

# 鹏华弘泽灵活配置混合型证券投资基金 2019 年半年度报告摘要

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：招商银行股份有限公司

送出日期：2019 年 8 月 23 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。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。

基金托管人招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 2019 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	鹏华弘泽混合	
基金主代码	001172	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 4 月 14 日	
基金管理人	鹏华基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	454,922,734.30 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	鹏华弘泽混合 A	鹏华弘泽混合 C
下属分级基金的交 易代码	001172	001381
报告期末下属分级 基金的份额总额	454,600,389.99 份	322,344.31 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，严选安全边际较高的股票、债券等投资标的，力争实现绝对收益的目标。
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、税收、货币、汇率政策等），并结合美林时钟等科学严谨的资产配置模型，动态评估不同资产大类在不同时期的投资价值及其风险收益特征，追求股票、债券和货币等大类资产的灵活配置和稳健的绝对收益目标。</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上市公司，严选其中安全边际较高的个股构建投资组合：自上而下地分析行业的成长前景、行业结构、商业模式、竞争要素等分析把握其投资机会；自下而上地评判企业的产品、核心竞争力、管理层、治理结构等；并结合企业基本面和估值水平进行综合的研判，严选安全边际较高的个股，力争实现组合的绝对收益。</p> <p>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、中小企业私募债投资策略等积极投资策略，灵活地调整组合的券种搭配，精选安全边际较高的个券，</p>

	力争实现组合的绝对收益。4、股指期货、权证等投资策略 本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低申购赎回时现金资产对投资组合的影响及投资组合仓位调整的交易成本，达到稳定投资组合资产净值的目的。
业绩比较基准	一年期银行定期存款利率（税后）+3%
风险收益特征	本基金属于混合型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金，属于证券投资基金里中高风险、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	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张戈	张燕
	联系电话	0755-82825720	0755-83199084
	电子邮箱	zhangge@phfund.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		4006788999	95555
传真		0755-82021126	0755-83195201

### 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	<a href="http://www.phfund.com.cn">http://www.phfund.com.cn</a>
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(2019年1月1日-2019年6月30日)	
	鹏华弘泽混合 A	鹏华弘泽混合 C
本期已实现收益	2,416,298.60	55,621.41
本期利润	6,011,479.27	45,754.45
加权平均基金份额本期利润	0.0511	0.0111
本期基金份额净值增长率	2.01%	1.97%

3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)	
期末可供分配基金份额利润	0.1182	0.1037
期末基金资产净值	519,588,090.90	361,281.00
期末基金份额净值	1.1430	1.1208

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

鹏华弘泽混合 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	1.17%	0.14%	0.37%	0.01%	0.80%	0.13%
过去三个月	1.36%	0.09%	1.12%	0.01%	0.24%	0.08%
过去六个月	2.01%	0.06%	2.23%	0.01%	-0.22%	0.05%
过去一年	0.94%	0.23%	4.50%	0.01%	-3.56%	0.22%
过去三年	6.92%	0.18%	13.50%	0.01%	-6.58%	0.17%
自基金成立起	14.30%	0.16%	19.27%	0.01%	-4.97%	0.15%

鹏华弘泽混合 C

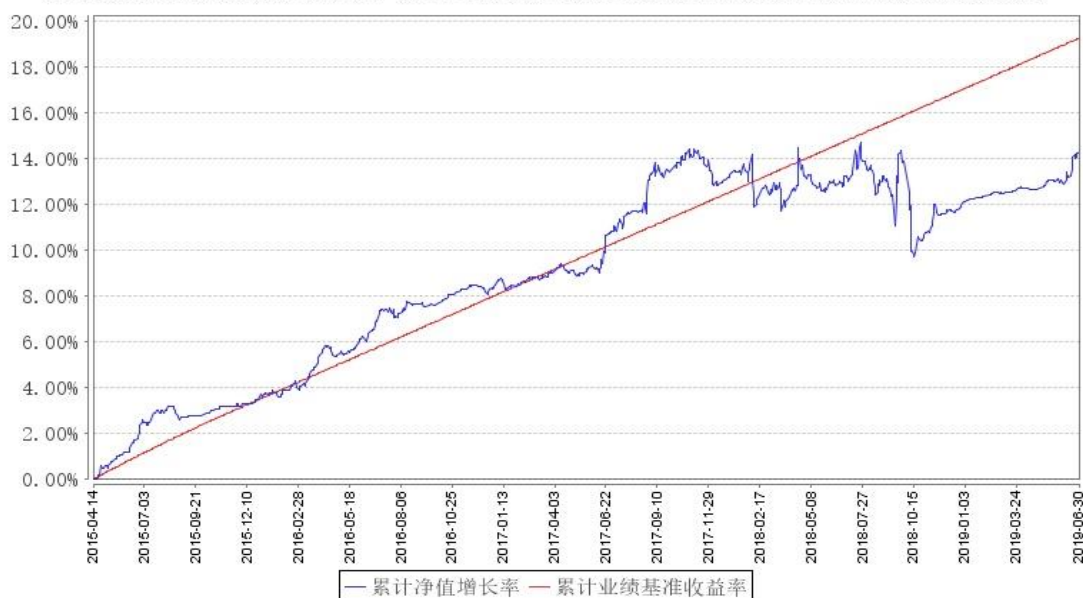
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.16%	0.14%	0.37%	0.01%	0.79%	0.13%
过去三个月	1.33%	0.09%	1.12%	0.01%	0.21%	0.08%
过去六个月	1.97%	0.06%	2.23%	0.01%	-0.26%	0.05%
过去一年	0.73%	0.23%	4.50%	0.01%	-3.77%	0.22%

过去三年	6.37%	0.18%	13.50%	0.01%	-7.13%	0.17%
自基金成立起	12.08%	0.16%	18.66%	0.01%	-6.58%	0.15%

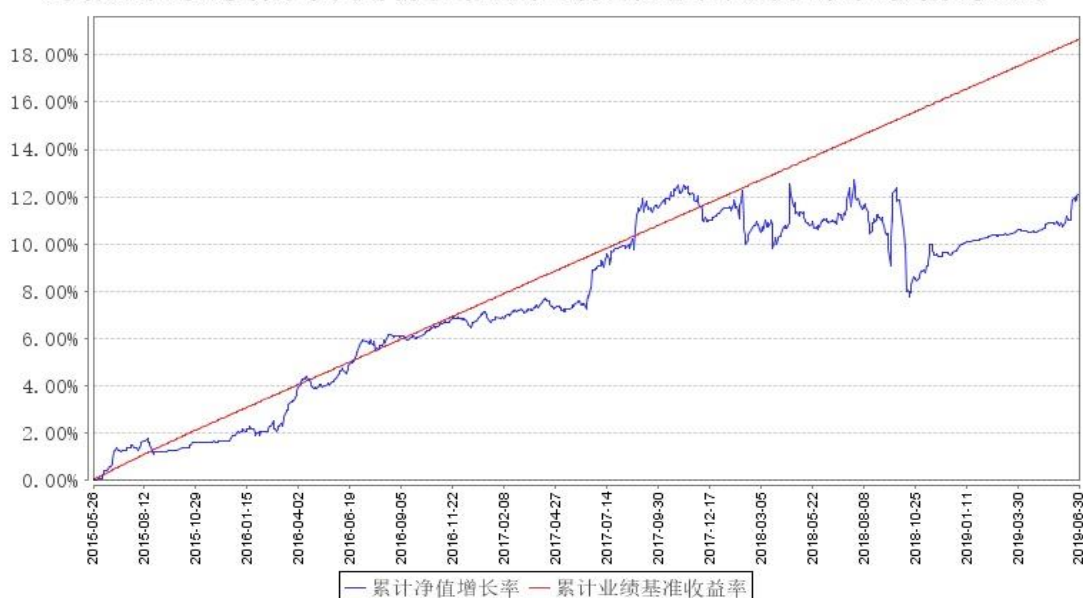
注：业绩比较基准=一年期银行定期存款利率(税后)+3%

### 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

鹏华弘泽混合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



鹏华弘泽混合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 2015 年 04 月 14 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		
周恩源	本基金基金经理	2016-02-27	-	7	周恩源先生，国籍中国，经济学博士，7 年证券基金从业经验。2012 年 6 月加盟鹏华基金管理有限公司，从事债券投资研究工作，历任固定收益部基金经理助理/高级债券研究员，现担任公募债券投资部基金经理。2016 年 02 月担任鹏华丰泽债券（LOF）基金基金经理，2016 年 02 月担任鹏华弘泽混合基金基金经理，2016 年 09 月担任鹏华丰饶债券基金基金经理，2016 年 09 月至 2018 年 07 月担任鹏华弘康混合基金基金经理，2016 年 09 月至 2018 年 06 月担任鹏华弘腾混合基金基金经理，2016 年 10 月至

					<p>2018 年 07 月担任鹏华弘尚混合基金基金经理，2017 年 03 月担任鹏华丰玉债券基金基金经理，2017 年 03 月担任鹏华丰享债券基金基金经理，2017 年 05 月担任鹏华弘泰混合基金基金经理，2017 年 07 月至 2018 年 03 月担任鹏华丰玺债券基金基金经理，2017 年 07 月担任鹏华丰源债券基金基金经理，2018 年 02 月担任鹏华永泽定期开放债券基金基金经理，2018 年 05 月担任鹏华尊悦发起式定开债券基金基金经理，2018 年 10 月担任鹏华 3 个月中短债基金基金经理，2018 年 12 月担任鹏华丰润债券（LOF）基金基金经理。周恩源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，增聘张栓伟为本基金基金经理。</p>
张栓伟	本基金基金经理	2019-05-11	-	8	<p>张栓伟先生，国籍中国，工学硕士，8 年证券基金从业经验。历任中山证券固定收益部交易员，鹏华基金管理有限公司集中交易室高级债券交易员，财富证券有限责任公司资产管理部投资主办；2016 年 6 月加盟鹏华基金管理有限公</p>



					<p>司，从事投研工作，现担任稳定收益投资部基金经理。2016年08月担任鹏华弘益混合基金基金经理，2016年11月至2018年06月担任鹏华弘腾混合基金基金经理，2016年11月担任鹏华弘康混合基金基金经理，2016年11月担任鹏华弘尚混合基金基金经理，2017年05月担任鹏华兴合定期开放混合基金基金经理，2017年05月担任鹏华弘嘉混合基金基金经理，2017年05月至2018年05月担任鹏华兴盛定期开放混合基金基金经理，2018年02月至2018年09月担任鹏华兴嘉定期开放混合基金基金经理，2018年05月至2018年10月担任鹏华兴盛混合基金基金经理，2019年05月担任鹏华弘泽混合基金基金经理。张栓伟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，增聘张栓伟为本基金基金经理。</p>
叶朝明	本基金基金经理	2018-11-24	-	11	<p>叶朝明先生，国籍中国，工商管理硕士，11年证券基金从业经验。曾任职于招商银行总行，从事本外币资金管理相关工作；2014年1月加</p>

				<p>盟鹏华基金管理有限公司,从事货币基金管理工作,现担任现金投资部总经理、基金经理。2014 年 02 月担任鹏华增值宝货币基金基金经理,2015 年 01 月担任鹏华安盈宝货币基金基金经理,2015 年 07 月担任鹏华添利宝货币基金基金经理,2016 年 01 月担任鹏华添利基金基金经理,2017 年 05 月担任鹏华聚财通货币基金基金经理,2017 年 06 月担任鹏华盈余宝货币基金基金经理,2017 年 06 月担任鹏华金元宝货币基金基金经理,2018 年 08 月担任鹏华弘泰混合基金基金经理,2018 年 09 月担任鹏华兴鑫宝货币基金基金经理,2018 年 09 月担任鹏华货币基金基金经理,2018 年 11 月担任鹏华弘泽混合基金基金经理,2018 年 12 月担任鹏华弘康混合基金基金经理。叶朝明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,增聘张栓伟为本基金基金经理。</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

债券配置以 AAA 评级高等级信用债为主，辅助以现金管理工具，久期以短久期为主，减少了利率风险对净值的冲击，受益于上半年超宽松的货币市场环境，债券部分取得了一定的超额收益。权益配置以大盘蓝筹、白马股为主，收益尚可，辅助以打新、转债的方式增强收益，追求净值的稳健增长。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

鹏华弘泽 A 净值增长率 2.01%，鹏华弘泽 C 净值增长率 1.97%；鹏华弘泽 A 业绩基准增长率 2.23%，鹏华弘泽 C 业绩基准增长率 2.23%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对下半年的宏观经济，我们认为大概率维持平稳下行态势。投资方面，随着信贷的再度收紧，地产投资增速大概率回落，地方债助力基建投资，但预计仍是个位数增长，盈利不确定性加大会持续抑制制造业投资增速，综合看，投资方面亮点匮乏。消费增速 6 月份大幅回升，虽有国五汽车去库的影响，但是整体增速仍较为平稳，会是下半年经济增长的重要支点。中美贸易摩擦前景不明，叠加上半年的抢出口效应，我们对下半年的出口持悲观态度。

基于我们对宏观经济的判读，对下半年证券市场的走势，相对更看好债券市场，看好收益率的进一步下行。权益市场经过这两年的大幅调整，绝大部分股票的估值都已经回落的历史底部，

虽然下跌空间有限，但受制于宏观经济的压制，大概率维持一个宽幅震荡走势。行业方面，周期相关的板块会面临一定的调整压力，相对更看好消费和科技板块。

#### 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，鹏华弘泽混合 A 期末可供分配利润为 53,744,068.41 元，期末基金份额净值 1.1430 元；截止本报告期末，鹏华弘泽混合 C 期末可供分配利润为 33,419.19 元，期末基金份额净值 1.1208 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

本基金自 2018 年 12 月 5 日至 2019 年 3 月 5 日、2019 年 4 月 9 日至 2019 年 5 月 15 日期间分别出现连续二十个（或以上）工作日基金资产净值低于五千万的情形。

## § 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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本半年度报告中利润分配情况真实、准确。

### 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

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，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：鹏华弘泽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	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>		
银行存款	8,610,674.02	1,618,330.60
结算备付金	2,302,804.37	993,909.80
存出保证金	22,404.41	163,114.96

交易性金融资产	523,556,284.11	41,062,900.00
其中：股票投资	67,093,484.11	-
基金投资	-	-
债券投资	456,462,800.00	37,062,900.00
资产支持证券投资	-	4,000,000.00
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	7,000,000.00	-
应收证券清算款	5,000,000.00	-
应收利息	6,217,787.59	624,633.41
应收股利	-	-
应收申购款	192,090.09	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	552,902,044.59	44,462,888.77
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2019年6月30日</b>	<b>2018年12月31日</b>
<b>负 债：</b>		
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	23,500,000.00	-
应付证券清算款	8,583,978.56	-
应付赎回款	94,108.54	204.67
应付管理人报酬	244,754.53	27,509.54
应付托管费	101,981.07	11,462.31
应付销售服务费	64.16	24.56
应付交易费用	97,865.28	56,857.17
应交税费	23,807.30	1,227.64
应付利息	7,073.55	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	299,039.70	350,000.00
负债合计	32,952,672.69	447,285.89
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	454,922,734.30	39,285,203.08
未分配利润	65,026,637.60	4,730,399.80
所有者权益合计	519,949,371.90	44,015,602.88
负债和所有者权益总计	552,902,044.59	44,462,888.77

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额总额 454,922,734.30 份，其中鹏华弘泽混合 A 基金份额总额为 454,600,389.99 份，基金份额净值 1.1430 元；鹏华弘泽混合 C 基金份额总额为 322,344.31 份，基金份额净值 1.1208 元。

## 6.2 利润表

会计主体：鹏华弘泽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	上年度可比期间
		2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		6,952,725.65	4,425,785.47
1. 利息收入		2,169,035.46	9,528,929.82
其中：存款利息收入		31,328.13	278,995.15
债券利息收入		1,977,133.99	7,166,721.70
资产支持证券利息收入		53,667.31	-
买入返售金融资产收入		106,906.03	2,083,212.97
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,189,952.54	-10,994,974.39
其中：股票投资收益		481,560.20	-10,910,198.33
基金投资收益		-	-
债券投资收益		53,859.74	-348,725.08
资产支持证券投资收益		39,711.78	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		614,820.82	263,949.02
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		3,585,313.71	5,891,084.63
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		8,423.94	745.41
减：二、费用		895,491.93	4,029,384.67
1. 管理人报酬	6.4.8.2.1	399,338.15	1,367,266.50
2. 托管费	6.4.8.2.2	166,390.91	569,694.41
3. 销售服务费	6.4.8.2.3	2,644.87	24,311.81
4. 交易费用		125,667.76	1,481,079.72
5. 利息支出		73,286.60	345,844.71
其中：卖出回购金融资产支出		73,286.60	345,844.71
6. 税金及附加		3,471.12	11,318.71
7. 其他费用		124,692.52	229,868.81
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		6,057,233.72	396,400.80

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		6,057,233.72	396,400.80

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鹏华弘泽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）	39,285,203.08	4,730,399.80	44,015,602.88
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	6,057,233.72	6,057,233.72
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）	415,637,531.22	54,239,004.08	469,876,535.30
其中：1. 基金申购款	439,469,500.15	57,010,166.71	496,479,666.86
2. 基金赎回款	-23,831,968.93	-2,771,162.63	-26,603,131.56
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）	454,922,734.30	65,026,637.60	519,949,371.90
项目	上年度可比期间 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）	471,734,675.71	61,940,813.93	533,675,489.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期	-	396,400.80	396,400.80



利润)			
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）	-308,499,505.66	-41,971,048.79	-350,470,554.45
其中：1. 基金申购款	44,692,928.69	5,604,223.50	50,297,152.19
2. 基金赎回款	-353,192,434.35	-47,575,272.29	-400,767,706.64
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）	163,235,170.05	20,366,165.94	183,601,335.99

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

鹏华弘泽灵活配置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[2015]410号《关于准予鹏华弘泽灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准，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《鹏华弘泽灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。

本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 772,834,701.16 元，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(2015)第 313 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《鹏华弘泽灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 4 月 14 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 772,946,467.85 份基金份额，其中认购资金利息折合 111,766.69 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，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《鹏华弘泽灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《鹏华弘泽灵活配置混合型证券投资基

金招募说明书》和《关于鹏华弘泽灵活配置混合型证券投资基金增加 C 类份额并修改基金合同的公告》，本基金自 2015 年 5 月 25 日起根据销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者持有基金期间不计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者持有基金期间从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存，由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华弘泽灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行和上市交易的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。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%；基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金业绩比较基准为：一年期银行定存款利率（税后）+3%。

#### 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》、《鹏华弘泽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 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
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	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

注：无。

###### 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

注：无。

##### 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	上年度可比期间
----	----	---------

	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	399,338.15	1,367,266.50
其中:支付销售机构的客户维护费	193,128.63	85,947.65

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 0.6%，逐日计提，按月支付。

日管理费=前一日基金资产净值×0.6%÷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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	166,390.91	569,694.41

注:支付基金托管人招商银行股份有限公司的托管费年费率为 0.25%，逐日计提，按月支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷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 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		
	鹏华弘泽混合 A	鹏华弘泽混合 C	合计
鹏华基金公司	-	1,754.33	1,754.33
合计	-	1,754.33	1,754.33
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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		
	鹏华弘泽混合 A	鹏华弘泽混合 C	合计
鹏华基金公司	-	24,290.76	24,290.76
合计	-	24,290.76	24,290.76

注: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 0.12%，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×0.12%÷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未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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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
招商银行	8,610,674.02	26,211.24	5,048,325.83	74,406.79

**6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位: 张)	总金额
国信证券	601138	工业富联	网上申购	1,000	13,770.00

注:本基金在本报告期内未参与本管理人、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。

**6.4.8.7 其他关联交易事项的说明**

本报告期内,本基金因投资招商银行的同业存单产生的利息收入合计 9,950.83 元(2018 年上半年:0.00 元)。

**6.4.9 期末(2019年6月30日)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**

金额单位:人民币元

6.4.9.1.2 受限证券类别:债券										
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: 张)	期末成本总额	期末估值总额	备注

112922	19 蛇 口 02	2019 年 6 月 25 日	2019-07-04	新债 未上 市	100.00	100.00	100,000	10,000,000.00	10,000,000.00	-
--------	--------------------	-----------------------	------------	---------------	--------	--------	---------	---------------	---------------	---

注:截至本报告期末,本基金没有持有因认购新发或增发而流通受限的股票和权证。

#### 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 2019 年 6 月 30 日止,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 23,500,000.00 元,于 2019 年 07 月 01 日、2019 年 07 月 02 日(先后)到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券,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。

#### 6.4.10 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	67,093,484.11	12.13
	其中:股票	67,093,484.11	12.13
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	456,462,800.00	82.56
	其中:债券	456,462,800.00	82.56
	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	7,000,000.00	1.27
	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	10,913,478.39	1.97
8	其他各项资产	11,432,282.09	2.07

9	合计	552,902,044.59	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	-	-
B	采矿业	2,833,893.90	0.55
C	制造业	17,435,830.45	3.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,879,500.00	0.36
E	建筑业	2,578,359.00	0.50
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	867,957.00	0.17
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	821,965.76	0.16
J	金融业	37,547,012.00	7.22
K	房地产业	2,041,132.00	0.39
L	租赁和商务服务业	975,150.00	0.19
M	科学研究和技术服务业	112,684.00	0.02
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	67,093,484.11	12.90

### 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

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	144,700	12,821,867.00	2.47
2	600519	贵州茅台	6,300	6,199,200.00	1.19
3	601398	工商银行	621,400	3,660,046.00	0.70
4	600030	中信证券	147,800	3,519,118.00	0.68
5	601328	交通银行	469,900	2,875,788.00	0.55
6	601166	兴业银行	152,600	2,791,054.00	0.54



7	600887	伊利股份	67,900	2,268,539.00	0.44
8	601601	中国太保	59,500	2,172,345.00	0.42
9	600276	恒瑞医药	32,000	2,112,000.00	0.41
10	600900	长江电力	105,000	1,879,500.00	0.36

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于鹏华基金管理有限公司网站 <http://www.phfund.com.cn> 的半年度报告正文。

## 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	11,353,612.00	25.79
2	601398	工商银行	11,273,078.00	25.61
3	600519	贵州茅台	7,793,604.00	17.71
4	601988	中国银行	7,335,388.00	16.67
5	600030	中信证券	3,183,175.87	7.23
6	601328	交通银行	2,843,721.00	6.46
7	601166	兴业银行	2,720,014.00	6.18
8	601601	中国太保	2,074,739.00	4.71
9	600887	伊利股份	2,047,696.97	4.65
10	600276	恒瑞医药	1,927,093.00	4.38
11	601688	华泰证券	1,883,076.00	4.28
12	600900	长江电力	1,867,350.00	4.24
13	600016	民生银行	1,716,632.00	3.90
14	601288	农业银行	1,549,390.00	3.52
15	600000	浦发银行	1,514,159.00	3.44
16	601668	中国建筑	1,381,745.00	3.14
17	600048	保利地产	1,031,081.00	2.34
18	601169	北京银行	1,028,703.17	2.34
19	600104	上汽集团	1,027,983.00	2.34
20	601211	国泰君安	940,994.52	2.14
21	601766	中国中车	916,742.88	2.08
22	600585	海螺水泥	893,741.00	2.03

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	601398	工商银行	7,878,800.00	17.90
2	601988	中国银行	5,623,000.00	12.78
3	600519	贵州茅台	2,091,750.00	4.75

4	600016	民生银行	1,781,934.00	4.05
5	601211	国泰君安	1,023,599.00	2.33
6	601688	华泰证券	669,705.00	1.52
7	601336	新华保险	570,800.00	1.30
8	600036	招商银行	322,525.00	0.73

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	82,629,770.45
卖出股票收入(成交)总额	19,962,113.00

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	116,105,700.00	22.33
	其中:政策性金融债	45,407,700.00	8.73
4	企业债券	141,697,000.00	27.25
5	企业短期融资券	19,988,000.00	3.84
6	中期票据	98,210,500.00	18.89
7	可转债(可交换债)	2,167,000.00	0.42
8	同业存单	78,294,600.00	15.06
9	其他	-	-
10	合计	456,462,800.00	87.79

#### 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	124935	14 冀建投	300,000	30,978,000.00	5.96
2	101900113	19 中油股 MTN001	300,000	30,021,000.00	5.77
3	108602	国开 1704	230,000	23,232,300.00	4.47
4	101456017	14 津城建 MTN001	200,000	20,980,000.00	4.04
5	143525	G18 光水 1	200,000	20,340,000.00	3.91

#### 7.7 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。

## 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:本基金本报告期内未发生股指期货投资。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低申购赎回时现金资产对投资组合的影响及投资组合仓位调整的交易成本,达到稳定投资组合资产净值的目的。

## 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

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

### 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:本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

### 7.11.3 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。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

广发证券 2019 年 3 月 25 日,公司收到广东证监局《关于对广发证券股份有限公司采取责令改正措施的决定》(广东证监局行政监管措施决定书[2019]20 号),指出公司存在对境外子公司管控不到位,未有效督促境外子公司强化合规风险管理及审慎开展业务等问题,违反了《证券公司监督管理条例》第二十七条、《证券公司和证券投资基金管理公司境外设立、收购、参股经营机构管理办法》第二十七条的规定;广东证监局依照《证券公司监督管理条例》第七十条的规定,决定对公司采取责令改正的行政监管措施。

广东证监局依照《证券公司监督管理条例》第七十条的规定,决定对公司采取责令改正的行政监管措施,公司应于 2019 年 6 月 30 日之前予以改正,并向广东局提交书面整改报告。具体整

改措施包括：一是充分履行股东职责，依法参与境外子公司的法人治理，健全对境外子公司的风险管控，形成权责明确、流程清晰、制衡有效的管理机制。二是加强信息系统投入和人员配备，提高合规风控与内部控制管理水平。三是建立健全对境外子公司的稽核审计制度，检查和评估境外子公司内部控制的有效性等。四是严格追究导致境外子公司出现重大风险的相关责任人员责任，并向广东局书面报告问责结果。公司应切实采取措施建立并持续完善覆盖境外机构的合规管理、风险管理和内部控制体系。

对此，公司高度重视，将切实进行整改，采取措施建立并持续完善覆盖境外机构的合规管理、风险管理和内部控制体系。

2018 年 10 月 27 日，广发证券股份有限公司第九届董事会第八次会议、2017 年度股东大会审议通过了公司非公开发行 A 股股票的相关议案。目前，本次非公开发行处于审核阶段。根据中国证券监督管理委员会出具的《中国证监会行政许可项目审查一次反馈意见通知书》（181351 号）的要求，经公司自查，将公司及其子公司最近五年被证券监管部门和交易所采取的处罚或监管措施以及整改情况进行了说明，包括如下 17 项：

1、2013 年 7 月 25 日，广东证监局向公司出具行政监管措施决定书[2013]21 号《关于对广发证券股份有限公司采取出具警示函措施的决定》

2、2013 年 10 月 30 日，广东证监局向公司珠海九洲大道证券营业部出具行政监管措施决定书[2013]35 号《关于对广发证券股份有限公司珠海九洲大道证券营业部采取责令增加合规检查次数措施的决定》

3、2014 年 1 月 20 日，中国证监会上市公司监管二部向公司出具上市二部函[2014]5 号《关于对创业板上市公司持续督导工作进行整改的函》

4、2014 年 9 月 22 日，北京证监局向公司出具行政监管措施决定书[2014]23 号《关于对广发证券股份有限公司采取监管谈话措施的决定》

5、2014 年 11 月 15 日，上交所会员部向公司出具上证会函[2014]486 号《关于通关测试异常交易申报的监管工作函》

6、2015 年 1 月 16 日，中国证监会向公司出具行政监管措施决定书[2015]7 号《关于对广发证券股份有限公司采取责令限期改正措施的决定》

7、2015 年 8 月 11 日，股转系统向公司出具股转系统发[2015]82 号《关于对广发证券股份有限公司采取要求提交书面承诺的监管措施的决定》

8、2015 年 8 月 28 日，上交所衍生品业务部向公司出具衍生品业务部函[2015]28 号《关于广发证券股份有限公司股票期权做市业务报价异常的监管警示函》

9、2016 年 5 月 18 日，股转系统向公司出具股转系统发[2016]50 号《关于对广发证券股份有限公司采取约见谈话并责令改正自律监管措施的决定》

10、2016 年 11 月 23 日，辽宁证监局向公司营口学府路证券营业部出具行政监管措施决定书[2016]10 号《关于对广发证券股份有限公司营口学府路证券营业部采取责令改正措施的决定》

11、2016 年 11 月 25 日，中国证监会向公司出具[2016]128 号《行政处罚决定书》

12、2017 年 1 月 9 日，广东证监局向广发期货出具行政监管措施决定书[2017]1 号《关于对广发期货有限公司采取出具警示函措施的决定》

13、2017 年 1 月 9 日，股转系统向公司出具股转系统发[2016]434 号《关于对广发证券股份有限公司采取要求提交书面承诺的自律监管措施的决定》

14、2018 年 9 月 5 日，广东证监局向广发合信产业投资管理有限公司出具[2018]53 号《关于对广发合信产业投资管理有限公司采取责令改正措施的决定》

15、2018 年 9 月 5 日，广东证监局向广发信德智胜投资管理有限公司出具[2018]54 号《关于对广发信德智胜投资管理有限公司采取责令改正措施的决定》

16、2018 年 9 月 20 日，广东证监局向瑞元资本管理有限公司出具[2018]67 号《关于对瑞元资本管理有限公司采取责令改正措施的决定》

17、2018 年 10 月 17 日，广东证监局向广发期货出具[2018]77 号《关于对广发期货有限公司采取责令改正措施的决定》

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。

## 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	22,404.41
2	应收证券清算款	5,000,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	6,217,787.59
5	应收申购款	192,090.09
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	11,432,282.09
---	----	---------------

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113517	曙光转债	2,167,000.00	0.42

#### 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 (%)
鹏华弘泽混合 A	3,869	117,498.16	-	-	454,600,389.99	100.00
鹏华弘泽混合 C	24	13,431.01	-	-	322,344.31	100.00
合计	3,893	116,856.60	-	-	454,922,734.30	100.00

#### 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	鹏华弘泽混合 A	44,025.67	0.0097
	鹏华弘泽混合 C	99,094.56	30.7418

金			
	合计	143,120.23	0.0315

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	鹏华弘泽混合 A	0~10
	鹏华弘泽混合 C	-
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	鹏华弘泽混合 A	-
	鹏华弘泽混合 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	鹏华弘泽混合 A	鹏华弘泽混合 C
基金合同生效日 (2015年4月14日) 基金份额总额	772,946,467.85	-
本报告期期初基金份额总额	39,064,701.74	220,501.34
本报告期基金总申购份额	426,668,239.84	12,801,260.31
减:本报告期基金总赎回份额	11,132,551.59	12,699,417.34
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	454,600,389.99	322,344.31

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。

报告期内，基金托管人无重大人事变动。

### 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	
广发证券	1	26,854,048.87	26.24%	24,471.93	26.60%	-
招商证券	1	23,334,997.00	22.80%	21,264.75	23.11%	-
中泰证券	2	20,846,960.68	20.37%	18,997.69	20.65%	-
国金证券	1	18,746,661.17	18.32%	17,084.15	18.57%	-
国盛证券	2	12,563,899.00	12.28%	10,192.79	11.08%	本报



						告期 内新 增。
爱建证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方财富证 券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	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
广发证券	2,169,500.00	0.85%	155,400,000.00	21.11%	-	-
招商证券	165,782,140.00	64.58%	290,300,000.00	39.43%	-	-
中泰证券	67,523,810.00	26.30%	71,700,000.00	9.74%	-	-
国金证券	21,234,657.30	8.27%	205,900,000.00	27.96%	-	-
国盛证券	-	-	13,000,000.00	1.77%	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方财富 证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

## § 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

2019 年 8 月 23 日