

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:2011年8月25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。

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2011年8月22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,也不保证基金份额持有人的资产不受损失。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。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。

本半年度报告摘要未经审计。
本报告自2011年1月1日起至6月30日止。

Table with 2 columns: 基金基本情况, 基金管理人:鹏华中国50混合, 基金代码:160605

Table with 2 columns: 2.2 基金产品说明, 投资目标:以价值投资方法, 通过集中投资于基本面良好和流动性良好时收益价值或成长性相对较高的股票, 长期持有并适度波段操作, 以求在充分控制风险的前提下分享中国经济增长和企业价值提升带来的长期增值收益。

Table with 2 columns: 2.3 基金管理人, 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

Table with 2 columns: 2.4 信息披露, 信息披露网址: http://www.pfund.com.cn

§3 主要财务指标和基金净值表现

Table with 2 columns: 3.1.1 期间回报指标, 本报告期(2011年1月1日至2011年6月30日), 基金净值增长率: -1.949%

Table with 2 columns: 3.1.2 期末基金份额净值, 本报告期末(2011年6月30日), 基金份额净值: 1.590

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低于所列数字。

③表中“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。

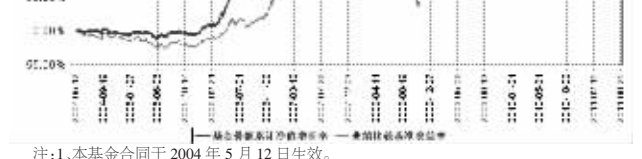
3.2 基金净值表现

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

Table with 4 columns: 阶段, 基金份额净值增长率, 业绩比较基准收益率, ①-②, ②-③

注:基金业绩比较基准=上证180指数涨跌幅x65%+深证100指数涨跌幅x30%+金融同业存款利率x5%。

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



基金业绩比较基准:上证180指数涨跌幅x65%+深证100指数涨跌幅x30%+金融同业存款利率x5%

注:1.本基金合同于2004年5月12日生效。

2.截至建仓期末,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、中国证监会许可的其他业务。

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、中国证监会许可的其他业务。

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、中国证监会许可的其他业务。

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、中国证监会许可的其他业务。

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、中国证监会许可的其他业务。

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、中国证监会许可的其他业务。

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、中国证监会许可的其他业务。

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、中国证监会许可的其他业务。

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、中国证监会许可的其他业务。

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、中国证监会许可的其他业务。

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、中国证监会许可的其他业务。

鹏华中国50开放式证券投资基金

2011 半年度 报告摘要

2011年6月30日

核算及账务处理:每日按日按收或交数据及权益数据,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。

配备的基金会计具备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、政策和程序。

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,本基金对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。

基金估值参与或决定基金日常估值,基金经理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 本公司没有进行任何定价服务的签约。

4.7.1 截止本报告期末,本基金可供分配利润为1,496,204,810.57元。

5.1 报告期内本基金托管人遵守情况报告摘要

2011年上半年度,基金托管人在鹏华中国50开放式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份额持有人利益的行为。

2011年上半年度,鹏华基金管理有限公司在鹏华中国50开放式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份额持有人利益的行为。

本报告期末本基金未进行收益分配。

2011年上半年度,由鹏华基金管理有限公司编制并经经托管人复核审查的有关鹏华中国50开放式证券投资基金的半年度报告中文财务指标、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)

Table with 2 columns: 资产, 2011年6月30日, 2010年12月31日

Table with 2 columns: 负债, 2011年6月30日, 2010年12月31日

Table with 2 columns: 所有者权益, 2011年6月30日, 2010年12月31日

注:本报告截止日2011年6月30日,基金份额净值1.590元,基金份额总额2,534,080,439.23份。

4.3.2.1 利润表

Table with 2 columns: 项目, 2011年1月1日至2011年6月30日, 2010年1月1日至2010年6月30日

注:本报告截止日2011年6月30日,基金份额净值1.590元,基金份额总额2,534,080,439.23份。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

Table with 2 columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产的比例(%)

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 代码, 行业名称, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

Table with 2 columns: 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(%)

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

Table with 2 columns: 序号, 股票代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

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

Table with 2 columns: 序号, 股票代码, 资产支持证券名称, 数量(元), 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

7.6 投资组合报告附注

报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

金额单位:人民币元

Table with 2 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计卖出金额, 占期末基金资产净值比例(%)

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。

7.4.3 买入股票的成本及卖出股票的收入总额

Table with 2 columns: 单位:人民币元, 买入股票成本/成交总额, 卖出股票收入/成交总额

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

Table with 2 columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

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

Table with 2 columns: 序号, 股票代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

注:上述债券均为本基金本报告期末持有的全部债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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 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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 报告期内,本基金投资的前十名证券之一五粮液的投资主体宜宾五粮液股份有限公司,因涉及多起信息披露事项披露不及时并在重大遗漏等违规行为,于2011年5月28日受到中国证监会的行政处罚。

7.9.2 报告期内,本基金投资的前十名证券之一五粮液的投资主体宜宾五粮液股份有限公司,因涉及多起信息披露事项披露不及时并在重大遗漏等违规行为,于2011年5月28日受到中国证监会的行政处罚。

7.9.3 期末其他各项资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额

7.9.4 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。

7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.9.6 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 基金价格持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

Table with 2 columns: 序号, 项目, 金额

注:截止本报告期末,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。

§9 开放式基金份额变动

Table with 2 columns: 基金合同生效日(2004年5月12日), 基金份额总额, 2,444,882,321.46

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金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重大人事变动

2011年3月11日,中国证监会第二十次例会审议通过,聘任胡军为公司副总经理,高晋资格申请时间为2011年3月4日,聘任时间为2011年4月27日,自聘任之日起生效。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金报告期内无基金投资策略改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金报告期内无会计师事务所变更。

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、基金托管人及其高级管理人员报告期内无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

2011年上半年,本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

Table with 2 columns: 券商名称, 交易单元数量, 股票交易, 占当期股票成交总额的比例, 债券交易, 占当期债券成交总额的比例, 权证交易, 占当期权证成交总额的比例

注:交易单元选择的标准和程序:1.基金管理人选择符合中国证监会规定的证券公司,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资产雄厚,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,最近一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,并能与本基金提供信息系统的需要;

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。

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

Table with 2 columns: 券商名称, 债券交易, 占当期债券成交总额的比例, 权证交易, 占当期权证成交总额的比例

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 累计卖出金额超过期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

Table with 2 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期末基金资产净值比例(%)