鹏华消费领先灵活配置混合型证券投资基金

2014 第一季度 报告

2014年3月31日

基金管理人:鹏华基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
报告送出日期:2014年4月22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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年4月17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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	鹏华消费领先混合
基金主代码	160624
交易代码	160624
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年12月23日
报告期末基金份额总额	1,404,515,308.24份
投资目标	本基金为混合型基金,通过积极灵活的资产配置,并精选优质的消费服务行业上市公司,在有效控制风险前提下,力求超越业绩比较基准的投资回报,争取实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	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。
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	交通银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年1月1日 - 2014年3月31日)
1.本期已实现收益	14,509,457.12
2.本期利润	-69,669,598.29
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0370
4.期末基金资产净值	1,364,394,044.64
5.期末基金份额净值	0.971

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。

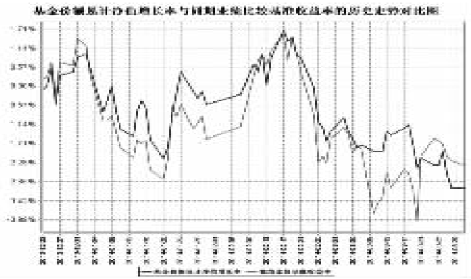
3.2 基金净值表现

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	-3.87%	0.53%	-3.74%	0.72%	-0.13%	-0.19%

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



注:1、本基金基金合同于2013年11月23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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

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		
刘苏	本基金基金经理	2013年12月23日	-	9	刘苏先生,国籍中国,北京大学理学硕士,9年证券从业经验。曾任职于深圳国际信托投资有限责任公司(现公司更名为:华润深国投信托有限公司)证券信托部,担任信托经理;2008年10月加盟鹏华基金管理有限公司,从事研究分析工作,历任研究部高级研究员、基金经理助理;2011年12月起至今担任鹏华精选成长股票型证券投资基金基金经理,2013年10月至2013年12月担任原鹏华普惠基金(2013年12月已转型为鹏华消费领先灵活配置混合型证券投资基金)基金经理,2013年12月起兼任鹏华消费领先灵活配置混合型证券投资基金基金经理。刘苏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遵规守信情况的说明

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,主要原因在于指数成分股交易不活跃导致。

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

报告期内,国内经济增长亮点不多,在此背景下,政府释放了部分稳增长的信号。同时,各项改革措施陆续出台,改变了资本市场对于很多传统行业的预期;而互联网经济的蓬勃发展,也使资本市场对之充满热情。上证指数在经济基本面和资金面均无明显趋势性变化的情况下,微幅震荡,基本符合我们之前判断的"市场可能仍然呈现指数不温不火但结构性热点频出的状态"的判断。从行业结构的表现来看,受益于互联网经济的部分行业如计算机、通信等整体表现较好,而基本面情况一般且缺乏催化剂的部分中上游行业表现较弱。本季度,本基金绝大多数时间处于建仓期,由于对市场整体看法相对谨慎,因此始终保持了较低仓位运作。

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-3.87%,同期上证综指下跌3.91%,深证成指下跌11.48%,沪深300指数下跌7.88%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下一季度,我们认为,首先,政府近期对于经济政策的表态体现出托底但不大规模刺激的意向。因此,依靠大规模投资拉动导致投资相关产业链整体利润大幅回升的可能性比较小,这些行业利润率的变化仍取决于供需形势改善的程度;其次,尽管需求疲弱不会造成短期通货膨胀的出现,但银行资产结构的调整也使得流动性异常宽松的局面很难出现,而稳增长又不能让国内资金面过于紧张,所以我们判断流动性环境处于中性状态;第三,各项改革措施层出不穷,市场热点频出。综合而言,我们认为,在经济基本面并不强劲的背景下,仅靠改革预期,2季度的股票市场出现系统性机会的可能性仍不高,但市场整体风险也不大,指数平淡、个股精彩的情况或许继续存在。在这样的市场情况下,我们会适当提高仓位,希望通过坚持精选优秀成长型公司来分享企业成长带来的价值增长。我们将致力于寻找所处市场前景广阔且行业格局较好,具备相对竞争优势,尚处于较快增长阶段的公司,尽量回避已处于成长阶段的末期、扩张空间有限的公司,以期为投资者获取较好的收益。

§5 投资组合报告

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	452,455,515.64	32.79
	其中:股票	452,455,515.64	32.79
2	固定收益投资	104,393,727.22	7.57
	其中:债券	104,393,727.22	7.57
	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	341,680,650.84	24.76
	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	472,326,665.46	34.23
7	其他资产	8,846,836.67	0.64
8	合计	1,379,703,395.83	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	-	-
B	采矿业	2,456,156.79	0.18
C	制造业	329,474,339.50	24.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,142,105.52	0.82
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	24,077,543.84	1.76
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	27,281,401.05	2.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
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	36,329,399.73	2.66
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	19,108,608.00	1.40
R	文化、体育和娱乐业	2,585,961.21	0.19
S	综合	-	-
	合计	452,455,515.64	33.16

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	600535	天士力	1,629,808	63,546,213.92	4.66
2	600887	伊利股份	1,599,878	57,323,628.74	4.20
3	300070	碧水源	1,099,891	36,329,399.73	2.66
4	601126	四方股份	1,818,131	31,399,122.37	2.30
5	002410	广联达	749,695	27,281,401.05	2.00
6	300145	南方泵业	716,770	26,298,291.30	1.93
7	002250	联化科技	1,350,000	24,880,500.00	1.82
8	000786	北新建材	1,600,000	24,432,000.00	1.79
9	002262	恩华药业	999,898	24,077,543.84	1.76
10	002470	金正大	1,098,045	20,950,698.60	1.54

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	99,808,000.00	7.32
	其中:政策性金融债	99,808,000.00	7.32
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	4,585,727.22	0.34
8	其他	-	-
9	合计	104,393,727.22	7.65

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	110406	11农发06	500,000	50,005,000.00	3.66
2	130236	13国开36	300,000	29,967,000.00	2.20
3	100401	10农发01	200,000	19,836,000.00	1.45
4	128002	东华转债	26,860	4,585,727.22	0.34

注:上述债券为本基金本报告期末持有的全部债券。

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

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

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

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

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的。

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

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	441,115.30
2	应收证券清算款	5,168,790.20
3	应收股利	-
4	应收利息	3,236,931.17
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,846,836.67

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	128002	东华转债	4,585,727.22	0.34

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	2,000,000,000.00
报告期期间基金总申购份额	28,507,596.87
减:报告期期间基金总赎回份额	483,244,562.63
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-140,747,726.00
报告期期末基金份额总额	1,404,515,308.24

注:拆分变动份额为本基金在2014年1月27日所做的份额折算。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人本报告期未申购、赎回或者买卖本基金基金份额。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

(一)《鹏华消费领先灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

(二)《鹏华消费领先灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

(三)《鹏华消费领先灵活配置混合型证券投资基金2014年第1季度报告》(原文)。

8.2 存放地点

深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心43层鹏华基金管理有限公司

上海市仙霞路18号交通银行股份有限公司

8.3 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4月22日

鹏华沪深300交易型开放式指数证券投资基金

2014 第一季度 报告

2014年3月31日

基金管理人:鹏华基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2014年4月22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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年4月17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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	鹏华沪深300ETF
基金主代码	159927
交易代码	159927
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013年7月19日
报告期末基金份额总额	62,192,168.00份
投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金采用被动式指数投资方法,按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。 当预期成份股发生调整或成份股发生配股、增发、分红等行为时,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或因某些特殊情况导致流动性不足时,或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整,力求降低跟踪误差。
业绩比较基准	沪深300指数
风险收益特征	本基金属于股票型基金,其风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金,为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。同时本基金为交易型开放式指数基金,采用完全复制法跟踪标的指数表现,具有与标的指数以及标的指数所代表的证券市场相似的风险收益特征。
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

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"A300ETF"

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年1月1日 - 2014年3月31日)
1.本期已实现收益	-797,341.02
2.本期利润	-12,557,767.50
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1914
4.期末基金资产净值	132,667,046.83
5.期末基金份额净值	2.1332

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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

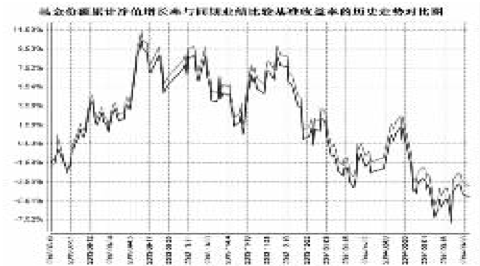
3.2 基金净值表现

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	-8.08%	1.18%	-7.88%	1.19%	-0.20%	-0.01%

注:业绩比较基准=沪深300指数

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



注:1、本基金基金合同于2013年7月19日生效,截至本报告期末本基金基金合同生效未满一年。

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

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		
崔俊杰	本基金基金经理	2013年7月19日	-	6	崔俊杰先生,国籍中国,金融工程专业管理学硕士,6年证券基金从业经验。2008年7月加盟鹏华基金管理有限公司,历任产品规划部产品设计师、量化投资部量化研究员,先后从事产品设计、量化研究工作,2013年3月起担任鹏华深证民营ETF基金及其联接基金基金经理,2013年3月起兼任鹏华上证民企50ETF基金及其联接基金基金经理,2013年7月起兼任鹏华沪深300ETF基金基金经理。崔俊杰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遵规守信情况的说明

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,主要原因在于指数成分股交易不活跃导致。

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

2014年第一季度由于经济增速下调,A股市场呈现震荡下跌的局面。本基金秉承指数基金的投资策略,在应对申购赎回的基础上,力争跟踪指数收益,并将基金跟踪误差控制在合理范围内。

面对市场震荡及基金申赎变动,我们进行了精心的管理,较好的实现了跟踪误差控制目标。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期末,本基金份额净值为2.1332元,累计净值0.9440元;本报告期基金份额净值增长率为-8.08%。本报告期基金日均跟踪偏离度的绝对值0.006%,年化跟踪误差0.121%。

对本基金而言,报告期内跟踪误差的主要来源为:样本股特殊事件导致的停复牌、成分股调整以及为应对申购赎回必要的现金留存等,对此我们采取了进一步的优化策略进行应对。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

整体来看,2014年经济总量增速预期略微下调,结构失衡仍较为严重,预期今年仍以经济结构调整为主线。过去的总量控制已显得不合时宜,如何破旧立新是当前经济转型面临的首要问题。

2014年宏观经济面临的问题较多,诸如货币政策的松紧,人民币汇率的弹性控制,未来房地产市场如何发展、经济增速保底下的投资政策,美联储的加息预期等。这些问题及衍生的新问题的出现和解决也决定了未来A股市场的走势,也许随着货币政策的转宽松,新城镇化方针具体政策的颁布和实施,双边汇率的进一步放开等政策的逐步明朗A股市场整体估值将可能会有所修复,但在市场波动中尤其要注意参与力度和风险控制,因此,我们建议继续密切关注与实体经济相关的宏观数据变化和政策信息。

我们仍然强调前期的观点:反复的经济形势势必带来资产之间轮动演绎的复杂化和高频率化,资产配置犯错的概率和机会成本相对较高,建议投资者从中长期投资的角度来考虑战略资产配置,避免短期频繁操作带来的风险。

本基金将积极应对各种因素对指数跟踪效果带来的冲击,努力将跟踪误差控制在基金合同规定的范围内,力争为投资者带来较好的投资回报。

§5 投资组合报告

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	132,168,785.39	99.46
	其中:股票	132,168,785.39	99.46
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	601,197.05	0.45
7	其他资产	117,769.17	0.09
8	合计	132,887,751.61	100.00

注:上表中的股票投资项含可退替代款估值增值,而5.2.1的合计项不含可退替代款估值增值。

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	854,635.79	0.64
B	采矿业	7,845,518.39	5.91
C	制造业	47,666,590.07	35.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,329,850.51	3.26
E	建筑业	4,407,652.93	3.32
F	批发和零售业	3,941,207.11	2.97
G	交通运输、仓储和邮政业	3,542,155.16	2.67
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,943,833.46	2.97
J	金融业	44,821,825.97	33.79
K	房地产业	6,599,225.33	4.97
L	租赁和商务服务业	887,283.94	0.67
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,257,988.20	0.95
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	827,795.20	0.62
S	综合	1,243,223.33	0.94
	合计	132,168,785.39	99.62

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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	601318	中国平安	131,691	4,946,313.96	3.73
2	600016	民生银行	625,400	4,790,564.00	3.61
3	600036	招商银行	456,899	4,486,748.18	3.38
4	601166	兴业银行	316,520	3,013,270.40	2.27
5	600000	浦发银行	309,860	3,011,839.20	2.27
6	000002	万 科A	264,840	2,142,555.60	1.61
7	600837	海通证券	224,089	2,070,582.36	1.56
8	600030	中信证券	185,380	1,952,051.40	1.47
9	000651	格力电器	66,629	1,865,612.00	1.41
10	600519	贵州茅台	11,400	1,763,580.00	1.33

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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

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

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

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

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,降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差,达到有效跟踪标的指数的目的。

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

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年平安证券投行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。本基金为ETF基金,为更好地跟踪标的指数,控制跟踪误差对该证券的投资属于按照指数成分股的权重进行配置,符合ETF基金的管理规定,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之一的海通证券的发行人海通证券股份有限公司于2013年4月22日收到中国证券监督管理委员会上海监管局《关于对海通证券股份有限公司采取责令改正措施的决定》(沪证监决【2013】12号)(以下简称"决定"),主要内容如下:"经查,我局发现你公司发行的"一海通财"系列产品系现行监管规则未予明确的创新型产品,但你公司未按照《证券公司业务(产品)创新工作指引(试行)》的规定,向中国证监会机构监管部履行创新产品方案报送义务。" 针对决定提出的问题,发行人组织整改,完善相关工作程序,并对相关责任人进行了责任追究和处分。

对该股票的投资决策程序的说明:本次监管措施对该股票的投资价值不产生重大影响。本基金为ETF基金,为更好地跟踪标的指数,控制跟踪误差对该股票的投资属于按照指数成分股的权重进行配置,符合ETF基金的管理规定,该股票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他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	11,164.99
2	应收证券清算款	106,466.73
3	应收股利	-
4	应收利息	137.45
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	117,769.17

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

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

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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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

报告期期初基金份额总额	70,192,168.00
报告期期间基金总申购份额	-
减:报告期期间基金总赎回份额	8,000,000.00
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	62,192,168.00

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人本报告期未申购、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

本基金托管人2014年2月7日发布任免通知,解聘尹东中国建设银行投资托管业务部总经理助理职务。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

(一)《鹏华沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金合同》;

(二)《鹏华沪深300交易型开放式指数证券投资基金托管协议》;

(三)《鹏华沪深300交易型开放式指数证券投资基金2014年第1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43层鹏华基金管理有限公司

北京市西城区金融大街25 号中国建设银行股份有限公司

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4月22日

普丰证券投资基金

2014 第一季度 报告

2014年3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
报告送出日期:2014年4月22日

§1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。

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4月17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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

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。
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

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年1月1日 - 2014年3月31日)
1.本期已实现收益	-11,847,962.27
2.本期利润	-133,475,161.59
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0445
4.期末基金资产净值	2,376,335,716.04
5.期末基金份额净值	0.7921

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。

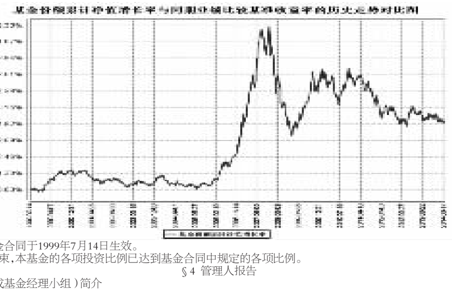
3.2 基金净值表现

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	-5.32%	1.73%	-	-	-	-

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



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

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	-	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,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,2013年1月起兼任鹏华普丰基金基金经理,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遵规守信情况的说明

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,主要原因在于指数成分股交易不活跃导致。

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

2014年一季度,市场延续弱势,沪深300指数一度下跌接近10%;创业板指数在二月份创出历史新高,之后有所调整。金融、地产、周期性板块进一步下跌,食品饮料、医药等传统的防御性行业也被抛售。

季度内,本基金降低了股票仓位,行业配置进一步向与经济周期关联度较小的防御性行业集中。不过一季度总体看,市场的获利机会主要还是集中于新兴产业和并购等事件性刺激,本组合被动防御的效果不明显,表现不佳。

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-5.32%,同期上证综指下跌3.91%,深证成指下跌11.48%,沪深300指数下跌7.88%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

开年以来,数据显示国内经济继续低迷,政府投资在防控地方债务风险的考虑下受到一定压制,房地产销售与投资转弱,消费增长不温不火。市场对国内经济增速预期进一步下调。季度末,政策出现一些保增长的迹象,市场开始憧憬投资与房地产政策的放松,从而引发了A股市场风格在一定程度的转变。

展望未来:一方面,从全球来看,美联储给出了QE退出的计划,不过由于其退出影响的复杂性,路径仍不清晰。QE的退出不仅对美国的经济,对全球的流动性状况都将会有较大的影响;另一方面,国内经济政策虽有转向保增长的可能,但其力度、效果、市场反应仍存很多不确定性。保增长既要达到稳定经济与就业的效果,又能顺应经济结构调整的方向,这才是市场愿意看到的;如果重回刺激投资的旧路,不仅有可能达不到预期效果,也可能造成"钱荒"再现。

在如此复杂的经济环境中,本基金只能将关注点集中于更为深入的研究公司基本面,并且尽可能的减少市场系统性风险带来的波动,力争为投资人创造良好的回报。

§5 投资组合报告

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	1,630,496,584.82	68.51
	其中:股票	1,630,496,584.82	68.51
2	固定收益投资	533,236,078.47	22.40
	其中:债券	533,236,078.47	22.40
	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	199,717,519.06	8.39
7	其他资产	16,579,052.36	0.70
8	合计	2,380,029,234.71	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	4,965,063.47	0.21
B	采矿业	49,338,140.31	2.08
C	制造业	273,685,133.22	11.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	21,010,602.21	0.88
E	建筑业	27,555,146.29	1.16
F	批发和零售业	21,273,941.34	0.90
G	交通运输、仓储和邮政业	17,957,441.32	0.76
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,625,060.00	0.74
J	金融业	278,639,236.72	11.73
K	房地产业	40,681,173.43	1.71
L	租赁和商务服务业	5,266,949.07	0.22
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	6,066,808.41	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	2,144,851.20	0.09
S	综合	7,578,513.60	0.32
	合计	773,788,060.59	32.58

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	512,520,154.95	21.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	50,084,721.75	2.11
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	78,343,200.00	3.30
K	房地产业	215,760,447.53	9.08
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	856,708,524.23	36.06

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	600016	民生银行	3,911,565	29,962,587.90	1.26
2	600036	招商银行	2,892,023	28,399,665.86	1.20
3	601166	兴业银行	2,805,655	26,709,835.60	1.12
4	601318	中国平安	583,998	21,934,964.88	0.92
5	000001	平安银行	1,889,622	20,351,228.94	0.86
6	600000	浦发银行	1,965,313	19,102,842.36	0.80
7	000002	万 科A	1,718,650	13,903,878.50	0.59
8	600837	海通证券	1,393,630	12,877,141.20	0.54
9	600030	中信证券	1,193,395	12,566,449.35	0.53
10	000651	格力电器	414,410	11,603,480.00	0.49

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	600519	贵州茅台	699,995	108,289,226.50	4.56
2	600383	金地集团	13,999,907	96,879,356.44	4.08
3	600196	复星医药	4,000,000	80,120,000.00	3.37
4	600030	中信证券	7,440,000	78,343,200.00	3.30
5	000002	万 科A	7,999,901	64,719,199.09	2.72

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	529,481,000.00	22.28
	其中:政策性金融债	529,481,000.00	22.28
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	3,755,078.47	0.16
8	其他	-	-
9	合计	533,236,078.47	22.44

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	130218	13国开18	1,500,000	150,000,000.00	6.31
2	130222	13国开22	1,000,000	89,550,000.00	3.77
3	130428	13农发28	500,000	50,035,000.00	2.11
4	130322	13进出22	500,000	50,000,000.00	2.10
5	110310	11进出10	500,000	49,990,000.00	2.10

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

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

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

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

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

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年平安证券投行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。

本基金投资的指数部分中的前十名证券之一的海通证券的发行人海通证券股份有限公司于2013年4月22日收到中国证券监督管理委员会上海监管局《关于对海通证券股份有限公司采取责令改正措施的决定》(沪证监决【2013】12号)(以下简称"决定"),主要内容如下:"经查,我局发现你公司发行的"一海通财"系列产品系现行监管规则未予明确的创新型产品,但你公司未按照《证券公司业务(产品)创新工作指引(试行)》的规定,向中国证监会机构监管部履行创新产品方案报送义务。" 针对决定提出的问题,发行人组织整改,完善相关工作程序,并对相关责任人进行了责任追究和处分。

对该股票的投资决策程序的说明:本次监管措施对该股票的投资价值不产生重大影响。本基金为ETF基金,为更好地跟踪标的指数,控制跟踪误差对该股票的投资属于按照指数成分股的权重进行配置,符合ETF基金的管理规定,该股票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	216,523.83
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	16,362,528.53
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,579,052.36

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	3,178,394.10	0.13
2	110017	中海转债	216,499.50	0.01
3	110022	同仁转债	129,945.60	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

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

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 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

6.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	3,750,000.00
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	3,750,000.00
报告期期末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适用的费率标准相一致。

6.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人本报告期未申购、赎回或者买卖本基金基金份额。

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

(一)《普丰证券投资基金基金合同》;

(二)《普丰证券投资基金托管协议》;

(三)《普丰证券投资基金2014年第1季度报告》(原文)。

7.2 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

7.3 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4月22日