

鹏华盛世创新股票型证券投资基金 (LOF)

【2013】半年度报告摘要

管理费-前一日基金资产净值×0.25%+当年天数/360

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期间均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

本报告期末及上年度末除本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		上年度可比期间	
	2013年1月1日至2013年6月30日	期末余额	2012年1月1日至2012年6月30日	期末余额
中国建设银行	55,523,014.81	309,717.21	129,091,443.67	407,357.93

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期间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股票

6.4.9.1 因认购新发增发证券而于期末持有的流通受限股票

金额单位：人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日期	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
002004	华邦	2013年2月27日	非公开发行股票	14.03	14.05	350,000	4,910,500.00	4,917,500.00	-
4	华泰	2013年2月27日	非公开发行股票	14.03	14.05	350,000	4,910,500.00	4,917,500.00	-

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	复牌开盘价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600088	海螺水泥	2013年5月30日	资产重组	14.29	-	-	399,949	5,325,886.32	5,715,271.21	-

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	232,006,508.01	79.08
2	固定收益投资	232,006,508.01	79.08
3	其中：债券	3,096,670.50	1.06
4	资产支持证券	3,096,670.50	1.06
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
8	银行存款和结算备付金合计	57,017,109.37	19.44
9	其他各项资产	1,249,211.15	0.43
10	合计	293,369,499.03	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	10,349,882.64	3.57
B	采矿业	-	-
C	制造业	123,299,023.74	42.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应	6,486,419.88	2.24
E	建筑业	5,973,966.27	2.06
F	批发和零售业	15,400,947.20	5.32
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	5,350,383.20	1.85
J	金融业	44,542,405.67	15.37
K	房地产业	9,153,605.00	3.16
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	-	-
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	11,449,874.41	3.95
S	综合	-	-
合计		232,006,508.01	80.08

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	000076	北方新基建	1,210,000	21,320,200.00	7.36
2	300145	南京聚宝	555,802	13,600,474.94	4.69
3	600062	华邦医药	648,276	12,978,485.52	4.48
4	601318	中国平安	354,917	12,336,914.92	4.26
5	601398	工商银行	2,930,925	11,782,318.50	4.07
6	601126	四方股份	743,078	10,737,477.10	3.71
7	002004	华邦医药	741,933	10,439,835.97	3.60
8	600537	江南高纤	1,849,922	10,341,063.98	3.57
9	600325	天士力	259,755	10,169,408.25	3.51
10	300346	南大光电	240,308	10,083,323.68	3.48

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有投资明细，应阅读登载于鹏华盛世创新股票型证券投资基金网站

http://www.phfund.com的半年度报告正文。

7.4 期末按行业分类的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	000001	平安银行	26,798,056.86	5.83
2	600795	国电电力	29,754,903.45	5.25
3	601318	中国平安	25,695,416.04	5.05
4	601166	兴业银行	24,132,504.25	4.74
5	601601	中国太保	22,685,006.22	4.46
6	000002	万科A	22,086,634.32	4.34
7	601126	四方股份	20,256,712.30	3.98
8	600104	上汽集团	20,225,477.63	3.97
9	600535	天士力	17,373,983.98	3.41
10	000062	华闻数码	16,729,218.68	3.29
11	300346	南大光电	13,687,389.22	2.69
12	300145	南京聚宝	13,297,342.06	2.61
13	000100	TCL 集团	13,103,766.20	2.57
14	601311	骆驼股份	12,925,842.53	2.54
15	000312	平高电气	12,715,800.27	2.50
16	600362	江西铜业	12,278,062.00	2.41
17	600309	万华化学	11,261,698.60	2.21
18	601668	中国建筑	10,403,626.32	2.04
19	600016	民生银行	10,337,338.20	2.03
20	600527	江南高纤	10,217,919.59	2.01

注：买入金额按买入成交金额 成交单价乘以成交数量 填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 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	601166	兴业银行	47,820,371.47	9.39
2	600104	上汽集团	36,755,480.04	7.22
3	601601	中国太保	35,800,402.90	7.03
4	600016	民生银行	26,866,230.03	5.28
5	600000	浦发银行	25,458,456.30	5.00
6	002038	双鹭药业	23,678,998.97	4.63
7	002065	东华软件	22,109,756.40	4.34
8	600060	海信电器	22,024,853.35	4.33
9	000002	万科A	21,850,196.20	4.29
10	601628	中国人寿	21,401,440.41	4.20
11	600690	青岛海尔	20,262,507.60	3.98
12	600585	海螺水泥	19,306,950.60	3.79
13	000001	平安银行	17,407,972.92	3.42
14	600030	中信证券	17,361,028.61	3.41
15	600383	金地集团	16,343,618.26	3.21
16	600795	国电电力	16,132,740.97	3.17
17	000651	格力电器	15,052,137.89	2.96
18	000069	华侨城A	14,952,152.20	2.94
19	601311	骆驼股份	14,423,858.98	2.83
20	002508	老板电器	14,362,788.03	2.82
21	300032	金龙机电	14,120,508.10	2.77
22	002152	广电运通	14,036,256.94	2.76
23	002025	联化科技	13,802,023.16	2.71
24	600210	平高电气	13,209,604.46	2.59
25	000100	TCL 集团	12,864,466.40	2.53
26	600309	万华化学	12,094,478.50	2.38
27	600809	山西汾酒	11,728,866.10	2.30
28	601633	长城汽车	11,686,639.15	2.28
29	600535	天士力	11,577,933.90	2.27
30	600672	江西铜业	11,285,727.04	2.22
31	600364	川投能源	11,284,574.92	2.22
32	000415	渤海租赁	10,919,645.93	2.14
33	601318	中国平安	10,660,369.25	2.09
34	000568	泸州老窖	10,527,303.59	2.07
35	601098	中南传媒	10,398,026.05	2.04

注：卖出金额按卖出成交金额 成交单价乘以成交数量 填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本及卖出股票的收入总额

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	000001	平安银行	26,798,056.86	5.83
2	600795	国电电力	29,754,903.45	5.25
3	601318	中国平安	25,695,416.04	5.05
4	601166	兴业银行	24,132,504.25	4.74
5	601601	中国太保	22,685,006.22	4.46
6	000002	万科A	22,086,634.32	4.34
7	601126	四方股份	20,256,712.30	3.98
8	600104	上汽集团	20,225,477.63	3.97
9	600535	天士力	17,373,983.98	3.41
10	000062	华闻数码	16,729,218.68	3.29
11	300346	南大光电	13,687,389.22	2.69
12	300145	南京聚宝	13,297,342.06	2.61
13	000100	TCL 集团	13,103,766.20	2.57
14	601311	骆驼股份	12,925,842.53	2.54
15	000312	平高电气	12,715,800.27	2.50
16	600362	江西铜业	12,278,062.00	2.41
17	600309	万华化学	11,261,698.60	2.21
18	601668	中国建筑	10,403,626.32	2.04
19	600016	民生银行	10,337,338.20	2.03
20	600527	江南高纤	10,217,919.59	2.01

注：买入金额按买入成交金额 成交单价乘以成交数量 填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 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	601166	兴业银行	47,820,371.47	9.39
2	600104	上汽集团	36,755,480.04	7.22
3	601601	中国太保	35,800,402.90	7.03
4	600016	民生银行	26,866,230.03	5.28
5	600000	浦发银行	25,458,456.30	5.00
6	002038	双鹭药业	23,678,998.97	4.63
7	002065	东华软件	22,109,756.40	4.34
8	600060	海信电器	22,024,853.35	4.33
9	000002	万科A	21,850,196.20	4.29
10	601628	中国人寿	21,401,440.41	4.20
11	600690	青岛海尔	20,262,507.60	3.98
12	600585	海螺水泥	19,306,950.60	3.79
13	000001	平安银行	17,407,972.92	3.42
14	600030	中信证券	17,361,028.61	3.41
15	600383	金地集团	16,343,618.26	3.21
16	600795	国电电力	16,132,740.97	3.17
17	000651	格力电器	15,052,137.89	2.96
18	000069	华侨城A	14,952,152.20	2.94
19	601311	骆驼股份	14,423,858.98	2.83
20	002508	老板电器	14,362,788.03	2.82
21	300032	金龙机电	14,120,508.10	2.77
22	002152	广电运通	14,036,256.94	2.76
23	002025	联化科技	13,802,023.16	2.71
24	600210	平高电气	13,209,604.46	2.59
25	000100	TCL 集团	12,864,466.40	2.53
26	600309	万华化学	12,094,478.50	2.38
27	600809	山西汾酒	11,728,866.10	2.30
28	601633	长城汽车	11,686,639.15	2.28
29	600535	天士力	11,577,933.90	2.27
30	600672	江西铜业	11,285,727.04	2.22
31	600364	川投能源	11,284,574.92	2.22
32	000415	渤海租赁	10,919,645.93	2.14
33	601318	中国平安	10,660,369.25	2.09
34	000568	泸州老窖	10,527,303.59	2.07
35	601098	中南传媒	10,398,026.05	2.04

注：卖出金额按卖出成交金额 成交单价乘以成交数量 填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本及卖出股票的收入总额