

Disclosure

(上接 B49 版)

(3) 由关联方保管的银行存款余额及由此产生的利息收入

A. 鹏华普天债券投资基金

普天债券基金的银行存款由基金托管人交通银行保管,并按银行间同业利率计息。基金托管人于 2006 年 6 月 30 日保管的银行存款余额为 1,779,548.22 元(2006 年 6 月 30 日:1,583,236.39 元)。2006 年上半年由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为 18,841.07 元(2006 年上半年:16,963.50 元)。

普天债券基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司,于 2006 年 6 月 30 日的相关余额 1,269,256.05 元,计入“结算备付金”科目(2006 年 6 月 30 日:864,013.47)。

B. 鹏华普天收益证券投资基金

普天收益基金的银行存款由基金托管人交通银行保管,并按银行间同业利率计息。基金托管人于 2006 年 6 月 30 日保管的银行存款余额为 3,715,436.67 元(2006 年 6 月 30 日:2,350,003.95 元)。2006 年上半年由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为 24,301.58 元(2006 年上半年:62,580.77 元)。

普天收益基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司,于 2006 年 6 月 30 日的相关余额 10,865,455.83 元,计入“结算备付金”科目(2006 年 6 月 30 日:4,483,872.68 元),其中最低结算备付金 601,906.45 元(2006 年 6 月 30 日:3,578,094.45),其他结算备付金 10,263,550.38 元(2006 年 6 月 30 日:905,778.23 元)。

(4) 关联方交易,下列关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

A. 2006 年上半年及 2006 年上半年本系列基金没有通过关联方席位进行股票、债券、债券回购及权证交易。

B. 关联方报酬

a. 基金管理人报酬

支付给基金管理人鹏华基金管理公司的管理费,根据 2006 年 5 月 9 日发布的《鹏华基金管理有限公司关于普天债券基金新增收费方式及调整费率标准的公告》,从 2006 年 5 月 15 日起,普天债券基金按前一日基金资产净值的 0.6%的年费率计提,逐日计提,按月支付,日管理费=前一日基金资产净值×0.6%÷当年天数,调整后的管理费适用于 A、B 两类基金份额。普天收益基金按前一日基金资产净值的 1.5%的年费率计提,逐日计提,按月支付,日管理费=前一日基金资产净值×1.5%÷当年天数。

截止至 2006 年 6 月 30 日,普天债券基金共需支付基金管理人报酬人民币 277,985.04 元;2006 年上半年共支付基金管理人报酬人民币 142,067.39 元;

截止至 2006 年 6 月 30 日,普天收益基金共需支付基金管理人报酬人民币 1,690,189.83 元;2006 年上半年共支付基金管理人报酬人民币 2,173,912.95 元。

b. 基金托管人报酬

支付给基金托管人交通银行的托管费,根据 2006 年 5 月 9 日发布的《鹏华基金管理有限公司关于普天债券基金新增收费方式及调整费率标准的公告》,从 2006 年 5 月 15 日起,普天债券基金按前一日基金资产净值的 0.18%的年费率计提,逐日计提,按月支付,日托管费=前一日基金资产净值×0.18%÷当年天数,调整后的托管费适用于 A、B 两类基金份额。普天收益基金按前一日基金资产净值的 0.2%的年费率计提,逐日计提,按月支付,日托管费=前一日基金资产净值×0.2%÷当年天数。

截止至 2006 年 6 月 30 日,普天债券基金共需支付基金托管人报酬人民币 76,339.71 元;2006 年上半年共支付基金托管人报酬人民币 91,217.93 元;

截止至 2006 年 6 月 30 日,普天收益基金共需支付基金托管人报酬人民币 225,360 元;2006 年上半年共支付基金托管人报酬人民币 289,855.03 元。

C. 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易
与关联方之间通过银行间同业市场进行的债券交易,该类交易是在正常业务中按照一般商业条款而订立。

a. 鹏华普天债券投资基金:

关联方名称	年度	债券交易额(元)	卖出回购(元)	利息支出(元)
交通银行股份有限公司	2006年上半年	4,091,085.26	0.00	0.00
	2006年上半年	0.00	0.00	0.00

b. 鹏华普天收益投资基金:

2006 年上半年及 2006 年上半年本基金没有与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

4. 本报告期末流通转让受限的基金资产

(1) 鹏华普天债券投资基金

a. 截至 2006 年 6 月 30 日,基金获配但不能流通的股票成本为 813,120.00 元,股票市值为 813,120.00 元,对比成本估值增值为 0.00 元,普天债券投资基金持有未上市或市未流通的股票明细如下:

序号	股票名称	数量(股)	总成本(元)	总市值(元)	估值方法	转让受限原因	受限期限
1	中国银行	264,000	813,120.00	813,120.00	成本价	新股未上市	2006-07-05 上市

b. 本基金截至 2006 年 6 月 30 日止没有持有因股权分置改革而暂时停牌的股票及债券。

(2) 鹏华普天收益证券投资基金

a. 截至 2006 年 6 月 30 日,基金获配但不能流通的股票成本为 1,167,320.00 元,股票市值为 1,167,320.00 元,对比成本估值增值为 0.00 元,普天收益证券投资基金持有未上市或市未流通的股票明细如下:

序号	股票名称	数量(股)	总成本(元)	总市值(元)	估值方法	转让受限原因	受限期限
1	中国银行	379,000	1,167,320.00	1,167,320.00	成本价	新股未上市	2006-07-05 上市

b. 本基金截至 2006 年 6 月 30 日止有以下因股权分置改革而暂时停牌的股票及债券,这些股票及债券将在上市公司完成与流通股股东的沟通协商程序后或在股权分置改革规定的程序结束后复牌:

六. 基金投资组合报告

(一) 本报告期末基金资产组合情况

(1) 鹏华普天债券投资基金

序号	资产品种	金额(元)	金额占基金总资产比例(%)
1	股票	813,120.00	1.04
2	债券	73,275,806.03	93.49
3	权证	0.00	0.00
4	银行存款及清算备付金	3,048,803.67	3.89
5	其他资产	1,237,293.69	1.58
	合计	78,375,022.59	100

(2) 鹏华普天收益证券投资基金

序号	资产品种	金额(元)	金额占基金总资产比例(%)
1	股票	167,213,743.91	68.32
2	债券	52,474,605.00	21.44
3	权证	1,257,048.00	0.51
4	银行存款及清算备付金	14,580,892.50	5.96
5	其他资产	9,210,278.75	3.77
	合计	244,736,568.16	100

(二) 本报告期末行业分类的股票投资组合:

(1) 鹏华普天债券投资基金

序号	证券板块名称	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例(%)
1	A. 农、林、牧、渔业	-	-
2	B. 采矿业	-	-
3	C. 制造业	-	-
其中:	C1 食品、饮料	-	-
	C2 纺织、服装、皮毛	-	-
	C3 木材、家具	-	-
	C4 造纸、印刷	-	-
	C5 石油、化学、塑胶、塑料	-	-
	C6 电子	-	-
	C7 金属、非金属	-	-
	C8 机械、设备、仪表	-	-
	C9 医药、生物制品	-	-
	C99 其他制造业	-	-
4	D. 电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
5	E. 建筑业	-	-
6	F. 交通运输、仓储业	-	-
7	G. 信息技术业	-	-
8	H. 批发和零售贸易	-	-
9	I. 金融、保险业	813,120.00	1.06
10	J. 房地产业	-	-
11	K. 社会服务业	-	-
12	L. 传播与文化业	-	-
13	M. 综合类	-	-
	合计	813,120.00	1.06

(2) 鹏华普天收益证券投资基金

序号	行业	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例(%)
1	A. 农、林、牧、渔业	0.00	0.00
2	B. 采矿业	20,119,300.00	8.31
3	C. 制造业	111,717,724.00	46.17
其中:	C1 食品、饮料	13,757,680.00	5.69
	C2 纺织、服装、皮毛	0.00	0.00
	C3 木材、家具	0.00	0.00
	C4 造纸、印刷	0.00	0.00
	C5 石油、化学、塑胶、塑料	29,158,060.00	12.05
	C6 电子	0.00	0.00
	C7 金属、非金属	26,042,900.00	10.76
	C8 机械、设备、仪表	16,000,794.00	6.61

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	期末市值(元)	市值占净值比例(%)
38	C39 医药、生物制品		20,112,270.00	8.31	
C39	其他制造业		6,645,200.00	2.75	
4	D. 电力、煤气及水的生产和供应业		4,866,000.00	2.01	
E	建筑业		0.00	0.00	
6	F. 交通运输、仓储业		8,306,424.00	3.43	
7	G. 信息技术业		7,468,975.91	3.09	
8	H. 批发和零售贸易		13,568,000.00	5.61	
9	I. 金融、保险业		1,167,320.00	0.48	
10	J. 房地产业		0.00	0.00	
11	K. 社会服务业		0.00	0.00	
12	L. 传播与文化业		0.00	0.00	
13	M. 综合类		0.00	0.00	
	合计		167,213,743.91	69.10	

(三) 本报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

(1) 鹏华普天债券投资基金

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	期末市值(元)	市值占净值比例(%)
1	601982	中国银行	264,000	813,120.00	1.06

注:上述股票明细为本基金截止本报告期末投资的全部股票。

(2) 鹏华普天收益证券投资基金

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	期末市值(元)	市值占净值比例(%)
1	600619	G 茅台	290,000	13,757,680.00	5.69
2	002024	苏宁电器	295,000	13,568,000.00	5.61
3	600653	G 三一	592,000	13,556,800.00	5.60
4	600549	G 厦钨	890,000	13,195,000.00	5.44
5	600456	G 广夏	270,000	12,877,000.00	5.32
6	000792	G 钾肥	600,000	12,189,000.00	5.03
7	600329	G 万华	820,000	11,890,000.00	4.91
8	600276	G 恒瑞	490,000	11,352,000.00	4.69
9	600220	G 振华	560,000	11,064,400.00	4.57
10	000638	G 白云药	302,600	8,760,270.00	3.62

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于鹏华基金管理有限公司网站 <http://www.phfund.com.cn> 的 2006 年半年度报告正文。

(四) 报告期内股票投资组合的重大变动

1. 鹏华普天债券投资基金

(1) 按累计买入价值超出期初基金净值 2%或前 20 名的股票明细如下:

序号	股票代码	股票名称	累计买入金额(元)	占期初净值比例(%)
1	600036	G 招行	6,940,020.65	8.50
2	600011	G 邯 钢	1,636,710.70	2.34
3	601988	中国银行	813,120.00	1.16
4	000932	G 华 菱	612,297.12	0.88
5	600096	G 云天化	568,645.12	0.80
6	601001	大同煤业	216,320.00	0.21
7	002052	同洲电子	80,000.00	0.11

(2) 按累计卖出价值超出期初基金净值 2%或前 20 名的股票明细如下:

序号	股票代码	股票名称	累计卖出金额(元)	占期初净值比例(%)
1	600036	G 招 行	7,396,774.19	10.59
2	600016	G 民生	3,356,953.62	4.91
3	000630	G 桐 都	2,728,708.02	3.80
4	600011	G 邯 钢	1,609,671.19	2.30
5	000792	G 钾 肥	715,983.88	1.02
6	000932	G 华 菱	693,892.28	0.99
7	600096	G 云天化	656,062.22	0.94
8	601001	大同煤业	346,891.73	0.50
9	002052	同洲电子	184,470.66	0.26

注:以上为普天债券基金在本报告期内买入或卖出股票的全部明细。

(3) 报告期内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

	2006 年上半年
买入股票的成本总额	9,857,113.59
卖出股票的收入总额	17,686,362.71

2. 鹏华普天收益证券投资基金

(1) 累计买入价值超出期初基金净值 2%或前 20 名的股票明细如下:

序号	股票代码	股票名称	累计买入金额(元)	占期初净值比例(%)
1	002001	新 和 成	27,572,628.87	12.28
2	600683	G 海 工	23,861,256.39	10.63
3	600331	G 宏 达	22,694,894.61	10.11
4	600456	G 宝 钛	21,548,119.30	9.60
5	600276	G 恒 瑞	21,068,412.43	9.38
6	000060	G 中 金	19,314,169.21	8.60
7	600028	中国石化	18,998,771.22	8.49
8	002024	苏宁电器	18,108,727.22	8.08
9	600549	G 厦 钨	14,796,539.60	6.64
10	600497	G 皖 安	10,859,489.69	4.67
11	600647	G 鲁黄金	10,359,818.25	4.61
12	600619	G 茅 台	10,143,112.26	4.52
13	600320	G 振 华	10,045,830.14	4.47
14	600048	G 国 阳	9,938,766.43	4.42
15	000638	G 白云药	9,517,626.76	4.24
16	000022	G 万 科 A	8,925,315.09	3.97
17	000792	G 钾 肥	8,587,896.08	3.82
18	600625	G 长 润	8,546,742.60	3.81
19	600299	星新材料	8,212,852.70	3.66
20	000027	G 深能源	8,159,326.69	3.63
21	600696	G 新 安	7,664,894.49	3.41
22	000053	G 中 兴	6,531,646.20	2.91
23	600309	G 万 华	5,826,160.44	2.59
24	000900	G 视 听 股	5,682,655.25	2.49
25	600016	G 民 生	5,247,122.08	2.34
26	600099	G 沪 机 电	4,960,876.61	2.21
27	000858	G 广 联 通	4,942,628.29	2.20

(2) 累计卖出价值超出期初基金净值 2%或前 20 名的股票明细如下:

序号	股票代码	股票名称	累计卖出金额(元)	占期初净值比例(%)
1	002001	新 和 成	40,363,889.08	17.97
2	000060	G 中 金	28,681,800.51	12.77
3	600331	G 宏 达	28,203,129.26	12.56
4	600449	G 厦 钨	25,908,388.76	11.54
5	600497	G 皖 安	24,128,346.66	10.74
6	600683	G 海 工	23,917,068.78	10.65
7	600348	G 国 阳	19,381,103.51	8.63
8	600276	G 恒 瑞	18,899,772.68	8.42
9	600028	中国石化	18,687,258.82	8.32
10	000053	G 中 兴	18,191,913.24	8.10
11	600456	G 宝 钛	17,610,867.99	7.84
12	000022	G 万 科 A	16,569,331.14	7.38
13	600143	G 金 发	15,049,895.27	6.70
14	002024	苏宁电器	13,630,200.89	6.01
15	600016	G 民 生	13,542,699.28	6.01
16	000027	G 深能源	12,008,714.25	5.36
17	600299	星新材料	11,308,399.68	5.04
18	000792	G 钾 肥	10,875,458.32	4.94
19	600036	G 招 行	10,726,810.90	4.78
20	600099	G 沪机 电	9,352,107.98	4.16
21	000900	G 视 听 股	8,918,013.00	3.97
22	600596	G 新 安	8,054,620.52	3.63
23	600123	G 兰 花	7,242,335.31	3.25
24	600547	G 鲁黄金	7,026,006.46	3.18
25	600320	G 振 华	5,870,280.56	2.61
26	600160	G 亿 化	5,777,639.03	2.57
27	000069			