

鹏华中证500指数证券投资基金(LOF)

2012 第一季度报告

基金管理人:鹏华基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
报告送出日期:2012年4月24日

基金管理人、基金托管人、基金销售机构不存在虚假记载、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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

基金的投资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。

本报告期自2012年1月1日起至3月31日止。

基金简称:鹏华中证500指数(LOF)
基金代码:160616
交易代码:160616

基金运作方式:上市契约型开放式
基金合同生效日:2010年2月5日
报告期末基金份额总额:1,417,418,670.72份

投资目标:采用指数化投资策略,追求基金净值增长率与业绩比较基准收益率的长期跟踪误差最小化。

投资策略:本基金采用被动式指数投资策略,原则上按照标的指数在中证500指数中的权重进行资产配置。

业绩比较基准:中证500指数收益率\*95%+银行同业存款利率\*5%

风险收益特征:本基金属于采用指数化操作的股票型基金,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。

基金管理人:鹏华基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司

注:本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息披露场合下,可简称为“鹏华500”。

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
报告期:2012年1月1日至2012年3月31日

1.本期已实现收益 -15,159,652.50
2.本期利润 33,071,023.23
3.加权平均基金份额本期利润 0.0232

4.期末基金资产净值 1,013,973,755.58
5.期末基金份额净值 0.715

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。

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

Table with columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率基准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益差④, ①-③, ②-④

注:1.本基金合同于2010年2月5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。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介
姓名: 方南
职务: 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。

4.2 管理人报告期内本基金运作遵守信用的说明
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。

4.3 公平交易专项说明
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。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析
今年以来,市场在年初和年中下旬,市场单日波动加剧加大,对基金的管理运作带来一定影响。

定影响;三是目前的份额净值计算精度。基金份额净值的计算保留到小数点后3位,小数点后第4位(即万分位)向未位的四舍五入,这也是本期跟踪误差的主要来源之一。

5. 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
下一阶段我们建议关注以下几个方面:一是面临经济增速回落,新的需求能否逐步启动并带动新的库存周期和增长动能。

5.1 报告期末基金资产组合情况
序号: 1 权益投资 962,725,321.01 94.65

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
代码: A 农林牧渔 17,068,140.41 1.68

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: 1 000070 中科三环 256,802 6,674,283.98 0.66

5.4 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债券投资明细
序号: 1 000017 电广传媒 205,098 5,972,453.76 0.59

5.5 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权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.6 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序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 其他资产构成
序号: 1 存出保证金 594,731.11

5.9 投资组合报告附注
5.9.1 报告期内本基金投资的前十名股票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。

5.9.2 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。

5.9.3 其他资产构成
序号: 1 存出保证金 594,731.11

5.9.4 报告期内本基金投资的前十名股票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。

5.9.5 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。

5.9.6 其他资产构成
序号: 1 存出保证金 594,731.11

5.9.7 报告期内本基金投资的前十名股票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。

5.9.8 其他资产构成
序号: 1 存出保证金 594,731.11

5.9.9 报告期内本基金投资的前十名股票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。

5.9.10 其他资产构成
序号: 1 存出保证金 594,731.11

5.9.11 报告期内本基金投资的前十名股票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。

5.9.12 其他资产构成
序号: 1 存出保证金 594,731.11

5.9.13 报告期内本基金投资的前十名股票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。

5.9.14 其他资产构成
序号: 1 存出保证金 594,731.11

5.9.15 报告期内本基金投资的前十名股票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。

5.9.16 其他资产构成
序号: 1 存出保证金 594,731.11

5.9.17 报告期内本基金投资的前十名股票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。

5.9.18 其他资产构成
序号: 1 存出保证金 594,731.11

5.9.19 报告期内本基金投资的前十名股票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。

5.9.20 其他资产构成
序号: 1 存出保证金 594,731.11

5.9.21 报告期内本基金投资的前十名股票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。

鹏华中国50开放式证券投资基金

2012 第一季度报告

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
报告送出日期:2012年4月24日

基金管理人、基金托管人、基金销售机构不存在虚假记载、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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

基金的投资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。

本报告期自2012年1月1日起至3月31日止。

基金简称:鹏华中国50混合
基金代码:160605
交易代码:160605

基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2004年5月12日
报告期末基金份额总额:3,647,808,856.52份

投资目标:以价值投资方式,通过集中投资于基本面和流动性良好而估值相对低估的个股,长期持有并适度波段操作,以求在充分控制风险的前提下分享中国中高速增长带来的长期确定性增值。

投资策略:(1)股票选择方法:本基金投资策略中,精选个股,长期持有并适度波段操作,注重长期收益,将类指数的选股方法与积极的个股配置相结合,从而在保持收益空间的前提下一定程度上降低了投资风险。

业绩比较基准:上证180指数涨跌幅\*65%+沪深300指数涨跌幅\*30%+金融同业存款利率\*5%

风险收益特征:本基金属于平衡型证券投资基金,为证券投资基金中的中高风险品种,长期平均的风险和预期收益低于成长型基金,高于价值型基金、纯股票基金、纯债券基金和国债。

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

注:1.本基金合同于2004年5月12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。

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
报告期:2012年1月1日至2012年3月31日

1.本期已实现收益 -209,206,428.35
2.本期利润 114,624,960.18
3.加权平均基金份额本期利润 0.0314

4.期末基金资产净值 4,058,127,301.00
5.期末基金份额净值 1.112

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。

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

Table with columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率基准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益差④, ①-③, ②-④

注:1.本基金合同于2004年5月12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。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介
姓名: 陈鹏
职务: 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。

4.2 管理人报告期内本基金运作遵守信用的说明
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。

4.3 公平交易专项说明
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。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析
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。

性等方面,二季度环比一季度都会有所改善。而经济结构的转型也会在兼顾发展速度与经济稳定的基础上进行,因此经济出现超预期下降的可能性不大。

5. 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
下一阶段我们建议关注以下几个方面:一是面临经济增速回落,新的需求能否逐步启动并带动新的库存周期和增长动能。

5.1 报告期末基金资产组合情况
序号: 1 权益投资 3,067,634,541.20 74.85

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
代码: A 农林牧渔 1,251,909,481.66 6.21

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: 1 000858 五粮液 7,299,931 239,729,734.04 5.91

5.4 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债券投资明细
序号: 1 1101022 11央行票据22 1,000,000 96,810,000.00 2.39

5.5 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权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.6 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序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 其他资产构成
序号: 1 存出保证金 1,450,337.85

5.9 投资组合报告附注
5.9.1 报告期内本基金投资的前十名股票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。

5.9.2 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。

5.9.3 其他资产构成
序号: 1 存出保证金 1,450,337.85

5.9.4 报告期内本基金投资的前十名股票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。

5.9.5 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。

5.9.6 其他资产构成
序号: 1 存出保证金 1,450,337.85

5.9.7 报告期内本基金投资的前十名股票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。

5.9.8 其他资产构成
序号: 1 存出保证金 1,450,337.85

5.9.9 报告期内本基金投资的前十名股票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。

5.9.10 其他资产构成
序号: 1 存出保证金 1,450,337.85

5.9.11 报告期内本基金投资的前十名股票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。

5.9.12 其他资产构成
序号: 1 存出保证金 1,450,337.85

5.9.13 报告期内本基金投资的前十名股票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。

5.9.14 其他资产构成
序号: 1 存出保证金 1,450,337.85

5.9.15 报告期内本基金投资的前十名股票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。

5.9.16 其他资产构成
序号: 1 存出保证金 1,450,337.85

5.9.17 报告期内本基金投资的前十名股票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。

5.9.18 其他资产构成
序号: 1 存出保证金 1,450,337.85

5.9.19 报告期内本基金投资的前十名股票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。

5.9.20 其他资产构成
序号: 1 存出保证金 1,450,337.85

5.9.21 报告期内本基金投资的前十名股票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。