

# 鹏华弘泰灵活配置混合型证券投资基金

# 2019年半年度报告摘要

基金管理人：鹏华基金管理有限公司  
基金托管人：中国工商银行股份有限公司  
基金合同生效日期：2019年8月23日

**1 重要提示**  
基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。本半年度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。  
基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年8月22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预示其未来表现，投资有风险，投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。  
本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应当阅读半年度报告正文。  
本报告中所列财务数据未经审计。  
本报告自2019年01月01日起至06月30日。

**2 基金简介**  
**2.1 基金基本情况**

基金名称	鹏华弘泰混合
基金代码	000901
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年8月23日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,232,569,670.53份
基金合同存续期	不定期
下属分级基金的基金名称	鹏华弘泰混合A 鹏华弘泰混合C
下属分级基金的合同简称	200901 001075
报告期末下属分级基金的资产总额	213,021,917.13元 1,019,747,753.41元

**2.2 基金产品说明**  
本基金在符合法律法规的前提下，广泛投资于国际领先的、业绩优秀、成长性高、流动性好的上市公司股票，力争实现较高的投资收益。  
**投资目标**  
1. 追求长期回报。本基金通过精选具有良好发展前景的上市公司股票，在有效控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期增值。  
2. 分散投资。本基金通过分散投资于不同行业、不同风格的上市公司股票，降低单一股票对基金资产净值的影响。  
3. 动态调整。本基金根据市场环境的变化，动态调整股票仓位，力争实现基金资产的长期增值。  
**投资策略**  
1. 资产配置策略。本基金根据宏观经济、政策环境、市场估值等因素，动态调整股票、债券、现金等资产的配置比例。  
2. 股票投资策略。本基金采用自上而下和自下而上相结合的方法，精选具有良好发展前景的上市公司股票。  
3. 债券投资策略。本基金采用自上而下和自下而上相结合的方法，精选具有良好发展前景的上市公司股票。  
4. 现金管理策略。本基金采用自上而下和自下而上相结合的方法，精选具有良好发展前景的上市公司股票。  
**风险收益特征**  
本基金属于混合型基金，其预期风险和预期收益高于货币型基金、债券型基金，低于股票型基金。本基金的风险收益特征与本基金合同约定的投资范围和投资策略相一致。

**3 主要会计数据和财务指标**  
**3.1 主要会计数据和财务指标**  
金额单位：人民币元

项目	基金管理人	基金托管人
名称	鹏华基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
注册地址	深圳市福田区福华一路100号	中国工商银行股份有限公司
办公地址	深圳市福田区福华一路100号	中国工商银行股份有限公司
法定代表人	刘伟	刘建军
电话	0755-8201328	010-66105788

**3.2 基金管理人及基金托管人**

**3.3 主要会计数据和基金净值表现**  
金额单位：人民币元

项目	基金管理人	基金托管人
名称	鹏华基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
注册地址	深圳市福田区福华一路100号	中国工商银行股份有限公司
办公地址	深圳市福田区福华一路100号	中国工商银行股份有限公司
法定代表人	刘伟	刘建军
电话	0755-8201328	010-66105788

**3.4 基金业绩比较基准**  
本基金业绩比较基准为：  
沪深300指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%

**3.5 基金管理人及基金托管人**  
鹏华基金管理有限公司  
中国工商银行股份有限公司

**3.6 基金业绩比较基准**  
本基金业绩比较基准为：  
沪深300指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%

**3.7 基金业绩比较基准**  
本基金业绩比较基准为：  
沪深300指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%

**3.8 基金业绩比较基准**  
本基金业绩比较基准为：  
沪深300指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%

**3.9 基金业绩比较基准**  
本基金业绩比较基准为：  
沪深300指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%

**3.10 基金业绩比较基准**  
本基金业绩比较基准为：  
沪深300指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%

**3.11 基金业绩比较基准**  
本基金业绩比较基准为：  
沪深300指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%

**3.12 基金业绩比较基准**  
本基金业绩比较基准为：  
沪深300指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%

**3.13 基金业绩比较基准**  
本基金业绩比较基准为：  
沪深300指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%

**3.14 基金业绩比较基准**  
本基金业绩比较基准为：  
沪深300指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%

**3.15 基金业绩比较基准**  
本基金业绩比较基准为：  
沪深300指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%

**3.16 基金业绩比较基准**  
本基金业绩比较基准为：  
沪深300指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%

**3.17 基金业绩比较基准**  
本基金业绩比较基准为：  
沪深300指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%

**3.18 基金业绩比较基准**  
本基金业绩比较基准为：  
沪深300指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%

**3.19 基金业绩比较基准**  
本基金业绩比较基准为：  
沪深300指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%

**3.20 基金业绩比较基准**  
本基金业绩比较基准为：  
沪深300指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%

**3.21 基金业绩比较基准**  
本基金业绩比较基准为：  
沪深300指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%

**3.22 基金业绩比较基准**  
本基金业绩比较基准为：  
沪深300指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%

**3.23 基金业绩比较基准**  
本基金业绩比较基准为：  
沪深300指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%

**3.24 基金业绩比较基准**  
本基金业绩比较基准为：  
沪深300指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%

**3.25 基金业绩比较基准**  
本基金业绩比较基准为：  
沪深300指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%

报告截止日：2019年6月30日

单位：人民币元

资产	本报告期末2019年6月30日	上年度末2018年12月31日
货币资金	8,848,272.21	2,264,520.37
结算备付金	-	33,114.76
交易性金融资产	2,100.38	149,124.83
债权投资	1,059,443.74	2,095,499,496.99
其他债权投资	-	-
其他权益工具投资	-	-
其他资产	1,007,227,900.00	2,068,408,012.24
资产总计	22,162,523.64	10,011,904.11
负债	-	-
应付短期融资券	-	-
应付债券	281,906,792.87	100,000,364.00
其他负债	-	-
负债总计	281,906,792.87	100,000,364.00
所有者权益	21,880,730.77	9,911,539.71
实收资本	41,549,004.14	28,338,000.71
其他综合收益	-	-
未分配利润	-	-
所有者权益合计	1,008,816.87	610,170,949.11

**注：**报告截止日2019年6月30日，基金份额总额1,232,569,670.53份，其中鹏华弘泰混合A基金份额总额为213,021,917.12份，基金份额净值1.0986元；鹏华弘泰混合C基金份额总额为1,018,747,753.41份，基金份额净值1.1241元。

**6.2 关联方**  
会计主体：鹏华弘泰灵活配置混合型证券投资基金  
本报告期：2019年1月1日至2019年6月30日

项目	报告期	2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间2018年12月31日至2019年6月30日
一、收入		37,074,129.62	1,083,463.19
1.利息收入		41,206,499.29	5,697,013.82
其中：存款利息收入		30,002.62	119,287.11
债券利息收入		39,764,061.48	4,619,663.39
资产支持证券利息收入		1,012,434.83	101,289.89
其他利息收入		988,090.98	898,292.70
2.投资收益		-5,696,093.03	-6,665,351.11
其中：长期股权投资收益		-	-7,781,289.67
其他投资收益		-5,696,093.03	-
3.公允价值变动收益		-6,541,600.92	1,144,028.84
资产支持证券公允价值变动收益		-400,450.31	-
其他公允价值变动收益		-	-
衍生工具收益		-	-
4.其他收入		600,739.06	1,086,032.04
其中：基金赎回费（含赎回费）		-	-
5.其他收入		600,739.06	1,086,032.04
二、费用		11,227,699.39	2,568,127.12
1.管理人报酬	0.6421	4,960,967.96	601,003.94
2.托管费	0.6423	2,000,300.37	249,840.43
3.销售服务费	0.6423	651,712.28	14,096.14
4.其他费用		12,369.59	919,282.64
其中：基金赎回费		12,369.59	254,229.47
其他费用		-	664,953.17
5.其他费用		13,001.03	221,288.20
三、利润总额（亏损总额）		25,796,477.23	-1,504,448.40
减：所得税		-	-
净利润（净亏损）		25,796,477.23	-1,504,448.40

**6.3 所有者权益（基金净值）变动表**  
会计主体：鹏华弘泰灵活配置混合型证券投资基金  
本报告期：2019年1月1日至2019年6月30日

项目	本报告期	2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间2018年12月31日至2019年6月30日
一、期初基金份额总额	1,201,029,326.27	524,794,088.69	1,608,727,411.96
二、本期基金份额变动	-	-26,796,477.23	26,796,477.23
其中：基金申购/赎回	-214,110,024.41	-38,329,868.13	-282,439,870.64
基金转换	-	-	-
基金拆分	-	-	-
三、期末基金份额总额	2,286,209,222.11	291,899,097.79	2,567,323,299.89
四、本期基金份额变动	-2,469,973,344.52	-289,789,328.88	-2,760,762,770.80
其中：本期基金份额变动	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,007,816,867.87	312,280,700.19	1,388,079,019.11
六、所有者权益（基金净值）			
实收资本	41,549,004.14	28,338,000.71	28,338,000.71
其他综合收益	-	-	-
未分配利润	966,267,863.73	303,942,700.48	1,359,741,018.40

**6.4 关联方**  
会计主体：鹏华弘泰灵活配置混合型证券投资基金  
本报告期：2019年1月1日至2019年6月30日

项目	本报告期	2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间2018年12月31日至2019年6月30日
一、收入		37,074,129.62	1,083,463.19
1.利息收入		41,206,499.29	5,697,013.82
其中：存款利息收入		30,002.62	119,287.11
债券利息收入		39,764,061.48	4,619,663.39
资产支持证券利息收入		1,012,434.83	101,289.89
其他利息收入		988,090.98	898,292.70
2.投资收益		-5,696,093.03	-6,665,351.11
其中：长期股权投资收益		-	-7,781,289.67
其他投资收益		-5,696,093.03	-
3.公允价值变动收益		-6,541,600.92	1,144,028.84
资产支持证券公允价值变动收益		-400,450.31	-
其他公允价值变动收益		-	-
衍生工具收益		-	-
4.其他收入		600,739.06	1,086,032.04
其中：基金赎回费（含赎回费）		-	-
5.其他收入		600,739.06	1,086,032.04
二、费用		11,227,699.39	2,568,127.12
1.管理人报酬	0.6421	4,960,967.96	601,003.94
2.托管费	0.6423	2,000,300.37	249,840.43
3.销售服务费	0.6423	651,712.28	14,096.14
4.其他费用		12,369.59	919,282.64
其中：基金赎回费		12,369.59	254,229.47
其他费用		-	664,953.17
5.其他费用		13,001.03	221,288.20
三、利润总额（亏损总额）		25,796,477.23	-1,504,448.40
减：所得税		-	-
净利润（净亏损）		25,796,477.23	-1,504,448.40

**6.5 关联方**  
会计主体：鹏华弘泰灵活配置混合型证券投资基金  
本报告期：2019年1月1日至2019年6月30日

**6.6 关联方**  
会计主体：鹏华弘泰灵活配置混合型证券投资基金  
本报告期：2019年1月1日至2019年6月30日

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，非货物期货按结算价格为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场取得的收入，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费附加等税费按照实际缴纳增值税的适用比例计算缴纳。

**6.4.7 关联方关系**  
6.4.7.1 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  
6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	关联关系	与本基金的关联关系
鹏华基金管理有限公司（“鹏华基金”）	基金管理人、基金运营机构、基金销售机构	基金管理人、基金运营机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金代销机构	基金托管人、基金代销机构
招商证券股份有限公司（“招商证券”）	基金管理人、基金代销机构	基金管理人、基金代销机构

**6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联交易**  
6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

关联方名称	2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间2018年12月31日至2019年6月30日
招商证券	134,564,841.38	134,564,841.38

**6.4.8.2 债券交易**  
金额单位：人民币元

关联方名称	2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间2018年12月31日至2019年6月30日
成交金额	90,289,916.00	90,289,916.00
占当期债券成交总额的比例（%）	62.81	62.81

**6.4.8.3 债券回购交易**  
金额单位：人民币元

关联方名称	2019年1月1日至2019年6月30日	2018年12月31日至2019年6月30日
成交金额	947,700,000.00	947,700,000.00
占当期债券回购成交总额的比例（%）	100.00	100.00

**6.4.8.4 权证交易**  
注：无。

**6.4.8.5 应支付关联方的佣金**  
金额单位：人民币元

关联方名称	本报告期	2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间2018年12月31日至2019年6月30日
招商证券	3,308,694.47	660,761.84	660,761.84

**6.4.8.6 基金管理人**  
金额单位：人民币元

项目	本报告期	2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间2018年12月31日至2019年6月30日
管理费	4,960,967.96	601,003.94	601,003.94
托管费	2,000,300.37	249,840.43	249,840.43
销售服务费	651,712.28	14,096.14	14,096.14
其他费用	12,369.59	919,282.64	919,282.64
合计	7,625,350.19	1,074,122.15	1,074,122.15

**6.4.8.7 关联方报酬**  
6.4.8.7.1 基金管理人报酬  
6.4.8.7.2 基金托管人报酬  
6.4.8.7.3 基金销售服务费

**6.4.8.8 销售服务费**  
金额单位：人民币元

项目	本报告期	2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间2018年12月31日至2019年6月30日
招商证券	651,712.28	14,096.14	14,096.14

**6.4.8.9 关联方报酬**  
金额单位：人民币元

项目	本报告期	2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间2018年12月31日至2019年6月30日
管理费	4,960,967.96	601,003	