

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：中国工商银行股份有限公司
报告送出日期：2013年1月22日

基金管理人、基金托管人及基金销售机构不存在虚假记载、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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013年1月17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。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。

本报告期财务报表未经审计。
本报告期自2012年10月1日起至12月31日止。

2.1 基金基本情况
基金简称：鹏华美国房地产(ODI)
基金代码：206011
交易代码：206011
基金运作方式：契约型开放式
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

主要投资于美国上市交易的房地产信托凭证，投资于房地产信托凭证的交易为开放式指数基金以及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，为投资者提供一类可有效分散组合风险的地产类基金。

投资策略
注：本基金主要通过自下而上地筛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。
本基金采用多重投资策略，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，衍生品投资不作为本基金的主要投资品种，仅用于适当规避外汇风险及其他相关风险之目的。

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，在证券投资基金中属于较高预期风险和预期收益的基金品种。

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

境外投资顾问：无
境外投资托管人：无

3.1 主要财务指标
单位：人民币元

主要财务指标
1.本期已实现收益 490,475.59
2.本期利润 1,032,560.22
3.加权平均基金份额本期利润 0.0138
4.期末基金资产净值 74,804,564.13
5.期末基金份额净值 1.037

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.截至本报告期末本基金资产配置符合基金合同规定的投资比例。

3.2 基金净值表现
3.2.1 本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较
阶段 净值增长率① 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 1.57% 1.28% 0.65% 0.29% -0.07%

注：1.本基金合同于2011年11月25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
姓名 职务 任职日期 离任日期 从业年限 说明
袁耀先生，国籍中国，CFA、理学硕士，8年证券从业经验，历任美国国际资产管理公司(原美国国际资产管理公司)基金经理，2010年2月加盟鹏华基金管理有限公司，任资产管理部副经理，2010年10月至今担任国际环球投资证券投资基金基金经理，2011年11月起兼任鹏华美国房地产证券投资基金基金经理，现同时担任国际业务部副经理，负责衍生品具备基金从业资格的基金管理人，本基金运作合规，不存在违反基金合同和投资基金合同约定利益的行为。

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规定的办法的相关规定。
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

4.3 报告期内基金投资策略和业绩表现说明
报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规、中国证监会的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。本报告期内，本基金运作合规，不存在违反基金合同和投资基金合同约定利益的行为。

4.4 公平交易专项说明
4.4.1 公平交易制度的执行情况
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、分配等各个环节得到公平对待。

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规、中国证监会的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。本报告期内，本基金运作合规，不存在违反基金合同和投资基金合同约定利益的行为。

4.6 公平交易专项说明
4.6.1 公平交易制度的执行情况
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、分配等各个环节得到公平对待。

4.7 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规、中国证监会的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。本报告期内，本基金运作合规，不存在违反基金合同和投资基金合同约定利益的行为。

4.8 公平交易专项说明
4.8.1 公平交易制度的执行情况
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、分配等各个环节得到公平对待。

4.9 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规、中国证监会的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。本报告期内，本基金运作合规，不存在违反基金合同和投资基金合同约定利益的行为。

4.10 公平交易专项说明
4.10.1 公平交易制度的执行情况
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、分配等各个环节得到公平对待。

4.11 公平交易专项说明
4.11.1 公平交易制度的执行情况
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、分配等各个环节得到公平对待。

4.12 公平交易专项说明
4.12.1 公平交易制度的执行情况
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、分配等各个环节得到公平对待。

4.13 公平交易专项说明
4.13.1 公平交易制度的执行情况
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、分配等各个环节得到公平对待。

4.14 公平交易专项说明
4.14.1 公平交易制度的执行情况
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、分配等各个环节得到公平对待。

4.15 公平交易专项说明
4.15.1 公平交易制度的执行情况
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、分配等各个环节得到公平对待。

4.16 公平交易专项说明
4.16.1 公平交易制度的执行情况
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、分配等各个环节得到公平对待。

4.17 公平交易专项说明
4.17.1 公平交易制度的执行情况
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、分配等各个环节得到公平对待。

4.18 公平交易专项说明
4.18.1 公平交易制度的执行情况
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、分配等各个环节得到公平对待。

4.19 公平交易专项说明
4.19.1 公平交易制度的执行情况
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、分配等各个环节得到公平对待。

4.20 公平交易专项说明
4.20.1 公平交易制度的执行情况
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、分配等各个环节得到公平对待。

4.21 公平交易专项说明
4.21.1 公平交易制度的执行情况
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、分配等各个环节得到公平对待。

4.22 公平交易专项说明
4.22.1 公平交易制度的执行情况
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、分配等各个环节得到公平对待。

4.23 公平交易专项说明
4.23.1 公平交易制度的执行情况
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、分配等各个环节得到公平对待。

4.24 公平交易专项说明
4.24.1 公平交易制度的执行情况
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、分配等各个环节得到公平对待。

4.25 公平交易专项说明
4.25.1 公平交易制度的执行情况
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、分配等各个环节得到公平对待。

4.26 公平交易专项说明
4.26.1 公平交易制度的执行情况
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、分配等各个环节得到公平对待。

4.27 公平交易专项说明
4.27.1 公平交易制度的执行情况
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、分配等各个环节得到公平对待。

4.28 公平交易专项说明
4.28.1 公平交易制度的执行情况
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、分配等各个环节得到公平对待。

4.29 公平交易专项说明
4.29.1 公平交易制度的执行情况
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、分配等各个环节得到公平对待。

4.30 公平交易专项说明
4.30.1 公平交易制度的执行情况
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、分配等各个环节得到公平对待。

4.31 公平交易专项说明
4.31.1 公平交易制度的执行情况
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、分配等各个环节得到公平对待。

4.32 公平交易专项说明
4.32.1 公平交易制度的执行情况
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、分配等各个环节得到公平对待。

4.33 公平交易专项说明
4.33.1 公平交易制度的执行情况
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、分配等各个环节得到公平对待。

鹏华盛世创新股票型证券投资基金(LOF)

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、基金托管人及基金销售机构不存在虚假记载、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根据本基金合同规定，于2013年1月17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。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。

本报告期财务报表未经审计。
本报告期自2012年10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
报告期末基金份额总额：428,030,184.98份

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，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。

投资策略
注：本基金的资产配置分为两个层次，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。在充分分散投资风险的基础上，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。

业绩比较基准
沪深300指数收益率×75%+中证综合债指数收益率×25%

风险收益特征
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，可简称为“鹏华创新”。

3.1 主要财务指标
单位：人民币元

主要财务指标
1.本期已实现收益 -5,105,372.07
2.本期利润 51,352,021.97
3.加权平均基金份额本期利润 0.1193
4.期末基金资产净值 509,200,301.65
5.期末基金份额净值 1.190

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.截至本报告期末本基金资产配置符合基金合同规定的投资比例。

3.2 基金净值表现
3.2.1 本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较
阶段 净值增长率① 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%

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
姓名 职务 任职日期 离任日期 从业年限 说明
伍旋先生，国籍中国，北京大学工商管理硕士，6年证券从业经验，曾任招商局集团、鹏华基金管理有限公司、从事研究部高级研究员、基金助理助理，2011年12月起至今担任鹏华盛世创新股票型证券投资基金(LOF)基金经理，伍旋先生具备基金从业资格，本报告期内本基金基金运作合规，不存在违反基金合同和投资基金合同约定利益的行为。

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规定的办法的相关规定。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介
报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规、中国证监会的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。本报告期内，本基金运作合规，不存在违反基金合同和投资基金合同约定利益的行为。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
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、分配等各个环节得到公平对待。

4.4 公平交易专项说明
4.4.1 公平交易制度的执行情况
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、分配等各个环节得到公平对待。

4.5 公平交易专项说明
4.5.1 公平交易制度的执行情况
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、分配等各个环节得到公平对待。

4.6 公平交易专项说明
4.6.1 公平交易制度的执行情况
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、分配等各个环节得到公平对待。

4.7 公平交易专项说明
4.7.1 公平交易制度的执行情况
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、分配等各个环节得到公平对待。

4.8 公平交易专项说明
4.8.1 公平交易制度的执行情况
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、分配等各个环节得到公平对待。

4.9 公平交易专项说明
4.9.1 公平交易制度的执行情况
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、分配等各个环节得到公平对待。

4.10 公平交易专项说明
4.10.1 公平交易制度的执行情况
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、分配等各个环节得到公平对待。

4.11 公平交易专项说明
4.11.1 公平交易制度的执行情况
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、分配等各个环节得到公平对待。

4.12 公平交易专项说明
4.12.1 公平交易制度的执行情况
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、分配等各个环节得到公平对待。

4.13 公平交易专项说明
4.13.1 公平交易制度的执行情况
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、分配等各个环节得到公平对待。

4.14 公平交易专项说明
4.14.1 公平交易制度的执行情况
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、分配等各个环节得到公平对待。

4.15 公平交易专项说明
4.15.1 公平交易制度的执行情况
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、分配等各个环节得到公平对待。

4.16 公平交易专项说明
4.16.1 公平交易制度的执行情况
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、分配等各个环节得到公平对待。

4.17 公平交易专项说明
4.17.1 公平交易制度的执行情况
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、分配等各个环节得到公平对待。

4.18 公平交易专项说明
4.18.1 公平交易制度的执行情况
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、分配等各个环节得到公平对待。

4.19 公平交易专项说明
4.19.1 公平交易制度的执行情况
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、分配等各个环节得到公平对待。

4.20 公平交易专项说明
4.20.1 公平交易制度的执行情况
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、分配等各个环节得到公平对待。

4.21 公平交易专项说明
4.21.1 公平交易制度的执行情况
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、分配等各个环节得到公平对待。

4.22 公平交易专项说明
4.22.1 公平交易制度的执行情况
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、分配等各个环节得到公平对待。

4.23 公平交易专项说明
4.23.1 公平交易制度的执行情况
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、分配等各个环节得到公平对待。

4.24 公平交易专项说明
4.24.1 公平交易制度的执行情况
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、分配等各个环节得到公平对待。

4.25 公平交易专项说明
4.25.1 公平交易制度的执行情况
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、分配等各个环节得到公平对待。

4.26 公平交易专项说明
4.26.1 公平交易制度的执行情况
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、分配等各个环节得到公平对待。

4.27 公平交易专项说明
4.27.1 公平交易制度的执行情况
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、分配等各个环节得到公平对待。

4.28 公平交易专项说明
4.28.1 公平交易制度的执行情况
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、分配等各个环节得到公平对待。

4.29 公平交易专项说明
4.29.1 公平交易制度的执行情况
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、分配等各个环节得到公平对待。

4.30 公平交易专项说明
4.30.1 公平交易制度的执行情况
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、分配等各个环节得到公平对待。

4.31 公平交易专项说明
4.31.1 公平交易制度的执行情况
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、分配等各个环节得到公平对待。

4.32 公平交易专项说明
4.32.1 公平交易制度的执行情况
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、分配等各个环节得到公平对待。

报告期内，本基金净值增长率为11.21%，同期上证综指上涨8.77%，深圳成指上涨5.04%，沪深300指数上涨10.02%。

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，我们认为实体经济筑底回升的态势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4季度的大涨，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，选择具备较好竞争优势和增长潜力的上市公司，适时调整组合的持仓结构。

5.1 报告期末基金资产组合情况
序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)
1 权益投资 464,522,255.18 90.81
其中：股票 464,522,255.18 90.81
2 固定收益投资 - -
其中：债券 - -
资产支持证券 - -
3 金融衍生品投资 - -
4 买入返售金融资产 - -
其中：买断式回购的买入返售金融资产 - -
5 银行存款和结算备付金合计 41,994,473.50 8.21
6 其他资产 4,988,373.40 0.98
7 合计 511,505,102.08 100.00

5.2 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 采矿业 - -
C 制造业 204,550,308.34 40.17
D 电力、热力、燃气及水的生产和供应业 19,112,377.92 3.75
E 建筑业 - -
F 交通运输、仓储业 - -
G 信息技术业 11,690,528.64 2.30
H 批发和零售业 14,354,320.00 2.82
I 金融、保险业 140,679,912.96 27.63
J 房地产业 48,141,498.38 9.45
K 社会服务业 28,899,126.42 5.68
L 传播与文化业 10,519,090.08 2.07
M 综合类 - -
合计 464,522,255.18 91.23

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
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 601166 兴业银行 1,708,103 28,508,239.07 5.60
2 600000 浦发银行 2,470,000 24,502,400.00 4.81
3 600014 上汽集团 1,258,901 22,207,017.64 4.36
4 000069 华侨城A 2,514,377 18,857,827.50 3.70
5 601628 中国人寿 879,925 18,830,395.00 3.70
6 600383 海澜之家 2,443,306 17,152,008.12 3.37
7 600016 民生银行 2,179,036 17,127,222.96 3.36
8 600086 青岛海尔 1,272,684 17,053,965.60 3.35
9 600595 海螺水泥 896,393 16,538,450.85 3.25
10 600030 中信证券 1,210,000 16,165,600.00 3.17

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
本基金本报告期末未持有债券。

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
本基金本报告期末未持有债券。

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
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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
本基金本报告期末未持有权证。

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
序号 名称 金额(元)
1 存出保证金 250,000.00
2 应收证券清算款 4,616,024.78
3 应收股利 -
4 应收利息 13,429.77
5 应收申购款 108,918.85
6 其他应收款 -
7 待摊费用 -
8 其他 -
9 合计 4,988,373.40

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.8.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分
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。

5.9 开放式基金份额变动
单位：份
本报告期初基金份额总额 432,052,628.41
本报告期基金总申购份额 3,962,162.51
减：本报告期基金总赎回份额 7,984,605.94
本报告期基金拆分变动份额 -
本报告期末基金份额总额 428,030,184.98

7.1 备查文件目录
(一) 鹏华盛世创新股票型证券投资基金(LOF)基金合同；
(二) 鹏华盛世创新股票型证券投资基金(LOF)托管协议；
(三) 鹏华盛世创新股票型证券投资基金(LOF)2012年度第4季度报告(原文)。

7.2 存放地点
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。
北京市西城区南大街1号1号楼中国建设银行股份有限公司。

7.3 查阅方式
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.pfund.com.cn查询。

投资者对本报告如有疑问，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热线，咨询电话：4006788999。

鹏华基金管理有限公司
2013年1月22日

本报告期末基金资产组合情况
序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)
1 权益投资 557,985,703.75 88.03
其中：股票 557,985,703.75 88.03
2 固定收益投资 - -
其中：债券 - -
资产支持证券 - -
3 金融衍生品投资 - -
4 买入返售金融资产 - -
其中：买断式回购的买入返售金融资产 - -
5 银行存款和结算备付金合计 74,821,031.53 11.80
6 其他资产 1,032,049.27 0.16
7 合计 633,838,784.55 100.00

5.2 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 采矿业 - -
C 制造业 222,833,215.32 37.05
D 电力、热力、燃气及水的生产和供应业 8,651,775.16 1.44
E 建筑业 - -
F 交通运输、仓储业 19,262,002.50 3.20
G 信息技术业 18,092,093.22 3.01
H 批发和零售业 15,896,499.26 2.63
I 金融、保险业 91,220,374.73 15.17
J 房地产业 27,375,000.00 4.55
K 社会服务业 - -
L 传播与文化业 - -
M 综合类 - -
合计 557,985,703.75 92.77

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
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 601166 兴业银行 2,880,000 48,067,200.00 7.99
2 300168 万达信息 3,134,729 48,053,153.70 7.99
3 601169 北京银行 4,350,000 40,455,000.00 6.73
4 000550 天汽集团 2,231,443 40,121,345.16 6.67
5 000024 招商地产 949,845 28,390,867.05 4.73
6 600104 上汽集团 28,375,227.72 4.72
7 000069 华侨城A 3,650,000 27,375,000.00 4.55
8 600000 浦发银行 2,500,000 24,800,000.00 4.12
9 600418 小天鹅A 2,530,496 23,873,272.32 3.96
10 000016 民生银行 2,900,000 22,794,000.00 3.79

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
本基金本报告期末未持有债券。

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
本基金本报告期末未持有债券。

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
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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
本基金本报告期末未持有权证。

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。