

鹏华兴安定期开放灵活配置混合型证券投资
基金
2020 年第 4 季度报告

2020 年 12 月 31 日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 1 月 22 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 01 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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 10 月 01 日起至 2020 年 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	鹏华兴安定期开放混合
基金主代码	003186
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 9 月 27 日
报告期末基金份额总额	537,532,602.13 份
投资目标	在有效控制风险的基础上，通过定期开放的形式保持适度流动性，力求取得超越基金业绩比较基准的收益。
投资策略	1、资产配置策略 本基金将通过跟踪考量通常的宏观经济变量（包括 GDP 增长率、CPI 走势、M2 的绝对水平和增长率、利率水平与走势等）以及各项国家政策（包括财政、税收、货币、汇率政策等），并结合美林时钟等科学严谨的资产配置模型，动态评估不同资产大类在不同时期的投资价值及其风险收益特征，在股票、债券和货币等资产间进行大类资产的灵活配置。 2、股票投资策略 本基金通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘优质的上市公司，严选其中安全边际较高的个股构建投资组合：自上而下地分析行业的增长前景、行业结构、商业模式、竞争要素等分析把握其投资机会；自下而上地评判企业的产品、核心竞争力、管理层、治理结构等；并结合企业基本面和估值水平进行综合的研判，严选安全边际较高的个股，力争实现组合的绝对收益。（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。（2）自下而上的个股选择 本基金主要从两方面进行自下而上的个股选择：一方面是竞争力分析，通过对公司竞争策略和核心竞争力的分析，选择具有可持续竞争优势的上市公司或未来具有广阔成长空间的公司。就公司竞争策略，基于行业分析的结果判断策略的有效性、策略的实施支持和策略的执行成果；就核心竞争力，分析公司的现有核心竞争力，并判断公司能否利用现有的资源、能力和定位取得可持续竞争优势。另一方面是管理层分析，在国内监管体系落后、公司治理结构不完善的基础上，上市公司的命运对管理团队的依赖度大大增加。本基金将着重考察公司的管理层以及管理制度。（3）综合研判 本基金在自上而下和自下而上的基础上，结合估值分析，严选安全边际较高的个股，力争实现组合的绝对收益。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。（4）存托凭证投资策略 本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。

3、债券投资策略 本基金债券投资将采取久期策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、个券选择策略、信用策略、中小企业私募债投资策略等积极投资策略，灵活地调整组合的券种搭配，精选安全边际较高的个券，力争实现组合的绝对收益。（1）久期策略 久期管理是债券投资的重要考量因素，本基金将采用以“目标久期”为中心、自上而下的组合久期管理策略。（2）收益率曲线策略 收益率曲线的形状变化是判断市场整体走向的一个重要依据，本基金将据此调整组合长、中、短期债券的搭配，并进行动态调整。（3）骑乘策略 本基金将采用基于收益率曲线分析对债券组合进行适时调整的骑乘策略，以达到增强组合的持有期收益的目的。（4）息差策略 本基金将采用息差策略，以达到更好地利用杠杆放大债券投资的收益的目的。（5）个券选择策略 本基金将根据单个债券到期收益率相对于市场收益率曲线的偏离程度，结合信用等级、流动性、选择权条款、税赋特点等因素，确定其投资价值，选择定价合理或价值被低估的债券进行投资。（6）信用策略 本基金通过主动承担适度的信用风险来获取信用溢价，根据内、外部信用评级结果，结合对类似债券信用利差的分析以及对未来信用利差走势的判断，选择信用利差被高估、未来信用利差可能下降的信用债进行投资。（7）中小企业私募债投资策略 本基金将深入研究发行人资信及公司运营情况，与中小企业私募债券承销券商紧密合作，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，力求规避可能存在的债券违约，并获取超额收益。（8）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。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×30%+中证全债指数收益率×70%
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。
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	平安银行股份有限公司

注：无。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2020 年 10 月 1 日-2020 年 12 月 31 日）
1. 本期已实现收益	11,723,096.12
2. 本期利润	44,946,653.57
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0836
4. 期末基金资产净值	777,987,011.58
5. 期末基金份额净值	1.4473

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。

3.2 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

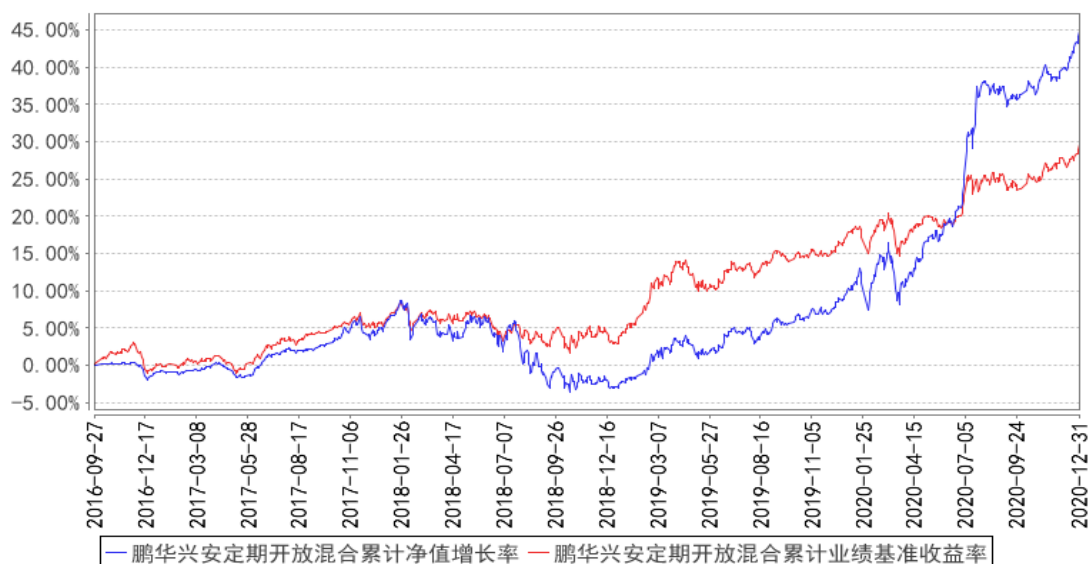
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	6.13%	0.29%	4.91%	0.30%	1.22%	-0.01%
过去六个月	18.87%	0.54%	7.62%	0.40%	11.25%	0.14%
过去一年	31.66%	0.61%	10.38%	0.41%	21.28%	0.20%
过去三年	37.63%	0.52%	22.84%	0.39%	14.79%	0.13%
自基金合同	44.73%	0.45%	29.69%	0.35%	15.04%	0.10%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

注：业绩比较基准=沪深 300 指数收益率×30%+中证全债指数收益率×70%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

鹏华兴安定期开放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 2016 年 09 月 27 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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李韵怡	本基金基金经理	2016-09-27	-	13 年	李韵怡女士，国籍中国，经济学硕士，13 年证券基金从业经验。曾任职于广州证券股份有限公司投资管理总部，先后担任研究员、交易员和投资经理等职务，从事新股及可转债申购、定增项目等工作；2015 年 6 月加盟鹏华基金管理有限公司，从事投研工作，现担任稳定收益投资部总经理助理/基金经理。2015 年 07 月至 2017 年 01 月担任鹏华弘锐混合基金基金经理，2015 年 07 月担任鹏华弘益混合基金基金

					<p>经理，2015 年 07 月至 2017 年 02 月担任鹏华弘信混合基金基金经理，2015 年 07 月担任鹏华弘实混合基金基金经理，2015 年 07 月至 2017 年 03 月担任鹏华弘华混合基金基金经理，2015 年 07 月至 2017 年 01 月担任鹏华弘和混合基金基金经理，2015 年 07 月担任鹏华弘鑫混合基金基金经理，2016 年 06 月至 2018 年 07 月担任鹏华兴泽定期开放混合基金基金经理，2016 年 09 月至 2020 年 05 月担任鹏华兴润定期开放混合基金基金经理，2016 年 09 月至 2020 年 05 月担任鹏华兴安定期开放混合基金基金经理，2016 年 09 月担任鹏华兴安定期开放混合基金基金经理，2016 年 09 月至 2018 年 06 月担任鹏华兴实定期开放混合基金基金经理，2016 年 12 月至 2018 年 07 月担任鹏华弘樽混合基金基金经理，2017 年 01 月担任鹏华兴惠定期开放混合基金基金经理，2019 年 06 月担任鹏华科创 3 年封闭混合基金基金经理，2019 年 11 月担任鹏华金亨混合基金基金经理，2020 年 04 月担任鹏华鑫享稳健混合基金基金经理。李韵怡女士具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理未发生变动。</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。

4.1.1 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 公平交易专项说明

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2020 年四季度，权益市场震荡上行，板块表现分化，新能源、白酒等板块表现较强。债券市场在 10-11 月延续下跌趋势，12 月后，信用债市场逐步回暖。

具体操作方面，该基金始终坚持在控制回撤的前提下，追求稳定收益。债券配置品种以收益相对稳定的中短期品种为主，维持了一定的杠杆比例。股票方面，以消费、医药和新能源等板块为主要配置方向。同时，积极参与新股、可转债、可交换债的网下申购获取增强收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

鹏华兴安定期开放混合组合净值增长率 6.13%; 鹏华兴安定期开放混合业绩比较基准增长率 4.91%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	176,563,279.21	17.30
	其中：股票	176,563,279.21	17.30
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	817,856,949.00	80.14
	其中：债券	817,856,949.00	80.14
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-

	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	14,980,824.40	1.47
8	其他资产	11,174,835.11	1.09
9	合计	1,020,575,887.72	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	117,338,362.19	15.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,832,000.00	0.49
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	3,559,622.72	0.46
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	647,774.03	0.08
J	金融业	16,520,267.21	2.12
K	房地产业	4,879,000.00	0.63
L	租赁和商务服务业	14,348,460.00	1.84
M	科学研究和技术服务业	7,178,959.36	0.92
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	8,258,833.70	1.06
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	176,563,279.21	22.69

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	601888	中国中免	50,800	14,348,460.00	1.84
2	601318	中国平安	135,800	11,811,884.00	1.52
3	601012	隆基股份	115,000	10,603,000.00	1.36

4	000333	美的集团	100,000	9,844,000.00	1.27
5	300750	宁德时代	28,000	9,831,080.00	1.26
6	000661	长春高新	19,500	8,753,745.00	1.13
7	600031	三一重工	250,000	8,745,000.00	1.12
8	002475	立讯精密	129,880	7,288,865.60	0.94
9	603259	药明康德	53,288	7,178,959.36	0.92
10	002311	海大集团	101,336	6,637,508.00	0.85

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	369,135,000.00	47.45
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	448,652,000.00	57.67
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	69,949.00	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	817,856,949.00	105.12

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	112901	19 申证 05	400,000	40,316,000.00	5.18
2	136678	16 穗建 03	400,000	40,276,000.00	5.18
3	175062	20 光证 G5	400,000	40,232,000.00	5.17
4	155543	19 华电 04	400,000	40,164,000.00	5.16
5	175292	20 招证 G6	400,000	40,096,000.00	5.15

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

注：无。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

注：无。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注

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

中信建投

关于对中信建投证券股份有限公司采取责令改正措施的决定，具体如下：

中信建投证券股份有限公司：

经查，你公司发布的某研究报告存在以下问题：一是研究依据不充分，研究报告参考资料为电子平台个人账户上传文章，未进行规范信息源确认，关键数据交叉验证不足，数据基础不扎实；二是研究方法不够专业谨慎，分析逻辑客观性不足，以预测数据和假设条件主观推定结论。

上述问题反映出你公司对该份研究报告的质量控制和合规审查不到位，违反了《发布证券研究报告暂行规定》（证监会公告〔2010〕28号）第九条、第十条规定。根据《发布证券研究报告暂行规定》第二十二条规定，我局决定对你公司采取责令改正的行政监管措施，你公司应进一步加强对研究报告的质量控制和合规审查，切实提升制作、发布研究报告的质量。你公司应于收到本决定书之日起 30 日内向我局提交书面整改报告。

如果对本监督管理措施不服，可以在收到本决定书之日起 60 日内向中国证券监督管理委员会

提出行政复议申请，也可以在收到本决定书之日起 6 个月内向有管辖权的人民法院提起诉讼。复议与诉讼期间，上述监督管理措施不停止执行。

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

关于对中信建投证券股份有限公司上海分公司采取责令改正措施的决定，具体如下：

中信建投证券股份有限公司上海分公司：

经查，你分公司（统一社会信用代码：91310000590394387G）在尚未取得换发经营证券业务许可证的情况下，关闭了原营业场所；上海营口路证券营业部变更营业场所后，未及时向我局申请换发经营证券业务许可证。上述行为违反了《证券公司分支机构监管规定》（证监会公告[2013]17号）第十二条第一款的规定，反映出你分公司存在内部控制不完善的问题。

根据《证券公司监督管理条例》第七十条第一款和《证券公司分支机构监管规定》第二十条的规定，我局决定对你分公司采取责令改正的行政监管措施。你分公司应在收到本决定书之日起 3 个月内完成整改，并向我局提交书面整改报告。

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

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

申万宏源

关于对申万宏源证券有限公司采取责令改正措施的决定，具体如下：

申万宏源证券有限公司：

经查，你公司（统一社会信用代码：913100003244445565）子公司上海申银万国证券研究所有限公司（以下简称“研究所”）开展发布证券研究报告业务，但未对研究所署名证券分析师刘洋在冠以公司名称的公众号上发布的某篇证券研究报告进行发布前的质量控制和合规审查。上述行为不符合《发布证券研究报告暂行规定》（证监会公告[2010]28号）第十条的规定，违反了《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》（证监会令第133号）第六条的规定。根据《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》（证监会令第133号）第三十二条的规定，我局决定对你公司采取责令改正的行政监管措施。你公司应高度重视，充分吸取教训，持续完善内部控制，

切实提高合规管理水平，并自收到本决定之日起 30 日内向我局提交书面整改报告。

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

复议与诉讼期间，上述监督管理措施不停止执行

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

光大证券

关于对光大证券股份有限公司及有关责任人予以通报批评的决定，具体如下：

经查明，2019 年 1 月 26 日，光大证券股份有限公司（以下简称光大证券或公司）披露 2018 年年度业绩预减公告，预计公司 2018 年全年归属于上市公司股东的净利润为 134,711 万元，同比减少 166,936 万元左右，同比下降约 55.34%。业绩预减的主要原因包括市场波动对营业收入的影响、信用风险事件频发、公司对存在减值迹象的资产计提重大单项资产减值准备等。3 月 20 日，公司披露业绩预告更正公告，预计 2018 年全年实现归属于上市公司股东的净利润为 10,332 万元，同比下降 96.6%。业绩预告更正的原因为公司下属孙公司光大浸辉投资管理（上海）有限公司担任执行事务合伙人的上海浸鑫投资咨询合伙企业（有限合伙）投资项目（以下简称 MPS 项目）出现风险，未能按原计划实现退出，公司相应计提了大额预计负债和资产减值准备。3 月 28 日，公司披露 2018 年年度报告，实现归属于上市公司股东的净利润为 10,332 万元。

公司年度业绩是投资者关注的重大事项，可能对公司股价及投资者决策产生重大影响，公司理应根据会计准则对当期业绩进行客观、谨慎的估计，准确预告业绩。公司 2018 年度业绩预减公告中预计 2018 年度归属于上市公司股东的净利润同比下降约 55%，但更正后的业绩为归属于上市公司股东的净利润同比下降约 96.6%，与预告业绩相比差异幅度达到 92.33%，差异的绝对金额高达 12 亿元。公司在业绩预减公告中也未对可能导致变更的不确定事项进行相应的风险提示。同时，公司迟至 2019 年 3 月 20 日才发布业绩预告更正公告。

公司业绩预告信息披露不准确，差异绝对值金额巨大且未及时更正，违反了《上海证券交易所股票上市规则》（以下简称《股票上市规则》）第 2.1 条、第 2.6 条、第 11.3.3 条等有关规定。公司时任董事长薛峰作为公司主要负责人和信息披露第一责任人，时任执行总裁兼主管会计工作负责人周健男作为公司经营管理主要人员、财务负责人，时任独立董事兼董事会审计委员会召集人徐经长作为财务会计事项的主要督导人员，时任董事会秘书朱勤作为公司信息披露事务具体负责人，未能勤勉尽责，对公司的违规行为负有责任。上述责任人的行为违反了《股票上市规则》第 2.2

条、第 3.1.4 条、第 3.1.5 条和第 3.2.2 条的规定及其在《董事（监事、高级管理人员）声明及承诺书》中做出的承诺。

鉴于上述事实 and 情节，根据《股票上市规则》第 17.2 条、第 17.3 条、第 17.4 条和《上海证券交易所纪律处分和监管措施实施办法》等有关规定，本所作出如下纪律处分决定：对光大证券股份有限公司及时任董事长薛峰、时任执行总裁兼主管会计工作负责人周健男、时任独立董事兼董事会审计委员会召集人徐经长、时任董事会秘书朱勤予以通报批评。

对于上述纪律处分，本所将通报中国证监会，并记入上市公司诚信档案。

公司应当引以为戒，严格按照法律、法规和《股票上市规则》的规定规范运作，认真履行信息披露义务；董事、监事、高级管理人员应当履行忠实勤勉义务，促使公司规范运作，并保证公司及时、公平、真实、准确和完整地披露所有重大信息。

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

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	271,122.34
2	应收证券清算款	123,093.85
3	应收股利	-
4	应收利息	10,780,618.92
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,174,835.11

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

5.11.6 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。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	537,532,602.13
报告期期间基金总申购份额	-
减：报告期期间基金总赎回份额	-
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	537,532,602.13

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：无

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：无

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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	20201001~20201231	123,853,652.58	-	-	123,853,652.58	23.04
	2	20201001~20201231	131,043,900.15	-	-	131,043,900.15	24.38
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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- (一) 《鹏华兴安定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- (二) 《鹏华兴安定期开放灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- (三) 《鹏华兴安定期开放灵活配置混合型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告》（原文）。

9.2 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。

9.3 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

2021 年 1 月 22 日