

鹏华盛世创新股票型证券投资基金（LOF） 2011 年年度报告摘要

2011 年 12 月 31 日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2012 年 3 月 26 日

§ 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2011 年 3 月 23 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

安永华明会计师事务所注册会计师对本基金出具了“标准无保留意见”的审计报告。

本报告期自 2011 年 1 月 1 日起至 2011 年 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|--------------|-----------------|
| 基金简称 | 鹏华盛世创新股票(LOF) |
| 基金主代码 | 160613 |
| 交易代码 | 160613 |
| 基金运作方式 | 上市契约型开放式(LOF) |
| 基金合同生效日 | 2008年10月10日 |
| 基金管理人 | 鹏华基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 574,746,625.30份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |
| 基金份额上市的证券交易所 | 深圳证券交易所 |
| 上市日期 | 2008年11月10日 |

注：本基金在交易所行情系统净值提示等其他信息披露场合下，可简称为“鹏华创新”。

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 精选具有竞争力比较优势和持续盈利增长潜力的自主创新类上市公司中价值相对低估的股票，进行积极主动的投资管理，在有效控制投资风险的前提下，为基金份额持有人谋求长期、稳定的资本增值。 |
| 投资策略 | 本基金的投资策略分为两个层次：第一层次是“自上而下”的资产配置策略，第二层次是“自下而上”的选股策略，主要投资于具有竞争力比较优势和持续盈利增长潜力的自主创新类上市公司中价值相对低估的股票。在充分控制投资风险的基础上，通过积极主动的投资管理，为基金份额持有人谋求长期、稳定的资本增值。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×75%+中证综合债指数收益率×25% |
| 风险收益特征 | 本基金属于股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金，为证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。 |

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 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 张戈 | 尹东 |
| | 联系电话 | 0755-82825720 | 010-67595003 |
| | 电子邮箱 | ph@mail.phfund.com.cn | yindong.zh@ccb.com |

| | | |
|--------|---------------|--------------|
| 客户服务电话 | 4006788999 | 010-67595096 |
| 传真 | 0755-82021126 | 010-66275853 |

2.4 信息披露方式

| | |
|------------------|--|
| 登载基金年度报告正文的互联网网址 | http://www.phfund.com.cn |
| 基金年度报告备置地点 | 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； 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼中国建设银行股份有限公司 |

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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 | 2011 年 | 2010 年 | 2009 年 |
|---------------|-----------------|-----------------|----------------|
| 本期已实现收益 | -177,806,136.37 | -95,384,473.99 | 128,611,598.28 |
| 本期利润 | -256,654,280.23 | -127,424,668.29 | 180,478,870.94 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.5242 | -0.2164 | 0.6132 |
| 本期基金份额净值增长率 | -31.28% | -7.38% | 70.14% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2011 年末 | 2010 年末 | 2009 年末 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0700 | 0.4027 | 0.5361 |
| 期末基金资产净值 | 615,000,283.15 | 694,966,857.06 | 710,600,218.04 |
| 期末基金份额净值 | 1.070 | 1.557 | 1.681 |

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）表中的“期末”均指报告期最后一日，即 12 月 31 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

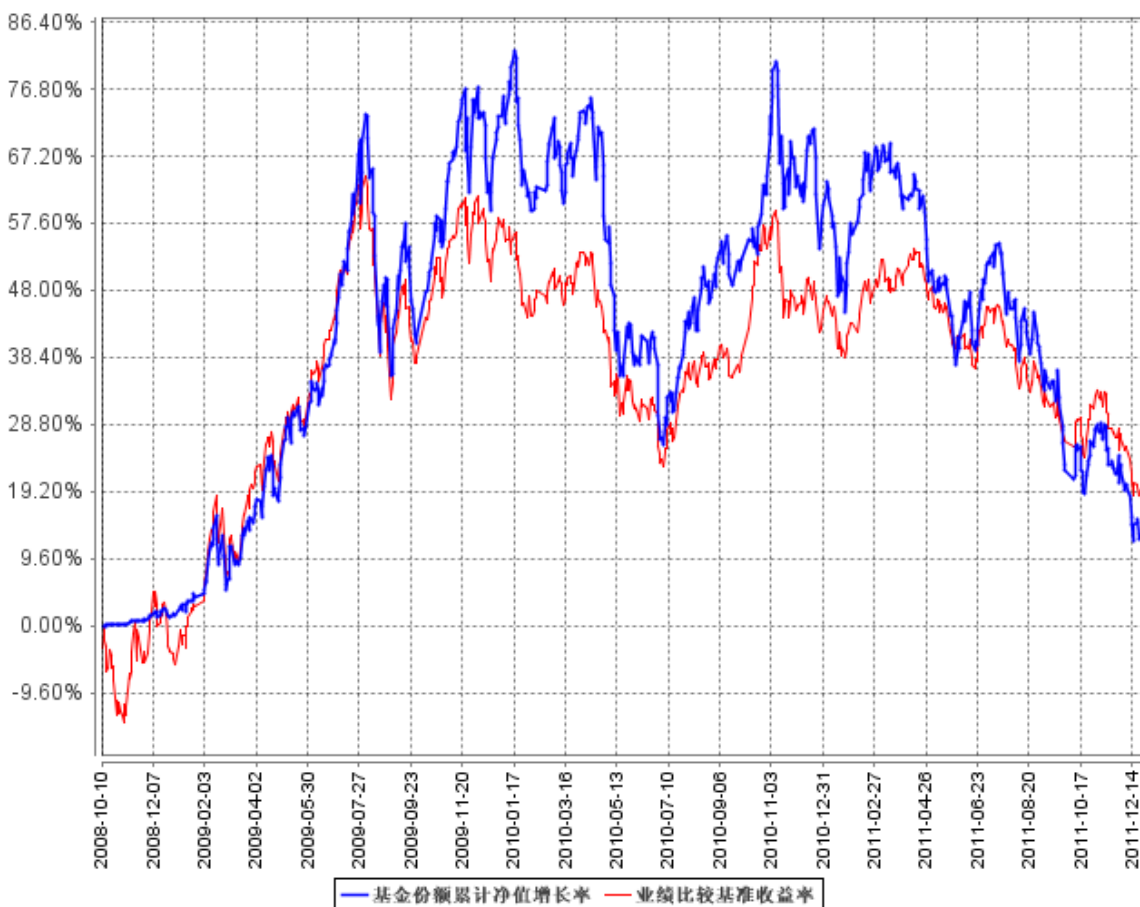
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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 |
|----------|----------|-------------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去三个月 | -10.08% | 1.33% | -5.96% | 1.05% | -4.12% | 0.28% |
| 过去六个月 | -26.46% | 1.35% | -16.74% | 1.02% | -9.72% | 0.33% |
| 过去一年 | -31.28% | 1.36% | -18.00% | 0.98% | -13.28% | 0.38% |
| 过去三年 | 8.30% | 1.59% | 25.79% | 1.26% | -17.49% | 0.33% |
| 过去五年 | - | - | - | - | - | - |
| 自基金成立起至今 | 10.03% | 1.53% | 18.93% | 1.36% | -8.90% | 0.17% |

注：本基金业绩比较基准为沪深 300 指数收益率×75%+中证综合债指数收益率×25%。

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



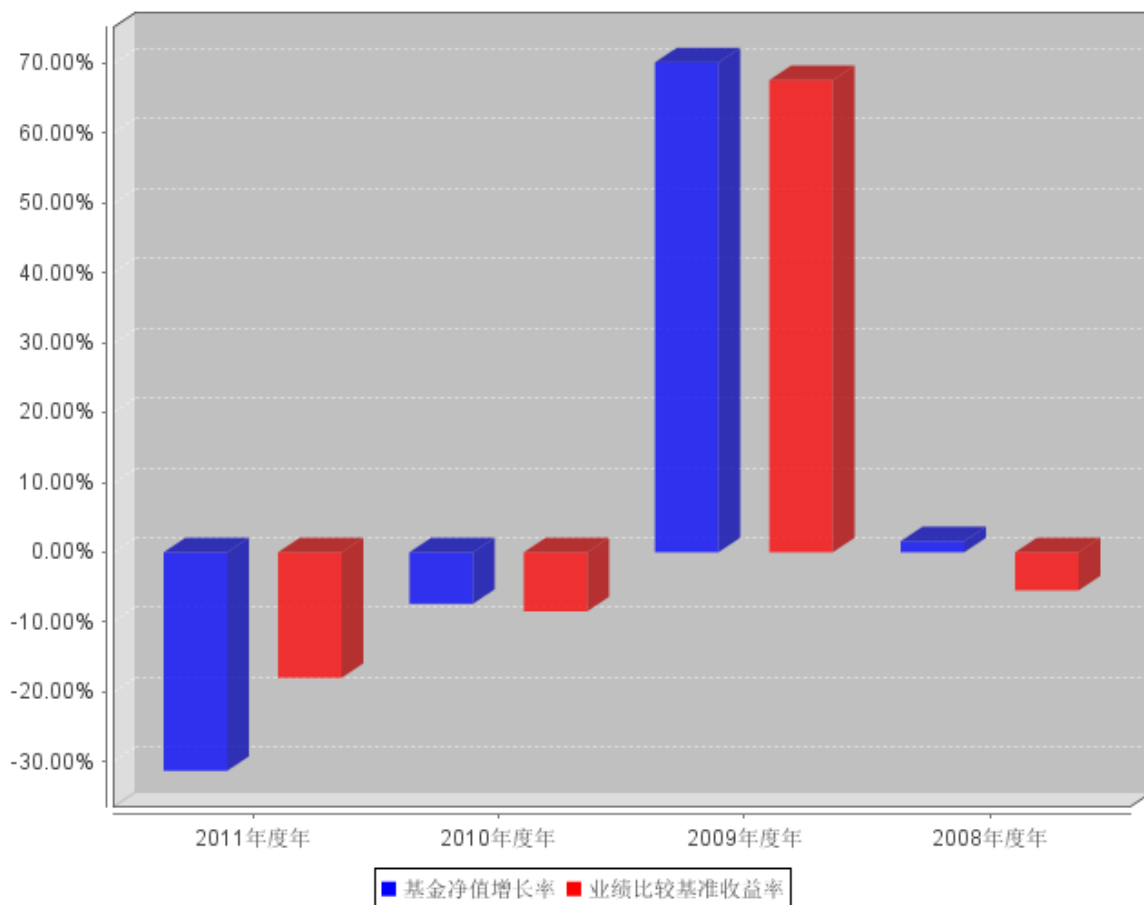
注：1、本基金合同于 2008 年 10 月 10 日生效。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的

约定，截至本基金建仓期结束，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。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按照实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

| 年度 | 每10份基金份额 分红数 | 现金形式发放 总额 | 再投资形式发 放总额 | 年度利润分配合 计 | 备注 |
|------|-----------------|--------------|---------------|--------------|--------------------|
| 2011 | - | - | - | - | 本基金本报告期内未进行利润分配 |
| 2010 | - | - | - | - | 本基金本报告期内未进行利润分配 |
| 2009 | 0.3000 | 3,460,448.49 | 1,406,328.97 | 4,866,777.46 | 2009年03月12日分红，每10份 |

| | | | | | |
|----|--------|--------------|--------------|--------------|---------------|
| | | | | | 分配 0.300 元 |
| 合计 | 0.3000 | 3,460,448.49 | 1,406,328.97 | 4,866,777.46 | |

§ 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、25 只开放式基金和 6 只社保组合，经过 13 年投资管理基金，在基金投资、风险控制等方面积累了丰富经验。

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 | | |
| 唐文杰 | 本基金基金经理 | 2009 年 7 月 14 日 | 2011 年 12 月 28 日 | 7 | 唐文杰先生，国籍中国，理学硕士，7 年证券从业经验。曾任广州金骏资产管理有限公司研究员、长盛基金管理有限公司研究员、博时基金管理有限公司研究员。2009 年 6 月加盟鹏华基金管理有限公司，2009 |

| | | | | | |
|----|---------|------------------|---|---|--|
| | | | | | <p>年 7 月至 2011 年 12 月担任鹏华盛世创新股票型证券投资基金(LOF)基金经理。唐文杰具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理发生变动,唐文杰不再担任本基金基金经理。</p> |
| 伍旋 | 本基金基金经理 | 2011 年 12 月 28 日 | - | 5 | <p>伍旋先生,国籍中国,北京大学工商管理硕士,5 年证券从业经验。曾任职于中国建设银行,2006 年 6 月加盟鹏华基金管理有限公司,从事研究分析工作,历任研究部高级研究员、基金经理助理;2011 年 12 月起至今担任鹏华盛世创新股票型证券投资基金</p> |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|---|
| | | | | | (LOF) 基金经理。本报告期内本基金基金经理发生变动, 转由伍旋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

报告期内, 本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规、中国证监会的有关规定以及本基金基金合同的约定, 本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产, 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。本报告期内, 本基金运作合法合规, 不存在违反基金合同和损害基金份额持有人利益的行为。

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、分配各环节得到公平对待。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金管理人旗下无其他投资风格相似的投资组合。

4.3.3 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并对基金财产造成损失的异常交易行为。

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

2011 是起伏跌宕的一年, 1-2 季度市场热点较多, 但 2 季度末受到欧洲债务危机和欧元危机的影响以及国内地产政策的影响, 经济增长下滑拐点显现, 原有经济增长模式面临结构调整的选择, 而新兴产业的发展并非一蹴而成。市场持续走弱, 低估值的大盘蓝筹股票相对抗跌, 而中小型的成长性公司的盈利大幅低于预期, 加上前期被透支的高估值, 中小市值股票表现大幅落后。我们根据经济和市

场状况，在 2 季度初降低仓位，减持了部分涨幅过大的股票，但继续持有船舶、海工装备、航天航空等子行业，在 4 季度末我们适时提高仓位，增加了银行、保险等行业的配置。

回顾我们 2011 年的表现，我们在下半年适时采取防御性策略配置了低估值的金融股，但我们确实存在对我国经济转型认识不足的问题，如果能在更早之前重新审视机会与风险，我们的表现应该会更好。

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-31.28%，同期上证综指下跌 21.68%，深圳成指下跌 28.41%，沪深 300 指数下跌 25.01%。

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 2012 年，我们认为，尽管未来通胀压力逐步缓解，但市场震荡的大格局并未改变，海外金融危机延续的不确定性也使得市场变数增大，而国内经济的结构调整尚未完成。在此背景下，我们认识到，市场可能较 2011 年更为复杂，需要对未来经济发展做出更为深邃、谨慎的思考，对细分行业做出更广泛的覆盖和政策判断。短期内，我们认为，金融地产等低估值行业的增长势头相对清晰，应该存在着估值修复的机会。我们同时意识到，伴随经济转型，文化、旅游、传媒等现代服务业逐渐兴起，可能有着新的生命力和创新潜力，当股价调整至合理的估值水平内，我们将考虑适时买入并持有，分享其长期的成长性。

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，本基金本期利润为-256,654,280.23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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 6 审计报告

安永华明会计师事务所注册会计师对本基金出具了“标准无保留意见”的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：鹏华盛世创新股票型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2011年12月31日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2011年12月31日 | 上年度末 2010年12月31日 |
|-----------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | | 156,786,996.32 | 35,945,837.94 |
| 结算备付金 | | 298,036.12 | 1,849,884.04 |
| 存出保证金 | | - | 17,237.17 |
| 交易性金融资产 | | 450,337,353.07 | 657,956,950.30 |
| 其中：股票投资 | | 450,337,353.07 | 657,956,950.30 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | | - | - |
| 买入返售金融资产 | | - | - |
| 应收证券清算款 | | 12,847,740.72 | - |
| 应收利息 | | 15,428.87 | 11,100.69 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 71,461.99 | 1,228,744.15 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | | - | - |
| 资产总计 | | 620,357,017.09 | 697,009,754.29 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2011年12月31日 | 上年度末 2010年12月31日 |
| 负债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | | - | - |

| | | | |
|---------------|--|----------------|----------------|
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | 3,702,021.95 | - |
| 应付赎回款 | | 177,047.65 | 74,405.24 |
| 应付管理人报酬 | | 819,816.39 | 982,547.69 |
| 应付托管费 | | 136,636.09 | 163,757.96 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | | 420,776.90 | 721,916.74 |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | | 100,434.96 | 100,269.60 |
| 负债合计 | | 5,356,733.94 | 2,042,897.23 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | | 574,746,625.30 | 446,217,471.64 |
| 未分配利润 | | 40,253,657.85 | 248,749,385.42 |
| 所有者权益合计 | | 615,000,283.15 | 694,966,857.06 |
| 负债和所有者权益总计 | | 620,357,017.09 | 697,009,754.29 |

注：报告截至日 2011 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.070 元，基金份额总额 574,746,625.30 份。

7.2 利润表

会计主体：鹏华盛世创新股票型证券投资基金（LOF）

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日 |
|--------------------|-----|---|--|
| 一、收入 | | -237,850,481.02 | -103,203,601.67 |
| 1. 利息收入 | | 549,718.07 | 743,446.63 |
| 其中：存款利息收入 | | 549,718.07 | 743,446.63 |
| 债券利息收入 | | - | - |
| 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） | | -159,704,784.84 | -73,175,519.38 |
| 其中：股票投资收益 | | -163,254,563.01 | -78,950,726.94 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | | - | - |
| 资产支持证券投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | | - | - |
| 股利收益 | | 3,549,778.17 | 5,775,207.56 |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-” | | -78,848,143.86 | -32,040,194.30 |

| | | | |
|-----------------------------|-----------|-----------------|-----------------|
| 号填列) | | | |
| 4. 汇兑收益 (损失以“-”号填列) | | - | - |
| 5. 其他收入 (损失以“-”号填列) | | 152,729.61 | 1,268,665.38 |
| 减：二、费用 | | 18,803,799.21 | 24,221,066.62 |
| 1. 管理人报酬 | 7.4.7.2.1 | 10,138,725.80 | 13,506,200.56 |
| 2. 托管费 | 7.4.7.2.2 | 1,689,787.56 | 2,251,033.42 |
| 3. 销售服务费 | | - | - |
| 4. 交易费用 | | 6,485,674.85 | 7,972,889.52 |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6. 其他费用 | | 489,611.00 | 490,943.12 |
| 三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列) | | -256,654,280.23 | -127,424,668.29 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润 (净亏损以“-”号填列) | | -256,654,280.23 | -127,424,668.29 |

7.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体：鹏华盛世创新股票型证券投资基金 (LOF)

本报告期：2011年1月1日至2011年12月31日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2011年1月1日至2011年12月31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) | 446,217,471.64 | 248,749,385.42 | 694,966,857.06 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润) | - | -256,654,280.23 | -256,654,280.23 |
| 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) | 128,529,153.66 | 48,158,552.66 | 176,687,706.32 |
| 其中：1. 基金申购款 | 232,690,093.50 | 99,177,683.88 | 331,867,777.38 |
| 2. 基金赎回款 | -104,160,939.84 | -51,019,131.22 | -155,180,071.06 |
| 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) | 574,746,625.30 | 40,253,657.85 | 615,000,283.15 |

| 项目 | 上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31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） | 422,703,765.25 | 287,896,452.79 | 710,600,218.04 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | -127,424,668.29 | -127,424,668.29 |
| 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） | 23,513,706.39 | 88,277,600.92 | 111,791,307.31 |
| 其中：1. 基金申购款 | 750,502,609.84 | 490,002,895.97 | 1,240,505,505.81 |
| 2. 基金赎回款 | -726,988,903.45 | -401,725,295.05 | -1,128,714,198.50 |
| 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） | 446,217,471.64 | 248,749,385.42 | 694,966,857.06 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

 邓召明 胡湘 刘慧红
 基金管理公司负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

鹏华盛世创新股票型证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”），系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[2008]838号文《关于同意鹏华盛世创新股票型证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人鹏华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华盛世创新股票型证券投资基金(LOF)基金合同》的约定募集设立。本基金为上市契约型开放式，存续期限为不定期，首次设立募集不包括认购资金利息共募集1,144,932,018.81元，经安永华明会计师事务所验证并出具安永华明（2008）验字第60468989_H01号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《鹏华盛世创新股票型证券投资基金(LOF)基金合同》于2008年10月10日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为1,145,339,439.27份基金份额，其中认购资金利息折合407,420.46份基金份额。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

经深圳证券交易所（以下简称“深交所”）深证上字[2008]第154号文审核同意，本基金

177,293,934.00 份基金份额于 2008 年 11 月 10 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华盛世创新股票型证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定，本基金的投资范围仅限于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的各类股票、债券、央行票据、权证、资产证券化产品以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如有投资需要可参与有价值的新股配售和增发。其中股票的主要投资方向为具有竞争力比较优势和持续盈利增长潜力的自主创新类上市公司中价值相对低估的股票，该部分股票的投资比例不低于本基金股票资产的 80%。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×75%+中证综合债指数收益率×25%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本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》、《鹏华盛世创新股票型证券投资基金(LOF)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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2011 年度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 2011 年 12 月 31 日的财务状况以及 2011 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 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。

7.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期没有发生重大会计差错更正。

7.4.6 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 |
| 中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”) | 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 |
| 意大利欧利盛资本资产管理股份公司(Eurizon Capital SGR S.p.A.) | 基金管理人的股东 |

| | |
|----------------|----------|
| 深圳市北融信投资发展有限公司 | 基金管理人的股东 |
|----------------|----------|

注：1、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。

2、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金 2011 年、2010 年未通过关联方交易单元发生股票交易、权证交易、债券交易、债券回购交易，也没有发生应支付关联方的佣金业务。

7.4.7.2 关联方报酬

7.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|-----------------|----------------------------------|----------------------------------|
| | 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日 | 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 10,138,725.80 | 13,506,200.56 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 980,267.23 | 1,304,328.06 |

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 1.5%，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。

（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。

7.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------|----------------------------------|----------------------------------|
| | 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日 | 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,689,787.56 | 2,251,033.42 |

注：支付基金托管人中国建设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。

7.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金 2011 年、2010 年末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

2011 年及 2010 年, 本基金管理人未投资、持有本基金。

7.4.7.4.2 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

2011 年末及 2010 年末除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。

7.4.7.5 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 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日 | | 上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日 | |
|--------|--|------------|---|------------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国建设银行 | 156,786,996.32 | 478,954.92 | 35,945,837.94 | 644,891.32 |

7.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

| 上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日 | | | | | |
|---|--------|------|------|-----------|--------------|
| 关联方名称 | 证券代码 | 证券名称 | 发行方式 | 基金在承销期内买入 | |
| | | | | 数量（单位：股） | 总金额 |
| 国信证券 | 601288 | 农业银行 | 网上申购 | 929,000 股 | 2,489,720.00 |

注：本基金本报告期末参与关联方承销的证券。

7.4.8 期末（2011 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.8.1 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 2011 年 12 月 31 日止, 本基金没有持有因认购新发或增发而流通受限股票, 也没有持有因认购新发或增发而流通受限债券及权证。

7.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末 2011 年 12 月 31 日止, 本基金没有持有暂时停牌的股票。

7.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2011 年 12 月 31 日止, 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。

7.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2011 年 12 月 31 日止, 本基金没有从事证券交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款。

§ 8 投资组合报告

8.1 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 | 450,337,353.07 | 72.59 |
| | 其中：股票 | 450,337,353.07 | 72.59 |
| 2 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 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 | 157,085,032.44 | 25.32 |
| 6 | 其他各项资产 | 12,934,631.58 | 2.09 |
| 7 | 合计 | 620,357,017.09 | 100.00 |

8.2 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 | 采掘业 | - | - |
| C | 制造业 | 17,819,478.32 | 2.90 |
| C0 | 食品、饮料 | - | - |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | - | - |
| C2 | 木材、家具 | - | - |
| C3 | 造纸、印刷 | - | - |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | - | - |
| C5 | 电子 | 17,659,691.28 | 2.87 |
| C6 | 金属、非金属 | - | - |

| | | | |
|-----|----------------|----------------|-------|
| C7 | 机械、设备、仪表 | 159,787.04 | 0.03 |
| C8 | 医药、生物制品 | - | - |
| C99 | 其他制造业 | - | - |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 18,274,500.00 | 2.97 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 交通运输、仓储业 | 32,015,095.20 | 5.21 |
| G | 信息技术业 | - | - |
| H | 批发和零售贸易 | - | - |
| I | 金融、保险业 | 299,471,979.21 | 48.69 |
| J | 房地产业 | - | - |
| K | 社会服务业 | 37,761,207.75 | 6.14 |
| L | 传播与文化产业 | 8,501,596.99 | 1.38 |
| M | 综合类 | 36,493,495.60 | 5.93 |
| | 合计 | 450,337,353.07 | 73.23 |

8.3 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

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 | 601166 | 兴业银行 | 3,779,913 | 47,324,510.76 | 7.70 |
| 2 | 601998 | 中信银行 | 11,499,877 | 46,459,503.08 | 7.55 |
| 3 | 600016 | 民生银行 | 7,699,874 | 45,352,257.86 | 7.37 |
| 4 | 601318 | 中国平安 | 1,259,781 | 43,386,857.64 | 7.05 |
| 5 | 601169 | 北京银行 | 4,329,911 | 40,181,574.08 | 6.53 |
| 6 | 000062 | 深圳华强 | 6,291,982 | 36,493,495.60 | 5.93 |
| 7 | 600106 | 重庆路桥 | 4,599,870 | 32,015,095.20 | 5.21 |
| 8 | 601601 | 中国太保 | 1,599,892 | 30,733,925.32 | 5.00 |
| 9 | 000069 | 华侨城A | 3,499,914 | 24,989,385.96 | 4.06 |
| 10 | 000001 | 深发展A | 1,599,985 | 24,943,766.15 | 4.06 |

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> 的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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 | 600016 | 民生银行 | 57,220,693.54 | 8.23 |
| 2 | 601998 | 中信银行 | 54,330,087.31 | 7.82 |
| 3 | 601166 | 兴业银行 | 52,704,310.33 | 7.58 |
| 4 | 601106 | 中国一重 | 52,685,830.41 | 7.58 |
| 5 | 601818 | 光大银行 | 49,393,597.41 | 7.11 |
| 6 | 601318 | 中国平安 | 49,385,993.35 | 7.11 |
| 7 | 600106 | 重庆路桥 | 48,802,750.06 | 7.02 |
| 8 | 601799 | 星宇股份 | 45,405,802.74 | 6.53 |
| 9 | 601268 | 二重重装 | 44,428,907.63 | 6.39 |
| 10 | 601169 | 北京银行 | 44,300,251.88 | 6.37 |
| 11 | 601766 | 中国南车 | 41,669,465.21 | 6.00 |
| 12 | 600328 | 兰太实业 | 40,825,281.58 | 5.87 |
| 13 | 601299 | 中国北车 | 40,765,946.41 | 5.87 |
| 14 | 601390 | 中国中铁 | 40,324,530.49 | 5.80 |
| 15 | 600895 | 张江高科 | 37,288,389.11 | 5.37 |
| 16 | 600068 | 葛洲坝 | 34,780,913.74 | 5.00 |
| 17 | 002564 | 张化机 | 33,798,294.14 | 4.86 |
| 18 | 600015 | 华夏银行 | 33,384,517.11 | 4.80 |
| 19 | 600116 | 三峡水利 | 33,085,803.77 | 4.76 |
| 20 | 601601 | 中国太保 | 32,478,650.91 | 4.67 |
| 21 | 000062 | 深圳华强 | 32,046,663.64 | 4.61 |
| 22 | 600108 | 亚盛集团 | 31,526,801.95 | 4.54 |
| 23 | 600798 | 宁波海运 | 27,825,124.61 | 4.00 |
| 24 | 000001 | 深发展A | 27,543,693.85 | 3.96 |
| 25 | 601002 | 晋亿实业 | 27,532,093.19 | 3.96 |
| 26 | 600283 | 钱江水利 | 27,057,037.14 | 3.89 |
| 27 | 000069 | 华侨城A | 24,573,349.81 | 3.54 |
| 28 | 000610 | 西安旅游 | 23,382,798.54 | 3.36 |
| 29 | 000777 | 中核科技 | 22,928,386.92 | 3.30 |
| 30 | 600736 | 苏州高新 | 22,309,335.88 | 3.21 |
| 31 | 000534 | 万泽股份 | 22,096,002.54 | 3.18 |
| 32 | 600456 | 宝钛股份 | 22,095,131.31 | 3.18 |
| 33 | 600100 | 同方股份 | 21,442,833.43 | 3.09 |
| 34 | 000721 | 西安饮食 | 20,627,195.98 | 2.97 |
| 35 | 600060 | 海信电器 | 20,594,617.73 | 2.96 |
| 36 | 600776 | 东方通信 | 20,329,127.58 | 2.93 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 37 | 601866 | 中海集运 | 19,934,841.24 | 2.87 |
| 38 | 600072 | 中船股份 | 19,913,996.78 | 2.87 |
| 39 | 000888 | 峨眉山A | 19,894,484.97 | 2.86 |
| 40 | 601599 | 鹿港科技 | 19,707,020.00 | 2.84 |
| 41 | 601718 | 际华集团 | 19,634,848.00 | 2.83 |
| 42 | 600331 | 宏达股份 | 19,611,774.45 | 2.82 |
| 43 | 000563 | 陕国投A | 19,414,598.15 | 2.79 |
| 44 | 000762 | 西藏矿业 | 19,313,033.01 | 2.78 |
| 45 | 600271 | 航天信息 | 19,122,253.63 | 2.75 |
| 46 | 600795 | 国电电力 | 18,153,828.00 | 2.61 |
| 47 | 600677 | 航天通信 | 17,995,541.24 | 2.59 |
| 48 | 600760 | 中航黑豹 | 17,900,373.56 | 2.58 |
| 49 | 600523 | 贵航股份 | 16,666,231.08 | 2.40 |
| 50 | 002467 | 二六三 | 15,830,062.32 | 2.28 |
| 51 | 002320 | 海峡股份 | 15,733,633.51 | 2.26 |
| 52 | 600496 | 精工钢构 | 15,693,184.24 | 2.26 |
| 53 | 600391 | 成发科技 | 15,494,936.95 | 2.23 |
| 54 | 600054 | 黄山旅游 | 14,938,024.27 | 2.15 |
| 55 | 000561 | 烽火电子 | 14,285,427.60 | 2.06 |
| 56 | 600685 | 广船国际 | 14,226,417.18 | 2.05 |
| 57 | 600039 | 四川路桥 | 13,902,963.43 | 2.00 |

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。

8.4.2 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 | 600283 | 钱江水利 | 69,150,291.30 | 9.95 |
| 2 | 601989 | 中国重工 | 54,908,549.01 | 7.90 |
| 3 | 601106 | 中国一重 | 50,799,744.93 | 7.31 |
| 4 | 600150 | 中国船舶 | 49,818,295.50 | 7.17 |
| 5 | 601268 | 二重重装 | 42,379,476.72 | 6.10 |
| 6 | 601766 | 中国南车 | 41,268,396.63 | 5.94 |
| 7 | 601818 | 光大银行 | 40,402,342.77 | 5.81 |
| 8 | 601299 | 中国北车 | 39,932,773.20 | 5.75 |
| 9 | 600328 | 兰太实业 | 39,377,335.91 | 5.67 |
| 10 | 000901 | 航天科技 | 38,839,917.32 | 5.59 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 11 | 600895 | 张江高科 | 37,878,960.01 | 5.45 |
| 12 | 601390 | 中国中铁 | 37,300,807.30 | 5.37 |
| 13 | 600068 | 葛洲坝 | 36,963,900.06 | 5.32 |
| 14 | 000534 | 万泽股份 | 35,248,059.90 | 5.07 |
| 15 | 600116 | 三峡水利 | 34,870,460.79 | 5.02 |
| 16 | 000610 | 西安旅游 | 33,508,521.15 | 4.82 |
| 17 | 600967 | 北方创业 | 32,277,384.27 | 4.64 |
| 18 | 002320 | 海峡股份 | 31,766,247.05 | 4.57 |
| 19 | 600855 | 航天长峰 | 31,282,352.22 | 4.50 |
| 20 | 600108 | 亚盛集团 | 31,119,992.64 | 4.48 |
| 21 | 000721 | 西安饮食 | 29,373,267.68 | 4.23 |
| 22 | 600774 | 汉商集团 | 28,671,954.68 | 4.13 |
| 23 | 601002 | 晋亿实业 | 28,083,230.03 | 4.04 |
| 24 | 000982 | 中银绒业 | 27,767,543.32 | 4.00 |
| 25 | 601799 | 星宇股份 | 26,261,981.73 | 3.78 |
| 26 | 600879 | 航天电子 | 24,633,433.24 | 3.54 |
| 27 | 600400 | 红豆股份 | 24,531,404.56 | 3.53 |
| 28 | 600736 | 苏州高新 | 23,756,989.93 | 3.42 |
| 29 | 600707 | 彩虹股份 | 22,523,751.82 | 3.24 |
| 30 | 600798 | 宁波海运 | 22,162,321.99 | 3.19 |
| 31 | 600456 | 宝钛股份 | 21,176,908.79 | 3.05 |
| 32 | 600776 | 东方通信 | 20,839,493.45 | 3.00 |
| 33 | 601866 | 中海集运 | 20,799,627.77 | 2.99 |
| 34 | 600100 | 同方股份 | 20,607,303.21 | 2.97 |
| 35 | 002564 | 张化机 | 20,577,070.63 | 2.96 |
| 36 | 000777 | 中核科技 | 20,301,135.42 | 2.92 |
| 37 | 600072 | 中船股份 | 20,141,664.17 | 2.90 |
| 38 | 600271 | 航天信息 | 19,665,620.37 | 2.83 |
| 39 | 600760 | 中航黑豹 | 18,801,746.21 | 2.71 |
| 40 | 600677 | 航天通信 | 18,686,386.60 | 2.69 |
| 41 | 600015 | 华夏银行 | 18,676,456.61 | 2.69 |
| 42 | 000888 | 峨眉山A | 18,054,017.84 | 2.60 |
| 43 | 600496 | 精工钢构 | 17,507,490.92 | 2.52 |
| 44 | 600765 | 中航重机 | 17,347,151.60 | 2.50 |
| 45 | 000762 | 西藏矿业 | 17,045,642.70 | 2.45 |
| 46 | 600151 | 航天机电 | 16,535,196.74 | 2.38 |
| 47 | 600877 | 中国嘉陵 | 16,504,779.30 | 2.37 |
| 48 | 601718 | 际华集团 | 16,169,180.49 | 2.33 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 49 | 601599 | 鹿港科技 | 15,300,283.08 | 2.20 |
| 50 | 000799 | 酒鬼酒 | 14,447,257.68 | 2.08 |
| 51 | 600685 | 广船国际 | 14,377,534.76 | 2.07 |
| 52 | 002467 | 二六三 | 14,351,531.09 | 2.07 |
| 53 | 002209 | 达意隆 | 14,296,879.86 | 2.06 |
| 54 | 000561 | 烽火电子 | 13,926,371.92 | 2.00 |

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。

8.4.3 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 | 2,130,180,817.96 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 2,095,697,708.32 |

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

8.8 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。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 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。

8.9.2 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。

8.9.3 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 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | 12,847,740.72 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 15,428.87 |
| 5 | 应收申购款 | 71,461.99 |

| | | |
|---|-------|---------------|
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 12,934,631.58 |

8.9.4 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。

8.9.5 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情况。

8.9.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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 |
| 19,396 | 29,632.22 | 330,678,652.88 | 57.53% | 244,067,972.42 | 42.47% |

9.2 期末上市基金前十名持有人

| 序号 | 持有人名称 | 持有份额(份) | 占上市总份 额比 例 |
|----|------------|------------|------------------|
| 1 | 祁鸿雁 | 430,000.00 | 7.01% |
| 2 | 巩非 | 400,136.00 | 6.52% |
| 3 | 陈芳 | 302,906.00 | 4.94% |
| 4 | 浙江中凯服饰有限公司 | 200,000.00 | 3.26% |
| 5 | 王大凯 | 179,119.00 | 2.92% |
| 6 | 姜卫平 | 118,642.00 | 1.93% |
| 7 | 陈明杰 | 105,600.00 | 1.72% |
| 8 | 窦世彦 | 102,700.00 | 1.67% |
| 9 | 张琅琅 | 92,080.00 | 1.50% |
| 10 | 唐金萍 | 84,400.00 | 1.38% |

注：持有人为场内持有人。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

| 项目 | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|----------------------|--------------|----------|
| 基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金 | 1,436,538.32 | 0.2499% |

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。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|----------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2008年10月10日）基金份额总额 | 1,145,339,439.27 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 446,217,471.64 |
| 本报告期基金总申购份额 | 232,690,093.50 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 104,160,939.84 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 574,746,625.30 |

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。

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

11.2.1 基金管理人的重大人事变动：

1、2011年4月，胡湘先生任基金管理人副总经理。上述事项已经公司董事会审议通过，并经中国证监会核准（证监许可【2011】613号），胡湘具有基金从业资格。

2、2011年12月，毕国强先生任基金管理人副总经理。上述事项已经公司董事会审议通过，并经中国证监会核准（证监许可【2011】2088号），毕国强具有基金从业资格。

3、2011年12月，高鹏先生任基金管理人督察长。上述事项已经公司董事会审议通过，并经中国证监会核准（证监许可【2011】2088号），高鹏具有基金从业资格。

4、2011年12月，吴伟先生不再任基金管理人督察长职务。上述事项已经公司董事会审议通过。

11.2.2 基金托管人的重大人事变动：

本基金托管人2011年2月9日发布公告，经中国建设银行研究决定，聘任杨新丰为中国建设银行

投资托管服务部副总经理（主持工作），其任职资格已经中国证监会审核批准（证监许可〔2011〕115号）。解聘罗中涛中国建设银行投资托管服务部总经理职务。本基金托管人2011年1月31日发布任免通知，解聘李春信中国建设银行投资托管服务部副总经理职务。本基金托管人2011年10月24日发布任免通知，聘任张军红为中国建设银行投资托管服务部副总经理。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金管理人聘请安永华明会计师事务所为本基金审计的会计师事务所。本年度应支付给安永华明会计师事务所审计费用100,000.00元，该审计机构已提供审计服务的年限为四年。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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 | |
| 宏源证券 | 1 | 13,057,092,474.56 | 72.34% | 2,598,508.99 | 73.22% | - |
| 中银国际 | 1 | 1,142,683,098.31 | 27.04% | 928,443.40 | 26.16% | - |
| 中信证券 | 1 | 26,102,953.41 | 0.62% | 22,188.21 | 0.63% | - |
| 上海证券 | 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, 分别向中银国际证券有限责任公司、中信证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、宏源证券股份有限公司租用交易单元作为基金专用交易单元, 并从 2008 年 10 月开始陆续使用。本报告期内上述其他交易单元未发生变化。

11.7.2 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权证交易、债券交易及债券回购交易。

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

1、2011 年 10 月 28 日, 托管人中国建设银行股份有限公司发布关于董事长辞任的公告, 根据国家金融工作的需要, 郭树清先生已向中国建设银行股份有限公司 (“本行”) 董事会 (“董事会”) 提出辞呈, 请求辞去本行董事长、执行董事等职务。根据《中华人民共和国公司法》等相关法律法规和本行章程的规定, 郭树清先生的辞任自辞呈送达本行董事会之日起生效。

2、2012 年 1 月 16 日, 托管人中国建设银行股份有限公司发布关于董事长任职的公告, 自 2012 年 1 月 16 日起, 王洪章先生就任本行董事长、执行董事。

鹏华基金管理有限公司
2012 年 3 月 26 日