

# 鹏华丰利分级债券型发起式证券投资基金 2014 年半年度报告

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：招商银行股份有限公司

送出日期：2014 年 8 月 26 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2014 年 8 月 21 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 2014 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§2 基金简介</b>	<b>5</b>
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	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
<b>§4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
<b>§5 托管人报告</b>	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
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	13
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>13</b>
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
<b>§7 投资组合报告</b>	<b>34</b>
7.1 期末基金资产组合情况	34
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	34
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	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	34
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	34
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	35
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	35
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	35
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	35
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	35
7.11 投资组合报告附注	36
<b>§8 基金份额持有人信息</b>	<b>36</b>

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	36
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	37
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	37
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	37
8.5 发起式基金发起资金持有份额情况.....	37
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>38</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>38</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	38
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.....	38
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	39
10.4 基金投资策略的改变.....	39
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	39
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.....	39
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	39
10.8 其他重大事件.....	40
<b>§11 备查文件目录.....</b>	<b>46</b>
11.1 备查文件目录.....	46
11.2 存放地点.....	46
11.3 查阅方式.....	47

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华丰利分级债券型发起式证券投资基金	
基金简称	鹏华丰利分级债券	
场内简称	鹏华丰利	
基金主代码	160622	
基金运作方式	契约型开放式。本基金合同生效后三年内（含三年）为基金分级运作期，丰利债 A 自基金合同生效日起于丰利债 A 的申购开放日接受申购申请、丰利债 A 的赎回开放日接受赎回申请，丰利债 B 封闭运作并在深圳证券交易所上市交易。基金分级运作期届满，本基金转为上市开放式基金（LOF）。	
基金合同生效日	2013 年 4 月 23 日	
基金管理人	鹏华基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1, 013, 292, 400. 80 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2013-07-17	
下属分级基金的基金简称：	丰利债 A	丰利债 B
下属分级基金的交易代码：	160623	150129
报告期末下属分级基金的份额总额	113, 437, 762. 07 份	899, 854, 638. 73 份

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，上市交易并封闭运作的基金份额可简称为“丰利债 B”。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在有效控制风险、保持适当流动性的前提下，通过积极主动的投资管理，力争取得超越基金业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金债券投资将主要采取久期策略，同时辅之以信用利差策略、收益率曲线策略、收益率利差策略、息差策略、债券选择策略等积极投资策略，在有效控制风险、保持适当流动性的前提下，通过积极主动的投资管理，力争取得超越基金业绩比较基准的收益。 在资产配置方面，本基金通过对宏观经济形势、经济周期所处阶段、利率曲线变化趋势和信用利差变化趋势的重点分析，比较未来一定时间内不同债券品种和债券市场的相对预期收益率，在基金规定的投资比例范围内对不同久期、信用特征的券种及债券与现金之间进行动态调整。
业绩比较基准	中债总指数收益率
风险收益特征	本基金是债券型证券投资基金，属于具有中低风险收益特征的基金品种，其

	长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金。	
	丰利债 A	丰利债 B
下属分级基金的风险收益特征	丰利 A 份额表现出低风险、低收益的明显特征，其预期收益和预期风险要低于普通的债券型基金份额。	丰利 B 份额表现出高风险、高收益的显著特征，其预期收益和预期风险要高于普通的债券型基金份额。

### 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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张戈	张燕
	联系电话	0755-82825720	0755-83199084
	电子邮箱	zhangge@phfund.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		4006788999	95555
传真		0755-82021126	0755-83195201
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	深圳深南大道 7088 号招商银行大厦
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	深圳深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		518048	518040
法定代表人		何如	傅育宁

### 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	<a href="http://www.phfund.com">http://www.phfund.com</a>
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第 43 层鹏华基金管理有限公司 深圳深南大道 7088 号招商银行大厦招商银行股份有限公司

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
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(2014年1月1日 - 2014年6月30日)
本期已实现收益	39,475,467.82
本期利润	76,882,694.44
加权平均基金份额本期利润	0.0635
本期加权平均净值利润率	6.96%
本期基金份额净值增长率	8.26%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)
期末可供分配利润	-47,959,546.29
期末可供分配基金份额利润	-0.0473
期末基金资产净值	960,501,614.42
期末基金份额净值	0.948
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2014年6月30日)
基金份额累计净值增长率	0.53%

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

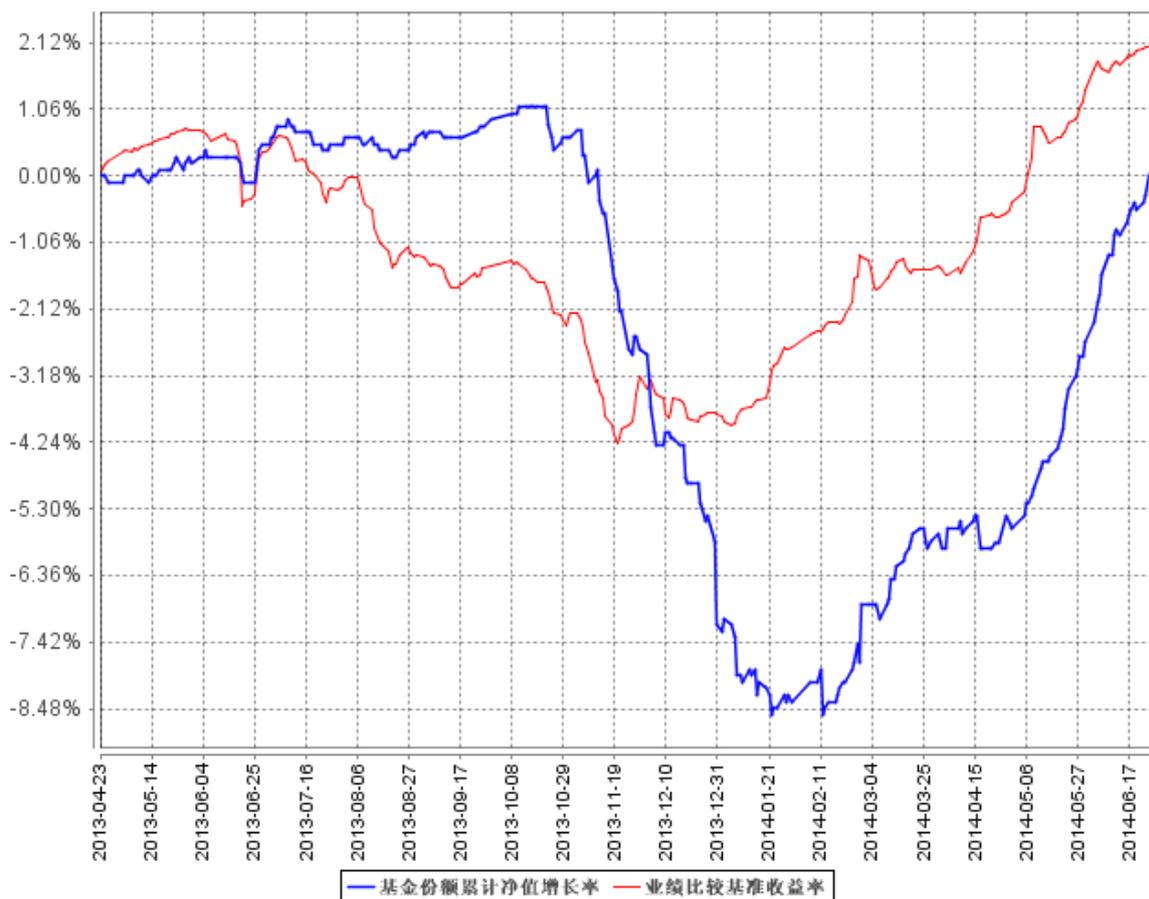
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	3.27%	0.17%	0.68%	0.09%	2.59%	0.08%
过去三个月	6.62%	0.18%	3.51%	0.11%	3.11%	0.07%
过去六个月	8.26%	0.22%	6.05%	0.11%	2.21%	0.11%
过去一年	0.03%	0.22%	1.63%	0.12%	-1.60%	0.10%

过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	0.53%	0.21%	2.03%	0.12%	-1.50%	0.09%

注：业绩比较基准=中债总指数收益率。

### 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 4 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。

### 3.3 其他指标

单位：人民币元

其他指标	报告期末（2014 年 6 月 30 日）
丰利债 A 与丰利债 B 基金份额配比	0.126062318:1
期末丰利债 A 参考净值	1.008
期末丰利债 A 累计参考净值	1.053
丰利 A 累计折算份额	10,903,010.87

期末丰利债 B 参考净值	0.940
期末丰利债 B 累计参考净值	0.940
丰利债 A 年收益率（单利）	4.40%

## § 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 51 只开放式基金和 7 只社保组合，经过近 16 年投资管理基金，在基金投资、风险控制等方面积累了丰富经验。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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		
刘太阳	本基金基金经理	2013 年 4 月 23 日	-	8	刘太阳先生，国籍中国，理学硕士，8 年金融证券从业经验。曾任中国农业银行金融市场部高级交易员，从事债券投资交易工作；2011 年 5 月加盟鹏华基金管理有限公司，从事债券研究工作，担任固定收益部研究员。2012 年 9 月起至今担任鹏华纯债债券型证券投资基金基金经理，2012 年 12 月至 2014 年 3 月担任鹏华理财 21 天债券型证券投资基金（2014 年 3 月已转型为鹏华月月发短期理财债券型证券投资基金）基金经理，2013 年 4 月起兼任鹏华丰利分级债券型发起式证券投资基金基金经理，2013 年 5 月起兼任鹏华实业债纯债债券型证券投资基金基金经理，2014 年 3 月起兼任鹏华月月发短期理

					财债券型证券投资基金基金经理。刘太阳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 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 2 次，主要原因分别在于采用量化策略的基金调仓和指数成分股交易不活跃导致。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年受房地产和制造业投资增速下滑影响，国内经济增速继续回落；同时由于信用风险上升及政策收紧，银行压缩部分非标业务，债券配置需求有所恢复。此外，央行持续出台宽松政策，市场资金较为充裕，机构做多热情高涨，债券收益率曲线出现了陡峭化下行，其中 10 年期国债收益率最低下行至 4.0% 附近，与去年底相比下降了约 55bp。上半年所有全价及财富指数均出现不同程度的上涨，其中企业债财富指数上涨幅度最大，涨幅达 7.05%。

在上半年，由于 A 端出现赎回，组合杠杆有所上升，我们利用债券市场表现较好的时机调整了部分持仓，重点配置中高评级信用债。此外，我们还选择的参与了部分可转债的申购。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

上半年基金的净值增长率为 8.26%，同期业绩基准增长率为 6.05%。

#### 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，由于当前企业杠杆率居于高位，且盈利保持低迷，制造业投资短期内难以大幅回升。房地产投资受限于销售不畅，短期内亦难有起色。基建投资方面由于基数已经较高，较难有大幅增长，因此预计经济整体仍较为低迷，债券市场整体风险不大。

但另一方面，随着经济增速的持续下滑，政府托底动力日益增强，后期或将继续出台稳增长措施。政策重点也可能由之前的“宽资金”转向“宽信用”，进而推动社会融资总量回升及银行资产负债表的重新扩张，这可能会挤压部分债券配置资金，从而限制债券收益率的下行空间。同时，由于上半年债券市场已积累一定涨幅，机构进一步配置债券动力可能略有减弱，也使得债券收益率难以继续大幅回落。

信用产品方面，虽然部分低评级信用债券收益率处于历史较高水平，并且在资金宽松的格局下，机构风险偏好有可能提升；但在经济未能企稳回升、企业盈利尚未改善情况下，局部领域的信用风险事件仍将陆续发生，进而可能导致信用债表现出现分化。后期投资中我们将继续规避中低评级信用债，以有效控制风险。

综合而言，我们对债券市场依然谨慎乐观，但须关注政策风险，预计下半年债券收益率呈窄幅整理格局，投资收益可能主要来自于票息收入。组合将保持中性久期，品种选择方面，预计仍会以中高评级信用债为主。

#### 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、债券不活跃市场报价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、债券研究员、监察稽核部、金融工程师、登记结算部相关人员组成。

#### 4.6.2 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 根据本基金基金合同约定，基金合同生效之日起3年内，本基金不对丰利债A和丰利债B进行收益分配。

4.7.2 本基金本报告期末未进行利润分配。

## § 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

托管人声明，在本报告期内，基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对本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

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、

准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 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：鹏华丰利分级债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	13,616,895.98	8,998,899.54
结算备付金		153,871,461.60	246,366,216.08
存出保证金		279,216.08	405,629.51
交易性金融资产	6.4.7.2	2,035,808,139.42	2,718,416,192.70
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		2,035,808,139.42	2,718,416,192.70
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	6.4.6.4	-	-
应收证券清算款		-	67,551,378.63
应收利息	6.4.7.5	32,250,610.41	86,060,731.07
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,235,826,323.49	3,127,799,047.53
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2014 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2013 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
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		1,265,900,000.00	1,910,000,000.00
应付证券清算款		8,468,946.68	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		544,212.87	744,252.87
应付托管费		155,489.43	212,643.65
应付销售服务费		32,843.81	130,654.69
应付交易费用	6.4.7.7	-4,890.78	15,280.90

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	228,107.06	230,000.00
负债合计		1,275,324,709.07	1,911,332,832.11
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	1,008,461,160.71	1,327,113,341.07
未分配利润	6.4.7.10	-47,959,546.29	-110,647,125.65
所有者权益合计		960,501,614.42	1,216,466,215.42
负债和所有者权益总计		2,235,826,323.49	3,127,799,047.53

注：报告截止日 2014 年 6 月 30 日，下属丰利分级债券型基金 A 类的份额参考净值 1.008 元，下属丰利分级债券型基金 B 类的份额参考净值 0.940 元，基金份额总额 1,013,292,400.80 份，下属丰利分级债券型基金 A 类的份额总额 113,437,762.07 份，下属丰利分级债券型基金 B 类的份额总额 899,854,638.73 份。

## 6.2 利润表

会计主体：鹏华丰利分级债券型发起式证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2013 年 4 月 23 日(基 金合同生效日)至 2013 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		107,596,062.34	23,701,535.35
1.利息收入		89,001,492.42	26,785,988.27
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,435,721.01	5,390,300.61
债券利息收入		87,333,135.81	20,202,029.64
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		232,635.60	1,193,658.02
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-18,812,656.70	-2,003,514.29
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-18,812,656.70	-2,003,514.29
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	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	37,407,226.62	-1,080,961.42

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	-	22.79
<b>减：二、费用</b>		30,713,367.90	8,292,044.07
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,839,474.35	3,917,019.37
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,096,992.77	1,119,148.42
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	551,353.78	1,374,849.40
4. 交易费用	6.4.7.18	200.00	21,765.00
5. 利息支出		24,978,838.32	1,770,719.80
其中：卖出回购金融资产支出		24,978,838.32	1,770,719.80
6. 其他费用	6.4.7.19	246,508.68	88,542.08
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		76,882,694.44	15,409,491.28
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		76,882,694.44	15,409,491.28

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鹏华丰利分级债券型发起式证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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）	1,327,113,341.07	-110,647,125.65	1,216,466,215.42
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	76,882,694.44	76,882,694.44
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）	-318,652,180.36	-14,195,115.08	-332,847,295.44
其中：1. 基金申购款	9,261,438.55	411,984.77	9,673,423.32
2. 基金赎回款	-327,913,618.91	-14,607,099.85	-342,520,718.76

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）	1,008,461,160.71	-47,959,546.29	960,501,614.42
项目	上年度可比期间 2013年4月23日(基金合同生效日)至2013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）	2,999,634,101.44	-	2,999,634,101.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	15,409,491.28	15,409,491.28
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	2,999,634,101.44	15,409,491.28	3,015,043,592.72

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：

          邓召明  邓召明  刘慧红            
 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

鹏华丰利分级债券型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2013]154号《关于核准鹏华丰利分级债券型发起式证券投资基金募集的批复》核准,由鹏华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华丰利分级债券型发起式证券投资基金基金合同》公开募集。本基金为契约型证券投资基金,

存续期限不定。本基金自 2013 年 3 月 25 日至 2013 年 4 月 17 日期间公开发售，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 2,999,052,076.34 元，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入 582,025.10 元，经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）普华永道中天验字(2013)第 117 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《鹏华丰利分级债券型发起式证券投资基金基金合同》于 2013 年 4 月 23 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,999,634,101.44 份基金份额，其中认购资金利息折合 582,025.10 份基金份额。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。另根据中国证监会基金部通知[2012]22 号《关于增设发起式基金审核通道有关问题的通知》，鹏华丰利分级债券基金在募集时，使用发起资金认购的本基金份额为 20,003,124.00 份，且发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

根据《鹏华丰利分级债券型发起式证券投资基金基金合同》的相关规定，本基金《基金合同》生效之日起 3 年内，本基金通过基金收益分配的安排，将基金份额分成预期收益与风险不同的两个级别，即丰利债 A 基金份额（基金份额简称“丰利债 A”）和丰利债 B 基金份额（基金份额简称“丰利债 B”）。除收益分配、基金合同终止时的基金清算财产分配和基金转换运作方式时的基金份额折算外，每份丰利债 A 和每份丰利债 B 享有同等的权利和义务。丰利债 A 和丰利债 B 分别募集并按照基金合同约定的比例进行初始配比，所募集的两级基金的基金资产合并运作。其中，丰利债 A 根据《基金合同》的规定获取约定收益，并自基金合同生效之日起每满 6 个月开放一次，接受申购与赎回，在丰利债 A 的每次申购开放日，基金管理人将对丰利债 A 进行基金份额折算，丰利债 A 的基金份额净值调整为 1.000 元，基金份额持有人持有的丰利债 A 份额数按折算比例相应增减；本基金净资产优先分配予丰利债 A 份额的本金及约定应得收益，剩余净资产分配予丰利债 B 基金份额；在分级运作期内每次开放时，如本基金净资产等于或低于丰利债 A 份额的本金及约定应得收益的总额，本基金净资产全部分配予丰利债 A 份额后，仍存在额外未弥补的丰利债 A 份额本金及约定收益总额的差额，则不再进行弥补。丰利债 B 在《基金合同》生效后封闭运作，封闭期为 3 年。

本基金分级运作期届满，本基金的两级基金份额将按约定的收益分配规则进行净值计算，并以各自的基金份额净值为基准转换为同一上市开放式基金（LOF）的份额，并办理基金的申购、赎回业务。经深圳证券交易所深证上[2013]284 号文审核同意，丰利债 B 基金份额于 2013 年 7 月 19 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的固定收益类品种，包括国内依法发行交易的国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、地方政府债、中期票据、短期融资券、可转换债券（含分

离交易可转债)、资产支持证券、次级债、中小企业私募债、债券回购、银行存款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)。本基金不直接买入股票、权证等权益类金融工具,因所持可转换公司债券转股形成的股票、因投资于分离交易可转债而产生的权证,在其可上市交易后不超过 10 个交易日的时间内卖出。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为:本基金对债券等固定收益品种的投资比例不低于基金资产的 80%;现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金整体的业绩比较基准为:中债总指数收益率。

#### 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 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5 号《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>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《鹏华丰利分级债券型发起式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 2014 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 2014 年 6 月 30 日的财务状况以及 2014 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。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本报告期本基金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 2014 年 6 月 30 日
----	------------------------

活期存款	13,616,895.98
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计	13,616,895.98

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	2,064,485,022.34	2,035,808,139.42
	银行间市场	-	-
	合计	2,064,485,022.34	2,035,808,139.42
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	2,064,485,022.34	2,035,808,139.42	-28,676,882.92

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

截至本报告期末，本基金未持有衍生金融资产和衍生金融负债。

### 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

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

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 2014 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	2,036.75
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	69,242.20
应收债券利息	32,179,205.86
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	125.60
合计	32,250,610.41

注：其他为应收结算保证金利息。

#### 6.4.7.6 其他资产

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 2014年6月30日
交易所市场应付交易费用	-5,210.78
银行间市场应付交易费用	320.00
合计	-4,890.78

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	228,107.06
合计	228,107.06

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

丰利债 A		
项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	436,684,133.80	427,258,702.34
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-335,147,473.53	-327,913,618.91
2014年4月22日 基金拆分/份额折	101,536,660.27	99,345,083.43

算前		
基金拆分/份额折算变动份额	2,227,678.48	-
本期申购	9,673,423.32	9,261,438.55
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	113,437,762.07	108,606,521.98

金额单位：人民币元

丰利债 B		
项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	899,854,638.73	899,854,638.73
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	899,854,638.73	899,854,638.73

注：根据《鹏华丰利分级债券型证券投资基金招募说明书》和《鹏华丰利分级债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的基金管理人鹏华基金管理有限公司确定 2014 年 4 月 22 日为丰利债 A 的基金份额折算日。折算日丰利债 A 的基金份额净值调整为 1.000 元。各基金份额持有人持有的丰利债 A 经折算后的份额数采用截尾的方式保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金资产。

#### 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	-56,316,439.29	-54,330,686.36	-110,647,125.65
本期利润	39,475,467.82	37,407,226.62	76,882,694.44
本期基金份额交易产生的变动数	-28,915,646.20	14,720,531.12	-14,195,115.08
其中：基金申购款	843,285.94	-431,301.17	411,984.77
基金赎回款	-29,758,932.14	15,151,832.29	-14,607,099.85
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-45,756,617.67	-2,202,928.62	-47,959,546.29

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 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	1,377,487.11
其他	4,178.03
合计	1,435,721.01

注：其他为结算保证金利息收入和申购款利息收入。

### 6.4.7.12 股票投资收益

#### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期没有发生股票投资收益。

### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	720,668,333.54
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	721,945,772.57
减：应收利息总额	17,535,217.67
债券投资收益	-18,812,656.70

### 6.4.7.14 衍生工具收益

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

本基金本报告期没有发生股利收益。

### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
1. 交易性金融资产	37,407,226.62
——股票投资	-
——债券投资	37,407,226.62
——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	37,407,226.62

**6.4.7.17 其他收入**

本基金本报告期没有发生其他收入。

**6.4.7.18 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
交易所市场交易费用	-
银行间市场交易费用	200.00
合计	200.00

**6.4.7.19 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
审计费用	49,588.57
信息披露费	148,765.71
其他	400.00
账户维护费	12,000.00
上市年费	29,752.78
银行汇划费用	6,001.62
合计	246,508.68

注：其他为上交所数字证书费。

**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
招商银行股份有限公司(“招商银行”)	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。

## 6.4.10 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

本基金本报告期内及 2013 年 4 月 23 日(基金合同生效日)至 2013 年 6 月 30 日未通过关联方交易单元发生股票交易、权证交易、债券交易、债券回购交易，也没有发生应支付关联方的佣金业务。

### 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 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2013 年 4 月 23 日(基金合同生效 日)至 2013 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,839,474.35	3,917,019.37
其中：支付销售机构的客户 维护费	543,159.67	855,693.39

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 0.70%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×0.70%÷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 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2013 年 4 月 23 日(基金合同生效 日)至 2013 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的 托管费	1,096,992.77	1,119,148.42

注：支付基金托管人交通银行的托管费年费率为 0.20%，逐日计提，按月支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.20%÷当年天数。

**6.4.10.2.3 销售服务费**

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	丰利债 A	丰利债 B	合计
鹏华基金管理有限公司	59,474.75	-	59,474.75
招商银行	322,097.92	-	322,097.92
国信证券	888.02	-	888.02
合计	382,460.69	-	382,460.69
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2013 年 4 月 23 日(基金合同生效日)至 2013 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	丰利债 A	丰利债 B	合计
鹏华基金管理有限公司	484,922.61	-	484,922.61
招商银行	599,963.59	-	599,963.59
国信证券	5,184.37	-	5,184.37
合计	1,090,070.57	-	1,090,070.57

注：支付基金销售机构的销售服务费按丰利债 A 前一日基金资产净值 0.35% 的年费率计提，逐日计提，按月支付，日销售服务费=前一日基金资产净值×0.35%÷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**

本基金本报告期及 2013 年 4 月 23 日（基金合同生效日）至 2013 年 6 月 30 日未发生与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）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 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	
	丰利债 A	丰利债 B
基金合同生效日（2013 年 4 月 23 日）持有的基金	-	-

份额		
期初持有的基金份额	10,222,902.33	10,000,874.00
期间申购/买入总份额	4,000,000.00	-
期间因拆分变动份额	224,287.71	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	14,447,190.04	10,000,874.00
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	12.7358%	1.1114%

项目	上年度可比期间	
	2013 年 4 月 23 日(基金合同生效日)至 2013 年 6 月 30 日	
	丰利债 A	丰利债 B
基金合同生效日(2013 年 4 月 23 日)持有的基金份额	10,002,250.00	10,000,874.00
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	10,002,250.00	10,000,874.00
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.4763%	1.1114%

注：(1) 本基金自 2013 年 3 月 25 日至 2013 年 4 月 17 日止期间公开发售，于 2013 年 4 月 23 日基金合同正式生效。

(2) 本基金管理人在募集期间认购本基金份额 20,003,124 份，2013 年 10 月 22 日丰利债 A 基金份额折算后本基金管理人持有本基金份额 20,223,776.33 份。

(3) 本基金管理人于 2014 年 4 月 22 日申购丰利债 A 份额 4,000,000 份。

(4) 2014 年 4 月 22 日丰利债 A 基金份额折算后本基金管理人持有本基金份额 24,448,064.04 份。

(5) 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

丰利债 B		
关联方名称	本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日

	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例
国信证券	200,010,600.00	22.2270%	200,011,664.00	22.2271%

注：（1）本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金 A 级份额。

（2）上表中持有的基金份额占基金总份额的比例为国信证券持有的基金份额占丰利债 B 总份额的比例。

#### 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 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2013 年 4 月 23 日(基金合同生效日)至 2013 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
招商银行	13,616,895.98	54,055.87	103,368,634.70	333,097.03

#### 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

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2014 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

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债券及权证。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末，本基金没有持有暂时停牌股票。

##### 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 2014 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证

券款余额 1,265,900,000.00 元，于 2014 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

### **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**

本基金为债券型证券投资基金。本基金主要投资债券等固定收益类金融工具。

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招商银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。

本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发

行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

#### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	2,035,808,139.42	2,718,416,192.70
未评级	-	-
合计	2,035,808,139.42	2,718,416,192.70

注：未评级债券包括国债、中央银行票据和政策性金融债。

#### 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、组合在短期内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

除卖出回购金融资产款余额 1,265,900,000.00 元将在一个月以内到期且计息外，本基金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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，此外还持有银行存款、结算备付金等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。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，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2014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	13,616,895.98	-	-	-	13,616,895.98
结算备付金	153,871,461.60	-	-	-	153,871,461.60
存出保证金	279,216.08	-	-	-	279,216.08
交易性金融资产	-	640,314,842.10	1,395,493,297.32	-	2,035,808,139.42
应收利息	-	-	-	32,250,610.41	32,250,610.41
资产总计	167,767,573.66	640,314,842.10	1,395,493,297.32	32,250,610.41	2,235,826,323.49
负债					
卖出回购金融资产款	1,265,900,000.00	-	-	-	1,265,900,000.00
应付证券清算款	-	-	-	8,468,946.68	8,468,946.68
应付管理人报酬	-	-	-	544,212.87	544,212.87
应付托管费	-	-	-	155,489.43	155,489.43

应付销售服务费	-	-	-	32,843.81	32,843.81
应付交易费用	-	-	-	-4,890.78	-4,890.78
其他负债	-	-	-	228,107.06	228,107.06
负债总计	1,265,900,000.00	-	-	9,424,709.07	1,275,324,709.07
利率敏感度缺口	-1,098,132,426.34	640,314,842.10	1,395,493,297.32	22,825,901.34	960,501,614.42
上年度末 2013 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	8,998,899.54	-	-	-	8,998,899.54
结算备付金	246,366,216.08	-	-	-	246,366,216.08
存出保证金	405,629.51	-	-	-	405,629.51
交易性金融资产	-	155,852,000.00	2,562,564,192.70	-	-2,718,416,192.70
应收证券清算款	-	-	-	67,551,378.63	67,551,378.63
应收利息	-	-	-	86,060,731.07	86,060,731.07
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	255,770,745.13	155,852,000.00	2,562,564,192.70	153,612,109.70	3,127,799,047.53
负债					
卖出回购金融资产款	1,910,000,000.00	-	-	-	-1,910,000,000.00
应付管理人报酬	-	-	-	744,252.87	744,252.87
应付托管费	-	-	-	212,643.65	212,643.65
应付销售服务费	-	-	-	130,654.69	130,654.69
应付交易费用	-	-	-	15,280.90	15,280.90
其他负债	-	-	-	230,000.00	230,000.00
负债总计	1,910,000,000.00	-	-	1,332,832.11	1,911,332,832.11
利率敏感度缺口	-1,654,229,254.87	155,852,000.00	2,562,564,192.70	152,279,277.59	1,216,466,215.42

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的到期日予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有债券资产的利率风险状况测算的理论变动值对基金资产净值的影响金额。	
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。	
	此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的

	影响金额（单位：人民币元）	
	本期末（2014年6月30日）	上年度末（2013年12月31日）
市场利率下降 25 个基点	15,257,350.38	22,142,322.53
市场利率上升 25 个基点	-15,081,978.69	-21,872,040.35

#### 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。

本基金对固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的 80%。

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

本基金本期末和上年度末均未持有交易性权益类投资。

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：于 2014 年 6 月 30 日，本基金未持有的交易性权益类投资（2013 年 12 月 31 日：未持有），因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响（2013 年

12 月 31 日：同)。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 不以公允价值计量的金融工具

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

##### (b) 以公允价值计量的金融工具

##### (i) 金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

##### (ii) 各层次金融工具公允价值

于 2014 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层级的余额为 1,947,764,139.42 元，属于第二层级的余额为 88,044,000.00 元，无属于第三层级的余额(2013 年 12 月 31 日：第一层级 2,512,984,657.50 元，第二层级 205,431,535.20 元，无属于第三层级的余额)。

##### (iii) 公允价值所属层次间的重大变动

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

##### (iv) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	2,035,808,139.42	91.05
	其中：债券	2,035,808,139.42	91.05
	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	167,488,357.58	7.49
7	其他各项资产	32,529,826.49	1.45
8	合计	2,235,826,323.49	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

### 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

本基金本报告期末未持有股票。

### 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

本基金本报告期内没有发生股票投资。

#### 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

本基金本报告期内没有发生股票投资。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内没有发生股票投资。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-

2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	2,033,725,667.42	211.74
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	2,082,472.00	0.22
8	其他	-	-
9	合计	2,035,808,139.42	211.95

## 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

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	122584	12 松城开	1,099,000	109,910,990.00	11.44
2	124319	13 昌国资	1,099,980	108,722,023.20	11.32
3	122619	12 迁安债	1,000,000	100,500,000.00	10.46
4	124292	13 溧城建	990,000	98,990,100.00	10.31
5	122610	12 乐清债	900,000	90,441,000.00	9.42

## 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

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

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

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

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。

### 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 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	279,216.08
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	32,250,610.41
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	32,529,826.49

### 7.11.4 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。

### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

### 7.11.6 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。

## § 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

份额 级别	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

丰利债 A	931	121,845.07	14,632,462.51	12.90%	98,805,299.56	87.10%
丰利债 B	337	2,670,191.81	861,652,796.00	95.75%	38,201,842.73	4.25%
合计	1,268	799,126.50	876,285,258.51	86.48%	137,007,142.29	13.52%

## 8.2 期末上市基金前十名持有人

丰利债 B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	国信证券股份有限公司	200,010,600.00	90.79%
2	鹏华基金管理有限公司	10,000,874.00	4.54%
3	王守明	1,992,751.00	0.90%
4	光大证券—光大银行—光大阳光 5 号集合资产管理计划	1,551,356.00	0.70%
5	徐莉珍	962,000.00	0.44%
6	全国社保基金—零零八组合	744,217.00	0.34%
7	陈素珍	716,473.00	0.33%
8	陈学臻	494,069.00	0.22%
9	淮北矿业（集团）有限责任公司企业年金计划—中国银行股份有限公司	490,200.00	0.22%
10	中国太平洋财产保险股份有限公司—传统—普通保险产品—013C-CT001 深	403,366.00	0.18%

注：持有人为场内持有人。

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本基金管理人的所有从业人员本报告期末未持有本基金。

## 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

本基金管理人的所有从业人员本报告期末未持有本基金。

## 8.5 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例（%）	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例（%）	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	24,448,064.04	2.41	20,448,064.04	2.02	三年

基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	200,010,600.00	19.74	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	224,458,664.04	22.15	20,448,064.04	2.02	-

注：（1）本基金管理人于 2014 年 4 月 22 日申购丰利债 A 份额 4,000,000 份，不属于利用发起式资金认购的发起份额。

（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。

（3）截至本报告期末，本基金管理人持有丰利债 A 份额 14,447,190.04 份，持有丰利债 B 份额 10,000,874.00 份，合计持有数量为 24,448,064.04 份。

（4）上表内基金管理公司股东国信证券股份有限公司持有丰利债 B 份额 200,010,600.00 份，不属于利用发起资金认购的发起份额。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	丰利债 A	丰利债 B
基金合同生效日（2013 年 4 月 23 日）	2,099,779,462.71	899,854,638.73
基金份额总额		
本报告期期初基金份额总额	436,684,133.80	899,854,638.73
本报告期基金总申购份额	9,673,423.32	-
减：本报告期基金总赎回份额	335,147,473.53	-
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	2,227,678.48	-
本报告期末基金份额总额	113,437,762.07	899,854,638.73

注：总申购份额含红利再投份额。

## § 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：报告期内公司原副总经理毕国强因个人职业发展原因提出辞职，经公司第五届董事会第二十六次会议审议，同意毕国强先生提出的辞职申请，并同意其在办理完工作交接手续后正式离任。毕国强先生于 2014 年 7 月 10 日正式离任。

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	
齐鲁证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-700.82	100.00%	-

注：1、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，最近二年未发生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，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) 选择交易单元的程序:

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。我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。本报告期内交易单元未发生变化。

### 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
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	684,062,426.35	100.00%	181,880,500,000.00	100.00%	-	-

### 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“11 临汾债”债券估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014 年 1 月 2 日
2	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的“12 中华信”债券估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014 年 1 月 2 日
3	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的“12 潭城建”债券估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014 年 1 月 2 日
4	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014 年 1 月 2 日

	的“13 沧建投”债券估值方法变更的提示性公告		
5	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的“13 南高速”债券估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2014 年 1 月 2 日
6	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的“13 温经开”债券估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2014 年 1 月 2 日
7	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的“12 东台债”债券估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2014 年 1 月 3 日
8	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的“12 益城投”债券估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2014 年 1 月 7 日
9	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的“12 中水 02”债券估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2014 年 1 月 7 日
10	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的“12 驻投资”债券估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2014 年 1 月 8 日
11	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的“13 合工投”债券估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2014 年 1 月 9 日
12	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的“13 吉城债”债券估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2014 年 1 月 9 日
13	鹏华基金管理有限公司	中国证券报、上海证券报、	2014 年 1 月 11 日

	司关于旗下基金持有的“12 启国投”债券估值方法变更的提示性公告	证券时报	
14	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的“13 抚城投”债券估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2014 年 1 月 11 日
15	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的“13 海发控”债券估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2014 年 1 月 11 日
16	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的“12 平发债”债券估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2014 年 1 月 15 日
17	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的“13 西经开”债券估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2014 年 1 月 15 日
18	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的“12 渝北飞”债券估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2014 年 1 月 17 日
19	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的“12 营口债”债券估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2014 年 1 月 17 日
20	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的“12 津生态”债券估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2014 年 1 月 18 日
21	鹏华基金 2013 年四季度报告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2014 年 1 月 21 日
22	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的“13 皋投债”债券	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2014 年 1 月 22 日

	估值方法变更的提示性公告		
23	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的“13 弘湘资”债券估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2014 年 1 月 22 日
24	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的“13 荣经开”债券估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2014 年 1 月 22 日
25	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的“13 新郑投”债券估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2014 年 1 月 22 日
26	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的“12 渝北飞”债券估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2014 年 1 月 23 日
27	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的“13 合川投”债券估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2014 年 1 月 24 日
28	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的“12 驻投资”债券估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2014 年 1 月 28 日
29	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的“12 晋煤运”债券估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2014 年 1 月 30 日
30	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的“13 德清债”债券估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2014 年 2 月 12 日
31	鹏华基金管理有限公司	中国证券报、上海证券报、	2014 年 2 月 13 日

	司关于旗下基金持有的“13 津滨投”债券估值方法变更的提示性公告	证券时报	
32	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的“10 沈煤债”债券估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2014 年 2 月 25 日
33	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的“11 华泰债”债券估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2014 年 3 月 4 日
34	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的“10 沈煤债”债券估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2014 年 3 月 8 日
35	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的“11 泰矿债”债券估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2014 年 3 月 14 日
36	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的“12 绍新城”债券估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2014 年 3 月 26 日
37	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的“13 渝南发”债券估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2014 年 3 月 27 日
38	鹏华基金 2013 年年度报告摘要	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2014 年 3 月 27 日
39	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的“12 乐清债”债券估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2014 年 4 月 3 日
40	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的“13 平煤债”债券	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2014 年 4 月 10 日

	估值方法变更的提示性公告		
41	鹏华基金管理有限公司关于鹏华丰利分级债券型发起式证券投资基金之丰利债 A 开放申购与赎回业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2014 年 4 月 17 日
42	鹏华丰利分级债券型发起式证券投资基金之丰利债 B 份额 (150129) 交易风险提示性公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2014 年 4 月 17 日
43	鹏华丰利分级债券型发起式证券投资基金之丰利债 A 份额折算方案的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2014 年 4 月 17 日
44	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的“12 平发债”债券估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2014 年 4 月 18 日
45	鹏华丰利分级债券型发起式证券投资基金之丰利债 B 份额 (150129) 暂停交易公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2014 年 4 月 21 日
46	鹏华基金 2014 年一季度报告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2014 年 4 月 22 日
47	鹏华丰利分级债券型发起式证券投资基金之丰利债 A 份额折算和申购与赎回结果的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2014 年 4 月 24 日
48	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的“13 溧城建”债券估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2014 年 4 月 26 日
49	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的“13 西经开”债券估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2014 年 5 月 10 日

50	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的“12 乐清债”债券估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2014 年 5 月 23 日
51	鹏华丰利分级债券型发起式证券投资基金更新的招募说明书摘要	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2014 年 6 月 4 日
52	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的“12 乐清债”债券估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2014 年 6 月 12 日
53	鹏华基金管理有限公司关于公司董事、监事、高级管理人员以及其他从业人员在子公司兼职及领薪情况的公告	证券时报	2014 年 6 月 14 日
54	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的“12 蒙高新”债券估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2014 年 6 月 17 日

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- (一) 《鹏华丰利分级债券型发起式证券投资基金基金合同》;
- (二) 《鹏华丰利分级债券型发起式证券投资基金托管协议》;
- (三) 《鹏华丰利分级债券型发起式证券投资基金 2014 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第 43 层鹏华基金管理有限公司  
深圳深南大道 7088 号招商银行大厦招商银行股份有限公司

### 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  
2014年8月26日