鹏华基金管理有限公司
PENGHUA FUND MANAGEMENT CO.,LTD

鹏华中国50开放式证券投资基金
更新的招募说明书摘要

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

二〇一一年十二月

本基金经中国证监会 2004 年 3 月 9 日证监基金字[2004]26 号文件《关于同意鹏华中国 50 开放式证券投资基金设立的批复》批准发起设立。根据当时有效的法规，本基金基金合同已于 2004 年 5 月 12 日生效，基金管理人于该日起正式开始对基金财产进行运作管理。

重要提示

投资有风险,投资者申购基金时应认真阅读招募说明书，全面认识本基金产品的风险收益特征，充分考虑投资人自身的风险承受能力，并对于申购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行负责。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本摘要根据本基金的基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准,但中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。请投资者根据自身风险承受能力谨慎选择适合自己的基金产品。

本基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为 2011 年 11 月 11 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2011 年 9 月 30 日（本报告中财务数据未经审计）。

一、　基金管理人

（一）基金管理人概况

1、名称：鹏华基金管理有限公司

2、住所：深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层

3、设立日期：1998 年 12 月 22 日

4、法定代表人：何如

5、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

6、电话：0755-82021233　　传真：0755-82021155

7、联系人：梁静

8、注册资本：人民币 1.5 亿元

9、股权结构：

出资人名称	出资额（万元）	出资比例
国信证券股份有限公司	7,500	50%
意大利欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.)	7,350	49%
深圳市北融信投资发展有限公司	150	1%
总　计	15,000	100%

（二）主要人员情况

1、基金管理人董事会成员

何如先生，董事长，硕士，高级会计师，国籍：中国。历任中国电子器件公司深圳公司副总会计师兼财务处处长、总会计师、常务副总经理、总经理、党委书记，深圳发展银行行长助理、副行长、党委委员、副董事长、行长、党委副书记，现任国信证券股份有限公司董事长、党委书记，鹏华基金管理有限公司董事长。

胡继之先生，董事，金融学博士，高级经济师，国籍：中国。历任中国人民银行武汉市分行办公室科长、金融研究所副所长、所长，中国人民银行深圳分行办公室负责人，深圳证券交易所总经理助理兼办公室主任、理事会秘书长、策划总监、纪委书记、党委委员、副总经理，现任国信证券股份有限公司总裁、党委副书记。

孙煜扬先生，董事，经济学博士，国籍：中国。历任贵州省政府经济体制改革委员会主任科员、中共深圳市委政策研究室副处长、深圳证券结算公司常务副总经理、深圳证券交易所首任行政总监、香港深业（集团）有限公司助理总经理、香港深业控股有限公司副总经理、中国高新技术产业投资管理有限公司董事长兼行政总裁、鹏华基金管理有限公司董事总裁，现任国信证券股份有限公司副总裁。

Massimo Mazzini 先生，董事，经济和商学学士。国籍：意大利。曾在安达信（Arthur Andersen MBA）从事风险管理和资产管理工作，历任 CA AIPG SGR 投资总监、CAAM AI SGR 及 CA AIPG SGR 首席执行官和投资总监、东方汇理资产管理股份有限公司（CAAM SGR）投资副总监、农业信贷另类投资集团（Credit Agricole Alternative Investments Group）国际执行委员会委员、欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）投资方案部投资总监、Epsilon 资产管理股份公司（Epsilon SGR）首席执行官，现任欧利盛资本股份公司（Eurizon Capital S.A.）（卢森堡）首席执行官和总经理，同时兼任欧利盛 AI 资产管理股份公司（Eurizon AI SGR）首席执行官。

Alessandro Varaldo 先生，董事，经济学和商业管理博士，国籍：意大利。曾任米兰德意志银行集团Finanza e Futuro Fondi Sprind股份公司投资管理部债券基金和现金头寸管理高级经理，IMI Fideuram 资产管理股份公司投资管理部固定收益组合和现金管理业务负责人，圣保罗银行投资公司（Banca Sanpaolo Invest S.p.A.）财务及营销策划部负责人，Capitalia 股份公司（Capitalia S.p.A.）产品和销售部负责人，Capitalia 投资管理股份公司（Capitalia Investment Management S.A.）董事总经理，Unicredit Holding 财务风险管理部意大利企业法人风险管理业务负责人，欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A）首席市场官、欧利盛资本股份公司（Eurizon Capital S.A.）（卢森堡）董事，现任意大利联合圣保罗银行股份有限公司（Intesa Sanpaolo S.p.A.）储蓄、投资和养老金产品部负责人。

史际春先生，独立董事，法学博士，国籍：中国。历任安徽大学讲师、中国人民大学副教授，现任中国人民大学法学院教授、博士生导师，国务院特殊津贴专家，兼任中国法学会经济法学研究会副会长、北京市人大常委会和法制委员会委员、北京市人民政府顾问。

李相启先生，独立董事，高级经济师、研究员，国籍：中国。历任陕西省委办公厅秘书、省委政策研究室财贸处处长、副主任，陕西省经济体制改革委员会副书记、副主任、党组书记、主任，陕西省证券监管委员会主席，中国证监会济南证管办党委书记、主任、济南稽查局局长，山东证监局局长，上海证券交易所理事会理事、产品委员会主任。

宋泓先生，独立董事，经济学博士，国籍：中国。曾在美国哥伦比亚大学作访问学者，

并在陕西省社科院工作，现任中国社会科学院世界经济与政治研究所国际贸易研究室主任、研究员、教授、博士生导师。

张新民先生，独立董事，管理学博士，会计学教授，博士生导师，国籍：中国。现任对外经济贸易大学副校长兼国际商学院院长，国务院特殊津贴专家，全国 MBA 教育指导委员会委员，英国特许公认会计师（FCCA），澳洲注册会计师（FCPA）。

2、基金管理人监事会成员

孙枫先生，监事会主席，国际金融专业硕士，高级会计师，中国注册会计师，国籍：中国。历任武汉市经济研究所副所长，武汉市轻工业局副局长，武汉友谊复印机制造公司副经理，深圳市财政局企财处处长、办公室主任、副局长，深圳市商业银行董事长、党委书记，深圳发展银行董事长、党委书记，鹏华基金管理有限公司董事长、党总支书记，现任鹏华基金管理有限公司监事会主席。

Andrea Vismara 先生，监事，法学学士，律师，国籍：意大利。曾在意大利多家律师事务所担任律师，先后在法国农业信贷集团（Credit Agricole Group）东方汇理资产管理股份有限公司（CAAM SGR）法务部、产品开发部，欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）治理与股权部工作，现在欧利盛资本资产管理股份公司运营部工作。

黄俞先生，监事，研究生学历，国籍：中国。曾在中农信公司、正大财务公司工作，曾任鹏华基金管理有限公司董事，现任深圳市北融信投资发展有限公司董事长。

高鹏先生，职工监事，经济学硕士，国籍：中国。曾任博时基金管理有限公司监察法律部监察稽核经理，现任鹏华基金管理有限公司监察稽核部总经理。

刘慧红女士，职工监事，本科学历，国籍：中国。曾在中国工商银行深圳分行、平安证券公司工作，1998 年 12 月加盟鹏华基金管理有限公司，现任鹏华基金管理有限公司登记结算部副总经理。

3、高级管理人员情况

何如先生，董事长，简历同前。

邓召明先生，总裁，经济学博士，讲师，国籍：中国。历任北京理工大学管理与经济学院讲师、中国兵器工业总公司主任科员、中国证监会处长、南方基金管理有限公司副总经理，现任鹏华基金管理有限公司总裁、党总支书记。

高阳先生，副总裁，经济学硕士，十年证券从业经验，CFA，国籍：中国。历任中国国际金融有限公司债券投资经理，博时基金管理有限公司博时价值增长基金基金经理、固定收益部总经理、基金裕泽基金经理、基金裕隆基金经理、股票投资部总经理，现任鹏华基金管

理有限公司副总裁。

曹毅先生，副总裁，经济学博士，国籍：中国。历任中国人民银行广州分行科员，中国人民银行深圳中心支行副主任科员，南方基金管理有限公司市场拓展部副总监、渠道部总监，现任鹏华基金管理有限公司副总裁。

胡湘先生，副总裁，经济学硕士，国籍：中国。历任全国社会保障基金理事会投资部、境外投资部副主任科员、主任科员、副处长，鹏华基金管理有限公司总裁助理，现任鹏华基金管理有限公司副总裁。

吴伟先生，督察长，法学博士，国籍：中国。曾任中国建设银行深圳市分行法律部副科长。2001 年 3 月加盟鹏华基金管理有限公司，历任公司法律顾问、社保基金独立稽察员、监察稽核部总监，现任公司督察长。

4、本基金基金经理

陈鹏，国籍中国，清华大学工商管理硕士，8 年证券从业经验。曾在联合证券有限责任公司任行业研究员；2006 年 5 月加入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、鹏华价值优势股票型证券投资基金（LOF）基金经理助理，2007 年 8 月至 2011 年 1 月担任鹏华行业成长证券投资基金基金经理，2008 年 8 月至 2011 年 5 月担任鹏华普丰基金基金经理，2011 年 1 月起至今担任鹏华中国 50 开放式证券投资基金基金经理，2011 年 6 月 15 日起兼任鹏华新兴产业股票型证券投资基金基金经理。陈鹏先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理未发生变动。

本基金历任基金经理：

自 2004 年 5 月基金合同生效至 2006 年 3 月由黄钦来先生担任本基金基金经理；

自 2006 年 3 月至 2006 年 9 月由胡建平先生担任本基金基金经理；

自 2006 年 9 月至 2007 年 7 月由黄敬东先生担任本基金基金经理。

自 2007 年 8 月至 2011 年 1 月由黄鑫先生担任本基金基金经理。

从 2011 年 1 月 28 日至本招募说明书更新截止日由陈鹏先生担任本基金基金经理。

本基金基金经理管理其它基金情况：

陈鹏先生于 2007 年 8 月至 2011 年 1 月担任鹏华行业成长基金基金经理，2008 年 8 月至 2011 年 5 月担任鹏华普丰基金基金经理，2011 年 6 月 15 日起兼任鹏华新兴产业股票型证券投资基金基金经理。

5、投资决策委员会成员的姓名和职务

投资决策委员会成员组成：公司总裁邓召明先生、副总裁高阳先生、机构投资部总经理

杨俊先生、研究部总经理冀洪涛先生、基金管理部总经理程世杰先生、固定收益部总经理初冬女士、鹏华动力增长基金黄鑫先生。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、 基金托管人

（一）基金托管人概况

公司法定中文名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

公司法定英文名称：BANK OF COMMUNICATIONS CO.,LTD

法定代表人：胡怀邦

住所：上海市浦东新区银城中路188号

办公地址：上海市浦东新区银城中路188号

邮政编码：200120

注册时间：1987年3月30日

注册资本：562.59亿元

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]25号

联系人：张咏东

电话：021-32169999

交通银行始建于1908年，是中国历史最悠久的银行之一，也是近代中国发钞行之一。交通银行先后于2005年6月和2007年5月在香港联交所、上交所挂牌上市，是中国2010年上海世博会唯一的商业银行全球合作伙伴。《财资》杂志（The Asset）“2010年全球最佳交易银行评选”中，交通银行荣膺“中国最具成长性现金管理银行”、“最佳次托管银行”两项大奖。英国《银行家》杂志2011年公布的全球1000家银行排名，交通银行以343.21亿美元的一级资本连续第三年跻身全球商业银行50强。截至2011年9月30日止，交通银行资产总额达到人民币4.36万亿元，实现净利润人民币384.16亿元。

交通银行总行设资产托管部。现有员工具有多年基金、证券和银行的从业经验，具备基金从业资格，以及经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称，员工的学历层次较高，专业分布合理，职业技能优良，职业道德素质过硬，是一支诚实勤勉、积极进取、开拓创新、奋发向上的资产托管从业人员队伍。

(二)主要人员情况

牛锡明先生，交通银行行长，哈尔滨工业大学经济学硕士，高级经济师。2009年12月起担任交通银行副董事长、行长。

王滨先生，交通银行副行长，主管交通银行资产托管业务，南开大学经济学博士，高级经济师。曾任交通银行北京分行副行长、交通银行天津分行行长、交通银行北京分行行长。2006年1月至今任交通银行副行长、党委委员兼北京分行党委书记。

谷娜莎女士，交通银行资产托管部总经理。大学学历，经济师。曾任交通银行研究开发部主任科员、交通银行信托部代理业务处副处长、交通银行证券投资基金托管部规划处副处长、交通银行证券投资基金托管部内控巡查处处长；2001 年 1 月任交通银行证券投资基金托管部总经理助理，2002 年 5 月起任交通银行资产托管部副总经理，2007 年 12 月起任交通银行资产托管部总经理。

（三）基金托管业务经营情况

截止 2011 年 9 月末，交通银行共托管证券投资基金 56 只，包括博时现金收益货币、博时新兴成长股票、长城久富股票(LOF)、富国汉兴封闭、富国天益价值股票、光大保德信中小盘股票、国泰金鹰增长股票、海富通精选混合、华安安顺封闭、华安宝利配置混合、华安策略优选股票、华安创新股票、华夏蓝筹混合(LOF)、华夏债券、汇丰晋信 2016 周期混合、汇丰晋信龙腾股票、汇丰晋信动态策略混合、汇丰晋信平稳增利债券、汇丰晋信大盘股票、汇丰晋信低碳先锋股票、汇丰晋信消费红利股票、建信优势动力封闭、金鹰红利价值混合、金鹰中小盘精选混合、大摩货币、农银恒久增利债券、农银行业成长股票、农银平衡双利混合、鹏华普惠封闭、鹏华普天收益混合、鹏华普天债券、鹏华中国 50 混合、鹏华信用增利债券、融通行业景气混合、泰达宏利成长股票、泰达宏利风险预算混合、泰达宏利稳定股票、泰达宏利周期股票、天治创新先锋股票、天治核心成长股票(LOF)、万家公用事业行业股票(LOF)、易方达科汇灵活配置混合、易方达科瑞封闭、易方达上证 50 指数、易方达科讯股票、银河银富货币、银华货币、中海优质成长混合、兴全磐稳增利债券、华富中证 100 指数、工银瑞信双利债券、长信量化先锋股票、华夏亚债中国指数、博时深证基本面 200ETF 及联接、建信信用增强债券、富安达优势成长。此外，还托管了全国社会保障基金、保险资产、企业年金、QFII、QDII、信托计划、证券公司集合资产计划、ABS、产业基金、专户理财等 12 类产品，托管资产规模超过七千亿元。

三、 相关服务机构

（一）基金销售机构

1、直销机构：

（1）鹏华基金管理有限公司

住所：深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层

法定代表人：何如

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

电话：（0755）82021233

传真：（0755）82021155

联系人：梁静

网址：www.phfund.com.cn

（2）鹏华基金管理有限公司北京分公司

办公地址：北京市西城区金融大街甲 9 号金融街中心南楼 502 房

电话：（010）88082426-178

传真：（010）88082018

联系人：李筠

（3）鹏华基金管理有限公司上海分公司

办公地址：上海市浦东新区花园石桥路 33 号 801B 室

电话：（021）68876878

传真：（021）68876821

联系人：李化怡

（4）鹏华基金管理有限公司武汉分公司

办公地址：武汉市江汉区建设大道 568 号新世界国贸大厦 I 座 4312 室

联系电话：（027）85557881

传真：（027）85557973

联系人：祁明兵

（5）鹏华基金管理有限公司广州分公司

办公地址：广州市珠江新城华夏路 10 号富力中心 24 楼 07 单元

电话：（020）38011004

传真：（020）38010789

联系人：袁桢

2、代销机构：

（1）交通银行股份有限公司

注册（办公）地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：胡怀邦

电话：021-58781234

传真：021-58408483

联系人：曹榕

客户服务电话：95559

网址：www.bankcomm.com

（2）中国建设银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：张建国（代行）

联系人：何奕

客户服务电话：95533

传真：010-66275654

网址：www.ccb.com

（3）中国银行股份有限公司

注册地址：北京市复兴门内大街 1 号

办公地址：北京市复兴门内大街 1 号

法定代表人：肖钢

统一客户服务电话：95566

公司网站：www.boc.cn

（4）深圳发展银行股份有限公司

注册（办公）地址：深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦

法定代表人：肖遂宁

联系人：张青

电话：0755-82088888

传真：0755-82080406

客服电话：95501

网址：www.sdb.com.cn

（5）平安银行股份有限公司

注册（办公）地址：深圳市深南中路 1099 号平安银行大厦

法定代表人：孙建一

联系人：芮蕊

电话：0755-25879756

客服电话：95511-3

网址：http://bank.pingan.com/

（6）中国工商银行股份有限公司

注册（办公）地址：北京复兴门内大街 55 号

法定代表人：姜建清

客户服务电话：95588（全国）

传真：010-66107913

联系人：刘业伟

网址：www.icbc.com.cn

（7）中国农业银行股份有限公司

注册（办公）地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：项俊波

客户服务电话：95599

联系人：张令玮

网址：www.95599.cn

（8）上海银行股份有限公司

注册（办公）地址：上海市浦东新区银城中路 168 号

法定代表人：宁黎明

开放式基金咨询电话：021-962888

开放式基金业务传真：021-68476111

联系人：张萍

联系电话：021-68475888

网址：www.bankofshanghai.com

（9）招商银行股份有限公司

注册（办公）地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：傅育宁

电话：0755-83198888

传真：0755-83195049

联系人：邓炯鹏

客服电话：95555

网址：www.cmbchina.com

(10）中国民生银行股份有限公司

注册（办公）地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：董文标

客户服务电话：95568

联系人：董云巍

传真：010-58560666

网址：www.cmbc.com.cn

（11）中信银行股份有限公司

地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

法定代表人：田国立

联系人：丰靖

客服电话：95558

网站：http://bank.ecitic.com

（12）中国光大银行股份有限公司

注册（办公）地址：北京市西城区复兴门外大街 6 号光大大厦

法定代表人：唐双宁

联系人：李伟

电话：010-68098778

传真：010-68560661

客服电话：95595（全国）

网址：www.cebbank.com

（13）宁波银行股份有限公司

注册（办公）地址： 宁波市鄞州区宁南南路 700 号

法定代表人：陆华裕

电话：0574-89068340

传真：0574-87050024

联系人： 胡技勋

客户服务电话：96528（上海、北京地区 962528）

网址：www.nbcb.com.cn

（14）中国邮政储蓄银行有限责任公司

注册地址：北京市西城区宣武门西大街 131 号

办公地址：北京市西城区金融大街 3 号

法定代表人：刘安东

联系人：陈春林

传真：010-68858117

客户服务电话：95580

网址 www.psbc.com

(15) 北京银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街甲 17 号首层

办公地址：北京市西城区金融大街丙 17 号

法定代表人：闫冰竹

联系人：王曦

传真：010-66226045

客户服务电话：95526

公司网站：www.bankofbeijing.com.cn

（16）广发银行股份有限公司

注册（办公）地址：广州市东风东路 713 号

法定代表人：董建岳

联系人：李静筠

客服电话：400-830-8003

网址：www.gdb.com.cn

（17）浙商银行股份有限公司

注册（办公）地址：中国杭州市庆春路 288 号

法定代表人：张达洋

联系人：毛真海

客户服务热线：95527

传真： 0571-87659188

公司网站：www.czbank.com

（18）上海浦东发展银行股份有限公司

注册（办公）地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人:吉晓辉

客户服务热线：95528

联系人：唐苑

公司网站：www.spdb.com.cn

（19）杭州银行股份有限公司

地址：杭州市庆春路 46 号杭州银行大厦

法定代表人：吴太普

联系人：严峻

客户服务电话： 0571-96523，4008888508

网址：www.hzbank.com.cn

（20）兴业银行股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 154 号中山大厦

办公地址：上海市江宁路 168 号

法定代表人：高建平

联系人：梁曦

客户服务电话：95561

网址: www.cib.com.cn

(21) 华夏银行股份有限公司

办公地点：北京市东城区建国门内大街 22 号

法定代表人：吴建

客户服务电话：95577；

联系人：郑鹏

网站：www.hxb.com.cn；

（22）浙江民泰商业银行股份有限公司

办公地址：温岭市三星大道 168 号

法定代表人：江建法

客户服务电话：4008896521

联系人：刘兴龙

网址：www.mintaibank.com

（23）中国银河证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：顾伟国

联系电话：010－66568430

传真：010-83574087

联系人：田薇

网址：www.chinastock.com.cn

（24）中信证券股份有限公司

住所：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人：王东明

联系人：张于爱

联系电话：010-60833799

传真：010-60833739

网址：www.citics.com

（25）海通证券股份有限公司

住所：上海广东路 689 号

办公地址：上海广东路 689 号

法定代表人：王开国

联系电话：021－23219275

联系人：李笑鸣

客户服务电话：95553

网址：www.htsec.com

（26）国泰君安证券股份有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行厦 29 楼

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行厦 29 楼

法定代表人：万建华

联系电话：021-38676666

传真：021-38670666

联系人：芮敏祺

客户服务电话：95521

网址：www.gtja.com

（27）中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 6 6 号 4 号楼

办公地址：北京市东城区朝内大街 1 8 8 号

法定代表人：王常青

联系人：许梦园

传真：010-65182261

客服电话：4008888108

公司网站：www.csc108.com

（28）国信证券股份有限公司

住所：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16－26 层

法定代表人：何如

联系电话：0755-82133066

传真：0755-82133952

联系人：齐晓燕

客户服务电话：95536

网址：www.guosen.com.cn

（29）兴业证券股份有限公司

住所：福州市湖东路268号

法定代表人：兰荣

办公地址：浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼21层

联系电话：021-38565785

传真：021-38565955

联系人：谢高得

客户服务电话：95562

网址：www.xyzq.com.cn

（30）华泰证券股份有限公司

住所：江苏省南京市中山东路90 号华泰证券大厦

办公地址：江苏省南京市中山东路90 号华泰证券大厦

法定代表人：吴万善

联系电话：025-83290575

联系人：张威

网址：www.htsc.com.cn

（31）中信万通证券有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层（1507-1510室）

办公地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层

法定代表人：张智河

联系人：吴忠超

联系电话：0532-85022326

传真：0532-85022605

客户服务电话：0532-96577

网址：www.zxwt.com.cn

（32）招商证券股份有限公司

住所：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

法定代表人：宫少林

联系电话：0755－82960223

联系人：林生迎

客户服务电话：95565

网址：www.newone.com.cn

（33）东吴证券股份有限公司

注册地址：苏州工业园区翠园路 181 号

办公地址：苏州工业园区翠园路 181 号

法定代表人：吴永敏

电话：0512-65581136

传真：0512-65588021

联系人：方晓丹

客户服务热线：0512-33396288

网址：www.dwzq.com.cn

（34）长江证券股份有限公司

注册地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦

办公地址：上武汉市新华路特8号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

联系电话：027-65799999

传真：027-85481900

联系人：李良

客户服务电话：95579或4008888999

网址：www.95579.com

（35）湘财证券有限责任公司

住所：湖南省长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼

办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路198号标志商务中心A栋11层

法定代表人：林俊波

联系电话：021－68634518

传真：021-68865680

联系人：钟康莺

客户服务电话：400-888-1551

网址：www.xcsc.com

（36）国元证券股份有限公司

注册地址：合肥市寿春路１７９号国元大厦 11 楼

法定代表人：凤良志

办公地址：合肥市寿春路１７９号国元大厦11楼

联系电话：0551－2207936

传真：0551-2207935

联系人：祝丽萍

客户服务电话：400-8888-777

网址：www.gyzq.com.cn

（37）广发证券股份有限公司

住所：广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼（4301-4316房）

办公地址：广东省广州天河北路大都会广场5、18、19、36、38、41、42楼

法定代表人：林治海

联系人：黄岚

联系电话：020-87555888

传真：020-87553600

客服电话：95575

网址：www.gf.com.cn

（38）申银万国股份有限公司

住所：上海市常熟路171号

办公地址：上海市常熟路171号

法定代表人：丁国荣

联系电话：021-54047892

联系人：曹晔

客户服务电话：95523或4008895523

电话委托：021-962505

网址：www.sywg..com

（39）华泰联合证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第五层

办公地址：深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第五层

法定代表人：马昭明

电话：0755-82492000

传真：0755-82492962

客户服务热线：95513

联系人：盛宗凌

公司网址：www.lhzq.com

（40）山西证券股份有限公司

注册地址：太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼

办公地址：太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼

法定代表人：侯巍

联系电话：0351－8686659

联系人：郭熠

网址：www.i618.com.cn

客服电话：400-666-1618、95573

（41）长城证券有限责任公司

住所：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

办公地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

法定代表人：黄耀华

联系电话：0755-83516289

联系人：李春芳

网址：www.cc168.com.cn

（42）齐鲁证券有限公司

住所：山东省济南市经七路 86 号

办公地址：山东省济南市经七路 86 号 2316 室

法定代表人：李玮

联系电话：0531-68889157

联系人：王霖

客户服务电话：95538

网址：www.qlzq.com.cn

（43）国都证券有限责任公司

注册地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层办公地址

办公地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层（100007）

法定代表人：常喆

联系人：黄静

客户服务电话：400-818-8118

网址：www.guodu.com

（44）国盛证券有限责任公司

注册地址：江西省南昌市北京西路 88 号江信大厦 4 楼

法定代表人：曾小普

办公地址：江西省南昌市北京西路 88 号江信大厦 4 楼

电话：（0791）86285337

传真：(0791)86289395

联系人：徐美云

网址：www.gsstock.com

（45）财通证券有限责任公司

注册地址：杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心

办公地址：杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心

法定代表人：沈继宁

联系人：乔骏

联系电话：0571-87925129

客户服务电话：96336（上海地区：962336）

网址：www.ctsec.com

（46）金元证券股份有限公司

注册地址：海口市南宝路 36 号证券大厦 4 楼

办公地址：深圳市深南大道 4001 号时代金融中心 17 层

法定代表人：陆涛

电话：0755-83025666

传真：0755-83025625

联系人　马贤清

客户服务热线：400-8888-228

网址：www.jyzq.cn

（47）东莞证券有限责任公司

住所：广东省东莞市莞城区可园南路1 号金源中心30 楼

办公地址：　广东省东莞市莞城区可园南路1 号金源中心30 楼

法定代表人：张运勇

联系人：张巧玲

联系电话： 0769-22119426

公司网址：www.dgzq.com.cn

(48) 宏源证券股份有限公司

住所：新疆乌鲁木齐市文艺路 233 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 19 号

法定代表人：冯戎

联系电话：010-88085201

联系人：李巍

客户服务电话：4008-000-562

网址：www.hysec.com

（49）东北证券股份有限公司

住所：长春市自由大路 1138 号

办公地址：长春市自由大路 1138 号

法定代表人：矫正中

联系电话：0431-85096709

传真：0431-85096795

联系人：潘锴

网址：www.nesc.cn

（50）上海证券有限责任公司

住所：上海市黄浦区西藏中路336 号

办公地址：上海市黄浦区西藏中路336 号

法定代表人：郁忠民

联系电话：021-53519888

传真：021-65081434

联系人：刘乔

客服热线：4008-918-918

公司网站：www.962518.com

（51）东海证券有限责任公司

注册地址：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18 楼

办公地址：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18 楼

法定代表人：朱科敏

联系电话：021- 50586660-8644

传真：021-50586660-8880

联系人：李涛

客服热线：021-50585609、400-888-8588

公司网站：www.longone.com.cn

（52）中信金通证券有限责任公司

注册地址：浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19层、20层

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19层、20层

法定代表人：沈强

联系人：丁思聪

联系电话：0571-87112510

传真：0571-87696598

客户服务电话：96598

网址：www.bigsun.com.cn

（53）光大证券股份有限公司

住所：上海市静安区新闸路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闸路 1508 号

法定代表人：徐浩明

联系电话：021-22169081

传真：021-68817271

联系人：刘晨

客户服务电话：95525

公司网站：www.ebscn.com

（54）平安证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼

办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼

法定代表人：杨宇翔

联系电话：0755-22627802

传真：0755-82400862

联系人：郑舒丽

客服电话：95511—8

网站：www.pingan.com

(55) 西部证券股份有限公司

注册地址：西安市东新街 232 号陕西信托大厦 16－17 层

办公地址：西安市东新街 232 号陕西信托大厦 16－17 层

法定代表人：刘建武

电话：029-87406172

传真：029-87406387

客服热线：029-87406132

联系人：冯萍

网址：www.westsecu.com.cn

(56) 中航证券有限责任公司

注册地址：江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号南昌国际金融大厦 A 栋 41 层

办公地址：江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号南昌国际金融大厦 A 栋 41 层

法定代表人：杜航

电话：0791-86768681

传真：0791-86770178

联系人：戴 蕾

客户服务热线：400-8866-567

网址：http://www.avicsec.com/

（57）华安证券有限责任公司

注册地址：安徽省合肥市长江中路 357 号

办公地址：安徽省合肥市阜南路 166 号润安大厦 A 座 24-32 层

法定代表人：李工

电话：0551- 5161821

传真：0551-5161672

联系人：甘霖

咨询电话：96518（安徽）、4008096518（全国）

公司网址：www.hazq.com

（58）安信证券股份有限公司

住所：深圳市福田区金田路 2222 号安联大厦 34 层、28 层 A02 单元

办公地址：深圳市福田区金田路 2222 号安联大厦 34 层、28 层 A02 单元

深圳市福田区深南大道 2008 号中国凤凰大厦 1 栋 9 层

法定代表人：牛冠兴

联系电话：0755-82825551

传真：0755-82558355

联系人：陈剑虹

客户服务电话：4008001001

网址：www.essence.com.cn

（59）渤海证券股份有限公司

住所：天津市经济技术开发区第二大街42号写字楼101室

办公地址：天津市南开区宾水西道8号

法定代表人：杜庆平

联系人：王兆权

联系电话：022-28451861

传真 022-28451892

网址：wwww.bhzq.com

（60）财富证券有限责任公司

住所：长沙市芙蓉中路二段 8 0 号顺天国际财富中心 2 6 层

地址：长沙市芙蓉中路二段 8 0 号顺天国际财富中心 2 6 层

法定代表人：周晖

联系电话：0731-84403319

传真：0731-84403439

联系人：郭磊

客户服务热线：0731-84403343

网址：www.cfzq.com

（61）中国中投证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层-21 层及第 04 层 01、02、03、05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23 单元

办公地址：深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 04、18 层至 21 层

法定代表人：龙增来

联系人：刘毅

电话 0755-82023442

传真 0755-82026539

网址 www.cjis.cn

客服电话 400 600 8008

（62）万联证券有限责任公司

注册地址：广州市中山二路18号电信广场36、37层

办公地址：广州市中山二路18号电信广场36、37层

法定代表人：张建军

联系人：罗创斌

联系电话：020-37865070

客户服务电话：400-8888-133

网址：www.wlzq.com.cn

（63）第一创业证券有限责任公司

注册地址：广东省深圳市罗湖区笋岗路 12 号中民时代广场 B 座 25、26 层

办公地址：广东省深圳市罗湖区笋岗路 12 号中民时代广场 B 座 25、26 层

法定代表人：刘学民

联系人：崔国良

客服电话：0755-25832583

网址：www.firstcapital.com.cn

（64）中山证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区益田路 6009 号新世界中心 29 层

办公地址：深圳市福田区益田路 6009 号新世界中心 29 层

法定代表人：吴泳良

联系人：李珍

咨询电话：4001022011

网址：www.zszp.com.cn

（65）广州证券有限责任公司

注册地址：广州市越秀区先烈路69号东山广场主楼17楼

办公地址：广州市越秀区先烈路69号东山广场主楼17楼

法定代表人：刘东

联系人：林洁茹

联系电话：020-87323735

客服热线：961303

网址：www.gzs.com.cn

（66）国联证券股份有限公司

注册地址：无锡市县前东街 168 号

办公地址：无锡市太湖新城金融一街八号国联金融大厦 702

法定代表人：雷建辉

电话：0510-82832919

传真：0510-82833124

联系人：徐欣

联系电话：4008885288，0510-82588168

网址：www.glsc.com.cn

(67) 世纪证券有限责任公司

注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 4 1 楼

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 40-42 楼

法定代表人：卢长才

电话：0755－83199511

传真：0755－83199545

联系人：方文

咨询电话：0755－83199511

网址：www.csco.com.cn

(68) 浙商证券有限责任公司

注册地址：杭州市杭大路 1 号黄龙世纪广场 A 座 6-7 楼

办公地址：杭州市杭大路 1 号黄龙世纪广场 A 座 6-7 楼

法定代表人：吴承根

电话：0571-87901912

传真：0571-87902092

联系人：许嘉行

客户服务热线：0571-967777

网址：www.stocke.com.cn

（69）华林证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区民田路 178 号华融大厦 5、6 楼

公司地址：深圳市福田区民田路 178 号华融大厦 5、6 楼

法定代表人：宋志江

联系电话：0755-82707855

传真：0755-82707700

联系人：杨玲

网址：www.chinalions.com

（70）日信证券有限责任公司

注册地址：内蒙古呼和浩特市新城区锡林南路 18 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号长安兴融中心西座 11 层

法定代表人：孔佑杰

联系人：苏江

电话：010- 88086830-652

网址：www.rxzq.com.cn

（71）方正证券股份有限公司

住所：湖南长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦 22-24 层

办公地址：湖南长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦 22-24 层

法定代表人：雷杰

联系人：郭军瑞

联系电话：0731-85832503

客户服务电话：95571

网址：www.foundersc.com

（72）江海证券有限公司

注册地址：哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

办公地址：哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

法定代表人：孙名扬

联系人：张宇宏

联系电话：0451-82336863

客服热线：4006662288

网址：www.jhzq.com.cn

（73）华西证券有限责任公司

注册地址：四川省成都市陕西街239号

办公地址：深圳市深南大道4001号时代金融中心18楼

法定代表人：杨炯洋

联系人：金达勇

联系电话：028－86137782

传真：028-86150615

客户服务咨询电话 ：400-8888-818

网址：www.hx168.com.cn

（74）红塔证券股份有限公司

注册地址：昆明市北京路 155 号附 1 号红塔大厦 9 楼

办公地址：昆明市北京路 155 号附 1 号红塔大厦 9 楼

法定代表人：况雨林

联系人：刘晓明

电话：0871- 3577942

客户服务电话：0871-3577930

网址：www.hongtazq.com

（75）厦门证券有限公司

注册地址：厦门市莲前西路 2 号莲富大厦十七楼

办公地址：厦门市莲前西路 2 号莲富大厦十七楼

法定代表人：傅毅辉

电话：0592-5161642

传真：0592-5161140

联系人：卢金文

客户服务热线：0592-5163588

网址：www.xmzq.cn

(76) 银泰证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区竹子林四路紫竹七道１８号光大银行大厦１８楼

办公地址：深圳市福田区竹子林四路紫竹七道１８号光大银行大厦１８楼

法定代表人：高颂

联系人：林文宇

联系电话：0755-83703759

咨询电话：0755-83710885

公司网址：www.ytzq.net

(77) 华宝证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路166号未来资产大厦27层

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路166号未来资产大厦27层

法定代表人：陈林

联系人：宋歌

客户服务电话：400-820-9898

网址：www.cnhbstock.com

(78)爱建证券有限责任公司

注册地址：上海市南京西路 758 号 23 楼

办公地址：上海市南京西路 758 号 20-25 楼

法定代表： 郭林

联系人： 陈敏

电话：021-62171984

传真：021-62878783

服务热线：021-63340678

公司网站：www.ajzq.com

(79)国金证券股份有限公司

注册地址：成都市东城根上街 95 号

办公地址：成都市东城根上街 95 号

法定代表：冉云

联系人：金喆

电话：028-86690126

传真：028-86690126

服务热线：4006-600109

公司网站：www.gjzq.com.cn

（80）信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街9 号院1 号楼信达金融中心

法定代表人：高冠江

联系人：唐静

联系电话：010-63080985

客服热线：400-800-8899

网址：www.cindasc.com

（81）华龙证券有限责任公司

注册地址：甘肃省兰州市静宁路 308 号

办公地址：甘肃省兰州市东岗路 638 号财富大厦

法定代表人：李晓安

电话：0931-8888088

传真：0931-4890515

联系人：李昕田

客户服务电话：0931-4890619、4890618、4890100

网址：http://www.hlzqgs.com

（82）民生证券有限责任公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-20 层

办公地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-20 层

法定代表：岳献春

联系人：赵明

电话：010－85252656

服务热线：400－619－8888

公司网站：www.mszq.com

（83）华福证券有限责任公司

注册地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层

办公地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7 至 10 层

法定代表人：黄金琳

邮政编码：350003

联系人：张腾

联系电话：0591-87383623

业务传真：0591-87383610

统一客户服务电话：96326（福建省外请先拨 0591）。

公司网址：www.hfzq.com.cn

（84）东兴证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 12-15 层

办公地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 12-15 层

法定代表：徐勇力

联系人：汤漫川

电话：010-66555835

服务热线：010-66555262，66555382

公司网站：www.dxzq.net

（85）天相投资顾问有限公司

注册地址：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701

办公地址：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701

法定代表人：林义相

联系人：姜吉灵

联系电话：010-66045491

基金热线：010-66045678

网址：www.txsec.com

（二）注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

注册（办公）地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：金颖

电话：（010）58598839

传真：（010）58598907

联系人：朱立元

（三）律师事务所与经办律师

律师事务所：北京市德恒律师事务所

住所：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 12 层

办公地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 12 层

负责人：王丽

电话：（010）66575888

传真：（010）65232181

联系人：苏文静

经办律师：陈静茹、苏文静

（四）会计师事务所与经办注册会计师

名称：普华永道中天会计师事务所有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

法定代表人：杨绍信

联系电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

联系人：沈兆杰

经办会计师：薛竞、金毅

四、　基金的名称

本基金名称：鹏华中国 50 开放式证券投资基金

五、　基金的类型

本基金类型：混合型

六、 基金的投资目标

以价值投资为本，通过集中投资于基本面和流动性良好同时收益价值或成长价值相对被低估的股票，长期持有结合适度波段操作，以求在充分控制风险的前提下分享中国经济成长成果和实现基金财产的长期稳定增值。

七、 基金的投资方向

本基金以股票、中央银行票据、债券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具为主要投资方向。

八、 基金的投资策略

1、债券投资方法

本基金债券投资以降低组合总体波动性从而改善组合风险构成为目的，采取积极主动的投资策略，谋取超额收益。如投资有需要则可在严格控制风险的前提下通过回购参与有价值的新股配售和增发。

2、股票投资方法

本基金股票投资中，精选个股，长期持有结合适度波段操作，注重长期收益。将类指数的选股方式与积极的权重配置相结合，从而在保持了收益空间的前提下一定程度上降低了投资风险。股票价值分析兼顾收益性和成长性。

具体流程是：首先选择全市场基本面流动性较好、流通市值较大的 100 只股票；由行业研究小组运用鹏华财务评级系统对其财务指标和资产质量的真实性进行评估，进一步筛选到 80 只；基金经理再根据市场价格波动的情况，动态分析其价值低估程度，选择收益价值或成长价值相对被低估的 50 只左右的股票长期投资；为避免行业配置过于集中，由金融工程研究部对拟投资组合进行行业比例测算，如果个别行业的投资比例过高，则进行适当之调整。

3、决策程序

投资决策委员会：确定本基金总体资产配置和投资策略。投资决策委员会定期召开会议，如需及时做出重大决策或经基金管理小组提议，可临时召开投资决策委员会会议。

金融工程研究员及行业研究员：对于宏观经济、行业、上市公司、投资策略、金融工程、可投资股票备选库的建立与完善、投资风险控制与基金绩效评估等与投资决策有关的内容进

行全面深入的研究，作为投资决策的依据。

基金管理部：构造和调整投资组合。设计和调整投资组合需要考虑的基本因素包括：投资决策委员会决议、每日基金申购和赎回净现金流量；基金合同所设定的投资限制和比例限制；研究员的投资建议；基金经理的独立判断；绩效与风险评估小组的建议等。

集中交易室：基金经理向集中交易室下达投资指令，集中交易室经理向交易员分配交易指令，交易员执行投资指令。

绩效与风险评估小组：对基金投资组合进行绩效评估，对各种投资风险指标进行测量并向基金管理小组提出预警和调整建议。

监察稽核部：对投资流程的合法合规性进行监控。

九、 基金的业绩比较基准

上证 180 指数涨跌幅×65%＋深证 100 指数涨跌幅×30%＋金融同业存款利率×5%

本基金主要以基本面和流动性良好同时收益价值或成长价值相对被低估的股票为投资对象，且股票投资数目有限，适合用成分指数作为比较基准。而上证 180 指数和深证 100 指数分别是上交所和深交所最重要的成分指数，分别代表了这两个交易所中总市值、成交量最大的一部分 A 股，成长性强，估值水平低，具有很高的投资价值。

本基金充分考虑本基金各资产投资比例要求从而构建上述业绩比较基准。

十、 基金的风险收益特征

本基金属平衡型证券投资基金，为证券投资基金中的中风险品种。长期平均的风险和预期收益低于成长型基金，高于价值型基金、指数型基金、纯债券基金和国债。

十一、基金的投资组合报告（未经审计）

本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。

本基金的托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，已于 2011 年 10 月 21 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。

本报告中所列财务数据截至 2011 年 9 月 30 日，未经审计。

1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	3,301,643,568.16	76.45
	其中：股票	3,301,643,568.16	76.45
2	固定收益投资	401,798,785.00	9.30
	其中：债券	401,798,785.00	9.30
	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	608,233,526.51	14.08
6	其他资产	6,963,857.99	0.16
7	合计	4,318,639,737.66	100.00

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）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	107,996,287.50	2.59
B	采掘业	-	-
C	制造业	1,600,890,161.44	38.43
C0	食品、饮料	323,819,165.10	7.77
C1	纺织、服装、皮毛	21,054,000.00	0.51
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	318,327,241.20	7.64
C5	电子	97,402,000.00	2.34
C6	金属、非金属	217,521,907.82	5.22
C7	机械、设备、仪表	405,409,358.18	9.73
C8	医药、生物制品	169,866,052.02	4.08
C99	其他制造业	47,490,437.12	1.14
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	115,722,753.04	2.78
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	384,183,184.82	9.22
H	批发和零售贸易	216,160,206.90	5.19
I	金融、保险业	581,760,802.95	13.96
J	房地产业	99,347,688.32	2.38
K	社会服务业	69,918,689.73	1.68
L	传播与文化产业	51,765,286.24	1.24

M	综合类	73,898,507.22	1.77
	合计	3,301,643,568.16	79.25

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000858	五 粮 液	6,399,977	232,319,165.10	5.58
2	600050	中国联通	44,999,611	230,398,008.32	5.53
3	601318	中国平安	6,099,881	204,773,005.17	4.92
4	000527	美的电器	11,301,583	166,585,333.42	4.00
5	600036	招商银行	13,999,979	154,839,767.74	3.72
6	000629	攀钢钒钛	17,739,811	142,273,284.22	3.42
7	600000	浦发银行	13,899,817	118,704,437.18	2.85
8	000418	小天鹅A	9,700,000	113,878,000.00	2.73
9	002086	东方海洋	7,999,725	107,996,287.50	2.59
10	000501	鄂武商A	6,214,320	104,959,864.80	2.52

4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	390,000,000.00	9.36
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	11,798,785.00	0.28
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	401,798,785.00	9.64

5 报告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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	1001060	10 央行票据 60	3,000,000	293,400,000.00	7.04
2	1101022	11 央行票据 22	1,000,000	96,600,000.00	2.32
3	126011	08 石化债	131,830	11,798,785.00	0.28

注：上述债券明细为本基金本报告期末持有的全部债券。

6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名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 报告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。

8 投资组合报告附注

（1）本报告期内，本基金投资的前十名证券之一的五粮液的发行主体宜宾五粮液股份有限公司，因涉及多个信息披露事项披露不及时并存在重大遗漏等违规事件，曾于 2011 年 5 月 28 日受到中国证监会的行政处罚。本报告期内，五粮液股份有限公司未再就该事项发布新公告。
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，认为高端白酒估值合理，成长确定且业绩有保证，该股票虽受到行政处罚但长期价值仍在。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。

报告期内本基金投资的前十名证券中的其它证券中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、处罚的股票。

（2） 报告期内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。

（3） 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,353,913.63
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,626,942.14
5	应收申购款	1,983,002.22
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,963,857.99

(4)报告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。

(5) 报告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。

(6) 投资组合报告附注的其他文字描述部分

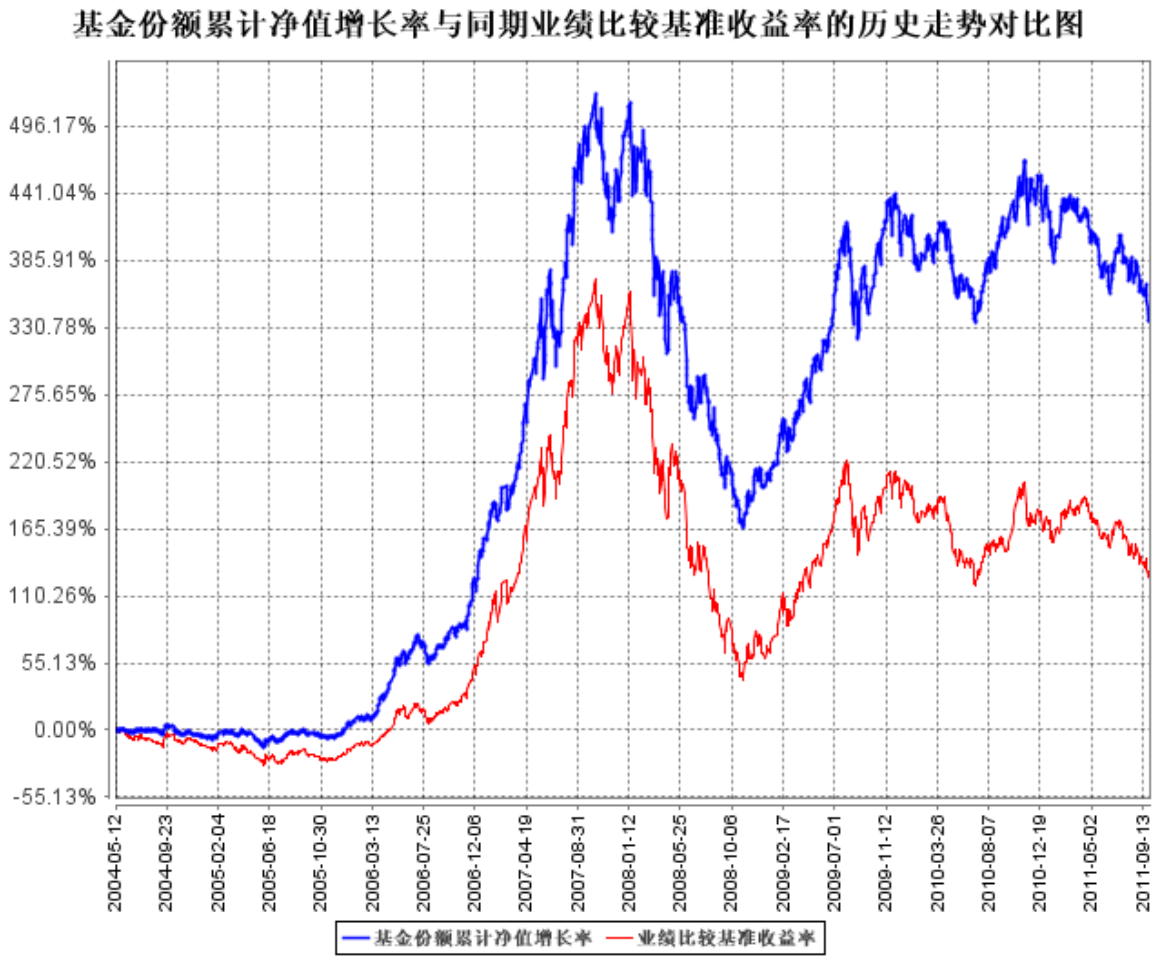
由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

十二、基金的业绩

1、基金合同生效以来的投资业绩及其与同期基准的比较如下表所示：

	净值增长率 1	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
2004 年 5 月 12 日至 2004 年 12 月 31 日	-4.90%	0.68%	-13.42%	1.09%	8.52%	-0.41%
2005 年 1 月 1 日至 2005 年 12 月 31 日	5.15%	0.89%	-7.45%	1.28%	12.60%	-0.39%
2006 年 1 月 1 日至 2006 年 12 月 31 日	157.92%	1.30%	115.20%	1.34%	42.72%	-0.04%
2007 年 1 月 1 日至 2007 年 12 月 31 日	127.81%	1.98%	149.71%	2.18%	-21.90%	-0.20%
2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日	-48.86%	2.08%	-63.21%	2.89%	14.35%	-0.81%
2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日	73.87%	1.57%	92.86%	1.97%	-18.99%	-0.40%
2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	3.58%	1.26%	-11.40%	1.51%	14.98%	-0.25%
2011 年 1 月 1 日至 2011 年 9 月 30 日	-19.58%	1.07%	-16.88%	1.22%	-2.70%	-0.15%
自基金合同生效起至 2011 年 9 月 30 日	335.62%	1.48%	125.02%	1.84%	210.60%	-0.36%

2、基金合同生效以来基金份额净值的变动情况，并与同期业绩比较基准的变动进行比较：



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财产，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，投资人在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

注 1：业绩比较基准（Benchmark）：上证 180 指数涨跌幅×65%＋深证 100 指数涨跌幅×30%＋金融同业存款利率×5%。

注 2：本基金基金合同于 2004 年 5 月 12 日生效；

注 3：基金业绩截止日为 2011 年 9 月 30 日（未经审计）。

十三、基金的费用

（一）与基金运作有关的费用

1、基金费用的种类

（1）基金管理人的管理费；

（2）基金托管人的托管费；

（3）证券交易费用；

（4）基金信息披露费用；

（5）基金份额持有人大会费用；

（6）与基金相关的会计师费、审计费、验资费和律师费；

（7）其他按照国家有关规定可以列入的费用。

上述基金费用由基金托管人根据有关法规和相应协议的规定，按费用的实际支出金额支付，列入当期基金费用。国家另有规定的从其规定。

2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

（1）基金管理人的管理费

基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×1.5%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首 2 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

（2）基金托管人的托管费

基金托管费按前一日基金资产净值的 2.5‰年费率计提。计算方法如下：

H=E×2.5‰÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

（3）本条第 1 款第（3）至第（7）项费用由基金托管人根据有关法规及相关合同等的规定，按费用实际支出金额支付，列入当期基金费用。

3、基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可磋商酌情降低基金管理费和基金托管费，此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。

（二）与基金销售有关的费用

1、申购费用

基金的申购费由申购人承担，不计入基金财产。投资者通过场外、场内申购本基金的申购费率相同，具体申购费率如下：

申购金额 M	申购费率
1000 元≤M＜10 万元	1.50%
10 万元≤M＜100 万元	1.00%
100 万元≤M＜500 万元	0.50%
M≥500 万元	0.02%

注：投资者在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。

场外计算公式：

申购费用＝申购金额 /（1＋申购费率）×申购费率

净申购金额＝申购金额－申购费用

申购份额＝净申购金额/T 日基金份额净值

场内计算公式：

净申购金额＝申购金额/（1＋申购费率）

申购手续费＝申购金额－净申购金额

申购份额＝净申购金额/申购当日基金份额净值

场内申购份额保留到整数位，计算所得整数位后小数部分的份额对应的资金返还至投资者资金账户。

2、赎回费用

本基金赎回费用由基金赎回人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取，扣除由基金管理人等相关当事人收取的注册登记等费用后归基金资产。本基金的场外赎回费率按持有年限逐年递减，具体赎回费率如下：

持有年限（Y）	赎回费率
Y＜1 年	0.5%
1 年≤Y＜2 年	0.3%
2 年≤Y＜3 年	0.1%
3 年≤Y	0

说明：赎回费由赎回申请人承担，其中 60%作为注册登记费用由基金管理人收取，40%

归基金财产。

本基金的场内赎回费率为固定值 0.5%。赎回费由赎回申请人承担，其中 60%作为注册登记等费用，40%归入基金财产。

场外计算公式：

赎回费 = 赎回当日基金份额净值×赎回份额×赎回费率

赎回金额 = 赎回当日基金份额净值×赎回份额－赎回费

场内计算公式：

赎回总金额＝赎回份额×赎回当日基金份额净值

赎回手续费＝赎回总金额×赎回费率

净赎回金额＝赎回总金额－赎回手续费

赎回总金额、净赎回金额按四舍五入的原则保留到小数点后两位。

3、转换费用

本基金已经开通与本基金管理人旗下其它基金的转换业务， 相关基金转换费率、计算公式、使用方法及转换业务规则等相关规定请查看相关业务公告。

说明：转换费由转换申请人承担，不低于转换费总额 25%的部分归转出基金的基金财产，其余部分作为注册登记等费用由基金管理人等收取并使用。

4、基金管理人可以在基金合同规定的范围内调整上述费率，无须召开基金份额持有人大会。本基金可在中国证监会允许的条件下按国家的有关规定增加其他种类的基金费用。如本基金仅对新发售的基金份额适用新的基金费用种类，不涉及现有基金份额持有人利益的，无须召开基金份额持有人大会。上述费率如发生变更，基金管理人应最迟于新的费率实施前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。调整后的上述费率还将在最新的招募说明书中列示。

5、基金管理人可以在不违背法律、法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对特定地域范围、特定行业、特定职业的投资者以及以特定交易方式(如网上交易、电话交易等)等定期或不定期地开展基金促销活动。对部分投资人费用的减免不构成对其他投资人的同等义务。

（三）其他费用

按照国家有关规定可以列入的其他费用根据相关法律及中国证监会相关规定列支。

（四）不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损

失，以及处理与基金运作无关事项发生的费用等不列入基金费用。

基金合同生效之前的律师费、会计师费和信息披露费用不得从基金财产列支。国家另有规定的除外。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的规定，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对本基金管理人于 2011 年 6 月 23 日公告的本基金招募说明书进行了更新，主要更新的内容如下：

1、在“重要提示”部分明确了更新招募说明书内容的截止日期及有关财务数据的截止日期。

2、根据实际情况，对“三、基金管理人”的“（二）主要人员情况”中“4、本基金基金经理”的相关内容进行了更新。

3、更新了“四、基金托管人”部分中相关内容。

4、根据本基金管理人刊登的增加代销机构的相关公告，在“五、相关服务机构”一章，新增1家机构为本基金的代销机构。根据实际情况，对“五、相关服务机构”一章的部分相关服务机构的相关内容进行了更新。

5、在“九、基金的投资”一章，更新了基金投资组合报告内容，数据截至日期为 2011 年 9 月 30 日。

6、更新了“十、基金的业绩”一章的投资业绩内容，数据截至日期为 2011 年 9 月 30 日。

7、鉴于本基金管理人投资者服务方面措施的进一步提升，在“二十一、对基金份额持有人的服务”一章，更新了服务中的相关内容。

8、在“二十二、其他应披露事项”一章，更新了 2011 年 5 月 12 日至 2011 年 11 月 11 日期间的信息披露情况，包括公告事项、信息披露的媒体与披露时间。

鹏华基金管理有限公司

2011 年 12 月 24 日