

鹏华金城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

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
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
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
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	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
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	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	44

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	44
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	45
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	45
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	45
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	45
7.12 投资组合报告附注	45
§ 8 基金份额持有人信息.....	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	47
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	47
§ 9 开放式基金份额变动.....	47
§ 10 重大事件揭示	48
10.1 基金份额持有人大会决议	48
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	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	48
10.4 基金投资策略的改变	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	48
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	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	48
10.8 其他重大事件	49
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	53
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	53
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	53
§ 12 备查文件目录	54
12.1 备查文件目录	54
12.2 存放地点	54
12.3 查阅方式	54

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

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	531,376,059.77 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在科学严谨的资产配置框架下，精选股票、债券等投资标的，力争基金资产长期稳定的增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略 本基金将通过跟踪考量通常的宏观经济变量（包括 GDP 增长率、CPI 走势、M2 的绝对水平和增长率、利率水平与走势等）以及各项国家政策（包括财政、货币、税收、汇率政策等）来判断经济周期目前的位置以及未来将发展的方向，在此基础上对各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估，制定股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。</p> <p>2、股票投资策略 本基金通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘优质的公司，构建股票投资组合。核心思路在于：1）自上而下地分析行业的增长前景、行业结构、商业模式、竞争要素等分析把握其投资机会；2）自下而上地评判企业的核心竞争力、管理层、治理结构等以及其所提供的产品和服务是否契合未来行业增长的大趋势，对企业基本面和估值水平进行综合的研判，深度挖掘优质的个股。</p> <p>（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，主要分析行业的外部发展环境、行业的生命周期以及行业波动与经济周期的关系等；对行业利润前景，主要分析行业结构，特别是业内竞争的方式、业内竞争的激烈程度、以及业内厂商的谈判能力等。基于对行业结构的分析形成对业内竞争的关键成功要素的判断，为预测企业经营环境的变化建立起扎实的基础。</p> <p>（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。</p> <p>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：一方面为竞争力分析，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</p>

	<p>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。</p> <p>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、历史比较和增长性分析,确定具有上升基础的股价水平。</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,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。</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期收益的目的。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>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。</p> <p>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。</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。
--	---------------------------------------

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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.phfund.com.cn
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)
本期已实现收益	19,952,409.27
本期利润	17,672,494.67
加权平均基金份额本期利润	0.0327
本期加权平均净值利润率	2.81%
本期基金份额净值增长率	2.88%
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	86,904,153.96
期末可供分配基金份额利润	0.1635

期末基金资产净值	625,389,821.12
期末基金份额净值	1.177
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	10.10%

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

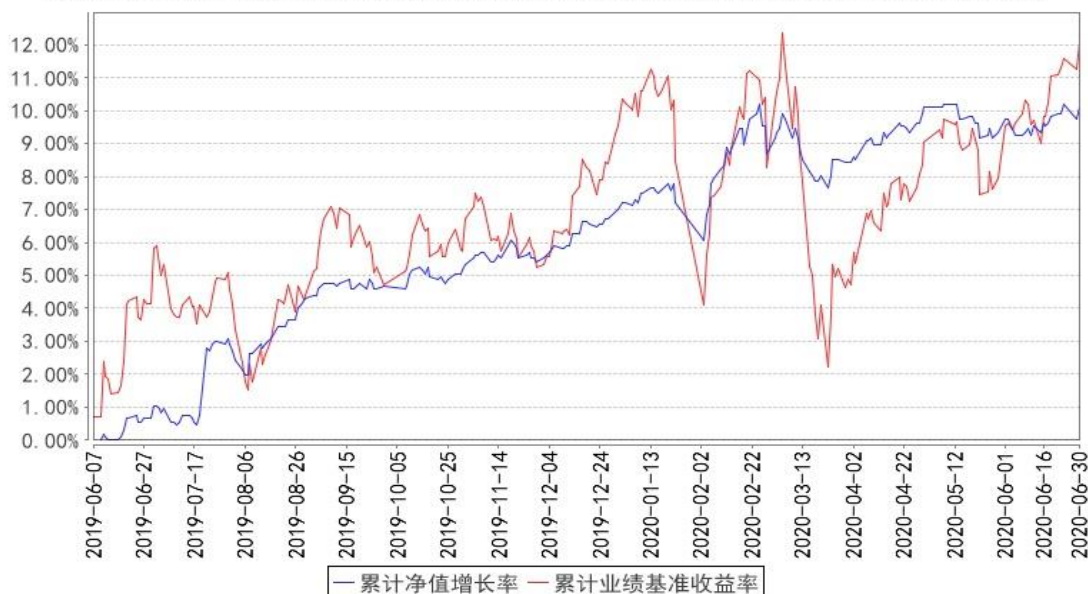
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.68%	0.20%	3.83%	0.49%	-3.15%	-0.29%
过去三个月	1.55%	0.19%	6.88%	0.50%	-5.33%	-0.31%
过去六个月	2.88%	0.27%	2.31%	0.82%	0.57%	-0.55%
过去一年	9.39%	0.25%	7.61%	0.66%	1.78%	-0.41%
自基金合同生效起至今	10.10%	0.25%	12.07%	0.66%	-1.97%	-0.41%

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

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

鹏华金城混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 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。

3.3 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		
方昶	本基金基金经理	2019-06-19	-	6 年	方昶先生，国籍中国，经济学硕士，6 年证券基金从业经验。曾任中国工商银行资

					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，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 年上半年债券市场收益率先下后上，整体呈现宽幅震荡格局。1 月下旬至 4 月中旬，受海内外疫情影响，我国实体经济受到较大冲击，央行货币政策宽松力度加码，银行间资金利率大幅下行带动现券收益率下行；4 月底 5 月初开始，随着社融数据、经济数据反弹超出市场预期，债券市场出现较大幅度调整。权益市场方面，3 月底 4 月初随着美股筑底企稳，全球风险资产在经历一季度暴跌之后逐步企稳向上，A 股市场表现出较强的韧性，二季度随着经济数据环比改善，风险偏好整体有所提振，权益市场整体有较好表现。

本组合上半年债券部位灵活操作，一季度主动拉长组合债券久期，二季度主动降低组合债券久期，以中等久期优质信用债套息交易为主；权益部位在 3 月上旬大幅减仓后，在 4 月初做出加仓动作，结构上整体均衡配置，力争为投资者创造持续稳健回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

鹏华灵活配置组合净值增长率 2.88%；鹏华灵活配置混合业绩比较基准增长率 2.31%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，从全球角度来看，疫情对全球经济基本面的影响仍将持续，但是边际上将呈现逐级改善态势，全球央行仍将维持宽松的流动性环境。国内方面，基本面延续 4 月以来的边际改善局面，但是力度有所放缓。宏观经济基本面在经历二季度的环比快速改善后，3、4 季度外需层面将面临一定挑战，其中，地产投资方面，上半年保持较强的韧性，但四季度或有一定的下行压力；基建投资层面，随着二季度的地方债资金逐步到位，3、4 季度对经济的托底作用将逐步显现；通胀层面，9 月份附近大概率见到年内高点后逐级回落。总体来看，宏观经济下半年将延续温和改善局面，但与此同时，也面临内外需不足的不确定性，在此背景下央行仍将维持稳健的货币政策。

整体来看，当前的债券市场，收益率已调整至疫情之前水平，信用利差和期限利差均较一季度大幅走扩，已经有了较好的配置价值；权益市场方面，考虑到随着基本面的逐级改善，企业盈利大概率从一季度底部逐级向上爬坡，且当前整体估值仍然较为合理，下半年仍将有较好的投资机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

(1) 日常估值流程

基金的估值由基金会计负责，基金会计对公司所管理的基金以基金为会计核算主体，独立建

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

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

(2) 特殊业务估值流程

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

2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理不参与或决定基金日常估值。

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

3、本公司参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4. 定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1、截止本报告期末，本基金期末可供分配利润为 86,904,153.96 元，期末基金份额净值 1.177 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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：鹏华金城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
资产：			
银行存款	6.4.7.1	31,369,774.82	10,015,347.37
结算备付金		23,062,588.56	6,394,801.95
存出保证金		90,427.38	37,270.69
交易性金融资产	6.4.7.2	792,296,986.23	785,845,743.59
其中：股票投资		131,579,738.95	83,122,244.69
基金投资		-	-
债券投资		630,717,247.28	692,723,498.90
资产支持证券投资		30,000,000.00	10,000,000.00
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		-	270,312.00

应收利息	6.4.7.5	14,412,582.38	11,195,121.10
应收股利		-	-
应收申购款		1,182.32	60,534.40
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		861,233,541.69	813,819,131.10
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		213,800,000.00	179,600,000.00
应付证券清算款		21,235,410.95	-
应付赎回款		39,177.10	448,054.67
应付管理人报酬		306,824.65	322,775.56
应付托管费		51,137.47	53,795.92
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	236,702.10	203,103.63
应交税费		65,060.83	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	6.4.7.8	109,407.47	270,051.19
负债合计		235,843,720.57	180,941,225.28
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	531,376,059.77	553,049,389.92
未分配利润	6.4.7.10	94,013,761.35	79,828,515.90
所有者权益合计		625,389,821.12	632,877,905.82
负债和所有者权益总计		861,233,541.69	813,819,131.10

注：报告截止日 2020 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.177 元，基金份额总额 531,376,059.77 份。

6.2 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：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	上年度可比期间
		2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	2019 年 6 月 7 日（基金合 同生效日）至 2019 年 6 月 30 日

一、收入		23,298,501.21	5,448,611.76
1. 利息收入		13,740,767.74	1,055,315.92
其中：存款利息收入	6.4.7.11	209,586.04	154,560.27
债券利息收入		12,913,644.13	872,855.40
资产支持证券利息收入		607,949.12	-
买入返售金融资产收入		9,588.45	27,900.25
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		11,830,061.36	1,804,792.72
其中：股票投资收益	6.4.7.12	11,952,710.99	727,148.37
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-1,323,941.62	-11,115.78
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	1,201,291.99	1,088,760.13
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-2,279,914.60	2,588,285.11
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	7,586.71	218.01
减：二、费用		5,626,006.54	955,494.19
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,878,456.57	663,089.70
2. 托管费	6.4.10.2.2	313,076.17	110,514.95
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	787,538.67	139,226.12
5. 利息支出		2,463,482.29	25,522.81
其中：卖出回购金融资产支出		2,463,482.29	25,522.81
6. 税金及附加		45,510.83	2,161.64
7. 其他费用	6.4.7.20	137,942.01	14,978.97
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		17,672,494.67	4,493,117.57
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		17,672,494.67	4,493,117.57

6.3 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：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)	553,049,389.92	79,828,515.90	632,877,905.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	17,672,494.67	17,672,494.67
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)	-21,673,330.15	-3,487,249.22	-25,160,579.37
其中：1. 基金申购款	1,662,827.96	271,071.10	1,933,899.06
2. 基金赎回款	-23,336,158.11	-3,758,320.32	-27,094,478.43
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)	531,376,059.77	94,013,761.35	625,389,821.12
项目	上年度可比期间 2019 年 6 月 7 日(基金合同生效日)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)	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)	-	4,493,117.57	4,493,117.57
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)	-42,456,487.72	-3,083,950.37	-45,540,438.09

其中：1. 基金申购款	16, 112. 17	1, 228. 70	17, 340. 87
2. 基金赎回款	-42, 472, 599. 89	-3, 085, 179. 07	-45, 557, 778. 96
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）	605, 722, 427. 03	45, 885, 334. 16	651, 607, 761. 19

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

邓召明

苏波

郝文高

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

鹏华金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%。

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。

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	31,369,774.82
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	31,369,774.82

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	127,978,501.93	131,579,738.95	3,601,237.02
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	360,614,740.31	360,728,847.28
	银行间市场	268,785,734.32	269,988,400.00
	合计	629,400,474.63	630,717,247.28
资产支持证券	30,000,000.00	30,000,000.00	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	787,378,976.56	792,296,986.23	4,918,009.67

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	1,520.82
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	9,340.38

应收债券利息	13,757,414.96
应收资产支持证券利息	644,269.59
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	36.63
合计	14,412,582.38

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	234,020.07
银行间市场应付交易费用	2,682.03
合计	236,702.10

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	9.09
应付证券出借违约金	-
预提费用	109,398.38
合计	109,407.47

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	553,049,389.92	553,049,389.92
本期申购	1,662,827.96	1,662,827.96
本期赎回（以“-”号填列）	-23,336,158.11	-23,336,158.11
- 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	531,376,059.77	531,376,059.77

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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	70,055,325.83	9,773,190.07	79,828,515.90
本期利润	19,952,409.27	-2,279,914.60	17,672,494.67
本期基金份额交易产生的变动数	-3,103,581.14	-383,668.08	-3,487,249.22
其中：基金申购款	237,662.54	33,408.56	271,071.10
基金赎回款	-3,341,243.68	-417,076.64	-3,758,320.32
本期已分配利润	-	-	-
本期末	86,904,153.96	7,109,607.39	94,013,761.35

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	41,816.63
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	167,053.00
其他	716.41
合计	209,586.04

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	11,952,710.99
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	11,952,710.99

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	257,151,255.54
减：卖出股票成本总额	245,198,544.55

买卖股票差价收入	11,952,710.99
----------	---------------

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	-1,323,941.62
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-1,323,941.62

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	295,457,496.50
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	288,078,413.68
减：应收利息总额	8,703,024.44
买卖债券差价收入	-1,323,941.62

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	1,201,291.99
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	1,201,291.99

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	-2,279,914.60
股票投资	-750,371.77
债券投资	-1,529,542.83

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	-2,279,914.60

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	5,428.62
基金转换费收入	1,067.68
其他	1,090.41
合计	7,586.71

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	783,478.67
银行间市场交易费用	4,060.00
合计	787,538.67

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	49,726.04
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行汇划费用	9,943.63
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	137,942.01

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

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**

注：无。

6.4.10.1.2 债券交易

注：无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

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

注：无。

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 6 月 7 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,878,456.57	663,089.70
其中：支付销售机构的客户维护费	77,363.64	63,321.31

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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 6 月 7 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	313,076.17	110,514.95

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。

6.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

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6月7日（基金合同生效日）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
中国银行	31,369,774.82	41,816.63	17,246,425.12	22,041.93

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	-
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	-
688157	松井股份	2020年 5月29 日	2020年 12月9 日	锁定期 股票	34.48	86.64	3,402	117,300.96	294,749.28	-
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	-
688312	燕麦科技	2020年 5月29 日	2020年 12月8 日	锁定期 股票	19.68	41.77	7,390	145,435.20	308,680.30	-
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	-
688518	联赢激光	2020年 6月12 日	2020年 12月 22日	锁定期 股票	7.81	20.83	14,111	110,206.91	293,932.13	-
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	-
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	-
688600	皖仪科技	2020年 6月23 日	2021年 01月 04日	锁定期 股票	15.50	15.50	5,468	84,754.00	84,754.00	-

注：1、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 213,800,000.00 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银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。

本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2019 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券占基金资产净值的比例为 57.53%（2018 年 12 月 31 日：未持有）。

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	10,072,000.00	10,061,000.00
A-1 以下	1,005,300.00	20,052,000.00
未评级	28,442,736.00	50,020,000.00
合计	39,520,036.00	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。

6.4.13.2.2 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 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	30,000,000.00	10,000,000.00
未评级	-	-
合计	30,000,000.00	10,000,000.00

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	375,121,945.44	342,274,944.30
AAA 以下	209,504,646.54	263,891,010.60
未评级	6,570,619.30	6,424,544.00
合计	591,197,211.28	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。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理职能部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注中列示的

部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2020 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额 213,800,000.00 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。

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	31,369,774.82	-	-	-	31,369,774.82
结算备付金	23,062,588.56	-	-	-	23,062,588.56
存出保证金	90,427.38	-	-	-	90,427.38
交易性金融资产	218,929,136.00	420,657,501.74	21,130,609.54	131,579,738.95	792,296,986.23
应收利息	-	-	-	14,412,582.38	14,412,582.38
应收申购款	-	-	-	1,182.32	1,182.32
资产总计	273,451,926.76	420,657,501.74	21,130,609.54	145,993,503.65	861,233,541.69
负债					
应付赎回款	-	-	-	39,177.10	39,177.10
应付管理人报酬	-	-	-	306,824.65	306,824.65
应付托管费	-	-	-	51,137.47	51,137.47

应付证券清算款	-	-	-	21,235,410.95	21,235,410.95
卖出回购金融资产款	213,800,000.00	-	-	-	213,800,000.00
应付交易费用	-	-	-	236,702.10	236,702.10
应交税费	-	-	-	65,060.83	65,060.83
其他负债	-	-	-	109,407.47	109,407.47
负债总计	213,800,000.00	-	-	22,043,720.57	235,843,720.57
利率敏感度缺口	59,651,926.76	420,657,501.74	21,130,609.54	123,949,783.08	625,389,821.12
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	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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有债券资产的利率风险状况测算的理论变动值对基金资产净值的影响金额。	
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。	
	此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。	
相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
	本期末（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, 228, 266. 56	2, 606, 413. 23
	市场利率上升 25 个基点	-2, 199, 082. 87	-2, 573, 481. 66

注：于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.00%，因此当利率发生合理、可能的变动时，对于本基金资产净值无重大影响。

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%；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。

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	131,579,738.95	21.04	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	22,305,491.98	3.57	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	153,885,230.93	24.61	116,766,299.59	18.45

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%	4,643,805.28	-
	业绩比较基准下降	-4,643,805.28	-

	5%		
	-	-	-

注：于 2019 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值比例为 18.45%，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。

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	131,579,738.95	15.28
	其中：股票	131,579,738.95	15.28
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	660,717,247.28	76.72
	其中：债券	630,717,247.28	73.23
	资产支持证券	30,000,000.00	3.48
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	54,432,363.38	6.32
8	其他各项资产	14,504,192.08	1.68
9	合计	861,233,541.69	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	59,906.91	0.01
B	采矿业	36,472.15	0.01
C	制造业	51,678,832.40	8.26

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,629,671.38	0.42
E	建筑业	96,471.55	0.02
F	批发和零售业	103,021.79	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	9,906,800.00	1.58
H	住宿和餐饮业	4,511,095.00	0.72
I	信息传输、软件和信息技术服务业	19,259,604.78	3.08
J	金融业	12,622,256.76	2.02
K	房地产业	21,309,907.12	3.41
L	租赁和商务服务业	1,335,810.74	0.21
M	科学研究和技术服务业	6,570,892.62	1.05
N	水利、环境和公共设施管理业	1,177,709.75	0.19
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	118,391.00	0.02
R	文化、体育和娱乐业	121,518.00	0.02
S	综合	41,377.00	0.01
	合计	131,579,738.95	21.04

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	000651	格力电器	234,100	13,243,037.00	2.12
2	601006	大秦铁路	1,395,900	9,827,136.00	1.57
3	300113	顺网科技	386,200	9,809,480.00	1.57
4	000002	万科A	358,700	9,376,418.00	1.50
5	000401	冀东水泥	583,500	9,359,340.00	1.50
6	600048	保利地产	588,004	8,690,699.12	1.39
7	600690	海尔智家	455,900	8,069,430.00	1.29
8	601166	兴业银行	455,700	7,190,946.00	1.15
9	603259	药明康德	67,320	6,503,112.00	1.04
10	600258	首旅酒店	293,500	4,511,095.00	0.72
11	300418	昆仑万维	175,500	4,380,480.00	0.70
12	300078	思创医惠	295,400	3,996,762.00	0.64
13	601658	邮储银行	742,068	3,391,250.76	0.54
14	600801	华新水泥	139,107	3,298,226.97	0.53
15	600383	金地集团	236,700	3,242,790.00	0.52

16	600585	海螺水泥	55,400	2,931,214.00	0.47
17	600900	长江电力	131,800	2,496,292.00	0.40
18	600161	天坛生物	54,792	2,483,721.36	0.40
19	600036	招商银行	60,500	2,040,060.00	0.33
20	300188	美亚柏科	90,700	1,798,581.00	0.29
21	002271	东方雨虹	40,800	1,657,704.00	0.27
22	300369	绿盟科技	68,700	1,600,023.00	0.26
23	002027	分众传媒	228,800	1,274,416.00	0.20
24	002602	世纪华通	58,000	887,980.00	0.14
25	002241	歌尔股份	27,800	816,208.00	0.13
26	000596	古井贡酒	4,800	721,152.00	0.12
27	600031	三一重工	34,000	637,840.00	0.10
28	601200	上海环境	51,100	613,200.00	0.10
29	688558	国盛智科	8,488	376,018.40	0.06
30	600323	瀚蓝环境	15,300	334,764.00	0.05
31	688312	燕麦科技	7,390	308,680.30	0.05
32	603788	宁波高发	16,600	297,638.00	0.05
33	688157	松井股份	3,402	294,749.28	0.05
34	688518	联赢激光	14,111	293,932.13	0.05
35	688025	杰普特	4,655	267,662.50	0.04
36	688555	泽达易盛	3,004	234,312.00	0.04
37	688568	中科星图	11,020	178,634.20	0.03
38	603737	三棵树	1,540	142,018.80	0.02
39	688377	迪威尔	7,894	129,619.48	0.02
40	300253	卫宁健康	5,200	119,288.00	0.02
41	002739	万达电影	7,700	117,579.00	0.02
42	603087	甘李药业	1,076	107,922.80	0.02
43	688277	天智航-U	8,810	106,072.40	0.02
44	688027	国盾量子	2,830	102,389.40	0.02
45	300347	泰格医药	1,000	101,880.00	0.02
46	600276	恒瑞医药	1,080	99,684.00	0.02
47	002985	北摩高科	782	97,335.54	0.02
48	601778	晶科科技	12,349	97,063.14	0.02
49	688528	秦川物联	8,337	94,458.21	0.02
50	300815	玉禾田	716	87,810.24	0.01
51	000858	五粮液	500	85,560.00	0.01
52	688600	皖仪科技	5,468	84,754.00	0.01
53	000089	深圳机场	10,400	79,664.00	0.01
54	300803	指南针	1,393	78,606.99	0.01
55	603893	瑞芯微	810	73,305.00	0.01
56	603719	良品铺子	963	70,645.68	0.01
57	601827	三峰环境	6,723	63,801.27	0.01

58	603786	科博达	816	61,485.60	0.01
59	002982	湘佳股份	581	59,906.91	0.01
60	300821	东岳硅材	5,703	59,083.08	0.01
61	603755	日辰股份	637	56,285.32	0.01
62	002989	中天精装	980	55,056.40	0.01
63	002990	盛视科技	612	53,807.04	0.01
64	603568	伟明环保	2,210	51,272.00	0.01
65	603995	甬金股份	1,888	50,787.20	0.01
66	300308	中际旭创	800	50,400.00	0.01
67	300793	佳禾智能	1,882	50,061.20	0.01
68	601609	金田铜业	4,477	46,829.42	0.01
69	002987	京北方	770	45,853.50	0.01
70	002980	华盛昌	700	44,492.00	0.01
71	603679	华体科技	1,113	43,752.03	0.01
72	300829	金丹科技	574	42,872.06	0.01
73	601512	中新集团	3,598	41,377.00	0.01
74	300831	派瑞股份	1,716	41,372.76	0.01
75	300787	海能实业	948	35,550.00	0.01
76	688168	安博通	352	34,327.04	0.01
77	603610	麒盛科技	1,037	33,266.96	0.01
78	603353	和顺石油	689	32,376.11	0.01
79	300806	斯迪克	666	31,868.10	0.01
80	002986	宇新股份	630	31,783.50	0.01
81	002983	芯瑞达	660	31,554.60	0.01
82	300825	阿尔特	1,642	31,280.10	0.01
83	300801	泰和科技	1,550	31,093.00	0.00
84	002978	安宁股份	881	30,967.15	0.00
85	300802	矩子科技	830	28,452.40	0.00
86	603439	贵州三力	797	28,317.41	0.00
87	300790	宇瞳光学	1,208	28,255.12	0.00
88	603390	通达电气	2,119	27,716.52	0.00
89	605001	威奥股份	1,353	27,709.44	0.00
90	002979	雷赛智能	1,005	27,104.85	0.00
91	002973	侨银环保	1,146	26,862.24	0.00
92	300833	浩洋股份	406	26,430.60	0.00
93	300805	电声股份	1,142	26,174.64	0.00
94	300830	金现代	1,671	26,134.44	0.00
95	605166	聚合顺	1,641	26,009.85	0.00
96	603950	长源东谷	1,081	25,716.99	0.00
97	300808	久量股份	1,297	25,680.60	0.00
98	002972	科安达	1,075	25,617.25	0.00
99	603115	海星股份	1,299	24,525.12	0.00

100	002981	朝阳科技	490	24,348.10	0.00
101	603109	神驰机电	684	24,213.60	0.00
102	002969	嘉美包装	3,100	23,653.00	0.00
103	603053	成都燃气	1,648	23,549.92	0.00
104	300797	钢研纳克	1,582	23,429.42	0.00
105	603682	锦和商业	2,018	23,227.18	0.00
106	300838	浙江力诺	909	22,243.23	0.00
107	300809	华辰装备	1,107	21,918.60	0.00
108	002971	和远气体	859	21,483.59	0.00
109	603221	爱丽家居	1,442	21,442.54	0.00
110	002963	豪尔赛	875	21,420.00	0.00
111	002988	豪美新材	1,097	20,491.96	0.00
112	603815	交建股份	959	19,995.15	0.00
113	603948	建业股份	860	19,324.20	0.00
114	603095	越剑智能	630	19,000.80	0.00
115	603212	赛伍技术	715	18,954.65	0.00
116	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.00
117	000895	双汇发展	400	18,436.00	0.00
118	002976	瑞玛工业	536	18,052.48	0.00
119	603949	雪龙集团	875	17,648.75	0.00
120	300015	爱尔眼科	380	16,511.00	0.00
121	603551	奥普家居	888	14,412.24	0.00
122	300817	双飞股份	506	13,505.14	0.00
123	300823	建科机械	453	13,096.23	0.00
124	300564	筑博设计	497	13,071.10	0.00
125	300819	聚杰微纤	541	12,935.31	0.00
126	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.00
127	300796	贝斯美	620	12,604.60	0.00
128	600741	华域汽车	600	12,474.00	0.00
129	300795	米奥会展	556	11,992.92	0.00
130	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.00
131	300502	新易盛	140	8,836.80	0.00
132	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
133	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
134	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
135	603993	洛阳钼业	1,500	5,505.00	0.00
136	600612	老凤祥	100	4,819.00	0.00
137	600977	中国电影	300	3,939.00	0.00
138	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.00
139	002507	涪陵榨菜	100	3,601.00	0.00
140	300073	当升科技	100	3,307.00	0.00
141	002100	天康生物	100	1,610.00	0.00

142	688599	天合光能	64	1,075.20	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	22,032,130.69	3.48
2	002271	东方雨虹	15,811,522.36	2.50
3	600048	保利地产	15,603,401.70	2.47
4	300113	顺网科技	13,940,555.00	2.20
5	000401	冀东水泥	13,778,438.00	2.18
6	000002	万科A	11,981,777.52	1.89
7	601006	大秦铁路	11,906,348.00	1.88
8	002027	分众传媒	11,737,950.00	1.85
9	600161	天坛生物	10,045,309.13	1.59
10	000858	五粮液	8,847,812.00	1.40
11	600801	华新水泥	8,129,169.88	1.28
12	600690	海尔智家	7,522,416.15	1.19
13	002185	华天科技	7,359,392.00	1.16
14	600640	号百控股	6,927,315.00	1.09
15	603259	药明康德	6,370,684.32	1.01
16	300476	胜宏科技	5,854,567.81	0.93
17	300418	昆仑万维	5,666,170.00	0.90
18	603799	华友钴业	5,370,865.02	0.85
19	600258	首旅酒店	4,971,328.00	0.79
20	300308	中际旭创	4,651,258.32	0.73

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	000651	格力电器	15,143,970.01	2.39
2	002271	东方雨虹	14,279,698.76	2.26
3	600048	保利地产	13,238,475.92	2.09
4	002185	华天科技	10,330,481.00	1.63
5	002027	分众传媒	9,800,249.00	1.55
6	601318	中国平安	8,925,555.00	1.41
7	000858	五粮液	8,702,484.00	1.38
8	600161	天坛生物	7,922,149.62	1.25
9	603259	药明康德	7,556,196.68	1.19
10	300760	迈瑞医疗	7,192,980.56	1.14
11	600276	恒瑞医药	6,818,199.42	1.08

12	600640	号百控股	6,302,039.35	1.00
13	601006	大秦铁路	6,262,260.00	0.99
14	300476	胜宏科技	5,670,699.00	0.90
15	600872	中炬高新	5,552,329.00	0.88
16	600801	华新水泥	5,000,890.00	0.79
17	300308	中际旭创	4,892,782.00	0.77
18	300113	顺网科技	4,675,841.00	0.74
19	000596	古井贡酒	4,563,189.00	0.72
20	300394	天孚通信	4,543,322.50	0.72

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	294,406,410.58
卖出股票收入（成交）总额	257,151,255.54

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	6,570,619.30	1.05
2	央行票据	-	-
3	金融债券	28,442,736.00	4.55
	其中：政策性金融债	28,442,736.00	4.55
4	企业债券	323,868,000.00	51.79
5	企业短期融资券	11,077,300.00	1.77
6	中期票据	238,453,100.00	38.13
7	可转债（可交换债）	22,305,491.98	3.57
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	630,717,247.28	100.85

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	136611	16 电投 04	500,000	50,400,000.00	8.06
2	155862	19 中化 Y1	400,000	40,344,000.00	6.45
3	143916	17 兖煤 Y1	400,000	40,132,000.00	6.42
4	136227	16 住总 01	350,000	35,273,000.00	5.64
5	136995	16 葛洲 Y2	300,000	30,117,000.00	4.82

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

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	138387	元熹 1 优 1	200,000	20,000,000.00	3.20
2	165378	碧强 02 优	100,000	10,000,000.00	1.60

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：无。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

注：无。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**7.11.1 本期国债期货投资政策**

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。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：无。

7.11.3 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注**7.12.1 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。

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	90,427.38
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	14,412,582.38
5	应收申购款	1,182.32
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,504,192.08

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	128081	海亮转债	11,647,981.80	1.86
2	113020	桐昆转债	3,305,122.00	0.53
3	128018	时达转债	1,934,147.20	0.31
4	113549	白电转债	1,054,000.00	0.17
5	123033	金力转债	983,555.44	0.16
6	127007	湖广转债	834,694.80	0.13
7	128084	木森转债	216,701.10	0.03
8	113029	明阳转债	216,348.30	0.03
9	110062	烽火转债	182,076.60	0.03
10	110065	淮矿转债	140,275.10	0.02
11	110061	川投转债	77,556.00	0.01
12	113030	东风转债	30,514.40	0.00
13	128086	国轩转债	10,981.50	0.00

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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 (%)
736	721,978.34	500,499,000.00	94.19	30,877,059.77	5.81

8.2 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	0.1871

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

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	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 开放式基金份额变动

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
本报告期期初基金份额总额	553,049,389.92
本报告期基金总申购份额	1,662,827.96
减：本报告期基金总赎回份额	23,336,158.11
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	531,376,059.77

§ 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	
广发证券	2	186,902,321.91	34.13%	170,324.93	36.79%	-
天风证券	2	154,400,709.33	28.19%	125,265.71	27.05%	-
恒泰证券	1	143,744,504.36	26.25%	116,620.15	25.19%	-
华创证券	1	62,614,562.43	11.43%	50,799.40	10.97%	-

注：交易单元选择的标准和程序：

1) 基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其交易单元作为基金的专用交易单元，选择的标准是：

- (1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，最近二年未发生因重大违规行为而受到中国证监会处罚；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的
需要，并能为本基金提供全面的信息服务；
- (6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨
询服务。

2) 选择交易单元的程序：

我公司根据上述标准，选定符合条件的证券公司作为租用交易单元的对象。我公司投研部门定期对所选定证券公司的服务进行综合评比，评比内容包括：提供研究报告质量、数量、及时性
及提供研究服务主动性和质量等情况，并依据评比结果确定交易单元交易的具体情况。我公司在
比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向券商租用交易单元作为基金专
用交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例	成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	成交金额	占当期权 证 成交总额 的比例
广发证券	42,432,414.00	89.17%	22,330,000,000.00	85.56%	-	-
天风证券	632,581.78	1.33%	44,000,000.00	0.17%	-	-
恒泰证券	4,521,312.37	9.50%	10,000,000.00	0.04%	-	-
华创证券	-	-	3,714,600,000.00	14.23%	-	-

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部分基金参与中国农业银行股份有限公司基金申购（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04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（含定期定额申购）费率优惠活动的	《上海证券报》	2020年05月06日

	公告		
3	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国农业银行股份有限公司基金申购（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 04 日
4	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国农业银行股份有限公司基金申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《证券日报》	2020 年 01 月 04 日
5	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
6	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
7	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
8	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
9	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
10	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
11	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
12	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
13	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
14	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
15	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
16	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

17	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
18	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
19	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
20	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
21	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
22	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
23	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	《证券时报》	2020 年 03 月 28 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
26	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
27	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
28	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
29	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
30	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
31	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
32	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
33	鹏华金城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
34	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金	《证券时报》	2020 年 04 月 22 日

	2020 年第 1 季度报告提示性公告		
35	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
36	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
37	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
38	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	《上海证券报》	2020 年 04 月 28 日
39	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
40	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	《证券时报》	2020 年 05 月 06 日
41	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
42	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
43	鹏华金城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
44	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
45	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
46	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
47	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	《上海证券报》	2020 年 05 月 18 日

	公告		
48	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
49	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
50	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国农业银行股份有限公司基金申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《证券时报》	2020 年 01 月 04 日

注：无。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20200101~20200630	500,499,000.00	-	-	500,499,000.00	94.19
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
基金份额持有人持有的基金份额所占比例过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引起基金净值剧烈波动，甚至可能引发基金流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。							

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

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

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一)《鹏华金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 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