

# 鹏华弘实灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 3 季度报告

2021 年 9 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

报告送出日期：2021 年 10 月 26 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 10 月 25 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 07 月 01 日起至 2021 年 09 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

|            |   |
|------------|---|
| 基金简称       | 鹏华弘实混合  |
| 基金主代码      | 001329  |
| 基金运作方式     | 契约型开放式  |
| 基金合同生效日    | 2015 年 5 月 25 日   |
| 报告期末基金份额总额 | 553,729,797.84 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，力争实现绝对收益的目标。   |
| 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，追求股票、债券和货币等大类资产的灵活配置和稳健的绝对收益目标。 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。 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，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。 |                  |
| 业绩比较基准          | 一年期银行定期存款利率（税后）+3%   |                  |
| 风险收益特征          | 本基金属于混合型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金，属于证券投资基金里中高风险、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           | 中国建设银行股份有限公司   |                  |
| 下属分级基金的基金简称     | 鹏华弘实混合 A   | 鹏华弘实混合 C         |
| 下属分级基金的交易代码     | 001329   | 001330           |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 293,588,186.33 份   | 260,141,611.51 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7月1日-2021年9月30日） |                |
|-----------------|---------------------------|----------------|
|                 | 鹏华弘实混合 A                  | 鹏华弘实混合 C       |
| 1. 本期已实现收益      | 8,861,069.73              | 7,917,671.82   |
| 2. 本期利润         | -90,159.00                | -192,211.42    |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0003                   | -0.0008        |
| 4. 期末基金资产净值     | 415,097,698.79            | 398,162,348.41 |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.4139                    | 1.5306         |

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

鹏华弘实混合 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      | -0.06% | 0.29%     | 1.13%      | 0.01%         | -1.19% | 0.28% |
| 过去六个月      | 4.62%  | 0.30%     | 2.26%      | 0.01%         | 2.36%  | 0.29% |
| 过去一年       | 11.12% | 0.38%     | 4.50%      | 0.01%         | 6.62%  | 0.37% |
| 过去三年       | 31.29% | 0.33%     | 13.51%     | 0.01%         | 17.78% | 0.32% |
| 过去五年       | 37.01% | 0.27%     | 22.51%     | 0.01%         | 14.50% | 0.26% |
| 自基金合同生效起至今 | 48.62% | 0.24%     | 28.81%     | 0.01%         | 19.81% | 0.23% |

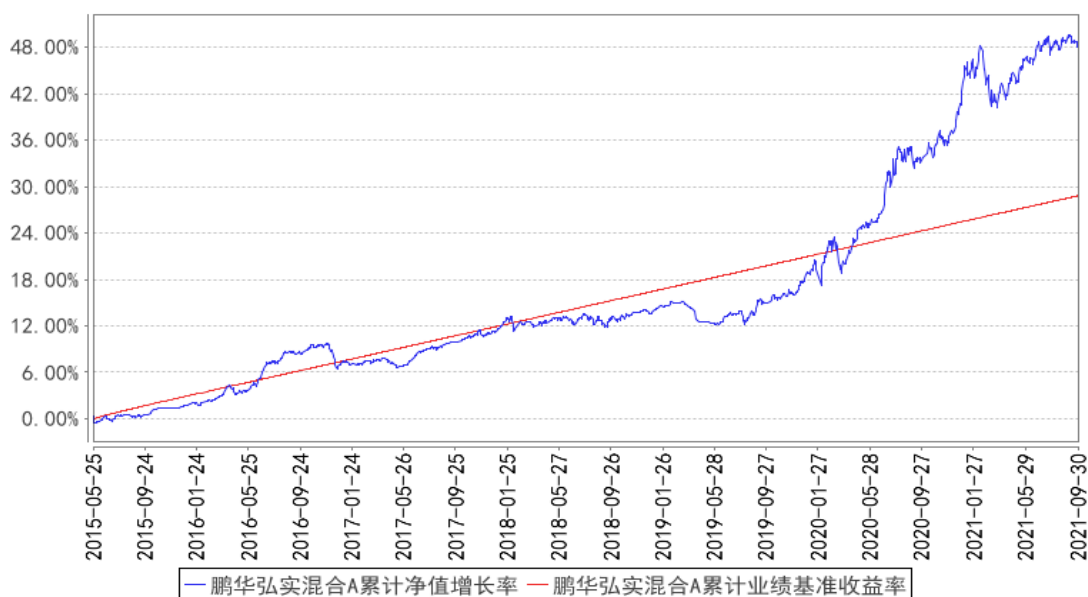
鹏华弘实混合 C

| 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      | -0.08% | 0.30%     | 1.13%      | 0.01%         | -1.21% | 0.29% |
| 过去六个月      | 4.59%  | 0.30%     | 2.26%      | 0.01%         | 2.33%  | 0.29% |
| 过去一年       | 11.06% | 0.38%     | 4.50%      | 0.01%         | 6.56%  | 0.37% |
| 过去三年       | 31.07% | 0.33%     | 13.51%     | 0.01%         | 17.56% | 0.32% |
| 过去五年       | 36.59% | 0.27%     | 22.51%     | 0.01%         | 14.08% | 0.26% |
| 自基金合同生效起至今 | 58.31% | 0.31%     | 28.81%     | 0.01%         | 29.50% | 0.30% |

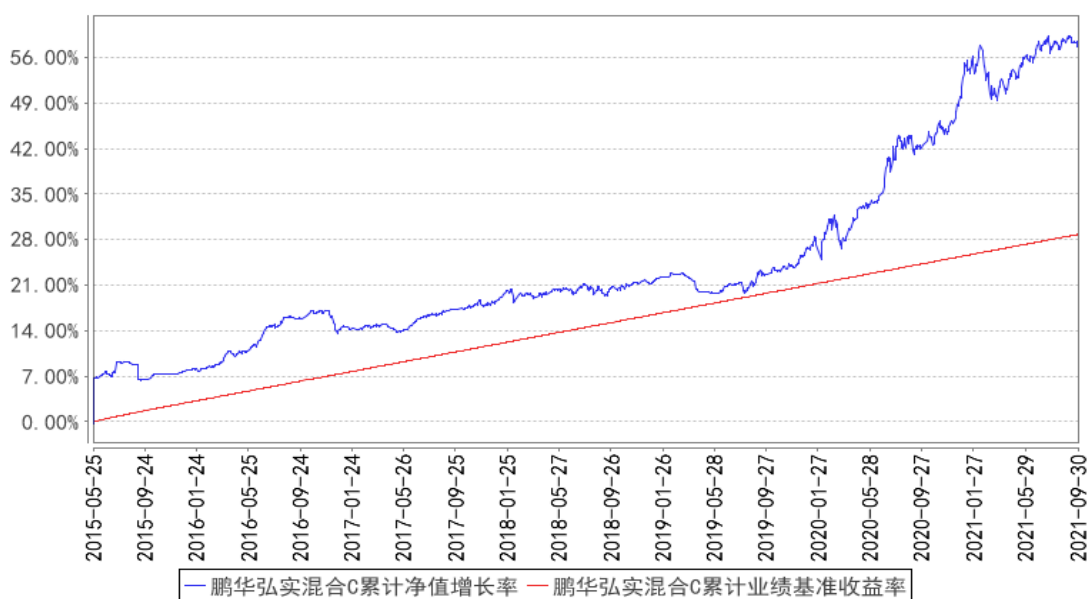
注：业绩比较基准=一年期银行定期存款利率（税后）+3%

### 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

鹏华弘实混合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



鹏华弘实混合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 2015 年 05 月 25 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 | 基金经理 | 2015-07-23  | -    | 14 年   | 李韵怡女士，国籍中国，经济学硕士，14 年证券从业经验。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 02 月担任鹏华弘信灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015 年 07 月至 2017 年 03 月担任鹏华弘华灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015 年 07 月至今担任鹏华弘实灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015 年 07 月至今担任鹏华弘益灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015 年 07 月至今担任鹏华弘鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015 年 07 月至 2017 年 01 月担任鹏华弘和灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015 年 07 月至 2017 年 01 月担任鹏华弘锐灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 06 月至 2018 年 07 月担任鹏华兴泽定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 09 月至 2020 年 05 月担任鹏华兴润定期开放灵活配置混合型基金基金经理，2016 年 09 月至今担任鹏华兴安定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 09 月至 2020 年 05 月担任鹏华兴合定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 09 月至 2018 年 06 月担任鹏华兴实定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 12 月至 2018 年 07 月担任鹏华弘樽灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017 年 01 月至今担任鹏华兴惠定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2019 年 06 月至今担任鹏华科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2019 年 11 月至今担任鹏华金享混合型证券投资基金基金经理，2020 年 04 月至今担任鹏华鑫享稳健混合型证券投资基金基金经理，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。   |
| 戴钢 | 基金经理 | 2018-09-01 | - | 19 年 | 戴钢先生，国籍中国，经济学硕士，19 年证券从业经验。曾就职于广东民安证券研究发展部，担任研究员；2005 年 9 月加盟鹏华基金管理有限公司，从事研究分析工作，历任债券研究员、专户投资经理，现担任稳定收益投资部副总经理/基金经理。2011 年 12 月至 2014 年 12 月担任鹏华丰泽分级债券型证券投资基金基金经理，2012 年 06 月至 2018 年 07 月担任鹏华金刚保本混合型证券投资基金基金经理，2012 年 11 月至 2015 年 11 月担任鹏华中小企业纯债债券型发起式证券投资基金基金经理，2013 年 09 月至今担任鹏华丰实定期开放债券型证券投资基金基金经理，2013 年 09 月至今担任鹏华丰泰定期开放债券型证券投资基金基金经理，2013 年 10 月至 2018 年 05 月担任鹏华丰信分级债券型证券投资基金基金经理，2014 年 12 月至 2016 年 02 月担任鹏华丰泽债券型证券投资基金 (LOF) 基金经理，2015 年 11 月至今担任鹏华丰和债券型证券投资基金 (LOF) 基金经理，2016 年 03 月至今担任鹏华丰尚定期开放债券型证券投资基金基金经理，2016 年 04 月至 2018 年 10 月担任鹏华金鼎保本混合型证券投资基金基金经理，2016 年 08 月至 2018 年 05 月担任鹏华丰饶定期开放债券型证券投资基金基金经理，2018 年 05 月至 2018 年 12 月担任鹏华普悦债券型证券投资基金基金经理，2018 年 07 月至今担任鹏华宏观灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2018 年 09 月至今担任鹏华弘实灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2018 年 10 月至今担任鹏华金鼎灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2019 年 09 月至 2021 年 03 月担任鹏华锦利两年定期开放债券型证券投资基金基金经理，戴钢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

三季度，市场风格发生较大变化，受产品价格上涨影响，周期板块整体表现较好。具体操作方面，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。权益方面，在控制总仓位的前提下，结构上趋于均衡，并积极参与新股和可转债申购，获取增强收益机会。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期 A 类份额净值增长率为-0.06%，同期业绩比较基准增长率为 1.13%，C 类份额净值增长率为-0.08%，同期业绩比较基准增长率为 1.13%。

#### 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              | 161,736,070.47 | 19.86  |
|   | 其中：股票             | 161,736,070.47 | 19.86  |
| 2 | 基金投资              | -              | -      |
| 3 | 固定收益投资            | 629,870,806.50 | 77.36  |
|   | 其中：债券             | 629,870,806.50 | 77.36  |
|   | 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      | 13,777,759.16  | 1.69   |
| 8 | 其他资产              | 8,873,604.33   | 1.09   |
| 9 | 合计                | 814,258,240.46 | 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         | 18,116.82      | 0.00         |
| B  | 采矿业              | 2,462,864.00   | 0.30         |
| C  | 制造业              | 97,000,846.27  | 11.93        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 9,308,511.22   | 1.14         |
| E  | 建筑业              | 20,183.39      | 0.00         |
| F  | 批发和零售业           | 61,969.47      | 0.01         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -              | -            |
| H  | 住宿和餐饮业           | 40,233.44      | 0.00         |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 2,087,133.98   | 0.26         |
| J  | 金融业              | 24,881,000.60  | 3.06         |
| K  | 房地产业             | 8,070,848.00   | 0.99         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 11,492,000.00  | 1.41         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 6,244,796.88   | 0.77         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 38,613.78      | 0.00         |
| 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        | 8,952.62       | 0.00         |
| S  | 综合               | -              | -            |
|    | 合计               | 161,736,070.47 | 19.89        |

### 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

| 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  | 300750 | 宁德时代 | 22,900  | 12,039,217.00 | 1.48         |
| 2  | 601888 | 中国中免 | 44,200  | 11,492,000.00 | 1.41         |
| 3  | 601012 | 隆基股份 | 125,440 | 10,346,291.20 | 1.27         |
| 4  | 600036 | 招商银行 | 127,600 | 6,437,420.00  | 0.79         |
| 5  | 600905 | 三峡能源 | 907,763 | 6,299,875.22  | 0.77         |
| 6  | 603259 | 药明康德 | 40,686  | 6,216,820.80  | 0.76         |
| 7  | 600048 | 保利发展 | 363,500 | 5,099,905.00  | 0.63         |
| 8  | 002371 | 北方华创 | 13,400  | 4,900,246.00  | 0.60         |
| 9  | 601601 | 中国太保 | 172,200 | 4,673,508.00  | 0.57         |
| 10 | 600519 | 贵州茅台 | 2,400   | 4,392,000.00  | 0.54         |

#### 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      | 10,450,353.60  | 1.28         |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 307,836,200.00 | 37.85        |
|    | 其中：政策性金融债 | 56,192,200.00  | 6.91         |
| 4  | 企业债券      | 290,490,000.00 | 35.72        |
| 5  | 企业短期融资券   | -              | -            |
| 6  | 中期票据      | 20,095,000.00  | 2.47         |
| 7  | 可转债（可交换债） | 999,252.90     | 0.12         |
| 8  | 同业存单      | -              | -            |
| 9  | 其他        | -              | -            |
| 10 | 合计        | 629,870,806.50 | 77.45        |

### 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  | 175099 | 20 国君 G5 | 500,000 | 50,715,000.00 | 6.24         |
| 2  | 163774 | 20 中证 15 | 400,000 | 40,340,000.00 | 4.96         |

|   |        |          |         |               |      |
|---|--------|----------|---------|---------------|------|
| 3 | 155125 | 19 津投 01 | 400,000 | 40,068,000.00 | 4.93 |
| 4 | 163222 | 20 信投 G1 | 350,000 | 35,000,000.00 | 4.30 |
| 5 | 124184 | 13 京投债   | 300,000 | 30,837,000.00 | 3.79 |

## 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

国家开发银行旗下分支机构在报告期内受到中国银行保险监督管理委员会大连监管局、陕西

监管局、浙江监管局、国家外汇管理局广西壮族自治区分局、海南省分局和中国人民银行南宁中心支行的行政处罚。

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。

国泰君安证券股份有限公司

国泰君安证券股份有限公司旗下分支机构在报告期内受到中国银行保险监督管理委员会江苏监管局和国家税务总局天津经济技术开发区税务局、吉首市税务局乾州税务所的行政处罚。

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   | 25,964.86    |
| 2  | 应收证券清算款 | 34,781.25    |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 7,698,252.13 |

|   |       |              |
|---|-------|--------------|
| 5 | 应收申购款 | 1,114,606.09 |
| 6 | 其他应收款 | -            |
| 7 | 待摊费用  | -            |
| 8 | 其他    | -            |
| 9 | 合计    | 8,873,604.33 |

#### 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

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值<br>(元) | 占基金资产净<br>值比例 (%) | 流通受限情<br>况说明 |
|----|--------|------|--------------------|-------------------|--------------|
| 1  | 600905 | 三峡能源 | 6,299,875.22       | 0.77              | 锁定期股票        |

#### 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                        | 鹏华弘实混合 A       | 鹏华弘实混合 C       |
|---------------------------|----------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 333,884,188.47 | 203,661,804.50 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 2,016,017.85   | 79,422,358.27  |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 42,312,019.99  | 22,942,551.26  |
| 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               | 293,588,186.33 | 260,141,611.51 |

## § 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) 《鹏华弘实灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- (二) 《鹏华弘实灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- (三) 《鹏华弘实灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 3 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 10 月 26 日