

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:2013年3月29日

§ 1 重要提示

基金管理人、基金托管人、基金销售机构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。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、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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,投资者在作出投资决策前应先仔细阅读该基金的投资说明文件及其更新。

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。

本报告自2013年1月1日起至2012年12月31日止。

2.1 基金基本情况	
基金简称	鹏华盛世创新股票(LOF)
基金代码	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	428,030,184.98份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市证券交易所	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

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。

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。

沪深300指数收益率×75%+中证综合债指数收益率×25%

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,为证券投资基金中较高风险、较高收益基金。

2.3 基金管理人		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		张克	田青
联系电话		0755-82825720	010-67595096
电子邮箱		zhangke@phfund.com.cn	tianqing126@cfbc.com.cn
客户服务电话		4006788999	010-67595096
传真		0755-83021126	010-66275853

2.4 信息披露方式

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
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 主要财务数据和财务指标

		2012年	2011年	2010年	金额单位:人民币元
3.1.1 期间数据和指标					
本期已实现收益		-62,564,887.02	-177,806,136.37	-95,384,473.99	
本期利润		51,292,012.89	-256,654,280.23	-127,424,668.29	
加权平均基金份额本期利润		0.0994	-0.5242	-0.2164	
本期基金份额净值增长率		11.21%	-31.28%	-7.38%	
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		-0.0321	0.0700	0.4027	
期末基金资产净值		509,200,301.65	615,000,283.15	694,966,857.06	
期末基金份额净值		1.190	1.070	1.557	

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,开放式基金申购赎回费、基金转换费等),计入费用后实际收益率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。

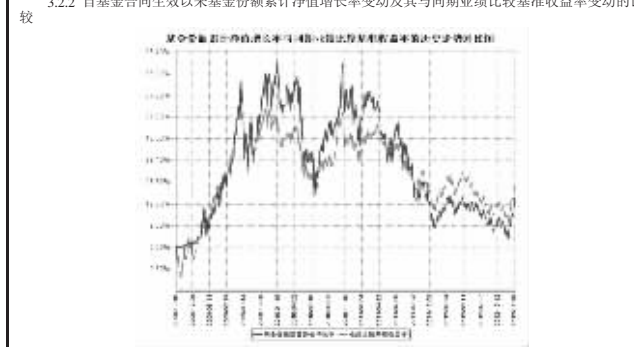
3.2 基金净值表现

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	11.21%	1.05%	7.70%	0.96%	3.51%	0.09%
过去六个月	3.84%	0.95%	2.20%	0.93%	1.64%	0.02%
过去一年	11.21%	0.95%	6.95%	0.96%	4.26%	-0.01%
过去三年	-29.21%	1.34%	-19.72%	1.04%	-9.49%	0.30%
自基金合同生效起至今	22.37%	1.42%	27.20%	1.28%	-4.83%	0.14%

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%。

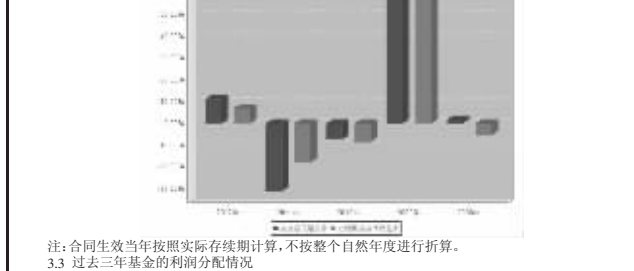
3.2.2 自基金合同生效以来基金基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1、本基金合同于2008年10月10日生效。

2、截至本基金建仓期结束,本基金的投资资产比例已到达基金合同中规定的各项比例。

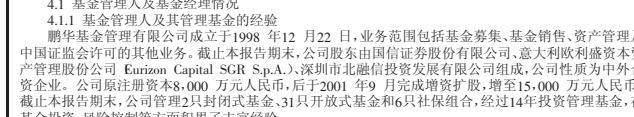
3.2.3 自基金合同生效以来基金基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1、本基金合同于2008年10月10日生效。

2、截至本基金建仓期结束,本基金的投资资产比例已到达基金合同中规定的各项比例。

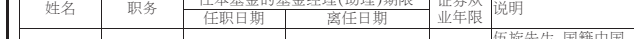
3.2.3 自基金合同生效以来基金基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1、本基金合同于2008年10月10日生效。

2、截至本基金建仓期结束,本基金的投资资产比例已到达基金合同中规定的各项比例。

3.2.3 自基金合同生效以来基金基金份额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2008年10月10日生效。

2、截至本基金建仓期结束,本基金的投资资产比例已到达基金合同中规定的各项比例。

3.2.3 自基金合同生效以来基金基金份额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2008年10月10日生效。

2、截至本基金建仓期结束,本基金的投资资产比例已到达基金合同中规定的各项比例。

3.2.3 自基金合同生效以来基金基金份额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2008年10月10日生效。

2、截至本基金建仓期结束,本基金的投资资产比例已到达基金合同中规定的各项比例。

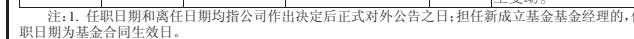
3.2.3 自基金合同生效以来基金基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1、本基金合同于2008年10月10日生效。

2、截至本基金建仓期结束,本基金的投资资产比例已到达基金合同中规定的各项比例。

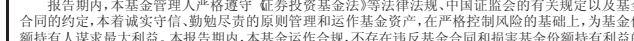
3.2.3 自基金合同生效以来基金基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1、本基金合同于2008年10月10日生效。

2、截至本基金建仓期结束,本基金的投资资产比例已到达基金合同中规定的各项比例。

3.2.3 自基金合同生效以来基金基金份额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2008年10月10日生效。

2、截至本基金建仓期结束,本基金的投资资产比例已到达基金合同中规定的各项比例。

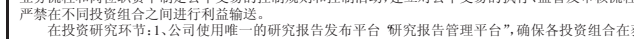
3.2.3 自基金合同生效以来基金基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1、本基金合同于2008年10月10日生效。

2、截至本基金建仓期结束,本基金的投资资产比例已到达基金合同中规定的各项比例。

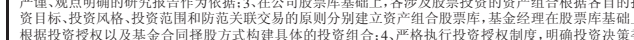
3.2.3 自基金合同生效以来基金基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1、本基金合同于2008年10月10日生效。

2、截至本基金建仓期结束,本基金的投资资产比例已到达基金合同中规定的各项比例。

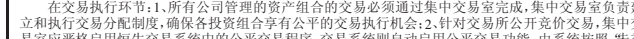
3.2.3 自基金合同生效以来基金基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1、本基金合同于2008年10月10日生效。

2、截至本基金建仓期结束,本基金的投资资产比例已到达基金合同中规定的各项比例。

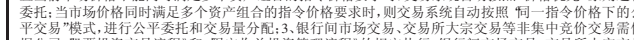
3.2.3 自基金合同生效以来基金基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1、本基金合同于2008年10月10日生效。

2、截至本基金建仓期结束,本基金的投资资产比例已到达基金合同中规定的各项比例。

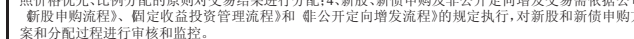
3.2.3 自基金合同生效以来基金基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1、本基金合同于2008年10月10日生效。

2、截至本基金建仓期结束,本基金的投资资产比例已到达基金合同中规定的各项比例。

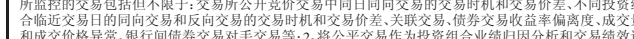
3.2.3 自基金合同生效以来基金基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1、本基金合同于2008年10月10日生效。

2、截至本基金建仓期结束,本基金的投资资产比例已到达基金合同中规定的各项比例。

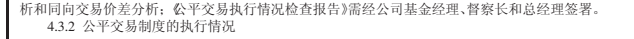
3.2.3 自基金合同生效以来基金基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1、本基金合同于2008年10月10日生效。

2、截至本基金建仓期结束,本基金的投资资产比例已到达基金合同中规定的各项比例。

3.2.3 自基金合同生效以来基金基金份额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



鹏华盛世创新股票型证券投资基金(LOF)

【2012】年度报告摘要

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可能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2012年, A股市场表现起伏较大,前11个月沪深300指数下跌8.79%,进入12月后,随着宏观经济数据的超预期回升,改革预期的进一步深化等因素筑底回升,单月上涨1.91%,全年累计涨幅7.55%。我们认为,在中国经济增速放缓、市场体制逐步完善的时期,股票市场估值中枢处于逐渐下移的阶段,同时企业经营行为也会随之调整,这样的环境下也为投资价值型企业提供了较好的机会,全年我们从低估值的企业行业内部挖掘,竞争中选优,处于上升趋势的企业,除了坚持之前配置较重的银行、家电、地产等行业外,在四季度也适时增加了 机械、化工、建材等周期股的投资。

4.4.2 报告期内基金的投资表现

报告期内,本基金净值增长率为11.21%,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3.55%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2013年,我们认为实体经济回升的趋势使得以延续的概率较大,流动性环境预计会相对宽松,尽管经历了2012年4季度的大幅上涨,但股票的估值水平依然具备一定的吸引力。我们依然会结合估值水平,选择具有竞争优势和增长潜力的上市公司,并适时调整组合的持仓结构。

4.6 管理人对报告期内基金净值增长情况的说明

4.6.1 有关公允价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:

基金估值由估值委员会负责,基金会计对会计所管理的基金以基金会计计算主账,独立建账、独立核算,保证不同基金之间在明细登记、账户设置、数据复核、账簿记录等方面相互独立。基金会计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账务处理,每日按日计提或成交数据及收益数据,进行基金估值。基金会计核算采用基金管理人与托管银行双人同步复核核算、相互核对的方式,每日就基金估值进行核算。基金估值与托管银行进行核对,每日估值结果必须与托管银行一致后才能对外公布。基金会计核算设有专职基金会计核算岗,还设有基金会计核算岗,负责基金会计核算的日常事后复核工作,确保基金估值核算无误。

4.6.2 估值委员会的组成

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,熟悉了解基金估值法规、政策和方法。

4.6.3 估值委员会的职责

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等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。

4.6.4 本公司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净值增长情况的说明

4.7.1 截止本报告期末,本基金可供分配利润为-13,729,889.50元,期末基金份额净值1.190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 本基金本报告期末未进行利润分配。

§ 5 托管人报告

本报告期内本基金托管人履行诚信受托义务,严格按照《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。

5.1 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

本报告期内,本托管人按照国家有关法规、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。

5.2 基金管理人未发生损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对基金管理人提供的基金净值、基金会计、托管协议和其他有关资料的真实性、准确性和完整性发表意见

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

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:2012年12月31日

资产	附注号	2012年12月31日	上年度末2011年12月31日
货币资金		41,280,361.05	156,786,996.32
结算备付金		714,112.45	298,036.12
存出保证金		250,000.00	-
交易性金融资产		464,522,255.18	450,337,353.07
其中:股票投资		464,522,255.18	450,337,353.07
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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	12,847,740.72
应收利息		13,429.77	15,428.87
应收股利		-	-
应收申购款		108,918.85	71,461.99
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		511,505,102.08	620,357,017.09

负债和所有者权益 附注号 2012年12月31日 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		3,702,021.95	-
应付赎回款		751,810.92	177,047.65
应付管理人报酬		595,403.51	819,816.39
应付托管费		99,233.92	136,636.09
应付销售服务费		-	-
应付交易费		505,773.63	420,776.90
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付股利		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		352,578.45	100,434.96
负债合计		2,304,800.43	5,356,733.94
所有者权益:			
实收基金		428,030,184.98	574,746,625.30
未分配利润		81,170,116.67	40,253,657.85
所有者权益合计		509,200,301.65	615,000,283.15
负债和所有者权益总计		511,505,102.08	620,357,017.09

注:报告截至2012年12月31日,基金份额净值1.190元,基金份额总额428,030,184.98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)

报告截止日:2012年1月1日至2012年12月31日

项目	附注号	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		65,696,673.80	-237,850,481.02
1.利息收入		824,851.15	549,718.07
其中:存款利息收入		824,851.15	549,718.07
债券利息收入		-	-
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)		-49,114,813.31	-159,704,784.84
其中:股票投资收益		-58,824,243.31	-163,254,563.01
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		9,709,430.00	3,549,778.17
3.公允价值变动收益(损失以“-”填列)		113,856,899.91	-78,848,143.86
4.汇兑收益(损失以“-”填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”填列)		129,736.05	152,729.61
减:一、费用		14,404,660.91	18,803,799.21
1.管理人报酬	7.4.7.2.1	8,671,019.56	10,138,725.80
2.托管费	7.4.7.2.2	1,445,169.96	1,689,787.56
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		3,799,449.37	6,485,674.85
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用		489,022.02	489,611.00
三、利润总额(亏损总额以“-”填列)		51,292,012.89	-256,654,280.23
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”填列)		51,292,012.89	-256,654,280.23

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:2012年1月1日至2012年12月31日

应付托管费	99,233.92	136,636.09
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	505,773.63	420,776.90
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	352,578.45	100,434.96
负债合计	2,304,800.43	5,356,733.94
所有者权益:		
实收资本	428,030,184.98	574,746,625.30
未分配利润	81,170,116.67	40,253,657.85
所有者权益合计	509,200,301.65	615,000,283.15
负债和所有者权益总计	511,505,107.08	620,357,017.00