鹏华新兴产业股票型证券投资基金

2013 半年度 报告摘要

2013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:招商银行股份有限公司
送出日期:2013年8月27日

§1 重要提示

1.1 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年8月22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2013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	鹏华新兴产业股票
基金主代码	206009
交易代码	206009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年6月15日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	351,469,554.67份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在适度控制风险并保持良好流动性的前提下,控掘未来推动经济发展的新兴产业并从中精选优质个股,力求超额收益与长期资本增值。
投资策略	1、资产配置策略 本基金通过对宏观经济、微观经济运行态势、政策环境、利率走势、证券市场走势及证券市场现阶段的系统性风险以及未来一段时期内各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估,运用定量及定性相结合的手段,制定股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。 2、股票投资策略 本基金通过跟踪、分析经济运行态势、经济政策以及产业结构的优化升级,识别经济发展过程中具有良好发展前景的新兴产业及相关上市公司,针对各类公司的不同特征,通过自上而下及自下而上相结合的方法筛选出优秀的上市公司构建投资组合。 3、债券投资策略 本基金通过久期配置、类属配置、期限结构配置等,采取积极主动的投资策略,在严格控制风险的前提下,发掘和利用市场失衡提供的投资机会,实现债券组合增值。 4、权证产品投资策略 本基金通过对权证标的证券基本面的研究,并结合权证定价模型及价值挖掘策略、价差策略、双向权证策略等寻求权证的合理估值水平,追求稳定的当期收益。
业绩比较基准	中证新兴产业指数收益率×75%+中证综合债指数收益率×25%
风险收益特征	本基金属于股票型基金,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,属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种。

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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张戈	张燕
	联系电话	0755-82825720	0755-83199084
	电子邮箱	zhangge@phfund.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		4006788999	95555
传真		0755-82021126	0755-83195201

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
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43层鹏华基金管理有限公司 深圳深南大道7088号招商银行大厦招商银行股份有限公司

§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(2013年1月1日 - 2013年6月30日)
本期已实现收益	63,963,874.77
本期利润	49,818,331.07
加权平均基金份额本期利润	0.0997
本期基金份额净值增长率	6.61%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0486
期末基金资产净值	368,562,743.35
期末基金份额净值	1.049

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。

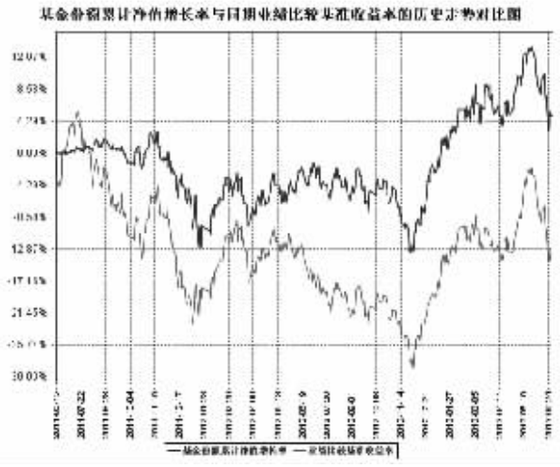
3.2 基金净值表现

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	-7.98%	1.47%	-12.02%	1.56%	4.04%	-0.09%
过去三个月	-2.24%	1.12%	-2.38%	1.24%	0.14%	-0.12%
过去六个月	6.61%	1.08%	5.30%	1.20%	1.31%	-0.12%
过去一年	8.26%	0.99%	1.84%	1.10%	6.42%	-0.11%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	4.90%	0.94%	-14.46%	1.15%	19.36%	-0.21%

注:基金业绩比较基准=中证新兴产业指数收益率×75%+中证综合债指数收益率×25%

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、鹏华新兴产业股票型证券投资基金基金合同于2011年6月15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、37只开放式基金和7只社保组合,经过近15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		
梁浩	本基金基金经理	2011年7月14日	-	5	梁浩先生,国籍中国,中国人民大学经济学博士,5年证券从业经验。曾任职于信息产业部电信研究院,从事产业政策研究;2008年5月加盟鹏华基金管理有限公司,从事研究分析工作,担任研究部高级研究员、基金经理助理,2011年7月起担任鹏华新兴产业股票型证券投资基金基金经理。梁浩先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理发生变动,由梁浩先生继续担任本基金基金经理。
陈鹏	本基金基金经理	2011年6月15日	2013年3月16日	10	陈鹏先生,国籍中国,清华大学工商管理硕士,10年证券从业经验。曾在联合证券有限责任公司任行业研究员;2006年5月加入鹏华基金管理有限公司从事行业研究工作,历任行业研究员、鹏华价值优势股票型证券投资基金(LOF)基金经理助理,2007年8月至2011年1月担任鹏华行业成长证券投资基金基金经理,2008年6月至2011年5月担任鹏华普丰基金基金经理,2011年6月至2013年3月担任鹏华新兴产业股票型证券投资基金基金经理,2011年1月起至今担任鹏华中国50开放式证券投资基金基金经理,2013年1月起兼任鹏华普丰基金基金经理。陈鹏先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理发生变动,陈鹏先生不再担任本基金基金经理。

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对基金财产造成损失的异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价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%的交易次数为2次,主要原因在于指数成份股交易不活跃导致。

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

2013年1季度,我们以稳健成长的原则,将仓位大部分配置在以医药、TMT为主的成长类公司上,基金取得相对较好的收益。2季度, 我们对以成长股为代表的创业板的大幅上涨和大盘股低迷预料不足。4月底5月初,我们集中减持了一些前期收益较高的成长类公司,基金仓位有所下降;另一方面,新兴产业基金重仓的一些医药股在一季度涨幅较高,但二季度受广东招标政策的影响,整体表现不佳。基金2季度业绩相对不理想,导致整体上半年业绩并不突出。

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6.61%,同期上证综指下跌12.78%,深证成指下跌15.60%,沪深300指数下跌12.78%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

如我们在一季报中所担心,宏观数据在2季度开始出现疲态。汇丰PMI4-6月份的数据分别为50.4、49.2和48.3;开始下降至枯荣线以下。工业增加值同比增速降低至10%以下,4-5月维持在9.4%的水平。PPI从12年3月份开始,持续14个月的负增长,未出现任何改观。整体看,宏观经济有通缩的迹象。

1季度时,我们对2季度的宏观经济有较为明确的看法、同时我们认为,"经过1季度的大幅上涨,成长类的公司现在估值已经较高,一些已经经历过市场检验的优秀公司,其2013年的估值已经至30倍以上。除非盈利超出预期,否则很难指望这类公司继续大幅上涨"。现在回顾,对宏观经济和市场缺乏系统性机会的看法是正确的,但对成长类公司的看法与市场走势之间出现偏差。目前时点看3季度,我们认为,创业板已经有一定泡沫,从3季度开始,各类公司全年的盈利状况将逐步清晰,很多公司将开始经历业绩的检验。

我们认为,宏观经济将持续低迷,市场在未来很长时间内都会是结构性的个股机会。我们仍然坚持成长类的投资风格,在成长股的选择上,坚持以公司价值和基本面的分析作为投资的主要依据,以合理的估值,耐心配置优秀的成长类公司。

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,本基金期末可供分配利润为17,093,188.68元,期末基金份额净值1.049元。

4.7.2本基金本报告期内未进行利润分配。

4.7.3根据相关法律法规及本基金合同的规定,本基金管理人将会综合考虑各方面因素,在严格遵守规定前提下,对本报告期内可供分配利润适时作出相应安排。

§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

托管人声明,在本报告期内,基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、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,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§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:鹏华新兴产业股票型证券投资基金

报告截止日:2013年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
资 产:		
银行存款	93,840,273.40	192,819,134.32
结算备付金	674,202.02	908,228.83
存出保证金	215,960.13	250,000.00
交易性金融资产	276,626,166.82	501,496,345.00
其中:股票投资	276,626,166.82	501,496,345.00
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	-	28,387,516.64
应收利息	18,829.97	38,049.54
应收股利	64,125.00	-
应收申购款	85,224.14	180,989.90
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	371,524,781.48	724,080,264.23
负债和所有者权益	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012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	-	-
应付赎回款	1,106,877.51	2,168,707.59
应付管理人报酬	475,588.21	854,057.76
应付托管费	79,264.68	142,342.99
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,117,751.29	621,051.07
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	182,556.44	354,180.55
负债合计	2,962,038.13	4,140,339.96
所有者权益:		
实收基金	351,469,554.67	732,003,291.05
未分配利润	17,093,188.68	-12,063,366.78
所有者权益合计	368,562,743.35	719,939,924.27
负债和所有者权益总计	371,524,781.48	724,080,264.23

注:报告截止日2013年6月30日,基金份额净值1.049元,基金份额总额351,469,554.67份。

6.2 利润表

会计主体:鹏华新兴产业股票型证券投资基金

本报告期:2013年1月1日 至 2013年6月30日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
一、收入		56,560,083.79	28,689,904.56
1.利息收入		523,488.87	816,574.10
其中:存款利息收入		522,895.09	816,196.68
债券利息收入		593.78	377.42
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)		69,905,467.92	-24,308,903.01
其中:股票投资收益		66,891,923.97	-28,575,821.79
基金投资收益		-	-
债券投资收益		103,654.22	152,874.08
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		2,909,889.73	4,114,044.70
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-14,145,543.70	51,861,091.72
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		276,670.70	321,141.75
减:二、费用		6,741,752.72	10,746,619.02
1.管理人报酬	6.4.8.2.1	3,934,780.09	6,715,154.33
2.托管费	6.4.8.2.2	655,796.77	1,119,192.38
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		1,960,828.90	2,704,275.90
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用		190,346.96	207,996.41
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		49,818,331.07	17,943,285.54
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		49,818,331.07	17,943,285.54

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:鹏华新兴产业股票型证券投资基金

本报告期:2013年1月1日 至 2013年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013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)	732,003,291.05	-12,063,366.78	719,939,924.27
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	49,818,331.07	49,818,331.07
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)	-380,533,736.38	-20,661,775.61	-401,195,511.99
其中:1.基金申购款	25,536,176.45	1,753,776.01	27,289,952.46
2.基金赎回款	-406,069,912.83	-22,415,551.62	-428,485,464.45
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)	351,469,554.67	17,093,188.68	368,562,743.35
项目	上年度可比期间 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)	962,286,970.90	-47,458,247.89	914,828,723.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	17,943,285.54	17,943,285.54
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)	-150,349,596.31	4,549,192.74	-145,800,403.57
其中:1.基金申购款	124,742,578.16	-8,272,256.53	116,470,321.63
2.基金赎回款	-275,092,174.47	12,821,449.27	-262,270,725.20
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)	811,937,374.59	-24,965,769.61	786,971,604.98

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 毕国强 刘慧红

基金管理人负责人 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

鹏华新兴产业股票型证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2011]602号《关于核准鹏华新兴产业股票型证券投资基金募集的批复》核准,由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《鹏华新兴产业股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币1,360,809,713.38元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2011)第209号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华新兴产业股票型证券投资基金基金合同》于2011年6月15日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,361,139,361.80份基金份额,其中认购资金利息折合329,648.42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,基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华新兴产业股票型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具。本基金的投资组合中股票资产占基金资产的60%-95%,其中投资于新兴产业相关的股票占股票资产的比例不低于80%,债券、货币市场工具、权证及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他资产不高于基金资产的40%,基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的3%;基金保留的现金以及到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为:中证新兴产业指数收益率×75%+中证综合债指数收益率×25%。

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》、《鹏华新兴产业股票型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2013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2013年6月30日的财务状况以及2013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

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。

(2)基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴20%的个人所得税,暂不征收企业所得税。2013年1月1日以前,对基金取得的股票的股息、红利收入,由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按50%计入个人应纳税所得额,依照现行税法规定即20%代扣代缴个人所得税,暂不征收企业所得税。自2013年1月1日起,对基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

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、基金注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司("招商银行")	基金托管人、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

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股票交易、权证交易、债券交易、债券回购交易,也没有发生应支付关联方的佣金业务。

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 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,934,780.09	6,715,154.33
其中:支付销售机构的客户维护费	1,554,580.49	2,236,713.69

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1.5%,逐日计提,按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×1.5%÷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 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	655,796.77	1,119,192.38

注:支付基金托管人招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未发生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 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012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
招商银行	93,840,273.40	513,619.75	202,348,419.76	789,642.68

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未参与关联方承销的证券。

6.4.9 期末(2013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

金额单位:人民币元

6.4.9.1.1 受限证券类别:股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600498	烽火通信	2012年7月6日	2013年7月4日	非公开发行流通受限	25.48	16.43	1,000,000	12,740,000.00	16,430,000.00	-

注:(1)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的债券及权证。

(2)烽火通信科技股份有限公司2012年度利润分配方案为:向全体股东每10股派发现金3.200元(含税),以资本公积金向全体股东每 10 股转增 10 股,股权登记日为2013年5月21日,除权除息日为2013年5月22日。

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
300027	华谊兄弟	2013年6月5日	重大事项	28.55	2013年7月24日	31.41	10,000	181,475.24	285,500.00	-
000999	华润三九	2013年6月3日	资产重组	26.55	2013年8月19日	26.51	254,735	7,002,628.12	6,763,214.25	-

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	276,626,166.82	74.46
	其中:股票	276,626,166.82	74.46
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	94,514,475.42	25.44
6	其他各项资产	384,139.24	0.10
7	合计	371,524,781.48	100.00

7.2 期末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	采矿业	-	-
C	制造业	134,406,560.48	36.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,455,214.16	4.19
E	建筑业	21,030,000.00	5.71
F	批发和零售业	8,767,000.00	2.38
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	42,130,843.10	11.43
J	金融业	7,581,779.64	2.06
K	房地产业	4,924,980.30	1.34
L	租赁和商务服务业	8,759,328.40	2.38
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	9,059,251.68	2.46
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	20,658,780.00	5.61
R	文化、体育和娱乐业	3,852,429.06	1.05
S	综合	-	-
	合计	276,626,166.82	75.06

7.3 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

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	600050	中国联通	9,401,089	29,331,397.68	7.96
2	300244	迪安诊断	573,855	20,658,780.00	5.61
3	600498	烽火通信	1,000,000	16,430,000.00	4.46
4	600535	天士力	297,304	11,639,451.60	3.16
5	000527	美的电器	899,922	11,177,031.24	3.03
6	002038	双鹭药业	186,540	10,931,244.00	2.97
7	600276	恒瑞医药	414,472	10,925,481.92	2.96
8	002250	联化科技	506,969	10,134,310.31	2.75
9	002140	东华科技	400,000	9,924,000.00	2.69
10	600887	伊利股份	299,914	9,381,309.92	2.55

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

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	600050	中国联通	37,387,291.14	5.19
2	000539	粤电力A	22,196,433.31	3.08
3	600900	长江电力	20,880,061.78	2.90
4	601991	大唐发电	19,816,365.94	2.75
5	600016	民生银行	14,702,268.94	2.04
6	600011	华能国际	14,443,540.92	2.01
7	601288	农业银行	13,998,885.00	1.94
8	600718	东软集团	13,741,539.26	1.91
9	002140	东华科技	13,004,820.88	1.81
10	600153	建发股份	12,522,678.95	1.74
11	000999	华润三九	11,950,801.95	1.66
12	000527	美的电器	11,805,630.92	1.64
13	002073	软控股份