

# 鹏华鑫享稳健混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告

2021 年 3 月 31 日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：中信建投证券股份有限公司

报告送出日期：2021 年 4 月 21 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。

基金托管人中信建投证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 04 月 20 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 2021 年 01 月 01 日起至 2021 年 03 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	鹏华鑫享稳健混合
基金主代码	008058
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 4 月 10 日
报告期末基金份额总额	578,317,197.87 份
投资目标	本基金在科学严谨的资产配置框架下，严格控制基金资产风险，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金的投资策略分为两个层面：首先，依据资产配置策略动态调整基金资产在各类资产间的分配比例；而后，进行各类资产中的个股、个券精选。在严格控制基金资产风险的前提下，动态调整基金资产在各类资产间的分配比例，力争实现基金资产的长期稳健增值。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以及各项国家政策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。主要考虑的因素包括：（1）宏观经济指标：GDP 增长率、CPI 走势、M2 的绝对水平和增长率、利率水平与走势、固定资产投资总量、采购经理人指数、进出口数据、工业用电量、客运量及货运量等；（2）政策因素：税收、政府购买总量以及转移支付水平等财政政策，利率水平、货币净投放等货币政策、汇率政策等；（3）市场指标：

市场整体估值水平、市场资金的供需情况以及市场的参与情绪等因素。结合对全球宏观经济的研判，本基金将在严格控制基金资产风险的前提下，动态调整基金资产在各类资产间的分配比例，力争实现基金资产的长期稳健增值。

2、股票投资策略 本基金通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘优质的公司，构建股票投资组合。核心思路在于：1) 自上而下地分析行业的增长前景、行业结构、商业模式、竞争要素等分析把握其投资机会；2) 自下而上地评判企业的核心竞争力、管理层、治理结构等以及其所提供的产品和服务是否契合未来行业增长的大趋势，对企业基本面和估值水平进行综合的研判，深度挖掘优质的个股。

(1) 自上而下的行业遴选 本基金将自上而下地进行行业遴选，重点关注行业增长前景、行业利润前景和行业成功要素。对行业增长前景，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 本基金通过定性和定量相结合的方法进行自下而上的个股选择，对企业基本面和估值水平进行综合的研判，精选优质个股。

1) 定性分析 本基金通过以下两方面标准对股票的基本面进行研究分析并筛选出优质的公司：一方面为竞争力分析，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资源、能力和定位取得可持续竞争优势。另一方面为管理层分析，通过着重考察公司的管理层以及管理制度，选择具有良好治理结构、管理水平较高的优质公司。

2) 定量分析 本基金通过对公司定量的估值分析，挖掘优质的投资标的。通过对估值方法的选择和估值倍数的比较，选择股价相对低估的股票。就估值方法而言，基于行业的特点确定对股价最有影响力的关键估值方法(包括PE、PEG、PB、PS、EV/EBITDA等)；就估值倍数而言，通过业内比较、历史比较和增长性分析，确定具有上升基础的股价水平。

(3) 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、信用策略等积极投资策略，自上而下地管理组合的久期，灵

活地调整组合的券种搭配，同时精选个券，以增强组合的持有期收益。

(1) 久期策略 久期管理是债券投资的重要考量因素，本基金将采用以“目标久期”为中心、自上而下的组合久期管理策略。如果预期利率下降，本基金将增加组合的久期，直至接近目标久期上限，以较多地获得债券价格上升带来的收益；反之，如果预期利率上升，本基金将缩短组合的久期，直至目标久期下限，以减小债券价格下降带来的风险。

(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，即通过对收益率曲线形状变化的预测，适时采用子弹式、杠铃或梯形策略构造组合，并进行动态调整。

(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。该策略是指通过对收益率曲线的分析，在可选的目标久期区间买入期限位于收益率曲线较陡峭处右侧的债券。在收益率曲线不变动的情况下，随着其剩余期限的衰减，债券收益率将沿着陡峭的收益率曲线有较大幅度的下滑，从而获得较高的资本收益；即使收益率曲线上升或进一步变陡，这一策略也能够提供更多的安全边际。

(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。该策略是指在回购利率低于债券收益率的情形下，通过正回购将所获得的资金投资于债券，利用杠杆放大债券投资的收益。

(5) 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。本基金主要关注信用债收益率受信用利差曲线变动趋势和信用变化两方面影响，相应地采用以下两种投资策略：

1) 信用利差曲线变化策略：首先分析经济周期和相关市场变化情况，其次分析标的债券市场容量、结构、流动性等变化趋势，最后综合分析信用利差曲线整体及分行业走势，确定本基金信用债分行业投资比例。

2) 信用变化策略：信用债信用等级发生变化后，本基金将采用最新信用级别所对应的信用利差曲线对债券进行重新定价。本基金将根据内、外部信用评级结果，结合对类似债券信用利差的分析以及对未来信用利差走势的判断，选择信用利差被高估、未来信用利差可能下降的信用债进行投资。

4、股指期货投资策略 本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目标，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，充分考虑股指期货的风险收益特征，通过多头或空头的套期保值策略，以改善投资组合的投资效果，实现股票组

	合的超额收益。 5、国债期货投资策略 本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目标，在风险可控的前提下，投资国债期货。本基金将充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现委托财产的长期稳定增值。 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。	
业绩比较基准	中债总指数收益率*80%+沪深 300 指数收益率*20%。	
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。	
基金管理人	鹏华基金管理有限公司	
基金托管人	中信建投证券股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	鹏华鑫享稳健混合 A 类	鹏华鑫享稳健混合 C 类
下属分级基金的交易代码	008058	008059
报告期末下属分级基金的份额总额	479,391,507.98 份	98,925,689.89 份
下属分级基金的风险收益特征	风险收益特征同上。	风险收益特征同上。

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（2021 年 1 月 1 日-2021 年 3 月 31 日）	
	鹏华鑫享稳健混合 A 类	鹏华鑫享稳健混合 C 类
1. 本期已实现收益	16,020,147.31	3,187,087.54
2. 本期利润	1,614,129.84	-447,067.62
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0034	-0.0045
4. 期末基金资产净值	545,805,813.86	111,984,328.35
5. 期末基金份额净值	1.1385	1.1320

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

鹏华鑫享稳健混合 A 类

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	-0.40%	0.55%	0.03%	0.34%	-0.43%	0.21%
过去六个月	5.72%	0.45%	3.97%	0.28%	1.75%	0.17%
自基金合同生效起至今	13.85%	0.43%	5.57%	0.26%	8.28%	0.17%

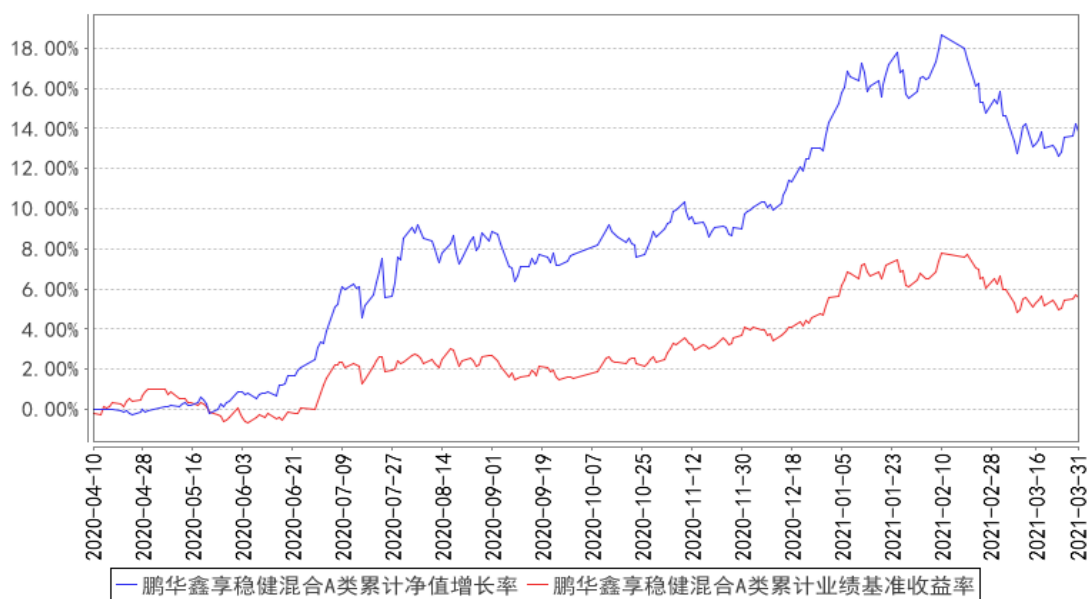
鹏华鑫享稳健混合 C 类

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	-0.55%	0.55%	0.03%	0.34%	-0.58%	0.21%
过去六个月	5.41%	0.45%	3.97%	0.28%	1.44%	0.17%
自基金合同生效起至今	13.20%	0.43%	5.57%	0.26%	7.63%	0.17%

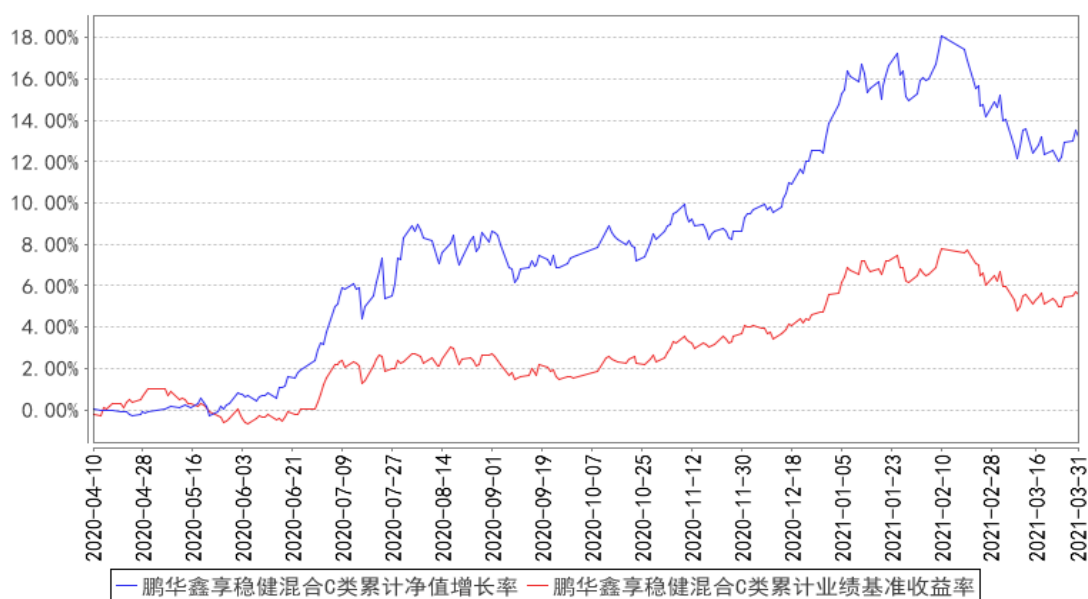
注：业绩比较基准=中债总指数收益率\*80%+沪深 300 指数收益率\*20%。

#### 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

鹏华鑫享稳健混合A类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



鹏华鑫享稳健混合C类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 04 月 10 日生效，截至本报告期末本基金基金合同生效未满一年。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	2020-04-10	-	14 年	李韵怡女士，国籍中国，经济学硕士，14 年证券基金从业经验。曾任职于广州证券股份有限公司投资管理总部，先后担任研究员、交易员和投资经理等职务，从事新股及可转债申购、定增项目等工作；2015 年 6 月加盟鹏华基金管理有限公司，从事投研工作，现担任稳定收益投资部总经理助理/基金经理。2015 年 07 月担任鹏华弘益混合基金基金经理，2015 年 07 月至 2017 年 01 月担任鹏华弘锐混合基金基金经理，2015 年 07 月担任鹏华弘实混合基金基金经理，2015 年 07 月至 2017 年 03 月担任鹏华弘华混合基金基金经理，2015 年 07 月至 2017 年 02 月担任鹏华弘信混合基金基金经理，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 09 月至 2020 年 05 月担任鹏华兴合定期开放混合基金基金经理，2016 年 12 月至 2018 年 07 月担任鹏华弘樽混合基金基金经理，2017 年 01 月担任鹏华兴惠定期开放混合基金基金经理，2019 年 06 月担任鹏华科创 3 年封闭混合基金基金经理，2019 年 11 月担任鹏华金享混合基金基金经理，2020 年 04 月担任鹏华鑫享稳健混合基金基金经理。李韵怡女士具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理未发生变动。
-----	---------	------------	---	------	--

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

2. 证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

#### 4.1.1 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2021 年一季度，权益市场出现较大波动。受美债收益率上行影响，前期涨幅较大的白酒、家电、医药、新能源等板块出现了较大回撤，核心资产和其余板块的估值趋于相对均衡。债券市场，收益率窄幅震荡。

具体操作方面，本基金以追求绝对收益为主要目标。债券配置以中短期品种为主，维持了一定的杠杆比例。股票方面，结合行业基本面和市场风险偏好的变化，小幅调整了组合仓位和结构。并积极参与新股申购，获取增强收益。

### 4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，鹏华鑫享稳健混合 A 类组合净值增长率 -0.40%；鹏华鑫享稳健混合 C 类组合净值增长率 -0.55%；鹏华鑫享稳健混合 A 类业绩比较基准增长率 0.03%；鹏华鑫享稳健混合 C 类业绩比较基准增长率 0.03%。

### 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	138,304,703.37	16.15
	其中：股票	138,304,703.37	16.15
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	598,642,000.00	69.90
	其中：债券	598,642,000.00	69.90
	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	98,000,000.00	11.44
	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	10,968,628.56	1.28
8	其他资产	10,510,212.35	1.23
9	合计	856,425,544.28	100.00

注：第 7 项中的银行存款含本基金存放在开立于基金结算机构的证券交易资金账户内的存款。

## 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	866,000.00	0.13
C	制造业	101,626,263.51	15.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	24,036.12	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	20,493.82	0.00
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	471,782.77	0.07
J	金融业	19,185,111.93	2.92
K	房地产业	900,000.00	0.14
L	租赁和商务服务业	10,406,720.00	1.58
M	科学研究和技术服务业	4,770,903.20	0.73
N	水利、环境和公共设施管理业	33,392.02	0.01
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	-	-

S	综合	-	-
	合计	138,304,703.37	21.03

### 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	34,000	10,406,720.00	1.58
2	002311	海大集团	99,900	7,792,200.00	1.18
3	601318	中国平安	95,700	7,531,590.00	1.14
4	000651	格力电器	119,900	7,517,730.00	1.14
5	600036	招商银行	130,000	6,643,000.00	1.01
6	600031	三一重工	185,000	6,317,750.00	0.96
7	300750	宁德时代	19,310	6,221,102.70	0.95
8	600276	恒瑞医药	66,000	6,077,940.00	0.92
9	000333	美的集团	70,000	5,756,100.00	0.88
10	000661	长春高新	12,700	5,749,671.00	0.87

### 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	229,648,000.00	34.91
	其中：政策性金融债	29,993,000.00	4.56
4	企业债券	368,878,000.00	56.08
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	116,000.00	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	598,642,000.00	91.01

### 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	163475	20 东航 01	500,000	49,020,000.00	7.45
2	163513	20 中金 G3	400,000	39,292,000.00	5.97
3	155441	19 中核 01	300,000	30,234,000.00	4.60
4	175062	20 光证 G5	300,000	30,192,000.00	4.59
5	155570	19 宁安 01	300,000	30,153,000.00	4.58

## 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：无。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目标，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，充分考虑股指期货的风险收益特征，通过多头或空头的套期保值策略，以改善投资组合的投资效果，实现股票组合的超额收益。

## 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

本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目标，在风险可控的前提下，投资国债期货。本基金将充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现委托财产的长期稳定增值。

### 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：无。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

## 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

光大证券

#### 一、处罚事由

经查明，2019 年 1 月 26 日，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。

#### 二、处罚机构及处罚结果

鉴于上述事实和情节，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，上海证券交易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。

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。

中金公司

#### 一、处罚事由

经查，证监会发现公司存在以下违规问题：

1、投资银行类业务内部控制不完善。内部控制人员数量不符合规定要求。项目主要人员收入递延支付机制不完善。部分项目立项、内核环节对立项委员和内核委员的利益冲突审查和回避审查不充分。债券一、二级市场业务未在部门设置方面严格分离。

2、廉洁从业风险防控机制不完善，未指定专门部门负责廉洁从业监督检查等。

上述情况违反了《证券公司投资银行类业务内部控制指引》第三十条、第三十一条、第三十二条、第八十七条，《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》（以下简称《合规管理办法》）第六条和《证券期货经营机构及其工作人员廉洁从业规定》（以下简称《廉洁从业规定》）第五条的规定。

## 二、处罚机构及处罚结果

按照《合规管理办法》第三十二条和《廉洁从业规定》第十八条的规定，中国证监会决定对公司采取责令改正的行政监督管理措施。

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	-
2	应收证券清算款	384,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	10,109,631.75
5	应收申购款	16,580.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,510,212.35

### 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

项目	鹏华鑫享稳健混合 A 类	鹏华鑫享稳健混合 C 类
报告期期初基金份额总额	560,425,747.24	89,618,339.82
报告期期间基金总申购份额	111,229,341.10	38,084,498.86
减：报告期期间基金总赎回份额	192,263,580.36	28,777,148.79
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	479,391,507.98	98,925,689.89

## § 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	20210302~20210323	113,777,672.51	-	26,500,000.00	87,277,672.51	15.09
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) 《鹏华鑫享稳健混合型证券投资基金基金合同》；
- (二) 《鹏华鑫享稳健混合型证券投资基金托管协议》；
- (三) 《鹏华鑫享稳健混合型证券投资基金 2021 年第 1 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 4 月 21 日