

鹏华消费领先灵活配置混合型证券投资基金 2015 年半年度报告

2015 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：交通银行股份有限公司

送出日期：2015 年 8 月 25 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 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。本半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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 8 月 20 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 6 月 30 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	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.8 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.....	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况.....	35
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	35
7.3 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.....	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	40
7.6 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.....	40
7.7 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.....	40
7.8 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.....	40
7.9 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.....	40
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	41
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	41
7.12 投资组合报告附注.....	41

§8 基金份额持有人信息	44
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	44
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	45
8.3 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.....	45
§9 开放式基金份额变动	45
§10 重大事件揭示	45
10.1 基金份额持有人大会决议.....	45
10.2 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.....	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	46
10.4 基金投资策略的改变.....	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	46
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	46
10.8 其他重大事件.....	48
§11 备查文件目录	65
11.1 备查文件目录.....	65
11.2 存放地点.....	65
11.3 查阅方式.....	65

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华消费领先灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	鹏华消费领先混合
场内简称	鹏华领先
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
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
报告期末基金份额总额	386,527,162.13 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	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。

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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张戈	汤嵩彦
	联系电话	0755-82825720	95559
	电子邮箱	zhangge@phfund.com.cn	tangsy@bankcomm.com

客户服务电话	4006788999	95559
传真	0755-82021126	021-62701216
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	上海市浦东新区银城中路188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	上海市浦东新区银城中路188号
邮政编码	518048	200120
法定代表人	何如	牛锡明

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》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.phfund.com
基金半年度报告备置地点	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。

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
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 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2015年1月1日 - 2015年6月30日)
本期已实现收益	373,072,725.65
本期利润	373,428,087.01
加权平均基金份额本期利润	0.7849
本期加权平均净值利润率	46.66%
本期基金份额净值增长率	62.58%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)
期末可供分配利润	335,034,725.77
期末可供分配基金份额利润	0.8668
期末基金资产净值	753,926,797.54
期末基金份额净值	1.951

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015年6月30日)
基金份额累计净值增长率	94.81%

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) 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6月30日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

3.2 基金净值表现

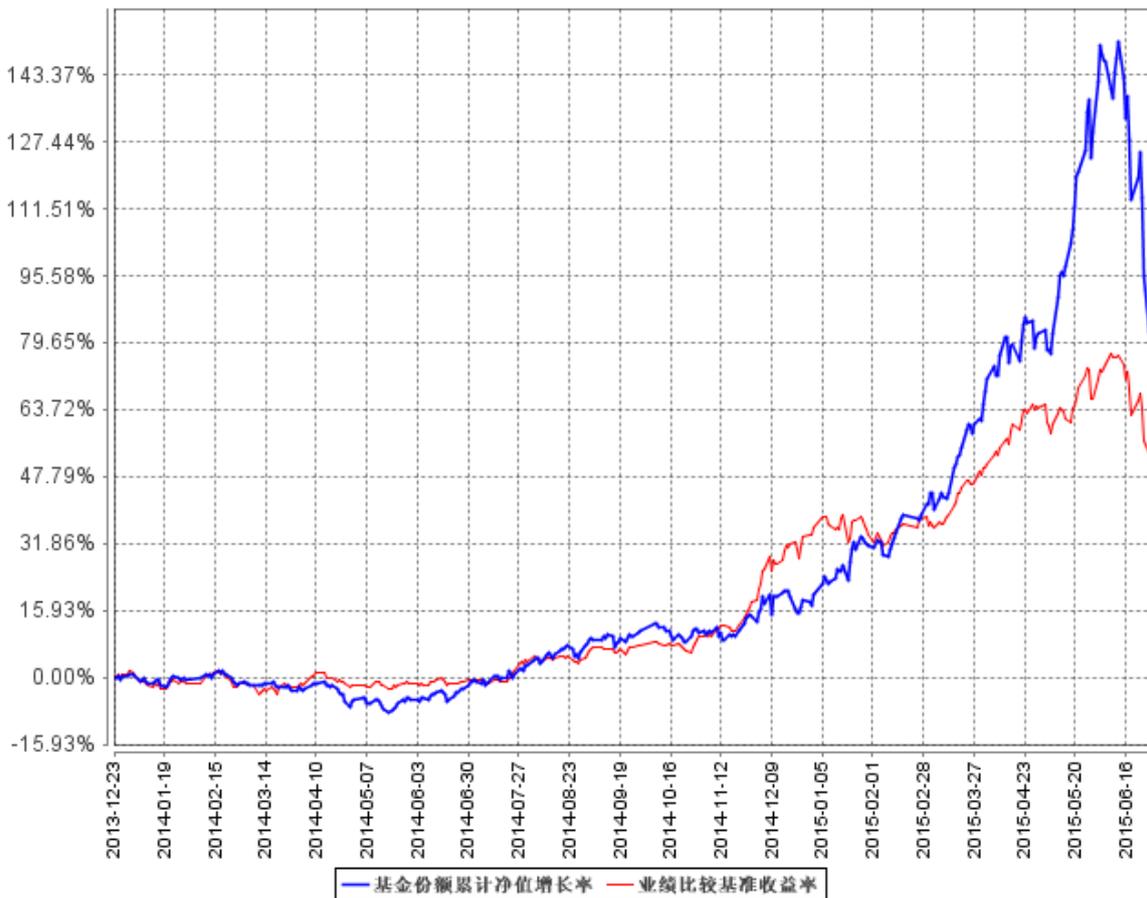
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去一个月	-15.25%	4.15%	-4.19%	2.09%	-11.06%	2.06%
过去三个月	20.88%	3.05%	7.55%	1.57%	13.33%	1.48%
过去六个月	62.58%	2.39%	17.46%	1.36%	45.12%	1.03%
过去一年	98.47%	1.82%	60.59%	1.10%	37.88%	0.72%
自基金合同生效起至今	94.81%	1.53%	59.45%	0.97%	35.36%	0.56%

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 2013 年 11 月 23 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，公司管理资产总规模达到 3575.13 亿

元，管理 81 只开放式基金、10 只全国社保投资组合。经过近 17 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

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		
刘苏	本基金基金经理	2013 年 12 月 23 日	2015 年 5 月 5 日	10	刘苏先生，国籍中国，北京大学理学硕士，10 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 月至 2015 年 5 月担任鹏华精选成

					<p>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月至2015年5月担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发生变动，刘苏不再担任本基金基金经理。</p>
陈鹏	本基金基金经理	2015年5月5日	-	12	<p>陈鹏先生，国籍中国，清华大学工商管理硕士，12年</p>

				<p>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</p>
--	--	--	--	---

					<p>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，2015 年 5 月起至今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。现同时担任基金管理部副总经理、投资决策委员会成员。本报告期内本基金基金经理发生变动，刘苏不再担任本基金基金经理，由陈鹏担任本基金基金经理。</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。

4.2 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 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。

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。本报告期内未发生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% 的情况。

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

2015 年上半年，国内经济总体仍比较疲软，但局部地也出现了一些亮点，例如：房地产销售的回暖，地方债务置换快速推进等。A 股市场延续了去年下半年以来的强势，许多股票的涨幅和上涨的速度都是近年比较少见的。但是 6 月中旬以后，随着监管机构对场外配资的清查，市场开始大幅回落，速度之快也让人猝不及防。

本基金在上半年基本保持了较高的仓位，由于股票上涨速度太快，本基金也提高了换手率，对股价反应比较充分的个股进行减持，同时买入一些仍有上行空间的公司。在行业配置上，比较侧重于环保、医药、制造业，对估值偏高的计算机等行业参与不多。因为 6 月中旬以来的下跌速度较快，且一路伴随着各种救市政策的出台，本基金在仓位上没有做太大调整，导致虽然在选股上有一定的贡献，但总体而言净值回撤还是比较大。

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 62.58%，同期上证综指上涨 32.23%，深证成指上涨 30.17%，沪深 300 指数上涨 26.58%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为国内经济内生的复苏动力仍然会比较弱，但中央政府在下半年可能会把“稳增长”放在更重要的位置，政策取向的变化值得关注。

A 股市场下半年的形势会比较复杂。在国内：过去一年中，各路资金跑步入市与股价快速上涨的正反馈已经被打破；市场大起大落后，投资者的情绪普遍比较迷茫，缺乏方向。在国外：美联储在年底前加息概率很大，近期已经对新兴市场带来一定压力。

总体而言，我们判断下半年经济出现大幅下滑的可能性不大，加上流动性仍然较为宽松，这意味着市场出现系统性风险的机会不大。在微观层面，一些新兴行业景气度处于上行周期；很多公司仍在努力进行经营层面的转型升级，提升公司价值。这也为我们选股提供了基础。而市场情绪偏悲观也意味着我们能够以较好的价格买到优秀的公司。

基于此，从本基金在下半年将更加专注于个股的研究和精选。多挖掘处于成长期的优质公司，尽可能的控制买入成本，稳扎稳打构建组合，争取为投资者创造良好的收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.6.1 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

4.6.1.1 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会计核算岗外，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。

4.6.1.2 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等没有市价的投资品种估值小组，成员由基金经理、行业研究员、监察稽核部、金融工程师、登记结算部相关人员组成。

4.6.2 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。

4.6.3 本公司参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.6.4 本公司现没有进行任何定价服务的签约。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

4.7.1 截止本报告期末，本基金期末可供分配利润为 335,034,725.77 元，期末基金份额净值 1.951 元。

4.7.2 本基金本报告期内未进行利润分配。

4.7.3 根据相关法律法规及本基金基金合同的规定，本基金管理人将会综合考虑各方面因素，在严格遵守规定前提下，对本报告期内可供分配利润适时作出相应安排。

4.8 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

注：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

2015 年上半年度，基金托管人在鹏华消费领先灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2015 年上半年度，鹏华基金管理有限公司在鹏华消费领先灵活配置混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未

发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2015 年上半年度，由鹏华基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关鹏华消费领先灵活配置混合型证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：鹏华消费领先灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,511,293.10	47,401,811.64
结算备付金		40,844,030.33	19,210,431.16
存出保证金		525,653.32	293,863.08
交易性金融资产	6.4.7.2	711,528,610.22	648,883,142.46
其中：股票投资		711,528,610.22	628,409,142.46
基金投资		-	-
债券投资		-	20,474,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		14,198,637.40	-
应收利息	6.4.7.5	24,188.41	706,923.85
应收股利		-	-
应收申购款		9,399.31	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		768,641,812.09	716,496,172.19
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	3,818,542.28
应付赎回款		11,213,718.82	1,620,773.67
应付管理人报酬		1,189,726.55	909,953.37
应付托管费		198,287.75	151,658.89
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,615,595.33	1,927,314.06
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	497,686.10	395,001.27
负债合计		14,715,014.55	8,823,243.54
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	415,775,598.26	634,105,911.76
未分配利润	6.4.7.10	338,151,199.28	73,567,016.89
所有者权益合计		753,926,797.54	707,672,928.65
负债和所有者权益总计		768,641,812.09	716,496,172.19

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.951 元，基金份额总额 386,527,162.13 份。

6.2 利润表

会计主体：鹏华消费领先灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
一、收入		385,408,346.09	-42,446,382.69
1.利息收入		517,876.23	6,713,939.25
其中：存款利息收入	6.4.7.11	475,550.81	3,700,256.94
债券利息收入		42,325.42	2,973,050.06
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	40,632.25
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		383,007,827.53	11,768,178.16
其中：股票投资收益	6.4.7.12	380,213,295.29	11,728,091.08
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	257,326.83	-3,686,807.01
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	2,537,205.41	3,726,894.09

3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	355,361.36	-65,770,541.35
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	1,527,280.97	4,842,041.25
减：二、费用		11,980,259.08	14,740,903.10
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	5,926,130.17	10,002,652.83
2. 托管费	6.4.10.2.2	987,688.29	1,667,108.84
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	4,860,251.04	2,800,707.66
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.19	206,189.58	270,433.77
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		373,428,087.01	-57,187,285.79
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		373,428,087.01	-57,187,285.79

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鹏华消费领先灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 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）	634,105,911.76	73,567,016.89	707,672,928.65
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	373,428,087.01	373,428,087.01
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）	-218,330,313.50	-108,843,904.62	-327,174,218.12
其中：1.基金申购款	123,920,563.15	90,293,776.56	214,214,339.71
2.基金赎回款	-342,250,876.65	-199,137,681.18	-541,388,557.83
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)	415,775,598.26	338,151,199.28	753,926,797.54
项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30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)	2,000,000,000.00	-121,119,547.12	1,878,880,452.88
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-57,187,285.79	-57,187,285.79
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)	-1,217,852,343.33	111,142,556.97	-1,106,709,786.36
其中：1.基金申购款	30,815,324.13	-2,173,934.18	28,641,389.95
2.基金赎回款	-1,248,667,667.46	113,316,491.15	-1,135,351,176.31
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)	782,147,656.67	-67,164,275.94	714,983,380.73

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u> 邓召明 </u>	<u> 高鹏 </u>	<u> 郝文高 </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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

鹏华消费领先灵活配置混合型证券投资基金是根据原普惠证券投资基金(以下简称“基金普惠”)基金份额持有人大会 2013 年 11 月 19 日决议通过的《关于普惠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”)基金部函[2013]1025 号文备案，由原基金普惠转型而来。原基金普惠存续期限至 2013 年 12 月 22 日止。自 2013 年 12 月 23 日起，原基金普惠更名为鹏华消费领先灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)，《普惠证券投资基金基金合同》失效的同时《鹏华消费领先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，基金托管人为交通银

行股份有限公司。

原基金普惠于基金合同失效前的基金资产净值为 1,861,279,465.28 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《鹏华消费领先灵活配置混合型证券投资基金基金合同》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%;投资于消费服务行业上市公司的股票占非现金资产的比例不低于 80%;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%。

6.4.2 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》、《鹏华消费领先灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的基金行业实务操作的有关规定编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2015 年上半年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 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期的会计估计发生变更。本基金本报告期根据中国证券投资基金业协会《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》(以下简称“估值处理标准”),对于交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外),采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

除以上会计估计的变更,本报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 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

本报告期税项未发生变化。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
活期存款	1,511,293.10
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	1,511,293.10

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	651,142,078.02	711,528,610.22	60,386,532.20
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	651,142,078.02	711,528,610.22	60,386,532.20

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：截止本报告期末，本基金未持有衍生金融资产和衍生金融负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：截至本报告期末，本基金未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：截至本报告期末，本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应收活期存款利息	676.49
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	23,298.98
应收债券利息	-
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	212.94
合计	24,188.41

注：其他为应收结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

注：截至本报告期末，本基金未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,615,595.33
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,615,595.33

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,811.52

预提费用	495,874.58
合计	497,686.10

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	589,498,009.88	634,105,911.76
本期申购	115,206,625.54	123,920,563.15
本期赎回(以“-”号填列)	-318,177,473.29	-342,250,876.65
本期末	386,527,162.13	415,775,598.26

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 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	26,695,995.59	46,871,021.30	73,567,016.89
本期利润	373,072,725.65	355,361.36	373,428,087.01
本期基金份额交易产生的变动数	-64,733,995.47	-44,109,909.15	-108,843,904.62
其中：基金申购款	46,295,743.46	43,998,033.10	90,293,776.56
基金赎回款	-111,029,738.93	-88,107,942.25	-199,137,681.18
本期已分配利润	-	-	-
本期末	335,034,725.77	3,116,473.51	338,151,199.28

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
	活期存款利息收入
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	290,546.22
其他	13,673.08
合计	475,550.81

注：其他为申购款利息收入与结算保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,717,038,175.02
减：卖出股票成本总额	1,336,824,879.73
买卖股票差价收入	380,213,295.29

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	22,025,296.80
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	21,037,600.00
减：应收利息总额	730,369.97
买卖债券差价收入	257,326.83

6.4.7.14 衍生工具收益

注：本基金本报告期没有发生衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	2,537,205.41
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,537,205.41

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	355,361.36
——股票投资	189,761.36
——债券投资	165,600.00
——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	355,361.36

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2015年1月1日至2015年6月30日
基金赎回费收入	1,527,280.97
合计	1,527,280.97

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2015年1月1日至2015年6月30日
交易所市场交易费用	4,860,251.04
银行间市场交易费用	-
合计	4,860,251.04

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2015年1月1日至2015年6月30日
审计费用	47,108.87
信息披露费	148,765.71
其他	200.00
账户维护费	9,000.00
银行汇划费用	1,115.00
合计	206,189.58

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30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	290,380,704.57	9.26%	32,781,257.16	1.95%

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期内及上年度可比较期间未通过关联方交易单元发生债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期内及上年度可比较期间未通过关联方交易单元发生债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度可比较期间未通过关联方交易单元发生权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015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	257,670.72	9.21%	11,830.56	0.73%

关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1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	29,844.34	1.99%	-	-

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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月 30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	5,926,130.17	10,002,652.83
其中：支付销售机构的客户维护费	135,958.48	140,062.89

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1.5%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×1.5%÷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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	987,688.29	1,667,108.84

注：支付基金托管人交通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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

注：本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）的交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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
	2015年1月1日至2015年6月30日	2014年1月1日至2014年6月30日
基金合同生效日（2013年12月23日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	6,972,196.00	7,500,000.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-527,804.00
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	6,972,196.00	6,972,196.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.8038%	0.9588%

注：（1）封闭式基金普惠证券投资基金由于封闭期限结束，于2013年12月23日终止上市，转型为开放式基金鹏华消费领先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1月27日原基金普惠基金份额进行折算后，折算后原基金普惠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6,972,196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。

6.4.10.4.2 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	
	2015年6月30日		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	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 券股份 有限公 司	13,944,392.00	3.6076%	13,944,392.00	2.3655%
------------------------	---------------	---------	---------------	---------

6.4.10.5 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 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	1,511,293.10	171,331.51	15,435,073.17	882,924.81

6.4.10.6 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没有参与关联方承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2015年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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等其他证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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
000786	北新 建材	2015 年4月 10日	重大 事项	19.13	-	-	1,146,160	10,157,268.60	21,926,040.80	-
300190	维尔 利	2015 年5月 25日	重大 事项	31.15	-	-	499,954	13,336,304.04	15,573,567.10	-
600499	科达 洁能	2015 年6月 10日	重大 事项	22.85	-	-	400,000	11,419,864.20	9,140,000.00	-
601311	骆驼	2015	重大	23.31	2015	25.38	349,972	10,778,086.60	8,157,847.32	-

	股份	年 6 月	事项		年 7 月					
		18 日			15 日					
603939	益丰 药房	2015 年 6 月 8 日	重大 事项	78.14	2015 年 8 月 17 日	89.89	150,000	13,344,299.29	11,721,000.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 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。

6.4.12.3.2 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 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。

6.4.13.2 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交通银行股份有限公司，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 2015 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券。（2014 年 12 月 31 日：0.07%）。

6.4.13.3 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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,511,293.10	-	-	-	1,511,293.10
结算备付金	40,844,030.33	-	-	-	40,844,030.33
存出保证金	525,653.32	-	-	-	525,653.32
交易性金融资产	-	-	-	711,528,610.22	711,528,610.22
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	14,198,637.40	14,198,637.40
应收利息	-	-	-	24,188.41	24,188.41
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	9,399.31	9,399.31
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	42,880,976.75	-	-	725,760,835.34	768,641,812.09
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	-	-	-	11,213,718.82	11,213,718.82
应付管理人报酬	-	-	-	1,189,726.55	1,189,726.55
应付托管费	-	-	-	198,287.75	198,287.75
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	1,615,595.33	1,615,595.33

应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	497,686.10	497,686.10
负债总计	-	-	-	14,715,014.55	14,715,014.55
利率敏感度缺口	42,880,976.75	-	-	711,045,820.79	753,926,797.54
上年度末 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	47,401,811.64	-	-	-	47,401,811.64
结算备付金	19,210,431.16	-	-	-	19,210,431.16
存出保证金	293,863.08	-	-	-	293,863.08
交易性金融资产	19,990,000.00	484,000.00	-	628,409,142.46	648,883,142.46
应收利息	-	-	-	706,923.85	706,923.85
资产总计	86,896,105.88	484,000.00	-	629,116,066.31	716,496,172.19
负债					
应付证券清算款	-	-	-	3,818,542.28	3,818,542.28
应付赎回款	-	-	-	1,620,773.67	1,620,773.67
应付管理人报酬	-	-	-	909,953.37	909,953.37
应付托管费	-	-	-	151,658.89	151,658.89
应付交易费用	-	-	-	1,927,314.06	1,927,314.06
其他负债	-	-	-	395,001.27	395,001.27
负债总计	-	-	-	8,823,243.54	8,823,243.54
利率敏感度缺口	86,896,105.88	484,000.00	-	620,292,822.77	707,672,928.65

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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2015 年 6 月 30 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 0.00%（2014 年 12 月 31 日：2.89%）因此当利率发生合理、可能的变动时，对于本基金资产净值无重大影响（2014 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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 0%—95%，其中投资于消费服务行业上市公司的股票占股票资产的比例不低于 80%；债券、货币市场工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他资产不低于基金资产的 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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		上年度末 2014 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	711,528,610.22	94.38	628,409,142.46	88.80
交易性金融资产-基金投资	0.00	0.00	0.00	0.00
交易性金融资产-贵金属投资	0.00	0.00	0.00	0.00
衍生金融资产-权证投资	0.00	0.00	0.00	0.00
其他	0.00	0.00	0.00	0.00
合计	711,528,610.22	94.38	628,409,142.46	88.80

6.4.13.4.3.2 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（2015 年 6 月 30 日）	上年度末（2014 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	27,301,779.82	29,325,293.87
业绩比较基准下降 5%	-27,301,779.82	-29,325,293.87	

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告**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	711,528,610.22	92.57
	其中：股票	711,528,610.22	92.57
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	42,355,323.43	5.51
7	其他各项资产	14,757,878.44	1.92
8	合计	768,641,812.09	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	507,298,079.31	67.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	26,074,735.00	3.46
E	建筑业	37,759,444.81	5.01
F	批发和零售业	11,721,000.00	1.55
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	11,592,000.00	1.54
I	信息传输、软件和信息技术服务业	40,096,080.00	5.32
J	金融业	-	-

K	房地产业	34,055,600.00	4.52
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	15,573,567.10	2.07
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	9,233,400.00	1.22
R	文化、体育和娱乐业	18,124,704.00	2.40
S	综合	-	-
	合计	711,528,610.22	94.38

7.3 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	300145	南方泵业	1,162,690	51,100,225.50	6.78
2	002616	长青集团	1,300,000	38,610,000.00	5.12
3	000880	潍柴重机	1,659,913	35,771,125.15	4.74
4	300156	神雾环保	800,000	34,792,000.00	4.61
5	000961	中南建设	1,599,973	31,951,460.81	4.24
6	300259	新天科技	2,000,000	30,200,000.00	4.01
7	002008	大族激光	1,000,000	28,720,000.00	3.81
8	002475	立讯精密	749,915	25,354,626.15	3.36
9	600201	金宇集团	355,996	25,318,435.52	3.36
10	000503	海虹控股	499,920	24,496,080.00	3.25
11	002108	沧州明珠	1,417,086	22,333,275.36	2.96
12	000786	北新建材	1,146,160	21,926,040.80	2.91
13	600521	华海药业	699,907	21,872,093.75	2.90
14	600038	中直股份	329,988	20,442,756.60	2.71
15	002572	索菲亚	500,000	19,315,000.00	2.56
16	000957	中通客车	799,910	19,301,828.30	2.56
17	000718	苏宁环球	1,320,000	19,047,600.00	2.53
18	000673	当代东方	549,900	18,124,704.00	2.40
19	300253	卫宁软件	300,000	15,600,000.00	2.07
20	300190	维尔利	499,954	15,573,567.10	2.07
21	000544	中原环保	650,000	15,340,000.00	2.03

22	002285	世联行	700,000	15,008,000.00	1.99
23	300154	瑞凌股份	549,987	14,772,650.82	1.96
24	002664	信质电机	400,000	14,404,000.00	1.91
25	300009	安科生物	499,922	13,442,902.58	1.78
26	002262	恩华药业	377,629	12,212,521.86	1.62
27	603939	益丰药房	150,000	11,721,000.00	1.55
28	000428	华天酒店	1,050,000	11,592,000.00	1.54
29	300362	天保重装	300,000	11,562,000.00	1.53
30	002271	东方雨虹	447,928	11,511,749.60	1.53
31	000601	韶能股份	1,148,100	10,734,735.00	1.42
32	300165	天瑞仪器	300,000	10,431,000.00	1.38
33	300244	迪安诊断	110,000	9,233,400.00	1.22
34	600499	科达洁能	400,000	9,140,000.00	1.21
35	601311	骆驼股份	349,972	8,157,847.32	1.08
36	002171	精诚铜业	300,000	6,606,000.00	0.88
37	000628	高新发展	398,900	5,807,984.00	0.77

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	000961	中南建设	63,842,983.45	9.02
2	600804	鹏博士	51,853,959.05	7.33
3	601318	中国平安	42,252,174.63	5.97
4	002008	大族激光	37,565,605.65	5.31
5	002450	康得新	35,829,482.38	5.06
6	000503	海虹控股	33,722,326.25	4.77
7	000880	潍柴重机	32,873,969.42	4.65
8	000568	泸州老窖	30,322,827.42	4.28
9	002475	立讯精密	29,690,336.10	4.20
10	600713	南京医药	27,861,299.70	3.94
11	002616	长青集团	26,288,727.48	3.71
12	603939	益丰药房	25,798,533.82	3.65
13	300156	神雾环保	25,383,053.05	3.59
14	600038	中直股份	25,274,437.00	3.57

15	002285	世联行	24,481,589.25	3.46
16	300251	光线传媒	24,204,446.85	3.42
17	300253	卫宁软件	23,447,959.69	3.31
18	002444	巨星科技	22,811,481.81	3.22
19	000673	当代东方	22,569,562.02	3.19
20	002108	沧州明珠	21,870,103.28	3.09
21	600521	华海药业	21,729,650.88	3.07
22	000718	苏宁环球	21,147,306.36	2.99
23	000712	锦龙股份	20,953,050.50	2.96
24	300154	瑞凌股份	20,851,975.10	2.95
25	300165	天瑞仪器	20,627,583.30	2.91
26	300198	纳川股份	20,020,024.32	2.83
27	300207	欣旺达	19,822,343.75	2.80
28	000333	美的集团	19,729,598.34	2.79
29	603222	济民制药	18,958,221.50	2.68
30	600201	金宇集团	18,242,143.90	2.58
31	600309	万华化学	18,021,957.52	2.55
32	600986	科达股份	18,015,341.62	2.55
33	000544	中原环保	17,957,178.40	2.54
34	002531	天顺风能	17,932,608.38	2.53
35	000957	中通客车	17,498,753.72	2.47
36	002271	东方雨虹	17,449,766.89	2.47
37	002375	亚厦股份	17,263,312.00	2.44
38	300009	安科生物	17,217,284.21	2.43
39	300362	天保重装	17,202,464.87	2.43
40	600845	宝信软件	16,966,719.64	2.40
41	600687	刚泰控股	16,623,114.00	2.35
42	300037	新宙邦	16,400,462.10	2.32
43	600651	飞乐音响	15,904,383.29	2.25
44	300089	长城集团	15,036,410.55	2.12
45	002048	宁波华翔	14,721,380.00	2.08
46	000428	华天酒店	14,649,645.20	2.07
47	000628	高新发展	14,340,904.10	2.03
48	601601	中国太保	14,289,123.20	2.02

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。

7.4.2 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	002410	广联达	82,768,459.70	11.70
2	600804	鹏博士	82,634,905.56	11.68
3	601318	中国平安	79,626,989.42	11.25
4	300244	迪安诊断	62,606,318.38	8.85
5	002450	康得新	54,071,621.64	7.64
6	600535	天士力	53,823,353.91	7.61
7	600048	保利地产	46,274,263.65	6.54
8	002250	联化科技	41,895,755.54	5.92
9	002375	亚厦股份	40,474,312.24	5.72
10	000961	中南建设	39,173,358.27	5.54
11	002572	索菲亚	36,999,714.30	5.23
12	002664	信质电机	33,257,710.01	4.70
13	002531	天顺风能	32,893,050.48	4.65
14	000568	泸州老窖	32,726,177.56	4.62
15	300259	新天科技	32,279,037.31	4.56
16	600713	南京医药	31,552,200.74	4.46
17	300251	光线传媒	29,731,570.64	4.20
18	000024	招商地产	27,711,411.98	3.92
19	300089	长城集团	27,179,676.64	3.84
20	300335	迪森股份	26,966,728.78	3.81
21	601098	中南传媒	25,208,048.55	3.56
22	000712	锦龙股份	24,246,120.24	3.43
23	002672	东江环保	24,085,463.44	3.40
24	300198	纳川股份	24,057,286.05	3.40
25	000651	格力电器	21,743,529.91	3.07
26	002444	巨星科技	21,587,706.61	3.05
27	600000	浦发银行	21,579,012.07	3.05
28	000333	美的集团	21,242,690.92	3.00
29	000802	北京文化	20,118,762.36	2.84
30	600651	飞乐音响	20,115,623.96	2.84
31	000718	苏宁环球	19,613,136.82	2.77
32	600750	江中药业	19,446,291.47	2.75
33	002170	芭田股份	18,476,725.14	2.61
34	600986	科达股份	18,177,811.00	2.57

35	603222	济民制药	17,403,640.30	2.46
36	300037	新宙邦	17,192,495.34	2.43
37	300207	欣旺达	16,789,828.43	2.37
38	600114	东睦股份	15,991,487.60	2.26
39	600309	万华化学	15,946,731.07	2.25
40	600687	刚泰控股	15,879,266.52	2.24
41	601166	兴业银行	15,818,319.07	2.24
42	002048	宁波华翔	15,814,831.92	2.23
43	601628	中国人寿	15,075,139.55	2.13
44	600845	宝信软件	14,818,462.00	2.09
45	601601	中国太保	14,576,360.00	2.06
46	603939	益丰药房	14,469,266.58	2.04
47	002385	大北农	14,281,072.48	2.02
48	300165	天瑞仪器	14,214,487.90	2.01
49	300236	上海新阳	14,177,986.28	2.00

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。

7.4.3 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	1,419,754,586.13
卖出股票收入（成交）总额	1,717,038,175.02

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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.6 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

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

7.11.2 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。

7.11.3 本期国债期货投资评价

注：本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

2014 年 6 月 23 日，本基金投资的前十名证券之一的新天科技之发行人新天科技股份有限公司（以下简称“公司”或“新天科技”）收到了中国证监会河南监管局《关于新天科技股份有限公司公司治理情况的综合评价及整改要求》（豫证监发[2014]164 号，以下简称“整改意见”）。要求公司在收到通知十五日内，提出具体的改进措施，并书面报送中国证监会河南监管局。

2014 年 7 月 1 日，公司发布公告，说明“在收到中国证监会河南监管局的整改意见后，公司董事会高度重视，认真对照《上市公司章程指引》、《深圳证券交易所创业板股票上市规则》、《上市公司股东大会规则》、《上市公司董事、监事和高级管理人员所持本公司股份及其变动管理规则》（证监公司字[2007]56 号）、《上市公司治理准则》等相关法律法规及《公司章程》等内部规章制度，对中国证监会河南监管局现场检查我公司中发现的问题进行了认真、深入的分析，积极查找问题的根源，结合公司实际情况制订了整改方案，并采取有效的措施进行整改。”

根据公告，公司整改方案如下：

一、部分制度需进一步完善

1. 公司制度中董事会、股东大会对个别事项的审议权限存在矛盾。公司董事会议事规则第六

条规定交易金额占总资产比例达到 50%的，由股东大会审议；公司章程和股东大会会议事规则中规定一年内购买、出售资产达到总资产的 30%的，必须提交股东大会审议。

整改措施：公司根据《深圳证券交易所创业板股票上市规则》、《上市公司章程指引》及《公司章程》等有关规定，对公司《董事会议事规则》进行了修订，使公司《董事会议事规则》与《公司章程》的审批权限相一致。相关内容已经公司第二届董事会第九次会议审议通过，目前尚需提交股东大会审议通过后生效。

2. 公司制订的《公司董事、监事和高级管理人员所持本公司股份及其变动管理规则》中，未对持股超过 5%以上股东违规买卖股票行为做出限定，不符合《上市公司董事、监事和高级管理人员所持本公司股份及其变动管理规则》（证监公司字[2007]56 号）的相关规定。

整改措施：公司按照《公司法》、《证券法》、《上市公司董事、监事和高级管理人员所持本公司股份及其变动管理规则》等法律、法规及规范性文件的要求，对《公司董事、监事和高级管理人员持有和买卖本公司股票管理制度》进行了修订。相关内容已经公司第二届董事会第九次会议审议通过，自董事会审议通过之日起生效。

二、股东大会运作不规范

1. 存在个别股东委托其他股东出席股东大会，缺少授权委托书的情形，不符合《上市公司章程指引》第六十条的规定。

整改措施：公司已组织相关人员再次学习了《上市公司章程指引》、《上市公司股东大会规则》、《公司章程》及《公司股东大会会议事规则》，今后，公司将进一步规范股东大会的召开，确保工作底稿保存的规范性、完整性。

2. 个别股东大会未按要求选举两名股东代表计票和监票，不符合《上市公司章程指引》第八十七条的规定。

整改措施：公司已组织相关人员再次学习了《上市公司章程指引》、《上市公司股东大会规则》、《公司章程》及《公司股东大会会议事规则》，今后，公司将进一步规范股东大会计票、监票工作，确保各项文件均按要求签字、盖章。

三、募集资金使用审批不完整

公司募集资金使用的审批程序未严格按照公司募集资金管理制度的规定执行，存在个别支付项目审批不完整的情形。

整改措施：公司募集资金支出中的个别凭证缺少董事长或总经理的签批，主要是经办人员在董事长或总经理出差期间电话请示后，未做书面记录所致。公司已组织相关人员重新学习了《公司募集资金管理和使用办法》，后期，公司将进一步规范募集资金使用审批流程，确保募集资金使

用审批的完整性。

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，从公告中知悉，公司将认真落实各项整改措施，加强各岗位人员的学习和培训，进一步完善公司法人治理结构，促进公司的健康、稳定发展。本次整改对于上市公司经营并不构成重大实质性影响。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之一的内蒙古金宇集团股份有限公司（简称“金宇集团”或“公司”）于 2014 年 6 月 19 日至 6 月 27 日，内蒙古证监局对公司进行了现场检查，并于 2014 年 9 月 16 日向公司下发了《关于内蒙古金宇集团股份有限公司的监管关注函》（内证监上市字[2014]36 号）。现场检查发现金宇集团存在如下问题：1、公司部分制度需要进一步修订完善，包括公司《董事会工作条例》和《总裁工作细则》关于总裁授权的规定不一致、公司《信息披露管理制度》需要补充完善、公司高级管理人员报酬制度需要重新修订、公司《章程》及《股东大会规则》需要补充完善等；2、公司董事会薪酬与考核委员会没有严格按照《上市公司治理准则》第五十六条规定充分发挥作用。

根据金宇集团发布的公告，公司部署了相应整改措施，包括 1、将尽快对《董事会工作条例》与《公司总裁工作细则》两项制度进行修订完善，统一资金运用权限的决策标准；2、对《信息披露管理制度》进行查缺补漏；3、计划将高级管理人员薪酬制度纳入到公司薪酬和考核制度方案当中，并根据不同岗位采取固浮比年薪制，运用 KPI 考核指标，加强和完善高级管理人员的考核机制，形成一套科学合理的高管薪酬考核制度；4、对《公司章程》和《股东大会规则》当中相关内容进行补充修订，提交董事会、股东大会进行审议；5、组织董事会薪酬与考核委员会成员认真学习《上市公司治理准则》及《金宇集团薪酬与考核委员会会议规则》，总结过去工作中的不足，恪守勤勉尽责的义务，与咨询公司密切配合，积极参与公司薪酬与考核制度改革和方案制定；上述工作正在进行中，预计于 2015 年 4 月 30 日前完成。

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，金宇集团作为国内生物疫苗市场苗的龙头企业，具备较好的投资价值。从监管措施公告中知悉，相关问题对于公司经营并不构成重大实质性影响。对金宇集团的财务状况及经营成果并不产生重大实质性影响。本次监管措施对该股票的投资价值不产生重大影响。公司在证监局的监督下，已经提出了相应的整改措施。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。

7.12.2

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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	525,653.32
2	应收证券清算款	14,198,637.40
3	应收股利	-
4	应收利息	24,188.41
5	应收申购款	9,399.31
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,757,878.44

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末股票投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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
18,622	20,756.48	233,293,014.57	60.36%	153,234,147.56	39.64%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	316.33	0.0001%

注：截至本报告期末，本基金管理人从业人员投资、持有本基金符合相关法律法规、中国证监会规定及相关管理制度的规定。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

注：（1）本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人本报告期末未持有本基金份额。

（2）本基金的基金经理本报告期末未持有本基金份额。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013年12月23日）基金份额总额	2,000,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	589,498,009.88
本报告期基金总申购份额	115,206,625.54
减：本报告期基金总赎回份额	318,177,473.29
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	386,527,162.13

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。

§ 10 重大事件揭示**10.1 基金份额持有人大会决议**

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 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

基金管理人的重大人事变动：

报告期内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。

报告期内经公司股东会审议通过，公司聘任陈冰女士担任公司监事，并自陈冰女士担任公司监事之日起，李国阳先生不再担任公司监事。陈冰女士任职日期自2015年6月2日起。

基金托管人的重大人事变动：报告期内基金托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

10.3 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。

10.4 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。

10.5 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。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
申银万国	2	2,378,009,649.23	75.82%	2,121,349.06	75.86%	-
招商证券	2	429,591,627.93	13.70%	382,851.60	13.69%	-
国信证券	2	290,380,704.57	9.26%	257,670.72	9.21%	-
长城证券	1	38,464,496.60	1.23%	34,704.84	1.24%	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
中信证券（山东）	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-

广发证券	1	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---

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。

10.7.2 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
申银万国	-	-	-	-	-	-
招商证券	1,295,296.80	100.00%	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券（山东）	-	-	-	-	-	-

中金公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	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》	2015 年 1 月 6 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》	2015 年 1 月 7 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》	2015 年 1 月 7 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》	2015 年 1 月 14 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》	2015 年 1 月 21 日
6	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》	2015 年 1 月 21 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》	2015 年 1 月 21 日
8	2014 年第四季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 1 月 22 日

9	鹏华消费领先灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书的摘要	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 2 月 3 日
10	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》	2015 年 2 月 4 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》	2015 年 2 月 7 日
12	基金高级管理人员变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 2 月 9 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》	2015 年 2 月 12 日
14	鹏华基金管理有限公司关于增加天风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》	2015 年 2 月 13 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》	2015 年 2 月 14 日
16	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》	2015 年 2 月 14 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》	2015 年 2 月 17 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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 2 月 17 日

	变更的提示性公告	报》	
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》	2015 年 2 月 17 日
20	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》	2015 年 2 月 25 日
21	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》	2015 年 2 月 27 日
22	鹏华基金管理有限公司关于新增中国邮政储蓄银行为旗下部分开放式基金代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 3 月 3 日
23	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金在邮储银行开通定投业务并参加定投费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 3 月 3 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》	2015 年 3 月 3 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》	2015 年 3 月 3 日
26	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》	2015 年 3 月 3 日
27	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》	2015 年 3 月 5 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》	2015 年 3 月 6 日
29	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》	2015 年 3 月 11 日
30	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》	2015 年 3 月 14 日
31	鹏华基金管理有限公司关于增加东莞农村商业银行股份有限公司为旗下部分开放式基金代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 3 月 16 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》	2015 年 3 月 19 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》	2015 年 3 月 21 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》	2015 年 3 月 21 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》	2015 年 3 月 21 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》	2015 年 3 月 24 日
37	鹏华基金管理有限公司关于旗下	《中国证券报》、《上	2015 年 3 月 24 日

	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》	
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》	2015 年 3 月 25 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》	2015 年 3 月 25 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》	2015 年 3 月 25 日
41	2014 年年度报告摘要	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 3 月 26 日
42	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》	2015 年 3 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》	2015 年 3 月 27 日
44	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》	2015 年 3 月 31 日
45	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》	2015 年 4 月 1 日
46	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》	2015 年 4 月 2 日

47	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》	2015 年 4 月 2 日
48	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》	2015 年 4 月 3 日
49	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》	2015 年 4 月 3 日
50	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》	2015 年 4 月 4 日
51	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》	2015 年 4 月 4 日
52	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》	2015 年 4 月 7 日
53	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》	2015 年 4 月 7 日
54	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》	2015 年 4 月 9 日
55	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》	2015 年 4 月 13 日
56	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》	2015 年 4 月 13 日

	变更的提示性公告	报》	
57	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》	2015 年 4 月 14 日
58	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》	2015 年 4 月 15 日
59	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》	2015 年 4 月 16 日
60	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》	2015 年 4 月 18 日
61	2015 年第一季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 4 月 21 日
62	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》	2015 年 4 月 23 日
63	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》	2015 年 4 月 23 日
64	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》	2015 年 4 月 23 日
65	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》	2015 年 4 月 24 日
66	鹏华基金管理有限公司关于旗下	《中国证券报》、《上	2015 年 4 月 28 日

	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》	
67	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》	2015 年 4 月 28 日
68	鹏华消费领先灵活配置混合型证券投资基金关于基金经理变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 5 月 5 日
69	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》	2015 年 5 月 7 日
70	鹏华基金管理有限公司关于增加中国国际金融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》	2015 年 5 月 8 日
71	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》	2015 年 5 月 8 日
72	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》	2015 年 5 月 9 日
73	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》	2015 年 5 月 12 日
74	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》	2015 年 5 月 12 日
75	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》	2015 年 5 月 12 日

76	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》	2015 年 5 月 12 日
77	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》	2015 年 5 月 13 日
78	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》	2015 年 5 月 15 日
79	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》	2015 年 5 月 16 日
80	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》	2015 年 5 月 19 日
81	鹏华基金管理有限公司关于增加中信建投期货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》	2015 年 5 月 19 日
82	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》	2015 年 5 月 21 日
83	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》	2015 年 5 月 22 日
84	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》	2015 年 5 月 22 日
85	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》	2015 年 5 月 22 日

	变更的提示性公告	报》	
86	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》	2015 年 5 月 22 日
87	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》	2015 年 5 月 22 日
88	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》	2015 年 5 月 22 日
89	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》	2015 年 5 月 22 日
90	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》	2015 年 5 月 22 日
91	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》	2015 年 5 月 22 日
92	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》	2015 年 5 月 23 日
93	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》	2015 年 5 月 26 日
94	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》	2015 年 5 月 26 日
95	鹏华基金管理有限公司关于旗下	《中国证券报》、《上	2015 年 5 月 26 日

	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》	
96	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》	2015 年 5 月 26 日
97	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》	2015 年 5 月 26 日
98	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》	2015 年 5 月 27 日
99	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》	2015 年 5 月 27 日
100	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》	2015 年 5 月 27 日
101	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》	2015 年 5 月 27 日
102	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》	2015 年 5 月 27 日
103	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》	2015 年 5 月 27 日
104	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》	2015 年 5 月 28 日

105	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》	2015 年 5 月 29 日
106	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》	2015 年 5 月 29 日
107	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》	2015 年 6 月 2 日
108	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》	2015 年 6 月 2 日
109	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》	2015 年 6 月 3 日
110	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》	2015 年 6 月 3 日
111	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》	2015 年 6 月 3 日
112	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》	2015 年 6 月 3 日
113	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》	2015 年 6 月 3 日
114	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》	2015 年 6 月 6 日

	变更的提示性公告	报》	
115	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》	2015 年 6 月 9 日
116	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》	2015 年 6 月 9 日
117	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》	2015 年 6 月 11 日
118	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分开放式基金参与华鑫证券自助式交易系统投资费率优惠活动公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 6 月 11 日
119	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》	2015 年 6 月 12 日
120	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》	2015 年 6 月 13 日
121	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》	2015 年 6 月 13 日
122	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》	2015 年 6 月 16 日
123	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》	2015 年 6 月 17 日

124	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》	2015 年 6 月 17 日
125	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》	2015 年 6 月 18 日
126	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》	2015 年 6 月 19 日
127	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》	2015 年 6 月 19 日
128	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》	2015 年 6 月 19 日
129	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》	2015 年 6 月 19 日
130	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》	2015 年 6 月 19 日
131	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》	2015 年 6 月 19 日
132	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》	2015 年 6 月 20 日
133	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》	2015 年 6 月 20 日

	变更的提示性公告	报》	
134	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》	2015 年 6 月 20 日
135	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》	2015 年 6 月 20 日
136	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》	2015 年 6 月 20 日
137	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》	2015 年 6 月 20 日
138	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》	2015 年 6 月 20 日
139	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》	2015 年 6 月 20 日
140	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》	2015 年 6 月 20 日
141	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》	2015 年 6 月 20 日
142	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》	2015 年 6 月 20 日
143	鹏华基金管理有限公司关于旗下	《中国证券报》、《上	2015 年 6 月 24 日

	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》	
144	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》	2015 年 6 月 26 日
145	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》	2015 年 6 月 27 日
146	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》	2015 年 6 月 27 日
147	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》	2015 年 6 月 27 日
148	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》	2015 年 6 月 27 日
149	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》	2015 年 6 月 27 日
150	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》	2015 年 6 月 27 日
151	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》	2015 年 6 月 27 日
152	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》	2015 年 6 月 27 日

153	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》	2015 年 6 月 27 日
154	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》	2015 年 6 月 27 日
155	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》	2015 年 6 月 30 日
156	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》	2015 年 6 月 30 日
157	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》	2015 年 6 月 30 日
158	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》	2015 年 6 月 30 日
159	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》	2015 年 6 月 30 日
160	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》	2015 年 6 月 30 日
161	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》	2015 年 6 月 30 日
162	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》	2015 年 6 月 30 日

	变更的提示性公告	报》	
163	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》	2015 年 6 月 30 日
164	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》	2015 年 6 月 30 日
165	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》	2015 年 6 月 30 日
166	鹏华基金旗下部分基金参与交通银行网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 6 月 30 日

§ 11 备查文件目录

11.1 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 2015 年半年度报告》(原文)。

11.2 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。

11.3 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 8 月 25 日