

鹏华宏观灵活配置混合型证券投资基金(原鹏 华金刚保本混合型证券投资基金)2018年第 3季度报告

2018年09月30日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：2018年10月25日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 10 月 25 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。

本基金由原鹏华金刚保本混合型证券投资基金转型而来。鹏华金刚保本混合型证券投资基金于 2012 年 5 月 3 日至 2012 年 6 月 8 日进行募集，并于 2012 年 6 月 13 日正式成立，每个保本周期为三年，第一个保本周期自 2012 年 6 月 13 日起至 2015 年 6 月 15 日止，第二个保本周期自 2015 年 7 月 13 日起至 2018 年 7 月 13 日止。鹏华金刚保本混合型证券投资基金由于在第二个保本周期届满后不再符合保本基金的续存条件，根据《鹏华金刚保本混合型证券投资基金基金合同》的约定，于 2018 年 7 月 19 日转型为“鹏华宏观灵活配置混合型证券投资基金”。转型后的基金投资目标、投资范围、投资策略以及基金费率等相关内容也将根据基金合同的相关约定作相应修改。

本报告中，原鹏华金刚保本混合型证券投资基金报告期自 2018 年 7 月 1 日至 2018 年 7 月 18 日止，鹏华宏观灵活配置混合型证券投资基金报告期自 2018 年 7 月 19 日（基金合同生效日）至 2018 年 9 月 30 日止。

本报告中财务资料未经审计。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况（转型后）

基金简称	鹏华宏观混合
场内简称	-
基金代码	206013
基金运作方式	契约型开放式

基金合同生效日	2018 年 07 月 19 日
报告期末基金份额总额	45,946,082.19 份
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	三年期定期存款税后利率
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。
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

2.1 基金基本情况（转型前）

基金简称	鹏华金刚保本混合
场内简称	-
基金代码	206013
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012 年 06 月 13 日
报告期末基金份额总额	63,356,385.89 份
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	三年期定期存款税后利率
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。
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
基金保证人	重庆市三峡担保集团有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标（转型后）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2018 年 7 月 19 日 - 2018 年 9 月 30 日)
1. 本期已实现收益	-1, 443. 32
2. 本期利润	64, 207. 81
3. 加权平均基金份额本期利润	0. 0013
4. 期末基金资产净值	48, 690, 586. 61
5. 期末基金份额净值	1. 060

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。

3.1 主要财务指标(转型前)

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018 年 07 月 01 日 -2018 年 07 月 18 日)
1. 本期已实现收益	-696, 665. 94
2. 本期利润	834, 712. 38
3. 加权平均基金份额本期利润	0. 0073
4. 期末基金资产净值	67, 058, 751. 98
5. 期末基金份额净值	1. 058

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。

3.2 基金净值表现(转型后)

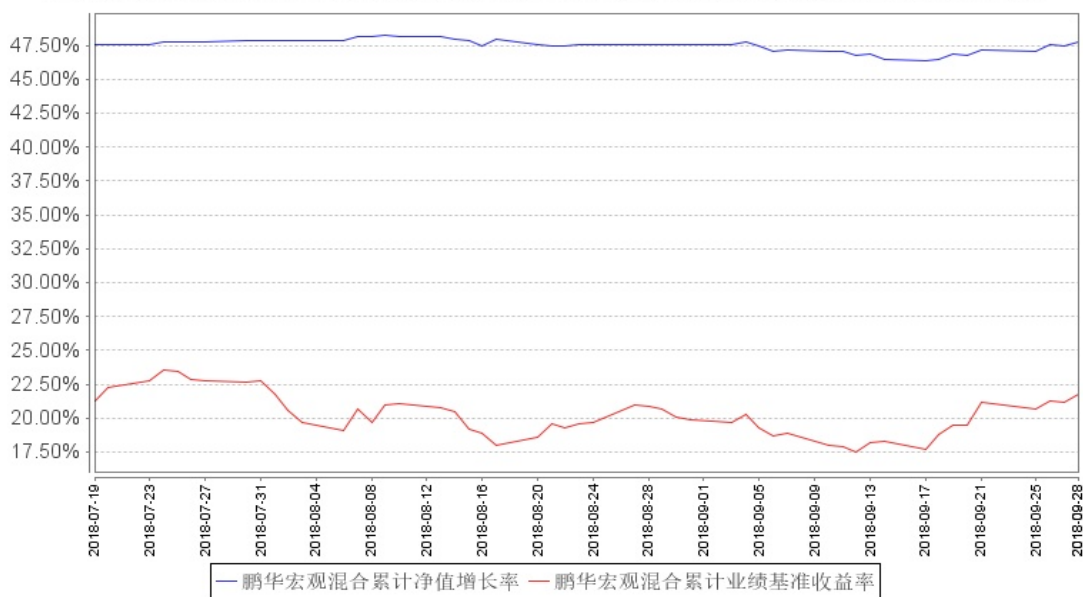
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0. 19%	0. 15%	0. 54%	0. 61%	-0. 35%	-0. 46%

注:业绩比较基准=沪深 300 指数收益率×55%+中债总指数收益率×45%

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

鹏华宏观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 2018 年 07 月 19 日生效，截至本报告期末本基金基金合同生效未满一年。2、本基金管理人将严格按照本基金合同的约定，于本基金建仓期届满后确保各项投资比例符合基金合同的约定。

3.2 基金净值表现（转型前）

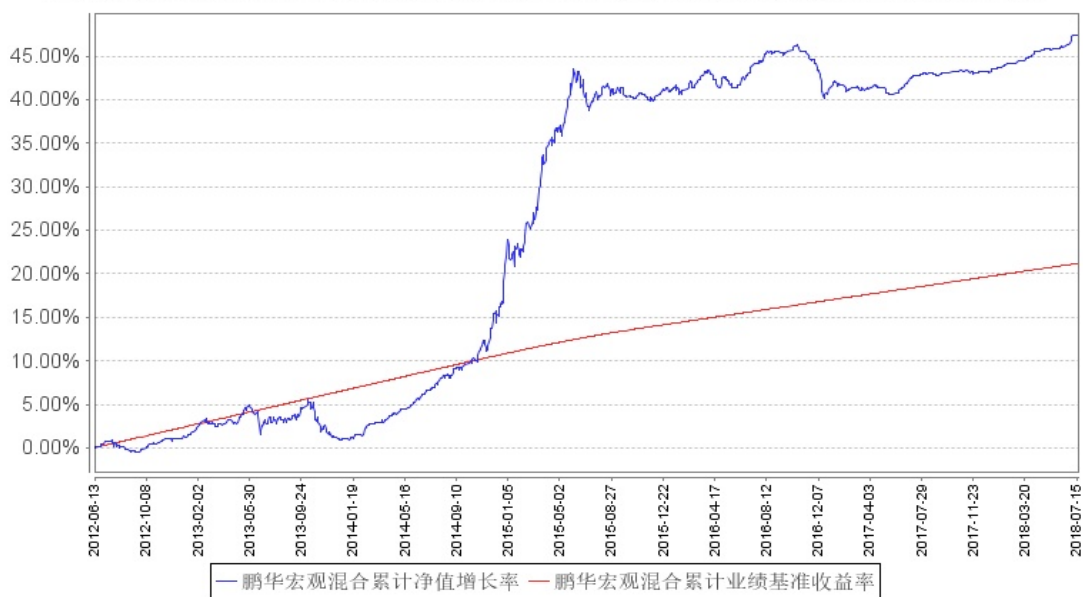
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.67%	0.07%	0.14%	0.01%	0.53%	0.06%

注：业绩比较基准=三年期定期存款税后利率

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

鹏华宏观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 2012 年 06 月 13 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

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型后）

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	本基金基金经理	2012-06-13	-	12	王宗合先生，国籍中国，金融学硕士，12 年证券基金从业经验。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

				<p>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）基金经理助理。现担任权益投资二部总经理。2010 年 12 月担任鹏华消费优选混合基金基金经理，2012 年 06 月至 2018 年 07 月担任鹏华金刚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</p>
--	--	--	--	--

					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基金基金经理，2018 年 07 月担任鹏华宏观混合基金基金经理。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未发生变动。
戴钢	本基金基金经理	2012-06-13	-	16	戴钢先生，国籍中国，经济学硕士，16 年证券基金从业经验。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 月至 2018 年 07 月担任鹏华金刚保本混合基金基金经理，2012 年

				<p>11 月至 2015 年 11 月担任鹏华中小企债基金基金经理，</p> <p>2013 年 09 月担任鹏华丰实定期开放债券基金基金经理，</p> <p>2013 年 09 月担任鹏华丰泰定期开放债券基金基金经理，</p> <p>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，</p> <p>2015 年 11 月担任鹏华丰和基金基金经理，</p> <p>2016 年 03 月担任鹏华丰尚定期开放债券基金基金经理，</p> <p>2016 年 04 月担任鹏华金鼎保本混合基金基金经理，</p> <p>2016 年 08 月至 2018 年 05 月担任鹏华丰饶债券基金基金经理，</p> <p>2018 年 05 月担任鹏华普悦债券基金基金经理，</p> <p>2018 年 07 月担任鹏华宏观混合基金基金经理，</p> <p>2018 年 09 月担任鹏华弘实</p>
--	--	--	--	--

					混合基金基金经理。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。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介(转型前)

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	本基金基金经理	2012-06-13	2018-07-18	12	王宗合先生,国籍中国,金融学硕士,12年证券基金从业经验。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。现担任权益投资二部总经理。2010年12月担任鹏华消费优选混合基金基金经理,

				<p>2012 年 06 月至 2018 年 07 月担任鹏华金刚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基金基金经理，2018 年 07 月担任鹏华宏观混合基金基金经理。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未</p>
--	--	--	--	---

					发生变动。
戴钢	本基金基金经理	2012-06-13	2018-07-18	16	戴钢先生，国籍中国，经济学硕士，16 年证券基金从业经验。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 月至 2018 年 07 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，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

				<p>华丰信分级债券基金基金经理，2015 年 11 月担任鹏华丰和基金基金经理，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 08 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，2018 年 07 月担任鹏华宏观混合基金基金经理，2018 年 09 月担任鹏华弘实混合基金基金经理。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。</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。

4.2 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 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

2018 年三季度债券市场持续上涨，中债总财富指数上涨 0.93%。在经济下行压力逐步加大的大背景下，市场信用收缩趋势加剧。在此背景下中央政府开始对前期的去杠杆政策基调进行适度调整，稳经济的重要性开始提升。此时央行也进一步出台政策鼓励银行放贷，尤其是对中小微企业，加强资金对实体经济的支持。稳增长的财政政策也有所发力，新的基建项目陆续出台。宽松的货币环境有利于债券市场，但对于刺激政策效果的担忧使得债券市场涨幅受限。经济下行使得市场对盈利增速有所担心，这不利于权益市场。第三季度的权益市场整体下跌，沪深 300 下跌了 2.05%。

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，我们进行了适度的参与。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2018 年三季度本基金转型为鹏华宏观混合，转型前后的净值增长率分别为 0.67%、0.19%，同期业绩基准增长率分别为 0.14%、0.54%。

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（转型后）

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	6,478,855.00	13.21
	其中：股票	6,478,855.00	13.21
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	30,229,588.20	61.62
	其中：债券	30,229,588.20	61.62
	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	6,500,000.00	13.25
	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	5,349,170.45	10.90
8	其他资产	496,880.66	1.01
9	合计	49,054,494.31	100.00

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	3,433,493.00	7.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	3,045,362.00	6.25
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务	-	-

	业		
M	科学研究和技术服务业		-
N	水利、环境和公共设施管理业		-
O	居民服务、修理和其他服务业		-
P	教育		-
Q	卫生和社会工作		-
R	文化、体育和娱乐业		-
S	综合		-
	合计	6,478,855.00	13.31

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.3 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	002815	崇达技术	144,900	2,458,953.00	5.05
2	601318	中国平安	23,100	1,582,350.00	3.25
3	601601	中国太保	41,200	1,463,012.00	3.00
4	600690	青岛海尔	29,500	487,340.00	1.00
5	002013	中航机电	58,000	487,200.00	1.00

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	23,156,600.00	47.56
	其中：政策性金融债	20,084,000.00	41.25
4	企业债券	7,072,988.20	14.53
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	30,229,588.20	62.09

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	018005	国开 1701	100,000	10,060,000.00	20.66
2	180207	18 国开 07	100,000	10,024,000.00	20.59
3	143492	18 银河 G1	30,000	3,072,600.00	6.31
4	136544	16 联通 03	30,000	2,980,500.00	6.12
5	143188	18 长电 01	20,000	1,992,600.00	4.09

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

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

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

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

本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

5.9.2 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。

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

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。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	9,750.86
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	484,343.76
5	应收申购款	2,786.04
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	496,880.66

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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

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。

§ 5 投资组合报告（转型前）

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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	50,195,000.00	53.25
	其中：债券	50,195,000.00	53.25
	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	43,536,570.30	46.19
8	其他资产	528,992.25	0.56
9	合计	94,260,562.55	100.00

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

无。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.3 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

无。

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	50,195,000.00	74.85
	其中：政策性金融债	50,195,000.00	74.85
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	50,195,000.00	74.85

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	180207	18 国开 07	400,000	40,052,000.00	59.73
2	140209	14 国开 09	100,000	10,143,000.00	15.13

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

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

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

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

本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

5.9.2 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。

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

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。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
----	----	-------

1	存出保证金	4,981.87
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	524,010.38
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	528,992.25

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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

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（转型后）

单位：份

基金合同生效日（2018年7月19日）持有的基金份额	63,356,385.89
报告期期间基金总申购份额	288,272.64
减：报告期期间基金总赎回份额	17,698,576.34
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	45,946,082.19

§ 6 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

本报告期期初基金份额总额	124,007,775.14
本报告期基金总申购份额	192,800.26
减：本报告期基金总赎回份额	60,844,189.51
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-

本报告期末基金份额总额	63,356,385.89
-------------	---------------

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型后）

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型前）

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息（转型后）

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

无。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

基金管理人于 2018 年 7 月 6 日发布了《鹏华金刚保本混合型证券投资基金保本周期到期安排及转型为鹏华宏观灵活配置混合型证券投资基金相关业务规则的公告》，鹏华金刚保本混合型证券投资基金保本周期于 2018 年 7 月 13 日到期，随后转型成为鹏华宏观灵活配置混合型证券投资基金，《鹏华宏观灵活配置混合型证券投资基金基金合同》及《鹏华宏观灵活配置混合型证券投资基金托管协议》自 2018 年 7 月 19 日起生效，具体详见相关公告。

影响投资者决策的其他重要信息（转型前）

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

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)《鹏华宏观灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- (二)《鹏华宏观灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- (三)《鹏华宏观灵活配置混合型证券投资基金 2018 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>）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

2018 年 10 月 25 日