

鹏华盛世创新股票型证券投资基金（LOF） 2013 年半年度报告

2013 年 6 月 30 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

送出日期：2013 年 8 月 27 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 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、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2013 年 8 月 22 日复核了本报告中的财务指标、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，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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2013 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	12
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.....	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告	30
7.1 期末基金资产组合情况.....	30
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	31
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	31
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	32
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	34
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.....	35
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	35
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.....	35
7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	35
7.10 投资组合报告附注.....	35
§8 基金份额持有人信息	37
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	37
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	37

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	37
§9 开放式基金份额变动.....	38
§10 重大事件揭示.....	38
10.1 基金份额持有人大会决议.....	38
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	38
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	38
10.4 基金投资策略的改变.....	38
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	38
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	39
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	39
10.8 其他重大事件	40
§11 备查文件目录.....	43
11.1 备查文件目录.....	43
11.2 存放地点.....	43
11.3 查阅方式.....	43

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华盛世创新股票型证券投资基金 (LOF)
基金简称	鹏华盛世创新股票 (LOF)
基金主代码	160613
交易代码	160613
基金运作方式	上市契约型开放式 (LOF)
基金合同生效日	2008 年 10 月 10 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
报告期末基金份额总额	249,269,703.54 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2008 年 11 月 10 日

注：本基金在交易所行情系统净值提示等其他信息披露场合下，可简称为“鹏华创新”。

2.2 基金产品说明

投资目标	精选具有竞争力比较优势和持续盈利增长潜力的自主创新类上市公司中价值相对低估的股票，进行积极主动的投资管理，在有效控制投资风险的前提下，为基金份额持有人谋求长期、稳定的资本增值。
投资策略	本基金的投资策略分为两个层次：第一层次是“自上而下”的资产配置策略，第二层次是“自下而上”的选股策略，主要投资于具有竞争力比较优势和持续盈利增长潜力的自主创新类上市公司中价值相对低估的股票。在充分控制投资风险的基础上，通过积极主动的投资管理，为基金份额持有人谋求长期、稳定的资本增值。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×75%+中证综合债指数收益率×25%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金，为证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。

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
信息披露负责人	姓名	张戈	田青
	联系电话	0755-82825720	010-67595096

	电子邮箱	zhangge@phfund.com.cn	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		4006788999	010-67595096
传真		0755-82021126	010-66275853
注册地址		深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心第43层	北京市西城区金融街25号
办公地址		深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心第43层	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		518048	100033
法定代表人		何如	王洪章

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.phfund.com
基金半年度报告备置地点	深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心43层鹏华基金管理有限公司 北京市西城区闹市口大街1号院1号楼中国建设银行股份有限公司

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2013年1月1日 - 2013年6月30日)
本期已实现收益	74,537,263.62
本期利润	9,166,962.34
加权平均基金份额本期利润	0.0227
本期加权平均净值利润率	1.81%
本期基金份额净值增长率	-2.35%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013年6月30日)
期末可供分配利润	40,248,943.07
期末可供分配基金份额利润	0.1615

期末基金资产净值	289,710,033.14
期末基金份额净值	1.162
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2013年6月30日)
基金份额累计净值增长率	19.49%

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），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(3) 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润期末余额和未分配利润中已实现部分的期末余额的孰低数。表中的“期末”均指报告期最后一日，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

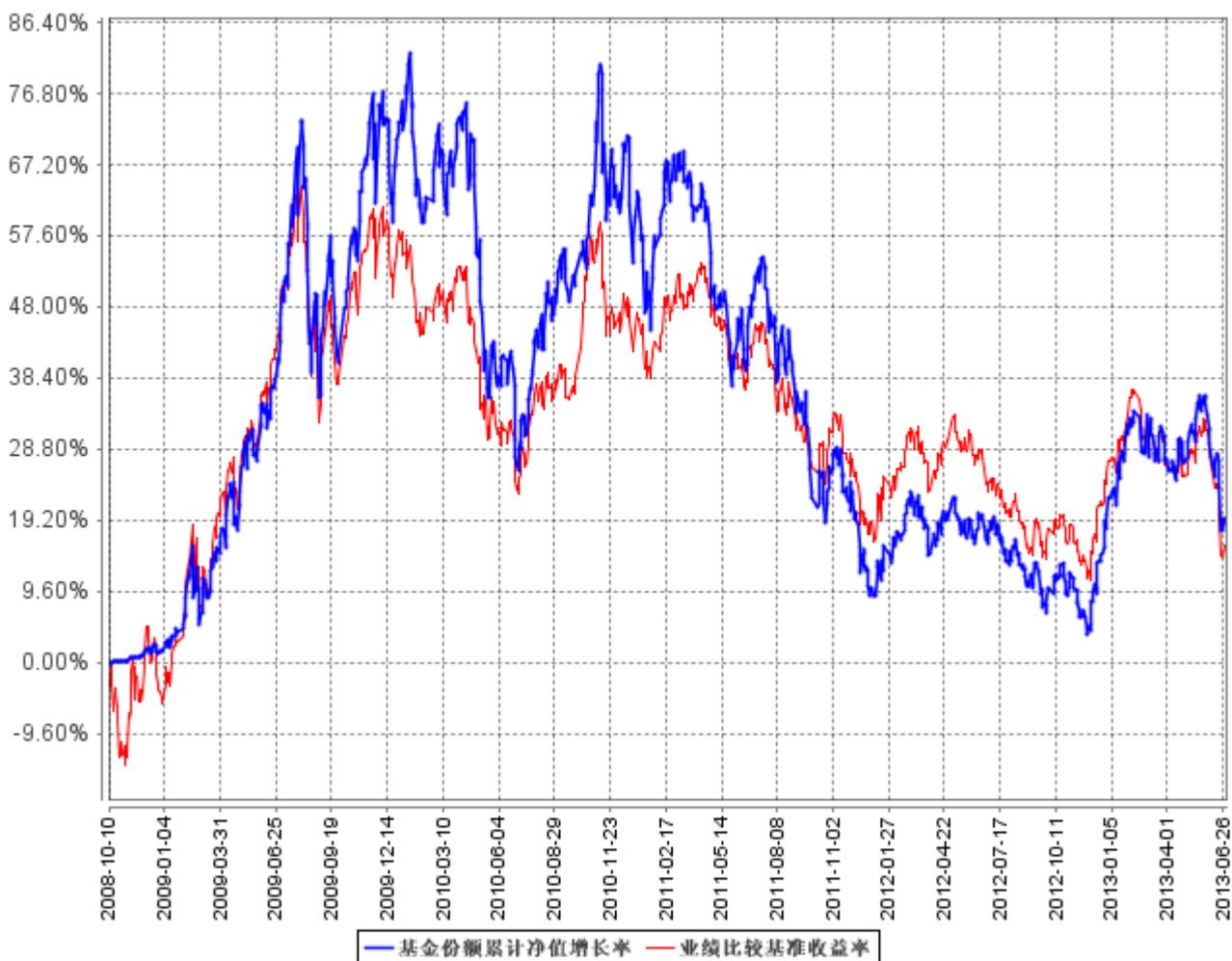
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-11.37%	1.52%	-11.93%	1.41%	0.56%	0.11%
过去三个月	-5.99%	1.21%	-8.68%	1.09%	2.69%	0.12%
过去六个月	-2.35%	1.33%	-9.02%	1.13%	6.67%	0.20%
过去一年	1.40%	1.14%	-7.02%	1.03%	8.42%	0.11%
过去三年	-6.37%	1.28%	-7.23%	1.03%	0.86%	0.25%
自基金合同生效起至今	19.49%	1.41%	15.73%	1.26%	3.76%	0.15%

注：基金业绩比较基准=沪深300指数收益率×75%+中证综合债指数收益率×25%。

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金合同于 2008 年 10 月 10 日生效。

2、截至建仓期结束，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。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

鹏华基金管理有限公司成立于 1998 年 12 月 22 日，业务范围包括基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。截止本报告期末，公司股东由国信证券股份有限公司、意大利欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）、深圳市北融信投资发展有限

公司组成，公司性质为中外合资企业。公司原注册资本 8,000 万元人民币，后于 2001 年 9 月完成增资扩股，增至 15,000 万元人民币。截止本报告期末，公司管理 2 只封闭式基金、37 只开放式基金和 7 只社保组合，经过近 15 年投资管理基金，在基金投资、风险控制等方面积累了丰富的经验。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
伍旋	本基金基金经理	2011 年 12 月 28 日	-	7	伍旋先生，国籍中国，北京大学工商管理硕士，7 年证券从业经验。曾任职于中国建设银行，2006 年 6 月加盟鹏华基金管理有限公司，从事研究分析工作，历任研究部高级研究员、基金经理助理；2011 年 12 月起至今担任鹏华盛世创新股票型证券投资基金（LOF）基金经理。伍旋先生具备基金从业资格

					格。本报告期内本基金基金经理未发生变动。
--	--	--	--	--	----------------------

注：1. 任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日；担任新成立基金基金经理的，任职日期为基金合同生效日。

2. 证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规、中国证监会的有关规定以及基金合同的约定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合规，不存在违反基金合同和损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行公平交易制度，确保不同投资组合在研究、交易、分配各环节得到公平对待。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未发生违法违规且对基金财产造成损失的异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易次数为 2 次，主要原因在于指数成份股交易不活跃导致。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2013 年上半年，宏观经济相对低迷，GDP、工业增加值、固定资产投资、进出口等指标呈环比回落的趋势，A 股市场行业表现差异巨大，沪深 300 累计下跌 12.78%，而中小版指数上涨 5.19%、创业板指数上涨 41.72%，传媒、TMT、医药、环保等行业涨幅居前，而煤炭、有色、保险、建材等周期性行业呈下跌趋势。上半年内，由于组合持仓在金融、地产、建材等行业配置较重，与市场热点契合度不高，导致表现较差。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金净值增长率为-2.35%，同期上证综指下跌 12.78%，深证成指下跌 15.60%，

沪深 300 指数下跌 12.78%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,我们认为在宏观经济“弱复苏”的环境下,加上“去杠杆”的政策倾向,股票市场短期内机会不大,依旧延续震荡行情的概率较高。我们依然会结合公司治理结构、竞争优势、增长潜力以及估值水平来调整组合的持仓结构。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.6.1 有关参与估值流程各方及人员的职责分工、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,基金会计对公司所管理的基金以基金为会计核算主体,独立建账、独立核算,保证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公司会计核算。基金会计核算采用专用的财务核算软件系统进行基金核算及帐务处理;每日按时接收成交数据及权益数据,进行基金估值。基金会计核算采用基金管理公司与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行核对一致后才能对外公告。基金会计除设有专职基金会计核算岗外,还设有基金会计复核岗位,负责基金会计核算的日常事后复核工作,确保基金净值核算无误。

配备的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法规、政策和方法。

4.6.1.2 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,本公司成立停牌股票等没有市价的投资品种估值小组,成员由基金经理、行业研究员、监察稽核部、金融工程师、登记结算部相关人员组成。

4.6.2 基金经理参与或决定估值的程度

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估值的讨论,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政策。

4.6.3 本公司参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.6.4 本公司现没有进行任何定价服务的签约。

4.7 管理人对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，本基金期末可供分配利润为 40,248,943.07 元，期末基金份额净值 1.162 元。

4.7.2 本基金本报告期内未进行利润分配。

4.7.3 根据相关法律法规及本基金合同的规定，本基金管理人将会综合考虑各方面因素，在严格遵守规定前提下，对本报告期内可供分配利润适时作出相应安排。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、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，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：鹏华盛世创新股票型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	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	6.4.7.1	55,523,014.81	41,280,361.05

结算备付金		1,494,094.56	714,112.45
存出保证金		265,916.83	250,000.00
交易性金融资产	6.4.7.2	235,103,178.51	464,522,255.18
其中：股票投资		232,006,508.01	464,522,255.18
基金投资		-	-
债券投资		3,096,670.50	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	4,616,024.78
应收利息	6.4.7.5	16,879.05	13,429.77
应收股利		936,922.65	-
应收申购款		29,492.62	108,918.85
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		293,369,499.03	511,505,102.08
负债和所有者权益	附注号	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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,637,091.41	-
应付赎回款		126,667.43	751,810.92
应付管理人报酬		427,940.82	595,403.51
应付托管费		71,323.48	99,233.92
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,168,512.87	505,773.63
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	227,929.88	352,578.45
负债合计		3,659,465.89	2,304,800.43
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	249,269,703.54	428,030,184.98
未分配利润	6.4.7.10	40,440,329.60	81,170,116.67
所有者权益合计		289,710,033.14	509,200,301.65
负债和所有者权益总计		293,369,499.03	511,505,102.08

注：报告截至日 2013 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.162 元，基金份额总额 249,269,703.54 份。

6.2 利润表

会计主体：鹏华盛世创新股票型证券投资基金（LOF）

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		15,911,643.05	49,632,657.92
1.利息收入		329,353.58	418,690.23
其中：存款利息收入	6.4.7.11	325,122.58	418,690.23
债券利息收入		4,231.00	-
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）		80,636,215.31	-15,179,403.35
其中：股票投资收益	6.4.7.12	76,406,818.37	-21,173,737.18
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	4,229,396.94	5,994,333.83
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-65,370,301.28	64,367,841.23
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	316,375.44	25,529.81
减：二、费用		6,744,680.71	7,550,793.21
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,756,791.43	4,648,614.31
2. 托管费	6.4.10.2.2	626,131.91	774,769.11
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	2,121,804.31	1,883,878.28
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.19	239,953.06	243,531.51
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		9,166,962.34	42,081,864.71
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		9,166,962.34	42,081,864.71

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鹏华盛世创新股票型证券投资基金（LOF）

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		
	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)	428,030,184.98	81,170,116.67	509,200,301.65
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	9,166,962.34	9,166,962.34
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)	-178,760,481.44	-49,896,749.41	-228,657,230.85
其中：1.基金申购款	136,853,603.48	34,237,331.03	171,090,934.51
2.基金赎回款	-315,614,084.92	-84,134,080.44	-399,748,165.36
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)	249,269,703.54	40,440,329.60	289,710,033.14
项目	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)	574,746,625.30	40,253,657.85	615,000,283.15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	42,081,864.71	42,081,864.71
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)	-10,063,334.91	-73,787.94	-10,137,122.85
其中：1.基金申购款	55,252,734.88	8,631,630.72	63,884,365.60
2.基金赎回款	-65,316,069.79	-8,705,418.66	-74,021,488.45
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)	564,683,290.39	82,261,734.62	646,945,025.01
-----------------	----------------	---------------	----------------

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 邓召明	_____ 毕国强	_____ 刘慧红
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

鹏华盛世创新股票型证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监基金字[2008]838 号文《关于同意鹏华盛世创新股票型证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人鹏华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华盛世创新股票型证券投资基金(LOF)基金合同》的约定募集设立。本基金为上市契约型开放式，存续期限为不定期，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 1,144,932,018.81 元，经安永华明会计师事务所验证并出具安永华明(2008)验字第 60468989_H01 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《鹏华盛世创新股票型证券投资基金(LOF)基金合同》于 2008 年 10 月 10 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,145,339,439.27 份基金份额，其中认购资金利息折合 407,420.46 份基金份额。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

经深圳证券交易所（以下简称“深交所”）深证上字[2008]第 154 号文审核同意，本基金 177,293,934.00 份基金份额于 2008 年 11 月 10 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华盛世创新股票型证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定，本基金的投资范围仅限于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的各类股票、债券、央行票据、权证、资产证券化产品以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如有投资需要可参与有价值的新股配售和增发。其中股票的主要投资方向为具有竞争力比较优势和持续盈利增长潜力的自主创新类上市公司中价值相对低估的股票，该部分股票的投资比例不低于本基金股票资产的 80%。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×75%+中证综合债指数收益率×25%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5 号《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《鹏华盛世创新股票型证券投资基金(LOF)基金合同》和中国证监会允许的基金行业实务操作的有关规定编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2013 年上半年财务报表符合企业会计准则的要求, 真实、完整地反映了本基金 2013 年 6 月 30 日的财务状况以及 2013 年上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期没有发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102 号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107 号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作, 主要税项列示如下:

- (1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围, 不征收营业税。
- (2) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。
- (3) 对基金取得的企业债券利息收入, 由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税, 暂不征收企业所得税。2013 年 1 月 1 日以前, 对基金取得的股票的股息、红利收入, 由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额, 依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税, 暂不征收企业所得税。自 2013 年 1 月 1 日起, 对基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票, 持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的, 其股息红利所得全额计入应纳税所得额; 持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的, 暂减按 50% 计入应纳税所得额; 持

股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日
活期存款	55,523,014.81
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	55,523,014.81

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	240,412,132.71	232,006,508.01	-8,405,624.70
债券	交易所市场	3,096,670.50	117,670.50
	银行间市场	-	-
	合计	3,096,670.50	117,670.50
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	243,391,132.71	235,103,178.51	-8,287,954.20

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

截止本报告期末，本基金未持有衍生金融资产和衍生金融负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

截至本报告期末，本基金未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

截止本报告期末，本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2013年6月30日
应收活期存款利息	11,856.05
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	672.30
应收债券利息	4,231.00
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	119.70
合计	16,879.05

注：其他为应收结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

截止本报告期末，本基金未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2013年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,168,512.87
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,168,512.87

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2013年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	302.52
预提费用	225,627.36
其他	2,000.00
合计	227,929.88

注：其他为应付代垫券商席位费。

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	428,030,184.98	428,030,184.98
本期申购	136,853,603.48	136,853,603.48
本期赎回(以“-”号填列)	-315,614,084.92	-315,614,084.92
本期末	249,269,703.54	249,269,703.54

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-13,729,889.50	94,900,006.17	81,170,116.67
本期利润	74,537,263.62	-65,370,301.28	9,166,962.34
本期基金份额交易产生的变动数	-20,558,431.05	-29,338,318.36	-49,896,749.41
其中：基金申购款	2,520,951.09	31,716,379.94	34,237,331.03
基金赎回款	-23,079,382.14	-61,054,698.30	-84,134,080.44
本期已分配利润	-	-	-
本期末	40,248,943.07	191,386.53	40,440,329.60

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	309,717.21
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	8,889.17
其他	6,516.20
合计	325,122.58

注：其他为申购款利息收入 4,734.53 元和结算保证金利息收入 1,781.67 元。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	780,233,900.42
减：卖出股票成本总额	703,827,082.05
买卖股票差价收入	76,406,818.37

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期没有发生债券投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期没有发生衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
股票投资产生的股利收益	4,229,396.94
基金投资产生的股利收益	-
合计	4,229,396.94

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
1. 交易性金融资产	-65,370,301.28
——股票投资	-65,487,971.78
——债券投资	117,670.50
——资产支持证券投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-65,370,301.28

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
基金赎回费收入	248,044.34
转换费收入	68,331.10
合计	316,375.44

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	2,121,804.31
银行间市场交易费用	-
合计	2,121,804.31

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
审计费用	47,108.87
信息披露费	148,765.71
账户维护费	9,000.00
上市年费	29,752.78
银行汇划费用	5,325.70
合计	239,953.06

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内及上年度可比期内未通过关联方交易单元发生股票交易、权证交易、债券交易、债券回购交易，也没有发生应支付关联方的佣金业务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

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
当期发生的基金应支付的管理费	3,756,791.43	4,648,614.31
其中：支付销售机构的客户维护费	372,829.25	371,352.68

注：（1）支付基金管理人鹏华基金管理有限公司的管理人报酬年费率为 1.5%，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。

（2）根据《开放式证券投资基金销售费用管理规定》，基金管理人依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，客户维护费从基金管理费中列支。

6.4.10.2.2 基金托管费

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
当期发生的基金应支付的托管费	626,131.91	774,769.11

注：支付基金托管人中国建设银行股份有限公司的托管费年费率为 0.25%，逐日计提，按月支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

6.4.10.3 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。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 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 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
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。

6.4.10.6 本基金在承销期内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。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2013年6月30日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	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	华邦颖泰	2013年2月7日	2014年2月10日	非公开发行流通受限	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。

6.4.12.2 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	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600088	中视传媒	2013年5月30日	资产重组	14.29	-	-	399,949	5,325,886.32	5,715,271.21	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 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款余额。

6.4.12.3.2 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款余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型证券投资基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。

本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人致力于全面内部控制体系的建设，建立了从董事会层面到各业务部门的风险管理组织架构。本基金的基金管理人在董事会下设风险控制和合规审计委员会，主要负责制定基金管理人风险控制战略和控制政策、协调突发重大风险等事项；督察长负责对基金管理人各业务环节合法合规运作进行监督检查，组织、指导基金管理人内部监察稽核工作，并可向董事会和中国证监会直接报告；在公司内部设立独立的监察稽核部，专职负责对基金管理人各部门、各业务的风险控制情况进行督促和检查，并适时提出整改建议。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。

本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和

款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2013 年 6 月 30 日，本基金持有信用类债券占基金净值比 1.07%（2012 年 12 月 31 日：未持有）

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理职能部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金持有同一机构（政府、国际金融组织除外）发行的证券市值不得超过基金净值的 10%，本基金管理人管理的全部基金不得持有同一机构 10%以上具有投票权的证券发行总量。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，或通过场外的交易方式变现，因此除附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，所有已售出而未回购证券总市值不得超过本基金总资产的 50%。

本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

下表按资产负债表日至衍生工具合约到期日的剩余期限，对本基金所持有的衍生工具投资进行了统计。表中所示为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等，其余大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2013年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	55,523,014.81	-	-	-	55,523,014.81
结算备付金	1,494,094.56	-	-	-	1,494,094.56
存出保证金	265,916.83	-	-	-	265,916.83
交易性金融资产	-	-	3,096,670.50	232,006,508.01	235,103,178.51
应收利息	-	-	-	16,879.05	16,879.05
应收股利	-	-	-	936,922.65	936,922.65
应收申购款	-	-	-	29,492.62	29,492.62
资产总计	57,283,026.20	-	3,096,670.50	232,989,802.33	293,369,499.03
负债					
应付证券清算款	-	-	-	1,637,091.41	1,637,091.41
应付赎回款	-	-	-	126,667.43	126,667.43
应付管理人报酬	-	-	-	427,940.82	427,940.82
应付托管费	-	-	-	71,323.48	71,323.48
应付交易费用	-	-	-	1,168,512.87	1,168,512.87
其他负债	-	-	-	227,929.88	227,929.88
负债总计	-	-	-	3,659,465.89	3,659,465.89
利率敏感度缺口	57,283,026.20	-	3,096,670.50	229,330,336.44	289,710,033.14
上年度末 2012年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	41,280,361.05	-	-	-	41,280,361.05
结算备付金	714,112.45	-	-	-	714,112.45

存出保证金	-	-	250,000.00	250,000.00
交易性金融资产	-	-	464,522,255.18	464,522,255.18
应收证券清算款	-	-	4,616,024.78	4,616,024.78
应收利息	-	-	13,429.77	13,429.77
应收申购款	108,918.85	-	-	108,918.85
资产总计	42,103,392.35	-	469,401,709.73	511,505,102.08
负债				
应付赎回款	-	-	751,810.92	751,810.92
应付管理人报酬	-	-	595,403.51	595,403.51
应付托管费	-	-	99,233.92	99,233.92
应付交易费用	-	-	505,773.63	505,773.63
其他负债	-	-	352,578.45	352,578.45
负债总计	-	-	2,304,800.43	2,304,800.43
利率敏感度缺口	42,103,392.35	-	467,096,909.30	509,200,301.65

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2013年6月30日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为1.07%(2012年12月31日：未持有)，因此当利率发生合理、可能的变动时，对于本基金资产净值无重大影响(2012年12月31日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。

本基金投资组合中股票资产占基金资产的比例为 60%~95%，债券资产占基金资产的比例为 0~35%，权证市值不得超过基金资产净值的 3%。

此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日		上年度末 2012 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	232,006,508.01	80.08	464,522,255.18	91.23
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	232,006,508.01	80.08	464,522,255.18	91.23

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2013 年 6 月 30 日）	上年度末（2012 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	15,157,744.60	23,781,181.69
业绩比较基准下降 5%	-15,157,744.60	-23,781,181.69	

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值, 公允价值层级可分为:

第一层级: 相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级: 直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级: 以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

(ii) 各层次金融工具公允价值

于 2013 年 6 月 30 日, 本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 224,470,407.30 元, 属于第二层级的余额为 10,632,771.21 元, 无属于第三层级的余额(2012 年 12 月 31 日: 第一层级 454,402,821.90 元, 第二层级 10,119,433.28 元, 无第三层级)。

(iii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券, 若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况, 本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和债券的公允价值列入第一层级; 并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度, 确定相关股票和债券公允价值应属第二层级或第三层级。

(iv) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(2) 除公允价值外, 截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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
	其中: 股票	232,006,508.01	79.08
2	固定收益投资	3,096,670.50	1.06
	其中: 债券	3,096,670.50	1.06
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-

	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	57,017,109.37	19.44
6	其他各项资产	1,249,211.15	0.43
7	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业	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	信息传输、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所有股票投资明细

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	000786	北新建材	1,210,000	21,320,200.00	7.36
2	300145	南方泵业	555,802	13,600,474.94	4.69
3	600062	华润双鹤	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	华邦颖泰	741,933	10,439,835.97	3.60
8	600527	江南高纤	1,849,922	10,341,063.98	3.57
9	600535	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
11	000963	华东医药	251,648	10,028,172.80	3.46
12	000001	平安银行	1,003,544	10,005,333.68	3.45
13	000002	万科A	929,300	9,153,605.00	3.16
14	601908	京运通	1,100,000	6,534,000.00	2.26
15	600795	国电电力	2,844,921	6,486,419.88	2.24
16	601166	兴业银行	410,000	6,055,700.00	2.09
17	601668	中国建筑	1,826,901	5,973,966.27	2.06
18	601098	中南传媒	616,624	5,734,603.20	1.98
19	600088	中视传媒	399,949	5,715,271.21	1.97
20	002701	奥瑞金	193,907	5,468,177.40	1.89
21	002234	民和股份	650,000	5,460,000.00	1.88
22	000501	鄂武商A	479,712	5,372,774.40	1.85
23	600108	亚盛集团	749,982	4,889,882.64	1.69
24	002152	广电运通	399,925	4,391,176.50	1.52
25	600016	民生银行	509,001	4,362,138.57	1.51
26	300275	梅安森	451,342	4,332,883.20	1.50
27	002250	联化科技	199,960	3,997,200.40	1.38
28	002396	星网锐捷	130,000	1,851,200.00	0.64
29	002572	索菲亚	100,000	1,387,000.00	0.48
30	600718	东软集团	125,000	1,017,500.00	0.35

7.4 报告期内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	29,708,056.86	5.83

2	600795	国电电力	26,754,903.45	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	600062	华润双鹤	16,729,218.68	3.29
11	300346	南大光电	13,687,389.82	2.69
12	300145	南方泵业	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	600312	平高电气	12,715,800.47	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	10,403,626.52	2.04
19	600016	民生银行	10,337,388.30	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	4.65
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	002250	联化科技	13,802,023.16	2.71
24	600312	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	2.30
29	600535	天士力	11,577,933.90	2.27
30	600362	江西铜业	11,285,727.04	2.22
31	600674	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	536,799,306.66
卖出股票收入（成交）总额	780,233,900.42

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-

	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	3,096,670.50	1.07
8	其他	-	-
9	合计	3,096,670.50	1.07

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110023	民生转债	29,790	3,096,670.50	1.07

注：上述债券明细为本基金本报告期末持有的全部债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.9.1 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。

7.9.2 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。

7.10 投资组合报告附注

7.10.1

本基金投资的前十名证券之一的中国平安的发行主体中国平安保险(集团)股份有限公司控股子公司平安证券收到中国证监会《行政处罚和市场禁入事先告知书》，中国证监会决定对平安证券被给予警告并没收其在“万福生科”发行上市项目中的业务收入人民币 2,555 万元，并处以人民币 5,110 万元的罚款，暂停其保荐机构资格 3 个月。

对该股票的投资决策程序的说明：本基金管理人长期跟踪研究该股票，认为中国平安作为国

内最大的保险机构之一将长期受益于我国保险行业的发展，从处罚公告中知悉，2012 年平安证券投资业务承销佣金收入占平安集团营业收入的 0.19%，净利润的 0.66%，对平安集团的财务状况及经营成果并不产生实质性影响。本次行政处罚对该股票的投资价值不产生重大影响。该证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

本基金投资的前十名证券中的其它证券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。

7.10.2

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。

7.10.3 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	265,916.83
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	936,922.65
4	应收利息	16,879.05
5	应收申购款	29,492.62
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,249,211.15

7.10.4 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。

7.10.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002004	华邦颖泰	4,917,500.00	1.70	非公开发行

7.10.6 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，投资组合报告中数字分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	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
15,533	16,047.75	45,780,080.82	18.37%	203,489,622.72	81.63%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额 比例
1	祁鸿雁	455,000.00	9.74%
2	巩非	400,136.00	8.56%
3	陈芳	302,906.00	6.48%
4	浙江中凯服饰有限公司	200,000.00	4.28%
5	王大凯	179,119.00	3.83%
6	姜卫平	118,642.00	2.54%
7	陈明杰	105,600.00	2.26%
8	窦世彦	102,700.00	2.20%
9	张琅琅	92,080.00	1.97%
10	刘继海	85,528.00	1.83%

注：持有人为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（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	1,395,141.84	0.5597%

注：（1）本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为 100 万份-150 万份（含）；

（2）本基金的基金经理本报告期末未持有本基金份额；

（3）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（2008年10月10日）基金份额总额	1,145,339,439.27
本报告期期初基金份额总额	428,030,184.98
本报告期基金总申购份额	136,853,603.48
减：本报告期基金总赎回份额	315,614,084.92
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	249,269,703.54

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

本基金本报告期内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 基金管理人的重大人事变动：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

经公司内部讨论，本基金本报告期内改聘普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金审计的会计师事务所，并依法履行了公告手续。

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

10.7.1 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	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		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	
上海证券	1	22,989,585.28	1.75%	20,929.91	1.76%	-
宏源证券	1	80,198,592.17	6.11%	73,012.03	6.14%	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	210,627,693.28	16.05%	186,385.16	15.67%	-
中投证券	1	286,553,144.09	21.84%	260,878.72	21.94%	-
中信证券	1	711,753,692.26	54.24%	647,977.66	54.49%	-

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营机构，使用其交易单元作为基金的专用交易单元，选择的标准是：

- (1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 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；
- (4) 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；
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施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；
- (6) 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。

2) 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对象。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比，评比内容包括：提供研究报告质量、数量、及时性及提供研究服务主动性和质量等情况，并依据评比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营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，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。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期内未通过券商交易单元进行权证交易、债券交易及债券回购交易。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	鹏华基金管理有限公司旗下基金 2012年12月31日资产净值公告	《中国证券报》,《上海 证券报》,《证券时 报》	2013年1月4日
2	鹏华关于旗下基金参与诺亚正行 申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》,《上 海证券报》,《证券时 报》	2013年1月4日
3	鹏华基金管理有限公司关于旗下 部分基金参与工商银行 2013 年 定投申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》,《上 海证券报》,《证券时 报》	2013年1月4日
4	鹏华盛世创新股票型证券投资基 金(LOF)改聘会计师事务所的公 告	《证券时报》	2013年1月5日
5	鹏华基金管理有限公司关于旗下 基金持有的股票停牌后估值方法 变更的提示性公告	《中国证券报》,《上 海证券报》,《证券时 报》	2013年1月9日
6	鹏华基金关于参加浙商银行费率 优惠的公告	《中国证券报》,《上 海证券报》,《证券时 报》	2013年1月10日
7	鹏华管理有限公司关于成立鹏华 资产管理(深圳)有限公司的公告	《证券时报》	2013年1月12日
8	鹏华基金管理有限公司关于旗下 基金持有的股票停牌后估值方法 变更的提示性公告	《中国证券报》,《上 海证券报》,《证券时 报》	2013年1月19日

9	2012 年第 4 季报报告	《中国证券报》,《上海证券报》,《证券时报》	2013 年 1 月 22 日
10	关于鹏华基金管理有限公司与财付通合作开通网上直销第三方支付业务的公告	《中国证券报》,《上海证券报》,《证券时报》	2013 年 2 月 1 日
11	关于鹏华基金管理有限公司与支付宝合作开通网上直销第三方支付业务及费率优惠的公告	《中国证券报》,《上海证券报》,《证券时报》	2013 年 2 月 1 日
12	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金参与非公开发行股票的公告 (华邦制药)	《中国证券报》,《上海证券报》,《证券时报》	2013 年 2 月 19 日
13	鹏华基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《中国证券报》,《上海证券报》,《证券时报》	2013 年 3 月 9 日
14	参与工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》,《上海证券报》,《证券时报》	2013 年 3 月 29 日
15	2012 年年度报告摘要	《中国证券报》,《上海证券报》,《证券时报》	2013 年 3 月 29 日
16	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》,《上海证券报》,《证券时报》	2013 年 4 月 2 日
17	鹏华关于旗下基金参与和讯基金网上申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》,《上海证券报》,《证券时报》	2013 年 4 月 19 日
18	鹏华基金管理有限公司关于新增和讯信息科技有限公司为旗下部	《中国证券报》,《上海证券报》,《证券时报》	2013 年 4 月 19 日

	分开放式基金代销机构的公告	报》	
19	鹏华基金关于好买基金的上线定投的公告	《中国证券报》,《上海证券报》,《证券时报》	2013 年 4 月 19 日
20	鹏华关于部分基金参与好买基金网上定投费率优惠活动的公告	《中国证券报》,《上海证券报》,《证券时报》	2013 年 4 月 19 日
21	2013 年第 1 季报报告	《中国证券报》,《上海证券报》,《证券时报》	2013 年 4 月 20 日
22	鹏华盛世创新股票型证券投资基金更新招募书摘要	《中国证券报》,《上海证券报》,《证券时报》	2013 年 5 月 23 日
23	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》,《上海证券报》,《证券时报》	2013 年 6 月 21 日
24	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》,《上海证券报》,《证券时报》	2013 年 6 月 25 日
25	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》,《上海证券报》,《证券时报》	2013 年 6 月 25 日
26	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》,《上海证券报》,《证券时报》	2013 年 6 月 27 日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- (一)《鹏华盛世创新股票型证券投资基金(LOF)基金合同》;
- (二)《鹏华盛世创新股票型证券投资基金(LOF)托管协议》;
- (三)《鹏华盛世创新股票型证券投资基金(LOF)2013 年半年度报告》(原文)。

11.2 存放地点

深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心 43 层鹏华基金管理有限公司

北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼中国建设银行股份有限公司

11.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件,或通过本基金管理人网站(<http://www.phfund.com>)查阅。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人鹏华基金管理有限公司,本公司已开通客户服务系统,咨询电话:4006788999。

鹏华基金管理有限公司
2013 年 8 月 27 日