

鹏华中国50开放式证券投资基金 2009|第二季度报告

2009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
报告发布日期:二〇〇九年七月二十日

§1 重要提示

基金管理人的董事、监事、高级管理人员和基金经理等人员不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金经理丘丹对本报告所载资料不存在虚假记载、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。

基金过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2009 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	鹏华中国50混合
交易代码	160605
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年5月12日
报告期末基金份额总额	2,754,840,525.01份
投资目标	本基金以价值投资为本,通过集中投资于基本面和流动性良好同时收益稳定或长期收益相对稳定的股票,保持长期持有和积极主动的投资策略,谋取超额收益。
投资策略	(1)股票投资策略:本基金将股票投资作为核心,坚持个股选择与板块的权重配置相结合,从而在保证了投资空间的前提下一定比例降低投资风险。股票投资主要通过行业配置、个股精选、仓位控制等方法实现。
业绩比较基准	(2)债券投资策略:本基金侧重投资于具有良好流动性的债券品种,从而调整组合的风险水平,降低组合的波动率。
风险收益特征	本基金属于平衡型股票基金,为股票基金中的中低风险品种。长期平均的预期风险和预期收益低于成长型基金,高于价值型基金,指数型基金,纯债基金和国债。
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元	
主要财务指标	报告期(2009年4月1日-2009年6月30日)
1.本期已实现收益	122,773,028.20
2.本期利润	834,239,922.10
3.加权平均基金份额本期利润	0.3152
4.期末基金份额净值	4,653,833,218.37
5.期末基金份额总资产值	1,689
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,本期利息收入为本期利息加上本期公允价值变动收益。	
2.所列基金净值不包括持有人认购或交易基金份额的各项费用(例如,开放式基金的申购赎回费、基金转换费等),计入费用后实际净值水平将低于所列数字。	

3.2 基金净值表现

序号	阶段	净值增长率	净值增长率标准差(%)	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差(%)	①-③	②-④
过去三个月		22.66%	1.24%	25.07%	1.49%	-2.41%	-0.25%
注:业绩比较基准=上证180指数涨跌幅*65%+深证100指数涨跌幅*30%+金融同业存款利率*8%							
3.2.2 自基金合同生效以来基金总报酬率及其与同期业绩比较基准收益率的比较							
累计净值增长率为20.91%,同期业绩比较基准收益率为18.04%。							
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,本期利息收入为本期利息加上本期公允价值变动收益。							
2.所列基金净值不包括持有人认购或交易基金份额的各项费用(例如,开放式基金的申购赎回费、基金转换费等),计入费用后实际净值水平将低于所列数字。							

3.3 其他指标

序号	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细
1	中国平安 6,199,867 306,645,212.82 6.59
2	招商银行 9,424,659 211,206,608.19 4.54
3	北京银行 12,000,000 195,120,000.00 4.19
4	000024 招商地产 5,499,962 174,623,793.50 3.75
5	000002 万科 A 12,499,907 159,371,814.25 3.42
6	600030 中信证券 5,200,000 146,952,000.00 3.16
7	600031 三一重工 4,499,497 129,463,475.19 2.78
8	600016 民生银行 15,000,000 118,800,000.00 2.55
9	000051 丽珠集团 4,269,454 113,482,867.32 2.44
10	10 600025 华夏基金 5,000,000 112,950,000.00 2.43

3.4 报告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细
1	中国平安 6,199,867 306,645,212.82 6.59
2	招商银行 9,424,659 211,206,608.19 4.54
3	北京银行 12,000,000 195,120,000.00 4.19
4	000024 招商地产 5,499,962 174,623,793.50 3.75
5	000002 万科 A 12,499,907 159,371,814.25 3.42
6	600030 中信证券 5,200,000 146,952,000.00 3.16
7	600031 三一重工 4,499,497 129,463,475.19 2.78
8	600016 民生银行 15,000,000 118,800,000.00 2.55
9	000051 丽珠集团 4,269,454 113,482,867.32 2.44
10	10 600025 华夏基金 5,000,000 112,950,000.00 2.43

3.5 报告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细
1	中国平安 381,250 33,031,500.00 0.71
2	招商银行 352,655,211.26
3	600030 249,703,315.05
4	000024 249,703,315.05
5	10 600025 249,703,315.05

3.6 投资组合报告附注

3.6.1 本报告期内本基金没有购买或出售单只证券的金额超过基金资产净值10%的记录。

3.6.2 本报告期内本基金没有向关联方支付的管理费、托管费、销售服务费。

3.6.3 本报告期内本基金没有向关联方支付的佣金。

3.6.4 本报告期内本基金没有向关联方支付的利息。

3.6.5 本报告期内本基金没有向关联方支付的手续费。

3.6.6 本报告期内本基金没有向关联方支付的税金。

3.6.7 本报告期内本基金没有向关联方支付的其他费用。

3.6.8 本报告期内本基金没有向关联方支付的其他项目。

3.6.9 本报告期内本基金没有向关联方支付的其他项目。

3.6.10 本报告期内本基金没有向关联方支付的其他项目。

3.6.11 本报告期内本基金没有向关联方支付的其他项目。

3.6.12 本报告期内本基金没有向关联方支付的其他项目。

3.6.13 本报告期内本基金没有向关联方支付的其他项目。

3.6.14 本报告期内本基金没有向关联方支付的其他项目。

3.6.15 本报告期内本基金没有向关联方支付的其他项目。

3.6.16 本报告期内本基金没有向关联方支付的其他项目。

3.6.17 本报告期内本基金没有向关联方支付的其他项目。

3.6.18 本报告期内本基金没有向关联方支付的其他项目。

3.6.19 本报告期内本基金没有向关联方支付的其他项目。

3.6.20 本报告期内本基金没有向关联方支付的其他项目。

3.6.21 本报告期内本基金没有向关联方支付的其他项目。

3.6.22 本报告期内本基金没有向关联方支付的其他项目。

3.6.23 本报告期内本基金没有向关联方支付的其他项目。

3.6.24 本报告期内本基金没有向关联方支付的其他项目。

3.6.25 本报告期内本基金没有向关联方支付的其他项目。

3.6.26 本报告期内本基金没有向关联方支付的其他项目。

3.6.27 本报告期内本基金没有向关联方支付的其他项目。

3.6.28 本报告期内本基金没有向关联方支付的其他项目。

3.6.29 本报告期内本基金没有向关联方支付的其他项目。

3.6.30 本报告期内本基金没有向关联方支付的其他项目。

3.6.31 本报告期内本基金没有向关联方支付的其他项目。

3.6.32 本报告期内本基金没有向关联方支付的其他项目。

3.6.33 本报告期内本基金没有向关联方支付的其他项目。

3.6.34 本报告期内本基金没有向关联方支付的其他项目。

3.6.35 本报告期内本基金没有向关联方支付的其他项目。

3.6.36 本报告期内本基金没有向关联方支付的其他项目。

3.6.37 本报告期内本基金没有向关联方支付的其他项目。

3.6.38 本报告期内本基金没有向关联方支付的其他项目。

3.6.39 本报告期内本基金没有向关联方支付的其他项目。

3.6.40 本报告期内本基金没有向关联方支付的其他项目。

3.6.41 本报告期内本基金没有向关联方支付的其他项目。

3.6.42 本报告期内本基金没有向关联方支付的其他项目。

3.6.43 本报告期内本基金没有向关联方支付的其他项目。

3.6.44 本报告期内本基金没有向关联方支付的其他项目。

3.6.45 本报告期内本基金没有向关联方支付的其他项目。

3.6.46 本报告期内本基金没有向关联方支付的其他项目。

3.6.47 本报告期内本基金没有向关联方支付的其他项目。

3.6.48 本报告期内本基金没有向关联方支付的其他项目。

3.6.49 本报告期内本基金没有向关联方支付的其他项目。

3.6.50 本报告期内本基金没有向关联方支付的其他项目。

3.6.51 本报告期内本基金没有向关联方支付的其他项目。

</