（上接B238版）

分离交易可转债，上市日前，采用估值技术分别对债券和权证进行估值；自上市日起，上市流通的债券和权证分别按上述的相关方法进行估值。

6.4.4.6 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。当本基金依法有权抵销债权债务且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列示。

6.4.4.7 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。

6.4.4.8 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，并于期末金额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 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；处置时其公允价值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也可按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管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。

6.4.4.11 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。

6.4.4.12 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：

6.4.4.12.1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。

6.4.4.12.2对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会计字[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》之附件《若在证券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。

6.4.4.12.3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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期没有发生会计政策变更。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 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。

6.4.6 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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

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。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
鹏华基金管理有限公司	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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 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。

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 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6月30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	7.04%

6.4.8.1.2 债券交易

注：本基金2014年6月10日（基金合同生效日）至2014年6月30日未通过关联方交易单元发生债券交易。

6.4.8.1.3 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6月30日未通过关联方交易单元发生债券回购交易。

6.4.8.1.4 权证交易

注：本基金2014年6月10日（基金合同生效日）至2014年6月30日未通过关联方交易单元发生权证交易。

6.4.8.1.5 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6月30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	7.05%	12,214.65	1.64%

注：（1）佣金的计算公式

上海证券交易所的交易佣金=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=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。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 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6月30日
当期应支付的管理费	2,089,203.71

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1.50%，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。

6.4.8.2.2 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6月30日
当期应支付的托管费	348,200.60

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。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期没有与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 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6月30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	–
期间赎回/卖出总份额	–
期末持有的基金份额	3,750,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.1250%

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。

6.4.8.4.2 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6月30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	7,500,000.00	0.2500%

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，本基金管理人之外的其他关联方持有份额不变。

6.4.8.5 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6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	572,399,435.47	167,905.57

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期未参与关联方承销的证券。

6.4.9 期末（2014年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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

6.4.9.1.2受限证券类别：债券									
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：张)	期末成本总额	期末估值总额
128006	长青转债	2014年6月25日	2014年7月9日	新债锁定	100.00	100.00	78,320	7,832,000.00	7,832,000.00

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股票及权证。

6.4.9.2 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
002035	华帝股份	2014年6月30日	重大事项	9.89	2014年7月2日	10.58	1,429,500	15,203,452.23	14,137,755.00	–
600832	东方明珠	2014年5月29日	资产重组	10.98	–	–	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	–	–	92,039	1,528,536.25	2,948,009.17	–
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	–	–	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	–
600516	方大炭素	2014年6月30日	临时停牌	9.59	2014年7月2日	9.05	107,702	805,403.01	1,032,862.18	–
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	–
002570	贝因美	2014年6月19日	重大事项	14.36	–	–	65,583	992,371.21	941,771.88	–
600498	烽火通信	2014年6月30日	重大事项	11.91	2014年7月7日	12.10	69,713	980,785.70	830,281.83	–
600582	天地科技	2014年6月26日	资产重组	7.97	–	–	70,497	804,129.27	561,861.09	–
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	–

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 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。

6.4.9.3.2 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 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）

7.1 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

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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(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

7.2.2 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

7.2.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的指数投资前十名和积极投资前五名股票投资明细

7.2.4 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

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	1.2
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

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于鹏华基金管理有限公司网站http://www.phfund.com的半年度报告正文。

7.2.5 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	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

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于鹏华基金管理有限公司网站http://www.phfund.com的半年度报告正文。

7.3 报告期内股票投资组合的重大变动

7.3.1 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。

7.3.2 累计卖出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。

7.3.3 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。

7.4 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

7.5 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

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.7 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。

7.8 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。

7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.9.1 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。

7.9.2 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。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.10.3 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。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1

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。

7.11.2

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。

7.11.3 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

7.11.4 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

7.11.5 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。

7.11.6 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。

7.11.7 投资组合报告附注的其他文字描述部分

§7 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6月30日）

7.1 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	1,134,106,383.32	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

7.2 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(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

7.3 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

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	2,909,242	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

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于鹏华基金管理有限公司网站http://www.phfund.com的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	002380	科远股份	4,996,871.41	0.21
2	000932	华菱钢铁	2,047,884.00	0.08
3	002313	日海通讯	1,999,098.00	0.08
4	002140	东华科技	1,014,000.00	0.04
5	300285	国瓷材料	498,663.75	0.02

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。

7.4.2 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	600383	金地集团	9,801,405.04	0.40
2	600557	康缘药业	6,605,548.04	0.27
3	601939	建设银行	5,697,711.51	0.23
4	600036	招商银行	5,306,019.12	0.22
5	600016	民生银行	5,256,976.49	0.22
6	600525	长园集团	5,188,222.07	0.21
7	601288	农业银行	5,099,928.43	0.21
8	601166	兴业银行	4,861,577.93	0.20
9	601857	中国石油	4,248,800.15	0.17
10	600000	浦发银行	3,403,400.40	0.14
11	000001	平安银行	3,331,022.15	0.14
12	601988	中国银行	3,130,276.94	0.13
13	600028	中国石化	2,984,751.55	0.12
14	601328	交通银行	2,834,344.25	0.12
15	601088	中国神华	2,587,321.60	0.11
16	000002	万科A	2,550,112.62	0.10
17	600030	中信证券	2,452,669.69	0.10
18	600519	贵州茅台	2,376,486.00	0.10