鹏华中证500指数证券投资基金(LOF)

2012 半年度 报告摘要

2012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:中国工商银行股份有限公司
送出日期:2012年8月29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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年8月24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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2012年1月1日起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	鹏华中证500指数(LOF)
基金主代码	160616
交易代码	160616
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2010年2月5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	1,339,349,345.26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	2010-04-28

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,可简称为 鹏华500”。

2.2 基金产品说明

投资目标	采用指数化投资方式,追求基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间的跟踪误差最小化,力争将日均跟踪偏离度控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内,以实现对中证500指数的有效跟踪。
投资策略	本基金采用被动式指数投资方法,原则上按照成份股在中证500指数中的基准权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。 当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或因某些特殊情况导致流动性不足时,或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整,力求降低跟踪误差。
业绩比较基准	中证500指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%
风险收益特征	本基金属于采用指数化操作的股票型基金,其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金,为证券投资基金中的较高预期风险、较高预期收益品种。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张戈	赵会军
	联系电话	0755-82825720	010-66105799
	电子邮箱	zhangge@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

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.phfund.com.cn
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

§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(2012年1月1日 - 2012年6月30日)
本期已实现收益	-71,757,566.58
本期利润	55,195,128.94
加权平均基金份额本期利润	0.0396
本期基金份额净值增长率	5.97%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2012年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.2721
期末基金资产净值	974,871,593.98
期末基金份额净值	0.728

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)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。

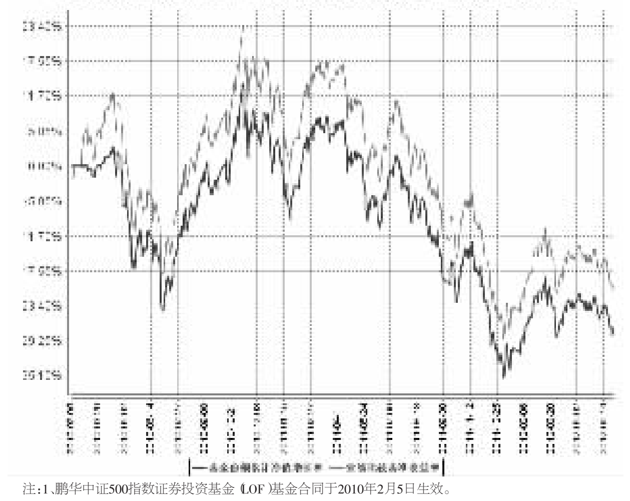
3.2 基金净值表现

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	-6.91%	1.18%	-7.16%	1.18%	0.25%	0.00%
过去三个月	1.82%	1.17%	1.53%	1.16%	0.29%	0.01%
过去六个月	5.97%	1.52%	6.02%	1.53%	-0.05%	-0.01%
过去一年	-23.85%	1.52%	-23.00%	1.53%	-0.85%	-0.01%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-27.20%	1.54%	-19.95%	1.57%	-7.25%	-0.03%

注:本基金业绩比较基准=中证500指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%。

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



注:1、鹏华中证500指数证券投资基金(LOF)基金合同于2010年2月5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2只封闭式基金、27只开放式基金和6只社保组合,经过13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		
方南	本基金基金经理	2010年2月5日	-	10	方南先生,国籍中国,工商管理硕士,10年证券从业经验。曾任职于杭州恒生电子股份有限公司,上海新利多数字技术有限公司。2001年11月加盟鹏华基金管理有限公司,历任金融工程部(原)研究员、金融工程部(原)总经理助理、鹏华沪深300指数证券投资基金(LOF)基金经理助理。2010年2月至今担任鹏华中证500指数证券投资基金(LOF)基金经理,2010年8月至今兼任鹏华上证民企50ETF基金及其联接基金基金经理,2011年9月起兼任鹏华深证民营ETF基金及其联接基金基金经理。方南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遵规守信情况的说明

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、分配等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并对基金财产造成损失的异常交易行为,未存在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的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

年初,短期内通胀、房地产价格等结构性矛盾、风险较前期有所缓和,在数据上给政府的政策微调打下了基础和提供了可能性,也给市场带来了较为乐观的预期,从而迎来了一定的上涨。

然而随着经济数据的不断确认,经济增速的回落已成事实,与此对应的是,A股市场估值中枢下移。前期我们关注的需求能否逐步启动并带动新的库存周期和增长动能在二季度仍未得到明显确认。市场预期相对于股市的提前量及博弈氛围有所降低,结构性机会在进行较长时间的市场抉择和参与后并未有实质性中枢行业支撑,市场整体缺乏上涨动力、回调压力逐步增大。

在此期间,市场整体处于震荡状态,单日波动保持较高程度,对基金的管理运作带来一定影响,面临这种情况,我们进行了精心的管理,较好的实现了跟踪误差控制目标。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期末,本基金份额净值为0.728元,累计净值0.728元;本报告期基金份额净值增长率为5.97%,同期业绩比较基准收益率为6.02%。

报告期内,本基金日均跟踪偏离度的绝对值0.001%,年化跟踪误差0.908%,较好的完成了跟踪目标。

对本基金而言,本期间跟踪误差的主要来源主要有三个方面:一是样本股调整,对此,我们采取了 优化”策略以应对,取得了较好的效果;二是本期基金面临了一定的申赎变动,而当时市场单日波幅较大,对我们的跟踪管理带来了一定影响;三是目前的份额净值计算精度(基金份额净值的计算保留到小数点后3位,小数点后第4位四舍五入)所带来的跟踪误差,这也是本期跟踪误差的主要来源之一。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经济增速下降得到市场确认后,虽然央行在二季度启动降息,但带有一点利率市场化的意味,存贷款利率实际波动的不对称结果,导致 降息”对于股市的短期效用较以往有所折扣,但从长远来看,有利于市场的资源优化。从近大半年来的政策基调和措施观察来看,所谓的经济刺激政策不太可能再次形成市场的拐点主因,以转型为主线、以微调为短期手段将成为常态,其整体力度从短期来看要低于资本市场投资者普遍习惯的 救市”预期程度,这将造成投资者预期的波动,在反复确认经济层面没有明显转机后,自然加剧悲观的反馈。另外,我们也看到,海外市场仍然存在波动风险,无论结局如何,经济和货币本身都会受到影响。

目前是经济寻底的过程,有几个方面值得关注,首先,通过对近期经济数据的分析我们可以发现,虽然PMI数据整体不尽如人意,但从分项可以看到,国内需求有所回升,这也在一定程度上稳定了制造业景气波动,其次,展望后期,市场资金面有望进一步改善,假如后期货币政策有助于进一步降低市场真实利率的话,这将很大程度上缓解目前的企业经营及盈利状况,有助于经济的逐步回暖。除市场整体方向外,把握经济及产业政策方面作出的结构性的调整及方向将是投资者获取超额收益的主要来源之一。

同时我们仍然强调前期的观点:反复的经济形势势必带来资产之间轮动演绎的复杂化和高频率化,资产配置犯错的概率和机会成本相对较高,建议投资者从中长期投资的角度来考虑战略资产配置,避免短期频繁操作带来的风险。

本基金将积极应对各种因素对指数跟踪效果带来的冲击,努力将跟踪误差控制在基金合同规定的范围内,力争为投资者带来较好的投资回报。

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,本基金可供分配利润为-364,477,751.28元,期末基金份额净值0.728元,不符合利润分配条件,本基金本期将不进行利润分配。

4.7.2本基金本报告期内未进行利润分配。

§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

2012年上半年,本基金托管人在对鹏华中证500指数证券投资基金(LOF)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投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2012年上半年,鹏华中证500指数证券投资基金(LOF)的管理人——鹏华基金管理有限公司在鹏华中证500指数证券投资基金(LOF)的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、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,鹏华中证500指数证券投资基金(LOF)未进行利润分配。

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

本托管人依法对鹏华基金管理有限公司编制和披露的鹏华中证500指数证券投资基金(LOF)2012年上半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 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:鹏华中证500指数证券投资基金(LOF)

报告截止日:2012年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2012年6月30日	上年度末 2011年12月31日
资产:		
银行存款	50,699,835.19	45,460,873.02
结算备付金	593,230.47	596,351.51
存出保证金	364,777.11	642,023.90
交易性金融资产	922,980,741.40	851,541,181.53
其中:股票投资	922,980,741.40	851,541,181.53
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	5,038,749.84	3,018,362.37
应收利息	9,648.24	9,676.48
应收股利	98,838.86	-
应收申购款	862,874.89	683,709.04
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	980,648,696.00	901,952,177.85
负债和所有者权益	本期末 2012年6月30日	上年度末 2011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	3,659,956.98	4,625,901.44
应付赎回款	243,221.82	356,062.69
应付管理人报酬	624,646.90	618,041.49
应付托管费	124,929.39	123,608.30
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	834,761.28	757,436.24
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	289,585.65	161,324.94
负债合计	5,777,102.02	6,642,375.10
所有者权益:		
实收基金	1,339,349,345.26	1,303,188,501.95
未分配利润	-364,477,751.28	-407,878,699.20
所有者权益合计	974,871,593.98	895,309,802.75
负债和所有者权益总计	980,648,696.00	901,952,177.85

注:报告截止日2012年6月30日,基金份额净值0.728元,基金份额总额1,339,349,345.26份。

6.2 利润表

会计主体:鹏华中证500指数证券投资基金(LOF)

本报告期:2012年1月1日至2012年6月30日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
一、收入		62,039,244.25	-82,118,213.64
1.利息收入		207,939.46	277,785.64
其中:存款利息收入		207,939.46	277,679.75
债券利息收入		-	105.89
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		-65,443,725.18	25,483,890.49
其中:股票投资收益		-70,830,941.03	20,995,273.68
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	33,998.11
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		5,387,215.85	4,454,618.70
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		126,952,695.52	-108,504,495.86
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)		322,334.45	624,606.09
二、费用		6,844,115.31	8,049,342.26
1.管理人报酬	6.4.8.2.1	3,887,645.32	4,784,531.59
2.托管费	6.4.8.2.2	777,529.05	956,906.27
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		1,845,673.68	1,951,727.53
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用		333,267.26	356,176.87
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		55,195,128.94	-90,167,555.90
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		55,195,128.94	-90,167,555.90

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:鹏华中证500指数证券投资基金(LOF)

本报告期:2012年1月1日至2012年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012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)	1,303,188,501.95	-407,878,699.20	895,309,802.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	55,195,128.94	55,195,128.94
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)	36,160,843.31	-11,794,181.02	24,366,662.29
其中:1.基金申购款	486,642,441.81	-117,404,787.78	369,237,654.03
2.基金赎回款	-450,481,598.50	105,610,606.76	-344,870,991.74
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)	1,339,349,345.26	-364,477,751.28	974,871,593.98

项目	上年度可比期间 2011年1月1日至2011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)	1,206,398,882.34	34,579,576.38	1,240,978,458.72
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-90,167,555.90	-90,167,555.90
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)	-74,747,459.25	5,353,410.90	-69,394,048.35
其中:1.基金申购款	550,941,294.07	13,803,523.81	564,744,817.88
2.基金赎回款	-625,688,753.32	-8,450,112.91	-634,138,866.23
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)	1,131,651,423.09	-50,234,568.62	1,081,416,854.47

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______ ______胡湘______ ____刘慧红____

基金管理公司负责人 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

鹏华中证500指数证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”),系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[2009]1374号文《关于核准鹏华中证500指数证券投资基金(LOF)募集的批复》的核准,由基金管理人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《鹏华中证500指数证券投资基金(LOF)基金合同》的约定募集设立。本基金为上市契约型开放式,存续期限为不定期,首次设立募集不包括认购资金利息共募集2,629,831,732.31元,经普华永道中天会计师事务所有限公司验证并出具普华永道中天验字(2010)第021号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华中证500指数证券投资基金(LOF)基金合同》于2010年2月5日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为2,630,723,634.12份基金份额,其中认购资金利息折合891,901.81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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2010]第129号文审核同意,本基金583,423,342.00份基金份额于2010年4月28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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华中证500指数证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定,本基金投资于具有良好流动性的金融工具,主要投资于中证500指数的成份股及其备选成份股(投资比例不低于基金资产净值的90%),现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。此外,为更好的实现投资目标,本基金将少量投资于非中证500成份股、新股(首次发行或增发等)以及法律法规及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。本基金业绩比较基准为:中证500指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%。

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》、《鹏华中证500指数证券投资基金(LOF)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2012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2012年6月30日的财务状况以及2012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 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011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	346,383,921.88	28.58%	70,652,722.12	5.61%

6.4.8.1.2 债券交易

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。

6.4.8.1.3 债券回购交易

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。

6.4.8.1.4 权证交易

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。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012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	294,427.27	28.89%	202,026.03	24.20%
关联方名称	上年度可比期间 2011年1月1日至2011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	60,055.19	5.73%	0.00	0.00%

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《证券交易单元租用协议》。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。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,887,645.32	4,784,531.59
其中:支付销售机构的客户维护费	676,646.56	945,422.41

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0.75%,逐日计提,按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×0.75%÷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。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	777,529.05	956,906.27

注:支付基金托管人中国工商银行股份有限公司的托管费年费率为0.15%,逐日计提,按月支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.15%÷当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比较期间没有与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间管理人未投资、持有本基金。

6.4.8.4.2 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

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方没有投资及持有本基金份额。

6.4.8.5 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 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011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
中国工商银行	50,699,835.19	195,181.22	56,195,358.25	253,417.83

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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。

6.4.9 期末(2012年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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等其他证券。

6.4.9.2 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
600499	科达机电	2012年6月20日	重大事项停牌	10.28	2012年7月2日	10.11	293,723	4,102,621.55	3,019,472.44	-
600780	通宝能源	2012年1月18日	重大事项停牌	6.70	-	-	268,283	1,784,288.34	1,797,496.10	注
000767	*ST漳电	2012年6月1日	筹划资产重组	3.72	2012年7月27日	3.90	406,352	1,637,774.86	1,511,629.44	-

注:山西通宝能源股份有限公司2011年度利润分配方案为:向全体股东每10股派发现金1元(含税),股权登记日为2012年6月20日,除权除息日为2011年6月21日。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 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。

6.4.9.3.2 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。

§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	922,980,741.40	94.12
	其中:股票	922,980,741.40	94.12
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	51,293,065.66	5.23
6	其他各项资产	6,374,888.94	0.65
7	合计	980,648,696.00	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资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	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	15,762,349.27	1.62
B	采掘业	15,507,414.32	1.59
C	制造业	525,031,975.88	53.86
C0	食品、饮料	59,553,890.87	6.11
C1	纺织、服装、皮毛	27,260,715.09	2.80
C2	木材、家具	3,422,689.20	0.35
C3	造纸、印刷	15,052,995.48	1.54
C4	石油、化学、塑胶、塑料	86,857,887.63	8.91
C5	电子	56,372,411.11	5.78
C6	金属、非金属	52,433,639.21	5.38
C7	机械、设备、仪表	135,642,357.23	13.91
C8	医药、生物制品	76,925,667.84	7.89
C99	其他制造业	11,509,722.22	1.18
D	电力、煤气及水的生产和供应业	40,090,341.06	4.11
E	建筑业	16,754,828.24	1.72
F	交通运输、仓储业	37,579,524.04	3.85
G	信息技术业	50,164,787.08	5.15
H	批发和零售贸易	50,260,023.63	5.16
I	金融、保险业	12,483,957.75	1.28
J	房地产业	71,924,916.65	7.38
K	社会服务业	33,251,715.07	3.41
L	传播与文化产业	27,223,186.73	2.79
M	综合类	26,945,721.68	2.76
	合计	922,980,741.40	94.68

7.2.2 期末积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的指数投资前十名和积极投资前五名股票投资明细

7.3.1 期末指数投资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

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	000799	酒鬼酒	113,670	5,956,308.00	0.61
2	600199	金种子酒	227,233	5,676,280.34	0.58
3	600079	人福医药	229,526	5,322,707.94	0.55
4	600702	沱牌舍得	137,313	4,977,596.25	0.51
5	000917	电广传媒	195,863	4,843,691.99	0.50
6	600300	维维股份	484,237	4,590,566.76	0.47
7	600366	宁波韵升	209,577	4,350,818.52	0.45
8	600138	中青旅	241,853	4,348,516.94	0.45
9	600637	百视通	325,318	4,261,665.80	0.44
10	002029	七匹狼	146,710	4,078,538.00	0.42

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于鹏华基金管理有限公司网站http://www.phfund.com.cn的半年度报告正文。

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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

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	000970	中科三环	23,595,717.68	2.64
2	600199	金种子酒	13,781,572.91	1.54
3	002236	大华股份	11,275,584.45	1.26
4	000826	桑德环境	9,786,522.40	1.09
5	600157	永泰能源	9,747,168.36	1.09
6	002250	联化科技	7,765,883.75	0.87
7	002154	报喜鸟	7,621,786.91	0.85
8	002410	广联达	7,047,684.77	0.79
9	600425	青松建化	5,666,305.75	0.63
10	600240	华业地产	5,395,910.17	0.60
11	000563	陕国投A	5,024,411.84	0.56
12	000861	海印股份	4,979,338.07	0.56
13	002475	立讯精密	4,430,396.14	0.49
14	002006	精功科技	4,388,698.99	0.49
15	002161	远望谷	4,044,478.37	0.45
16	600022	山东钢铁	3,933,593.27	0.44
17	000750	国海证券	3,829,727.42	0.43
18	002005	德豪润达	3,733,338.97	0.42
19	600635	大众公用	3,602,352.60	0.40
20	600340	华夏幸福	3,596,125.22	0.40

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	000970	中科三环	33,033,149.80	3.69
2	002236	大华股份	14,721,078.10	1.64
3	600199	金种子酒	13,654,432.06	1.53
4	000826	桑德环境	9,820,044.74	1.10
5	600157	永泰能源	8,610,973.03	0.96
6	002154	报喜鸟	8,214,817.20	0.92
7	002250	联化科技	7,377,928.12	0.82
8	600827	友谊股份	7,364,991.13	0.82
9	600060	海信电器	7,289,764.60	0.81
10	002410	广联达	7,167,463.06	0.80
11	600240	华业地产	5,711,640.19	0.64
12	600022	山东钢铁	5,421,717.05	0.61
13	600425	青松建化	5,328,769.06	0.60
14	000861	海印股份	4,973,045.37	0.56
15	000563	陕国投A	4,936,818.51	0.55
16	002475	立讯精密	4,452,538.80	0.50
17	002006	精功科技	4,234,552.64	0.47
18	002161	远望谷	4,073,673.77	0.46
19	601566	九牧王	3,599,773.05	0.40
20	600724	宁波富达	3,504,099.39	0.39

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	618,442,941.63
卖出股票收入(成交)总额	603,125,136.25

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

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名的前五名债券投资明细

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名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名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 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。

7.9.2 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。

7.9.3 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	364,777.11
2	应收证券清算款	5,038,749.84
3	应收股利	98,838.86
4	应收利息	9,648.24
5	应收申购款	862,874.89
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,374,888.94

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 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.9.6 期末积极投资前五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积极投资的股票。

7.9.7 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
32,307	41,456.94	404,309,280.32	30.19%	935,040,064.94	69.81%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	高桂英	1,950,260.00	2.67%
2	王延安	1,280,252.00	1.76%
3	薛晓京	1,005,030.00	1.38%
4	肖菊华	1,000,070.00	1.37%
5	钟莉莉	1,000,060.00	1.37%
5	张雪红	1,000,060.00	1.37%
6	冷利群	800,024.00	1.10%
7	邹娜	746,536.00	1.02%
8	谢琳琳	725,521.00	0.99%
9	王军	673,000.00	0.92%
10	王晓东	600,048.00	0.82%

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

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本基金	656,416.38	0.0490%

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;

(3)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。

§9 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2010年2月5日)基金份额总额	2,630,723,634.12
本报告期期初基金份额总额	1,303,188,501.95
本报告期基金总申购份额	486,642,441.81
减:本报告期基金总赎回份额	450,481,598.50
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,339,349,345.26

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

10.2.1 本基金管理人——鹏华基金管理有限公司本报告期内没有发生重大人事变动。

10.2.2 本基金托管人——中国工商银行股份有限公司的基金托管部门本报告期内未发生重大人事变动。

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	
长江证券	1	616,639,944.94	50.87%	508,341.14	49.88%	-
国信证券	1	346,383,921.88	28.58%	294,427.27	28.89%	-
银河证券	1	249,136,016.78	20.55%	216,381.81	21.23%	-

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,最近二年未发生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,向中国银河证券股份有限公司、长江证券股份有限公司及国信证券股份有限公司租用交易单元作为基金专用交易单元,并从2010年2月开始陆续使用。本报告期内上述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

本基金本报告期内未通过券商交易单元进行债券交易、债券回购交易及权证交易。

鹏华基金管理有限公司
2012年8月29日