

Disclosure 信息披露

(上接B47版)
 客户服务热线:95538
 联系人:陆娟
 电话:0531-81283938
 传真:0531-81283900
 网址:www.dqzq.com.cn
(81)日信证券有限责任公司
 注册地址:呼和浩特市新城二环路林荫路18号
 法定代表人:王洪忠
 联系人:李俊
 电话:010-66880800
 联系人:陈若彤
 电话:010-66155337
 传真:010-66155337
 网址:www.rmqz.com.cn
(82)华龙证券有限责任公司
 注册地址:甘肃省兰州市静宁路308号
 法定代表人:李俊
 联系人:杨晓天
 联系电话:0931-4784509
 传真:0931-489619
 甘肃省客服电话:96668
 网址:www.hlzq.com.cn
(83)湘财证券有限责任公司
 办公地址:湖南长沙芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心C2层
 法定代表人:周立
 联系人:李海霞
 联系电话:0731-83440319
 联系人:胡蓉
 电话:0731-84779521
 传真:0731-84404319
 网址:www.xcjq.com
(84)华融证券有限责任公司
 注册地址:福州东大路157号新天地大厦7、8层
 法定代表人:黄金荣
 客服电话:0591-96326
 联系人:陈嘉福
 电话:0591-87227801/
 传真:0591-87841150
 网址:www.hfzq.com.cn
(85)大通证券股份有限公司
 注册地址:大连市中山区人民路24号
 办公地址:大连市沙河口区会展路129号大连期货大厦30-3层
 法定代表人:张智勇
 联系人:王洪岩
 电话:0411-9672320
 传真:0411-9672310
 客户服务电话:4008-169-169
 网址:www.daton.com.cn
(86)中原证券股份有限公司
 地址:郑州市郑东新区商务外环路10号
 法定代表人:菅明军
 联系人:程雁
 电话:0371-65585645
 网址:www.ccny.com.cn
(87)西南证券股份有限公司
 注册地址:重庆市中区新华路
 办公地址:重庆江北新区红锦大道2号
 法定代表人:王珠林
 客服电话:400896096
 联系人:陈俊峰
 电话:023-63786212
 网址:www.swsc.com.cn
(88)山西证券股份有限公司
 注册地址:山西太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼
 法定代表人:侯巍
 客服电话:0351-8686868
 联系人:张丽娟
 电话:0351-8686703
 传真:0351-8686619
 网址:www.sxzc.com.cn
(89)天源证券经纪有限公司
 注册地址:青海省西宁市长江路53号汇通大厦六楼
 办公地址:深圳市福田区福中一路100号平安大厦14楼
 法定代表人:林青
 电话:0755-33331188
 传真:0755-33328181
 统一客服电话:400643218
 公司网址:www.tyazq.com.cn
(90)天弘证券股份有限公司
 注册地址:湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦四楼
 法定代表人:余磊
 联系人:董芳
 电话:(027)87188822、(028) 86711410
 传真:(027)87618863
 网址:www.thzq.com.cn
(91)国信证券股份有限公司
 注册地址:江西省南昌市北京西路88号江信国际大厦A座
 办公地址:江西省南昌市北京西路88号江信国际大厦A座4楼
 法定代表人:何小鹏
 联系人:徐芸
 电话:0791-8285337
 传真:0791-82829291
 网址:www.guotai.com.cn
(92)华创证券有限责任公司
 注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01(1)单元
 办公地址:上海市肇嘉浜路750号
 法定代表人:洪家新
 联系人:陈静
 网站:www.hczq.com.cn
 客户服务热线:021-32109999/029-6819888/4001099918
(三)注册证券经纪人
 名称:大成基金管理有限公司
 注册地址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层
 办公地址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层
 办公场所:福田区、南山区、福田区、南山区
 联系人:张树忠
 电话:0755-83183388
 电话:0755-83193239
 联系人:范瑶
(四)律师事务所和会计师事务所
 律师事务所名称:通力律师事务所
 注册地址:上海市浦东新区银城中路200号上海证大广场南塔21楼
 办公地址:上海市浦东新区银城中路200号上海证大广场南塔21楼
 办公场所:福田区、南山区、福田区、南山区
 电话:021-68810880
 会计师事务所名称:普华永道中天会计师事务所有限公司
 注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦4楼
 办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦4楼
 法定代表人:李丹
 经办注册会计师:薛静、刘颖
 电话:021-23238888
 传真:021-23238800
 联系人:刘颖

四、基金的名称
五、基金的类型

基金类型:契约型
 基金运作方式:开放式
六、基金的投资目标
 以价值增长为主要投资方向,在有效分散投资风险的基础上,通过资产配置和组合投资的动态调整,达到超越市场的长期增值之目的,实现基金资产的长期增值。

七、基金的投资范围
 本基金的投资范围限于国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具,主要投资对象为沪深两市A股中PB值较低,具有可持续发展潜力、盈利水平超过行业平均水平,具有核心竞争力的优质企业。

八、基金的投资策略
 本基金投资策略分三个层次:资产配置和行业配置层面下,在积极策略、个股选择层面自上而下,在积极策略层面,本基金遵循投资比例不低于20%,股票投资重点集中在:股中PB值、具有可持续发展潜力、盈利水平超过行业平均水平,具有核心竞争力的优质企业。

九、基金的风险控制
 1. 投资决策
 本基金管理人将主要通过投资决策委员会资产配置和具体证券的买卖:
 (1) 国家宏观经济、法律法规及基金合同的相关规定;
 (2) 国家宏观经济环境及其对证券市场的影响;
 (3) 国家货币政策、产业政策及证券市场政策;
 (4) 行业、地区发展前景;
 (5) 上市公司财务状况、行业地位、经济和市场需求状况及其当前市场价格;
 (6) 证券市场资金供求状况及未来走势。

十、基金的业绩比较基准
 本基金原业绩比较基准为:中证500指数收益率×80%+中国国债收益率×20%。自2008年3月1日起,该基金业绩比较基准更改为:(沪深300指数×80%+中国国债指数×20%)。自2013年6月1日起,该基金业绩比较基准更改为:(沪深300指数×80%+中国国债指数×20%)。

十一、基金的风险控制
 本基金管理人将主要通过投资决策委员会资产配置和具体证券的买卖:
 (1) 国家宏观经济、法律法规及基金合同的相关规定;
 (2) 国家宏观经济环境及其对证券市场的影响;
 (3) 国家货币政策、产业政策及证券市场政策;
 (4) 行业、地区发展前景;
 (5) 上市公司财务状况、行业地位、经济和市场需求状况及其当前市场价格;
 (6) 证券市场资金供求状况及未来走势。

十二、基金的投资组合报告
 本基金管理人按照基金合同规定,在报告期内,本基金投资组合符合基金合同的约定,本基金投资组合符合基金合同的约定,本基金投资组合符合基金合同的约定,本基金投资组合符合基金合同的约定。

十三、基金的投资组合报告
 本基金管理人按照基金合同规定,在报告期内,本基金投资组合符合基金合同的约定,本基金投资组合符合基金合同的约定,本基金投资组合符合基金合同的约定,本基金投资组合符合基金合同的约定。

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	股权投资	5,525,808,823.40	69.49
2	固定收益	5,252,808,823.40	69.49
3	其他资产	1,652,081,133.70	21.86
4	其中:债券	1,652,081,133.70	21.86
5	资产支持证券	-	0.00
6	买入返售金融资产	-	0.00
7	其中:买入返售金融资产	-	0.00
8	其他金融资产	-	0.00
9	其中:应收利息和债券应计利息	621,997,341.01	8.23
10	其他资产	32,287,550.91	0.43
11	合计	7,559,174,849.02	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	-	0.00
B	采矿业	105,240,000.00	1.40
C	制造业	1,771,225,269.29	23.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	0.00
E	建筑业	184,278,702.24	2.45
F	批发和零售业	19,198,789.93	2.55
G	交通运输、仓储和邮政业	92,957,823.00	1.23
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息技术、软件和信息技术服务业	121,151,811.28	1.61
J	金融业	2,062,435,009.29	27.37
K	房地产业	477,570,258.37	6.34
L	租赁和商务服务业	-	0.00
M	科学研究和技术服务业	-	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	228,080,000.00	3.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	0.00
P	教育	-	0.00
Q	卫生和社会工作	-	0.00
R	文化、体育和娱乐业	17,671,092.00	0.23
S	综合	-	0.00
T	合计	5,525,808,823.40	69.71

名称:普华永道中天会计师事务所有限公司
 地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
 办公地址:上海市南汇区滴水湖环湖大道111号
 法定代表人:杨俊
 联系人:李天
 电话:021-23238888
 经办注册会计师:李天、申峰、刘颖
 联系人:魏俊伟

本基金名称:鹏华中国50开放式证券投资基金
 基金类型:混合型

六、基金的投资目标
 以价值增长为本,通过集中投资于基本面和成长性良好且估值相对被低估的股票,中长期持有结合适度波段操作,以求在有效控制风险的前提下分享中国经济长期增长带来的基金资产的长期增值。

七、基金的投资方向
 本基金以股票、中央银行票据、债券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具为主要投资方向。

八、基金的投资策略
 1. 债券投资策略
 本基金债券投资以组合配置为基础,以分散组合风险为目的,采取积极主动的投资策略,谋求超额收益。如投资组合面临严重不利风险时,将适度参与有价证券的回购和融资。

九、基金的风险控制
 本基金管理人将主要通过投资决策委员会资产配置和具体证券的买卖:
 (1) 国家宏观经济、法律法规及基金合同的相关规定;
 (2) 国家宏观经济环境及其对证券市场的影响;
 (3) 国家货币政策、产业政策及证券市场政策;
 (4) 行业、地区发展前景;
 (5) 上市公司财务状况、行业地位、经济和市场需求状况及其当前市场价格;
 (6) 证券市场资金供求状况及未来走势。

十、基金的业绩比较基准
 本基金原业绩比较基准为:中证500指数收益率×80%+中国国债收益率×20%。自2008年3月1日起,该基金业绩比较基准更改为:(沪深300指数×80%+中国国债指数×20%)。自2013年6月1日起,该基金业绩比较基准更改为:(沪深300指数×80%+中国国债指数×20%)。

十一、基金的投资组合报告
 本基金管理人按照基金合同规定,在报告期内,本基金投资组合符合基金合同的约定,本基金投资组合符合基金合同的约定,本基金投资组合符合基金合同的约定,本基金投资组合符合基金合同的约定。

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	股权投资	2,734,070,649.28	68.53
2	固定收益	2,734,070,649.28	68.53
3	其他资产	649,965,000.00	16.29
4	其中:债券	649,965,000.00	16.29
5	资产支持证券	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	其中:买入返售金融资产	-	-
8	其他金融资产	-	-
9	其中:应收利息和债券应计利息	562,427,238.05	14.10
10	其他资产	42,974,844.44	1.08
11	合计	3,989,437,731.77	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,534,240,063.88	38.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	101,520,000.00	2.57
E	建筑业	269,298,925.01	6.81
F	批发和零售业	171,022,580.80	4.33
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	197,409,509.95	4.98
K	房地产业	363,376,661.80	9.19
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	27,914,907.84	0.71
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	69,448,000.00	1.76
T	合计	2,734,070,649.28	69.16

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	600878	伊利股份	8,043,077	254,804,679.36	6.45
2	600518	美盛集团	27,000,000	177,390,000.00	4.49
3	600535	华光股份	2,397,464	160,741,483.80	4.07
4	000963	华冠国际	3,264,080	159,572,060.00	3.53
5	000423	烟台冰塔	4,297,820	138,055,622.00	3.49
6	000100	TCL集团	46,999,975	123,139,934.50	3.11
7	600312	华电电气	13,127,605	114,341,935.55	2.89
8	000002	万科A	10,000,000	107,600,000.00	2.72
9	601398	工商银行	22,999,879	93,149,509.95	2.36
10	600557	康缘药业	3,110,409	89,548,675.11	2.27

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	601318	中国平安	10,000,000	417,700,000.00	5.54
2	600000	浦发银行	33,949,927	339,354,268.71	4.40
3	601166	兴业银行	19,197,619	323,118,808.70	4.51
4	600016	招商银行	19,525,539	246,607,557.37	3.27
5	600066	民生银行	24,412,223	235,334,793.72	3.12
6	000826	鲁商环保	5,000,000	229,980,000.00	3.03
7	000641	伟星电气	7,000,000	199,090,000.00	2.65
8	600518	康美药业	11,099,777	194,609,058.28	2.58
9	000002	万科A	15,785,116	169,847,848.16	2.25
10	600561	阳光照明	16,000,000	159,840,000.00	2.12

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债券	296,261,007.00	7.62
2	央行票据	198,041,000.00	5.19
3	金融债	451,399,000.00	5.99
4	其中:政策性金融债	451,399,000.00	5.99
5	企业债	-	0.00
6	中期票据	-	0.00
7	可转债	-	0.00
8	其他	13,510,096.00	0.18
9	合计	1,652,081,133.70	21.02

序号	股票代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1001042	10央行票据42	2,300,000	229,931,000.00	3.05
2	1001060	10央行票据60	1,800,000	179,841,000.00	2.39
3	1001047	10央行票据47	1,500,000	149,940,000.00	1.99
4	010107	21国债(7)	1,403,980	147,333,661.20	1.96
5	1001032	10央行票据32	1,200,000	119,976,000.00	1.59

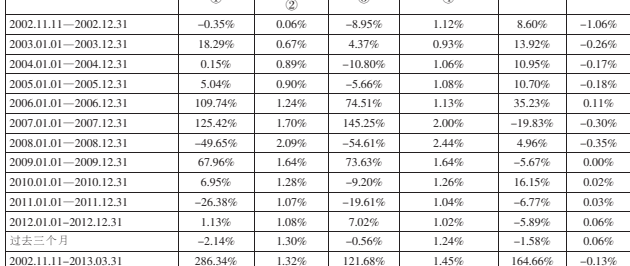
6. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
 本基金本报告期末未持有资产支持证券。
 7. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细
 本基金本报告期末未持有权证。
 8. 投资组合报告附注
 (1) 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。
 (2) 本基金持有的前十名证券中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。
 (3) 本基金持有的其他证券投资
 (4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
 本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。
 (5) 报告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。
 (6) 由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,581,216.16
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收股利	-
5	应收申购款	30,125,720.47
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	32,287,550.91

(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) 报告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。
 (6) 由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。

十一、基金业绩
 基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益;基金的过往业绩并不构成对未来业绩表现的承诺。投资者有风险,投资需谨慎。请在作出投资决策前仔细阅读本基金的招募说明书。

(一) 自基金合同生效以来(2002年11月11日至2013年3月31日)基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比:



自基金合同生效以来基金基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图
 大成价值增长证券投资基金(2002年11月11日至2013年3月31日)

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准标准差④	①-③	②-④
2002.11.11—2002.12.31	-0.35%	0.06%	-8.95%	1.12%	8.60%	-1.06%
2003.01.01—2003.12.31	18.29%	0.67%	4.37%	0.93%	13.92%	-0.26%
2004.01.01—2004.12.31	0.15%	0.89%	-10.80%	1.06%	10.95%	-0.17%
2005.01.01—2005.12.31	5.04%	0.90%	-5.66%	1.08%	10.70%	-0.18%
2006.01.01—2006.12.31	109.74%	1.24%	74.51%	1.15%	35.23%	0.11%
2007.01.01—2007.12.31	125.42%	1.70%	145.25%	2.00%	-19.83%	-0.30%
2008.01.01—2008.12.31	-49.65%	2.09%	-54.61%	2.44%	4.96%	-0.35%
2009.01.01—2009.12.31	67.96%	1.64%	73.67%	1.64%	-5.71%	0.09%
2010.01.01—2010.12.31	6.95%	1.28%	-9.20%	1.26%	16.15%	0.02%
2011.01.01—2011						