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
送出日期:2013年3月29日

普惠证券投资基金

【2012】年度报告摘要

§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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年3月26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。

安永华明会计师事务所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2012年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	鹏华普惠封闭
基金主代码	184689
交易代码	184689
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	1999年1月6日
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
报告期末基金份额总额	2,000,000,000.00份
基金合同存续期	至2014年1月6日止
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	1999年1月27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"基金普惠"。

2.2 基金产品说明

投资目标	为投资者减少和分散投资风险,确保基金资产的安全并谋求基金长期稳定的投资收益。
投资策略	本基金采取自上而下与自下而上相结合的投资思路,以宏观经济、政策研究和行业研究作为投资方向的指导,以市场、技术、管理、机制等为主体内容的核心竞争力作为成长性企业的选择标准,同时兼顾具有稳固基础但被市场低估的质优和绩优个股。本基金在投资组合构建中注意引入投资组合理论思想和辅助工具,根据市场变化灵活调整各类财产的投资比例,注重基金财产的流动性,以优化投资组合的风险和收益特征。
业绩比较基准	无
风险收益特征	无

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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张戈	裴学敏
	联系电话	0755-82825720	021-32169999
	电子邮箱	zhangge@phfund.com.cn	zh_jjb@bankcomm.com
客户服务电话		4006788999	95559
传真		0755-82021126	021-62701262

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.cn
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 上海市仙霞路18号交通银行股份有限公司

§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	2012年	2011年	2010年
本期已实现收益	-199,795,396.85	-57,794,702.01	276,066,379.76
本期利润	63,064,098.54	-549,371,989.61	149,078,591.63
加权平均基金份额本期利润	0.0315	-0.2747	0.0745
本期基金份额净值增长率	3.43%	-22.93%	7.82%
3.1.2 期末数据和指标	2012年末	2011年末	2010年末
期末可供分配基金份额利润	-0.1101	-0.0776	0.1947
期末基金资产净值	1,907,954,571.24	1,844,890,472.70	2,746,262,462.31
期末基金份额净值	0.9540	0.9224	1.3731

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,封闭式基金交易佣金等),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	5.78%	2.19%	-	-	-	-
过去六个月	0.56%	2.31%	-	-	-	-
过去一年	3.43%	2.04%	-	-	-	-
过去三年	-14.06%	2.22%	-	-	-	-
过去五年	-33.37%	2.81%	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	367.93%	2.62%	-	-	-	-

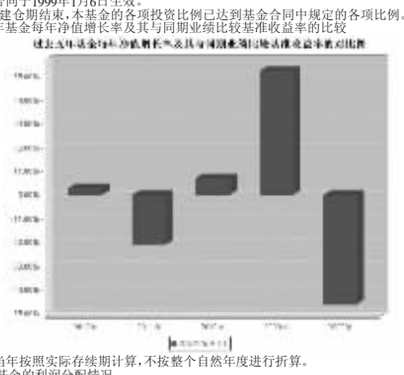
注:基金合同中未规定业绩基准。

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

注:1、本基金合同于1999年1月6日生效。

2、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



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

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2012	-	-	-	-	
2011	1.7600	352,000,000.00	-	352,000,000.00	
2010	5.4000	1,080,000,000.00	-	1,080,000,000.00	
合计	7.1600	1,432,000,000.00	-	1,432,000,000.00	

§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2只封闭式基金、31只开放式基金和6只社保组合,经过14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		
杨俊	本基金基金经理、研究部总经理	2011年12月10日	-	10	杨俊先生,国籍中国,澳大利亚麦考瑞大学商学硕士,10年证券从业经验。2002年10月加盟鹏华基金管理有限公司,历任行业研究员、社保基金组合投资经理助理、投资经理,现任鹏华基金管理有限公司研究部总经理,投资决策委员会委员,2011年12月起担任鹏华普惠基金基金经理。杨俊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遵规守信情况的说明

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本基金基金合同的约定,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。本报告期内,本基金运作合法合规,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中的公平交易程序,交易系统则自动启用公平交易功能,由系统按照"宋委托数量"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、银行间债券交易对于交易等;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、分配等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

2012年,上证指数录得3%的涨幅,上下振幅均在10%左右。在一季度"春季躁动"之后,较差的经济数据和稳健的货币政策,导致市场一路下行,并在11月底跌破2000点,创出行情新低。此后,新一届国家领导人市场化改革的施政方向和回暖的经济数据,终于唤醒了投资者的热情,市场迎来了2012年度最快最迅猛的上涨,全年最终得以阳线报收。

2012年,普惠基金较为保守,我们预判宏观经济复苏需要较长时间,因此,在资产配置上,年初并未大幅加仓。在行业配置上,我们认为证券行业的创新,短期无法带来盈利的恢复,对非银行金融配置较少。个股上,业绩大幅上涨的个股持仓不多。尽管在金融地产、建筑、家电等行业上略有盈利,但全年基金收益仅与基准相当,甚为遗憾。

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3.43%,同期上证综指上涨3.17%,深证成指上涨2.22%,沪深300指数上涨7.55%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们预判2013年,中国宏观经济小幅复苏,尤其是名义GDP将高于2012年。考虑到全年通胀水平仍不高,货币政策收紧的可能性不大,加之,市场估值水平仍然处于低位。我们预计市场表现将好于2012年。影响市场最大的变量是新一届政府的施政方针,若能切实开启改革,释放制度红利,市场将稳健上行,并为今后的行情打下坚实基础。

从估值看,市场估值水平不高,尤其是金融、地产、汽车、家电、商业、食品、服装、软件等行业处于历史较低水平,可作为基础的资产配置,对于业绩成长性好的公司,更可以重点持仓。同时,我们也将保持对市场的警惕,尤其是那些2012年涨幅较大,或者可能受到政策抑制的行业和个股。

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,本公司成立长期停牌股票等没有市价的投资品种估值小组,成员由基金经理、行业研究员、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长期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,本基金已实现收益为-199,795,396.85元,期末基金份额净值0.9540元,不符合利润分配条件,本基金本期将不进行利润分配。

4.7.2本基金本报告期内未进行利润分配。

§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

2012年度,托管人在普惠证券投资基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务,不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2012年度,鹏华基金管理有限公司在普惠证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金费用开支等问题上,托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配,符合基金合同的规定。

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

2012年度,由鹏华基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关普惠证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 审计报告

安永华明会计师事务所注册会计师对本基金出具了"标准无保留意见"的审计报告。投资者可通过年报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:普惠证券投资基金

报告截止日:2012年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
资 产:			
银行存款		41,533,990.63	1,384,554.46
结算备付金		4,934,995.56	92,749,535.62
存出保证金		596,633.60	945,568.53
交易性金融资产		1,882,134,499.65	1,796,873,817.98
其中:股票投资		1,493,998,749.65	1,348,859,782.98
基金投资		-	-
债券投资		388,135,750.00	448,014,035.00
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		-	-
应收利息		8,430,379.52	6,319,334.82
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		1,937,630,498.96	1,898,272,811.41
负债和所有者权益	附注号	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011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		25,625,991.35	48,596,332.64
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		2,276,607.10	2,425,613.88
应付托管费		379,434.52	404,268.96
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		1,043,894.75	1,582,123.23
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		350,000.00	374,000.00
负债合计		29,675,927.72	53,382,338.71
所有者权益:			
实收基金		2,000,000,000.00	2,000,000,000.00
未分配利润		-92,045,428.76	-155,109,527.30
所有者权益合计		1,907,954,571.24	1,844,890,472.70
负债和所有者权益总计		1,937,630,498.96	1,898,272,811.41

注:报告截止日2012年12月31日,基金份额净值0.9540元,基金份额总额2,000,000,000份。

7.2 利润表

会计主体:普惠证券投资基金

本报告期:2012年1月1日至2012年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
一、收入		103,698,592.46	-493,410,676.72
1.利息收入		17,391,986.77	16,089,943.68
其中:存款利息收入		1,805,671.90	1,691,658.48
债券利息收入		15,586,314.87	14,238,609.99
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	159,675.21
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-176,580,833.66	-17,923,612.49
其中:股票投资收益		-196,468,476.05	-25,010,091.21
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-330,248.16	-2,985,048.94
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		20,217,890.55	10,071,527.66
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		262,859,495.39	-491,577,287.60
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		27,943.96	279.69
减:二、费用		40,634,493.92	55,961,312.89
1.管理人报酬	7.4.7.2.1	27,622,721.68	34,166,086.15
2.托管费	7.4.7.2.2	4,603,786.91	5,694,347.79
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		7,926,792.41	13,538,013.06
5.利息支出		-	1,040,856.39
其中:卖出回购金融资产支出		-	1,040,856.39
6.其他费用		481,192.92	1,522,009.50
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		63,064,098.54	-549,371,989.61
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		63,064,098.54	-549,371,989.61

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:普惠证券投资基金

本报告期:2012年1月1日至2012年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 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
一、期初所有者权益(基金净值)	2,000,000,000.00	-155,109,527.30	1,844,890,472.70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	63,064,098.54	63,064,098.54
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)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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)	2,000,000,000.00	-92,045,428.76	1,907,954,571.24
项目	上年度可比期间 2011年1月1日至2011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)	2,000,000,000.00	746,262,462.31	2,746,262,462.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-549,371,989.61	-549,371,989.61
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)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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)	-	-352,000,000.00	-352,000,000.00
五、期末所有者权益(基金净值)	2,000,000,000.00	-155,109,527.30	1,844,890,472.70

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　　毕国强　　刘慧红

基金管理公司负责人　　主管会计工作负责人　　会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

普惠证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会《证监基字《1998》32号文》批准,于1999年1月6日募集设立。本基金为契约型封闭式,存续期15年,发行规模为20亿份基金份额。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。《普惠证券投资基金招募说明书》、《普惠证券投资基金基金合同》等文件已按规定报送中国证监会备案。本基金经深圳证券交易所(以下简称深交所)《深证上《999》7》号文》审核同意,于1999年1月27日在深交所挂牌交易。

根据《证券投资基金法》及其实施细则和《普惠证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资对象为具有良好流动性的金融工具,其中主要投资于国内依法公开发行、上市的股票及债券。

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》、《普惠证券投资基金基金合同》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。

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

本报告期内所采用的会计政策、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 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	基金发起人、基金管理人
交通银行股份有限公司("交通银行")	基金托管人
国信证券股份有限公司("国信证券")	基金发起人、基金管理人的股东
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
方正证券有限责任公司("方正证券")	基金发起人
安徽国元信托投资有限责任公司("安徽国元信托")	基金发起人
安信信托投资股份有限公司	基金发起人

注:1.本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

2.下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.7.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年12月31日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国信证券	788,908,215.72	15.09%	2,308,274,844.32	26.42%
方正证券	-	-	-	-

7.4.7.1.2债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年12月31日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
国信证券	-	-	62,015,830.80	42.15%
方正证券	-	-	-	-

7.4.7.1.3债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年12月31日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
国信证券	-	-	660,000,000.00	53.37%
方正证券	-	-	-	-

7.4.7.1.4 权证交易

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权证交易。

7.4.7.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国信证券	697,984.36	15.57%	487,391.98	46.72%
方正证券	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国信证券	1,948,105.35	26.57%	259,398.47	16.43%
方正证券	-	-	-	-

注:1、佣金的计算公式上海证券交易所的交易佣金=买(卖)成交金额×1‰-买(卖)经手费-买(卖)证管费

深圳证券交易所的交易佣金=买(卖)成交金额×1‰-买(卖)经手费-买(卖)证管费

(佣金比率按照与一般证券公司签订的协议条款订立。)

2、本基金与关联方已按同业统一的基金佣金计算方式和佣金比例签订了《证券交易席位租用协议》。根据协议规定,上述单位定期或不定期地为我公司提供研究服务以及其他研究支持。

7.4.7.2 关联方报酬

7.4.7.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	27,622,721.68	34,166,086.15

注: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。

7.4.7.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	4,603,786.91	5,694,347.79

注:支付基金托管人交通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。

7.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年12月31日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
交通银行	-	9,764,449.56	-	-	-	-
银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
交通银行	-	104,456,075.34	-	-	-	-

注:与关联方之间通过银行间同业市场进行的债券(含回购)交易,该类交易均在正常业务中按一般商业条款而订立。

7.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
基金合同生效日(1999年1月6日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	7,500,000.00	7,500,000.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	7,500,000.00	7,500,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.38%	0.38%

注:本基金管理人投资本基金的费率标准与其他相同条件的投资者适用的费率标准相一致。

7.4.7.4.2 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

份额单位:份

关联方名称	本期末 2012年12月31日		上年度末 2011年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
国信证券	15,000,000.00	0.75%	15,000,000.00	0.75%
方正证券	3,750,000.00	0.19%	3,750,000.00	0.19%
安徽国元信托	3,750,000.00	0.19%	3,750,000.00	0.19%

注:(1)"方正证券、安徽国元信托"为本基金发起人;

(2)关联方投资本基金为基金发行期间按统一认购费率认购。

7.4.7.5 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 2012年1月1日至2012年12月31日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011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
交通银行	41,533,990.63	230,811.97	1,384,554.46	202,311.23

7.4.7.6 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。

7.4.8 期末(2012年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.8.1 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

7.4.10.1.1 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
600863	内蒙华电	2012年3月21日	2013年3月21日	非公开发行流通受限	7.76	7.50	3,000,000	23,280,000.00	22,500,000.00	-
600027	华电国际	2012年7月5日	2013年7月3日	非公开发行流通受限	3.12	3.54	1,300,000	4,056,000.00	4,602,000.00	-

注:

(1)内蒙古蒙电华能热电股份有限公司2011年度利润分配方案为:向全体股东每10股派发现金1.20元(含税),股权登记日为2012年8月21日,除权除息日为2012年8月22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债券及权证。

7.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末,本基金没有持有暂时停牌等流通受限的股票。

7.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.8.3.1 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。

7.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末,本基金没有从事证券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	1,493,998,749.65	77.10
	其中:股票	1,493,998,749.65	77.10
2	固定收益投资	388,135,750.00	20.03
	其中:债券	388,135,750.00	20.03
	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	46,468,986.19	2.40
6	其他各项资产	9,027,013.12	0.47
7	合计	1,937,