

鹏华金鼎灵活配置混合型证券投资基金 2019 年半年度报告

2019 年 6 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：2019 年 8 月 23 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 2019 年 8 月 22 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
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	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	10
§ 4 管理人报告	10
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	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	16
§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	16
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	16
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
7.3 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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	49
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	50
7.7 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	50

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	50
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	50
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50
7.12 投资组合报告附注	51
§ 8 基金份额持有人信息	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52
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	52
§ 9 开放式基金份额变动	53
§ 10 重大事件揭示	53
10.1 基金份额持有人大会决议	53
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	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	53
10.4 基金投资策略的改变	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	54
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	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	54
10.8 其他重大事件	55
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	60
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	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	61
§ 12 备查文件目录	61
12.1 备查文件目录	61
12.2 存放地点	61
12.3 查阅方式	61

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华金鼎灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	鹏华金鼎混合	
基金主代码	002504	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 10 月 19 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	466,426,727.86 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	鹏华金鼎混合 A	鹏华金鼎混合 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	442,812,191.97 份	23,614,535.89 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在科学严谨的资产配置框架下，精选股票、债券等投资标的，力争基金资产长期稳定的增值。
投资策略	<p>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。</p> <p>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优质的公司，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</p>

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、历史比较和成长性分析，确定具有上升基础的股价水平。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。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。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。6、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×55%+中证综合债指数收益率×45%
风险收益特征	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，属于证券投资基金中中高风险、中高预期收益的品种。

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	010-66105799
	电子邮箱	zhangge@phfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4006788999	95588
传真		0755-82021126	010-66105798
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	北京市西城区复兴门内大街 55 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	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		518048	100140
法定代表人		何如	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	鹏华基金管理有限公司	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层

§ 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(2019年1月1日-2019年6月30日)	
	鹏华金鼎混合 A	鹏华金鼎混合 C
本期已实现收益	1,748,740.71	765,057.93
本期利润	6,939,597.34	1,232,775.04
加权平均基金份额本期利润	0.0665	0.0366
本期加权平均净值利润率	6.43%	3.61%
本期基金份额净值增长率	5.15%	4.73%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)	
期末可供分配利润	12,946,040.13	243,653.28
期末可供分配基金份额利润	0.0292	0.0103
期末基金资产净值	479,073,082.73	25,071,994.37
期末基金份额净值	1.082	1.062
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	10.91%	4.94%

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) 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	9.74%	1.27%	3.20%	0.63%	6.54%	0.64%
过去三个月	3.05%	1.17%	0.01%	0.83%	3.04%	0.34%
过去六个月	5.15%	0.84%	14.87%	0.85%	-9.72%	-0.01%
自基金成立起	10.91%	0.75%	17.13%	0.84%	-6.22%	-0.09%

鹏华金鼎混合 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	9.71%	1.25%	3.20%	0.63%	6.51%	0.62%
过去三个月	2.91%	1.16%	0.01%	0.83%	2.90%	0.33%
过去六个月	4.73%	0.83%	14.87%	0.85%	-10.14%	-0.02%
自基金成立起	4.94%	0.69%	17.13%	0.84%	-12.19%	-0.15%

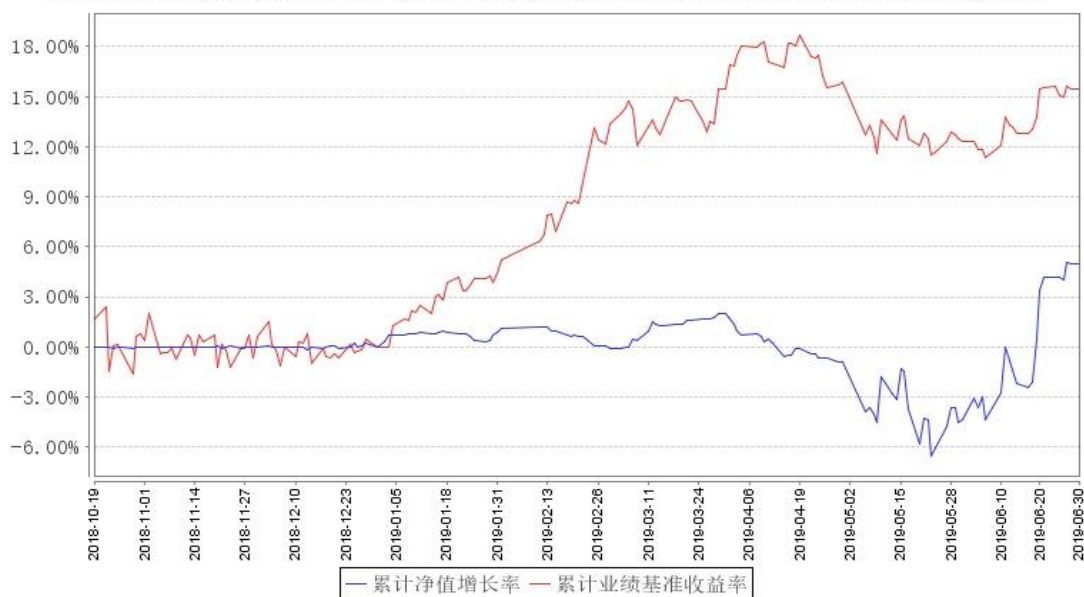
注：业绩比较基准=沪深 300 指数收益率×55%+中证综合债指数收益率×45%

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



注:1、本基金基金合同于 2016 年 04 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

注:无。

§ 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。截止到 2019 年 6 月,公司管理资产总规模达到 5,644.95 亿元,管理 159 只公募基金、10 只全国社保投资组合、4 只基本养老保险投资组合。

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		
戴钢	本基金基金经理	2016-04-13	-	17	戴钢先生,国籍中国,经济学硕士,17 年证券基金从业经验。曾就职于广东民

					<p>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2014年12月担任鹏华丰泽分级基金基金经理，2012年06月至2018年07月担任鹏华金鼎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月担任鹏华丰信分级债券基金基金经理，2014年12月至2016年02月担任鹏华丰泽债券(LOF)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月至2018年10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月至2018年12月担任鹏华普悦债券基</p>
--	--	--	--	--	--

					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，2018年10月担任鹏华金鼎混合基金基金经理。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。
王宗合	本基金基金经理	2016-04-13	-	13	王宗合先生，国籍中国，金融学硕士，13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，2012年06月至2018年07月担任鹏华金鼎保本混合基金基金经理，2014年07月至2019年04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月至2018年10月担任鹏华金鼎保本混合基金基金

					<p>经理，2016 年 06 月至 2019 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，2018 年 10 月担任鹏华金鼎混合基金基金经理，2019 年 01 月担任鹏华优选回报混合基金基金经理，2019 年 06 月至 2019 年 06 月担任鹏华金城混合基金基金经理，2019 年 06 月担任鹏华精选回报三年定开混合基金基金经理。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。</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 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

2019 年上半年债券市场持续上涨，中债总财富指数上涨 1.50%。上半年债券市场收益率整体下行。一季度，在经济预期较为悲观的情况下收益率出现了较为明显的下行，不过随后社融数据的反弹，经济开始企稳，收益率出现了一定幅度的反弹。四月政治局会议的定调，政策面微调的意图明显。这些对债券市场形成了较大的冲击，债券市场出现了明显调整。不过进入 5 月，随着中美贸易战的升级，经济形势急转直下，叠加外围经济体利率的持续下行，国内宽松预期重新抬头。虽然期间出现了包商银行事件的冲击，但是随着央行的强力出手，6 月资金面宽松远超预期。受上述因素影响，债券市场收益率逐步下行。一季度权益市场在宏观面企稳预期下出现了大的估值修复行情，大幅度上涨。二季度的权益市场在中美贸易战的负面影响下出现了调整。上半年沪深 300 的涨幅为 27.07%。

在组合的资产配置上，我们在年初主要配置了中长期债券。4 月进行了资产的切换，降低了组合债券的配置比例，更多的转向权益资产，在权益市场调整中逐步买入。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2019 年上半年金鼎 A 净值增长率 5.15%，金鼎 C 净值增长率 4.73%。同期业绩比较基准率为 14.87%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

虽然中美重启贸易谈判，但是中美贸易带来的负面影响以及包商事件的后续发酵都将会对经济下行带来明显的下行压力。考虑到目前外围国家的收益率经过前期的下行已经处于较低位置，我们仍然看好债券市场。

对于权益市场而言，考虑到政府对经济下行的容忍度，宏观托底政策后续将对经济形成支撑，

这无疑也将对企业的盈利企稳回升创造条件。因此我们对权益市场也维持乐观态度，重点关注结构性和市场调整带来的机会。

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，本基金 A 类份额期末可供分配利润为 12,946,040.13 元，期末基金份额净值 1.082 元；C 类份额期末可供分配利润为 243,653.28 元，期末基金份额净值 1.062 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：鹏华金鼎灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	34,780,351.73	2,041,865.09
结算备付金		1,241,581.06	1,893,004.03
存出保证金		66,576.08	226,184.29
交易性金融资产	6.4.7.2	472,153,367.69	145,693,975.40
其中：股票投资		465,622,415.09	-
基金投资		-	-

债券投资		6,530,952.60	145,693,975.40
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	25,996,143.99
应收证券清算款		-	10,326,337.56
应收利息	6.4.7.5	156,173.82	1,918,700.22
应收股利		-	-
应收申购款		6,157.13	55,943.36
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		508,404,207.51	188,152,153.94
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	200,000.00
应付证券清算款		2,230,981.76	10,000,000.00
应付赎回款		792,251.28	795,476.21
应付管理人报酬		174,491.06	236,862.87
应付托管费		31,846.49	39,477.16
应付销售服务费		16,180.28	34,638.76
应付交易费用	6.4.7.7	663,988.35	13,720.11
应交税费		573.78	5,106.21
应付利息		-	175.87
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	348,817.41	450,000.06
负债合计		4,259,130.41	11,775,457.25
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	466,426,727.86	172,141,588.92
未分配利润	6.4.7.10	37,718,349.24	4,235,107.77
所有者权益合计		504,145,077.10	176,376,696.69
负债和所有者权益总计		508,404,207.51	188,152,153.94

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额总额 466,426,727.86 份，其中鹏华金鼎混合 A 基金份额总额为 442,812,191.97 份，基金份额净值 1.082 元；鹏华金鼎混合 C 基金份额总额为 23,614,535.89 份，基金份额净值 1.062 元。

6.2 利润表

会计主体：鹏华金鼎灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		11,070,684.43
1. 利息收入		2,147,523.11
其中：存款利息收入	6.4.7.11	57,330.71
债券利息收入		2,022,521.74
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		67,670.66
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		3,259,392.94
其中：股票投资收益	6.4.7.12	3,996,889.70
基金投资收益	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-1,667,607.79
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	930,111.03
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	5,658,573.74
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	5,194.64
减：二、费用		2,898,312.05
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,014,679.40
2. 托管费	6.4.10.2.2	171,877.96
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	136,057.99
4. 交易费用	6.4.7.19	1,038,359.10
5. 利息支出		364,057.77
其中：卖出回购金融资产支出		364,057.77
6. 税金及附加		789.30
7. 其他费用	6.4.7.20	172,490.53
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		8,172,372.38
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		8,172,372.38

注：本基金基金合同于 2018 年 10 月 19 日生效，无上年度可比较期间及可比较数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鹏华金鼎灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019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)	172,141,588.92	4,235,107.77	176,376,696.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	8,172,372.38	8,172,372.38
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)	294,285,138.94	25,310,869.09	319,596,008.03
其中：1. 基金申购款	376,823,453.82	27,736,056.13	404,559,509.95
2. 基金赎回款	-82,538,314.88	-2,425,187.04	-84,963,501.92
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)	466,426,727.86	37,718,349.24	504,145,077.10

注：本基金基金合同于 2018 年 10 月 19 日生效，无上年度可比较期间及可比较数据。

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：

邓召明

苏波

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

鹏华金鼎灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)是根据原鹏华金鼎保本混合型证券投资基金(以下简称“原鹏华金鼎保本基金”)于 2018 年 10 月 9 日发布的《鹏华金鼎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金鼎灵活配置混合型证券投资基金相关业务规则的公告》，由鹏华金鼎保本混合型证券投资基金转型而来。原鹏华金鼎保本基金第一个保本期

于 2018 年 10 月 15 日到期，且原鹏华金鼎保本基金无法为转入下一保本周期确定保证人或保本义务人，鹏华金鼎保本基金将不符合保本基金存续的条件。经鹏华金鼎保本基金管理人与基金托管人协商一致，自 2018 年 10 月 19 日起，原鹏华金鼎保本基金更名为鹏华金鼎灵活配置混合型证券投资基金，《鹏华金鼎灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于同一日生效，同时《鹏华金鼎保本混合型证券投资基金基金合同》失效。本基金为契约开放式，存续期限不定。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。

原鹏华金鼎保本基金于基金合同失效前的基金资产净值为 354,189,489.51 元，已于本基金的基金合同生效日全部转为本基金的基金资产净值。根据《鹏华金鼎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金鼎灵活配置混合型证券投资基金相关业务规则的公告》的有关规定，原鹏华金鼎保本 A 类基金份额转为鹏华金鼎灵活配置 A 类基金份额，原鹏华金鼎保本 C 类基金份额转为鹏华金鼎灵活配置 C 类基金份额，对投资者持有的原鹏华金鼎保本基金的全部基金份额变更登记为本基金基金份额，基金份额总额为 346,479,704.72 份。

根据《鹏华金鼎灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和鹏华金鼎灵活配置混合型证券投资基金基金招募说明书》的相关规定，本基金根据认购、申购费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购时收取认购、申购费用的基金份额，称为 A 类基金份额；在投资者认购、申购时不收取认购、申购费用，但从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存，并分别计算基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华金鼎灵活配置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，包括国内依法发行的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（含国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券、中小企业私募债、并购重组私募债等）、货币市场工具、权证、资产支持证券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（但须符合中国证监会相关规定）。基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%—95%；本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%，其中现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×55%+中证综合债指数收益率×45%。

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》、《鹏华金鼎灵活配置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 2019 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 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 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。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 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
活期存款	34,780,351.73
定期存款	-
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	-
合计	34,780,351.73

6.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	459,601,959.49	465,622,415.09	6,020,455.60
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-

债券	交易所市场	6,540,842.88	6,530,952.60	-9,890.28
	银行间市场	-	-	-
	合计	6,540,842.88	6,530,952.60	-9,890.28
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		466,142,802.37	472,153,367.69	6,010,565.32

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注:无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注:无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注:无。

6.4.7.5 应收利息

单位:人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应收活期存款利息	13,925.50
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	502.83
应收债券利息	141,718.49
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	27.00
合计	156,173.82

6.4.7.6 其他资产

注:无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位:人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	662,163.35
银行间市场应付交易费用	1,825.00

合计	663,988.35
----	------------

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	189.14
预提费用	348,628.27
合计	348,817.41

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

鹏华金鼎混合 A

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	122,717,160.26	122,717,160.26
本期申购	374,397,697.62	374,397,697.62
本期赎回（以“-”号填列）	-54,302,665.91	-54,302,665.91
-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	442,812,191.97	442,812,191.97

鹏华金鼎混合 C

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	49,424,428.66	49,424,428.66
本期申购	2,425,756.20	2,425,756.20
本期赎回（以“-”号填列）	-28,235,648.97	-28,235,648.97
-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	23,614,535.89	23,614,535.89

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。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

鹏华金鼎混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

上年度末	178,032.61	3,375,383.72	3,553,416.33
本期利润	1,748,740.71	5,190,856.63	6,939,597.34
本期基金份额交易产生的变动数	11,019,266.81	14,748,610.28	25,767,877.09
其中：基金申购款	11,657,740.12	16,022,621.72	27,680,361.84
基金赎回款	-638,473.31	-1,274,011.44	-1,912,484.75
本期已分配利润	-	-	-
本期末	12,946,040.13	23,314,850.63	36,260,890.76
鹏华金鼎混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-640,971.13	1,322,662.57	681,691.44
本期利润	765,057.93	467,717.11	1,232,775.04
本期基金份额交易产生的变动数	119,566.48	-576,574.48	-457,008.00
其中：基金申购款	-21,368.18	77,062.47	55,694.29
基金赎回款	140,934.66	-653,636.95	-512,702.29
本期已分配利润	-	-	-
本期末	243,653.28	1,213,805.20	1,457,458.48

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2019年1月1日至2019年6月30日	
活期存款利息收入		38,293.21
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		17,755.66
其他		1,281.84
合计		57,330.71

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	
	2019年1月1日至2019年6月30日	
卖出股票成交总额		192,810,694.23
减：卖出股票成本总额		188,813,804.53
买卖股票差价收入		3,996,889.70

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-1,667,607.79
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	-1,667,607.79

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	306,785,260.36
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	304,812,875.12
减：应收利息总额	3,639,993.03
买卖债券差价收入	-1,667,607.79

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注:无。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注:无。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注:无。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注:无。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注:无。

6.4.7.16 股利收益

单位:人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	930,111.03
基金投资产生的股利收益	-
合计	930,111.03

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位:人民币元

项目名称	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
1. 交易性金融资产	5,658,573.74
股票投资	6,020,455.60
债券投资	-361,881.86
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减: 应税金融商品公允价值变动	-

产生的预估增值税	
合计	5,658,573.74

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	5,133.89
基金转换费收入	60.75
合计	5,194.64

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
交易所市场交易费用	1,034,159.10
银行间市场交易费用	4,200.00
合计	1,038,359.10

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
审计费用	74,383.76
信息披露费	74,244.51
银行汇划费用	1,762.26
账户维护费	18,000.00
其他	4,100.00
合计	172,490.53

6.4.7.21 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金基金合同于 2018 年 10 月 19 日生效,无上年度可比期间及可比较数据。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
国信证券	216,968,213.62	25.80

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)
国信证券	74,199,895.20	74.67

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)
国信证券	305,610,000.00	14.31

6.4.10.1.4 权证交易

注:无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019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	197,723.17	25.80	197,723.17	29.86

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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费
其中:支付销售机构的客户维护费	453,825.29

注:1、支付基金管理人鹏华基金管理公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.80%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:日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.80%÷当年天数。

2、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。

3、本基金合同生效日起至本报告期末未满一年,故无上年度可比期间数据。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	171,877.96

注:1、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。

2、本基金合同生效日起至本报告期末未满一年，故无上年度可比期间数据。

6.4.10.2.3 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鹏华金鼎混合 A	鹏华金鼎混合 C	合计
国信证券	-	39.78	39.78
鹏华基金公司	-	1,477.38	1,477.38
中国工商银行	-	44,212.02	44,212.02
合计	-	45,729.18	45,729.18

注:1、支付基金销售机构的 C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.80%，逐日计提，按月支付，A 类基金份额不支付销售服务费。日销售服务费=前一日 C 类基金资产净值×0.80%÷当年天数。

2、本基金合同生效日起至本报告期末未满一年，故无上年度可比期间数据。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注:无。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	34,780,351.73	38,293.21

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金在本报告期内及上年度可比期间内未参与本管理人、管理人控股股东、托管人、委托人及委托人控股股东承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

注:无。

6.4.12 期末(2019 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 受限证券类别: 股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	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
300788	中信出版	2019 年 6 月 27 日	2019 年 7 月 5 日	新股未上市	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注:无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注:无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型证券投资基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。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。

6.4.13.2 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中国工商银行股份有限公司，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。于 2019 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券占基金资产净值的比例为 0.3%。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注:无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注:无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注:无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注:无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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、组合在短时间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。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(所有者权益)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。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注:无。

6.4.13.3.2 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、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期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上市公司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其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股股票不得超过该上市公司可流通股股票的 15%,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股票,不得超过该上市公司可流通股股票的 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。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算,确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等，其余大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	34,780,351.73	-	-	-	34,780,351.73
结算备付金	1,241,581.06	-	-	-	1,241,581.06
存出保证金	66,576.08	-	-	-	66,576.08
交易性金融资产	5,003,000.00	1,527,952.60	-	-465,622,415.09	472,153,367.69
应收利息	-	-	-	156,173.82	156,173.82
应收申购款	-	-	-	6,157.13	6,157.13
资产总计	41,091,508.87	1,527,952.60	-	-465,784,746.04	508,404,207.51
负债					
应付赎回款	-	-	-	792,251.28	792,251.28
应付管理人报酬	-	-	-	174,491.06	174,491.06
应付托管费	-	-	-	31,846.49	31,846.49
应付证券清算款	-	-	-	2,230,981.76	2,230,981.76
应付销售服务费	-	-	-	16,180.28	16,180.28
应付交易费用	-	-	-	663,988.35	663,988.35
应交税费	-	-	-	573.78	573.78
其他负债	-	-	-	348,817.41	348,817.41
负债总计	-	-	-	4,259,130.41	4,259,130.41
利率敏感度缺口	41,091,508.87	1,527,952.60	-	-461,525,615.63	504,145,077.10
上年度末 2018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	2,041,865.09	-	-	-	2,041,865.09
结算备付金	1,893,004.03	-	-	-	1,893,004.03
存出保证金	226,184.29	-	-	-	226,184.29
交易性金融资产	38,680,720.00	2,987,900.00	104,025,355.40	-	145,693,975.40
买入返售金融资产	25,996,143.99	-	-	-	25,996,143.99
应收利息	-	-	-	1,918,700.22	1,918,700.22
应收申购款	-	-	-	55,943.36	55,943.36

应收证券清算款	-	-	-	10,326,337.56	10,326,337.56
资产总计	68,837,917.40	2,987,900.00	104,025,355.40	12,300,981.14	188,152,153.94
负债					
应付赎回款	-	-	-	795,476.21	795,476.21
应付管理人报酬	-	-	-	236,862.87	236,862.87
应付托管费	-	-	-	39,477.16	39,477.16
应付证券清算款	-	-	-	10,000,000.00	10,000,000.00
卖出回购金融资产款	200,000.00	-	-	-	200,000.00
应付销售服务费	-	-	-	34,638.76	34,638.76
应付交易费用	-	-	-	13,720.11	13,720.11
应付利息	-	-	-	175.87	175.87
应付税费	-	-	-	5,106.21	5,106.21
其他负债	-	-	-	450,000.06	450,000.06
负债总计	200,000.00	-	-	11,575,457.25	11,775,457.25
利率敏感度缺口	68,637,917.40	2,987,900.00	104,025,355.40	725,523.89	176,376,696.69

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。

6.4.13.4.1.2 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（2019 年 6 月 30 日）	上年度末（2018 年 12 月 31 日）	
分析	市场利率下降 25 个基点	11,867.16	2,165,022.63
	市场利率上升 25 个基点	-11,764.60	-2,115,999.81

注：于 2019 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 1.30%。

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无。

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无。

6.4.13.4.3 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股票和债券，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。本基金股票资产占基金资产的比例为 0%—95%，基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%，本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%。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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日		上年度末 2018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	465,622,415.09	92.36	—	—
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—

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	465,622,415.09	92.36	-	-

注:债券投资为可转换债券、可交换债券投资。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注:于 2019 年 6 月 30 日,由于本基金运行期间不足一年,尚不存在足够的经验数据,因此,无法对本基金资产净值对于市场价格风险的敏感性作定量分析。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注:无。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 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	465,622,415.09	91.59
	其中:股票	465,622,415.09	91.59
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	6,530,952.60	1.28
	其中:债券	6,530,952.60	1.28
	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	36,021,932.79	7.09
8	其他各项资产	228,907.03	0.05
9	合计	508,404,207.51	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

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	6,925,368.00	1.37
B	采矿业	15,019,212.50	2.98
C	制造业	184,640,865.29	36.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,690,139.00	2.12
E	建筑业	14,251,388.00	2.83
F	批发和零售业	6,352,708.00	1.26
G	交通运输、仓储和邮政业	14,307,890.00	2.84
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,119,916.76	3.40
J	金融业	162,872,095.94	32.31
K	房地产业	21,378,064.00	4.24
L	租赁和商务服务业	6,578,824.00	1.30
M	科学研究和技术服务业	338,052.00	0.07
N	水利、环境和公共设施管理业	572,565.00	0.11
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,345,050.00	0.47
R	文化、体育和娱乐业	2,230,276.60	0.44
S	综合	-	-
	合计	465,622,415.09	92.36

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	601318	中国平安	408,854	36,228,552.94	7.19
2	600519	贵州茅台	18,800	18,499,200.00	3.67
3	600036	招商银行	502,500	18,079,950.00	3.59
4	601166	兴业银行	550,900	10,075,961.00	2.00
5	601288	农业银行	2,746,800	9,888,480.00	1.96
6	000651	格力电器	178,600	9,823,000.00	1.95
7	000333	美的集团	174,615	9,055,533.90	1.80
8	000858	五粮液	72,100	8,504,195.00	1.69
9	600276	恒瑞医药	116,800	7,708,800.00	1.53
10	600887	伊利股份	230,700	7,707,687.00	1.53
11	600030	中信证券	298,700	7,112,047.00	1.41

12	601328	交通银行	1,034,900	6,333,588.00	1.26
13	600016	民生银行	936,300	5,945,505.00	1.18
14	000002	万科A	185,100	5,147,631.00	1.02
15	300498	温氏股份	142,300	5,102,878.00	1.01
16	601668	中国建筑	789,900	4,541,925.00	0.90
17	600900	长江电力	250,500	4,483,950.00	0.89
18	000001	平安银行	323,700	4,460,586.00	0.88
19	600837	海通证券	305,900	4,340,721.00	0.86
20	601601	中国太保	118,800	4,337,388.00	0.86
21	002415	海康威视	144,400	3,982,552.00	0.79
22	600104	上汽集团	140,300	3,577,650.00	0.71
23	600048	保利地产	269,100	3,433,716.00	0.68
24	601169	北京银行	561,700	3,319,647.00	0.66
25	601888	中国国旅	36,400	3,226,860.00	0.64
26	603288	海天味业	30,300	3,181,500.00	0.63
27	601688	华泰证券	140,800	3,142,656.00	0.62
28	000725	京东方A	910,000	3,130,400.00	0.62
29	600585	海螺水泥	74,800	3,104,200.00	0.62
30	601211	国泰君安	165,900	3,044,265.00	0.60
31	600009	上海机场	36,000	3,016,080.00	0.60
32	000063	中兴通讯	91,800	2,986,254.00	0.59
33	601766	中国中车	368,700	2,982,783.00	0.59
34	601988	中国银行	795,700	2,975,918.00	0.59
35	600031	三一重工	221,000	2,890,680.00	0.57
36	300059	东方财富	206,900	2,803,495.00	0.56
37	600028	中国石化	507,400	2,775,478.00	0.55
38	002304	洋河股份	22,500	2,735,100.00	0.54
39	601088	中国神华	122,800	2,502,664.00	0.50
40	600309	万华化学	58,000	2,481,820.00	0.49
41	601229	上海银行	207,400	2,457,690.00	0.49
42	600690	海尔智家	136,733	2,364,113.57	0.47
43	002475	立讯精密	95,000	2,355,050.00	0.47
44	002142	宁波银行	97,100	2,353,704.00	0.47
45	601818	光大银行	599,900	2,285,619.00	0.45
46	000338	潍柴动力	182,100	2,238,009.00	0.44
47	000568	泸州老窖	27,300	2,206,659.00	0.44
48	600340	华夏幸福	67,400	2,195,218.00	0.44
49	601012	隆基股份	94,600	2,186,206.00	0.43
50	600050	中国联通	354,500	2,183,720.00	0.43
51	600019	宝钢股份	330,900	2,150,850.00	0.43
52	601857	中国石油	307,000	2,112,160.00	0.42
53	002027	分众传媒	395,300	2,091,137.00	0.41

54	601939	建设银行	269,400	2,004,336.00	0.40
55	601989	中国重工	348,700	1,938,772.00	0.38
56	600919	江苏银行	262,100	1,902,846.00	0.38
57	001979	招商蛇口	90,700	1,895,630.00	0.38
58	601009	南京银行	227,200	1,876,672.00	0.37
59	002230	科大讯飞	56,200	1,868,088.00	0.37
60	601881	中国银河	151,000	1,849,750.00	0.37
61	601390	中国中铁	283,500	1,848,420.00	0.37
62	600999	招商证券	107,900	1,844,011.00	0.37
63	002714	牧原股份	31,000	1,822,490.00	0.36
64	601006	大秦铁路	223,500	1,808,115.00	0.36
65	600015	华夏银行	232,800	1,792,560.00	0.36
66	601628	中国人寿	62,500	1,770,000.00	0.35
67	601186	中国铁建	175,400	1,745,230.00	0.35
68	002594	比亚迪	34,100	1,729,552.00	0.34
69	601899	紫金矿业	456,200	1,719,874.00	0.34
70	000166	申万宏源	342,400	1,715,424.00	0.34
71	601336	新华保险	31,100	1,711,433.00	0.34
72	000661	长春高新	5,000	1,690,000.00	0.34
73	600570	恒生电子	24,400	1,662,860.00	0.33
74	000538	云南白药	19,500	1,626,690.00	0.32
75	002024	苏宁易购	136,300	1,564,724.00	0.31
76	600352	浙江龙盛	98,400	1,551,768.00	0.31
77	601669	中国电建	290,300	1,535,687.00	0.30
78	000776	广发证券	110,400	1,516,896.00	0.30
79	601933	永辉超市	146,000	1,490,660.00	0.30
80	300015	爱尔眼科	47,000	1,455,590.00	0.29
81	600958	东方证券	136,200	1,454,616.00	0.29
82	601225	陕西煤业	149,200	1,378,608.00	0.27
83	000100	TCL 集团	411,200	1,369,296.00	0.27
84	000876	新 希 望	78,200	1,358,334.00	0.27
85	300142	沃森生物	46,700	1,324,412.00	0.26
86	601155	新城控股	33,000	1,313,730.00	0.26
87	600741	华域汽车	60,700	1,311,120.00	0.26
88	600406	国电南瑞	69,500	1,295,480.00	0.26
89	600436	片仔癀	11,200	1,290,240.00	0.26
90	600588	用友网络	47,100	1,266,048.00	0.25
91	002202	金风科技	101,500	1,261,645.00	0.25
92	600660	福耀玻璃	53,100	1,206,963.00	0.24
93	601377	兴业证券	178,700	1,204,438.00	0.24
94	000157	中联重科	193,900	1,165,339.00	0.23
95	600010	包钢股份	684,800	1,157,312.00	0.23

96	000783	长江证券	147,000	1,148,070.00	0.23
97	600795	国电电力	449,800	1,142,492.00	0.23
98	002008	大族激光	33,000	1,134,540.00	0.23
99	600547	山东黄金	27,300	1,123,941.00	0.22
100	600705	中航资本	206,700	1,120,314.00	0.22
101	000069	华侨城 A	157,300	1,093,235.00	0.22
102	601111	中国国航	113,700	1,088,109.00	0.22
103	601108	财通证券	97,300	1,068,354.00	0.21
104	600703	三安光电	94,400	1,064,832.00	0.21
105	600011	华能国际	169,800	1,057,854.00	0.21
106	603993	洛阳钼业	264,300	1,046,628.00	0.21
107	600111	北方稀土	81,100	1,041,324.00	0.21
108	600438	通威股份	72,900	1,024,974.00	0.20
109	600383	金地集团	85,700	1,022,401.00	0.20
110	600089	特变电工	141,000	1,022,250.00	0.20
111	601800	中国交建	89,600	1,014,272.00	0.20
112	600029	南方航空	130,900	1,010,548.00	0.20
113	600886	国投电力	129,700	1,007,769.00	0.20
114	002236	大华股份	68,600	996,072.00	0.20
115	601985	中国核电	176,500	981,340.00	0.19
116	600000	浦发银行	83,900	979,952.00	0.19
117	600271	航天信息	42,200	972,710.00	0.19
118	601600	中国铝业	247,300	969,416.00	0.19
119	002422	科伦药业	32,500	966,225.00	0.19
120	600196	复星医药	37,800	956,340.00	0.19
121	002007	华兰生物	31,300	954,337.00	0.19
122	002001	新 和 成	49,000	945,210.00	0.19
123	600606	绿地控股	138,200	943,906.00	0.19
124	600115	东方航空	150,100	941,127.00	0.19
125	000895	双汇发展	37,500	933,375.00	0.19
126	601555	东吴证券	91,000	932,750.00	0.19
127	300003	乐普医疗	40,300	927,706.00	0.18
128	002311	海大集团	29,300	905,370.00	0.18
129	600061	国投资本	64,400	902,244.00	0.18
130	600109	国金证券	92,000	894,240.00	0.18
131	002044	美年健康	71,500	889,460.00	0.18
132	600221	海航控股	437,700	888,531.00	0.18
133	300124	汇川技术	38,300	877,453.00	0.17
134	600332	白云山	21,100	864,467.00	0.17
135	000413	东旭光电	168,000	863,520.00	0.17
136	600522	中天科技	93,800	860,146.00	0.17
137	000963	华东医药	33,000	856,680.00	0.17

138	600487	亨通光电	50,800	851,408.00	0.17
139	002410	广联达	25,700	845,273.00	0.17
140	601788	光大证券	74,000	845,080.00	0.17
141	600177	雅戈尔	132,800	843,280.00	0.17
142	600018	上港集团	122,600	836,132.00	0.17
143	603019	中科曙光	23,800	835,380.00	0.17
144	600637	东方明珠	78,300	825,282.00	0.16
145	600100	同方股份	91,000	823,550.00	0.16
146	601618	中国中冶	270,100	821,104.00	0.16
147	000768	中航飞机	52,000	819,000.00	0.16
148	300033	同花顺	8,200	806,552.00	0.16
149	601607	上海医药	43,800	794,970.00	0.16
150	300017	网宿科技	73,600	793,408.00	0.16
151	000425	徐工机械	177,100	789,866.00	0.16
152	300122	智飞生物	18,100	780,110.00	0.15
153	600893	航发动力	34,100	774,411.00	0.15
154	300408	三环集团	39,800	774,110.00	0.15
155	002352	顺丰控股	22,300	757,308.00	0.15
156	601877	正泰电器	32,600	752,734.00	0.15
157	600498	烽火通信	27,000	752,220.00	0.15
158	002271	东方雨虹	33,000	747,780.00	0.15
159	600176	中国巨石	78,000	743,340.00	0.15
160	601919	中远海控	146,700	736,434.00	0.15
161	300136	信维通信	30,000	733,500.00	0.15
162	600516	方大炭素	59,004	725,159.16	0.14
163	601727	上海电气	134,200	721,996.00	0.14
164	000728	国元证券	77,000	706,090.00	0.14
165	601998	中信银行	116,300	694,311.00	0.14
166	000423	东阿阿胶	17,300	688,886.00	0.14
167	600004	白云机场	37,800	687,960.00	0.14
168	002460	赣锋锂业	29,300	686,499.00	0.14
169	600023	浙能电力	154,200	681,564.00	0.14
170	002673	西部证券	67,000	675,360.00	0.13
171	600809	山西汾酒	9,700	669,785.00	0.13
172	600867	通化东宝	43,300	666,820.00	0.13
173	002241	歌尔股份	75,000	666,750.00	0.13
174	600489	中金黄金	64,300	660,361.00	0.13
175	601018	宁波港	149,100	654,549.00	0.13
176	002466	天齐锂业	25,800	652,224.00	0.13
177	600068	葛洲坝	104,600	651,658.00	0.13
178	600926	杭州银行	78,000	649,740.00	0.13
179	600066	宇通客车	49,800	648,396.00	0.13

180	002179	中航光电	19,300	645,778.00	0.13
181	601021	春秋航空	14,200	639,000.00	0.13
182	600170	上海建工	169,300	636,568.00	0.13
183	300024	机器人	41,600	633,568.00	0.13
184	601997	贵阳银行	73,200	633,180.00	0.13
185	002081	金螳螂	61,400	633,034.00	0.13
186	300144	宋城演艺	27,300	631,722.00	0.13
187	002146	荣盛发展	66,500	624,435.00	0.12
188	600398	海澜之家	68,700	623,109.00	0.12
189	601198	东兴证券	52,400	622,512.00	0.12
190	600219	南山铝业	273,100	617,206.00	0.12
191	000961	中南建设	71,200	616,592.00	0.12
192	002602	世纪华通	56,200	613,704.00	0.12
193	600482	中国动力	25,800	609,396.00	0.12
194	601838	成都银行	68,900	608,387.00	0.12
195	600362	江西铜业	38,600	607,564.00	0.12
196	600085	同仁堂	20,800	603,200.00	0.12
197	000703	恒逸石化	43,500	594,210.00	0.12
198	600674	川投能源	66,400	590,960.00	0.12
199	603156	养元饮品	15,900	589,572.00	0.12
200	000630	铜陵有色	238,700	587,202.00	0.12
201	002739	万达电影	31,700	584,548.00	0.12
202	002493	荣盛石化	48,000	578,880.00	0.11
203	000786	北新建材	31,600	572,908.00	0.11
204	300070	碧水源	73,500	572,565.00	0.11
205	603986	兆易创新	6,600	572,220.00	0.11
206	002456	欧菲光	72,900	571,536.00	0.11
207	600535	天士力	34,500	570,975.00	0.11
208	600297	广汇汽车	124,100	553,486.00	0.11
209	002555	三七互娱	40,500	548,775.00	0.11
210	002050	三花智控	52,000	548,600.00	0.11
211	000629	攀钢钒钛	161,500	547,485.00	0.11
212	601138	工业富联	45,300	545,865.00	0.11
213	300296	利亚德	68,600	537,138.00	0.11
214	600369	西南证券	106,800	527,592.00	0.10
215	002624	完美世界	20,200	521,362.00	0.10
216	603799	华友钴业	24,300	517,833.00	0.10
217	600663	陆家嘴	33,000	511,500.00	0.10
218	000596	古井贡酒	4,300	509,593.00	0.10
219	603833	欧派家居	4,700	505,814.00	0.10
220	600118	中国卫星	22,400	505,120.00	0.10
221	600208	新湖中宝	160,400	503,656.00	0.10

222	002065	东华软件	70,600	493,494.00	0.10
223	600346	恒力石化	40,460	491,993.60	0.10
224	000656	金科股份	81,000	488,430.00	0.10
225	000627	天茂集团	74,900	486,101.00	0.10
226	000625	长安汽车	73,100	484,653.00	0.10
227	002508	老板电器	17,800	483,092.00	0.10
228	000709	河钢股份	159,700	477,503.00	0.09
229	600153	建发股份	53,500	475,080.00	0.09
230	601992	金隅集团	126,200	474,512.00	0.09
231	601878	浙商证券	50,600	470,580.00	0.09
232	002032	苏泊尔	6,200	470,146.00	0.09
233	600027	华电国际	124,100	467,857.00	0.09
234	600583	海油工程	83,400	467,040.00	0.09
235	600038	中直股份	11,200	459,424.00	0.09
236	600760	中航沈飞	15,800	458,674.00	0.09
237	601117	中国化学	74,500	448,490.00	0.09
238	600977	中国电影	28,500	446,310.00	0.09
239	603858	步长制药	16,900	435,513.00	0.09
240	002153	石基信息	12,000	434,280.00	0.09
241	600688	上海石化	83,000	428,280.00	0.08
242	601216	君正集团	129,000	424,410.00	0.08
243	600415	小商品城	102,800	423,536.00	0.08
244	002558	巨人网络	23,000	417,910.00	0.08
245	600816	安信信托	82,400	416,120.00	0.08
246	002252	上海莱士	56,800	394,760.00	0.08
247	000671	阳光城	60,600	392,688.00	0.08
248	601319	中国人保	41,100	390,039.00	0.08
249	601238	广汽集团	34,800	380,364.00	0.08
250	601633	长城汽车	45,800	378,766.00	0.08
251	002010	传化智联	50,300	378,759.00	0.08
252	002310	东方园林	62,500	375,000.00	0.07
253	600188	兖州煤业	33,000	358,710.00	0.07
254	002294	信立泰	16,000	358,080.00	0.07
255	300072	三聚环保	44,900	356,057.00	0.07
256	000402	金融街	44,900	352,016.00	0.07
257	600704	物产中大	64,600	350,132.00	0.07
258	601066	中信建投	16,500	347,820.00	0.07
259	002601	龙蟠佰利	23,100	342,573.00	0.07
260	002120	韵达股份	11,100	342,102.00	0.07
261	000898	鞍钢股份	89,570	339,470.30	0.07
262	603259	药明康德	3,900	338,052.00	0.07
263	601898	中煤能源	69,000	331,200.00	0.07

264	002773	康弘药业	10,000	329,200.00	0.07
265	300413	芒果超媒	7,800	320,190.00	0.06
266	601360	三六零	14,700	314,286.00	0.06
267	002411	延安必康	17,500	304,500.00	0.06
268	000938	紫光股份	11,000	299,750.00	0.06
269	600372	中航电子	20,100	298,284.00	0.06
270	601228	广州港	71,100	297,198.00	0.06
271	002468	申通快递	11,200	279,328.00	0.06
272	000415	渤海租赁	71,100	278,712.00	0.06
273	600025	华能水电	67,900	276,353.00	0.05
274	600339	中油工程	64,200	270,924.00	0.05
275	600998	九州通	21,600	266,976.00	0.05
276	300251	光线传媒	33,000	224,400.00	0.04
277	601162	天风证券	20,100	217,884.00	0.04
278	601808	中海油服	22,400	215,712.00	0.04
279	300433	蓝思科技	30,100	209,797.00	0.04
280	002925	盈趣科技	5,200	202,852.00	0.04
281	600390	五矿资本	20,200	190,486.00	0.04
282	002945	华林证券	9,800	181,300.00	0.04
283	000553	安道麦 A	16,900	181,168.00	0.04
284	601828	美凯龙	14,800	179,820.00	0.04
285	603260	合盛硅业	3,800	178,828.00	0.04
286	600233	圆通速递	13,800	170,154.00	0.03
287	000408	藏格控股	20,400	168,708.00	0.03
288	601298	青岛港	18,500	155,215.00	0.03
289	002625	光启技术	16,700	155,143.00	0.03
290	601212	白银有色	33,000	144,870.00	0.03
291	601577	长沙银行	14,500	138,330.00	0.03
292	600733	北汽蓝谷	15,900	131,334.00	0.03
293	600299	安迪苏	10,900	113,033.00	0.02
294	600968	海油发展	15,750	55,912.50	0.01
295	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.01
296	300594	朗进科技	721	31,803.31	0.01
297	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.01
298	300788	中信出版	1,556	23,106.60	0.00

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

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	601318	中国平安	37,448,997.46	21.23
2	600519	贵州茅台	19,191,028.50	10.88

3	600036	招商银行	17,726,749.00	10.05
4	002475	立讯精密	11,877,870.72	6.73
5	601166	兴业银行	9,999,972.96	5.67
6	601288	农业银行	9,972,258.00	5.65
7	000651	格力电器	9,559,586.12	5.42
8	600030	中信证券	9,371,332.49	5.31
9	002463	沪电股份	9,068,440.00	5.14
10	000333	美的集团	9,020,226.50	5.11
11	601881	中国银河	8,847,534.00	5.02
12	600276	恒瑞医药	8,725,254.96	4.95
13	300498	温氏股份	8,711,918.00	4.94
14	600837	海通证券	8,575,355.00	4.86
15	000858	五粮液	8,218,839.00	4.66
16	600600	青岛啤酒	7,935,559.25	4.50
17	000063	中兴通讯	7,776,305.00	4.41
18	600887	伊利股份	7,491,872.00	4.25
19	300525	博思软件	7,427,959.00	4.21
20	600309	万华化学	7,110,634.00	4.03
21	300122	智飞生物	7,045,888.69	3.99
22	603160	汇顶科技	6,625,810.00	3.76
23	600031	三一重工	6,611,251.32	3.75
24	601328	交通银行	6,340,236.00	3.59
25	600016	民生银行	5,956,862.41	3.38
26	601688	华泰证券	5,852,790.24	3.32
27	600958	东方证券	5,676,887.00	3.22
28	600298	安琪酵母	5,614,853.68	3.18
29	603317	天味食品	5,338,248.00	3.03
30	600104	上汽集团	5,237,668.00	2.97
31	002851	麦格米特	5,212,396.00	2.96
32	601066	中信建投	5,188,577.56	2.94
33	000002	万科A	5,140,431.20	2.91
34	600886	国投电力	5,087,498.58	2.88
35	601336	新华保险	5,030,101.00	2.85
36	601668	中国建筑	4,631,463.80	2.63
37	600900	长江电力	4,441,473.00	2.52
38	601601	中国太保	4,297,838.00	2.44
39	000001	平安银行	4,292,877.94	2.43
40	600741	华域汽车	4,231,260.00	2.40
41	002670	国盛金控	4,225,106.45	2.40
42	601939	建设银行	4,046,867.00	2.29
43	601888	中国国旅	4,020,672.35	2.28
44	002415	海康威视	3,764,332.75	2.13

45	002430	杭氧股份	3,695,562.00	2.10
46	603338	浙江鼎力	3,650,830.48	2.07

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。

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

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	002475	立讯精密	8,640,942.40	4.90
2	002463	沪电股份	8,510,583.00	4.83
3	600600	青岛啤酒	8,244,270.48	4.67
4	300525	博思软件	7,656,075.80	4.34
5	603160	汇顶科技	7,558,186.00	4.29
6	601881	中国银河	7,361,420.00	4.17
7	600298	安琪酵母	6,287,021.44	3.56
8	300122	智飞生物	5,970,943.00	3.39
9	603317	天味食品	5,770,602.00	3.27
10	002851	麦格米特	5,032,595.75	2.85
11	600309	万华化学	4,873,386.00	2.76
12	600958	东方证券	4,398,656.00	2.49
13	601066	中信建投	4,382,655.00	2.48
14	000063	中兴通讯	4,364,730.50	2.47
15	600837	海通证券	4,251,936.00	2.41
16	600031	三一重工	4,192,071.00	2.38
17	002670	国盛金控	4,164,868.19	2.36
18	600886	国投电力	4,122,779.00	2.34
19	603338	浙江鼎力	4,031,037.20	2.29
20	300498	温氏股份	3,954,050.00	2.24
21	002430	杭氧股份	3,755,281.00	2.13

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。

7.4.3 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	648,415,764.02
卖出股票收入(成交)总额	192,810,694.23

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。

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	5,003,000.00	0.99
	其中：政策性金融债	5,003,000.00	0.99
4	企业债券	1,527,952.60	0.30
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	6,530,952.60	1.30

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	108603	国开 1804	50,000	5,003,000.00	0.99
2	124736	PR 柳龙投	20,270	1,527,952.60	0.30

7.7 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。

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

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。

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	66,576.08
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	156,173.82
5	应收申购款	6,157.13
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	228,907.03

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(%)
鹏华金鼎混合 A	1,205	367,479.00	372,437,616.38	84.11	70,374,575.59	15.89
鹏华金鼎混合 C	399	59,184.30	-	-	23,614,535.89	100.00
合计	1,604	290,789.73	372,437,616.38	79.85	93,989,111.48	20.15

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	鹏华金鼎混合 A	9,691.57	0.0022
	鹏华金鼎混合 C	-	-
	合计	9,691.57	0.0021

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	鹏华金鼎混合 A	0~10
	鹏华金鼎混合 C	-
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	鹏华金鼎混合 A	-
	鹏华金鼎混合 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	鹏华金鼎混合 A	鹏华金鼎混合 C
基金合同生效日 (2018年10月19日)基金份额总额	213,496,397.85	70,208,697.75
本报告期期初基金份额总额	122,717,160.26	49,424,428.66
本报告期基金总申购份额	374,397,697.62	2,425,756.20
减:本报告期基金总赎回份额	54,302,665.91	28,235,648.97
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	442,812,191.97	23,614,535.89

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

报告期内,基金管理人无重大人事变动。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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	
申万宏源	1	306,218,149.56	36.41%	279,050.01	36.41%	-
国信证券	2	216,968,213.62	25.80%	197,723.17	25.80%	-
招商证券	1	185,948,879.94	22.11%	169,455.18	22.11%	-
东吴证券	1	80,402,830.77	9.56%	73,271.65	9.56%	-
中信证券	1	31,874,156.13	3.79%	29,046.96	3.79%	-
西南证券	1	19,700,775.00	2.34%	17,953.38	2.34%	-
华林证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	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
申万宏源	12,832,644.10	12.91%	229,700,000.00	10.76%	-	-
国信证券	74,199,895.20	74.67%	305,610,000.00	14.31%	-	-
招商证券	1,154,348.76	1.16%	85,066,000.00	3.98%	-	-
东吴证券	5,128,287.70	5.16%	1,478,100,000.00	69.24%	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	6,056,940.30	6.10%	9,320,000.00	0.44%	-	-
华林证券	-	-	27,100,000.00	1.27%	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-

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	2018 年第四季度报告	《证券日报》	2019 年 01 月 21 日
2	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金在浙江金观诚基金销售有限公司暂停办理相关销售业务的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2019 年 01 月 22 日
3	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2019 年 02 月 12 日
4	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》	2019 年 02 月 26 日
5	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金	《中国证券报》	2019 年 02 月 26 日

	持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告		
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	《证券时报》	2019 年 02 月 26 日
7	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《中国证券报》	2019 年 03 月 01 日
8	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《上海证券报》	2019 年 03 月 01 日
9	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《证券日报》	2019 年 03 月 01 日
10	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《证券时报》	2019 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北京恒天明泽基金销售有限公司认\申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2019 年 03 月 13 日
12	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与北京恒天明泽基金销售有限公司认\申购费率优惠活动的公告	《证券时报》	2019 年 03 月 13 日
13	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与北京恒天明泽基金销售有限公司认\申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》	2019 年 03 月 13 日
14	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与北京恒天明泽基金销售有限公司认\申购费率优惠活动的公告	《证券日报》	2019 年 03 月 13 日
15	鹏华基金管理有限公司关于增加上海基煜基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《上海证券报》	2019 年 03 月 20 日
16	鹏华基金管理有限公司关于增加上海基煜基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《证券日报》	2019 年 03 月 20 日
17	鹏华基金管理有限公司关于增加上海基煜基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》	2019 年 03 月 20 日
18	鹏华基金管理有限公司关于增加上海基煜基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《证券时报》	2019 年 03 月 20 日
19	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与国信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	《中国证券报》	2019 年 03 月 27 日
20	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与国信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	《证券时报》	2019 年 03 月 27 日
21	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与国信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	《证券日报》	2019 年 03 月 27 日

	公告		
22	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与国信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》	2019年03月27日
23	2018年年度报告摘要	《证券日报》	2019年03月28日
24	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国中投证券有限责任公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2019年03月29日
25	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国中投证券有限责任公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《证券时报》	2019年03月29日
26	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国中投证券有限责任公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《证券日报》	2019年03月29日
27	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国中投证券有限责任公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《中国证券报》	2019年03月29日
28	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行股份有限公司手机银行渠道基金申购及定期定额投资申购费率优惠的公告	《证券时报》	2019年03月30日
29	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行股份有限公司手机银行渠道基金申购及定期定额投资申购费率优惠的公告	《中国证券报》	2019年03月30日
30	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行股份有限公司手机银行渠道基金申购及定期定额投资申购费率优惠的公告	《上海证券报》	2019年03月30日
31	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行股份有限公司手机银行渠道基金申购及定期定额投资申购费率优惠的公告	《证券日报》	2019年03月30日
32	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	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2019年04月08日
33	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》	2019年04月13日

34	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	《中国证券报》	2019 年 04 月 13 日
35	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	《证券时报》	2019 年 04 月 13 日
36	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	《证券日报》	2019 年 04 月 13 日
37	2019 年第一季度报告	《证券日报》	2019 年 04 月 19 日
38	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	《证券日报》	2019 年 05 月 07 日
39	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	《证券时报》	2019 年 05 月 07 日
40	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	《中国证券报》	2019 年 05 月 07 日
41	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》	2019 年 05 月 07 日
42	鹏华基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	《证券日报》	2019 年 05 月 13 日
43	鹏华基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	《证券时报》	2019 年 05 月 13 日
44	鹏华基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	《中国证券报》	2019 年 05 月 13 日
45	鹏华基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	《上海证券报》	2019 年 05 月 13 日
46	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票估值方法变更的提示性公告	《证券时报》	2019 年 05 月 18 日
47	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》	2019 年 05 月 18 日
48	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票估值方法变更的提示性公告	《证券日报》	2019 年 05 月 18 日
49	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金	《上海证券报》	2019 年 05 月 18 日

	持有的停牌股票估值方法变更的提示性公告		
50	鹏华基金管理有限公司关于北京恒天明泽基金销售有限公司终止销售本公司旗下部分基金的公告	《证券日报》	2019 年 05 月 22 日
51	鹏华金鼎灵活配置混合型证券投资基金更新的招募说明书摘要	《证券日报》	2019 年 06 月 03 日
52	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资于科创板股票的公告	《证券日报》	2019 年 06 月 20 日
53	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资于科创板股票的公告	《上海证券报》	2019 年 06 月 20 日
54	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资于科创板股票的公告	《中国证券报》	2019 年 06 月 20 日
55	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资于科创板股票的公告	《证券时报》	2019 年 06 月 20 日
56	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与徽商银行股份有限公司认、申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《证券时报》	2019 年 06 月 24 日
57	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与徽商银行股份有限公司认、申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《证券日报》	2019 年 06 月 24 日
58	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与徽商银行股份有限公司认、申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2019 年 06 月 24 日
59	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与徽商银行股份有限公司认、申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《中国证券报》	2019 年 06 月 24 日
60	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票估值方法变更的提示性公告	《证券日报》	2019 年 06 月 26 日
61	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票估值方法变更的提示性公告	《上海证券报》	2019 年 06 月 26 日
62	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》	2019 年 06 月 26 日
63	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票估值方法变更的提示性公告	《证券时报》	2019 年 06 月 26 日
64	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分	《上海证券报》	2019 年 06 月 27 日

	基金参与中国银行股份有限公司定期定额申购费率优惠活动的公告		
65	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国银行股份有限公司定期定额申购费率优惠活动的公告	《证券时报》	2019 年 06 月 27 日
66	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国银行股份有限公司定期定额申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》	2019 年 06 月 27 日
67	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国银行股份有限公司定期定额申购费率优惠活动的公告	《证券日报》	2019 年 06 月 27 日
68	关于调整鹏华金鼎灵活配置混合型证券投资基金管理费率 and 托管费率并修改基金合同等事项的公告	《证券日报》	2019 年 06 月 28 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20190625~20190630	-	186,218,808.19	-	186,218,808.19	39.92
	2	20190625~20190630	-	186,218,808.19	-	186,218,808.19	39.92
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
基金份额持有人持有的基金份额所占比例过于集中时,可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引起基金净值剧烈波动,甚至可能引发基金流动性风险,基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请,基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。							

注:1、申购份额包含基金申购份额、基金转换入份额、强制调增份额、场内买入份额、指数分级基金合并份额和红利再投;

2、赎回份额包含基金赎回份额、基金转换出份额、强制调减份额、场内卖出份额和指数分级基金拆分份额。

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)《鹏华金鼎灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- (二)《鹏华金鼎灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- (三)《鹏华金鼎灵活配置混合型证券投资基金 2019 年半年度报告》（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 43 层鹏华基金管理有限公司

北京市西城区复兴门内大街 55 号中国工商银行股份有限公司

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>）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

2019 年 8 月 23 日