

基金管理人：鹏华基金管理有限公司  
基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2014年8月26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、完整性承担责任个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之一以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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，应阅读半年度报告全文。

本报告附注中财务数据未经审计。

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	鹏华价值优势股票(LOF)
场内简称	鹏华价值
基金代码	160607
交易代码	160607
基金合同生效方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同成立日	2006年7月18日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
基金类型	股票型
基金资产净值总额	9,623,253,667.19份
基金份额净值	不定
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2006-07-18

#### 2.2 基产品说明

投资目标	依托严格的研究流程和投资纪律，强调运用相对估值分析方法，发掘并把握具有长期投资价值的行业和个股，谋求基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金将通过深入研究，选择具有较好发展前景的行业和个股，通过积极主动的投资策略，力求在控制风险的前提下，实现基金资产的稳定增值。
业绩比较基准	中信标普股票综合指数收益率×70%+中信标普债券指数收益率×30%。
风险收益特征	本基金为股票型基金，风险收益特征高于混合型基金，低于股票型基金。

#### 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	中国建设银行股份有限公司
姓名	张文	田青
信息披露负责人	鹏华基金管理有限公司	田青
电子邮箱	0755-82527507	601-67595096
客户服务电话	4006789999	010-67595096
传真	0755-82021126	010-66725853

#### 2.4 信息披露方式

基金管理年度报告正式的管理人互联网网址	http://www.phfund.com
基金管理年度报告置地点	深圳市福田区福华三路168号国信金融中心43层鹏华基金管理有限公司 北京市西城区闹市口大街1号1号楼中国建设银行股份有限公司

#### § 3 主要财务指标和基金净值表现

金额单位：人民币元

3.1 期间数据和指标		报告期(2014年1月1日至2014年6月30日)	
本期已实现收益	-494,650,703.72		
本期利润	-347,104,521.65		
加权平均基金份额本期利润	-0.0342		
本期基金份额净值增长率	-3.95%		
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)		
可供分配基金份额利润	0.2668		
基金份额净值	7,125,494,374.81		
基金份额净值增长率	0.740		

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申购基金的各项费用(例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等)，计算费用后实际收益水平要低于剔除费用后的收益水平。

(3)中的“期末”指报告期的最后一日，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(%)	份额净值增 长标准差(%)	业绩比较基 准收益率(%)	业绩比较基 准收益率差 幅(%)	①-③	②-④
过去一个月	0.54%	0.75%	1.33%	0.60%	-0.79%	0.15%
过去三个月	3.21%	0.77%	1.80%	0.63%	0.41%	0.14%
过去六个月	-3.95%	0.96%	-0.16%	0.75%	-3.79%	0.21%
过去一年	7.63%	1.02%	7.99%	0.81%	-0.36%	0.21%
过去三年	-4.98%	1.03%	-10.83%	0.92%	-1.35%	0.11%
过去五年	14.90%	1.51%	90.31%	1.32%	58.50%	0.19%

注：基金业绩比较基准=中行标普股票综合指数收益率×70%+中信标普债券指数收益率×30%。

3.2.2 基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动与其同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：报告截止日2014年6月30日，基金份额净值0.740元，基金资产总额9,623,253,667.19份。

6.2 利润表

会计主体：鹏华价值优势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	2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间
一、收入	-	-277,921,866.14	-604,380,417.89
1.利息收入	5,270,807.85	15,749,935.76	
其中：存款利息收入	920,361.28	2,636,136.55	
应收利息收入	4,350,446.57	11,225,482.86	
2.投资收益	-	-	
其中：股票投资收益	3,454,474.57	1,888,316.35	
3.公允价值变动损益	8,408,553.59	6,561,595.98	
4.手续费及佣金收入	8,800,205.01	10,631,805.56	
5.其他收入	1,466,700.82	1,771,968.11	
减：投资损失	-	-	
减：公允价值变动损失	5,020,495.91	4,694,388,609.93	
减：汇兑损失	7,413,402.11	3,127,458.80	
减：吸收存款利息	84,631.06	327,064.74	
减：应付债券利息	-	-	
减：应付票据利息	-	-	
减：应付股利	-	-	
减：应付利息	-	-	
减：应付手续费及佣金	-	-	
减：应付交易费用	-	-	
减：应付税款	-	-	
减：其他费用	-	-	
减：其他收入	-	-	
减：投资损失	-	-	
减：公允价值变动损失	-	-	
减：汇兑损失	-	-	
减：吸收存款利息	-	-	
减：应付债券利息	-	-	
减：应付票据利息	-	-	
减：应付股利	-	-	
减：应付利息	-	-	
减：应付手续费及佣金	-	-	
减：应付交易费用	-	-	
减：应付税款	-	-	
减：其他费用	-	-	
减：其他收入	-	-	
减：投资损失	-	-	
减：公允价值变动损失	-	-	
减：汇兑损失	-	-	
减：吸收存款利息	-	-	
减：应付债券利息	-	-	
减：应付票据利息	-	-	
减：应付股利	-	-	
减：应付利息	-	-	
减：应付手续费及佣金	-	-	
减：应付交易费用	-	-	
减：应付税款	-	-	
减：其他费用	-	-	
减：其他收入	-	-	
减：投资损失	-	-	
减：公允价值变动损失	-	-	
减：汇兑损失	-	-	
减：吸收存款利息	-	-	
减：应付债券利息	-	-	
减：应付票据利息	-	-	
减：应付股利	-	-	
减：应付利息	-	-	
减：应付手续费及佣金	-	-	
减：应付交易费用	-	-	
减：应付税款	-	-	
减：其他费用	-	-	
减：其他收入	-	-	
减：投资损失	-	-	
减：公允价值变动损失	-	-	
减：汇兑损失	-	-	
减：吸收存款利息	-	-	
减：应付债券利息	-	-	
减：应付票据利息	-	-	
减：应付股利	-	-	
减：应付利息	-	-	
减：应付手续费及佣金	-	-	
减：应付交易费用	-	-	
减：应付税款	-	-	
减：其他费用	-	-	
减：其他收入	-	-	
减：投资损失	-	-	
减：公允价值变动损失	-	-	
减：汇兑损失	-	-	
减：吸收存款利息	-	-	
减：应付债券利息	-	-	
减：应付票据利息	-	-	
减：应付股利	-	-	
减：应付利息	-	-	
减：应付手续费及佣金	-	-</	