

(上接C36版)

[2005]102号文规定,自2005年6月13日起,扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时,减按50%计算应纳税所得额,即由原来20%的个人所得税调整为10%个人所得税。

- 2.重大会计差错的内容和更正金额
- 本期没有重大会计差错。
- 3.关联方关系及交易
- (1)关联方关系
- | | |
|----------------|-----------------|
| 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、基金发起人 |
| 交通银行 | 基金托管人、基金代销机构 |
| 国信证券有限责任公司 | 基金管理人的股东、基金代销机构 |
| 方正证券有限责任公司 | 基金管理人的股东 |
| 安信信托投资股份有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 安徽国元信托投资有限责任公司 | 基金管理人的股东 |
- 本报告期内关联方关系未发生变化
- (2)关联方交易,下列关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。
- A本系列基金没有通过关联方席位进行的股票、债券及债券回购交易,并未向关联方支付席位交易佣金。

B关联方报酬

a.基金管理人报酬

支付基金管理人鹏华基金管理公司的管理费, 普天债券基金按前日的基金资产净值的0.75%的年费率计提,逐日计提,按月支付,日管理费=前一日基金资产净值×0.75%÷当年天数,普天收益基金按前一日

的基金资产净值的1.5%的年费率计提,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。

截止至2005年6月30日,普天债券基金共需支付基金管理人报酬人民币342,067.39元;2004年上半年共支付基金管理人报酬人民币491,575.96元;

截止至2005年6月30日,普天收益基金共需支付基金管理人报酬人民币2,173,912.95元;2004年上半年共支付基金管理人报酬人民币2,454,188.17元。

b.基金托管人报酬

支付基金托管人交通银行的托管费按前一日

的基金资产净值的0.2%的年费率计提,逐日计提,按月支付,日托管费=前一日基金资产净值×0.2%÷当年天数。

截止至2005年6月30日,普天债券基金共需支付基金托管人报酬人民币91,217.93元;2004年上半年共支付基金托管人报酬人民币131,086.93元;

截止至2005年6月30日,普天收益基金共需支付基金托管人报酬人民币289,855.03元;2004年上半年共支付基金托管人报酬人民币327,225.13元。

- c.与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易
- 2005年上半年本系列基金没有与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。
- 4.本报告期末流通转让受限制的基金资产
- (1)鹏华普天债券投资基金
- 截至2005年6月30日,基金获配暂不能流通的股票成本为2,413,799.83元,股票市值为3,660,311.63元,对比成本估值增值为1,246,511.80元,普天债券投资基金持有未上市或上市未流通的股票明细如下:

序号	股票名称	数量(股)	总成本(元)	总市值(元)	估值方法	转让受限制原因	受限制期限
1	登海种业	19,885	332,079.50	428,124.05	收市价	新股未流通	2005-07-20流通
2	兔宝宝	23,152	115,296.96	157,433.60	收市价	新股未流通	2005-08-10流通
3	江苏三友	28,151	99,936.05	146,103.69	收市价	新股未流通	2005-08-18流通
4	广州国光	31,733	342,716.40	363,342.85	收市价	新股未流通	2005-08-23流通
5	轴研科技	31,879	203,706.81	376,172.20	收市价	新股未流通	2005-08-26流通
6	成霖股份	33,744	290,198.40	306,732.96	收市价	新股未流通	2005-08-31流通
7	宁波华翔	28,671	164,858.25	238,542.72	收市价	新股未流通	2005-09-03流通
8	晶源电子	77,748	371,635.44	814,021.56	收市价	新股未流通	2005-09-06流通
9	包头铝业	60,642	212,247.00	228,013.92	收市价	新股未流通	2005-08-09流通
10	中材国际	37,334	281,125.02	601,824.08	收市价	新股未流通	2005-07-12流通

(2)鹏华普天收益证券投资基金

截至2005年6月30日,基金获配暂不能流通的股票成本为4,063,278.53元,股票市值为5,761,397.85元,对比成本估值增值为1,698,119.32元,普天收益证券投资基金持有未上市或上市未流通的股票明细如下:

序号	股票名称	数量(股)	总成本(元)	总市值(元)	估值方法	转让受限制原因	受限制期限
1	登海种业	25,188	420,639.60	542,297.64	收市价	新股未流通	2005-07-20流通
2	兔宝宝	60,775	302,659.50	413,270.00	收市价	新股未流通	2005-08-10流通
3	江苏三支	110,159	391,064.45	571,725.21	收市价	新股未流通	2005-08-18流通
4	广州国光	59,236	639,748.80	678,252.20	收市价	新股未流通	2005-08-23流通
5	轴研科技	31,879	203,706.81	376,172.20	收市价	新股未流通	2005-08-26流通
6	成霖股份	71,578	615,570.80	650,644.02	收市价	新股未流通	2005-08-03流通
7	宁波华翔	103,217	593,497.75	858,765.44	收市价	新股未流通	2005-09-03流通
8	晶源电子	92,558	442,427.24	969,082.26	收市价	新股未流通	2005-09-06流通
9	包头铝业	72,506	253,771.00	272,622.56	收市价	新股未流通	2005-08-09流通
10	中材国际	26,586	200,192.58	428,566.32	收市价	新股未流通	2005-07-12流通

六、基金投资组合报告

(一)本报告期末基金资产组合情况

(1)鹏华普天债券投资基金

序号	资产品种	金额(元)	金额占基金总资产比例(%)
1	股票	8,572,058.14	10.32
2	债券	71,089,841.31	85.60
3	银行存款及清算备付金	2,447,249.86	2.95
4	其他资产	941,158.83	1.13
	合计	83,050,308.14	100

(2)鹏华普天收益证券投资基金

序号	资产品种	金额(元)	金额占基金总资产比例(%)
1	股票	157,341,711.49	72.10
2	债券	53,182,612.75	24.37
3	银行存款及清算备付金	6,833,876.63	3.13
4	其他资产	881,892.99	0.40
	合计	218,240,093.86	100

(二)本报告期末行业分类的股票投资组合:

(1)鹏华普天债券投资基金

序号	证券板块名称	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例(%)
1	A 农、林、牧、渔业	428,124.05	0.53
2	B 采掘业	1,987,966.51	2.44
3	C 制造业	2,648,543.50	3.25
其中:	C0 食品、饮料	-	-
	C1 纺织、服装、皮毛	146,103.69	0.18
	C2 木材、家具	157,433.60	0.19
	C3 造纸、印刷	-	-
	C4 石油、化学、塑胶、塑料	-	-
	C5 电子	1,177,364.41	1.45
	C6 金属、非金属	552,926.88	0.68
	C7 机械、设备、仪表	614,714.92	0.75
	C8 医药、生物制品	-	-
	C99 其他制造业	-	-
4	D 电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
5	E 建筑业	601,824.08	0.74
6	F 交通运输、仓储业	-	-
7	G 信息技术业	-	-
8	H 批发和零售贸易	-	-
9	I 金融、保险业	-	-
10	J 房地产业	-	-
11	K 社会服务业	2,905,600.00	3.57
12	L 传播与文化产业	-	-
13	M 综合类	-	-
	合计	8,572,058.14	10.53

(2)鹏华普天收益证券投资基金

序号	行业	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例(%)
1	A 农、林、牧、渔业	671,477.64	0.31
2	B 采掘业	7,687,258.83	3.55
3	C 制造业	78,582,636.90	36.33
其中:	C0 食品、饮料	14,901,617.15	6.89
	C1 纺织、服装、皮毛	644,245.21	0.30
	C2 木材、家具	413,270.00	0.19
	C3 造纸、印刷	1,061,506.24	0.49
	C4 石油、化学、塑胶、塑料	19,547,942.30	9.04
	C5 电子	1,858,024.46	0.86
	C6 金属、非金属	27,305,263.58	12.62
	C7 机械、设备、仪表	1,234,937.64	0.57
	C8 医药、生物制品	11,615,830.32	5.37
	C99 其他制造业	-	-
4	D 电力、煤气及水的生产和供应业	25,036,111.00	11.58
5	E 建筑业	428,566.32	0.20
6	F 交通运输、仓储业	28,379,788.38	13.12
7	G 信息技术业	5,491,872.42	2.54
8	H 批发和零售贸易	-	-
9	I 金融、保险业	11,064,000.00	5.12
10	J 房地产业	-	-
11	K 社会服务业	-	-
12	L 传播与文化产业	-	-
13	M 综合类	-	-
	合计	157,341,711.49	72.75

(三)本报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

(1)鹏华普天债券投资基金

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	期末市值(元)	市值占净值比例(%)
1	000069	华侨城A	320,000	2,905,600.00	3.57
2	000937	金牛能源	349,379	1,987,966.51	2.44
3	002049	晶源电子	77,748	814,021.56	1.00
4	600970	中材国际	37,334	601,824.08	0.74
5	002041	登海种业	19,885	428,124.05	0.53
6	002046	轴研科技	31,879	376,172.20	0.46
7	002045	广州国光	31,733	363,342.85	0.45
8	002047	成霖股份	35,744	324,912.96	0.40
9	002048	宁波华翔	28,671	238,542.72	0.29
10	600472	包头铝业	60,642	228,013.92	0.28

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.cn的半年度报告正文。

(2)鹏华普天收益证券投资基金

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	期末市值(元)	市值占净值比例(%)
1	600033	福建高速	1,200,000	10,032,000.00	4.64
2	600900	长江电力	1,100,000	8,987,000.00	4.16
3	000027	深能源A	1,319,900	8,882,927.00	4.11
4	600009	上海机场	503,705	8,512,614.50	3.94
5	600019	宝钢股份	1,599,950	7,967,751.00	3.68
6	600519	贵州茅台	135,991	7,295,917.15	3.37
7	600036	招商银行	1,200,000	7,272,000.00	3.36
8	600143	金发科技	585,390	6,872,478.60	3.18
9	600085	同仁堂	300,000	6,690,000.00	3.09
10	600028	中国石化	1,889,211	6,668,914.83	3.08

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.cn的半年度报告正文。

(四)报告期内股票投资组合的重大变动

1.鹏华普天债券投资基金

(1)按累计买入价值超出期初基金净值2%或前20名的股票明细如下:

序号	股票代码	股票名称	累计买入金额(元)	占期初净值比例(%)
1	000069	华侨城A	10,666,914.53	10.88
2	000630	铜都铜业	4,547,034.51	4.64
3	000937	金牛能源	2,371,386.74	2.42
4	002049	晶源电子	371,635.44	0.38
5	002045	广州国光	342,716.40	0.35
6	002041	登海种业	332,079.50	0.34
7	002040	南京港	328,891.50	0.34
8	002047	成霖股份	307,398.40	0.31
9	600970	中材国际	281,125.02	0.29
10	600472	包头铝业	212,247.00	0.22
11	002046	轴研科技	203,706.81	0.21
12	002048	宁波华翔	164,858.25	0.17
13	002043	兔宝宝	120,276.96	0.12
14	002044	江苏三友	99,936.05	0.10
15	600027	华电国际	7,560.00	0.01

(2)按累计卖出价值超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细如下:

序号	股票代码	股票名称	累计卖出金额(元)	占期初净值比例(%)
1	000069	华侨城A	10,208,089.06	10.41
2	000630	铜都铜业	6,903,994.15	7.04
3	000625	长安汽车	1,594,603.39	1.63
4	600016	民生银行	1,477,297.07	1.51
5	002040	南京港	434,651.96	0.44
6	600320	振华港机	351,515.67	0.36
7	002024	苏宁电器	50,067.86	0.05
8	600027	华电国际	11,335.81	0.01
9	002043	兔宝宝	6,092.76	0.01

(3)报告期内买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

买入股票的成本总额	人民币元
卖出股票的收入总额	20,357,767.11
	21,037,647.73

2.鹏华普天收益证券投资基金

(1)累计买入价值超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细如下:

序号	股票代码	股票名称	累计买入金额(元)	占期初净值比例(%)
1	600019	宝钢股份	31,862,887.66	9.92
2	600900	长江电力	28,876,713.35	8.99
3	600028	中国石化	21,852,422.07	6.80
4	600887	伊利股份	18,383,395.06	5.72
5	600036	招商银行	17,416,191.92	5.42
6	000895	双汇发展	15,717,942.67	4.89
7	600005	武钢股份	14,851,853.89	4.62
8	600011	华能国际	13,818,725.38	4.30
9	600519	贵州茅台	13,625,241.21	4.24
10	600276	恒瑞医药	12,893,317.83	4.01
11	600016	民生银行	12,386,972.23	3.86
12	600426	华鲁恒升	11,980,514.02	3.73
13	600029	南方航空	11,537,846.08	3.59
14	600143	金发科技	11,410,951.54	3.55
15	000027	深能源A	11,071,879.00	3.45
16	600296	兰州铝业	10,344,964.60	3.22
17	000022	深赤湾A	10,212,095.14	3.18
18	600009	上海机场	10,201,176.06	3.18
19	600026	中海发展	10,121,637.92	3.15
20	600308	华泰股份	9,840,329.13	3.06
21	000488	晨鸣纸业	9,480,869.00	2.95
22	600085	同仁堂	9,058,516.05	2.82
23	600123	兰花科创	8,874,942.38	2.76
24	000063	中兴通讯	8,762,890.32	2.73
25	000792	盐湖钾肥	8,695,658.56	2.71
26	000933	神火股份	8,629,376.81	2.69
27	600096	云天化	8,238,487.34	2.56
28	000422	湖北宜化	8,111,105.46	2.52
29	600660	福耀玻璃	7,930,217.51	2.47
30	600886	国投电力	7,373,425.87	2.30
31	600591	上海航空	6,954,088.93	2.16

(2)累计卖出价值超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细如下:

序号	股票代码	股票名称	累计卖出金额(元)	占期初净值比例(%)
1	600019	宝钢股份	28,338,296.93	8.82
2	600900	长江电力	26,484,055.58	8.24
3	600028	中国石化	19,352,679.80	6.02
4	600005	武钢股份	16,162,534.92	5.03
5	600887	伊利股份	15,975,501.47	4.97
6	600036	招商银行	15,114,376.58	4.70
7	600308	华泰股份	14,457,017.05	4.50
8	600660	福耀玻璃	14,405,158.57	4.48
9	000630	铜都铜业	13,444,501.99	4.19
10	600029	南方航空	13,243,998.38	4.12
11	600011	华能国际	12,957,067.93	4.03
12	000069	华侨城A	12,882,111.98	4.01
13	000895	双汇发展	12,652,662.46	3.94
14	600018	上港集团	12,544,940.25	3.91
15	000002	万科A	11,858,919.11	3.69
16	000063	中兴通讯	11,735,866.38	3.65
17	600012	皖通高速	11,494,479.13	3.58
18	000422	湖北宜化	11,073,638.79	3.45
19	600694	大商股份	10,777,794.65	3.35
20	600276	恒瑞医药	10,777,304.44	3.35
21	000488	晨鸣纸业	10,378,405.66	3.23
22	600009	上海机场	9,478,146.30	2.95
23	600026	中海发展	9,436,153.39	2.94
24	600085	同仁堂	9,386,312.65	2.92
25	600296	兰州铝业	8,907,046.91	2.77
26	600426	华鲁恒升	8,557,400.55	2.66
27	600000	浦发银行	8,310,260.19	2.59
28	600519	贵州茅台	8,247,389.84	2.57
29	600591	上海航空	8,214,935.43	2.56
30	600016	民生银行	7,965,723.42	2.48
31	000792	盐湖钾肥	7,747,033.18	2.41
32	000933	神火股份	7,369,657.84	2.29
33	600002	齐鲁石化	7,235,244.69	2.25
34	000022	深赤湾A	7,168,119.40	2.23
35	002024	苏宁电器	6,870,978.72	2.14
36	600050	中国联通	6,773,949.36	2.11
37	600033	福建高速	6,680,446.09	2.08
38	000423	东阿阿胶	6,549,683.84	2.04
39	600123	兰花科创	6,482,829.34	2.02