

普惠证券投资基金 2006年半年度报告摘要

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

重要提示

基金管理人、基金托管人、基金销售机构及其从业人员在基金业务活动中,应当遵守法律、行政法规及中国证监会的规定,恪守基金管理人应当遵守的职业道德和行为规范,不得从事与基金业务无关的活动,不得损害基金份额持有人的合法权益。

一、基金简介

(一)基金简称:普惠基金
交易代码:184689
基金运作方式:契约型封闭式
基金合同生效日:1999年1月6日
报告期末基金份额总额:20亿份

(二)基金投资目标

本基金的投资目标:为投资者减少和分散投资风险,确保基金财产的安全并谋求基金长期稳定的投资收益。

(三)基金管理人

法定名称:鹏华基金管理有限公司
信息披露负责人:程国洪
联系电话:0756-82021186
传真:0756-82021126
电子邮箱:ph@mail.phfund.com.cn

(四)基金托管人

法定名称:交通银行股份有限公司
信息披露负责人:张咏东
联系电话:021-68888917
传真:021-68408836
电子邮箱:zhangyud@bankcomm.com

(五)信息披露

登载半年度报告正文的管理人互联网网址:http://www.phfund.com.cn

基金半年度报告置备地点:深圳市福田区福华一路与益田路交汇处深圳国际商会中心

二、主要财务指标和基金净值表现(未经审计)

单位:人民币元

Table with 2 columns: Item, 2006年6月30日. Rows include 基金本期净收益, 基金本期净收益, 期末可供分配基金收益, etc.

提示:上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,封闭式基金交易佣金等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

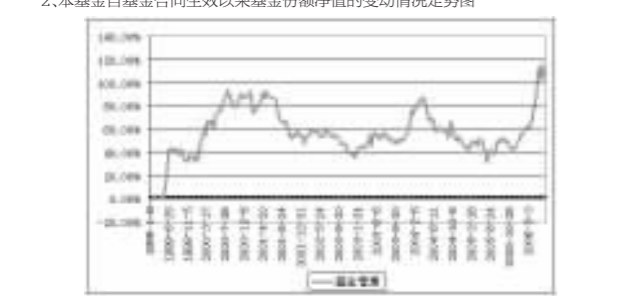
(二)基金净值表现

1.基金历史各时间段基金份额净值增长率

Table with 3 columns: Period, 净值增长率, 净值增长率标准差. Rows include 过去一个月, 过去三个月, etc.

注:基金合同中未规定业绩比较基准。

2.基金自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况走势图



注:基金合同中未规定业绩比较基准。

三、基金管理人报告

(一)基金管理人简介

鹏华基金管理有限公司成立于1998年12月22日,业务范围包括基金发行、募集、管理基金业务及中国证监会批准的其他业务。公司股东由国信证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、安徽国元信托投资有限公司、深圳市北融信投资发展有限公司组成。

(二)基金经理简历

黄中先生,基金普惠基金经理,男,研究生学历,14年证券从业经验,曾在华夏证券有限公司和国信证券股份有限公司从事投资银行及投资管理业务。

(三)基金运作合规性说明

基金运作合规性声明:本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称《基金法》)、《证券投资基金运作管理办法》及其他相关法律法规、基金合同、托管协议、尽职履责地履行了托管人应尽的义务,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

(四)投资策略和业绩表现说明

2006年6月末,本基金份额净值为1.3821元,较05年末增长42.07%;同期上证指数、上证50指数分别上涨44.02%、38.46%。

06年上半年市场走出大幅上涨的行情。大盘上涨的根本原因是制度改革增强了投资者的信心,股改使上市公司治理结构获得较大的改善,且市场经过几年下跌,整体估值也偏低。

(五)市场展望

展望下半年,我们认为影响行情最重要因素是宏观调控。我们将密切关注宏观经济数据的变化,适当调整持仓结构。我们看好那些有良好资产整体上市的公司,仍然看好竞争性服务行业、食品饮料、商业、机械、地产等行业。

四、基金托管人报告

2006年上半年,托管人在普惠证券投资基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》及其他相关法律法规、基金合同、托管协议,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

2006年上半年,鹏华基金管理有限公司在普惠证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金费用开支等问题上,托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面均按照基金合同的规定进行。

五、基金财务会计报告(未经审计)

1.普惠证券投资基金本报告期末及前一年度末的资产负债表

Table with 4 columns: Item, 2006年6月30日, 2005年12月31日. Rows include 资产总计, 负债合计, 所有者权益合计, etc.

2.普惠证券投资基金本报告期末及前一年度末的利润表

Table with 4 columns: Item, 2006年6月30日, 2005年12月31日. Rows include 营业收入, 营业支出, 利润总额, etc.

3.普惠证券投资基金本报告期末及前一年度末的现金流量表

Table with 4 columns: Item, 2006年6月30日, 2005年12月31日. Rows include 经营活动产生的现金流量, 投资活动产生的现金流量, etc.

Table with 5 columns: Item, 2006年6月30日, 2005年12月31日. Rows include 应收股利, 应收利息, 应收申购款, etc.

4.普惠证券投资基金本报告期末及前一年度可比期间的比较式投资业绩表

Table with 5 columns: Item, 2006年上半年, 2005年上半年. Rows include 项目, 基金净收益, 基金净收益, etc.

5.普惠证券投资基金本报告期末及前一年度可比期间的比较式收益分配表

Table with 5 columns: Item, 2006年上半年, 2005年上半年. Rows include 项目, 基金净收益, 基金净收益, etc.

6.普惠证券投资基金本报告期末及前一年度可比期间的比较式净值变动表

Table with 5 columns: Item, 2006年上半年, 2005年上半年. Rows include 项目, 基金净收益, 基金净收益, etc.

(二)会计报表附注

1.本报告期所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表相一致。

2.重大会计差错的内容和更正金额

本期没有重大会计差错。

3.关联方关系及交易

关联方名称:鹏华基金管理有限公司

基金发起人、基金管理人、基金托管人

国信证券有限责任公司

基金发起人、基金管理人、基金托管人

方正证券有限责任公司

基金发起人、基金管理人、基金托管人

安徽国元信托投资有限公司

基金发起人、基金管理人、基金托管人

深圳市北融信投资发展有限公司

基金管理人、基金托管人

本报告期内关联方关系未发生变化。

本报告各关联方投资本基金情况

A.基金管理人投资情况

Table with 5 columns: 年度, 基金管理人, 基金管理人, 基金管理人, 基金管理人. Rows include 2006年上半年, 2006年上半年, etc.

B.基金托管人主要股东及其控制的机构投资者情况

Table with 5 columns: 关联方名称, 年度, 与本基金的关系, 期末持有基金份额, 占基金总份额的比例. Rows include 国信证券, 2006年上半年, etc.

(3)由关联方保管的银行存款余额及由此产生的利息收入

本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管,并按银行同期利率计息。基金托管人于2006年6月30日保管的银行存款余额为76,048,016.57元(2005年6月30日:101,673,190.78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187,187.96元(2005年上半年:608,390.33元)。

本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”转存于中国证券投资基金托管有限责任公司,于2006年6月30日的相关余额58,022,824.81元计入“结算备付金”科目(2005年6月30日:89,454,036.25元),其中最低结算备付金7,765,825.23元(2005年6月30日:3,061,127.48元),其他结算备付金50,256,989.58元(2005年6月30日:86,392,908.77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.通过关联方席位进行的是与关联方签订证券交易席位租用协议后进行,该协议按照与一般证券公司签订的协议条款订立。

Table with 7 columns: 关联方名称, 年度, 股票成交量, 占股票总成交量的比例, 债券成交量, 占债券总成交量的比例, 债券回购成交量, 占债券回购总成交量的比例, 权证成交量, 占权证总成交量的比例, 占权比例. Rows include 国信证券, 2006年上半年, etc.

B.通过关联方席位交易支付的佣金

Table with 5 columns: 关联方名称, 年度, 佣金(元), 占累计佣金比例. Rows include 国信证券, 2006年上半年, etc.

注:佣金的计算公式

上海证券交易场所的交易佣金=买(卖)成交金额×1‰-买(卖)手续费-证券结算风险基金

深圳证券交易场所的交易佣金=买(卖)成交金额×1‰-买(卖)手续费-证券结算风险基金

C.佣金比率按照与一般证券公司签订的协议条款订立。

由关联方获得的服务说明

本基金与关联方已按照统一的基金净值计算方法与佣金比例签订了《证券交易席位租用协议》,根据协议规定,上述单位定期或不定期地向本基金管理人提供研究服务以及其他技术支持。

D.关联方报告

a.基金管理人报酬

Table with 5 columns: 年度, 基金管理人, 基金管理人, 基金管理人, 基金管理人. Rows include 2006年上半年, 2006年上半年, etc.

b.基金托管人报酬

Table with 5 columns: 年度, 基金托管人, 基金托管人, 基金托管人, 基金托管人. Rows include 2006年上半年, 2006年上半年, etc.

c.基金销售服务费

Table with 5 columns: 年度, 基金销售服务费, 基金销售服务费, 基金销售服务费, 基金销售服务费. Rows include 2006年上半年, 2006年上半年, etc.

d.基金持有人服务费

Table with 5 columns: 年度, 基金持有人服务费, 基金持有人服务费, 基金持有人服务费, 基金持有人服务费. Rows include 2006年上半年, 2006年上半年, etc.

e.基金管理人报酬

Table with 5 columns: 年度, 基金管理人报酬, 基金管理人报酬, 基金管理人报酬, 基金管理人报酬. Rows include 2006年上半年, 2006年上半年, etc.

支付基金管理人鹏华基金管理有限公司的管理费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,本基金2006年上半年共需支付基金管理人报酬人民币17,157,480.05元,2006年上半年本基金共支付基金管理人报酬人民币13,928,770.62元。

b.基金托管人报酬

支付基金托管人交通银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值的0.25%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×0.25%÷当年天数。截止至2006年6月30日,本基金2006年上半年需支付基金托管人报酬人民币2,888,746.67元。

c.与关联方进行银行间同业市场的债券回购交易

2005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回购交易。

4.本报告期末流通受限的股票资产

(1)截至2006年6月30日,基金获配不能流通的股票成本为27,972,619.56元,股票市值为31,796,383.46元,对成本估值增值为3,823,763.90元,普惠证券投资基金持有未上市或未流通的股票明细如下:

Table with 7 columns: 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. Rows include 1. 同洲电子, 2. 大同煤业, etc.

(2)截至2006年6月30日止持有以下因股权激励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激励方案规定的程序结束后复牌。

Table with 7 columns: 序号, 股票名称, 停牌日期, 期末估值, 复牌日期, 复牌开盘数量(股), 期末成本总额(元), 期末估值总额(元). Rows include 1. 上海机电, etc.

六、基金投资组合报告

(一)本报告期末基金资产组合情况

Table with 3 columns: 序号, 资产品种, 金额(元), 金额占基金总资产比例(%). Rows include 1. 股票, 2. 债券, etc.

(二)本报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 3 columns: 序号, 行业, 期末市值(元), 市值占净值比例(%). Rows include 1. A.农、林、牧、渔业, 2. B.采掘业, etc.

(三)本报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 3 columns: 序号, 股票名称, 数量(股), 期末市值(元), 市值占净值比例(%). Rows include 1. 000069 侨华侨, 2. 000088 五粮液, etc.

(四)报告期内股票投资组合的重大变动

1.累计买入价值超出期初基金总资产净值2%或者前20名的股票明细如下:

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 累计买入金额(元), 占期初净值比例(%). Rows include 1. 000000 中金, 2. 600028 中国石化, etc.

2.累计卖出价值超出期初基金总资产净值2%或者前20名的股票明细如下:

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 累计卖出金额(元), 占期初净值比例(%). Rows include 1. 000060 万科A, 2. 600060 中金, etc.

3.报告期内买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额:

Table with 2 columns: 2006年上半年, 2005年上半年. Rows include 买入股票的成本总额, 卖出股票的收入总额.

(五)本报告期末按券种分类的债券投资组合

Table with 3 columns: 序号, 债券品种, 期末市值(元), 市值占净值比例(%). Rows include 1. 国债, 2. 金融债, etc.

(六)本报告期末按市值占基金总资产净值大小排序的前五名债券明细

Table with 3 columns: 序号, 债券名称, 期末市值(元), 市值占净值比例(%). Rows include 1. 000100 央行票据, 2. 200100 央行票据, etc.

(七)投资组合报告附注

1.报告期内本基金投资的前十名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

Table with 2 columns: 其他资产明细, 金额(元). Rows include 应收交易保证金, 应收证券清算款, etc.

4.基金持有的处于转股期的可转换债券

本报告期末本基金没有持有处于转股期的可转换债券。

5.股权投资获取权证情况及本报告期末基金持有权证情况

本基金本报告期没有主动投资权证,因股权分置获权权证情况统计如下表:

Table with 5 columns: 权证名称, 本报告期获权数量, 本报告期获权成本(元), 本报告期获权市值(元), 报告期末持有市值占基金资产净值比例(%). Rows include 招商银行认沽权证, 华泰认沽权证, etc.

七、基金持有人结构

(一)本报告期末基金份额持有人信息

Table with 4 columns: 基金份额持有人户数(户), 基金份额(份), 机构投资者持有基金份额(份), 机构投资者持有基金份额占基金总份额的比例(%). Rows include 66,874, 29,906,959, etc.

(二)本报告期末基金前十名份额持有人

Table with 3 columns: 序号, 持有人名称, 持有份额(份), 占基金总份额的比例(%). Rows include 1. 中国人寿保险(集团)公司, 2. 中国人寿保险股份有限公司, etc.

八、重大事件揭示

(一)本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

(二)本基金管理人(以下简称“本公司”)、托管人的重大人事变动:

1.本基金管理人的重大人事变动情况

因本公司第二届董事会、监事会成员任期届满,按照《公司法》及本公司章程的有关规定,董事会、监事会成员已按规定程序进行了换届,根据股东大会推荐,并经股东大会审议通过,部分董事、独立董事、监事发生了变更。

变更后的本公司第二届董事会成员现为:孙枫、胡继之、钱海章、陈毅、过仕刚、黄俞、郝珠江、方兆本、柳青、黄世忠、孙煜烽、殷克勤,其中孙枫任董事长,郝珠江、方兆本、柳青、黄世忠任独立董事,吴瑞坤不再担任本公司董事和副董事长职务,孙文娟不再担任本公司董事,朱祺祈不再担任本公司独立董事。

变更后的本公司第三届监事会成员现为:李国阳、朱天相、徐剑、孙洋,其中李国阳任监事会召集人,程裕芬、戴耀梅不再担任本公司监事。

上述变更事项均已报中国证监会备案,并于2006年1月21日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登。

2.本基金托管人——交通银行股份有限公司的专门基金托管部门的重大人事变动情况

2006年1月25日,交通银行股份有限公司在《证券时报》、《金融时报》上刊登了《交通银行股份有限公司关于新加基金托管行业高管任职资格的公告》。

(三)本报告期内涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

(四)本报告期内本基金投资策略未改变。

(五)本报告期内未进行收益分配。

(六)本报告期内未改聘为本基金审计的会计师事务所。

(七)本基金管理人、基金托管人涉及托管业务的诉讼事项及其高级管理人员在报告期内未受到任何处罚

(八)基金租用证券公司专用交易席位的情况:

1.本基金管理人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,分别向国信证券有限责任公司、方正证券有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、万通证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、天同证券有限责任公司、长城证券股份有限公司、大通证券股份有限公司、中国国际金融有限公司、湘财证券有限责任公司、天同证券有限责任公司、广发证券股份有限公司租用席位作为基金专用交易席位。2006年新增中信建投证券有限责任公司、齐鲁证券有限公司席位作为基金专用席位。

2.普惠证券投资基金2006年1-6月通过各证券经营机构的席位买卖证券的数量及支付的佣金如下:

Table with 10 columns: 券商名称, 席位数, 股票成交量(元), 比例(%), 债券成交量(元), 比例(%), 债券回购成交量(元), 比例(%), 权证成交量(元), 比例(%). Rows include 国信证券, 方正证券, etc.

(九)2006年1-6月股票、债券、债券回购及权证交易量情况如下:

Table with 10 columns: 券商名称, 席位数, 股票成交量(元), 比例(%), 债券成交量(元), 比例(%), 债券回购成交量(元), 比例(%), 权证成交量(元), 比例(%). Rows include 国信证券, 方正证券, etc.

(十)2006年1-6月股票、债券、债券回购及权证交易量情况如下:

Table with 10 columns: 券商名称, 席位数, 股票成交量(元), 比例(%), 债券成交量(元), 比例(%), 债券回购成交量(元), 比例(%), 权证成交量(元), 比例(%). Rows include 国信证券, 方正证券, etc.

(十一)2006年1-6月股票、债券、债券回购及权证交易量情况如下:

Table with 10 columns: 券商名称, 席位数, 股票成交量(元), 比例(%), 债券成交量(元), 比例(%), 债券回购成交量(元), 比例(%), 权证成交量(元), 比例(%). Rows include 国信证券, 方正证券, etc.

(十二)2006年1-6月股票、债券、债券回购及权证交易量情况如下:

Table with 10 columns: 券商名称, 席位数, 股票成交量(元), 比例(%), 债券成交量(元), 比例(%), 债券回购成交量(元), 比例(%), 权证成交量(元), 比例(%). Rows include 国信证券, 方正证券, etc.

(十三)2006年1-6月股票、债券、债券回购及权证交易量情况如下:

Table with 10 columns: 券商名称, 席位数, 股票成交量(元), 比例(%), 债券成交量(元), 比例(%), 债券回购成交量(元), 比例(%), 权证成交量(元), 比例(%). Rows include 国信证券, 方正证券, etc.

(十四)2006年1-6月股票、债券、债券回购及权证交易量情况如下:

Table with 10 columns: 券商名称, 席位数, 股票成交量(元), 比例(%), 债券成交量(元), 比例(%), 债券回购成交量(元), 比例(%), 权证成交量(元), 比例(%). Rows include 国信证券, 方正证券, etc.

(十五)2006年1-6月股票、债券、债券回购及权证交易量情况如下:

Table with 10 columns: 券商名称, 席位数, 股票成交量(元), 比例(%), 债券成交量(元), 比例(%), 债券回购成交量(元), 比例(%), 权证成交量(元), 比例(%). Rows include 国信证券, 方正证券, etc.

(十六)2006年1-6月股票、债券、债券回购及权证交易量情况如下:

Table with 10 columns: 券商名称, 席位数, 股票成交量(元), 比例(%), 债券成交量(元), 比例(%), 债券回购成交量(元), 比例(%), 权证成交量(元), 比例(%). Rows include 国信证券, 方正证券, etc.

(十七)2006年1-6月股票、债券、债券回购及权证交易量情况如下:

Table with 10 columns: 券商名称, 席位数, 股票成交量(元), 比例(%), 债券成交量(元), 比例(%), 债券回购成交量(元), 比例(%), 权证成交量(元), 比例(%). Rows include 国信证券, 方正证券, etc.

(十八)2006年1-6月股票、债券、债券回购及权证交易量情况如下:

Table with 10 columns: 券商名称, 席位数, 股票成交量(元), 比例(%), 债券成交量(元), 比例(%), 债券回购成交量(元), 比例(%), 权证成交量(元), 比例(%). Rows include 国信证券, 方正证券, etc.

(十九)2006年1-6月股票、债券、债券回购及权证交易量情况如下:

Table with 10 columns: 券商名称, 席位数, 股票成交量(元), 比例(%), 债券成交量(元), 比例(%), 债券回购成交量(元), 比例(%), 权证成交量(元), 比例(%). Rows include 国信证券, 方正证券, etc.

(二十)2006年1-6月股票、债券、债券回购及权证交易量情况如下:

Table with 10 columns: 券商名称, 席位数, 股票成交量(元), 比例(%), 债券成交量(元), 比例(%), 债券回购成交量(元), 比例(%), 权证成交量(元), 比例(%). Rows include 国信证券, 方正证券, etc.

(二十一)2006年1-6月股票、债券、债券回购及权证交易量情况如下:

Table with 10 columns: 券商名称, 席位数, 股票成交量(元), 比例(%), 债券成交量(元), 比例(%), 债券回购成交量(元), 比例(%), 权证成交量(元), 比例(%). Rows include 国信证券, 方正证券, etc.

(二十二)2006年1-6月股票、债券、债券回购及权证交易量情况如下:

Table with 10 columns: 券商名称, 席位数, 股票成交量(元), 比例(%), 债券成交量(元), 比例(%), 债券回购成交量(元),