

鹏华双债加利债券型证券投资基金 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：北京银行股份有限公司

送出日期：2020 年 8 月 31 日

§ 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。

基金托管人北京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。

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 | 5 |
| 2.4 信息披露方式 | 6 |
| 2.5 其他相关资料 | 6 |
| § 3 主要财务指标和基金净值表现 | 6 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 6 |
| 3.2 基金净值表现 | 7 |
| 3.3 其他指标 | 8 |
| § 4 管理人报告 | 8 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 8 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 | 9 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 9 |
| 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 | 10 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 | 10 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 11 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 12 |
| 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 | 12 |
| § 5 托管人报告 | 12 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 12 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 12 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 | 12 |
| § 6 半年度财务会计报告（未经审计） | 12 |
| 6.1 资产负债表 | 12 |
| 6.2 利润表 | 14 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表 | 15 |
| 6.4 报表附注 | 16 |
| § 7 投资组合报告 | 36 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 36 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 36 |
| 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 | 37 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 38 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 39 |

| | |
|---|-----------|
| 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 | 40 |
| 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 | 40 |
| 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 | 40 |
| 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 | 40 |
| 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 40 |
| 7.11 投资组合报告附注 | 41 |
| § 8 基金份额持有人信息 | 42 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 42 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 42 |
| 8.3 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 | 42 |
| § 9 开放式基金份额变动 | 42 |
| § 10 重大事件揭示 | 43 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 | 43 |
| 10.2 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 | 43 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 43 |
| 10.4 基金投资策略的改变 | 43 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 43 |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 | 43 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 43 |
| 10.8 其他重大事件 | 44 |
| § 11 影响投资者决策的其他重要信息 | 48 |
| 11.1 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 | 48 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 49 |
| § 12 备查文件目录 | 49 |
| 12.1 备查文件目录 | 49 |
| 12.2 存放地点 | 49 |
| 12.3 查阅方式 | 49 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|-----------------|
| 基金名称 | 鹏华双债加利债券型证券投资基金 |
| 基金简称 | 鹏华双债加利债券 |
| 基金主代码 | 000143 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2013 年 5 月 27 日 |
| 基金管理人 | 鹏华基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 北京银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 51,755,453.51 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 在合理控制信用风险、保持适当流动性的基础上，以企业债和可转债为主要投资标的，力争取得超越基金业绩比较基准的收益。 |
| 投资策略 | 1、大类资产配置 本基金综合运用定性和定量的分析手段，在对宏观经济因素进行充分研究的基础上，判断宏观经济周期所处阶段。基金将依据经济周期理论，结合对证券市场的系统性风险以及未来一段时期内各大类资产风险和预期收益率的评估，制定本基金在股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则。 2、债券投资策略 本基金债券投资将主要采取信用策略，同时辅之以久期策略、骑乘策略、息差策略、债券选择策略等积极投资策略，在合理控制风险、保持适当流动性的基础上，以企业债和可转债为主要投资标的，力争取得超越基金业绩比较基准的收益。 3、股票投资策略 本基金股票投资以精选个股为主，发挥基金管理人专业研究团队的研究能力，从定量和定性两方面考察上市公司的增值潜力。 |
| 业绩比较基准 | 三年期银行定期存款利率（税后）+2% |
| 风险收益特征 | 本基金属于债券型基金，其预期的收益与风险低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金，为证券投资基金中具有中低风险收益特征的品种。 |

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 | 北京银行股份有限公司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 张戈 |
| | 联系电话 | 0755-82825720 |
| | 电子邮箱 | zhangge@phfund.com.cn |
| 客户服务电话 | 4006788999 | 95526 |
| 传真 | 0755-82021126 | 010-66225309 |
| 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 | 北京市西城区金融大街甲 17 号首层 |
| 办公地址 | 深圳市福田区福华三路 168 号深 | 北京市西城区金融大街丙 17 号 |

| | | |
|-------|---------------|--------|
| | 圳国际商会中心第 43 楼 | |
| 邮政编码 | 518048 | 100033 |
| 法定代表人 | 何如 | 张东宁 |

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 |
| 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 | 鹏华基金管理有限公司 | 深圳市福田区福华三路 168 号 深圳国际商会中心 43 层 |

§ 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 | 3,105,225.88 |
| 本期利润 | 4,086,997.39 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0876 |
| 本期加权平均净值利润率 | 5.67% |
| 本期基金份额净值增长率 | 6.46% |
| 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 | 30,242,739.49 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.5843 |
| 期末基金资产净值 | 82,077,194.26 |
| 期末基金份额净值 | 1.5859 |
| 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 | 66.47% |

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）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 |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月 | 1.70% | 0.26% | 0.42% | 0.01% | 1.28% | 0.25% |
| 过去三个月 | 3.28% | 0.23% | 1.18% | 0.01% | 2.10% | 0.22% |
| 过去六个月 | 6.46% | 0.36% | 2.37% | 0.02% | 4.09% | 0.34% |
| 过去一年 | 12.09% | 0.29% | 4.76% | 0.02% | 7.33% | 0.27% |
| 过去三年 | 23.05% | 0.23% | 14.26% | 0.01% | 8.79% | 0.22% |
| 自基金合同生效起至今 | 66.47% | 0.26% | 36.72% | 0.02% | 29.75% | 0.24% |

注：业绩比较基准=三年期银行定期存款利率（税后）+2%

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

鹏华双债加利债券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 2013 年 05 月 27 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 | | |
| 王石千 | 本基金基金经理 | 2018-03-28 | - | 6 年 | 王石千先生，国籍中国，经济学硕士，6 年证券投资基金从业经验。2014 年 7 月加盟鹏 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|
| | | | | | <p>华基金管理有限公司，曾任固定收益部高级债券研究员，从事债券投资研究工作，现担任公募债券投资部基金经理。2018 年 03 月担任鹏华双债加利债券基金基金经理，2018 年 04 月至 2020 年 02 月担任鹏华纯债债券基金基金经理，2018 年 04 月担任鹏华丰利债券（LOF）基金基金经理，2018 年 07 月担任鹏华可转债债券基金基金经理，2018 年 10 月至 2019 年 11 月担任鹏华信用增利债券基金基金经理，2018 年 11 月担任鹏华弘盛混合基金基金经理，2019 年 07 月担任鹏华双债保利债券基金基金经理，2019 年 09 月担任鹏华丰饶定期开放债券基金基金经理，2019 年 09 月担任鹏华永泽定期开放债券基金基金经理。王石千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。</p> |
|--|--|--|--|--|--|

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，因市场波动等被动原因存在本基金投资比例不符合基金合同要求的情形，本基金管理人严格按照基金合同的约定及时进行了调整，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

2020 年上半年债券市场收益率先下后上。1 月至 2 月中旬，国内新冠肺炎爆发，避险情绪升温，央行 2 月 3 日降低公开市场逆回购利率，债券收益率快速下行；2 月底开始疫情在海外陆续爆发，美联储先后紧急降息 50 和 100 个基点，叠加原油价格战导致油价大幅下跌，债券收益率进一步下行。3 月末政治局会议定调“加大逆周期调节”，货币政策宽松明显加码，债券收益率在 4 月份大幅回落；进入 5 月份，随着全球疫情逐渐趋缓，国内经济数据好于预期，5 月份利率债发行量加大的同时货币政策保持定力，债券收益率明显上行。

2020 年上半年股票市场表现较为分化。以创业板指为代表的成长股表现要好于以沪深 300 为代表的蓝筹股。以电子、通信等行业为代表的科技股延续了 2019 年下半年的强势表现，并在春节后进一步加速上涨；海外疫情扩散对相关行业的基本面预期造成负面影响，海外股市的连续暴跌也打击了市场的风险偏好，权益市场自 2 月末开始调整；自 4 月开始，受益于较为宽松的流动性环境和疫情逐步缓解带来的基本面改善预期，股票市场在二季度持续上涨，以食品饮料、电子、医药为代表的高景气度行业表现更好。

转债市场在上半年总体表现偏弱，但个券表现较为分化。一季度转债市场表现强于股票市场，中证转债指数一季度上涨 0.02%；在股票市场快速上涨、债券市场资金充裕的背景下，转债市场随股票上涨、估值提升，且在后续股票市场下跌的过程中转债也调整偏少。二季度转债市场表现偏弱，中证转债指数二季度下跌 1.86%；由于一季度转债市场表现明显强于正股，转债市场估值有较大幅度提升，在二季度债券市场调整的背景下，转债市场估值有一定幅度的压缩，导致转债整体表现较差。

报告期内本基金以持有中高评级信用债为主，在一季度增配长久期利率债，在二季度增加了股票和可转债的仓位。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内鹏华双债加利债券组合净值增长率为 6.46%，业绩比较基准增长率为 2.37%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

债券市场方面，预计随着国内疫情防控的常态化，以及财政等刺激政策的进一步落地，经济数据大概率继续呈现逐季修复的状态，但复苏的强度偏弱；央行的货币政策在边际上有所收敛，银行间流动性从此前的“过度宽松”向“宽松”回归，预计短端利率可能维持在政策利率附近；经过二季度的调整，债券市场的性价比有所恢复，结合基本面和资金面，预计未来一个季度债券市场收益率大概率维持区间震荡的格局。

股票市场方面，预计企业盈利增速将随经济基本面逐步修复，对权益市场形成支撑；央行仍可能维持偏宽松的货币和信用环境，权益市场面临较为有利的流动性环境。但考虑到流动性环境边际上难以更加宽松，企业盈利反弹的力度偏弱，预计股票市场更可能表现为具备结构性机会的震荡市；如果市场出现快速、全面的上涨，则需要关注股票市场的下行风险。

转债市场方面，当前转债整体估值相对合理，转债相对于股票的弹性较好；但转债的整体价位偏高，债底对转债的支撑不足，在权益市场下跌时，转债市场调整的风险也相对较大；从自下而上的角度来看，转债市场的个券机会仍然较多。

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

(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 30,242,739.49 元,期末基金份额净值 1.5859 元。

2、本基金本报告期内未进行利润分配。

3、根据相关法律法规及本基金基金合同的规定,本基金管理人将会综合考虑各方面因素,在严格遵守规定前提下,对本报告期内可供分配利润适时作出相应安排。

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。

§ 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,本基金托管人在托管鹏华双债加利债券型证券投资基金(以下称“本基金”)的过程中,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和基金合同的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,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

在本报告期内,本基金托管人按照相关法律法规、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作进行了监督,未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配情况、投资组合报告的内容(“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内),保证复核内容真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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:鹏华双债加利债券型证券投资基金

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 | 上年度末 |
|----|-----|-----|------|
|----|-----|-----|------|

| | | 2020年6月30日 | 2019年12月31日 |
|-----------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 资产: | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 2,458,208.67 | 1,425,160.78 |
| 结算备付金 | | 1,468,274.48 | 1,195,800.44 |
| 存出保证金 | | 61,904.89 | 59,628.02 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 102,880,035.93 | 79,138,088.10 |
| 其中: 股票投资 | | 16,605,522.45 | 8,705,444.70 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 86,274,513.48 | 70,432,643.40 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 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 | | 996,579.57 | 333,826.01 |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 1,162,481.23 | 1,110,081.22 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 853,677.70 | 42,965.63 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 109,881,162.47 | 83,305,550.20 |
| 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 | | 25,820,000.00 | 14,700,000.00 |
| 应付证券清算款 | | 981,885.81 | - |
| 应付赎回款 | | 820,768.72 | 199,594.86 |
| 应付管理人报酬 | | 32,219.51 | 28,358.51 |
| 应付托管费 | | 9,665.84 | 8,507.55 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 64,790.45 | 44,918.82 |
| 应交税费 | | 6,319.64 | 6,444.92 |
| 应付利息 | | - | -1,271.92 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 68,318.24 | 45,752.24 |
| 负债合计 | | 27,803,968.21 | 15,032,304.98 |
| 所有者权益: | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 51,755,453.51 | 45,831,081.38 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 30,321,740.75 | 22,442,163.84 |
| 所有者权益合计 | | 82,077,194.26 | 68,273,245.22 |

| | | | |
|------------|--|----------------|---------------|
| 负债和所有者权益总计 | | 109,881,162.47 | 83,305,550.20 |
|------------|--|----------------|---------------|

注：报告截止日 2020 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.5859 元，基金份额总额 51,755,453.51 份。

6.2 利润表

会计主体：鹏华双债加利债券型证券投资基金

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 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 |
|------------------------|------------|--|---|
| 一、收入 | | 4,806,476.26 | 3,258,292.21 |
| 1. 利息收入 | | 1,516,162.64 | 1,063,630.74 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 23,553.13 | 18,544.55 |
| 债券利息收入 | | 1,490,670.21 | 1,043,245.51 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 1,939.30 | 1,840.68 |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | 2,275,637.85 | 1,662,535.45 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | 1,516,015.37 | 811,464.72 |
| 基金投资收益 | - | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | 698,450.89 | 826,700.18 |
| 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 | 61,171.59 | 24,370.55 |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | 981,771.51 | 531,645.09 |
| 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 | 32,904.26 | 480.93 |
| 减：二、费用 | | 719,478.87 | 541,056.52 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 178,972.96 | 124,691.58 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 53,691.82 | 37,407.41 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | - | - |

| | | | |
|---------------------|-------------|--------------|--------------|
| 4. 交易费用 | 6. 4. 7. 19 | 206,689.03 | 148,639.56 |
| 5. 利息支出 | | 191,048.10 | 158,253.64 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 191,048.10 | 158,253.64 |
| 6. 税金及附加 | | 4,731.19 | 3,183.08 |
| 7. 其他费用 | 6. 4. 7. 20 | 84,345.77 | 68,881.25 |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) | | 4,086,997.39 | 2,717,235.69 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列) | | 4,086,997.39 | 2,717,235.69 |

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：鹏华双债加利债券型证券投资基金

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) | 45,831,081.38 | 22,442,163.84 | 68,273,245.22 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 4,086,997.39 | 4,086,997.39 |
| 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) | 5,924,372.13 | 3,792,579.52 | 9,716,951.65 |
| 其中：1. 基金申购款 | 24,503,510.20 | 13,813,030.29 | 38,316,540.49 |
| 2. 基金赎回款 | -18,579,138.07 | -10,020,450.77 | -28,599,588.84 |
| 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) | - | - | - |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 51,755,453.51 | 30,321,740.75 | 82,077,194.26 |

| 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) | 37,961,145.44 | 12,925,657.46 | 50,886,802.90 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 2,717,235.69 | 2,717,235.69 |
| 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) | -1,848,861.34 | -660,904.90 | -2,509,766.24 |
| 其中：1. 基金申购款 | 2,049,952.54 | 839,010.38 | 2,888,962.92 |
| 2. 基金赎回款 | -3,898,813.88 | -1,499,915.28 | -5,398,729.16 |
| 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) | - | - | - |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 36,112,284.10 | 14,981,988.25 | 51,094,272.35 |

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

鹏华双债加利债券型证券投资基金(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”)证监基金字[2013]362号《关于核准鹏华双债加利债券型证券投资基金募集的批复》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《鹏华双债加利债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 822,678,920.27 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2013)第 290 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华双债加利债

券型证券投资基金基金合同》于 2013 年 5 月 27 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 822,951,911.75 份基金份额，其中认购资金利息折合 272,991.48 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，基金托管人为北京银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华双债加利债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为依法发行的固定收益类品种，包括国内依法发行交易的国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、地方政府债、中期票据、短期融资券、可转换债券(含分离交易可转债)、资产支持证券、次级债、中小企业私募债、债券回购、银行存款等。本基金同时投资于 A 股股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证等权益类品种以及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。基金的投资组合比例为：本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%；投资于双债的比例合计不低于非现金基金资产的 80%；股票等权益类品种的投资比例不超过基金资产的 20%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：三年期银行定期存款利率(税后)+2%。

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》、《鹏华双债加利债券型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。

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 | 2,458,208.67 |
| 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 | 2,458,208.67 |

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 | 14,346,901.65 | 16,605,522.45 | 2,258,620.80 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 53,662,863.48 | 715,981.88 |
| | 银行间市场 | 32,611,650.00 | 246,026.94 |
| | 合计 | 86,274,513.48 | 962,008.82 |
| 资产支持证券 | - | - | - |
| 基金 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 合计 | 99,659,406.31 | 102,880,035.93 | 3,220,629.62 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

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 | 651.23 |
| 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 | 660.70 |
| 应收债券利息 | 1,161,141.50 |
| 应收资产支持证券利息 | - |
| 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 | 27.80 |
| 合计 | 1,162,481.23 |

6.4.7.6 其他资产

注：无。

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 | 64,632.95 |
| 银行间市场应付交易费用 | 157.50 |
| 合计 | 64,790.45 |

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 | 3,673.66 |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 预提费用 | 64,644.58 |
| 合计 | 68,318.24 |

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 | 45,831,081.38 | 45,831,081.38 |
| 本期申购 | 24,503,510.20 | 24,503,510.20 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -18,579,138.07 | -18,579,138.07 |

| | | |
|---------------|---------------|---------------|
| - 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 | 51,755,453.51 | 51,755,453.51 |

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

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 | 23,648,080.58 | -1,205,916.74 | 22,442,163.84 |
| 本期利润 | 3,105,225.88 | 981,771.51 | 4,086,997.39 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 3,489,433.03 | 303,146.49 | 3,792,579.52 |
| 其中：基金申购款 | 13,881,136.84 | -68,106.55 | 13,813,030.29 |
| 基金赎回款 | -10,391,703.81 | 371,253.04 | -10,020,450.77 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 30,242,739.49 | 79,001.26 | 30,321,740.75 |

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年1月1日至2020年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入 | 7,982.81 |
| 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 | 14,681.47 |
| 其他 | 888.85 |
| 合计 | 23,553.13 |

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 | 1,516,015.37 |
| 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 | 1,516,015.37 |

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 | 66,543,348.33 |
| 减：卖出股票成本总额 | 65,027,332.96 |
| 买卖股票差价收入 | 1,516,015.37 |

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 | 698,450.89 |
| 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 | 698,450.89 |

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 | 49,340,357.64 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 47,498,915.17 |
| 减：应收利息总额 | 1,142,991.58 |
| 买卖债券差价收入 | 698,450.89 |

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。

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 | 61,171.59 |
| 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 | 61,171.59 |
|----|-----------|

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 | 981,771.51 |
| 股票投资 | 1,536,136.63 |
| 债券投资 | -554,365.12 |
| 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 | - |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | - |
| 合计 | 981,771.51 |

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年1月1日至2020年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 32,876.74 |
| 基金转换费收入 | 27.52 |
| 合计 | 32,904.26 |

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 | 205,427.78 |
| 银行间市场交易费用 | 1,261.25 |
| 合计 | 206,689.03 |

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 | 24,863.02 |
| 信息披露费 | 39,781.56 |
| 证券出借违约金 | - |
| 银行汇划费用 | 1,101.19 |
| 账户维护费 | 18,000.00 |
| 其他 | 600.00 |

| | |
|----|-----------|
| 合计 | 84,345.77 |
|----|-----------|

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。

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”） | 基金注册登记机构、基金管理人、基金销售机构 |
| 北京银行股份有限公司（“北京银行”） | 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 |

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。

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 | 178,972.96 | 124,691.58 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 41,546.79 | 24,299.78 |

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 0.50%，逐日计提，按月支付。日管理费 = 前一日基金资产净值 × 0.50% ÷ 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 | 53,691.82 | 37,407.41 |

注：支付基金托管人北京银行的托管费年费率为 0.15%，逐日计提，按月支付。日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.15% ÷ 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。

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

注：无

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

注：本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方没有投资及持有本基金份额。

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 | |
|-------|----------------------------|----------|---------------------------------|----------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 北京银行 | 2,458,208.67 | 7,982.81 | 1,100,516.41 | 7,437.47 |

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

无。

6.4.11 利润分配情况

注：无。

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

注：无。

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 25,820,000.00 元，于 2020 年 07 月 01 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

本基金为债券型证券投资基金。本基金主要投资债券等固定收益类金融工具。

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北京银行股份有限公司，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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

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 | 11,038,900.00 | 11,533,800.00 |
| 未评级 | 3,876,660.50 | 2,550,529.40 |
| 合计 | 14,915,560.50 | 14,084,329.40 |

注：未评级债券包括国债、中央银行票据和政策性金融债；A-1 以下包含未评级的超短期融资券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

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 | 39,848,549.36 | 37,374,901.90 |
| AAA 以下 | 25,668,693.12 | 18,480,644.10 |
| 未评级 | 5,841,710.50 | 492,768.00 |
| 合计 | 71,358,952.98 | 56,348,314.00 |

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一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面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。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

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 25,820,000.00 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同约定到期日均为一个月以内且不计息,可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息,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期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上市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其他开放式基金共同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 15%,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。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算,确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

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 | 2,458,208.67 | - | - | - | 2,458,208.67 |
| 结算备付金 | 1,468,274.48 | - | - | - | 1,468,274.48 |
| 存出保证金 | 61,904.89 | - | - | - | 61,904.89 |
| 交易性金融资产 | 26,705,153.70 | 45,832,283.56 | 13,737,076.22 | 16,605,522.45 | 102,880,035.93 |
| 应收利息 | - | - | - | 1,162,481.23 | 1,162,481.23 |
| 应收申购款 | - | - | - | 853,677.70 | 853,677.70 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 996,579.57 | 996,579.57 |
| 资产总计 | 30,693,541.74 | 45,832,283.56 | 13,737,076.22 | 19,618,260.95 | 109,881,162.47 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 820,768.72 | 820,768.72 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 32,219.51 | 32,219.51 |
| 应付托管费 | - | - | - | 9,665.84 | 9,665.84 |

| | | | | | |
|--------------------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|
| 应付证券清算款 | - | - | - | 981,885.81 | 981,885.81 |
| 卖出回购金融资产款 | 25,820,000.00 | - | - | - | 25,820,000.00 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 64,790.45 | 64,790.45 |
| 应交税费 | - | - | - | 6,319.64 | 6,319.64 |
| 其他负债 | - | - | - | 68,318.24 | 68,318.24 |
| 负债总计 | 25,820,000.00 | - | - | 1,983,968.21 | 27,803,968.21 |
| 利率敏感度缺口 | 4,873,541.74 | 45,832,283.56 | 13,737,076.22 | 17,634,292.74 | 82,077,194.26 |
| 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 | 1,425,160.78 | - | - | - | 1,425,160.78 |
| 结算备付金 | 1,195,800.44 | - | - | - | 1,195,800.44 |
| 存出保证金 | 59,628.02 | - | - | - | 59,628.02 |
| 交易性金融资产 | 20,761,409.30 | 45,271,929.60 | 4,399,304.50 | 8,705,444.70 | 79,138,088.10 |
| 应收利息 | - | - | - | 1,110,081.22 | 1,110,081.22 |
| 应收申购款 | - | - | - | 42,965.63 | 42,965.63 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 333,826.01 | 333,826.01 |
| 资产总计 | 23,441,998.54 | 45,271,929.60 | 4,399,304.50 | 10,192,317.56 | 83,305,550.20 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 199,594.86 | 199,594.86 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 28,358.51 | 28,358.51 |
| 应付托管费 | - | - | - | 8,507.55 | 8,507.55 |
| 卖出回购金融资产款 | 14,700,000.00 | - | - | - | 14,700,000.00 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 44,918.82 | 44,918.82 |
| 应付利息 | - | - | - | -1,271.92 | -1,271.92 |
| 应交税费 | - | - | - | 6,444.92 | 6,444.92 |
| 其他负债 | - | - | - | 45,752.24 | 45,752.24 |
| 负债总计 | 14,700,000.00 | - | - | 332,304.98 | 15,032,304.98 |
| 利率敏感度缺口 | 8,741,998.54 | 45,271,929.60 | 4,399,304.50 | 9,860,012.58 | 68,273,245.22 |

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。 | | |
| 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（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 | 459,901.96 | 235,479.01 |
| | 市场利率上升 25 个基点 | -444,675.29 | -232,733.11 |

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。

本基金对固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的 80%；对信用债和可转债的比例不低于固定收益类资产的 80%；股票等权益类品种的投资比例不超过基金资产的 20%。

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 | 16,605,522.45 | 20.23 | 8,705,444.70 | 12.75 |
| 交易性金融资产—基金投资 | — | — | — | — |
| 交易性金融资产—债券投资 | 13,068,312.48 | 15.92 | 6,929,258.00 | 10.15 |
| 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 | 29,673,834.93 | 36.15 | 15,634,702.70 | 22.90 |

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

| 假设 | 除业绩比较基准外的其他市场变量保持不变 | | |
|----|---------------------|-----------------------------|-------------------|
| | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（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 | 业绩比较基准上升5% | 785,025.47 | 543,271.15 |
| | 业绩比较基准下降5% | -785,025.47 | -543,271.15 |

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。

§ 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 | 16,605,522.45 | 15.11 |
| | 其中：股票 | 16,605,522.45 | 15.11 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 86,274,513.48 | 78.52 |
| | 其中：债券 | 86,274,513.48 | 78.52 |
| | 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 | 3,926,483.15 | 3.57 |
| 8 | 其他各项资产 | 3,074,643.39 | 2.80 |
| 9 | 合计 | 109,881,162.47 | 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 | 262,400.00 | 0.32 |
| B | 采矿业 | 415,360.00 | 0.51 |
| C | 制造业 | 12,161,226.95 | 14.82 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 327,385.50 | 0.40 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 2,110,973.00 | 2.57 |
| J | 金融业 | 478,740.00 | 0.58 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 446,687.00 | 0.54 |
| 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 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 402,750.00 | 0.49 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 16,605,522.45 | 20.23 |

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 | 300750 | 宁德时代 | 3,700 | 645,132.00 | 0.79 |
| 2 | 002475 | 立讯精密 | 12,480 | 640,848.00 | 0.78 |
| 3 | 002008 | 大族激光 | 14,000 | 503,300.00 | 0.61 |
| 4 | 600570 | 恒生电子 | 4,620 | 497,574.00 | 0.61 |
| 5 | 300059 | 东方财富 | 23,700 | 478,740.00 | 0.58 |
| 6 | 601012 | 隆基股份 | 11,100 | 452,103.00 | 0.55 |
| 7 | 300502 | 新易盛 | 7,100 | 448,152.00 | 0.55 |
| 8 | 601888 | 中国中免 | 2,900 | 446,687.00 | 0.54 |
| 9 | 000895 | 双汇发展 | 9,400 | 433,246.00 | 0.53 |
| 10 | 300760 | 迈瑞医疗 | 1,400 | 427,980.00 | 0.52 |
| 11 | 601899 | 紫金矿业 | 94,400 | 415,360.00 | 0.51 |
| 12 | 600845 | 宝信软件 | 6,900 | 407,652.00 | 0.50 |
| 13 | 002351 | 漫步者 | 19,100 | 403,392.00 | 0.49 |
| 14 | 603882 | 金域医学 | 4,500 | 402,750.00 | 0.49 |
| 15 | 000858 | 五粮液 | 2,300 | 393,576.00 | 0.48 |
| 16 | 300558 | 贝达药业 | 2,800 | 391,944.00 | 0.48 |
| 17 | 300014 | 亿纬锂能 | 7,995 | 382,560.75 | 0.47 |
| 18 | 300253 | 卫宁健康 | 16,600 | 380,804.00 | 0.46 |
| 19 | 000725 | 京东方A | 81,500 | 380,605.00 | 0.46 |
| 20 | 603659 | 璞泰来 | 3,500 | 360,570.00 | 0.44 |
| 21 | 300122 | 智飞生物 | 3,600 | 360,540.00 | 0.44 |
| 22 | 002555 | 三七互娱 | 7,400 | 346,320.00 | 0.42 |
| 23 | 002648 | 卫星石化 | 21,100 | 343,297.00 | 0.42 |
| 24 | 603686 | 龙马环卫 | 13,500 | 328,995.00 | 0.40 |
| 25 | 002100 | 天康生物 | 20,400 | 328,440.00 | 0.40 |
| 26 | 002120 | 韵达股份 | 13,390 | 327,385.50 | 0.40 |
| 27 | 000938 | 紫光股份 | 7,200 | 309,456.00 | 0.38 |

| | | | | | |
|----|--------|------|--------|------------|------|
| 28 | 002600 | 领益智造 | 29,000 | 308,270.00 | 0.38 |
| 29 | 002821 | 凯莱英 | 1,200 | 291,600.00 | 0.36 |
| 30 | 600426 | 华鲁恒升 | 16,400 | 289,952.00 | 0.35 |
| 31 | 600309 | 万华化学 | 5,800 | 289,942.00 | 0.35 |
| 32 | 600438 | 通威股份 | 16,500 | 286,770.00 | 0.35 |
| 33 | 002080 | 中材科技 | 18,100 | 280,550.00 | 0.34 |
| 34 | 603788 | 宁波高发 | 15,600 | 279,708.00 | 0.34 |
| 35 | 000977 | 浪潮信息 | 6,800 | 266,424.00 | 0.32 |
| 36 | 600161 | 天坛生物 | 5,800 | 262,914.00 | 0.32 |
| 37 | 002714 | 牧原股份 | 3,200 | 262,400.00 | 0.32 |
| 38 | 002129 | 中环股份 | 11,500 | 258,290.00 | 0.31 |
| 39 | 300010 | 立思辰 | 13,000 | 254,410.00 | 0.31 |
| 40 | 603369 | 今世缘 | 6,300 | 250,677.00 | 0.31 |
| 41 | 600966 | 博汇纸业 | 24,200 | 245,630.00 | 0.30 |
| 42 | 002084 | 海鸥住工 | 26,900 | 243,445.00 | 0.30 |
| 43 | 000513 | 丽珠集团 | 5,000 | 240,050.00 | 0.29 |
| 44 | 002507 | 涪陵榨菜 | 6,500 | 234,065.00 | 0.29 |
| 45 | 300737 | 科顺股份 | 11,800 | 232,814.00 | 0.28 |
| 46 | 600556 | 天下秀 | 12,100 | 224,213.00 | 0.27 |
| 47 | 300142 | 沃森生物 | 4,200 | 219,912.00 | 0.27 |
| 48 | 300782 | 卓胜微 | 360 | 146,077.20 | 0.18 |

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 | 002100 | 天康生物 | 1,445,266.00 | 2.12 |
| 2 | 600438 | 通威股份 | 1,415,500.00 | 2.07 |
| 3 | 300502 | 新易盛 | 1,362,130.40 | 2.00 |
| 4 | 601012 | 隆基股份 | 1,330,565.00 | 1.95 |
| 5 | 000671 | 阳光城 | 1,223,532.00 | 1.79 |
| 6 | 002648 | 卫星石化 | 1,206,403.00 | 1.77 |
| 7 | 600183 | 生益科技 | 1,188,563.25 | 1.74 |
| 8 | 603686 | 龙马环卫 | 1,178,601.00 | 1.73 |
| 9 | 002080 | 中材科技 | 1,151,921.00 | 1.69 |
| 10 | 002507 | 涪陵榨菜 | 1,134,510.00 | 1.66 |
| 11 | 600966 | 博汇纸业 | 1,123,090.00 | 1.64 |
| 12 | 002555 | 三七互娱 | 1,114,437.00 | 1.63 |
| 13 | 601899 | 紫金矿业 | 955,118.00 | 1.40 |
| 14 | 600547 | 山东黄金 | 913,428.45 | 1.34 |
| 15 | 300737 | 科顺股份 | 912,035.00 | 1.34 |
| 16 | 000977 | 浪潮信息 | 908,425.56 | 1.33 |

| | | | | |
|----|--------|------|------------|------|
| 17 | 603737 | 三棵树 | 891,098.00 | 1.31 |
| 18 | 300724 | 捷佳伟创 | 888,715.00 | 1.30 |
| 19 | 002371 | 北方华创 | 841,895.00 | 1.23 |
| 20 | 002460 | 赣锋锂业 | 831,877.00 | 1.22 |

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 | 600438 | 通威股份 | 1,540,344.00 | 2.26 |
| 2 | 600183 | 生益科技 | 1,297,498.15 | 1.90 |
| 3 | 000671 | 阳光城 | 1,214,847.00 | 1.78 |
| 4 | 002100 | 天康生物 | 1,138,392.00 | 1.67 |
| 5 | 300502 | 新易盛 | 1,115,217.74 | 1.63 |
| 6 | 000977 | 浪潮信息 | 1,089,473.16 | 1.60 |
| 7 | 002648 | 卫星石化 | 1,066,634.00 | 1.56 |
| 8 | 002507 | 涪陵榨菜 | 1,041,172.00 | 1.53 |
| 9 | 600966 | 博汇纸业 | 1,033,552.00 | 1.51 |
| 10 | 601012 | 隆基股份 | 993,523.78 | 1.46 |
| 11 | 603686 | 龙马环卫 | 989,295.00 | 1.45 |
| 12 | 300724 | 捷佳伟创 | 977,527.00 | 1.43 |
| 13 | 601899 | 紫金矿业 | 951,673.00 | 1.39 |
| 14 | 600547 | 山东黄金 | 941,822.00 | 1.38 |
| 15 | 002460 | 赣锋锂业 | 923,179.00 | 1.35 |
| 16 | 603737 | 三棵树 | 892,779.00 | 1.31 |
| 17 | 002080 | 中材科技 | 861,798.00 | 1.26 |
| 18 | 002371 | 北方华创 | 833,609.00 | 1.22 |
| 19 | 300628 | 亿联网络 | 832,788.00 | 1.22 |
| 20 | 002555 | 三七互娱 | 798,896.00 | 1.17 |

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 | 71,391,274.08 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 66,543,348.33 |

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 | 8,332,955.50 | 10.15 |

| | | | |
|----|-----------|---------------|--------|
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 1,385,415.50 | 1.69 |
| | 其中：政策性金融债 | 1,385,415.50 | 1.69 |
| 4 | 企业债券 | 33,822,330.00 | 41.21 |
| 5 | 企业短期融资券 | 11,038,900.00 | 13.45 |
| 6 | 中期票据 | 18,626,600.00 | 22.69 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 13,068,312.48 | 15.92 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 86,274,513.48 | 105.11 |

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 | 019547 | 16 国债 19 | 61,550 | 5,841,710.50 | 7.12 |
| 2 | 101800382 | 18 京粮 MTN001 | 50,000 | 5,093,000.00 | 6.21 |
| 3 | 101800423 | 18 渝高新 MTN001 | 40,000 | 4,195,200.00 | 5.11 |
| 4 | 112905 | 19TCL01 | 40,000 | 4,050,400.00 | 4.93 |
| 5 | 136825 | 16 滇路 03 | 40,000 | 4,026,400.00 | 4.91 |

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

注：无。

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国债期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.10.3 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。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 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

本基金投资的前十名证券中本期没有发行主体被监管部门立案调查的、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

7.11.2 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。

7.11.3 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 | 61,904.89 |
| 2 | 应收证券清算款 | 996,579.57 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 1,162,481.23 |
| 5 | 应收申购款 | 853,677.70 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 3,074,643.39 |

7.11.4 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 | 128084 | 木森转债 | 874,150.20 | 1.07 |
| 2 | 113558 | 日月转债 | 859,507.20 | 1.05 |
| 3 | 127005 | 长证转债 | 796,651.20 | 0.97 |
| 4 | 113545 | 金能转债 | 764,617.00 | 0.93 |
| 5 | 128046 | 利尔转债 | 609,347.40 | 0.74 |
| 6 | 128066 | 亚泰转债 | 604,340.00 | 0.74 |
| 7 | 128088 | 深南转债 | 580,205.92 | 0.71 |
| 8 | 113519 | 长久转债 | 571,483.20 | 0.70 |
| 9 | 128071 | 合兴转债 | 512,952.50 | 0.62 |
| 10 | 128030 | 天康转债 | 409,580.00 | 0.50 |
| 11 | 132014 | 18 中化 EB | 399,056.00 | 0.49 |
| 12 | 128042 | 凯中转债 | 386,473.60 | 0.47 |
| 13 | 113534 | 鼎胜转债 | 377,451.40 | 0.46 |
| 14 | 110062 | 烽火转债 | 375,377.10 | 0.46 |
| 15 | 132012 | 17 巨化 EB | 355,250.00 | 0.43 |
| 16 | 128010 | 顺昌转债 | 231,741.60 | 0.28 |
| 17 | 113508 | 新风转债 | 201,824.10 | 0.25 |

| | | | | |
|----|--------|---------|------------|------|
| 18 | 110063 | 鹰 19 转债 | 187,563.20 | 0.23 |
| 19 | 113029 | 明阳转债 | 43,498.60 | 0.05 |
| 20 | 113030 | 东风转债 | 8,718.40 | 0.01 |

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

7.11.6 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。

§ 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 (%) |
| 3,195 | 16,198.89 | 15,294,432.55 | 29.55 | 36,461,020.96 | 70.45 |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 持有份额总数 (份) | 占基金总份额比例 (%) |
|------------------|------------|--------------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 2,052.35 | 0.0040 |

注：截至本报告期末，本基金管理人从业人员投资、持有本基金符合相关法律法规、中国证监会规定及相关管理制度的规定。

8.3 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、基金投资和研发部门负责人及本基金的基金经理未持有本基金份额。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|-------------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2013年5月27日） 基金份额总额 | 822,951,911.75 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 45,831,081.38 |
| 本报告期基金总申购份额 | 24,503,510.20 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 18,579,138.07 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少 以“-”填列） | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 51,755,453.51 |

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未改变。

10.5 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。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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例 | |
| 华泰证券 | 2 | 137,934,622.41 | 100.00% | 125,636.36 | 100.00% | - |

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。

10.7.2 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 |
| 华泰证券 | 71,382,165.78 | 100.00% | 1,939,829,000.00 | 100.00% | - | - |

10.8 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 |
| 2 | 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 |
| 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 | 《证券日报》 | 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 | 《中国证券报》 | 2020年01月17日 |
| 5 | 鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 | 《证券时报》 | 2020年01月20日 |

| | | | |
|----|---|---------|------------------|
| | 2019 年第 4 季度报告提示性公告 | | |
| 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 |
| 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使用不低于 5000 万元自有资金购买本公司旗下偏股型公募基金的公告 | 《中国证券报》 | 2020 年 02 月 05 日 |
| 12 | 鹏华基金管理有限公司关于使用不低于 5000 万元自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 |
| 13 | 鹏华基金管理有限公司关于使用不低于 5000 万元自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 |
| 14 | 鹏华基金管理有限公司关于使用不低于 5000 万元自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 |
| 15 | 鹏华基金管理有限公司关于增加上海联泰基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告 | 《证券时报》 | 2020 年 03 月 03 日 |
| 16 | 鹏华基金管理有限公司关于增加上海联泰基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告 | 《中国证券报》 | 2020 年 03 月 03 日 |
| 17 | 鹏华基金管理有限公司关于增加上海联泰基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告 | 《上海证券报》 | 2020 年 03 月 03 日 |
| 18 | 鹏华基金管理有限公司关于增加爱建证券有限责任公司为旗下部分基金销售机构的公告 | 《上海证券报》 | 2020 年 03 月 18 日 |
| 19 | 鹏华基金管理有限公司关于增加珠海盈米基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告 | 《上海证券报》 | 2020 年 03 月 25 日 |
| 20 | 鹏华基金管理有限公司关于增加珠海盈米基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告 | 《中国证券报》 | 2020 年 03 月 25 日 |

| | | | |
|----|--|---------|------------------|
| 21 | 鹏华基金管理有限公司关于增加珠海盈米基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告 | 《证券时报》 | 2020 年 03 月 25 日 |
| 22 | 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 |
| 23 | 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 |
| 24 | 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 |
| 25 | 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 |
| 26 | 鹏华基金管理有限公司关于增加喜鹊财富基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告 | 《证券时报》 | 2020 年 04 月 07 日 |
| 27 | 鹏华基金管理有限公司关于增加喜鹊财富基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告 | 《证券日报》 | 2020 年 04 月 07 日 |
| 28 | 鹏华基金管理有限公司关于增加喜鹊财富基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告 | 《中国证券报》 | 2020 年 04 月 07 日 |
| 29 | 鹏华基金管理有限公司关于增加喜鹊财富基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告 | 《上海证券报》 | 2020 年 04 月 07 日 |
| 30 | 鹏华基金管理有限公司关于增加阳光人寿保险股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告 | 《中国证券报》 | 2020 年 04 月 09 日 |
| 31 | 鹏华基金管理有限公司关于增加阳光人寿保险股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告 | 《上海证券报》 | 2020 年 04 月 09 日 |
| 32 | 鹏华基金管理有限公司关于增加阳光人寿保险股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告 | 《证券时报》 | 2020 年 04 月 09 日 |
| 33 | 鹏华基金管理有限公司关于增加阳光人寿保险股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告 | 《证券日报》 | 2020 年 04 月 09 日 |
| 34 | 鹏华基金管理有限公司关于增加上海长量基金销售投资顾问有限公司为旗下部分基金销售机构的公告 | 《中国证券报》 | 2020 年 04 月 13 日 |
| 35 | 鹏华基金管理有限公司关于增加上海长量基金销售投资顾问有限公司为旗 | 《上海证券报》 | 2020 年 04 月 13 日 |

| | | | |
|----|---|---------|------------------|
| | 下部分基金销售机构的公告 | | |
| 36 | 鹏华基金管理有限公司关于增加上海长量基金销售投资顾问有限公司为旗下部分基金销售机构的公告 | 《证券时报》 | 2020 年 04 月 13 日 |
| 37 | 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 |
| 38 | 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 |
| 39 | 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 |
| 40 | 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 |
| 41 | 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 |
| 42 | 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 |
| 43 | 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 |
| 44 | 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 |
| 45 | 鹏华双债加利债券型证券投资基金更新的招募说明书摘要(2020 年第 1 号) | 《证券时报》 | 2020 年 04 月 20 日 |
| 46 | 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 |
| 47 | 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 |
| 48 | 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 |
| 49 | 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 |
| 50 | 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 |
| 51 | 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 |
| 52 | 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 |
| 53 | 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 | 《证券时报》 | 2020 年 05 月 06 日 |

| | | | |
|----|--|-------------------------------|-------------|
| | (含定期定额申购)费率优惠活动的公告 | | |
| 54 | 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 |
| 55 | 鹏华双债加利债券型证券投资基金更新的招募说明书摘要 | 《上海证券报》 | 2020年05月15日 |
| 56 | 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 |
| 57 | 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 |
| 58 | 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 |
| 59 | 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 |
| 60 | 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 |
| 61 | 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告 | 《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》 | 2020年05月28日 |
| 62 | 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 |

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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 | 报告期内持有基金份额变化情况 | 报告期末持有基金情况 |
|------|----------------|------------|
|------|----------------|------------|

| 别 | 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 | 20200101~20200630 | 15,294,432.55 | - | - | 15,294,432.55 | 29.55 |
| 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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一)《鹏华双债加利债券型证券投资基金基金合同》;
- (二)《鹏华双债加利债券型证券投资基金托管协议》;
- (三)《鹏华双债加利债券型证券投资基金 2020 年中期报告》(原文)。

12.2 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。

12.3 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