

信息披露 Disclosure

(上接B043版)

客服热线: 400 888 6661
网址: www.yfyk.com.cn
(8) 浙江同花顺基金销售有限公司
办公地址: 浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903
法定代表人: 李骁海
客服电话: (0671) 66768888
传真: (0571) 88911818
联系人: 蒋祥君
网址: www.10jqka.com.cn
(9) 上海天天基金销售有限公司
办公地址: 上海市徐汇区龙田路195号2号楼2层
法定代表人: 其实
联系人: 高莉莉
联系电话: 020-87596527
客服电话: 4001818188
网址: www.1234567.com.cn
(10) 浙江金观诚财富管理有限公司
住所: 拱墅区霞湾巷230号8号楼4楼403室
办公地址: 杭州市教工路18号EAC欧凯中心A座D区8层
联系人: 陆彬彬
联系电话: 0571-56028617
客服电话: 4000800805
网址: www.jincheng-fund.com
(11) 和讯信息科技有限公司
住所: 北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
办公地址: 北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
法定代表人: 王莉
联系人: 于扬
联系电话: 021-20638888
客服电话: 400-520-0022
网址: licaike.hexun.com
(12) 深圳市新富源证券投资咨询有限公司
住所: 深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#
办公地址: 深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#
法定代表人: 马令海
联系人: 郑洁
联系电话: 010-58321388-1106
客服电话: 010-58325327
网址: xj.rjindian.com
(13) 宜信普信投资顾问(北京)有限公司
住所: 北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809
办公地址: 北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809
法定代表人: 唐宁
联系人: 王月明
联系电话: 010-52856550
客服电话: 400-6099-500
网址: www.yixinfund.com
(14) 华益普基基金销售有限公司
住所: 四川省成都市成华区建设路9号高地中心1101室
办公地址: 四川省成都市成华区建设路9号高地中心1101室
法定代表人: 于海峰
联系人: 陈巍
联系电话: 028-48252471
客服电话: 4006-8797-666
网址: www.pyfund.com
(15) 中期时代基金销售(北京)有限公司
住所: 北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢11层1103号
办公地址: 北京市朝阳区建国门外光华路16号1幢11层
法定代表人: 路甬
联系人: 侯英建
联系电话: 010-59539888
客服电话: 400-8888-160
网址: www.cifofund.com
(16) 万景财富(北京)基金销售有限公司
住所: 北京市朝阳区北四环中路27号盘古大观3201
办公地址: 北京市朝阳区北四环中路27号盘古大观3201
法定代表人: 李耀辉
联系人: 李恒富
联系电话: 010-59393923
客服电话: 400-808-0069
网址: www.wy-fund.com
(17) 深圳鹏元基金销售有限公司
住所: 深圳市福田区福华三路卓越世纪中心1号楼1806-1810
办公地址: 深圳市福田区福华三路卓越世纪中心1号楼1806-1810
法定代表人: 卓卓晶
联系人: 王妮群
联系电话: 0756-33376853
客服电话: 4006-477-000
网址: www.downdfund.com
(18) 北京增财基金销售有限公司
住所: 北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208室
办公地址: 北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208室
法定代表人: 王昌庆
联系人: 罗细亚
联系电话: 010-67000888
客服电话: 400-001-8811
网址: www.zcwec.com.cn
(19) 北京恒天明泽基金销售有限公司
住所: 北京市朝阳区经济技术开发区安达北路10号院5座122室
办公地址: 北京市北京经济技术开发区安达北路10号院5座122室

法定代表人: 黄伟伟
联系人: 侯仁凤
联系电话: 010-57756068
客服电话: 400-788-8868
网址: www.chtfund.com
基金管理人根据有关法律法规要求, 根据实际, 选择其他符合要求的机构销售本基金或变更上述销售机构, 并及时公告。
(二) 登记机构
名称: 鹏华基金管理有限公司
注册地址: 深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心43层
办公地址: 深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心43层
法定代表人: 何如
联系人: 吴群群
联系电话: 0755-82021166
传真: 0755-82021165
(三) 律师事务所
名称: 广东嘉得信律师事务所
住所: 深圳市罗湖区笋岗东路中民时代广场A座201
负责人: 闵齐双
办公地址: 深圳市罗湖区笋岗东路中民时代广场A座201
联系电话: 0755-33033936
传真: 0755-33033906
联系人: 杜卫群
经办律师: 闵齐双 杜卫群
(四) 会计师事务所
名称: 普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
住所: 上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦C楼
办公地址: 上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
法定代表人: 杨绍信
联系电话: (021) 23238888
经办注册会计师: 单峰、魏巍
联系人: 魏巍

四、基金的名称
基金名称: 鹏华丰泰定期开放混合型证券投资基金
五、基金的运作方式与类型
契约型, 本基金采取在封闭期内封闭运作、封闭期与封闭期之间定期开放的运作方式。
本基金自基金合同生效之日起(含)起或自每一开放期结束之日次日(含)起一年的期间封闭运作, 不办理申购与赎回业务, 也不上市交易。
本基金自封闭期结束后第二个工作日(含)起进入开放期, 每个开放期原则上不少于五个工作日, 不超过二十个工作日, 开放期的具体时点以基金管理人届时公告为准。如发生不可抗力或其他情形致使本基金无法按时开放或需依据基金合同暂停申购与赎回业务的, 基金管理人有权合理调整申购或赎回业务的办理期间并予以公告。

六、基金的投资目标
在有效控制风险的基础上, 通过每年定期开放的形式保持适度流动性, 力求取得超越基金业绩比较基准的收益。
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、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、中小企业私募债、次级债、债券回购、银行存款以及法律法规和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)。本基金不直接买入股票、权证等权益类金融工具, 因所持可转换公司债券转股形成的股票, 因投资于分离交易可转债而产生的权证, 在其可上市交易后不超过10个交易日的时间内卖出。
如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种, 基金管理人在履行适当程序后, 可以将其纳入投资范围。

七、基金的投资方向
本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%, 但在每个封闭运作、不办理申购与赎回业务期间, 本基金不受上述比例限制, 开放期内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%。
(一) 投资策略
本基金债券投资将主要采取久期策略, 同时辅之以信用利差策略、收益率曲线策略、收益率利差策略、息差策略、债券选择策略等积极投资策略, 在有效控制风险的基础上, 通过每年定期开放的形式保持适度流动性, 力求取得超越基金业绩比较基准的收益。
(二) 资产配置策略
在资产配置方面, 本基金通过对外宏观经济形势、经济周期所处阶段、利率曲线变化趋势和信用利差变化趋势的分析, 比较未来一定时期内不同债券品种和债券市场的相对预期收益率, 在基金规定的投资比例范围内对可转债、不同久期、信用特征的债券, 及债券与基金类资产之间进行动态调整。
(三) 久期策略
本基金将主要采取久期策略, 通过自上而下的组合久期管理策略, 以实现对组合利率风险的有效控制。为控制风险, 本基金采用以“目标久期”为核心的资产配置方式。目标久期的设定分为两个层次: 战略性配置和战术性配置。“目标久期”的战略配置由投资决策委员会确定, 主要根据对宏观经济和资本市场的预期分析决定组合的目标久期。“目标久期”的战术性配置由基金经理根据市场短期利率的影响而在战略性配置预先设定的范围内进行调整。如果预期利率下降, 本基金将增加组合的久期, 在利率接近目标久期时, 以较多资金购买价格上升并带动收益率上升的债券品种, 以期在利率下降时, 本基金将缩短组合的久期, 直至目标久期下限, 以减小债券价格下降带来的风险。
(四) 收益率曲线策略
收益率曲线的形状变化是判断市场利率走向的重要依据之一, 本基金将据此调整组合中、短期债券的搭配。本基金将通过对收益率曲线变化的预测, 适时采用子弹式、杠铃或梯形策略组合进行, 并进行动态调整。
(五) 骑乘策略
本基金将采用骑乘策略增强组合的持有期收益。这一策略即通过对收益率曲线的分析, 在可选的目标久期区间买入期限位于收益率曲线较陡峭处右侧的债券。在收益率曲线不变动的情况下, 随着其剩余期限的衰减, 债券收益率将沿着陡峭的收益率曲线有较大幅度的下滑, 从而获得较高的资本收益; 同时收益率曲线上升或进一步变陡, 这一策略也能提供更好的安全边际。
5、息差策略

本基金将利用回购利率低于债券收益率的情形, 通过正回购所获得的资金投资于债券, 利用杠杆放大债券投资收益。
6、债券选择策略
根据单个债券到期收益率相对于市场收益率曲线的偏离程度, 结合信用等级、流动性、选择权条款、期权特点等因素, 确定其投资价值, 选择定价合理或价值被低估的债券进行投资。
7、中小企业私募债投资策略
本基金将深入研究发现发行人资信及公司运营情况, 与中小企业私募债券承销商紧密合作, 合理合规严格地进行中小企业私募债投资。本基金在投资过程中密切监控债券信用状况或发行人信用等级变化情况, 力求规避可能存在的债券违约, 并获取超额收益。
(二) 投资决策依据及程序
1、投资决策依据
(1) 有关法律、法规和基金合同的有关规定。
(2) 经济运行态势和证券市场走势。
(3) 投资对象的风险收益配比。
2、投资决策程序
(1) 投资决策委员会: 确定本基金总体资产配置和投资策略。投资决策委员会定期召开会议, 如需做出及时重大决策和基金经理小组提议, 可临时召开投资决策委员会会议。
(2) 基金经理(或管理小组): 设计和调整投资组合。设计和调整投资组合需要考虑的基本因素包括: 1) 基金合同和基金管理人制定的投资限制和比例限制; 2) 研究报告和投资建议: 基金经理的独立判断; 3) 研究员和基金经理小组的建议等。
(3) 集中交易室: 基金经理向集中交易室下达投资指令, 集中交易室经理收到投资指令后分为交易员, 交易员收到基金投资指令后准确执行。
(4) 绩效与风险评估小组: 对基金投资组合进行评价, 向基金经理(或管理小组)提出调整建议。
(5) 监察稽核部: 对投资流程等进行合法合规审核、监督和检查。
(6) 本基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据市场环境变化和实际需要调整上述投资决策程序, 并予以公告。
九、基金的业绩比较基准
一年定期存款税后利率+0.5%。
本基金投资于利率债和信用债的金融工具, 一年定期存款利率为中国人民银行公布的一年期人民币存款基准利率, 反映了不同信用等级债券在银行存入一年定期存款所能获得的年收益率, 扣除利率税后为实际可获得的收益率, 该利率可反映本基金自客户群体风险收益偏好且期限与本基金封闭期一致, 可以作为一个合理的业绩比较基准。

十、基金的风险收益特征
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较低风险收益特征的品种。
十一、基金的投资组合报告
基金管理人及董事监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责任。
基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金基金合同约定, 于2015年1月16日复核了本报告中财务指标、净值表现和投资组合报告等内容, 保证报告内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
本报告期间为2014年10月1日起至12月31日止。
1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
2	其中: 股票	-	-
3	固定收益投资	239,814,548.00	92.84
4	其中: 债券	239,814,548.00	92.84
5	资产支持证券	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	贵金属投资	-	-
8	其他投资	-	-
9	合计	239,814,548.00	92.84

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
2	其中: 股票	-	-
3	固定收益投资	239,814,548.00	92.84
4	其中: 债券	239,814,548.00	92.84
5	资产支持证券	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	贵金属投资	-	-
8	其他投资	-	-
9	合计	239,814,548.00	92.84

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
2	其中: 股票	-	-
3	固定收益投资	239,814,548.00	92.84
4	其中: 债券	239,814,548.00	92.84
5	资产支持证券	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	贵金属投资	-	-
8	其他投资	-	-
9	合计	239,814,548.00	92.84

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
2	其中: 股票	-	-
3	固定收益投资	239,814,548.00	92.84
4	其中: 债券	239,814,548.00	92.84
5	资产支持证券	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	贵金属投资	-	-
8	其他投资	-	-
9	合计	239,814,548.00	92.84

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
2	其中: 股票	-	-
3	固定收益投资	239,814,548.00	92.84
4	其中: 债券	239,814,548.00	92.84
5	资产支持证券	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	贵金属投资	-	-
8	其他投资	-	-
9	合计	239,814,548.00	92.84

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
2	其中: 股票	-	-
3	固定收益投资	239,814,548.00	92.84
4	其中: 债券	239,814,548.00	92.84
5	资产支持证券	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	贵金属投资	-	-
8	其他投资	-	-
9	合计	239,814,548.00	92.84

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
2	其中: 股票	-	-
3	固定收益投资	239,814,548.00	92.84
4	其中: 债券	239,814,548.00	92.84
5	资产支持证券	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	贵金属投资	-	-
8	其他投资	-	-
9	合计	239,814,548.00	92.84

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
2	其中: 股票	-	-
3	固定收益投资	239,814,548.00	92.84
4	其中: 债券	239,814,548.00	92.84
5	资产支持证券	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	贵金属投资	-	-
8	其他投资	-	-
9	合计	239,814,548.00	92.84

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
2	其中: 股票	-	-
3	固定收益投资	239,814,548.00	92.84
4	其中: 债券	239,814,548.00	92.84
5	资产支持证券	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	贵金属投资	-	-
8	其他投资	-	-
9	合计	239,814,548.00	92.84

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
2	其中: 股票	-	-
3	固定收益投资	239,814,548.00	92.84
4	其中: 债券	239,814,548.00	92.84
5	资产支持证券	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	贵金属投资	-	-
8	其他投资	-	-
9	合计	239,814,548.00	92.84

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
2	其中: 股票	-	-
3	固定收益投资	239,814,548.00	92.84
4	其中: 债券	239,814,548.00	92.84
5	资产支持证券	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	贵金属投资	-	-
8	其他投资	-	-
9	合计	239,814,548.00	92.84

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
2	其中: 股票	-	-
3	固定收益投资	239,814,548.00	92.84
4	其中: 债券	239,814,548.00	92.84
5	资产支持证券	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	贵金属投资	-	-
8	其他投资	-	-
9	合计	239,814,548.00	92.84

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
2	其中: 股票	-	-
3	固定收益投资	239,814,548.00	92.84
4	其中: 债券	239,814,548.00	92.84
5	资产支持证券	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	贵金属投资	-	-
8	其他投资	-	-
9	合计	239,814,548.00	92.84

6、报告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。
7、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、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权证投资明细
注: 本基金本报告期末未持有权证。
9、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
(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交易。
(2) 报告期末国债期货的投资持仓情况和期末持仓明细
注: 本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货交易。
(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交易。
10、投资组合报告附注
(1) 本基金投资的前十名证券中14武控01(发行主体: 武汉控股)存在如下情况: 2014年4月23日至4月30日湖北证监局对公司进行了资产重组后的现场检查并于6月10日向公司下发了《监管关注函》(鄂证监公司字[2014]114号)。该监管关注函主要涉及的问题有: 规范运作方面有待完善、(内幕知情人登记制度)存在瑕疵、公司内部控制实施有待提高、控股股东承诺履行公司管理层股权激励计划没有明确承诺履行的时间。根据公司公告、公司收悉《监管关注函》后, 已于6月11日将调查告知公司董事、监事、高级管理人员及控股股东, 并于2014年6月27日向湖北证监局上报《武汉控股关于湖北证监局现场检查的整改方案》, 针对《监管关注函》所提及的问题提出了切实可行的整改方案。2014年6月20日, 公司收到控股股东关于公司管理层股权激励计划承诺履行期限的承诺函, 控股股东承诺在2019年6月份之前实施公司管理层股权激励计划。针对在公司资产重组时控股股东作出的瑕疵土地房产价值保障承诺, 公司正在积极与控股股东就相关补偿款的支付问题进行沟通。湖北证监局未对公司提交的《整改方案》提出异议或提出进一步整改要求。
对该债券的未决程序的说明: 本基金管理人在跟踪评估该债券的过程中, 认为上述整改方案并不会对本债券的资质构成实质性影响, 因此不影响该债券的投资。该债券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。
本基金投资的前十名证券中的其他证券本期没有发行主体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、处罚的情况。
(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。
(3) 其他资产明细

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	61,474.17
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,866,777.16
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,928,251.33

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	61,474.17
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,866,777.16
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,928,251.33

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	61,474.17
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,866,777.16
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,928,251.33

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	61,474.17
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,866,777.16
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,928,251.33

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	61,474.17
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,866,777.16
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,928,251.33

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	61,474.17
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,866,777.16
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,928,251.33

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	61,474.17
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,866,777.16
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,928,251.33

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	61,474.17
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,866,777.16
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,928,251.33

据中国证券监督管理委员会《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》(【2008】38号公告)、中国证券业协会基金估值工作小组《证券投资基金估值业务指导意见》以及中国证券投资基金业协会《关于发布中国证券投资基金业协会估值指数的通知》(中基协发[2013]第13号)的原则和规定,本公司对管理的不同基金持有同一证券的估值政策