

鹏华中国50开放式证券投资基金

2012年9月30日

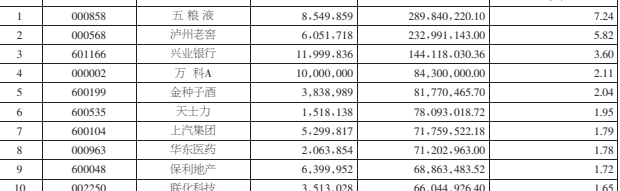
2012年9月30日

5.1 报告期末基金资产组合情况		55 投资组合报告	
序号	项目	金额 (元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	2,217,137,633.49	55.26
	其中:股票	2,217,137,633.49	55.26
2	固定收益投资	1,105,957,173.50	27.56
	其中:债券	1,105,957,173.50	27.56
	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:买入返售的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	662,105,416.22	16.50
6	其他资产	27,280,897.16	0.68
7	合计	4,012,481,120.37	100.00

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	23,119,156.00	0.58
B	采矿业	91,084,253.58	2.28
C	制造业	1,267,458,944.02	31.68
D	食品、饮料	687,118,949.40	17.17
E	纺织、服装、皮毛	-	-
G	木材、家具	-	-
C2	造纸、印刷	-	-
G4	石油、化学、塑胶、塑料	108,794,641.40	2.72
C5	电子	-	-
O6	金属、非金属	19,955,210.88	0.50
C7	机械、设备、仪表	147,251,773.03	3.68
C8	医药、生物制品	304,338,360.31	7.61
C99	其他制造业	-	-
D2	电力、煤气及水的生产和供应业	12,292,442.40	0.31

F	建筑业	—	—
F	交通运输、仓储业	19,562,081.63	0.49
G	信息技术业	109,912,711.06	2.75
H	批发和零售业	89,294,974.14	2.23
I	金融、保险业	265,486,227.54	6.64
J	房地产业	321,111,753.44	8.03
K	社区服务业	17,815,089.68	0.45
L	传播与文化产业	—	—
M	综合类	—	—
	合计	2,217,137,633.49	55.41

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
----	------	------	--------	----------	---------------



5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合			
序号	债券品种	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	844,274,000.00	61.20
3	金融债券	249,100,000.00	2.13
	其中：政策性金融债	249,100,000.00	0.23
4	企业债券	12,583,173.50	0.31
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	1,105,957,173.50	27.64

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	1101094	11央行票据094	3,600,000	348,120,000.00	6.70
2	1101088	11央行票据088	2,800,000	270,676,000.00	8.26
3	1001037	10央行票据37	1,000,000	99,680,000.00	2.49
4	120228	12国债28	5,000,000	59,820,000.00	2.49
5	120229	12国债29	5,000,000	59,760,000.00	2.47

5.7 报告期内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。

5.8 报告期内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。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 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、或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

5.9.2 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。

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,255,036.67
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	644,202.85
4	应收利息	25,065,771.15
5	应收中购款	315,886.40
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—

5.4	合计	27,280,897.16
5.5	报告期末持有的处于转股期的可转换债券余额 本基金报告期末,未持有处于转股期的可转换债券	
5.6	报告期末前十名股票中存在受限股份的说明 本基金报告期末前十名股票中不存在受限股份的情况	
5.6	报告期末前十名股票中存在受限股份的说明 由于四舍五入的原因,投资组合报告中股票分项之和与合计项之间可能存在尾差。	
96 开放式基金资产变动		单位:元
本报告期初基金份额总额		3,577,261,040.69
本报告期基金已申购份额		88,482,840.78
减:本报告期基金已赎回份额		62,401,214.68
本报告期基金净变动份额		

本报告期末基金份额总额	3,603,342,675.79
§7 备查文件目录	
(一) 鹏华中国50开放式证券投资基金合同； (二) 鹏华中国50开放式证券投资基金托管协议； (三) 鹏华中国50开放式证券投资基金2012年第三季度报告(原文)。 7.2 存放地点 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。 7.3 查阅方式 投资者可在本基金管理人营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件,或通过本基金管理人网站 http://www.fundcn.com 查阅。 若对本报告书有任何疑问,可咨询本基金管理人鹏华基金管理有限公司,本公司已开通客户服务热线,咨询电话:067388999。	
鹏华基金管理有限公司	
2012年10月24日	

基金名称	基金类别	运作方式	管理人	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例(%)
ABERDEEN G.L.	股票型	开放式	Abn-Amro Global Services S.A.	40,082,317.34	10.07

FRANK TEMP INV ASIA GR-I-ACC	股票型	开放式	Templeton Asset Management Ltd	7,285,091.39	6.68
SPDR S&P REGIONAL BANKING	股票型	ETF基金	State Street Global Markets LL	6,501,140.18	5.96
SPDR EURO STOXX 50 ETF	股票型	ETF基金	State Street Global Markets LL	6,165,709.90	5.66
US NATURAL GAS FUND LP	股票型	ETF基金	ALPS Distributors Inc	6,062,198.91	5.56
ING U.I.NV-GLOB HIGH DIV-3C	股票型	开放式	ING Investment Management Luxembourg	5,964,410.54	5.47
MARKET VECTORS RUSSIA ETF	股票型	ETF基金	Van Eck Securities Corp	5,443,313.70	4.99
MARKET VECTORS UKLEARN ETF	股票型	ETF基金	Van Eck Securities Corp	4,852,946.12	4.45
FRANK MUT-GLB DSC-I-ACC	股票型	开放式	Franklin Templeton International Services SA	4,530,780.25	4.16
MFS MER-EMERG MARK DEBT-HV	债券型	开放式	Massachusetts Financial Services Co	4,472,007.64	4.10

5.10.4 投资组合公允价值前十名证券中本期没有发行主体经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、处罚证券。

5.10.5 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。

5.10.6 其他资产构成

序号	名称	金额 (人民币元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	3,714,050.52
3	应收股利	84,886.27
4	应收利息	218.16
5	应收申购款	8,917.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,808,072.94

5.10.4 报告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。

5.10.5 报告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。

10.6 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之和可能与实际存在误差。	
9 开放式基金业绩比较	
	单位:元
本报告期初基金份额总额	124,076,865.08
本报告期基金份额申购份额	497,893.36
减:本报告期基金份额赎回份额	4,685,235.96
本报告期基金份额变动份额	-
本报告期末基金份额总额	119,889,522.48
9 备查文件目录	
1. 备查文件目录	
(一) 鹏华环保发展证券投资基金合同	
(二) 鹏华环保发展证券投资基金托管协议	
(三) 鹏华环保发展证券投资基金2012年第3季度报告(原文)	
2. 存放地点	
深圳市福田区福华三路168号深圳证券交易所中心43层鹏华基金管理有限公司	
北京市西城区阜成门大街1号院1号楼中国建设银行股份有限公司	
3. 查阅方式	
投资者可至基金管理人营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件,或通过本管理人网站 http://www.phfund.com.cn	
投资者对本报告如有疑问,可咨询本基金管理人鹏华基金管理有限公司客户服务电话:	
86789999。	
鹏华基金管理有限公司 2012年10月26日	