

鹏华盛世创新股票型证券投资基金（LOF） 2013年第1季度报告

2013年3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

报告送出日期：2013年4月20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 2013 年 4 月 17 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 2013 年 1 月 1 日起至 3 月 31 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	463,959,661.54 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（2013 年 1 月 1 日 — 2013 年 3 月 31 日）
1. 本期已实现收益	28,254,879.99
2. 本期利润	21,252,043.40
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0481
4. 期末基金资产净值	573,344,925.60
5. 期末基金份额净值	1.236

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

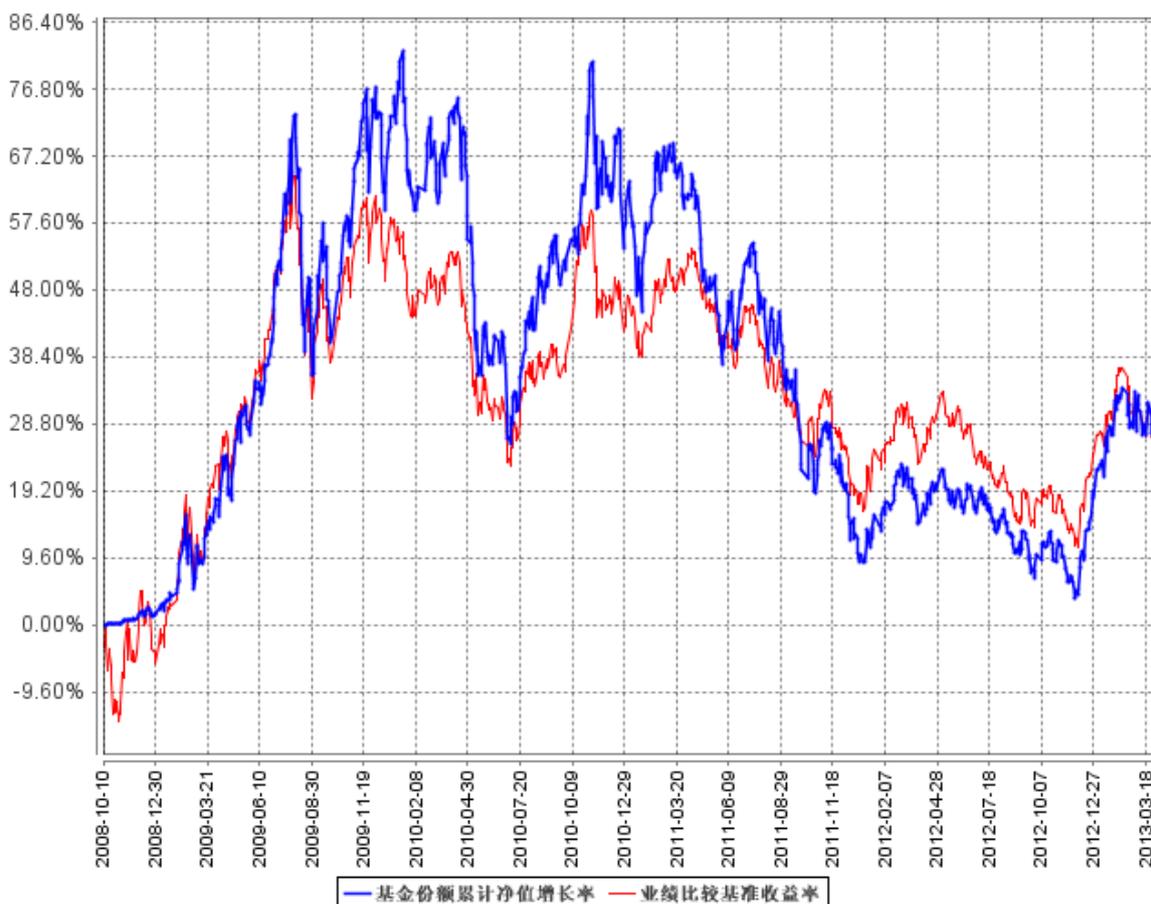
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	3.87%	1.44%	-0.37%	1.17%	4.24%	0.27%

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	-	7	伍旋先生，国籍中国，北京大学工商管理硕士，7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

13 年 1 季度从工业增加值、PMI、发电量等指标来看, 宏观经济处于“弱复苏”的趋势中, 同时新“国五条”、银行表外理财业务等政策的陆续出台, 表明决策层进一步调整经济增长结构的政策导向。流动性尽管依旧宽松, 但边际影响力减弱。受以上因素的影响, A 股市场整体呈现震荡行情, 中小市值股票表现好于大市值股票, 沪深 300 指数微跌-1.1%, 中小板指数上涨 8.92%, 创业板指数上涨 21.38%。1 季度内, 我们组合内部分优质上市公司表现较好, 但在银行、地产的配置上受行业政策的影响, 此外对白酒行业的判断过于乐观, 导致相关股票对组合拖累较大, 影响了整体的表现。我们也适时调整了非银金融、地产、医药、白酒等行业的持仓结构。

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 3.87%, 同期上证综指下跌 1.43%, 深证成指下跌 2.49%, 沪

深 300 指数下跌 1.10%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为在宏观经济“弱复苏”的环境下，股票市场的估值水平依然具备一定的吸引力，市场呈现震荡行情的概率颇大。我们依然会结合估值水平，选择具备较好的创新能力、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	448,121,086.02	77.40
	其中：股票	448,121,086.02	77.40
2	固定收益投资	3,155,356.80	0.54
	其中：债券	3,155,356.80	0.54
	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	121,312,873.94	20.95
6	其他资产	6,383,735.59	1.10
7	合计	578,973,052.35	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	271,380,168.80	47.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,672,100.00	2.04
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	22,239,653.78	3.88
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,341,081.44	2.50
J	金融业	102,428,024.66	17.86
K	房地产业	8,177,600.00	1.43

L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	17,882,457.34	3.12
S	综合	-	-
	合计	448,121,086.02	78.16

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	600104	上汽集团	2,078,901	30,767,734.80	5.37
2	002038	双鹭药业	371,473	23,217,062.50	4.05
3	000001	平安银行	1,130,000	22,735,600.00	3.97
4	600016	民生银行	2,219,001	21,391,169.64	3.73
5	600690	青岛海尔	1,580,684	20,122,107.32	3.51
6	600535	天士力	279,960	19,583,202.00	3.42
7	000786	北新建材	1,094,305	17,946,602.00	3.13
8	600000	浦发银行	1,730,000	17,524,900.00	3.06
9	600060	海信电器	1,286,929	16,382,606.17	2.86
10	601166	兴业银行	930,000	16,089,000.00	2.81

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	3,155,356.80	0.55
8	其他	-	-
9	合计	3,155,356.80	0.55

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110023	民生转债	29,790	3,155,356.80	0.55

注：上述债券为本基金本报告期末持有的全部债券。

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

5.9 投资组合报告附注**5.9.1**

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。

5.9.2

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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	258,483.77
2	应收证券清算款	5,918,961.74
3	应收股利	-
4	应收利息	29,230.82
5	应收申购款	177,059.26
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,383,735.59

5.9.4 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。

5.9.5 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。

5.9.6 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。

§ 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	428,030,184.98
本报告期基金总申购份额	91,409,629.99
减：本报告期基金总赎回份额	55,480,153.43
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	463,959,661.54

§ 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)2013 年度第 1 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
2013 年 4 月 20 日