

鹏华精选回报三年定期开放混合型证券投资
基金
2022 年第 3 季度报告

2022 年 9 月 30 日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 10 月 25 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 10 月 24 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 2022 年 07 月 01 日起至 2022 年 09 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	鹏华精选回报三年定开混合
场内简称	鹏华精选回报定开
基金主代码	160645
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2019 年 6 月 25 日
报告期末基金份额总额	59,657,677.98 份
投资目标	在有效控制风险的前提下,通过对不同资产类别的动态配置和个股精选,力争获取超额收益,追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	在大类资产配置的基础上,本基金将贯彻价值投资的理念,采用自上而下和自下而上相结合的方法,通过分析行业前景、行业结构、企业的核心竞争力、管理层、治理结构等把握其投资机会,在深入的基本面分析和估值研判的基础上,精选具备核心竞争优势和持续发展潜力的企业,分享企业成长的成果,以期获得超越业绩比较基准的回报。 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,在此基础上分析研判 A 股市场以及港股市场、债券市场、货币市场的预期收益与风险,并据此进行大类资产的配置与组合构建,合理确定本基金在股票(包括 A 股和港股)、债券、现金等金融工具上的投资比例,并随着各类资产风险收益特征的相对变化,适时动态地调整各资产投资比例。 2、股票投资策略 本基金通过自上而下及自下而上相结合的

方法挖掘 A 股和港股的优质公司,构建股票投资组合。核心思路在于:

1) 自上而下地分析行业的增长前景、行业结构、商业模式、竞争要素等分析把握其投资机会; 2) 自下而上地评判企业的核心竞争力、管理层、治理结构等以及其所提供的产品和服务是否契合未来行业增长的大趋势,对企业基本面和估值水平进行综合的研判,深度挖掘优质的个股。

(1) 自上而下的行业遴选 本基金将自上而下地进行行业遴选,重点关注行业增长前景、行业利润前景和行业成功要素。对行业增长前景,主要分析行业的外部发展环境、行业的生命周期以及行业波动与经济周期的关系等;对行业利润前景,主要分析行业结构,特别是业内竞争的方式、业内竞争的激烈程度、以及业内厂商的谈判能力等。基于对行业结构的分析形成对业内竞争的关键成功要素的判断,为预测企业经营环境的变化建立起扎实的基础。

(2) 自下而上的个股选择 本基金通过定性和定量相结合的方法进行自下而上的个股选择,对企业基本面和估值水平进行综合的研判,精选优质个股。

1) 定性分析 本基金通过以下两方面标准对股票的基本面进行研究分析并筛选出优质的公司: 一方面是竞争力分析,通过对公司竞争策略和核心竞争力的分析,选择具有可持续竞争优势的公司或未来具有广阔成长空间的公司。就公司竞争策略,基于行业分析的结果判断策略的有效性、策略的实施支持和策略的执行成果;就核心竞争力,分析公司的现有核心竞争力,并判断公司能否利用现有的资源、能力和定位取得可持续竞争优势。 另一方面是管理层分析,通过着重考察公司的管理层以及管理制度,选择具有良好治理结构、管理水平较高的优质公司。

2) 定量分析 本基金通过对公司定量的估值分析,挖掘优质的投资标的。通过对估值方法的选择和估值倍数的比较,选择股价相对低估的股票。就估值方法而言,基于行业的特点确定对股价最有影响力的关键估值方法(包括 PE、PEG、PB、PS、EV/EBITDA 等);就估值倍数而言,通过业内比较、历史比较和增长性分析,确定具有上升基础的股价水平。

(3) 港股通标的股票投资策略 本基金还将关注以下几类港股通标的股票: 1) 在港股市场上市、具有行业代表性的优质中资公司; 2) 具有行业稀缺性的香港本地和外资公司; 3) 港股市场在行业结构、估值、AH 股折溢价、分红率等方面具有吸引力的投资标的。

(4) 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。

(1) 久期策略 久期管理是债券投资的重要考量因素,本基金将采用以“目标久期”为中心、自上而下的组合久期管理策略。

(2) 收益率曲线策略 收益率曲线的形状变化是判断市场整体走向的一个重要依据,本基金将据此调整组合长、中、短期债券的搭配,并进行动态调整。

(3) 骑乘策略 本基金将采用基于收益率曲线分析对债券组合进行适时调整的骑乘策略,以达到增强组合的持有期收益的目的。

(4) 息差策略 本基金将采用息

	<p>差策略,以达到更好地利用杠杆放大债券投资的收益的目的。(5) 个券选择策略 本基金将根据单个债券到期收益率相对于市场收益率曲线的偏离程度,结合信用等级、流动性、选择权条款、税赋特点等因素,确定其投资价值,选择定价合理或价值被低估的债券进行投资。(6) 信用策略 本基金通过主动承担适度的信用风险来获取信用溢价,根据内、外部信用评级结果,结合对类似债券信用利差的分析以及对未来信用利差走势的判断,选择信用利差被高估、未来信用利差可能下降的信用债进行投资。</p> <p>4、权证投资策略 本基金通过对权证标的证券基本面的研究,并结合权证定价模型及价值挖掘策略、价差策略、双向权证策略等寻求权证的合理估值水平,追求稳定的当期收益。</p> <p>5、中小企业私募债投资策略 中小企业私募债券是在中国境内以非公开方式发行和转让,约定在一定期限还本付息的公司债券。由于其非公开性及条款可协商性,普遍具有较高收益。本基金将深入研究发行人资信及公司运营情况,合理合规合格地进行中小企业私募债券投资。本基金在投资过程中密切监控债券信用等级或发行人信用等级变化情况,尽力规避风险,并获取超额收益。</p> <p>6、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。</p> <p>7、资产支持证券的投资策略 本基金将综合运用战略资产配置和战术资产配置进行资产支持证券的投资组合管理,并根据信用风险、利率风险和流动性风险变化积极调整投资策略,严格遵守法律法规和基金合同的约定,在保证本金安全和基金资产流动性的基础上获得稳定收益。</p> <p>8、开放期投资策略 本基金以定期开放方式运作,即采取在封闭期内封闭运作、封闭期与封闭期之间定期开放的运作方式。开放期内,基金规模将随着投资人对本基金份额的申购与赎回而不断变化。本基金在开放期将重点关注基金资产的流动性和变现能力,保持资产适当的流动性,以应付当时市场条件下的赎回申请,防范流动性风险,满足开放期流动性需求。未来,如果港股通业务规则发生变化或出现法律法规或监管部门允许投资的其他模式,基金管理人在履行适当程序后可相应调整。未来,随着证券市场投资工具的发展和丰富,本基金可相应调整和更新相关投资策略,并在招募说明书中更新公告。</p>
业绩比较基准	$\text{沪深 300 指数收益率} \times 60\% + \text{恒生指数收益率(经汇率调整后)} \times 20\% + \text{中证综合债指数收益率} \times 20\%$
风险收益特征	<p>本基金属于混合型基金,其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金,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。</p>
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

注:无。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

第 4 页 共 14 页

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2022 年 7 月 1 日-2022 年 9 月 30 日）
1. 本期已实现收益	-3,507,900.43
2. 本期利润	-15,658,973.85
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.2517
4. 期末基金资产净值	77,618,836.83
5. 期末基金份额净值	1.3011

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

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

3.2 基金净值表现

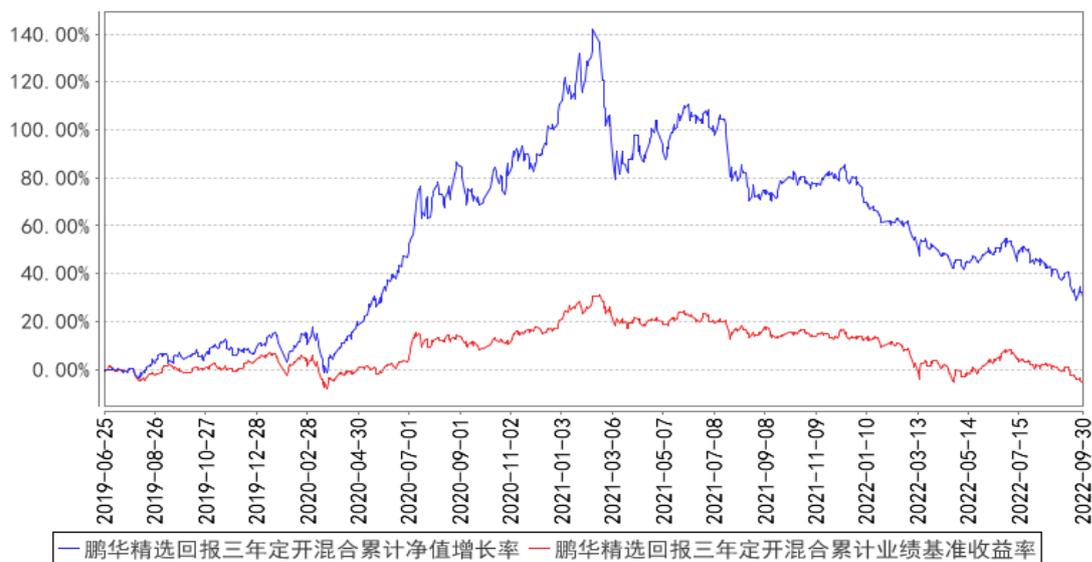
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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 准差④	①-③	②-④
过去三个月	-15.97%	1.17%	-12.30%	0.74%	-3.67%	0.43%
过去六个月	-14.14%	1.06%	-7.86%	0.96%	-6.28%	0.10%
过去一年	-27.01%	0.99%	-17.12%	0.97%	-9.89%	0.02%
过去三年	24.63%	1.50%	-4.20%	0.98%	28.83%	0.52%
自基金合同 生效起至今	30.11%	1.45%	-5.39%	0.96%	35.50%	0.49%

注：业绩比较基准=沪深 300 指数收益率×60%+恒生指数收益率（经汇率调整后）×20%+中证综合债指数收益率×20%

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

鹏华精选回报三年定开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 2019 年 06 月 25 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		
王宗合	基金经理	2019-06-25	-	16 年	王宗合先生，国籍中国，金融学硕士，16 年证券从业经验。曾任职于招商基金从事食品饮料、商业零售、农林牧渔、纺织服装、汽车等行业的研究。2009 年 5 月加盟鹏华基金管理有限公司，从事食品饮料、农林牧渔、商业零售、造纸包装等行业的研究工作，担任鹏华动力增长混合（LOF）基金基金经理助理。现担任公司副总裁/权益投资二部总经理/稳定收益投资部总经理，投资决策委员会成员。2010 年 12 月至今担任鹏华消费优选混合型证券投资基金基金经理，2012 年 06 月至 2018 年 07 月担任鹏华金刚保本混合型证券投资基金基金经理，2014 年 07 月至 2019 年 04 月担任鹏华品牌传承灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2014 年

				<p>12 月至今担任鹏华养老产业股票型证券投资基金基金经理, 2016 年 04 月至 2018 年 10 月担任鹏华金鼎保本混合型证券投资基金基金经理, 2016 年 06 月至 2019 年 06 月担任鹏华金城保本混合型证券投资基金基金经理, 2017 年 02 月至 2019 年 09 月担任鹏华安益增强混合型证券投资基金基金经理, 2017 年 07 月至今担任鹏华中国 50 开放式证券投资基金基金经理, 2017 年 09 月至 2020 年 08 月担任鹏华策略回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2018 年 05 月至今担任鹏华产业精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2018 年 07 月至 2019 年 09 月担任鹏华宏观灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2018 年 10 月至 2019 年 09 月担任鹏华金鼎灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2019 年 01 月至 2020 年 02 月担任鹏华优选回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2019 年 06 月至 2019 年 06 月担任鹏华金城灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2019 年 06 月至今担任鹏华精选回报三年定期开放混合型证券投资基金基金经理, 2020 年 02 月至今担任鹏华优质回报两年定期开放混合型证券投资基金基金经理, 2020 年 04 月至今担任鹏华价值共赢两年持有期混合型证券投资基金基金经理, 2020 年 05 月至今担任鹏华成长价值混合型证券投资基金基金经理, 2020 年 07 月至今担任鹏华匠心精选混合型证券投资基金基金经理, 2020 年 09 月至今担任鹏华创新未来 18 个月封闭运作混合型证券投资基金基金经理, 王宗合先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理发生变动, 增聘王云鹏为本基金基金经理。</p>
王云鹏	基金经理	2022-09-23	-	<p>5 年</p> <p>王云鹏先生, 国籍中国, 工程硕士, 5 年证券从业经验。2017 年 6 月加盟鹏华基金管理有限公司, 历任研究部研究员、高级研究员, 现任职于权益投资二部, 从事投研相关工作。2022 年 09 月至今担任鹏华中国 50 开放式证券投资基金基金经理, 2022 年 09 月至今担任鹏华精选回报三年定期开放混合型证券投资基金基金经理, 王云鹏先生具备基金从业资格。本</p>

					报告期内本基金基金经理发生变动,增聘王云鹏为本基金基金经理。
--	--	--	--	--	--------------------------------

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

2. 证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

4.1.1 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、分配等各环节得到公平对待。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

在经过二季度的反弹以后,三季度市场出现了较大程度的下跌,尤其是后半段时间市场比较低迷。我们分析这种低迷背后的原因有几个方面:一、疫情的不断反复,对整个需求造成了比较大的影响,整个消费需求不振,进而导致相关公司及产业链今年都处于相对低迷的状态。宏观经济受疫情的影响、需求的拖累也是比较大的,使得市场预期发生了一些变化。二、俄乌冲突带来的资源品价格高位波动。以欧洲的天然气价格为主,包括全球的煤炭价格、国内的煤炭价格、一些资源品的价格,都处于相对高位,导致很多产业的成本居高不下。三、过去几年以美国为代表的经济体在持续放水,带来了目前的高通胀。国外持续的高通胀给整个经济前景,包括未来的货币政策带来了非常大的预期上的变化。这些变化也影响到国内的一些风险资产的估值水平,以及

大家对明年全球经济的信心。三季度全球主要股票市场都处于一种下跌的状态，国内的资本市场亦然。

尽管国内宏观经济的长期基本面稳中向好，但是阶段性的、周期性的因素、疫情反复导致的因素，让我们短期的宏观经济面临着一些挑战。房地产行业处于一种出清的状态，地产产业链表现非常低迷，再叠加疫情带来的消费不振，导致目前宏观经济短期面临着增长乏力的挑战。这些挑战在微观产业层面体现得越来越深化，无论是消费还是传统制造类的企业都会感受到一些压力。也有相对比较好的细分产业，今年主要体现在新能源汽车、新能源、以及上游的资源品等领域。新能源汽车的产销、光伏、风电、煤炭等产业本身的发展趋势不错，但市场上大家的预期也处于较高位置，所以在风险偏好下降的过程中它们的波动也较大。

在此过程中，一些优秀的公司也会受到这种情绪的影响，估值出现系统性的回落。但是，尽管这些公司短期的增长有一些不确定性，但估值确实慢慢在进入到一个比较合理甚至比较低估的层面上，所以说我们对长期的展望并不悲观。在这种市场低迷的时候，我们主要的精力还是放在去寻找一些长期成长性比较好的公司上。当然，组合管理上也迎来了更多的挑战，核心体现在：在全球经济变化的背景下，中美逐渐走向高科技产业脱钩，很多产业未来发展的外在产业环境发生着深刻的变化，这或将会导致一些优秀的公司在将来的发展过程中面临更多挑战，甚至这种挑战最终会转化成风险。也有一些企业会在这种产业环境变化的过程中把握机遇，将来成长得更优秀。我们会在挑战中，努力挖掘出这些能把握时代机遇的优秀公司，为投资人创造回报。

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-15.97%，同期业绩比较基准增长率为-12.30%。

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	64,066,096.66	82.23
	其中：股票	64,066,096.66	82.23
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	113,409.24	0.15
	其中：债券	113,409.24	0.15
	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	11,780,356.95	15.12
8	其他资产	1,948,458.54	2.50
9	合计	77,908,321.39	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 11,506,225.26 元，占净值比 14.82%。

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	42,204,029.62	54.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	14,295.54	0.02
E	建筑业	5,529.07	0.01
F	批发和零售业	22,419.60	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	16,969.40	0.02
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,659,666.56	3.43
J	金融业	1,860,629.70	2.40
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	18,238.46	0.02
M	科学研究和技术服务业	44,785.61	0.06
N	水利、环境和公共设施管理业	191,078.30	0.25
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	5,522,229.54	7.11
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	52,559,871.40	67.72

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	-	-
非日常生活消费品	6,877,081.02	8.86

日常消费品	-	-
医疗保健	-	-
金融	-	-
信息技术	-	-
通信服务	4,629,144.24	5.96
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	11,506,225.26	14.82

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	600809	山西汾酒	26,260	7,953,891.40	10.25
2	603606	东方电缆	101,500	7,077,595.00	9.12
3	300896	爱美客	14,380	7,050,801.60	9.08
4	03690	美团-W	45,916	6,877,081.02	8.86
5	300015	爱尔眼科	191,848	5,500,282.16	7.09
6	01024	快手-W	100,200	4,617,338.04	5.95
7	300957	贝泰妮	25,800	4,438,374.00	5.72
8	600519	贵州茅台	1,756	3,288,110.00	4.24
9	603806	福斯特	41,860	2,226,952.00	2.87
10	002142	宁波银行	58,974	1,860,629.70	2.40

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	113,409.24	0.15
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	113,409.24	0.15

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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	128136	立讯转债	1,020	113,409.24	0.15

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

宁波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宁波监管局的处罚。

美团在报告编制日前一年内受到国家市场监督管理总局的处罚。

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。

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	48,463.29
2	应收证券清算款	1,899,995.25
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,948,458.54

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	128136	立讯转债	113,409.24	0.15

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	98,705,326.84
报告期期间基金总申购份额	260,701.88
减：报告期期间基金总赎回份额	39,308,350.74
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	59,657,677.98

§ 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) 《鹏华精选回报三年定期开放混合型证券投资基金基金合同》；
- (二) 《鹏华精选回报三年定期开放混合型证券投资基金托管协议》；
- (三) 《鹏华精选回报三年定期开放混合型证券投资基金 2022 年第 3 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 10 月 25 日