

鹏华盛世创新股票型证券投资基金（LOF） 2013 年年度报告摘要

2013 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：2014 年 3 月 27 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 2014 年 3 月 24 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。

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)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 2013 年 1 月 1 日起至 2013 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	244,336,213.18 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	田青
	联系电话	0755-82825720	010-67595096
	电子邮箱	zhangge@phfund.com.cn	tianqingl.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 管理人互联网网址	http://www.phfund.com
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	2013 年	2012 年	2011 年
本期已实现收益	86,075,562.08	-62,564,887.02	-177,806,136.37
本期利润	58,308,774.02	51,292,012.89	-256,654,280.23
加权平均基金份额本期利润	0.1827	0.0994	-0.5242
本期基金份额净值增长率	14.71%	11.21%	-31.28%
3.1.2 期末数据和指标	2013 年末	2012 年末	2011 年末
期末可供分配基金份额利润	0.2094	-0.0321	0.0700
期末基金资产净值	333,402,237.94	509,200,301.65	615,000,283.15
期末基金份额净值	1.365	1.190	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）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

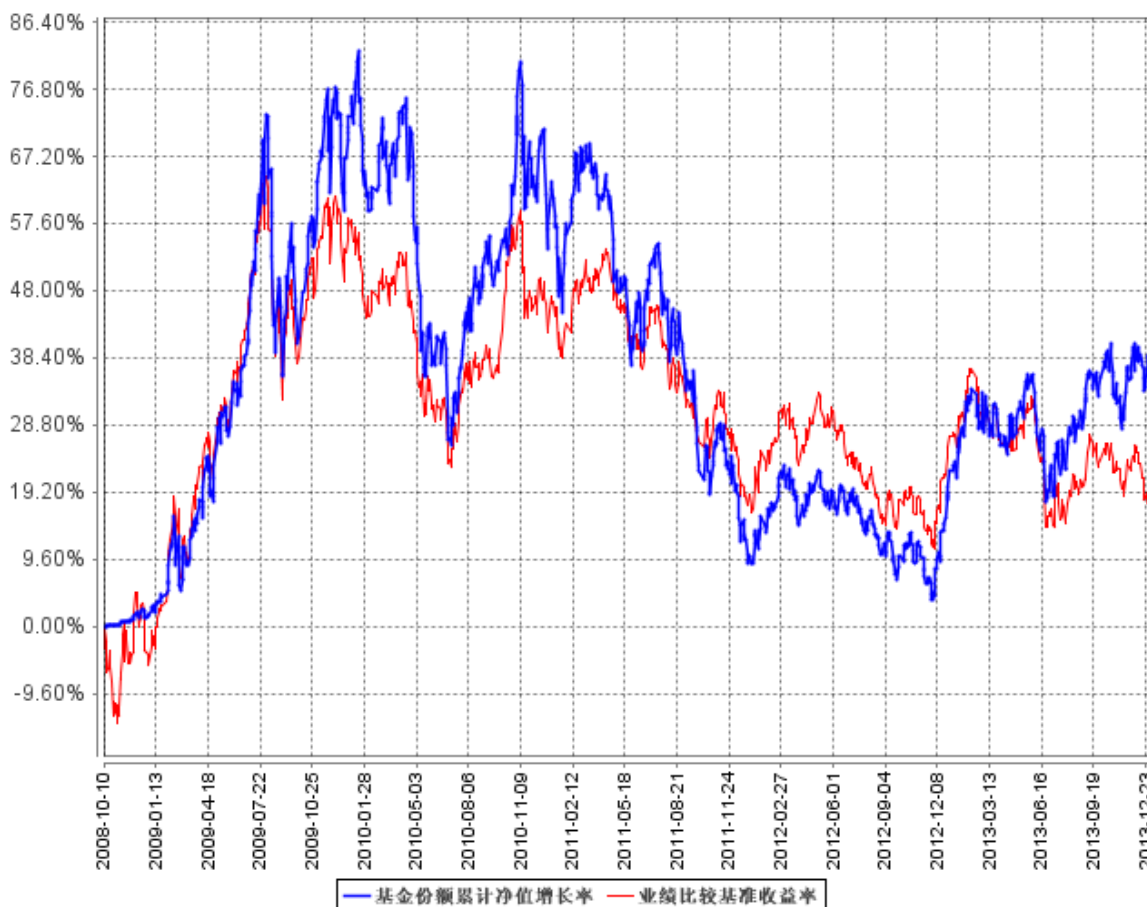
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	3.57%	1.19%	-2.85%	0.85%	6.42%	0.34%

过去六个月	17.47%	1.17%	3.89%	0.97%	13.58%	0.20%
过去一年	14.71%	1.25%	-5.48%	1.05%	20.19%	0.20%
过去三年	-12.33%	1.20%	-17.11%	0.99%	4.78%	0.21%
过去五年	38.15%	1.42%	27.16%	1.17%	10.99%	0.25%
自基金成立 起至今	40.36%	1.39%	20.23%	1.24%	20.13%	0.15%

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

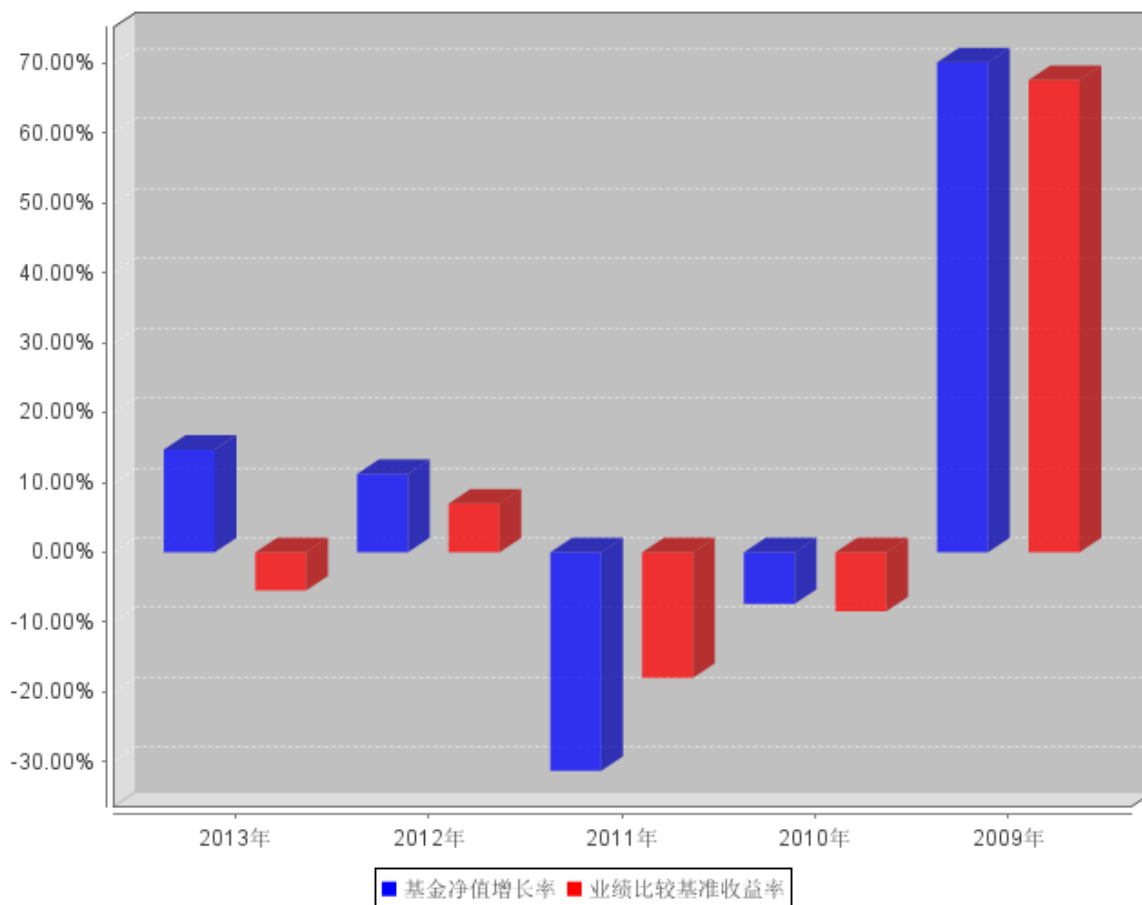


注：1、本基金合同于 2008 年 10 月 10 日生效。

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 过去五年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

过去五年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

过去三年本基金未进行利润分配。

§ 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 1 只封闭式基金、45 只开放

式基金和 7 只社保组合, 经过 15 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		
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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《鹏华基金管理有限公司公平交易管理规定》，将公司所管理的封闭式基金、开放式基金、社保组合、特定客户资产管理组合等不同资产组合的授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动均纳入公平交易管理，在业务流程和岗位职责中制定公平交易的控制规则和控制活动，建立对公平交易的执行、监督及审核流程，严禁在不同投资组合之间进行利益输送。

在投资研究环节：1、公司使用唯一的研究报告发布平台“研究报告管理平台”，确保各投资组合在获得投资信息、研究支持、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；2、公司严格按照《股票库管理规定》、《信用产品投资管理规定》，执行股票及信用产品出入库及日常维护工作，确保相关证券入库以内容严谨、观点明确的研究报告作为依据；3、在公司股票库基础上，各涉及股票投资的资产组合根据各自的投资目标、投资风格、投资范围和防范关联交易的原则分别建立资产组合股票库，基金经理在股票库基础上根据投资授权以及基金合同择股方式构建具体的投资组合；4、严格执行投资授权制度，明确投资决策委员会、分管投资副总裁、基金经理等各主体的职责和权限划分，合理确定基金经理的投资权限，超过投资权限的操作，应严格履行审批程序。

在交易执行环节：1、所有公司管理的资产组合的交易必须通过集中交易室完成，集中交易室负责建立和执行交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会；2、针对交易所公开竞价交易，集中交易室应严格启用恒生交易系统内的公平交易程序，交易系统则自动启用公平交易功能，由系统按照“未委托数量”的比例对不同资产组合进行委托量的公平分配；如果相关基金经理坚持以不同的价格进行交易，且当前市场价格不能同时满足多个资产组合的指令价格要求时，交易系统自动按照“价格优先”原则进行委托；当市场价格同时满足多个资产组合的指令价格要

求时，则交易系统自动按照“同一指令价格下的公平交易”模式，进行公平委托和交易量分配；3、银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易需依据公司《股票投资交易流程》和《固定收益投资管理流程》的规定执行；银行间市场交易、交易所大宗交易等以公司名义进行的交易，各投资组合经理应在交易前独立确定各投资组合的交易价格和数量，公司按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；4、新股、新债申购及非公开定向增发交易需依据公司《新股申购流程》、《固定收益投资管理流程》和《非公开定向增发流程》的规定执行，对新股和新债申购方案和分配过程进行审核和监控。

在交易监控、分析与评估环节：1、为加强对日常投资交易行为的监控和管理，杜绝利益输送、不公平交易等违规交易行为，防范日常交易风险，公司明确了关注类交易的界定及对应的监控和评估措施机制；所监控的交易包括但不限于：交易所公开竞价交易中同日同向交易的交易时机和交易价差、不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差、关联交易、债券交易收益率偏离度、成交量和成交价格异常、银行间债券交易对手交易等；2、将公平交易作为投资组合业绩归因分析和交易绩效评价的重要关注内容，发现的异常情况由金融工程师进行分析；3、监察稽核部分别于每季度和每年度编写《公平交易执行情况检查报告》，内容包括关注类交易监控执行情况、不同投资组合的整体收益率差异分析和同向交易价差分析；《公平交易执行情况检查报告》需经公司基金经理、督察长和总经理签署。

4.3.2 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。

4.3.3 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。

本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价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%的交易次数为 3 次，主要原因在于指数成份股交易不活跃导致。

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

回顾 2013 年，宏观经济处于稳中偏弱的格局，投资增速放缓，消费相对稳定，全年 GDP 增长 7.7%，经济整体内生增长动力不足，在化解产能、地方债务以及反腐等政策上的努力在一定程度上也对经济有负面影响。但由于整体经济增长尚未触及底线，政策的重心仍然在促改革、调结构。

全年 A 股市场弱势震荡,沪深 300 指数下跌 7.65%,中小板指上涨 17.54%,创业板指数上涨 82.73%。我们的投资策略依然是聚焦于具有创新能力和核心竞争能力中的低估值机会,在医药、家电、部分高端制造业上获得了一定的收益。

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 14.71%,同期上证综指下跌 6.75%,深证成指下跌 10.91%,沪深 300 指数下跌 7.65%。

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 2014 年,我们认为伴随海外经济复苏迹象出现,中国经济处在调结构的弱势运行区间。在流动性环境上,外围量化宽松进入逐步退出阶段、A 股新股发行启动、国内金融行业面临去杠杆的政策约束等因素有可能使得流动性相对收紧。股票市场估计仍会延续区间震荡的走势,未来的结构性机会可能会在制度改革红利释放、人口政策调整、新型城镇化、传统行业向互联网转型等亮点之中,我们仍将结合公司治理结构、竞争优势、创新能力以及股票估值水平来调整组合的持仓结构。

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、债券不活跃市场报价等投资品种估值小组，成员由基金经理、行业研究员、债券研究员、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，本基金期末可供分配利润为 51,170,240.71 元，期末基金份额净值 1.365 元。

4.7.2 本基金本报告期内未进行利润分配。

本基金于 2014 年 1 月 20 日对 2013 年年度可供分配利润进行分配，分配金额为 28,628,523.03 元。

§ 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

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)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：2013年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
资产：			
银行存款		38,331,119.80	41,280,361.05
结算备付金		736,659.50	714,112.45
存出保证金		152,577.44	250,000.00
交易性金融资产		296,260,359.53	464,522,255.18
其中：股票投资		292,587,047.03	464,522,255.18
基金投资		-	-
债券投资		3,673,312.50	-
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		-	4,616,024.78
应收利息		11,453.65	13,429.77
应收股利		-	-
应收申购款		112,236.04	108,918.85
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		335,604,405.96	511,505,102.08
负债和所有者权益		本期末 2013年12月31日	上年度末 2012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		-	-
应付赎回款		987,603.10	751,810.92
应付管理人报酬		417,495.68	595,403.51
应付托管费		69,582.60	99,233.92
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		415,305.16	505,773.63
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		312,181.48	352,578.45
负债合计		2,202,168.02	2,304,800.43
所有者权益：			
实收基金		244,336,213.18	428,030,184.98
未分配利润		89,066,024.76	81,170,116.67
所有者权益合计		333,402,237.94	509,200,301.65
负债和所有者权益总计		335,604,405.96	511,505,102.08

注：报告截止日 2013 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.365 元，基金份额总额 244,336,213.18 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：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日
一、收入		69,335,377.55	65,696,673.80
1. 利息收入		476,926.96	824,851.15
其中：存款利息收入		464,187.19	824,851.15
债券利息收入		12,739.77	-
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）		96,263,830.50	-49,114,813.31
其中：股票投资收益		91,177,515.32	-58,824,243.31
基金投资收益		-	-
债券投资收益		378,120.81	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		4,708,194.37	9,709,430.00
3. 公允价值变动收益（损失以“-”		-27,766,788.06	113,856,899.91

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)		361,408.15	129,736.05
减：二、费用		11,026,603.53	14,404,660.91
1. 管理人报酬	7.4.8.2.1	6,100,404.91	8,671,019.56
2. 托管费	7.4.8.2.2	1,016,734.14	1,445,169.96
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		3,426,719.69	3,799,449.37
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		482,744.79	489,022.02
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)		58,308,774.02	51,292,012.89
减：所得税费用		-	-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)		58,308,774.02	51,292,012.89

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：2013年1月1日至2013年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013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)	428,030,184.98	81,170,116.67	509,200,301.65
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	58,308,774.02	58,308,774.02
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)	-183,693,971.80	-50,412,865.93	-234,106,837.73
其中：1. 基金申购款	161,866,405.80	42,612,924.60	204,479,330.40
2. 基金赎回款	-345,560,377.60	-93,025,790.53	-438,586,168.13
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	244,336,213.18	89,066,024.76	333,402,237.94

项目	上年度可比期间		
	2012年1月1日至2012年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
金净值)			
一、期初所有者权益(基金净值)	574,746,625.30	40,253,657.85	615,000,283.15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	51,292,012.89	51,292,012.89
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)	-146,716,440.32	-10,375,554.07	-157,091,994.39
其中：1. 基金申购款	64,022,985.60	9,441,420.96	73,464,406.56
2. 基金赎回款	-210,739,425.92	-19,816,975.03	-230,556,400.95
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)	428,030,184.98	81,170,116.67	509,200,301.65

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
基金管理人负责人

毕国强
主管会计工作负责人

刘慧红
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 \times 75%+中证综合债指数收益率 \times 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 2013 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 2013 年 12 月 31 日的财务状况以及 2013 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 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市

公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 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
鹏华资产管理(深圳)有限公司	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内及上年度可比较期间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。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	6,100,404.91	8,671,019.56
其中:支付销售机构的客户维护费	719,186.99	721,776.27

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。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,016,734.14	1,445,169.96

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。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间没有与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

2013 年及 2012 年,本基金管理人未投资、持有本基金。

7.4.8.4.2 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

本基金本报告期末及上年度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。

7.4.8.5 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 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 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	38,331,119.80	440,393.39	41,280,361.05	806,230.89

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未参与关联方承销的证券。

7.4.9 期末（2013 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.9.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002004	华邦颖泰	2013 年 2 月 7 日	2014 年 2 月 10 日	非公开发行流通受限	14.03	15.04	350,000	4,910,500.00	5,264,000.00	-

注：（1）华邦颖泰股份有限公司 2012 年度利润分配方案为：向全体股东每 10 股派发现金 3.00 元（含税），股权登记日为 2013 年 7 月 9 日，除权除息日为 2013 年 7 月 10 日。

（2）截至本报告期末，本基金没有持有因认购新发或增发而流通受限的债券及权证。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002022	科华生物	2013 年 12 月 20 日	重大事项	16.82	2014 年 1 月 27 日	18.5	400,000	6,386,146.21	6,728,000.00	-

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，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余额。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金没有从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

§ 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	292,587,047.03	87.18
	其中：股票	292,587,047.03	87.18
2	固定收益投资	3,673,312.50	1.09
	其中：债券	3,673,312.50	1.09
	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	39,067,779.30	11.64
6	其他各项资产	276,267.13	0.08
7	合计	335,604,405.96	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	采矿业	-	-
C	制造业	170,825,481.22	51.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,336,320.00	3.10
E	建筑业	20,586,857.80	6.17
F	批发和零售业	4,600,920.00	1.38
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	18,043,040.00	5.41
J	金融业	56,281,371.01	16.88
K	房地产业	3,865,080.00	1.16
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	8,047,977.00	2.41
S	综合	-	-
	合计	292,587,047.03	87.76

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	601318	中国平安	550,517	22,973,074.41	6.89
2	300145	南方泵业	488,511	18,392,439.15	5.52
3	600887	伊利股份	388,000	15,163,040.00	4.55
4	600690	青岛海尔	600,000	11,700,000.00	3.51
5	000001	平安银行	903,544	11,068,414.00	3.32
6	601126	四方股份	563,078	10,839,251.50	3.25
7	000581	威孚高科	350,000	10,780,000.00	3.23
8	600527	江南高纤	1,529,836	10,678,255.28	3.20
9	300335	迪森股份	582,000	10,336,320.00	3.10
10	002152	广电运通	530,000	10,170,700.00	3.05

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> 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	601601	中国太保	48,959,391.64	9.61
2	601166	兴业银行	42,241,038.25	8.30
3	601318	中国平安	41,558,050.32	8.16
4	000001	平安银行	39,421,407.45	7.74

5	600016	民生银行	27,212,486.30	5.34
6	600795	国电电力	26,754,903.45	5.25
7	000002	万科A	25,737,861.98	5.05
8	601126	四方股份	23,393,794.95	4.59
9	002065	东华软件	21,915,471.83	4.30
10	600535	天士力	20,414,257.24	4.01
11	600104	上汽集团	20,225,477.63	3.97
12	300145	南方泵业	19,478,318.51	3.83
13	600062	华润双鹤	18,845,282.96	3.70
14	300275	梅安森	18,102,969.00	3.56
15	600312	平高电气	17,978,767.82	3.53
16	600887	伊利股份	16,885,314.43	3.32
17	600030	中信证券	16,379,434.44	3.22
18	002152	广电运通	16,049,989.77	3.15
19	300346	南大光电	14,697,300.32	2.89
20	600585	海螺水泥	14,559,094.16	2.86
21	600527	江南高纤	13,477,784.30	2.65
22	601633	长城汽车	13,210,832.94	2.59
23	000581	威孚高科	13,115,526.48	2.58
24	000100	TCL 集团	13,103,766.20	2.57
25	601311	骆驼股份	12,925,842.53	2.54
26	600690	青岛海尔	12,738,659.96	2.50
27	600362	江西铜业	12,278,062.00	2.41
28	601098	中南传媒	11,508,795.76	2.26
29	300128	锦富新材	11,413,869.07	2.24
30	600309	万华化学	11,261,698.60	2.21
31	601398	工商银行	11,174,200.00	2.19
32	601668	中国建筑	10,403,626.52	2.04

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	601166	兴业银行	73,354,309.56	14.41
2	601601	中国太保	59,282,681.65	11.64

3	600016	民生银行	44,484,612.76	8.74
4	600104	上汽集团	36,755,480.04	7.22
5	002065	东华软件	35,320,854.04	6.94
6	000002	万科A	33,474,131.20	6.57
7	600000	浦发银行	30,517,956.30	5.99
8	000001	平安银行	28,826,682.50	5.66
9	600030	中信证券	27,232,411.48	5.35
10	600585	海螺水泥	25,864,860.60	5.08
11	002038	双鹭药业	23,678,998.97	4.65
12	000786	北新建材	23,485,420.47	4.61
13	600795	国电电力	22,778,598.70	4.47
14	002250	联化科技	22,632,530.98	4.44
15	600060	海信电器	22,024,853.35	4.33
16	002152	广电运通	21,713,381.70	4.26
17	600690	青岛海尔	21,457,107.60	4.21
18	601628	中国人寿	21,401,440.41	4.20
19	601398	工商银行	20,526,867.03	4.03
20	601318	中国平安	19,455,473.93	3.82
21	601633	长城汽车	18,750,249.95	3.68
22	600312	平高电气	18,104,896.53	3.56
23	600535	天士力	17,672,982.18	3.47
24	300275	梅安森	17,629,204.84	3.46
25	600383	金地集团	16,343,618.26	3.21
26	601126	四方股份	15,564,364.21	3.06
27	000651	格力电器	15,052,137.89	2.96
28	000069	华侨城A	14,952,152.20	2.94
29	601098	中南传媒	14,817,810.59	2.91
30	300145	南方泵业	14,433,422.23	2.83
31	601311	骆驼股份	14,423,858.98	2.83
32	002508	老板电器	14,362,788.03	2.82
33	300032	金龙机电	14,120,508.10	2.77
34	300346	南大光电	14,022,534.12	2.75
35	000100	TCL 集团	12,864,466.40	2.53
36	600519	贵州茅台	12,757,391.63	2.51
37	600309	万华化学	12,094,478.50	2.38
38	600809	山西汾酒	11,728,866.10	2.30
39	600362	江西铜业	11,285,727.04	2.22
40	600674	川投能源	11,284,574.92	2.22

41	000415	渤海租赁	10,919,645.93	2.14
42	000568	泸州老窖	10,527,303.59	2.07

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	969,903,380.21
卖出股票收入（成交）总额	1,205,001,003.12

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	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	3,673,312.50	1.10
8	其他	-	-
9	合计	3,673,312.50	1.10

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113005	平安转债	34,250	3,673,312.50	1.10

注：上述债券明细为本基金本报告期末持有的全部债券。

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.9.1 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。

8.9.2 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。

8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.10.1 本期国债期货投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

8.10.2 报告期末本基金投资的国债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国债期货投资。

8.10.3 本期国债期货投资评价

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1

本基金投资的前十名证券之一的中国平安的发行主体中国平安保险(集团)股份有限公司(简称“中国平安”)于2013年5月22日发布公告称其控股子公司平安证券收到中国证监会《行政处罚和市场禁入事先告知书》，中国证监会决定对平安证券给予警告并没收其在“万福生科”发行上市项目中的业务收入人民币2,555万元，并处以人民币5,110万元的罚款，暂停其保荐机构资格3个月。2013年10月15日，中国平安发布公告称近日收到中国证监会《行政处罚决定书》([2013]48号)，决定对平安证券予以前述行政处罚。

对该股票的投资决策程序的说明：本基金管理人长期跟踪研究该股票，认为中国平安作为国内最大的保险机构之一将长期受益于我国保险行业的发展，从处罚公告中知悉，2012年平安证券投行业务承销佣金收入占平安集团营业收入的0.19%，净利润的0.66%，对平安集团的财务状况及经营成果并不产生实质性影响。本次行政处罚对该股票的投资价值不产生重大影响。该证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

本基金投资的前十名证券中的其它证券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。

8.11.2

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。

8.11.3 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	152,577.44
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	11,453.65
5	应收申购款	112,236.04
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	276,267.13

8.11.4 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。

8.11.5 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。

8.11.6 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
13,895	17,584.47	58,995,205.64	24.15%	185,341,007.54	75.85%

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	455,000.00	12.03%
2	巩非	400,136.00	10.58%
3	浙江中凯服饰有限公司	200,000.00	5.29%
4	姜卫平	118,642.00	3.14%
5	陈明杰	105,600.00	2.79%

6	窦世彦	102,700.00	2.72%
7	张琅琅	92,080.00	2.43%
8	刘继海	85,528.00	2.26%
9	李雪梅	79,600.00	2.10%
10	黄颖	78,814.00	2.08%

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
基金管理人所有从业人员持有本基金	1,197,495.38	0.4901%

注：（1）本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为 50 万份-100 万份（含）；

（2）本基金的基金经理本报告期末未持有本基金份额。

（3）截至本报告期末，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	428,030,184.98
本报告期基金总申购份额	161,866,405.80
减：本报告期基金总赎回份额	345,560,377.60
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	244,336,213.18

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 报告期内基金管理人的重大人事变动:

因公司原监事胡继之先生辞去鹏华基金管理有限公司监事职务, 根据股东国信证券股份有限公司推荐, 并经本公司 2013 年第三次股东会会议审议, 同意由李国阳先生担任本公司监事, 胡继之不再担任本公司监事职务。本公司已于 2013 年 11 月将上述变更事项报中国证券监督管理委员会深圳监管局备案。

报告期内公司原副总裁曹毅因个人原因提出辞职, 经公司五届董事会九次会议审议, 同意曹毅辞去公司副总裁职务, 相关高管任免情况已于 2013 年 3 月 9 日在指定媒体进行公告, 并向中国证券监督管理委员会深圳监管局备案。

11.2.2 报告期内基金托管人的重大人事变动:

本基金托管人 2013 年 12 月 5 日发布任免通知, 聘任黄秀莲为中国建设银行投资托管业务部副总经理。

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

经公司内部讨论, 本基金本报告期改聘普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金审计的会计师事务所, 并依法履行了公告手续。本年度应支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计费用 95,000.00 元, 该审计机构已提供审计服务的年限为一年。

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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	------	------	-----------	----

	数量	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	
中信证券	1	11,176,655,140.81	54.22%	1,071,223.15	54.37%	-
中投证券	1	516,639,628.23	23.81%	470,302.29	23.87%	-
民生证券	1	373,510,936.84	17.21%	334,674.06	16.99%	-
宏源证券	1	80,198,592.17	3.70%	73,012.03	3.71%	-
上海证券	1	22,989,585.28	1.06%	20,929.91	1.06%	-
中银国际	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，向券商租用交易单元作为基金专用交易单元。本报告期内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

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例	成交金额	占当期债 券回购 成交总额 的比例	成交金额	占当期权证 成交总额的 比例

中信证券	3,118,940.80	72.40%	-	-	-	-
中投证券	1,188,717.59	27.60%	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

鹏华基金管理有限公司
2014年3月27日