

# 鹏华金城灵活配置混合型证券投资基金 (原鹏华金城保本混合型证券投资基金) 2019 年年度报告

2019 年 12 月 31 日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2020 年 4 月 18 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 04 月 17 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。

本基金由原鹏华金城保本混合型证券投资基金转型而来。鹏华金城保本混合型证券投资基金于 2016 年 5 月 9 日至 2016 年 5 月 27 日进行募集，并于 2016 年 6 月 1 日正式成立，每个保本周期为三年，第一个保本周期自 2016 年 6 月 1 日起至 2019 年 6 月 3 日止。鹏华金城保本混合型证券投资基金由于在第一个保本周期届满后不再符合保本基金的续存条件，根据《鹏华金城保本混合型证券投资基金基金合同》的约定，于 2019 年 6 月 7 日转型为“鹏华金城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。

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）注册会计师对本基金出具了“标准无保留意见”的审计报告。

本报告中，原鹏华金城保本混合型证券投资基金报告期自 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 6 日止，鹏华金城灵活配置混合型证券投资基金报告期自 2019 年 6 月 7 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况（转型后） .....	6
2.1 基金基本情况（转型前） .....	6
2.2 基金产品说明（转型后） .....	6
2.2 基金产品说明（转型前） .....	8
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	10
2.4 信息披露方式 .....	10
2.5 其他相关资料 .....	10
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>11</b>
3.1 主要会计数据和财务指标（转型后） .....	11
3.1 主要会计数据和财务指标（转型前） .....	11
3.2 基金净值表现（转型后） .....	12
3.2 基金净值表现（转型前） .....	14
3.3 其他指标 .....	15
3.4 过去三年基金的利润分配情况（转型后） .....	16
3.4 过去三年基金的利润分配情况（转型前） .....	16
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>16</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	16
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	24
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	24
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.....	25
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	26
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	26
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	27
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	28
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明.....	28
4.10 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.....	28
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>28</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	28
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	28
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	29
<b>§ 6 审计报告（转型后）</b> .....	<b>29</b>
6.1 审计报告基本信息 .....	29
6.2 审计报告的基本内容 .....	29

<b>§ 6 审计报告（转型前）</b> .....	<b>31</b>
6.1 审计报告基本信息 .....	31
6.2 审计报告的基本内容 .....	31
<b>§ 7 年度财务报表（转型后）</b> .....	<b>33</b>
7.1 资产负债表 .....	33
7.2 利润表 .....	34
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	35
7.4 报表附注 .....	36
<b>§ 7 年度财务报表（转型前）</b> .....	<b>62</b>
7.1 资产负债表 .....	62
7.2 利润表 .....	63
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	64
7.4 报表附注 .....	66
<b>§ 8 投资组合报告（转型后）</b> .....	<b>93</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	93
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	93
8.3 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 .....	94
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	95
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	97
8.6 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 .....	97
8.7 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 .....	97
8.8 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 .....	97
8.9 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 .....	98
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	98
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	98
8.12 投资组合报告附注 .....	98
<b>§ 8 投资组合报告（转型前）</b> .....	<b>99</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	99
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	100
8.3 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 .....	100
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	100
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	101
8.6 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 .....	102
8.7 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 .....	102
8.8 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 .....	102
8.9 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 .....	102
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	102
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	103
8.12 投资组合报告附注 .....	103
<b>§ 9 基金份额持有人信息（转型后）</b> .....	<b>104</b>

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	104
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	104
9.3 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.....	104
<b>§ 9 基金份额持有人信息（转型前） .....</b>	<b>105</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	105
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	105
9.3 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.....	105
<b>§ 10 开放式基金份额变动（转型后） .....</b>	<b>105</b>
<b>§ 10 开放式基金份额变动（转型前） .....</b>	<b>106</b>
<b>§ 11 重大事件揭示.....</b>	<b>106</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	106
11.2 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.....	106
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	107
11.4 基金投资策略的改变 .....	107
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	107
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	107
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型后).....	108
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型前).....	109
11.8 其他重大事件（转型后） .....	110
11.8 其他重大事件（转型前） .....	118
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>122</b>
12.1 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 .....	122
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	123
<b>§ 13 备查文件目录.....</b>	<b>123</b>
13.1 备查文件目录 .....	123
13.2 存放地点 .....	123
13.3 查阅方式 .....	123

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况（转型后）

基金名称	鹏华金城灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	鹏华金城混合
基金主代码	002714
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 6 月 7 日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	553,049,389.92 份
基金合同存续期	不定期

### 2.1 基金基本情况（转型前）

基金名称	鹏华金城保本混合型证券投资基金
基金简称	鹏华金城保本
基金主代码	002714
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 6 月 1 日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	648,178,914.75 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明（转型后）

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，</p>

主要分析行业的外部发展环境、行业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

	<p>私募债券投资。本基金在投资过程中密切监控债券信用等级或发行人信用等级变化情况，尽力规避风险，并获取超额收益。</p> <p>6、资产支持证券的投资策略 本基金将综合运用战略资产配置和战术资产配置进行资产支持证券的投资组合管理，并根据信用风险、利率风险和流动性风险变化积极调整投资策略，严格遵守法律法规和基金合同的约定，在保证本金安全和基金资产流动性的基础上获得稳定收益。</p> <p>7、衍生品投资策略 为更好地实现投资目标，本基金在注重风险管理的前提下，以套期保值为目的，适度运用股指期货、国债期货等金融衍生品。本基金利用金融衍生品合约流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点，提高投资组合的运作效率。</p>
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。

## 2.2 基金产品说明（转型前）

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	<p>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。</p> <p>1、资产配置策略 本基金以优化的恒定比例组合保险策略（CPPI）为核心，并结合对市场时机的把握，确定和调整基金资产在风险资产和无风险资产间的投资比例，规避系统性风险，确保本基金投资目标的实现。</p> <p>2、债券投资策略 本基金将从风险和收益两方面进行考虑来构建债券投资组合。债券资产首先必须是足够安全的，且债券的现金流情况应与保本周期相一致；在上述前提下，基金管理人将尽量选择收益率水平高的品种，以实现安全垫的最大化。本基金将持有一部分剩余期限与保本周期相匹配的债券，另一部分兼顾收益性和流动性。本基金将采取久期策略、收益率曲线策略、骑乘策略、利差策略、息差策略等，力争在债券投资层面为基金保本增值产生正向贡献。</p> <p>（1）久期策略 本基金持有剩余期限与基金周期相匹配的债券，主要按买入并持有方式操作以保证组合收益的稳定性，有效回避利率风险。</p> <p>（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依据之一，本基金将据此调整组合长、中、短期债券的搭配。本基金将通过对收益率曲线变化的预测，适时采用子弹式、杠铃或梯形策略构造组合，并进行动态调整。</p> <p>（3）骑乘策略 本基金将采用骑乘策略增强组合的持有期收益。这一策略即通过对收益率曲线的分析，在可选的目标久期区间买入期限位于收益率曲线较陡峭处右侧的债券。在收益率曲线不变动的情况下，随着其剩余期限的衰减，债券收益率将沿着陡峭的收益率曲线有较大幅度的下滑，从而获得较高的资本收益；即使收益率曲线上升或进一步变陡，这一策略也能够提供更多的安全边际。</p> <p>（4）息差策略 本基金将利用回</p>



购利率低于债券收益率的情形，通过正回购将所获得的资金投资于债券，利用杠杆放大债券投资的收益。（5）利差策略 本基金通过对两个期限相近的债券的利差进行分析，从而对利差水平的未来走势作出判断，进而相应的进行债券置换。影响两期限相近债券的利差水平的因素主要有息票因素、流动性因素及信用评级因素等。当预期利差水平缩小时，买入收益率高的债券同时卖出收益率低的债券，通过两债券利差的缩小获得投资收益；当预期利差水平扩大时，则进行相反的操作。

3、股票投资策略 本基金从行业和个股两方面进行分析研究，精选具有清晰、可持续的业绩增长潜力且被市场相对低估或价格处于合理区间的股票，构建股票组合，分散非系统性风险，充分获取股市上涨收益。（1）行业配置 本基金将结合宏观经济研究及行业特性分析，动态调整行业配置，在研究分析中重点关注行业技术水平发展、产业政策变化、产业组织分析、市场需求及全球化等新兴因素等对行业估值水平可能产生影响的变量。（2）个股的筛选 本基金股票投资以精选个股为主。发挥基金管理人专业研究团队的研究能力，考察上市公司所属行业发展前景、行业地位、公司竞争优势、盈利能力、成长性、估值水平等多种因素，精选流动性好、成长性高、估值水平低的股票进行投资。为评估个股的投资价值，本基金将借助于定量分析和定性分析相结合的方式，对个股进行研究。

1) 定量分析 财务分析。通过对资产负债率、流动比率、速动比率等偿债能力指标，应收账款周转率、存货周转率等营运能力指标，资本金利润率、销售利税率(营业收入利税率)、成本费用利润率等盈利能力指标的分析，比较其与行业内其他企业的相对地位，鉴别企业的投资价值。估值分析。基金将选择运用相对估值方法和绝对估值方法，挖掘出价值低估和价值合理的企业。

2) 定性分析 在定量分析的基础上，本基金采用定性分析的方法研究并考察上市公司的品质和可靠性，以便从更长期的角度保证定量方法所选上市公司增长的持续性。本基金通过对上市公司技术水平、资源状况、公司战略、治理结构和商业模式的分析，判断推动上市公司主营业务收入或上市公司利润增长的原因和可望保持的时间，进而判断上市公司可长期投资的价值。

4、权证投资策略 本基金将权证看作是辅助性投资工具，权证的投资原则为有利于基金资产保值、增值，有利于加强基金风险控制。

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。

7、股指期货投资策略 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。8、国债期货投资策略 为有效控制债券投资的系统性风险，本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的，适度运用国债期货，提高投资组合的运作效率。在国债期货投资时，本基金将首先分析国债期货各合约价格与最便宜可交割券的关系，选择定价合理的国债期货合约，其次，考虑国债期货各合约的流动性情况，最终确定与现货组合的合适匹配，以达到风险管理的目标。
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。

### 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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张戈	许俊
	联系电话	0755-82825720	010-66594319
	电子邮箱	zhangge@phfund.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4006788999	95566
传真		0755-82021126	010-66594942
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 1 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 1 号
邮政编码		518048	100818
法定代表人		何如	刘连舸

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	上海市湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

#### 3.1 主要会计数据和财务指标(转型后)

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2019年6月7日（基金合同生效日）-2019年12月31日
本期已实现收益	37,360,228.22
本期利润	44,154,371.70
加权平均基金份额本期利润	0.0760
本期加权平均净值利润率	6.86%
本期基金份额净值增长率	7.02%
3.1.2 期末数据和指标	2019年末
期末可供分配利润	70,055,325.83
期末可供分配基金份额利润	0.1267
期末基金资产净值	632,877,905.82
期末基金份额净值	1.144
3.1.3 累计期末指标	2019年末
基金份额累计净值增长率	7.02%

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12月31日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

(4) 转型后本基金合同于2019年6月7日生效，至2019年12月31日未满一年，故2019年的数据和指标为非完整会计年度数据。

#### 3.1 主要会计数据和财务指标(转型前)

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2019年1月1日-2019年6月6日	2018年	2017年
本期已实现收益	101,108,888.75	46,443,315.60	170,189.86
本期利润	92,740,968.26	123,407,404.87	21,673,277.88
加权平均基金份额本期利润	0.0347	0.0420	0.0051
本期加权	3.29%	4.13%	0.52%

平均净值 利润率			
本期基金 份额净值 增长率	3.29%	4.12%	0.61%
3.1.2 期 末数据和 指标	2019 年 6 月 6 日	2018 年末	2017 年末
期末可供 分配利润	40,515,253.97	69,179,565.64	-22,442,854.82
期末可供 分配基金 份额利润	0.0625	0.0253	-0.0065
期末基金 资产净值	692,655,081.71	2,830,544,926.10	3,452,182,713.42
期末基金 份额净值	1.0690	1.0350	0.9940
3.1.3 累 计期末指 标	2019 年 6 月 6 日	2018 年末	2017 年末
基金份额 累计净值 增长率	6.90%	3.50%	-0.60%

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”指基金转型前最后一日，即 6 月 6 日。

(4) 转型前基金本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 2019 年 6 月 6 日止。

### 3.2 基金净值表现（转型后）

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	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
过去三个月	2.23%	0.14%	4.61%	0.40%	-2.38%	-0.26%

过去六个月	6.32%	0.24%	5.17%	0.47%	1.15%	-0.23%
过去一年	7.02%	0.23%	9.53%	0.50%	-2.51%	-0.27%
自基金合同生效至今	7.02%	0.23%	9.53%	0.50%	-2.51%	-0.27%

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 自基金转型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

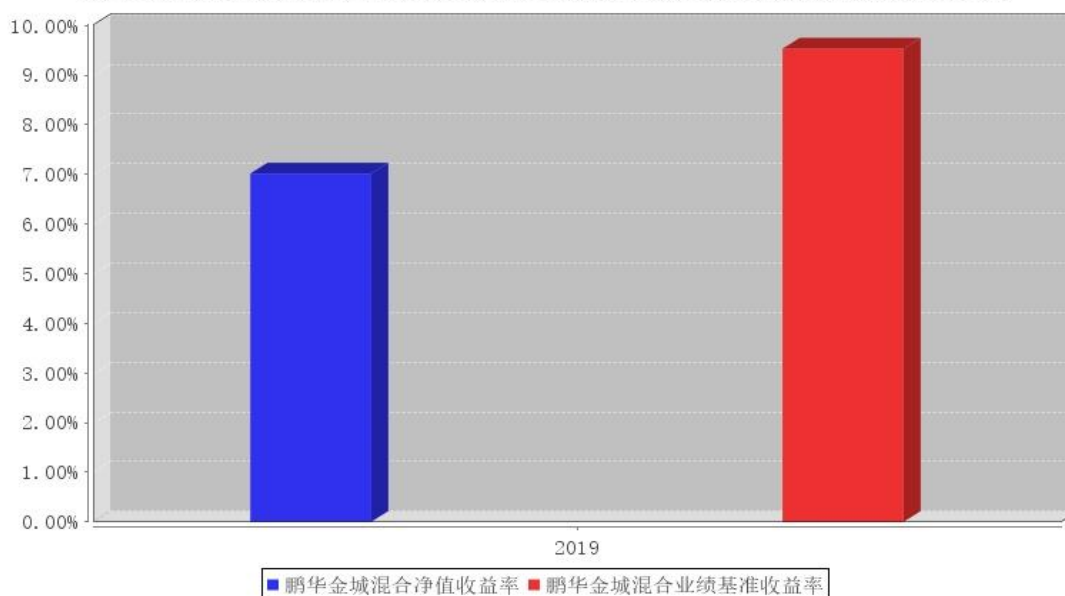


注:1、本基金基金合同于 2019 年 06 月 07 日生效。

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。

### 3.2.3 自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

鹏华金城混合基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按照实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

## 3.2 基金净值表现（转型前）

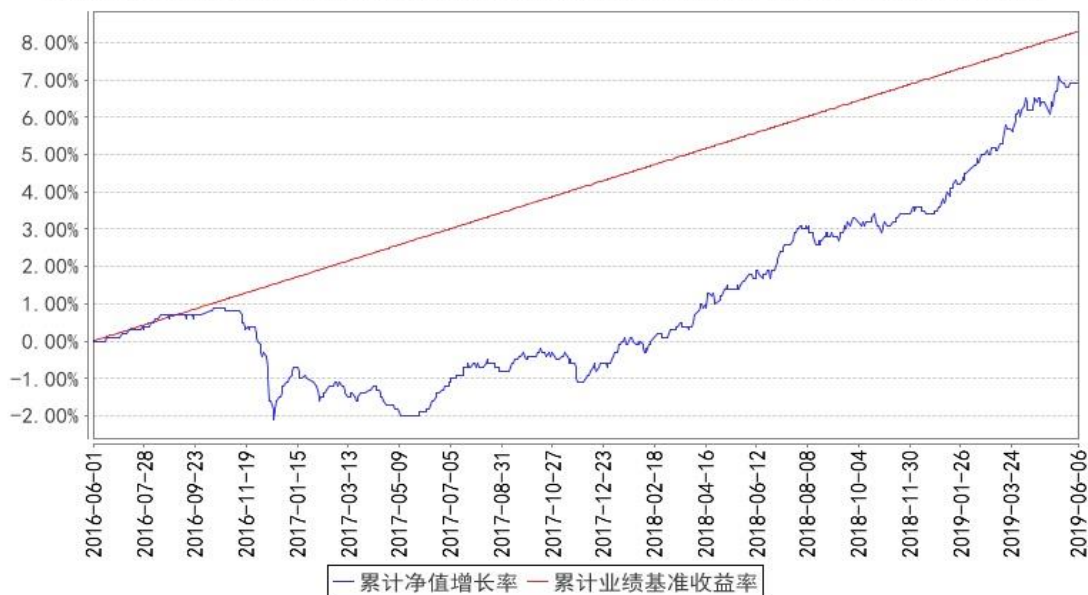
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	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
过去一年	3.29%	0.11%	1.18%	0.01%	2.11%	0.10%
过去三年	6.90%	0.09%	8.30%	0.01%	-1.40%	0.08%
自基金合同生效至今	6.90%	0.09%	8.30%	0.01%	-1.40%	0.08%

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

鹏华金城保本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

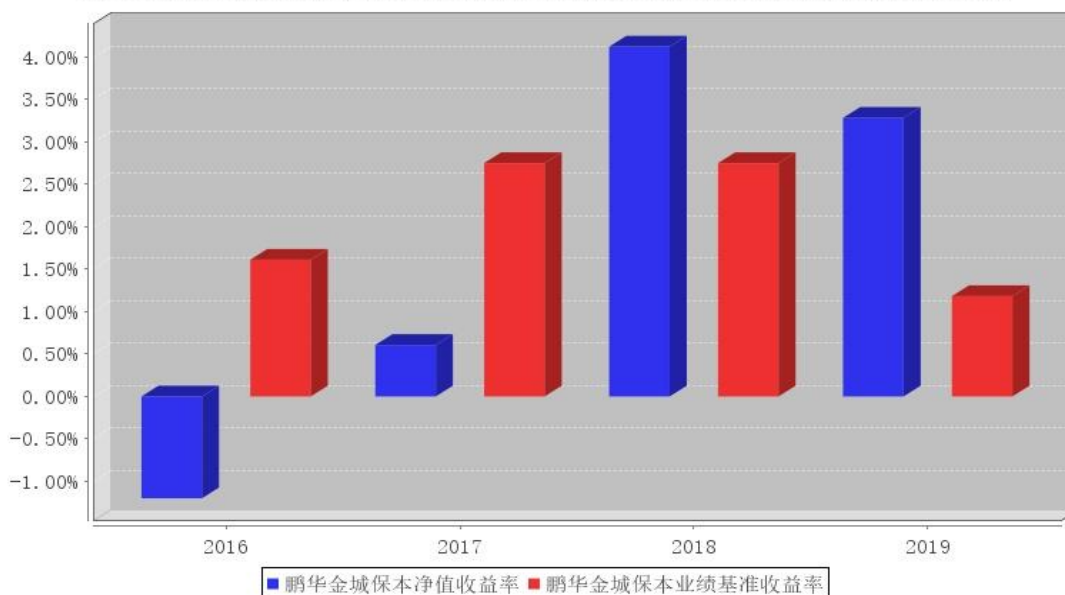


注:1、本基金基金合同于 2016 年 06 月 01 日生效。

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。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

鹏华金城保本基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注:合同生效当年按照实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 其他指标

无。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况（转型后）

本基金基金合同于 2019 年 6 月 7 日生效，截止本报告期末未满三年。截止本报告期末，本基金未进行利润分配。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况（转型前）

截止本报告期末，本基金未进行利润分配。

## § 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。截至 2019 年 12 月，公司管理资产总规模达到 5,683.41 亿元，管理 176 只公募基金、12 只全国社保投资组合、4 只基本养老保险投资组合。经过 21 年投资管理基金，在基金投资、风险控制等方面积累了丰富经验。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型后）

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		
李振宇	本基金基金经理	2017-05-24	2019-06-19	7	李振宇先生，国籍中国，经济学硕士，7 年证券基金从业经验。曾任银华基金管理有限公司固定收益部基金经理助理，从事债券投资研究工作；2016 年 8 月加盟鹏华基金管理有限公司，历任固定收益部投资经理，现



				<p>担任公募债券投资部基金经理。2016年12月至2018年07月担任鹏华丰惠债券基金基金经理，2016年12月担任鹏华丰盈债券基金基金经理，2017年02月至2018年07月担任鹏华可转债基金基金经理，2017年05月担任鹏华丰康债券基金基金经理，2017年05月至2019年06月担任鹏华金城保本混合基金基金经理，2018年06月至2019年10月担任鹏华尊享定期开放发起式债券基金基金经理，2018年06月至2019年10月担任鹏华安益增强混合基金基金经理，2018年12月至2019年12月担任鹏华丰华债券基金基金经理，2019年03月担任鹏华中债1-3年国开行债券指数基金基金经理，2019年05月担任鹏华9-10年利率发起式债券基金基金经理，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月担任鹏华尊诚定期开放发起式债券基金基金经理，2019年08月担任鹏华金利债券基金基金经理，2019年08月担任5年地债基金基</p>
--	--	--	--	--

					金经理，2019 年 09 月担任丰鑫债券基金基金经理，2019 年 12 月担任鹏华 0-5 年利率发起式债券基金基金经理。李振宇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，增聘方昶为本基金基金经理，王宗合、李振宇不再担任本基金基金经理。
王宗合	本基金基金经理	2016-06-01	2019-06-19	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 月担任鹏华金刚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

					<p>10 月担任鹏华金鼎保本混合基金基金经理，2016 年 06 月至 2019 年 06 月担任鹏华金城保本混合基金基金经理，2017 年 02 月至 2019 年 09 月担任鹏华安益增强混合基金基金经理，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 月至 2019 年 09 月担任鹏华宏观混合基金基金经理，2018 年 10 月至 2019 年 09 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发生变动，增聘方昶为本基金基金经理，王宗合、李振宇不再担任本基金基金经理。</p>
方昶	本基金基金经理	2019-06-19	-	5	<p>方昶先生，国籍中国，经济学硕士，5 年证券基金从业经验。曾任中国工商银</p>

					<p>行资产管理部投资经理；2016 年 12 月加盟鹏华基金管理有限公司，现担任公募债券投资部基金经理。2018 年 07 月至 2020 年 02 月担任鹏华丰腾债券基金基金经理，2018 年 10 月担任鹏华信用增利债券基金基金经理，2018 年 12 月至 2020 年 02 月担任鹏华丰华债券基金基金经理，2019 年 01 月担任鹏华丰恒债券基金基金经理，2019 年 03 月担任鹏华安益增强混合基金基金经理，2019 年 06 月担任鹏华金城混合基金基金经理，2019 年 09 月担任鹏华 3 个月中短债基金基金经理，2019 年 09 月担任鹏华丰享债券基金基金经理。方昶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，增聘方昶为本基金基金经理，王宗合、李振宇不再担任本基金基金经理。</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。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型前）

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		

李振宇	本基金基金经理	2017-05-24	2019-06-07	7	<p>李振宇先生,国籍中国,经济学硕士,7年证券投资基金从业经验。曾任银华基金管理有限公司固定收益部基金经理助理,从事债券投资研究工作;2016年8月加盟鹏华基金管理有限公司,历任固定收益部投资经理,现担任公募债券投资部基金经理。2016年12月至2018年07月担任鹏华丰惠债券基金基金经理,2016年12月担任鹏华丰盈债券基金基金经理,2017年02月至2018年07月担任鹏华可转债基金基金经理,2017年05月担任鹏华丰康债券基金基金经理,2017年05月至2019年06月担任鹏华金城保本混合基金基金经理,2018年06月至2019年10月担任鹏华尊享定期开放发起式债券基金基金经理,2018年06月至2019年10月担任鹏华安益增强混合基金基金经理,2018年12月至2019年12月担任鹏华丰华债券基金基金经理,2019年03月担任鹏华中债1-3年国开行债券指数基金基金经理,2019年05月担任鹏华9-10年利率发起式债券基金基金经</p>
-----	---------	------------	------------	---	--

					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 月担任鹏华尊诚定期开放发起式债券基金基金经理, 2019 年 08 月担任鹏华金利债券基金基金经理, 2019 年 08 月担任 5 年地债基金基金经理, 2019 年 09 月担任丰鑫债券基金基金经理, 2019 年 12 月担任鹏华 0-5 年利率发起式债券基金基金经理。李振宇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	2016-06-01	2019-06-07	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 月担任鹏华金刚保本混合基金基金经理, 2014 年 07

					<p>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月至2019年09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月至2019年09月担任鹏华宏观混合基金基金经理，2018年10月至2019年09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，因市场波动等被动原因存在本基金投资比例不符合基金合同要求的情形，本基金管理人严格按照基金合同的约定及时进行了调整，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 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《鹏华基金管理有限公司公平交易管理规定》，将公司所管理的封闭式基金、开放式基金、社保组合、养老组合、特定客户资产管理组合等不同资产组合的授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动均纳入公平交易管理，在业务流程和岗位职责中制定公平交易的控制规则和控制活动，建立对公平交易的执行、监督及审核流程，严禁在不同投资组合之间进行利益输送。在投资研究环节：1、公司使用唯一的研究报告发布平台“研究报告管理平台”，确保各投资组合在获得投资信息、研究支持、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；2、公司严格按照《股票库管理规定》、《信用债券投资与风险控制管理规定》，执行股票及信用产品出入库及日常维护工作，确保相关证券入库以内容严谨、观点明确的研究报告作为依据；3、在公司股票库基础上，各涉及股票投资的资产组合根据各自的投资目标、投资风格、投资范围和防范关联交易的原则分别建立资产组合股票库，基金经理在股票库基础上根据投资授权以及基金合同择股方式构建具体的投资组合；4、严格执行投资授权制度，明确投资决策委员会、分管投资副总裁、基金经理等各主体的职责和权限划分，合理确定基金经理的投资权限，超过投资权限的操作，应严格履行审批程序。在交易执行环节：1、所有公司管理的资产组合的交易必须通过集中交易室完成，集中交易室负责建立和执行交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会；2、针对交易所公开竞价交易，集中交易室应严格启用恒生交易系统内的公平交易程序，交易系统则自动启用公平交易功能，由系统按照“未委托数量”的比例对不同资产组合进行委托量的公平分配；如果相关基金经理坚持以不同的价格进行交易，且当前市场价格不能同时满足多个资产组合的指令价格要求时，交易系统自动按照“价格优先”原则进行委托；当市场价格同时满足多个资产组合的指令价格要求时，则



交易系统自动按照“同一指令价格下的公平交易”模式，进行公平委托和交易量分配；3、银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易需依据公司《股票投资交易流程》和《固定收益投资管理流程》的规定执行；银行间市场交易、交易所大宗交易等以公司名义进行的交易，各投资组合经理应在交易前独立确定各投资组合的交易价格和数量，公司按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；4、新股、新债申购及非公开定向增发交易需依据公司《新股申购流程》、《固定收益投资管理流程》和《非公开定向增发流程》的规定执行，对新股和新债申购方案和分配过程进行审核和监控。在交易监控、分析与评估环节：1、为加强对日常投资交易行为的监控和管理，杜绝利益输送、不公平交易等违规交易行为，防范日常交易风险，公司明确了关注类交易的界定及对应的监控和评估措施机制；所监控的交易包括但不限于：交易所公开竞价交易中同日同向交易的交易时机和交易价差、不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差、关联交易、债券交易收益率偏离度、成交量和成交价格异常、银行间债券交易对手交易等；2、将公平交易作为投资组合业绩归因分析和交易绩效评价的重要关注内容，发现的异常情况由投资监察员进行分析；3、监察稽核部分别于每季度和每年度编写《公平交易执行情况检查报告》，内容包括关注类交易监控执行情况、不同投资组合的整体收益率差异分析和同向交易价差分析；《公平交易执行情况检查报告》需经公司基金经理、督察长和总经理签署。

#### 4.3.2 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。同时，根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求，公司对所管理组合的不同时间窗的同向交易进行了价差专项分析，未发现存在违反公平交易原则的现象。

#### 4.3.3 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%的交易次数为 2 次，主要原因在于指数基金或量化基金成分股交易不活跃导致。

### 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，金融市场一波三折，经济基本面中美贸易战进程成为市场波动的双重主线。基本面方面，央行降准、年初金融数据同比大幅提升，带动经济企稳预期增强，一季度权益市场整体走强，债券市场收益率大幅调整；4-8 月份，随着中美贸易战再度升级，叠加经济金融数据持续弱

于预期，权益市场出现大幅调整，债券市场收益率震荡下行；从 8 月底至 10 月底，随着 CPI “破 3”，通胀预期明显回升，货币政策整体保持定力，债券收益率震荡上行；10 月底 11 月底，央行调降 MLF 和 OMO 利率，市场对通胀上行和货币政策收紧担忧缓解，带动债券收益率小幅回落；11 月底至年底，经济金融数据好于预期，中美谈判达成阶段性协议，基本面对债市支撑力度减弱，而债市在配置盘等因素的影响下保持韧性。

2019 年，金融市场呈现股债双牛格局。全年来看，债券市场取得较佳表现，但整体出现分化，其中长久期利率债收益率下行有限，但信用债收益率大幅下行。比较 2018 年底，10 年期国债收益率下行 9BP，10 年国开债收益率下行 6BP，银行间 3 年期 AAA 中票下行 38BP，AA+中票下行 50BP。权益市场全年大幅上涨，2019 年上证指数上涨 22.30%，而创业板指数上涨幅度则高达 43.79%。

本报告期内金城灵活基金以持有中等久期中高等级信用债为主；权益部位整体维持中等仓位。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

转型前：鹏华金城保本混合组合净值增长率 3.29%，鹏华金城保本混合业绩比较基准增长率 1.18%。转型后：鹏华金城灵活配置组合净值增长率 7.02%，鹏华金城灵活配置业绩比较基准增长率 9.53%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

基本面方面，疫情短期将对经济产生部分负面影响，但不影响我国经济中长期稳健发展的趋势。受疫情影响，2020 年上半年经济面临一定的下行压力，尤其是餐饮、旅游、交运、商贸零售等服务业将面临阶段性冲击，但是从全年来看，我国经济仍然存在较高的韧性。货币政策方面，在经济阶段性下行压力下，货币政策仍然将维持稳健偏松格局，市场流动性整体将保持充裕。

对于 2020 年国内债券市场，我们认为将仍有较好表现，但是空间和幅度可能弱于 2019 年；权益市场将整体存在结构性机会。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人继续完善内部控制、提升风险管理水平，着重开展了以下各项工作：

##### 1、继续完善内部控制体系

公司根据法律法规、监管要求及业务发展需求，不断优化现有的标准化业务流程体系，强调业务流程服务于加强风险防范和提升运营效率，通过信息技术手段持续提升业务操作的系统化程度，并不断优化。

##### 2、持续改进投资监控的方法与手段，保证基金投资业务的合法合规性

报告期内，在投资日常合规监控工作方面，公司根据法律法规和产品特点进一步完善了投资

监控系统以提升投资监控效率；在实现交易价差分析、银行间交易分析、研究报告检查等专项检查工作定期化、日常化的基础上，公司多次开展有关内幕交易、未公开信息等重要内容的合规培训，进一步强化全体投研人员的合规意识。

### 3、规范基金销售业务，保证基金销售业务的合法合规性

报告期内，在基金募集和持续营销活动中，公司严格规范基金销售业务，按照《证券投资基金销售管理办法》及相关法规规定审查宣传推介材料，逐步落实反洗钱法律法规各项要求，并督促销售部门做好投资者教育工作，本报告期内没有出现主动违规行为。

### 4、开展以风险为导向的内部稽核

报告期内，监察稽核部开展了对信息技术管理、投资相关流程、反洗钱业务、子公司管理和公司日常运作的定期监察稽核与专项监察稽核。监察稽核人员开展了以风险为导向的内部稽核，通过稽核发现，提高了公司标准化操作流程手册的执行效力，优化了标准化操作流程手册。报告期内，公司未发生重大风险事件。

## 4.7 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。

#### 4.8 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，本基金期末可供分配利润为 70,055,325.83 元，期末基金份额净值 1.144 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。

#### 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

#### 4.10 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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在鹏华金城灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金

份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 6 审计报告（转型后）

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2020)第 22009 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	鹏华金城灵活配置混合型证券投资基金(原鹏华金鼎保本混合型证券投资基金)全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了鹏华金城灵活配置混合型证券投资基金(原鹏华金城保本混合型证券投资基金,以下简称“鹏华金城混合基金”)的财务报表,包括2019年12月31日的资产负债表,2019年6月7日(基金合同生效日)至2019年12月31日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了鹏华金城混合基金2019年12月31日的财务状况以及2019年6月7日(基金合同生效日)至2019年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于鹏华金城混</p>

	合基金，并履行了职业道德方面的其他责任。
强调事项	无。
其他事项	无。
其他信息	无。
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>鹏华金城混合基金的基金管理人鹏华基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估鹏华金城混合基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算鹏华金城混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督鹏华金城混合基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对鹏华金城混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致鹏华金城混合基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内</p>

	容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	单峰	陈熹
会计师事务所的地址	中国上海市	
审计报告日期	2020-04-16	

## § 6 审计报告（转型前）

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2020)第 21989 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	鹏华金城保本混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了鹏华金城保本混合型证券投资基金(以下简称“鹏华金城保本基金”)的财务报表,包括 2019 年 6 月 6 日(基金合同失效日)的资产负债表,2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 6 日(基金合同失效日)止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了鹏华金城保本基金 2019 年 6 月 6 日(基金合同失效日)的财务状况以及 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 6 日(基金合同失效日)止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。

	按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于鹏华金城混合基金，并履行了职业道德方面的其他责任。
强调事项	无。
其他事项	无。
其他信息	无。
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>鹏华金城混合基金的基金管理人鹏华基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估鹏华金城混合基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算鹏华金城混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督鹏华金城混合基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对鹏华金城混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致鹏华金城混合基金不能持续经营。</p>



	(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容, 并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通, 包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	单峰	陈熹
会计师事务所的地址	中国上海市	
审计报告日期	2020-04-16	

## § 7 年度财务报表 (转型后)

### 7.1 资产负债表

会计主体: 鹏华金城灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日: 2019 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 日
<b>资产:</b>		
银行存款	7.4.7.1	10,015,347.37
结算备付金		6,394,801.95
存出保证金		37,270.69
交易性金融资产	7.4.7.2	785,845,743.59
其中: 股票投资		83,122,244.69
基金投资		-
债券投资		692,723,498.90
资产支持证券投资		10,000,000.00
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		270,312.00
应收利息	7.4.7.5	11,195,121.10
应收股利		-
应收申购款		60,534.40
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-

资产总计		813,819,131.10
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019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	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		179,600,000.00
应付证券清算款		-
应付赎回款		448,054.67
应付管理人报酬		322,775.56
应付托管费		53,795.92
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	203,103.63
应交税费		58,288.31
应付利息		-14,844.00
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	270,051.19
负债合计		180,941,225.28
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	7.4.7.9	553,049,389.92
未分配利润	7.4.7.10	79,828,515.90
所有者权益合计		632,877,905.82
负债和所有者权益总计		813,819,131.10

注：(1) 报告截止日 2019 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.144 元，基金份额总额 553,049,389.92 份。

(2) 本期财务报表的实际编制期间为 2019 年 6 月 7 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日止期间，无上年度末数据。

## 7.2 利润表

会计主体：鹏华金城灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 6 月 7 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019年6月7日(基金合同生效日)至2019年12月31日
一、收入		51,142,799.74
1. 利息收入		13,294,092.91
其中：存款利息收入	7.4.7.11	286,933.26

债券利息收入		12,928,980.39
资产支持证券利息收入		17,555.54
买入返售金融资产收入		60,623.72
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		31,047,264.29
其中：股票投资收益	7.4.7.12	28,657,672.45
基金投资收益	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	27,844.33
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-
股利收益	7.4.7.16	2,361,747.51
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	6,794,143.48
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	7,299.06
减：二、费用		6,988,428.04
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	4,000,116.24
2. 托管费	7.4.10.2.2	666,686.04
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-
4. 交易费用	7.4.7.19	1,268,799.01
5. 利息支出		824,277.72
其中：卖出回购金融资产支出		824,277.72
6. 税金及附加		39,992.03
7. 其他费用	7.4.7.20	188,557.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		44,154,371.70
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		44,154,371.70

注：（1）报告实际编制期间为 2019 年 6 月 7 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日。

（2）本期财务报表的实际编制期间为 2019 年 6 月 7 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日止期间，无上年度可比期间及可比较数据。

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鹏华金城灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 6 月 7 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 6 月 7 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 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)	648,178,914.75	44,476,166.96	692,655,081.71
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	44,154,371.70	44,154,371.70
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)	-95,129,524.83	-8,802,022.76	-103,931,547.59
其中：1. 基金申购款	1,603,606.87	181,439.75	1,785,046.62
2. 基金赎回款	-96,733,131.70	-8,983,462.51	-105,716,594.21
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)	553,049,389.92	79,828,515.90	632,877,905.82

注：本期财务报表的实际编制期间为 2019 年 6 月 7 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日止期间，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 7.1 至 7.4 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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

鹏华金城灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)是由鹏华金城保本混合型证券投资基金(以下简称“鹏华金城保本混合基金”)基金转型而来。根据本基金的基金管理人于 2019 年 5 月 27 日发布的《鹏华金城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城灵活配置混合型证券投资基金相关业务规则的公告》和《关于修订〈鹏华金城保本混合型证券投资基金基金合同〉的公告》，鹏华金城保本混合基金的基金管理人经与基金托管人协商一致，自 2019 年 6 月 7 日起，鹏华金城保本混合基金按基金合同的约定转型为“鹏华金城灵活配置混合型证券投资

基金”，《鹏华金城保本混合型证券投资基金基金合同》同日失效，《鹏华金城灵活配置混合型证券投资基金基金合同》同日生效，原鹏华金城保本混合基金基金份额转为本基金基金份额，基金份额总额为 648,178,914.75 份。鹏华金城保本混合基金转型后，基金托管人、基金登记机构及基金代码保持不变；转型后基金的投资目标、投资范围、投资策略以及基金费率等按照《鹏华金城灵活配置混合型证券投资基金基金合同》相关条款执行。本基金为契约型开放式，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，基金托管人为中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华金城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，包括国内依法发行上市的股票（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、中小企业私募债等）、货币市场工具（包括同业存单、大额存单等）、权证、资产支持证券、国债期货、股指期货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）。本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%；每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，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%。

本财务报表由本基金的基金管理人鹏华基金管理有限公司于本基金的审计报告日批准报出。

#### 7.4.2 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〈年度报告和中期报告〉》、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》、《鹏华金城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。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 年 6 月 7 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日止期间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 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年 6 月 7 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2019 年 6 月 7 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日。

### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；

或者(3) 该金融资产已转移,虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬,但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时,终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额,计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、基金投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的,应对市场交易价格进行调整,确定公允价值。与上述投资品种相同,但具有不同特征的,应以相同资产或负债的公允价值为基础,并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等,如果该限制是针对资产持有者的,那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外,基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场,采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时,优先使用可观察输入值,只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下,才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件,应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的;且 2) 交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转

出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税(和/或)股票交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费(如有)在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现



平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金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》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债

券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,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》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日
活期存款	10,015,347.37
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	10,015,347.37

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	78,770,635.90	83,122,244.69	4,351,608.79
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-

债券	交易所市场	350,909,385.95	352,933,098.90	2,023,712.95
	银行间市场	338,967,797.47	339,790,400.00	822,602.53
	合计	689,877,183.42	692,723,498.90	2,846,315.48
资产支持证券		10,000,000.00	10,000,000.00	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		778,647,819.32	785,845,743.59	7,197,924.27

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日
应收活期存款利息	2,447.45
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	2,877.70
应收债券利息	11,171,696.96
应收资产支持证券利息	18,082.19
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	-
应收出借证券利息	-
其他	16.80
合计	11,195,121.10

#### 7.4.7.6 其他资产

无。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日
交易所市场应付交易费用	199,816.07
银行间市场应付交易费用	3,287.56

合计	203, 103. 63
----	--------------

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	51. 19
应付证券出借违约金	-
预提费用	270, 000. 00
合计	270, 051. 19

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019 年 6 月 7 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	648, 178, 914. 75	648, 178, 914. 75
2019 年 6 月 7 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日基金份额折算调整	-	-
2019 年 6 月 7 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日未领取红利份额折算调整（若有）	-	-
2019 年 6 月 7 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日集中申购募集资金本金及利息	-	-
2019 年 6 月 7 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日基金拆分和集中申购完成后	-	-
本期申购	1, 603, 606. 87	1, 603, 606. 87
本期赎回（以“-”号填列）	-96, 733, 131. 70	-96, 733, 131. 70
本期末	553, 049, 389. 92	553, 049, 389. 92

注：（1）申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

（2）根据《鹏华金城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城灵活配置混合型证券投资基金相关业务规则的公告》，原鹏华金城保本混合型证券投资基金基金份额转为鹏华金城灵活配置混合型证券投资基金基金份额。

（3）根据《鹏华金城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城灵活配置混合型证券投资基金相关业务规则的公告》、《鹏华金城灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《鹏华金城灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》和《鹏华金城灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告》的相关规定，本基金于 2019 年 6 月 7 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 23 日止期间暂不向投资人开放基金交易。

## 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	40,515,253.97	3,960,912.99	44,476,166.96
本期利润	37,360,228.22	6,794,143.48	44,154,371.70
本期基金份额交易产生的变动数	-7,820,156.36	-981,866.40	-8,802,022.76
其中：基金申购款	164,630.96	16,808.79	181,439.75
基金赎回款	-7,984,787.32	-998,675.19	-8,983,462.51
本期已分配利润	-	-	-
本期末	70,055,325.83	9,773,190.07	79,828,515.90

## 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019年6月7日（基金合同生效日）至2019年12月31日
活期存款利息收入	79,962.47
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	201,910.28
其他	5,060.51
合计	286,933.26

## 7.4.7.12 股票投资收益

## 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019年6月7日（基金合同生效日）至2019年12月31日
卖出股票成交总额	395,125,789.35
减：卖出股票成本总额	366,468,116.90
买卖股票差价收入	28,657,672.45

## 7.4.7.12.2 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

## 7.4.7.13 债券投资收益

## 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2019年6月7日（基金合同生效日）至2019年12月

	31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	27,844.33
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	27,844.33

#### 7.4.7.13.2 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6月7日（基金合同生效日）至2019年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	351,430,902.02
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	342,397,982.36
减：应收利息总额	9,005,075.33
买卖债券差价收入	27,844.33

#### 7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

#### 7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

#### 7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

无。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

##### 7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

无。

##### 7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

##### 7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

##### 7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

## 7.4.7.15 衍生工具收益

## 7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

## 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2019年6月7日（基金合同生效日）至2019年12月31日
股票投资产生的股利收益	2,361,747.51
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,361,747.51

## 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2019年6月7日（基金合同生效日）至2019年12月31日
1. 交易性金融资产	6,794,143.48
股票投资	4,351,608.79
债券投资	2,442,534.69
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	6,794,143.48

## 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019年6月7日（基金合同生效日）至2019年12月31日
基金赎回费收入	7,098.37
基金转换费收入	0.69
其他	200.00



合计	7,299.06
----	----------

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2019年6月7日（基金合同生效日）至2019年12月31日
交易所市场交易费用	1,264,191.51
银行间市场交易费用	4,607.50
合计	1,268,799.01

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2019年6月7日（基金合同生效日）至2019年12月31日
审计费用	102,684.91
信息披露费	51,723.57
证券出借违约金	-
银行汇划费用	15,548.52
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	188,557.00

#### 7.4.7.21 分部报告

无。

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

无。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 7.4.9 关联方关系

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
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	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
意大利欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）	基金管理人的股东
深圳市北融信投资发展有限公司	基金管理人的股东
鹏华资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：1、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。

2、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金转型后基金合同于 2019 年 6 月 7 日生效，截止本报告期末不满一年。无上年度可比期间和数据。

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

无。

###### 7.4.10.1.2 债券交易

无。

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

###### 7.4.10.1.4 权证交易

无。

###### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 6 月 7 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,000,116.24
其中：支付销售机构的客户维护费	281,740.88

注：1. 支付基金管理人鹏华基金管理公司的管理人报酬年费率为 0.60%，逐日计提，按月支付。日管理费 = 前一日基金资产净值 × 0.60% ÷ 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。

###### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 6 月 7 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	666,686.04

注：支付基金托管人中国银行的托管费年费率为 0.10%，逐日计提，按月支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.10%÷当年天数。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

无。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

##### 7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

无。

##### 7.4.10.5.2 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

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。

#### 7.4.10.6 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6月7日(基金合同生效日)至2019年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	10,015,347.37	79,962.47

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期内未参与本基金管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司承销期内承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末(2019年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
002973	侨银环保	2019年12月27日	2020年1月6日	新股未上市	5.74	5.74	1,146	6,578.04	6,578.04	-
003816	中国广核	2019年8月14日	2020年2月27日	锁定期股票	2.49	3.53	562,958	1,401,765.42	1,987,241.74	-
601658	邮储银行	2019年12月2日	2020年6月10日	锁定期股票	5.50	5.71	796,578	4,381,179.00	4,548,460.38	-
601916	浙商银行	2019年11月18日	2020年5月26日	锁定期股票	4.94	4.66	294,195	1,453,323.30	1,370,948.70	-
688007	光峰科技	2019年7月12日	2020年1月22日	锁定期股票	17.50	26.91	26,857	469,997.50	722,721.87	-
688011	新光光电	2019年7月12日	2020年1月22日	锁定期股票	38.09	41.05	8,807	335,458.63	361,527.35	-
688025	杰普特	2019年10月24日	2020年05月06日	锁定期股票	43.86	38.36	4,655	204,168.30	178,565.80	-
7.4.12.1.2 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
110065	淮矿转债	2019年12月	2020年1月	新债未上市	100.00	100.00	1,330	133,000.00	133,000.00	-

		月 25 日	13 日							
113029	明阳转债	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 7 日	新债未上市	100.00	100.00	1,890	189,000.00	189,000.00	-
113030	东风转债	2019 年 12 月 26 日	2020 年 1 月 20 日	新债未上市	100.00	100.00	280	28,000.00	28,000.00	-
128084	木森转债	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 10 日	新债未上市	100.00	100.00	1,770	177,000.00	177,000.00	-
128086	国轩转债	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 10 日	新债未上市	100.00	100.00	1,370	137,000.00	137,000.00	-

注:1. 基金可使用以基金名义开设的股票账户,选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股,根据基金与上市公司所签订申购协议的规定,在新股上市后的约定期限内不能自由转让;基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股,从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。基金还可作为特定投资者,认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份,所认购的股份自发行结束之日起约定限售期内不得转让。

2. 根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》,本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的,锁定期为自发行人股票上市之日起 6 个月。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 12 月 31 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 179,600,000.00 元,于 2020 年 01 月 02 日到期。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。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 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。

##### 7.4.13.2 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 12 月 31 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 102.12%。

#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019 年 12 月 31 日
A-1	10,061,000.00
A-1 以下	20,052,000.00
未评级	50,020,000.00
合计	80,133,000.00

注：未评级债券包括国债、中央银行票据和政策性金融债；A-1 以下包含未评级的超短期融资券。

#### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019 年 12 月 31 日
A-1	-
A-1 以下	10,000,000.00
未评级	-
合计	10,000,000.00

注：A-1 以下包含发行期限小于 1 年的资产支持证券。

#### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019 年 12 月 31 日
AAA	342,274,944.30
AAA 以下	263,891,010.60
未评级	6,424,544.00
合计	612,590,498.90

注：未评级债券包括国债、中央银行票据和政策性金融债。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 7.4.13.3 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。

于 2019 年 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款余额 179,600,000.00 元将在一个月内到期且计息外，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。

#### 7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

#### 7.4.13.3.2 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时间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



股票不得超过该上市公司可流通股票的 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票，不得超过该上市公司可流通股票的 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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，此外还持有银行存款、结算备付金等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。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，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019 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	10,015,347.37	-	-	-	10,015,347.37
结算备付金	6,394,801.95	-	-	-	6,394,801.95
存出保证金	37,270.69	-	-	-	37,270.69
交易性金融资产	177,147,000.00	506,612,700.00	18,963,798.90	83,122,244.69	785,845,743.59
应收利息	-	-	-	11,195,121.10	11,195,121.10
应收申购款	-	-	-	60,534.40	60,534.40
应收证券清算款	-	-	-	270,312.00	270,312.00
资产总计	193,594,420.01	506,612,700.00	18,963,798.90	94,648,212.19	813,819,131.10
负债					
应付赎回款	-	-	-	448,054.67	448,054.67
应付管理人报酬	-	-	-	322,775.56	322,775.56
应付托管费	-	-	-	53,795.92	53,795.92
卖出回购金融资产款	179,600,000.00	-	-	-	179,600,000.00
应付交易费用	-	-	-	203,103.63	203,103.63
应付利息	-	-	-	-14,844.00	-14,844.00
应交税费	-	-	-	58,288.31	58,288.31
其他负债	-	-	-	270,051.19	270,051.19
负债总计	179,600,000.00	-	-	1,341,225.28	180,941,225.28
利率敏感度缺口	13,994,420.01	506,612,700.00	18,963,798.90	93,306,986.91	632,877,905.82

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。

#### 7.4.13.4.1.2 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 12 月 31 日）	
分析	市场利率下降 25 个基点	2,606,413.23
	市场利率上升 25 个基点	-2,573,481.66

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

#### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

无。

#### 7.4.13.4.3 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%；每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	83,122,244.69	13.13
交易性金融资产—基金投资	-	-

交易性金融资产—债券投资	33,644,054.90	5.32
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	116,766,299.59	18.45

注：债券投资为可转换债券、可交换债券投资。

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2019 年 12 月 31 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。

#### 7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2019 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 106,926,255.71 元，属于第二层次的余额为 668,919,487.88 元，属于第三层次的余额为 10,000,000.00 元。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期

间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

上述第三层次资产变动如下：

交易性金融资产——资产支持证券投资

2019 年 6 月 7 日(基金合同生效日) -

购买	-
出售	-
转入第三层级	10,000,000.00
转出第三层级	-
当期利得或损失总额	-
计入损益的利得或损失	-
2019 年 12 月 31 日	10,000,000.00

2019 年 12 月 31 日仍持有的资产计入

2019 年 6 月 7 日(基金合同生效日)至

2019 年 12 月 31 日止期间损益的

未实现利得或损失的变动

——公允价值变动损益 -

使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的相关信息如下：

2019 年 12 月 31 日公允价值 估值技术 不可观察输入值

名称 范围/加权平均值 与公允价值之间的关系

交易性金融资产——

资产支持证券投资 10,000,000.00 市场法 最近交易价格 100.00 元/张 正相关

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2019 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 年度财务报表（转型前）

### 7.1 资产负债表

会计主体：鹏华金城保本混合型证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 6 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 6 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	131,274,253.56	22,576,159.56
结算备付金		122,078,778.83	113,984,206.07
存出保证金		623,162.13	114,807.04
交易性金融资产	7.4.7.2	443,574,631.60	4,001,149,137.44
其中：股票投资		-	63,902,742.04
基金投资		-	-
债券投资		443,574,631.60	3,737,246,395.40
资产支持证券投资		-	200,000,000.00
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	483,991,202.48
应收证券清算款		130,035,402.75	11,997.26
应收利息	7.4.7.5	8,055,104.23	65,140,772.02
应收股利		-	-
应收申购款		-	49,703.55
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		835,641,333.10	4,687,017,985.42

负债和所有者权益	附注号	本期末 2019年6月6日	上年度末 2018年12月31日
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	1,850,000,000.00
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		141,902,482.16	655,313.58
应付管理人报酬		427,096.11	2,890,903.75
应付托管费		71,182.68	481,817.30
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	264,381.79	7,621.61
应交税费		4,890.33	239,080.42
应付利息		-	1,784,959.55
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	316,218.32	413,363.11
负债合计		142,986,251.39	1,856,473,059.32
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	648,178,914.75	2,735,367,911.33
未分配利润	7.4.7.10	44,476,166.96	95,177,014.77
所有者权益合计		692,655,081.71	2,830,544,926.10
负债和所有者权益总计		835,641,333.10	4,687,017,985.42

注：报告截止日 2019 年 6 月 6 日，基金份额净值 1.069 元，基金份额总额 648,178,914.75 份。

## 7.2 利润表

会计主体：鹏华金城保本混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 6 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6日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年 12月31日
一、收入		122,014,152.66	211,366,639.36
1. 利息收入		54,865,258.75	154,037,404.41
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,028,604.47	2,008,211.50
债券利息收入		47,765,938.74	135,494,008.72
资产支持证券利息收入		2,691,479.08	15,531,113.23
买入返售金融资产收入		3,379,236.46	1,004,070.96
证券出借利息收入		-	-

其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		75,147,098.88	-24,864,345.36
其中：股票投资收益	7.4.7.12	47,825,725.45	-9,018,616.63
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	23,786,539.52	-17,633,879.78
资产支持证券投资 收益	7.4.7.13.5	3,038,381.91	571,221.92
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	496,452.00	1,216,929.13
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-8,367,920.49	76,964,089.27
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	369,715.52	5,229,491.04
减：二、费用		29,273,184.40	87,959,234.49
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	14,638,540.19	35,951,036.74
2. 托管费	7.4.10.2.2	2,439,756.66	5,991,839.36
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	505,274.92	135,049.73
5. 利息支出		11,419,707.19	45,038,142.36
其中：卖出回购金融资产 支出		11,419,707.19	45,038,142.36
6. 税金及附加		121,413.17	366,321.05
7. 其他费用	7.4.7.20	148,492.27	476,845.25
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		92,740,968.26	123,407,404.87
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		92,740,968.26	123,407,404.87

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鹏华金城保本混合型证券投资基金

本报告期：2019年1月1日至2019年6月6日

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月6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）	2,735,367,911.33	95,177,014.77	2,830,544,926.10



二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	92,740,968.26	92,740,968.26
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）	-2,087,188,996.58	-143,441,816.07	-2,230,630,812.65
其中：1. 基金申购款	3,884,230.02	242,564.34	4,126,794.36
2. 基金赎回款	-2,091,073,226.60	-143,684,380.41	-2,234,757,607.01
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）	648,178,914.75	44,476,166.96	692,655,081.71
项目	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	3,474,625,568.24	-22,442,854.82	3,452,182,713.42
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	123,407,404.87	123,407,404.87
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）	-739,257,656.91	-5,787,535.28	-745,045,192.19
其中：1. 基金申购款	632,640.89	13,942.43	646,583.32
2. 基金赎回款	-739,890,297.80	-5,801,477.71	-745,691,775.51
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填	-	-	-

列)			
五、期末所有者权益(基金净值)	2,735,367,911.33	95,177,014.77	2,830,544,926.10

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

鹏华金城保本混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]792号《关于核准鹏华金城保本混合型证券投资基金募集的批复》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《鹏华金城保本混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。根据《鹏华金城保本混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金为契约型开放式,存续期限不定,第一个保本期自本基金基金合同生效之日起至3年后对应日止,如该日为非工作日,则保本期到期日顺延至下一个工作日,其后的保本周周期及起讫日见基金管理人届时公告。本基金第一个保本期由北京首创融资担保有限公司作为保证人提供连带责任保证。第一个保本期届满时,在符合保本基金存续条件下,本基金继续存续并进入下一保本期。如第一个保本期到期后,本基金未能符合保本基金存续条件,则将变更为非保本的混合型基金,基金名称相应变更为“鹏华金城灵活配置混合型证券投资基金”。如果第一个保本期到期后本基金不符合法律法规和基金合同对基金的存续要求,则本基金将根据基金合同的规定终止。

本基金自2016年5月9日起至2016年5月27日止期间内向社会公开募集,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币4,628,311,305.44元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第678号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华金城保本混合型证券投资基金基金合同》于2016年6月1日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为4,630,274,675.35份基金份额,其中认购资金利息折合1,963,369.91份基金份额。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《鹏华金城保本混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的第一个保本期为三年,本基金第一个保本期的保本额为基金份额持有人认购并持有到期的基金份额所对应的认购金额、认购费用及募集期利息收入之和。但在保本周期内,如本基金份额累计净值增长率连续15

个工作日达到或超过预设的目标收益率，则基金管理人将在满足条件之日(含)起 10 个工作日内公告本基金当期保本周期提前到期(提前到期日距离满足提前到期条件之日起不超过 20 个工作日，且不得晚于非提前到期情形下的保本周期到期日)，并进入到期操作期间。其中，第一个保本周期的目标收益率为 24%。在第一个保本期到期日，如基金份额持有人认购并持有到期的基金份额与到期日基金份额净值的乘积加上其认购并持有到期的基金份额累计分红款项之和计算的总金额低于基金份额持有人认购并持有到期的基金份额的保本金额，则基金管理人应补足该差额，并最迟在保本期到期日后 20 个工作日内将该差额支付给基金份额持有人，保证人对此提供连带责任保证。但上述基金份额持有人未持有到期而赎回或转换转出的，赎回或转换转出部分不适用保本条款；未经保证人书面同意提供保证，基金份额持有人在保本期申购或转换转入的基金份额也不适用保本条款。

根据本基金的基金管理人于 2019 年 5 月 27 日发布的《鹏华金城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城灵活配置混合型证券投资基金相关业务规则的公告》和《关于修订〈鹏华金城保本混合型证券投资基金基金合同〉的公告》，由于本基金的第一个保本周期即将到期，且本基金无法为转入下一保本周期确定保本担保人，本基金将不符合保本基金存续的条件。本基金的基金管理人经与基金托管人协商一致，自 2019 年 6 月 7 日起，本基金按基金合同的约定转型为非避险策略型的基金，更名为“鹏华金城灵活配置混合型证券投资基金”，《鹏华金城保本混合型证券投资基金基金合同》同日失效，《鹏华金城灵活配置混合型证券投资基金基金合同》同日生效。本基金转型后，基金托管人、基金登记机构及基金代码保持不变；转型后基金的投资目标、投资范围、投资策略以及基金费率等按照《鹏华金城灵活配置混合型证券投资基金基金合同》相关条款执行。

另外，根据上述公告，本基金为认购本基金并持有到期的基金份额持有人提供认购保本金额为在第一个保本周期内其认购并持有到期的基金份额所对应的净认购金额、认购费用及募集期利息之和。在发生保本赔付(如果保本周期到期日基金份额持有人认购并持有到期的基金份额的可赎回金额与其认购并持有到期的基金份额于持有期内的累计分红金额之和低于其认购保本金额)的情况下，基金管理人在保本周期到期日后二十个工作日内(含第二十个工作日)向基金份额持有人履行保本赔付差额的支付义务。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华金城保本混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、各类债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、债券回购、央行票据、中期票据、可转换债券、分离交易可转债、短期融资券、资产支持证券、中小企业私

募债、可交换债券以及经法律法规或中国证监会允许投资的其他债券类金融工具)、银行存款、货币市场工具(包括同业存单、大额存单等)、权证、国债期货、股指期货及中国证监会允许投资的其他金融工具。

本基金的投资组合比例由优化的 CPPI 策略决定,并对比例范围有如下限制:权益类资产占基金资产的比例不超过 40%,债券、货币市场工具及其它资产的比例合计不低于基金资产的 60%,其中基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:三年定期存款税后利率。

本财务报表由本基金的基金管理人鹏华基金管理有限公司于本基金的审计报告日批准报出。

#### 7.4.2 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<年度报告和中期报告>》、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》、《鹏华金城保本混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 6 日(基金合同失效前日)止期间的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 6 日(基金合同失效前日)的财务状况以及 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 6 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 6 日(基金合同失效前日)。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款

项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、基金投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最

近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税(和/或)股票

交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费(如有)在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金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》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，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》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。



## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

无。

## 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 6 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
活期存款	131,274,253.56	22,576,159.56
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	131,274,253.56	22,576,159.56

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 6 日_		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	244,576,727.66	244,362,631.60
	银行间市场	198,594,123.15	199,212,000.00
	合计	443,170,850.81	443,574,631.60
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	443,170,850.81	443,574,631.60	403,780.79

项目	上年度末 2018 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	70,116,782.21	63,902,742.04	-6,214,040.17
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	2,697,338,761.84	2,706,592,395.40
	银行间市场	1,024,921,892.11	1,030,654,000.00
	合计	3,722,260,653.95	3,737,246,395.40
资产支持证券	200,000,000.00	200,000,000.00	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	3,992,377,436.16	4,001,149,137.44	8,771,701.28

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 6 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-
项目	上年度末 2018 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	29,000,000.00	-
银行间市场	454,991,202.48	-
合计	483,991,202.48	-

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 6 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	144,293.80	5,072.45
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	368,527.96	51,292.90
应收债券利息	7,568,579.79	62,150,759.91
应收资产支持证券利息	-	2,056,740.82
应收买入返售证券利息	-26,552.06	876,854.24
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	254.74	51.70
合计	8,055,104.23	65,140,772.02

#### 7.4.7.6 其他资产

无。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月6日	上年度末 2018年12月31日
交易所市场应付交易费用	254,134.00	1,644.63
银行间市场应付交易费用	10,247.79	5,976.98
合计	264,381.79	7,621.61

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月6日	上年度末 2018年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	626.80	3,363.11
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	315,591.52	410,000.00
合计	316,218.32	413,363.11

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月6日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,735,367,911.33	2,735,367,911.33
本期申购	3,884,230.02	3,884,230.02
本期赎回（以“-”号填列）	-2,091,073,226.60	-2,091,073,226.60
- 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	648,178,914.75	648,178,914.75

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

## 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	69,179,565.64	25,997,449.13	95,177,014.77
本期利润	101,108,888.75	-8,367,920.49	92,740,968.26
本期基金份额交易产生的变动数	-129,773,200.42	-13,668,615.65	-143,441,816.07
其中：基金申购款	152,604.67	89,959.67	242,564.34
基金赎回款	-129,925,805.09	-13,758,575.32	-143,684,380.41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	40,515,253.97	3,960,912.99	44,476,166.96

## 7.4.7.11 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6日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日
活期存款利息收入	207,806.41	369,576.56
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	820,268.80	1,634,760.61
其他	529.26	3,874.33
合计	1,028,604.47	2,008,211.50

## 7.4.7.12 股票投资收益

## 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月6日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日
卖出股票成交总额	210,469,677.75	51,953,096.05
减：卖出股票成本总额	162,643,952.30	60,971,712.68
买卖股票差价收入	47,825,725.45	-9,018,616.63

## 7.4.7.12.2 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

## 7.4.7.13 债券投资收益

## 7.4.7.13.1 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6日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31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	23,786,539.52	-17,633,879.78
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	23,786,539.52	-17,633,879.78

#### 7.4.7.13.2 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6日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	4,017,091,613.23	4,107,802,163.79
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	3,903,379,971.02	4,042,420,630.48
减：应收利息总额	89,925,102.69	83,015,413.09
买卖债券差价收入	23,786,539.52	-17,633,879.78

#### 7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

#### 7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

#### 7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月6日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日
卖出资产支持证券成交总额	213,157,845.59	441,142,849.59
减：卖出资产支持证券成本总额	205,059,300.00	420,000,000.00
减：应收利息总额	5,060,163.68	20,571,627.67
资产支持证券投资收益	3,038,381.91	571,221.92

## 7.4.7.14 贵金属投资收益

## 7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

无。

## 7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

## 7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

## 7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

## 7.4.7.15 衍生工具收益

## 7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

## 7.4.7.16 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6日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日
股票投资产生的股利收益	496,452.00	1,216,929.13
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	496,452.00	1,216,929.13

## 7.4.7.17 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6日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日
1. 交易性金融资产	-8,367,920.49	76,964,089.27
股票投资	6,214,040.17	-19,058,403.78
债券投资	-14,581,960.66	96,022,493.05

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	-8,367,920.49	76,964,089.27

#### 7.4.7.18 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6日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日
基金赎回费收入	369,646.41	5,220,089.60
转换费收入	69.11	8,429.22
其他	-	972.22
合计	369,715.52	5,229,491.04

#### 7.4.7.19 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6日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日
交易所市场交易费用	495,674.92	105,474.73
银行间市场交易费用	9,600.00	29,575.00
合计	505,274.92	135,049.73

#### 7.4.7.20 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6日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日
审计费用	47,315.09	110,000.00
信息披露费	68,276.43	295,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费用	14,300.75	34,645.25
账户维护费	18,000.00	36,000.00
其他	600.00	1,200.00
合计	148,492.27	476,845.25

#### 7.4.7.21 分部报告

无。



## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 7.4.8.1 或有事项

无。

### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

《鹏华金城保本混合型证券投资基金基金合同》自 2019 年 6 月 7 日起失效,《鹏华金城灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于同日起生效,同时更名为“鹏华金城灵活配置混合型证券投资基金”。

## 7.4.9 关联方关系

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
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	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
意大利欧利盛资本资产管理股份公司 (Eurizon Capital SGR S.p.A.)	基金管理人的股东
深圳市北融信投资发展有限公司	基金管理人的股东
鹏华资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注:1、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。

2、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.10.1.1 股票交易

无。

#### 7.4.10.1.2 债券交易

无。

#### 7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

#### 7.4.10.1.4 权证交易

无。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

## 7.4.10.2 关联方报酬

## 7.4.10.2.1 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6日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	14,638,540.19	35,951,036.74
其中：支付销售机构的客户维护费	1,255,545.66	3,583,303.58

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

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

## 7.4.10.2.2 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6日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,439,756.66	5,991,839.36

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 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：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.20% / 当年天数。

## 7.4.10.2.3 销售服务费

无。

## 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2019年1月1日至2019年6月6日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	-	20,654,264.26	-	-	-	-
上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日						
银行间市场交易的	债券交易金额		基金逆回购		基金正回	

各关联方名称					购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
-	-	-	-	-	-	-

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

##### 7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

无。

##### 7.4.10.5.2 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

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。

#### 7.4.10.6 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6日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	131,274,253.56	207,806.41	22,576,159.56	369,576.56

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期内及上年度可比期间内未参与本基金管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司承销期内承销的证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

无。

#### 7.4.12 期末(2019年6月6日)本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

###### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

##### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为保本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。

#### 7.4.13.2 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 6 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 46.7%（2018 年 12 月 31 日：131.46%）。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019 年 6 月 6 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	100,432,000.00	70,094,000.00
未评级	120,082,631.60	110,186,200.00
合计	220,514,631.60	180,280,200.00

注：未评级债券包括国债、中央银行票据和政策性金融债；A-1 以下包含未评级的超短期融资券。

##### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

##### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019 年 6 月 6 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	28,866,000.00	77,048,000.00
未评级	-	-

合计	28,866,000.00	77,048,000.00
----	---------------	---------------

注:A-1 以下包含发行期限小于 1 年的同业存单。

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019 年 6 月 6 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
AAA	170,086,000.00	3,244,630,200.00
AAA 以下	24,108,000.00	129,129,395.40
未评级	-	106,158,600.00
合计	194,194,000.00	3,479,918,195.40

注:未评级债券包括国债、中央银行票据和政策性金融债。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019 年 6 月 6 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
AAA	-	200,000,000.00
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	200,000,000.00

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 7.4.13.3 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、组合在短期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。

于 2019 年 6 月 6 日，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。

#### 7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

#### 7.4.13.3.2 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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，此外还持有银行存款、结算备付金等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。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，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年6月6日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	131,274,253.56	-	-	-	131,274,253.56
结算备付金	122,078,778.83	-	-	-	122,078,778.83
存出保证金	623,162.13	-	-	-	623,162.13
交易性金融资产	393,469,631.60	50,105,000.00	-	-	443,574,631.60
应收利息	-	-	-	8,055,104.23	8,055,104.23
应收证券清算款	-	-	-	130,035,402.75	130,035,402.75
资产总计	647,445,826.12	50,105,000.00	-	138,090,506.98	835,641,333.10
负债					
应付赎回款	-	-	-	141,902,482.16	141,902,482.16
应付管理人报酬	-	-	-	427,096.11	427,096.11
应付托管费	-	-	-	71,182.68	71,182.68
应付交易费用	-	-	-	264,381.79	264,381.79
应交税费	-	-	-	4,890.33	4,890.33
其他负债	-	-	-	316,218.32	316,218.32
负债总计	-	-	-	142,986,251.39	142,986,251.39
利率敏感度缺口	647,445,826.12	50,105,000.00	-	-4,895,744.41	692,655,081.71
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	22,576,159.56	-	-	-	22,576,159.56
结算备付金	113,984,206.07	-	-	-	113,984,206.07



存出保证金	114,807.04	-	-	-	114,807.04
交易性金融资产	2,671,312,000.00	1,214,369,395.40	51,565,000.00	63,902,742.04	4,001,149,137.44
买入返售金融资产	483,991,202.48	-	-	-	483,991,202.48
应收利息	-	-	-	65,140,772.02	65,140,772.02
应收申购款	-	-	-	49,703.55	49,703.55
应收证券清算款	-	-	-	11,997.26	11,997.26
资产总计	3,291,978,375.15	1,214,369,395.40	51,565,000.00	129,105,214.87	4,687,017,985.42
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	655,313.58	655,313.58
应付管理人报酬	-	-	-	2,890,903.75	2,890,903.75
应付托管费	-	-	-	481,817.30	481,817.30
卖出回购金融资产款	1,850,000,000.00	-	-	-	1,850,000,000.00
应付交易费用	-	-	-	7,621.61	7,621.61
应付利息	-	-	-	1,784,959.55	1,784,959.55
应付税费	-	-	-	239,080.42	239,080.42
其他负债	-	-	-	413,363.11	413,363.11
负债总计	1,850,000,000.00	-	-	6,473,059.32	1,856,473,059.32
利率敏感度缺口	1,441,978,375.15	1,214,369,395.40	51,565,000.00	122,632,155.55	2,830,544,926.10

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。

#### 7.4.13.4.1.2 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。		
分析	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6日）	上年度末（2018年12月31日）
	市场利率下降 25 个基点	481,905.02	9,957,764.82
市场利率上升 25 个基点	-480,125.96	-9,877,885.48	

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

#### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

无。

#### 7.4.13.4.3 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。

本基金的投资组合比例由优化的 CPPI 策略决定，并对比例范围有如下限制：权益类资产占基金资产的比例不超过 40%；债券、货币市场工具及其它资产的比例合计不低于基金资产的 60%。

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。

#### 7.4.13.4.3.1 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6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	-	-	63,902,742.04	2.26
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	366,395.40	0.01

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	-	-	64,269,137.44	2.27

注：债券投资为可转换债券、可交换债券投资。

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2019 年 6 月 6 日，本基金未持有交易性权益类投资（2018 年 12 月 31 日：2.27%），因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响（2018 年 12 月 31 日：同）。

#### 7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2019 年 6 月 6 日（基金合同失效前日），本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为 443,574,631.60 元，无属于第一或第三层次的余额（2018 年 12 月 31 日：第一层次 63,902,742.04 元，第二层次 3,737,246,395.40 元，第三层次 200,000,000.00 元）。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易

不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

上述第三层次资产变动如下:

交易性金融资产—资产支持证券投资	
2019年1月1日	200,000,000.00
购买	-
出售	(213,095,943.84)
转入第三层次	5,059,300.00
转出第三层次	-
当期利得或损失总额	8,036,643.84
计入损益的利得或损失	8,036,643.84
2019年6月6日(基金合同失效前日)	-
2019年6月6日(基金合同失效前日)仍持有的资产计入当期损益的未实现利得或损失的变动	
——公允价值变动损益	-

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2019年6月6日(基金合同失效前日),本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2018年12月31日:同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告（转型后）

### 8.1 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	83,122,244.69	10.21
	其中：股票	83,122,244.69	10.21
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	702,723,498.90	86.35
	其中：债券	692,723,498.90	85.12
	资产支持证券	10,000,000.00	1.23
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	16,410,149.32	2.02
8	其他各项资产	11,563,238.19	1.42
9	合计	813,819,131.10	100.00

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 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	6,540.00	0.00
C	制造业	29,805,230.06	4.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,871,693.90	0.93
E	建筑业	46,652.83	0.01
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	4,610,540.00	0.73
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,319,429.36	0.68
J	金融业	26,276,782.48	4.15
K	房地产业	6,491,416.00	1.03
L	租赁和商务服务业	480,798.22	0.08
M	科学研究和技术服务业	5,152,005.60	0.81
N	水利、环境和公共设施管理业	6,578.04	0.00
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	4,566.00	0.00
S	综合	50,012.20	0.01
	合计	83,122,244.69	13.13

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 8.3 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	111,800	9,554,428.00	1.51
2	601166	兴业银行	371,200	7,349,760.00	1.16
3	600276	恒瑞医药	77,500	6,782,800.00	1.07
4	601658	邮储银行	1,137,968	6,549,005.78	1.03
5	600048	保利地产	401,200	6,491,416.00	1.03
6	000651	格力电器	97,800	6,413,724.00	1.01
7	600872	中炬高新	135,700	5,339,795.00	0.84
8	603259	药明康德	55,360	5,099,763.20	0.81
9	300760	迈瑞医疗	27,690	5,036,811.00	0.80
10	601006	大秦铁路	549,200	4,508,932.00	0.71
11	600900	长江电力	209,600	3,852,448.00	0.61
12	600406	国电南瑞	121,400	2,571,252.00	0.41
13	300073	当升科技	91,100	2,487,030.00	0.39
14	003816	中国广核	562,958	1,987,241.74	0.31
15	600519	贵州茅台	1,500	1,774,500.00	0.28
16	002174	游族网络	71,300	1,659,151.00	0.26
17	601601	中国太保	36,800	1,392,512.00	0.22
18	601916	浙商银行	294,195	1,370,948.70	0.22
19	688007	光峰科技	26,857	722,721.87	0.11
20	002027	分众传媒	69,300	433,818.00	0.07
21	688011	新光光电	8,807	361,527.35	0.06
22	688025	杰普特	4,655	178,565.80	0.03
23	000089	深圳机场	10,400	101,608.00	0.02
24	600585	海螺水泥	1,200	65,760.00	0.01
25	600036	招商银行	1,600	60,128.00	0.01
26	300787	海能实业	632	59,591.28	0.01
27	300793	佳禾智能	1,176	56,977.20	0.01
28	300803	指南针	1,393	52,766.84	0.01
29	603995	甬金股份	1,888	51,278.08	0.01

30	601512	中新集团	3,598	50,012.20	0.01
31	603786	科博达	816	42,554.40	0.01
32	603390	通达电气	2,119	39,710.06	0.01
33	002969	嘉美包装	3,100	36,952.00	0.01
34	688168	安博通	352	36,259.52	0.01
35	603610	麒盛科技	751	34,485.92	0.01
36	300797	钢研纳克	1,582	33,744.06	0.01
37	300801	泰和科技	861	32,433.87	0.01
38	603053	成都燃气	1,648	32,004.16	0.01
39	300808	久量股份	1,297	31,672.74	0.01
40	300805	电声股份	1,142	31,256.54	0.00
41	603755	日辰股份	637	30,964.57	0.00
42	002963	豪尔赛	875	29,995.00	0.00
43	300809	华辰装备	1,107	29,977.56	0.00
44	300790	宇瞳光学	671	28,853.00	0.00
45	603115	海星股份	1,299	26,824.35	0.00
46	300806	斯迪克	666	26,693.28	0.00
47	300802	矩子科技	519	26,157.60	0.00
48	002972	科安达	1,075	21,532.25	0.00
49	300564	筑博设计	497	18,498.34	0.00
50	603109	神驰机电	684	18,105.48	0.00
51	603815	交建股份	959	16,657.83	0.00
52	300795	米奥兰特	556	15,723.68	0.00
53	600741	华域汽车	600	15,594.00	0.00
54	300796	贝斯美	620	15,264.40	0.00
55	000895	双汇发展	400	11,612.00	0.00
56	002973	侨银环保	1,146	6,578.04	0.00
57	603993	洛阳钼业	1,500	6,540.00	0.00
58	600612	老凤祥	100	4,761.00	0.00
59	600977	中国电影	300	4,566.00	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	38,244,285.14	6.04
2	600547	山东黄金	36,723,538.97	5.80
3	000651	格力电器	27,897,673.00	4.41
4	601398	工商银行	23,473,575.00	3.71
5	600519	贵州茅台	22,183,802.00	3.51
6	600048	保利地产	21,730,279.00	3.43

7	600276	恒瑞医药	17,414,690.34	2.75
8	600036	招商银行	17,294,396.00	2.73
9	603259	药明康德	16,429,353.77	2.60
10	601818	光大银行	10,927,104.00	1.73
11	601601	中国太保	10,633,626.80	1.68
12	300073	当升科技	10,502,713.00	1.66
13	300760	迈瑞医疗	9,527,213.43	1.51
14	601006	大秦铁路	9,435,178.00	1.49
15	300450	先导智能	8,743,278.00	1.38
16	601166	兴业银行	8,299,899.00	1.31
17	002507	涪陵榨菜	8,063,382.67	1.27
18	600690	海尔智家	7,870,442.09	1.24
19	300750	宁德时代	7,802,327.00	1.23
20	002027	分众传媒	6,880,298.00	1.09

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。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600547	山东黄金	35,669,526.38	5.64
2	601318	中国平安	28,738,735.02	4.54
3	601398	工商银行	23,439,482.00	3.70
4	000651	格力电器	23,237,506.82	3.67
5	600519	贵州茅台	20,287,699.20	3.21
6	600036	招商银行	17,522,105.18	2.77
7	600048	保利地产	16,109,752.00	2.55
8	600276	恒瑞医药	14,350,787.84	2.27
9	603259	药明康德	12,103,766.20	1.91
10	601818	光大银行	11,150,005.00	1.76
11	601601	中国太保	10,153,715.00	1.60
12	300450	先导智能	9,408,385.68	1.49
13	300073	当升科技	8,942,507.16	1.41
14	300750	宁德时代	7,973,539.00	1.26
15	600690	海尔智家	7,658,106.52	1.21
16	002507	涪陵榨菜	7,548,741.90	1.19
17	002027	分众传媒	7,422,604.00	1.17
18	600585	海螺水泥	6,916,086.56	1.09
19	600019	宝钢股份	6,675,549.00	1.05
20	000895	双汇发展	6,409,535.00	1.01

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。



## 8.4.3 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	445,238,752.80
卖出股票收入（成交）总额	395,125,789.35

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。

## 8.5 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	6,424,544.00	1.02
2	央行票据	-	-
3	金融债券	60,034,000.00	9.49
	其中：政策性金融债	50,020,000.00	7.90
4	企业债券	329,683,500.00	52.09
5	企业短期融资券	30,113,000.00	4.76
6	中期票据	232,824,400.00	36.79
7	可转债（可交换债）	33,644,054.90	5.32
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	692,723,498.90	109.46

## 8.6 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	136611	16 电投 04	500,000	50,140,000.00	7.92
2	190301	19 进出 01	500,000	50,020,000.00	7.90
3	143916	17 兖煤 Y1	400,000	40,472,000.00	6.39
4	155862	19 中化 Y1	400,000	40,012,000.00	6.32
5	136227	16 住总 01	350,000	35,297,500.00	5.58

## 8.7 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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	165378	碧强 02 优	100,000	10,000,000.00	1.58

## 8.8 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

无。

## 8.9 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

无。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

### 8.10.2 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。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

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

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

无。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

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。

### 8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券备选库。

### 8.12.3 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	37,270.69

2	应收证券清算款	270,312.00
3	应收股利	-
4	应收利息	11,195,121.10
5	应收申购款	60,534.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,563,238.19

#### 8.12.4 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	113011	光大转债	13,725,066.00	2.17
2	113020	桐昆转债	3,581,345.00	0.57
3	128018	时达转债	1,945,931.20	0.31
4	127007	湖广转债	852,449.40	0.13

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	601658	邮储银行	4,548,460.38	0.72	锁定期股票

#### 8.12.6 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 投资组合报告（转型前）

#### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	443,574,631.60	53.08

	其中：债券	443,574,631.60	53.08
	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	253,353,032.39	30.32
8	其他各项资产	138,713,669.11	16.60
9	合计	835,641,333.10	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

无。

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

## 8.3 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

无。

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 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	601939	建设银行	67,735,755.34	2.39
2	601398	工商银行	24,077,940.00	0.85
3	600928	西安银行	90,684.36	0.00
4	002958	青农商行	70,092.00	0.00
5	603379	三美股份	66,546.36	0.00
6	300770	新媒股份	45,972.07	0.00
7	300773	拉卡拉	41,600.00	0.00
8	603967	中创物流	38,575.76	0.00
9	300761	立华股份	37,890.85	0.00
10	300765	新诺威	34,551.64	0.00
11	300755	华致酒行	31,917.79	0.00
12	603068	博通集成	22,933.53	0.00
13	300759	康龙化成	20,896.48	0.00
14	002946	新乳业	20,835.35	0.00
15	002949	华阳国际	20,757.25	0.00
16	002950	奥美医疗	20,449.62	0.00

17	300762	上海瀚讯	20,073.24	0.00
18	002947	恒铭达	19,918.08	0.00
19	603982	泉峰汽车	18,062.55	0.00
20	002951	金时科技	16,649.50	0.00

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。

#### 8.4.2 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	000858	五粮液	76,427,072.98	2.70
2	601939	建设银行	67,378,254.26	2.38
3	601398	工商银行	23,824,508.00	0.84
4	603369	今世缘	22,319,420.00	0.79
5	000651	格力电器	17,810,923.56	0.63
6	601319	中国人保	464,276.97	0.02
7	002939	长城证券	239,492.63	0.01
8	600928	西安银行	161,217.64	0.01
9	002958	青农商行	145,140.00	0.01
10	300759	康龙化成	116,935.24	0.00
11	002941	新疆交建	105,365.02	0.00
12	300770	新媒股份	100,029.28	0.00
13	300761	立华股份	98,181.89	0.00
14	603379	三美股份	84,337.20	0.00
15	002946	新乳业	74,204.43	0.00
16	300773	拉卡拉	71,787.50	0.00
17	300762	上海瀚讯	70,835.85	0.00
18	002949	华阳国际	67,505.50	0.00
19	603068	博通集成	61,734.65	0.00
20	300755	华致酒行	61,212.03	0.00

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。

#### 8.4.3 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	92,527,170.09
卖出股票收入(成交)总额	210,469,677.75

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。

#### 8.5 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	70,222,631.60	10.14
2	央行票据	-	-
3	金融债券	59,946,000.00	8.65
	其中：政策性金融债	49,860,000.00	7.20
4	企业债券	164,054,000.00	23.68
5	企业短期融资券	100,432,000.00	14.50
6	中期票据	20,054,000.00	2.90
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	28,866,000.00	4.17
9	其他	-	-
10	合计	443,574,631.60	64.04

### 8.6 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	019611	19 国债 01	703,070	70,222,631.60	10.14
2	011802354	18 海立 SCP001	500,000	50,220,000.00	7.25
3	136549	16 紫金 03	500,000	49,970,000.00	7.21
4	136611	16 电投 04	500,000	49,930,000.00	7.21
5	190301	19 进出 01	500,000	49,860,000.00	7.20

### 8.7 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

无。

### 8.8 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

无。

### 8.9 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

无。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

#### 8.10.2 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。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

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

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

无

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

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。

### 8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券备选库。

### 8.12.3 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	623,162.13
2	应收证券清算款	130,035,402.75
3	应收股利	-
4	应收利息	8,055,104.23
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	138,713,669.11

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

## 8.12.6 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。

## §9 基金份额持有人信息（转型后）

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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 (%)
855	646,841.39	500,499,000.00	90.50	52,550,389.92	9.50

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	994,348.29	0.1798

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。

### 9.3 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	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	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	-

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 基金份额持有人信息（转型前）

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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 (%)
1,386	467,661.55	500,499,000.00	77.22	147,679,914.75	22.78

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	994,348.29	0.1534

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。

### 9.3 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	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	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	-

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。

## § 10 开放式基金份额变动（转型后）

单位：份

基金合同生效日（2019年6月7日）基金份额总额	648,178,914.75
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	1,603,606.87
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	96,733,131.70
基金合同生效日起至报告期期末基金	-

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	553,049,389.92

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 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

基金合同生效日（2016年6月1日）基金份额总额	4,630,274,675.35
本报告期期初基金份额总额	2,735,367,911.33
本报告期基金总申购份额	3,884,230.02
减：本报告期基金总赎回份额	2,091,073,226.60
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	648,178,914.75

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。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人的重大人事变动：

2019年8月2日，经公司2019年第七次临时股东会会议审议通过，聘任杜海江先生担任鹏华基金新任董事，孙煜扬先生不再担任鹏华基金董事。本公司已将上述变更事项报中国证券监督管理委员会深圳监管局备案。

基金托管人的重大人事变动：

2019年5月，陈四清先生因工作调动，辞去中国银行股份有限公司董事长职务。上述人事变

动已按相关规定备案、公告。

2019 年 6 月，刘连舸先生任中国银行股份有限公司董事长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 11.3 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。

### 11.4 基金投资策略的改变

在报告期内，本基金由保本基金转型为灵活配置型基金。

本基金转型后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、中小企业私募债等）、货币市场工具（包括同业存单、大额存单等）、权证、资产支持证券、国债期货、股指期货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）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。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%；每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

### 11.5 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。本年度应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用 150,000.00 元（包括转型前及转型后费用），该审计机构为本基金提供审计服务的年限为 1 年。

### 11.6 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。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型后)

### 11.7.1 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	2	608,875,124.59	74.84%	554,862.24	76.96%	-
恒泰证券	1	133,673,350.75	16.43%	108,449.10	15.04%	-
华创证券	1	37,240,222.12	4.58%	30,213.29	4.19%	-
天风证券	2	33,820,286.35	4.16%	27,438.30	3.81%	本报告期内新增1个

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。

## 11.7.2 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	246,281,697.20	95.21%	7,078,100,000.00	95.69%	-	-
恒泰证券	-	-	170,400,000.00	2.30%	-	-
华创证券	-	-	111,400,000.00	1.51%	-	-
天风证券	12,380,377.96	4.79%	37,200,000.00	0.50%	-	-

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型前)

## 11.7.1 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	
华创证券	1	113,572,901.31	37.57%	92,138.91	36.06%	本报告期内新增
广发证券	2	102,911,956.90	34.04%	93,784.78	36.70%	-
天风证券	2	85,798,514.88	28.38%	69,608.42	27.24%	本报告期内新增1个
恒泰证券	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。

### 11.7.2 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
华创证券	-	-	9,500,700,000.00	8.22%	-	-
广发证券	2,569,896,606.79	100.00%	105,966,500,000.00	91.72%	-	-
天风证券	-	-	60,600,000.00	0.05%	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件（转型后）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	鹏华金城灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	《上海证券报》	2019年06月19日
2	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
3	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
4	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
5	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
6	鹏华金城灵活配置混合型证券投资基	《上海证券报》	2019年06月21日

	金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告		
7	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
8	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
9	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
10	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
11	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
12	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
13	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
14	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
15	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
16	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
17	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
18	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	《上海证券报》	2019年06月27日
19	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票估值方法变更的提示性公告	《上海证券报》	2019年07月05日

	告		
20	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票估值方法变更的提示性公告	《证券日报》	2019 年 07 月 05 日
21	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》	2019 年 07 月 05 日
22	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票估值方法变更的提示性公告	《证券时报》	2019 年 07 月 05 日
23	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 07 月 09 日
24	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 07 月 09 日
25	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》	2019 年 07 月 09 日
26	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票估值方法变更的提示性公告	《证券日报》	2019 年 07 月 09 日
27	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 07 月 09 日
28	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 07 月 09 日
29	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票估值方法变更的提示性公告	《上海证券报》	2019 年 07 月 09 日
30	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票估值方法变更的提示性公告	《证券时报》	2019 年 07 月 09 日
31	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与上海浦东发展银行股份有限公司定期定额申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2019 年 07 月 16 日
32	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与上海浦东发展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 07 月 16 日
33	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与上海浦东发展银行股份有限公司	《证券日报》	2019 年 07 月 16 日



	公司定期定额申购费率优惠活动的公告		
34	2019 年第二季度报告	《上海证券报》	2019 年 07 月 16 日
35	鹏华基金管理有限公司关于鹏华金城灵活配置混合型证券投资基金暂停大额申购、转换转入和定期定额投资业务的公告	《上海证券报》	2019 年 07 月 16 日
36	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与上海浦东发展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 07 月 16 日
37	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票估值方法变更的提示性公告	《证券时报》	2019 年 07 月 31 日
38	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票估值方法变更的提示性公告	《证券日报》	2019 年 07 月 31 日
39	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票估值方法变更的提示性公告	《上海证券报》	2019 年 07 月 31 日
40	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》	2019 年 07 月 31 日
41	鹏华基金管理有限公司关于提醒网上直销个人投资者及时上传有效身份证件照片并完善、更新身份信息以免影响业务办理的公告	《证券时报》	2019 年 08 月 09 日
42	鹏华基金管理有限公司关于提醒网上直销个人投资者及时上传有效身份证件照片并完善、更新身份信息以免影响业务办理的公告	《中国证券报》	2019 年 08 月 09 日
43	鹏华基金管理有限公司关于提醒网上直销个人投资者及时上传有效身份证件照片并完善、更新身份信息以免影响业务办理的公告	《上海证券报》	2019 年 08 月 09 日
44	鹏华基金管理有限公司关于提醒网上直销个人投资者及时上传有效身份证件照片并完善、更新身份信息以免影响业务办理的公告	《证券日报》	2019 年 08 月 09 日
45	鹏华基金管理有限公司关于提醒网上直销个人投资者及时上传有效身份证件照片并完善、更新身份信息以免影响业务办理的公告	《证券时报》	2019 年 08 月 10 日
46	鹏华基金管理有限公司关于提醒网上	《上海证券报》	2019 年 08 月 10 日

	直销个人投资者及时上传有效身份证件照片并完善、更新身份信息以免影响业务办理的公告		
47	鹏华基金管理有限公司关于提醒网上直销个人投资者及时上传有效身份证件照片并完善、更新身份信息以免影响业务办理的公告	《中国证券报》	2019 年 08 月 10 日
48	鹏华基金管理有限公司关于提醒网上直销个人投资者及时上传有效身份证件照片并完善、更新身份信息以免影响业务办理的公告	《证券日报》	2019 年 08 月 10 日
49	鹏华基金管理有限公司关于提醒网上直销个人投资者及时上传有效身份证件照片并完善、更新身份信息以免影响业务办理的公告	《证券日报》	2019 年 08 月 12 日
50	鹏华基金管理有限公司关于提醒网上直销个人投资者及时上传有效身份证件照片并完善、更新身份信息以免影响业务办理的公告	《上海证券报》	2019 年 08 月 12 日
51	鹏华基金管理有限公司关于提醒网上直销个人投资者及时上传有效身份证件照片并完善、更新身份信息以免影响业务办理的公告	《证券时报》	2019 年 08 月 12 日
52	鹏华基金管理有限公司关于提醒网上直销个人投资者及时上传有效身份证件照片并完善、更新身份信息以免影响业务办理的公告	《中国证券报》	2019 年 08 月 12 日
53	鹏华基金管理有限公司关于提醒网上直销个人投资者及时上传有效身份证件照片并完善、更新身份信息以免影响业务办理的公告	《上海证券报》	2019 年 08 月 13 日
54	鹏华基金管理有限公司关于提醒网上直销个人投资者及时上传有效身份证件照片并完善、更新身份信息以免影响业务办理的公告	《证券时报》	2019 年 08 月 13 日
55	鹏华基金管理有限公司关于提醒网上直销个人投资者及时上传有效身份证件照片并完善、更新身份信息以免影响业务办理的公告	《中国证券报》	2019 年 08 月 13 日
56	鹏华基金管理有限公司关于提醒网上直销个人投资者及时上传有效身份证件照片并完善、更新身份信息以免影响业务办理的公告	《证券日报》	2019 年 08 月 13 日
57	鹏华基金管理有限公司关于提醒网上	《上海证券报》	2019 年 08 月 14 日

	直销个人投资者及时上传有效身份证件照片并完善、更新身份信息以免影响业务办理的公告		
58	鹏华基金管理有限公司关于提醒网上直销个人投资者及时上传有效身份证件照片并完善、更新身份信息以免影响业务办理的公告	《证券时报》	2019 年 08 月 14 日
59	鹏华基金管理有限公司关于提醒网上直销个人投资者及时上传有效身份证件照片并完善、更新身份信息以免影响业务办理的公告	《中国证券报》	2019 年 08 月 14 日
60	鹏华基金管理有限公司关于提醒网上直销个人投资者及时上传有效身份证件照片并完善、更新身份信息以免影响业务办理的公告	《证券日报》	2019 年 08 月 14 日
61	鹏华基金管理有限公司关于提醒网上直销个人投资者及时上传有效身份证件照片并完善、更新身份信息以免影响业务办理的公告	《证券日报》	2019 年 08 月 15 日
62	鹏华基金管理有限公司关于提醒网上直销个人投资者及时上传有效身份证件照片并完善、更新身份信息以免影响业务办理的公告	《证券时报》	2019 年 08 月 15 日
63	鹏华基金管理有限公司关于提醒网上直销个人投资者及时上传有效身份证件照片并完善、更新身份信息以免影响业务办理的公告	《上海证券报》	2019 年 08 月 15 日
64	鹏华基金管理有限公司关于提醒网上直销个人投资者及时上传有效身份证件照片并完善、更新身份信息以免影响业务办理的公告	《中国证券报》	2019 年 08 月 15 日
65	鹏华基金管理有限公司关于提醒网上直销个人投资者及时上传有效身份证件照片并完善、更新身份信息以免影响业务办理的公告	《证券日报》	2019 年 08 月 16 日
66	鹏华基金管理有限公司关于提醒网上直销个人投资者及时上传有效身份证件照片并完善、更新身份信息以免影响业务办理的公告	《证券时报》	2019 年 08 月 16 日
67	鹏华基金管理有限公司关于提醒网上直销个人投资者及时上传有效身份证件照片并完善、更新身份信息以免影响业务办理的公告	《上海证券报》	2019 年 08 月 16 日
68	鹏华基金管理有限公司关于提醒网上	《中国证券报》	2019 年 08 月 16 日

	直销个人投资者及时上传有效身份证件照片并完善、更新身份信息以免影响业务办理的公告		
69	2019 年半年度报告摘要	《上海证券报》	2019 年 08 月 23 日
70	鹏华基金管理有限公司关于增加北京植信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 08 月 30 日
71	鹏华基金管理有限公司关于增加北京植信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 08 月 30 日
72	鹏华基金管理有限公司关于增加北京植信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 08 月 30 日
73	关于调整鹏华金城灵活配置混合型证券投资基金管理费和托管费并修改基金合同及托管协议等事项的公告	《上海证券报》	2019 年 09 月 26 日
74	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与腾安基金销售（深圳）有限公司认\申购费率优惠活动的公告	《证券时报》	2019 年 09 月 28 日
75	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与腾安基金销售（深圳）有限公司认\申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》	2019 年 09 月 28 日
76	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与腾安基金销售（深圳）有限公司认\申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2019 年 09 月 28 日
77	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与腾安基金销售（深圳）有限公司认\申购费率优惠活动的公告	《证券日报》	2019 年 09 月 28 日
78	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与上海浦东发展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 10 月 18 日
79	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与上海浦东发展银行股份有限公司定期定额申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2019 年 10 月 18 日
80	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与上海浦东发展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 10 月 18 日
81	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与上海浦东发展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 10 月 18 日

82	鹏华基金管理有限公司旗下证券投资基金 2019 年第 3 季度报告提示性公告	《证券时报》	2019 年 10 月 25 日
83	鹏华基金管理有限公司旗下证券投资基金 2019 年第 3 季度报告提示性公告	《证券日报》	2019 年 10 月 25 日
84	鹏华基金管理有限公司旗下证券投资基金 2019 年第 3 季度报告提示性公告	《中国证券报》	2019 年 10 月 25 日
85	鹏华基金管理有限公司旗下证券投资基金 2019 年第 3 季度报告提示性公告	《上海证券报》	2019 年 10 月 25 日
86	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 12 月 06 日
87	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 12 月 06 日
88	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 12 月 06 日
89	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 12 月 06 日
90	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与浙江同花顺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 12 月 09 日
91	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与浙江同花顺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 12 月 09 日
92	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与浙江同花顺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 12 月 09 日
93	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与浙江同花顺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 12 月 09 日
94	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《中国证券报》	2019 年 12 月 11 日
95	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《证券日报》	2019 年 12 月 11 日
96	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《证券时报》	2019 年 12 月 11 日
97	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《上海证券报》	2019 年 12 月 11 日
98	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2019 年 12 月 18 日
99	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费率优惠活动的公告	《中国证券报》	2019 年 12 月 31 日
100	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分	《上海证券报》	2019 年 12 月 31 日

	基金参与中国工商银行股份有限公司个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告		
101	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国工商银行股份有限公司“2020 倾心回馈”基金定期定额申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2019 年 12 月 31 日
102	鹏华基金管理有限公司关于旗下证券投资基金持有的股票估值方法变更的提示性公告	《上海证券报》	2019 年 12 月 31 日
103	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国工商银行股份有限公司个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	《证券时报》	2019 年 12 月 31 日
104	鹏华基金管理有限公司关于旗下证券投资基金持有的股票估值方法变更的提示性公告	《证券时报》	2019 年 12 月 31 日
105	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费率优惠活动的公告	《证券时报》	2019 年 12 月 31 日
106	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国工商银行股份有限公司“2020 倾心回馈”基金定期定额申购费率优惠活动的公告	《证券时报》	2019 年 12 月 31 日
107	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国工商银行股份有限公司个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》	2019 年 12 月 31 日
108	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国工商银行股份有限公司“2020 倾心回馈”基金定期定额申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》	2019 年 12 月 31 日
109	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费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2019 年 12 月 31 日
110	鹏华基金管理有限公司关于旗下证券投资基金持有的股票估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》	2019 年 12 月 31 日

### 11.8 其他重大事件（转型前）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	鹏华金城保本混合型证券投资基金更	《证券时报》、《中国证	2019 年 01 月 12 日

	新的招募说明书摘要	券报》、《上海证券报》	
2	鹏华金城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城灵活配置混合型证券投资基金相关业务规则的公告	《上海证券报》	2019 年 05 月 27 日
3	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
4	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
5	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
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 02 月 26 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	《证券时报》	2019 年 03 月 01 日
10	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《证券日报》	2019 年 03 月 01 日
11	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
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	《证券日报》	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	《上海证券报》	2019 年 03 月 13 日
15	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
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	《证券时报》	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	《上海证券报》	2019 年 03 月 20 日

	金销售机构的公告		
19	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
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	《中国证券报》	2019 年 03 月 27 日
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	《证券日报》	2019 年 03 月 27 日
23	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
24	2018 年年度报告摘要	《上海证券报》	2019 年 03 月 28 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	《证券日报》	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	《证券时报》	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
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	《证券时报》	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	《中国证券报》	2019 年 03 月 30 日



	购费率优惠的公告		
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
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	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2019年04月08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	《上海证券报》	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	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
38	2019年第一季度报告	《上海证券报》	2019年04月19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	《证券日报》	2019年05月07日
42	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
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	《证券日报》	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	《上海证券报》	2019年05月13日
45	鹏华基金管理有限公司关于提醒投资	《证券时报》	2019年05月13日

	者及时提供或更新身份信息资料的公告		
46	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
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	《上海证券报》	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
50	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
51	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
52	关于修订《鹏华金城保本混合型证券投资基金基金合同》的公告	《上海证券报》	2019 年 05 月 27 日
53	2018 年第四季度报告	《上海证券报》	2019 年 01 月 21 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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	20190101~20190603	1,400,699.00	-	1,400,699.00	-	-
	2	20190604~20190603	500,499,000.	-	-	500,499,000.00	90.50

		91231	00				
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。

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- (一)《鹏华金城灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- (二)《鹏华金城灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- (三)《鹏华金城灵活配置混合型证券投资基金 2019 年年度报告》（原文）。

### 13.2 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。

### 13.3 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

2020 年 4 月 18 日