鹏华消费领先灵活配置混合型证券投资基金

【2014】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:交通银行股份有限公司
送出日期:2014年8月26日

§1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年8月21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,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年1月1日起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	鹏华消费领先混合
场内简称	-
基金主代码	160624
交易代码	160624
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年12月23日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	727,145,866.50份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过积极灵活的资产配置,并精选优质的消费服务行业上市公司,在有效控制风险前提下,力求超越业绩比较基准的投资回报,争取实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金将通过跟踪考量通常的宏观经济变量(包括GDP增长率、CPI走势、M2的绝对水平和增长率、利率水平与走势等)以及各项国家政策(包括财政、税收、货币、汇率政策等)来判断经济周期目前的位置以及未来将发展的方向,在此基础上对各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估,制定股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例,调整原则和调整范围。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+中证综合债指数收益率×40%
风险收益特征	本基金属于混合型基金,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金,低于股票型基金,属于证券投资基金里中高风险、中高预期收益的品种。

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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张戈	王涛
	联系电话	0755-82825720	95559
	电子邮箱	zhangge@phfund.com.cn	t_wang@bankcomm.com
客户服务电话		4006788999	95559
传真		0755-82021126	021-62701216

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.phfund.com
基金半年度报告备置地点	深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心43层鹏华基金管理有限公司; 上海市仙霞路18号交通银行股份有限公司。

§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(2014年1月1日 - 2014年6月30日)
本期已实现收益	8,583,255.56
本期利润	-57,187,285.79
加权平均基金份额本期利润	-0.0414
本期基金份额净值增长率	-2.68%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.1087
期末基金资产净值	714,983,380.73
期末基金份额净值	0.983

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)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。

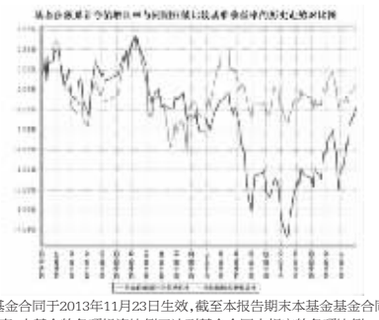
3.2 基金净值表现

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	3.47%	0.74%	0.55%	0.46%	2.92%	0.28%
过去三个月	1.24%	0.69%	1.69%	0.52%	-0.45%	0.17%
过去六个月	-2.68%	0.62%	-2.11%	0.62%	-0.57%	0.00%
自基金合同生效起至今	-1.85%	0.61%	-0.71%	0.62%	-1.14%	-0.01%

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率×60%+中证综合债指数收益率×40%

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2013年11月23日生效,截至本报告期末本基金基金合同生效未满一年。

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。

§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。公司原注册资本8,000 万元人民币,后于2001 年9 月完成增资扩股,增至15,000 万元人民币。截止本报告期末,公司管理51只开放式基金和7只社保组合,经过近16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		
刘苏	本基金基金经理	2013年12月23日	-	9	刘苏先生,国籍中国,北京大学理学硕士,9年证券从业经验。曾任职于深圳国际信托投资有限责任公司(现公司更名为:华润深国投信托有限公司)证券信托部,担任信托经理;2008年10月加盟鹏华基金管理有限公司,从事研究分析工作,历任研究部高级研究员,基金经理助理;2011年12月起至今担任鹏华精选成长股票型证券投资基金基金经理,2013年10月至2013年12月担任原鹏华普惠基金(2013年12月已转型为鹏华消费领先灵活配置混合型证券投资基金)基金经理,2013年12月起兼任鹏华消费领先灵活配置混合型证券投资基金基金经理。刘苏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。

4.2 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%的交易次数为2次,主要原因分别在于采用量化策略的基金调仓和指数成分股交易不活跃导致。

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

2014年上半年A股市场整体并未体现出趋势性的行情,也未体现出2013年股的巨大的结构分化:新兴成长股表现较好,而大盘蓝筹股也迎来的估值修复。本基金在坚持价值投资和精选个股的选股思路下,整体维持了成长股为主的配置,同时也适当参与了一些低预期改善型公司。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金净值增长率为-2.68%,同期上证综指下跌3.20%,深证成指下跌9.59%,沪深300指数下跌7.08%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,我们认为,首先,尽管政府陆续出台各类微刺激政策,但尚无大规模刺激经济的迹象,企业盈利在去年高基数的背景下呈现同比增速回落的态势;其次,尽管需求疲弱不会造成短期通货膨胀的出现,但银行资产结构的调整也使得流动性异常宽松的局面很难出现,而稳增长又不能让国内资金面过于紧张,所以我们判断流动性环境处于中性状态;第三,各项改革措施和新技术应用依然层出不穷,市场热点频出。综合而言,我们认为,在经济基本面并不强劲、企业整体盈利能力尚无明显改善的背景下,除非流动性超预期宽松,否则股票市场出现系统性机会的可能性仍不高,但由于经济指标阶段性企稳,流动性环境相对宽松,市场整体风险也不大,指数平淡、个股精彩的情况或许继续存在。在这样的市场情况下,我们将坚持之前的投资策略,即主要希望通过坚持精选优秀成长型公司来分享企业成长带来的价值增长。我们将致力于寻找所处市场前景广阔且行业格局较好,具备相对竞争优势,尚处于较快增长阶段的公司,尽量回避已处于成长阶段的末期、扩张空间有限的公司,以期为投资者获取较好的收益。同时,我们也会更积极的关注一些行业经营形势或供需形势有所改善,但市场预期仍较低的传统行业。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.6.1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

4.6.1.1 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。

4.6.1.2 特殊业务估值流程

根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范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、债券不活跃市场报价等投资品种估值小组,成员由基金经理、行业研究员、债券研究员、监察稽核部、金融工程师、登记结算部相关人员组成。

4.6.2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。

4.6.3本公司参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.6.4本公司现没有进行任何定价服务的签约。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

4.7.1截止本报告期末,本基金期末可供分配利润为-79,053,587.14元,期末基金份额净值0.983元。不符合利润分配条件,本基金本期将不进行利润分配。

4.7.2本基金本报告期内未进行利润分配。

§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

2014年上半年度,基金托管人在鹏华消费领先灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务,不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2014年上半年度,鹏华基金管理有限公司在鹏华消费领先灵活配置混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2014年上半年度,由鹏华基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关鹏华消费领先灵活配置混合型证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、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:鹏华消费领先灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日:2014年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
资 产:		
银行存款	15,435,073.17	27,728,506.73
结算备付金	134,597,176.08	344,630,339.39
存出保证金	402,269.06	525,513.30
交易性金融资产	568,432,673.21	1,514,016,828.60
其中:股票投资	513,882,691.41	1,106,443,206.94
基金投资	-	-
债券投资	54,549,981.80	407,573,621.66
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	179,163.82
应收利息	1,458,825.74	8,683,579.25
应收股利	-	-
应收申购款	5,991.20	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	720,332,008.46	1,895,763,931.09
负债和所有者权益	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
负 债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	2,251,980.17	13,308,768.39
应付赎回款	978,567.24	-
应付管理人报酬	897,347.45	2,395,507.81
应付托管费	149,557.90	399,251.33
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	851,276.33	466,950.68
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	219,898.64	313,000.00
负债合计	5,348,627.73	16,883,478.21
所有者权益:		
实收基金	782,147,656.67	2,000,000,000.00
未分配利润	-67,164,275.94	-121,119,547.12
所有者权益合计	714,983,380.73	1,878,880,452.88
负债和所有者权益总计	720,332,008.46	1,895,763,931.09

注:报告截止日2014年6月30日,基金份额净值0.983元,基金份额总额727,145,866.50份。

6.2 利润表

会计主体:鹏华消费领先灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
一、收入		-42,446,382.69
1.利息收入		6,713,939.25
其中:存款利息收入		3,700,256.94
债券利息收入		2,973,050.06
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		40,632.25
其他利息收入		-
2.投资收益(损失以"-"填列)		11,768,178.16
其中:股票投资收益		11,728,091.08
基金投资收益		-
债券投资收益		-3,686,807.01
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益		-
股利收益		3,726,894.09
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-65,770,541.35
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		4,842,041.25
减:二、费用		14,740,903.10
1.管理人报酬	6.4.8.2.1	10,002,652.83
2.托管费	6.4.8.2.2	1,667,108.84
3.销售服务费		-
4.交易费用		2,800,707.66
5.利息支出		-
其中:卖出回购金融资产支出		-
6.其他费用		270,433.77
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-57,187,285.79
减:所得税费用		-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-57,187,285.79

注:本基金基金合同于2013年12月23日生效,无上年度可比较期间及可比较数据。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:鹏华消费领先灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014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)	2,000,000,000.00	-121,119,547.12	1,878,880,452.88
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-57,187,285.79	-57,187,285.79
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)	-1,217,852,343.33	111,142,556.97	-1,106,709,786.36
其中:1.基金申购款	30,815,324.13	-2,173,934.18	28,641,389.95
2.基金赎回款	-1,248,667,667.46	113,316,491.15	-1,135,351,176.31
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)	782,147,656.67	-67,164,275.94	714,983,380.73

注:本基金基金合同于2013年12月23日生效,无上年度可比较期间及可比较数据。

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_____ _____邓召明_____ _____刘慧红_____

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

鹏华消费领先灵活配置混合型证券投资基金是根据原普惠证券投资基金(以下简称"基金普惠")基金份额持有人大会2013年11月19日决议通过的《关于普惠证券投资基金转型有关事项的议案》,经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")基金部函[2013]1025号文备案,由原基金普惠转型而来。原基金普惠存续期限至2013年12月22日止。自2013年12月23日起,原基金普惠更名为鹏华消费领先灵活配置混合型证券投资基金(以下简称"本基金"),《普惠证券投资基金基金合同》失效的同时《鹏华消费领先灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效。本基金存续期限为不定期。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

原基金普惠于基金合同失效前的基金资产净值为1,861,279,465.28元,已于本基金的基金合同生效日全部转为本基金的基金资产。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华消费领先灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资对象为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括中小企业私募债券)、货币市场工具、股指期货、权证、资产支持证券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)。本基金的投资组合比例为::股票资产占基金资产的比例为0%-95%;投资于消费服务行业上市公司的股票占非现金资产的比例不低于80%;债券、货币市场工具及其他资产占基金资产的比例不低于5%;基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的3%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×60%+中证综合债指数收益率×40%。

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日颁布的《企业会计准则-基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会公告[2010]5号《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《鹏华消费领先灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的基金行业实务操作的有关规定编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2014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2014年6月30日的财务状况以及2014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

本基金本报告期没有发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

本报告期税项未发生变化。

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

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。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

项目	与本基金的关系
鹏华基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
交通银行股份有限公司("交通银行")	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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金基金合同于2013年12月23日生效,截至本报告期末不满一年,无上年度可比期间数据。

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国信证券	32,781,257.16	1.95%

6.4.8.1.2 债券交易

注:本基金本报告期内未通过关联方交易单元发生债券交易。

6.4.8.1.3 债券回购交易

注:本基金本报告期内未通过关联方交易单元发生债券回购交易。

6.4.8.1.4 权证交易

注:本基金本报告期内未通过关联方交易单元发生权证交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国信证券	29,844.34	1.99%	-	-

注:1、佣金的计算公式

上海证券交易所的交易佣金=买(卖)成交金额×1‰-买(卖)经手费-买(卖)证管费等由券商承担的费用

深圳证券交易所的交易佣金=买(卖)成交金额×1‰-买(卖)经手费-买(卖)证管费等由券商承担的费用

(佣金比率按照与一般证券公司签订的协议条款订立。)

2、本基金与关联方已按同业统一的基金佣金计算方式和佣金比例签订了《证券交易席位租用协议》。根据协议规定,上述单位定期或不定期地为我公司提供研究服务以及其他研究支持。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	10,002,652.83
其中:支付销售机构的客户维护费	140,062.89

注:(1)支付基金管理人鹏华基金管理有限公司的管理人报酬年费率为1.5%,逐日计提,按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×1.5%÷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。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,667,108.84

注:支付基金托管人交通银行股份有限公司的托管费年费率为0.25%,逐日计提,按月支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
交通银行	-	41,003,380.27	-	-	-	-

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 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 2014年1月1日至2014年6月30日
基金合同生效日(2013年12月23日)持有的基金份额	-
期初持有的基金份额	7,500,000.00
期间申购/买入总份额	-
期间因拆分变动份额	-527,804.00
减:期间赎回/卖出总份额	-
期末持有的基金份额	6,972,196.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.9588%

注:(1)封闭式基金普惠证券投资基金由于封闭期限结束,于2013年12月23日终止上市,转型为开放式基金鹏华消费领先灵活配置混合型证券投资基金,本基金管理人持有份额不变。

(2)2014年1月27日原基金普惠基金份额进行折算,折算后原基金普惠基金份额变更登记为本基金基金份额,折算后本基金管理人持有本基金份6,972,196份。

(3)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。

6.4.8.4.2 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 2014年6月30日		上年度末 2013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
国信证券	13,944,392.00	1.9177%	15,000,000.00	0.7500%

6.4.8.5 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 2014年1月1日至2014年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
交通银行	15,435,073.17	882,924.81

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金本报告期没有参与关联方承销的证券。

6.4.9 期末(2014年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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

6.4.9.1.1 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
603328	依顿电子	2014年6月23日	2014年7月1日	新股流通受限	15.31	15.31	28,240	432,354.40	432,354.40	-
002727	一心堂	2014年6月25日	2014年7月2日	新股流通受限	12.20	12.20	2,690	32,818.00	32,818.00	-

注:截至本报告期末,本基金没有持有因认购新发或增发而流通受限的债券及权证。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300351	永贵电器	2014年6月23日	资产重组	25.10	2014年8月7日	27.61	199,846	5,089,714.20	5,016,134.60	-
300253	卫宁软件	2014年5月28日	资产重组	40.53	2014年8月1日	37.50	49,924	1,980,223.86	2,023,419.72	-

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末,本基金没有从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末,本基金没有从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

§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	513,882,691.41	71.34
	其中:股票	513,882,691.41	71.34
2	固定收益投资	54,549,981.80	7.57
	其中:债券	54,549,981.80	7.57
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	150,032,249.25	20.83
7	其他各项资产	1,867,086.00	0.26
8	合计	720,332,008.46	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

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	37,911,774.48	5.30
B	采矿业	11,967,093.16	1.67
C	制造业	319,026,181.74	44.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	28,758,381.63	4.02
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	36,760,917.54	5.14
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	45,074,402.60	6.30
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
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	-	-
Q	卫生和社会工作	31,495,983.58	4.41
R	文化、体育和娱乐业	2,887,956.68	0.40
S	综合	-	-
	合计	513,882,691.41	71.87

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	占基金资产净值比例(%)
1	600535	天士力	1,539,759	59,696,456.43	8.35
2	002410	广联达	1,628,252	43,050,982.88	6.02
3	300145	南方泵业	2,049,902	38,702,149.76	5.41
4	002262	恩华药业	1,653,674	36,728,099.54	5.14
5	000858	五粮液	2,000,000	35,860,000.00	5.02
6	000786	北新建材	2,029,907	27,850,324.04	3.90
7	002250	联化科技	1,875,000	26,625,000.00	3.72
8	300244	迪安诊断	558,904	24,463,228.08	3.42
9	002304	洋河股份	419,899	21,309,874.25	2.98
10	002714	牧原股份	439,716	19,369,489.80	2.71

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于鹏华基金管理有限公司网站http://www.phfund.com的半年度报告正文。

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	000858	五粮液	38,939,562.78	2.07
2	300145	南方泵业	37,708,450.62	2.01
3	002470	金正大	27,684,989.64	1.47
4	002664	信质电机	24,624,504.89	1.31
5	002304	洋河股份	24,572,373.44	1.31
6	300244	迪安诊断	21,332,095.48	1.14
7	002385	大北农	20,305,114.30	1.08
8	601318	中国平安	19,914,531.22	1.06
9	002410	广联达	19,867,915.76	1.06
10	002714	牧原股份	17,424,175.81	0.93
11	002299	圣农发展	16,845,237.09	0.90
12	300335	迪森股份	16,444,921.35	0.88
13	300070	碧水源	16,112,605.57	0.86
14	600509	天富能源	16,062,942.61	0.85
15	300157	恒泰艾普	15,560,786.76	0.83
16	002174	游族网络	14,878,146.49	0.79
17	300269	联建光电	13,746,511.15	0.73
18	002262	恩华药业	13,697,837.48	0.73
19	002023	海特高新	13,243,904.94	0.70
20	002148	北纬通信	13,200,600.99	0.70

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	600887	伊利股份	108,392,661.86	5.77
2	000333	美的集团	72,590,132.97	3.86
3	002375	亚厦股份	57,705,703.14	3.07
4	002701	奥瑞金	53,592,331.27	2.85
5	601166	兴业银行	48,726,367.44	2.59
6	300070	碧水源	45,162,569.87	2.40
7	002038	双鹭药业	43,855,549.54	2.33
8	601126