

## 鹏华美国房地产证券投资基金

## [2012]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:2013年1月22日

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。  
基金托管人中国建设银行股份有限公司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。

基金合同约定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。

报告期中财务数据未经审计。

报告期自2012年10月1日起至12月31日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称 鹏华美国房地产( QDII)

基金主代码 206011

交易代码 206011

基金运作方式 约定型开放式

基金合同生效日 2011年11月25日

报告期末基金份额总额 72,111,309.24份

投资目标 主要投资于美国上市交易的房地产信托凭证,投资于房地产行业上市公司股票,以获取稳健收益和资本增值为目标,为投资者提供一类有效的分散组合的房地产类金融理财产品。

投资策略 本基金主要通过自上而下地甄选在美国上市交易的REITs、REIT ETF和房地产行业股票,在有效分散风险的基础上,提高基金资产的收益。

本基金采用多渠道策略,采取自上而下的资产配置和自下而上的证券选择相结合的方法进行投资管理。

基金经理的投资不作为本基金的主要投资品种,仅用于适当规避风险及与其他相关风险的对冲。

业绩比较基准 人民币计价的MSCI美国REIT净总收益指数(MSCI US REIT Net Daily Total Return Index)

风险收益特征 本基金为股票型基金,主要投资于在美国上市交易的REITs、REIT ETF和房地产行业股票,在有效分散投资风险的基础上,为投资者提供一类有效的分散组合的房地产类金融理财产品。

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

境外投资顾问 无

境外资产托管人 英文名称:State Street Bank and Trust Company  
中文名称:洲际银行

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2012年10月1日-2012年12月31日) 490,475.59

1.本期已实现收益 1,032,560.22

2.本期利润 0.0138

3.加权平均基金份额本期利润 74,804,564.13

4.期末基金份额净值 1.037

5.期末可供分配基金份额利润 0.0000

注:本基金于2011年11月25日生效。

2、截至基金合同,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 管理人报告

4.1 基金经理或基金经理小组简介

姓名 职务 任职日期 离任日期 说明

裘楠 本基金基金经理 2011年11月25日 - 8 裴柏生,国籍中国,CFA,理学硕士,8年证券投资经验,历任美国运通公司研究员,美国哥伦比亚管理公司(原美国河源投资有限公司)基金经理,2010年2月加盟鹏华基金管理有限公司,任债券基金经理,2011年1月起兼任鹏华美国房地产证券投资基金基金经理,现时担任国际业务部副总经理,裴柏生具备基金经理从业资格。本基金报告期内本基金基金经理未发生变动。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要人员简介

4.3 报告期内本基金运作情况说明

本基金报告期内运作情况正常,严格遵守法律法规、中国证监会的有关规定以及基金合同约定,本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋取最大利益。本基金报告期内,本基金运作合规,不存在违反基金合同和损害基金份额持有人利益的行为。

4.4 公平交易专项说明

4.4.1 公平交易执行的情况

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。

4.4.2 异常交易行为的专项说明

报告期内,本基金未发现存在利用本基金对个股进行影响交易、利益输送、内幕交易、市场操纵等异常交易行为。

4.5 报告期内基金的证券投资情况说明

由于四舍五入的原因,投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

4.5.1 报告期内基金投资组合情况

4.5.2 报告期内基金投资组合的前十名股票

4.5.3 报告期内基金投资组合的前十名债券

4.5.4 报告期内基金投资组合的前十名贵金属

4.5.5 报告期内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组合

4.5.6 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

4.5.7 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资组合

4.5.8 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

4.5.9 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资组合

4.5.10 投资组合报告附注

4.5.11 报告期内基金投资组合的前十名股票

4.5.12 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股票库。

注:1、本基金于2011年11月25日生效。

2、截至基金合同,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。

§ 5 管理人报告

5.1 基金管理人基本情况

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:2013年1月22日

§ 6 管理人报告

6.1 管理人基本情况

姓名 职务 任职日期 离任日期 说明

裘楠 本基金基金经理 2011年11月25日 - 8 裴柏生,国籍中国,CFA,理学硕士,8年证券投资经验,历任美国运通公司研究员,美国哥伦比亚管理公司(原美国河源投资有限公司)基金经理,2010年2月加盟鹏华基金管理有限公司,任债券基金经理,2011年1月起兼任鹏华美国房地产证券投资基金基金经理,现时担任国际业务部副总经理,裴柏生具备基金经理从业资格。本基金报告期内本基金基金经理未发生变动。

6.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要人员简介

6.3 报告期内本基金运作情况说明

本基金报告期内运作情况正常,严格遵守法律法规、中国证监会的有关规定以及基金合同约定,本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋取最大利益。本基金报告期内,本基金运作合规,不存在违反基金合同和损害基金份额持有人利益的行为。

6.4 公平交易专项说明

6.4.1 公平交易执行的情况

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。

6.4.2 异常交易行为的专项说明

报告期内,本基金未发现存在利用本基金对个股进行影响交易、利益输送、内幕交易、市场操纵等异常交易行为。

6.5 报告期内基金的证券投资情况说明

由于四舍五入的原因,投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

6.5.1 报告期内基金投资组合情况

6.5.2 报告期内基金投资组合的前十名股票

6.5.3 报告期内基金投资组合的前十名债券

6.5.4 报告期内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组合

6.5.5 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

6.5.6 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资组合

6.5.7 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名金融衍生品投资明细

6.5.8 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资组合

6.5.9 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资组合

6.5.10 投资组合报告附注

6.5.11 报告期内基金投资组合的前十名股票

6.5.12 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股票库。

注:1、本基金于2011年11月25日生效。

2、截至基金合同,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。

§ 7 备查文件目录

7.1 各查文件目录:

7.1.1 鹏华美国房地产证券投资基金基金合同;

7.1.2 鹏华美国房地产证券投资基金托管协议;

7.1.3 鹏华美国房地产证券投资基金2012年第四季度报告(原文)。

7.2 备查文件目录:

7.2.1 深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心43层鹏华基金管理有限公司。

7.2.2 北京市西城区阜成门大街1号1号楼中国建设银行股份有限公司。

7.2.3 7.3.1 深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心43层鹏华基金管理有限公司。

7.3.2 投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件,或通过本基金管理人网站http://www.phfund.com.cn查阅。

7.3.3 投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人鹏华基金管理有限公司,本公司已开通客户服务系统,咨询电话:4006788999。

7.3.4 投资者在营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件,或通过本基金管理人网站

7.3.5 投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人鹏华基金管理有限公司,本公司已开通客户服务系统,咨询电话:4006788999。

7.4.1 报告期内基金的业绩表现

7.4.2 报告期内基金的利润分配情况

7.4.3 报告期内基金的费用情况

7.4.4 报告期内基金的税收情况

7.4.5 报告期内基金的关联交易

7.4.6 报告期内基金的其他重大事项

7.4.7 报告期内基金的其他重大事项

7.4.8 报告期内基金的其他重大事项

7.4.9 报告期内基金的其他重大事项

7.4.10 报告期内基金的其他重大事项

7.4.11 报告期内基金的其他重大事项

7.4.12 报告期内基金的其他重大事项

7.4.13 报告期内基金的其他重大事项

7.4.14 报告期内基金的其他重大事项

7.4.15 报告期内基金的其他重大事项

7.4.16 报告期内基金的其他重大事项

7.4.17 报告期内基金的其他重大事项

7.4.18 报告期内基金的其他重大事项

7.4.19 报告期内基金的其他重大事项

7.4.20 报告期内基金的其他重大事项

7.4.21 报告期内基金的其他重大事项

7.4.22 报告期内基金的其他重大事项

7.4.23 报告期内基金的其他重大事项

7.4.24 报告期内基金的其他重大事项

7.4.25 报告期内基金的其他重大事项

7.4.26 报告期内基金的其他重大事项

7.4.27 报告期内基金的其他重大事项

7.4.28 报告期内基金的其他重大事项

7.4.29 报告期内基金的其他重大事项

7.4.30 报告期内基金的其他重大事项

7.4.31 报告期内基金的其他重大事项

7.4.32 报告期内基金的其他重大事项

7.4.33 报告期内基金的其他重大事项

7.4.34 报告期内基金的其他重大事项

7.4.35 报告期内基金的其他重大