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅，也可按工本费购买复印件，或通过本基金管理人网站（<http://www.phfund.com.cn>）查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人鹏华基金管理有限公司，本公司已开通客户服务系统，咨询电话：4006788999。

鹏华基金管理有限公司

2022 年 1 月 21 日