普丰证券投资基金

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。

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2012年6月30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	3,000,000,000.00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

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"基金普丰"。

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	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	-102,037,812.43
本期利润	44,466,482.82
加权平均基金份额本期利润	0.0148
本期基金份额净值增长率	1.75%
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	-0.1415
期末基金资产净值	2,575,612,279.84
期末基金份额净值	0.8585

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。

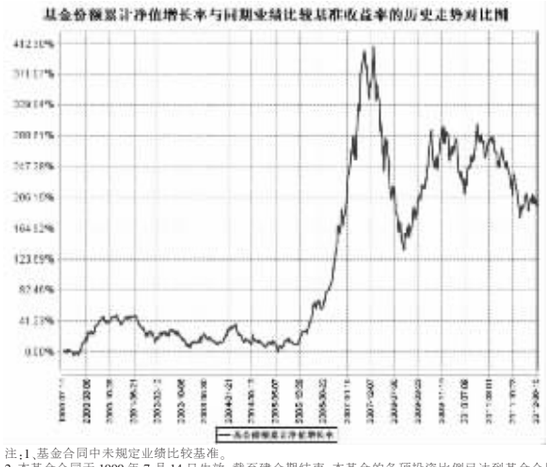
3.2 基金净值表现

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	-2.37%	2.50%	-	-	-	-
过去三个月	1.23%	2.06%	-	-	-	-
过去六个月	1.75%	2.05%	-	-	-	-
过去一年	-19.25%	2.22%	-	-	-	-
过去三年	-16.49%	2.35%	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	192.47%	2.50%	-	-	-	-

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



注:1、基金合同中未规定业绩比较基准。

2、本基金合同于1999年7月14日生效,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		
吴昱村	本基金基金经理	2009年7月14日	-	8	吴昱村先生,国籍中国,管理学硕士,8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,2009年7月起先今担任鹏华普丰基金基金经理。吴昱村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

回顾上半年,宏观经济表现出了明显的景气持续下滑特征,紧缩财政货币政策的收缩作用进一步显现,"硬着陆"的风险在4、5月出现了较为明显的上升。基于此背景,2季度政策预调微调的力度及频率明显加大,但其主旨仍在于对冲可能出现的经济超预期下滑风险,而非推动新的固定资产投资周期。证券市场对此的反应较为有效,即早周期行业股价在经历了年初短暂上涨后,二季度出现了持续下跌;食品饮料、医药等非周期行业及非银行金融、地产等政策导向趋于乐观的大市值行业表现良好。本基金年初重点配置了白色家电、乘用车、电力设备等早周期行业,一季度净值增长情况表现良好;但对食品饮料、医药等行业的配置不足是导致二季度净值增长率明显落后的主要原因。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金净值增长率为1.75%,同期上证综指上涨1.18%,深圳成指上涨6.52%,沪深300指数上涨4.94%。

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,我们认为政策的调整节奏将保持稳定,3季度在物价总水平快速回落的背景下降息及降准仍是大概率事件,这将有助于经济真正进入筑底休整阶段;宏观经济指标的同比表现可望好于上半年。但是,仅降低资金成本和改善市场流动性并不意味着总需求的必然扩张,缺乏明确财政投资导向以及房地产投资尚未实质性回升将导致相关产业缺乏景气快速回升的必要条件。总体而言,我们预计下半年市场将呈现相对强势的振荡走势,单边上涨或下跌的概率均不大。

综上,寻找结构性的行业机会和自下而上寻找优质标的仍将是下半年净值增长的主要来源。我们将采取相对均衡的行业配置策略,以避免市场振荡过程中偏离度过大带来的系统性风险。在此基础上,我们将沿以下方向寻找机会并积极反映于组合的调整:(1)地产、非银行金融等受益于行业政策调整、景气可望继续改善的行业;(2)行业政策风险基本释放、自身盈利增长确定、成长模式清晰的医药行业;以及(3)受益于Win8平板、超级本、中高档3G智能终端等三、四季度可望快速放量的部分电子信息设备子行业;(4)下半年景气可望出现触底回升、竞争优势独特的水产品、饲料行业。

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,本基金已实现收益为-102,037,812.43元,期末基金份额净值0.8585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,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

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2012年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:普丰证券投资基金

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	68,919,134.05	120,051,190.97
结算备付金	3,257,774.84	4,320,076.89
存出保证金	1,750,488.46	2,419,570.10
交易性金融资产	2,497,862,740.42	2,401,733,760.88
其中:股票投资	1,926,588,261.22	1,836,781,642.28
基金投资	-	-
债券投资	571,274,479.20	564,952,118.60
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	-	27,171,598.71
应收利息	7,196,576.00	9,470,464.86
应收股利	1,882,715.89	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	2,580,869,429.66	2,565,166,662.41
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	-	27,902,933.61
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	2,708,869.18	2,811,339.73
应付托管费	541,773.83	562,267.93
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,483,707.57	2,350,266.12
应交税费	2,058.00	2,058.00
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	520,741.24	392,000.00
负债合计	5,257,149.82	34,020,865.39
所有者权益:		
实收基金	3,000,000,000.00	3,000,000,000.00
未分配利润	-424,387,720.16	-468,854,202.98
所有者权益合计	2,575,612,279.84	2,531,145,797.02
负债和所有者权益总计	2,580,869,429.66	2,565,166,662.41

注:报告截止日2012年6月30日,基金份额净值0.8585元,基金份额总额3,000,000,000.00份。

6.2 利润表

会计主体:普丰证券投资基金

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		70,706,935.79	-103,099,016.90
1.利息收入		10,213,757.10	11,743,087.86
其中:存款利息收入		682,136.60	516,785.94
债券利息收入		9,531,620.50	11,201,814.39
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	24,487.53
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-86,054,428.83	33,458,841.48
其中:股票投资收益		-102,387,371.41	26,681,416.07
基金投资收益		-	-
债券投资收益		218,040.03	-7,679,631.66
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		16,114,902.55	14,457,057.07
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		146,504,295.25	-148,300,946.24
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		43,312.27	-
减:二、费用		26,240,452.97	35,254,327.74
1.管理人报酬	6.4.8.2.1	16,343,208.26	21,092,169.87
2.托管费	6.4.8.2.2	3,268,641.68	4,218,433.96
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		6,389,233.48	9,459,827.97
5.利息支出		-	11,965.28
其中:卖出回购金融资产支出		-	11,965.28
6.其他费用		239,369.55	471,930.66
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		44,466,482.82	-138,353,344.64
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		44,466,482.82	-138,353,344.64

6.3 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: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)	3,000,000,000.00	-468,854,202.98	2,531,145,797.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	44,466,482.82	44,466,482.82
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)	3,000,000,000.00	-424,387,720.16	2,575,612,279.84

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)	3,000,000,000.00	573,707,491.71	3,573,707,491.71
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-138,353,344.64	-138,353,344.64
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)	-	-246,000,000.00	-246,000,000.00
五、期末所有者权益(基金净值)	3,000,000,000.00	189,354,147.07	3,189,354,147.07

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

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%。

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》、《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。

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

本基金本报告期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

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	330,224,366.00	7.83%	106,439,723.18	1.73%

6.4.8.1.2 债券交易

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	-	-	3,461,198.60	5.90%

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	280,753.98	7.97%	104,527.49	7.05%

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	89,304.86	1.74%	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	16,343,208.26	21,092,169.87

注: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1.25%,逐日计提,按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×1.25%÷当年天数。

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	3,268,641.68	4,218,433.96

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0.25%,逐日计提,按月支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷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

份额单位:份

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
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	0.13%	0.13%

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。

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

份额单位:份

关联方名称	本期末 2012年6月30日		上年度末 2011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%	7,500,000.00	0.25%
安徽国元信托	1,875,000.00	0.06%	1,875,000.00	0.06%
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

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	68,919,134.05	648,168.07	99,216,546.51	475,061.30

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较期间未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的股票,也没有持有因认购新发或增发而流通受限的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
000059	辽通化工	2012年6月26日	重大事项	7.91	2012年7月3日	8.15	100,457	772,484.34	794,614.87	-
002500	山西证券	2012年5月15日	重大事项	8.19	-	-	80,243	721,837.70	657,190.17	-

注:山西证券股份有限公司2011年度利润分配方案为:向全体股东每10股派发现金0.50元(含税),股权登记日为2012年6月20日,除权除息日为2012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	1,926,588,261.22	74.65
	其中:股票	1,926,588,261.22	74.65
2	固定收益投资	571,274,479.20	22.13
	其中:债券	571,274,479.20	22.13
	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	72,176,908.89	2.80
6	其他各项资产	10,829,780.35	0.42
7	合计	2,580,869,429.66	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	5,464,424.81	0.21
B	采掘业	91,017,810.15	3.53
C	制造业	309,938,596.66	12.03
C0	食品、饮料	65,550,320.80	2.55
C1	纺织、服装、皮毛	2,642,627.09	0.10
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	16,422,978.00	0.64
C5	电子	8,903,222.56	0.35
C6	金属、非金属	71,432,381.15	2.77
C7	机械、设备、仪表	100,697,697.40	3.91
C8	医药、生物制品	43,989,483.66	1.71
C99	其他制造业	299,886.00	0.01
D	电力、煤气及水的生产和供应业	18,644,519.91	0.72
E	建筑业	25,268,050.57	0.98
F	交通运输、仓储业	25,732,950.85	1.00
G	信息技术业	25,757,052.67	1.00
H	批发和零售贸易	24,715,164.03	0.96
I	金融、保险业	279,666,116.91	10.86
J	房地产业	49,290,476.14	1.91
K	社会服务业	7,884,300.48	0.31
L	传播与文化产业	1,888,658.24	0.07
M	综合类	15,527,606.78	0.60
	合计	880,795,728.20	34.20

7.2.2 期末积极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	-	-
B	采掘业	24,420,000.00	0.95
C	制造业	732,719,987.59	28.45
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	51,789,256.03	2.01
C5	电子	78,162,000.00	3.03
C6	金属、非金属	76,279,427.26	2.96
C7	机械、设备、仪表	479,838,076.38	18.63
C8	医药、生物制品	46,651,227.92	1.81
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	25,438,600.80	0.99
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	37,750,000.00	1.47
I	金融、保险业	75,909,343.15	2.95
J	房地产业	65,277,014.64	2.53
K	社会服务业	84,277,586.84	3.27
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	1,045,792,533.02	40.60

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	601318	中国平安	637,260	29,148,272.40	1.13
2	600016	民生银行	4,295,888	25,732,369.12	1.00
3	600036	招商银行	2,066,200	22,562,904.00	0.88
4	601328	交通银行	4,354,969	19,771,559.26	0.77
5	601166	兴业银行	1,436,000	18,639,280.00	0.72
6	600000	浦发银行	2,128,928	17,308,184.64	0.67
7	600030	中信证券	1,309,611	16,540,386.93	0.64
8	600519	贵州茅台	68,830	16,460,694.50	0.64
9	000002	万 科A	1,841,742	16,409,921.22	0.64
10	601988	中国银行	5,469,268	15,423,335.76	0.60

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

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	000157	中联重科	7,999,877	80,238,766.31	3.12
2	600742	一汽富维	3,796,158	74,214,888.90	2.88
3	600690	青岛海尔	5,999,823	70,317,925.56	2.73
4	002106	莱宝高科	3,000,000	60,210,000.00	2.34
5	000415	渤海租赁	6,499,808	49,658,533.12	1.93

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。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动