

基金管理人:鹏华基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

送刊日期:2013年3月29日

§1 声明

基金管理人的董事会、监事会对本基金所载资料不存虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其中内容的真实性、准确性、完整性、及时性以及其组合投资的合理性承担法律责任。  
基金托管人对本基金年度报告书、托管协议书等文件进行复核，保证不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金合同于2012年4月25日生效，基金托管人于2012年4月25日复核了本报告中的有关指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、报告组合公告等信息，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金的存续并维系不代表未来持续、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报告。

本年度报告将简要公告年度报告，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

安永华明会计师事务所对本基金出具了“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2012年12月31日止。

§2 基金简介

**2.1 基金基本情况**

基金简称 鹏华优质治理股票型证券投资基金 LOF  
基金主代码 160611  
交易代码 160611  
基金运作方式 上市契约型开放式(LOF)  
基金合同生效日 2009年4月25日  
基金管理人 鹏华基金管理有限公司  
基金托管人 中国工商银行股份有限公司

报告期末基金资产总额 \$1,116,895,456.35元

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 2009年07月18日

注:本基金在交易所行情系统净值提示及其他信息显示场合下,可简称为“鹏华治理”。

**2.2 基金产品说明**

投资目标 投资于具有相对完善的公司治理结构和良好成长性的优质上市公司，为基金份额持有人谋求长期、稳定的资本增值。

投资策略 ①股票投资策略：本基金采取“自上而下的”资产配置和“自下而上”的选股策略相结合的二级投资管理策略。整体资产配置主要根据宏观经济、政策环境及行业发展趋势不同特点等决定股票投资比例。行业配置分析、流动性和估值等方法来评估个券的投资价值。

②债券投资策略：本基金的债券类资产采用久期控制下的主动投资策略，本着风险收益匹配最优、兼顾流动性的原则确定债券类资产的配置比例。在个券选择上，本基金综合运用利率差价、收益率曲线估值、信用利差分析、流动性评估等方法来评估个券的投资价值。

③权证投资策略：本基金将权证操作作为辅助性投资工具，其投资原则为有利于基金资产增值，有利于加强基金的风险控制。

沪深300指数收益率×75%+中证综合债指指数收益率×25%

本基金属于股票型基金。其预期的风险和收益高于货币型基金、债券基金、混合型基金，为证券投资基金中具有较高风险、较高收益的投资品种。

**2.3 基金管理人和基金托管人**

项目 基金托管人

名称 鹏华基金管理有限公司

姓名 张文

信息披露负责人 联系电话 0755-8282570

电子邮箱 zhangge@phfund.com.cn

客户服务电话 4006788999

传真 0755-82021126

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 http://www.phfund.com.cn

深圳市福田区福华一路168号深圳国际商会中心第43层鹏华基金管理有限公司

北京市西城区复兴门内大街55号中国工商银行股份有限公司

**§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况**

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 -473,546,101.62 -257,856,712.11 201,528,082.46

本期利润 210,494,129.29 -1,266,814,457.59 -543,887,046.18

加权平均基金份额本期利润 0.0395 -0.2160 -0.0788

本期基金份额净值增长率 4.65% -21.70% -5.57%

3.1.2 期末数据和指标 2012年末 2011年末

期末可供分配基金份额利润 -0.1677 -0.2051 0.0447

基金期末净资产收益率 4,258,837,051.04 4,609,657,294.55 6,410,195,927.66

基金份额净值 0.832 0.795 1.045

注:①本基金在每季度第一个自然日对收入、应收股息、其他收入、不含公允价值变动收益)和除相关费用后的余额，本报告期内未发生增加或减少公允价值变动收益的情况；②本基金所持证券不包括认购或交收交易基金的现金费用(例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等)，计入费用时应以实际盈亏为准；③所列数字。

④表中“本期”指报告期自1月1日至12月31日，无论该日是否为开放日或交易日的交易日。

⑤表中“本报告期”指报告期自1月1日至12月31日。

⑥表中“过去一年”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑦表中“过去三年”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑧表中“过去五年”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑨表中“过去十年”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑩表中“过去15个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑪表中“过去20个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑫表中“过去30个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑬表中“过去60个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑭表中“过去90个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑮表中“过去180个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑯表中“过去360个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑰表中“过去720个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑱表中“过去1440个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑲表中“过去2880个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑳表中“过去5600个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑳表中“过去11200个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑳表中“过去22400个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑳表中“过去44800个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑳表中“过去89600个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑳表中“过去179200个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑳表中“过去358400个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑳表中“过去716800个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑳表中“过去1433600个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑳表中“过去2867200个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑳表中“过去5734400个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑳表中“过去11468800个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑳表中“过去2293600个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑳表中“过去4587200个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑳表中“过去914400个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑳表中“过去1828800个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑳表中“过去3657600个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑳表中“过去731520个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑳表中“过去1463020个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑳表中“过去2926400个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑳表中“过去5855200个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑳表中“过去11710400个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑳表中“过去2342200个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑳表中“过去4684400个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑳表中“过去9359200个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑳表中“过去1872800个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑳表中“过去3745600个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑳表中“过去7491200个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑳表中“过去14982400个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑳表中“过去29964800个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑳表中“过去59889600个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑳表中“过去11971608个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑳表中“过去23922400个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑳表中“过去47844800个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑳表中“过去951160个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑳表中“过去19025740个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑳表中“过去3885520个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑳表中“过去7770924个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑳表中“过去15544800个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑳表中“过去31089600个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑳表中“过去62166800个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑳表中“过去1244492334个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑳表中“过去23527235514个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑳表中“过去4600300个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑳表中“过去212415836116个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑳表中“过去4600948个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑳表中“过去2839026765个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑳表中“过去1811976635个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑳表中“过去25765315167个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑳表中“过去2565968504个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑳表中“过去349165216592个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑳表中“过去31920818481个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑳表中“过去3088182495个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑳表中“过去29037284462个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑳表中“过去221197692057个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑳表中“过去513004255625个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑳表中“过去212415836116个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑳表中“过去147379116592个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑳表中“过去21632245243个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑳表中“过去12632245243个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑳表中“过去1420836213个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑳表中“过去2144492334个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑳表中“过去114973138个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑳表中“过去10202369153个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑳表中“过去2181443099个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑳表中“过去2025130436个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑳表中“过去191693203个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑳表中“过去180651477个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑳表中“过去17092548803个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。

⑳表中“过去1620386213个交易日”指报告期自1月1日至去年12月31日。