

# 鹏华行业成长证券投资基金 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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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 2013 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
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
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>12</b>
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
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>12</b>
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.....	15
6.4 报表附注.....	16
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>31</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	31
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	32
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.....	33
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	34
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	35
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.....	36
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.....	36
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.....	36
7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	36
7.10 投资组合报告附注.....	36
<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>37</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	37
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	38

<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>38</b>
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	<b>38</b>
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.....	39
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	39
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
<b>§11 备查文件目录</b> .....	<b>43</b>
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	鹏华行业成长证券投资基金
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
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
报告期末基金份额总额	563,411,477.39 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

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。
投资策略	<p>(1) 一级资产配置：本公司的投资决策委员会在综合考虑宏观经济形势、政策变动以及市场走势等因素的前提下及时调整基金财产中股票、债券和现金的配置比例。</p> <p>(2) 股票投资：在基金一级资产配置中股票的投资比例确定之后，本基金通过两次优化配置最终完成投资组合的构建。</p> <p>(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）。本基金将在对利率走势和债券发行人基本面进行分析的基础上，综合考虑利率变化对不同债券品种的影响、收益率水平、信用风险的大小、流动性好坏等因素，建立由不同类型、不同期限债券品种构成的组合。</p>
业绩比较基准	中信标普 A 股综合指数涨跌幅×80%+中信标普国债指数涨跌幅×20%
风险收益特征	本基金为证券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低于积极成长型基金，高于指数型基金、货币市场基金、纯债券基金和国债。

### 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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张戈	赵会军

	联系电话	0755-82825720	010-66105799
	电子邮箱	zhangge@phfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4006788999	95588
传真		0755-82021126	010-66105798
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	北京市西城区复兴门内大街 55 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	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		518048	100140
法定代表人		何如	姜建清

## 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	<a href="http://www.phfund.com">http://www.phfund.com</a>
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第 43 层鹏华基金管理有限公司 北京市西城区复兴门内大街 55 号中国工商银行股份有限公司

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	鹏华基金管理有限公司	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层

## § 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	42,377,561.86
本期利润	-16,956,443.55
加权平均基金份额本期利润	-0.0241
本期加权平均净值利润率	-2.70%
本期基金份额净值增长率	-4.12%
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	314,957,398.68
期末可供分配基金份额利润	0.5590
期末基金资产净值	470,367,565.42
期末基金份额净值	0.8349
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2013年6月30日)</b>
基金份额累计净值增长率	261.06%

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

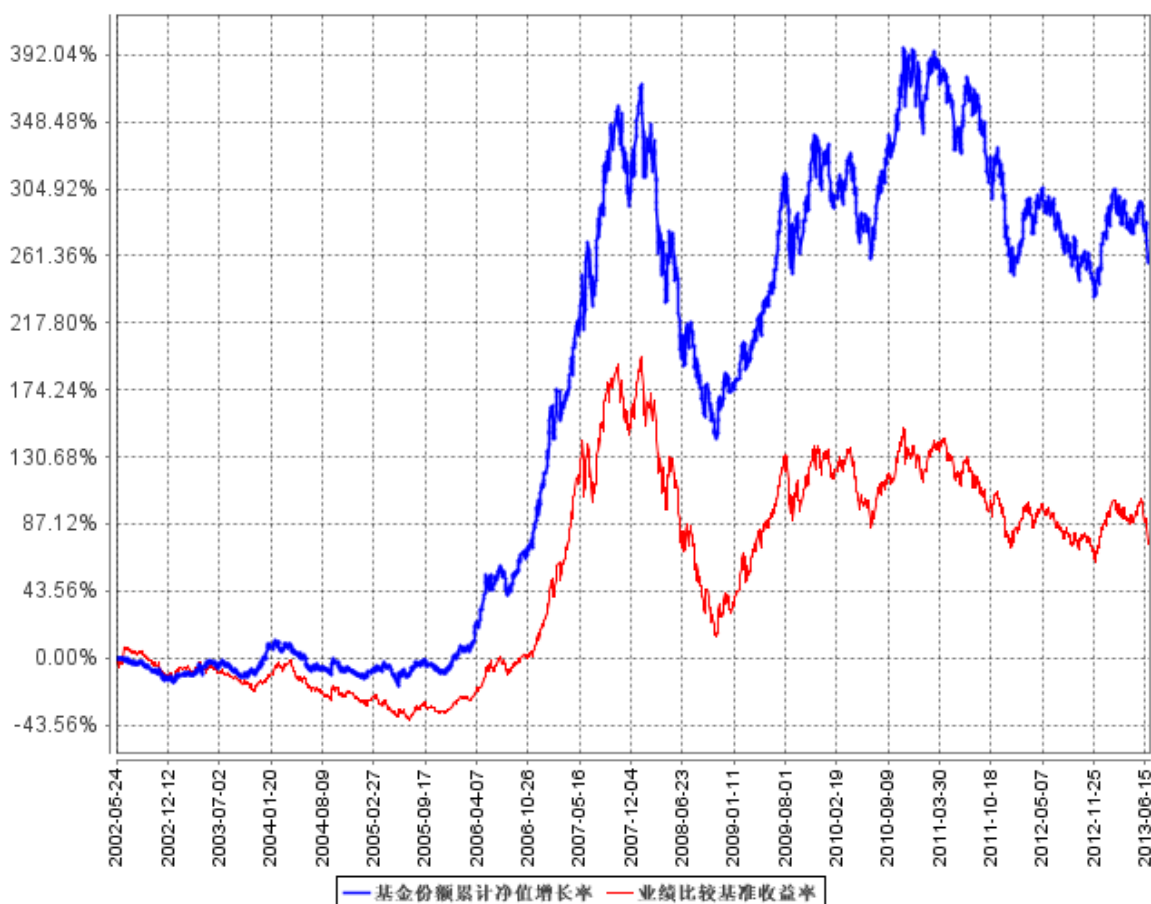
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-8.73%	1.14%	-12.72%	1.48%	3.99%	-0.34%
过去三个月	-7.09%	0.91%	-7.87%	1.14%	0.78%	-0.23%
过去六个月	-4.12%	1.03%	-6.11%	1.15%	1.99%	-0.12%
过去一年	-5.50%	0.98%	-5.85%	1.08%	0.35%	-0.10%
过去三年	-0.94%	1.07%	-6.41%	1.11%	5.47%	-0.04%
自基金合同生效日起至 今	261.06%	1.21%	76.33%	1.40%	184.73%	-0.19%

注：业绩比较基准=中信标普 A 股综合指数涨跌幅×80%+中信标普国债指数涨跌幅×20%

### 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 2002 年 5 月 24 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。



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		
彭建辉	本基金基金经理	2013年3月16日	-	5	彭建辉先生，国籍中国，工学博士，5年证券从业经验。曾任职于博时基金管理有限公司，担任研究部研究员，从事行业研究工作；2011年7月加盟鹏华基金管理有限公司从事研究投资工作，历任高级研究员、基金经理助理，2013年3月起至今担任鹏华行业成长证券投资基金基金经理。彭建辉具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理发生变动，新聘任基金经理彭建辉，改由彭建辉担任本基金基金经理。
张卓	本基金基金经理	2011年1月28日	2013年3月16日	9	张卓先生，国籍中国，管理学硕士，9年证券从业经验。2004年6月加盟鹏华基金管理有限公司从事行业研究工作，历任行业研究员、鹏华动力增长混合型证券投资基金（LOF）基金经理助理，2007年8月至2009年1月担任鹏华优质治理股票型证券投资基金（LOF）基金经理，2011年1月至2013年3月担任鹏华行业成长证券投资基金基金经理，2009年1月起至今担任鹏华普天收益证券投资基金基金经理。张卓先生具备基金从业

					资格。本报告期内本基金基金经理发生变动，张卓先生不再担任本基金基金经理。
--	--	--	--	--	--------------------------------------

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

在本报告期内，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、《鹏华行业成长证券投资基金基金合同》的规定。

#### 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、分配等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

上半年，宏观经济弱复苏而货币相对宽松，使得“小而美”的成长股受到市场的强力追捧，创业板指数上涨 41.72%。与此同时，传统的大盘价值股却大幅下跌，上证指数下跌 12.78%，市场结构分化明显。

本基金在报告期内，出于对经济增长的担忧继续回避了对房地产，煤炭，有色等强周期行业的配置，同时维持了对家电、汽车和公用事业的配置。但我们低估了在宏观经济偏弱情形下市场对新兴产业的追逐力度，TMT 等新兴行业的配置比例不足对本组合形成一定的拖累。

#### 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-4.12%，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

展望后市，目前经济增长水平仍在政府可接受范围，而流动性可能较上半年偏紧，因此市场的整体性机会不大。

我们继续以低估值或者消费类资产如家电、汽车、医药等行业为配置基础，重点持有质地优秀，业绩增长确定，善待投资者的公司，同时持续关注公司基本面的变化，力求获得良好回报。

#### 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，本基金本期利润总额为-16,956,443.55 元，基金份额净值 0.8349 元，不符合利润分配条件，本基金本期将不进行利润分配。

4.7.2 本基金本报告期内未进行利润分配。

## § 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

本报告期内，本基金托管人在对鹏华行业成长证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，鹏华行业成长证券投资基金的管理人——鹏华基金管理有限公司在鹏华行业成长证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，鹏华行业成长证券投资基金未进行利润分配。

### 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

本托管人依法对鹏华基金管理有限公司编制和披露的鹏华行业成长证券投资基金 2013 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 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：鹏华行业成长证券投资基金

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
<b>资产:</b>			
银行存款	6.4.7.1	56,102,817.82	34,020,087.24
结算备付金		391,490.85	1,094,181.09
存出保证金		379,332.09	879,019.41
交易性金融资产	6.4.7.2	412,362,807.75	683,409,283.12
其中: 股票投资		302,672,545.25	536,279,898.12
基金投资		-	-
债券投资		109,690,262.50	147,129,385.00
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		-	3,893,780.67
应收利息	6.4.7.5	2,518,269.96	1,732,371.19
应收股利		734,461.11	-
应收申购款		115,992.07	252,675.99
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		472,605,171.65	725,281,398.71
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2013 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2012 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债:</b>			
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		-	12,427,735.89
应付赎回款		172,963.63	255,127.43
应付管理人报酬		608,384.27	845,789.54
应付托管费		101,397.36	140,964.91
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	922,514.50	962,520.58
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	432,346.47	330,710.12
负债合计		2,237,606.23	14,962,848.47
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	155,410,166.74	225,004,043.99
未分配利润	6.4.7.10	314,957,398.68	485,314,506.25
所有者权益合计		470,367,565.42	710,318,550.24
负债和所有者权益总计		472,605,171.65	725,281,398.71

注：报告截至日 2013 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.8349 元，基金份额总额 563,411,477.39 份。

## 6.2 利润表

会计主体：鹏华行业成长证券投资基金

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
<b>一、收入</b>		-8,955,443.57	51,642,185.38
1.利息收入		2,368,904.18	3,289,918.48
其中：存款利息收入	6.4.7.11	240,734.21	261,461.98
债券利息收入		2,128,169.97	3,028,456.50
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）		47,783,067.63	-96,004,400.75
其中：股票投资收益	6.4.7.12	43,159,580.33	-100,153,940.89
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	722,966.67	226,550.62
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	3,900,520.63	3,922,989.52
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-59,334,005.41	144,220,211.53
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	226,590.03	136,456.12
<b>减：二、费用</b>		8,000,999.98	10,777,128.24
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	4,675,242.89	6,421,628.37
2. 托管费	6.4.10.2.2	779,207.20	1,070,271.48
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	2,354,195.51	3,085,607.47
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	192,354.38	199,620.92
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-16,956,443.55	40,865,057.14
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-16,956,443.55	40,865,057.14

**6.3 所有者权益（基金净值）变动表**

会计主体：鹏华行业成长证券投资基金

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）	225,004,043.99	485,314,506.25	710,318,550.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-16,956,443.55	-16,956,443.55
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）	-69,593,877.25	-153,400,664.02	-222,994,541.27
其中：1.基金申购款	5,802,744.11	12,998,095.45	18,800,839.56
2.基金赎回款	-75,396,621.36	-166,398,759.47	-241,795,380.83
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）	155,410,166.74	314,957,398.68	470,367,565.42
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）	274,869,233.19	567,059,611.94	841,928,845.13
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	40,865,057.14	40,865,057.14
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）	-19,923,076.07	-46,328,501.05	-66,251,577.12
其中：1.基金申购款	15,292,984.89	34,182,189.65	49,475,174.54
2.基金赎回款	-35,216,060.96	-80,510,690.70	-115,726,751.66
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）	254, 946, 157. 12	561, 596, 168. 03	816, 542, 325. 15

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

鹏华行业成长证券投资基金(以下简称“本基金”)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[2002]13 号文核准,由基金管理人鹏华基金管理有限公司依照《证券投资基金法》及相关法律法规的规定以及《鹏华行业成长证券投资基金基金合同》的约定募集设立。本基金为契约型开放式,存续期限为不定期。经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)验资报告予以验证,本基金首次募集不包括认购资金利息共募集人民币 3,977,178,040.00 元。经向中国证监会备案,本基金基金合同已于 2002 年 5 月 24 日生效,基金合同生效日的基金份额总额为 3,977,178,040.00 份。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《鹏华行业成长证券投资基金招募说明书》和《鹏华行业成长证券投资基金基金份额拆分的公告》的有关规定,本基金于 2008 年 3 月 10 日进行了基金份额拆分,拆分比例为 1:3.625254372,并于 2008 年 3 月 11 日进行了变更登记。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华行业成长证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金投资于股票、债券的比例不低于基金资产总值的 80%,投资于国家债券的比例不低于基金资产净值的 20%,此外,本基金应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为:中信标普 A 股综合指数涨跌幅×80%+中信标普国债指数涨跌幅×20%。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

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》、《鹏华行业成长证券投资基金基金合同》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

本报告期本基金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收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	56,102,817.82
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	56,102,817.82

### 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	324,363,716.31	302,672,545.25	-21,691,171.06	
债券	交易所市场	44,459,247.10	44,827,762.50	368,515.40
	银行间市场	64,268,208.33	64,862,500.00	594,291.67
	合计	108,727,455.43	109,690,262.50	962,807.07
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	433,091,171.74	412,362,807.75	-20,728,363.99	

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

截至本报告期末，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	9,008.25
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	158.58
应收债券利息	2,508,949.50
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	153.63
合计	2,518,269.96

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	922,239.50
银行间市场应付交易费用	275.00
合计	922,514.50

#### 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	250,000.00
应付赎回费	214.59
预提费用	181,991.88
应付其他	140.00
合计	432,346.47

#### 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	815,702,841.27	225,004,043.99
本期申购	21,036,353.45	5,802,744.11
本期赎回(以“-”号填列)	-273,327,717.33	-75,396,621.36
本期末	563,411,477.39	155,410,166.74

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	604,030,644.25	-118,716,138.00	485,314,506.25
本期利润	42,377,561.86	-59,334,005.41	-16,956,443.55
本期基金份额交易产生的变动数	-194,116,377.81	40,715,713.79	-153,400,664.02
其中：基金申购款	16,123,370.85	-3,125,275.40	12,998,095.45
基金赎回款	-210,239,748.66	43,840,989.19	-166,398,759.47
本期已分配利润	-	-	-
本期末	452,291,828.30	-137,334,429.62	314,957,398.68

#### 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	225,836.38
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	11,975.31
其他	2,922.52
合计	240,734.21

注：其他为申购款利息收入 11.90 元与结算保证金利息收入 2,910.62 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	848,642,316.54
减：卖出股票成本总额	805,482,736.21
买卖股票差价收入	43,159,580.33

**6.4.7.13 债券投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	97,227,678.77
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	94,253,883.33
减：应收利息总额	2,250,828.77
债券投资收益	722,966.67

**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	3,900,520.63
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,900,520.63

**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	-59,334,005.41
——股票投资	-58,493,741.24
——债券投资	-840,264.17
——资产支持证券投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-59,334,005.41

**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	225,792.74
转换费收入	797.29
合计	226,590.03

#### 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	2,353,483.01
银行间市场交易费用	712.50
合计	2,354,195.51

#### 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	33,224.36
信息披露费	148,767.52
上海清算所数字证书费	400.00
账户维护费	9,000.00
银行汇划费用	962.50
合计	192,354.38

### 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、基金注册登记人、基金销售机构

中国工商银行股份有限公司(“工商银行”)	基金托管人、基金代销机构
国信证券股份有限公司(“国信证券”)	基金管理人的股东、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

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：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	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例
国信证券	361,438,767.73	24.44%	564,991,508.66	28.16%

##### 6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元发生债券交易。

##### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元发生债券回购交易。

##### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方发生权证交易。

##### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
国信证券	327,942.70	24.71%	22,414.65	2.43%
关联方名称	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
国信证券	478,717.29	28.58%	147,036.01	17.80%

注：1、佣金的计算公式

上海证券交易所的交易佣金=买(卖)成交金额×1%-买(卖)经手费-买(卖)证管费等由券商

承担的费用

深圳证券交易所的交易佣金=买（卖）成交金额×1%-买（卖）经手费-买（卖）证管费等由券商承担的费用

（佣金比率按照与一般证券公司签订的协议条款订立。）

2、本基金与关联方已按同业统一的基金佣金计算方式和佣金比例签订了《证券交易单元租用协议》。根据协议规定，上述单位定期或不定期地为我公司提供研究服务以及其他研究支持。

## 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	4,675,242.89	6,421,628.37
其中：支付销售机构的客户维护费	243,533.84	235,348.49

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 1.50%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×1.50%÷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	779,207.20	1,070,271.48

注：支付基金托管人中国工商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没有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
工商银行	56,102,817.82	225,836.38	39,953,036.21	245,414.34

**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**

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股票，也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	-	-	524,959	6,892,943.03	7,501,664.11	-

### 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

本基金为混合型证券投资基金。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工商银行股份有限公司，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 0.59%（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、组合在短期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。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，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，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

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。

#### **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	56,102,817.82	-	-	-	56,102,817.82
结算备付金	391,490.85	-	-	-	391,490.85
存出保证金	379,332.09	-	-	-	379,332.09
交易性金融资产	106,930,390.00	-2,759,872.50	302,672,545.25		412,362,807.75
应收利息	-	-	-	2,518,269.96	2,518,269.96
应收股利	-	-	-	734,461.11	734,461.11
应收申购款	-	-	-	115,992.07	115,992.07
资产总计	163,804,030.76	-2,759,872.50	306,041,268.39		472,605,171.65
负债					
应付赎回款	-	-	-	172,963.63	172,963.63
应付管理人报酬	-	-	-	608,384.27	608,384.27
应付托管费	-	-	-	101,397.36	101,397.36
应付交易费用	-	-	-	922,514.50	922,514.50
其他负债	-	-	-	432,346.47	432,346.47
负债总计	-	-	-	2,237,606.23	2,237,606.23
利率敏感度缺口	163,804,030.76	-2,759,872.50	303,803,662.16		470,367,565.42
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	34,020,087.24	-	-	-	34,020,087.24
结算备付金	1,094,181.09	-	-	-	1,094,181.09
存出保证金	-	-	-	879,019.41	879,019.41
交易性金融资产	147,129,385.00	-	-	536,279,898.12	683,409,283.12
应收证券清算款	-	-	-	3,893,780.67	3,893,780.67
应收利息	-	-	-	1,732,371.19	1,732,371.19
应收申购款	-	-	-	252,675.99	252,675.99

资产总计	182,243,653.33	-	-543,037,745.38	725,281,398.71
负债				
应付证券清算款	-	-	12,427,735.89	12,427,735.89
应付赎回款	-	-	255,127.43	255,127.43
应付管理人报酬	-	-	845,789.54	845,789.54
应付托管费	-	-	140,964.91	140,964.91
应付交易费用	-	-	962,520.58	962,520.58
其他负债	-	-	330,710.12	330,710.12
负债总计	-	-	14,962,848.47	14,962,848.47
利率敏感度缺口	182,243,653.33	-	-528,074,896.91	710,318,550.24

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约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

假设	该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有债券资产的利率风险状况测算的理论变动值对基金资产净值的影响金额。		
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。		
	此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
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）
	市场利率下降 25 个基点	46,133.85	207,949.19
市场利率上升 25 个基点	-45,987.24	-207,338.96	

#### 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。

本基金组合投资于股票、债券的比例不低于基金资产总值的 80%，投资于国家债券的比例不低于基金资产净值的 20%。

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	302,672,545.25	64.35	536,279,898.12	75.50
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	302,672,545.25	64.35	536,279,898.12	75.50

#### 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%	20,090,591.57	31,368,732.66
业绩比较基准下降 5%	-20,090,591.57	-31,368,732.66	

#### 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) 各层级金融工具公允价值

于 2013 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层级的余额为 339,998,643.64 元，属于第二层级的余额为 72,364,164.11 元，无属于第三层级的余额(2012 年 12 月 31 日：第一层级 563,445,805.97 元，第二层级 119,963,477.15 元，无第三层级)。

## (iii) 公允价值所属层级间的重大变动

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，本基金不会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还是第三层级。

## (iv) 第三层级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	302,672,545.25	64.04
	其中：股票	302,672,545.25	64.04
2	固定收益投资	109,690,262.50	23.21
	其中：债券	109,690,262.50	23.21
	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	56,494,308.67	11.95
6	其他各项资产	3,748,055.23	0.79
7	合计	472,605,171.65	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	135,194,768.49	28.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	25,114,800.00	5.34
E	建筑业	32,918,963.52	7.00
F	批发和零售业	26,642,954.95	5.66
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	20,966,200.98	4.46
J	金融业	31,675,596.85	6.73
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	12,263,795.60	2.61
M	科学研究和技术服务业	10,393,800.75	2.21
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	7,501,664.11	1.59
S	综合	-	-
	合计	302,672,545.25	64.35



## 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	002664	信质电机	676,655	16,571,280.95	3.52
2	000963	华东医药	349,817	13,940,207.45	2.96
3	601668	中国建筑	4,159,000	13,599,930.00	2.89
4	002431	棕榈园林	694,357	13,165,008.72	2.80
5	002262	恩华药业	570,910	12,702,747.50	2.70
6	600062	华润双鹤	613,270	12,277,665.40	2.61
7	601888	中国国旅	419,993	12,263,795.60	2.61
8	600276	恒瑞医药	461,891	12,175,446.76	2.59
9	000100	TCL 集团	4,749,126	10,780,516.02	2.29
10	300284	苏交科	947,475	10,393,800.75	2.21
11	000651	格力电器	408,000	10,224,480.00	2.17
12	002004	华邦颖泰	699,915	9,861,802.35	2.10
13	600660	福耀玻璃	1,349,970	9,706,284.30	2.06
14	600690	青岛海尔	857,960	9,360,343.60	1.99
15	002521	齐峰股份	1,280,670	9,246,437.40	1.97
16	000982	中银绒业	1,099,984	8,810,871.84	1.87
17	601318	中国平安	250,000	8,690,000.00	1.85
18	600886	国投电力	2,560,000	8,652,800.00	1.84
19	002250	联化科技	420,000	8,395,800.00	1.78
20	600000	浦发银行	1,000,000	8,280,000.00	1.76
21	600016	民生银行	912,205	7,817,596.85	1.66
22	300170	汉得信息	339,928	7,709,567.04	1.64
23	600088	中视传媒	524,959	7,501,664.11	1.59
24	002063	远光软件	494,956	7,152,114.20	1.52
25	601288	农业银行	2,800,000	6,888,000.00	1.46
26	600104	上汽集团	518,363	6,847,575.23	1.46
27	002375	亚厦股份	199,806	6,154,024.80	1.31
28	600718	东软集团	749,941	6,104,519.74	1.30
29	600863	内蒙华电	1,000,000	5,650,000.00	1.20
30	600795	国电电力	2,400,000	5,472,000.00	1.16
31	002311	海大集团	470,784	5,395,184.64	1.15
32	600011	华能国际	1,000,000	5,340,000.00	1.14
33	300210	森远股份	151,039	3,020,780.00	0.64

34	000538	云南白药	30,000	2,520,300.00	0.54
----	--------	------	--------	--------------	------

## 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	000530	大冷股份	27,543,981.97	3.88
2	600894	广日股份	22,969,272.12	3.23
3	600978	宜华木业	21,089,272.70	2.97
4	000088	盐田港	19,945,224.81	2.81
5	002250	联化科技	19,917,191.25	2.80
6	000651	格力电器	19,677,532.43	2.77
7	002664	信质电机	17,940,778.57	2.53
8	002262	恩华药业	14,684,493.22	2.07
9	000848	承德露露	14,283,286.95	2.01
10	600276	恒瑞医药	14,077,401.50	1.98
11	600704	物产中大	14,065,819.97	1.98
12	600030	中信证券	14,049,451.71	1.98
13	601668	中国建筑	14,039,780.00	1.98
14	600809	山西汾酒	13,785,808.22	1.94
15	601888	中国国旅	13,591,503.59	1.91
16	000963	华东医药	13,570,278.77	1.91
17	002431	棕榈园林	13,538,194.42	1.91
18	600062	华润双鹤	13,428,975.37	1.89
19	000100	TCL 集团	12,689,427.39	1.79
20	000887	中鼎股份	12,265,503.31	1.73

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	300167	迪威视讯	39,422,247.19	5.55
2	002317	众生药业	32,926,288.52	4.64

3	000069	华侨城 A	30,847,168.03	4.34
4	000715	中兴商业	27,681,380.83	3.90
5	601965	中国汽研	26,208,405.49	3.69
6	600658	电子城	25,179,453.20	3.54
7	000530	大冷股份	24,713,797.42	3.48
8	600894	广日股份	22,453,820.42	3.16
9	600978	宜华木业	22,124,730.34	3.11
10	300007	汉威电子	21,234,277.19	2.99
11	600067	冠城大通	20,481,499.84	2.88
12	600325	华发股份	19,825,001.67	2.79
13	601100	恒立油缸	19,536,186.09	2.75
14	000001	平安银行	19,422,350.32	2.73
15	000088	盐田港	18,916,034.47	2.66
16	600016	民生银行	18,566,096.03	2.61
17	002190	成飞集成	18,431,250.92	2.59
18	000418	小天鹅 A	17,782,447.70	2.50
19	000848	承德露露	17,563,248.34	2.47
20	601699	潞安环能	16,935,695.02	2.38
21	600809	山西汾酒	16,713,311.59	2.35
22	600704	物产中大	16,527,544.86	2.33
23	300284	苏交科	16,499,320.24	2.32
24	600068	葛洲坝	16,207,283.25	2.28
25	000590	紫光古汉	15,535,748.62	2.19

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	630,369,124.58
卖出股票收入（成交）总额	848,642,316.54

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	42,067,890.00	8.94
2	央行票据	49,945,000.00	10.62
3	金融债券	14,917,500.00	3.17

	其中：政策性金融债	14,917,500.00	3.17
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	2,759,872.50	0.59
8	其他	-	-
9	合计	109,690,262.50	23.32

## 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	1001060	10 央行票据 60	500,000	49,945,000.00	10.62
2	010308	03 国债(8)	421,100	42,067,890.00	8.94
3	130201	13 国开 01	150,000	14,917,500.00	3.17
4	110023	民生转债	26,550	2,759,872.50	0.59

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中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	379,332.09
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	734,461.11
4	应收利息	2,518,269.96
5	应收申购款	115,992.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,748,055.23

## 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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

## 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
38,170	14,760.58	108,280,041.50	19.22%	455,131,435.89	80.78%

**8.2 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	37,966.39	0.0067%

注：（1）本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人本报告期末未持有本基金份额。

（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（2002年5月24日）基金份额总额	3,977,178,040.00
本报告期期初基金份额总额	815,702,841.27
本报告期基金总申购份额	21,036,353.45
减：本报告期基金总赎回份额	273,327,717.33
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	563,411,477.39

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 报告期内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 报告期内基金托管人的重大人事变动：基金托管人的专门基金托管部门本报告期内未发生重大人事变动。

**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

本报告期内未改聘为本基金审计的会计师事务所。

#### 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	
国泰君安	2	20,928,349.51	1.42%	18,519.54	1.40%	-
招商证券	1	546,363,205.49	36.94%	483,479.37	36.43%	-
国信证券	2	361,438,767.73	24.44%	327,942.70	24.71%	-
申银万国	1	151,741,290.71	10.26%	134,276.51	10.12%	-
齐鲁证券	1	398,539,827.68	26.95%	362,830.60	27.34%	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-

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债券交易、债券回购交易及权证交易。

### 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	鹏华行业成长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 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	《中国证券报》，《上海证券报》，《证券时报》	2013 年 1 月 9 日



	变更的提示性公告	报》	
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
13	基金经理变更公告	《中国证券报》,《上海证券报》,《证券时报》	2013 年 3 月 16 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	2013 年 3 月 29 日

		海证券报》,《证券时报》	
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	鹏华基金参与大连银行费率优惠公告	《中国证券报》,《上海证券报》,《证券时报》	2013 年 4 月 2 日
18	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
19	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分开放式基金代销机构的公告	《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
21	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
22	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
23	关于旗下部分基金参加徽商银行股份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 5 月 8 日
24	鹏华基金关于变更基金账户分红方式公告	《中国证券报》,《上海证券报》,《证券时报》	2013 年 5 月 23 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 21 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 25 日
27	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
28	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)《鹏华行业成长证券投资基金基金合同》;
- (二)《鹏华行业成长证券投资基金托管协议》;
- (三)《鹏华行业成长证券投资基金 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第 43 层鹏华基金管理有限公司。

北京市西城区复兴门内大街 55 号中国工商银行股份有限公司

### 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