

## 鹏华价值精选股票型证券投资基金

## [2013]第四季度报告

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  
报告送出日期:2014年1月21日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人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。

基金合同由基金管理人和基金托管人订立，于2014年1月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

基金财产由基金管理人管理，基金托管人保管，由基金管理人按照基金合同的约定运用基金财产进行投资，基金管理人和基金托管人各自履行基金合同规定的职责，其行为受基金合同约束。基金财产独立于基金管理人、基金托管人和代销机构等机构的财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

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、基金合同和基金份额持有人须知。

基金合同自2013年10月1日起至2013年12月31日止。

## §2 基金产品概况

基金简称 鹏华价值精选股票

基金主代码 206012

交易代码 206012

基金运作方式契约型开放式

基金合同生效日 2012年4月16日

报告期末基金份额总额 58,336,656.55份

在监控控制风险并保持良好流动性的前提下，精选具备

估值优势以及良好基本面的上市公司，力争实现超额收

益并长期资本增值。

本基金通过行业轮动、微观经济运行态势、政策环

境、利率走势、证券市场走势及股票市场价格指数的系

统性变化以及未来一段时间内各类资产的波动和预

期收益率进行分析评估，运用定性与相对性结合的手

段，制定债券、现金等大类资产之间的配置比例，调

整投资组合和调整范围。

## 2. 股票投资策略

本基金通过行业轮动、微观经济运行态势、政策环

境、利率走势、证券市场走势及股票市场价格指数的系

统性变化以及未来一段时间内各类资产的波动和预

期收益率进行分析评估，运用定性与相对性结合的手

段，制定债券、现金等大类资产之间的配置比例，调

整投资组合和调整范围。

## 4. 权证产品投资策略

本基金通过行业轮动、微观经济运行态势、政策环

境、利率走势、证券市场走势及股票市场价格指数的系

统性变化以及未来一段时间内各类资产的波动和预

期收益率进行分析评估，运用定性与相对性结合的手

段，制定债券、现金等大类资产之间的配置比例，调

整投资组合和调整范围。

## 5. 债券投资策略

本基金通过行业轮动、微观经济运行态势、政策环

境、利率走势、证券市场走势及股票市场价格指数的系

统性变化以及未来一段时间内各类资产的波动和预

期收益率进行分析评估，运用定性与相对性结合的手

段，制定债券、现金等大类资产之间的配置比例，调

整投资组合和调整范围。

## 6. 其他资产

本基金通过行业轮动、微观经济运行态势、政策环

境、利率走势、证券市场走势及股票市场价格指数的系

统性变化以及未来一段时间内各类资产的波动和预

期收益率进行分析评估，运用定性与相对性结合的手

段，制定债券、现金等大类资产之间的配置比例，调

整投资组合和调整范围。

## 7. 合计

52,450,795.30

占基金资产净值比例(%) 94.07

## 6.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

A 农、林、牧、渔业 - -

B 建筑业 - -

C 制造业 39,048,213.96 70.04

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 8,116,591.34 14.56

E 建筑业 1,075,020.00 1.93

F 交通运输、仓储和邮政业 1,623,630.00 2.91

G 住宿和餐饮业 - -

H 信息传输、软件和信息技术服务业 - -

J 金融业 1,616,840.00 2.90

K 房地产业 970,500.00 1.74

L 租赁和商务服务业 - -

M 科学研究和技术服务业 - -

N 水利、环境和公共设施管理业 - -

O 居民服务、修理和其他服务业 - -

P 教育 - -

Q 卫生和社会工作 - -

R 文化、体育和娱乐业 - -

S 综合 - -

合计 52,450,795.30

占基金资产净值比例(%) 94.07

## 6.4 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股票投资明细

单位:人民币元

序号 股票代码 股票名称 数量(股) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 600072 恒瑞医药 131,044 4,977,051.12 8.93

2 300346 南光光电 132,900 4,824,270.00 8.65

3 600519 贵州茅台 37,000 4,750,060.00 8.52

4 000543 皖能电力 420,000 2,998,800.00 5.38

5 300122 智飞生物 61,692 2,961,216.00 5.31

6 000568 泸州老窖 124,933 2,516,150.62 4.51

7 600027 华电国际 782,967 2,364,560.34 4.24

8 600660 海信电器 174,000 2,007,960.00 3.60

9 600032 白云山 68,200 1,886,412.00 3.38

10 600894 三一重工 139,000 1,670,780.00 3.00

## 6.5 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2013年10月1日 - 2013年12月31日)

1.本期已实现收益 2,103,324.08

2.本期利润 174,274.04

3.期末平均基金份额净值 55,754,524.60

4.期末基金份额净值 55,754,524.60

5.期末基金份额净值 0.956

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)(如,开放式基金的申购赎回费、基金转换费等),计算公式为:本期已实现收益=利息收入+投资收益+其他收入-费用支出;2.本期利润指基金本期已实现收益加上本期已分配的收益;3.期末平均基金份额净值=期末基金净值/期末基金份额总数;4.期末基金份额净值=基金资产净值/基金份额总数;5.期末基金份额净值=基金资产净值/基金份额总数。

注:业经审计。注:2013年10月1日至2013年12月31日,本基金的平均净值增长率为9.05%。

注:业经审计。注:2013年10月1日至2013年12月31日,本基金的平均净值增长率为9.05%。