

信息披露 disclosure

鹏华金刚保本混合型证券投资基金

2015 年度 报告 摘要

我们对债券市场维持谨慎乐观的态度,操作上将倾向于以中短期中等等级的信用债为主,并维持一定的杠杆水平。

对于权益市场,我们将严格控制权益仓位,积极把握右侧的投资机会。

4.6 管理人对于报告期内基金投资策略和运作情况的说明

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

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会计核算主体,独立建账、独立核算,保证不同基金之间在名称登记、账户设置、资金划划、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账务处理;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银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位外,还设有基金估值核算岗位,负责基金会计核算的日常事后复核工作,确保基金会计核算准确无误。

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[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等有市价的投资品种估值小组,成员由基金基金经理、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。

基金经理不参与或决定基金日常估值。

基金基金经理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方法。

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. 本公司现没有进行任何会计服务的约定。

4.7 管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明

1. 截止本报告期末,本基金可供分配利润为107,080,648.21元,期末基金份额净值1.0147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基金合同的规定,本基金管理人将综合考虑各方面因素,在严格遵守规定前提下,对报告期内可供分配利润适时作出相应安排。

4. 报告期内管理人对于本基金持有人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

在托管本基金的过程中,本基金托管人中国工商银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》及相关法规和规定以及基金合同、托管协议的约定,对在本基金管理人——鹏华基金管理有限公司2015年1月1日至2015年12月31日本基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为,鹏华基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,不存在有损基金份额持有人的利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,不存在有损基金份额持有人的利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为,鹏华基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有关基金资产净值的异常行为。

5.6 审计报告

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)注册会计师对本基金出具了“标准无保留意见”的审计报告。

5.7 年度财务报表

会计主体:鹏华金刚保本混合型证券投资基金

报告截止日:2015年12月31日

单位:人民币元

资产

负债

所有者权益

资产

负债

所有者权益

资产

负债

所有者权益

资产

负债

所有者权益

资产

负债

所有者权益

资产

负债

所有者权益

资产

负债

所有者权益

资产

负债

所有者权益

资产

负债

所有者权益

资产

负债

所有者权益

资产

负债

所有者权益

资产

负债

所有者权益

资产

负债

所有者权益

资产

负债

所有者权益

资产

负债

所有者权益

资产

负债

所有者权益

资产

负债

所有者权益

资产

负债

所有者权益

资产

负债

所有者权益

资产

负债

所有者权益

序号	代码/简称	股票名称	本报告期末持仓数量	占基金总资产比例(%)
1	000004	腾讯控股	32,428,280.00	5.07
2	001330	中国平安	31,459,388.04	4.91
3	000071	广药集团	30,285,167.88	4.64
4	000006	中航地产	28,769,414.61	4.44
5	000002	万科A	26,796,227.21	4.13
6	000000	浦发银行	18,489,187.20	2.81
7	000001	平安银行	18,328,368.89	2.80
8	000003	招商银行	18,127,249.63	2.79
9	000001	平安银行	21,781,747.84	3.34
10	000045	小商品城	15,918,268.47	2.45
11	001336	兴发集团	18,489,187.20	2.81
12	000000	浦发银行	17,128,448.00	2.65
13	000000	浦发银行	15,388,221.12	2.35
14	000000	浦发银行	16,363,288.02	2.50
15	000024	华兰生物	14,898,131.28	2.28
16	000029	中国人寿	14,498,131.28	2.23
17	000002	平安银行	12,825,388.84	1.97
18	000000	浦发银行	11,188,128.00	1.71
19	000000	浦发银行	10,914,768.81	1.66
20	000002	平安银行	10,171,171.11	1.55

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。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

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

序号	债券名称	持仓比例	占基金资产比例(%)
1	国债逆回购	112,017,000.00	20.74
2	国债逆回购	112,017,000.00	20.74
3	国债逆回购	112,017,000.00	20.74
4	国债逆回购	112,017,000.00	20.74
5	国债逆回购	112,017,000.00	20.74
6	国债逆回购	112,017,000.00	20.74
7	国债逆回购	112,017,000.00	20.74
8	国债逆回购	112,017,000.00	20.74
9	国债逆回购	112,017,000.00	20.74
10	国债逆回购	112,017,000.00	20.74

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

序号	债券名称	债券代码	持仓比例	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	121218A	121218A	1,342,467.41	138,247,369.00	24.53
2	121218A	121218A	889,259.20	91,347,313.60	16.63
3	121218A	121218A	483,525.00	49,732,464.00	9.04
4	121218A	121218A	514,000.00	52,841,000.00	9.64
5	130409	130409	540,000.00	51,475,000.00	9.40

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:无。

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:无。

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:无。

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

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 本报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

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。

8.12 投资组合报告附注

15华泰C1发行主体华泰证券股份有限公司(以下简称公司)于2015年9月收到中国证券监督管理委员会《行政处罚事先告知书》(处罚字[2015]172号),由于未按照《关于加强证券经营机构客户交易终端信息管理等客户信息管理的规定》第六条、第八条、第十三条、《中国证券登记结算有限责任公司证券账户管理规则》第五十条的规定对客户身份信息进行审核和反馈,违反了《证券公司监督管理条例》第二十八条第一款的规定,构成《证券公司监督管理条例》第八十一条第(四)项所述的违反。在证监会发布《关于清理整顿证券行业证券业务活动的意见》(证监会公告[2015]119号)之后,仍未采取有效措施清理证券行业证券业务活动,未及时发现和纠正证券行业证券业务活动,致使证监会对华泰证券业务整改事宜,给予了警告,没收违法所得,处以罚款。上述处罚事项可能给公司业务开展带来一定影响,但不会从根本上影响公司的正常经营,公司将按照相关规定和中国证监会的要求,认真进行整改,并进一步加强日常经营管理和风险管理,依法依规地开展各项业务。

美欣达于2015年2月收到深圳证券交易所中小板公司管理部下发的中小板关注函[2015]第67号《关于江苏美欣达印染集团股份有限公司的监管关注函》,要求

在2015年3月13日前向深圳证券交易所提交书面说明材料,说明所筹划重大事项的进展情况,申请股票继续停牌的理由,下一步工作计划和预计复牌时间,并加快工作进度,尽快申请股票复牌。维持投资者合法权益。公司对上述事项进行了说明并承诺如2015年3月31日前上述工作无法完成,公司将终止该重大资产重组并召开重组,同时按照相关法律法规、法规、深圳证券交易所《股票上市规则》和《中小板上市公司规范运作指引》等规定,公司承诺股票复牌之日起6个月内不再筹划重大资产重组事项。目前该公司已恢复上市。

12太钢01发行主体山西太钢不锈钢股份有限公司(以下简称公司)于2015年6月收到太原市环境保护局出具的并开日罚字[2015]001号及并开日罚字[2015]002号行政处罚决定书,对公司的环境违法行为处以人民币共计165万元。公司及相关部门及人员虚心接受太原市环境保护局行政处罚,不申请行政复议提起行政复议诉讼,已在规定期限内缴纳罚款。本次事项对公司经营不构成实质性影响,公司将进一步从严加强环境保护管理,确保各项环保措施全面落实到位,实现厂区环境质量的持续改善。

对上述证券的处罚,未对公司投资价值产生实质性影响,本基金管理人长期跟踪研究该公司,认为公司的上述违规行为对公司并不产生实质性影响。上述证券的投资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它证券本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、处罚的情况。

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 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	资产名称	金额
1	存出保证金	217,768.80
2	应收证券清算款	9,382,368.69
3	应收股利	-
4	应收利息	17,292,468.89
5	其他应收款	27,714.84
6	其他流动资产	-
7	待摊费用	-
8	预付账款	-
9	其他	28,251,287.82

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:无。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:无。

9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户名	持有份额(份)	持有比例(%)
3,281	31,243,281	100.00

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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。

9.3 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的情况

注:本公司高级管理人员、基金投资和研究部门7名人员及本基金基金经理本报告期末未持有本基金份额。

10 开放式基金估值

单位:份

基金名称	估值日期	估值金额	估值单位
鹏华金刚保本混合型证券投资基金	2015年12月31日	1,440,285,000.00	1,440,285,000.00
鹏华金刚保本混合型证券投资基金	2015年12月31日	1,440,285,000.00	1,440,285,000.00
鹏华金刚保本混合型证券投资基金	2015年12月31日	1,440,285,000.00	1,440,285,000.00
鹏华金刚保本混合型证券投资基金	2015年12月31日	1,440,285,000.00	1,440,285,000.00

注:总申购份额含红利再投、转换转入份额,总赎回份额含转换转出份额。

11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

注:无。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门(或)的重大人事变动

注:无。

11.3 涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼

注:无。

11.4 基金投资策略的改变

注:无。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

注:无。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注:无。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行证券投资及佣金支付情况

单位:人民币元

(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