

2013年3月29日 星期五

鹏华价值优势股票型证券投资基金 LOF

2012 年度报告摘要

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

国证券业协会2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、鹏华价值优势股票型证券投资基金 LOF 基金合同和中国证监会允许的如财务报表附注所列示的基金行业业务操作的有关法规编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定
本基金2012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2012年12月31日的财务状况以及2012年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

2.1 基金基本情况
基金名称:鹏华价值优势股票(LOF)
基金代码:160607
交易代码:160607

7.4.4 本报告期末资产负债表科目余额与最近一期资产负债表科目余额比较
本报告期末资产负债表科目余额与最近一期资产负债表科目余额比较一致。

7.4.5 本报告期末资产负债表科目余额与最近一期资产负债表科目余额比较
本报告期末资产负债表科目余额与最近一期资产负债表科目余额比较一致。

投资目标
本基金在严格控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

7.4.6 关联方关系
关联方名称:鹏华基金管理有限公司
关联方名称:中国建设银行股份有限公司

7.4.7.1 本报告期末在控制关系及其他重大关系的关联方没有发生交易。
7.4.7.2 本报告期末在控制关系及其他重大关系的关联方没有发生交易。

投资策略
本基金采取自上而下的资产配置策略,在严格控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

7.4.7.2.1 本报告期末在控制关系及其他重大关系的关联方没有发生交易。
7.4.7.2.2 本报告期末在控制关系及其他重大关系的关联方没有发生交易。

7.4.7.2.3 本报告期末在控制关系及其他重大关系的关联方没有发生交易。
7.4.7.2.4 本报告期末在控制关系及其他重大关系的关联方没有发生交易。

业绩比较基准
中信标普A股综合指数收益率\*70%+中信标普国债指数收益率\*30%

7.4.7.2.5 本报告期末在控制关系及其他重大关系的关联方没有发生交易。
7.4.7.2.6 本报告期末在控制关系及其他重大关系的关联方没有发生交易。

7.4.7.2.7 本报告期末在控制关系及其他重大关系的关联方没有发生交易。
7.4.7.2.8 本报告期末在控制关系及其他重大关系的关联方没有发生交易。

风险收益特征
本基金属于股票型证券投资基金,为证券投资基金中的中高风险品种。

7.4.7.2.9 本报告期末在控制关系及其他重大关系的关联方没有发生交易。
7.4.7.2.10 本报告期末在控制关系及其他重大关系的关联方没有发生交易。

7.4.7.2.11 本报告期末在控制关系及其他重大关系的关联方没有发生交易。
7.4.7.2.12 本报告期末在控制关系及其他重大关系的关联方没有发生交易。

基金管理人及基金托管人
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

7.4.7.2.13 本报告期末在控制关系及其他重大关系的关联方没有发生交易。
7.4.7.2.14 本报告期末在控制关系及其他重大关系的关联方没有发生交易。

7.4.7.2.15 本报告期末在控制关系及其他重大关系的关联方没有发生交易。
7.4.7.2.16 本报告期末在控制关系及其他重大关系的关联方没有发生交易。

Table with 3 columns: 主要会计数据和财务指标, 2012年, 2011年, 2010年. Rows include 本期已实现收益, 本期利润, 期末基金资产净值, etc.

Table with 3 columns: 资产, 附注号, 2012年12月31日, 2011年12月31日, 2010年12月31日. Rows include 货币资金, 结算备付金, 交易保证金, etc.

Table with 3 columns: 项目, 2012年1月1日至2012年12月31日, 2011年1月1日至2011年12月31日. Rows include 当期发生的基金应支付的基金管理费, 其中:支付销售机构的客户维护费, etc.

Table with 5 columns: 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标准差③, ①-③, ②-③. Rows include 过去三个月, 过去六个月, 过去一年, etc.

Table with 3 columns: 项目, 附注号, 2012年12月31日, 2011年12月31日. Rows include 总资产, 负债和所有者权益, 净资产, etc.

Table with 3 columns: 股票代码, 停牌日期, 停牌原因, 复牌日期, 复牌原因, 数量(股), 期末成本总额, 期末估值总额. Rows include 00005, 00027, etc.

Table with 3 columns: 项目, 附注号, 2012年1月1日至2012年12月31日, 2011年1月1日至2011年12月31日. Rows include 一、收入, 利息收入, 公允价值变动收益, etc.

Table with 3 columns: 项目, 2012年1月1日至2012年12月31日, 2011年1月1日至2011年12月31日. Rows include 一、期初所有者权益(基金净值), 本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润), etc.

Table with 3 columns: 代码, 行业类别, 公允价值, 占基金资产净值的比例(%). Rows include A 农林牧渔, B 采掘业, C 制造业, etc.

4.1 基金管理人及其管理基金的情况
4.2 基金管理人及其管理基金的情况

7.4.7.2.17 本报告期末在控制关系及其他重大关系的关联方没有发生交易。
7.4.7.2.18 本报告期末在控制关系及其他重大关系的关联方没有发生交易。

7.4.7.2.19 本报告期末在控制关系及其他重大关系的关联方没有发生交易。
7.4.7.2.20 本报告期末在控制关系及其他重大关系的关联方没有发生交易。

7.4.7.2.21 本报告期末在控制关系及其他重大关系的关联方没有发生交易。
7.4.7.2.22 本报告期末在控制关系及其他重大关系的关联方没有发生交易。

7.4.7.2.23 本报告期末在控制关系及其他重大关系的关联方没有发生交易。
7.4.7.2.24 本报告期末在控制关系及其他重大关系的关联方没有发生交易。

7.4.7.2.25 本报告期末在控制关系及其他重大关系的关联方没有发生交易。
7.4.7.2.26 本报告期末在控制关系及其他重大关系的关联方没有发生交易。

Table with 2 columns: 基金资产净值, 2,610,799,065.83; 基金份额净值, 5.973,882,065.28

Table with 5 columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Rows include 1 国家债券, 2 央行票据, 3 金融债券, etc.

Table with 5 columns: 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(%). Rows include 1 1001074, 10央行票据74, 2 1001079, 10央行票据79, etc.

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额. Rows include 1 存出保证金, 2 应收证券清算款, 3 应收股利, etc.

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值, 占基金资产净值比例(%), 流通受限情况说明. Rows include 1 000527, 美的电, 2 738,986,387.16, etc.

Table with 3 columns: 序号, 持有人名称, 持有份额(份), 占上市总份额比例. Rows include 1 徐冠雄, 2 刘瑞, 3 南宁德瑞科实业发展有限公司, etc.

Table with 3 columns: 项目, 持有份额(总份数), 占基金总份额比例. Rows include 基金管理人持有从人, 269,418.15, 0.0021%, etc.

Table with 3 columns: 基金合同生效日(2006年7月18日), 基金份额总额, 1,876,753,992.72; 本报告期初基金份额总额, 13,485,540,411.99, etc.

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额. Rows include 1 权益投资, 6,613,583,155.02, 58.52%; 2 固定收益投资, 998,395,000.00, 8.83%, etc.

Table with 5 columns: 券商名称, 交易数量, 成交金额, 占当期股票成交金额的比例, 佣金, 占当期佣金的比例. Rows include 中投证券, 2,201,299,242.07, 25.98%, etc.

注:1. 本基金基金合同于2006年7月18日生效。
2. 截至本基金基金合同生效日,本基金的基金份额持有人已达到基金合同中规定的各项比例。

7.4.7.2.27 本报告期末在控制关系及其他重大关系的关联方没有发生交易。
7.4.7.2.28 本报告期末在控制关系及其他重大关系的关联方没有发生交易。

7.4.7.2.29 本报告期末在控制关系及其他重大关系的关联方没有发生交易。
7.4.7.2.30 本报告期末在控制关系及其他重大关系的关联方没有发生交易。

鹏华基金管理有限公司
2013年3月29日