

# 鹏华安泽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 03 月 25 日（基金合同生效日）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	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	9
3.3 其他指标	10
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
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	13
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	13
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	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
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	15
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>15</b>
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	19
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>45</b>
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
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	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48

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 .....	49
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 .....	49
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 .....	49
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 .....	49
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	49
7.12 投资组合报告附注 .....	50
<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 .....	59
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>61</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 .....	61
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	62
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>62</b>
12.1 备查文件目录 .....	62
12.2 存放地点 .....	62
12.3 查阅方式 .....	62

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华安泽混合型证券投资基金	
基金简称	鹏华安泽混合	
基金主代码	009096	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 3 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	977,792,625.64 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	鹏华安泽混合 A	鹏华安泽混合 C
下属分级基金的交易代码	009096	009097
报告期末下属分级基金的份额总额	971,962,319.85 份	5,830,305.79 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，合理配置债券等固定收益类资产和权益类资产，追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>本基金采用积极主动管理的投资方法，自上而下地进行大类资产配置、债券投资和股票投资等，在严格控制风险的前提下，力争基金资产的长期稳健增值。</p> <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、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、可转债投资策略、可交换债券投资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</p>

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。

（7）可转债投资策略 1）传统可转债投资策略 传统可转债即可转换公司债券，兼具债权和股权双重属性。债权属性是指投资者可以选择持有可转债到期，得到本金与利息收益；股权属性即股票期权属性，是指投资者可以在转股期间以约定的转股价格把可转债转换成股票。因此，可转债的价格由债权价格和期权价格两部分组成。

a. 个券选择策略。一方面，本基金将对所有可转债对应的标的股票进行深入研究，采用定性分析（行业地位、竞争优势、治理结构、市场开拓、创新能力等）与定量分析（P/B、P/E、PEG、DCF、DDM、NAV 等）相结合的方式挑选成长性好且估值合理的正股；另一方面，本基金将深入研究分析可转债自身的信用评估。综上所述，本基金将结合可转债自身的信用评估和其正股的价值分析，做为选取个券的重要依据。

b. 条款价值发现策略。可转债一般均设有一些特殊条款，包括修正转股价条款、回售条款、赎回条款等，这些条款在特定环境下对可转债价值有着较大的影响。本基金将通过有效分析相关信息力争把握各项条款给可转债带来的可能的投资机会。

c. 套利策略。可转债可以按照约定的价格转换为股票，因此在日常交易运作过程中会出现可转债与标的股票之间的套利机会。当处于转股期内的可转债市价低于转股价值，即可转债的转换溢价率为负时，买入可转债的同时卖出标的股票可以获得套利价差；反之，买入标的股票的同时卖出可转债也可以获取反向套利价差。在日常交易运作中，本基金将密切关注可转债与标的股票之间价格之间的对比关系，择机实施套利策略，以增强本基金的收益。

2）分离交易可转债投资策略 本基金在对这类债券基本情况进行研究的同时，将重点分析附权部分对债券估值的影响。对于分离交易可转债的债券部分将按照债券投资策略进行管理，权证部分将在可交易之日起不超过 3 个月的时间内卖出。（8）可交换债券投资策略 可交换债券具有股性和债性，其中债性，即选择持有可交换债券至到期以获取票面价值和票面利息；而对于股性的分析则需关注目标公司的股票价值。本基金将通过对目标公司股票的投资价值分析和可交换债券的纯债部分价值分析综合开展投资决策。

3、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。本基金将重点关注行业增长前景、行业利润前景和行业成功要素等因素进行自上而下的行业遴选；同时结合对上市公司的竞争力分析、管理层分析等定性分析和对上市公司的关键估值方法（包括 PE、PEG、PB、PS、EV/EBITDA 等）等定量分析进行自下而上的个股精选。

4、国债期货投资策略 本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资

	产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。5、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，力争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。未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，本基金可相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书中更新并公告。
业绩比较基准	中债综合指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×20%
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、债券型基金，低于股票型基金。

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第 43 层

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020年3月25日(基金合同生效日)-2020年6月30日)	
	鹏华安泽混合 A	鹏华安泽混合 C
本期已实现收益	-415,238.56	-19,809.25
本期利润	-1,979,451.76	-46,527.60
加权平均基金份额本期利润	-0.0018	-0.0051
本期加权平均净值利润率	-0.18%	-0.51%
本期基金份额净值增长率	-0.13%	-0.26%
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	-1,248,826.30	-15,329.17
期末可供分配基金份额利润	-0.0013	-0.0026
期末基金资产净值	970,713,493.55	5,814,976.62
期末基金份额净值	0.9987	0.9974
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	-0.13%	-0.26%

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。

(4) 本基金基金合同于 2020 年 03 月 25 日生效，至 2020 年 06 月 30 日未满 6 个月。

### 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

鹏华安泽混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.38%	0.12%	0.95%	0.19%	-0.57%	-0.07%
过去三个月	-0.15%	0.08%	2.32%	0.20%	-2.47%	-0.12%
自基金合同生效起至	-0.13%	0.08%	2.90%	0.21%	-3.03%	-0.13%

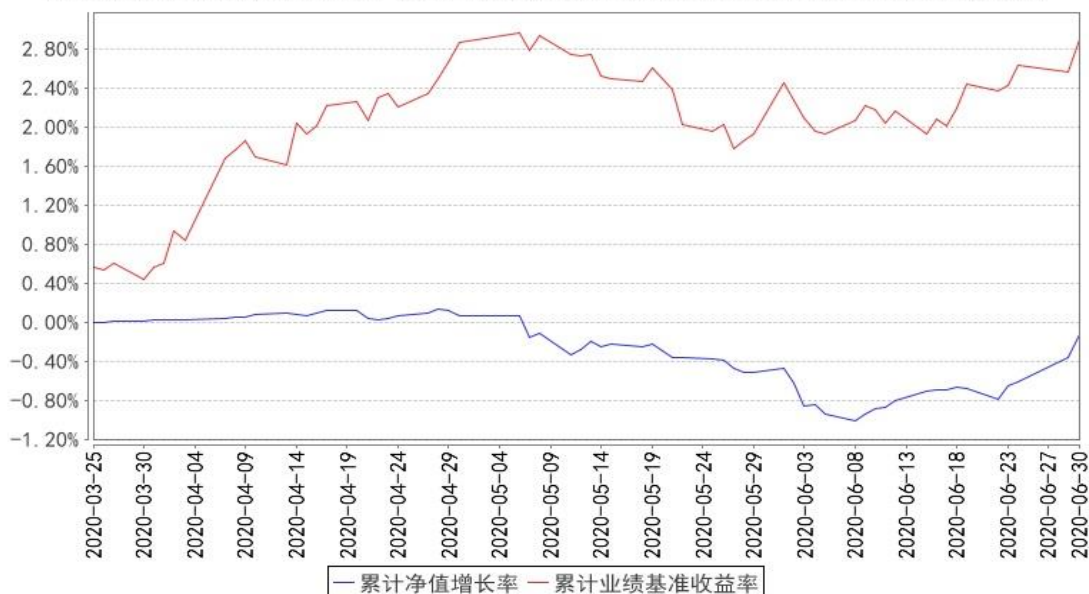
鹏华安泽混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.34%	0.12%	0.95%	0.19%	-0.61%	-0.07%
过去三个月	-0.27%	0.08%	2.32%	0.20%	-2.59%	-0.12%
自基金合同生效起至	-0.26%	0.08%	2.90%	0.21%	-3.16%	-0.13%

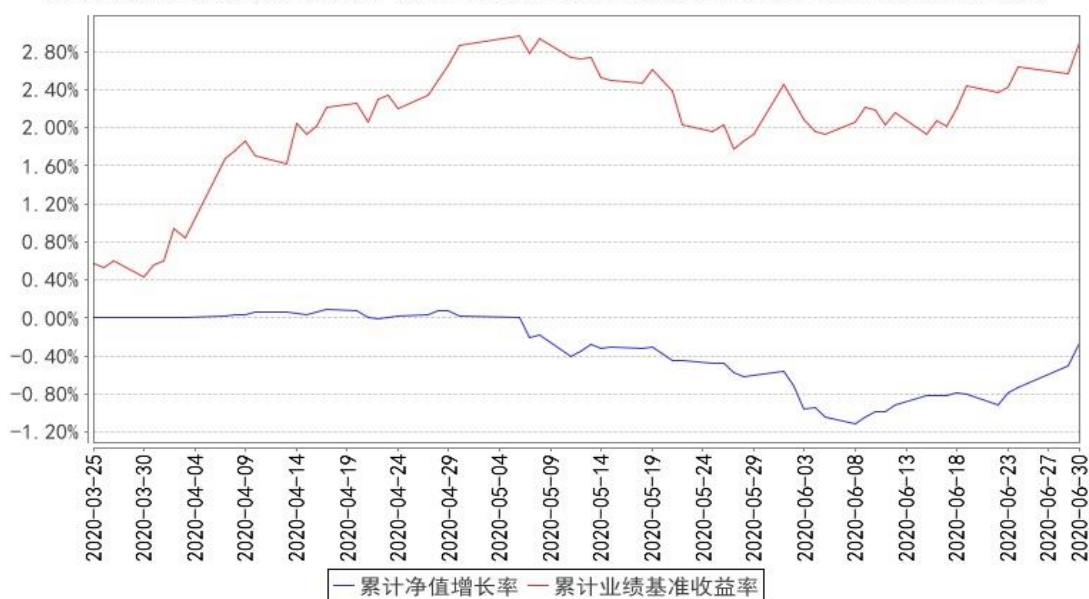
注：业绩比较基准=中债综合指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×20%

### 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

鹏华安泽混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



鹏华安泽混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2020 年 03 月 25 日生效，截至本报告期末本基金基金合同生效未滿一年。2、本基金管理人将严格按照本基金合同的约定，于本基金建仓期届满后确保各项投资比例符合基金合同的约定。

### 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		
刘太阳	本基金基金经理	2020-03-25	-	14 年	刘太阳先生，国籍中国，理学硕士，14 年证券基金从业经验。曾任中国农业银行金融市场部高级交易员，从事债券投资交易工作；2011 年 5 月加盟鹏华基金管理有限公司，从事债券研究工作，担任固定收益部研究员，现担任公募债券投资部总经理、基金经理。2012 年 09 月至 2018 年 04 月担任鹏华纯债债券基金基金经理，2012 年 12 月至 2015 年 04 月担任鹏华月月发短期理财债券基金基金经理，2013 年 04 月至 2016 年 04 月担任鹏华丰利分级债券基金基金经理，2013 年 05 月至 2018 年 12 月担任鹏华实业债基金基金经理，2015 年 03 月担任鹏华丰盛债券基金基金经理，2016 年 02 月至 2018 年 03 月担任鹏华弘盛混合基金基金经理，2016 年 04 月至 2018 年 04 月担任鹏华丰利债券（LOF）基金基金经理，2016 年 08 月担任鹏华丰收债券基金基金经理，2016 年 08 月至 2020 年 02 月担任鹏华双债保利债券基金基金经理，2016 年 08 月至 2017 年 09 月担任鹏华丰安债券基金基金经理，2016 年 08 月至 2018 年 06 月担任鹏华丰达债券基金基金经理，2016 年 09 月至 2018 年 04 月担任鹏华丰恒债券基金基金经理，2016 年 10 月至 2018 年 05 月担任鹏华丰腾债券基金基金经理，2016

				<p>年 10 月至 2018 年 05 月担任鹏华丰禄债券基金基金经理, 2016 年 11 月至 2018 年 07 月担任鹏华丰盈债券基金基金经理, 2016 年 12 月至 2018 年 05 月担任鹏华普泰债券基金基金经理, 2016 年 12 月至 2018 年 07 月担任鹏华丰惠债券基金基金经理, 2017 年 02 月至 2018 年 06 月担任鹏华安益增强混合基金基金经理, 2017 年 03 月至 2018 年 06 月担任鹏华丰享债券基金基金经理, 2017 年 03 月至 2018 年 06 月担任鹏华丰玉债券基金基金经理, 2017 年 03 月至 2017 年 12 月担任鹏华丰嘉债券基金基金经理, 2017 年 03 月至 2018 年 04 月担任鹏华丰康债券基金基金经理, 2017 年 04 月至 2018 年 05 月担任鹏华丰瑞债券基金基金经理, 2017 年 06 月至 2018 年 03 月担任鹏华丰玺债券基金基金经理, 2017 年 06 月至 2018 年 06 月担任鹏华丰源债券基金基金经理, 2018 年 10 月担任鹏华双债增利债券基金基金经理, 2018 年 12 月至 2019 年 01 月担任鹏华永诚一年定期开放债券基金基金经理, 2019 年 09 月担任鹏华丰润债券 (LOF) 基金基金经理, 2019 年 09 月担任鹏华丰华债券基金基金经理, 2019 年 09 月担任鹏华丰玉债券基金基金经理, 2019 年 09 月担任鹏华丰源债券基金基金经理, 2019 年 10 月担任鹏华丰庆债券基金基金经理, 2020 年 03 月担任鹏华安泽混合基金基金经理, 2020 年 06 月担任鹏华安惠混合基金基金经理。刘太阳先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理发生变动, 增聘刘太阳为本基金基金经理。本基金为本报告期内新成立基金。</p>
--	--	--	--	---

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

2. 证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

#### 4.1.3 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

上半年，债券市场波动较大，收益率先下后上，整体略有下行。具体来看，开年在宽裕资金面影响下，收益率延续 2019 年末下行趋势；1 月下旬开始，新冠疫情成为影响债市的核心变量，随着疫情在国内外的扩散，经济活动受到干扰，全球避险情绪升温，叠加全球主要经济体货币政策大幅宽松，推动债券收益率大幅下行，期间国内 10 年国债收益率突破 2016 年低点，创 2002 年以来新低。但 4 月底开始，在国内经济复苏背景下，央行逐步退出特殊时期货币政策，同时利率债供给放量，收益率触底回升。整体来看，上半年债券收益率总体下行。不同类型债券财富指数均有不同程度上涨，其中国债财富指数上涨 2.75%，企业债财富指数上涨 2.42%。上半年权益市场波动较大，整体上涨。沪深 300 指数上涨 1.64%，创业板指数上涨 35.6%。本报告期内基金以持有中高评级信用债为主，组合久期保持中性偏短水平，对权益市场投资进行了积极参与。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期鹏华安泽混合 A 类组合净值增长率-0.13%，鹏华安泽混合 C 类组合净值增长率-0.26%；鹏华安泽混合 A 类业绩比较基准增长率 2.90%，鹏华安泽混合 C 类业绩比较基准增长率 2.90%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，虽然 4 月份以来债券收益率出现较大幅度上行，短期内全球疫情、外需仍存在一定不确定性，叠加国内经济修复动能边际有所趋缓，债券市场或许存在交易性机会。但从中期来看，疫情对经济活动的冲击有望逐步消退，同时全球各经济体陆续出台经济刺激政策，后续国内经济增长有望逐季修复。因此，债券市场难以出现趋势性机会。

信用市场方面，受利率债收益率调整影响，信用债收益率在二季度末出现较大幅度上行，绝对收益率已经回到 2019 年年底水平。但由于二季度末债券持续下跌，部分净值型理财产品出现亏损，叠加股票市场加速上涨，债券型理财产品后续可能面临较大赎回压力，信用债的信用利差难以大幅压缩，投资上仍须控制久期风险。

权益方面，随着国内经济活动逐步恢复正轨，宽信用政策效果逐步显现，我们预计权益市场有望继续上涨，但另一方面，我们也须清醒的认识到，目前国内经济增长仍存在一定隐患，全球疫情仍有反复，同时权益市场近期已出现较大幅度上涨，后期股票市场波动可能加大，投资上须进一步加强灵活性，要及时根据政策变化及市场情况适当调整仓位及结构。

综合而言，我们对债券市场持谨慎观点，虽然后期可能参与债券市场交易性机会，但组合整体维持中性略短久期，品种仍以中高评级信用债为主。对于权益市场，我们认为权益市场仍具有较大投资机会，组合将继续参与权益投资，力争为投资者创造更高收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

###### (1) 日常估值流程

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

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

###### (2) 特殊业务估值流程

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

##### 2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理不参与或决定基金日常估值。

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

3、本公司参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4. 定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1、截止本报告期末，鹏华安泽混合 A 期末可供分配利润为-1,248,826.30 元，期末基金份额净值 0.9987 元，不符合利润分配条件；鹏华安泽混合 C 期末可供分配利润为-15,329.17 元，期末基金份额净值 0.9974 元，不符合利润分配条件。

2、本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 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：鹏华安泽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
<b>资产:</b>		
银行存款	6.4.7.1	20,265,900.28
结算备付金		8,022,183.02
存出保证金		82,721.22
交易性金融资产	6.4.7.2	1,224,563,477.94
其中: 股票投资		59,566,260.20
基金投资		-
债券投资		1,134,997,217.74
资产支持证券投资		30,000,000.00
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		17,074,428.52
应收利息	6.4.7.5	9,843,214.17
应收股利		-
应收申购款		20,023.58
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		1,279,871,948.73
<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>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		295,247,122.43
应付证券清算款		-
应付赎回款		6,773,184.18
应付管理人报酬		498,977.37
应付托管费		166,325.80
应付销售服务费		2,789.40
应付交易费用	6.4.7.7	426,556.92
应交税费		110,034.69
应付利息		61,943.47
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	56,544.30
负债合计		303,343,478.56
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	6.4.7.9	977,792,625.64
未分配利润	6.4.7.10	-1,264,155.47



所有者权益合计		976,528,470.17
负债和所有者权益总计		1,279,871,948.73

注：(1) 报告截止日 2020 年 06 月 30 日，基金份额总额 977,792,625.64 份，其中鹏华安泽混合 A 基金份额总额 971,962,319.85 份，基金份额净值 0.9987 元；鹏华安泽混合 C 基金份额总额 5,830,305.79 份，基金份额净值 0.9974 元。

(2) 本基金基金合同于 2020 年 03 月 25 日生效，无上年度可比较期间及可比较数据。

## 6.2 利润表

会计主体：鹏华安泽混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2020 年 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		1,690,767.94
1. 利息收入		8,748,109.53
其中：存款利息收入	6.4.7.11	645,223.66
债券利息收入		7,154,435.48
资产支持证券利息收入		193,161.77
买入返售金融资产收入		755,288.62
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-6,277,150.73
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-1,381,863.55
基金投资收益	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-5,035,516.11
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	140,228.93
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-1,590,931.55
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	810,740.69
减：二、费用		3,716,747.30
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,766,256.88
2. 托管费	6.4.10.2.2	588,752.34
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	11,996.95
4. 交易费用	6.4.7.19	663,371.28
5. 利息支出		614,364.04

其中：卖出回购金融资产支出		614,364.04
6. 税金及附加		23,379.60
7. 其他费用	6.4.7.20	48,626.21
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-2,025,979.36
减：所得税费用		-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-2,025,979.36

注：本财务报表的实际编制期间为 2020 年 03 月 25 日（基金合同生效日）至 2020 年 06 月 30 日止期间，无上年度可比期间及可比较数据。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鹏华安泽混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 3 月 25 日（基金合同生效日）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)	1,207,512,904.43	-	1,207,512,904.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-2,025,979.36	-2,025,979.36
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)	-229,720,278.79	761,823.89	-228,958,454.90
其中：1. 基金申购款	6,928,835.43	-21,184.63	6,907,650.80
2. 基金赎回款	-236,649,114.22	783,008.52	-235,866,105.70
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)	977,792,625.64	-1,264,155.47	976,528,470.17

注：本财务报表的实际编制期间为 2020 年 03 月 25 日（基金合同生效日）至 2020 年 06 月 30 日止期间，无上年度可比期间及可比较数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

鹏华安泽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[2020]333号《关于准予鹏华安泽混合型证券投资基金注册的批复》核准,由鹏华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华安泽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1,206,743,376.37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(2020)第0231号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华安泽混合型证券投资基金基金合同》于2020年3月25日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,207,512,904.43份基金份额,其中认购资金利息折合769,528.06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《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华安泽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(包括主板、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、地方政府债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券(含分离交易可转债的纯债部分)、可交换债券、次级债等)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、国债期货,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的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的0%-30%;每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,基金保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例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:中债综合指数收益率 $\times$ 80%+沪深300指数收益率 $\times$ 20%。

### 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》、《鹏华安泽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 03 月 25 日(基金合同生效日)至 2020 年 06 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2020 年 06 月 30 日的财务状况以及 2020 年 03 月 25 日(基金合同生效日)至 2020 年 06 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2020 年 3 月 25 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

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

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

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

###### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金

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

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 6.4.4.7 实收基金

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

#### 6.4.4.8 损益平准金

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

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类/级别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

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

#### 6.4.4.13 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股

票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

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

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

##### 6.4.5.3 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	20,265,900.28
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	20,265,900.28

### 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	54,337,677.73	59,566,260.20	5,228,582.47	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	514,423,597.67	511,346,317.74	-3,077,279.93
	银行间市场	627,393,134.09	623,650,900.00	-3,742,234.09
	合计	1,141,816,731.76	1,134,997,217.74	-6,819,514.02
资产支持证券	30,000,000.00	30,000,000.00	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	1,226,154,409.49	1,224,563,477.94	-1,590,931.55	

### 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	5,808.76
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	3,610.00
应收债券利息	9,634,801.50
应收资产支持证券利息	198,956.71
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	37.20
合计	9,843,214.17

#### 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	411,245.27
银行间市场应付交易费用	15,311.65
合计	426,556.92

#### 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	21,792.52
应付证券出借违约金	-
预提费用	34,751.78
合计	56,544.30

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

##### 鹏华安泽混合 A

项目	本期 2020 年 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	1,196,872,844.79	1,196,872,844.79
本期申购	6,062,820.14	6,062,820.14
本期赎回（以“-”号填列）	-230,973,345.08	-230,973,345.08
-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	971,962,319.85	971,962,319.85

## 鹏华安泽混合 C

项目	本期 2020年3月25日（基金合同生效日）至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	10,640,059.64	10,640,059.64
本期申购	866,015.29	866,015.29
本期赎回（以“-”号填列）	-5,675,769.14	-5,675,769.14
-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	5,830,305.79	5,830,305.79

注：1. 申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

2. 本基金自2020年3月9日至2020年3月20日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币1,206,743,376.37元。根据《鹏华安泽混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币769,528.06元在本基金成立后，折算为769,528.06份基金份额，划入基金份额持有人账户。

## 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

鹏华安泽混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-415,238.56	-1,564,213.20	-1,979,451.76
本期基金份额交易产生的变动数	216,548.21	514,077.25	730,625.46
其中：基金申购款	-15,898.90	-1,528.24	-17,427.14
基金赎回款	232,447.11	515,605.49	748,052.60
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-198,690.35	-1,050,135.95	-1,248,826.30
鹏华安泽混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效	-	-	-

日			
本期利润	-19,809.25	-26,718.35	-46,527.60
本期基金份额交易产生的变动数	10,804.26	20,394.17	31,198.43
其中：基金申购款	-1,615.26	-2,142.23	-3,757.49
基金赎回款	12,419.52	22,536.40	34,955.92
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-9,004.99	-6,324.18	-15,329.17

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2020年3月25日（基金合同生效日）至2020年6月30日	
活期存款利息收入		289,512.96
定期存款利息收入		306,666.67
其他存款利息收入		-
结算备付金利息收入		48,792.99
其他		251.04
合计		645,223.66

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3月25日（基金合同生效日）至2020年6月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入		-1,381,863.55
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		-1,381,863.55

##### 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3月25日（基金合同生效日）至2020年6月30日	

卖出股票成交总额	197,915,165.18
减：卖出股票成本总额	199,297,028.73
买卖股票差价收入	-1,381,863.55

#### 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3月25日（基金合同生效日）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	-5,035,516.11
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	-5,035,516.11

##### 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3月25日（基金合同生效日）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	524,725,491.31
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	524,289,792.53
减：应收利息总额	5,471,214.89
买卖债券差价收入	-5,035,516.11

##### 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3月25日（基金合同生效日）至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	140,228.93
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	140,228.93

**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 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-1,590,931.55
股票投资	5,228,582.47
债券投资	-6,819,514.02
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	-1,590,931.55

## 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	800,460.98
基金转换费收入	10,279.71
合计	810,740.69

## 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	650,848.78
银行间市场交易费用	12,522.50
合计	663,371.28

## 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
审计费用	34,751.78
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行汇划费用	13,774.43
其他	100.00
合计	48,626.21



#### 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（“中国建设银行”）	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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金基金合同于 2020 年 03 月 25 日生效，截至本报告期末不满一年，无上年度可比期间数据。

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
国信证券	101,706,941.82	22.54

###### 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 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
-------	---

	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)
国信证券	81,483,556.92	43.97

#### 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3月25日（基金合同生效日）至2020年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)
国信证券	331,100,000.00	3.15

#### 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3月25日（基金合同生效日）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	92,685.34	22.54	92,685.34	22.54

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3月25日（基金合同生效日）至2020年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费
其中：支付销售机构的客户维护费	1,375,800.45

注：1、支付基金管理人鹏华基金管理有限公司的管理人报酬年费率为 0.60%，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。

3、本基金合同生效日起至本报告期末未满一年，故无上年度可比期间数据。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	588,752.34

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费年费率为 0.20%，逐日计提，按月支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.20%÷当年天数。

#### 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 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鹏华安泽混合 A	鹏华安泽混合 C	合计
鹏华基金公司	-	232.37	232.37
中国建设银行	-	198.44	198.44
合计	-	430.81	430.81

注：1、支付基金销售机构的 C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.50%，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×0.50%÷当年天数。

2、本基金合同生效日起至本报告期末未满一年，故无上年度可比期间数据。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

#### 6.4.10.4 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固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：1、本基金本报告期除基金管理人之外的其他关联方未投资、持有本基金。

2、本基金合同生效日起至本报告期末未满一年，故无上年度可比期间数据。

#### 6.4.10.6 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3月25日（基金合同生效日）至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	20,265,900.28	289,512.96

#### 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	-

#### 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

截至本报告期末 2020 年 06 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 105,047,122.43 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
1480557	14 鹤城投债	2020 年 7 月 1 日	40.44	250,000	10,110,000.00
011902589	19 冀中能源 SCP014	2020 年 7 月 7 日	100.29	192,000	19,255,680.00
041900280	19 冀中能源 CP009	2020 年 7 月 7 日	100.61	400,000	40,244,000.00
041900482	19 冀中能源 CP010	2020 年 7 月 7 日	99.75	100,000	9,975,000.00
042000158	20 国宏投资 CP001	2020 年 7 月 7 日	99.86	300,000	29,958,000.00
102000907	20 泰安城乡 MTN001	2020 年 7 月 7 日	98.27	38,000	3,734,260.00
合计				1,280,000	113,276,940.00

#### 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 190,200,000.00 元，于 2020 年 07 月 01 日（先后）到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 6.4.12.4 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、债券投资及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具等。

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，将风险控制在此可承受的范围内。

##### 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 113.25%。

#### 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
A-1	234,399,500.00
A-1 以下	171,380,300.00
未评级	38,759,173.00
合计	444,538,973.00

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
A-1	-
A-1 以下	30,000,000.00
未评级	-
合计	30,000,000.00

注：A-1 以下包含发行期限小于 1 年的资产支持证券。

#### 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
AAA	310,615,500.00

AAA 以下	359,540,744.74
未评级	20,302,000.00
合计	690,458,244.74

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 295,247,122.43 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、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股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
<b>资产</b>					
银行存款	20,265,900.28	-	-	-	20,265,900.28
结算备付金	8,022,183.02	-	-	-	8,022,183.02
存出保证金	82,721.22	-	-	-	82,721.22
交易性金融资产	519,898,973.00	612,207,600.00	32,890,644.74	59,566,260.20	1,224,563,477.94
应收利息	-	-	-	9,843,214.17	9,843,214.17
应收申购款	-	-	-	20,023.58	20,023.58
应收证券清算款	-	-	-	17,074,428.52	17,074,428.52
<b>资产总计</b>	<b>548,269,777.52</b>	<b>612,207,600.00</b>	<b>32,890,644.74</b>	<b>86,503,926.47</b>	<b>1,279,871,948.73</b>
<b>负债</b>					
应付赎回款	-	-	-	6,773,184.18	6,773,184.18
应付管理人报酬	-	-	-	498,977.37	498,977.37
应付托管费	-	-	-	166,325.80	166,325.80
卖出回购金融资产款	295,247,122.43	-	-	-	295,247,122.43
应付销售服务费	-	-	-	2,789.40	2,789.40
应付交易费用	-	-	-	426,556.92	426,556.92
应付利息	-	-	-	61,943.47	61,943.47
应交税费	-	-	-	110,034.69	110,034.69
其他负债	-	-	-	56,544.30	56,544.30
<b>负债总计</b>	<b>295,247,122.43</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>8,096,356.13</b>	<b>303,343,478.56</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>253,022,655.09</b>	<b>612,207,600.00</b>	<b>32,890,644.74</b>	<b>78,407,570.34</b>	<b>976,528,470.17</b>

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约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）
分析	市场利率下降 25 个基点	4,247,215.37
	市场利率上升 25 个基点	-4,215,055.67

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。

本基金对股票资产的投资比例为 0%-30%；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例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	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	59,566,260.20	6.10
交易性金融资产—基金投资	—	—
交易性金融资产—债券投资	32,890,644.74	3.37
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	92,456,904.94	9.47

注：债券投资为可转换债券、可交换债券投资。

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：于 2020 年 6 月 30 日，由于本基金运行期间不足一年，尚不存在足够的经验数据，因此，无法对本基金资产净值对于市场价格风险的敏感性作定量分析。

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

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	59,566,260.20	4.65
	其中：股票	59,566,260.20	4.65
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,164,997,217.74	91.02
	其中：债券	1,134,997,217.74	88.68
	资产支持证券	30,000,000.00	2.34
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	28,288,083.30	2.21
8	其他各项资产	27,020,387.49	2.11
9	合计	1,279,871,948.73	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	42,396,380.31	4.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,185,513.57	1.56
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,014,000.00	0.10
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	957,600.00	0.10
S	综合	-	-
	合计	59,566,260.20	6.10

### 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	000725	京东方A	1,397,900	6,528,193.00	0.67
2	002555	三七互娱	67,400	3,154,320.00	0.32
3	300558	贝达药业	20,200	2,827,596.00	0.29
4	300373	扬杰科技	81,100	2,718,472.00	0.28
5	002475	立讯精密	49,899	2,562,313.65	0.26
6	600529	山东药玻	42,366	2,457,228.00	0.25
7	300476	胜宏科技	100,900	2,426,645.00	0.25
8	300737	科顺股份	110,000	2,170,300.00	0.22
9	600570	恒生电子	18,460	1,988,142.00	0.20
10	603658	安图生物	11,900	1,933,036.00	0.20
11	600588	用友网络	43,100	1,900,710.00	0.19
12	300315	掌趣科技	250,000	1,832,500.00	0.19
13	002371	北方华创	9,800	1,674,918.00	0.17
14	600176	中国巨石	177,700	1,625,955.00	0.17
15	600845	宝信软件	27,500	1,624,700.00	0.17
16	600801	华新水泥	66,600	1,579,086.00	0.16
17	600585	海螺水泥	28,100	1,486,771.00	0.15
18	300496	中科创达	17,000	1,320,900.00	0.14
19	300142	沃森生物	25,000	1,309,000.00	0.13
20	300122	智飞生物	13,000	1,301,950.00	0.13
21	300248	新开普	100,000	1,236,000.00	0.13
22	300760	迈瑞医疗	3,800	1,161,660.00	0.12
23	300674	宇信科技	26,000	1,121,900.00	0.11
24	000977	浪潮信息	28,600	1,120,548.00	0.11
25	600276	恒瑞医药	12,000	1,107,600.00	0.11
26	300078	思创医惠	80,000	1,082,400.00	0.11
27	300394	天孚通信	18,000	1,071,900.00	0.11
28	300628	亿联网络	15,200	1,037,552.00	0.11
29	002791	坚朗五金	11,000	1,034,990.00	0.11
30	300058	蓝色光标	130,000	1,014,000.00	0.10

31	300308	中际旭创	16,000	1,008,000.00	0.10
32	000063	中兴通讯	25,000	1,003,250.00	0.10
33	603881	数据港	9,200	994,244.00	0.10
34	300182	捷成股份	240,000	957,600.00	0.10
35	603087	甘李药业	1,076	107,922.80	0.01
36	605166	聚合顺	1,641	26,009.85	0.00
37	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.00
38	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.00
39	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
40	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
41	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
42	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末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	600837	海通证券	13,077,017.06	1.34
2	601319	中国人保	12,792,264.19	1.31
3	601601	中国太保	12,716,440.55	1.30
4	600048	保利地产	12,672,385.00	1.30
5	601398	工商银行	12,035,500.00	1.23
6	601318	中国平安	11,854,541.63	1.21
7	601818	光大银行	11,658,392.00	1.19
8	601628	中国人寿	11,294,010.00	1.16
9	601688	华泰证券	10,947,820.00	1.12
10	000002	万科A	10,609,975.00	1.09
11	601328	交通银行	10,360,000.00	1.06
12	600036	招商银行	9,887,229.40	1.01
13	600588	用友网络	7,720,491.93	0.79
14	600529	山东药玻	7,656,092.88	0.78
15	600801	华新水泥	7,637,349.17	0.78
16	000725	京东方A	7,543,833.00	0.77
17	600585	海螺水泥	7,423,815.00	0.76
18	300737	科顺股份	6,287,929.53	0.64
19	300601	康泰生物	6,076,100.00	0.62
20	603658	安图生物	5,389,537.00	0.55

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末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
----	------	------	----------	----------------

1	600048	保利地产	12,871,700.00	1.32
2	600837	海通证券	12,850,832.16	1.32
3	601601	中国太保	12,750,470.08	1.31
4	601319	中国人保	12,574,003.48	1.29
5	601398	工商银行	12,033,436.15	1.23
6	601318	中国平安	11,961,351.70	1.22
7	601818	光大银行	11,626,071.00	1.19
8	601628	中国人寿	11,140,223.50	1.14
9	601688	华泰证券	10,683,203.47	1.09
10	000002	万科A	10,406,170.46	1.07
11	601328	交通银行	10,280,000.00	1.05
12	600036	招商银行	9,774,071.12	1.00
13	600529	山东药玻	6,796,899.00	0.70
14	600588	用友网络	6,337,810.84	0.65
15	300601	康泰生物	5,819,422.00	0.60
16	600585	海螺水泥	5,653,460.82	0.58
17	600801	华新水泥	5,436,562.40	0.56
18	603658	安图生物	3,966,628.00	0.41
19	300737	科顺股份	3,908,315.00	0.40
20	300122	智飞生物	3,835,351.00	0.39

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	253,634,706.46
卖出股票收入（成交）总额	197,915,165.18

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	7,749,873.00	0.79
2	央行票据	-	-
3	金融债券	80,816,300.00	8.28
	其中：政策性金融债	51,311,300.00	5.25
4	企业债券	436,739,500.00	44.72
5	企业短期融资券	405,779,800.00	41.55
6	中期票据	171,021,100.00	17.51
7	可转债（可交换债）	32,890,644.74	3.37
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-



10	合计	1,134,997,217.74	116.23
----	----	------------------	--------

## 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	163400	20 晶电 01	600,000	59,526,000.00	6.10
2	012000951	20 绵阳科发 SCP001	500,000	50,300,000.00	5.15
3	102000959	20 孝感城投 MTN001	500,000	49,735,000.00	5.09
4	042000229	20 碧水源 CP002	500,000	49,540,000.00	5.07
5	152473	20 西咸 03	500,000	49,120,000.00	5.03

## 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	138587	睿思 01A	300,000	30,000,000.00	3.07

## 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

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	82,721.22
2	应收证券清算款	17,074,428.52
3	应收股利	-
4	应收利息	9,843,214.17
5	应收申购款	20,023.58
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	27,020,387.49

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)

鹏华安泽混合 A	5,015	193,811.03	50,769,931.75	5.22	921,192,388.10	94.78
鹏华安泽混合 C	1,445	4,034.81	-	-	5,830,305.79	100.00
合计	6,460	151,361.09	50,769,931.75	5.19	927,022,693.89	94.81

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	鹏华安泽混合 A	-	-
	鹏华安泽混合 C	50,025.00	0.8580
	合计	50,025.00	0.0051

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	鹏华安泽混合 A	鹏华安泽混合 C
基金合同生效日 (2020年3月25日) 基金份额总额	1,196,872,844.79	10,640,059.64
基金合同生效日起至 报告期期末基金总申 购份额	6,062,820.14	866,015.29

减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	230,973,345.08	5,675,769.14
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	971,962,319.85	5,830,305.79

## § 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

本基金管理人聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金审计的会计师事务所。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	

华西证券	1	215,644,218.83	47.79%	196,512.30	47.78%	本报告期内新增
中信证券	2	122,180,288.11	27.08%	111,343.42	27.07%	本报告期内新增
国信证券	2	101,706,941.82	22.54%	92,685.34	22.54%	本报告期内新增
中信建投	2	10,140,926.00	2.25%	9,241.53	2.25%	本报告期内新增
广州证券	1	1,570,583.86	0.35%	1,462.68	0.36%	本报告期内新增
安信证券	2	-	-	-	-	本报告期内新增
长城证券	1	-	-	-	-	本报告期内新增
长江证券	1	-	-	-	-	本报告期内

						内新增
东方财富证券	2	-	-	-	-	本报告期内新增
东方证券	1	-	-	-	-	本报告期内新增
东海证券	1	-	-	-	-	本报告期内新增
东莞证券	2	-	-	-	-	本报告期内新增
方正证券	2	-	-	-	-	本报告期内新增
光大证券	1	-	-	-	-	本报告期内新增
广发证券	1	-	-	-	-	本报告期内新增

国金证券	1	-	-	-	-	本报告期内新增
国联证券	1	-	-	-	-	本报告期内新增
国泰君安	2	-	-	-	-	本报告期内新增
海通证券	2	-	-	-	-	本报告期内新增
华创证券	1	-	-	-	-	本报告期内新增
华融证券	1	-	-	-	-	本报告期内新增
平安证券	2	-	-	-	-	本报告期内新增
瑞信方正	1	-	-	-	-	本报告期内新增

						内新增
瑞银证券	1	-	-	-	-	本报告期内新增
上海证券	1	-	-	-	-	本报告期内新增
申万宏源	2	-	-	-	-	本报告期内新增
天风证券	1	-	-	-	-	本报告期内新增
西部证券	1	-	-	-	-	本报告期内新增
湘财证券	1	-	-	-	-	本报告期内新增
新时代证券	1	-	-	-	-	本报告期内新增



兴业证券	1	-	-	-	-	本报告期内新增
银河证券	1	-	-	-	-	本报告期内新增
招商证券	1	-	-	-	-	本报告期内新增
中航证券	2	-	-	-	-	本报告期内新增
中金财富	2	-	-	-	-	本报告期内新增
中金公司	2	-	-	-	-	本报告期内新增
中泰证券	2	-	-	-	-	本报告期内新增

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
华西证券	8,186,667.00	4.42%	5,203,900,000.00	49.58%	-	-
中信证券	95,632,800.00	51.61%	3,760,000,000.00	35.82%	-	-
国信证券	81,483,556.92	43.97%	331,100,000.00	3.15%	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	1,202,000,000.00	11.45%	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东方财富 证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-

东莞证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
瑞信方正	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
新时代证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-

### 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	鹏华安泽混合型证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告	《上海证券报》	2020年03月04日
2	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
3	鹏华基金管理有限公司关于增加东莞农村商业银行股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《上海证券报》	2020年03月10日
4	鹏华基金管理有限公司关于增加中信银行股份有限公司为旗下部分基金销	《上海证券报》	2020年03月12日

	售机构的公告		
5	鹏华安泽混合型证券投资基金基金合同生效公告	《上海证券报》	2020 年 03 月 26 日
6	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
7	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
8	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
9	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
10	鹏华基金管理有限公司关于增加上海万得基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《证券时报》	2020 年 04 月 22 日
11	鹏华基金管理有限公司关于增加上海万得基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《上海证券报》	2020 年 04 月 22 日
12	鹏华基金管理有限公司关于增加上海万得基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《证券日报》	2020 年 04 月 22 日
13	鹏华基金管理有限公司关于增加上海万得基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》	2020 年 04 月 22 日
14	鹏华安泽混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告	《上海证券报》	2020 年 04 月 23 日
15	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告	《上海证券报》	2020 年 04 月 28 日
16	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
17	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
18	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

19	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
20	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
21	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
22	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
23	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
24	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
25	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
26	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
27	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2020 年 06 月 03 日
28	鹏华安泽混合型证券投资基金份额发售公告	《上海证券报》	2020 年 03 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

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)《鹏华安泽混合型证券投资基金基金合同》；
- (二)《鹏华安泽混合型证券投资基金托管协议》；
- (三)《鹏华安泽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