

鹏华盛世创新股票型证券投资基金（LOF） 2012年第3季度报告

2012年9月30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

报告送出日期：2012年10月24日

§ 1 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。

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 2012 年 10 月 22 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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2012 年 7 月 1 日起至 2012 年 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	432,052,628.41 份
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。
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

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”。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2012年7月1日—2012年9月30日）
1. 本期已实现收益	-32,173,538.45
2. 本期利润	-42,141,873.79
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0773
4. 期末基金资产净值	462,201,250.59
5. 期末基金份额净值	1.070

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。

3.2 基金净值表现

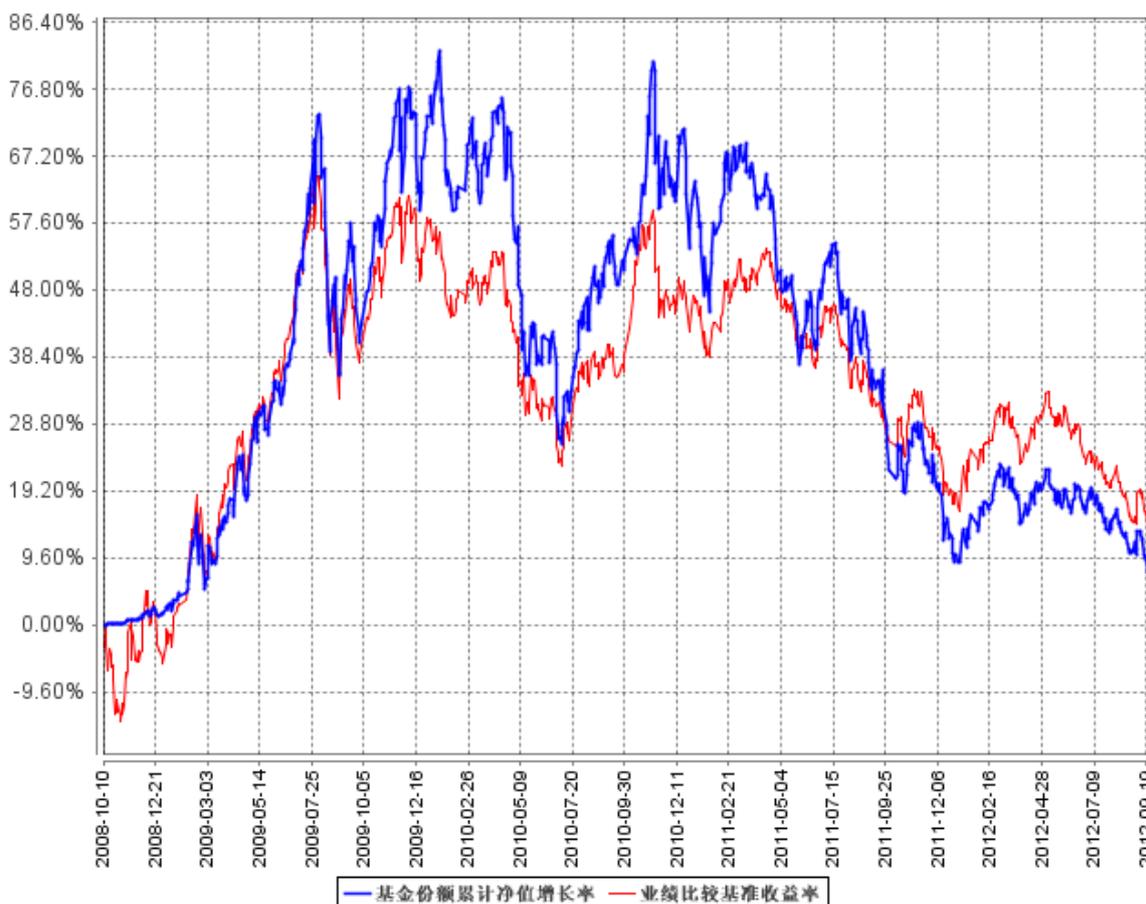
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	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
过去三个月	-6.63%	0.84%	-5.11%	0.89%	-1.52%	-0.05%

注：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%。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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、截至建仓期结束，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。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
伍旋	本基金基金经理	2011 年 12 月 28 日	-	6	伍旋先生，国籍中国，北京大学工商管理硕士，6 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(LOF)基金经理。伍旋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。
--	--	--	--	--	--

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基金合同的约定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产，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 公平交易专项说明

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、分配等各环节得到公平对待。

4.3.2 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对基金财产造成损失的异常交易行为，未存在同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

3季度市场回落趋势加大，沪深300指数大跌6.85%，实体经济整体低迷，工业增加值、投资、消费等延续疲态，仅在3季度末显现微弱企稳迹象，而期间政策出台的力度极其有限，资金面在7月初降息后反而持续紧张。短期来看，我们认为，A股走势仍将受国内外经济走势、政策以及市场预期的综合影响，维持震荡格局。

3季度内，我们对市场预期调整的估计不足，受地产股等大幅下跌的拖累，影响了组合的表现。

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-6.63%，同期上证综指下跌6.26%，深圳成指下跌8.64%，沪深300指数下跌6.85%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

尽管实体经济起色不大，结构转型任重而道远，但股票市场的整体估值水平已经有所体现，部分蓝筹公司的估值已经具备一定的吸引力，因此我们对A股市场也不过分悲观。同时我们也发现在低迷的经济环境下，仍有不少企业具有较好的竞争优势和持续的增长潜力，逆市而上。4季度我们依然会结合估值水平，选择具备较好竞争优势和增长潜力的上市公司，适时调整组合的持仓结构。

§ 5 投资组合报告

5.1 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	366,110,306.91	77.79
	其中：股票	366,110,306.91	77.79
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	104,397,384.73	22.18
6	其他资产	113,124.06	0.02
7	合计	470,620,815.70	100.00

5.2 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	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	145,141,680.26	31.40
C0	食品、饮料	13,630,019.10	2.95
C1	纺织、服装、皮毛	-	-

C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	3,033,262.00	0.66
C4	石油、化学、塑胶、塑料	13,532,146.00	2.93
C5	电子	13,714,095.06	2.97
C6	金属、非金属	9,200,385.90	1.99
C7	机械、设备、仪表	67,480,058.40	14.60
C8	医药、生物制品	24,551,713.80	5.31
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	8,884,381.23	1.92
E	建筑业	5,477,996.16	1.19
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	14,724,116.70	3.19
H	批发和零售贸易	14,642,379.84	3.17
I	金融、保险业	93,609,440.99	20.25
J	房地产业	30,472,278.37	6.59
K	社会服务业	22,817,135.04	4.94
L	传播与文化产业	30,340,898.32	6.56
M	综合类	-	-
	合计	366,110,306.91	79.21

5.3 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	601166	兴业银行	2,098,122	25,198,445.22	5.45
2	600016	民生银行	4,159,036	23,498,553.40	5.08
3	002038	双鹭药业	577,911	20,689,213.80	4.48
4	601098	中南传媒	1,665,832	16,341,811.92	3.54
5	601318	中国平安	380,967	15,977,755.98	3.46
6	000651	格力电器	739,578	15,812,177.64	3.42
7	600690	青岛海尔	1,272,684	14,419,509.72	3.12
8	000069	华侨城A	2,501,426	14,007,985.60	3.03
9	600383	金地集团	2,779,845	13,982,620.35	3.03
10	600199	金种子酒	639,907	13,630,019.10	2.95

5.4 报告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。

5.5 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

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 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。

5.7 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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1

本基金投资的前十名证券中本期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、处罚的证券。

5.8.2

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。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	51,430.55
4	应收利息	22,570.46
5	应收申购款	39,123.05
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	113,124.06

5.8.4 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。

5.8.5 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。

5.8.6 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。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	564,683,290.39
本报告期基金总申购份额	4,808,088.21
减：本报告期基金总赎回份额	137,438,750.19
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	432,052,628.41

§ 7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

- (一) 《鹏华盛世创新股票型证券投资基金(LOF)基金合同》；
- (二) 《鹏华盛世创新股票型证券投资基金(LOF)托管协议》；
- (三) 《鹏华盛世创新股票型证券投资基金(LOF)2012 年度第 3 季度报告》（原文）。

7.2 存放地点

深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心 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。

7.3 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。

鹏华基金管理有限公司
2012 年 10 月 24 日