上接B304版

会计主体:鹏华策略优选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2014年6月10日至2014年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2014年6月10日(基金合同生效日)至2014年12月31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)	3,000,000,000.00	-596,561,874.36	2,403,438,125.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	278,806,923.56	278,806,923.56
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)	-2,179,141,774.68	321,280,654.81	-1,857,861,119.87
其中:1.基金申购款	5,108,446.54	-801,392.07	4,307,054.47
2.基金赎回款(以"-"号填列)	-2,184,250,221.22	322,082,046.88	-1,862,168,174.34
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)	820,858,225.32	3,525,704.01	824,383,929.33

注:(1)报告实际编制期间为2014年6月10日(基金合同生效日)至2014年12月31日。

(2)本基金基金合同于2014年6月10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 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

邓召明 高鹏 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

鹏华策略优选灵活配置混合型证券投资基金是根据原普丰证券投资基金(以下简称"基金普丰")基金份额持有人大会2014年5月15日决议通过的《关于普丰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")证券基金机构监管部函[2014]373号文备案,由原基金普丰转型而来。原基金普丰存续期限至2014年6月9日止。自2014年6月10日起,原基金普丰更名为鹏华策略优选灵活配置混合型证券投资基金(以下简称"本基金"),《普丰证券投资基金基金合同》失效的同时《鹏华策略优选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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

原基金普丰于基金合同失效前的基金资产净值为2,403,438,125.64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《鹏华策略优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同基金合同》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%;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%。

7.4.2 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<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《鹏华策略优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2014年6月10日(基金合同生效日)至2014年12月31日止期间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12月31日的财务状况以及2014年6月10日(基金合同生效日)至2014年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2014年6月10日(基金合同生效日)至2014年12月31日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币,除有特别说明外,均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1)金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2)金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

(1)金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,应当单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

(2)以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量,应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

(3)以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动作为公允价值变动损益计入当期损益;在资产持有期间所取得的利息或现金股利以及处置时产生的处置损益计入当期损益。

(4)金融资产满足下列条件之一的,予以终止确认:(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止;(2)该金融资产已转移,且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方;或者(3)该金融资产已转移,虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬,但是放弃了对该金融资产控制。

(5)金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。

(6)当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时,终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额,计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易,但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2)存在活跃市场的金融工具,如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化,参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整最近交易市价以确定公允价值。

(3)当金融工具不存在活跃市场,采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时,尽可能最大程度使用市场参数,减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1)具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的;且2)交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1)在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为6次,每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的20%,若基金合同生效不满3个月则可不进行收益分配;

(2)本基金收益分配方式分为两种:现金分红与红利再投资,投资人可选择现金红利或将现金红利按除息日份额净值自动转为基金份额进行再投资;若投资人不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;

(3)基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值,即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;

(4)本基金的每份基金份额享有同等分配权;

(5)法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作,本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下:

(1)对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况,本基金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》,根据具体情况采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票,根据中国证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》,若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本,按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值;若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本,按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为投资组合的估值增值。

(3)在银行间同业市场交易的债券品种,根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值,具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于2014年颁布《企业会计准则第39号——公允价值计量》、《企业会计准则第40号——合营安排》、《企业会计准则第41号——在其他主体中权益的披露》和修订后的《企业会计准则第2号——长期股权投资》、《企业会计准则第9号——职工薪酬》、《企业会计准则第30号——财务报表列报》、《企业会计准则第33号——合并财务报表》以及《企业会计准则第37号——金融工具列报》,要求除《企业会计准则第37号——金融工具列报》自2014年度财务报表起施行外,其他准则自2014年7月1日起施行。上述准则对本基金本报告期无重大影响。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期没有发生会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税

(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,股权的股息、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,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。自2013年1月1日起,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,暂减按25%计入应纳税所得额。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。

7.4.7 关联方关系

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")	基金管理人、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
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
意大利欧利盛资本资产管理股份公司(Eurizon Capital SGR S.p.A.)	基金管理人的股东
深圳市北融信投资发展有限公司	基金管理人的股东
鹏华资产管理(深圳)有限公司	基金管理人的子公司

注:1、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。

2、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期间的关联方交易

本基金基金合同于2014年6月10日生效,截至本报告期末不满一年,无上年度可比期间数据。

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年6月10日(基金合同生效日)至2014年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国信证券	13,490,856.28	0.51%

7.4.8.1.2 债券交易

注:本基金2014年6月10日(基金合同生效日)至2014年12月31日未通过关联方交易单元发生债券交易。

7.4.8.1.3 债券回购交易

注:本基金2014年6月10日(基金合同生效日)至2014年12月31日未通过关联方交易单元发生债券回购交易。

7.4.8.1.4 权证交易

注:本基金2014年6月10日(基金合同生效日)至2014年12月31日未通过关联方交易单元发生权证交易。

7.4.8.1.5 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6月10日(基金合同生效日)至2014年12月31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	12,214.65	0.52%	-	-

注:(1)佣金的计算公式

上海证券交易所的交易佣金=股票买(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=股票买(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《证券交易单元租用协议》。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。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2014年6月10日(基金合同生效日)至2014年12月31日
当期应支付的管理费	11,891,535.74
其中:支付销售机构的客户维护费	99,841.37

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1.50%,逐日计提,按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×1.50%÷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。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2014年6月10日(基金合同生效日)至2014年12月31日
当期应支付的托管费	1,981,922.59

注:支付基金托管人中国工商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。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:本基金2014年6月10日(基金合同生效日)至2014年12月31日未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 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6月10日(基金合同生效日)至2014年12月31日
期初持有的基金份额	3,750,000.00
期间申购/买入总份额	-
期间因拆分增加的份额	-704,457.00
期间赎回/卖出总份额	-
期末持有的基金份额	3,046,543.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.46%

注:(1)封闭式基金普丰证券投资基金由于封闭期限结束,于2014年6月10日终止上市,转型为开放式基金鹏华策略优选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7月3日原基金普丰基金份额进行折算后,折算后原基金普丰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3046543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。

7.4.8.4.2 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
国信证券	6,093,086.00	0.91%

注:封闭式基金普丰证券投资基金由于封闭期限结束,于2014年6月10日终止上市,转型为开放式基金鹏华策略优选灵活配置混合型证券投资基金。

7.4.8.5 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6月10日(基金合同生效日)至2014年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	85,469,129.53	1,293,097.21

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金本报告期未参与关联方承销的证券。

7.4.9 期末(2014年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 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

7.4.9.1.1 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
601258	庞大集团	2014年11月19日	2015年11月17日	非公开发行流通受限	4.85	4.99	2,000,000	9,700,000.00	9,980,000.00

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债券及权证。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌股票

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
000925	众合机电	2014年12月31日	资产重组	21.40	2015年1月12日	21.65	208,700	4,272,060.00	4,466,180.00	-
000612	焦作万方	2014年12月29日	重大事项	10.10	2015年1月16日	10.20	165,602	1,821,622.00	1,672,580.20	-
002152	广电运通	2014年12月17日	重大事项	20.80	2015年3月11日	24.37	933,820	16,874,234.00	19,423,456.00	-

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 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。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

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

转型前:原普丰证券投资基金(报告期:2014年1月1日-2014年6月9日)

§8 投资组合报告(转型前)

8.1 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	1,278,320,750.73	53.15
	其中:股票	1,278,320,750.73	53.15
2	固定收益投资	888,930,639.55	36.96
	其中:债券	888,930,639.55	36.96
	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	212,498,737.49	8.83
7	其他资产	25,446,506.47	1.06
8	合计	2,405,196,634.24	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末指数投资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	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	4,598,043.05	0.19
B	采矿业	52,630,682.49	2.19
C	制造业	265,878,108.99	11.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	21,836,698.11	0.91
E	建筑业	27,526,209.01	1.15
F	批发和零售业	21,565,570.28	0.90
G	交通运输、仓储和邮政业	17,498,852.03	0.73
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,423,740.71	0.72
J	金融业	283,757,659.08	11.81
K	房地产业	41,197,506.39	1.71
L	租赁和商务服务业	5,058,069.85	0.21
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	6,196,648.20	0.26
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	2,182,924.80	0.09
S	综合	3,385,839.73	0.14
	合计	770,736,552.72	32.07

8.2.2 报告期末积极投资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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	383,313,498.01	15.95
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	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	1,630,700.00	0.07
K	房地产业	122,640,000.00	5.10
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	507,584,198.01	21.12

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的指数投资前十名和积极投资前五名股票投资明细

8.3.1 期末指数投资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	600036	招商银行	2,892,023	28,920,230.00	1.20
2	600016	民生银行	3,911,565	28,867,349.70	1.20
3	601166	兴业银行	2,805,655	27,467,362.45	1.14
4	601318	中国平安	583,998	23,184,720.60	0.96
5	000001	平安银行	1,889,622	21,692,860.56	0.90
6	600000	浦发银行	1,965,313	18,749,086.02	0.78
7	000002	万科A	1,718,650	14,264,795.00	0.59
8	600030	中信证券	1,193,395	13,342,156.10	0.56
9	600837	海通证券	1,393,630	12,640,224.10	0.53
10	000651	格力电器	414,410	12,067,619.20	0.50

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的年度报告正文。

8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	600887	伊利股份	2,699,717	86,363,946.83	3.59
2	600196	复星医药	4,000,000	78,320,000.00	3.26
3	000002	万科A	6,000,000	49,800,000.00	2.07
4	600519	贵州茅台	300,100	45,984,323.00	1.91
5	600383	金地集团	5,000,000	42,000,000.00	1.75

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的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	600887	伊利股份	81,075,722.66	3.23
2	002035	华帝股份	38,286,855.34	1.53
3	000333	美的集团	37,928,436.80	1.51
4	600519	贵州茅台	29,985,335.50	1.19
5	601633	长城汽车	16,481,747.63	0.66
6	300285	国瓷材料	12,863,791.68	0.51
7	002250	联化科技	12,601,598.11	0.50
8	600438	通威股份	11,996,090.68	0.48
9	600557	康缘药业	6,967,612.72	0.28
10	600978	宜华木业	5,098,023.40	0.20
11	000581	威孚高科	4,990,460.20	0.20
12	600525	长园集团	4,986,166.20	0.20
13	000880	潍柴重机	3,719,022.67	0.15
14	600688	上海石化	1,994,276.87	0.08
15	601555	东吴证券	1,646,800.00	0.07
16	600089	特变电工	655,589.70	0.03
17	600153	建发股份	326,262.87	0.01

注:(1)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。

(2)上述股票为本基金本报告期内买入的全部股票。

8.4.2 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	600030	中信证券	137,654,856.60	5.48
2	600519	贵州茅台	88,328,226.56	3.52
3	600383	金地集团	78,681,624.63	3.13
4	600585	海螺水泥	78,051,368.60	3.11
5	002250	联化科技	77,328,632.59	3.08
6	601318	中国平安	58,379,714.57	2.33
7	600276	恒瑞医药	54,743,083.66	2.18
8	000001	平安银行	50,068,217.95	1.99
9	601991	大唐发电	49,848,222.71	1.99
10	000418	小天鹅A	41,783,650.36	1.66
11	600048	保利地产	24,830,049.45	0.99
12	002035	华帝股份	22,879,528.58	0.91
13	000002	万科A	16,494,314.30	0.66
14	601555	东吴证券	16,071,797.98	0.64
15	601633	长城汽车	13,427,785.85	0.54
16	002255	海陆重工	12,252,323.75	0.49
17	600978	宜华木业	5,086,306.57	0.20

注:(1)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。

(2)上述股票为本基金本报告期内卖出的全部股票。

8.4.3 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	271,603,793.03
卖出股票收入(成交)总额	825,909,704.71

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。

8.5 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	885,094,000.00	36.83
	其中:政策性金融债	885,094,000.00	36.83
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	3,836,639.55	0.16
8	其他	-	-
9	合计	888,930,639.55	36.99

8.6 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	130236	13国开36	2,400,000	240,264,000.00	10.00
2	130322	13进出22	1,600,000	160,272,000.00	6.67
3	130222	13国开22	1,000,000	94,140,000.00	3.92
4	140429	14农发29	900,000	90,378,000.00	3.76
5	130428	13农发28	500,000	50,150,000.00	2.09

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 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:本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 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:本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

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、处罚的股票。

8.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 其他资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	339,995.31
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	216,384.02
4	应收利息	24,890,127.14
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	25,446,506.47

8.12.4 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	110023	民生转债	3,249,136.80	0.14
2	127002	徐工转债	242,355.75	0.01
3	110017	中海转债	222,448.20	0.01
4	110022	同仁转债	122,698.80	0.01

8.12.5 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

8.12.6 期末积