

# 鹏华普天系列证券投资基金 2007 年半年度报告

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

送出日期：2007 年 8 月 29 日

## 重要提示

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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2007年 8 月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。请投资者根据自身风险承受能力谨慎选择基金产品。

本报告期中的财务资料未经审计。

## 目 录

一、基金简介 .....	3
二、主要财务指标和基金净值表现（未经审计） .....	5
三、基金管理人报告 .....	9
四、基金托管人报告 .....	11
五、基金财务会计报告（未经审计） .....	12
六、基金投资组合报告 .....	32
七、基金份额持有人结构 .....	46
八、开放式基金份额变动 .....	47
九、重大事件揭示 .....	48
十、备查文件目录 .....	53

## 一、基金简介

### (一) 基金名称：鹏华普天系列开放式证券投资基金

基金简称：普天债券 A 类基金      普天债券 B 类基金      普天收益基金

交易代码：160602                      160608                      160603

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2003 年 7 月 12 日

报告期末基金份额总额：普天债券 A 类基金 127, 083, 262. 18 份

普天债券 B 类基金 178, 167, 220. 17 份

普天收益基金 441, 274, 504. 59 份

基金合同存续期：不定期

### (二) 基金投资目标：

#### 1、鹏华普天债券投资基金

本基金以分享中国经济成长和资本长期稳定增值为宗旨，主要投资于债券及新股配售和增发，在充分控制风险的前提下实现基金财产的长期稳定增值。

#### 2、鹏华普天收益证券投资基金

本基金以分享中国经济成长和资本长期稳健增值为宗旨，主要投资于连续现金分红股票及债券，通过组合投资，在充分控制风险的前提下实现基金财产的长期稳定增值。

### 基金投资策略：

#### 1、鹏华普天债券投资基金

债券管理的风险因素依据其对超额收益的贡献大小依次分为久期、期限结构、类属配置和个券选择，我们针对每一类别的风险因素设计相应的管理方法即形成投资策略，依次为久期配置策略、期限结构策略、类属配置策略和个券选择策略。在正常的市场状况下，债券投资比例为 80%~95%；股票投资比例不超过 20%。

#### 2、鹏华普天收益证券投资基金

债券投资方法：本基金债券投资的目的是降低组合总体波动性从而改善组合风险构成。但在债券的投资上，则采取积极主动的投资策略，不对持续期作限制。持续期、期限结构、类属配置以及个券选择的动态调整都将是我們获得超额收益的重要来源。

股票投资方法：本基金主要采用积极管理的投资方式。以鹏华股票池中连续两年分红股票以及三年内有两年分红记录的公司作为投资对象，适当集中投资。所有重点投资股票必须经过基金经理/研究员的调研，就企业经营、融资计划、分红能力、绝对价值、相对价值给出全面评估报告。

#### **基金业绩比较基准：**

##### **1、鹏华普天债券投资基金**

本基金的比较基准是“中信标普国债指数涨跌幅\*90%+金融同业存款利率\*10%”。

##### **2、鹏华普天收益证券投资基金**

本基金的业绩比较基准是“中信综合指数涨跌幅\*70%+中信标普国债指数涨跌幅\*25%+金融同业存款利率\*5%”。

#### **基金风险收益特征：**

##### **1、鹏华普天债券投资基金**

本基金属于证券投资基金中的低风险品种。其长期平均的风险和预期收益低于股票型基金，高于货币市场基金。

##### **2、鹏华普天收益证券投资基金**

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

### **（三）基金管理人**

法定名称：鹏华基金管理有限公司

注册及办公地址：深圳市福田区福华三路与益田路交汇处深圳国际商会中心 43 层鹏华基金管理有限公司

邮政编码：518048

法定代表人：孙枫

信息披露负责人：程国洪

联系电话：0755-82021186

传真：0755-82021126

电子邮箱：[ph@mail.phfund.com.cn](mailto: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

注册及办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号 邮政编码：200120

法定代表人：蒋超良

信息披露负责人：张咏东

联系电话：021-68888917

传真：021-58408836

电子邮箱：[zhangyd@bankcomm.com](mailto:zhangyd@bankcomm.com)

#### **(五) 信息披露**

报纸名称：中国证券报，证券时报，上海证券报

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：深圳市福田区福华三路与益田路交汇处深圳国际商会中心 43

层鹏华基金管理有限公司

上海市浦东新区银城中路 188 号交通银行股份有限公司

#### **(六) 其他有关资料**

注册登记机构的名称：中国证券登记结算有限责任公司

注册及办公地址：北京西城区金融大街 27 号投资广场 22 层

## **二、主要财务指标和基金净值表现（未经审计）**

### **(一) 财务指标**

#### **1、鹏华普天债券投资基金**

A 类

单位:人民币元

序号	项 目	2007 年 6 月 30 日
1	基金本期净收益	4,729,262.66
2	加权平均基金份额本期净收益	0.0355
3	期末可供分配基金收益	4,926,579.98
4	期末可供分配基金份额收益	0.0388
5	期末基金资产净值	132,009,842.16
6	期末基金份额净值	1.039
7	基金加权平均净值收益率	3.47%
8	本期基金份额净值增长率	3.67%
9	基金份额累计净值增长率	17.67%

B 类:

单位:人民币元

序号	项 目	2007 年 6 月 30 日
1	基金本期净收益	5,824,575.89
2	加权平均基金份额本期净收益	0.0324
3	期末可供分配基金收益	5,786,911.98
4	期末可供分配基金份额收益	0.0325
5	期末基金资产净值	183,984,012.00
6	期末基金份额净值	1.033
7	基金加权平均净值收益率	3.18%
8	本期基金份额净值增长率	3.38%
9	基金份额累计净值增长率	17.00%

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, 开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等), 计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

## 2、鹏华普天收益证券投资基金

单位:人民币元

序号	项 目	2007 年 6 月 30 日
1	基金本期净收益	258,585,595.16

2	加权平均基金份额本期净收益	0.4395
3	期末可供分配基金收益	185,506,893.81
4	期末可供分配基金份额收益	0.4204
5	期末基金资产净值	678,304,756.42
6	期末基金份额净值	1.537
7	基金加权平均净值收益率	34.37%
8	本期基金份额净值增长率	54.92%
9	基金份额累计净值增长率	301.69%

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，开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

## （二）基金净值表现

### 1、鹏华普天债券投资基金

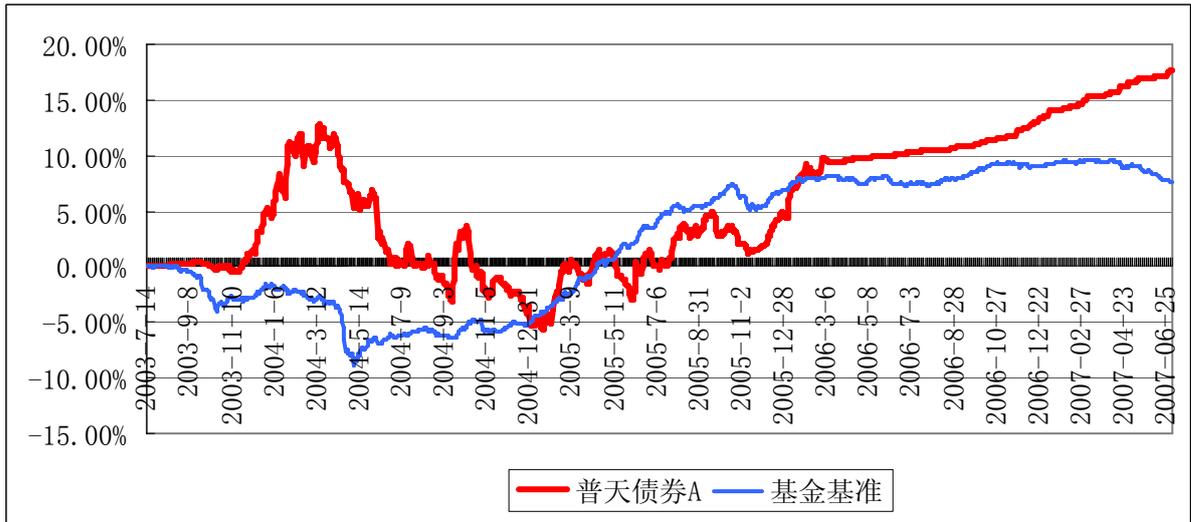
#### （1）普天债券基金历史各时间段基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较列表

A类	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
过去一个月	0.58%	0.07%	-0.86%	0.06%	1.44%	0.01%
过去三个月	1.86%	0.07%	-1.63%	0.07%	3.49%	0.00%
过去六个月	3.67%	0.08%	-1.27%	0.06%	4.94%	0.02%
过去一年	6.73%	0.07%	0.14%	0.07%	6.59%	0.00%
过去三年	16.92%	0.31%	14.99%	0.10%	1.93%	0.21%
自基金合同 生效起至今	17.67%	0.35%	7.69%	0.14%	9.98%	0.21%

B类	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
过去一个月	0.49%	0.05%	-0.86%	0.06%	1.35%	-0.01%
过去三个月	1.67%	0.06%	-1.63%	0.07%	3.30%	-0.01%
过去六个月	3.38%	0.07%	-1.27%	0.06%	4.65%	0.01%
过去一年	6.12%	0.07%	0.14%	0.07%	5.98%	0.00%
过去三年	16.25%	0.31%	14.99%	0.10%	1.26%	0.21%
自基金合同 生效起至今	17.00%	0.35%	7.69%	0.14%	9.31%	0.21%

注：业绩比较基准=中信标普国债指数涨跌幅\*90%+金融同业存款利率\*10%。

#### （2）普天债券基金自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的走势图：



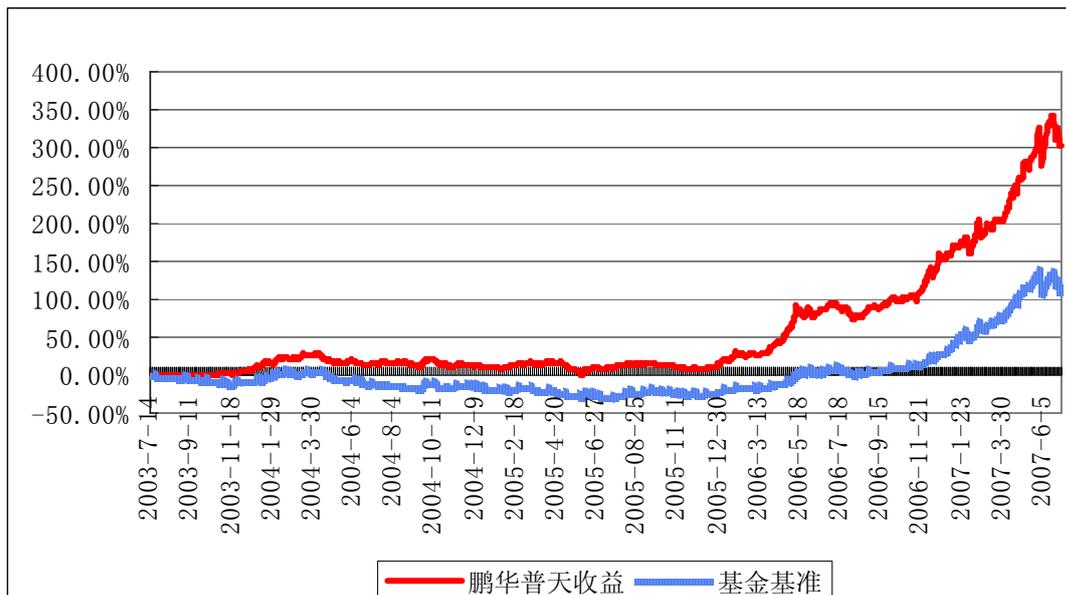
## 2、鹏华普天收益证券投资基金

### (1) 普天收益基金历史各时间段净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较列表

	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
过去一个月	-2.41%	2.54%	-6.06%	2.29%	3.65%	0.25%
过去三个月	32.50%	2.07%	20.14%	1.87%	12.36%	0.20%
过去六个月	54.92%	1.94%	58.43%	1.78%	-3.51%	0.16%
过去一年	109.38%	1.60%	95.71%	1.42%	13.67%	0.18%
过去三年	254.04%	1.27%	141.21%	1.17%	112.83%	0.10%
自基金合同生效之日起至今	301.69%	1.17%	110.00%	1.09%	191.69%	0.08%

注：业绩比较基准=中信综合指数涨跌幅\*70%+中信标普国债指数涨跌幅\*25%+金融同业存款利率\*5%。

(2) 普天收益基金自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的走势:



### 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有限责任公司、Eurizon Financial Group、深圳市北融信投资发展有限公司组成。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。公司目前管理两只封闭式基金、八只开放式基金和四只社保组合。伴随着中国证券市场的发展壮大,面对中国入世后的机遇和挑战,身处中国基金业高速发展的历史时刻,鹏华基金管理有限公司将在进一步提高基金管理水平、完善市场服务体系、新业务开发、国际合作等多方面加快步伐,努力进取,继续诚实信用、勤勉尽责地为广大基金投资者服务,为中国基金业的健康发展做出应有贡献。

#### (二) 基金经理及助理简历

##### 1、鹏华普天债券投资基金

阳先伟先生,硕士,5年证券从业经历,自2006年12月至今担任普天债券基金经理。

先后在民生证券、国海证券等机构从事债券研究及投资组合管理工作，历任研究员、高级经理等职。2004年9月加盟鹏华基金管理有限公司，从事债券及宏观研究工作，2006年1月任普天债券开放式证券投资基金基金经理助理。阳先伟先生具备基金从业资格。

## 2、鹏华普天收益证券投资基金

管文浩先生，硕士，8年证券从业经验，自2005年9月至2007年7月担任普天收益证券投资基金基金经理。先后任中国社会科学院世界经济与政治研究所助理研究员、国泰君安证券研究所研究员、国信证券投资研究中心研究员、泰信基金管理有限公司投资总监兼泰信先行策略基金基金经理，自2007年1月9日起至今兼任鹏华动力增长混合型证券投资基金（LOF）基金经理。管文浩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更。根据本基金管理人于2007年8月1日刊登的《鹏华基金管理有限公司关于基金经理变更的公告》，从2007年8月1日起普天收益基金的基金经理由管文浩先生变更为林宇坤先生。

### （三）基金运作的遵规守信情况说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等相关法律法规的规定及基金合同、招募说明书等基金法律文件的约定，本着“诚实信用、勤勉尽责，取信于市场、取信于投资者”的原则管理和运用基金财产，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，忠实履行基金管理职责。本报告期内，基金运作合法合规，无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

#### 1、鹏华普天债券投资基金

2007年上半年的债券市场在短暂上行后即呈持续下跌的走势，与去年末相比，交易所国债指数上半年下跌了1.62%。国债收益率曲线整体上移，10年以上长端上移幅度超过140Bp，而短期端上移幅度在50~70Bp之间，收益率曲线显著陡峭化。

上半年普天债券A类基金份额净值增长率为3.67%；普天债券B类基金份额净值增长率为3.38%。本基金在上半年继续维持短久期操作，避免了债券市场调整的风险；同时，通过一级市场申购新股和可转债，获取了一定无风险收益。

2007年上半年宏观经济整体表现偏热。前两个季度GDP增长分别达到11.1%和11.9%，大幅超过预期。投资及信贷增长强势，国内消费及出口均快速扩张；在这一背景下，国内

通胀压力加大，CPI 同比涨幅在六月份达到了 4.4%。市场资金供求偏紧，利率持续上升，对债券市场造成了较大压力。股市高度繁荣，在为债券组合提供新的收益来源的同时；也进一步分流了债市的资金，加剧了债市场的弱势。

## 2、鹏华普天收益证券投资基金

2007年上半年末，本基金份额净值和累计净值分别为1.537元和2.847元，净值增长率约为54.92%，同期上证指数和深圳综指分别上涨42.8%和95.78%。

上半年尤其是二季度大盘震荡剧烈，整体热点转换快，经历1月份大比例分红后，考虑到当时的情况，本基金积极建仓，策略主线在于人民币升值，重点布局在金融、钢铁有色、地产、机械等行业，采取均衡配置的策略，在6月之前取得不错的业绩；但6月份市场由于印花税政策的出台出现大幅下挫，虽然我们积极应对，但对基金业绩还是造成一定的影响。

## (五) 市场展望

### 1、鹏华普天债券投资基金

展望 2007 年下半年，我们认为在经济增长强劲和货币政策适度从紧的背景下，市场利率将继续保持高位，但进一步上升的空间有限。三季度末或四季度初市场可能存在一定机会，但仍需要进一步观察经济数据来确认；出现大行情的机会较小。

债券投资方面，在久期配置上，我们将组合久期保持在低水平，严格控制风险，适当参与债券一级市场的申购；在类属配置上，将以银行间国债、金融债、短期融资券等为主、适当参与交易所短期品种。同时，我们将积极参与新股申购，争取无风险收益，保持基金份额净值平稳增长。

### 2、鹏华普天收益证券投资基金

展望下半年，股市将呈现震荡向上的态势。本基金的重点投资还是在地产、金融、有色、机械、化工等行业，操作策略上重点布局价值股，风格上趋于攻守兼备，适度加强波段操作。

## 四、基金托管人报告

2007 年上半年，托管人在普天系列证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投

资基金法》及其他有关法律法规、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持有人利益的行为。

2007 年上半年，鹏华基金管理有限公司在普天系列证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

2007 年上半年，由普天系列基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关普天系列证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

交通银行股份有限公司

2007 年 8 月 20 日

## 五、基金财务会计报告（未经审计）

### （一）基金会计报告书

#### 1、鹏华普天债券投资基金

##### （1）普天债券投资基金本报告期末及前一年度末的比较式资产负债表

单位：人民币元

项 目	行次	2007 年 6 月 30 日	2006 年 12 月 31 日
资产			
银行存款	1	3,056,672.91	10,774,557.20
清算备付金	2	6,609,327.09	10,145,282.84
交易保证金	3	351,282.05	359,609.61
应收证券清算款	4	0.00	162,272.21
应收股利	5	0.00	0.00
应收利息(说明 A)	6	5,128,316.20	1,363,513.69
应收申购款	7	5,801,209.32	33,579.94
其他应收款	8	0.00	0.00
股票投资—市值	9	0.00	736,320.00
其中：股票投资成本	10	0.00	736,320.00
债券投资—市值	11	296,541,445.20	118,567,429.74

其中：债券投资成本	12	296,541,371.19	118,567,044.52
权证投资	13	145.51	0.00
其中：权证投资成本	14	55.61	0.00
买入返售证券	15	0.00	0.00
待摊费用	16	0.00	0.00
其他资产	17	0.00	0.00
资产总计	18	317,488,398.28	142,142,565.23
负债			
应付证券清算款	19	0.00	0.00
应付赎回款	20	732,138.61	68,869.57
应付赎回费	21	722.78	32.07
应付销售服务费	22	45,792.35	67,421.49
应付管理人报酬	23	159,458.26	20,226.47
应付托管费	24	47,837.48	17,916.08
应付佣金(说明 B)	25	18,170.60	13,135.69
应付利息	26	0.00	0.00
应付收益	27	0.00	0.00
未交税金	28	143,393.68	143,393.68
其他应付款项(说明 C)	29	252,497.12	250,001.88
卖出回购证券款	30	0.00	0.00
短期借款	31	0.00	0.00
预提费用(说明 D)	32	94,533.24	210,000.00
其他负债	33	0.00	0.00
负债合计	34	1,494,544.12	790,996.93
持有人权益			
实收基金(说明 E)	35	305,250,482.35	135,337,896.52
未实现利得(说明 F)	36	-4,983,067.99	-2,343,267.99
未分配收益	37	15,726,439.80	8,356,939.77
持有人权益合计	38	315,993,854.16	141,351,568.30

负债及持有人权益总计	39	317,488,398.28	142,142,565.23
报告期末基金份额净值(元)		A类基金份额净值: 1.039	A类基金份额净值: 1.046
		B类基金份额净值: 1.033	B类基金份额净值: 1.043

(2) 普天债券投资基金本报告期及上年度可比期间比较式经营业绩表

单位: 人民币元

项 目	行次	2007年上半年	2006年上半年
一、收入	1	12,863,273.10	4,097,744.52
1、股票差价收入(说明G)	2	6,861,474.23	2,229,933.64
2、债券差价收入(说明H)	3	286,009.67	697,347.95
3、权证收入(说明I)	4	869,702.68	235,907.53
4、债券利息收入	5	4,246,621.67	878,789.51
5、存款利息收入	6	309,841.06	39,608.43
6、股利收入	7	0.00	0.00
7、买入返售证券收入	8	3,000.00	3,700.00
8、其他收入(说明J)	9	286,623.79	12,457.46
二、费用	10	2,309,434.55	554,189.62
1、基金管理人报酬	11	949,443.80	277,985.04
2、基金托管费	12	284,833.13	76,339.71
3、卖出回购证券支出	13	661,651.38	22,645.78
4、利息支出	14	0.00	0.00
5、基金销售服务费	15	272,178.88	99.93
6、其他费用(说明K)	16	141,327.36	177,119.16
其中: 上市年费	17	0.00	0.00
信息披露费	18	54,697.45	84,300.75
审计费用	19	19,835.79	19,835.79
三、基金净收益	20	10,553,838.55	3,543,554.90
加: 未实现资本利得	21	-221.31	382,888.78

四、基金经营业绩	22	10,553,617.24	3,926,443.68
----------	----	---------------	--------------

(3) 普天债券投资基金本报告期及上年度可比期间比较式收益分配表

单位：人民币元

项目	行次	2007 年上半年	2006 年上半年
本期基金净收益	1	10,553,838.55	3,543,554.90
加：期初基金净收益	2	8,356,939.77	2,463,850.40
加：本期损益平准金	3	2,711,362.77	392,875.73
可供分配基金净收益	4	21,622,141.09	6,400,281.03
减：本期已分配基金净收益	5	5,895,701.29	2,141,901.37
期末基金净收益	6	15,726,439.80	4,258,379.66

(4) 普天债券投资基金本报告期及上年度可比期间比较式基金净值变动表

单位：人民币元

项目	行次	2007 年上半年	2006 年上半年
一、期初基金净值	1	141,351,568.30	69,864,546.53
二、本期经营活动	2		
基金净收益	3	10,553,838.55	3,543,554.90
未实现利得	4	-221.31	382,888.78
经营活动产生的基金净值变动数	5	10,553,617.24	3,926,443.68
三、本期基金份额交易	6		
基金申购款	7	522,356,206.29	25,909,664.56
基金赎回款	8	-352,371,836.38	-19,767,612.98
基金份额交易产生的基金净值变动数	9	169,984,369.91	6,142,051.58
四、本期向持有人分配收益	10		
向基金持有人分配收益产生的基金净值变动数	11	5,895,701.29	2,141,901.37
五、期末基金净值	12	315,993,854.16	77,791,140.42

注：后附会计报表附注是本财务会计报表的组成部分

## 2、鹏华普天收益证券投资基金

### (1) 普天收益证券投资基金本报告期末及前一年度末的比较式资产负债表

单位：人民币元

项目	行次	2007年6月30日	2006年12月31日
资产			
银行存款	1	2,210,323.51	28,064,258.91
清算备付金	2	11,650,581.88	27,370,035.04
交易保证金	3	1,058,274.62	609,609.61
应收证券清算款	4	8,675,439.47	0.00
应收股利	5	0.00	0.00
应收利息(说明A)	6	2,694,076.39	266,787.43
应收申购款	7	932,206.16	0.00
其他应收款	8	0.00	0.00
股票投资—市值	9	518,162,477.49	148,861,588.56
其中：股票投资成本	10	392,643,696.27	105,766,802.02
债券投资—市值	11	139,632,496.50	44,469,228.00
其中：债券投资成本	12	140,107,229.14	44,441,399.43
权证投资	13	0.00	2,248,281.00
其中：权证投资成本	14	0.00	0.00
买入返售证券	15	0.00	0.00
待摊费用	16	0.00	0.00
其他资产	17	0.00	0.00
资产总计	18	685,015,876.02	251,889,788.55
负债			
应付证券清算款	19	0.00	2,881,296.43
应付赎回款	20	3,738,531.66	273,320.82
应付赎回费	21	11,174.49	710.46

应付管理人报酬	22	915,961.10	263,596.58
应付托管费	23	122,128.15	35,146.19
应付佣金(说明B)	24	1,216,435.51	399,585.57
应付利息	25	0.00	44,400.00
应付收益	26	0.01	23,492,960.93
未交税金	27	112,355.44	112,355.44
其他应付款项(说明C)	28	500,000.00	500,000.00
卖出回购证券款	29	0.00	28,000,000.00
短期借款	30	0.00	0.00
预提费用(说明D)	31	94,533.24	210,000.00
其他负债	32	0.00	0.00
负债合计	33	6,711,119.60	56,213,372.42
持有人权益			
实收基金(说明E)	34	441,274,504.59	117,464,804.97
未实现利得(说明F)	35	51,523,358.02	29,048,949.60
未分配收益	36	185,506,893.81	49,162,661.56
持有人权益合计	37	678,304,756.42	195,676,416.13
负债及持有人权益总计	38	685,015,876.02	251,889,788.55
报告期末基金份额净值(元)		1.537	1.666

(2) 普天收益证券投资基金本报告期及上年度可比期间比较式经营业绩表

单位:人民币元

项 目	行次	2007年上半年	2006年上半年
一、收入	1	266,499,013.87	89,072,030.54
1、股票差价收入(说明G)	2	258,628,482.15	82,193,422.76
2、债券差价收入(说明H)	3	-530,009.05	86,304.41
3、权证收入(说明I)	4	2,179,254.46	4,553,018.54
4、债券利息收入	5	2,109,659.19	654,020.51
5、存款利息收入	6	513,069.64	90,825.37

6、股利收入	7	2,129,466.97	1,151,219.31
7、买入返售证券收入	8	0.00	0.00
8、其他收入(说明 J)	9	1,469,090.51	343,219.64
二、费用	10	7,913,418.71	2,073,409.46
1、基金管理人报酬	11	5,624,265.85	1,690,199.83
2、基金托管费	12	749,902.12	225,360.00
3、卖出回购证券支出	13	1,443,586.99	42,214.87
4、利息支出	14	0.00	0.00
5、其他费用(说明 K)	15	95,663.75	115,634.76
其中：上市年费	16	0.00	0.00
信息披露费	17	54,697.45	84,300.75
审计费用	18	19,835.79	19,835.79
三、基金净收益	19	258,585,595.16	86,998,621.08
加：未实现资本利得	20	79,673,152.47	39,120,833.47
四、基金经营业绩	21	338,258,747.63	126,119,454.55

(3) 普天收益证券投资基金本报告期及上年度可比期间比较式收益分配表

单位：人民币元

项 目	行次	2007 年上半年	2006 年上半年
本期基金净收益	1	258,585,595.16	86,998,621.08
加：期初基金净收益	2	49,162,661.56	-12,581,751.60
加：本期损益平准金	3	-27,127,718.85	1,952,072.84
可供分配基金净收益	4	280,620,537.87	76,368,942.32
减：本期已分配基金净收益	5	95,113,644.06	44,239,713.40
期末基金净收益	6	185,506,893.81	32,129,228.92

(4) 普天收益证券投资基金本报告期及上年度可比期间比较式基金净值变动表

单位：人民币元

项 目	行次	2007 年上半年	2006 年上半年
-----	----	-----------	-----------

一、期初基金净值	1	195,676,416.13	224,566,777.37
二、本期经营活动	2		
基金净收益	3	258,585,595.16	86,998,621.08
未实现利得	4	79,673,152.47	39,120,833.47
经营活动产生的基金净值变动数	5	338,258,747.63	126,119,454.55
三、本期基金份额交易	6		
基金申购款	7	1,101,759,918.16	218,432,103.99
基金赎回款	8	-862,276,681.44	-282,887,992.27
基金份额交易产生的基金净值变动数	9	239,483,236.72	-64,455,888.28
四、本期向持有人分配收益	10		
向基金持有人分配收益产生的基金净值变动数	11	95,113,644.06	44,239,713.40
五、期末基金净值	12	678,304,756.42	241,990,630.24

注：后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

## （二） 会计报表附注

1、本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计除下述变更外与上年度会计报表相一致。

根据财政部、国家税务总局财税[2007]84号《财政部、国家税务总局关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》规定，从2007年5月30日起，将证券(股票)交易印花税税率由1‰调整为3‰。

### 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

#### （1） 关联方关系

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
交通银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
国信证券有限责任公司	基金管理人的股东、基金代销机构
Eurizon Financial Group	基金管理人的股东
深圳市北融信托投资发展有限公司	基金管理人的股东

经本公司股东会审议通过，并经中国证监会（证监基金字[2007]178号文）及中国商务部（商外资资审字[2007]0259号文）批准，公司股东深圳市北融信托投资发展有限公司、方正证券有限责任公司、安徽国元信托投资有限责任公司将其持有的占本公司总股本49%的股权一次性整体转让给意大利Eurizon Financial Group，上述三家股东分别转让本公司股权的15.68%、16.66%、16.66%。本公司已于2007年7月27日发布《鹏华基金管理有限公司关于股权变更的公告》。本公司现正在办理工商变更登记手续，并在办理完毕该变更手续后，依法及时公告。

## （2） 基金各关联方投资本基金的情况

### A. 基金管理人投资情况

#### a. 鹏华普天债券投资基金

2007 年上半年及 2006 年上半年本基金管理公司没有投资及持有鹏华普天债券投资基金的基金份额。

#### b. 鹏华普天收益证券投资基金

年度	基金管理公司期末持有基金份额（份）	占基金总份额比例（%）	报告期内持有份额的变化（份）	适用费率
2007 年上半年	19,138,751.92	4.34	-39,000,000	持有基金满三年，免收赎回费
2006 年上半年	58,138,751.92	34.67	-30,000,000	赎回费按 0.1% 执行，与普通投资者适用费率相同

### B. 基金管理公司主要股东及其控制的机构投资情况

2007 年上半年及 2006 年上半年本系列基金管理公司主要股东及其控制的机构没有投资及持有普天系列证券投资基金的基金份额。

### (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股份有限公司保管，并按银行间同业利率计息。基金托管人于 2007 年 6 月 30 日保管的银行存款余额为 3,056,672.91 元(2006 年 6 月 30 日: 1,779,548.22 元)。2007 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 148,779.68 元(2006 年上半年: 18,841.07 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 2007 年 6 月 30 日的相关余额 6,609,327.09 元,计入“结算备付金”科目(2006 年 6 月 30 日: 1,269,255.65), 其中最低结算备付金 555,561.87 元(2006 年 6 月 30 日: 0.00 元), 其他结算备付金 6,053,765.22 元(2006 年 6 月 30 日: 0.00 元)。

#### 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股份有限公司保管，并按银行间同业利率计息。基金托管人于 2007 年 6 月 30 日保管的银行存款余额为 2,210,323.51 元(2006 年 6 月 30 日: 3,715,436.67 元)。2007 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 110,675.74 元(2006 年上半年: 24,301.58 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 2007 年 6 月 30 日的相关余额 11,650,581.88 元计入“结算备付金”科目(2006 年 6 月 30 日: 10,865,455.83 元), 其中最低结算备付金 6,325,442.88 元(2006 年 6 月 30 日: 601,905.45), 其他结算备付金 5,325,139.00 元(2006 年 6 月 30 日: 10,263,550.38 元)。

### (4) 本基金参与关联方承销证券的情况

下述方正证券有限责任公司为本报告期内本基金管理人股权变化前的公司股东。

#### A. 鹏华普天债券投资基金

关联方名称	2007年1月1日—2007年6月30日		2006年1月1日—2006年6月30日	
	证券名称	获配数量	证券名称	获配数量
方正证券	安纳达	3500股	-	-

本基金投资关联方承销的证券符合相关法律法规及中国证监会的规定，并依法进行了信

息披露。

B. 鹏华普天收益证券投资基金

关联方名称	2007年1月1日—2007年6月30日		2006年1月1日—2006年6月30日	
方正证券	证券名称	获配数量	证券名称	获配数量
	安纳达	2500股	-	-

本基金投资关联方承销的证券符合相关法律法规及中国证监会的规定，并依法进行了信息披露。

(5) 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、2007 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

支付基金管理人鹏华基金管理公司的管理费，普天债券基金 A、B 两类管理费年费率为 0.6%，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。普天收益基金管理费年费率为 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。

截止至 2007 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 949,443.80 元。2006 年上半年共支付基金管理人报酬人民币 277,985.04 元。

截止至 2007 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 5,624,265.85 元；2006 年上半年共支付基金管理人报酬人民币 1,690,199.83 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，普天债券基金 A、B 两类托管费年费率为 0.18%，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。普天收益基金托管费年费率为 0.2%，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 2007 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 284,833.13 元；2006 年上半年共支付基金托管人报酬人民币 76,339.71 元；

截止至 2007 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 749,902.12 元；2006 年上半年共支付基金托管人报酬人民币 225,360.00 元。

c. 销售服务费

普天债券 B 类支付基金销售机构的销售服务费年费率为 0.3% 的年费率计提，逐日计提，按月支付。日销售服务费=前一日基金资产净值×0.3%÷当年天数。

普天债券 B 类在本会计期间需向关联方支付的基金销售服务费如下：

单位：人民币元

关联方名称	2007 年上半年	2006 年上半年
鹏华基金管理有限公司(管理人)	135,789.68	0.00
交通银行股份有限公司(托管人)	5,640.49	0.00
合计	141,430.17	0.00

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(元)	卖出回购(元)	利息支出(元)
交通银行股 份有限公司	2007 年上半年	0.00	0.00	0.00
	2006 年上半年	4,091,085.26	0.00	0.00

b. 鹏华普天收益投资基金：

2007 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、会计报表重要项目说明

(1) 鹏华普天债券投资基金

A. 按银行存款利息、债券利息等分项列示应收利息的金额：

单位：人民币元

	2007 年 6 月 30 日
--	-----------------

应收银行存款利息	1,822.36
应收债券利息	5,123,927.83
应收清算备付金利息	2,472.35
应收交收价差保证金利息	41.04
应收申购款利息	52.62
合计	5,128,316.20

**B. 按证券经营机构分别列示应付佣金的金额:**

单位: 人民币元

	2007年6月30日
长江证券有限责任公司	2,186.66
中信建投有限责任公司	16,051.44
银河证券股份有限公司	-67.50
合计	18,170.60

**C. 分项列示其他应付款的金额:**

单位: 人民币元

	2007年6月30日
交易保证金	250,000.00
应付转换费	2,497.12
合计	252,497.12

**D. 预提费用明细:**

单位: 人民币元

	2007年6月30日
信息披露费	74,697.45
审计费	19,835.79
合计	94,533.24

**E. 实收基金:**

单位: 人民币元

A 类	2007 年上半年
期初数	59,419,944.53
本期申购	254,588,775.63
本期赎回	186,925,457.98
期末数	127,083,262.18

单位: 人民币元

B 类	2007 年上半年
期初数	75,917,951.99
本期申购	259,388,111.16
本期赎回	157,138,842.98
期末数	178,167,220.17

**F. 未实现利得:**

a. 未实现估值增值及未实现利得平准金金额:

单位: 人民币元

A 类	未实现估值增值	未实现利得平准金	合计
2006 年 12 月 31 日	-500.33	-2,349,572.70	-2,350,073.03
本期净变动数	-5,992.01	-	-5,992.01
本期申购基金份额	-	-10,004,507.50	-10,004,507.50
本期赎回基金份额	-	7,347,624.70	7,347,624.70
2007 年 6 月 30 日	-6,492.34	-5,006,455.50	-5,012,947.84

单位: 人民币元

B 类	未实现估值增值	未实现利得平准金	合计
2006 年 12 月 31 日	885.55	5,919.49	6,805.04

本期净变动数	5,770.70	-	5,770.70
本期申购基金份额	-	72,134.55	72,134.55
本期赎回基金份额	-	-54,830.44	-54,830.44
2007年6月30日	6,656.25	23,223.60	29,879.85

b. 按所估资产的种类分别列示投资估值增值的金额:

单位: 人民币元

	2007年6月30日
股票	0.00
债券	74.01
权证	89.90
合计	163.91

G. 股票差价收入:

单位: 人民币元

	2007年上半年
卖出股票成交总额	14,774,501.93
减: 卖出股票成本总额	7,900,635.00
减: 应付佣金	12,392.70
股票差价收入	6,861,474.23

注: 本基金于本年度未获得股权分置改革中由非流通股股东支付的现金对价。

H. 债券差价收入:

单位: 人民币元

	2007年上半年
卖出债券成交总额	241,450,035.39
减: 卖出债券成本总额	238,974,062.56
减: 应收利息总额	2,189,963.16
债券差价收入	286,009.67

I. 权证收入:

单位: 人民币元

	2007 年上半年
卖出权证成交总额	1,564,653.66
减: 卖出权证成本总额	694,950.98
权证差价收入	869,702.68

J. 其他收入明细:

单位: 人民币元

	2007 年上半年
赎回费收入	286,623.79
合计	286,623.79

K. 其他费用明细:

单位: 人民币元

	2007 年上半年
信息披露费	54,697.45
审计费用	19,835.79
席位使用费	34,787.63
账户维护费	22,890.00
银行费用	5,463.40
外汇交易中心手续费	3,653.09
合计	141,327.36

L. 本期基金收益分配情况:

单位: 人民币元

	2007 年上半年	
次 数	A 类收益分配时间	收益分配金额

1	2007年1月17日	2,555,161.15
合计		2,555,161.15

单位：人民币元

	2007年上半年	
次数	B类收益分配时间	收益分配金额
1	2007年1月17日	3,340,540.14
合计		3,340,540.14

M. 其他重要报表项目的说明：无

(2) 鹏华普天收益证券投资基金

A. 按银行存款利息、债券利息等分项列示应收利息的金额：

单位：人民币元

	2007年6月30日
应收银行存款利息	1,195.54
应收债券利息	2,669,530.16
应收清算备付金利息	23,000.82
应收交收价差保证金利息	41.04
应收申购款利息	308.83
合计	2,694,076.39

B. 按证券经营机构分别列示应付佣金的金额：

单位：人民币元

	2007年6月30日
长江证券有限责任公司	277,246.33
国元证券有限责任公司	595,916.41
汉唐证券有限责任公司	311,656.01

国泰君安证券有限责任公司	31,616.76
合计	1,216,435.51

C. 分项列示其他应付款的金额:

单位: 人民币元

	2007年6月30日
交易保证金	500,000.00
合计	500,000.00

D. 预提费用明细:

单位: 人民币元

	2007年6月30日
信息披露费	74,697.45
审计费	19,835.79
合计	94,533.24

E. 实收基金:

单位: 人民币元

	2007年上半年
期初数	117,464,804.97
本期申购	997,016,722.43
本期赎回	673,207,022.81
期末数	441,274,504.59

F. 未实现利得:

a. 未实现估值增值及未实现利得平准金金额:

单位: 人民币元

	未实现估值增值	未实现利得平准金	合计
2006年12月31日	45,370,896.11	-16,321,946.51	29,048,949.60

本期净变动数	79,673,152.47		79,673,152.47
本期申购基金份额		35,782,843.30	35,782,843.30
本期赎回基金份额		92,981,587.35	92,981,587.35
2007年6月30日	125,044,048.58	-73,520,690.56	51,523,358.02

b. 按所估资产的种类分别列示投资估值增值的金额:

单位: 人民币元

	2007年6月30日
股票	125,518,781.22
债券	-474,732.64
权证	0.00
合计	125,044,048.58

G. 股票差价收入:

单位: 人民币元

	2007年上半年
卖出股票成交总额	1,311,794,528.01
减: 卖出股票成本总额	1,052,067,524.90
减: 应付佣金	1,098,520.96
股票差价收入	258,628,482.15

注: 本基金于本年度未获得股权分置改革中由非流通股股东支付的现金对价。

H. 债券差价收入:

单位: 人民币元

	2007年上半年
卖出债券成交总额	175,308,536.33
减: 卖出债券成本总额	173,378,480.86
减: 应收利息总额	2,460,064.52
债券差价收入	-530,009.05

**I. 权证收入:**

单位: 人民币元

	2007 年上半年
卖出权证成交总额	2,179,254.46
减: 卖出权证成本总额	0.00
权证差价收入	2,179,254.46

**J. 其他收入明细:**

单位: 人民币元

	2007 年上半年
赎回费、转换费收入	1,469,090.51
合计	1,469,090.51

**K. 其他费用明细:**

单位: 人民币元

	2007 年上半年
信息披露费	54,697.45
审计费用	19,835.79
交易所用费	7,202.11
账户维护费	10,830.00
银行费用	2,643.50
外汇交易中心手续费	454.90
合计	95,663.75

**L. 本期基金收益分配情况:**

单位: 人民币元

	2007 年上半年	
次 数	收益分配时间	收益分配金额
1	2007 年 1 月 17 日	95,113,644.06

合 计		95,113,644.06
-----	--	---------------

**M. 其他重要报表项目的说明:无**

**5、本报告期末流通转让受限制的基金资产**

(1) 鹏华普天债券投资基金

本基金截至 2007 年 6 月 30 日止没有持有流通转让受限制的股票及债券。

(2) 鹏华普天收益证券投资基金

截至 2007 年 6 月 30 日, 本基金获配暂不能流通的股票成本为 7,978,831.02 元, 股票市值为 26,257,376.69 元, 对比成本估值增值为 18,278,545.67 元, 普天收益证券投资基金持有未上市或上市未流通的股票明细如下:

股票名称	数量(股)	总成本(元)	总市值(元)	估值方法	转让受限制原因	受限制期限
银轮股份	35,867	300,565.46	647,758.02	收盘价	网下申购未流通	2007-07-18 上市
利欧股份	19,284	263,997.96	584,498.04	收盘价	网下申购未流通	2007-07-27 上市
广宇集团	45,597	492,447.60	811,170.63	收盘价	网下申购未流通	2007-07-27 上市
津滨发展	1,000,000	3,480,000.00	14,960,000.00	收盘价	增发未上市	2007-08-28 流通
安徽合力	324,700	3,441,820.00	9,253,950.00	收盘价	增发未上市	2007-07-05 流通

**6、需要说明的其他事项: 无**

## 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	0.00	0.00
2	债券	296,541,445.20	93.40
3	权证	145.51	0.00
4	银行存款及清算备付金	9,666,000.00	3.05
5	其他资产	11,280,807.57	3.55
	合计	317,488,398.28	100.00

(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	518,162,477.49	75.65
2	债券	139,632,496.50	20.38
3	权证	0.00	0.00
4	银行存款及清算备付金	13,860,905.39	2.02
5	其他资产	13,359,996.64	1.95
	合计	685,015,876.02	100.00

(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	0.00	0.00
2	B 采掘业	0.00	0.00
3	C 制造业	0.00	0.00
其中:	C0 食品、饮料	0.00	0.00
	C1 纺织、服装、皮毛	0.00	0.00
	C2 木材、家具	0.00	0.00
	C3 造纸、印刷	0.00	0.00
	C4 石油、化学、塑胶、塑料	0.00	0.00

	C5 电子	0.00	0.00
	C6 金属、非金属	0.00	0.00
	C7 机械、设备、仪表	0.00	0.00
	C8 医药、生物制品	0.00	0.00
	C99 其他制造业	0.00	0.00
4	D 电力、煤气及水的生产和供应业	0.00	0.00
5	E 建筑业	0.00	0.00
6	F 交通运输、仓储业	0.00	0.00
7	G 信息技术业	0.00	0.00
8	H 批发和零售贸易	0.00	0.00
9	I 金融、保险业	0.00	0.00
10	J 房地产业	0.00	0.00
11	K 社会服务业	0.00	0.00
12	L 传播与文化产业	0.00	0.00
13	M 综合类	0.00	0.00
	合计	0.00	0.00

(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 采掘业	32,889,200.00	4.85
3	C 制造业	182,200,003.23	26.86
其中:	C0 食品、饮料	18,381,000.00	2.71
	C1 纺织、服装、皮毛	0.00	0.00
	C2 木材、家具	0.00	0.00
	C3 造纸、印刷	0.00	0.00
	C4 石油、化学、塑胶、塑料	11,025,025.00	1.63
	C5 电子	775,290.00	0.11
	C6 金属、非金属	50,329,000.72	7.42
	C7 机械、设备、仪表	81,411,287.51	12.00

	C8 医药、生物制品	20,278,400.00	2.99
	C99 其他制造业	0.00	0.00
4	D 电力、煤气及水的生产和供应业	4,592,000.00	0.68
5	E 建筑业	25,439,440.00	3.75
6	F 交通运输、仓储业	5,747,280.00	0.85
7	G 信息技术业	12,611,672.17	1.86
8	H 批发和零售贸易	22,632,700.00	3.34
9	I 金融、保险业	103,363,180.00	15.24
10	J 房地产业	85,706,070.63	12.64
11	K 社会服务业	33,268,000.00	4.90
12	L 传播与文化产业	0.00	0.00
13	M 综合类	9,712,931.46	1.43
	合计	518,162,477.49	76.39

### (三) 本报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有股票明细

#### (1) 鹏华普天债券投资基金

本报告期末基金没有持有股票。

#### (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	600030	中信证券	500,000	26,485,000.00	3.90
2	000758	中色股份	1,000,000	25,300,000.00	3.73
3	000768	西飞国际	650,000	20,065,500.00	2.96
4	600489	中金黄金	400,000	18,812,000.00	2.77
5	601318	中国平安	260,000	18,592,600.00	2.74
6	601628	中国人寿	450,000	18,499,500.00	2.73
7	000069	华侨城A	460,000	18,308,000.00	2.70
8	000655	金岭矿业	750,000	18,067,500.00	2.66
9	000002	万科A	900,000	17,208,000.00	2.54
10	000024	招商地产	350,000	17,185,000.00	2.53
11	000897	津滨发展	1,000,000	14,960,000.00	2.21

12	000046	泛海建设	420,000	14,485,800.00	2.14
13	000858	五粮液	450,000	14,157,000.00	2.09
14	600162	香江控股	600,000	13,338,000.00	1.97
15	600240	华业地产	900,000	12,816,000.00	1.89
16	600016	民生银行	1,100,000	12,573,000.00	1.85
17	000562	宏源证券	420,000	12,306,000.00	1.81
18	600100	同方股份	350,000	12,005,000.00	1.77
19	000960	锡业股份	350,000	11,378,500.00	1.68
20	600058	五矿发展	500,000	11,350,000.00	1.67
21	600456	宝钛股份	265,432	11,336,600.72	1.67
22	600739	辽宁成大	330,000	11,282,700.00	1.66
23	600000	浦发银行	300,000	10,977,000.00	1.62
24	600067	冠城大通	499,973	10,774,418.15	1.59
25	000952	广济药业	380,000	10,328,400.00	1.52
26	000400	许继电气	750,000	10,065,000.00	1.48
27	000623	吉林敖东	200,000	9,950,000.00	1.47
28	000616	亿城股份	650,000	9,873,500.00	1.46
29	600316	洪都航空	250,000	9,770,000.00	1.44
30	600832	东方明珠	599,934	9,712,931.46	1.43
31	600383	金地集团	280,000	9,581,600.00	1.41
32	600761	安徽合力	324,700	9,253,950.00	1.36
33	600725	云维股份	400,000	8,812,000.00	1.30
34	600547	山东黄金	120,000	8,794,800.00	1.30
35	000060	中金岭南	200,000	5,860,000.00	0.86
36	600673	阳之光	299,998	5,654,962.30	0.83
37	600497	驰宏锌锗	80,000	5,282,400.00	0.78
38	600795	国电电力	350,000	4,592,000.00	0.68
39	600195	中牧股份	200,000	4,224,000.00	0.62
40	601166	兴业银行	112,000	3,930,080.00	0.58
41	600087	南京水运	300,000	3,900,000.00	0.57
42	600052	*ST 广厦	250,000	3,745,000.00	0.55
43	000786	北新建材	360,000	3,686,400.00	0.54
44	600352	浙江龙盛	200,000	2,156,000.00	0.32

45	002123	荣信股份	15,147	1,257,201.00	0.19
46	601919	中国远洋	68,000	1,241,680.00	0.18
47	002133	广宇集团	45,597	811,170.63	0.12
48	002126	银轮股份	35,867	647,758.02	0.10
49	002115	三维通信	26,071	606,672.17	0.09
50	601006	大秦铁路	40,000	605,600.00	0.09
51	002134	天津普林	33,500	586,585.00	0.09
52	002131	利欧股份	19,284	584,498.04	0.09
53	002138	顺络电子	5,500	188,705.00	0.03
54	002135	东南网架	6,000	139,440.00	0.02
55	002136	安纳达	2,500	57,025.00	0.01

#### (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	601318	中国平安	2,298,400.00	1.63
2	601998	中信银行	1,078,800.00	0.76
3	601919	中国远洋	839,520.00	0.59
4	601166	兴业银行	751,060.00	0.53
5	002120	新海股份	408,800.00	0.29
6	002131	利欧股份	342,250.00	0.24
7	002126	银轮股份	297,490.00	0.21
8	002134	天津普林	273,240.00	0.19
9	002123	荣信股份	179,550.00	0.13
10	601007	金陵饭店	106,250.00	0.08
11	002138	顺络电子	102,000.00	0.07
12	002110	三钢闽光	99,000.00	0.07
13	601002	晋亿实业	93,720.00	0.07
14	002125	湘潭电化	84,500.00	0.06
15	002114	罗平锌电	60,480.00	0.04
16	002112	三变科技	44,100.00	0.03

17	002135	东南网架	43,200.00	0.03
18	002136	安纳达	28,280.00	0.02
19	002111	威海广泰	17,400.00	0.01
20	002107	沃华医药	16,275.00	0.01

(2) 按累计卖出价值超出期初基金资产净值 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	601318	中国平安	3,256,816.31	2.30
2	601998	中信银行	1,856,070.91	1.31
3	601919	中国远洋	1,677,649.22	1.19
4	601628	中国人寿	1,519,234.26	1.07
5	002120	新海股份	1,118,946.63	0.79
6	601166	兴业银行	1,068,008.77	0.76
7	002131	利欧股份	756,611.45	0.54
8	002126	银轮股份	744,705.58	0.53
9	002134	天津普林	570,898.25	0.40
10	002123	荣信股份	495,571.42	0.35
11	601007	金陵饭店	310,879.55	0.22
12	002125	湘潭电化	260,082.80	0.18
13	002138	顺络电子	256,430.02	0.18
14	601002	晋亿实业	183,477.74	0.13
15	002110	三钢闽光	164,639.24	0.12
16	002114	罗平锌电	163,255.90	0.12
17	002135	东南网架	112,275.97	0.08
18	002136	安纳达	89,209.73	0.06
19	002112	三变科技	75,734.95	0.05
20	002111	威海广泰	64,922.81	0.05

(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

	2007 年上半年
--	-----------

买入股票的成本总额	7,164,315.00
卖出股票的收入总额	14,774,501.93

## 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资产净值 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	601628	中国人寿	37,355,145.29	19.09
2	600030	中信证券	33,645,508.84	17.19
3	600456	宝钛股份	32,277,739.07	16.50
4	600428	中远航运	32,109,390.88	16.41
5	600240	华业地产	31,020,858.51	15.85
6	600104	上海汽车	30,546,567.96	15.61
7	000400	许继电气	30,230,344.40	15.45
8	000960	锡业股份	28,646,031.35	14.64
9	600036	招商银行	28,234,251.26	14.43
10	600000	浦发银行	28,140,228.96	14.38
11	600299	星新材料	27,621,839.40	14.12
12	000927	一汽夏利	27,355,749.96	13.98
13	000758	中色股份	27,295,215.80	13.95
14	600050	中国联通	25,619,494.62	13.09
15	601006	大秦铁路	25,462,997.47	13.01
16	000768	西飞国际	24,774,300.68	12.66
17	600269	赣粤高速	24,084,352.60	12.31
18	600489	中金黄金	24,045,023.12	12.29
19	600995	文山电力	23,341,437.21	11.93
20	600547	山东黄金	23,231,725.37	11.87
21	600016	民生银行	23,000,620.72	11.75
22	000002	万科A	22,380,696.66	11.44
23	002078	太阳纸业	21,541,404.84	11.01
24	000898	鞍钢股份	21,227,834.37	10.85
25	600026	中海发展	20,795,064.32	10.63
26	600497	驰宏锌锗	20,667,191.43	10.56
27	600195	中牧股份	20,631,052.87	10.54
28	600739	辽宁成大	20,173,403.02	10.31

29	000069	华侨城A	20,080,978.55	10.26
30	600058	五矿发展	19,448,365.73	9.94
31	000900	现代投资	19,352,231.07	9.89
32	600316	洪都航空	19,122,023.82	9.77
33	000623	吉林敖东	18,906,286.54	9.66
34	000060	中金岭南	18,692,902.87	9.55
35	600067	冠城大通	17,376,822.11	8.88
36	600177	雅戈尔	17,352,479.63	8.87
37	600331	宏达股份	17,313,588.98	8.85
38	601318	中国平安	16,056,590.98	8.21
39	000024	招商地产	15,984,043.31	8.17
40	000046	泛海建设	15,864,908.55	8.11
41	000858	五粮液	15,753,438.15	8.05
42	000625	长安汽车	15,480,669.15	7.91
43	600383	金地集团	15,192,715.10	7.76
44	600795	国电电力	14,916,524.82	7.62
45	000562	宏源证券	14,550,468.76	7.44
46	600052	*ST广厦	14,161,514.95	7.24
47	600832	东方明珠	14,021,952.61	7.17
48	600549	厦门钨业	13,577,320.54	6.94
49	000616	亿城股份	13,511,851.27	6.91
50	000522	白云山A	12,959,350.80	6.62
51	600677	航天通信	12,931,357.17	6.61
52	600308	华泰股份	12,905,328.81	6.60
53	000027	深能源A	12,465,909.66	6.37
54	600100	同方股份	12,278,937.16	6.28
55	000807	云铝股份	12,034,649.28	6.15
56	600725	云维股份	11,305,397.99	5.78
57	000655	金岭矿业	11,142,026.79	5.69
58	600019	宝钢股份	10,301,642.60	5.26
59	600162	香江控股	10,133,969.98	5.18
60	000952	广济药业	9,982,459.26	5.10
61	000786	北新建材	9,661,141.62	4.94
62	000039	中集集团	9,161,213.74	4.68
63	600971	恒源煤电	7,698,852.41	3.93
64	000792	盐湖钾肥	7,593,318.59	3.88

65	600029	南方航空	7,213,162.84	3.69
66	002047	成霖股份	7,212,371.98	3.69
67	000089	深圳机场	7,160,280.94	3.66
68	601111	中国国航	6,193,311.10	3.17
69	600352	浙江龙盛	6,005,841.96	3.07
70	600282	南钢股份	5,886,951.58	3.01
71	002073	青岛软控	5,711,131.47	2.92
72	000878	云南铜业	5,613,435.37	2.87
73	600673	阳之光	5,216,540.39	2.67
74	600028	中国石化	5,108,972.00	2.61
75	600087	南京水运	5,098,325.99	2.61
76	600519	贵州茅台	5,014,931.32	2.56
77	000028	一致药业	4,028,286.94	2.06

(2) 累计卖出价值超出期初基金资产净值 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	000960	锡业股份	46,360,682.32	23.69
2	600428	中远航运	40,691,987.42	20.80
3	600299	星新材料	39,310,973.15	20.09
4	600104	上海汽车	35,285,167.61	18.03
5	600036	招商银行	32,461,193.67	16.59
6	601006	大秦铁路	31,597,007.65	16.15
7	600000	浦发银行	31,423,387.02	16.06
8	000927	一汽夏利	31,351,656.14	16.02
9	600456	宝钛股份	29,196,155.71	14.92
10	600269	赣粤高速	27,550,700.25	14.08
11	002078	太阳纸业	27,293,396.14	13.95
12	000900	现代投资	26,944,076.13	13.77
13	600050	中国联通	26,828,507.59	13.71
14	000898	鞍钢股份	26,822,303.01	13.71
15	600547	山东黄金	26,533,166.37	13.56
16	600026	中海发展	25,503,481.87	13.03
17	600331	宏达股份	24,909,573.89	12.73
18	000400	许继电气	24,054,927.58	12.29
19	600995	文山电力	23,796,323.31	12.16

20	600497	驰宏锌锗	21,961,738.65	11.22
21	600739	辽宁成大	21,610,709.75	11.04
22	601628	中国人寿	21,334,650.36	10.90
23	000758	中色股份	21,205,039.70	10.84
24	600030	中信证券	20,600,065.21	10.53
25	000060	中金岭南	20,309,850.24	10.38
26	000069	华侨城A	20,099,373.75	10.27
27	000625	长安汽车	19,723,236.71	10.08
28	600795	国电电力	19,320,753.34	9.87
29	600383	金地集团	18,867,754.94	9.64
30	600519	贵州茅台	18,526,347.48	9.47
31	000623	吉林敖东	18,196,498.67	9.30
32	000002	万科A	18,180,244.59	9.29
33	600177	雅戈尔	17,698,367.04	9.04
34	600195	中牧股份	17,595,268.04	8.99
35	000792	盐湖钾肥	17,567,042.50	8.98
36	600677	航天通信	17,089,478.56	8.73
37	600058	五矿发展	16,842,921.25	8.61
38	600240	华业地产	16,070,469.26	8.21
39	000522	白云山A	16,023,855.11	8.19
40	000768	西飞国际	15,920,489.82	8.14
41	600489	中金黄金	15,626,291.75	7.99
42	000039	中集集团	14,926,804.14	7.63
43	600549	厦门钨业	14,203,353.57	7.26
44	600016	民生银行	14,049,218.75	7.18
45	000027	深能源A	13,840,530.13	7.07
46	000024	招商地产	13,468,326.16	6.88
47	600308	华泰股份	13,261,940.95	6.78
48	600052	*ST 广厦	13,251,239.49	6.77
49	000807	云铝股份	13,113,070.32	6.70
50	600316	洪都航空	12,171,437.80	6.22
51	600029	南方航空	10,217,675.53	5.22
52	600276	恒瑞医药	10,110,919.04	5.17
53	600019	宝钢股份	9,673,312.18	4.94
54	600971	恒源煤电	9,161,854.45	4.68
55	000089	深圳机场	8,004,650.08	4.09

56	600067	冠城大通	7,777,861.43	3.97
57	002047	成霖股份	7,690,988.97	3.93
58	600309	烟台万华	7,539,649.24	3.85
59	600583	海油工程	7,257,746.28	3.71
60	000046	泛海建设	7,155,835.54	3.66
61	002024	苏宁电器	7,013,012.39	3.58
62	002073	青岛软控	6,824,327.62	3.49
63	600282	南钢股份	6,535,626.24	3.34
64	000878	云南铜业	6,445,471.31	3.29
65	601111	中国国航	6,413,937.47	3.28
66	000402	金融街	6,093,102.68	3.11
67	000786	北新建材	5,909,742.55	3.02
68	600037	歌华有线	5,390,618.36	2.75
69	000538	云南白药	5,376,008.62	2.75
70	600406	国电南瑞	4,898,110.66	2.50
71	600100	同方股份	4,725,029.13	2.41
72	600028	中国石化	4,674,733.81	2.39
73	000028	一致药业	4,256,441.83	2.18

(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

	2007年上半年
买入股票的成本总额	1,338,944,419.15
卖出股票的收入总额	1,311,794,528.01

(五) 本报告期末按券种分类的债券投资组合

1、鹏华普天债券投资基金

序号	债券品种	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例(%)
1	国债	12,271.20	0.00
2	金融债	257,218,508.24	81.40
3	企业债	39,310,665.76	12.44
4	可转换债券	0.00	0.00

	合计	296,541,445.20	93.84
--	----	----------------	-------

## 2、鹏华普天收益证券投资基金

序号	债券品种	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例(%)
1	国债	99,620,536.50	14.69
2	金融债	40,011,960.00	5.90
3	企业债	0.00	0.00
4	可转换债券	0.00	0.00
	合计	139,632,496.50	20.59

## (六) 本报告期末按市值占基金净值比例大小排序的前五名债券明细

### 1、鹏华普天债券投资基金

序号	债券名称	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例(%)
1	06 农发 14	79,854,783.75	25.27
2	04 央行票据 98	50,269,830.94	15.91
3	07 央票 06	38,749,912.33	12.26
4	07 广晟 CP01	20,036,220.00	6.34
5	04 国开 15	20,023,075.35	6.34

### 2、鹏华普天收益证券投资基金

序号	债券名称	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例(%)
1	21 国债(15)	51,193,800.00	7.55
2	02 国债(10)	44,402,112.00	6.55
3	06 进出 05	40,011,960.00	5.90
4	20 国债(10)	4,024,624.50	0.59

注：上述债券明细为普天收益基金截止本报告期末投资的全部债券。

## (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

#### (1) 鹏华普天债券投资基金

其他资产明细	金额（元）
应收交易保证金	351,282.05
应收利息	5,128,316.20
应收申购款	5,801,209.32
合计	11,280,807.57

#### (2) 鹏华普天收益证券投资基金

其他资产明细	金额（元）
应收交易保证金	1,058,274.62
应收证券清算款	8,675,439.47
应收利息	2,694,076.39
应收申购款	932,206.16
合计	13,359,996.64

### 4、基金持有的处于转股期的可转换债券明细

#### (1) 鹏华普天债券投资基金

本基金本报告期末没有持有的处于转股期的可转换债券、也没有投资资产支持证券和分离交易可转债。

#### (2) 鹏华普天收益证券投资基金

本基金本报告期末没有持有的处于转股期的可转换债券、也没有投资资产支持证券和分离交易可转债。

### 5、本系列基金权证投资情况及本报告期末本系列基金持有权证情况

#### (1) 鹏华普天债券投资基金

权证名称	本报告期买入权证金额	本报告期获配权证数量	本报告期获配权证成本	本报告期获配权证市值	报告期末持有权证	报告期末权证

	(元)	(股)	(元)	(元)	市值(元)	市值占基金资产净值比(%)
武汉钢铁认购权证	0.00	299924	0.00	736,463.38	145.51	0.00
合计	0.00	299924	0.00	736,463.38	145.51	0.00

本基金投资及持有权证金额、比例等符合相关法律、法规及中国证监会的相关规定。

## (2) 鹏华普天收益证券投资基金

本基金本报告期末未持有权证，本报告期内未获配权证，也没有主动投资权证。

## 七、基金各关联方投资本基金的情况

### (一) 本报告期末基金份额持有人信息

#### 1、鹏华普天债券投资基金

份额级别	基金份额持有人户数(户)	平均每户持有的基金份额(份)	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有基金份额(份)	占总份额比例(%)	持有基金份额(份)	占总份额比例(%)
普天债券A类	5,702	22,287.49	52,527,612.48	41.33	74,555,649.70	58.67
普天债券B类	433	411,471.64	35,247,561.54	19.78	142,919,658.63	80.22

#### 2、鹏华普天收益证券投资基金

基金名称	基金份额持有人户数(户)	平均每户持有的基金份额(份)	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

			持有基金份额 (份)	占总份 额比例 (%)	持有基金份额 (份)	占总份 额比例 (%)
普天收益	17,027	25,916.16	73,847,735.05	16.74	367,426,769.54	83.26

## (二)基金管理人从业人员持有基金份额情况

### 1、鹏华普天债券投资基金

截止 2007 年 6 月 30 日基金管理人从业人员没有投资及持有鹏华普天债券投资基金的基金份额。

### 2、鹏华普天收益证券投资基金

截止期限	基金管理人从业人员 持有基金份额总量(份)	占该基金总份额的比 例 (%)
2007 年 6 月 30 日	956.22	0.0002

注：截止本报告期末，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。

## 八、开放式基金份额变动

### (一) 鹏华普天债券投资基金

单位：份

份 额 级 别	基金合同生效日 的基金份额总额	本报告期内基金份额的变化情况			
		本报告期期初 基金份额总额	本报告期间基金 总申购份额	本报告期间基 金总赎回份额	本报告期末基金 份额总额
普 天 债 券 A 类	797,604,310.79	59,419,944.53	254,588,775.63	186,925,457.98	127,083,262.18
普 天 债	0.00	75,917,951.99	259,388,111.16	157,138,842.98	178,167,220.17

券 B 类					
合 计	797,604,310.79	135,337,896.52	513,976,886.79	344,064,300.96	305,250,482.35

注:基金合同生效日为 2003 年 7 月 12 日,红利再投资和基金转换转入作为本期申购资金的来源,统一计入本报告期间基金总申购份额,基金转换转出作为本期赎回资金的支付,统一计入本报告期间基金总赎回份额,不单独列示。

## (二) 鹏华普天收益证券投资基金

单位:份

基 金 名 称	基金合同生效 日的基金份额 总额	本报告期内基金份额的变化情况			
		本报告期期初 基金份额总额	本报告期间基 金总申购份额	本报告期间基 金总赎回份额	本报告期末基 金份额总额
普 天 收 益	343,260,931.46	117,464,804.97	997,016,722.43	673,207,022.81	441,274,504.59

注:基金合同生效日为 2003 年 7 月 12 日,红利再投资和基金转换转入作为本期申购资金的来源,统一计入本报告期间基金总申购份额,基金转换转出作为本期赎回资金的支付,统一计入本报告期间基金总赎回份额,不单独列示。

## 九、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

(1) 因本公司职工监事孙泽女士离职,按照公司章程规定,需由公司职工民主选举另产生一名职工代表担任监事。根据 2007 年 5 月 15 日职工代表大会选举结果,现由张兴和

先生担任职工监事，孙泽女士不再担任职工监事。

(2) 因工作需要，经本公司第三届董事会第十三次会议审议批准，公司决定由阳先伟担任鹏华普天债券开放式证券投资基金基金经理，江明波不再担任该基金基金经理。上述变更事项已报中国证监会和深圳证监局备案并于 2007 年 1 月 20 日在《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》公告。

(3) 因工作需要，经本公司第三届董事会第二十次会议审议通过，公司决定从 2007 年 8 月 1 日由林宇坤先生接替管文浩先生担任鹏华普天收益开放式证券投资基金基金经理，管文浩先生不再担任该基金基金经理。上述事项已报中国证监会和深圳证监局备案并于 2007 年 8 月 1 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》公告。

(4) 本报告期内，本基金管理人的董事会成员未发生变更。根据欧利盛金融集团 (Eurizon Financial Group) 推荐，经本公司 2007 年第三次临时股东会会议审议，股东会一致同意：Francis Candylafitis 先生和 Ciro Beffi 先生担任鹏华基金管理有限公司非独立董事；同意过仕刚先生、陈锐女士辞去本公司董事职务，不再担任本公司董事。上述变更事项已报告中国证券监督管理委员会深圳监管局并于 2007 年 8 月 14 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》公告。

上述变更事项本公司已依法履行了变更手续。

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本报告期内没有发生重大人事变动情况。

(三) 本报告期内无涉及本基金管理人、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) 收益分配

本系列基金之普天收益基金报告期内进行了 1 次收益分配，累计向基金份额持有人按每 10 份基金份额派发红利 7.05 元，基金分红公告或分红预案公告分别刊登于 2007 年 1 月 15 日的《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》。

本系列基金之普天债券 A 类基金报告期内进行了 1 次收益分配，向基金份额持有人按每 10 份基金份额派发红利 0.44 元，基金分红公告或分红预案公告分别刊登于 2007 年 1 月 15 日的《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》。

本系列基金之普天债券 B 类基金报告期内进行了 1 次收益分配，向基金份额持有人按每 10 份基金份额派发红利 0.44 元，基金分红公告或分红预案公告分别刊登于 2007 年 1 月 15 日的《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》。

(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机构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有关情况：

1、交易席位选择的标准和程序

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，使用其席位作为基金的专用交易席位，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。

选择席位的程序：

我公司根据上述标准，选定符合条件的证券公司作为租用席位的对象。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席位交易的具体情况。我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，普天债券基金向长江证券有限责任公司（原大鹏证券有限责任公司并入长江证券有限责任公司）、中信建投证券有限责任公司、中国银河证券有限责任公司租用席位作为基金专用交易席位；普天收益基金向长江证券有限责任公司（原大鹏证券有限责任公司并入长江证券有限责任公司）、汉唐证券有限责任公司（目前由中国信达资产管理有限公司托管）、国元证券有限责任公司、华林证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司租用席位作为基金专用交易席位，并从 2003 年 7 月开始陆续使用。上述席位在本报告期内未发生变化。

2、鹏华普天系列证券投资基金 2007 年 1-6 月份通过各证券经营机构的席位买卖证券的交易量及支付的佣金如下：

- (1) 2007 年 1-6 月份各券商股票交易量及佣金情况如下：

普天债券投资基金

券商名称	租用席位数量	股票交易量(元)	占股票交易量比例 (%)	累计佣金 (元)	占各券商累计佣金比例 (%)
中信建投	1	9,887,116.13	66.82	37,446.00	88.77
长江证券	1	4,909,113.62	33.18	4,736.04	11.23
合计	2	14,796,229.75	100.00	42,182.04	100.00

普天收益证券投资基金

券商名称	租用席位数量	股票交易量(元)	占股票交易量比例 (%)	累计佣金 (元)	占各券商累计佣金比例 (%)
国元证券	1	1,450,060,914.74	54.93	1,179,954.88	55.69
汉唐证券	1	218,529,059.10	8.28	178,632.53	8.43
国泰君安	1	467,702,462.97	17.72	365,980.46	17.28
长江证券	1	503,703,949.40	19.08	394,151.98	18.60
合计	4	2,639,996,386.21	100.00	2,118,719.85	100.00

(2) 2007年1-6月份各券商债券、债券回购及权证交易量情况如下:

普天债券投资基金

券商名称	租用席位数量	债券交易量(元)	占债券交易量比例 (%)	债券回购交易量 (元)	占债券回购交易量比例 (%)	权证交易量 (元)	占权证交易量比例 (%)
中信建投	1	66,936,254.40	97.12	80,000,000.00	100.00	1,564,774.94	100.00
长江证券	1	1,988,000.00	2.88	0.00	0.00	0.00	0.00
合计	2	68,924,254.40	100.00	80,000,000.00	100.00	1,564,774.94	100.00

普天收益证券投资基金

券商名称	租用席位数量	债券交易量(元)	占债券交易量比例(%)	债券回购交易量(元)	占债券回购交易量比例(%)	权证交易量(元)	占权证交易量比例(%)
国元证券	1	336,076,713.20	85.76	1,272,300,000.00	100.00	0.00	0.00
汉唐证券	1	55,800,787.50	14.24	0.00	0.00	0.00	0.00
国泰君安	1	0.00	0.00	0.00	0.00	2,179,472.40	100.00
长江证券	1	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
合计	4	391,877,500.70	100.00	1,272,300,000.00	100.00	2,179,472.40	100.00

(九) 本报告期内其他重大事项:

1、本基金管理人于 2007 年 1 月 10 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登了《关于鹏华普天系列证券投资基金暂停申购、转换转入及定期定额业务的公告》，1 月 17 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登了关于鹏华普天系列证券投资基金恢复申购、转换转入及定期定额业务的公告》。

2、本基金管理人于 2007 年 1 月 15 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登了《关于开展鹏华普天系列基金申购及转换费率优惠持续营销活动的公告》，具体内容详见公告。

3、本基金管理人于 2007 年 1 月 16 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登了《关于开展普天系列开放式证券投资基金“鹏华财富人生基金组合”持续营销活动的公告》，具体内容详见公告。

4、本基金管理人于 2007 年 3 月 29 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登了《关于谨防不法人员冒用我司名义进行非法证券活动的特别提示》，具体内容详见公告。

5、根据中国证券监督管理委员会基金部通知[2007]10 号《关于统一规范证券投资基金认（申）购费用及认（申）购份额计算方法有关问题的通知》要求，以及本公司于 2007 年 5 月 15 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登的《鹏华基金管理有限公司关于旗下开放式基金申购费用及申购份额的计算方法调整及修改基金合同的公告》，自

2007年5月18日起，鹏华普天收益证券投资基金、鹏华普天债券投资基金A类的申购费用及申购份额的计算方法将统一调整为采用“外扣法”，具体内容详见公告。

6、根据中国证监会下发的《关于基金管理公司及证券投资基金执行〈企业会计准则〉的通知》规定，鹏华基金管理有限公司管理的所有基金于2007年7月1日实施新会计准则，实施新会计准则后，基金将全面采用公允价值进行会计计量，请投资者关注相关法规的规定以及相关基金定期信息披露报告。实施新会计准则后，基金估值方法及个别会计政策方面的变更不会对投资者利益造成实质性影响。上述事项已于2007年7月2日在本公司网站公告。

7、经本公司股东会审议通过，并经中国证监会（证监基金字[2007]178号文）及中国商务部（商外资资审字[2007]0259号文）批准，公司股东深圳市北融信投资发展有限公司、方正证券有限责任公司、安徽国元信托投资有限责任公司将其持有的占本公司总股本49%的股权转让给意大利欧利盛金融集团（Eurizon Financial Group），上述三家股东分别转让本公司股权的15.68%、16.66%、16.66%。本次股权转让后，本公司将依法变更设立为外商投资企业，国信证券有限责任公司、Eurizon Financial Group、深圳市北融信投资发展有限公司三家股东的出资比例分别为50%、49%、1%。本公司已于2007年7月27日将上述变更事项在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》公告，目前工商变更登记手续正在办理中，待该变更手续办理完毕，本公司将依法及时公告。

8、本基金最近一次更新的招募说明书摘要于2007年8月22日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》。

## 十、备查文件目录

- （一）《鹏华普天系列开放式证券投资基金基金合同》
- （二）《鹏华普天系列开放式证券投资基金托管协议》
- （三）鹏华普天系列开放式证券投资基金2007年半年度报告（原文）

查阅地点：深圳市福田区福华三路与益田路交汇处深圳国际商会中心43层鹏华基金管理有限公司。

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.cn>）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。

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

2007年8月29日