普丰证券投资基金 2009年年度报告摘要

2009年12月31日

基金管理人:鹏华基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一〇年三月三十一日

§1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2010年3月26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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

普华永道中天会计师事务所注册会计师对本基金出具了"标准无保留意见"的审计报告。

本报告期自2009年1月1日起至2009年12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	鹏华普丰封闭
基金主代码	184693
交易代码	184693
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	1999年7月14日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,000,000,000份
基金合同存续期	至2014年7月14日止
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	1999年7月30日

2.2 基金产品说明

投资目标	导入指数化投资概念,增加投资广度,分散投资风险,同时贯彻绩优、成长的选股原则。通过指数化投资和优化组合投资两种模式的积极结合,实现风险与收益的有效平衡,力争使基金取得超过市场平均收益率以上的投资收益,实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金将指数化投资与优化组合投资有机结合,在进一步分散风险的同时,积极投资绩优股和成长股,将基金财产按一定比例分为指数化投资部分、债券投资部分和优化组合投资部分,力争在降低风险的同时,实现基金财产增值。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	程国洪	蒋松云
	联系电话	0755-82021186	010-66105799
	电子邮箱	ph@mail.phfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4006788999	95588
传真		0755-82021126	010-66105798

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.phfund.com.cn
基金年度报告备置地点	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 北京市西城区复兴门内大街55号中国工商银行股份有限公司

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2009年	2008年	2007年
本期已实现收益	283,574,707.88	17,813,334.47	3,704,837,736.05
本期利润	1,576,135,171.93	-3,516,364,830.21	5,280,062,333.13
加权平均基金份额本期利润	0.5254	-0.1721	1.7600
本期基金份额净值增长率	54.63%	-47.17%	108.14%
3.1.2 期末数据和指标	2009年末	2008年末	2007年末
期末可供分配基金份额利润	0.2549	-0.0356	1.1728
期末基金资产净值	4,453,278,542.48	2,893,343,370.55	9,448,708,200.76
期末基金份额净值	1.4844	0.9644	3.1496

注:①本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

②所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如,封闭式基金交易佣金等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

③表中的"期末"均指报告期最后一日,即12月31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
过去三个月	14.44%	3.25%	-	-	-	-
过去六个月	12.52%	3.02%	-	-	-	-
过去一年	54.63%	2.71%	-	-	-	-
过去三年	70.03%	3.49%	-	-	-	-
过去五年	258.53%	3.08%	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	291.11%	2.57%	-	-	-	-

注:基金合同中未规定业绩比较基准。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

普丰证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(1999年7月14日至2009年12月31日)

注:①基金合同中未规定业绩比较基准。

②按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定,截至本基金建仓期结束,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。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

普丰证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

注:基金合同中未规定业绩比较基准。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2009年	0.054	16,200,000.00	-	16,200,000.00	2009年4月15日每10份分配0.054元
2008年	10.130	3,039,000,000.00	-	3,039,000,000.00	2008年4月1日每10份分配3.000元;2008年4月15日每10份分配4.000元;2008年4月25日每10份分配3.130元
2007年	4.450	1,335,000,000.00	-	1,335,000,000.00	2007年4月3日每10份分配3.450元;2007年10月16日每10份分配1.000元
合计	14.634	4,390,200,000.00	-	4,390,200,000.00	-

§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,公司管理两只封闭式基金、十二只开放式基金和六只社保组合,经过10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。伴随着中国证券市场的发展壮大,面对中国入世后的机遇和挑战,身处中国基金业高速发展的历史时刻,鹏华基金管理有限公司将在进一步提高基金管理水平、完善市场服务体系、新业务开发、国际合作等多方面加快步伐,努力进取,继续诚实信用、勤勉尽责地为广大基金投资者服务,为中国基金业的健康发展做出应有贡献。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
吴昱村	本基金基金经理	2009-07-14	-	5	吴昱村先生,管理学硕士,5年证券从业经验,曾任联合证券有限责任公司研究员,2008年10月加盟鹏华基金管理有限公司从事行业研究工作,任行业研究员。吴昱村具备基金从业资格。
陈鹏	本基金基金经理	2008-08-14	-	6	陈鹏,国籍中国,硕士,6年证券从业经验,自2008年8月起担任鹏华普丰封闭基金经理。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,2007年3月起担任价值优势基金(LOF)基金经理助理,2007年8月起担任鹏华行业成长基金基金经理。陈鹏先生具备基金从业资格。

注:①任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日;担任新成立基金基金经理的,任职日期为基金合同生效日。

②证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内,基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、《普丰证券投资基金基金合同》的规定。

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、分配等各环节得到公平对待。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金管理人旗下无其他投资风格相似的投资组合。

4.3.3 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并对基金财产造成损失的异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

纵观2009年,在经历了2008年下半年罕见的全球经济下滑后,以中国为代表的新兴市场国家自二季度起表现出了持续的复苏特征,上市公司的盈利增长恢复有力地推动了A股市场的上涨。本基金在09年上半年基于对宏观经济回升稳定程度的审慎判断在配置策略上侧重于稳健崭行业,下半年则逐渐增加了与经济复苏直接相关的汽车、家电等行业的配置,从实际情况看取得了较好的效果。偏于谨慎的大类资产配置策略与较低的股票仓位上限导致全年基金份额净值增长率低于上述指数表现。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2009年年末,本基金份额净值1.4844元,基金份额净值增长率为54.63%。同期上证指数和深圳综指分别上涨了79.98%和117.12%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2010年,中国经济的复苏趋势与质量改善已无需置疑,我们认为全年上市公司收入及盈利将继续保持明显增长。我们所关注的核心问题将转变为积极的财政政策和适度宽松的货币政策将选择在何时及何种方式退出,以及在此过程中国内经济增长的方式将如何转变。

在一个"出口、固定资产投资、内需"的经济增长框架中,我们认为2010年出口的表现或将成为左右经济增长结构的主要自变量,而固定资产投资及内需将更有可能作为因变量存在。换言之,固定资产投资及启动内需政策的力度与速度调整将主要取决于出口的恢复程度。

在此背景下,我们认为积极财政政策和适度宽松的货币政策退出将表现出较以往更加灵活和主动的特征。本质上,随着国内经济复苏质量的持续改善,09年初出台的部分经济刺激政策在2010年寻求退出的可能性较大,但我们认为这一过程将是松油门而非踩刹车,这一点与2004年及2007年的两次调控将有显著差异。

因此,我们认为年初存款准备金上调等政策调整带来的预期失衡将随着经济数据的继续向好表现获得支撑,全年市场可望维持震荡向上的趋势。2010年精选行业及个股将比简单的仓位控制策略更为有效,我们将重点沿着以下几条主线寻找投资机会:①与消费结构改善和升级相关的行业,包括通讯、消费电子等;②09年经济板块计划项目建设进展带动的设备及相关需求;③行业政策推动下的产业板块与升级。此外,我们将密切关注出口尤其是机电设备的复苏状况,并及时在组合中对其可能出现的乐观变化加以反映。在新的一年中,本基金一定勤勉尽职,精选个股,力争为基金持有人创造良好的收益。

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;每日按时接收交收数据及权益数据,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审后复核工作,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序:

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长期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,本基金已实现收益为283,574,707.88元。根据《中华人民共和国证券投资基金法》等法律法规的规定及本基金基金合同的规定,本基金本年度收益分配比例应不低于已实现收益的90%,即255,217,237.09元。

4.7.2 本基金本报告期内对2008年实现收益进行了收益分配,分配金额16,200,000.00元,占2008年实现收益的90.94%;(详见本报告3.3部分)

本基金在2010年对2009年度实现收益进行了两次收益分配,2010年1月27日每10份分配0.300元,分红金额为90,000,000.00元;2010年2月24日每10份分配0.300元,分红金额为90,000,000.00元,合计分红180,000,000.00元,占2009年度已实现收益的63.48%。

4.7.3 本基金将严格按照基金合同的规定,在本报告期结束后四个月内完成年度收益分配。

§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

2009年,本基金托管人在对普丰证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2009年,普丰证券投资基金的管理人——鹏华基金管理有限公司在普丰证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、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,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,普丰证券投资基金对基金份额持有人进行了一次利润分配,分配金额为16,200,000元。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对鹏华基金管理有限公司编制和披露的普丰证券投资基金2009年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

普华永道中天会计师事务所注册会计师对本基金出具了"标准无保留意见"的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:普丰证券投资基金

报告截止日:2009年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2009年12月31日	上年度末 2008年12月31日
资 产:			
银行存款		13,374,332.47	481,042,397.81
结算备付金		5,925,276.48	1,560,766.16
存出保证金		2,309,632.86	1,098,780.49
交易性金融资产		4,235,325,567.36	2,407,311,318.21
其中:股票投资		3,315,544,855.56	1,371,392,006.74
基金投资		-	-
债券投资		919,780,711.80	1,035,919,311.47
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	394,989.79
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		197,886,330.70	-
应收利息		9,805,042.70	9,445,158.89
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		4,464,626,182.57	2,900,853,411.35
负债和所有者权益	附注号	本期末 2009年12月31日	上年度末 2008年12月31日
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		-	-
应付管理人报酬		4,688,534.59	3,159,377.61
应付托管费		937,706.90	631,875.53
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		2,566,690.43	491,137.49
应交税费		2,804,708.17	2,802,650.17
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		350,000.00	425,000.00
负债合计		11,347,640.09	7,510,040.80
所有者权益:			
实收基金		3,000,000,000.00	3,000,000,000.00
未分配利润		1,453,278,542.48	-106,656,629.45
所有者权益合计		4,453,278,542.48	2,893,343,370.55
负债和所有者权益总计		4,464,626,182.57	2,900,853,411.35

注:报告截止日2009年12月31日,基金份额净值1.4844元,基金份额总额3,000,000,000.00份。

7.2 利润表

会计主体:普丰证券投资基金

本报告期:2009年1月1日至2009年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2009年1月1日至2009年12月31日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31日
一、收入		1,646,464,774.60	-3,395,271,700.24
1.利息收入		31,553,175.56	42,444,414.78
其中:存款利息收入		2,313,242.96	4,211,316.21
债券利息收入		29,239,932.60	37,947,641.17
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	285,457.40
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		322,323,292.85	96,286,266.57
其中:股票投资收益		278,891,497.49	64,431,726.09
基金投资收益		-	-
债券投资收益		20,479,762.06	8,565,277.37
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		599,553.81	755,732.36
股利收益		22,352,479.49	22,533,530.75
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		1,292,560,464.05	-3,534,178,164.68
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		27,842.14	175,783.09
减:二、费用		70,329,602.67	121,093,129.97
1.管理人报酬	7.4.7.2.1	47,636,085.67	60,778,040.10
2.托管费	7.4.7.2.2	9,527,217.14	12,155,948.07
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		12,101,059.85	33,734,012.00
5.利息支出		531,779.84	5,453,006.83
其中:卖出回购金融资产支出		531,779.84	5,453,006.83
6.其他费用		533,460.17	8,972,122.97
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		1,576,135,171.93	-3,516,364,830.21
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		1,576,135,171.93	-3,516,364,830.21

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:普丰证券投资基金

本报告期:2009年1月1日至2009年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年12月31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)	3,000,000,000.00	-106,656,629.45	2,893,343,370.55
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,576,135,171.93	1,576,135,171.93
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(以"-"号填列)	-	-	-
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)	-	-16,200,000.00	-16,200,000.00
五、期末所有者权益(基金净值)	3,000,000,000.00	1,453,278,542.48	4,453,278,542.48
项目	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31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)	3,000,000,000.00	6,448,708,200.76	9,448,708,200.76
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-3,516,364,830.21	-3,516,364,830.21
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(以"-"号填列)	-	-	-
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)	-	-3,039,000,000.00	-3,039,000,000.00
五、期末所有者权益(基金净值)	3,000,000,000.00	-106,656,629.45	2,893,343,370.55

报表附注为财务报表的组成部分

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

基金管理公司负责人:邓召明,主管会计工作负责人:胡潮,会计机构负责人:刘慧红

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

普丰证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会《证监基字[1999]20号文》批准于1999年7月14日募集设立。本基金为契约型封闭式,存续期15年,发行规模为30亿份基金单位。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。《普丰证券投资基金招募说明书》、《普丰证券投资基金基金合同》等文件已按规定报送中国证监会备案。本基金经深圳证券交易所《以下简称深交所》深证上[1999]63号文审核同意,于1999年7月30日在深交所挂牌交易。

根据《证券投资基金法》及相关法律法规以及《普丰证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围仅限于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行上市的股票、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具,其中基金资产的50%以指数化形式、按中证指数有限公司编制的沪深300指数股票构成及数量比例投资,另50%可以投资于深沪两市绩优股、成长股和具有良好发展前景的股票以及债券;债券投资中国债投资不低于基金资产的20%。

7.4.2 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》、《普丰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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2009年度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2009年12月31日的财务状况以及2009年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 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。

7.4.5 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。

7.4.6 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
鹏华基金管理有限公司("鹏华基金")	基金发起人、基金管理人
中国工商银行股份有限公司("中国工商银行")	基金托管人
国信证券股份有限公司("国信证券")	基金发起人、基金管理人的股东
意大利欧利盛金融集团股份公司(Eurizon Financial Group S.p.A.)	基金管理人的原股东(变更前)
意大利欧利盛资本资产管理股份公司(Eurizon Capital SGR S.p.A.)	基金管理人的现股东(变更后)
深圳市北融信投资发展有限公司	基金管理人的股东
方正证券有限责任公司("方正证券")	基金发起人
安徽国元信托有限责任公司("安徽国元信托")	基金发起人
安信信托股份有限公司("安信信托")	基金发起人

7.4.6.1 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

根据中国证券监督管理委员会《关于核准鹏华基金管理公司变更股权的批复》(证监许可[2009]746号),核准本公司原股东意大利欧利盛金融集团股份公司(Eurizon Financial Group S.p.A.)将其持有的本公司49%的股权转让给意大利欧利盛资本资产管理股份公司(Eurizon Capital SGR S.p.A.),本公司本次股权变更后,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、深圳市北融信投资发展有限公司三家股东持有本公司股权的比例分别为:50%、49%、1%。

本公司已于2009年9月21日依据相关法规规定办理完毕工商变更登记等相关事宜。

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的其他关联方没有发生变化。

7.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.7.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2009年1月1日至2009年12月31日		上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31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	1,073,567,111.42	13.40%	2,868,025,939.49	29.09%

7.4.7.1.2 权证交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2009年1月1日至2009年12月31日		上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31日	
	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国信证券	-	-	446,467.67	2.09%

7.4.7.1.3 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2009年1月1日至2009年12月31日		上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
国信证券	-	-	935,098.04	1.05%

7.4.7.1.4 债券回购交易

本基金2009及2008年未通过关联方交易单元发生债券回购交易。

7.4.7.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2009年1月1日至2009年12月31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	903,504.13	13.49%	329,405.14	12.85%
关联方名称	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31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	2,408,441.50	29.09%	257,558.14	52.48%

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

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

(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。

7.4.7.2 关联方报酬

7.4.7.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年12月31日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	47,636,085.67	60,778,040.10

注:支付基金管理人鹏华基金的管理人报酬按前一日基金资产净值1.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日管理费=前一日基金资产净值x1.25%/当年天数。

7.4.7.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年12月31日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	9,527,217.14	12,155,948.07

注:支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日托管费=前一日基金资产净值x0.25%/当年天数。

7.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行	-	569,435,249.83	-	-	-	-

注:①本基金本报告期内没有与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

②与关联方之间通过银行间市场进行的债券(含回购)交易,该类交易均在正常业务中按照一般商业条款而订立。

7.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

单位:份

项目	本期 2009年1月1日至2009年12月31日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31日
基金合同生效日(1999年7月14日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	3,750,000.00	3,750,000.00
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	3,750,000.00	3,750,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.125%	0.125%

注:本基金管理人投资本基金的费率标准与其他相同条件的投资者适用的费率标准相一致。

7.4.7.4.2 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 2009年12月31日		上年度末 2008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	7,500,000.00	0.25%	15,000,000.00	0.50%
安徽国元信托	1,875,000.00	0.06%	3,750,000.00	0.13%
方正证券	1,875,000.00	0.06%	1,875,000.00	0.06%

注:①安徽国元信托与方正证券为本基金发起人。

②关联方投资本基金为基金发行期间按统一认购费率认购。

7.4.7.5 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 2009年1月1日至2009年12月31日		上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	13,374,332.47	2,270,945.26	481,042,397.81	4,131,604.08

注:本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管,按银行同业利率计息。

7.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

关联方名称	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31日					
	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入		
				数量(单位:张)	总金额	
国信证券	126011	08石化债	配售	35,630	3,563,000.00	
国信证券	126011	08石化债	网下申购	657,330	65,733,000.00	
国信证券	112005	08万科G1	配售	1,141	114,100.00	
国信证券	112006	08万科G2	配售	857	85,700.00	
国信证券	601898	中煤能源	网上申购	794,000	13,363,020.00	
国信证券	601186	中国铁建	网上申购	1,235,000	11,213,800.00	

注:本基金本报告期没有在承销期内参与关联方承销证券的买卖。

7.4.8 期末(2009年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

7.4.9.1.1 受限证券类别:股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600239	云南城投	2009-04-14	2010-04-12	非公开发行流通受限	15.18	22.79	1,500,000	15,180,000.00	34,185,000.00	-
600376	首开股份	2009-07-21	2010-07-19	非公开发行流通受限	13.96	16.61	5,000,000	69,800,000.00	83,050,000.00	-

注:①云南城投置业股份有限公司实施了2008年度资本公积金转增股本方案,即向全体股东每10股转增5股。股权登记日为2009年6月15日,除权(息)日为2009年6月16日。

②截至本报告期末2009年12月31日止,本基金没有持有因认购新发或增发而流通受限债券及权证。

7.4.8.2 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
600022	济南钢铁	2009-11-09	公告重大事项	5.27	2010-02-24	5.00	403,986	1,635,165.05	2,129,006.22	-
600102	莱钢股份	2009-11-09	公告重大事项	13.07	2010-02-24	11.88	88,999	910,101.17	1,163,216.93	-
600100	同方股份	2009-12-29	公告重大事项	18.73	2010-01-04	18.70	220,995	3,143,828.76	4,139,236.35	-
000709	唐钢股