

鹏华策略优选灵活配置混合型证券投资基金（原普丰证券投资基金转型）2014 年年度报告

2014 年 12 月 31 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

送出日期：2015 年 3 月 26 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。本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 2015 年 3 月 24 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。

本基金系原封闭式基金普丰证券投资基金转型而来。2014 年 5 月 15 日，普丰证券投资基金基金份额持有人大会以现场方式召开，大会讨论通过了普丰证券投资基金转型议案，内容包括普丰证券投资基金由封闭式基金转为开放式基金、调整存续期限、终止上市、调整投资目标、范围和策略以及修订基金合同等。依据中国证监会 2014 年 5 月 28 日证券基金机构监管部函[2014]373 号文备案，持有人大会决议生效。自 2014 年 6 月 10 日起，原《普丰证券投资基金基金合同》终止，《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，基金正式转型为开放式基金，存续期限调整为无限期，基金投资目标、范围和策略调整，同时基金更名为“鹏华策略优选灵活配置混合型证券投资基金”。

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。

本报告中，原普丰证券投资基金报告期自 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 9 日止，鹏华策略优选灵活配置混合型证券投资基金报告期自 2014 年 6 月 10 日（基金合同生效日）至 2014 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

| | |
|--|-----------|
| §1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示..... | 2 |
| 1.2 目录..... | 3 |
| §2 基金简介 | 6 |
| 2.1 基金基本情况（转型前）..... | 6 |
| 2.1 基金基本情况（转型后）..... | 6 |
| 2.2 基金产品说明（转型前）..... | 6 |
| 2.2 基金产品说明（转型后）..... | 7 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人..... | 7 |
| 2.4 信息披露方式..... | 8 |
| 2.5 其他相关资料..... | 8 |
| §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 | 8 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 8 |
| 3.2 基金净值表现（转型前）..... | 10 |
| 3.2 基金净值表现（转型后）..... | 11 |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况..... | 13 |
| §4 管理人报告 | 13 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 13 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明..... | 16 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 16 |
| 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..... | 18 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 18 |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况..... | 18 |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 19 |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 20 |
| 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明..... | 20 |
| §5 托管人报告 | 20 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 20 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明..... | 20 |
| 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..... | 21 |
| §6 审计报告(转型前) | 21 |
| 6.1 审计报告基本信息..... | 21 |
| 6.2 审计报告的基本内容..... | 21 |
| §6 审计报告（转型后） | 22 |
| 6.1 审计报告基本信息..... | 22 |
| 6.2 审计报告的基本内容..... | 22 |
| §7 年度财务报表(转型前) | 23 |
| 7.1 资产负债表(转型前)..... | 23 |
| 7.2 利润表..... | 25 |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表..... | 26 |
| 7.4 报表附注..... | 27 |
| §7 年度财务报表(转型后) | 47 |

| | |
|--|-----------|
| 7.1 资产负债表（转型后） | 47 |
| 7.2 利润表 | 49 |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表 | 50 |
| 7.4 报表附注 | 50 |
| §8 投资组合报告(转型前) | 71 |
| 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） | 71 |
| 8.1 期末基金资产组合情况 | 71 |
| 8.2 期末按行业分类的股票投资组合 | 72 |
| 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 | 73 |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 81 |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 83 |
| 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 | 83 |
| 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 | 84 |
| 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 | 84 |
| 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 | 84 |
| 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 | 84 |
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 84 |
| 8.12 投资组合报告附注 | 84 |
| §8 投资组合报告(转型后) | 85 |
| 转型后：鹏华策略优选灵活配置混合型证券投资基金（报告期：2014 年 6 月 10 日（基金合同生效日）-2014 年 12 月 31 日） | 85 |
| 8.1 期末基金资产组合情况 | 85 |
| 8.2 期末按行业分类的股票投资组合 | 86 |
| 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 | 87 |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 88 |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 90 |
| 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 | 90 |
| 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 | 90 |
| 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 | 90 |
| 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 | 90 |
| 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 | 91 |
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 91 |
| 8.12 投资组合报告附注 | 91 |
| §9 基金份额持有人信息(转型前) | 92 |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 92 |
| 9.2 期末上市基金前十名持有人 | 92 |
| 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 93 |
| 9.4 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 | 93 |
| §9 基金份额持有人信息(转型后) | 93 |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 93 |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 93 |
| 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 | 93 |
| §10 开放式基金份额变动 | 93 |
| §11 重大事件揭示 | 94 |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 | 94 |

| | |
|--|------------|
| 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 | 94 |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 95 |
| 11.4 基金投资策略的改变 | 95 |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 95 |
| 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 | 95 |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 (转型后)..... | 95 |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 (转型前)..... | 97 |
| 11.8 其他重大事件 (转型后) | 98 |
| 11.8 其他重大事件 (转型前) | 103 |
| §12 影响投资者决策的其他重要信息..... | 105 |
| §13 备查文件目录..... | 106 |
| 13.1 备查文件目录..... | 106 |
| 13.2 存放地点..... | 106 |
| 13.3 查阅方式..... | 106 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况（转型前）

| | |
|------------------|--------------------|
| 基金名称 | 普丰证券投资基金 |
| 基金简称 | 鹏华普丰封闭 |
| 场内简称 | 基金普丰 |
| 基金主代码 | 184693 |
| 基金交易代码 | 184693 |
| 基金运作方式 | 契约型封闭式 |
| 基金合同生效日 | 1999 年 7 月 14 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 | 3,000,000,000.00 份 |
| 基金合同存续期（若有） | 至 2014 年 6 月 9 日止 |
| 基金份额上市的证券交易所（若有） | 深圳证券交易所 |
| 上市日期（若有） | 1999-07-30 |

2.1 基金基本情况（转型后）

| | |
|-------------|---------------------|
| 基金名称 | 鹏华策略优选灵活配置混合型证券投资基金 |
| 基金简称 | 鹏华策略优选混合 |
| 场内简称 | 鹏华策略 |
| 基金主代码 | 160627 |
| 基金交易代码 | 160627 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2014 年 6 月 10 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 | 666,865,536.12 份 |
| 基金合同存续期（若有） | 不定期 |

2.2 基金产品说明（转型前）

| | |
|------|--|
| 投资目标 | 导入指数化投资概念，增加投资广度，分散投资风险，同时贯彻绩优、成长的选股原则。通过指数化投资和优化组合投资两种模式的积极结合，实现风险与收益的有效平衡，力争使基金取得超过市场平均收益率以上的投资收益，实现基金资产的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | 本基金将指数化投资与优化组合投资有机结合，在进一步分散风险的同时，积极投资绩优股和成长股，将基金财产按一定比例分为指数化投资部分、债券投资部分和 |

| | |
|------------|-------------------------------|
| | 优化组合投资部分，力争在降低风险的同时，实现基金财产增值。 |
| 业绩比较基准（若有） | 无 |
| 风险收益特征（若有） | 无 |

2.2 基金产品说明（转型后）

| | |
|------------|--|
| 投资目标 | 灵活优选多种投资策略，挖掘优质的上市公司，在有效控制风险前提下，力求超额收益与长期资本增值。 |
| 投资策略 | <p>1、资产配置策略</p> <p>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。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金的股票投资包含策略选股和个股分析两个步骤。首先根据不同市场状况灵活运用多种策略选出备选股票，再针对相关个股进行深度分析。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>本基金债券投资将采取久期策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、个券选择策略、信用策略、中小企业私募债投资策略等积极投资策略。</p> <p>4、股指期货、权证等投资策略</p> <p>本基金可投资股指期货、权证和其他经中国证监会允许的金融衍生产品。</p> <p>本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低申购赎回时现金资产对投资组合的影响及投资组合仓位调整的交易成本，达到稳定投资组合资产净值的目的。</p> |
| 业绩比较基准（若有） | 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（若有） | 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 | 中国工商银行股份有限公司 |

| | | | |
|---------|------|--------------------------------|---------------------|
| 信息披露负责人 | 姓名 | 张戈 | 蒋松云 |
| | 联系电话 | 0755-82825720 | 010-66105799 |
| | 电子邮箱 | zhangge@phfund.com.cn | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话 | | 4006788999 | 95588 |
| 传真 | | 0755-82021126 | 010-66105798 |
| 注册地址 | | 深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层 | 北京市西城区复兴门内大街 55 号 |
| 办公地址 | | 深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层 | 北京市西城区复兴门内大街 55 号 |
| 邮政编码 | | 518048 | 100140 |
| 法定代表人 | | 何如 | 姜建清 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|--|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.phfund.com |
| 基金年度报告备置地点 | 深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层鹏华基金管理有限公司。 北京市西城区复兴门内大街 55 号中国工商银行股份有限公司 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|----------------------|-------------------------|
| 会计师事务所 | 普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙） | 上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼 |
| 注册登记机构 | 中国证券登记结算有限责任公司 | 北京市西城区太平桥大街 17 号 |

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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 | 2014 年 1 月 1 日 -2014 年 6 月 9 日 (基金合同失效前日) | 2014 年 6 月 10 日 (基金合同生效日) -2014 年 12 月 31 日 | 2013 年 | 2012 年 |
|---------------|---|---|----------------|-----------------|
| | 转型前 | 转型后 | | |
| 本期已实现收益 | -23,928,586.26 | 29,261,122.51 | 89,941,878.63 | -263,126,251.17 |
| 本期利润 | -106,372,751.99 | 278,806,923.56 | -74,304,415.10 | 52,969,495.71 |
| 加权平均基金 | -0.0355 | 0.1949 | -0.0248 | 0.0177 |

| | | | | |
|----------------------|---------------------------------|---------------------|------------------|------------------|
| 份额本期利润 | | | | |
| 本期加权平均净值利润率 | -4.42% | 19.56% | -2.97% | 2.09% |
| 本期基金份额净值增长率 | -4.24% | 25.36% | -2.88% | 2.10% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末 2014年6月9日 (基金合同失效前日) | 报告期末 2014年12月31日 | 2013年末 | 2012年末 |
| 期末可供分配利润 | -596,561,874.36 | -83,383,982.59 | -490,189,122.37 | -548,495,950.53 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.1989 | -0.1250 | -0.1634 | -0.1828 |
| 期末基金资产净值 | 2,403,438,125.64 | 824,383,929.33 | 2,509,810,877.63 | 2,584,115,292.73 |
| 期末基金份额净值 | 0.8011 | 1.236 | 0.8366 | 0.8614 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末 2014年6月9日 (基金合同失效前日) | 报告期末 2014年12月31日 | 2013年末 | 2012年末 |
| 基金份额累计净值增长率 | 173.11% | 25.36% | 185.00% | 193.45% |

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、封闭式基金交易佣金等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(3) 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润期末余额和未分配利润中已实现部分的期末余额的孰低数。表中的“期末”均指报告期最后一日，即12月31日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

(4) 转型前基金本报告期自2014年1月1日起至2014年6月9日止，转型后基金本报告期自2014年6月10日（基金合同生效日）起至2014年12月31日止。

3.2 基金净值表现（转型前）

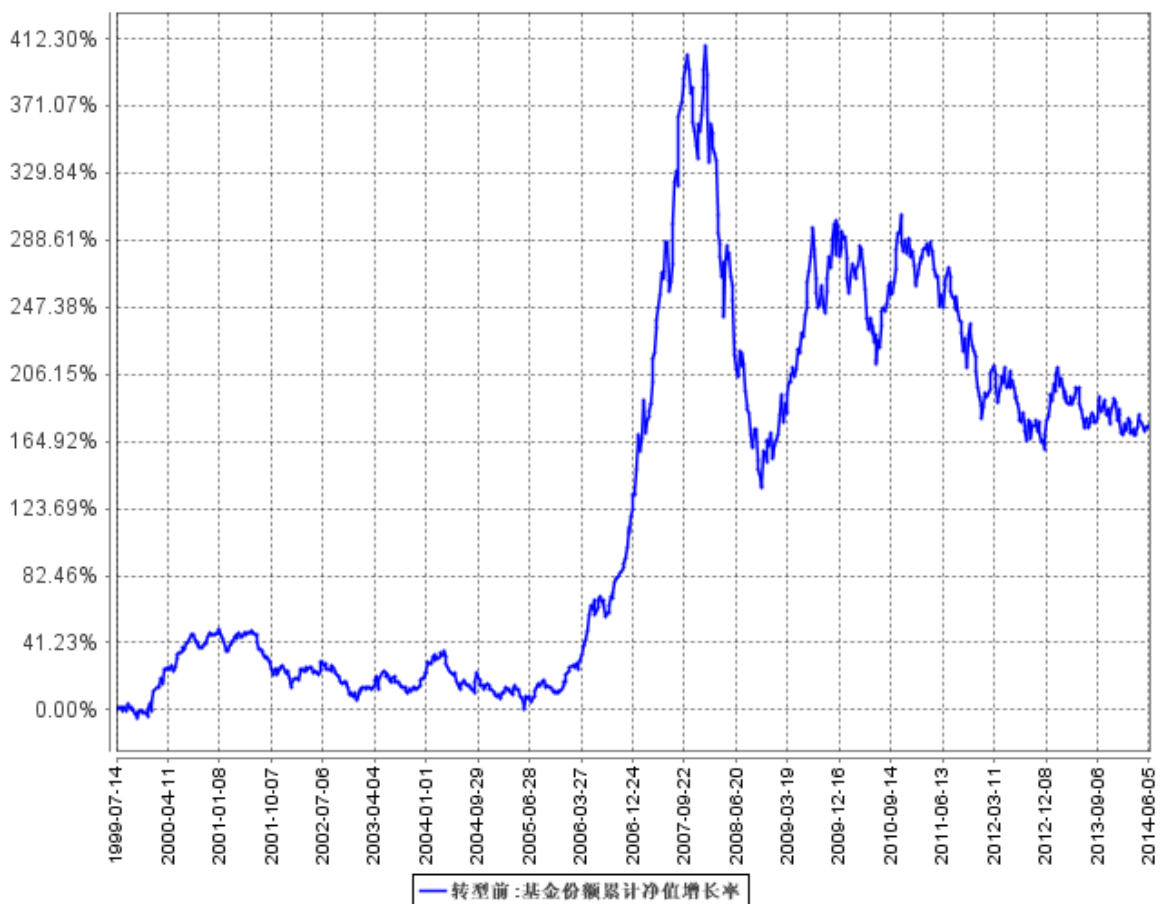
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 转型前 | | | | | | |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|-----|-----|
| 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 |
| 过去三个月 | 1.14% | 1.00% | - | - | - | - |
| 过去六个月 | -4.24% | 1.41% | - | - | - | - |
| 过去一年 | -0.06% | 1.64% | - | - | - | - |
| 过去三年 | -24.64% | 1.98% | - | - | - | - |
| 自基金合同生效起至今 | 173.11% | 2.42% | - | - | - | - |

注：基金合同中未规定业绩比较基准。

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

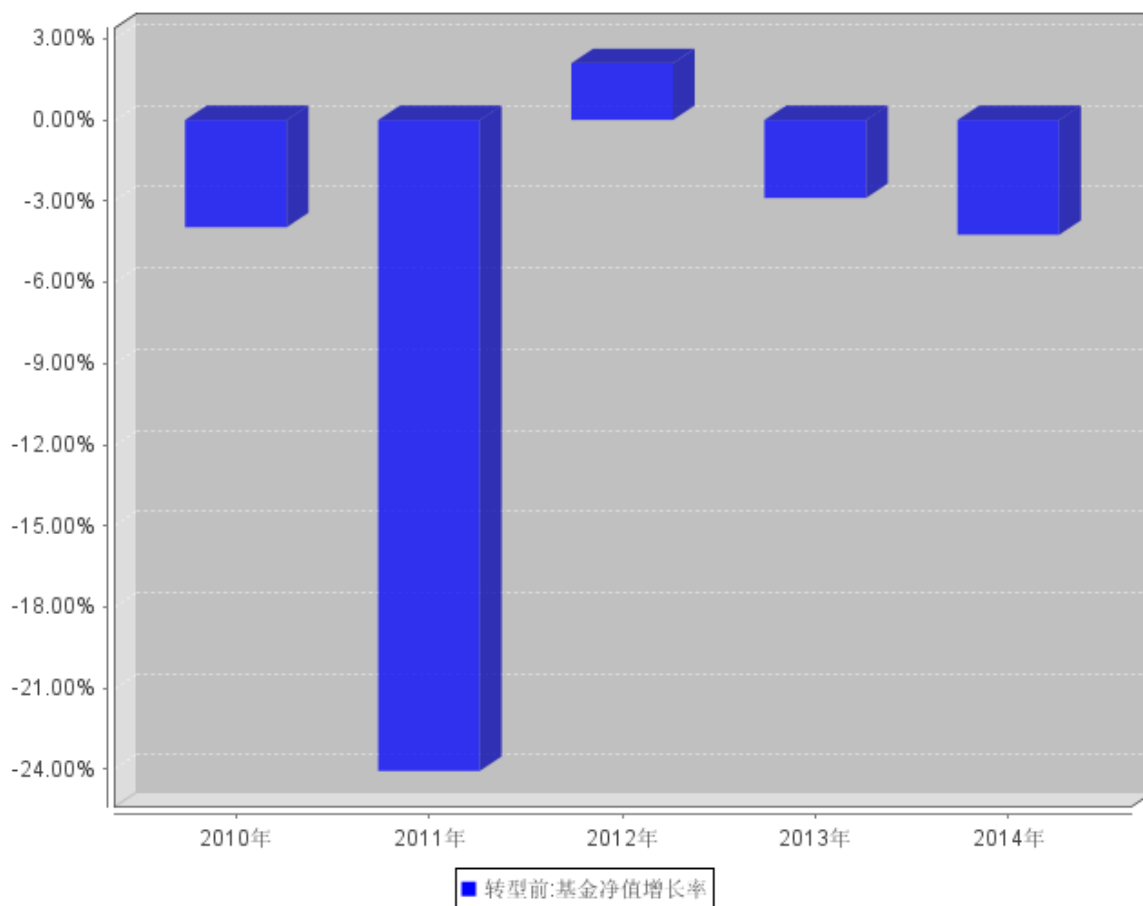


注：1、本基金基金合同于 1999 年 7 月 14 日生效。

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。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按照实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.2 基金净值表现（转型后）

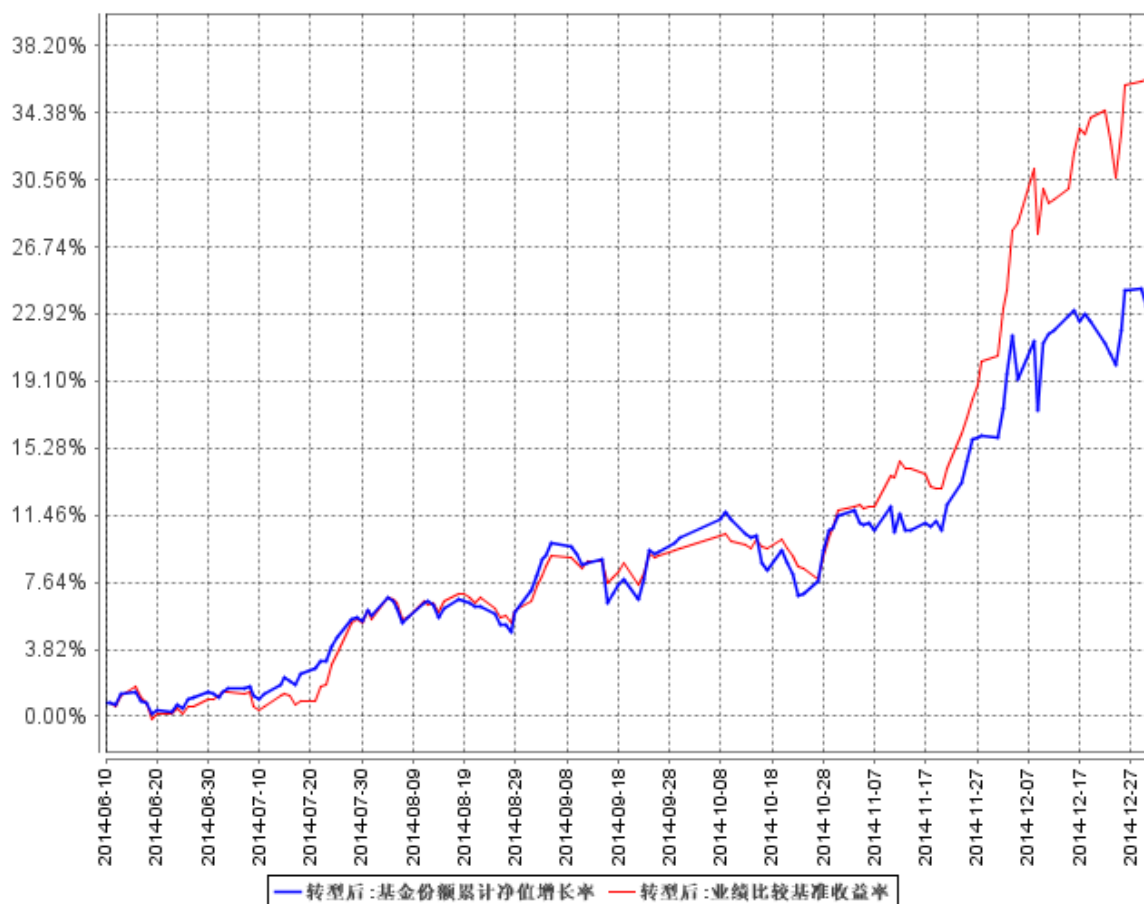
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 转型后 | | | | | | |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|-------|
| 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 |
| 过去三个月 | 13.81% | 1.08% | 26.09% | 0.98% | -12.28% | 0.10% |
| 过去六个月 | 23.66% | 0.86% | 36.72% | 0.79% | -13.06% | 0.07% |
| 自基金合同生效起至今 | 25.36% | 0.82% | 38.11% | 0.77% | -12.75% | 0.05% |

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 自基金转型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

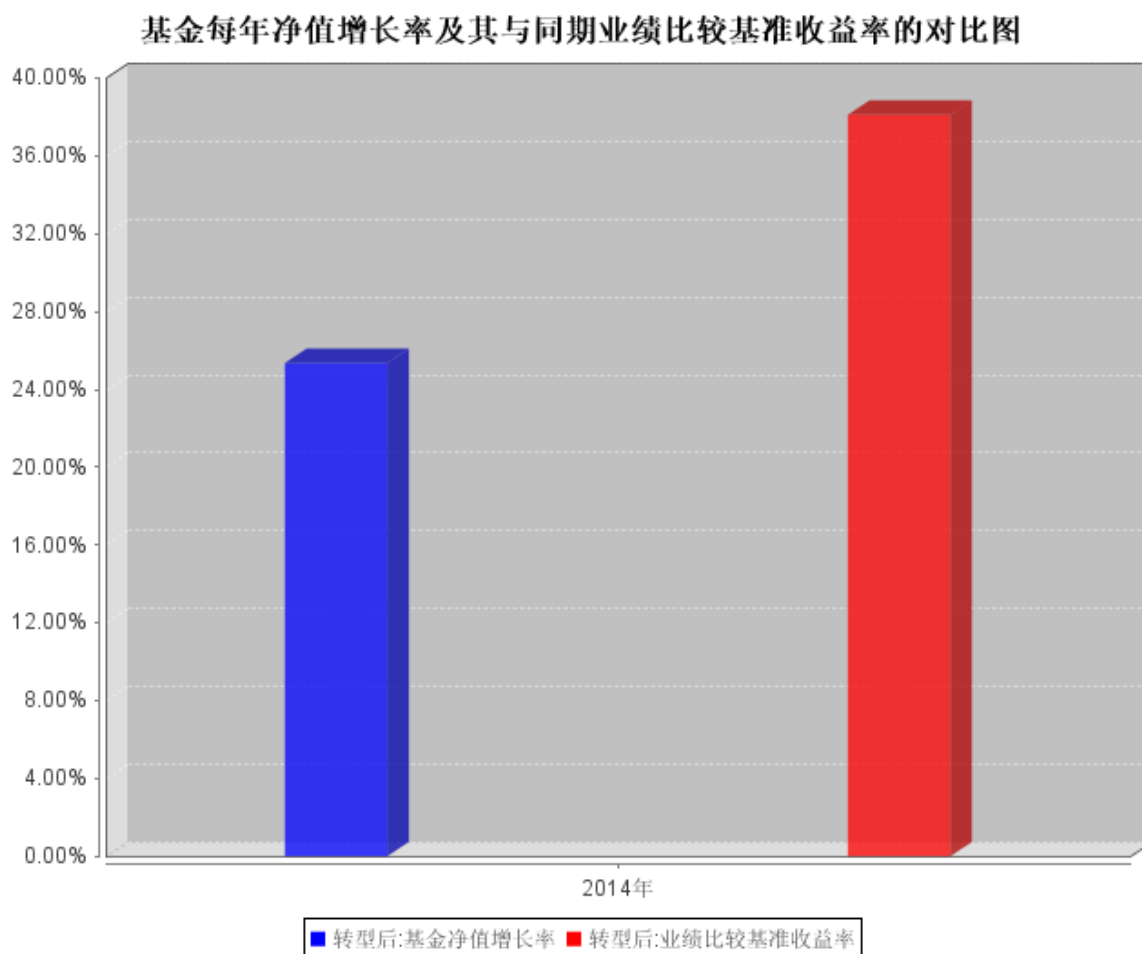
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2014 年 6 月 10 日生效，截至本报告期末本基金基金合同生效未满一年且仍处于建仓期。

2、本基金管理人将严格按照本基金合同的约定，于本基金建仓期届满后确保各项投资比例符合基金合同的约定。

3.2.3 自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：合同生效当年按照实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

过去三年本基金未进行利润分配。

§ 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 57 只开放式基金和 9 只社保组合，经过 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（转型前）

| 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 | | |
| 陈鹏 | 本基金基金经理 | 2013 年 1 月 26 日 | 2014 年 4 月 19 日 | 11 | 陈鹏先生，国籍中国，清华大学工商管理硕士，11 年证券从业经验。曾在联合证券有限责任公司任行业研究员；2006 年 5 月加入鹏华基金管理有限公司从事行业研究工作，历任行业研究员、鹏华价值优势股票型证券投资基金（LOF）基金经理助理，2007 年 8 月至 2011 年 1 月担任鹏华行业成长证券投资基金基金经理，2008 年 8 月至 2011 年 5 月担任鹏华普丰基金基金经理，2011 年 6 月至 2013 年 3 月担任鹏华新兴产业股票型证券投资基金基金经理，2013 年 1 月至 2014 年 4 月担任鹏华普丰基金基金经理，2011 年 1 月起至今担任鹏华中国 50 开放式证券投资基金基金经理，现同时担任基金管理部副总经理、投资决策委员会成员。陈鹏先生具备基金从业资格。本报告期内陈鹏不再担任本基金基金经理。 |
| 张戈 | 本基金基金经理 | 2014 年 4 月 19 日 | 2014 年 6 月 10 日 | 7 | 张戈先生，经济学博士，7 年证券从业 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|---|
| | | | | | <p>经验。历任宝盈基金管理有限公司核心研究员，从事策略、地产等研究；2012年5月加盟鹏华基金管理有限公司，担任研究部高级研究员，从事策略研究工作，2014年4月至2014年6月担任鹏华普丰证券投资基金（2014年6月已转型为鹏华策略优选灵活配置混合型证券投资基金）基金经理，2014年6月起至今担任鹏华策略优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。张戈先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理发生变动。</p> |
|--|--|--|--|--|---|

基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型后）

| 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 | | |
| 张戈 | 本基金基金经理 | 2014年6月10日 | - | 7 | 张戈先生，国籍中国，经济学博士，7年证券从业经验。历任宝盈基金管理有限公司核心研究员，从事策略、地产等研究；2012年5月加盟鹏华基金管理有限公司，担任研究部高级研究员，从事策略研究工作，2014年4月至2014年6月担任鹏华普丰证券投资基金（2014年6月 |

| | | | | |
|--|--|--|--|--|
| | | | | 已转型为鹏华策略优选灵活配置混合型证券投资基金) 基金经理, 2014 年 6 月起至今担任鹏华策略优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2014 年 7 月起兼任鹏华优质治理股票型证券投资基金 (LOF) 基金经理。张戈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合规守信情况的说明

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本基金基金合同的约定, 本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产, 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, 本基金运作合法合规, 不存在违反基金合同和损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》, 公司制定了《鹏华基金管理有限公司公平交易管理规定》, 将公司所管理的封闭式基金、开放式基金、社保组合、特定客户资产管理组合等不同资产组合的授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动均纳入公平交易管理, 在业务流程和岗位职责中制定公平交易的控制规则和控制活动, 建立对公平交易的执行、监督及审核流程, 严禁在不同投资组合之间进行利益输送。在投资研究环节: 1、公司使用唯一的研究报告发布平台“研究报告管理平台”, 确保各投资组合在获得投资信息、研究支持、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会; 2、公司严格按照《股票库管理规定》、《信用产品投资管理规定》, 执行股票及信用产品出入库及日常维护工作, 确保相关证券入库以内容严谨、观点明确的研究报告作为依据; 3、在公司股票库基础上, 各涉及股票投资的资产组合根

据各自的投资目标、投资风格、投资范围和防范关联交易的原则分别建立资产组合股票库，基金经理在股票库基础上根据投资授权以及基金合同择股方式构建具体的投资组合；4、严格执行投资授权制度，明确投资决策委员会、分管投资副总裁、基金经理等各主体的职责和权限划分，合理确定基金经理的投资权限，超过投资权限的操作，应严格履行审批程序。在交易执行环节：1、所有公司管理的资产组合的交易必须通过集中交易室完成，集中交易室负责建立和执行交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会；2、针对交易所公开竞价交易，集中交易室应严格启用恒生交易系统内的公平交易程序，交易系统则自动启用公平交易功能，由系统按照“未委托数量”的比例对不同资产组合进行委托量的公平分配；如果相关基金经理坚持以不同的价格进行交易，且当前市场价格不能同时满足多个资产组合的指令价格要求时，交易系统自动按照“价格优先”原则进行委托；当市场价格同时满足多个资产组合的指令价格要求时，则交易系统自动按照“同一指令价格下的公平交易”模式，进行公平委托和交易量分配；3、银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易需依据公司《股票投资交易流程》和《固定收益投资管理流程》的规定执行；银行间市场交易、交易所大宗交易等以公司名义进行的交易，各投资组合经理应在交易前独立确定各投资组合的交易价格和数量，公司按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；4、新股、新债申购及非公开定向增发交易需依据公司《新股申购流程》、《固定收益投资管理流程》和《非公开定向增发流程》的规定执行，对新股和新债申购方案和分配过程进行审核和监控。在交易监控、分析与评估环节：1、为加强对日常投资交易行为的监控和管理，杜绝利益输送、不公平交易等违规交易行为，防范日常交易风险，公司明确了关注类交易的界定及对应的监控和评估措施机制；所监控的交易包括但不限于：交易所公开竞价交易中同日同向交易的交易时机和交易价差、不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差、关联交易、债券交易收益率偏离度、成交量和成交价格异常、银行间债券交易对手交易等；2、将公平交易作为投资组合业绩归因分析和交易绩效评价的重要关注内容，发现的异常情况由投资监察员进行分析；3、监察稽核部分别于每季度和每年度编写《公平交易执行情况检查报告》，内容包括关注类交易监控执行情况、不同投资组合的整体收益率差异分析和同向交易价差分析；《公平交易执行情况检查报告》需经公司基金经理、督察长和总经理签署。

4.3.2 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、分配各环节得到公平对待。同时，根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求，公司对所管理组合的不同时间窗的同向交易进行了价差专项分析，未发现存在违反公平交易原则的现象。

4.3.3 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并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 5 次，主要原因在于指数成分股交易不活跃及采用量化策略的基金调仓导致。

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

回顾 2014 年，中国债市和股市均经历了一轮牛市，而和实体联系密切的房地产和各类大宗商品价格则持续低迷。造成这一现象的逻辑是，在经济疲弱的背景下，货币政策出现了明显的宽松，成为推动资产表现的主导因素。4 季度结构性政策更加积极，包括放松地产限购、推进“一带一路”、自贸区和“京津冀”一体化建设等，这推动以金融、地产等低估值蓝筹为主的周期性行业大幅上涨。四季度，本基金增持了金融、地产、有色、工程机械等行业相关股票。

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 25.36%，同期上证综指上涨 52.87%，深证成指上涨 35.62%，沪深 300 指数上涨 51.66%。

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 2015 年，我们认为市场仍将保持强势格局。当前沪深 300 指数市盈率不到 12 倍，除去银行以外，还有一大批市值在千亿元以上的公司市盈率都在 10 倍以下。考虑到 2015 年企业盈利增速有底、降息降准等宽松货币政策出台、居民资产重配的驱动因素，市场整体估值中枢有 20%-30% 的上升空间。

关于结构：（1）风格上大小盘相差不大。对于大盘股，在既有货币持续宽松的条件下，从增量资金和增量政策看相对安全。小盘股绝对估值偏高，但目前相对估值位于 2012 年 12 月的点位，具备一定的吸引力，其走势更多看注册制的实施进度；（2）行业。货币政策的延续使得利率下行成为最为确定的宏观特征，利率敏感型行业最为受益。与此同时，行业景气见底或维持高位仍然是基础配置的重要标准。二者综合考虑，我们会重点关注非银金融、高端装备、食品饮料、医药、交通运输等行业的投资机会。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人继续完善内部控制、提升风险管理水平，着重开展了以下各项工作：

1、继续完善内部控制体系

公司不断更新完善业务流程和运营风险数据库,通过标准化业务流程将业务操作落实到岗,明确业务流程与控制活动的关联关系,确定关键控制活动,以及各个业务操作所使用的相关文档或表单,并将业务操作与法律法规的相关法条建立关联,将控制活动与风险建立关联,将法律法规要求与信息披露报备规则建立关联。

2、继续优化内部控制措施

报告期内,公司继续完善内部控制措施,制定、颁布和更新了一系列公司基本管理制度,通过信息技术手段陆续实现了部分标准化操作流程手册的系统化,并不断优化。

3、持续改进投资监控的方法与手段,保证基金投资业务的合法合规性

报告期内,在投资日常合规监控工作方面,公司根据产品特点进一步完善了投资监控系统以提升投资监控效率;在实现交易价差分析、银行间交易分析、研究报告检查等专项检查工作定期化、日常化的基础上,公司加强了内幕交易风险的检查和防范,明确了内幕交易防范要求,多次开展有关内幕交易的培训,进一步强化全体投研人员对内幕交易行为和结果的认识。

4、规范基金销售业务,保证基金销售业务的合法合规性

报告期内,在基金募集和持续营销活动中,公司严格规范基金销售业务,按照《证券投资基金销售管理办法》及相关法规规定审查宣传推介材料,逐步落实反洗钱法律法规各项要求,并督促销售部门做好投资者教育工作,本报告期内没有出现主动违规行为。

5、开展以风险为导向的内部稽核

报告期内,监察稽核部开展了对基金投资管理、市场营销管理、财务费用管理和公司日常运作的定期监察稽核与专项监察稽核。监察稽核人员开展了以风险为导向的内部稽核,通过稽核发现,提高了公司标准化操作流程手册的执行效力,优化了标准化操作流程手册,更新了风险控制矩阵。报告期内,公司没有发生重大风险事件。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.7.1 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:

4.7.1.1 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

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。

4.7.1.2 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。

4.7.2 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。

4.7.3 本公司参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.7.4 本公司现没有进行任何定价服务的签约。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

4.8.1 截止本报告期末，本基金可供分配利润为-83,383,982.59元，期末基金份额净值1.236元，不符合利润分配条件，本基金本期将不进行利润分配。

4.8.2 本基金本报告期内未进行利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有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

本报告期内，本基金托管人在对鹏华策略优选灵活配置混合型证券投资基金（原普丰证券投资基金）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，鹏华策略优选灵活配置混合型证券投资基金（原普丰证券投资基金）的托管人——鹏华基金管理有限公司在鹏华策略优选灵活配置混合型证券投资基金（原普丰证券投资基金）

的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人依法对鹏华基金管理有限公司编制和披露的鹏华策略优选灵活配置混合型证券投资基金（原普丰证券投资基金）2014 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告(转型前)

6.1 审计报告基本信息

| | |
|------------|-------------------------|
| 财务报表是否经过审计 | 是 |
| 审计意见类型 | 标准无保留意见 |
| 审计报告编号 | 普华永道中天审字(2015)第 21434 号 |

6.2 审计报告的基本内容

| 审计报告标题 | 审计报告 |
|--------------|---|
| 审计报告收件人 | 普丰证券投资基金全体基金份额持有人 |
| 引言段 | 我们审计了后附的普丰证券投资基金(以下简称“基金普丰”)的财务报表,包括 2014 年 6 月 9 日(基金合同失效前日)的资产负债表、2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 9 日(基金合同失效前日)止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。 |
| 管理层对财务报表的责任段 | 编制和公允列报财务报表是 基金普丰 的基金管理人 鹏华基金管理有限公司 管理层的责任。这种责任包括: (1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“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财务报表,并使其实现公允反映; (2) 设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 |
| 注册会计师的责任段 | 我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括 |

| | |
|-----------|---|
| | <p>对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p> |
| 审计意见段 | 我们认为，上述基金普丰的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中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，公允反映了基金普丰 2014 年 6 月 9 日(基金合同失效前日)的财务状况以及 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 9 日(基金合同失效前日)止期间的经营成果和基金净值变动情况。 |
| 注册会计师的姓名 | 单峰 魏佳亮 |
| 会计师事务所的名称 | 普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) |
| 会计师事务所的地址 | 中国 上海市 |
| 审计报告日期 | 2015 年 3 月 23 日 |

§ 6 审计报告（转型后）

6.1 审计报告基本信息

| | |
|------------|-------------------------|
| 财务报表是否经过审计 | 是 |
| 审计意见类型 | 标准无保留意见 |
| 审计报告编号 | 普华永道中天审字(2015)第 21486 号 |

6.2 审计报告的基本内容

| 审计报告标题 | 审计报告 |
|--------------|--|
| 审计报告收件人 | 鹏华策略优选灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人 |
| 引言段 | 我们审计了后附的鹏华策略优选灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“鹏华策略优选混合基金”)的财务报表,包括 2014 年 12 月 31 日的资产负债表、2014 年 6 月 10 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。 |
| 管理层对财务报表的责任段 | 编制和公允列报财务报表是鹏华策略优选混合基金的基金管理人鹏华基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括: (1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作 |

| | |
|-----------|---|
| | 编制财务报表，并使其实现公允反映； (2) 设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 |
| 注册会计师的责任段 | 我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。 我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。 |
| 审计意见段 | 我们认为，上述鹏华策略优选混合基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中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，公允反映了鹏华策略优选混合基金 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。 |
| 注册会计师的姓名 | 单峰 魏佳亮 |
| 会计师事务所的名称 | 普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) |
| 会计师事务所的地址 | 中国·上海市 |
| 审计报告日期 | 2015 年 3 月 23 日 |

§ 7 年度财务报表(转型前)

7.1 资产负债表(转型前)

会计主体：普丰证券投资基金

报告截止日：2014 年 6 月 9 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2014 年 6 月 9 日 (基金合 同失效前日) | 上年度末 2013 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|--------------------------------------|--------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 7.4.7.1 | 212,332,909.35 | 17,930,344.45 |
| 结算备付金 | | 165,828.14 | 133,907.79 |

| | | | |
|-----------------|------------|---|-----------------------------|
| 存出保证金 | | 339,995.31 | 380,685.25 |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 2,167,251,390.28 | 2,481,330,772.10 |
| 其中：股票投资 | | 1,278,320,750.73 | 1,950,795,422.02 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 888,930,639.55 | 530,535,350.08 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 7.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 7.4.7.4 | - | - |
| 应收证券清算款 | | - | - |
| 应收利息 | 7.4.7.5 | 24,890,127.14 | 13,719,391.13 |
| 应收股利 | | 216,384.02 | - |
| 应收申购款 | | - | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 7.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 2,405,196,634.24 | 2,513,495,100.72 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2014年6月9日（基金合 同失效前日） | 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 | 7.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 741,535.06 | 2,673,961.83 |
| 应付托管费 | | 148,307.03 | 534,792.39 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 7.4.7.7 | 575,266.11 | 149,410.87 |
| 应交税费 | | 2,058.00 | 2,058.00 |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 7.4.7.8 | 291,342.40 | 324,000.00 |
| 负债合计 | | 1,758,508.60 | 3,684,223.09 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 7.4.7.9 | 3,000,000,000.00 | 3,000,000,000.00 |
| 未分配利润 | 7.4.7.10 | -596,561,874.36 | -490,189,122.37 |
| 所有者权益合计 | | 2,403,438,125.64 | 2,509,810,877.63 |
| 负债和所有者权益总计 | | 2,405,196,634.24 | 2,513,495,100.72 |

注：报告截止日 2014 年 6 月 9 日（基金合同失效前日），基金份额净值 0.8011 元，基金份额总额 3,000,000,000.00 份。

7.2 利润表

会计主体：普丰证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 9 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 9 日（基金合同 失效前日） | 上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日 |
|----------------------------|------------|---|--|
| 一、收入 | | -88,322,568.95 | -30,266,481.14 |
| 1. 利息收入 | | 12,121,711.73 | 22,840,769.67 |
| 其中：存款利息收入 | 7.4.7.11 | 671,034.34 | 1,978,501.85 |
| 债券利息收入 | | 11,450,677.39 | 20,336,102.58 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | - | 526,165.24 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | -18,000,114.95 | 111,026,096.08 |
| 其中：股票投资收益 | 7.4.7.12 | -27,119,114.41 | 78,273,374.68 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 7.4.7.13 | 236,441.65 | 3,447,888.74 |
| 资产支持证券投资收益 | 7.4.7.13.1 | - | - |
| 贵金属投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | 7.4.7.14 | - | - |
| 股利收益 | 7.4.7.15 | 8,882,557.81 | 29,304,832.66 |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.16 | -82,444,165.73 | -164,246,293.73 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | 7.4.7.17 | - | 112,946.84 |
| 减：二、费用 | | 18,050,183.04 | 44,037,933.96 |
| 1. 管理人报酬 | 7.4.10.2.1 | 13,199,930.18 | 31,732,626.99 |
| 2. 托管费 | 7.4.10.2.2 | 2,639,986.05 | 6,349,930.92 |
| 3. 销售服务费 | | - | - |
| 4. 交易费用 | 7.4.7.18 | 1,942,394.81 | 5,469,591.15 |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6. 其他费用 | 7.4.7.19 | 267,872.00 | 485,784.90 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | -106,372,751.99 | -74,304,415.10 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | -106,372,751.99 | -74,304,415.10 |

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：普丰证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 9 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 9 日（基金合同失效前日） | | |
|--|--|-----------------|------------------|
| | 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 | -490,189,122.37 | 2,509,810,877.63 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | -106,372,751.99 | -106,372,751.99 |
| 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） | - | - | - |
| 其中：1. 基金申购款 | - | - | - |
| 2. 基金赎回款 | - | - | - |
| 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） | 3,000,000,000.00 | -596,561,874.36 | 2,403,438,125.64 |
| 项目 | 上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 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 | -415,884,707.27 | 2,584,115,292.73 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | -74,304,415.10 | -74,304,415.10 |
| 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） | - | - | - |
| 其中：1. 基金申购款 | - | - | - |
| 2. 基金赎回款 | - | - | - |
| 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） | 3,000,000,000.00 | -490,189,122.37 | 2,509,810,877.63 |
|-----------------|------------------|-----------------|------------------|

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：

| | | |
|------------|-----------|------------|
| <u>邓召明</u> | <u>高鹏</u> | <u>刘慧红</u> |
| 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

普丰证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(证监基字[1999]20 号文)批准于 1999 年 7 月 14 日募集设立。本基金为契约型封闭式, 存续期 15 年, 发行规模为 30 亿份基金单位。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。《普丰证券投资基金招募说明书》、《普丰证券投资基金基金合同》等文件已按规定报送中国证监会备案。本基金经深圳证券交易所(以下简称深交所)深证上[1999]63 号文审核同意, 于 1999 年 7 月 30 日在深交所挂牌交易。

根据《证券投资基金法》及相关法律法规以及《普丰证券投资基金基金合同》的有关规定, 本基金的投资范围仅限于具有良好流动性的金融工具, 包括国内依法公开发行上市的股票、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具, 其中基金资产的 50%以指数化形式、按中证指数有限公司编制的沪深 300 指数股票构成及数量比例投资, 另 50%可以投资于深沪两市绩优股、成长股和具有良好发展前景的股票以及债券; 债券投资中国债投资不低于基金资产的 20%。

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》、《普丰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 1 月 1 日至 2014 年 6 月 9 日(基金合同失效前日)止期间的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 9 日(基金合同失效前日)的财务状况以及 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 9 日(基金合同失效前日)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。

7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记帐本位币，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。每份基金份额面值为 1.00 元。

7.4.4.8 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。

7.4.4.9 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。

7.4.4.10 基金的收益分配政策

基金收益分配采取现金方式，每年度至少分配一次，年度收益分配比例不得低于基金年度已实现收益的 90%；基金当年收益应先弥补上一年度亏损后，才可进行当年收益分配；基金投资当年亏损，则不进行收益分配；每一基金份额享有同等分配权。

7.4.4.11 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[1998]55号《关于证券投资基金税收问题的通知》、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 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位: 人民币元

| 项目 | 本期末 2014 年 6 月 9 日 (基金合同失 效前日) | | 上年度末 2013 年 12 月 31 日 |
|-----------------|--------------------------------------|----------------|--------------------------|
| | 活期存款 | 212,332,909.35 | 17,930,344.45 |
| 定期存款 | - | - | |
| 其中: 存款期限 1-3 个月 | - | - | |
| 其他存款 | - | - | |
| 合计: | 212,332,909.35 | 17,930,344.45 | |

7.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

| 项目 | 本期末 2014 年 6 月 9 日 (基金合同失 效前日) | | |
|-------------------|--------------------------------------|------------------|-----------------|
| | 成本 | 公允价值 | 估值增值 |
| 股票 | 1,385,559,516.48 | 1,278,320,750.73 | -107,238,765.75 |
| 贵金属投资-金交所 黄金合约 | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 4,197,300.00 | 3,836,639.55 |
| | 银行间市场 | 891,573,790.00 | 885,094,000.00 |
| | 合计 | 895,771,090.00 | 888,930,639.55 |
| 资产支持证券 | - | - | - |
| 基金 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 合计 | 2,281,330,606.48 | 2,167,251,390.28 | -114,079,216.20 |
| 项目 | 上年度末 2013 年 12 月 31 日 | | |
| | 成本 | 公允价值 | 估值增值 |
| 股票 | 1,966,984,542.57 | 1,950,795,422.02 | -16,189,120.55 |
| 贵金属投资-金交所 黄金合约 | - | - | - |

| | | | | |
|--------|-------|------------------|------------------|----------------|
| 债券 | 交易所市场 | 4,197,300.00 | 4,061,350.08 | -135,949.92 |
| | 银行间市场 | 541,783,980.00 | 526,474,000.00 | -15,309,980.00 |
| | 合计 | 545,981,280.00 | 530,535,350.08 | -15,445,929.92 |
| 资产支持证券 | | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - |
| 合计 | | 2,512,965,822.57 | 2,481,330,772.10 | -31,635,050.47 |

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

截至本报告期末及上年度末，本基金未持有衍生金融资产和衍生金融负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：截至本报告期末及上年度末，本基金未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：截至本报告期末及上年度末，本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 | 上年度末 |
|------------|---------------------|---------------|
| | 2014年6月9日(基金合同失效前日) | 2013年12月31日 |
| 应收活期存款利息 | 396,477.77 | 3,598.10 |
| 应收定期存款利息 | - | - |
| 应收其他存款利息 | - | - |
| 应收结算备付金利息 | 2,234.51 | 60.30 |
| 应收债券利息 | 24,490,443.01 | 13,715,561.33 |
| 应收买入返售证券利息 | - | - |
| 应收申购款利息 | - | - |
| 应收黄金合约拆借孳息 | - | - |
| 其他 | 971.85 | 171.40 |
| 合计 | 24,890,127.14 | 13,719,391.13 |

注：其他为应收结算保证金利息。

7.4.7.6 其他资产

注：截至本报告期末，本基金未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 | 上年度末 |
|----|-----|------|
|----|-----|------|

| | 2014 年 6 月 9 日(基金合同失效前日) | 2013 年 12 月 31 日 |
|-------------|--------------------------|------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 573,116.11 | 149,410.87 |
| 银行间市场应付交易费用 | 2,150.00 | - |
| 合计 | 575,266.11 | 149,410.87 |

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2014 年 6 月 9 日(基金合同失效前日) | 上年度末 2013 年 12 月 31 日 |
|-------------|---------------------------------|--------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - | - |
| 应付赎回费 | - | - |
| 预提费用 | 205,342.40 | 300,000.00 |
| 应付其他 | 86,000.00 | 24,000.00 |
| 合计 | 291,342.40 | 324,000.00 |

注：其他为应付代垫券商席位费和计提的持有人大会费。

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 9 日(基金合同失效前日) | |
|---------------|--|------------------|
| | 基金份额(份) | 账面金额 |
| 基金合同生效日 | 3,000,000,000.00 | 3,000,000,000.00 |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回(以“-”号填列) | - | - |
| 本期末 | 3,000,000,000.00 | 3,000,000,000.00 |

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|-----------------|----------------|-----------------|
| 上年度末 | -458,554,071.90 | -31,635,050.47 | -490,189,122.37 |
| 本期利润 | -23,928,586.26 | -82,444,165.73 | -106,372,751.99 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | - | - | - |
| 其中：基金申购款 | - | - | - |
| 基金赎回款 | - | - | - |
| 本期已分配利润 | - | - | - |

| | | | |
|-----|-----------------|-----------------|-----------------|
| 本期末 | -482,482,658.16 | -114,079,216.20 | -596,561,874.36 |
|-----|-----------------|-----------------|-----------------|

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|-----------|-------------------------------|-----------------------|
| | 2014年1月1日至2014年6月9日（基金合同失效前日） | 2013年1月1日至2013年12月31日 |
| 活期存款利息收入 | 665,791.03 | 1,938,656.29 |
| 定期存款利息收入 | - | - |
| 其他存款利息收入 | - | - |
| 结算备付金利息收入 | 3,081.01 | 30,237.24 |
| 其他 | 2,162.30 | 9,608.32 |
| 合计 | 671,034.34 | 1,978,501.85 |

注：其他为结算保证金利息收入。

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|------------|-------------------------------|-----------------------|
| | 2014年1月1日至2014年6月9日（基金合同失效前日） | 2013年1月1日至2013年12月31日 |
| 卖出股票成交总额 | 825,909,704.71 | 1,800,587,306.71 |
| 减：卖出股票成本总额 | 853,028,819.12 | 1,722,313,932.03 |
| 买卖股票差价收入 | -27,119,114.41 | 78,273,374.68 |

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|------------------------|-------------------------------|-----------------------|
| | 2014年1月1日至2014年6月9日（基金合同失效前日） | 2013年1月1日至2013年12月31日 |
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 309,844,521.80 | 584,130,268.03 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 299,903,050.00 | 564,795,731.26 |
| 减：应收利息总额 | 9,705,030.15 | 15,886,648.03 |
| 买卖债券差价收入 | 236,441.65 | 3,447,888.74 |

7.4.7.14 衍生工具收益

注：本基金本报告期没有发生衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2014年1月1日至2014年6月9日（基金合同失效前日） | 上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日 |
|-------------|-------------------------------------|----------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 8,882,557.81 | 29,304,832.66 |
| 基金投资产生的股利收益 | - | - |
| 合计 | 8,882,557.81 | 29,304,832.66 |

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2014年1月1日至2014年6月9日（基金合同失效前日） | 上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日 |
|------------|-------------------------------------|----------------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | -82,444,165.73 | -164,246,293.73 |
| ——股票投资 | -91,049,645.20 | -144,535,055.37 |
| ——债券投资 | 8,605,479.47 | -19,711,238.36 |
| ——资产支持证券投资 | - | - |
| ——贵金属投资 | - | - |
| ——其他 | - | - |
| 2. 衍生工具 | - | - |
| ——权证投资 | - | - |
| 3. 其他 | - | - |
| 合计 | -82,444,165.73 | -164,246,293.73 |

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2014年1月1日至2014年6月9日（基金合同失效前日） | 上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日 |
|---------|-------------------------------------|----------------------------------|
| 基金赎回费收入 | - | - |
| 其他 | - | 112,946.84 |
| 合计 | - | 112,946.84 |

注：其他是交易所退还证管费。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|-----------|---|----------------------------------|
| | 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 9 日 (基金合同失效前日) | 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日 |
| 交易所市场交易费用 | 1,939,419.81 | 5,465,341.15 |
| 银行间市场交易费用 | 2,975.00 | 4,250.00 |
| 合计 | 1,942,394.81 | 5,469,591.15 |

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|--------|---|----------------------------------|
| | 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 9 日 (基金合同失效前日) | 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日 |
| 审计费用 | 43,835.20 | 100,000.00 |
| 信息披露费 | 131,507.20 | 300,000.00 |
| 其他 | 400.00 | 400.00 |
| 持有人大会费 | 10,000.00 | - |
| 账户维护费 | 9,000.00 | 18,000.00 |
| 上市年费 | 30,000.00 | 60,000.00 |
| 银行汇划费用 | 3,129.60 | 7,384.90 |
| 律师费 | 40,000.00 | - |
| 合计 | 267,872.00 | 485,784.90 |

注：其他为上清所数字证书费。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金于 2014 年 6 月 9 日进行终止上市权利登记，2014 年 6 月 10 日终止上市。原《普丰证券投资基金基金合同》于终止上市日起失效，《鹏华策略优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于同日起生效，同时本基金更名为鹏华策略优选灵活配置混合型证券投资基金。

7.4.9 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”) | 基金发起人、基金管理人 |
| 中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”) | 基金托管人 |
| 国信证券股份有限公司(“国信证券”) | 基金发起人、基金管理人的股东 |

| | |
|--|-----------|
| 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 |
| 方正证券有限责任公司(“方正证券”) | 基金发起人 |
| 安徽国元信托有限责任公司(“安徽国元信托”) | 基金发起人 |
| 安信信托股份有限公司(“安信信托”) | 基金发起人 |
| 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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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9日(基金合同失效前日) | | 上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日 | |
|-------|-------------------------------------|--------------|----------------------------------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 |
| 国信证券 | - | - | 167,368,592.97 | 4.65% |

7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元发生债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元发生债券回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方发生权证交易。

7.4.10.1.5 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9日(基金合同失效前日) | | | |
|-------|-------------------------------------|------------|----------|--------------|
| | 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 | - | - | - | - |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2013年1月1日至2013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 | 150,953.13 | 4.65% | - | - |

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------|-------------------------------|-----------------------|
| | 2014年1月1日至2014年6月9日（基金合同失效前日） | 2013年1月1日至2013年12月31日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 13,199,930.18 | 31,732,626.99 |

注：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1.25%，逐日计提，按月支付。

日管理费=前一日基金资产净值×1.25%÷当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------|-------------------------------|-----------------------|
| | 2014年1月1日至2014年6月9日（基金合同失效前日） | 2013年1月1日至2013年12月31日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 2,639,986.05 | 6,349,930.92 |

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。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间没有与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**7.4.10.4.1 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 | 上年度可比期间 |
|-------------------|-------------------------------|-----------------------|
| | 2014年1月1日至2014年6月9日（基金合同失效前日） | 2013年1月1日至2013年12月31日 |
| 基金合同生效日持有的基金份额 | - | - |
| 期初持有的基金份额 | 3,750,000.00 | 3,750,000.00 |
| 期间申购/买入总份额 | - | - |
| 期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减：期间赎回/卖出总份额 | - | - |
| 期末持有的基金份额 | 3,750,000.00 | 3,750,000.00 |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 0.13% | 0.13% |

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）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。

7.4.10.4.2 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 | | 上年度末 | |
|--------|---------------------|---------------------|---------------|---------------------|
| | 2014年6月9日（基金合同失效前日） | | 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 | 7,500,000.00 | 0.25% | 43,161,685.00 | 1.44% |
| 安徽国元信托 | 1,875,000.00 | 0.06% | 1,875,000.00 | 0.06% |
| 方正证券 | 1,875,000.00 | 0.06% | 1,875,000.00 | 0.06% |

注：（1）“方正证券、安徽国元信托”为本基金发起人；

（2）关联方投资本基金为基金发行期间按统一认购费率认购。

7.4.10.5 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 | | 上年度可比期间 | |
|--------|-------------------------------|------------|-----------------------|--------------|
| | 2014年1月1日至2014年6月9日(基金合同失效前日) | | 2013年1月1日至2013年12月31日 | |
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国工商银行 | 212,332,909.35 | 665,791.03 | 17,930,344.45 | 1,938,656.29 |

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间未参与关联方承销的证券。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2014年6月9日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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股票，也没有持有因认购新发或增发而流通受限的债券及权证。

7.4.12.2 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 |
|--------|------|-------------|------|--------|-------------|--------|---------|--------------|--------------|----|
| 600535 | 天士力 | 2014年6月3日 | 重大事项 | 37.49 | 2014年6月18日 | 39.09 | 92,877 | 1,942,282.63 | 3,481,958.73 | - |
| 600832 | 东方明珠 | 2014年5月29日 | 资产重组 | 10.98 | 2014年11月24日 | 12.01 | 270,906 | 2,235,982.62 | 2,974,547.88 | - |
| 600637 | 百视通 | 2014年5月29日 | 资产重组 | 32.03 | 2014年11月24日 | 35.19 | 92,039 | 1,528,536.25 | 2,948,009.17 | - |
| 600100 | 同方股份 | 2014年5月29日 | 重大事项 | 8.60 | 2014年6月17日 | 8.80 | 262,456 | 1,878,835.88 | 2,257,121.60 | - |
| 000009 | 中国宝安 | 2014年5月28日 | 重大事项 | 10.21 | 2014年8月15日 | 9.33 | 199,193 | 830,823.92 | 2,033,760.53 | - |
| 601669 | 中国电建 | 2014年5月13日 | 资产重组 | 2.79 | 2014年9月30日 | 2.92 | 680,300 | 2,690,769.48 | 1,898,037.00 | - |
| 000562 | 宏源证券 | 2013年10月31日 | 资产重组 | 8.22 | 2014年7月28日 | 8.93 | 211,067 | 2,322,534.06 | 1,734,970.74 | - |
| 000960 | 锡业股份 | 2014年5月6日 | 资产重组 | 12.44 | 2014年8月5日 | 13.68 | 79,500 | 2,449,177.85 | 988,980.00 | - |
| 000878 | 云南铜业 | 2014年4月17日 | 重大事项 | 7.61 | 2014年7月17日 | 7.50 | 124,453 | 1,845,074.26 | 947,087.33 | - |
| 002092 | 中泰化学 | 2014年3月28日 | 重大事项 | 5.76 | 2014年6月27日 | 5.97 | 158,009 | 2,008,046.73 | 910,131.84 | - |
| 600157 | 永泰能 | 2014年4月15日 | 资产重组 | 2.33 | 2014年6月10日 | 2.56 | 370,000 | 1,949,287.34 | 862,100.00 | - |

| | 源 | | | | | | | | | |
|--------|------|-----------|------|-------|------------|-------|---------|--------------|------------|---|
| 600058 | 五矿发展 | 2014年6月5日 | 资产重组 | 10.91 | 2014年6月16日 | 10.80 | 70,537 | 1,087,787.32 | 769,558.67 | - |
| 002069 | 獐子岛 | 2014年6月3日 | 重大事项 | 14.25 | 2014年6月24日 | 14.60 | 48,986 | 1,276,435.60 | 698,050.50 | - |
| 000807 | 云铝股份 | 2014年5月5日 | 资产重组 | 3.25 | 2014年7月28日 | 3.58 | 158,985 | 972,296.75 | 516,701.25 | - |

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 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。

7.4.12.3.2 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为封闭式股票型证券投资基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。本基金的基金管理人致力于全面内部控制体系的建设，建立了从董事会层面到各业务部门的风险管理组织架构。本基金的基金管理人在董事会下设风险控制和合规审计委员会，主要负责制定基金管理人风险控制战略和控制政策、协调突发重大风险等事项；督察长负责对基金管理人各业务环节合法合规运作进行监督检查，组织、指导基金管理人内部监察稽核工作，并可向董事会和中国证监会直接报告；在公司内部设立独立的监察稽核部，专职负责对基金管理人各部门、各业务的风险控制情况进行督促和检查，并适时提出整改建议。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2014 年 12 月 31 日，本基金持有信用类债券占基金净值比 0.16%（上年度末数据：0.16%）。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理职能部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等，其余大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

| 本期末 2014年6月9日(基 金合同失效前日) | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
|--------------------------------|------------------|----------------|------------------|------------------|------------------|
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 212,332,909.35 | - | - | - | 212,332,909.35 |
| 结算备付金 | 165,828.14 | - | - | - | 165,828.14 |
| 存出保证金 | 339,995.31 | - | - | - | 339,995.31 |
| 交易性金融资产 | 794,790,639.55 | -94,140,000.00 | 1,278,320,750.73 | 2,167,251,390.28 | |
| 应收利息 | - | - | - | 24,890,127.14 | 24,890,127.14 |
| 应收股利 | - | - | - | 216,384.02 | 216,384.02 |
| 资产总计 | 1,007,629,372.35 | -94,140,000.00 | 1,303,427,261.89 | 2,405,196,634.24 | |
| 负债 | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 741,535.06 | 741,535.06 |
| 应付托管费 | - | - | - | 148,307.03 | 148,307.03 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 575,266.11 | 575,266.11 |
| 应交税费 | - | - | - | 2,058.00 | 2,058.00 |
| 其他负债 | - | - | - | 291,342.40 | 291,342.40 |
| 负债总计 | - | - | - | 1,758,508.60 | 1,758,508.60 |
| 利率敏感度缺口 | 1,007,629,372.35 | -94,140,000.00 | 1,301,668,753.29 | 2,403,438,125.64 | |
| 上年度末 2013年12月31日 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 17,930,344.45 | - | - | - | 17,930,344.45 |
| 结算备付金 | 133,907.79 | - | - | - | 133,907.79 |
| 存出保证金 | 380,685.25 | - | - | - | 380,685.25 |
| 交易性金融资产 | 438,194,000.00 | 351,008.10 | 91,990,341.98 | 1,950,795,422.02 | 2,481,330,772.10 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - |
| 应收利息 | - | - | - | 13,719,391.13 | 13,719,391.13 |
| 其他资产 | - | - | - | - | - |

| | | | | | |
|---------|----------------|------------|---------------|------------------|------------------|
| 资产总计 | 456,638,937.49 | 351,008.10 | 91,990,341.98 | 1,964,514,813.15 | 2,513,495,100.72 |
| 负债 | | | | | |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 2,673,961.83 | 2,673,961.83 |
| 应付托管费 | - | - | - | 534,792.39 | 534,792.39 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 149,410.87 | 149,410.87 |
| 应交税费 | - | - | - | 2,058.00 | 2,058.00 |
| 其他负债 | - | - | - | 324,000.00 | 324,000.00 |
| 负债总计 | - | - | - | 3,684,223.09 | 3,684,223.09 |
| 利率敏感度缺口 | 456,638,937.49 | 351,008.10 | 91,990,341.98 | 1,960,830,590.06 | 2,509,810,877.63 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| | | | |
|----|---|-----------------------------|------------------------|
| 假设 | 该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有债券资产的利率风险状况测算的理论变动值对基金资产净值的影响金额。 | | |
| | 假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。 | | |
| | 此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。 | | |
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） | |
| | | 本期末（2014 年 6 月 9 日） | 上年度末（2013 年 12 月 31 日） |
| | 市场利率下降 25 个基点 | 2,274,670.90 | 1,931,680.92 |
| | 市场利率上升 25 个基点 | -2,236,076.63 | -1,894,525.84 |

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，

做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于股票、债券的比例不低于基金资产总值的 80%，投资于国家债券的比例不低于基金资产净值的 20%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2014 年 6 月 9 日 (基金合同失效前日) | | 上年度末 2013 年 12 月 31 日 | |
|---------------|----------------------------------|-------------------|--------------------------|----------------------|
| | 公允价值 | 占基金资产净值 比例 (%) | 公允价值 | 占基金资产 净值比例 (%) |
| 交易性金融资产-股票投资 | 1,278,320,750.73 | 53.19 | 1,950,795,422.02 | 77.73 |
| 交易性金融资产-基金投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产-贵金属投资 | - | - | - | - |
| 衍生金融资产-权证投资 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 1,278,320,750.73 | 53.19 | 1,950,795,422.02 | 77.73 |

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除业绩比较基准外的其他市场变量保持不变 | | |
|----|---------------------|------------------------------|-------------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元) | |
| | | 本期末 (2014 年 6 月 9 日) | 上年度末 (2013 年 12 月 31 日) |
| | 业绩比较基准上升 5 | 79,127,191.69 | 100,706,161.46 |
| | 业绩比较基准下降 5 | -79,127,191.69 | -100,706,161.46 |

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最

低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2014 年 6 月 9 日(基金合同失效前日)，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 1,259,136,375.04 元，属于第二层次的余额为 908,115,015.24 元，无属于第三层次的余额(2013 年 12 月 31 日：第一层次 1,942,380,373.05 元，第二层次 538,950,399.05 元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2014 年 6 月 9 日(基金合同失效前日)，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2013 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 年度财务报表(转型后)

7.1 资产负债表(转型后)

会计主体：鹏华策略优选灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2014 年 12 月 31 日 |
|-----------------|------------|---------------------------------|
| 资产: | | |
| 银行存款 | 7.4.7.1 | 85,469,129.53 |
| 结算备付金 | | 332,517.05 |
| 存出保证金 | | 744,002.53 |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 760,092,245.62 |
| 其中: 股票投资 | | 720,148,245.62 |
| 基金投资 | | - |
| 债券投资 | | 39,944,000.00 |
| 资产支持证券投资 | | - |
| 贵金属投资 | | - |
| 衍生金融资产 | 7.4.7.3 | - |
| 买入返售金融资产 | 7.4.7.4 | - |
| 应收证券清算款 | | - |
| 应收利息 | 7.4.7.5 | 1,106,364.64 |
| 应收股利 | | - |
| 应收申购款 | | 9,881.42 |
| 递延所得税资产 | | - |
| 其他资产 | 7.4.7.6 | - |
| 资产总计 | | 847,754,140.79 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2014 年 12 月 31 日 |
| 负债: | | |
| 短期借款 | | - |
| 交易性金融负债 | | - |
| 衍生金融负债 | 7.4.7.3 | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - |
| 应付证券清算款 | | - |
| 应付赎回款 | | 21,075,579.68 |
| 应付管理人报酬 | | 1,079,581.21 |
| 应付托管费 | | 179,930.22 |
| 应付销售服务费 | | - |
| 应付交易费用 | 7.4.7.7 | 536,977.58 |
| 应交税费 | | 2,058.00 |
| 应付利息 | | - |
| 应付利润 | | - |
| 递延所得税负债 | | - |
| 其他负债 | 7.4.7.8 | 496,084.77 |
| 负债合计 | | 23,370,211.46 |
| 所有者权益: | | |
| 实收基金 | 7.4.7.9 | 820,858,225.32 |
| 未分配利润 | 7.4.7.10 | 3,525,704.01 |
| 所有者权益合计 | | 824,383,929.33 |

| | | |
|------------|--|----------------|
| 负债和所有者权益总计 | | 847,754,140.79 |
|------------|--|----------------|

注：（1）报告截止日 2014 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.236 元，基金份额总额 666,865,536.12 份。

（2）本基金基金合同于 2014 年 6 月 10 日生效，无上年度末数据。

7.2 利润表

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（基金合同生效日）至 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期 |
|----------------------------|------------|---|
| | | 2014 年 6 月 10 日（基金合同生效日）至 2014 年 12 月 31 日 |
| 一、收入 | | 297,340,811.33 |
| 1. 利息收入 | | 5,225,699.11 |
| 其中：存款利息收入 | 7.4.7.11 | 1,398,581.73 |
| 债券利息收入 | | 1,854,661.65 |
| 资产支持证券利息收入 | | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 1,972,455.73 |
| 其他利息收入 | | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | 35,943,773.86 |
| 其中：股票投资收益 | 7.4.7.12 | 23,122,405.45 |
| 基金投资收益 | | - |
| 债券投资收益 | 7.4.7.13 | -3,617,540.21 |
| 资产支持证券投资收益 | 7.4.7.13.1 | - |
| 贵金属投资收益 | | - |
| 衍生工具收益 | 7.4.7.14 | - |
| 股利收益 | 7.4.7.15 | 16,438,908.62 |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.16 | 249,545,801.05 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | 7.4.7.17 | 6,625,537.31 |
| 减：二、费用 | | 18,533,887.77 |
| 1. 管理人报酬 | 7.4.10.2.1 | 11,891,535.74 |
| 2. 托管费 | 7.4.10.2.2 | 1,981,922.59 |
| 3. 销售服务费 | | - |
| 4. 交易费用 | 7.4.7.18 | 4,394,815.10 |
| 5. 利息支出 | | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - |
| 6. 其他费用 | 7.4.7.19 | 265,614.34 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 278,806,923.56 |

| | | |
|--------------------------|--|-----------------------|
| 减：所得税费用 | | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 278,806,923.56 |

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。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

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：

| | | |
|--------------------------------|-------------------------------|--------------------------------|
| <u> 邓召明 </u> | <u> 高鹏 </u> | <u> 刘慧红 </u> |
| 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 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2014 年 12 月 31 日 |
|------|-------------------------|
| 活期存款 | 85,469,129.53 |
| 定期存款 | - |

| | |
|----------------|---------------|
| 其中：存款期限 1-3 个月 | - |
| 其他存款 | - |
| 合计： | 85,469,129.53 |

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2014 年 12 月 31 日 | | | |
|-------------------|-------------------------|----------------|----------------|------------|
| | 成本 | 公允价值 | 估值增值 | |
| 股票 | 585,001,100.77 | 720,148,245.62 | 135,147,144.85 | |
| 贵金属投资-金交所 黄金合约 | - | - | - | |
| 债券 | 交易所市场 | - | - | |
| | 银行间市场 | 39,624,560.00 | 39,944,000.00 | 319,440.00 |
| | 合计 | 39,624,560.00 | 39,944,000.00 | 319,440.00 |
| 资产支持证券 | - | - | - | |
| 基金 | - | - | - | |
| 其他 | - | - | - | |
| 合计 | 624,625,660.77 | 760,092,245.62 | 135,466,584.85 | |

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：截至本报告期末，本基金未持有衍生金融资产和衍生金融负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：截至本报告期末，本基金没有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：截止本报告期末，本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2014 年 12 月 31 日 |
|-----------|-------------------------|
| 应收活期存款利息 | 15,206.27 |
| 应收定期存款利息 | - |
| 应收其他存款利息 | - |
| 应收结算备付金利息 | 149.60 |
| 应收债券利息 | 1,090,673.97 |

| | |
|------------|--------------|
| 应收买入返售证券利息 | - |
| 应收申购款利息 | - |
| 应收黄金合约拆借孳息 | - |
| 其他 | 334.80 |
| 合计 | 1,106,364.64 |

注：其他为应收结算保证金利息。

7.4.7.6 其他资产

注：截至本报告期末，本基金未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2014年12月31日 |
|-------------|--------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 536,802.58 |
| 银行间市场应付交易费用 | 175.00 |
| 合计 | 536,977.58 |

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2014年12月31日 |
|-------------|--------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | 66,084.77 |
| 预提费用 | 430,000.00 |
| 合计 | 496,084.77 |

7.4.7.9 实收基金

金额单位：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 | |
|----------------------|---|------------------|
| | 基金份额(份) | 账面金额 |
| 基金合同生效日 | 3,000,000,000.00 | 3,000,000,000.00 |
| - 2014年7月3日 基金份额折算调整 | -562,765,374.00 | - |
| - 未领取红利份额折算调整(若有) | - | - |
| - 集中申购募集资金本金及利息 | 1,662,702.17 | 2,046,625.49 |
| - 基金拆分和集中申购完成后 | 2,438,897,328.17 | 3,002,046,625.49 |
| 本期申购 | 2,487,714.03 | 3,061,821.05 |

| | | |
|---------------|-------------------|-------------------|
| 本期赎回（以“-”号填列） | -1,774,519,506.08 | -2,184,250,221.22 |
| 本期末 | 666,865,536.12 | 820,858,225.32 |

注：（1）原基金普丰于基金合同失效前经审计的基金资产净值为 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净值。根据《鹏华策略优选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》和《鹏华策略优选灵活配置混合型证券投资基金集中申购结果暨原普丰证券投资基金基金份额折算结果的公告》的有关规定，本基金以 2014 年 7 月 3 日为基金份额折算基准日对投资人持有的原基金普丰份额进行了折算，折算后原基金普丰份额变更登记为鹏华策略优选混合基金基金份额。折算前基金总份额为 3,000,000,000.00 份。根据基金份额折算公式，基金份额折算比例为 0.812411542，折算后基金份额总额为 2,437,234,626.00 份，折算后基金份额净值为 1.000 元。鹏华基金管理有限公司已根据上述折算比例，对原基金普丰投资者持有的基金份额进行了折算，并于 2014 年 7 月 4 日完成了变更登记。

（2）本基金自 2014 年 6 月 16 日至 2014 年 6 月 30 日止期间开放集中申购，共募集有效净认购资金 1,662,152.66 元。根据《鹏华策略优选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》和《鹏华策略优选灵活配置混合型证券投资基金集中申购期基金份额发售公告》的规定，本基金集中申购期内申购资金产生的利息收入 549.51 元，折算为 549.51 份基金份额，连同净有效集中申购资金一起折算基金份额，划入基金份额持有人账户。

7.4.7.10 未分配利润

金额单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 基金合同生效日 | -482,482,658.16 | -114,079,216.20 | -596,561,874.36 |
| 本期利润 | 29,261,122.51 | 249,545,801.05 | 278,806,923.56 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 369,837,553.06 | -48,556,898.25 | 321,280,654.81 |
| 其中：基金申购款 | -856,656.52 | 55,264.45 | -801,392.07 |
| 基金赎回款 | 370,694,209.58 | -48,612,162.70 | 322,082,046.88 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | -83,383,982.59 | 86,909,686.60 | 3,525,704.01 |

7.4.7.11 存款利息收入

| 项目 | 本期 2014 年 6 月 10 日（基金合同生效日）至 2014 年 12 月 31 日 |
|----------|---|
| 活期存款利息收入 | 1,293,097.21 |

| | |
|-----------|--------------|
| 定期存款利息收入 | - |
| 其他存款利息收入 | - |
| 结算备付金利息收入 | 101,024.81 |
| 其他 | 4,459.71 |
| 合计 | 1,398,581.73 |

注：其他为结算保证金利息收入和认申购款利息收入。

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

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 |
|----------|---|
| 卖出股票成交总额 | 1,729,923,235.74 |
| 卖出股票成本总额 | 1,706,800,830.29 |
| 买卖股票差价收入 | 23,122,405.45 |

7.4.7.13 债券投资收益

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 |
|------------------------|---|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 909,310,420.48 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 887,673,530.00 |
| 减：应收利息总额 | 25,254,430.69 |
| 买卖债券差价收入 | -3,617,540.21 |

7.4.7.14 股利收益

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 |
|-------------|---|
| 股票投资产生的股利收益 | 16,438,908.62 |
| 基金投资产生的股利收益 | - |
| 合计 | 16,438,908.62 |

7.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2014年6月10日(基金合同生效日)至2014 年12月31日 |
|------------|---|
| 1. 交易性金融资产 | 249,545,801.05 |
| ——股票投资 | 242,385,910.60 |
| ——债券投资 | 7,159,890.45 |
| ——资产支持证券投资 | - |
| ——贵金属投资 | - |
| ——其他 | - |
| 2. 衍生工具 | - |
| ——权证投资 | - |
| | |
| 3. 其他 | - |
| 合计 | 249,545,801.05 |

7.4.7.16 其他收入

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 |
|---------|---|
| 基金赎回费收入 | 6,507,605.60 |
| 转换费收入 | 117,931.71 |
| 合计 | 6,625,537.31 |

7.4.7.17 交易费用

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 |
|-----------|---|
| 交易所市场交易费用 | 4,391,790.10 |
| 银行间市场交易费用 | 3,025.00 |
| 合计 | 4,394,815.10 |

7.4.7.18 其他费用

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 |
|--------|-------------|
| 审计费用 | 86,164.80 |
| 信息披露费 | 168,492.80 |
| 账户维护费 | 9,000.00 |
| 银行汇划费用 | 1,956.74 |
| 合计 | 265,614.34 |

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 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。

7.4.10 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。

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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% |
|------|---------------|-------|

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 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。

7.4.10.1.4 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。

7.4.10.1.5 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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 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。

7.4.10.2.2 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。

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 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 |

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期末参与关联方承销的证券。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2014 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

| 7.4.12.1.1 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。

7.4.12.2 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 | |

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 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。

7.4.12.3.2 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型证券投资基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。本基金的基金管理人致力于全面内部控制体系的建设，建立了从董事会层面到各业务部门的风险管理组织架构。本基金的基金管理人在董事会下设风险控制和合规审计委员会，主要负责制定基金管理人风险控制战略和控制政策、协调突发重大风险等事项；督察长负责对基金管理人各业务环节合法合规运作进行监督检查，组织、指导基金管理人内部监察稽核工作，并可向董事会和中国证监会直接报告；在公司内部设立独立的监察稽核部，专职负责对基金管理人各部门、各业务的风险控制情况进行督促和检查，并适时提出整改建议。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模

型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2014 年 12 月 31 日，本基金未持有信用类债券。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理职能部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对

流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等，其余大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

| 本期末 2014 年 12 月 31 日 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|-------------------------|----------------|-------|-------|----------------|----------------|
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 85,469,129.53 | - | - | - | 85,469,129.53 |
| 结算备付金 | 332,517.05 | - | - | - | 332,517.05 |
| 存出保证金 | 744,002.53 | - | - | - | 744,002.53 |
| 交易性金融资产 | 39,944,000.00 | - | - | 720,148,245.62 | 760,092,245.62 |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | - | - | - | - |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - |
| 应收利息 | - | - | - | 1,106,364.64 | 1,106,364.64 |
| 应收股利 | - | - | - | - | - |
| 应收申购款 | - | - | - | 9,881.42 | 9,881.42 |
| 其他资产 | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 126,489,649.11 | - | - | 721,264,491.68 | 847,754,140.79 |
| 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 | - | - | - | - | - |
| 应付赎回款 | - | - | - | 21,075,579.68 | 21,075,579.68 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 1,079,581.21 | 1,079,581.21 |
| 应付托管费 | - | - | - | 179,930.22 | 179,930.22 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - |
| 应付交易费用 | - | - | - | 536,977.58 | 536,977.58 |
| 应交税费 | - | - | - | 2,058.00 | 2,058.00 |
| 应付利息 | - | - | - | - | - |
| 应付利润 | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | 496,084.77 | 496,084.77 |
| 负债总计 | - | - | - | 23,370,211.46 | 23,370,211.46 |
| 利率敏感度缺口 | 126,489,649.11 | - | - | -697,894,280.22 | 824,383,929.33 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2014 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 4.85%

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金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%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基

金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2014 年 12 月 31 日 | |
|---------------|-------------------------|---------------|
| | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
| 交易性金融资产-股票投资 | 720,148,245.62 | 87.36 |
| 交易性金融资产-基金投资 | - | - |
| 交易性金融资产-贵金属投资 | - | - |
| 衍生金融资产-权证投资 | - | - |
| 其他 | - | - |
| 合计 | 720,148,245.62 | 87.36 |

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：于 2014 年 12 月 31 日，由于本基金运行期间不足一年，尚不存在足够的经验数据，因此，无法对本基金资产净值对于市场价格风险的敏感性作定量分析。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2014 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 684,606,029.42 元，属于第二层次的余额为 75,486,216.20 元，无属于第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(i) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2014 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告(转型前)

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）

8.1 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所有股票投资明细

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所有股票投资明细

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 |
| 11 | 601288 | 农业银行 | 4,232,886 | 10,666,872.72 | 0.44 |
| 12 | 600519 | 贵州茅台 | 68,823 | 10,545,748.29 | 0.44 |
| 13 | 601328 | 交通银行 | 2,724,194 | 10,379,179.14 | 0.43 |
| 14 | 601601 | 中国太保 | 551,273 | 9,399,204.65 | 0.39 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-----------|--------------|------|
| 15 | 600104 | 上汽集团 | 577,142 | 8,570,558.70 | 0.36 |
| 16 | 601088 | 中国神华 | 569,666 | 8,169,010.44 | 0.34 |
| 17 | 601668 | 中国建筑 | 2,672,767 | 7,911,390.32 | 0.33 |
| 18 | 601169 | 北京银行 | 944,100 | 7,448,949.00 | 0.31 |
| 19 | 601006 | 大秦铁路 | 1,068,085 | 7,134,807.80 | 0.30 |
| 20 | 601818 | 光大银行 | 2,857,213 | 7,085,888.24 | 0.29 |
| 21 | 600887 | 伊利股份 | 212,820 | 6,808,111.80 | 0.28 |
| 22 | 600383 | 金地集团 | 786,107 | 6,603,298.80 | 0.27 |
| 23 | 600015 | 华夏银行 | 788,843 | 6,421,182.02 | 0.27 |
| 24 | 601939 | 建设银行 | 1,564,240 | 6,397,741.60 | 0.27 |
| 25 | 600048 | 保利地产 | 1,123,950 | 5,777,103.00 | 0.24 |
| 26 | 002024 | 苏宁云商 | 763,044 | 5,745,721.32 | 0.24 |
| 27 | 600585 | 海螺水泥 | 351,176 | 5,703,098.24 | 0.24 |
| 28 | 000858 | 五粮液 | 321,884 | 5,449,496.12 | 0.23 |
| 29 | 000333 | 美的集团 | 307,348 | 5,400,104.36 | 0.22 |
| 30 | 000776 | 广发证券 | 518,111 | 5,165,566.67 | 0.21 |
| 31 | 600900 | 长江电力 | 797,529 | 5,000,506.83 | 0.21 |
| 32 | 600111 | 包钢稀土 | 258,880 | 4,986,028.80 | 0.21 |
| 33 | 600028 | 中国石化 | 925,767 | 4,647,350.34 | 0.19 |
| 34 | 600050 | 中国联通 | 1,427,854 | 4,497,740.10 | 0.19 |
| 35 | 600089 | 特变电工 | 526,889 | 4,462,749.83 | 0.19 |
| 36 | 601857 | 中国石油 | 564,323 | 4,221,136.04 | 0.18 |
| 37 | 000538 | 云南白药 | 77,984 | 4,187,740.80 | 0.17 |
| 38 | 600999 | 招商证券 | 406,656 | 4,070,626.56 | 0.17 |
| 39 | 600690 | 青岛海尔 | 269,168 | 4,064,436.80 | 0.17 |
| 40 | 600011 | 华能国际 | 727,000 | 4,027,580.00 | 0.17 |
| 41 | 000625 | 长安汽车 | 345,749 | 4,017,603.38 | 0.17 |
| 42 | 600256 | 广汇能源 | 553,626 | 3,963,962.16 | 0.16 |
| 43 | 000063 | 中兴通讯 | 311,938 | 3,930,418.80 | 0.16 |
| 44 | 600276 | 恒瑞医药 | 116,403 | 3,900,664.53 | 0.16 |
| 45 | 601628 | 中国人寿 | 259,707 | 3,708,615.96 | 0.15 |
| 46 | 601688 | 华泰证券 | 483,989 | 3,692,836.07 | 0.15 |
| 47 | 600518 | 康美药业 | 239,159 | 3,659,132.70 | 0.15 |
| 48 | 000895 | 双汇发展 | 101,973 | 3,590,469.33 | 0.15 |
| 49 | 600196 | 复星医药 | 182,336 | 3,570,138.88 | 0.15 |
| 50 | 000581 | 威孚高科 | 138,996 | 3,524,938.56 | 0.15 |
| 51 | 000157 | 中联重科 | 788,479 | 3,508,731.55 | 0.15 |
| 52 | 600535 | 天士力 | 92,877 | 3,481,958.73 | 0.14 |
| 53 | 601989 | 中国重工 | 789,608 | 3,458,483.04 | 0.14 |

| | | | | | |
|----|--------|--------|-----------|--------------|------|
| 54 | 601766 | 中国南车 | 824,434 | 3,429,645.44 | 0.14 |
| 55 | 600795 | 国电电力 | 1,489,340 | 3,425,482.00 | 0.14 |
| 56 | 600406 | 国电南瑞 | 254,488 | 3,318,523.52 | 0.14 |
| 57 | 600019 | 宝钢股份 | 840,510 | 3,303,204.30 | 0.14 |
| 58 | 000100 | TCL 集团 | 1,438,628 | 3,294,458.12 | 0.14 |
| 59 | 000069 | 华侨城 A | 649,617 | 3,222,100.32 | 0.13 |
| 60 | 600739 | 辽宁成大 | 224,039 | 3,201,517.31 | 0.13 |
| 61 | 601988 | 中国银行 | 1,123,434 | 3,055,740.48 | 0.13 |
| 62 | 601299 | 中国北车 | 710,265 | 3,039,934.20 | 0.13 |
| 63 | 002594 | 比亚迪 | 66,452 | 3,036,856.40 | 0.13 |
| 64 | 002304 | 洋河股份 | 56,235 | 3,014,196.00 | 0.13 |
| 65 | 600832 | 东方明珠 | 270,906 | 2,974,547.88 | 0.12 |
| 66 | 600637 | 百视通 | 92,039 | 2,948,009.17 | 0.12 |
| 67 | 601009 | 南京银行 | 364,876 | 2,875,222.88 | 0.12 |
| 68 | 600309 | 万华化学 | 173,929 | 2,868,089.21 | 0.12 |
| 69 | 601901 | 方正证券 | 513,919 | 2,831,693.69 | 0.12 |
| 70 | 600031 | 三一重工 | 552,847 | 2,813,991.23 | 0.12 |
| 71 | 601899 | 紫金矿业 | 1,293,995 | 2,807,969.15 | 0.12 |
| 72 | 600703 | 三安光电 | 120,911 | 2,731,379.49 | 0.11 |
| 73 | 000338 | 潍柴动力 | 155,507 | 2,722,927.57 | 0.11 |
| 74 | 600352 | 浙江龙盛 | 178,969 | 2,691,693.76 | 0.11 |
| 75 | 600804 | 鹏博士 | 195,370 | 2,666,800.50 | 0.11 |
| 76 | 000783 | 长江证券 | 287,825 | 2,662,381.25 | 0.11 |
| 77 | 000725 | 京东方 A | 1,230,027 | 2,619,957.51 | 0.11 |
| 78 | 002241 | 歌尔声学 | 94,420 | 2,513,460.40 | 0.10 |
| 79 | 000423 | 东阿阿胶 | 81,260 | 2,479,242.60 | 0.10 |
| 80 | 600547 | 山东黄金 | 161,673 | 2,468,746.71 | 0.10 |
| 81 | 600600 | 青岛啤酒 | 58,015 | 2,415,744.60 | 0.10 |
| 82 | 601186 | 中国铁建 | 541,113 | 2,402,541.72 | 0.10 |
| 83 | 601336 | 新华保险 | 114,500 | 2,390,760.00 | 0.10 |
| 84 | 002202 | 金风科技 | 252,482 | 2,385,954.90 | 0.10 |
| 85 | 600886 | 国投电力 | 469,260 | 2,379,148.20 | 0.10 |
| 86 | 000402 | 金融街 | 398,806 | 2,352,955.40 | 0.10 |
| 87 | 600315 | 上海家化 | 73,834 | 2,297,714.08 | 0.10 |
| 88 | 601390 | 中国中铁 | 897,806 | 2,280,427.24 | 0.09 |
| 89 | 002142 | 宁波银行 | 253,540 | 2,274,253.80 | 0.09 |
| 90 | 600583 | 海油工程 | 322,506 | 2,273,667.30 | 0.09 |
| 91 | 600100 | 同方股份 | 262,456 | 2,257,121.60 | 0.09 |
| 92 | 600340 | 华夏幸福 | 88,135 | 2,238,629.00 | 0.09 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|---------|--------------|------|
| 93 | 002353 | 杰瑞股份 | 57,686 | 2,237,063.08 | 0.09 |
| 94 | 601377 | 兴业证券 | 269,580 | 2,215,947.60 | 0.09 |
| 95 | 600066 | 宇通客车 | 143,877 | 2,156,716.23 | 0.09 |
| 96 | 600332 | 白云山 | 82,500 | 2,137,575.00 | 0.09 |
| 97 | 000024 | 招商地产 | 186,137 | 2,108,932.21 | 0.09 |
| 98 | 600010 | 包钢股份 | 568,345 | 2,091,509.60 | 0.09 |
| 99 | 002415 | 海康威视 | 123,502 | 2,090,888.86 | 0.09 |
| 100 | 601998 | 中信银行 | 482,698 | 2,065,947.44 | 0.09 |
| 101 | 000009 | 中国宝安 | 199,193 | 2,033,760.53 | 0.08 |
| 102 | 600009 | 上海机场 | 154,458 | 1,966,250.34 | 0.08 |
| 103 | 002038 | 双鹭药业 | 44,553 | 1,930,481.49 | 0.08 |
| 104 | 000768 | 中航飞机 | 217,364 | 1,921,497.76 | 0.08 |
| 105 | 600674 | 川投能源 | 164,203 | 1,912,964.95 | 0.08 |
| 106 | 600893 | 航空动力 | 87,709 | 1,907,670.75 | 0.08 |
| 107 | 600660 | 福耀玻璃 | 237,087 | 1,903,808.61 | 0.08 |
| 108 | 601669 | 中国电建 | 680,300 | 1,898,037.00 | 0.08 |
| 109 | 000568 | 泸州老窖 | 119,116 | 1,883,223.96 | 0.08 |
| 110 | 601788 | 光大证券 | 237,883 | 1,876,896.87 | 0.08 |
| 111 | 000039 | 中集集团 | 152,634 | 1,869,766.50 | 0.08 |
| 112 | 600489 | 中金黄金 | 245,932 | 1,854,327.28 | 0.08 |
| 113 | 601607 | 上海医药 | 152,854 | 1,848,004.86 | 0.08 |
| 114 | 600150 | 中国船舶 | 93,589 | 1,834,344.40 | 0.08 |
| 115 | 002081 | 金螳螂 | 97,779 | 1,834,334.04 | 0.08 |
| 116 | 000623 | 吉林敖东 | 121,885 | 1,831,931.55 | 0.08 |
| 117 | 600839 | 四川长虹 | 590,327 | 1,806,400.62 | 0.08 |
| 118 | 000970 | 中科三环 | 146,800 | 1,766,004.00 | 0.07 |
| 119 | 600271 | 航天信息 | 92,693 | 1,753,751.56 | 0.07 |
| 120 | 601633 | 长城汽车 | 66,226 | 1,741,081.54 | 0.07 |
| 121 | 000562 | 宏源证券 | 211,067 | 1,734,970.74 | 0.07 |
| 122 | 002236 | 大华股份 | 71,491 | 1,732,226.93 | 0.07 |
| 123 | 600085 | 同仁堂 | 102,081 | 1,707,815.13 | 0.07 |
| 124 | 601117 | 中国化学 | 310,798 | 1,700,065.06 | 0.07 |
| 125 | 601168 | 西部矿业 | 325,011 | 1,699,807.53 | 0.07 |
| 126 | 601808 | 中海油服 | 102,622 | 1,689,158.12 | 0.07 |
| 127 | 600362 | 江西铜业 | 141,496 | 1,686,632.32 | 0.07 |
| 128 | 000728 | 国元证券 | 174,356 | 1,686,022.52 | 0.07 |
| 129 | 600718 | 东软集团 | 136,851 | 1,684,635.81 | 0.07 |
| 130 | 600649 | 城投控股 | 262,436 | 1,679,590.40 | 0.07 |
| 131 | 000792 | 盐湖股份 | 110,406 | 1,669,338.72 | 0.07 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|---------|--------------|------|
| 132 | 600369 | 西南证券 | 195,098 | 1,662,234.96 | 0.07 |
| 133 | 600741 | 华域汽车 | 173,008 | 1,660,876.80 | 0.07 |
| 134 | 600118 | 中国卫星 | 95,524 | 1,640,147.08 | 0.07 |
| 135 | 600642 | 申能股份 | 382,975 | 1,635,303.25 | 0.07 |
| 136 | 600153 | 建发股份 | 293,363 | 1,590,027.46 | 0.07 |
| 137 | 600252 | 中恒集团 | 137,081 | 1,577,802.31 | 0.07 |
| 138 | 000729 | 燕京啤酒 | 230,016 | 1,573,309.44 | 0.07 |
| 139 | 000061 | 农产品 | 163,647 | 1,546,464.15 | 0.06 |
| 140 | 601800 | 中国交建 | 411,200 | 1,517,328.00 | 0.06 |
| 141 | 600177 | 雅戈尔 | 232,601 | 1,514,232.51 | 0.06 |
| 142 | 600549 | 厦门钨业 | 59,520 | 1,514,188.80 | 0.06 |
| 143 | 601600 | 中国铝业 | 496,919 | 1,490,757.00 | 0.06 |
| 144 | 002422 | 科伦药业 | 39,567 | 1,481,388.48 | 0.06 |
| 145 | 000983 | 西山煤电 | 284,254 | 1,472,435.72 | 0.06 |
| 146 | 601018 | 宁波港 | 652,534 | 1,468,201.50 | 0.06 |
| 147 | 000425 | 徐工机械 | 215,600 | 1,455,300.00 | 0.06 |
| 148 | 600655 | 豫园商城 | 192,951 | 1,454,850.54 | 0.06 |
| 149 | 000629 | 攀钢钒钛 | 719,198 | 1,452,779.96 | 0.06 |
| 150 | 000012 | 南玻 A | 206,956 | 1,450,761.56 | 0.06 |
| 151 | 000876 | 新希望 | 119,814 | 1,428,182.88 | 0.06 |
| 152 | 600029 | 南方航空 | 618,075 | 1,421,572.50 | 0.06 |
| 153 | 601618 | 中国中冶 | 832,555 | 1,407,017.95 | 0.06 |
| 154 | 601555 | 东吴证券 | 197,100 | 1,397,439.00 | 0.06 |
| 155 | 002385 | 大北农 | 128,424 | 1,386,979.20 | 0.06 |
| 156 | 600068 | 葛洲坝 | 360,795 | 1,363,805.10 | 0.06 |
| 157 | 002146 | 荣盛发展 | 131,393 | 1,361,231.48 | 0.06 |
| 158 | 601888 | 中国国旅 | 43,400 | 1,355,816.00 | 0.06 |
| 159 | 600005 | 武钢股份 | 677,815 | 1,355,630.00 | 0.06 |
| 160 | 000060 | 中金岭南 | 244,700 | 1,343,403.00 | 0.06 |
| 161 | 600827 | 友谊股份 | 113,941 | 1,339,946.16 | 0.06 |
| 162 | 600588 | 用友软件 | 93,115 | 1,321,301.85 | 0.05 |
| 163 | 600208 | 新湖中宝 | 447,921 | 1,316,887.74 | 0.05 |
| 164 | 600109 | 国金证券 | 68,045 | 1,314,629.40 | 0.05 |
| 165 | 000999 | 华润三九 | 70,277 | 1,314,179.90 | 0.05 |
| 166 | 000800 | 一汽轿车 | 136,577 | 1,311,139.20 | 0.05 |
| 167 | 600694 | 大商股份 | 49,280 | 1,304,441.60 | 0.05 |
| 168 | 600875 | 东方电气 | 114,283 | 1,284,540.92 | 0.05 |
| 169 | 000709 | 河北钢铁 | 705,481 | 1,276,920.61 | 0.05 |
| 170 | 002375 | 亚厦股份 | 55,700 | 1,271,631.00 | 0.05 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|---------|--------------|------|
| 171 | 601898 | 中煤能源 | 316,043 | 1,254,690.71 | 0.05 |
| 172 | 600060 | 海信电器 | 124,200 | 1,254,420.00 | 0.05 |
| 173 | 601699 | 潞安环能 | 161,218 | 1,251,051.68 | 0.05 |
| 174 | 600881 | 亚泰集团 | 332,541 | 1,240,377.93 | 0.05 |
| 175 | 600108 | 亚盛集团 | 219,403 | 1,233,044.86 | 0.05 |
| 176 | 601992 | 金隅股份 | 220,800 | 1,229,856.00 | 0.05 |
| 177 | 600166 | 福田汽车 | 248,403 | 1,227,110.82 | 0.05 |
| 178 | 600497 | 驰宏锌锗 | 146,076 | 1,209,509.28 | 0.05 |
| 179 | 601333 | 广深铁路 | 485,483 | 1,208,852.67 | 0.05 |
| 180 | 600143 | 金发科技 | 272,744 | 1,208,255.92 | 0.05 |
| 181 | 600415 | 小商品城 | 236,862 | 1,196,153.10 | 0.05 |
| 182 | 601933 | 永辉超市 | 189,444 | 1,193,497.20 | 0.05 |
| 183 | 002007 | 华兰生物 | 46,909 | 1,186,797.70 | 0.05 |
| 184 | 600811 | 东方集团 | 230,854 | 1,184,281.02 | 0.05 |
| 185 | 002001 | 新和成 | 93,014 | 1,181,277.80 | 0.05 |
| 186 | 600348 | 阳泉煤业 | 209,607 | 1,175,895.27 | 0.05 |
| 187 | 000750 | 国海证券 | 117,932 | 1,141,581.76 | 0.05 |
| 188 | 600267 | 海正药业 | 81,244 | 1,131,728.92 | 0.05 |
| 189 | 000630 | 铜陵有色 | 123,479 | 1,115,015.37 | 0.05 |
| 190 | 601118 | 海南橡胶 | 200,429 | 1,114,385.24 | 0.05 |
| 191 | 601098 | 中南传媒 | 80,640 | 1,107,993.60 | 0.05 |
| 192 | 002570 | 贝因美 | 84,080 | 1,079,587.20 | 0.04 |
| 193 | 000046 | 泛海控股 | 247,900 | 1,075,886.00 | 0.04 |
| 194 | 601928 | 凤凰传媒 | 123,840 | 1,074,931.20 | 0.04 |
| 195 | 601958 | 金钼股份 | 164,225 | 1,057,609.00 | 0.04 |
| 196 | 002500 | 山西证券 | 161,143 | 1,045,818.07 | 0.04 |
| 197 | 601099 | 太平洋 | 172,030 | 1,044,222.10 | 0.04 |
| 198 | 600027 | 华电国际 | 319,100 | 1,037,075.00 | 0.04 |
| 199 | 002310 | 东方园林 | 43,066 | 1,034,445.32 | 0.04 |
| 200 | 600115 | 东方航空 | 442,903 | 1,014,247.87 | 0.04 |
| 201 | 600316 | 洪都航空 | 66,278 | 1,012,727.84 | 0.04 |
| 202 | 601238 | 广汽集团 | 140,300 | 1,010,160.00 | 0.04 |
| 203 | 601111 | 中国国航 | 304,462 | 992,546.12 | 0.04 |
| 204 | 000960 | 锡业股份 | 79,500 | 988,980.00 | 0.04 |
| 205 | 000839 | 中信国安 | 153,936 | 986,729.76 | 0.04 |
| 206 | 600432 | 吉恩镍业 | 71,000 | 985,480.00 | 0.04 |
| 207 | 600219 | 南山铝业 | 203,145 | 985,253.25 | 0.04 |
| 208 | 600664 | 哈药股份 | 156,930 | 972,966.00 | 0.04 |
| 209 | 600436 | 片仔癀 | 13,004 | 965,416.96 | 0.04 |

| | | | | | |
|-----|--------|--------|---------|------------|------|
| 210 | 600516 | 方大炭素 | 136,225 | 963,110.75 | 0.04 |
| 211 | 002344 | 海宁皮城 | 78,530 | 959,636.60 | 0.04 |
| 212 | 000878 | 云南铜业 | 124,453 | 947,087.33 | 0.04 |
| 213 | 600062 | 华润双鹤 | 54,140 | 933,915.00 | 0.04 |
| 214 | 002092 | 中泰化学 | 158,009 | 910,131.84 | 0.04 |
| 215 | 000778 | 新兴铸管 | 165,143 | 901,680.78 | 0.04 |
| 216 | 000758 | 中色股份 | 96,778 | 901,003.18 | 0.04 |
| 217 | 600498 | 烽火通信 | 77,319 | 896,127.21 | 0.04 |
| 218 | 600123 | 兰花科创 | 119,305 | 888,822.25 | 0.04 |
| 219 | 600157 | 永泰能源 | 370,000 | 862,100.00 | 0.04 |
| 220 | 601866 | 中海集运 | 406,559 | 849,708.31 | 0.04 |
| 221 | 600598 | *ST 大荒 | 127,576 | 848,380.40 | 0.04 |
| 222 | 000528 | 柳工 | 139,587 | 847,293.09 | 0.04 |
| 223 | 600376 | 首开股份 | 191,447 | 846,195.74 | 0.04 |
| 224 | 601106 | 中国一重 | 453,973 | 844,389.78 | 0.04 |
| 225 | 600895 | 张江高科 | 131,660 | 832,091.20 | 0.03 |
| 226 | 002294 | 信立泰 | 29,300 | 830,655.00 | 0.03 |
| 227 | 600170 | 上海建工 | 142,897 | 823,086.72 | 0.03 |
| 228 | 002155 | 辰州矿业 | 113,578 | 814,354.26 | 0.03 |
| 229 | 601666 | 平煤股份 | 205,623 | 812,210.85 | 0.03 |
| 230 | 601158 | 重庆水务 | 164,139 | 800,998.32 | 0.03 |
| 231 | 600169 | 太原重工 | 291,027 | 788,683.17 | 0.03 |
| 232 | 000401 | 冀东水泥 | 99,834 | 778,705.20 | 0.03 |
| 233 | 000422 | 湖北宜化 | 155,020 | 775,100.00 | 0.03 |
| 234 | 600058 | 五矿发展 | 70,537 | 769,558.67 | 0.03 |
| 235 | 600125 | 铁龙物流 | 155,038 | 765,887.72 | 0.03 |
| 236 | 600582 | 天地科技 | 86,700 | 763,827.00 | 0.03 |
| 237 | 000969 | 安泰科技 | 87,053 | 737,338.91 | 0.03 |
| 238 | 000686 | 东北证券 | 100,886 | 732,432.36 | 0.03 |
| 239 | 600132 | 重庆啤酒 | 48,761 | 720,687.58 | 0.03 |
| 240 | 002106 | 莱宝高科 | 67,094 | 709,183.58 | 0.03 |
| 241 | 002299 | 圣农发展 | 68,835 | 704,182.05 | 0.03 |
| 242 | 002069 | 獐子岛 | 48,986 | 698,050.50 | 0.03 |
| 243 | 600216 | 浙江医药 | 77,832 | 696,596.40 | 0.03 |
| 244 | 000937 | 冀中能源 | 120,538 | 687,066.60 | 0.03 |
| 245 | 601001 | 大同煤业 | 115,218 | 682,090.56 | 0.03 |
| 246 | 600188 | 兖州煤业 | 103,182 | 679,969.38 | 0.03 |
| 247 | 600221 | 海南航空 | 410,168 | 676,777.20 | 0.03 |
| 248 | 601717 | 郑煤机 | 138,416 | 675,470.08 | 0.03 |

| | | | | | |
|-----|--------|-------|---------|------------|------|
| 249 | 600859 | 王府井 | 41,338 | 674,222.78 | 0.03 |
| 250 | 600266 | 北京城建 | 92,263 | 658,757.82 | 0.03 |
| 251 | 600546 | 山煤国际 | 175,616 | 639,242.24 | 0.03 |
| 252 | 601258 | 庞大集团 | 139,698 | 620,259.12 | 0.03 |
| 253 | 000718 | 苏宁环球 | 148,020 | 620,203.80 | 0.03 |
| 254 | 600809 | 山西汾酒 | 45,970 | 615,998.00 | 0.03 |
| 255 | 600096 | 云天化 | 85,924 | 610,919.64 | 0.03 |
| 256 | 600160 | 巨化股份 | 120,410 | 609,274.60 | 0.03 |
| 257 | 600395 | 盘江股份 | 86,336 | 589,674.88 | 0.02 |
| 258 | 002051 | 中工国际 | 37,440 | 583,689.60 | 0.02 |
| 259 | 000539 | 粤电力A | 124,900 | 578,287.00 | 0.02 |
| 260 | 000933 | 神火股份 | 160,843 | 572,601.08 | 0.02 |
| 261 | 002431 | 棕榈园林 | 31,909 | 545,643.90 | 0.02 |
| 262 | 000869 | 张裕A | 21,769 | 540,524.27 | 0.02 |
| 263 | 600528 | 中铁二局 | 118,898 | 539,796.92 | 0.02 |
| 264 | 600863 | 内蒙华电 | 147,888 | 535,354.56 | 0.02 |
| 265 | 002603 | 以岭药业 | 17,572 | 530,147.24 | 0.02 |
| 266 | 600783 | 鲁信创投 | 34,300 | 519,988.00 | 0.02 |
| 267 | 000807 | 云铝股份 | 158,985 | 516,701.25 | 0.02 |
| 268 | 600970 | 中材国际 | 75,299 | 516,551.14 | 0.02 |
| 269 | 600550 | *ST天威 | 111,851 | 508,922.05 | 0.02 |
| 270 | 601139 | 深圳燃气 | 73,900 | 503,998.00 | 0.02 |
| 271 | 601369 | 陕鼓动力 | 82,276 | 484,605.64 | 0.02 |
| 272 | 002399 | 海普瑞 | 25,865 | 475,916.00 | 0.02 |
| 273 | 600997 | 开滦股份 | 104,035 | 453,592.60 | 0.02 |
| 274 | 002128 | 露天煤业 | 69,736 | 453,284.00 | 0.02 |
| 275 | 600403 | 大有能源 | 83,500 | 450,900.00 | 0.02 |
| 276 | 600971 | 恒源煤电 | 84,444 | 449,242.08 | 0.02 |
| 277 | 002673 | 西部证券 | 41,100 | 448,812.00 | 0.02 |
| 278 | 601101 | 昊华能源 | 81,739 | 438,938.43 | 0.02 |
| 279 | 000059 | 华锦股份 | 100,476 | 414,965.88 | 0.02 |
| 280 | 000961 | 中南建设 | 60,464 | 412,969.12 | 0.02 |
| 281 | 601918 | 国投新集 | 139,856 | 390,198.24 | 0.02 |
| 282 | 600508 | 上海能源 | 49,739 | 383,985.08 | 0.02 |
| 283 | 600779 | 水井坊 | 55,207 | 370,991.04 | 0.02 |
| 284 | 000596 | 古井贡酒 | 19,900 | 351,633.00 | 0.01 |
| 285 | 000656 | 金科股份 | 40,700 | 293,040.00 | 0.01 |
| 286 | 002269 | 美邦服饰 | 34,100 | 286,099.00 | 0.01 |
| 287 | 000780 | 平庄能源 | 71,819 | 272,194.01 | 0.01 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 288 | 603993 | 洛阳钼业 | 34,200 | 205,542.00 | 0.01 |
|-----|--------|------|--------|------------|------|

注：宏源证券(股票代码:000562)报告期后被申万证券(股票代码:000166)吸收合并而退市。

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所有股票投资明细

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 |
| 6 | 000333 | 美的集团 | 1,999,880 | 35,137,891.60 | 1.46 |
| 7 | 600048 | 保利地产 | 6,000,000 | 30,840,000.00 | 1.28 |
| 8 | 600062 | 华润双鹤 | 1,472,561 | 25,401,677.25 | 1.06 |
| 9 | 600690 | 青岛海尔 | 1,650,000 | 24,915,000.00 | 1.04 |
| 10 | 002250 | 联化科技 | 1,046,077 | 21,350,431.57 | 0.89 |
| 11 | 002035 | 华帝股份 | 1,429,500 | 14,452,245.00 | 0.6 |
| 12 | 300285 | 国瓷材料 | 509,495 | 12,941,173.00 | 0.54 |
| 13 | 600438 | 通威股份 | 1,312,563 | 12,456,222.87 | 0.52 |
| 14 | 600557 | 康缘药业 | 199,996 | 6,175,876.48 | 0.26 |
| 15 | 000581 | 威孚高科 | 209,641 | 5,316,495.76 | 0.22 |
| 16 | 600525 | 长园集团 | 451,100 | 4,858,347.00 | 0.2 |
| 17 | 000880 | 潍柴重机 | 457,700 | 3,876,719.00 | 0.16 |
| 18 | 600312 | 平高电气 | 306,330 | 3,795,428.70 | 0.16 |
| 19 | 600688 | 上海石化 | 624,673 | 1,967,719.95 | 0.08 |
| 20 | 601555 | 东吴证券 | 230,000 | 1,630,700.00 | 0.07 |

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所有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 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

8.12.7 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 投资组合报告(转型后)

转型后：鹏华策略优选灵活配置混合型证券投资基金(报告期：2014年6月10日(基金合同生效日)-2014年12月31日)

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 | 720,148,245.62 | 84.95 |

| | | | |
|---|-------------------|----------------|--------|
| | 其中：股票 | 720,148,245.62 | 84.95 |
| 2 | 固定收益投资 | 39,944,000.00 | 4.71 |
| | 其中：债券 | 39,944,000.00 | 4.71 |
| | 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 | 85,801,646.58 | 10.12 |
| 7 | 其他资产 | 1,860,248.59 | 0.22 |
| 8 | 合计 | 847,754,140.79 | 100.00 |

8.2 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 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|----------------|---------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 750,083.67 | 0.09 |
| B | 采矿业 | 29,796,783.43 | 3.61 |
| C | 制造业 | 472,738,192.66 | 57.34 |
| 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 | 29,954,078.60 | 3.63 |
| 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 | 8,388,773.40 | 1.02 |
| J | 金融业 | 53,876,890.00 | 6.54 |
| K | 房地产业 | 99,499,083.48 | 12.07 |
| 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 | 25,144,360.38 | 3.05 |
| 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 | 720,148,245.62 | 87.36 |

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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 | 000002 | 万科A | 3,606,407 | 50,129,057.30 | 6.08 |
| 2 | 600048 | 保利地产 | 4,562,849 | 49,370,026.18 | 5.99 |
| 3 | 600894 | 广日股份 | 2,699,500 | 34,688,575.00 | 4.21 |
| 4 | 000001 | 平安银行 | 2,000,000 | 31,680,000.00 | 3.84 |
| 5 | 002662 | 京威股份 | 2,541,750 | 30,755,175.00 | 3.73 |
| 6 | 000858 | 五粮液 | 1,400,000 | 30,100,000.00 | 3.65 |
| 7 | 601258 | 庞大集团 | 5,356,988 | 29,954,078.60 | 3.63 |
| 8 | 600887 | 伊利股份 | 951,590 | 27,244,021.70 | 3.30 |
| 9 | 000831 | 五矿稀土 | 894,029 | 26,811,929.71 | 3.25 |
| 10 | 002073 | 软控股份 | 2,212,173 | 26,789,415.03 | 3.25 |
| 11 | 000333 | 美的集团 | 972,153 | 26,675,878.32 | 3.24 |
| 12 | 002672 | 东江环保 | 723,787 | 25,144,360.38 | 3.05 |
| 13 | 300203 | 聚光科技 | 1,308,177 | 25,090,834.86 | 3.04 |
| 14 | 600259 | 广晟有色 | 419,440 | 23,312,475.20 | 2.83 |
| 15 | 002572 | 索菲亚 | 1,077,068 | 23,049,255.20 | 2.80 |
| 16 | 600196 | 复星医药 | 1,003,983 | 21,184,041.30 | 2.57 |
| 17 | 600420 | 现代制药 | 952,074 | 19,907,867.34 | 2.41 |
| 18 | 002152 | 广电运通 | 933,820 | 19,423,456.00 | 2.36 |
| 19 | 600031 | 三一重工 | 1,800,000 | 17,964,000.00 | 2.18 |
| 20 | 600690 | 青岛海尔 | 879,931 | 16,331,519.36 | 1.98 |
| 21 | 600549 | 厦门钨业 | 479,882 | 15,826,508.36 | 1.92 |
| 22 | 600519 | 贵州茅台 | 83,304 | 15,796,104.48 | 1.92 |
| 23 | 600715 | 松辽汽车 | 916,237 | 15,759,276.40 | 1.91 |
| 24 | 601628 | 中国人寿 | 396,700 | 13,547,305.00 | 1.64 |
| 25 | 000880 | 潍柴重机 | 1,095,742 | 12,513,373.64 | 1.52 |
| 26 | 000528 | 柳工 | 900,000 | 11,322,000.00 | 1.37 |
| 27 | 601233 | 桐昆股份 | 1,064,822 | 11,287,113.20 | 1.37 |
| 28 | 000157 | 中联重科 | 1,447,441 | 10,218,933.46 | 1.24 |
| 29 | 600750 | 江中药业 | 473,319 | 9,584,709.75 | 1.16 |
| 30 | 600030 | 中信证券 | 255,150 | 8,649,585.00 | 1.05 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 31 | 600406 | 国电南瑞 | 576,548 | 8,388,773.40 | 1.02 |
| 32 | 300157 | 恒泰艾普 | 642,647 | 6,484,308.23 | 0.79 |
| 33 | 002275 | 桂林三金 | 340,042 | 6,239,770.70 | 0.76 |
| 34 | 000581 | 威孚高科 | 186,028 | 4,991,131.24 | 0.61 |
| 35 | 000925 | 众合机电 | 208,700 | 4,466,180.00 | 0.54 |
| 36 | 600521 | 华海药业 | 274,343 | 3,988,947.22 | 0.48 |
| 37 | 000837 | 秦川机床 | 236,423 | 2,662,122.98 | 0.32 |
| 38 | 000612 | 焦作万方 | 165,602 | 1,672,580.20 | 0.20 |
| 39 | 600257 | 大湖股份 | 105,497 | 750,083.67 | 0.09 |
| 40 | 300038 | 梅泰诺 | 21,000 | 392,700.00 | 0.05 |
| 41 | 000625 | 长安汽车 | 47 | 772.21 | 0.00 |

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末基金资产净值 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 | 占期末基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|---------------|-----------------|
| 1 | 601088 | 中国神华 | 49,987,367.40 | 6.06 |
| 2 | 600894 | 广日股份 | 46,712,994.65 | 5.67 |
| 3 | 002662 | 京威股份 | 44,428,108.18 | 5.39 |
| 4 | 000858 | 五粮液 | 39,985,763.01 | 4.85 |
| 5 | 601258 | 庞大集团 | 35,685,726.80 | 4.33 |
| 6 | 600259 | 广晟有色 | 31,432,313.70 | 3.81 |
| 7 | 000596 | 古井贡酒 | 31,106,814.11 | 3.77 |
| 8 | 300203 | 聚光科技 | 29,998,473.01 | 3.64 |
| 9 | 000001 | 平安银行 | 29,994,149.73 | 3.64 |
| 10 | 002073 | 软控股份 | 29,482,566.70 | 3.58 |
| 11 | 000831 | 五矿稀土 | 29,281,103.67 | 3.55 |
| 12 | 002273 | 水晶光电 | 27,988,989.86 | 3.40 |
| 13 | 600613 | 神奇制药 | 26,997,277.02 | 3.27 |
| 14 | 002672 | 东江环保 | 25,939,183.97 | 3.15 |
| 15 | 002572 | 索菲亚 | 24,101,692.19 | 2.92 |
| 16 | 000625 | 长安汽车 | 22,616,310.41 | 2.74 |
| 17 | 600420 | 现代制药 | 22,308,019.71 | 2.71 |
| 18 | 000425 | 徐工机械 | 20,992,021.92 | 2.55 |
| 19 | 002060 | 粤水电 | 20,658,971.02 | 2.51 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 20 | 600549 | 厦门钨业 | 19,993,104.68 | 2.43 |
| 21 | 600715 | 松辽汽车 | 19,914,536.65 | 2.42 |
| 22 | 002051 | 中工国际 | 19,278,015.71 | 2.34 |
| 23 | 002152 | 广电运通 | 17,860,826.09 | 2.17 |
| 24 | 600031 | 三一重工 | 17,115,252.76 | 2.08 |

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。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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 | 占期末基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|---------------|-----------------|
| 1 | 600887 | 伊利股份 | 85,411,911.29 | 10.36 |
| 2 | 600196 | 复星医药 | 59,102,175.86 | 7.17 |
| 3 | 601088 | 中国神华 | 55,590,080.01 | 6.74 |
| 4 | 600383 | 金地集团 | 53,504,281.16 | 6.49 |
| 5 | 600519 | 贵州茅台 | 51,263,729.46 | 6.22 |
| 6 | 000002 | 万科A | 46,276,681.54 | 5.61 |
| 7 | 000596 | 古井贡酒 | 40,066,555.39 | 4.86 |
| 8 | 000001 | 平安银行 | 34,485,438.92 | 4.18 |
| 9 | 002662 | 京威股份 | 31,257,978.09 | 3.79 |
| 10 | 600613 | 神奇制药 | 30,098,604.25 | 3.65 |
| 11 | 000625 | 长安汽车 | 30,072,585.39 | 3.65 |
| 12 | 600036 | 招商银行 | 29,225,641.95 | 3.55 |
| 13 | 600016 | 民生银行 | 28,851,634.64 | 3.50 |
| 14 | 002273 | 水晶光电 | 28,629,702.76 | 3.47 |
| 15 | 601166 | 兴业银行 | 28,295,509.05 | 3.43 |
| 16 | 600062 | 华润双鹤 | 27,558,270.10 | 3.34 |
| 17 | 000333 | 美的集团 | 27,369,610.69 | 3.32 |
| 18 | 000425 | 徐工机械 | 27,166,930.13 | 3.30 |
| 19 | 002051 | 中工国际 | 25,365,507.79 | 3.08 |
| 20 | 601318 | 中国平安 | 24,272,341.67 | 2.94 |
| 21 | 002250 | 联化科技 | 23,111,250.16 | 2.80 |
| 22 | 002060 | 粤水电 | 22,780,665.27 | 2.76 |
| 23 | 600048 | 保利地产 | 22,319,520.32 | 2.71 |
| 24 | 600030 | 中信证券 | 21,468,691.70 | 2.60 |
| 25 | 600000 | 浦发银行 | 18,240,189.75 | 2.21 |
| 26 | 000858 | 五粮液 | 16,778,230.01 | 2.04 |

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

单位：人民币元

| | |
|--------------|------------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 906,242,414.58 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 1,729,923,235.74 |

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 | 39,944,000.00 | 4.85 |
| | 其中：政策性金融债 | 39,944,000.00 | 4.85 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债 | - | - |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 39,944,000.00 | 4.85 |

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 | 130405 | 13 农发 05 | 400,000 | 39,944,000.00 | 4.85 |

注：上述债券明细为本基金本报告期末持有的全部债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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：本基金本报告期内未发生股指期货投资。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低申购赎回时现金资产对投资组合的影响及投资组合仓位调整的交易成本，达到稳定投资组合资产净值的目的。

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 | 744,002.53 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 1,106,364.64 |
| 5 | 应收申购款 | 9,881.42 |
| 6 | 其他应收款 | - |

| | | |
|---|------|--------------|
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 1,860,248.59 |

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|--------------|---------------|----------|
| 1 | 601258 | 庞大集团 | 9,980,000.00 | 1.21 | 非公开发行 |

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息(转型前)

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数 (户) | 户均持有的 基金份额 | 持有人结构 | | | |
|--------------|---------------|------------------|------------|----------------|------------|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | 持有份额 | 占总份 额比例 | 持有份额 | 占总份 额比例 |
| 31,349 | 95,696.83 | 2,351,284,872.00 | 78.38% | 648,715,128.00 | 21.62% |

9.2 期末上市基金前十名持有人

| 序号 | 持有人名称 | 持有份额 (份) | 占上市总份 额比例 |
|----|---------------------------------------|----------------|--------------|
| 1 | 中国人寿保险(集团)公司 | 383,979,769.00 | 12.80 |
| 2 | 中国人寿保险股份有限公司 | 299,960,685.00 | 10.00 |
| 3 | 幸福人寿保险股份有限公司-分红 | 197,141,862.00 | 6.57 |
| 4 | 泰康人寿保险股份有限公司-分红-个人分 红-019L-FH002 深 | 188,410,311.00 | 6.28 |

| | | | |
|----|-------------------------------------|----------------|------|
| 5 | 中国太平洋人寿保险股份有限公司—分红—个人分红 | 107,261,187.00 | 3.58 |
| 6 | 阳光人寿保险股份有限公司—分红保险产品 | 103,007,787.00 | 3.43 |
| 7 | 伦敦市投资管理有限公司—客户资金 | 84,594,191.00 | 2.82 |
| 8 | 中国太平洋财产保险—传统—普通保险产品-013C-CT001 深 | 79,217,744.00 | 2.64 |
| 9 | 中国太平洋人寿保险股份有限公司—传统—普通保险产品 | 66,586,346.00 | 2.22 |
| 10 | 中国太保集团股份有限公司—本级—集团自有资金-012G-ZY001 深 | 65,524,837.00 | 2.18 |

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：本基金管理人的所有从业人员本报告期末未持有本基金。

9.4 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

本基金管理人的所有从业人员本报告期末未持有本基金。

§ 9 基金份额持有人信息(转型后)

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数 (户) | 户均持有的 基金份额 | 持有人结构 | | | |
|--------------|---------------|----------------|------------|----------------|------------|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | 持有份额 | 占总份 额比例 | 持有份额 | 占总份 额比例 |
| 27,456 | 24,288.52 | 357,068,597.00 | 53.54% | 309,796,939.12 | 46.46% |

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：本基金管理人的所有从业人员本报告期末未持有本基金。

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

本基金管理人的所有从业人员本报告期末未持有本基金。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|--------------------------------------|------------------|
| 基金合同生效日 (2014 年 6 月 10 日) 基金份额总额 | 3,000,000,000.00 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额 | 4,150,416.20 |
| 减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额 | 1,774,519,506.08 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列) | -562,765,374.00 |
| 报告期期末基金份额总额 | 666,865,536.12 |

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

鹏华策略优选灵活配置混合型证券投资基金由普丰证券投资基金转型而成。2014 年 5 月 15 日，普丰证券投资基金基金份额持有人大会以现场方式召开，大会讨论通过了普丰证券投资基金转型议案，内容包括普丰证券投资基金由封闭式基金转为开放式基金、调整存续期限、终止上市、调整投资目标、范围和策略、修订基金合同等，并更名为“鹏华策略优选灵活配置混合型证券投资基金”。经中国证监会备案，基金份额持有人大会决议生效。自 2014 年 6 月 10 日起，由《普丰证券投资基金基金合同》修订而成的《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，原《普丰证券投资基金基金合同》同日起失效。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

11.2.1 报告期内基金管理人的重大人事变动：

基金管理人的重大人事变动：报告期内公司原副总经理毕国强先生因个人职业发展原因提出辞职，经公司董事会审议，同意毕国强先生提出的辞职申请，并同意其在办理完工作交接手续后正式离任。毕国强先生于 2014 年 7 月 10 日正式离任。

报告期内因公司工作安排，经公司董事会审议通过，自 2014 年 12 月 25 日起，高鹏先生转任公司副总经理，不再担任公司督察长职务。在新任督察长任职之前，代为履行督察长职务。

经公司董事会审议通过，并经中国证券监督管理委员会证监许可[2015]217 号文核准，公司聘任高永杰先生担任公司督察长，任职日期自 2015 年 2 月 6 日起。

本公司已将上述变更事项报中国证券监督管理委员会深圳监管局备案。

11.2.2 本报告期内托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

本报告期内，因中国工商银行股份有限公司（以下简称“本行”）工作需要，周月秋同志不再担任本行资产托管部总经理。在新任资产托管部总经理李勇同志完成证券投资基金行业高级管理

人员任职资格备案手续前，由副总经理王立波同志代为行使本行资产托管部总经理部分业务授权职责。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的，与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未改聘为本基金审计的会计师事务所。本年度应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）常规审计费用 130,000.00 元（包括转型前及转型后费用）。该审计机构已提供审计服务的连续年限为 1 年。

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

本基金管理人、基金托管人涉及托管业务机构及其高级管理人员在报告期内未受到任何稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型后）

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------|--------|------------------|--------------|------------|------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 兴业证券 | 1 | 1,086,153,799.18 | 41.36% | 960,703.39 | 40.80% | - |
| 银河证券 | 1 | 879,077,317.53 | 33.47% | 800,282.07 | 33.99% | - |
| 中信建投 | 1 | 529,667,594.21 | 20.17% | 476,926.50 | 20.26% | - |
| 招商证券 | 1 | 117,874,780.53 | 4.49% | 104,307.61 | 4.43% | - |
| 国信证券 | 3 | 13,490,856.28 | 0.51% | 12,214.65 | 0.52% | - |
| 中银国际 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 宏源证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 申银万国 | 1 | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 国泰君安 | 2 | - | - | - | - | - |
|------|---|---|---|---|---|---|

注：交易单元选择的标准和程序

1、基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其交易单元作为基金的专用交易单元，选择的标准是：

- (1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，最近二年未因重大违规行为而受到中国证监会处罚；
- (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，并能为本基金提供全面的信息服务；
- (6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务。

2、选择交易单元程序：

我公司根据上述标准，选定符合条件的证券公司作为租用交易单元的对象。我公司投研部门定期对所选定证券公司的服务进行综合评比，评比内容包括：提供研究报告质量、数量、及时性及提供研究服务主动性和质量等情况，并依据评比结果确定交易单元交易的具体情况。本公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向券商租用交易单元作为基金专用交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|------|---------------|--------------|-------------------|----------------|------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 兴业证券 | 10,868,479.27 | 27.66% | 20,000,000.00 | 0.15% | - | - |
| 银河证券 | 27,808,635.30 | 70.78% | 600,000,000.00 | 4.62% | - | - |
| 中信建投 | 614,132.20 | 1.56% | 12,363,000,000.00 | 95.22% | - | - |
| 招商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中银国际 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 宏源证券 | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 申银万国 | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | - | - | - | - | - | - |

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 (转型前)

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------|--------|----------------|--------------|------------|------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 中信建投 | 1 | 716,838,426.05 | 65.37% | 652,607.69 | 65.93% | - |
| 兴业证券 | 1 | 331,196,832.33 | 30.20% | 293,076.66 | 29.61% | - |
| 国泰君安 | 2 | 48,496,386.79 | 4.42% | 44,152.02 | 4.46% | - |
| 宏源证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中银国际 | 1 | - | - | - | - | - |
| 申银万国 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | 3 | - | - | - | - | - |

注：交易单元选择的标准和程序

1、基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其交易单元作为基金的专用交易单元，选择的标准是：

- (1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，最近二年未因重大违规行为而受到中国证监会处罚；
- (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，并能为本基金提供全面的信息服务；
- (6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务。

2、选择交易单元程序：

我公司根据上述标准，选定符合条件的证券公司作为租用交易单元的对象。我公司投研部门定期

对所选定证券公司的服务进行综合评比，评比内容包括：提供研究报告质量、数量、及时性及提供研究服务主动性和质量等情况，并依据评比结果确定交易单元交易的具体情况。本公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向券商租用交易单元作为基金专用交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|------|------------|--------------|--------|----------------|------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 中信建投 | 139,521.80 | 100.00% | - | - | - | - |
| 兴业证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | - | - | - | - | - | - |
| 宏源证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中银国际 | - | - | - | - | - | - |
| 申银万国 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | - | - | - | - | - | - |

11.8 其他重大事件（转型后）

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|--|------------------------|------------|
| 1 | 鹏华策略优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2014年6月5日 |
| 2 | 鹏华策略优选灵活配置混合型证券投资基金合同摘要、集中申购份额发售公告及招募说明书 | 《上海证券报》 | 2014年6月11日 |
| 3 | 鹏华基金管理有限公司关于公司董事、监事、高级管理人员 | 《证券时报》 | 2014年6月14日 |

| | | | |
|----|--|------------------------|-----------------|
| | 以及其他从业人员在子公司兼职及领薪情况的公告 | | |
| 4 | 鹏华策略优选灵活配置混合型证券投资基金份额上网发售提示性公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2014 年 6 月 16 日 |
| 5 | 鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2014 年 6 月 28 日 |
| 6 | 关于鹏华策略优选灵活配置混合型证券投资基金基金份额折算日的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2014 年 6 月 30 日 |
| 7 | 鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2014 年 7 月 1 日 |
| 8 | 鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2014 年 7 月 2 日 |
| 9 | 鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2014 年 7 月 4 日 |
| 10 | 鹏华策略优选灵活配置混合型证券投资基金集中申购结果暨原普丰证券投资基金基金份额折算结果的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2014 年 7 月 7 日 |
| 11 | 鹏华基金管理有限公司关于鹏华策略优选灵活配置混合型证券投资基金开通跨系统转托管业务的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2014 年 7 月 8 日 |
| 12 | 鹏华策略优选灵活配置混合型 | 《中国证券报》、《上 | 2014 年 7 月 9 日 |

| | | | |
|----|---|------------------------|-----------------|
| | 证券投资基金关于开放申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告 | 海证券报》、《证券时报》 | |
| 13 | 鹏华基金管理有限公司高级管理人员变更公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2014 年 7 月 12 日 |
| 14 | 2014 年二季度报告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2014 年 7 月 19 日 |
| 15 | 鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2014 年 8 月 1 日 |
| 16 | 鹏华基金管理有限公司关于增加五矿证券有限公司为鹏华策略优选灵活配置混合型证券投资基金代销机构的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2014 年 8 月 7 日 |
| 17 | 鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2014 年 8 月 19 日 |
| 18 | 鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2014 年 8 月 20 日 |
| 19 | 鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2014 年 8 月 22 日 |
| 20 | 2014 年半年度报告摘要 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2014 年 8 月 26 日 |
| 21 | 鹏华基金管理有限公司关于旗 | 《中国证券报》、《上 | 2014 年 9 月 3 日 |

| | | | |
|----|--|------------------------|------------------|
| | 下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告 | 海证券报》、《证券时报》 | |
| 22 | 鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2014 年 9 月 10 日 |
| 23 | 鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2014 年 9 月 16 日 |
| 24 | 鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2014 年 9 月 25 日 |
| 25 | 鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2014 年 10 月 9 日 |
| 26 | 2014 年第三季度报告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2014 年 10 月 24 日 |
| 27 | 鹏华基金管理有限公司关于增加联讯证券股份有限公司为我司旗下部分基金代销机构的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2014 年 10 月 27 日 |
| 28 | 鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2014 年 10 月 28 日 |
| 29 | 鹏华基金管理有限公司关于增加华鑫证券有限责任公司为我司旗下部分基金代销机构的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2014 年 10 月 29 日 |
| 30 | 鹏华基金管理有限公司关于旗 | 《中国证券报》、《上 | 2014 年 10 月 31 日 |

| | | | |
|----|--------------------------------------|------------------------|-------------|
| | 下基金资产支持证券投资方案的公告 | 海证券报》、《证券时报》 | |
| 31 | 关于旗下基金所持獐子岛(002069)估值调整的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2014年11月1日 |
| 32 | 鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2014年11月26日 |
| 33 | 鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2014年12月4日 |
| 34 | 鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2014年12月5日 |
| 35 | 鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2014年12月5日 |
| 36 | 鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2014年12月9日 |
| 37 | 鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2014年12月9日 |
| 38 | 鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2014年12月18日 |
| 39 | 鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2014年12月23日 |

| | | | |
|----|--------------------------------------|------------------------|------------------|
| 40 | 鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2014 年 12 月 24 日 |
| 41 | 鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2014 年 12 月 26 日 |
| 42 | 基金高级管理人员变更公告 | 《证券时报》 | 2014 年 12 月 27 日 |
| 43 | 鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2014 年 12 月 31 日 |

11.8 其他重大事件（转型前）

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|--------------------------------------|------------------------|-----------------|
| 1 | 2013 年四季度报告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2014 年 1 月 21 日 |
| 2 | 鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2014 年 1 月 24 日 |
| 3 | 鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2014 年 1 月 30 日 |
| 4 | 鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2014 年 2 月 27 日 |
| 5 | 鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2014 年 3 月 25 日 |
| 6 | 2013 年年度报告摘要 | 《中国证券报》、《上 | 2014 年 3 月 27 日 |

| | | | |
|----|---|------------------------|-----------------|
| | | 海证券报》、《证券时报》 | |
| 7 | 鹏华基金管理有限公司关于以现场方式召开普丰证券投资基金基金份额持有人大会的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2014 年 4 月 15 日 |
| 8 | 基金经理变更公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2014 年 4 月 19 日 |
| 9 | 2014 年一季度报告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2014 年 4 月 22 日 |
| 10 | 鹏华基金管理有限公司关于以现场方式召开普丰证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2014 年 4 月 25 日 |
| 11 | 鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2014 年 4 月 26 日 |
| 12 | 鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2014 年 4 月 29 日 |
| 13 | 鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2014 年 4 月 29 日 |
| 14 | 鹏华基金管理有限公司关于以现场方式召开普丰证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2014 年 5 月 5 日 |
| 15 | 鹏华基金管理有限公司关于普 | 《中国证券报》、《上 | 2014 年 5 月 6 日 |

| | | | |
|----|--------------------------------------|------------------------|-----------------|
| | 丰证券投资基金停牌的提示性公告 | 海证券报》、《证券时报》 | |
| 16 | 关于普丰证券投资基金基金份额持有人大会表决结果的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2014 年 5 月 16 日 |
| 17 | 关于普丰证券投资基金基金份额持有人大会决议生效的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2014 年 5 月 30 日 |
| 18 | 普丰证券投资基金终止上市公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2014 年 6 月 5 日 |
| 19 | 鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2014 年 6 月 6 日 |
| 20 | 普丰证券投资基金终止上市提示性公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2014 年 6 月 9 日 |

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

2014 年 5 月 15 日，普丰证券投资基金基金份额持有人大会以现场方式召开，大会讨论通过了普丰证券投资基金转型议案，内容包括普丰证券投资基金由封闭式基金转为开放式基金、调整存续期限、终止上市、调整投资目标、范围和策略以及修订基金合同等。依据中国证监会 2014 年 5 月 28 日证券基金机构监管部函[2014]373 号文备案，持有人大会决议生效。自 2014 年 6 月 10 日起，原《普丰证券投资基金基金合同》终止，《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，基金正式转型为开放式基金，存续期限调整为无限期，基金投资目标、范围和策略调整，同时基金更名为“鹏华策略优选灵活配置混合型证券投资基金”。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- (一)《鹏华策略优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;
- (二)《鹏华策略优选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;
- (三)《鹏华策略优选灵活配置混合型证券投资基金 2014 年年度报告》(原文)。

13.2 存放地点

深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层鹏华基金管理有限公司。

北京市西城区复兴门内大街 55 号中国工商银行股份有限公司

13.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件,或通过本基金管理人网站(<http://www.phfund.com>)查阅。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人鹏华基金管理有限公司,本公司已开通客户服务系统,咨询电话:4006788999。

鹏华基金管理有限公司
2015 年 3 月 26 日