

# 鹏华策略优选灵活配置混合型证券投资基金 2014 年第 2 季度报告

2014 年 6 月 30 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

报告送出日期：2014 年 7 月 19 日

## § 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。

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 2014 年 7 月 16 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

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”。

本报告中，原普丰证券投资基金报告期自 2014 年 4 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 6 月 30 日止。

本报告中财务资料未经审计。

## § 2 基金产品概况

转型后：

基金简称	鹏华策略优选混合
基金主代码	160627
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
报告期末基金份额总额	3,000,000,000.00 份
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 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 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 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 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。 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	沪深 300 指数收益率×60%+中证综合债指数收益率×40%
风险收益特征	本基金属于混合型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金，属于证券投资基金里中高风险、中高预期收益的品种。
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

转型前：

基金简称	鹏华普丰封闭
基金主代码	184693
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
报告期末基金份额总额	3,000,000,000.00 份

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	无
风险收益特征	无
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

注：本基金在交易所行情系统净值提示等其他信息披露场合下，可简称为“基金普丰”。

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标（转型后）

单位：人民币元

主要财务指标	转型后
	报告期（2014年6月10日（基金合同生效日） — 2014年6月30日）
1. 本期已实现收益	-30,480,187.27
2. 本期利润	32,176,591.22
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0107
4. 期末基金资产净值	2,435,614,716.86
5. 期末基金份额净值	0.812

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

2. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 3.1 主要财务指标（转型前）

主要财务指标	转型前
--------	-----

	报告期( 2014 年 4 月 1 日 — 2014 年 6 月 9 日 )
1. 本期已实现收益	-12,080,623.99
2. 本期利润	27,102,409.60
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0090
4. 期末基金资产净值	2,403,438,125.64
5. 期末基金份额净值	0.8011

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，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。

### 3.2 基金净值表现（转型后）

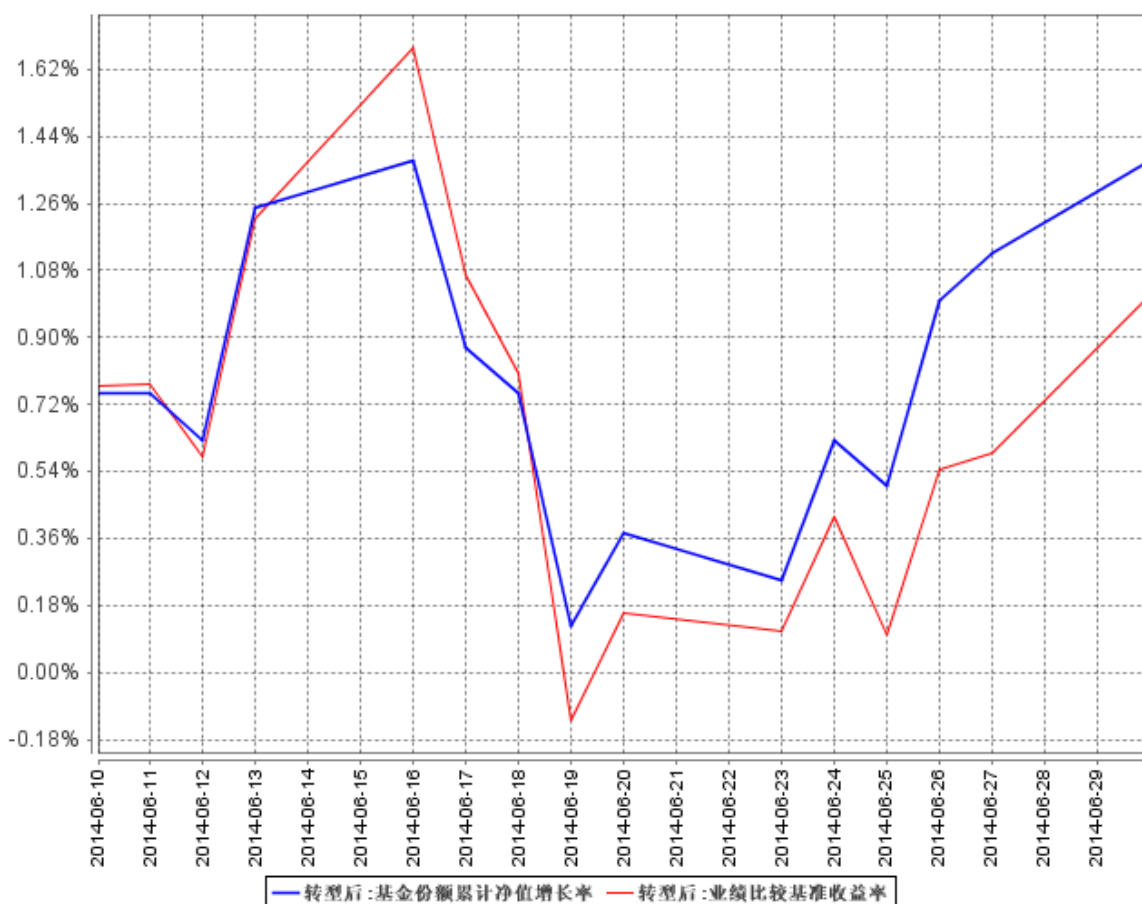
#### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	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	1.37%	0.38%	1.02%	0.47%	0.35%	-0.09%

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

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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 基金净值表现（转型前）

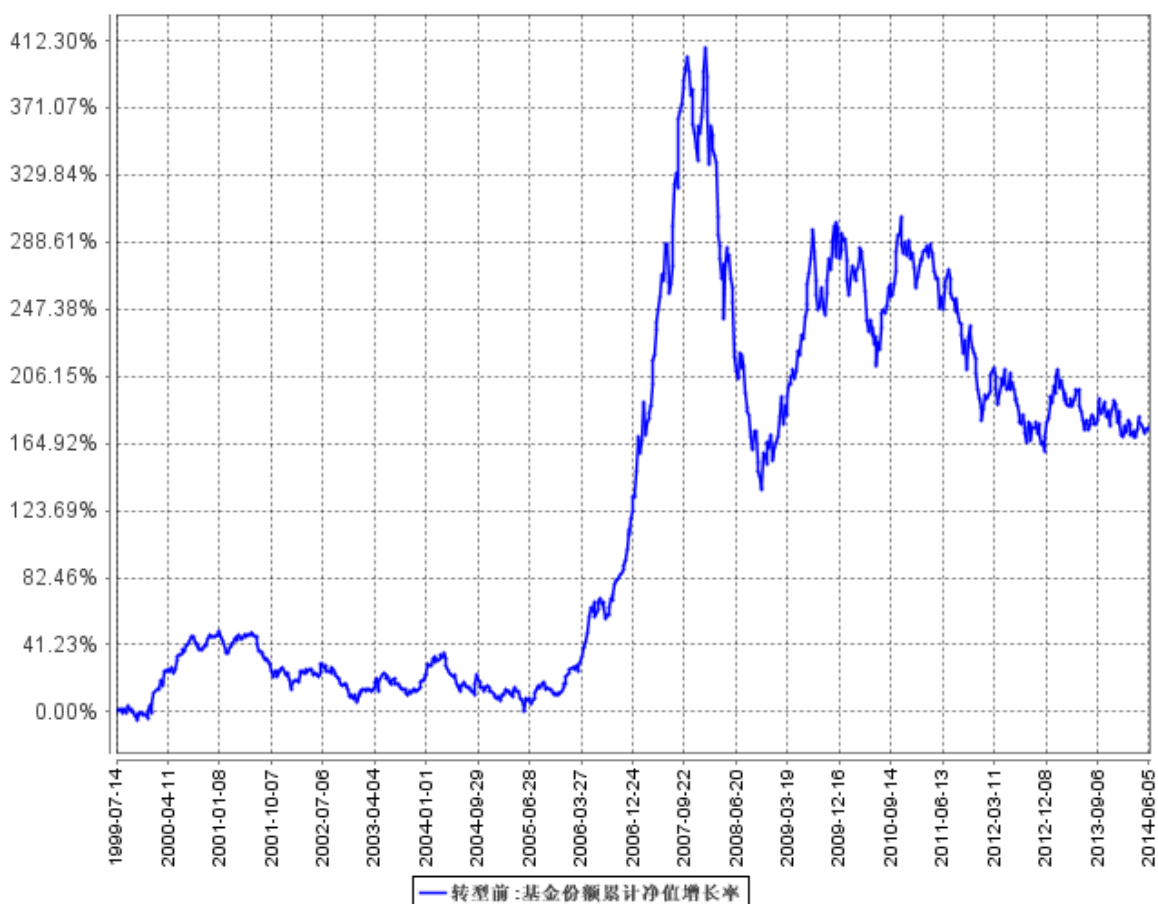
### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	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%	-	-	-	-

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。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型前）

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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

					<p>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。</p>
张戈	本基金基金经理	2014 年 4 月 19 日	2014 年 6 月 10 日	7	<p>张戈先生，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。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>

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。

#### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型后）

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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，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。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基金合同的约定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合规，不存在违反基金合同和损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行公平交易制度，确保不同投资组合在研究、交易、分配等

各环节得到公平对待。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未发生违法违规且对基金财产造成损失的异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易次数为 1 次，主要原因在于采用量化策略的基金调仓导致。

## 4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾上半年 A 股市场：（1）大势上，沪深 300 在不停的做俯卧撑，创业板则呈 N 型，高点在 2 月中下旬，低点在 5 月中旬；（2）风格上，小盘成长股继续跑赢，但 2013 年的风格分化有显著收敛；（3）行业，TMT、军工、电力设备等显著跑赢，煤炭、非银、农业等显著跑输。之所以会出现这个局面，与中国经济目前处于转型期这个时代背景有关。一系列研究表明，小盘成长股在转向器会持续跑赢，但在宏观经济或市场环境发生重大变化时会出现反复。2 月 23 日我们观察到出现兴业银行开始控制房地产行业贷款、杭州楼市出现冰冻的新闻报道，进而对市场、对小盘成长股的行情产生警惕。5 月中下旬以来，保增长的信号逐渐明确，货币、PMI 等指标也有所好转，市场、特别是小盘成长出现显著反弹。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

原鹏华基金普丰投资基金 2014 年 4 月 1 日至 6 月 9 日期间的净值增长率为 1.14%；鹏华策略优选混合型证券投资基金 2014 年 6 月 10 日至 6 月 30 日期间的净值增长率为 1.37%。同期上证综指上涨 0.74%，深证成指上涨 2.14%，沪深 300 指数上涨 0.88%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年宏观经济缺乏内生增长动力，但政策有望予以对冲：（1）我国经济增长动力主要来自出口与投资。美欧经济仍处弱复苏期、我国产品成本上升，出口总体个位数增长。产能过剩与企业债务问题对投资需求的抑制仍然存在，而房地产市场的低迷可能会进一步影响投资需求；（2）政策总体中性、定向宽松。下半年政府在进一步推动项目投资的同时，可能仍然会实行定向降准与定向再贷款。政策的节奏、力度与经济运行态势紧密相关，如果经济出现新一轮快速下行，则政策力度可能会加大；否则，稳增长政策的力度可能会相对温和。

整体而言，下半年的宏观经济和政策格局对股票市场而言是中性的，还是要努力寻找结构性机会。从房地产业发展相对成熟的美日经验来看，后房地产时代房地产及相关产业的增长或将减

速，但同时，随着技术的进步、消费的升级，又会有新的行业成长起来。而对于我国，体制改革也有望释放可观的红利。因此，应当自下而上地选择符合技术进步、消费升级、体制改革趋势的行业和个股。

具体而言我们建议关注以下四个领域：（1）技术进步包括高端装备制造、电动汽车、智能装备、互联网等；（2）消费升级包括现代农业、医药、仪器、环保、文化娱乐服务业等；（3）体制改革包括国企改革、油气改革等；（4）军工也是值得关注的主题，具体地包括军工装备、军工电子、军工信息与通信。

## § 5 投资组合报告

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 6 月 30 日）

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,134,106,383.32	46.44
	其中：股票	1,134,106,383.32	46.44
2	固定收益投资	131,509,430.52	5.39
	其中：债券	131,509,430.52	5.39
	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	600,000,000.00	24.57
	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	572,565,263.61	23.45
7	其他资产	3,778,366.97	0.15
8	合计	2,441,959,444.42	100.00

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	3,443,870.95	0.14
B	采矿业	35,379,930.69	1.45
C	制造业	619,657,208.58	25.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,903,896.30	0.69
E	建筑业	22,716,725.07	0.93
F	批发和零售业	17,173,683.98	0.71
G	交通运输、仓储和邮政业	13,363,981.19	0.55

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,271,898.48	0.63
J	金融业	227,415,641.90	9.34
K	房地产业	148,049,526.35	6.08
L	租赁和商务服务业	4,361,999.69	0.18
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	5,421,860.23	0.22
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	1,798,585.56	0.07
S	综合	3,147,574.35	0.13
	合计	1,134,106,383.32	46.56

### 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600887	伊利股份	2,909,242	96,354,095.04	3.96
2	600196	复星医药	4,179,530	84,384,710.70	3.46
3	000002	万科A	7,414,460	61,317,584.20	2.52
4	600519	贵州茅台	388,747	55,194,299.06	2.27
5	000333	美的集团	2,302,543	44,485,130.76	1.83
6	600383	金地集团	4,656,063	41,392,400.07	1.70
7	600048	保利地产	6,899,904	34,223,523.84	1.41
8	600690	青岛海尔	1,915,034	28,265,901.84	1.16
9	600062	华润双鹤	1,516,069	26,061,226.11	1.07
10	600036	招商银行	2,371,537	24,284,538.88	1.00

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	119,754,000.00	4.92
	其中：政策性金融债	119,754,000.00	4.92
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	11,755,430.52	0.48
8	其他	-	-

9	合计	131,509,430.52	5.40
---	----	----------------	------

### 5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	110413	11 农发 13	500,000	50,005,000.00	2.05
2	130405	13 农发 05	500,000	49,745,000.00	2.04
3	130236	13 国开 36	200,000	20,004,000.00	0.82
4	128006	长青转债	78,320	7,832,000.00	0.32
5	110023	民生转债	35,910	3,332,448.00	0.14

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 5.9.1 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。

#### 5.9.2 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。

### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 5.10.1 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。

#### 5.10.2 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。

### 5.10.3 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。

### 5.11 投资组合报告附注

#### 5.11.1

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。

#### 5.11.2

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。

#### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	339,995.31
2	应收证券清算款	85,427.82
3	应收股利	-
4	应收利息	3,352,943.84
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,778,366.97

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110023	民生转债	3,332,448.00	0.14
2	127002	徐工转债	245,525.32	0.01
3	110017	中海转债	221,926.80	0.01
4	110022	同仁转债	123,530.40	0.01

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 5.11.6 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。

转型前：原普丰证券投资基金（报告期：2014 年 4 月 1 日-2014 年 6 月 9 日）

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	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

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

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	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

### 5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

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

### 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 5.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600036	招商银行	2,892,023	28,920,230.00	1.2
2	600016	民生银行	3,911,565	28,867,349.70	1.2
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	0.9
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	0.5

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	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

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	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	可转债	3,836,639.55	0.16
7	其他	-	-
8	合计	888,930,639.55	36.99

### 5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	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

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

## 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 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。

### 5.9.2 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。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 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。

### 5.10.2 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。

### 5.10.3 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。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1

本基金投资的指数部分中的前十名证券之一的中国平安的发行主体中国平安保险(集团)股份有限公司(简称“中国平安”)于 2013 年 5 月 22 日发布公告称其控股子公司平安证券收到中国证监会《行政处罚和市场禁入事先告知书》，中国证监会决定对平安证券给予警告并没收其在“万福生科”发行上市项目中的业务收入人民币 2,555 万元，并处以人民币 5,110 万元的罚款，暂停其保荐机构资格 3 个月。2013 年 10 月 15 日，中国平安发布公告称近日收到中国证监会《行政处罚决定书》([2013]48 号)，决定对平安证券予以前述行政处罚。

对该股票的投资决策程序的说明：本基金管理人长期跟踪研究该股票，认为中国平安作为国

内最大的保险机构之一将长期受益于我国保险行业的发展，从处罚公告中知悉，2012 年平安证券投资业务承销佣金收入占平安集团营业收入的 0.19%，净利润的 0.66%，对平安集团的财务状况及经营成果并不产生实质性影响。本次行政处罚对该股票的投资价值不产生重大影响。该证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

本基金投资的前十名证券中的其它证券本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、处罚的证券。

### 5.11.2

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。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
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

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	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

### 5.11.5 报告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。

**5.11.6 报告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。

**5.11.7 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。

**§ 6 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	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-
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）	-
报告期期末基金份额总额	3,000,000,000.00

注：截止本报告期末，本基金尚处于封闭期。

**§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型后）****7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况（转型后）**

单位：份

基金合同生效日管理人持有的本基金份额	3,750,000.00
基金合同生效日至报告期末买入/申购总份额	-
基金合同生效日至报告期末卖出/赎回总份额	-
报告期末管理人持有的本基金份额	3,750,000.00
报告期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	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。

**7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细（转型后）**

注：本基金管理人本报告期末申购、赎回或者买卖本基金基金份额。

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型前）

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况（转型前）

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	3,750,000.00
报告期期初至 2014 年 6 月 9 日买入/申购总份额	-
报告期期初至 2014 年 6 月 9 日卖出/赎回总份额	-
2014 年 6 月 9 日管理人持有的本基金份额	3,750,000.00
2014 年 6 月 9 日持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	0.13

注：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。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细（转型前）

注：本基金管理人本报告期内未申购、赎回或者买卖本基金基金份额。

## § 8 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 日证券投资基金机构监管部[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”。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 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》；

第 21 页 共 22 页

(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 年第 2 季度报告》（原文）。

## 9.2 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

## 9.3 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  
2014 年 7 月 19 日