

鹏华优质治理股票型证券投资基金 (LOF)

2010 第四季度报告

2010年12月31日

基金管理人:鹏华基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
报告送出日期:2011年1月22日

重要提示
基金管理人、基金托管人及基金销售机构在本报告期内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。

基金管理人鹏华基金管理有限公司根据本基金合同约定,于2011年1月20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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,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。

本报告自2010年10月1日起至12月31日止。

基金名称:鹏华优质治理股票(LOF)
基金代码:160611
基金运作方式:上市型开放式

基金合同生效日:2007年4月25日
报告期末基金份额总额:6,136,069,786.12份

投资目标:投资于具有相对优势的上市公司,为基金持有人谋求长期、稳定的资本增值。

投资策略:
1. 股票投资策略:本基金采取“自上而下”的资产配置和“自下而上”的选股策略相结合的主动投资管理策略。

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%

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型基金、债券基金、混合型基金,为证券投资基金中较高风险、较高收益的投资品种。

基金管理人:鹏华基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
主要财务指标 报告期(2010年10月1日至2010年12月31日)

1.本期已实现收益 172,053,645.73
2.本期利润 150,286,205.27
3.加权平均基金份额本期利润 0.0235
4.期末基金份额净值 6,410,195,927.66

3.2 本基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准:沪深300指数收益率\*75%+中证综合指数收益率\*25%

3.3 本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
阶段 净值增长率① 净值增长率基准② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率④

过去三个月 1.95% 1.74% 4.65% 1.33% -2.70% 0.41%
注:1.本基金合同于2007年4月25日生效。
2.截至建仓期末,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 基金管理人 基金基金经理小组 简介
姓名 职务 任本基金的基金经理年限 证券从业年限 说明

谢卫 先生,国籍中国,经济学博士,8年证券从业经历,曾任中国证监会基金部处长,现任鹏华基金管理有限公司基金经理,负责鹏华优质治理股票基金的投资管理工作。

4.2 基金托管人 基金托管人 交通银行股份有限公司
4.3 基金销售机构
4.4 基金投资策略
4.5 基金业绩比较基准

5.1 报告期末基金资产组合情况
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
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

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细
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十名资产支持证券投资明细

5.6 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
5.7 报告期末持有的权证投资明细

5.8 报告期末基金资产组合中公允价值占基金资产净值比例前五名的权证投资明细
5.9 报告期末基金资产组合中公允价值占基金资产净值比例前五名的权证投资明细

5.10 报告期末基金资产组合中公允价值占基金资产净值比例前五名的权证投资明细
5.11 报告期末基金资产组合中公允价值占基金资产净值比例前五名的权证投资明细

5.12 报告期末基金资产组合中公允价值占基金资产净值比例前五名的权证投资明细
5.13 报告期末基金资产组合中公允价值占基金资产净值比例前五名的权证投资明细

5.14 报告期末基金资产组合中公允价值占基金资产净值比例前五名的权证投资明细
5.15 报告期末基金资产组合中公允价值占基金资产净值比例前五名的权证投资明细

5.16 报告期末基金资产组合中公允价值占基金资产净值比例前五名的权证投资明细
5.17 报告期末基金资产组合中公允价值占基金资产净值比例前五名的权证投资明细

5.18 报告期末基金资产组合中公允价值占基金资产净值比例前五名的权证投资明细
5.19 报告期末基金资产组合中公允价值占基金资产净值比例前五名的权证投资明细

5.20 报告期末基金资产组合中公允价值占基金资产净值比例前五名的权证投资明细
5.21 报告期末基金资产组合中公允价值占基金资产净值比例前五名的权证投资明细

鹏华中证500指数证券投资基金 (LOF)

2010 第四季度报告

2010年12月31日

基金管理人:鹏华基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
报告送出日期:2011年1月22日

重要提示
基金管理人、基金托管人及基金销售机构在本报告期内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。

基金管理人鹏华基金管理有限公司根据本基金合同约定,于2011年1月20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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,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。

本报告自2010年10月1日起至12月31日止。

基金名称:鹏华中证500指数(LOF)
基金代码:160616
基金运作方式:上市型开放式

基金合同生效日:2010年2月5日
报告期末基金份额总额:1,206,398,882.34份

投资目标:采用指数化投资方式,追求基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间的跟踪误差最小化。

投资策略:本基金采用被动式指数化投资策略,跟踪标的指数的表现,力求跟踪偏离度控制在4%以内。

业绩比较基准:中证500指数收益率\*95%+银行活期存款利率\*5%

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型基金、债券基金、混合型基金,为证券投资基金中较高风险、较高收益的投资品种。

基金管理人:鹏华基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
主要财务指标 报告期(2010年10月1日至2010年12月31日)

1.本期已实现收益 105,052,079.56
2.本期利润 139,727,830.64
3.加权平均基金份额本期利润 0.0942
4.期末基金份额净值 1,240,978,458.72

3.2 本基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准:中证500指数收益率\*95%+银行活期存款利率\*5%

3.3 本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
阶段 净值增长率① 净值增长率基准② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率④

过去三个月 5.43% 1.83% 5.69% 1.84% -0.26% -0.01%
注:1.本基金合同于2010年2月5日生效。
2.截至建仓期末,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 基金管理人 基金基金经理小组 简介
姓名 职务 任本基金的基金经理年限 证券从业年限 说明

方南先生,国籍中国,工商管理硕士,8年证券从业经历,曾任杭州恒生电子股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、鹏华基金管理有限公司,现任鹏华中证500指数证券投资基金基金经理。

4.2 基金托管人 基金托管人 交通银行股份有限公司
4.3 基金销售机构
4.4 基金投资策略
4.5 基金业绩比较基准

5.1 报告期末基金资产组合情况
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
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

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细
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十名资产支持证券投资明细

5.6 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
5.7 报告期末持有的权证投资明细

5.8 报告期末基金资产组合中公允价值占基金资产净值比例前五名的权证投资明细
5.9 报告期末基金资产组合中公允价值占基金资产净值比例前五名的权证投资明细

5.10 报告期末基金资产组合中公允价值占基金资产净值比例前五名的权证投资明细
5.11 报告期末基金资产组合中公允价值占基金资产净值比例前五名的权证投资明细

5.12 报告期末基金资产组合中公允价值占基金资产净值比例前五名的权证投资明细
5.13 报告期末基金资产组合中公允价值占基金资产净值比例前五名的权证投资明细

5.14 报告期末基金资产组合中公允价值占基金资产净值比例前五名的权证投资明细
5.15 报告期末基金资产组合中公允价值占基金资产净值比例前五名的权证投资明细

5.16 报告期末基金资产组合中公允价值占基金资产净值比例前五名的权证投资明细
5.17 报告期末基金资产组合中公允价值占基金资产净值比例前五名的权证投资明细

5.18 报告期末基金资产组合中公允价值占基金资产净值比例前五名的权证投资明细
5.19 报告期末基金资产组合中公允价值占基金资产净值比例前五名的权证投资明细

5.20 报告期末基金资产组合中公允价值占基金资产净值比例前五名的权证投资明细
5.21 报告期末基金资产组合中公允价值占基金资产净值比例前五名的权证投资明细

鹏华中证500指数证券投资基金 (LOF)

2010 第四季度报告

2010年12月31日

基金管理人:鹏华基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
报告送出日期:2011年1月22日

重要提示
基金管理人、基金托管人及基金销售机构在本报告期内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。

基金管理人鹏华基金管理有限公司根据本基金合同约定,于2011年1月20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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,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。

本报告自2010年10月1日起至12月31日止。

基金名称:鹏华中证500指数(LOF)
基金代码:160616
基金运作方式:上市型开放式

基金合同生效日:2010年2月5日
报告期末基金份额总额:1,206,398,882.34份

投资目标:采用指数化投资方式,追求基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间的跟踪误差最小化。

投资策略:本基金采用被动式指数化投资策略,跟踪标的指数的表现,力求跟踪偏离度控制在4%以内。

业绩比较基准:中证500指数收益率\*95%+银行活期存款利率\*5%

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型基金、债券基金、混合型基金,为证券投资基金中较高风险、较高收益的投资品种。

基金管理人:鹏华基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
主要财务指标 报告期(2010年10月1日至2010年12月31日)

1.本期已实现收益 105,052,079.56
2.本期利润 139,727,830.64
3.加权平均基金份额本期利润 0.0942
4.期末基金份额净值 1,240,978,458.72

3.2 本基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准:中证500指数收益率\*95%+银行活期存款利率\*5%

3.3 本基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率的比较
阶段 净值增长率① 净值增长率基准② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率④

过去三个月 5.43% 1.83% 5.69% 1.84% -0.26% -0.01%
注:1.本基金合同于2010年2月5日生效。
2.截至建仓期末,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 基金管理人 基金基金经理小组 简介
姓名 职务 任本基金的基金经理年限 证券从业年限 说明

方南先生,国籍中国,工商管理硕士,8年证券从业经历,曾任杭州恒生电子股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、鹏华基金管理有限公司,现任鹏华中证500指数证券投资基金基金经理。

4.2 基金托管人 基金托管人 交通银行股份有限公司
4.3 基金销售机构
4.4 基金投资策略
4.5 基金业绩比较基准

5.1 报告期末基金资产组合情况
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
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

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细
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十名资产支持证券投资明细

5.6 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
5.7 报告期末持有的权证投资明细

5.8 报告期末基金资产组合中公允价值占基金资产净值比例前五名的权证投资明细
5.9 报告期末基金资产组合中公允价值占基金资产净值比例前五名的权证投资明细

5.10 报告期末基金资产组合中公允价值占基金资产净值比例前五名的权证投资明细
5.11 报告期末基金资产组合中公允价值占基金资产净值比例前五名的权证投资明细

5.12 报告期末基金资产组合中公允价值占基金资产净值比例前五名的权证投资明细
5.13 报告期末基金资产组合中公允价值占基金资产净值比例前五名的权证投资明细

5.14 报告期末基金资产组合中公允价值占基金资产净值比例前五名的权证投资明细
5.15 报告期末基金资产组合中公允价值占基金资产净值比例前五名的权证投资明细

5.16 报告期末基金资产组合中公允价值占基金资产净值比例前五名的权证投资明细
5.17 报告期末基金资产组合中公允价值占基金资产净值比例前五名的权证投资明细

5.18 报告期末基金资产组合中公允价值占基金资产净值比例前五名的权证投资明细
5.19 报告期末基金资产组合中公允价值占基金资产净值比例前五名的权证投资明细

5.20 报告期末基金资产组合中公允价值占基金资产净值比例前五名的权证投资明细
5.21 报告期末基金资产组合中公允价值占基金资产净值比例前五名的权证投资明细