

鹏华金鼎保本混合型证券投资基金 2018 年半年度报告摘要

2018 年 06 月 30 日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2018 年 08 月 27 日

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。本半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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日。

基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	鹏华金鼎保本混合	
场内简称	-	
基金主代码	002504	
前端交易代码	-	
后端交易代码	-	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 4 月 13 日	
基金管理人	鹏华基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,703,958,345.44 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	鹏华金鼎保本混合 A	鹏华金鼎保本混合 C
下属分级基金的交易代码	002504	002505
报告期末下属分级基金的 份额总额	2,275,977,921.56 份	427,980,423.88 份

2.2 基金产品说明

投资目标	灵活运用投资组合保险策略，在保证本金安全的基础上追求基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金通过灵活运用投资组合保险策略，在本金安全的基础上追求基金资产的稳定增值。本基金的整体投资策略分为三个层次：第一层次，以保本为出发点的资产配置策略；第二层次，以追求本金安全和稳定的收益回报为目的的固定收益类资产投资策略；第三层次，以股票为主要投资对象的权益类资产投资策略。
业绩比较基准	两年期定期存款税后利率×1.5
风险收益特征	本基金属于保本混合型基金，属于证券投资基金中的低风险品种。

注：无。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	鹏华基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	张戈	郭明
	联系电话	0755-82825720	010-66105798
	电子邮箱	zhangge@phfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4006788999	95588
传真		0755-82021126	010-66105799

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.phfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2018 年 01 月 01 日-2018 年 06 月 30 日）		
	鹏华金鼎保本混合 A	鹏华金鼎保本混合 C	
本期已实现收益	-18,111,832.88	-3,804,351.79	
本期利润	70,605,776.40	12,240,662.34	
加权平均基金份额本期利润	0.0291	0.0273	
本期基金份额净值增长率	2.97%	2.80%	
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2018 年 06 月 30 日）		
	期末可供分配基金份额利润	0.0056	-0.0090
	期末基金资产净值	2,288,827,343.26	424,143,467.99
	期末基金份额净值	1.006	0.991

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。

(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) 表中的“期末”均指报告期最后一日，即 6 月 30 日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

鹏华金鼎保本混合 A

阶段	份额净值增长率 ① (%)	份额净值增长率标准差 ② (%)	业绩比较基准收益率 ③ (%)	业绩比较基准收益率标准差 ④ (%)	①— ③ (%)	②— ④ (%)
过去一个月	0.30	0.06	0.26	0.01	0.04	0.05
过去三个月	1.21	0.06	0.79	0.01	0.42	0.05
过去六个月	2.97	0.06	1.56	0.01	1.41	0.05
过去一年	3.18	0.06	3.15	0.01	0.03	0.05
自基金成立起至今	0.60	0.11	6.98	0.01	-6.38	0.10

鹏华金鼎保本混合 C

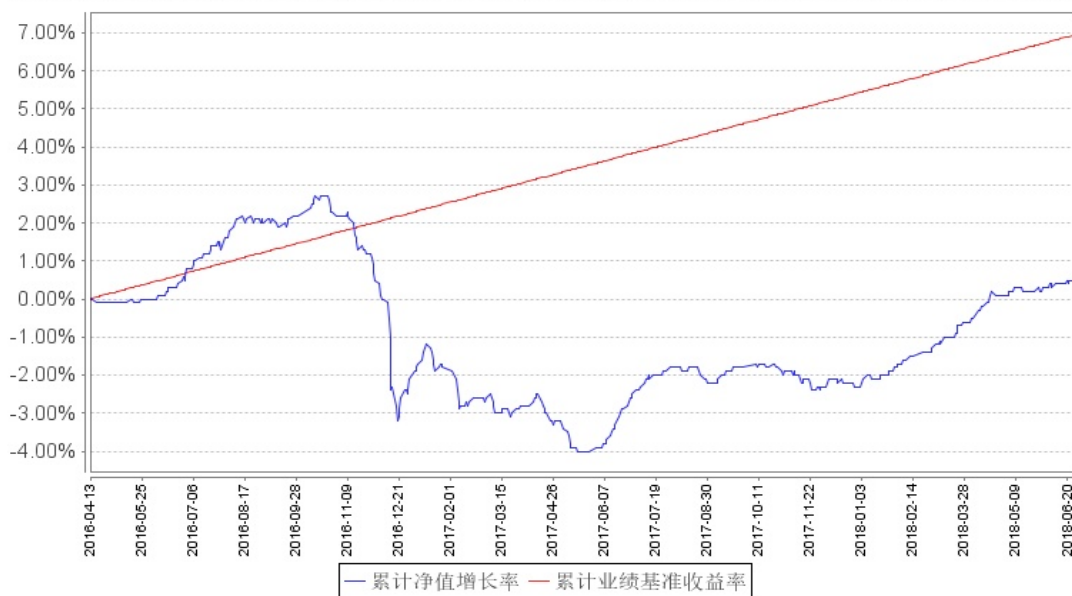
阶段	份额净值增长率 ① (%)	份额净值增长率标准差 ② (%)	业绩比较基准收益率 ③ (%)	业绩比较基准收益率标准差 ④ (%)	①— ③ (%)	②— ④ (%)
过去一个月	0.30	0.05	0.26	0.01	0.04	0.04
过去三个月	1.12	0.05	0.79	0.01	0.33	0.04
过去六个月	2.80	0.06	1.56	0.01	1.24	0.05

过去一年	2.48	0.06	3.15	0.01	-0.67	0.05
自基金成立起至今	-0.90	0.11	6.98	0.01	-7.88	0.10

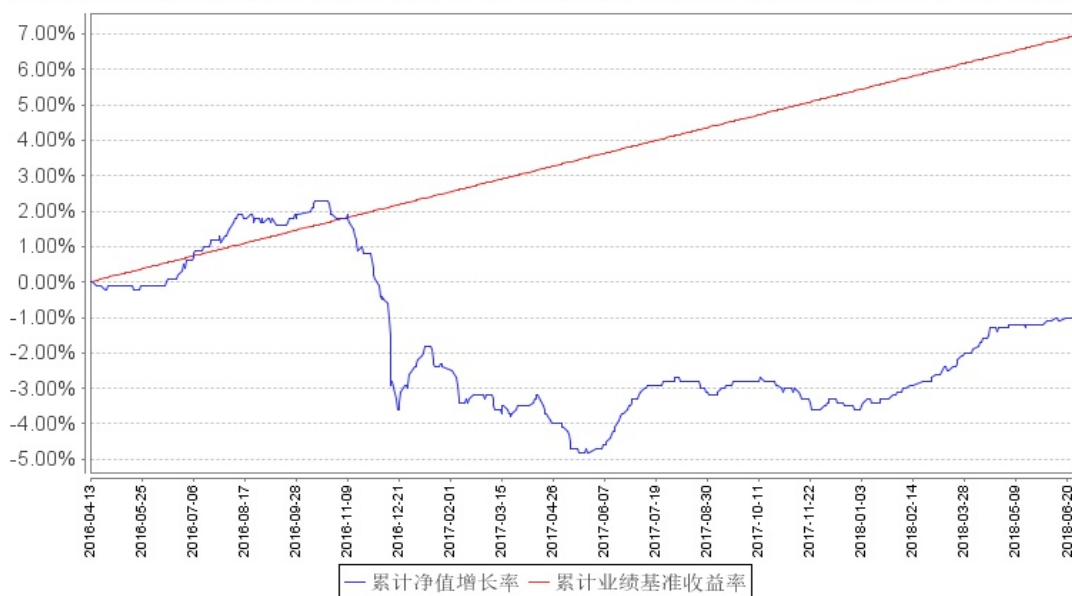
注：业绩比较基准=两年期定期存款利率(税后)*1.5

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

鹏华金鼎保本混合A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



鹏华金鼎保本混合C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



§ 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。截止本报告期末，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。公司原注册资本 8,000 万元人民币，后于 2001 年 9 月完成增资扩股，增至 15,000 万元人民币。截止 2018 年 6 月，公司管理资产总规模达到 5,232.30 亿元，管理 152 只公募基金、10 只全国社保投资组合、3 只基本养老保险投资组合。经过近 20 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		
王宗合	本基金基金经理	2016-04-13	-	12	王宗合先生，国籍中国，金融学硕士，12 年证券从业经验，曾经在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，2010 年 12 月担任鹏华消费优选混合基金基金经理，2012 年 06 月担任鹏华金鼎保本混合基金基金经理，2014 年 07 月担任鹏华品牌传承混合基金基金经理，2014 年 12 月担任鹏华养老产业股票基金

					<p>基金经理，2016 年 04 月担任鹏华金鼎保本混合基金基金经理，2016 年 06 月担任鹏华金城保本混合基金基金经理，2017 年 02 月担任鹏华安益增强混合基金基金经理，2017 年 07 月担任鹏华中国 50 混合基金基金经理，2017 年 09 月担任鹏华策略回报混合基金基金经理，2018 年 05 月担任鹏华产业精选混合基金基金经理，现同时担任权益投资二部总经理。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未发生变动。</p>
戴钢	本基金基金经理	2016-04-13	-	16	<p>戴钢先生，国籍中国，经济学硕士，16 年证券从业经验。曾就职于广东民安证券研究发展部，担任研究员；2005 年 9 月加盟鹏华基金管理有限公司，从事研究分析工作，历任债券研究员、专户投资经理等职；2011 年 12 月至 2016 年 02 月担任鹏华丰泽债券（LOF）基金基金经理，2012 年 06 月担任鹏华金刚保本混合基金基金经理，2012 年 11 月至 2015 年 11 月担任鹏华中小企业债基金基金经理，2013 年 09 月担任鹏华丰实定期开放债券基金基金经理，</p>

					2013 年 09 月担任鹏华丰泰定期开放债券基金基金经理，2013 年 10 月至 2018 年 05 月担任鹏华丰信分级债券基金基金经理，2015 年 11 月担任鹏华丰和债券（LOF）基金基金经理，2016 年 03 月担任鹏华丰尚定期开放债券基金基金经理，2016 年 04 月担任鹏华金鼎保本混合基金基金经理，2016 年 09 月至 2018 年 05 月担任鹏华丰饶债券基金基金经理，2018 年 05 月担任鹏华普悦债券基金基金经理，现同时担任绝对收益投资部副总经理。戴钢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。
--	--	--	--	--	---

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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2018 年上半年债券市场持续上涨，中债总财富指数上涨 4.95%。今年伊始，宏观经济开始出现下行压力。此后信用市场出现了连续的违约事件使得市场的信用开始整体收缩。社融增速持续下滑叠加中美贸易战的开启，市场开始对经济前景较为悲观。而此时的货币政策也开始转向。分别在 4 月和 6 月实施了两次降准。这无疑对债券市场形成了强力支持，呈现出牛市格局。而经济下行导致对盈利预期的下调不利于权益市场。上半年权益市场整体下跌，沪深 300 下跌了 12.90%。

在组合的资产配置上，我们对债券资产仍然维持了以中短期债券品种为主的投资策略，并保持了一定的杠杆水平。对于权益类资产，我们保持了观望。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2018 年上半年金鼎 A 基金的净值增长率为 2.97%，金鼎 C 基金的净值增长率为 2.80%，同期业绩基准增长率为 1.56%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

虽然央行在货币政策上有所调整，但是单纯的降准很难改变目前市场的紧信用的漩涡。随着社融的逐步下行，宏观经济的压力也将更为明显。因此大趋势对于债券市场是有利的。当前对于收益率的制约更多的来自于中美利差已经处于较低水平，而人民币汇率是否能够稳住。

对于权益市场而言，经过前期的调整，目前权益市场估值已处于历史低位，因此配置价值明显，值得重点关注。但右侧交易可能会是更好的选择。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

(1) 日常估值流程

基金的估值由基金会计负责，基金会计对公司所管理的基金以基金为会计核算主体，独立建账、独立核算，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账簿记录等方面相互独立。

基金会计核算独立于公司会计核算。基金会计核算采用专用的财务核算软件系统进行基金核算及帐务处理；每日按时接收成交数据及权益数据，进行基金估值。基金会计核算采用基金管理公司与托管银行双人同步独立核算、相互核对的方式，每日就基金的会计核算、基金估值等与托管银行进行核对；每日估值结果必须与托管行核对一致后才能对外公告。基金会计除设有专职基金会计核算岗外，还设有基金会计复核岗位，负责基金会计核算的日常事后复核工作，确保基金净值核算无误。

配备的基金会计具备会计资格和基金从业资格，在基金核算与估值方面掌握了丰富的知识和经验，熟悉及了解基金估值法规、政策和方法。

(2) 特殊业务估值流程

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》的相关规定，本公司成立停牌股票等没有市价的投资品种估值小组，成员由基金经理、行业研究员、监察稽核部、金融工程师、登记结算部相关人员组成。

2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理不参与或决定基金日常估值。

基金经理参与估值小组对停牌股票估值的讨论，发表相关意见和建议，与估值小组成员共同商定估值原则和政策。

3、本公司参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4. 定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1、截止本报告期末，金鼎保本 A 期末可供分配利润为 12,849,421.70 元，期末基金份额净值 1.006 元；金鼎保本 C 期末可供分配利润为-3,836,955.89 元，期末基金份额净值 0.991 元。

2、本基金本报告期内未进行利润分配。

3、根据相关法律法规及本基金基金合同的规定，本基金管理人将会综合考虑各方面因素，在严格遵守规定前提下，对本报告期内可供分配利润适时作出相应安排。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国工商银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：鹏华金鼎保本混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	10,205,380.73	205,096,517.83
结算备付金	44,562,686.02	22,060,912.39
存出保证金	50,917.76	97,316.72
交易性金融资产	3,942,969,275.00	5,121,927,866.70
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	3,942,969,275.00	5,121,927,866.70
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	5,051,540.16	16,262,914.45

应收利息	64,390,888.84	88,208,540.75
应收股利	-	-
应收申购款	30,259.40	494.06
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	4,067,260,947.91	5,453,654,562.90
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2018年6月30日	2017年12月31日
负 债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	1,343,088,000.00	2,289,930,000.00
应付证券清算款	4,367,730.97	14,789,220.92
应付赎回款	2,506,330.49	4,023,153.83
应付管理人报酬	2,690,610.84	3,242,175.72
应付托管费	448,435.14	540,362.64
应付销售服务费	3,504.95	319,174.01
应付交易费用	1,425.00	1,849.94
应交税费	359,467.57	-
应付利息	608,629.82	-59,494.25
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	216,001.88	500,319.43
负债合计	1,354,290,136.66	2,313,286,762.24
所有者权益:		
实收基金	2,703,958,345.44	3,221,704,210.44
未分配利润	9,012,465.81	-81,336,409.78
所有者权益合计	2,712,970,811.25	3,140,367,800.66
负债和所有者权益总计	4,067,260,947.91	5,453,654,562.90

注：报告截止日 2018 年 06 月 30 日，基金份额总额 2,703,958,345.44 份，其中鹏华金鼎保本混合 A 基金份额的份额总额为 2,275,977,921.56 份，份额净值 1.006 元，鹏华金鼎保本混合 C 基金份额的份额总额为 427,980,423.88 份，份额净值 0.991 元

6.2 利润表

会计主体：鹏华金鼎保本混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 6 月 30 日

一、收入		145,430,855.92	67,485,825.52
1. 利息收入		87,256,122.89	132,201,288.47
其中：存款利息收入		5,371,914.04	4,430,597.36
债券利息收入		81,701,620.72	126,303,589.07
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		182,588.13	1,467,102.04
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-49,107,812.93	-56,144,348.69
其中：股票投资收益		-	523,932.84
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-49,107,812.93	-56,668,281.53
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		104,762,623.41	-10,529,263.22
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		2,519,922.55	1,958,148.96
减：二、费用		62,584,417.18	91,744,876.00
1. 管理人报酬	6.4.8.2.1	16,925,076.34	25,526,296.13
2. 托管费	6.4.8.2.2	2,820,846.01	4,254,382.62
3. 销售服务费	6.4.8.2.3	488,287.95	2,453,338.74
4. 交易费用		10,182.05	15,269.89
5. 利息支出		41,872,150.93	59,278,717.28
其中：卖出回购金融资产支出		41,872,150.93	59,278,717.28
6. 税金及附加		248,771.87	-
7. 其他费用		219,102.03	216,871.34
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		82,846,438.74	-24,259,050.48
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		82,846,438.74	-24,259,050.48

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鹏华金鼎保本混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	3,221,704,210.44	-81,336,409.78	3,140,367,800.66
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润)	-	82,846,438.74	82,846,438.74
三、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)	-517,745,865.00	7,502,436.85	-510,243,428.15
其中：1. 基金申购款	887,842.36	-9,761.76	878,080.60
2. 基金赎回款	-518,633,707.36	7,512,198.61	-511,121,508.75
四、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)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	2,703,958,345.44	9,012,465.81	2,712,970,811.25
项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	4,556,006,274.97	-96,896,546.46	4,459,109,728.51
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润)	-	-24,259,050.48	-24,259,050.48
三、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)	-341,154,026.48	11,051,746.75	-330,102,279.73
其中：1. 基金申购款	958,935.20	-30,610.44	928,324.76
2. 基金赎回款	-342,112,961.68	11,082,357.19	-331,030,604.49
四、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)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	4,214,852,248.49	-110,103,850.19	4,104,748,398.30

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>邓召明</u>	<u>苏波</u>	<u>郝文高</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

鹏华金鼎保本混合型证券投资基金(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[2016]364号《关于准予鹏华金鼎保本混合型证券投资基金注册的批复》准予,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《鹏华金鼎保本混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。根据《鹏华金鼎保本混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金为契约型开放式,存续期限不定,第一个保本期自本基金基金合同生效之日(即2016年4月13日)起至三十个月对应日(即2018年10月13日)止,如该日为非工作日,则保本到期日顺延至下一个工作日,其后的保本周期及起讫日见基金管理人届时公告。本基金第一个保本期由北京首创融资担保有限公司作为保证人提供连带责任保证。第一个保本期届满时,在符合保本基金存续条件下,本基金继续存续并进入下一保本期。如第一个保本期到期后,本基金未能符合保本基金存续条件,则将变更为非保本的混合型基金,基金名称相应变更为“鹏华金鼎灵活配置混合型证券投资基金”。如果第一个保本期到期后本基金不符合法律法规和基金合同对基金的存续要求,则本基金将根据基金合同的规定终止。

本基金自2016年3月21日起至2016年4月11日止期间内向社会公开募集,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币4,830,084,237.99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(2016)第408号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华金鼎保本混合型证券投资基金基金合同》于2016年4月13日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为4,832,115,498.18份基金份额,其中认购资金利息折合2,031,260.19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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《鹏华金鼎保本混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的第一个保本期为三十个月,本基金第一个保本期的保本额为基金份额持有人认购并持有到期的基金份额所对应的认购金额及募集期利息收入之和。在第一个保本期到期日,如基金份额持有人认购并持有到期的基金份额与到期日基金份额净值的乘积加上其认购并持有到期的基金份额累计分红款项之和计算的总金额低于基金份额持有人认购并持有到期的基金份额的保本金额,则基金管理人应补足该差额,

并最迟在保本期到期日后 20 个工作日内将该差额支付给基金份额持有人，保证人对此提供连带责任保证。但上述基金份额持有人未持有到期而赎回或转换转出的，赎回或转换转出部分不适用保本条款；未经保证人书面同意提供保证，基金份额持有人在保本期申购或转换转入的基金份额也不适用保本条款。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华金鼎保本混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，本基金可以投资于股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、各类债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、债券回购、央行票据、中期票据、可转换债券、可分离交易债券、短期融资券、资产支持证券、中小企业私募债以及经法律法规或中国证监会允许投资的其他债券类金融工具）、银行存款、货币市场工具、权证、国债期货、股指期货及中国证监会允许投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。本基金的投资组合比例由优化的 CPPI 策略决定，并对比例范围有如下限制：权益类资产占基金资产的比例不超过 40%；债券、货币市场工具及其它资产的比例合计不低于基金资产的 60%，其中基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：两年期定期存款税后利率 \times 1.5

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、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》、《鹏华金鼎保本混合型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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 年上半年财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2018 年 06 月 30 日的财务状况以及 2018 年上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期没有发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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。

(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费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
鹏华基金管理有限公司（“鹏华基金公司”）	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金代销机构
国信证券股份有限公司（“国信证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

注：无。

6.4.8.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月 30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)
国信证券	901,444,790.00	84.76	825,685,838.02	97.28

6.4.8.1.3 债券回购交易

注：无。

6.4.8.1.4 权证交易

注：无。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至 2018年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例 (%)	期末应付佣 金余额	占期末应付佣金总额的 比例 (%)
国信证券	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至 2017年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例 (%)	期末应付佣 金余额	占期末应付佣金总额的 比例 (%)
国信证券	-	-	-	-

注:1、佣金的计算公式

上海/深圳证券交易所的交易佣金=买(卖)成交金额×1%-买(卖)经手费-买(卖)证管费等由券商承担的费用

(佣金比率按照与一般证券公司签订的协议条款订立。)

2、本基金与关联方已按同业统一的基金佣金计算方式和佣金比例签订了《证券交易单元租用协议》。根据协议规定,上述单位定期或不定期地为我公司提供研究服务以及其他研究支持。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至 2018年 6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至 2017年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	16,925,076.34
其中:支付销售机构的客户维护费	6,438,509.20	8,405,137.35

注:1、支付基金管理人鹏华基金管理有限公司的管理人报酬年费率为1.20%,逐日计提,按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×1.20%÷当年天数。

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

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至 2018年	上年度可比期间 2017年1月1日至
----	------------------------	-----------------------

	6 月 30 日	2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,820,846.01	4,254,382.62

注:支付基金托管人中国工商银行股份有限公司的托管费年费率为 0.20%,逐日计提,按月支付。

日托管费=前一日基金资产净值×0.20%÷当年天数。

6.4.8.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鹏华金鼎保本混合 A	鹏华金鼎保本混合 C	合计
中国工商银行	-	175,885.20	175,885.20
鹏华基金公司	-	4,117.64	4,117.64
国信证券	-	10.53	10.53
合计	-	180,013.37	180,013.37
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鹏华金鼎保本混合 A	鹏华金鼎保本混合 C	合计
中国工商银行	-	767,628.52	767,628.52
鹏华基金公司	-	5,316.26	5,316.26
国信证券	-	38.08	38.08
合计	-	772,982.86	772,982.86

注:支付基金销售机构的 C 类基金份额的销售服务费按前一日基金资产净值 0.01%的年费率计提,逐日计提,按月支付,A 类基金份额不收取销售服务费。日销售服务费=前一日 C 类基金资产净值×0.01%÷当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:无。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注:无。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2018年1月1日至2018年6月30日	2017年1月1日至2017年6月30日	2017年1月1日至2017年6月30日	2017年1月1日至2017年6月30日
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	10,205,380.73	107,909.73	5,089,058.30	59,051.25

注:本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金本报告期及上年度可比期间未参与关联方承销的证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末(-)本基金持有的流通受限证券**6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

注:无。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:无。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购**

注:无。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 6 月 30 日止,本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 1,343,088,000.00 元,分别于 2018 年 7 月 2 日、2018 年 7 月 9 日、2018 年 7 月 13 日、2018 年 7 月 18 日、2018 年 7 月 27 日、2018 年 8 月 7 日、2018 年 10 月 23 日和 2018 年 10 月 24 日分别到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券,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 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,942,969,275.00	96.94
	其中：债券	3,942,969,275.00	96.94
	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	54,768,066.75	1.35
8	其他各项资产	69,523,606.16	1.71
9	合计	4,067,260,947.91	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

无。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

注：无。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：无。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：无。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

无。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
----	------	------	---------------

1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	234,116,000.00	8.63
	其中：政策性金融债	140,420,000.00	5.18
4	企业债券	3,157,953,275.00	116.40
5	企业短期融资券	411,446,000.00	15.17
6	中期票据	139,454,000.00	5.14
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,942,969,275.00	145.34

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	136427	16 葛洲 02	2,500,000	247,075,000.00	9.11
2	122366	14 武钢债	1,953,770	195,279,311.50	7.20
3	136259	16 龙湖 03	1,890,000	185,673,600.00	6.84
4	122425	15 际华 01	1,700,000	169,711,000.00	6.26
5	136029	15 华宝债	1,600,000	159,328,000.00	5.87

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

注：无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：无。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：无。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金参与股指期货的投资的，应符合基金合同规定的保本策略和投资目标。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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

为有效控制债券投资的系统性风险，本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的，适度运用国债期货，提高投资组合的运作效率。在国债期货投资时，本基金将首先分析国债期货各合约价格与最便宜可交割券的关系，选择定价合理的国债期货合约，其次，考虑国债期货各合约的流动性情况，最终确定与现货组合的合适匹配，以达到风险管理的目标。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：无。

7.11.3 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

际华集团 际华集团于 2017 年 12 月 21 日收到中国证券监督管理委员会北京监管局下发的《关于对际华集团股份有限公司采取出具警示函措施的决定（[2017]155 号）》的行政监管措施决定书。主要内容系公司于 2016 年、2017 年均收到大额政府补助并计入当期损益，上述事项产生的利润已分别超过公司 2015 年、2016 年经审计净利润的 10%，属于应当立即披露的重大事件，但公司未能及时发布临时公告予以披露，存在以定期报告代替临时公告、信息披露滞后的问题。上述行为违反了《上市公司信息披露管理办法》第二条、第三十条的规定。根据《上市公司信息披露管理办法》第五十九条规定，现对公司予以警示，将相关违规行为记入诚信档案。

公司在收到《警示函》第一时间对相关内容进行了公告，对后续整改事项进行了具体安排，并对 2016、2017 年政府补助事项重新梳理。对《警示函》中相关事项进行了认真细致的调查，对相关责任人进行了问责。同时，责令财务、董办等管理部门以此为戒，强化公司内部信息收集、流转的管理和监督，认真履行信息披露义务，进一步增强风险防范意识，提高信息披露质量。

本次《警示函》系北京监管局对公司予以口头警示，并未出具任何处罚措施，经判定，不对公司生产经营和信用资质产生影响。

对该证券的投资决策程序的说明：本基金管理人长期跟踪研究该公司，认为公司的上述违规行为对公司并不产生实质性影响。上述通告对该公司债券的投资价值不产生重大影响。该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。

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

7.12.2

本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券备选库

7.12.3 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	50,917.76
2	应收证券清算款	5,051,540.16
3	应收股利	-
4	应收利息	64,390,888.84
5	应收申购款	30,259.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	69,523,606.16

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息**8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

份额 级别	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 (%)
鹏华 金鼎 保本 混合 A	10,447	217,859.47	402,981,419.86	17.71	1,872,996,501.70	82.29
鹏华 金鼎 保本	2,392	178,921.58	-	-	427,980,423.88	100.00

混合 C						
合计	12,839	210,605.06	402,981,419.86	14.90	2,300,976,925.58	85.10

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	鹏华金鼎保本混合 A	1,004,418.01	0.0441
	鹏华金鼎保本混合 C	-	-
	合计	1,004,418.01	0.0371

注:截至本报告期末,本基金管理人从业人员投资、持有本基金符合相关法律法规、中国证监会规定及相关管理制度的规定。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	鹏华金鼎保本混合 A	>100
	鹏华金鼎保本混合 C	-
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	鹏华金鼎保本混合 A	-
	鹏华金鼎保本混合 C	-
	合计	-

注:1、截至本报告期末,本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人投资、持有本基金符合相关法律法规、中国证监会规定及相关管理制度的规定。

2、截至本报告期末,本基金的基金经理未持有本基金份额。

§ 9 开放式基金份额变动

单位:份

项目	鹏华金鼎保本混合 A	鹏华金鼎保本混合 C
基金合同生效日 (2016年4月13日)基金份额总额	4,070,145,989.71	761,969,508.47
本报告期期初基金份额总额	2,741,881,749.34	479,822,461.10
本报告期基金总申购份额	663,305.73	224,536.63
减:本报告期基金总赎回	466,567,133.51	52,066,573.85

份额		
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）		
本报告期期末基金份额总额	2,275,977,921.56	427,980,423.88

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 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：基金管理人本报告期内无重大人事变动。

基金托管人的重大人事变动：无。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的，与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

无

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未改聘为本基金审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、基金托管人涉及托管业务机构及其高级管理人员在报告期内未受到任何稽查或处罚。

10.7 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	
东吴证券	1	-	-	-	-	-

国信证券	2	-	-	-	-	-
华林证券	1	-	-	-	-	本报告期新增
中信证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	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、及时性及提供研究服务主动性和质量等情况,并依据评比结果确定交易单元交易的具体情况。我公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后,向券商租用交易单元作为基金专用交易单元。

10.7.2 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	成交金额	占当期债券回购成交总额的	成交金额	占当期权证成交总额

		的比例		比例		的比例
东吴证券	83,723,698.00	7.87%	52,714,600,000.00	90.06%	-	-
国信证券	901,444,790.00	84.76%	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	78,305,663.02	7.36%	5,818,074,000.00	9.94%	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-

§ 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。

鹏华基金管理有限公司

2018 年 08 月 27 日