

信息披露 Disclosure

鹏华行业成长证券投资基金

2011 第一季度报告

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
报告送出日期:2011年4月22日

§ 1 重要提示
基金管理人的董事会及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责任。
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2011年4月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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好基金资产，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。
本基金合同中财务资料未经审计。

本基金合同自2011年1月1日起至2012年1月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	鹏华行业成长混合
基金主代码	206001
交易代码	206001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2002年5月24日
报告期末基金份额总额	707,670,752.15份
投资目标	在控制风险的前提下谋求基金财产的长期稳定增值。 (1)一级资产配置：本基金的投资决策委员会在综合考虑宏观经济形势、政策环境以及市场趋势等因素除外时对整体基金财产中股票、债券等金融的配置比例。 (2)股票投资：在基金一级资产配置股票的投资比例确定之后，本基金通过首次优化配置最终完成投资策略。 (3)债券投资：本基金可投资于国债、金融债和企业债(包括可转债)，本基金在对利率走势和债券发行人基本面进行分析的基础上，综合考虑收益率变化对债券投资的影响，收益率水平、信用风险的小、大规模好坏券等要素，建立不同类型、不同期限债券品种构成的组合。
业绩比较基准	中信标普中国综合指数涨跌幅×80%+中信标普国债指数涨跌幅×20%
风险收益特征	本基金为股票投资基金中的中高风险品种。本基金长期平均的风险和预期收益率属于积极成长型基金，高于多数基金类型。货币市场基金、纯债券基金和国债。
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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标		报告期(2011年1月1日 - 2011年3月31日)		
1.本期已实现收益		19,205,701.11		
2.本期利润		-5,569,304.92		
3.加权平均基金份额本期利润		-0.0097		
4.期末基金资产净值		774,492,505.55		
5.期末基金份额净值		1.0944		
注:1.本期已实现收益指基金本期收入，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，本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。 2.所列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，计入申购后实际收益水平将低于所列数字。				

3.2.1 本基金采用“后进先出”原则计算基金本期收入、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，本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

过去三个月 -0.26% 1.12% 2.23% 1.09% -2.49% 0.03%

注:1.本基金合同于2002年5月24日生效。2.截至定期报告期末，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。

2.鹏华基金管理有限公司

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介			
姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业年限
陈鹏	本基金基金经理	2007年8月29日	2011年1月28日

我们判断股票市场维持相对振荡格局，对于市场趋于谨慎，策略上一方面把握波段性机会，另一方面自上而下发掘业绩真实性的成长的公司，争取创造良好的基金业绩。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况		
序号	项目	金额(元)
1	权益投资	553,392,250.61
其中：股票	553,392,250.61	71.15
2	固定收益投资	161,863,252.00
其中：债券	161,863,252.00	20.81
3	货币衍生品投资	-
4	买入返售金融资产	-
5	银行存款和结算备付金合计	57,747,168.04
6	其他资产	4,832,997.17
7	合计	777,835,667.82

占基金总资产的比例(%)

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合		
代码	行业类别	公允价值(元)
A	农、林、牧、渔业	12,549,656.70
B	采掘业	19,073,075.12
C	制造业	388,214,937.99
D	食品、饮料	32,731,983.25
E	纺织、服装、皮毛	14,386,924.50
F	木材、家具	-
G	造纸、印刷	3,057,858.00
H	石油、化学、塑胶、塑料	57,932,889.56
I	电子	109,897,165.99
J	金属、非金属	64,919,543.56
K	机械、设备、仪表	94,255,224.25
L	医药、生物制品	11,033,338.88
M	其他制造业	-
99	其他	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	39,144,161.84
E	建筑业	724,714.20
F	交通运输、仓储业	-
G	信息技术业	21,571,133.79
H	批发和零售贸易	45,945,931.81
I	金融、保险业	-
J	房地产业	-
K	社会服务业	26,168,639.16
L	传播与文化产业	-
M	综合类	-
99	其他	-
合计		553,392,250.61

占基金总资产的比例(%)

5.3 报告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

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资组合

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

5.7 报告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

5.8 其他资产构成

5.9 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10 基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券

5.11 报告期末持有的处于转股期的可转换债券的公允价值

5.12 前十名股票投资明细

5.13 前十名债券投资明细

5.14 前十名权证投资明细

5.15 前十名资产支持证券投资明细

5.16 前十名基金投资明细

5.17 前十名权证投资明细

5.18 报告期内新投入的资产支持证券投资

5.19 报告期内新持有的资产支持证券投资

5.20 报告期内新卖出的资产支持证券投资

5.21 报告期内新持有的权证投资

5.22 报告期内新卖出的权证投资

5.23 报告期内新持有的基金投资

5.24 报告期内新卖出的基金投资

5.25 报告期内新持有的股票投资

5.26 报告期内新卖出的股票投资

5.27 报告期内新持有的债券投资

5.28 报告期内新卖出的债券投资

5.29 报告期内新持有的权证投资

5.30 报告期内新卖出的权证投资

5.31 报告期内新持有的基金投资

5.32 报告期内新卖出的基金投资

5.33 报告期内新持有的股票投资

5.34 报告期内新卖出的股票投资

5.35 报告期内新持有的债券投资

5.36 报告期内新卖出的债券投资

5.37 报告期内新持有的权证投资

5.38 报告期内新卖出的权证投资

5.39 报告期内新持有的基金投资

5.40 报告期内新卖出的基金投资

5.41 报告期内新持有的股票投资

5.42 报告期内新卖出的股票投资

5.43 报告期内新持有的债券投资

5.44 报告期内新卖出的债券投资

5.45 报告期内新持有的权证投资

5.46 报告期内新卖出的权证投资

5.47 报告期内新持有的基金投资

5.48 报告期内新卖出的基金投资

5.49 报告期内新持有的股票投资

5.50 报告期内新卖出的股票投资

5.51 报告期内新持有的债券投资

5.52 报告期内新卖出的债券投资

5.53 报告期内新持有的权证投资

5.54 报告期内新卖出的权证投资

5.55 报告期内新持有的基金投资

5.56 报告期内新卖出的基金投资

5.57 报告期内新持有的股票投资

5.58 报告期内新卖出的股票投资

5.59 报告期内新持有的债券投资

5.60 报告期内新卖出的债券投资

5.61 报告期内新持有的权证投资

5.62 报告期内新卖出的权证投资

5.63 报告期内新持有的基金投资

5.64 报告期内新卖出的基金投资

5.65 报告期内新持有的股票投资

5.66 报告期内新卖出的股票投资