

2013年3月31日

4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

5. 投资组合概况

权益投资	-	-	-		
其中：股票	-	-	-		
2 固定收益投资	1,481,257,712.30	82.15	-		
其中：债券	1,481,257,712.30	82.15	-		
资产支持证券	-	-	-		
3 金融衍生品投资	-	-	-		
4 买入返售金融资产	207,000,510.50	11.48	-		
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	701,98,420.84	3.89	-		
其他资产	44,551,491.51	2.47	-		
7 合计	1,803,008,135.15	100.00	-		
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合					
5.2.1 报告期末按行业分类的股票投资组合					
5.2.2 报告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					
5.2.3 报告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					
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	国债债券	-	-		
2	央行票据	-	-		
3	金融债券	-	-		
	其中：政策性金融债	-	-		
4	企业债券	1,423,820,058.03	138.69		
5	企业短期融资券	-	-		
6	中期票据	-	-		
7	可转债	57,437,654.27	5.59		
8	其他	-	-		
9 合计		1,481,257,712.30	144.29		
5.5 报告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					
序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	122113	11新钢债	899,950	93,234,820.00	9.02
2	122809	11鲁国债	871,680	88,475,520.00	8.68
3	122658	12鲁高债	800,000	83,440,000.00	8.13
4	122545	12蒙高折	800,000	82,640,000.00	8.05
5	124095	12六开债	700,000	71,673,000.00	6.98
5.6 报告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					

5.7 报告期内被认定为价值点值基金资产净值比例大小排名的前五名证券投资明细

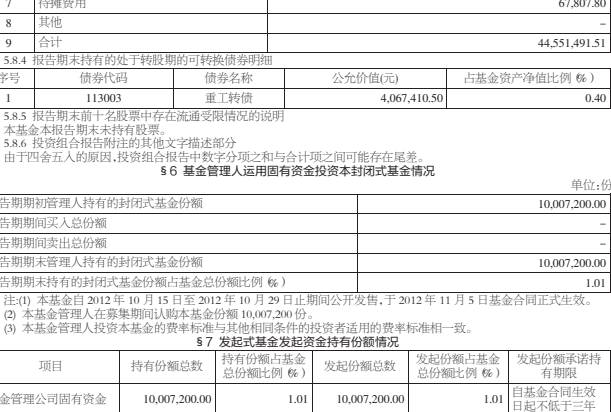
5.8 投资组合中债券明细表

5.8.1 投资组合中债券明细表

5.8.2 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。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额 (元)
1	存出保证金	276,052.81
2	应收证券清算款	17,855.77
3	应收股利	-
4	应收利息	44,189,775.13
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-



金管理公司高级管理	-	-	-	-	-
-----------	---	---	---	---	---

基金管理人员	200,135.00	0.02	--	--
基金管理公司股东	--	--	--	--
其他	--	--	--	--
合计	10,207,335.00	1.03	10,007,200.00	1.01

注：上表中基金经理等人持有份额小于100万股，未计入公允价值变动。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

（一）《鹏华中小企业债增信专项计划证券投资基金合同》；

（二）《鹏华中小企业债增信专项计划证券投资基金托管协议》；

（三）《鹏华中小企业债增信专项计划证券投资基金 2013 年第 1 季度报告》（原文）。

8.2 存查地点

深圳市福田区福华一路 168 号国际商会大厦中心 30 楼 鹏华基金管理有限公司
深圳市福田区福华一路 708 号招商银行股份有限公司总行

8.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内查阅，也可支付工本费购买复印件，或通过本基金管理人网站 <http://www.pf-fund.com> 查阅。

投资者若对本报告书如有疑问，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：78878899。

鹏华基金管理有限公司
2013 年 4 月 20 日

9	002024	苏宁云商	523,494	3,334,656.78	1.96
10	000063	中兴通讯	274,930	3,079,216.00	1.81

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 (%)
600276	恒瑞医药	149,218	5,015,216.98	2.85
600718	东软集团	155,945	1,364,518.75	0.90
600436	片仔癀	10,000	1,263,700.00	0.74
600585	海螺水泥	65,210	1,111,830.50	0.65
600251	冠城股份	68,591	1,093,340.54	0.64

[illegible]

	单位:元
报告期期初基金份额总额	211,535,483.94
报告期基金已申购份额	14,386,062.99
本期报告期基金总额申购份额	19,395,966.12
报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	206,525,580.61

注:总申购份额含申购和再投、转换入份额,总额赎回份额含转换出份额。

8.7 备查文件目录

1. 备查文件目录

① 中国证监会基金监管委员会批准设立招商基金基金管理有限公司的文件;

② 中国证监会基金监管委员会批准招商证券 100 指数证券投资基金设立的文件;

③ 《招商证券 100 指数证券投资基金基金合同》;

④ 《招商沪深 100 指数证券投资基金基金托管协议》;

⑤ 《招商证券 100 指数证券投资基金基金招募说明书》;

⑥ 《招商证券 100 指数证券投资基金基金 2013 年第 1 季度报告》。

2. 存放地点

招商基金管理有限公司
地址:中国深圳前海大道 7088 号招商银行大厦
3. 查阅方式

投资者对本招商基金管理有限公司互联网网站上查阅,或者在营业时间内到招商基金管理有限公司。如要查阅,可至招商基金管理有限公司。如要查阅,可至招商基金管理有限公司。

客户服务中心电话:400-887-8855

网址: <http://www.cmfchina.com>

招商基金管理有限公司