

# 鹏华弘实灵活配置混合型证券投资基金 2020 年中期报告

2020 年 6 月 30 日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2020 年 8 月 31 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。本中期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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 08 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 01 月 01 日起至 2020 年 06 月 30 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>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	9
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>14</b>
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	18
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>41</b>
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	47
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	47
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	47
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	47
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	47
7.12 投资组合报告附注 .....	48
<b>§ 8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>50</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	51
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	51
<b>§ 9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>51</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>52</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	52
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	52
10.4 基金投资策略的改变 .....	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	52
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	52
10.8 其他重大事件 .....	55
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>59</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	59
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>59</b>
12.1 备查文件目录 .....	59
12.2 存放地点 .....	59
12.3 查阅方式 .....	59

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华弘实灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	鹏华弘实混合	
基金主代码	001329	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 5 月 25 日	
基金管理人	鹏华基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	562,627,776.61 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	鹏华弘实混合 A	鹏华弘实混合 C
下属分级基金的交易代码	001329	001330
报告期末下属分级基金的份额总额	208,713,607.14 份	353,914,169.47 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在科学严谨的资产配置框架下，严选安全边际较高的股票、债券等投资标的，力争实现绝对收益的目标。
投资策略	<p>1、资产配置策略 本基金将通过跟踪考量通常的宏观经济变量（包括 GDP 增长率、CPI 走势、M2 的绝对水平和增长率、利率水平与走势等）以及各项国家政策（包括财政、税收、货币、汇率政策等），并结合美林时钟等科学严谨的资产配置模型，动态评估不同资产大类在不同时期的投资价值及其风险收益特征，追求股票、债券和货币等大类资产的灵活配置和稳健的绝对收益目标。</p> <p>2、股票投资策略 本基金通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘优质的上市公司，严选其中安全边际较高的个股构建投资组合：自上而下地分析行业的增长前景、行业结构、商业模式、竞争要素等分析把握其投资机会；自下而上地评判企业的产品、核心竞争力、管理层、治理结构等；并结合企业基本面和估值水平进行综合的研判，严选安全边际较高的个股，力争实现组合的绝对收益。</p> <p>3、债券投资策略 本基金债券投资将采取久期策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、个券选择策略、信用策略等积极投资策略，灵活地调整组合的券种搭配，精选安全边际较高的个券，力争实现组合的绝对收益。</p> <p>（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。</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。</p> <p>（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</p>

	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。
业绩比较基准	一年期银行定期存款利率（税后）+3%
风险收益特征	本基金属于混合型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金，低于股票型基金，属于证券投资基金中中高风险、中高预期收益的品种。

注：无。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		鹏华基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张戈	李申
	联系电话	0755-82825720	021-60637102
	电子邮箱	zhangge@phfund.com.cn	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		4006788999	021-60637111
传真		0755-82021126	021-60635778
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	北京市西城区金融大街 25 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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		518048	100033
法定代表人		何如	田国立

### 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》
登载基金中期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>
基金中期报告备置地点	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层鹏华基金管理有限公司

### 2.5 其他相关资料

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

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020年1月1日-2020年6月30日)		
	鹏华弘实混合 A	鹏华弘实混合 C	
本期已实现收益	10,691,691.46	16,304,063.52	
本期利润	12,720,731.84	21,259,762.26	
加权平均基金份额本期利润	0.0820	0.0927	
本期加权平均净值利润率	7.02%	7.33%	
本期基金份额净值增长率	7.56%	7.53%	
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)		
	期末可供分配利润	34,524,555.01	92,876,271.60
	期末可供分配基金份额利润	0.1654	0.2624
	期末基金资产净值	253,415,822.33	465,472,841.81
	期末基金份额净值	1.2142	1.3152
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)		
	基金份额累计净值增长率	27.63%	36.03%

注：（1）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

（2）所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

（3）期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润期末余额和未分配利润中已实现部分的期末余额的孰低数。表中的“期末”均指报告期最后一日，即6月30日，无论该日是否为开放

日或交易所的交易日。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

鹏华弘实混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.00%	0.20%	0.39%	0.01%	1.61%	0.19%
过去三个月	6.41%	0.24%	1.12%	0.01%	5.29%	0.23%
过去六个月	7.56%	0.41%	2.24%	0.02%	5.32%	0.39%
过去一年	12.58%	0.32%	4.51%	0.01%	8.07%	0.31%
过去三年	17.51%	0.22%	13.51%	0.01%	4.00%	0.21%
自基金合同生效起至	27.63%	0.18%	23.17%	0.01%	4.46%	0.17%

鹏华弘实混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.99%	0.20%	0.39%	0.01%	1.60%	0.19%
过去三个月	6.39%	0.24%	1.12%	0.01%	5.27%	0.23%
过去六个月	7.53%	0.41%	2.24%	0.02%	5.29%	0.39%
过去一年	12.48%	0.32%	4.51%	0.01%	7.97%	0.31%
过去三年	17.39%	0.22%	13.51%	0.01%	3.88%	0.21%
自基金合同生效起至	36.03%	0.28%	23.17%	0.01%	12.86%	0.27%

注：业绩比较基准=一年期银行定期存款利率（税后）+3%

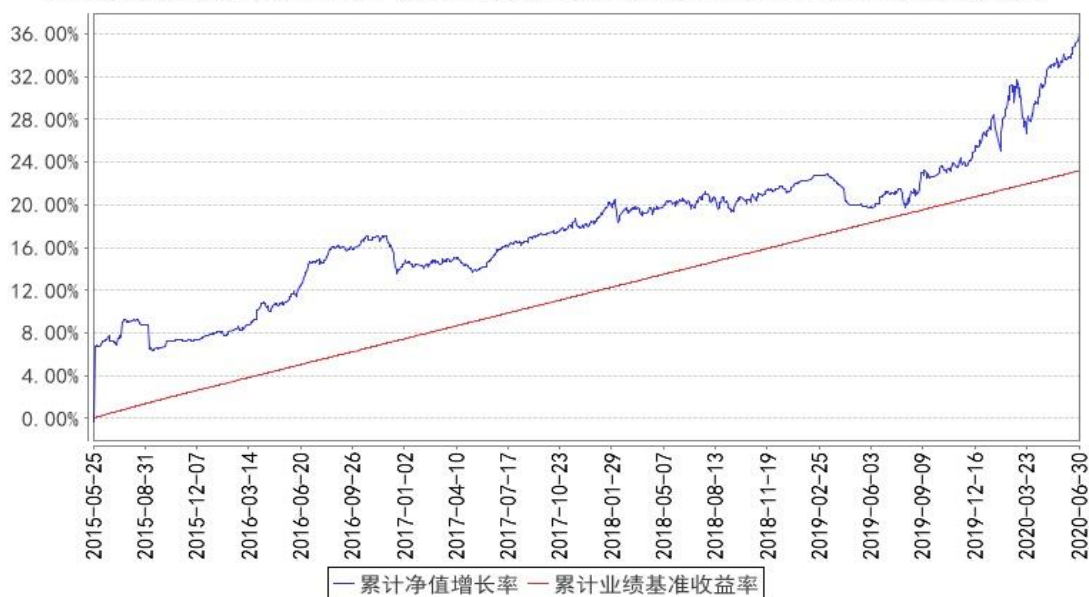


### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

鹏华弘实混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



鹏华弘实混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2015 年 05 月 25 日生效。2、截至建仓期结束，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

### 3.3 其他指标

注：无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

鹏华基金管理有限公司成立于 1998 年 12 月 22 日，业务范围包括基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。截止本报告期末，公司股东由国信证券股份有限公司、意大利欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）、深圳市北融信投资发展有限公司组成，公司性质为中外合资企业，注册资本 15,000 万元人民币。截至 2020 年 6 月，公司管理资产总规模达到 7,014.31 亿元，管理 196 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 22 年投资管理基金，在基金投资、风险控制等方面积累了丰富经验。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
戴钢	本基金基金经理	2018-09-01	-	18 年	戴钢先生，国籍中国，经济学硕士，18 年证券基金从业经验。曾就职于广东民安证券研究发展部，担任研究员；2005 年 9 月加盟鹏华基金管理有限公司，从事研究分析工作，历任债券研究员、专户投资经理，现担任稳定收益投资部副总经理/基金经理。2011 年 12 月至 2014 年 12 月担任鹏华丰泽分级基金基金经理，2012 年 06 月至 2018 年 07 月担任鹏华金鼎保本混合基金基金经理，2012 年 11 月至 2015 年 11 月担任鹏华中小企业债基金基金经理，2013 年 09 月担任鹏华丰实定期开放债券基金基金经理，2013 年 09 月担任鹏华丰泰定期开放债券基金基金经理，2013 年 10 月至 2018 年 05 月担任鹏华丰信分级债券基金基金经理，2014 年 12 月至 2016 年 02 月担任鹏华丰泽债券（LOF）基金基金经理，2015 年 11 月担任鹏华丰和债券（LOF）基金基金经理，2016 年 03 月担任鹏华丰尚定期开放债券基金基金经理，2016 年 04 月至 2018 年 10 月担任鹏华金鼎保本混合基金基金经理，2016 年 08 月至 2018 年 05 月担任鹏华丰饶定期开放债券基金基金经理，2018 年 05 月至 2018 年 12 月担任鹏华普悦债券基金基金经理，2018 年 07 月担任鹏华宏观混合基金基金经理，2018 年

					09 月担任鹏华弘实混合基金基金经理，2018 年 10 月担任鹏华金鼎混合基金基金经理，2019 年 09 月担任鹏华锦利两年定期开放债券基金基金经理。戴钢先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理未发生变动。
李韵怡	本基金基金经理	2015-07-23	-	13 年	李韵怡女士，国籍中国，经济学硕士，13 年证券基金从业经验。曾任职于广州证券股份有限公司投资管理总部，先后担任研究员、交易员和投资经理等职务，从事新股及可转债申购、定增项目等工作；2015 年 6 月加盟鹏华基金管理有限公司，从事投研工作，现担任稳定收益投资部总经理助理/基金经理。2015 年 07 月担任鹏华弘益混合基金基金经理，2015 年 07 月至 2017 年 01 月担任鹏华弘锐混合基金基金经理，2015 年 07 月担任鹏华弘实混合基金基金经理，2015 年 07 月至 2017 年 03 月担任鹏华弘华混合基金基金经理，2015 年 07 月至 2017 年 01 月担任鹏华弘和混合基金基金经理，2015 年 07 月担任鹏华弘鑫混合基金基金经理，2015 年 07 月至 2017 年 02 月担任鹏华弘信混合基金基金经理，2016 年 06 月至 2018 年 07 月担任鹏华兴泽定期开放混合基金基金经理，2016 年 09 月至 2020 年 05 月担任鹏华兴润定期开放混合基金基金经理，2016 年 09 月至 2020 年 05 月担任鹏华兴合定期开放混合基金基金经理，2016 年 09 月担任鹏华兴安定期开放混合基金基金经理，2016 年 09 月至 2018 年 06 月担任鹏华兴实定期开放混合基金基金经理，2016 年 12 月至 2018 年 07 月担任鹏华弘樽混合基金基金经理，2017 年 01 月担任鹏华兴惠定期开放混合基金基金经理，2019 年 06 月担任鹏华科创 3 年封闭混合基金基金经理，2019 年 11 月担任鹏华金享混合基金基金经理，2020 年 04 月担任鹏华鑫享稳健混合基金基金经理。李韵怡女士具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理未发生变动。

注：1. 任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日；担任新成立基金基金经理的，任职日期为基金合同生效日。

2. 证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

#### 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 公平交易制度的执行情况

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2020 年上半年，受新冠疫情影响，一季度股票市场呈震荡下行走势，二季度在疫情防控进入常态化后，恐慌情绪逐渐消退，股票市场呈现震荡上行走势。各主要指数在上半年表现差异较大，上证指数下跌 2.15%，沪深 300 指数上涨 1.64%，中小板指数上涨 20.85%，创业板指上涨 35.6%。在市场流动性充裕的情况下，景气度较高的食品饮料、医药和半导体等板块整体表现较好。债券市场整体收益率小幅上行。

具体操作方面，该基金始终坚持在控制回撤的前提下，追求稳定收益。债券配置以高评级中短期品种为主，维持了一定的杠杆比例。股票方面，配置了行业景气度较高的医药、消费、电子和新能源等板块，并积极参与新股的网下申购，获取增强收益。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2020 年上半年弘实 A 基金的净值增长率为 7.56%，弘实 C 基金的净值增长率为 7.53%，同期业绩基准增长率为 2.24%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，我们认为这次疫情可能会对经济活动带来很多长期的变化，如线下活动加速向线上迁移，各产业的景气度也可能产生相应的变化。我们会需要密切关注各行业的变化情况，在权益仓位的配置上做出调整。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

##### 1、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

###### (1) 日常估值流程

基金的估值由基金会计负责，基金会计对公司所管理的基金以基金为会计核算主体，独立建账、独立核算，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账簿记录等方面相互独立。基金会计核算独立于公司会计核算。基金会计核算采用专用的财务核算软件系统进行基金核算及帐务处理；每日按时接收成交数据及权益数据，进行基金估值。基金会计核算采用基金管理公司与托管银行双人同步独立核算、相互核对的方式，每日就基金的会计核算、基金估值等与托管银行进行核对；每日估值结果必须与托管行核对一致后才能对外公告。基金会计除设有专职基金会计核算岗外，还设有基金会计复核岗位，负责基金会计核算的日常事后复核工作，确保基金净值核算无误。

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

###### (2) 特殊业务估值流程

根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》的相关规定，本公司成立停牌股票等没有市价的投资品种估值小组，成员由基金经理、行业研究员、监察稽核部、金融工程师、登记结算部相关人员组成。

##### 2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理不参与或决定基金日常估值。

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

##### 3、本公司参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

##### 4. 定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1、截止本报告期末，弘实混合 A 期末可供分配利润为 34,524,555.01 元，期末基金份额净值 1.2142 元；截止本报告期末，弘实混合 C 期末可供分配利润为 92,876,271.60 元，期末基金份额

净值 1.3152 元。

2、本基金本报告期内未进行利润分配。

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

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：鹏华弘实灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	174,389,142.85	4,502,080.06
结算备付金		3,306,431.39	1,575,330.28
存出保证金		27,708.62	60,812.77
交易性金融资产	6.4.7.2	833,830,411.76	439,235,332.34

其中：股票投资		170,329,792.58	89,968,408.14
基金投资		-	-
债券投资		663,500,619.18	349,266,924.20
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	8,326,219.36	5,694,532.35
应收股利		-	-
应收申购款		65,198.49	12,624.78
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,019,945,112.47	451,080,712.58
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020年6月30日</b>	<b>上年度末 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		230,000,000.00	86,000,000.00
应付证券清算款		52,524,408.19	-
应付赎回款		17,856,176.39	409,178.41
应付管理人报酬		344,920.30	189,711.11
应付托管费		86,230.07	47,427.77
应付销售服务费		18,579.13	8,412.09
应付交易费用	6.4.7.7	107,670.26	42,734.25
应交税费		33,926.31	24,090.24
应付利息		-	14,574.80
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	84,537.68	170,067.73
负债合计		301,056,448.33	86,906,196.40
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	562,627,776.61	309,776,212.35
未分配利润	6.4.7.10	156,260,887.53	54,398,303.83
所有者权益合计		718,888,664.14	364,174,516.18
负债和所有者权益总计		1,019,945,112.47	451,080,712.58

注：报告截止日 2020 年 06 月 30 日，基金份额总额 562,627,776.61 份，其中鹏华弘实混合 A 基金份额总额 208,713,607.14 份，基金份额净值 1.2142 元；鹏华弘实混合 C 基金份额总额 353,914,169.47 份，基金份额净值 1.3152 元。

## 6.2 利润表

会计主体：鹏华弘实灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		37,490,085.53	2,153,739.00
1. 利息收入		7,389,145.08	699,355.48
其中：存款利息收入	6.4.7.11	116,735.04	76,340.55
债券利息收入		7,079,196.31	549,039.14
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		193,213.73	73,975.79
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		23,001,542.21	616,726.72
其中：股票投资收益	6.4.7.12	21,468,881.31	40,020.00
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	361,888.51	468,508.60
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	1,170,772.39	108,198.12
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	6,984,739.12	812,209.89
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	114,659.12	25,446.91
减：二、费用		3,509,591.43	349,558.48
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,411,050.64	161,744.22
2. 托管费	6.4.10.2.2	352,762.68	40,436.03
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	72,423.42	8,036.67
4. 交易费用	6.4.7.19	354,152.18	13,840.57
5. 利息支出		1,186,076.85	3,649.10
其中：卖出回购金融资产支出		1,186,076.85	3,649.10
6. 税金及附加		19,705.73	1,618.77
7. 其他费用	6.4.7.20	113,419.93	120,233.12



三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		33,980,494.10	1,804,180.52
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		33,980,494.10	1,804,180.52

### 6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：鹏华弘实灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2020年1月1日至2020年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	309,776,212.35	54,398,303.83	364,174,516.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	33,980,494.10	33,980,494.10
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)	252,851,564.26	67,882,089.60	320,733,653.86
其中：1. 基金申购款	412,457,743.55	100,639,285.63	513,097,029.18
2. 基金赎回款	-159,606,179.29	-32,757,196.03	-192,363,375.32
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)	562,627,776.61	156,260,887.53	718,888,664.14
项目	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	54,224,989.85	4,443,225.54	58,668,215.39
二、本期经营活	-	1,804,180.52	1,804,180.52

动产生的基金净值变动数（本期利润）			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	50,839,023.21	11,493,660.17	62,332,683.38
其中：1. 基金申购款	121,994,571.60	19,453,557.66	141,448,129.26
2. 基金赎回款	-71,155,548.39	-7,959,897.49	-79,115,445.88
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）	105,064,013.06	17,741,066.23	122,805,079.29

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

邓召明

苏波

郝文高

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

鹏华弘实灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2015]905号《关于准予鹏华弘实灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》准予，由鹏华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华弘实灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 714,894,604.33 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(2015)第 580 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《鹏华弘实灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 5 月 25 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 714,894,604.33 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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《鹏华弘实灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《鹏华弘实灵活配置混合型证券

投资基金招募说明书》，本基金根据销售服务费及赎回费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存，并分别计算基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华弘实灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（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）、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%—95%；投资于现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金业绩比较基准为：一年期银行定期存款利率（税后）+3%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》、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》、《鹏华弘实灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年上半年财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2020 年 06 月 30 日的财务状况以及 2020 年上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

无。

#### 6.4.6 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。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

## 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
活期存款	174,389,142.85
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	174,389,142.85

## 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	152,902,189.59	170,329,792.58	17,427,602.99
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	590,604,343.37	588,349,119.18
	银行间市场	75,545,629.04	75,151,500.00
	合计	666,149,972.41	663,500,619.18
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	819,052,162.00	833,830,411.76	14,778,249.76

## 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

## 6.4.7.4 买入返售金融资产

## 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

## 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

## 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	15,825.01
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	1,487.90
应收债券利息	8,308,893.95
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	12.50
合计	8,326,219.36

#### 6.4.7.6 其他资产

注：无。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	107,145.26
银行间市场应付交易费用	525.00
合计	107,670.26

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2.32
应付证券出借违约金	-
预提费用	84,535.36
合计	84,537.68

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

##### 鹏华弘实混合 A

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	156,144,933.28	156,144,933.28
本期申购	130,832,644.42	130,832,644.42
本期赎回（以“-”号填列）	-78,263,970.56	-78,263,970.56
-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	208,713,607.14	208,713,607.14

## 鹏华弘实混合 C

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	153,631,279.07	153,631,279.07
本期申购	281,625,099.13	281,625,099.13
本期赎回（以“-”号填列）	-81,342,208.73	-81,342,208.73
-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	353,914,169.47	353,914,169.47

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

## 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

鹏华弘实混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	15,329,099.63	4,791,491.02	20,120,590.65
本期利润	10,691,691.46	2,029,040.38	12,720,731.84
本期基金份额 交易产生的变 动数	8,503,763.92	3,357,128.78	11,860,892.70
其中：基金申 购款	18,272,415.60	4,186,728.52	22,459,144.12
基金赎 回款	-9,768,651.68	-829,599.74	-10,598,251.42
本期已分配利 润	-	-	-
本期末	34,524,555.01	10,177,660.18	44,702,215.19
鹏华弘实混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	29,175,862.49	5,101,850.69	34,277,713.18
本期利润	16,304,063.52	4,955,698.74	21,259,762.26
本期基金份额 交易产生的变 动数	47,396,345.59	8,624,851.31	56,021,196.90
其中：基金申 购款	66,440,169.92	11,739,971.59	78,180,141.51

基金赎回款	-19,043,824.33	-3,115,120.28	-22,158,944.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	92,876,271.60	18,682,400.74	111,558,672.34

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
活期存款利息收入		60,869.97
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		32,064.76
其他		23,800.31
合计		116,735.04

注：其他包含认/申购款利息收入，结算保证金利息收入等。

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入		21,468,881.31
股票投资收益——赎回差价收入		-
股票投资收益——申购差价收入		-
股票投资收益——证券出借差价收入		-
合计		21,468,881.31

##### 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
卖出股票成交总额		90,299,172.51
减：卖出股票成本总额		68,830,291.20
买卖股票差价收入		21,468,881.31

##### 6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。



## 6.4.7.13 债券投资收益

## 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	361,888.51
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	361,888.51

## 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	49,329,492.04
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	48,208,957.53
减：应收利息总额	758,646.00
买卖债券差价收入	361,888.51

## 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

## 6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

## 6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：无。

## 6.4.7.14 贵金属投资收益

## 6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

## 6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

## 6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

## 6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

## 6.4.7.15 衍生工具收益

## 6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

## 6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

## 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,170,772.39
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	1,170,772.39

## 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
1. 交易性金融资产	6,984,739.12
股票投资	9,128,401.62
债券投资	-2,143,662.50
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	6,984,739.12

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	108,127.48
基金转换费收入	6,531.64
合计	114,659.12

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	353,627.18
银行间市场交易费用	525.00
合计	354,152.18

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	24,863.02
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行汇划费用	10,284.57
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	113,419.93

#### 6.4.7.21 分部报告

无。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

## 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

## 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

## 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例(%)
国信证券	28,668,196.96	13.49	919,495.00	7.47

## 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)
国信证券	44,014,146.81	20.84	10,221,900.00	7.19

## 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)
国信证券	150,000,000.00	2.03	6,000,000.00	2.03

#### 6.4.10.1.4 权证交易

注：无。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
国信证券	26,125.42	13.68	14,791.06	13.80
关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
国信证券	837.89	7.47	235.01	2.37

注：（1）佣金的计算公式

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

(佣金比率按照与一般证券公司签订的协议条款订立。)

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

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6 月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,411,050.64	161,744.22
其中：支付销售机构的客户维护费	120,900.12	48,042.23

注：1、支付基金管理人鹏华基金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。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年6月30日	2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	352,762.68	40,436.03

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费年费率为 0.15%，逐日计提，按月支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.15%÷当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2020年1月1日至2020年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鹏华弘实混合 A	鹏华弘实混合 C	合计
鹏华基金公司	-	47,944.37	47,944.37
合计	-	47,944.37	47,944.37
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2019年1月1日至2019年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鹏华弘实混合 A	鹏华弘实混合 C	合计
鹏华基金公司	-	8.61	8.61
合计	-	8.61	8.61

注：支付基金销售机构的 C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.05%，逐日计提，按月支付，A 类基金份额不支付销售服务费。日销售服务费=前一日 C 类基金资产净值×0.05%÷当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

#### 6.4.10.4 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

##### 6.4.10.4.1 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

注：无。

#### 6.4.10.4.2 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

注：无。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

注：无

##### 6.4.10.5.2 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

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

#### 6.4.10.6 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 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	174,389,142.85	60,869.97	9,450,748.99	56,981.24

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在报告期内未参与关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：无。

#### 6.4.12 期末(2020年6月30日)本基金持有的流通受限证券

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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300840	酷特智能	2020年6月30日	2020年7月8日	新股未上市	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-
300843	胜蓝股份	2020年6月23日	2020年7月2日	新股未上市	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-

300845	捷安高科	2020年6月24日	2020年7月3日	新股未上市	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-
300846	首都在线	2020年6月22日	2020年7月1日	新股未上市	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-
601816	京沪高铁	2020年1月8日	2020年7月16日	锁定期股票	4.88	6.17	906,536	4,423,895.68	5,593,327.12	-
688027	国盾量子	2020年6月30日	2020年7月9日	新股未上市	36.18	36.18	2,830	102,389.40	102,389.40	-
688169	石头科技	2020年2月13日	2020年8月21日	锁定期股票	271.12	365.14	2,960	802,515.20	1,080,814.40	-
688189	南新制药	2020年3月18日	2020年9月28日	锁定期股票	34.94	50.21	6,833	238,745.02	343,084.93	-
688277	天智航-U	2020年6月24日	2020年7月7日	新股未上市	12.04	12.04	8,810	106,072.40	106,072.40	-
688377	迪威尔	2020年6月29日	2020年7月8日	新股未上市	16.42	16.42	7,894	129,619.48	129,619.48	-
688505	复旦张江	2020年6月10日	2020年12月21日	锁定期股票	8.95	24.78	22,688	203,057.60	562,208.64	-
688516	奥特维	2020年5月14日	2020年11月23日	锁定期股票	23.28	43.10	3,440	80,083.20	148,264.00	-
688528	秦川物联	2020年6月19日	2020年7月1日	新股未上市	11.33	11.33	8,337	94,458.21	94,458.21	-
688555	泽达易盛	2020年6月12日	2020年12月23日	锁定期股票	19.49	56.80	3,004	58,547.96	170,627.20	-
688568	中科星图	2020年6月30日	2020年7月8日	新股未上市	16.21	16.21	11,020	178,634.20	178,634.20	-
688599	天合光能	2020年6月	2020年12	锁定期股票	8.16	13.91	69,858	570,041.28	971,724.78	-



		2 日	月 10 日							
688600	皖仪科技	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 3 日	新股未上市	15.50	15.50	5,468	84,754.00	84,754.00	-

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。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 06 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 230,000,000.00 元，于 2020 年 07 月 01 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。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险

及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。本基金的基金管理人致力于全面内部控制体系的建设，建立了从董事会层面到各业务部门的风险管理组织架构。本基金的基金管理人在董事会下设风险控制和合规审计委员会，主要负责制定基金管理人风险控制战略和控制政策、协调突发重大风险等事项；督察长负责对基金管理人各业务环节合法合规运作进行监督检查，组织、指导基金管理人内部监察稽核工作，并可向董事会和中国证监会直接报告；在公司内部设立独立的监察稽核部，专职负责对基金管理人各部门、各业务的风险控制情况进行督促和检查，并适时提出整改建议。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行股份有限公司，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 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券占基金资产净值的比例为 87.31%（2019 年 12 月 31 日:91.78%）。

##### 6.4.13.2.1 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 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-

未评级	24,707,040.00	10,014,000.00
合计	24,707,040.00	10,014,000.00

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。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
AAA	627,633,000.00	333,810,965.20
AAA 以下	8,079.18	412,959.00
未评级	11,152,500.00	5,029,000.00
合计	638,793,579.18	339,252,924.20

注：未评级债券包括国债、中央银行票据和政策性金融债。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理职能部门设定流

动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短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 2020 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额 230,000,000.00 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。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

#### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家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。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	174,389,142.85	-	-	-	174,389,142.85
结算备付金	3,306,431.39	-	-	-	3,306,431.39
存出保证金	27,708.62	-	-	-	27,708.62
交易性金融资产	171,833,540.00	491,659,000.00	8,079.18	170,329,792.58	833,830,411.76
应收利息	-	-	-	8,326,219.36	8,326,219.36
应收申购款	-	-	-	65,198.49	65,198.49
资产总计	349,556,822.86	491,659,000.00	8,079.18	178,721,210.43	1,019,945,112.47
负债					
应付赎回款	-	-	-	17,856,176.39	17,856,176.39

应付管理人报酬	-	-	-	344,920.30	344,920.30
应付托管费	-	-	-	86,230.07	86,230.07
应付证券清算款	-	-	-	52,524,408.19	52,524,408.19
卖出回购金融资产款	230,000,000.00	-	-	-	230,000,000.00
应付销售服务费	-	-	-	18,579.13	18,579.13
应付交易费用	-	-	-	107,670.26	107,670.26
应交税费	-	-	-	33,926.31	33,926.31
其他负债	-	-	-	84,537.68	84,537.68
负债总计	230,000,000.00	-	-	71,056,448.33	301,056,448.33
利率敏感度缺口	119,556,822.86	491,659,000.00	8,079.18	107,664,762.10	718,888,664.14
上年度末 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	4,502,080.06	-	-	-	4,502,080.06
结算备付金	1,575,330.28	-	-	-	1,575,330.28
存出保证金	60,812.77	-	-	-	60,812.77
交易性金融资产	25,109,000.00	323,458,156.40	699,767.80	89,968,408.14	439,235,332.34
应收利息	-	-	-	5,694,532.35	5,694,532.35
应收申购款	-	-	-	12,624.78	12,624.78
资产总计	31,247,223.11	323,458,156.40	699,767.80	95,675,565.27	451,080,712.58
负债					
应付赎回款	-	-	-	409,178.41	409,178.41
应付管理人报酬	-	-	-	189,711.11	189,711.11
应付托管费	-	-	-	47,427.77	47,427.77
卖出回购金融资产款	86,000,000.00	-	-	-	86,000,000.00
应付销售服务费	-	-	-	8,412.09	8,412.09
应付交易费用	-	-	-	42,734.25	42,734.25
应付利息	-	-	-	14,574.80	14,574.80
应交税费	-	-	-	24,090.24	24,090.24
其他负债	-	-	-	170,067.73	170,067.73
负债总计	86,000,000.00	-	-	906,196.40	86,906,196.40
利率敏感度缺口	-54,752,776.89	323,458,156.40	699,767.80	94,769,368.87	364,174,516.18

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有债券资产的利率风险状况测算的理论变动值对基金资产净值的影响金额。
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。
	此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。
相关风险变量的变	对资产负债表日基金资产净值的

	动	影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2020年6月30日）	上年度末（2019年12月31日）
分析	市场利率下降 25 个基点	2,910,947.91	1,147,927.11
	市场利率上升 25 个基点	-2,887,621.02	-1,141,171.48

注：无。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无。

##### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。

本基金股票资产占基金资产的比例为 0%—95%；投资于现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。

此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日		上年度末 2019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	170,329,792.58	23.69	89,968,408.14	24.70
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	8,079.18	-	1,324,924.20	0.36
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	170,337,871.76	23.69	91,293,332.34	25.07

注：债券投资为可转换债券、可交换债券投资。

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准外的其他市场变量保持不变		
	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（2020年6月30日）	上年度末（2019年12月31日）
分析	业绩比较基准上升5%	8,693,887.93	1,073,836.25
	业绩比较基准下降5%	-8,693,887.93	-1,073,836.25

注：无。



## 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

## 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 7 投资组合报告

## 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	170,329,792.58	16.70
	其中：股票	170,329,792.58	16.70
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	663,500,619.18	65.05
	其中：债券	663,500,619.18	65.05
	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	177,695,574.24	17.42
8	其他各项资产	8,419,126.47	0.83
9	合计	1,019,945,112.47	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

## 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	444,720.00	0.06
B	采矿业	2,767,278.00	0.38
C	制造业	108,313,235.57	15.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	339,997.32	0.05
E	建筑业	2,135,381.00	0.30
F	批发和零售业	494,458.00	0.07
G	交通运输、仓储和邮政业	6,713,726.12	0.93
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,841,794.37	0.40
J	金融业	35,223,693.00	4.90

K	房地产业	2,230,872.00	0.31
L	租赁和商务服务业	7,639,888.00	1.06
M	科学研究和技术服务业	808,735.20	0.11
N	水利、环境和公共设施管理业	272,020.00	0.04
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	103,994.00	0.01
S	综合	-	-
	合计	170,329,792.58	23.69

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000661	长春高新	27,600	12,014,280.00	1.67
2	300750	宁德时代	56,000	9,764,160.00	1.36
3	000651	格力电器	170,000	9,616,900.00	1.34
4	601888	中国中免	49,600	7,639,888.00	1.06
5	002511	中顺洁柔	310,000	6,913,000.00	0.96
6	601318	中国平安	92,000	6,568,800.00	0.91
7	600519	贵州茅台	4,100	5,997,808.00	0.83
8	601816	京沪高铁	906,536	5,593,327.12	0.78
9	601166	兴业银行	349,100	5,508,798.00	0.77
10	002475	立讯精密	100,000	5,135,000.00	0.71
11	600276	恒瑞医药	51,360	4,740,528.00	0.66
12	600984	建设机械	180,000	4,464,000.00	0.62
13	600031	三一重工	228,100	4,279,156.00	0.60
14	002371	北方华创	25,000	4,272,750.00	0.59
15	600529	山东药玻	70,000	4,060,000.00	0.56
16	601012	隆基股份	86,700	3,531,291.00	0.49
17	600036	招商银行	87,700	2,957,244.00	0.41
18	000858	五粮液	17,000	2,909,040.00	0.40
19	002142	宁波银行	100,000	2,627,000.00	0.37
20	002311	海大集团	52,690	2,507,517.10	0.35
21	000581	威孚高科	120,000	2,481,600.00	0.35
22	300394	天孚通信	40,000	2,382,000.00	0.33
23	002541	鸿路钢构	80,000	2,339,200.00	0.33
24	000728	国元证券	253,300	2,127,720.00	0.30

25	002673	西部证券	229,800	1,875,168.00	0.26
26	600030	中信证券	72,100	1,738,331.00	0.24
27	600048	保利地产	112,200	1,658,316.00	0.23
28	600887	伊利股份	52,300	1,628,099.00	0.23
29	000333	美的集团	23,700	1,417,023.00	0.20
30	300558	贝达药业	10,000	1,399,800.00	0.19
31	002415	海康威视	43,600	1,323,260.00	0.18
32	601398	工商银行	251,900	1,254,462.00	0.17
33	600016	民生银行	209,600	1,188,432.00	0.17
34	601328	交通银行	231,500	1,187,595.00	0.17
35	601288	农业银行	321,100	1,085,318.00	0.15
36	688169	石头科技	2,960	1,080,814.40	0.15
37	600000	浦发银行	99,300	1,050,594.00	0.15
38	002643	万润股份	60,000	1,030,200.00	0.14
39	688599	天合光能	69,858	971,724.78	0.14
40	600703	三安光电	38,500	962,500.00	0.13
41	600104	上汽集团	55,400	941,246.00	0.13
42	688106	金宏气体	17,575	913,548.50	0.13
43	600585	海螺水泥	17,000	899,470.00	0.13
44	600837	海通证券	68,400	860,472.00	0.12
45	300059	东方财富	42,360	855,672.00	0.12
46	601668	中国建筑	179,000	853,830.00	0.12
47	688023	安恒信息	2,728	839,951.20	0.12
48	603259	药明康德	8,372	808,735.20	0.11
49	601390	中国中铁	150,900	757,518.00	0.11
50	601601	中国太保	27,000	735,750.00	0.10
51	601688	华泰证券	36,800	691,840.00	0.10
52	000568	泸州老窖	7,300	665,176.00	0.09
53	601211	国泰君安	38,100	657,606.00	0.09
54	600309	万华化学	12,700	634,873.00	0.09
55	601988	中国银行	178,500	621,180.00	0.09
56	600547	山东黄金	16,700	611,554.00	0.09
57	688505	复旦张江	22,688	562,208.64	0.08
58	600009	上海机场	7,800	562,146.00	0.08
59	600588	用友网络	12,220	538,902.00	0.07
60	600690	海尔智家	30,300	536,310.00	0.07
61	688123	聚辰股份	6,660	512,820.00	0.07
62	601818	光大银行	136,400	488,312.00	0.07
63	300498	温氏股份	20,400	444,720.00	0.06
64	600028	中国石化	113,000	441,830.00	0.06
65	002410	广联达	6,000	418,200.00	0.06
66	600352	浙江龙盛	32,100	410,559.00	0.06

67	601088	中国神华	28,200	404,952.00	0.06
68	002236	大华股份	20,400	391,884.00	0.05
69	601899	紫金矿业	88,900	391,160.00	0.05
70	600018	上港集团	93,100	391,020.00	0.05
71	601628	中国人寿	14,100	383,661.00	0.05
72	600050	中国联通	78,500	379,940.00	0.05
73	001979	招商蛇口	21,200	348,528.00	0.05
74	688189	南新制药	6,833	343,084.93	0.05
75	601857	中国石油	81,600	341,904.00	0.05
76	601186	中国铁建	39,800	333,524.00	0.05
77	600522	中天科技	28,900	330,905.00	0.05
78	600153	建发股份	40,500	328,050.00	0.05
79	600674	川投能源	35,300	327,231.00	0.05
80	601989	中国重工	79,200	316,800.00	0.04
81	002271	东方雨虹	7,600	308,788.00	0.04
82	000157	中联重科	47,400	304,782.00	0.04
83	601336	新华保险	6,800	301,104.00	0.04
84	600196	复星医药	8,400	284,340.00	0.04
85	300070	碧水源	33,500	272,020.00	0.04
86	601997	贵阳银行	34,600	247,736.00	0.03
87	000425	徐工机械	40,300	238,173.00	0.03
88	600438	通威股份	13,700	238,106.00	0.03
89	600340	华夏幸福	9,800	224,028.00	0.03
90	601138	工业富联	14,500	219,675.00	0.03
91	603993	洛阳钼业	59,400	217,998.00	0.03
92	600583	海油工程	44,000	200,200.00	0.03
93	000768	中航飞机	11,100	196,914.00	0.03
94	600741	华域汽车	9,200	191,268.00	0.03
95	601618	中国中冶	75,900	190,509.00	0.03
96	300017	网宿科技	22,100	187,629.00	0.03
97	688568	中科星图	11,020	178,634.20	0.02
98	688555	泽达易盛	3,004	170,627.20	0.02
99	601111	中国国航	25,300	167,233.00	0.02
100	601808	中海油服	12,000	157,680.00	0.02
101	600299	安迪苏	12,900	157,638.00	0.02
102	600118	中国卫星	5,100	157,233.00	0.02
103	601066	中信建投	3,900	153,582.00	0.02
104	688516	奥特维	3,440	148,264.00	0.02
105	688377	迪威尔	7,894	129,619.48	0.02
106	688558	国盛智科	2,887	127,894.10	0.02
107	688078	龙软科技	2,811	115,813.20	0.02
108	601992	金隅集团	36,800	112,608.00	0.02

109	603087	甘李药业	1,076	107,922.80	0.02
110	600019	宝钢股份	23,300	106,248.00	0.01
111	688277	天智航-U	8,810	106,072.40	0.01
112	688027	国盾量子	2,830	102,389.40	0.01
113	688528	秦川物联	8,337	94,458.21	0.01
114	601933	永辉超市	9,700	90,986.00	0.01
115	688600	皖仪科技	5,468	84,754.00	0.01
116	002024	苏宁易购	8,600	75,422.00	0.01
117	600977	中国电影	4,600	60,398.00	0.01
118	600010	包钢股份	55,200	59,616.00	0.01
119	601319	中国人保	8,900	57,316.00	0.01
120	002032	苏泊尔	700	49,700.00	0.01
121	300144	宋城演艺	2,520	43,596.00	0.01
122	603899	晨光文具	700	38,220.00	0.01
123	603833	欧派家居	200	23,180.00	0.00
124	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.00
125	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.00
126	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.00
127	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
128	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
129	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
130	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000651	格力电器	10,178,299.51	2.79
2	000661	长春高新	9,619,953.95	2.64
3	300750	宁德时代	8,256,655.00	2.27
4	601816	京沪高铁	6,319,848.88	1.74
5	002511	中顺洁柔	6,098,106.37	1.67
6	300315	掌趣科技	5,082,822.00	1.40
7	002475	立讯精密	4,750,811.10	1.30
8	002371	北方华创	4,089,844.00	1.12
9	000636	风华高科	3,997,537.00	1.10
10	601166	兴业银行	3,960,265.00	1.09
11	601888	中国中免	3,861,761.00	1.06
12	600984	建设机械	3,778,754.50	1.04
13	600031	三一重工	3,285,981.00	0.90
14	000581	威孚高科	2,707,495.00	0.74
15	002142	宁波银行	2,667,300.00	0.73

16	002311	海大集团	2,532,962.20	0.70
17	002897	意华股份	2,308,660.00	0.63
18	600529	山东药玻	2,290,062.00	0.63
19	601012	隆基股份	2,285,347.70	0.63
20	600030	中信证券	2,177,934.00	0.60

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	688126	沪硅产业-U	6,341,103.68	1.74
2	300315	掌趣科技	4,546,512.73	1.25
3	601901	方正证券	4,480,026.09	1.23
4	601818	光大银行	3,976,706.00	1.09
5	688111	金山办公	3,621,986.87	0.99
6	000636	风华高科	3,089,959.00	0.85
7	002897	意华股份	2,724,378.00	0.75
8	601816	京沪高铁	2,701,410.50	0.74
9	300248	新开普	2,344,940.93	0.64
10	600030	中信证券	2,116,606.00	0.58
11	300476	胜宏科技	1,947,269.00	0.53
12	601878	浙商证券	1,632,501.00	0.45
13	688396	华润微	1,589,776.17	0.44
14	300015	爱尔眼科	1,508,158.60	0.41
15	601318	中国平安	1,451,979.00	0.40
16	300450	先导智能	1,282,544.00	0.35
17	688200	华峰测控	1,227,968.04	0.34
18	300003	乐普医疗	1,223,135.98	0.34
19	600183	生益科技	1,211,390.00	0.33
20	600862	中航高科	1,156,471.00	0.32

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	140,063,274.02
卖出股票收入（成交）总额	90,299,172.51

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

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

1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	211,143,040.00	29.37
	其中：政策性金融债	35,859,540.00	4.99
4	企业债券	422,034,500.00	58.71
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	30,315,000.00	4.22
7	可转债（可交换债）	8,079.18	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	663,500,619.18	92.30

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	163222	20 信投 G1	350,000	34,811,000.00	4.84
2	163525	20 渤海 01	350,000	34,401,500.00	4.79
3	124184	13 京投债	300,000	31,389,000.00	4.37
4	112812	18 申证 03	300,000	30,750,000.00	4.28
5	143381	18 宁安 02	300,000	30,453,000.00	4.24

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：无。

### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：无。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：无。

### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

#### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

#### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

### 7.12 投资组合报告附注

#### 7.12.1 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

中信建投

关于公司 2019 年 7 月 17 日，交易商协会关于中信建投处罚通知：主要是针对公司主承的 18 五矿地产 ABN002、19 五矿地产 ABN001、19 五矿地产 ABN002 和 19 五矿地产 ABN003 等 4 期资产支持票据未向协会备案发行，工作尽职履责不到位，且承兑 19 五矿地产 ABN003 发行文件中前海结算 2019 年一季报披露不准确事项，未能及时关注到相关财务报表的差异，进行批评处分，并责令整改。

关于对中信建投证券股份有限公司采取出具警示函监管措施的决定（20200421），具体如下：

经查，你公司管理 8 只私募资管计划，投资于同一资产的资金均超过该资产管理计划资产净值的 25%。

上述行为违反了《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》（证监会公告〔2018〕31 号）第十五条的规定，按照《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（证监会令第 151 号）第七十八条的规定，我局决定对你公司采取出具警示函的行政监督管理措施。

上述违规行为反映出你公司内部控制存在薄弱环节，私募资管业务风险管控不足。你公司应进一步强化合规管理与风险控制，杜绝此类违规事件再次发生。

如果对本监督管理措施不服，可以在收到本决定书之日起六十日内向中国证券监督管理委员会提出行政复议申请，也可以在收到本决定书之日起六个月内向有管辖权的人民法院提起诉讼。复议与诉讼期间，上述监督管理措施不停止执行。

对该证券的投资决策程序的说明：本基金管理人长期跟踪研究该公司，认为公司的上述违规行为对公司并不产生实质性影响。上述通告对该公司证券的投资价值不产生重大影响。该证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

国泰君安

本基金持有的前十大证券之一的国泰君安证券股份有限公司在本报告期内有如下情形需要公告：

吉林证监局关于对国泰君安证券股份有限公司四平中央西路证券营业部采取责令改正行政监管措施的决定（20190920），具体如下：营业部员工王珏在替客户办理证券交易操作，与客户约定分享投资收益的行为，营业部未能有效防范员工违法违规风险，存在异常交易监控不到位，部分重要空白合同文本管理不到位的问题，反映公司营业部内控不完善。上述行为违反了《证券经纪



人管理暂行规定》第十八条及《证券公司监督管理条例》第二十七条第一款的规定，根据规定，吉林证监局对营业部采取责令整改的行政监管措施。

深圳证监局关于对国泰君安证券股份有限公司深圳红荔西路证券营业部采取出局警示函措施的决定（20200317），具体如下：营业部存在副总经理实际履行分支机构负责人职责 4 个月未向深圳证监局报备，违反了《证券公司分支机构监管规定》第十七条相关规定，因此对营业部采取出局警示函的行政监管措施，要求营业部加强综合管理，提升合规管理水平，依法稳健经营。

中国证券监督管理委员会上海监管局关于对国泰君安证券股份有限公司采取出具警示函措施的决定（20191219），具体如下：公司分支机构员工存在替客户办理证券交易操作、为客户的融资活动提供便利等违规行为，公司未能有效动态监控客户交易活动，未及时报告、处置重大异常行为，在分支机构管理、异常交易和操作监控等方面存在不足。上述行为违反了《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》（证监会令第 133 号）第六条第三项、《证券经纪人管理暂行规定》（证监会公告[2009]2 号）第十八条、《证券公司内部控制指引》（证监机构字[2003]260 号）第三十七条的有关规定。根据《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》第三十二条第一款的规定，现决定对公司采取出具警示函的行政监管措施。

关于对国泰君安证券股份有限公司采取出具警示函措施的决定（20200506），具体如下：经查，你公司作为富贵鸟股份有限公司公开发行 2014 年公司债券的承销机构和受托管理人，在尽职调查和受托管理过程中未严格遵守执业规范，未能勤勉尽责地履行相关责任，违反了中国证监会《公司债券发行与交易管理办法》（证监会令第 113 号，以下简称《管理办法》）第七条和第四十九条的规定。

根据《管理办法》第五十八条的相关规定，我局决定对你公司采取出具警示函的监督管理措施，你公司应引以为戒，在开展业务时恪守勤勉尽责义务，严格遵守职业规范和监管规则，加强业务质量控制，提升合规水平。

如果对本监督管理措施不服，可以在收到本决定书之日起 60 日内向中国证券监督管理委员会提出行政复议申请，也可以在收到本决定书之日起 6 个月内向有管辖权的人民法院提起诉讼。复议与诉讼期间，上述监督管理措施不停止执行。

对该证券的投资决策程序的说明：本基金管理人长期跟踪研究该公司，认为公司的上述违规行为对公司并不产生实质性影响。上述通告对该公司证券的投资价值不产生重大影响。该证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

### 7.12.2 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。

## 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	27,708.62
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,326,219.36
5	应收申购款	65,198.49
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,419,126.47

## 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

## 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	601816	京沪高铁	5,593,327.12	0.78	锁定期股票

## 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

## 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
鹏华弘实混合 A	717	291,092.90	206,550,144.50	98.96	2,163,462.64	1.04
鹏华	1,691	209,292.83	330,162,602.91	93.29	23,751,566.56	6.71

弘实混合 C						
合计	2,408	233,649.41	536,712,747.41	95.39	25,915,029.20	4.61

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	鹏华弘实混合 A	57,430.20	0.0275
	鹏华弘实混合 C	159,192.17	0.0450
	合计	216,622.37	0.0385

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

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

注：截止本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人及本基金的基金经理未持有本基金份额。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	鹏华弘实混合 A	鹏华弘实混合 C
基金合同生效日 (2015年5月25日) 基金份额总额	677,332,318.04	37,562,286.29
本报告期期初基金份额总额	156,144,933.28	153,631,279.07
本报告期基金总申购份额	130,832,644.42	281,625,099.13
减：本报告期基金总赎回份额	78,263,970.56	81,342,208.73
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	208,713,607.14	353,914,169.47

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

### 10.4 基金投资策略的改变

无

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未改聘为本基金审计的会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券	1	29,908,268.00	14.08%	27,255.75	14.28%	-
国泰君安	2	28,935,980.82	13.62%	26,369.30	13.81%	-
国信证券	2	28,668,196.96	13.49%	26,125.42	13.68%	-
东莞证券	2	26,258,739.24	12.36%	23,929.61	12.53%	-
东方财富证券	2	25,356,350.61	11.93%	20,571.28	10.78%	-
中信建投	2	23,347,086.49	10.99%	21,276.54	11.14%	-

瑞信方正	1	21,842,718.13	10.28%	19,902.49	10.42%	-
华西证券	1	15,095,704.61	7.10%	13,756.45	7.21%	-
长江证券	1	6,824,029.32	3.21%	6,218.60	3.26%	-
中金财富	1	3,646,339.50	1.72%	3,322.83	1.74%	-
华融证券	1	1,712,422.00	0.81%	1,389.47	0.73%	-
方正证券	2	873,056.38	0.41%	795.61	0.42%	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-

中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

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、及时性以及提供研究服务主动性和质量等情况，并依据评比结果确定交易单元交易的具体情况。我公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向券商租用交易单元作为基金专用交易单元。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
招商证券	213,192.00	0.10%	479,000,000.00	6.48%	-	-
国泰君安	1,250,305.41	0.59%	3,800,000.00	0.05%	-	-
国信证券	44,014,146.81	20.84%	150,000,000.00	2.03%	-	-
东莞证券	-	-	23,000,000.00	0.31%	-	-
东方财富证券	-	-	649,000,000.00	8.78%	-	-
中信建投	-	-	3,282,000,000.00	44.42%	-	-

瑞信方正	2,752,316.10	1.30%	1,407,200,000.00	19.05%	-	-
华西证券	-	-	315,500,000.00	4.27%	-	-
长江证券	1,007,000.00	0.48%	476,000,000.00	6.44%	-	-
中金财富	129,168.00	0.06%	363,500,000.00	4.92%	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	239,000,000.00	3.23%	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
天风证券	161,804,600.00	76.62%	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
新时代证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	鹏华基金管理有限公司关于旗下证券投资基金招募说明书的补充提示	《上海证券报》	2020年01月16日
2	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与华安证券股份有限公司申购	《证券时报》	2020年05月06日

	(含定期定额申购)费率优惠活动的公告		
3	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与青岛意才基金销售有限公司认、申购(含定期定额申购)费率优惠活动的公告	《证券日报》	2020年01月17日
4	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与青岛意才基金销售有限公司认、申购(含定期定额申购)费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2020年01月17日
5	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金2019年第4季度报告提示性公告	《证券时报》	2020年01月20日
6	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金2019年第4季度报告提示性公告	《上海证券报》	2020年01月20日
7	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金2019年第4季度报告提示性公告	《中国证券报》	2020年01月20日
8	鹏华基金管理有限公司关于调整旗下基金2020年春节假期清算交收安排及申购赎回等交易业务的提示性公告	《证券时报》	2020年02月03日
9	鹏华基金管理有限公司关于调整旗下基金2020年春节假期清算交收安排及申购赎回等交易业务的提示性公告	《上海证券报》	2020年02月03日
10	鹏华基金管理有限公司关于调整旗下基金2020年春节假期清算交收安排及申购赎回等交易业务的提示性公告	《证券日报》	2020年02月03日
11	鹏华基金管理有限公司关于使用不低于5000万元自有资金购买本公司旗下偏股型公募基金的公告	《证券时报》	2020年02月05日
12	鹏华基金管理有限公司关于使用不低于5000万元自有资金购买本公司旗下偏股型公募基金的公告	《证券日报》	2020年02月05日
13	鹏华基金管理有限公司关于使用不低于5000万元自有资金购买本公司旗下偏股型公募基金的公告	《上海证券报》	2020年02月05日
14	鹏华基金管理有限公司关于使用不低于5000万元自有资金购买本公司旗下偏股型公募基金的公告	《中国证券报》	2020年02月05日
15	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》、《上海证券报》、《证券日报》、《证券时报》	2020年03月17日
16	鹏华基金管理有限公司关于延期披露旗下基金2019年年度报告的提示性公告	《证券日报》	2020年03月28日
17	鹏华基金管理有限公司关于延期披露	《证券时报》	2020年03月28日



	旗下基金 2019 年年度报告的提示性公告		
18	鹏华基金管理有限公司关于延期披露旗下基金 2019 年年度报告的提示性公告	《上海证券报》	2020 年 03 月 28 日
19	鹏华基金管理有限公司关于延期披露旗下基金 2019 年年度报告的提示性公告	《中国证券报》	2020 年 03 月 28 日
20	鹏华基金管理有限公司修改旗下 88 只证券投资基金基金合同的公告	《上海证券报》	2020 年 04 月 15 日
21	鹏华基金管理有限公司修改旗下 88 只证券投资基金基金合同的公告	《中国证券报》	2020 年 04 月 15 日
22	鹏华基金管理有限公司修改旗下 88 只证券投资基金基金合同的公告	《证券时报》	2020 年 04 月 15 日
23	鹏华基金管理有限公司修改旗下 88 只证券投资基金基金合同的公告	《证券日报》	2020 年 04 月 15 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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》、《证券时报》	2020 年 04 月 15 日
25	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2019 年年度报告提示性公告	《证券日报》	2020 年 04 月 18 日
26	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2019 年年度报告提示性公告	《中国证券报》	2020 年 04 月 18 日
27	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2019 年年度报告提示性公告	《证券时报》	2020 年 04 月 18 日
28	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2019 年年度报告提示性公告	《上海证券报》	2020 年 04 月 18 日
29	鹏华弘实灵活配置混合型证券投资基金更新的招募说明书摘要（2020 年第 1 号）	《上海证券报》	2020 年 04 月 20 日
30	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2020 年第 1 季度报告提示性公告	《证券时报》	2020 年 04 月 22 日
31	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2020 年第 1 季度报告提示性公告	《证券日报》	2020 年 04 月 22 日
32	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2020 年第 1 季度报告提示性公告	《上海证券报》	2020 年 04 月 22 日
33	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2020 年第 1 季度报告提示性公告	《中国证券报》	2020 年 04 月 22 日
34	鹏华基金管理有限公司关于结束旗下基金在中信证券华南股份有限公司（原广州证券股份有限公司）申购费率优惠活动的公告	《证券时报》	2020 年 04 月 28 日
35	鹏华基金管理有限公司关于结束旗下基金在中信证券华南股份有限公司	《上海证券报》	2020 年 04 月 28 日

	(原广州证券股份有限公司) 申购费率优惠活动的公告		
36	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与华安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》	2020 年 05 月 06 日
37	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与华安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》	2020 年 05 月 06 日
38	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与华安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》	2020 年 05 月 06 日
39	鹏华弘实灵活配置混合型证券投资基金更新的招募说明书摘要	《上海证券报》	2020 年 05 月 15 日
40	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与万联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》	2020 年 05 月 18 日
41	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与万联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》	2020 年 05 月 18 日
42	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与万联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》	2020 年 05 月 18 日
43	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与万联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》	2020 年 05 月 18 日
44	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金在蒙商银行股份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》	2020 年 05 月 23 日
45	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》、《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2020 年 06 月 03 日
46	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与青岛意才基金销售有限公司认、申购(含定期定额申购)费率优惠活动的公告	《中国证券报》	2020 年 01 月 17 日

注：无。

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注:无。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (一)《鹏华弘实灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- (二)《鹏华弘实灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- (三)《鹏华弘实灵活配置混合型证券投资基金 2020 年中期报告》（原文）。

### 12.2 存放地点

深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层鹏华基金管理有限公司。

### 12.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅，也可按工本费购买复印件，或通过本基金管理人网站（<http://www.phfund.com.cn>）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 8 月 31 日