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:2014年8月26日

鹏华优质治理股票型证券投资基金(LOF)

2014 半年度 报告摘要

2014年6月30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2014年8月21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2014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	鹏华优质治理股票(LOF)
场内简称	鹏华治理
基金主代码	160611
交易代码	160611
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2007年4月25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	4,220,855,556.81份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2007-07-18

2.2 基金产品说明

投资目标	投资于具有相对完善的公司治理结构和良好成长性的优质上市公司,为基金份额持有人谋求长期、稳定的资本增值。
投资策略	①股票投资策略:本基金采取"自上而下"的资产配置和"自下而上"的选股策略相结合的主动投资管理策略。整体资产和行业配置主要根据宏观经济、政策环境及行业发展不同阶段、不同特点等情况确定股票投资比例和行业配置比例,个股方面,主要投资于具有相对完善的公司治理结构和良好成长性的优质上市公司,同时关注那些过去基本面较差但正在发生转折的上市公司,采用多种价值评估方法,多视角地进行分析,努力选择最具有投资价值的公司进行投资。 ②债券投资策略:本基金的债券投资采用久期控制下的主动投资策略,本着风险收益匹配最优、兼顾流动性的原则确定债券各类属资产的配置比例。在个券选择上,本基金综合运用利率预期、收益率曲线估值、信用等级分析、流动性评估等方法来评估个券的投资价值。 ③权证投资策略:本基金将权证看作是辅助性投资工具,其投资原则为有利于基金资产增值,有利于加强基金风险控制。
业绩比较基准	沪深300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型基金、债券基金、混合型基金,为证券投资基金中具有较高风险、较高收益的投资品种。

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	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
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 北京市西城区复兴门内大街55号中国工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(2014年1月1日 - 2014年6月30日)
本期已实现收益	-359,167,645.49
本期利润	-419,510,714.07
加权平均基金份额本期利润	-0.0927
本期基金份额净值增长率	-10.51%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.2416
期末基金资产净值	3,200,956,945.14
期末基金份额净值	0.758

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。

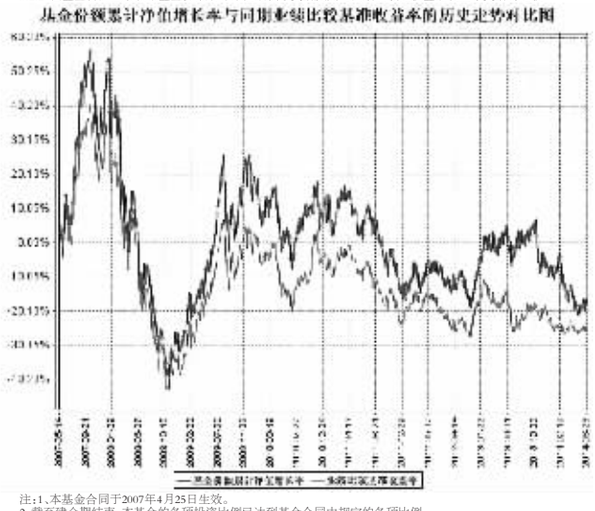
3.2 基金净值表现

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	2.43%	0.72%	0.50%	0.58%	1.93%	0.14%
过去三个月	0.66%	0.87%	1.39%	0.65%	-0.73%	0.22%
过去六个月	-10.51%	1.13%	-3.98%	0.78%	-6.53%	0.35%
过去一年	-12.47%	1.20%	-0.24%	0.88%	-12.23%	0.32%
过去三年	-22.34%	1.20%	-19.18%	0.97%	-3.16%	0.23%
自基金合同生效起至今	-16.76%	1.55%	-25.16%	1.42%	8.40%	0.13%

注:基金业绩比较基准=沪深300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、本基金合同于2007年4月25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51只开放式基金和7只社保组合,经过近16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		
谢可	本基金基金经理	2009年10月13日	-	12	谢可先生,国籍中国,经济学硕士,12年证券从业经验。历任国信证券股份有限公司投资策略分析师、招商基金管理有限公司投资策略分析师及国投瑞银基金管理有限公司专户投资经理。谢可于2009年5月加盟鹏华基金管理有限公司,从事研究投资工作,2009年10月起担任鹏华优质治理股票型证券投资基金(LOF)基金经理。谢可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 管理人对投资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,主要原因分别在于采用量化策略的基金调仓和指数成分股交易不活跃导致。

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A股市场:(1)大势上,沪深300在不停的做俯卧撑,创业板则呈N型,高点在2月中下旬,低点在5月中旬;(2)风格上,小盘成长股继续跑赢,但2013年的风格分化有显著收敛;(3)行业,TMT、军工、电力设备等显著跑赢,煤炭、非银、农业等显著跑输。之所以会出现这个局面,与中国经济目前处于转型期这个时代背景有关。2014年上半年我们的配置整体均衡,不足之处是在5月20日以来的反弹中偏保守,错失了一些投资机会。

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-10.51%,同期上证综指下跌3.20%,深证成指下跌9.59%,沪深300指数下跌7.08%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年宏观经济缺乏内生增长动力,但政策有望予以对冲:(1)我国经济增长动力主要来自出口与投资。美欧经济仍处弱复苏期,我国产品成本上升,出口总体个位数增长。产能过剩与企业债务问题对投资需求的抑制仍然存在,而房地产市场的低迷可能会进一步影响投资需求;(2)政策总体中性、定向宽松。下半年政府在进一步推动项目投资的同时,可能仍然会实行定向降准与定向再贷款。政策的节奏、力度与经济运行态势紧密相关,如果经济出现新一轮快速下行,则政策力度可能会加大;否则,稳增长政策的力度可能会相对温和。

整体而言,下半年的宏观经济和政策格局对股票市场而言是中性的,还是要努力寻找结构性机会。从房地产业发展相对成熟的美日经验来看,后房地产时代房地产及相关产业的增长或将减速,但同时,随着技术的进步、消费的升级,又会有新的行业成长起来。而对于我国,体制改革也有望释放可观的红利。因此,自下而上地选择技术进步、消费升级,符合体制改革趋势的行业和与股是经济结构调整的大背景的。

具体而言我们建议关注以下四个领域:(1)技术进步包括高端装备制造、电动汽车、智能装备、互联网等;(2)消费升级包括现代农业、医药、仪器、环保、文化娱乐服务业等;(3)体制改革包括国企改革、油气改革等;(4)军工也是值得关注的主题,具体地包括军工装备、军工电子、军工信息与通信。

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]40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、债券不活跃市场报价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、债券研究员、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,本基金可供分配利润为-1,019,898,611.67元,期末基金份额净值0.758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

本报告期内,本基金托管人在对鹏华优质治理股票型证券投资基金(LOF)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

本报告期内,鹏华优质治理股票型证券投资基金(LOF)的管理人——鹏华基金管理有限公司在鹏华优质治理股票型证券投资基金(LOF)的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、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,鹏华优质治理股票型证券投资基金(LOF)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

本托管人依法对鹏华基金管理有限公司编制和披露的鹏华优质治理股票型证券投资基金 (LOF)2014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:鹏华优质治理股票型证券投资基金(LOF)

报告截止日:2014年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
资 产:		
银行存款	596,883,774.56	596,497,652.14
结算备付金	4,757,083.39	7,268,647.45
存出保证金	1,521,967.76	3,068,510.49
交易性金融资产	2,691,067,619.78	3,495,559,688.30
其中:股票投资	2,684,560,755.78	3,396,439,688.30
基金投资	-	-
债券投资	6,506,864.00	99,120,000.00
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	113,334.60	2,040,922.19
应收股利	-	-
应收申购款	12,684.83	59,958.20
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	3,294,356,464.92	4,104,495,378.77
负债和所有者权益	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013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	81,954,529.34	-
应付赎回款	3,560,016.31	2,913,869.11
应付管理人报酬	3,897,010.42	5,016,769.42
应付托管费	649,501.75	836,128.24
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	2,253,242.66	3,559,815.10
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,085,219.30	1,142,164.09
负债合计	93,399,519.78	13,468,745.96
所有者权益:		
实收基金	4,220,855,556.81	4,829,145,978.69
未分配利润	-1,019,898,611.67	-738,119,345.88
所有者权益合计	3,200,956,945.14	4,091,026,632.81
负债和所有者权益总计	3,294,356,464.92	4,104,495,378.77

注:报告截止日2014年6月30日,基金份额净值0.758元,基金份额总额4,220,855,556.81份。

6.2 利润表

会计主体:鹏华优质治理股票型证券投资基金(LOF)

本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、收入		-378,920,609.55	243,557,663.82
1.利息收入		2,798,152.09	2,195,633.15
其中:存款利息收入		1,449,260.81	2,030,763.21
债券利息收入		1,348,891.28	24,606.25
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	140,263.69
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-321,723,270.54	114,327,232.90
其中:股票投资收益		-346,091,689.11	76,777,350.94
基金投资收益		-	-
债券投资收益		2,617,710.33	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		21,750,708.24	37,549,881.96
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-60,343,068.58	127,005,330.28
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		347,577.48	29,467.49
减:二、费用		40,590,104.52	58,091,109.70
1.管理人报酬	6.4.8.2.1	26,568,418.84	33,455,902.10
2.托管费	6.4.8.2.2	4,428,069.83	5,575,983.63
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		9,295,501.16	18,820,954.39
5.利息支出		61,471.65	-
其中:卖出回购金融资产支出		61,471.65	-
6.其他费用		236,643.04	238,269.58
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-419,510,714.07	185,466,554.12
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-419,510,714.07	185,466,554.12

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:鹏华优质治理股票型证券投资基金(LOF)

本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014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)	4,829,145,978.69	-738,119,345.88	4,091,026,632.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-419,510,714.07	-419,510,714.07
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)	-608,290,421.88	137,731,448.28	-470,558,973.60
其中:1.基金申购款	13,515,650.93	-2,848,703.58	10,666,947.35
2.基金赎回款	-621,806,072.81	140,580,151.86	-481,225,920.95
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)	4,220,855,556.81	-1,019,898,611.67	3,200,956,945.14
项目	上年度可比期间 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)	5,116,895,456.35	-858,058,405.31	4,258,837,051.04
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	185,466,554.12	185,466,554.12
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)	-262,431,357.01	23,646,747.18	-238,784,609.83
其中:1.基金申购款	23,649,201.75	-2,281,304.02	21,367,897.73
2.基金赎回款	-286,080,558.76	25,928,051.20	-260,152,507.56
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)	4,854,464,099.34	-648,945,104.01	4,205,518,995.33

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 邓召明 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

根据原普润证券投资基金("普润基金")基金份额持有人大会审议通过的《关于普润证券投资基金转换基金运作方式有关事项的议案》和原普华证券投资基金("普华基金")基金份额持有人大会审议通过的《关于普华证券投资基金转换基金运作方式有关事项的议案》,并经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监基金字[2007]100号《关于核准普润证券投资基金基金份额持有人大会的批复》、证监基金字[2007]101号《关于核准普华证券投资基金基金份额持有人大会的批复》及上海证券交易所上证债字[2007]25号《关于终止普润证券投资基金上市的决定》、深圳证券交易所深证复[2007]22号《关于同意普华证券投资基金终止上市并转型为上市开放式基金的批复》的同意,基金普润及基金普华于2007年4月25日终止上市。原《普润证券投资基金基金合同》及原《普华证券投资基金基金合同》于终止上市日起失效,《鹏华优质治理股票型证券投资基金(LOF)基金合同》于同日起生效。原普润证券投资基金及原普华证券投资基金于2007年5月15日并入鹏华优质治理股票型证券投资基金,进行资产合并。原基金普润及原基金普华在5月14日基金份额转换基准日经审计的基金净值分别为1,295,520,211.38元和1,204,163,435.07元,原基金普润及原基金普华已将所实现的全部收益在5月14日转换基准日转换成基金份额。基金普润转换比例为1:2.5910404,基金普华转换比例为1:2.4083268。本基金自2007年5月8日至2007年5月9日期间进行集中申购,集中申购资金不包括利息为9,382,669,143.08元,折合9,382,669,143.08份基金份额,申购资金在集中申购期产生的利息为1,571,880.73元,折合1,571,608.08份基金份额,折算差额272.65元计入基金资产,经安永华明会计师事务所有限公司安永华明(2007)验字第60468989_H01号验资报告予以验证,并已向中国证监会备案。鹏华治理基金的运作方式为上市契约型开放式,存续期限不定。鹏华治理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,基金注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司。

经深圳证券交易所(以下简称"深交所")深证上[2007]第109号文审核同意,本基金2,512,802,220.00份基金份额于2007年7月18日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外,基金份额持有人可通过本基金代销机构赎回或通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后进行上市交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华优质治理股票型证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定,本基金的投资范围限于具有良好流动性的金融工具,主要包括国内依法发行上市的股票、债券、短期金融工具以及由中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金的业绩比较基准为:沪深300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

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》、《鹏华优质治理股票型证券投资基金(LOF)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2014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2014年6月30日的财务状况以及2014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

本报告期本基金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	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(中国工商银行")	基金托管人、基金代销机构
国信证券股份有限公司(国信证券")	基金管理人的股东、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

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013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	-	-	2,230,172,534.47	18.41%

6.4.8.1.2 债券交易

注:本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元发生债券交易。

6.4.8.1.3 债券回购交易

注:本基金本报告期内及上年度可比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

注:本基金本报告期内及上年度可比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 2014年1月1日至2014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	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日至2013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	2,025,003.37	18.53%	3,126,413.88	42.09%

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)证管费等由券商承担的费用

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)证管费等由券商承担的费用

(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 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	26,568,418.84	33,455,902.10
其中:支付销售机构的客户维护费	5,319,067.27	7,017,893.28

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1.50%,逐日计提,按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×1.50%÷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 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	4,428,069.83	5,575,983.63

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

注:本基金本报告期及上年度可比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 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
基金合同生效日(2007年4月25日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	46,794,805.00	46,794,805.00
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	46,794,805.00	46,794,805.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.1087%	0.9640%

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

注: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 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013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
工商银行	596,883,774.56	1,392,992.33	992,095,795.95	1,938,431.81

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金本报告期及上年度可比期间没有参与关联方承销的证券。

6.4.9 期末(2014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

注: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。

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
002565	上海绿新	2014年6月16日	重大事项	8.64	2014年7月7日	9.10	2,000,000	24,547,796.99	17,280,000.00	-

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	2,684,560,755.78	81.49
	其中:股票	2,684,560,755.78	81.49
2	固定收益投资	6,506,864.00	0.20
	其中:债券	6,506,864.00	0.20
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	601,640,857.95	18.26
7	其他各项资产	1,647,987.19	0.05
8	合计	3,294,356,464.92	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(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,828,106,740.84	57.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	169,170,245.64	5.28
F	批发和零售业	-	-
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	3,695,386.60	0.12
J	金融业	467,590,946.84	14.61
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	70,183,799.28	2.19
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	29,702,280.85	0.93
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	116,111,355.73	3.63
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,684,560,755.78	83.87

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	600887	伊利股份	7,900,000	261,648,000.00	8.17
2	601318	中国平安	5,799,943	228,169,757.62	7.13
3	002140	东华科技	10,051,708	169,170,245.64	5.28
4	000400	许继电气	8,403,860	168,497,393.00	5.26
5	600332	白云山	6,228,829	155,035,553.81	4.84
6