

鹏华金城灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告

2022 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：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2022 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 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 2022 年 01 月 01 日起至 2022 年 03 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	鹏华金城混合
基金主代码	002714
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 6 月 7 日
报告期末基金份额总额	600,789,131.34 份
投资目标	本基金在科学严谨的资产配置框架下，精选股票、债券等投资标的，力争基金资产长期稳定的增值。
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、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。 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；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、策略的実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，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。

(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，本基金将根据此调整组合长、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。

4、权证投资策略 本基金通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型及价值挖掘策略、价差策略、双向权证策略等寻求权证的合理估值水平，追求稳定的当期收益。

5、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。 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。 7、衍生品投资策略 为更好地实现投资目标，本基金在注重风险管理的前提下，以套期保值为目的，适度运用股指期货、国债期货等金融衍生品。本基金利用金融衍生品合约流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点，提高投资组合的运作效率。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×55%+中证综合债指数收益率×45%
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	中国银行股份有限公司

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（2022 年 1 月 1 日-2022 年 3 月 31 日）
1. 本期已实现收益	-18,682,425.23
2. 本期利润	-26,735,833.47
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0446
4. 期末基金资产净值	765,129,094.76
5. 期末基金份额净值	1.274

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等未实现收益。

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

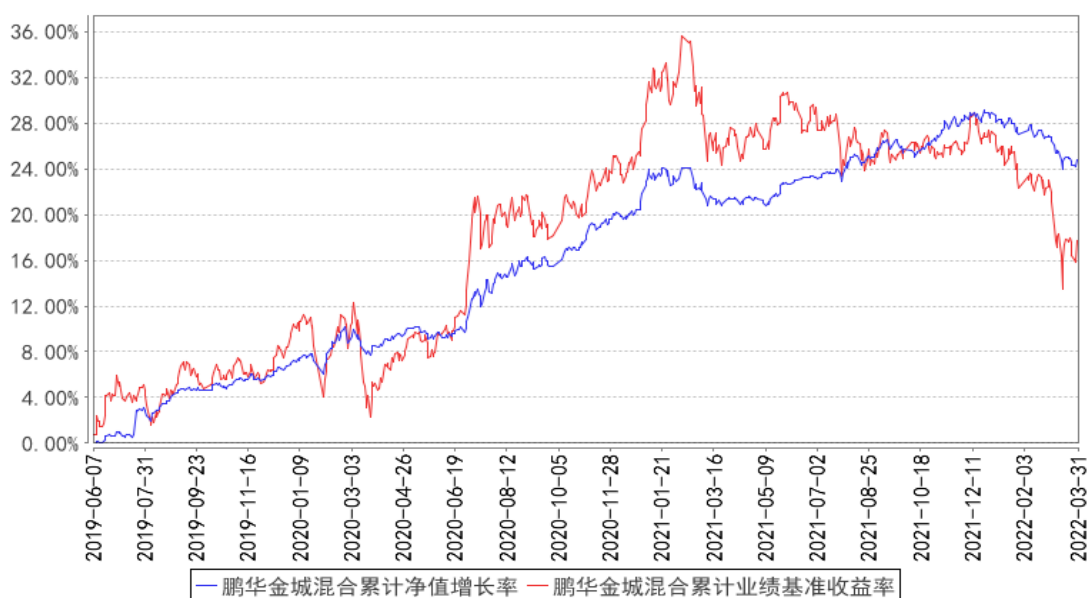
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④

过去三个月	-3.26%	0.26%	-7.81%	0.80%	4.55%	-0.54%
过去六个月	-0.85%	0.24%	-6.48%	0.64%	5.63%	-0.40%
过去一年	2.75%	0.22%	-6.97%	0.62%	9.72%	-0.40%
自基金合同 生效起至今	24.66%	0.26%	17.29%	0.68%	7.37%	-0.42%

注：业绩比较基准=沪深 300 指数收益率×55%+中证综合债指数收益率×45%

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

鹏华金城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 2019 年 06 月 07 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		
方昶	基金经理	2019-06-19	-	8 年	方昶先生，国籍中国，经济学硕士，8 年证券从业经验。曾任中国工商银行资产管理部投资经理；2016 年 12 月加盟鹏华基金管理有限公司，现担任债券投资一部基

					金经理。2018 年 07 月至 2020 年 02 月担任鹏华丰腾债券型证券投资基金基金经理, 2018 年 10 月至今担任鹏华信用增利债券型证券投资基金基金经理, 2018 年 12 月至 2020 年 02 月担任鹏华丰华债券型证券投资基金基金经理, 2019 年 01 月至今担任鹏华丰恒债券型证券投资基金基金经理, 2019 年 03 月至今担任鹏华安益增强混合型证券投资基金基金经理, 2019 年 06 月至今担任鹏华金城灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2019 年 09 月至今担任鹏华丰享债券型证券投资基金基金经理, 2019 年 09 月至 2021 年 01 月担任鹏华中短债 3 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理, 2020 年 12 月至今担任鹏华安润混合型证券投资基金基金经理, 2021 年 06 月至今担任鹏华弘盛灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 方昶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。
范晶伟	基金经理	2021-08-07	-	6 年	范晶伟先生, 国籍中国, 金融硕士, 6 年证券从业经验。2016 年 07 月加盟鹏华基金管理有限公司, 历任固定收益部助理债券研究员、债券研究员、固定收益研究部高级债券研究员、基金经理助理, 现任职于混合资产投资部, 从事投研相关工作。2021 年 08 月至今担任鹏华金城灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2021 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, 2021 年 08 月至今担任鹏华丰盛稳固收益债券型证券投资基金基金经理, 2021 年 11 月至今担任鹏华安源 5 个月持有期混合型证券投资基金基金经理, 范晶伟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。
陈大焯	基金经理	2021-08-24	-	5 年	陈大焯先生, 国籍中国, 金融硕士, 5 年证券从业经验。2017 年 07 月加盟鹏华基金管理有限公司, 历任固定收益部助理债券研究员、债券研究员、固定收益研究部高级债券研究员、基金经理助理, 现任职于混合资产投资部, 从事投研相关工作。2021 年 08 月至今担任鹏华双债增利债券型证券投资基金基金经理, 2021 年 08 月至今担任鹏华金城灵活配置混合型证券

					投资基金基金经理, 陈大焯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

22 年 1 季度 A 股遭遇了较差的开局。一方面是外围市场环境较差，俄乌冲突促使全球大宗商品价格大幅上涨，加剧通胀冲击，联储加快加息缩表的步伐，全球流动性面临收缩的压力，另一方面国内疫情防控压力明显加大，地产销售整体低迷，社融方面居民信贷出现了较大幅度的萎缩，不少高杠杆地产企业面临较大的信用风险，整体经济面临较大的放缓压力与通胀冲击。而 A 股由于对于基本面的担忧有所加大，整体市场出现了较大幅度的调整。当前市场情绪较为低迷，我们认为只有当经济失速风险明显减缓后，市场的风险偏好才能得到有效的缓解。开年以来政策的持续吹风以及 3 月中旬的金稳委会议给市场提振了信心，我们认为随着国内疫情得到有效的控制，

地产政策的边际转暖、基建发力都会大概率提振 2 季度经济，我们认为短期市场风险偏好较低下，更愿意选择当前政策和基本面最为确定、边际变化最为明显的领域，因此我们加大了对于稳增长板块的配置。同时，我们认为中期来看居民对于住房的需求会在一个合理的水平，而在本轮地产企业信用风险之后，经营稳健的地产企业大概率会获得更多的市场份额，地产行业的格局将更加集中，不少经营稳健的地产企业有可能有业绩和估值双升的机会。同时，一些地产产业链的公司也会跟随下游有进一步的集中度提升。由于海外货币政策收紧的预期持续，整体成长股在估值上面临一定的压力，但是我们认为随着国内经济中期转型的逻辑不变，在宏观因素的影响下部分成长股估值如果出现明显的回落之后，整体投资性价比会明显提升，届时我们会选择能够在新的技术创新上能够持续成长的个股进行参与。经过一季度的调整之后，我们看到整体 A 股的估值性价比已经得到了明显的提升，今年国内经济也是一个逐步向好的过程，我们也因此提升了整体权益部分的仓位。但值得注意的是，由于俄乌战争以及大宗商品资本开支不足的影响，整体通胀的压力可能仍然持续，同时联储的加速加息缩表可能也会对美国经济产生较为明显的影响，我们也需要密切关注海外市场带来的进一步的风险。

债券市场方面，1 季度经济压力较大下，央行降低了公开市场操作利率，中短端利率出现明显下行，我们适当的参与了一些交易性的机会。展望后市，我们认为当前在疫情影响不确定性，央行大概率还是会维持宽松的货币政策基调，整体债券市场依然保持较为有利的环境，整体债券市场大幅调整的风险不大。但是后续关注国内经济稳增长的持续性以及后续疫情防控政策方面可能的变化。如果随着经济企稳，债券市场交易性的机会也可能逐步减少。信用风险方面，22 年的形势依然严峻，我们继续严控风险。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期份额净值增长率为-3.26%，同期业绩比较基准增长率为-7.81%。

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	144,472,135.15	18.77
	其中：股票	144,472,135.15	18.77
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	561,171,564.56	72.91

	其中：债券	561,171,564.56	72.91
	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	38,000,000.00	4.94
	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	22,291,949.59	2.90
8	其他资产	3,709,436.30	0.48
9	合计	769,645,085.60	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	2,752,000.00	0.36
C	制造业	75,920,927.19	9.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,861,620.00	0.64
E	建筑业	7,938,000.00	1.04
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	16,541.00	0.00
H	住宿和餐饮业	3,208,800.00	0.42
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,492,672.50	0.46
J	金融业	25,282,500.00	3.30
K	房地产业	20,895,300.00	2.73
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	103,774.46	0.01
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	144,472,135.15	18.88

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	300122	智飞生物	45,000	6,210,000.00	0.81
2	601155	新城控股	190,000	6,112,300.00	0.80
3	601288	农业银行	1,700,000	5,236,000.00	0.68
4	601166	兴业银行	250,000	5,167,500.00	0.68
5	601669	中国电建	700,000	5,103,000.00	0.67
6	002594	比亚迪	21,000	4,825,800.00	0.63
7	000002	万科 A	250,000	4,787,500.00	0.63
8	002271	东方雨虹	95,000	4,269,300.00	0.56
9	300750	宁德时代	8,000	4,098,400.00	0.54
10	601398	工商银行	800,000	3,816,000.00	0.50

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	102,421,435.60	13.39
	其中：政策性金融债	41,142,561.64	5.38
4	企业债券	18,626,981.92	2.43
5	企业短期融资券	273,110,807.66	35.69
6	中期票据	122,982,720.55	16.07
7	可转债（可交换债）	14,255,238.47	1.86
8	同业存单	29,774,380.36	3.89
9	其他	-	-
10	合计	561,171,564.56	73.34

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	072110032	21 申万宏源 CP007	400,000	40,571,934.25	5.30
2	180403	18 农发 03	300,000	30,904,791.78	4.04
3	2120071	21 上海银行	300,000	30,632,281.64	4.00
4	042100465	21 锡产业 CP004	300,000	30,428,235.62	3.98
5	112185315	21 杭州银行 CD140	300,000	29,774,380.36	3.89

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

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值(元)	公允价值变动 (元)	风险说明
IC2204	IC2204	-5	-6,318,200.00	-280.00	-
公允价值变动总额合计（元）					-280.00
股指期货投资本期收益（元）					1,166,778.90
股指期货投资本期公允价值变动（元）					61,357.73

注：无。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低申购赎回时现金资产对投资组合的影响及投资组合仓位调整的交易成本，达到稳定投资组合资产净值的目的。

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

为了更好地实现投资目标本基金在注重风险管理的前提下以套期保值为目的适度运用股指期货、国债期货等金融衍生品本基金利用金融衍生品合约流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点提高投资组合的运作效率

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

申万宏源证券有限公司在报告编制日前一年内受到中国证券监督管理委员会重庆监管局的处罚。上海银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到中国银行保险监督管理委员会上海监管局的处罚。杭州银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到中国银行保险监督管理委员会浙江监管局的处罚。中国农业发展银行在报告编制日前一年内受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。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	962,993.01
2	应收证券清算款	2,745,772.29
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	671.00
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	3,709,436.30

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	110076	华海转债	3,322,631.51	0.43
2	127013	创维转债	1,999,939.73	0.26
3	113050	南银转债	1,193,971.23	0.16
4	110043	无锡转债	1,168,038.08	0.15
5	127020	中金转债	1,150,697.12	0.15
6	123088	威唐转债	1,124,841.64	0.15
7	132021	19 中电 EB	1,071,369.86	0.14
8	113584	家悦转债	1,030,145.21	0.13
9	113589	天创转债	1,003,195.34	0.13
10	123038	联得转债	596,919.32	0.08
11	127033	中装转 2	245,367.27	0.03
12	110073	国投转债	132,233.67	0.02
13	128125	华阳转债	107,842.19	0.01
14	127041	弘亚转债	37,093.39	0.00
15	128122	兴森转债	31,832.13	0.00
16	132017	19 新钢 EB	27,095.34	0.00

17	128135	洽洽转债	12,025.44	0.00
----	--------	------	-----------	------

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	582,969,280.96
报告期期间基金总申购份额	168,781,761.74
减：报告期期间基金总赎回份额	150,961,911.36
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	600,789,131.34

§ 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	20220112~20220112	74,072,958.39	38,225,535.17	-	112,298,493.56	18.69
	2	20220101~20220331	227,616,843.70	38,431,206.76	-	266,048,050.46	44.28
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。

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) 《鹏华金城灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- (二) 《鹏华金城灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- (三) 《鹏华金城灵活配置混合型证券投资基金 2022 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

2022 年 4 月 21 日