鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金
2020 年中期报告

2020 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：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：2020 年 8 月 31 日

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

§1 重要提示及目录

1.1 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 08 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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 01 月 01 日起至 2020 年 06 月 30 日止。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2

1.1 重要提示 2
1.2 目录 3

§2 基金简介 5

2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 6
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 7

§3 主要财务指标和基金净值表现 7

3.1 主要会计数据和财务指标 7
3.2 基金净值表现 7
3.3 其他指标 8

§4 管理人报告 9

4.1 基金管理人及基金经理情况 9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 13

§5 托管人报告 14

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 14

§6 半年度财务会计报告（未经审计） 14

6.1 资产负债表 14
6.2 利润表 15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 17
6.4 报表附注 18

§7 投资组合报告 42

7.1 期末基金资产组合情况 42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 42
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 45

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

7.6 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 45
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 45
7.8 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贵金属投资明细 46
7.9 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 46
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 46
7.12 投资组合报告附注 46

§8 基金份额持有人信息 48

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 48
8.2 期末上市基金前十名持有人 49
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 49
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 49
8.5 发起式基金发起资金持有份额情况 49

§9 重大事件揭示 50

9.1 基金份额持有人大会决议 50
9.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 50
9.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 50
9.4 基金投资策略的改变 50
9.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 50
9.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 50
9.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 50
9.8 其他重大事件 52

§10 影响投资者决策的其他重要信息 55

10.1 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 55
10.2 影响投资者决策的其他重要信息 55

§11 备查文件目录 55

11.1 备查文件目录 55
11.2 存放地点 55
11.3 查阅方式 55

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金
基金简称	鹏华前海万科 REITs
场内简称	鹏华前海
基金主代码	184801
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	2015 年 7 月 6 日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	29,995,915.35 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2015 年 9 月 30 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过投资于目标公司股权参与前海金融创新，力争分享金融创新的红利。
投资策略	基金合同生效后，本基金根据与目标公司及其股东所签订的增资协议等相关协议约定的程序和时间，通过增资方式持有目标公司股权至 2023 年 7 月 24 日，获取自 2015 年 1 月 1 日起至 2023 年 7 月 24 日期间前海企业公馆项目 100%的实际或应当取得的除物业管理费收入之外的营业收入，营业收入依据相关协议约定的业绩补偿机制和激励机制进行调整。前述目标公司的概况、增资入股情况、退出安排、交易结构、业绩补偿机制和激励措施等详见招募说明书。 本基金投资目标公司之外的基金资产可投资于依法发行或上市的股票、债券和货币市场工具等。 1、对于目标公司的投资策略 本基金将审慎论证宏观经济因素（就业、利率、人口结构等）、商业地产周期（供需结构、租金和资产价格波动等）、以及其他可比投资资产项目的风险和预期收益率来判断目标公司持有商业物业当前的投资价值以及未来的发展空间。在此基础上，基金将深入调研目标 公司所持商业物业的基本面（包括位置、质量、资产价格、出租率、租金价格、租户、租约、现金流等）和运营基本面（包括定位、经营策略、租赁能力、物业管理能力等），通过合适的估值方法评估其收益状况和增值潜力、预测现金流收入的规模和建立合适的估值模型。 本基金将根据投资需要参与所投资项目商业运营并代表持有人行使股东权利，并与目标公司服务机构签订相应的股权回购协议以及建立运营绩效保证机制，力争获取稳定的租金收益，具体交易结构详见招募说明书。 2、固定收益资产投资策略 本基金投资目标公司前的基金资产以及投资目标公司后的剩余资产、本基金获得的分红款、本基金对目标公司股权的退出款在按照本《基金合同》

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

	约定进行分配或支付前，可全部投资于依法发行或上市的债券和货币市场工具等固定收益类资产。 本基金将采用持有到期策略构建投资组合，以获取相对确定的目标收益。首先对存款利率、回购利率和债券收益率进行比较，并在对封闭运作期内资金面进行判断的基础上，判断是否存在利差套利空间，以确定是否进行杠杆操作；其次对各类固定收益资产在封闭运作期内的持有期收益进行比较，确定优先配置的资产类别，并结合各类固定收益资产的市场容量，确定配置比例。本基金将对整体固定收益组合久期做严格管理和匹配，完全配合基金合同期限内的允许范围。 投资决策委员会将定期或不定期召开会议，确定本基金固定收益资产各类属的配置比例、组合的杠杆水平等目标区间。本公司信用评估团队依托基金管理人信用分析系统评估债务人的相对违约率并确定个券的信用评级，为本基金的组合构建和调整提供标的建议。本基金将依据投资决策委员会决议和信用分析团队的建议制定具体的配置和调整计划，进行固定收益投资组合的构建和日常管理。 3、权益类资产投资策略 在严格控制风险、保持资产流动性的前提下，本基金将根据发行人的基本面情况，并结合对市场流动性、上市后表现的预期，适当参与股票等权益类投资，以增加基金收益。
业绩比较基准	十年期国债收益率+1.5%
风险收益特征	本基金在封闭运作期内投资于目标公司股权，以获取商业物业租金收益为目标，因此与股票型基金和债券型基金有不同的风险收益特征，本基金预期风险和收益高于债券型基金和货币型基金，低于股票型基金。

注：无。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		鹏华基金管理有限公司	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张戈	胡波
	联系电话	0755-82825720	021-61618888
	电子邮箱	zhangge@phfund.com.cn	Hub5@spdb.com.cn
客户服务电话		4006788999	95528
传真		0755-82021126	021-63602540
注册地址		深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	上海市中山东一路 12 号
办公地址		深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	上海市北京东路 689 号
邮政编码		518048	200001
法定代表人		何如	郑杨

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.phfund.com.cn

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

基金中期报告备置地点	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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020 年 1 月 1 日-2020 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	86,901,475.13
本期利润	72,829,063.40
加权平均基金份额本期利润	2.4280
本期加权平均净值利润率	2.31%
本期基金份额净值增长率	2.34%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	113,245,394.11
期末可供分配基金份额利润	3.7754
期末基金资产净值	3,145,078,815.30
期末基金份额净值	104.850
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	32.39%

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，封闭式基金交易佣金等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

（3）期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润期末余额和未分配利润中已实现部分的期末余额的孰低数。表中的“期末”均指报告期最后一日，即 6 月 30 日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

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

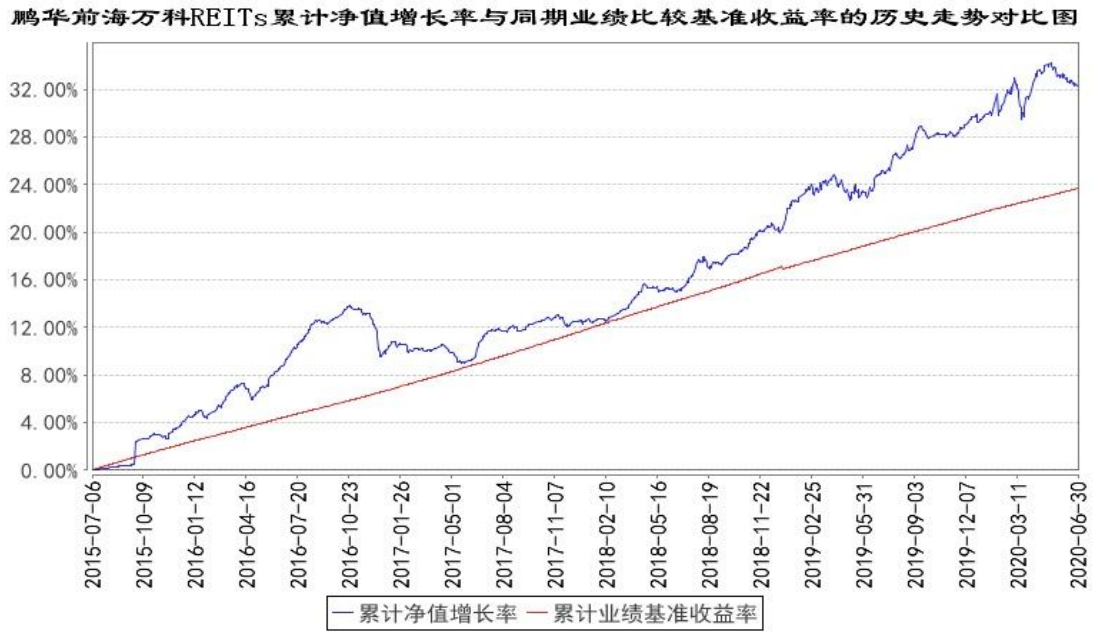
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

过去一个月	-0.40%	0.14%	0.38%	0.01%	-0.78%	0.13%
过去三个月	0.97%	0.16%	1.04%	0.01%	-0.07%	0.15%
过去六个月	2.34%	0.27%	2.12%	0.02%	0.22%	0.25%
过去一年	6.03%	0.21%	4.47%	0.01%	1.56%	0.20%
过去三年	18.87%	0.16%	14.57%	0.01%	4.30%	0.15%
自基金合同生效起至今	32.39%	0.15%	23.69%	0.01%	8.70%	0.14%

注：业绩比较基准=十年期国债收益率+1.5%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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



注：1、本基金基金合同于 2015 年 07 月 06 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。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

鹏华基金管理有限公司成立于 1998 年 12 月 22 日，业务范围包括基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。截止本报告期末，公司股东由国信证券股份有限公司、意大利欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）、深圳市北融信投资发展有限公司组成，公司性质为中外合资企业，注册资本 15,000 万元人民币。截至 2020 年 6 月，公司管理资产总规模达到 7,014.31 亿元，管理 196 只公募基金、12 只全国社保投资组合、4 只基本养老保险投资组合。经过 22 年投资管理基金，在基金投资、风险控制等方面积累了丰富经验。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
尤柏年	本基金基金经理	2015-07-06	-	16 年	尤柏年先生，国籍中国，经济学博士，16 年证券基金从业经验。历任澳大利亚 BConnect 公司 Apex 投资咨询团队分析师，华宝兴业基金管理有限公司金融工程部高级数量分析师、海外投资管理部高级分析师、基金经理助理、华宝兴业成熟市场基金和华宝兴业标普油气基金基金经理等职；2014 年 7 月加盟鹏华基金管理有限公司，历任国际业务部副总经理，现担任国际业务部总经理、基金经理。2014 年 08 月担任鹏华全球高收益债基金基金经理，2014 年 09 月至 2020 年 01 月担任鹏华环球发现（QDII-FOF）基金基金经理，2015 年 07 月担任鹏华前海万科 REITs 基金基金经理，2016 年 12 月担任鹏华沪深港新兴成长混合基金基金经理，2017 年 11 月担任鹏华港美互联股票（LOF）基金基金经理，2017 年 11 月至 2019 年 08 月担任鹏华香港银行指数(LOF)基金基金经理，2017 年 11 月担任鹏华香港中小企业指数(LOF)基金基金经理，2020 年 01 月担任鹏华全球中短债债券（QDII）基金基金经理。尤柏年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。
刘方正	本基金基金经理	2015-08-06	-	10 年	刘方正先生，国籍中国，理学硕士，10 年证券基金从业经验。2010 年 6 月加盟鹏华

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

					基金管理有限公司，从事债券研究工作，历任固定收益部高级研究员、基金经理助理，现任稳定收益投资部总经理助理、基金经理。2015 年 03 月至 2017 年 01 月担任鹏华弘利混合基金基金经理，2015 年 03 月至 2015 年 08 月担任鹏华行业成长基金基金经理，2015 年 04 月至 2017 年 01 月担任鹏华弘润混合基金基金经理，2015 年 05 月担任鹏华弘华混合基金基金经理，2015 年 05 月担任鹏华弘和混合基金基金经理，2015 年 05 月至 2017 年 01 月担任鹏华弘益混合基金基金经理，2015 年 06 月至 2017 年 01 月担任鹏华弘鑫混合基金基金经理，2015 年 08 月担任鹏华前海万科 REITs 基金基金经理，2015 年 08 月至 2017 年 01 月担任鹏华弘泰混合基金基金经理，2016 年 03 月担任鹏华弘信混合基金基金经理，2016 年 03 月至 2017 年 05 月担任鹏华弘实混合基金基金经理，2016 年 03 月至 2018 年 05 月担任鹏华弘锐混合基金基金经理，2016 年 08 月担任鹏华弘达混合基金基金经理，2016 年 08 月至 2017 年 12 月担任鹏华弘嘉混合基金基金经理，2016 年 09 月担任鹏华弘惠混合基金基金经理，2016 年 11 月至 2018 年 01 月担任鹏华兴裕定开混合基金基金经理，2016 年 11 月担任鹏华兴泰定期开放混合基金基金经理，2016 年 12 月担任鹏华兴悦定期开放混合基金基金经理，2017 年 09 月至 2018 年 08 月担任鹏华兴益定期开放混合基金基金经理，2018 年 05 月担任鹏华睿投混合基金基金经理。刘方正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。

4.1.3 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遵规守信情况的说明

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

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金持有的项目公司物业万科前海企业公馆在 2020 年上半年完成总收入 9,548 万元。其中公馆租赁收入占总收入的 96%，会议中心等其他收入合计占 4%。

2020 年上半年，受新冠疫情突发因素的影响，宏观经济在去年四季度触底企稳回升的周期被打乱，总需求在春节以后快速冻结，三四月份开始逐步缓解，二季度中后期快速回升。其中，疫情对居民生活行为产生的影响远大于工业层面，需要通过人与人互动形成的需求受抑制非常明显，依赖于服务业的居民收入显著回落，社会零售品销售总额等宏观层面的数据恢复的非常缓慢。另外一方面，为了对冲居民部门需求回落对经济的冲击，政府为主导的经济构成部分有较为强烈的加杠杆动力。货币政策保持一段时间非常宽松的状态，财政政策主导了需求的扩张。基建投资有明显抬升，国有企业的投资也有所提高，制造业投资受民营企业投资的拖累恢复稍显缓慢。货币宽松过程中，房地产市场的需求也有显著扩张，销售和投资都呈现了不错的趋势。金融数据方面，央行引导信用扩张，社融同比增速快速上升，并且辅之以精准投放，信用扩张的趋势较为显著。

2020 年上半年，权益市场经历了较大幅度的震荡，总体指数上行为主，中间受到国内疫情爆发和海外疫情爆发等多次事件冲击，指数均有较大幅度且快速的调整，其后均有一定程度的回升修复。市场风格方面，受益于货币政策的宽松和风险偏好水平的提高，创业板和科创板等科技板块表现相对强势，上涨幅度较大，以上证 50 为代表的大市值股票在经济需求回落过程中表现较弱，市场风格明显向中小市值偏离。债券市场也受到了疫情较大程度的影响，疫情爆发以后，全

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

球进入流动性极度宽松和总需求快速回落的过程中，债券收益率快速大幅度下行，海外收益率维持在极低水平，国内来讲，疫情受到严格控制以后总需求快速回升，极度宽松的货币环境下金融套利较多，因此，国内流动性有所收缩，债券收益率又在二季度经受一波大幅度的调整。

本基金以追求稳定收益为主要投资策略，控制基金净值回撤幅度。在操作上，保持稳健的中短久期债券资产配置，以固定收益类资产为主要方向，在严格控制整体仓位的前提下，少量参与股票二级市场投资，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。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2020 年上半年前海万科 REITS 组合净值增长率为 2.34%，同期业绩基准增长率为 2.12%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，我们认为宏观经济仍将延续二季度以来的反弹趋势，但边际增速将有明显回落，一方面，新冠病毒疫苗或特效药研制成功以前，社会活动仍将受到明显抑制，居民收入也将受到明显影响，消费回升将面临较大压力。另一方面，中美关系受美国大选影响越来越严重，外需大概率将面临较大的波动。目前来看，政府代表的基建和国有企业投资确定性最高，对整体投资起到支撑作用，房地产短期来看仍具备一定向上恢复惯性，在房地产限制政策趋严的基础上，持续时间需逐月观察。政府加杠杆仍是确定性最高的方向，外需尤其是科技方向将面临较大不确定性，居民收入和消费将在较长时期内受到抑制。

在此情况下，我们认为，权益市场受政策鼓励且流动性环境舒适的情况下，大概率是利好向上的，但其中部分热门板块也面临估值处于历史偏高水平的风险。在企业盈利温和修复和流动性相对宽松的环境下，市场风格较难出现大幅度的切换，大概率仍利好中小市值方向，部分周期低估值方向或将有部分切换机会。债券方面，近期收益率调整相对充分，金融体系内流动性受金融杠杆抬头的影响暂时有所收紧，但经济总需求偏弱的情况下，货币大幅收紧的可能性较低，中短久期资产仍是获得确定性收益的最优资产，中长久期受经济回暖和信用扩张的抑制较为显著，方向存在较大的不确定性。

未来我们仍将坚持稳健的投资策略，稳步增加固定收益率资产配置，保持中高仓位、中短久期的债券配置，严控仓位情况下适当参与股票市场，并通过参与新股、可转债、可交换债网下申购等投资，追求稳定的投资收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

（1）日常估值流程

基金的估值由基金会计负责，基金会计对公司所管理的基金以基金为会计核算主体，独立建账、独立核算，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账簿记录等方面相互独立。基金会计核算独立于公司会计核算。基金会计核算采用专用的财务核算软件系统进行基金核算及帐务处理；每日按时接收成交数据及权益数据，进行基金估值。基金会计核算采用基金管理公司与托管银行双人同步独立核算、相互核对的方式，每日就基金的会计核算、基金估值等与托管银行进行核对；每日估值结果必须与托管行核对一致后才能对外公告。基金会计除设有专职基金会计核算岗外，还设有基金会计复核岗位，负责基金会计核算的日常事后复核工作，确保基金净值核算无误。

配备的基金会计具备会计资格和基金从业资格，在基金核算与估值方面掌握了丰富的知识和经验，熟悉及了解基金估值法规、政策和方法。

（2）特殊业务估值流程

根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》的相关规定，本公司成立停牌股票等没有市价的投资品种估值小组，成员由基金经理、行业研究员、监察稽核部、金融工程师、登记结算部相关人员组成。

2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理不参与或决定基金日常估值。

基金经理参与估值小组对停牌股票估值的讨论，发表相关意见和建议，与估值小组成员共同商定估值原则和政策。

3、本公司参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1、截止本报告期末，本基金期末可供分配利润为 113,245,394.11 元，期末基金份额净值 104.850 元。

2、本基金于 2020 年 1 月 14 日进行利润分配，分配金额为 237,327,683.49 元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

该基金本报告期内进行了一次利润分配，分配金额为 237,327,683.49 元。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由鹏华基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	15,353,372.94	66,579,213.30
结算备付金		146,406,600.20	145,936,184.26
存出保证金		648,211.24	902,903.07
交易性金融资产	6.4.7.2	4,572,647,183.87	4,466,279,334.51
其中：股票投资		302,174,850.37	121,947,263.81
基金投资		-	-
债券投资		4,250,472,333.50	4,324,332,070.70
资产支持证券投资		20,000,000.00	20,000,000.00
贵金属投资		-	-

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	79,465,689.66	65,450,063.33
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	679,950,893.28	776,350,000.00
资产总计		5,494,471,951.19	5,521,497,698.47
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2020 年 6 月 30 日**	**上年度末 2019 年 12 月 31 日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		2,341,000,000.00	2,151,900,000.00
应付证券清算款		4,764,238.46	55,716,582.73
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,680,359.13	1,826,796.35
应付托管费		258,516.80	281,045.60
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	475,535.01	602,593.41
应交税费		355,724.41	446,547.74
应付利息		80,664.09	119,606.08
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	778,097.99	1,027,091.17
负债合计		2,349,393,135.89	2,211,920,263.08
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	2,999,591,557.72	2,999,591,557.72
未分配利润	6.4.7.10	145,487,257.58	309,985,877.67
所有者权益合计		3,145,078,815.30	3,309,577,435.39
负债和所有者权益总计		5,494,471,951.19	5,521,497,698.47

注： 报告截止日 2020 年 06 月 30 日，基金份额净值 104.850 元，基金份额总额 29,995,915.35 份。

6.2 利润表

会计主体：鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

		2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		118,645,120.84	180,034,181.35
1.利息收入		81,635,649.90	79,302,495.93
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,434,295.47	1,465,665.27
债券利息收入		79,813,042.30	77,836,830.66
资产支持证券利息收入		385,157.28	-
买入返售金融资产收入		3,154.85	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		26,501,572.28	51,600,808.24
其中：股票投资收益	6.4.7.12	8,193,860.31	13,505,328.15
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	9,366,593.59	28,795,168.90
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	8,941,118.38	9,300,311.19
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-14,072,411.73	-10,017,732.32
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	24,580,310.39	59,148,609.50
减：二、费用		45,816,057.44	56,595,487.41
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	10,186,701.65	10,213,742.38
2．托管费	6.4.10.2.2	1,567,184.89	1,571,345.01
3．销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4．交易费用	6.4.7.19	2,162,057.77	4,514,437.55
5．利息支出		28,098,863.06	36,510,232.76
其中：卖出回购金融资产支出		28,098,863.06	36,510,232.76
6．税金及附加		270,507.34	238,316.66
7．其他费用	6.4.7.20	3,530,742.73	3,547,413.05
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		72,829,063.40	123,438,693.94
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		72,829,063.40	123,438,693.94

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,999,591,557.72	309,985,877.67	3,309,577,435.39
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	72,829,063.40	72,829,063.40
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-237,327,683.49	-237,327,683.49
五、期末所有者权益（基金净值）	2,999,591,557.72	145,487,257.58	3,145,078,815.30
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,999,591,557.72	294,227,389.39	3,293,818,947.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	123,438,693.94	123,438,693.94
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-	-	-

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

（净值减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-222,899,647.73	-222,899,647.73
五、期末所有者权益(基金净值)	2,999,591,557.72	194,766,435.60	3,194,357,993.32

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

邓召明	苏波	郝文高
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]1116 号《关于准予鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金注册的批复》核准，由鹏华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型基金，在基金合同生效后十年内(含十年)封闭运作，在深圳证券交易所(以下简称“深交所”)上市交易，封闭期结束后转为上市开放式基金(LOF)，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 2,998,986,947.73 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第 878 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2015 年 7 月 6 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,999,591,557.72 份基金份额，其中认购资金利息折合 604,609.99 份基金份额。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。根据中国证监会基金部通知[2012]22 号《关于增设发起式基金审核通道有关问题的通知》，本基金在募集时，使用发起资金认购的金额不少于人民币 10,000,000.00 元，且发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。另根据《投资顾问协议》，本基金的投资顾

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

问及基石投资人深圳市前海金融控股有限公司以自有资金人民币 300,000,000.00 元认购本基金基金份额，自基金合同生效之日起 2 年内不得转让。

经深交所深证上[2015]432 号文审核同意，本基金 3,033,156.00 份基金份额于 2015 年 9 月 30 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人可通过本基金代销机构赎回或通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后进行上市交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金封闭运作期内按照基金合同的约定投资于确定的、单一的目标公司股权。本基金的其他基金资产可以投资于固定收益类资产(具体包括：国债、金融债、企业(公司)债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、资产支持证券、债券回购、银行存款等)、现金，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金同时可参与股票、权证等权益类资产的投资。其中目标公司是指深圳市万科前海公馆建设管理有限公司及其组织形式变更后的实体(以下简称“目标公司”)。本基金对目标公司投资前，目标公司为深圳市万科房地产有限公司全资持股的有限责任公司。本基金对目标公司投资后，目标公司将按照约定变更为股份有限公司。基金合同生效后，本基金根据与目标公司及其股东所签订的增资协议等相关协议约定的程序和时间，通过增资方式持有目标公司股权至 2023 年 7 月 24 日，获取自 2015 年 1 月 1 日起至 2023 年 7 月 24 日期间前海企业公馆项目 100%的实际或应当取得的除物业管理费收入之外的营业收入，营业收入依据相关协议约定的业绩补偿机制和激励机制进行调整。本基金投资于确定的、单一的目标公司股权的比例不超过基金资产的 50%，投资于固定收益类资产、权益类资产等的比例不低于基金资产的 50%。本基金的业绩比较基准：十年期国债收益率+1.5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则－基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年上半年财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2020 年 06 月 30 日的财务状况以及 2020 年上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融　房地产开发　教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)　资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2)　对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
活期存款	15,353,372.94
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	15,353,372.94

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2020 年 6 月 30 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		309,133,211.78	302,174,850.37	-6,958,361.41
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	3,992,044,020.67	4,029,390,333.50	37,346,312.83
	银行间市场	219,441,573.92	221,082,000.00	1,640,426.08
	合计	4,211,485,594.59	4,250,472,333.50	38,986,738.91
资产支持证券		20,000,000.00	20,000,000.00	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		4,540,618,806.37	4,572,647,183.87	32,028,377.50

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	5,346.58
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	59,294.61
应收债券利息	78,855,032.52
应收资产支持证券利息	545,753.42
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	262.53
合计	79,465,689.66

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
其他应收款	-
待摊费用	123,356.28
目标公司投资	679,827,537.00
合计	679,950,893.28

注：物业收益权公允价值根据现金流量折现模型确定。截至 2020 年 6 月 30 日止，物业收益权成本为 679,614,051.03 元，公允价值变动为 213,485.97 元。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	474,485.01
银行间市场应付交易费用	1,050.00

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

合计	475,535.01

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	261,064.44
应付投资顾问费	517,033.55
合计	778,097.99

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	29,995,915.35	2,999,591,557.72
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	29,995,915.35	2,999,591,557.72

注：根据《鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金招募说明书》的相关规定，本基金合同生效后(2015 年 7 月 6 日)十年之内(含十年)为封闭期，在此期间投资人不能申购、赎回基金份额，但可在本基金上市交易后通过深圳证券交易所买卖基金份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	263,671,602.47	46,314,275.20	309,985,877.67
本期利润	86,901,475.13	-14,072,411.73	72,829,063.40
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-237,327,683.49	-	-237,327,683.49
本期末	113,245,394.11	32,241,863.47	145,487,257.58

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	166,784.13
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,261,455.30
其他	6,056.04
合计	1,434,295.47

注：其他包含认/申购款利息收入，结算保证金利息收入等。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	8,193,860.31
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	8,193,860.31

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	667,963,704.91
减：卖出股票成本总额	659,769,844.60
买卖股票差价收入	8,193,860.31

6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	9,366,593.59

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	9,366,593.59

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	673,304,480.53
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	635,650,922.54
减：应收利息总额	28,286,964.40
买卖债券差价收入	9,366,593.59

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	8,941,118.38
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	8,941,118.38

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-11,855,015.82
股票投资	-13,410,016.60
债券投资	1,555,000.78
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2.衍生工具	-
权证投资	-
3.其他	-2,217,395.91
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-14,072,411.73

注：其他为目标公司投资公允价值变动收益。

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
房地产投资收益	24,580,310.39
合计	24,580,310.39

注：目标公司投资投资收益为物业收益权收益。根据《鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金招募说明书》目标公司投资收益为本基金根据与目标公司及其股东所签订的增资协议等相关协议约定的程序和时间，通过增资方式持有目标公司股权至 2023 年 7 月 24 日，获取自 2015 年 1 月 1 日起至 2023 年 7 月 24 日期间前海企业公馆项目 100%的实际或应当取得的扣除物业管理费收入之外的营业收入，营业收入依据相关协议约定的业绩补偿机制和激励机制进行调整。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	2,160,782.77
银行间市场交易费用	1,275.00
合计	2,162,057.77

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
审计费用	109,398.38
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行汇划费用	2,737.15
账户维护费	18,000.00
上市年费	29,835.26
其他	600.00
分红手续费	113,971.40
评估费	62,158.46
投资顾问费	3,134,369.74
合计	3,530,742.73

6.4.7.21 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
鹏华基金管理有限公司（“鹏华基金公司”）	基金发起人、基金管理人、基金销售机构
上海浦东发展银行股份有限公司（“上海浦东发展银行”）	基金托管人、基金代销机构
国信证券股份有限公司（“国信证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
深圳市前海金融控股有限公司（“前海金控”）	《合作框架协议》其他签订方、基石投资人、基金投资顾问

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注：无。

6.4.10.1.2 债券交易

注：无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

6.4.10.1.4 权证交易

注：无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：无。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	10,186,701.65	10,213,742.38
其中：支付销售机构的客户维护费	477,540.34	457,724.59

注：1、支付基金管理人鹏华基金公司的管理人报酬年费率为 0.65%，逐日计提，按月支付。日管理费＝前一日基金资产净值×0.65%÷当年天数。

2、根据《开放式证券投资基金销售费用管理规定》，基金管理人依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，客户维护费从基金管理费中列支。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,567,184.89	1,571,345.01

注：支付基金托管人浦发银行的托管费年费率为 0.10%，逐日计提，按月支付。日托管费＝前一日基金资产净值×0.10%÷当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：无。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2015 年 7 月 6 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	100,027.00	100,027.00
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	100,027.00	100,027.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.3335%	0.3335%

注：本基金管理人投资本基金的费率标准与其他相同条件的投资者适用的费率标准相一致。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例（%）	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例（%）
前海金控	3,000,405.00	10.00	3,000,405.00	10.00

注：除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的费率标准与其他相同条件的投资者适用的费率标准相一致。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
上海浦东发展银行	15,353,372.94	166,784.13	10,478,865.57	262,528.76

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在报告期内未参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金支付基金投资顾问前海金控的投资顾问费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费＝前一日基金资产净值 X0.20%÷当年天数。

本基金本报告期发生的投资顾问费为人民币 3,134,369.74 元。于 2020 年 6 月 30 日，本基金需支付的投资顾问费余额为人民币 517,033.55 元。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2020 年 1 月 14 日	2020 年 01 月 15 日	2020 年 01 月 14 日	79.1200	237,327,683.49	-	237,327,683.49	-
合计	-	-	-	79.1200	237,327,683.49	-	237,327,683.49	-

6.4.12 期末(2020 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300840	酷特智能	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 8 日	新股未上市	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-
300843	胜蓝股份	2020 年 6 月 23	2020 年 7 月 2	新股未上市	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

		日	日							
300845	捷安高科	2020 年 6 月 24 日	2020 年 7 月 3 日	新股未上市	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-
300846	首都在线	2020 年 6 月 22 日	2020 年 7 月 1 日	新股未上市	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-
300847	中船汉光	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 9 日	新股未上市	6.94	6.94	1,421	9,861.74	9,861.74	-
601816	京沪高铁	2020 年 1 月 8 日	2020 年 7 月 16 日	锁定期股票	4.88	6.17	906,536	4,423,895.68	5,593,327.12	-
603186	华正新材	2020 年 5 月 29 日	2020 年 11 月 30 日	锁定期股票	51.20	45.10	97,656	4,999,987.20	4,404,285.60	-
688027	国盾量子	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 9 日	新股未上市	36.18	36.18	2,830	102,389.40	102,389.40	-
688208	道通科技	2020 年 2 月 6 日	2020 年 8 月 13 日	锁定期股票	24.36	54.23	14,165	345,059.40	768,167.95	-
688277	天智航-U	2020 年 6 月 24 日	2020 年 7 月 7 日	新股未上市	12.04	12.04	8,810	106,072.40	106,072.40	-
688377	迪威尔	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 8 日	新股未上市	16.42	16.42	7,894	129,619.48	129,619.48	-
688398	赛特新材	2020 年 2 月 3 日	2020 年 8 月 11 日	锁定期股票	24.12	54.47	3,246	78,293.52	176,809.62	-
688520	神州细胞-U	2020 年 6 月 11	2020 年 12 月 22	锁定期股票	25.64	58.82	12,351	316,679.64	726,485.82	-

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

		日	日							
688528	秦川物联	2020 年 6 月 19 日	2021 年 01 月 04 日	锁定期股票	11.33	11.33	8,337	94,458.21	94,458.21	-
688568	中科星图	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 8 日	新股未上市	16.21	16.21	11,020	178,634.20	178,634.20	-
688600	皖仪科技	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 3 日	新股未上市	15.50	15.50	5,468	84,754.00	84,754.00	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
163690	20 铁工 Y5	2020 年 6 月 24 日	2020 年 7 月 3 日	新债未上市	100.00	100.00	1,000,000	100,000,000.00	100,000,000.00	-
163696	20 建二 Y1	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 8 日	新债未上市	100.00	100.00	1,500,000	150,000,000.00	150,000,000.00	-

注：1、基金可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股份，自股份解除限售之日起 12 个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过其持有该次非公开发行股份数量的 50%；采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。此外，本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

2、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起约定限售期内不得转让。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

3、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 06 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 2,341,000,000.00 元，于 2020 年 07 月 01 日、2020 年 07 月 06 日、2020 年 07 月 07 日（先后）到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型证券投资基金。本基金投资的金融工具主要包括确定的、单一的目标公司股权、股票投资、债券投资及权证投资等。

本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人致力于全面内部控制体系的建设，建立了从董事会层面到各业务部门的风险管理组织架构。本基金的基金管理人在董事会下设风险控制和合规审计委员会，主要负责制定基金管理人风险控制战略和控制政策、协调突发重大风险等事项；督察长负责对基金管理人各业务环节合法合规运作进行监督检查，组织、指导基金管理人内部监察稽核工作，并可向董事会和中国证监会直接报告；在公司内部设立独立的监察稽核部，专职负责对基金管理人各部门、各业务

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

的风险控制情况进行督促和检查，并适时提出整改建议。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行上海浦东发展银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。

本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券占基金资产净值的比例为 135.78%（2019 年 12 月 31 日:131.27%）。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	20,000,000.00	20,000,000.00
未评级	-	-

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

合计	20,000,000.00	20,000,000.00

注：A-1 以下包含发行期限小于 1 年的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
AAA	3,819,434,400.00	3,700,238,350.20
AAA 以下	431,037,933.50	624,093,720.50
未评级	-	-
合计	4,250,472,333.50	4,324,332,070.70

注：未评级债券包括国债、中央银行票据和政策性金融债。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

--

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理职能部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2020 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额 2,341,000,000.00 元将在一个月内到期且计息外，本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注“期末本基金持有的流通受限证券”。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，此外还持有银行存款、结算备付金等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	15,353,372.94	-	-	-	15,353,372.94
结算备付金	146,406,600.20	-	-	-	146,406,600.20
存出保证金	648,211.24	-	-	-	648,211.24
交易性金融资产	664,666,330.00	3,604,796,142.00	1,009,861.50	302,174,850.37	4,572,647,183.87
应收利息	-	-	-	79,465,689.66	79,465,689.66
其他资产	241,207,798.78	438,619,738.22	-	123,356.28	679,950,893.28
资产总计	1,068,282,313.16	4,043,415,880.22	1,009,861.50	381,763,896.31	5,494,471,951.19
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	1,680,359.13	1,680,359.13
应付托管费	-	-	-	258,516.80	258,516.80
应付证券清算款	-	-	-	4,764,238.46	4,764,238.46

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

卖出回购金融资产款	2,341,000,000.00	-	-	-	2,341,000,000.00
应付销售服务费	-	-	-	517,033.55	517,033.55
应付交易费用	-	-	-	475,535.01	475,535.01
应付利息	-	-	-	80,664.09	80,664.09
应交税费	-	-	-	355,724.41	355,724.41
其他负债	-	-	-	261,064.44	261,064.44
负债总计	2,341,000,000.00	-	-	8,393,135.89	2,349,393,135.89
利率敏感度缺口	-1,272,717,686.84	4,043,415,880.22	1,009,861.50	373,370,760.42	3,145,078,815.30
上年度末 2019 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	66,579,213.30	-	-	-	66,579,213.30
结算备付金	145,936,184.26	-	-	-	145,936,184.26
存出保证金	902,903.07	-	-	-	902,903.07
交易性金融资产	758,835,800.00	3,577,912,616.60	7,583,654.10	121,947,263.81	4,466,279,334.51
应收利息	-	-	-	65,450,063.33	65,450,063.33
其他资产	257,610,000.00	518,740,000.00	-	-	776,350,000.00
资产总计	1,229,864,100.63	4,096,652,616.60	7,583,654.10	187,397,327.14	5,521,497,698.47
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	1,826,796.35	1,826,796.35
应付托管费	-	-	-	281,045.60	281,045.60
应付证券清算款	-	-	-	55,716,582.73	55,716,582.73
卖出回购金融资产款	2,151,900,000.00	-	-	-	2,151,900,000.00
应付交易费用	-	-	-	602,593.41	602,593.41
应付利息	-	-	-	119,606.08	119,606.08
应交税费	-	-	-	446,547.74	446,547.74
其他负债	-	-	-	1,027,091.17	1,027,091.17
负债总计	2,151,900,000.00	-	-	60,020,263.08	2,211,920,263.08
利率敏感度缺口	-922,035,899.37	4,096,652,616.60	7,583,654.10	127,377,064.06	3,309,577,435.39

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有债券资产的利率风险状况测算的理论变动值对基金资产净值的影响金额。	
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。	
	此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。	
	相关风险变量的变	对资产负债表日基金资产净值的

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

	动	影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 （2020 年 6 月 30 日）	上年度末 （2019 年 12 月 31 日 ）
分析	市场利率下降 25 个基点	13,614,476.64	20,845,486.24
	市场利率上升 25 个基点	-13,524,081.62	-20,695,613.87

注：无。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注:无。

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。

本基金投资于确定的、单一的目标公司股权的比例不超过基金资产的 50%，投资于固定收益类资

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

产、权益类资产等的比例不低于基金资产的 50%。

此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR（Value at Risk）指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	302,174,850.37	9.61	121,947,263.81	3.68
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	32,309,503.50	1.03	39,450,330.70	1.19
交易性金融资产－贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	334,484,353.87	10.64	161,397,594.51	4.88

注：债券投资为可转换债券、可交换债券投资。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注:于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值比例为 10.64%（2019 年 12 月 31 日：4.72%）,因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响（2019 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	302,174,850.37	5.50
	其中：股票	302,174,850.37	5.50
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,270,472,333.50	77.72
	其中：债券	4,250,472,333.50	77.36
	资产支持证券	20,000,000.00	0.36
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	161,759,973.14	2.94
8	其他各项资产	760,064,794.18	13.83
9	合计	5,494,471,951.19	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	52,196,381.69	1.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	5,593,327.12	0.18
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	190,731.77	0.01
J	金融业	171,816,081.47	5.46
K	房地产业	72,365,562.00	2.30
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	-	-

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	302,174,850.37	9.61

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

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	601988	中国银行	14,062,500	48,937,500.00	1.56
2	601288	农业银行	13,979,600	47,251,048.00	1.50
3	000651	格力电器	800,000	45,256,000.00	1.44
4	601398	工商银行	8,977,735	44,709,120.30	1.42
5	600048	保利地产	2,600,000	38,428,000.00	1.22
6	000002	万 科A	1,298,300	33,937,562.00	1.08
7	601939	建设银行	4,899,907	30,918,413.17	0.98
8	601816	京沪高铁	906,536	5,593,327.12	0.18
9	603186	华正新材	97,656	4,404,285.60	0.14
10	688208	道通科技	14,165	768,167.95	0.02
11	688520	神州细胞-U	12,351	726,485.82	0.02
12	688568	中科星图	11,020	178,634.20	0.01
13	688398	赛特新材	3,246	176,809.62	0.01
14	688558	国盛智科	3,565	157,929.50	0.01
15	688377	迪威尔	7,894	129,619.48	0.00
16	603087	甘李药业	1,076	107,922.80	0.00
17	688277	天智航-U	8,810	106,072.40	0.00
18	688027	国盾量子	2,830	102,389.40	0.00
19	688528	秦川物联	8,337	94,458.21	0.00
20	688600	皖仪科技	5,468	84,754.00	0.00
21	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.00
22	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.00
23	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.00
24	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.00
25	300847	中船汉光	1,421	9,861.74	0.00
26	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
27	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
28	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
29	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.00

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600048	保利地产	90,103,194.14	2.72
2	000651	格力电器	84,262,687.17	2.55
3	000581	威孚高科	81,227,155.54	2.45
4	000671	阳 光 城	58,375,966.54	1.76
5	000889	中嘉博创	52,447,655.86	1.58
6	600028	中国石化	51,872,510.25	1.57
7	000002	万 科A	46,567,965.25	1.41
8	000338	潍柴动力	43,623,779.02	1.32
9	600031	三一重工	37,716,433.00	1.14
10	000961	中南建设	29,743,536.64	0.90
11	601318	中国平安	25,028,934.88	0.76
12	002142	宁波银行	23,322,653.00	0.70
13	600027	华电国际	21,350,972.80	0.65
14	601988	中国银行	21,155,920.00	0.64
15	601288	农业银行	20,633,238.00	0.62
16	600036	招商银行	19,833,030.40	0.60
17	601398	工商银行	19,607,482.58	0.59
18	601088	中国神华	19,146,885.60	0.58
19	300441	鲍斯股份	14,973,374.00	0.45
20	601939	建设银行	14,668,534.71	0.44

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000581	威孚高科	81,988,621.74	2.48
2	000671	阳 光 城	55,002,338.89	1.66
3	000889	中嘉博创	54,777,650.91	1.66
4	600048	保利地产	51,132,863.74	1.54
5	600028	中国石化	48,165,784.07	1.46
6	000338	潍柴动力	40,155,448.08	1.21
7	600031	三一重工	40,102,306.73	1.21
8	000651	格力电器	36,702,507.81	1.11
9	000961	中南建设	26,369,933.57	0.80
10	601318	中国平安	24,449,553.55	0.74
11	600027	华电国际	22,484,330.60	0.68
12	002142	宁波银行	20,121,003.19	0.61
13	600036	招商银行	20,004,015.93	0.60

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

14	601088	中国神华	19,733,875.90	0.60
15	300441	鲍斯股份	15,141,696.60	0.46
16	600104	上汽集团	11,323,531.93	0.34
17	000002	万 科A	10,318,842.00	0.31
18	601328	交通银行	8,375,754.00	0.25
19	600016	民生银行	6,922,242.00	0.21
20	601009	南京银行	6,279,022.00	0.19

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	853,407,447.76
卖出股票收入（成交）总额	667,963,704.91

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	397,602,300.00	12.64
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	3,599,478,530.00	114.45
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	221,082,000.00	7.03
7	可转债（可交换债）	32,309,503.50	1.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,250,472,333.50	135.15

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	155047	18 华泰 G1	2,700,000	274,077,000.00	8.71
2	112273	15 金街 01	2,640,000	269,755,200.00	8.58
3	112960	19 深能 Y1	2,600,000	262,886,000.00	8.36
4	155057	G18 龙源 2	2,300,000	233,289,000.00	7.42
5	136014	15 福投债	2,000,000	200,880,000.00	6.39

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	165015	企发 01A	200,000	20,000,000.00	0.64

7.8 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贵金属投资明细

注：无。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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

华泰证券

关于华泰证券 2020 年 2 月 10 日处罚：未按规定履行客户识别义务；未按规定报送可疑交易报告；与不明的客户进行交易，中国人民银行对公司做出 1010 万元的处罚。

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。

中国建筑第二工程局有限公司：

2020 年春节前，南京市出现建筑施工企业拖欠薪酬，引发数起群体性讨薪事件。2020 年 4 月 23 日，南京市建委通报了一批欠薪建筑企业及个人名单，宣布将对其中 47 家建筑施工企业（个人）

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

限制市场准入，其中包括中国建筑第二工程局有限公司。47 家被全市限制市场准入的企业和个人，在通知发布三个月后，可以携带解除限制市场准入申请、整改报告和双倍缴存民工工资保证金保函等资料到南京市清欠办申请解除市场准入限制。二局对单一城市的依赖度较低，且处罚时间仅三个月，对于公司的经营以及本期债券的偿付无影响。

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。上述通告对该公司债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。

华泰证券

关于对华泰证券股份有限公司采取责令改正监督管理措施的决定（20190823），具体如下：

华泰证券股份有限公司：

经查，你公司在代销“聚潮资产-中科招商新三板 I 期 A、B 专项资管计划”过程中，存在使用未经报备的宣传推介材料的情形。该行为违反《证券公司代销金融产品管理规定》第十条的规定，反映出你公司内部控制不完善。

根据《证券公司监督管理条例》第七十条的规定，我局决定对你公司采取责令改正的监督管理措施。你公司应采取切实有效措施，完善内部控制，并于收到本决定之日起 30 日内向我局提交书面整改报告。

如对本监督管理措施不服的，可以在收到本决定之日起 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，上述行政监管措施不停止执行。

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。上述通告对该公司债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。

7.12.2 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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	648,211.24
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	79,465,689.66

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	123,356.28
8	其他	679,827,537.00
9	合计	760,064,794.18

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	128035	大族转债	22,972,934.80	0.73
2	128032	双环转债	5,403,440.00	0.17
3	113527	维格转债	885,600.00	0.03
4	113537	文灿转债	837,792.20	0.03
5	110062	烽火转债	673,434.00	0.02
6	123017	寒锐转债	628,300.00	0.02
7	113014	林洋转债	557,167.60	0.02
8	110060	天路转债	208,291.50	0.01
9	110061	川投转债	128,136.00	0.00
10	113012	骆驼转债	14,407.40	0.00

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	601816	京沪高铁	5,593,327.12	0.18	锁定期股票
2	603186	华正新材	4,404,285.60	0.14	锁定期股票
3	688208	道通科技	768,167.95	0.02	锁定期股票

7.12.6 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。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
1,818	16,499.40	26,817,871.47	89.41	3,178,043.88	10.59

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	平安银行-东海证券 1 号定向资产管理计划	4,744,057.00	58.44
2	陈穗强	400,014.00	4.93
3	中信信托有限责任公司－企业年金资金信托 12	373,354.00	4.60
4	陈阳薇	300,061.00	3.70
5	吴姣梅	61,000.00	0.75
6	泰康人寿保险有限责任公司－万能－个险万能（乙）	42,100.00	0.52
7	泰康资管－工商银行－泰康资产管理有限责任公司 FOF 稳赢 1 号资产管理产品	40,500.00	0.50
8	何燕	39,000.00	0.48
9	周英飚	36,890.00	0.45
10	江西省出版集团公司企业年金计划－中信银行股份有限公司	36,400.00	0.45

注：持有人为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：截止本报告期末，本基金管理人所有从业人员未持有本基金份额。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

注：截止本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人及本基金的基金经理未持有本基金份额。

8.5 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	100,027.00	0.33	100,027.00	0.33	三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	3,000,405.00	10.00	-	-	二年

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

合计	3,100,432.00	10.33	100,027.00	0.33	-

注：1、本基金自 2015 年 6 月 26 日至 2015 年 7 月 1 日止期间公开发售，于 2015 年 7 月 6 日基金合同正式生效。

2、本基金管理人在募集期间认购本基金份额 10,002,700.27 份，2015 年 9 月 18 日本基金经折算后的份额为 100,027 份。

3、本基金基石投资人前海金控在募集期间认购本基金份额 300,040,500.13 份，2015 年 9 月 18 日本基金经折算后的份额为 3,000,405 份。

§9 重大事件揭示

9.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

9.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

9.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的，与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

9.4 基金投资策略的改变

无。

9.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未改聘为本基金审计的会计师事务所。

9.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、基金托管人涉及托管业务机构及其高级管理人员在报告期内未受到任何稽查或处罚。

9.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

9.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比	

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

					例	
国泰君安	2	777,172,321.27	51.94%	708,235.19	54.83%	-
海通证券	1	379,992,967.48	25.40%	308,284.35	23.87%	-
广发证券	1	339,050,598.27	22.66%	275,072.00	21.30%	-

注：交易单元选择的标准和程序：

1) 基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其交易单元作为基金的专用交易单元，选择的标准是：

（1）实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；

（2）财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；

（3）经营行为规范，最近二年未发生因重大违规行为而受到中国证监会处罚；

（4）内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

（5）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；

（6）研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务。

2) 选择交易单元的程序：

我公司根据上述标准，选定符合条件的证券公司作为租用交易单元的对象。我公司投研部门定期对所选定证券公司的服务进行综合评比，评比内容包括：提供研究报告质量、数量、及时性及提供研究服务主动性和质量等情况，并依据评比结果确定交易单元交易的具体情况。我公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向券商租用交易单元作为基金专用交易单元。

9.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国泰君安	556,753,458.76	99.79%	101,759,337,000.00	57.49%	-	-
海通证券	-	-	40,512,200,000.00	22.89%	-	-
广发证券	1,143,836.70	0.21%	34,731,500,000.00	19.62%	-	-

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

9.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	鹏华基金管理有限公司关于鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金 2020 年第 1 次分红公告	《上海证券报》	2020 年 01 月 09 日
2	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告	《上海证券报》	2020 年 06 月 03 日
3	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与青岛意才基金销售有限公司认、申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《中国证券报》	2020 年 01 月 17 日
4	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与青岛意才基金销售有限公司认、申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《证券日报》	2020 年 01 月 17 日
5	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与青岛意才基金销售有限公司认、申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2020 年 01 月 17 日
6	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2019 年第 4 季度报告提示性公告	《中国证券报》	2020 年 01 月 20 日
7	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2019 年第 4 季度报告提示性公告	《上海证券报》	2020 年 01 月 20 日
8	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2019 年第 4 季度报告提示性公告	《证券时报》	2020 年 01 月 20 日
9	鹏华基金管理有限公司关于调整旗下基金 2020 年春节假期清算交收安排及申购赎回等交易业务的提示性公告	《证券日报》	2020 年 02 月 03 日
10	鹏华基金管理有限公司关于调整旗下基金 2020 年春节假期清算交收安排及申购赎回等交易业务的提示性公告	《上海证券报》	2020 年 02 月 03 日
11	鹏华基金管理有限公司关于调整旗下基金 2020 年春节假期清算交收安排及申购赎回等交易业务的提示性公告	《证券时报》	2020 年 02 月 03 日
12	鹏华基金管理有限公司关于使用不低于 5000 万元固有资金购买本公司旗下偏股型公募基金的公告	《证券时报》	2020 年 02 月 05 日
13	鹏华基金管理有限公司关于使用不低于 5000 万元固有资金购买本公司旗下偏股型公募基金的公告	《证券日报》	2020 年 02 月 05 日
14	鹏华基金管理有限公司关于使用不低于 5000 万元固有资金购买本公司旗下偏股型公募基金的公告	《上海证券报》	2020 年 02 月 05 日
15	鹏华基金管理有限公司关于使用不低	《中国证券报》	2020 年 02 月 05 日

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

	于 5000 万元固有资金购买本公司旗下偏股型公募基金的公告		
16	鹏华基金管理有限公司关于延期披露旗下基金 2019 年年度报告的提示性公告	《上海证券报》	2020 年 03 月 28 日
17	鹏华基金管理有限公司关于延期披露旗下基金 2019 年年度报告的提示性公告	《证券时报》	2020 年 03 月 28 日
18	鹏华基金管理有限公司关于延期披露旗下基金 2019 年年度报告的提示性公告	《证券日报》	2020 年 03 月 28 日
19	鹏华基金管理有限公司关于延期披露旗下基金 2019 年年度报告的提示性公告	《中国证券报》	2020 年 03 月 28 日
20	鹏华基金管理有限公司修改旗下 88 只证券投资基金基金合同的公告	《上海证券报》	2020 年 04 月 15 日
21	鹏华基金管理有限公司修改旗下 88 只证券投资基金基金合同的公告	《证券时报》	2020 年 04 月 15 日
22	鹏华基金管理有限公司修改旗下 88 只证券投资基金基金合同的公告	《证券日报》	2020 年 04 月 15 日
23	鹏华基金管理有限公司修改旗下 88 只证券投资基金基金合同的公告	《中国证券报》	2020 年 04 月 15 日
24	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2019 年年度报告提示性公告	《中国证券报》	2020 年 04 月 18 日
25	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2019 年年度报告提示性公告	《证券日报》	2020 年 04 月 18 日
26	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2019 年年度报告提示性公告	《上海证券报》	2020 年 04 月 18 日
27	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2019 年年度报告提示性公告	《证券时报》	2020 年 04 月 18 日
28	鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金更新的招募说明书摘要（2020 年第 1 号）	《上海证券报》	2020 年 04 月 20 日
29	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2020 年第 1 季度报告提示性公告	《证券日报》	2020 年 04 月 22 日
30	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2020 年第 1 季度报告提示性公告	《证券时报》	2020 年 04 月 22 日
31	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2020 年第 1 季度报告提示性公告	《中国证券报》	2020 年 04 月 22 日
32	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2020 年第 1 季度报告提示性公告	《上海证券报》	2020 年 04 月 22 日
33	鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金收到关于深圳市万科前海公馆建设管理股份有限公司	《上海证券报》	2020 年 04 月 24 日

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

	2019 年度业绩补偿款的公告		
34	鹏华基金管理有限公司关于结束旗下基金在中信证券华南股份有限公司（原广州证券股份有限公司）申购费率优惠活动的公告	《证券时报》	2020 年 04 月 28 日
35	鹏华基金管理有限公司关于结束旗下基金在中信证券华南股份有限公司（原广州证券股份有限公司）申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2020 年 04 月 28 日
36	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与华安证券股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《证券时报》	2020 年 05 月 06 日
37	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与华安证券股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《证券日报》	2020 年 05 月 06 日
38	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与华安证券股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2020 年 05 月 06 日
39	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与华安证券股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《中国证券报》	2020 年 05 月 06 日
40	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与万联证券股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《中国证券报》	2020 年 05 月 18 日
41	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与万联证券股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《证券日报》	2020 年 05 月 18 日
42	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与万联证券股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《证券时报》	2020 年 05 月 18 日
43	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与万联证券股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2020 年 05 月 18 日
44	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金在蒙商银行股份有限公司暂停办理相关销售业务的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2020 年 05 月 23 日

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

45	鹏华基金管理有限公司关于旗下证券投资基金招募说明书的补充提示	《上海证券报》	2020 年 01 月 16 日

注：无。

§10 影响投资者决策的其他重要信息

10.1 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。

10.2 影响投资者决策的其他重要信息

鹏华资产管理有限公司及其产品持有鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金情况

公司/产品名称	期末持有份额（份）
鹏华资产－浦发银行－上海浦东发展银行股份有限公司	4,269,650.45

§11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

（一）《鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金基金合同》；

（二）《鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金托管协议》；

（三）《鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金 2020 年中期报告》（原文）。

11.2 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。

11.3 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

2020 年 8 月 31 日

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn