

鹏华盛世创新股票型证券投资基金(LOF)

2012 第三季度报告

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:2012年10月24日

基金管理人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。

本报告期内基金资产净值未发生变动。

本报告期末基金资产净值 432,052,628.41份

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型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。

本基金的资产配置策略分为两个层次:第一层次为"自上而下"的资产配置策略,第二层次为"自下而上"的选股策略。

业绩比较基准:沪深300指数收益率*75%+中证综合指数收益率*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、债券型基金、混合型基金,为证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。

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

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"鹏华创新"。

3.1 主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2012年7月1日-2012年9月30日)

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。

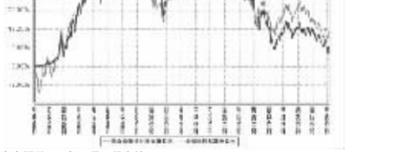
2.所投资基金业绩指标不包括持有买入认购或交易基金的公允价值变动收益、基金转购费(若有),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 本报告期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

Table with 5 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率基准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率基准差④

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率*75%+中证综合指数收益率*25%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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2008年10月10日生效。

2.截至建仓期结束,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。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理期限, 证券从业年限, 说明

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的相关法规规定。

3.2 基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金注册登记机构、中国证监会有关规定以及基金合同的约定,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。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

4.3.2 异常交易行为的专项说明

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

4.4.2 报告期内基金资产净值变动及业绩表现

4.4.3 报告期内基金资产净值变动及业绩表现

4.4.4 报告期内基金资产净值变动及业绩表现

4.4.5 报告期内基金资产净值变动及业绩表现

4.4.6 报告期内基金资产净值变动及业绩表现

4.4.7 报告期内基金资产净值变动及业绩表现

4.4.8 报告期内基金资产净值变动及业绩表现

4.4.9 报告期内基金资产净值变动及业绩表现

4.4.10 报告期内基金资产净值变动及业绩表现

4.4.11 报告期内基金资产净值变动及业绩表现

4.4.12 报告期内基金资产净值变动及业绩表现

4.4.13 报告期内基金资产净值变动及业绩表现

4.4.14 报告期内基金资产净值变动及业绩表现

4.4.15 报告期内基金资产净值变动及业绩表现

4.4.16 报告期内基金资产净值变动及业绩表现

4.4.17 报告期内基金资产净值变动及业绩表现

4.4.18 报告期内基金资产净值变动及业绩表现

4.4.19 报告期内基金资产净值变动及业绩表现

4.4.20 报告期内基金资产净值变动及业绩表现

4.4.21 报告期内基金资产净值变动及业绩表现

4.4.22 报告期内基金资产净值变动及业绩表现

4.4.23 报告期内基金资产净值变动及业绩表现

4.4.24 报告期内基金资产净值变动及业绩表现

4.4.25 报告期内基金资产净值变动及业绩表现

4.4.26 报告期内基金资产净值变动及业绩表现

4.4.27 报告期内基金资产净值变动及业绩表现

4.4.28 报告期内基金资产净值变动及业绩表现

4.4.29 报告期内基金资产净值变动及业绩表现

4.4.30 报告期内基金资产净值变动及业绩表现

4.4.31 报告期内基金资产净值变动及业绩表现

4.4.32 报告期内基金资产净值变动及业绩表现

4.4.33 报告期内基金资产净值变动及业绩表现

4.4.34 报告期内基金资产净值变动及业绩表现

4.4.35 报告期内基金资产净值变动及业绩表现

4.4.36 报告期内基金资产净值变动及业绩表现

注:1.鹏华美国房地产证券投资基金自2011年11月25日生效,截至报告日本基金合同

鹏华美国房地产证券投资基金

季度内,我们对市场预期调整的估计不足,受地产等大幅下跌拖累,影响了组合的表现。

4.4.2 报告期内基金的投资策略和业绩表现

报告期内,本基金净值增长率为-6.63%,同期上证综指下跌6.26%,深圳成指下跌8.64%,沪深300指数下跌6.58%。

4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

尽管实体经济起色不大,结构转型任重道远,但股票市场的整体估值水平已经有所体现,部分蓝筹公司的估值已经具备一定的吸引力,因此我们对A股市场也不过分悲观。

4.6 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.3 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

Table with 5 columns: 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(%)

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

5.6 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资产支持证券投资明细

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 本基金投资的前十名证券中本期没有发行主体被监管部门立案调查的,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

5.8.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.8.3 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.5 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.8.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.7 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.8 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.9 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.10 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.11 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.12 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.13 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.14 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.15 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.16 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.17 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.18 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.19 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.20 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.21 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.22 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.23 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.24 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.25 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.26 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.27 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.28 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.29 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.30 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.31 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.32 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.33 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.34 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.35 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.36 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.37 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.38 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.39 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.40 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.41 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.42 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.43 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.44 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.45 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.46 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.47 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.48 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.49 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.50 投资组合报告附注的其他文字描述部分

鹏华精选成长股票型证券投资基金

2012 第三季度报告

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:2012年10月24日

基金管理人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。

本报告期内基金资产净值未发生变动。

本报告期末基金资产净值 1,151,598,919.52份

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型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。

本基金的资产配置策略分为两个层次:第一层次为"自上而下"的资产配置策略,第二层次为"自下而上"的选股策略。

业绩比较基准:沪深300指数收益率*80%+中证综合指数收益率*20%

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、债券型基金、混合型基金,为证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。

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

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"鹏华精选"。

3.1 主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2012年7月1日-2012年9月30日)

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。

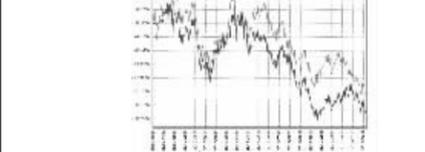
2.所投资基金业绩指标不包括持有买入认购或交易基金的公允价值变动收益、基金转购费(若有),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 本报告期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

Table with 5 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率基准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率基准差④

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率*80%+中证综合指数收益率*20%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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2009年9月9日生效。

2.截至建仓期结束,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。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理期限, 证券从业年限, 说明

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的相关法规规定。

3.2 基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金注册登记机构、中国证监会有关规定以及基金合同的约定,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。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

4.3.2 异常交易行为的专项说明

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

4.4.2 报告期内基金资产净值变动及业绩表现

4.4.3 报告期内基金资产净值变动及业绩表现

4.4.4 报告期内基金资产净值变动及业绩表现

4.4.5 报告期内基金资产净值变动及业绩表现

4.4.6 报告期内基金资产净值变动及业绩表现

4.4.7 报告期内基金资产净值变动及业绩表现

4.4.8 报告期内基金资产净值变动及业绩表现

4.4.9 报告期内基金资产净值变动及业绩表现

4.4.10 报告期内基金资产净值变动及业绩表现

4.4.11 报告期内基金资产净值变动及业绩表现

4.4.12 报告期内基金资产净值变动及业绩表现

4.4.13 报告期内基金资产净值变动及业绩表现

4.4.14 报告期内基金资产净值变动及业绩表现

4.4.15 报告期内基金资产净值变动及业绩表现

4.4.16 报告期内基金资产净值变动及业绩表现

4.4.17 报告期内基金资产净值变动及业绩表现

4.4.18 报告期内基金资产净值变动及业绩表现

4.4.19 报告期内基金资产净值变动及业绩表现

4.4.20 报告期内基金资产净值变动及业绩表现

4.4.21 报告期内基金资产净值变动及业绩表现

4.4.22 报告期内基金资产净值变动及业绩表现

4.4.23 报告期内基金资产净值变动及业绩表现

4.4.24 报告期内基金资产净值变动及业绩表现

4.4.25 报告期内基金资产净值变动及业绩表现

4.4.26 报告期内基金资产净值变动及业绩表现

4.4.27 报告期内基金资产净值变动及业绩表现

4.4.28 报告期内基金资产净值变动及业绩表现

4.4.29 报告期内基金资产净值变动及业绩表现

4.4.30 报告期内基金资产净值变动及业绩表现

4.4.31 报告期内基金资产净值变动及业绩表现

4.4.32 报告期内基金资产净值变动及业绩表现

4.4.33 报告期内基金资产净值变动及业绩表现

4.4.34 报告期内基金资产净值变动及业绩表现

4.4.35 报告期内基金资产净值变动及业绩表现

4.4.36 报告期内基金资产净值变动及业绩表现

鹏华精选成长股票型证券投资基金

季度内,我们对市场预期调整的估计不足,受地产等大幅下跌拖累,影响了组合的表现。

4.4.2 报告期内基金的投资策略和业绩表现

报告期内,本基金净值增长率为-5.53%,同期上证综指下跌6.26%,深圳成指下跌8.64%,沪深300指数下跌6.58%。

4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

尽管实体经济起色不大,结构转型任重道远,但股票市场的整体估值水平已经有所体现,部分蓝筹公司的估值已经具备一定的吸引力,因此我们对A股市场也不过分悲观。

4.6 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.3 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

Table with 5 columns: 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(%)

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

5.6 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资产支持证券投资明细

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 本基金投资的前十名证券中本期没有发行主体被监管部门立案调查的,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

5.8.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.8.3 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.5 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.8.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.7 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.8 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.9 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.10 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.11