鹏华盛世创新股票型证券投资基金（LOF）2010年年度报告摘要

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：中国建设银行股份有限公司
报告送出日期：2011年3月29日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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2011年3月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

安永华明会计师事务所注册会计师对本基金出具了“标准无保留意见”的审计报告。

本报告期自2010年1月1日起至2010年12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	鹏华盛世创新股票（LOF）
基金主代码	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
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
报告期末基金份额总额	446,217,471.64 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2008年11月10日

2.2 基金产品说明

投资目标	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	本基金的投资策略分为两个层次：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。在充分控制投资风险的基础上，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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		鹏华基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	程国洪	尹东
	联系电话	0755-82021186	010-67595003
	电子邮箱	ph@mail.phfund.com.cn	yindong.zh@ccb.cn
客户服务电话		4006788999	010-67595096
传真		0755-82021126	010-66275853

2.4信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.phfund.com.cn
基金年度报告备置地点	深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心第43层鹏华基金管理有限公司； 北京市西城区闹市口大街1号院1号楼中国建设银行股份有限公司

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2010 年	2009 年	2008年10月10日（基金合同生效日）至2008年12月31日
本期已实现收益	-95,384,473.99	128,611,598.28	7,023,139.98
本期利润	-127,424,668.29	180,478,870.94	9,269,652.65
加权平均基金份额本期利润	-0.2164	0.6132	0.0139
本期基金份额净值增长率	-7.38%	70.14%	1.60%
3.1.2 期末数据和指标	2010 年末	2009 年末	2008 年末
期末可供分配基金份额利润	0.4027	0.5361	0.0160
期末基金资产净值	694,966,857.06	710,600,218.04	290,151,499.52
期末基金份额净值	1.557	1.681	1.016

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）所述基金业绩指标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）表中的“期末”均指报告期最后一日，即12月31日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

（4）本基金基金合同于2008年10月10日生效，截止本报告期末，本基金基金合同生效不满三年。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	5.06%	1.88%	4.65%	1.33%	0.41%	0.55%
过去六个月	25.46%	1.60%	16.27%	1.16%	9.19%	0.44%
过去一年	-7.38%	1.62%	-8.46%	1.19%	1.08%	0.43%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	60.11%	1.60%	45.05%	1.50%	15.06%	0.10%

注：1、本基金业绩比较基准为沪深300指数收益率×75%+中证综合债指数收益率×25%。

2、沪深300指数选择我国A股市场规模较大、流动性较强、基本面良好的300家上市公司的股票作为样本股，充分反映了A股市场的行业代表性，描述了沪深A股市场的总体趋势，同时该指数还具有指数编制方法透明、样本股调整规则清晰等特征，是目前市场上较有影响力的股票投资业绩比较基准。

中证综合债指数的选样债券的信用类别覆盖全面，期限构成宽泛，能较好地反映我国债券市场的整体价格变动趋势，因此选择该指数作为衡量基金债券投资部分的业绩比较基准。

本基金充分考虑本基金各资产投资比例要求从而构建上述业绩比较基准。

3、本基金基金合同于2008年10月10日生效，截止本报告期末，不满三年。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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、业绩比较基准为“沪深300指数收益率×75%+中证综合债指数收益率×25%”。

2、本基金基金合同于2008年10月10日生效，截至本基金建仓期结束，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。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：1、业绩比较基准为“沪深300指数收益率×75%+中证综合债指数收益率×25%”；

2、合同生效当年按照实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2010	-	-	-	-	本基金本报告期内未进行利润分配
2009	0.300	3,460,448.49	1,406,328.97	4,866,777.46	2009年03月12日分红，每10份分配0.300元
2008年10月10日（基金合同生效日）至2008年12月31日	-	-	-	-	本基金本报告期内未进行利润分配
合计	0.300	3,460,448.49	1,406,328.97	4,866,777.46	

注：本基金基金合同于2008年10月10日生效，截止本报告期末未满三年。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

鹏华基金管理有限公司成立于1998 年12 月22 日，业务范围包括基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。截止本报告期末，公司股东由国信证券股份有限公司、意大利欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）、深圳市北融信投资发展有限公司组成，公司性质为中外合资企业。公司原注册资本8,000 万元人民币，后于2001 年9 月完成增资扩股，增至15,000 万元人民币。截止本报告期末，公司管理2只封闭式基金、19只开放式基金和6只社保组合，经过11年投资管理基金，在基金投资、风险控制等方面积累了丰富经验。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
唐文杰	本基金基金经理	2009年7月14日	-	6	唐文杰先生，理学硕士，6年证券从业经验。曾任广州金骏资产管理有限公司研究员、长盛基金管理有限公司研究员、博时基金管理有限公司研究员。2009年6月加盟鹏华基金管理有限公司，2009年7月起至今担任鹏华盛世创新基金基金经理。唐文杰具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理发生变动，唐文杰先生继续担任本基金基金经理。
黄鑫	本基金基金经理	2008年10月10日	2010年7月26日	8	黄鑫先生，国籍中国，硕士，8年证券从业经验。曾在民生证券公司证券投资部、长城证券公司研究所从事研究工作。2004年10月加盟鹏华基金管理有限公司从事行业研究工作，曾任公司机构理财部理财经理助理、理财经理；2007年8月起至今担任鹏华中国50 基金基金经理，2008 年10 月至2010年7月担任鹏华盛世创新股票型证券投资基金（LOF）基金经理，2010年7月26日起兼任鹏华动力增长混合型证券投资基金（LOF）基金经理。黄鑫先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理发生变动，黄鑫先生不再担任本基金基金经理。

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办法的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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本基金基金合同的约定，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，本基金运作合法合规，不存在违反基金合同和损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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、分配等各环节得到公平对待。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金管理人旗下无其他投资风格相似的投资组合。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未发生违法违规且并对基金财产造成损失的异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金在2010年1季度继续围绕2009年“转型、消费和创新”的整体思路构建投资组合，超配可选消费，科技和新兴产业等行业，取得了超额收益。2季度本基金增加了部分传统产业的配置，但4月中旬超预期的地产调控政策引发了市场对经济二次探底的担忧，市场出现较大幅度的调整，本基金的仓位调整不够坚决。3季度市场逐步企稳回升，本基金逐步提高仓位，进一步增加了部分估值合理，具有一定安全边际的传统产业，如机械，交通运输等；减持了部分公用事业。4季度市场整体呈现冲高回落态势，本基金延续三季度的思路，继续持有估值合理，具有一定安全边际的传统产业，如机械、交通运输、商业等；增持了部分具有核心竞争力的新兴产业公司，减持了金融股和部分消费品。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2010年本基金的净值增长率为-7.38%，同期上证指数及深圳成指的收益率分别为-14.31%和-9.06%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

中国要顺利完成经济转型需要时间和空间，结构调整是一个长期的过程。中国具有庞大的消费人群和生产能力，在这两者之间如果能够有效的搭建消费以及保障消费的制度性桥梁，那未来中国经济的内生可持续性是可以期待的，而这一变化是需要持续观察。2011年国内国外的宏观环境不确定性较大，近期中央经济工作会议强调处理好经济平稳较快增长，调整经济结构和管理通胀预期三者之间的关系，这说明：这三者是相互影响和相对对立的几个政策目标，宏观政策对这三个目标应该是通盘考虑，互有权衡的，我们预计2011年不会做出过分激烈的调整。中国在过去两年间的整体货币环境较为宽松，而近期美国的量化宽松政策对全球流动性起到推波助澜的作用，使得全球农产品，大宗商品价格不断走高，这使得中国面临较大的通货膨胀压力。控制通胀以及管理通胀预期的举措，将使市场面临一定的不确定性，结构性的行情和轮动，将伴随经济的结构调整而不断演绎，但各市场子行业的差异估计不会像2010年那么显著。未来，包括海工装备，航空航天，核电设备在内的高端制造业是我们关注的重点；同时，我们也会重点寻找商业零售，水利建设以及部分有核心竞争力的新兴产业公司的投资机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.6.1有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述：

4.6.1.1 日常估值流程

基金的估值由基金会计负责，基金会计对公司所管理的基金以基金为会计核算主体，独立建账、独立核算，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账簿记录等方面相互独立。基金会计核算独立于公司会计核算。基金会计核算采用专用的财务核算软件系统进行基金核算及帐务处理；每日按时接收成交数据及权益数据，进行基金估值。基金会计核算采用基金管理公司与托管银行双人同步独立核算、相互核对的方式，每日就基金的会计核算、基金估值等与托管银行进行核对；每日估值结果必须与托管行核对一致后才能对外公告。基金会计除设有专职基金会计核算岗外，还设有基金会计复核岗位，负责基金会计核算的日常事后复核工作，确保基金净值核算无误。

配备的基金会计具备会计资格和基金从业资格，在基金核算与估值方面掌握了丰富的知识和经验，熟悉及了解基金估值法规、政策和方法。

4.6.1.2 特殊业务估值流程

根据中国证监会公告［2008］38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》的相关规定，本公司成立停牌股票等没有市价的投资品种估值小组，成员由基金经理、行业研究员、监察稽核部、金融工程师、登记结算部相关人员组成。

4.6.2基金经理参与或决定估值的程度：

基金经理不参与或决定基金日常估值。

基金经理参与估值小组对停牌股票估值的讨论，发表相关意见和建议，与估值小组成员共同商定估值原则和政策。

4.6.3本公司参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.6.4本公司现没有进行任何定价服务的签约。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

4.7.1截止本报告期末，本基金本期利润为-127,424,668.29元，本期已实现收益-95,384,473.99元。不符合利润分配条件，本基金将不进行利润分配。

4.7.2本基金本报告期内未进行利润分配。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

§6 审计报告

安永华明会计师事务所注册会计师对本基金出具了“标准无保留意见”的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1资产负债表

会计主体：鹏华盛世创新股票型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2010年12月31日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
资 产：			
银行存款		35,945,837.94	43,108,161.63
结算备付金		1,849,884.04	3,496,181.04
存出保证金		17,237.17	707,276.71
交易性金融资产		657,956,950.30	656,427,399.24
其中：股票投资		657,956,950.30	656,427,399.24
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息		11,100.69	16,446.55
应收股利		-	-
应收申购款		1,228,744.15	17,704,748.91
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		697,009,754.29	721,460,214.08
负债和所有者权益	附注号	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		74,405.24	8,244,365.93
应付管理人报酬		982,547.69	899,549.82
应付托管费		163,757.96	149,924.97
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		721,916.74	1,435,803.32
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		100,269.60	130,352.00
负债合计		2,042,897.23	10,859,996.04
所有者权益：			
实收基金		446,217,471.64	422,703,765.25
未分配利润		248,749,385.42	287,896,452.79
所有者权益合计		694,966,857.06	710,600,218.04
负债和所有者权益总计		697,009,754.29	721,460,214.08

注：报告截止日2010年12月31日，基金份额净值1.557元，基金份额总额446,217,471.64 份。

7.2 利润表

会计主体：鹏华盛世创新股票型证券投资基金（LOF）

本报告期：2010年1月1日 至 2010年12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
一、收入		-103,203,601.67	196,533,262.31
1.利息收入		743,446.63	833,963.12
其中：存款利息收入		743,446.63	479,897.36
债券利息收入		-	354,065.76
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-73,175,519.38	142,498,137.61
其中：股票投资收益		-78,950,726.94	139,167,595.73
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	1,661,430.00
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		5,775,207.56	1,669,111.88
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-32,040,194.30	51,867,272.66
4. 汇兑收益（损失以"-"号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		1,268,665.38	1,333,888.92
减：二、费用		24,221,066.62	16,054,391.37
1.管理人报酬	7.4.7.2.1	13,506,200.56	6,209,992.55
2.托管费	7.4.7.2.2	2,251,033.42	1,034,998.74
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		7,972,889.52	8,315,768.57
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用		490,943.12	493,631.51
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-127,424,668.29	180,478,870.94
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-127,424,668.29	180,478,870.94

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鹏华盛世创新股票型证券投资基金（LOF）

本报告期：2010年1月1日 至 2010年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	422,703,765.25	287,896,452.79	710,600,218.04
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-127,424,668.29	-127,424,668.29
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	23,513,706.39	88,277,600.92	111,791,307.31
其中：1.基金申购款	750,502,609.84	490,002,895.97	1,240,505,505.81
2.基金赎回款	-726,988,903.45	-401,725,295.05	-1,128,714,198.50
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	446,217,471.64	248,749,385.42	694,966,857.06
项目	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	285,590,704.46	4,560,795.06	290,151,499.52
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	180,478,870.94	180,478,870.94
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	137,113,060.79	107,723,564.25	244,836,625.04
其中：1.基金申购款	918,211,844.65	396,620,722.70	1,314,832,567.35
2.基金赎回款	-781,098,783.86	-288,897,158.45	-1,069,995,942.31
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-4,866,777.46	-4,866,777.46
五、期末所有者权益（基金净值）	422,703,765.25	287,896,452.79	710,600,218.04

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

邓召明	胡湘	刘慧红
基金管理公司负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

鹏华盛世创新股票型证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监基金字［2008］838号文《关于同意鹏华盛世创新股票型证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人鹏华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华盛世创新股票型证券投资基金（LOF）基金合同》的约定募集设立。本基金为上市契约型开放式，存续期限为不定期，首次设立募集不包括认购资金利息共募集1,144,932,018.81元，经安永华明会计师事务所验证并出具安永华明（2008）验字第60468989_H01号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《鹏华盛世创新股票型证券投资基金（LOF）基金合同》于2008年10月10日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为1,145,339,439.27份基金份额，其中认购资金利息折合407,420.46份基金份额。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

经深圳证券交易所（以下简称“深交所”）深证上字［2008］第154号文审核同意，本基金177,293,934.00份基金份额于2008年11月10日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华盛世创新股票型证券投资基金（LOF）基金合同》的有关规定，本基金的投资范围仅限于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的各类股票、债券、央行票据、权证、资产证券化产品以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如有投资需要可参与有价值的新股配售和增发。其中股票的主要投资方向为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，该部分股票的投资比例不低于本基金股票资产的80%。本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×75%+中证综合债指数收益率×25%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则-基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会公告［2010］5号《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《鹏华盛世创新股票型证券投资基金（LOF）基金合同》和中国证监会允许的基金行业实务操作的有关规定编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2010年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2010年12月31日的财务状况以及2010年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.5差错更正的说明

本基金本报告期没有发生重大会计差错更正。

7.4.6关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
鹏华基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金代销机构
国信证券股份有限公司（“国信证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
意大利欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）	基金管理人的股东
深圳市北融信投资发展有限公司	基金管理人的股东

注：1、本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的其他关联方没有发生变化。

2、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金2010年、2009年未通过关联方交易单元发生股票交易、权证交易、债券交易、债券回购交易，也没有发生应支付关联方的佣金业务。

7.4.7.2 关联方报酬

7.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	13,506,200.56	6,209,992.55
其中：支付给销售机构的客户维护费	1,304,328.06	555,575.83

注：（1）支付基金管理人鹏华基金管理有限公司的管理人报酬年费率为1.5%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×1.5%÷当年天数。

（2）根据《开放式证券投资基金销售费用管理规定》，基金管理人依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，客户维护费从基金管理费中列支。

7.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,251,033.42	1,034,998.74

注：支付基金托管人中国建设银行股份有限公司的托管费年费率为0.25%，逐日计提，按月支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

7.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金2010年、2009 年未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

2010年及2009年，本基金管理人未投资、持有本基金。

7.4.7.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

2010年末及2009年末除基金管理人之外的其他关联方没有投资及持有本基金份额。

7.4.7.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日		上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	35,945,837.94	644,891.32	43,108,161.63	393,467.46

7.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2010年1月1日至2010年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股）	总金额
国信证券	601288	农业银行	网上申购	929,000股	2,489,720.00

注：2009年本基金没有在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.8 期末（2010年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

截至本报告期末2010年12月31日止，本基金没有持有因认购新发或增发而流通受限股票，也没有持有因认购新发或增发而流通受限债券及权证。

7.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末2010年12月31日止，本基金没有持有暂时停牌的股票。

7.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2010年12月31日止，本基金没有从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款。

7.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2010年12月31日止，本基金没有从事证券交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	657,956,950.30	94.40
	其中：股票	657,956,950.30	94.40
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	37,795,721.98	5.42
6	其他各项资产	1,257,082.01	0.18
7	合计	697,009,754.29	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	386,902,188.96	55.67
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	41,061,887.10	5.91
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	4,561,947.00	0.66
C5	电子	41,128,279.20	5.92
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	288,250,985.66	41.48
C8	医药、生物制品	11,899,090.00	1.71
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	42,012,700.16	6.05
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	30,384,743.20	4.37
G	信息技术业	12,658,259.85	1.82
H	批发和零售贸易	53,523,092.69	7.70
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	32,023,524.13	4.61
K	社会服务业	57,091,704.14	8.22
L	传播与文化产业	11,524,655.00	1.66
M	综合类	31,836,082.17	4.58
	合计	657,956,950.30	94.67

8.3 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600150	中国船舶	699,776	47,409,824.00	6.82
2	601989	中国重工	3,999,924	47,159,103.96	6.79
3	600283	钱江水利	2,569,891	35,361,700.16	5.09
4	000062	深圳华强	3,749,833	31,836,082.17	4.58
5	000901	航天科技	1,899,802	31,631,703.30	4.55
6	002320	海峡股份	775,121	30,384,743.20	4.37
7	000534	万泽股份	4,639,731	28,905,524.13	4.16
8	600707	彩虹股份	1,499,910	28,678,279.20	4.13
9	600774	汉商集团	2,999,945	28,109,484.65	4.04
10	600967	北方创业	1,799,932	26,387,003.12	3.80

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于鹏华基金管理有限网站http://www.phfund.com.cn的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	72,405,339.43	10.19
2	601998	中信银行	64,259,278.74	9.04
3	601818	光大银行	62,757,440.71	8.83
4	600150	中国船舶	49,826,848.19	7.01
5	000960	锡业股份	49,549,213.15	6.97
6	600000	浦发银行	49,336,371.23	6.94
7	601989	中国重工	46,828,343.21	6.59
8	600106	重庆路桥	41,770,838.14	5.88
9	000901	航天科技	39,344,092.91	5.54
10	601328	交通银行	38,974,044.54	5.48
11	600900	长江电力	38,498,825.49	5.42
12	600502	安徽水利	37,851,212.89	5.33
13	000534	万泽股份	37,625,542.54	5.29
14	000062	深圳华强	37,267,303.90	5.24
15	600283	钱江水利	37,227,033.00	5.24
16	600183	生益科技	36,725,869.32	5.17
17	600169	太原重工	35,922,009.08	5.06
18	600826	兰生股份	35,507,465.30	5.00
19	600839	四川长虹	35,498,933.98	5.00
20	601601	中国太保	35,062,624.82	4.93
21	000973	佛塑股份	33,752,695.20	4.75
22	600509	天富热电	33,465,167.00	4.71
23	600100	同方股份	33,400,558.20	4.70
24	600467	好当家	33,049,223.91	4.65
25	600416	湘电股份	32,881,133.05	4.63
26	002320	海峡股份	32,808,301.80	4.62
27	600783	鲁信高新	32,202,219.28	4.53
28	600583	海油工程	32,081,966.44	4.51
29	000718	苏宁环球	31,768,643.96	4.47
30	600312	平高电气	31,616,116.18	4.45
31	000988	华工科技	31,196,215.81	4.39
32	002327	富安娜	30,199,418.42	4.25
33	600967	北方创业	30,115,257.01	4.24
34	600707	彩虹股份	30,060,976.39	4.23
35	002285	世联地产	29,970,771.50	4.22
36	000748	长城信息	29,869,688.25	4.20
37	000514	渝 开 发	29,868,554.99	4.20
38	600774	汉商集团	29,139,392.40	4.10
39	600438	通威股份	28,591,633.71	4.02
40	600543	莫高股份	28,550,060.78	4.02
41	000926	福星股份	28,445,349.62	4.00
42	600831	广电网络	28,425,776.73	4.00
43	600704	中大股份	27,049,637.04	3.81
44	600171	上海贝岭	26,443,465.81	3.72
45	600622	嘉宝集团	25,984,081.33	3.66
46	600151	航天机电	25,472,215.82	3.58
47	600879	航天电子	25,286,874.40	3.56
48	600737	中粮屯河	24,690,069.23	3.47
49	600330	天通股份	24,660,519.66	3.47
50	600765	中航重机	24,404,408.94	3.43
51	600456	宝钛股份	24,047,962.09	3.38
52	600855	航天长峰	24,035,032.23	3.38
53	000610	西安旅游	23,806,045.99	3.35
54	002022	科华生物	23,577,117.66	3.32
55	600877	中国嘉陵	23,239,505.10	3.27
56	000796	易食股份	22,938,619.94	3.23
57	000026	飞亚达A	22,580,433.99	3.18
58	000721	西安饮食	22,380,904.93	3.15
59	600580	卧龙电气	21,324,781.01	3.00
60	600546	山煤国际	21,142,653.16	2.98
61	000559	万向钱潮	20,283,498.28	2.85
62	000920	南方汇通	20,036,441.80	2.82
63	600400	红豆股份	18,307,566.62	2.58
64	600362	江西铜业	17,571,784.17	2.47
65	002182	云海金属	17,485,394.81	2.46
66	002209	达 意 隆	17,091,724.36	2.41
67	601988	中国银行	16,877,401.47	2.38
68	600240	华业地产	16,833,555.00	2.37
69	000401	冀东水泥	15,880,283.91	2.23
70	000612	焦作万方	15,728,439.51	2.21
71	600271	航天信息	15,543,423.24	2.19
72	600383	金地集团	15,450,470.09	2.17
73	601808	中海油服	15,347,051.09	2.16
74	000636	风华高科	14,820,160.00	2.09
75	600435	中兵光电	14,747,085.16	2.08

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601998	中信银行	92,322,775.62	12.99
2	601318	中国平安	82,344,814.21	11.59
3	601818	光大银行	71,849,732.88	10.11
4	600100	同方股份	51,762,381.76	7.28
5	600000	浦发银行	49,497,009.81	6.97
6	600106	重庆路桥	40,985,748.18	5.77
7	000728	国元证券	37,782,265.80	5.32
8	000973	佛塑股份	37,582,929.44	5.29
9	600467	好当家	37,096,677.64	5.22
10	600416	湘电股份	36,880,434.77	5.19
11	600054	黄山旅游	36,565,158.34	5.15
12	601328	交通银行	36,264,101.60	5.10
13	000026	飞亚达A	36,153,266.29	5.09
14	600509	天富热电	35,774,798.01	5.03
15	002327	富安娜	35,701,703.60	5.02
16	600169	太原重工	35,014,965.18	4.93
17	600028	中国石化	33,858,329.10	4.76
18	600900	长江电力	33,625,845.89	4.73
19	600446	金证股份	33,507,543.11	4.72
20	600330	天通股份	32,870,945.96	4.63
21	600030	中信证券	32,596,244.83	4.59
22	601601	中国太保	32,133,729.21	4.52
23	000988	华工科技	31,976,064.58	4.50
24	002123	荣信股份	31,625,643.54	4.45
25	600183	生益科技	31,325,612.35	4.41
26	600438	通威股份	30,900,011.04	4.35
27	600826	兰生股份	30,264,628.39	4.26
28	000718	苏宁环球	29,709,130.34	4.18
29	600754	锦江股份	29,026,307.15	4.08
30	600839	四川长虹	28,918,298.87	4.07
31	600583	海油工程	28,917,173.54	4.07
32	600693	东百集团	28,812,761.89	4.05
33	600312	平高电气	28,240,986.12	3.97
34	600037	歌华有线	27,795,640.20	3.91
35	000748	长城信息	27,764,585.80	3.91
36	002301	齐心文具	27,044,662.25	3.81
37	002285	世联地产	27,007,867.40	3.80
38	000960	锡业股份	26,759,976.88	3.77
39	600783	鲁信高新	26,570,645.19	3.74
40	600739	辽宁成大	25,991,992.04	3.66
41	000903	云内动力	25,971,809.11	3.65
42	600546	山煤国际	25,954,492.00	3.65
43	600502	安徽水利	25,304,290.95	3.56
44	600880	博瑞传播	24,537,385.21	3.45
45	002022	科华生物	24,270,120.77	3.42
46	002286	保龄宝	24,140,693.28	3.40
47	600456	宝钛股份	23,860,782.11	3.36
48	601989	中国重工	23,078,143.38	3.25
49	000926	福星股份	22,811,035.49	3.21
50	600458	时代新材	22,669,610.09	3.19
51	601002	晋亿实业	21,982,429.02	3.09
52	600704	中大股份	21,786,677.16	3.07
53	600879	航天电子	21,175,740.23	2.98
54	600543	莫高股份	21,073,914.50	2.97
55	600171	上海贝岭	20,816,186.10	2.93
56	000888	峨眉山A	20,659,135.01	2.91
57	000559	万向钱潮	20,543,449.78	2.89
58	600595	中孚实业	19,933,635.81	2.81
59	600580	卧龙电气	19,924,681.07	2.80
60	000514	渝 开 发	19,915,247.06	2.80
61	600831	广电网络	19,851,830.82	2.79
62	600271	航天信息	19,486,359.07	2.74
63	600737	中粮屯河	18,780,995.53	2.64
64	000401	冀东水泥	18,162,386.33	2.56
65	600622	嘉宝集团	18,089,229.50	2.55
66	000796	易食股份	17,752,638.27	2.50
67	000920	南方汇通	16,775,838.24	2.36
68	601988	中国银行	16,545,580.93	2.33
69	600122	宏图高科	15,907,518.35	2.24
70	600435	中兵光电	15,793,608.02	2.22
71	601808	中海油服	15,494,464.20	2.18
72	000565	渝三峡A	15,124,865.30	2.13
73	600143	金发科技	15,035,028.07	2.12
74	600362	江西铜业	14,812,785.66	2.08
75	000717	韶钢松山	14,712,599.08	2.07
76	600189	吉林森工	14,518,770.14	2.04

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,683,489,516.02
卖出股票收入（成交）总额	2,570,969,043.72

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 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。

8.6 期末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

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 报告期内本基金投资的前十名证券中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、处罚的股票。

8.9.2 报告期内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。

8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	17,237.17
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	11,100.69
5	应收申购款	1,228,744.15
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,257,082.01

8.9.4 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。

8.9.5 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情况。

8.9.6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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
19,033	23,444.41	185,501,208.88	41.57%	260,716,262.76	58.43%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	祁鸿雁	410,000.00	5.39%
2	巩非	400,136.00	5.26%
3	张启春	400,000.00	5.26%
4	邓姣	339,762.00	4.46%
5	陈芳	302,906.00	3.98%
6	王大凯	180,000.00	2.37%
7	姜卫平	118,642.00	1.56%
8	陈荣建	113,700.00	1.49%
9	贾菲	112,919.00	1.48%
10	邹志和	112,100.00	1.47%

注：持有人为场内持有人。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	1,423,379.24	0.3190%

注：截止本报告期末，本基金管理人从业人员投资、持有本基金符合相关法律法规、中国证监会规定及相关管理制度的规定。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2008年10月10日）基金份额总额	1,145,339,439.27
本报告期期初基金份额总额	422,703,765.25
本报告期基金总申购份额	750,502,609.84
减：本报告期基金总赎回份额	726,988,903.45
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	446,217,471.64

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

11.2.1基金管理人的重大人事变动

1、因原董事Francis Candylaftis先生提出辞去本公司董事职务，根据股东欧利盛资本资产管理股份公司推荐，并经本公司2010年股东会会议审议，同意由Alessandro Varaldo先生担任本公司董事，Francis Candylaftis先生不再担任本公司董事职务。本公司已于2010年3月将上述变更事项报中国证券监督管理委员会深圳监管局备案并在基金更新招募书说明书中披露。

2、因原董事Ciro Beffi先生辞去本公司董事职务，原监事Pierre Bouchoms先生辞去本公司监事职务，根据股东欧利盛资本资产管理股份公司推荐，并经本公司2010年第三次临时股东会会议审议，同意由Massimo Mazzini先生担任本公司董事，Ciro Beffi先生不再担任本公司董事职务；由Andrea Vismara先生担任本公司监事，Pierre Bouchoms先生不再担任本公司监事职务。本公司已于2010年11月将上述董事、监事任免的有关材料报中国证券监督管理委员会深圳监管局备案并在基金更新招募书说明书中披露。

3、因工作需要，黄鑫先生不再担任鹏华盛世创新股票型证券投资基金（LOF）基金经理，唐文杰先生继续担任本基金基金经理。上述基金经理变更事项已按有关规定向中国证券业协会办理了基金经理注册登记及变更手续，已报中国证监会深圳监管局备案，并于2010年7月26日在指定媒体公告。

11.2.2基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本基金托管人2011年2月9日发布公告，经中国建设银行研究决定，聘任杨新丰为中国建设银行投资托管服务部副总经理（主持工作），其任职资格已经中国证监会审核批准（证监许可［2011］115号）。解聘罗中涛中国建设银行投资托管服务部总经理职务。

2、本基金托管人2011年1月31日发布任免通知，解聘李春信中国建设银行投资托管服务部副总经理职务。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的，与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金管理人聘请安永华明会计师事务所为本基金审计的会计师事务所。本年度应支付给安永华明会计师事务所审计费用100,000.00元，该审计机构已提供审计服务的年限为三年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、基金托管人涉及托管业务机构及其高级管理人员在报告期内未受到任何稽查或处罚。

11.7基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	1	2,961,852,343.95	56.43%	2,517,565.43	57.21%	-
中银国际	1	1,624,572,029.69	30.95%	1,319,980.72	30.00%	-
宏源证券	1	427,637,644.43	8.15%	363,490.91	8.26%	本报告期新增席位
上海证券	1	234,602,266.47	4.47%	199,409.58	4.53%	-

注：交易单元选择的标准和程序

1、基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其交易单元作为基金的专用交易单元，选择的标准是：

（1）实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于3亿元人民币；

（2）财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；

（3）经营行为规范，最近二年未发生重大违规行为而受到中国证监会处罚；

（4）内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

（5）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；

（6）研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务。

2、选择交易单元的程序：

我公司根据上述标准，选定符合条件的证券公司作为租用交易单元的对象。我公司投研部门定期对所选定证券公司的服务进行综合评比，评比内容包括：提供研究报告质量、数量、及时性及提供研究服务主动性和质量等情况，并依据评比结果确定交易单元交易的具体情况。我公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，分别向中银国际证券有限责任公司、中信证券股份有限公司、上海证券有限责任公司租用交易单元作为基金专用交易单元，并从2008年10月开始陆续使用。2010年新增宏源证券股份有限公司交易单元作为基金专用交易单元。本报告期内上述其他交易单元未发生变化。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期内未通过券商交易单元进行权证交易、债券交易及债券回购交易。

§12 影响投资者决策的其他重要信息

本基金托管人中国建设银行股份有限公司的重大事项披露如下：

2010年1月29日，托管人中国建设银行股份有限公司发布第二届董事会第二十八次会议决议公告，决议聘任庞秀生先生担任中国建设银行股份有限公司副行长。

2010年5月13日，托管人中国建设银行股份有限公司发布关于高级管理人员辞任的公告，范一飞先生已提出辞呈，辞去中国建设银行股份有限公司副行长的职务。

2010年6月21日，托管人中国建设银行股份有限公司发布关于中央汇金投资有限责任公司承诺认购配股股票的公告。

2010年7月1日，托管人中国建设银行股份有限公司发布2009年度A股分红派息实施公告，每 10 股派发现金股息人民币 2.02 元（含税）。

2010年9月15日，托管人中国建设银行股份有限公司发布公告，张福荣先生担任中国建设银行股份有限公司监事长，谢渡扬先生辞去中国建设银行股份有限公司监事、监事长职务。

2010年11月2日，托管人中国建设银行股份有限公司发布2010年度A股配股发行公告。

鹏华基金管理有限公司
2011年3月29日