

鹏华上证民营企业50交易型开

【2013】半

延续上一期季报的思路,对市场做一个简要思考及展望。

总体来说,市场整体估值有所修复,对经济结构调整的预期前期反映至资本市场,目前市场整体无论估值、流动性、实体经济都处于较平衡的状态,方向性的投资尤为重要。我们强调的估值,虽然经济趋势的实质性方向短期内尚存波动,但从中长期来看,应该逐步步明且逐步向好,目前最大的风险主要来自对经济结构调整带来的短期阵痛,这些阵痛、收紧流动性、清理影子银行等可预见一斑。

因此,我们仍然认为,改革、创新不是一蹴而就,经济趋势的形成是个长期过程,而期间的资本市场的起伏在经济趋势明朗前往往会出现短期波动特征,势必带来资产之间轮动演绎的复杂化和高风险化,资产配置更应谨慎和机会成本相对较高,建议投资者短期注意参与力度和风险控制,尽量将注意力转移到与实体经济相关的中期宏观数据指标,从中长期投资的角度来考虑资产配置,以减少短期市场波动可能造成的投资干扰。

本基金将积极应对各种因素对指数跟踪误差带来的冲击,努力将跟踪误差控制在基金合同规定的范围内,力争为投资者带来较好的投资回报。

4.6 管理人对于估值流程合规等事项的说明

4.6.1 有关人员和估值流程涉及人员的职责分工、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,基金会计对所管理基金的基金会计账务主体、独立建账、独立核算,确保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会计核算,基金会计核算采用总账的财务核算体系进行基金核算及账务处理,每日按照接收或收取数据及权益数据,进行基金估值。基金会计核算采用基金管理人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银行一致后方可对外公布。基金会计除设有专职基金会计核算岗外,还有基金会计复核岗位,负责基金会计核算岗日常业务复核工作,确保基金净值核算无误。

4.6.2 本基金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流程、政策和方法。

4.6.2.1 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,本公司会计结算部相关人员组成。

4.6.2.2 基金不参与或决定基金日常估值:

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价格的讨论,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依据。

4.6.3 基金参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.6.4 本公司没有进行任何定价服务的签约。

4.7 管理人对于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-27,476,931.1元,期末基金份额净值0.897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循了信守说明

本报告期内,本基金托管人在对鹏华上证民营企业50交易型开放式证券投资基金联接基金的托管过程中,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,本基金托管人遵照《鹏华上证民营企业50交易型开放式证券投资基金联接基金的管理人——鹏华基金管理有限公司关于鹏华上证民营企业50交易型开放式证券投资基金联接基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额净值申购赎回价格计算、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;在净值方面运作严格按照基金合同的约定进行。本报告期内,鹏华上证民营企业50交易型开放式证券投资基金联接基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息真实、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上证民营企业50交易型开放式证券投资基金联接基金2013年半年度报告中财务数据、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,以内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)

会计主体:鹏华上证民营企业50交易型开放式证券投资基金联接基金

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	12,036,038.18	13,410,253.16
结算备付金	-	55,632.40
存出保证金	45,208.11	-
交易性金融资产	226,388,483.17	253,670,796.95
其中:股票投资	-	-
基金投资	226,388,483.17	253,670,796.95
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	-	307,384.99
应收利息	2,249.02	2,598.72
应收股利	1,851.36	-
应收申购款	284,445.26	58,506.82
递延所得税资产	-	-
其他资产	5,288.00	5,177.50
资产总计	238,763,563.10	267,510,350.54
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	76,500.46	283,337.54
应付管理人报酬	5,293.37	5,569.95
应付托管费	1,058.68	1,114.00
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	29,179.04	15,122.77
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	173,651.82	50,532.45
负债合计	285,683.37	355,676.71
所有者权益:		
实收基金	265,954,810.84	315,973,657.29
未分配利润	-27,476,931.11	-48,818,983.46
所有者权益合计	238,477,879.73	267,154,673.83
负债和所有者权益总计	238,763,563.10	267,510,350.54

注:报告截止日2013年6月30日,基金份额净值0.897元,基金份额总额265,954,810.84份。

6.2 利润表

会计主体:鹏华上证民营企业50交易型开放式指数证券投资基金联接基金

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		19,592,484.29	14,043,762.11
1.利息收入		53,578.25	53,459.93
其中:存款利息收入		53,578.25	53,459.93
债券利息收入		-	-
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)		-10,133,847.76	-6,599,198.34
其中:股票投资收益		166,420.35	74,428.04
基金投资收益		-10,302,835.15	-6,677,741.18
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		2,567.04	4,114.80
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		29,619,040.01	20,566,337.33
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)		53,713.79	23,163.19
减:一、费用		346,984.75	249,534.50
1.管理人报酬	6.4.8.2.1	34,658.84	36,079.62
2.托管费	6.4.8.2.2	6,931.72	7,215.96
3.销售服务费	-	-	-
4.交易费用		131,664.98	29,543.34
5.利息支出	-	-	-
其中:卖出回购金融资产支出		173,729.21	176,695.58
6.其他费用	-	-	-
二、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		19,245,499.54	13,794,227.61
减:所得税费用	-	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		19,245,499.54	13,794,227.61

6.3 所有者权益 基金份额变动 变动表

会计主体:鹏华上证民营企业50交易型开放式指数证券投资基金联接基金

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	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)	315,973,657.29	-48,818,983.46	267,154,673.83
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	19,245,499.54	19,245,499.54
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)	-50,018,846.45	2,096,552.81	-47,922,293.64
其中:1.基金申购款	46,650,758.03	-2,601,838.59	44,048,919.44
2.基金赎回款	-96,669,604.48	4,698,391.40	-91,971,213.08
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)	265,954,810.84	-27,476,931.11	238,477,879.73

项目

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)

二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)

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)

其中:1.基金申购款

2.基金赎回款

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)

328,449,756.34

-51,697,415.36

270,792,340.98

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	600016	民生银行	5,656,576.47	2.12				
2	600256	广汇能源	2,605,730.03	0.98				
3	600031	三一重工	2,084,246.11	0.78				
4	600518	康美药业	1,669,910.92	0.63				
5	600089	特变电工	1,332,833.81	0.50				
6	600535	天士力	1,304,984.95	0.49				
7	600276	恒瑞医药	1,203,338.95	0.45				
8	600066	宇通客车	889,069.72	0.33				
9	600196	复星医药	862,166.72	0.32				
10	600660	福耀玻璃	775,471.55	0.29				
11	601633	长城汽车	768,809.04	0.29				
12	600703	三安光电	733,814.36	0.27				
13	600143	金发科技	711,855.64	0.27				
14	600083	鹏博士	710,800.98	0.27				
15	600252	中恒集团	688,450.50	0.26				
16	600340	华夏幸福	680,732.40	0.25				
17	600177	雅戈尔	675,702.40	0.25				
18	600208	新湖中宝	596,381.00	0.22				
19	600352	浙江龙盛	589,934.52	0.22				
20	600655	豫园商城	557,964.26	0.21				
注：买入金额按买入成交金额 按成交单乘以成交数量 填列，不考虑相关交易费用。								
7.4.3 累计卖出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	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)				
1	600016	民生银行	7,675,474.79	2.87				
2	600256	广汇能源	3,496,812.13	1.31				
3	600031	三一重工	2,802,273.20	1.05				
4	600518	康美药业	2,209,447.76	0.83				
5	600089	特变电工	1,797,673.00	0.67				
6	600535	天士力	1,726,829.66	0.65				
7	600276	恒瑞医药	1,591,707.57	0.60				
8	600066	宇通客车	1,228,314.72	0.46				
9	600196	复星医药	1,180,680.52	0.44				
10	600660	福耀玻璃	1,086,287.99	0.41				
11	601633	长城汽车	1,085,296.84	0.41				
12	600804	鹏博士	1,025,876.78	0.38				
13	600703	三安光电	1,004,350.78	0.38				
14	600143	金发科技	968,980.03	0.36				
15	600177	雅戈尔	940,972.18	0.35				
16	600340	华夏幸福	934,666.88	0.35				
17	600252	中恒集团	932,447.75	0.35				
18	600208	新湖中宝	921,509.96	0.33				
19	600352	浙江龙盛	821,348.53	0.31				
20	600655	豫园商城	761,618.20	0.29				
注：卖出金额按卖出成交金额 按成交单乘以成交数量 填列，不考虑相关交易费用。								
7.4.4 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额								
			单位：人民币元					
买入股票成本(成交)总额			33,684,026.09					
卖出股票收入(成交)总额			46,199,621.15					
注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额 按成交单乘以成交数量 填列，不考虑相关交易费用。								
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合								
本基金本报告期末未持有债券。								
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细								
本基金本报告期末未持有债券。								
7.7 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。								
7.8 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。								
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细								
金额单位：人民币元								
序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值 占基金资产净值比例(%)			
1	上证民营企业50交易型开放式股票证券投资基金	股票型基金	交易型开放式	鹏华基金管理有限公司	226,388,483.17 94.93			
注：上述基金明细为本基金本报告期末持有的全部基金。								
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明								
7.10.3 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细								
本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资								
7.10.4 本基金投资股指期货的投资政策								
本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资								
7.11 投资组合报告附注								
7.11.3 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、处罚的证券。								
7.11.4 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。								
7.11.5 期末其他各项资产构成								
单位：人民币元								
序号	名称	金额						
1	存出保证金	45,208.11						
2	应收证券清算款	—						
3	应收股利	1,851.36						
4	应收利息	2,289.02						
5	应收申购款	284,445.26						
6	其他应收款	5,288.00						
7	待摊费用	—						
8	其他	—						
9	合计	339,041.75						
7.11.6 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。								
7.11.7 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明								
本基金本报告期末未持有股票								
7.11.8 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，投资组合组合中数字项之和与合计项之间可能存在尾差。								
§ 8 基金份额持有人信息								
8.1 期末基金的份额持有人户数及持有人结构								
份额单位：份								
持有人户数(户)		户均持有的基金份额	机构投资者持有份额		个人投资者持有份额			
			持有份额	占总比例	持有份额 占总比例			
8,588		30,968.19	30,681,491.51	11.54%	235,273,319.33 88.46%			
8.2 期末基金管理人持有的从业人员持有本基金的情况								
项目		持有基金份额总份(份)		占基金总份额比例				
基金管理人所有从业人员持有本基金		736,404.81		0.2769%				
注：A 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人本报告期末未持有本基金份额。								
B 本公司的基金经理本报告期末未持有本基金份额。								
C 截至本报告期末，本基金管理人从业人员投资、持有本基金符合相关法律法规、中国证监会规定及公司相关管理制度的规定。								
§ 9 开放式基金份额变动								
单位：份								
基金合同生效日(2010年8月5日)基金总份额		基金总份额		571,845,507.41				
本报告期期初基金总份额		基金总份额		315,973,657.29				
本报告期基金总申购份额		基金总份额		46,650,758.03				
减：本报告期基金总赎回份额		基金总份额		96,669,604.48				
本报告期基金净申购份额		基金总份额		—				
本报告期末基金总份额		基金总份额		265,954,810.84				
注：总申购份额含红利再投、转换入份额。总赎回份额含转换出份额。								
§ 10 重大事件揭示								
10.1 基金份额持有人大会决议								
本基金本报告期无基金份额持有人大会决议。								
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动								
10.2.1 基金管理人的人事变动：2013年3月，曹毅先生不再担任基金管理人副总裁职务。上述事项已经公司董事会审议通过。								
10.2.2 基金托管人的重大人事变动：报告期内基金托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。								
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼								
本报告期无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的、与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。								
10.4 基金投资策略的改变								
本基金本报告期基金投资策略未改变。								
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况								
报告期内未改聘为本基金审计的会计师事务所。								
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况								
本基金管理人、基金托管人涉及托管业务机构及其高级管理人员在报告期内未受到任何稽查或处罚。								
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况								
10.7.3 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况								
金额单位：人民币元								
券商名称	交易单元数量	成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	备注		
海通证券	1	79,883,647.24	100.00%	72,726.38	100.00%	—		
注：交易单元选择的标准和程序								
1 基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经纪机构，使用其交易单元作为基金的专用交易单元，选择的标准是：								
0 财务状况良好，信誉良好，注册资本不少于3亿元人民币；								
0 履约状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；								
0 经营行为规范，最近二年未发生因重大违规行为而受到中国证监会处罚；								
0 内部管理规范，严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；								
0 具备基金业务所需的高效率、高质量的通讯条件，能提供基金运作全面符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；								
0 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务。								
0 选择交易单元的程序：								
我公司根据上述标准，选定符合条件的证券公司作为租用交易单元的券商。我公司投研部门定期对所选定证券公司的服务进行综合评价，评价内容包括：提供研究报告质量、数量、及时性并提供研究报告的主动性和质量等情况，并依据评价结果确定交易单元交易的具体情况。我公司在比较了多家证券经纪机构的财务状况、经营情况、研究水平、向券商租用交易单元作为基金专用交易单元。本报告期内交易单元未发生变化。								
10.7.4 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况								
金额单位：人民币元								
券商名称	债券交易成交金额	占当期债券成交总额的比例	债券回购成交金额	占当期回购成交总额的比例	权证交易成交金额	占当期权证成交总额的比例	基金交易成交金额	占当期基金成交总额的比例
海通证券	—	—	—	—	—	—	34,291,508.52	100.00%
鹏华基金管理有限公司 2 0 1 3 年 8 月 2 日								