

# 鹏华弘康灵活配置混合型证券投资基金

## 2021 年第 2 季度报告

2021 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：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 7 月 20 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 07 月 19 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 04 月 01 日起至 2021 年 06 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	鹏华弘康混合
基金主代码	003411
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 9 月 29 日
报告期末基金份额总额	288,983,629.85 份
投资目标	本基金在科学严谨的资产配置框架下，严选安全边际较高的股票、债券等投资标的，力争基金资产的保值增值。
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、税收、货币、汇率政策等），并结合美林时钟等科学严谨的资产配置模型，动态评估不同资产大类在不同时期的投资价值及其风险收益特征，追求股票、债券和货币等大类资产的灵活配置和稳健收益。</p> <p>2、股票投资策略 本基金通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘优质的上市公司，严选其中安全边际较高的个股构建投资组合：自上而下地分析行业的成长前景、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，力争实现组合的保值增值。（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</p>

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，力争实现组合的保值增值。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、历史比较和成长性分析，确定具有上升基础的股价水平。

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，力争实现组合的保值增值。

(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 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。4、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	中证综合债指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×10%	
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	招商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	鹏华弘康混合 A	鹏华弘康混合 C
下属分级基金的交易代码	003411	003412
报告期末下属分级基金的份额总额	763,439.35 份	288,220,190.50 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 4 月 1 日-2021 年 6 月 30 日）	
	鹏华弘康混合 A	鹏华弘康混合 C
1. 本期已实现收益	3,810.54	1,956,903.62
2. 本期利润	4,694.76	2,663,394.90
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0104	0.0102
4. 期末基金资产净值	1,011,668.12	366,773,477.37
5. 期末基金份额净值	1.3251	1.2725

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，开放式基金的申购费

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

鹏华弘康混合 A

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	0.84%	0.01%	1.48%	0.10%	-0.64%	-0.09%
过去六个月	1.70%	0.02%	2.09%	0.14%	-0.39%	-0.12%
过去一年	2.72%	0.02%	5.11%	0.14%	-2.39%	-0.12%
过去三年	30.32%	0.61%	18.25%	0.13%	12.07%	0.48%
自基金合同生效起至今	32.51%	0.49%	22.51%	0.13%	10.00%	0.36%

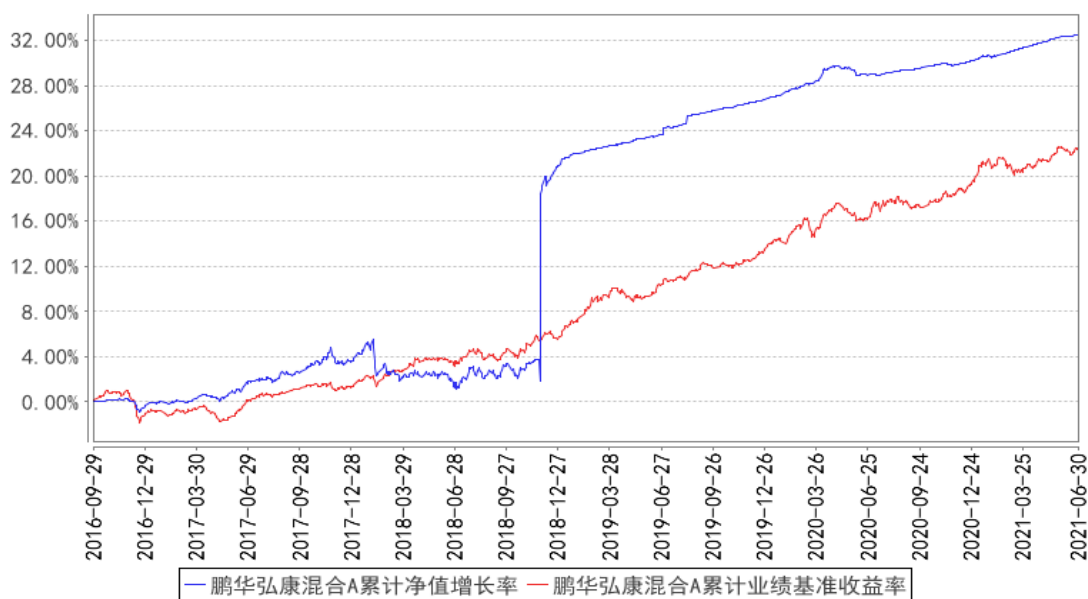
鹏华弘康混合 C

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	0.82%	0.01%	1.48%	0.10%	-0.66%	-0.09%
过去六个月	1.65%	0.02%	2.09%	0.14%	-0.44%	-0.12%
过去一年	2.63%	0.02%	5.11%	0.14%	-2.48%	-0.12%
过去三年	29.74%	0.61%	18.25%	0.13%	11.49%	0.48%
自基金合同生效起至今	27.25%	0.50%	22.51%	0.13%	4.74%	0.37%

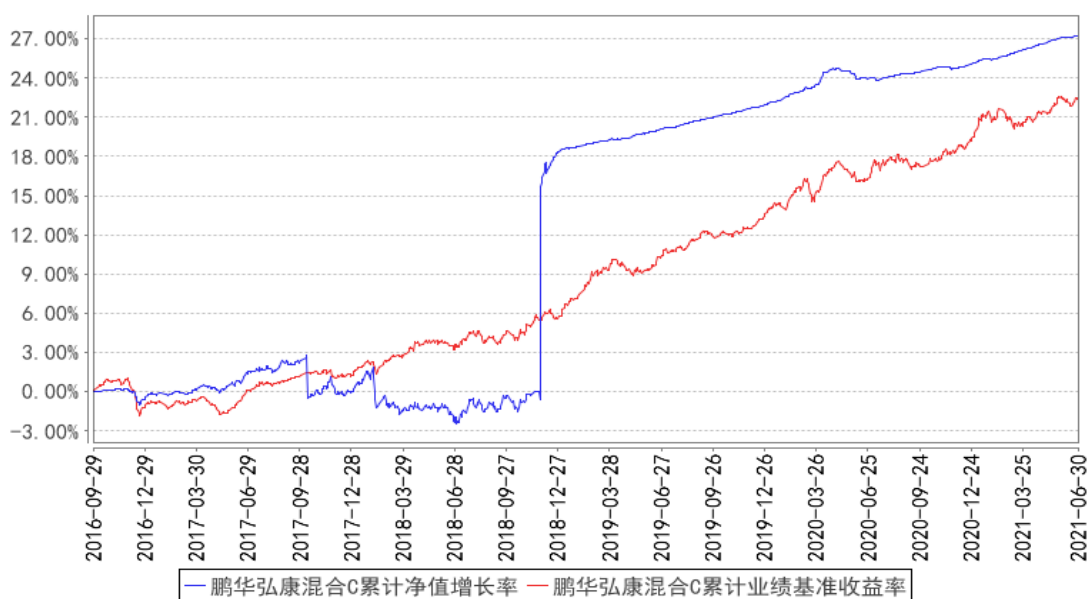
注：业绩比较基准=中证综合债指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×10%

#### 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

鹏华弘康混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



鹏华弘康混合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 2016 年 09 月 29 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		

叶朝明	基金经理	2018-12-27	-	13 年	叶朝明先生，国籍中国，工商管理硕士，13 年证券从业经验。曾任职于招商银行总行，从事本外币资金管理相关工作；2014 年 1 月加盟鹏华基金管理有限公司，从事货币基金管理工作，现担任现金投资部总经理、基金经理。2014 年 02 月至今担任鹏华增值宝货币市场基金基金经理，2015 年 01 月至今担任鹏华安盈宝货币市场基金基金经理，2015 年 07 月至今担任鹏华添利宝货币市场基金基金经理，2016 年 01 月至今担任鹏华添利交易型货币市场基金基金经理，2017 年 05 月至今担任鹏华聚财通货币市场基金基金经理，2017 年 06 月至今担任鹏华盈余宝货币市场基金基金经理，2017 年 06 月至今担任鹏华金元宝货币市场基金基金经理，2018 年 08 月至今担任鹏华弘泰灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2018 年 09 月至今担任鹏华兴鑫宝货币市场基金基金经理，2018 年 09 月至今担任鹏华货币市场证券投资基金基金经理，2018 年 11 月至今担任鹏华弘泽灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2018 年 12 月至今担任鹏华弘康灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2019 年 08 月至今担任鹏华浮动净值型发起式货币市场基金基金经理，2019 年 10 月至今担任鹏华稳利短债债券型证券投资基金基金经理，2020 年 06 月至今担任鹏华中短债 3 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理，叶朝明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。

#### 4.1.1 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%的交易次数为 2 次，主要原因在于指数基金成份股交易不活跃导致。

### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2021 年二季度，国内经济保持平稳，从 2019 年两年复合同比增速来看，工业增加值仍在合理区间，房地产投资处于偏高水平，制造业投资小幅改善，基建投资处于低位，消费继续稳步恢复，出口保持较高的景气度。6 月 PMI 数据显示制造业仍处于景气区间，经济仍然具有一定韧性。金融数据方面，社融与 M2 同比均有所下滑，后续随着地方政府债供给增加，信用债发行回归常态，社融和 M2 增速预计将趋于稳定。通胀方面，PPI 快速上行，CPI 和核心 CPI 温和上涨，随着大宗商品价格趋稳，后续 PPI 或将在高位震荡，CPI 上升幅度有限，总体通胀风险不大。政策方面，积极的财政政策强调落实落细，稳健的货币政策要灵活精准、合理适度。海外方面，发达国家疫苗接种速度快于发展中国家，经济复苏不平衡。美联储上修经济增长及通胀预期，暂时维持基准利率水平与月度购债规模不变，市场对于美联储缩减资产购买规模的讨论开始增加。公开市场操作方面，二季度央行净投放 1639 亿，除季末等个别时点外，每个交易日保持 100 亿元的 7 天逆回购操作，操作利率保持不变，LPR 报价与上一季度持平。二季度资金面整体平稳，资金利率围绕政策利率波动。银行间 7 天质押式回购加权利率均值为 2.25%，较上一季度下降 16BP。3 个月期限 AAA 同业存单到期收益率均值在 2.46%，较上一季度下降 15BP。

2021 年二季度，债券市场收益率下行。其中，1 年期国开债收益率下行 25BP 左右，1 年期 AA+ 短融收益率下行 12BP 左右。

本基金二季度总体采用短久期固定收益品种运作策略，在绝对收益较高的时点，增加对长期限资产的配置，在保证组合良好流动性的基础上，力争提高组合整体收益。



#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，鹏华弘康 A 组合净值增长率 0.84%；鹏华弘康 C 组合净值增长率 0.82%。鹏华弘康 A 业绩比较基准增长率 1.48%；鹏华弘康 C 业绩比较基准增长率 1.48%。

#### 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	423,762,500.00	97.36
	其中：债券	423,762,500.00	97.36
	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	3,027,475.42	0.70
8	其他资产	8,467,259.60	1.95
9	合计	435,257,235.02	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

注：无。

##### 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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

##### 5.3.1 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

注：无。

##### 5.3.2 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资明细

注：无。

#### 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	20,002,000.00	5.44
	其中：政策性金融债	20,002,000.00	5.44
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	217,885,100.00	59.24
6	中期票据	156,496,400.00	42.55
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	29,379,000.00	7.99
9	其他	-	-
10	合计	423,762,500.00	115.22

#### 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	012101882	21 粤交投 SCP003	300,000	30,012,000.00	8.16
2	112104011	21 中国银行 CD011	300,000	29,379,000.00	7.99
3	101801022	18 汾湖投资 MTN003	200,000	20,340,000.00	5.53
4	101800977	18 渝惠通 MTN001	200,000	20,330,000.00	5.53
5	101800808	18 衡阳城投 MTN003	200,000	20,224,000.00	5.50

#### 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

国家开发银行

2020 年 12 月 25 日，中国银行保险监督管理委员会对国家开发银行的以下违法违规行为一、为违规的政府购买服务项目提供融资，二、项目资本金管理不到位，棚改贷款项目存在资本金违规抽回情况，三、违规变相发放土地储备贷款，四、设置不合理存款考核要求，以贷转存，虚增存款，五、贷款风险分类不准确，六、向资产管理公司以外的主体批量转让不良信贷资产，七、违规进行信贷资产拆分转让，隐匿信贷资产质量，八、向棚改业务代理结算行强制搭售低收益理财产品，九、扶贫贷款存贷挂钩，十、易地扶贫搬迁贷款“三查”不尽职，部分贷款资金未真正用于扶贫搬迁，十一、未落实同业业务交易对手名单制监管要求，十二、以贷款方式向金融租赁公司提供同业融资，未纳入同业借款业务管理，十三、以协定存款方式吸收同业存款，未纳入同业存款业务管理，十四、风险隔离不到位，违规开展资金池理财业务，十五、未按规定向投资者充分披露理财产品投资非标准化债权资产情况，十六、逾期未整改，屡查屡犯，违规新增业务，十七、利用集团内部交易进行子公司间不良资产非洁净出表，十八、违规收取小微企业贷款承诺费，十九、收取财务顾问费质价不符，二十、利用银团贷款承诺费浮利分费，二十一、向检查组提供虚假整改说明材料，二十二、未如实提供信贷资产转让台账，二十三、案件信息迟报、瞒报，

二十四、对以往监管检查中发现的国别风险管理问题整改不到位，对公司处以罚款 4880 万元。

2020 年 10 月 26 日，国家外汇管理局北京外汇管理部对国家开发银行违反银行交易记录管理规定的违法违规行为，对国家开发银行处以 60 万元人民币罚款，要求该行对直接负责的主管人员和其他直接责任人员给予处分。

衡阳市城市建设投资有限公司

2021 年 1 月 14 日，湖南省统计局针对衡阳市城市建设投资有限公司的提供不真实统计资料的违法违规行为，对公司处以警告和罚款的处罚。

中国银行

2021 年 5 月 17 日，中国银行保险监督管理委员会针对中国银行股份有限公司的以下违法违规行为一、向未纳入预算的政府购买服务项目发放贷款，二、违规向关系人发放信用贷款，三、向无资金缺口企业发放流动资金贷款，四、存款月末冲时点，五、为无真实贸易背景企业签发银行承兑汇票，六、贷款管理不严，信贷资金被挪用，七、票据贴现资金直接回流至出票人或其关联人账户，八、理财产品质押贸易融资业务风险控制有效性不足，九、超比例发放并购贷款，十、向未经备案的跨境并购业务提供并购贷款，十一、违规为私募股权基金收购境内企业发放并购贷款，十二、超授权期限办理汇出汇款融资业务，十三、与名单外交易对手开展同业业务，十四、违规为他行开立投融资性同业账户，十五、以同业返存方式不当吸收存款，十六、自营和代客理财业务未能实现风险隔离，十七、面向一般客户销售的理财产品投资二级市场股票，十八、未按规定向投资者充分披露理财产品投资非标准化债权风险状况，十九、违规向四证不全房地产项目提供融资，二十、理财资金违规用于支付土地款或置换股东购地借款，二十一、理财资金违规用于土地储备项目，二十二、理财非标融资入股商业银行，二十三、理财非标融资用于商业银行注册验资，二十四、超授信额度提供理财非标融资，二十五、买入返售业务标的资产不合规，二十六、个人住房贷款业务搭售保险产品，二十七、单家分支行代销 3 家以上保险公司保险产品，二十八、主承销债券包销余券未通过风险处置专户处置，二十九、通过平移贷款延缓风险暴露，三十、债券投资业务未分类，表内人民币债券未计提减值准备，三十一、与资产管理公司合作设立有限合伙基金，不洁净转让不良资产，三十二、迟报案件信息，三十三、案件问责不到位，三十四、提供质价不符的服务，三十五、违规收取福费廷风险承担费，三十六、违规向部分已签约代发工资客户收取年费，对公司处以罚款 8761.355 万元。

2020 年 12 月 1 日，中国银行保险监督管理委员会针对中国银行股份有限公司“原油宝”产品风险事件相关的产品管理不规范，包括保证金相关合同条款不清晰、产品后评价工作不独立、未对产品开展压力测试相关工作等；风险管理不审慎，包括市场风险限额设置存在缺陷、市场风

险限额调整和超限操作不规范、交易系统功能存在缺陷未按要求及时整改等；内控管理不健全，包括绩效考核和激励机制不合理、消费者权益保护履职不足、全行内控合规检查未涵盖全球市场部对私产品销售管理等；销售管理不合规，包括个别客户年龄不满足准入要求、部分宣传销售文本内容存在夸大或者片面宣传、采取赠送实物等方式销售产品等的违法违规行为，对公司处以罚款 5050 万元。

重庆市永川区惠通建设发展有限公司

2021 年 3 月 26 日，永川区规划和自然资源局针对重庆市永川区惠通建设发展有限公司的建设实训基地的违法违规行为，对公司处以拆除及罚款的处罚。

以上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	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,941,827.89
5	应收申购款	2,525,431.71
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,467,259.60

### 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	鹏华弘康混合 A	鹏华弘康混合 C
报告期期初基金份额总额	338,318.24	263,827,444.24
报告期期间基金总申购份额	609,322.39	154,419,076.11
减:报告期期间基金总赎回份额	184,201.28	130,026,329.85
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	763,439.35	288,220,190.50

## § 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

注:无。

### 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)《鹏华弘康灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;
- (二)《鹏华弘康灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;
- (三)《鹏华弘康灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 2 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 7 月 20 日