

## 鹏华盛世创新股票型证券投资基金(LOF)

## [2015]第一季度报告

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:2015年4月21日

**§ 1重要提示**  
基金管理人的董事、监事及董事会秘书不存在虚假记载、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2015年4月16日恢复了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核后不存在虚假记载、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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年1月1日起至3月31日止。

**% 基金产品概况**

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	120,657,187.83	60.55	
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-	-
E 建筑业	4,907,472.50	2.46	
F 批发和零售业	7,113,500.00	3.57	
G 交通运输、仓储和邮政业	6,176,800.00	3.10	
H 餐饮业	-	-	-
I 信息传输、软件和信息技术服务业	-	-	-
J 金融业	26,486,590.00	13.29	
K 房地产业	4,545,617.36	2.28	
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	3,860,000.00	1.94	
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	13,887,185.20	6.97	
S 综合	-	-	-
合计	187,634,352.89	94.17	

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年1月1日起至3月31日止。

**% 基金产品概况**

基金简称:鹏华盛世创新股票(LOF)  
场内简称:鹏华创新  
基金主代码:160613  
交易代码:160613  
上市交易场所:上海证券交易所  
基金合同生效日:2008年10月10日  
报告期末基金份额总额:113,212,096.85份

投资目标:精选具有竞争力优势和持续盈利能力的自由现金流企业，通过积极主动的资产配置和严格的风险控制，在有效控制风险的前提下，为基金份额持有人谋取长期、稳定的资本增值。

投资策略:本基金主要投资于具有良好基本面的股票，同时适当配置债券、货币市场工具等固定收益类金融产品，以降低整体组合的波动率，提高组合的稳定性。

业绩比较基准:沪深300指数收益率×75%+银行存款利率(税后)×25%

风险收益特征:本基金属于高风险、高收益品种，适合风险承受能力较强的投资者。

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

**§ 3 主要财务指标**

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2015年1月1日—2015年3月31日)

1.本期实现收益 34,208,798.66

2.本期利润 48,206,878.32

3.加权平均基金份额本期利润 0.3808

4.期末基金资产净值 199,254,828.55

5.期末基金净值 1.760

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.所述营业利润不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等)，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.基金净值=净资产/份额

3.2 基金净值表现

3.2.1 本基金报告期基金份额净值增长率及其同同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长① (%) 净值增长率标准差② (%) 业绩比较基准收益率③ (%) ①-③ (%) ②-④ (%)

过去三个月 28.10% 1.42% 11.26% 1.37% 16.84% 0.05%

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率×75%+银行存款利率(税后)×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

基金合同生效以来至报告期末基金累计净值增长率变动情况

注:基金合同生效以来至报告期末，本基金无净值增长率数据。

3.3 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(2015年1月1日—2015年3月31日)

1.本期实现收益 34,208,798.66

2.本期利润 48,206,878.32

3.加权平均基金份额本期利润 0.3808

4.期末基金资产净值 199,254,828.55

5.期末基金净值 1.760

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.所述营业利润不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等)，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.基金净值=净资产/份额

3.4 管理人报告

3.4.1 基金经理的简介

基金经理:陈立,男,国籍:中国,北京工商大学管理学硕士,9年证券从业经验,曾任鹏华基金管理有限公司助理研究员、高级研究员、基金经理助理,现任鹏华基金管理有限公司基金经理。陈立先生具有良好的职业道德,责任心强,具备丰富的投资管理经验,能够独立判断和分析宏观经济形势,对宏观经济政策有深入理解,并能结合宏观经济形势进行有效的投资决策。

3.4.2 公平交易专项说明

报告期内,本基金未发生不公平交易且对基金财产造成损失的异常交易行为。

报告期内,本基金未发生不公平交易且对基金财产造成损失的关联交易行为。

3.4.3 异常交易行为的专项说明

本基金因经济、证券市场及行业政策的简要展望

报告期内,本基金已经公开披露过基金的运作轨迹,但从A股角度来看继续走强的趋势有望得到延续,短期内,本基金将密切关注宏观经济形势,密切关注政策变化,密切关注行业政策、行业经济形势对股价的影响,寻找买入机会。

3.4.4 投资组合的定期报告

报告期内,本基金未发生定期报告且对基金财产造成损失的异常交易行为。

3.4.5 公开披露的净值表现的说明

本基金的净值表现每日公布一次。

3.4.6 报告期内持有人数或基金份额净值变动情况说明

注:无

**% 投资组合**

5.1 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 002152 广电运通 380,021 14,985,422.57 7.47

2 601099 中信海仓 470,098 10,330,195.20 5.28

3 000146 沪商银行 214,901 8,810,941.00 4.42

4 601788 大秦铁路 285,000 7,951,500.00 3.99

5 600999 中国神华 245,000 7,98,350.00 3.91

6 002664 信能电气 170,000 7,298,100.00 3.66

7 300145 南方航空 250,057 7,216,455.02 3.62

8 600066 申能股份 215,000 6,379,500.00 3.20

9 601006 大秦铁路 560,000 6,176,800.00 3.10

10 600811 中国远洋 262,909 5,352,872.44 2.69

注:1.本基金的过往表现由陈立先生负责管理。

2.截至建仓期结束,本基金的各项投资比例已达基金合同中规定的各项比

3.基金管理人:鹏华基金管理有限公司

4.管理人报告

4.1 公平交易专项说明

报告期内,本基金未发生不公平交易且对基金财产造成损失的关联交易行为。

4.2 偏好交易专项说明

报告期内,本基金未发生偏好交易且对基金财产造成损失的关联交易行为。

4.3 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金未发生不公平交易且对基金财产造成损失的关联交易行为。

4.4 报告期内涉及不公平交易且对基金财产造成损失的关联交易行为的专项说明

报告期内,本基金未发生不公平交易且对基金财产造成损失的关联交易行为。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业政策的简要展望

报告期内,本基金已经公开披露过基金的运作轨迹,从A股角度来看继续走强的趋势有望得到延续,短期内,本基金将密切关注宏观经济形势,密切关注政策变化,密切关注行业政策、行业经济形势对股价的影响,寻找买入机会。

4.6 报告期内涉及不公平交易且对基金财产造成损失的关联交易行为的专项说明

报告期内,本基金未发生不公平交易且对基金财产造成损失的关联交易行为。

4.7 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金未发生不公平交易且对基金财产造成损失的关联交易行为。

4.8 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金未发生不公平交易且对基金财产造成损失的关联交易行为。

4.9 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金未发生不公平交易且对基金财产造成损失的关联交易行为。

4.10 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金未发生不公平交易且对基金财产造成损失的关联交易行为。

4.11 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金未发生不公平交易且对基金财产造成损失的关联交易行为。

4.12 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金未发生不公平交易且对基金财产造成损失的关联交易行为。

4.13 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金未发生不公平交易且对基金财产造成损失的关联交易行为。

4.14 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金未发生不公平交易且对基金财产造成损失的关联交易行为。

4.15 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金未发生不公平交易且对基金财产造成损失的关联交易行为。

4.16 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金未发生不公平交易且对基金财产造成损失的关联交易行为。

4.17 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金未发生不公平交易且对基金财产造成损失的关联交易行为。

4.18 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金未发生不公平交易且对基金财产造成损失的关联交易行为。

4.19 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金未发生不公平交易且对基金财产造成损失的关联交易行为。

4.20 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金未发生不公平交易且对基金财产造成损失的关联交易行为。

4.21 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金未发生不公平交易且对基金财产造成损失的关联交易行为。

4.22 公平交易制度的执行情况