# 鹏华价值优势股票型证券投资基金（LOF）

## 2011 第三季度 报告

2011年9月30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10月25日**

### §1 重要提示

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根据本基金合同规定,于2011年10月21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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2011年7月1日起至9月30日止。

### §2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 鹏华价值优势股票（LOF）(场内简称:鹏华价值) |
| 基金主代码 | 160607 |
| 交易代码 | 160607 |
| 基金运作方式 | 上市契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2006年7月18日 |
| 报告期末基金份额总额 | 13,541,764,353.94份 |
| 投资目标 | 依托严格的研究流程和投资纪律,强调运用相对估值分析方法,发掘我国资本市场国际接轨趋势下具备相对价值优势的中国企业,谋求基金资产的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | (1)股票投资:首先按照既有的研究流程和投资纪律进行行业配置和个股选择,再运用相对估值分析方法,进行多维估值比较,分析行业、个股的合理估值区间,深入发掘行业和个股层面由于具备相对价值优势而存在的投资机会,以此作为基金经理的投资线索以及权重调整的重要依据。(2)债券投资:以降低组合总体波动性从而改善组合风险构成为目的,采取积极主动的投资策略,进而谋取超额收益。 |
| 业绩比较基准 | 中信标普A股综合指数收益率×70%+中信标普国债指数收益率×30% |
| 风险收益特征 | 本基金属于股票型证券投资基金,为证券投资基金中的中高风险品种。基金长期平均的风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金、货币型基金,低于成长型股票基金。 |
| 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(2011年7月1日 - 2011年9月30日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | -56,256,648.15 |
| 2.本期利润 | -1,465,161,842.37 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.1081 |
| 4.期末基金资产净值 | 10,170,197,223.87 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.751 |

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。

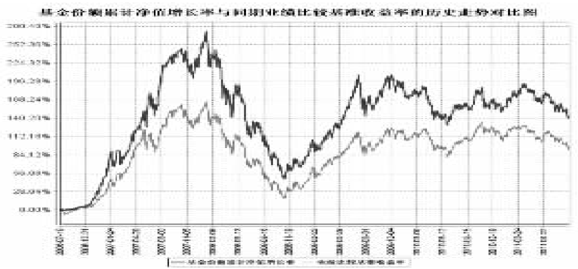
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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 | 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 | -12.57% | 1.19% | -10.21% | 0.96% | -2.36% | 0.23% |

注:业绩比较基准=中信标普A股综合指数收益率×70%+中信标普国债指数收益率×30%

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、本基金合同于2006年7月18日生效。2、按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定,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 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 程世杰 | 本基金基金经理,基金管理部总经理 | 2007年4月20日 | - | 14 | 程世杰先生,国籍中国,经济学硕士,14年金融证券从业经验。2001年5月加盟鹏华基金管理有限公司,历任行业研究员、鹏华中国50开放式证券投资基金基金经理助理,2005年5月至2007年5月担任原鹏华普华基金(2007年4月已转型为鹏华优质治理股票型证券投资基金(LOF))基金经理,2007年5月至2007年8月担任鹏华优质治理股票型证券投资基金(LOF)基金经理,2009年9月至2011年5月担任鹏华精选成长股票型证券投资基金基金经理,2007年4月起至今担任鹏华价值优势股票型证券投资基金(LOF)基金经理,现同时担任基金管理部总经理,投资决策委员会成员。程世杰先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理未发生变动。 |

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

在本报告期内,基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、《鹏华价值优势股票型证券投资基金(LOF)基金合同》的规定。

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 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

三季度上证指数下跌14.59%,深证成指下跌15.02%,沪深300指数下跌15.20%,本基金季末净值为0.751元,较季初下跌12.57%,跌幅仅略低于市场。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内,紧缩政策持续,通货膨胀处于高位徘徊,市场对经济下滑的担忧开始增强,外围经济环境恶化,投资者恐慌情绪开始蔓延,估值重心进一步下移,本基金重仓持有的家电等行业个股跌幅相对较大。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市,我们认为本基金重仓持有的投资品种已经具有相对明显的投资价值,具有相对较高的安全边际,投资风险可控。尽管如此,在通货膨胀保持较高水平、政策紧缩和流动性吃紧的情况下,由于资金供求失衡,市场也很难出现大的系统性投资机会。我们将继续坚持自下而上的原则,精选估值合理、公司治理结构较好、管理优秀、具有较好发展前景和产业竞争力、善待投资者的公司进行重点投资。

### §5 投资组合报告

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 | 9,546,539,202.81 | 93.53 |
| | 其中:股票 | 9,546,539,202.81 | 93.53 |
| 2 | 固定收益投资 | 282,097,800.00 | 2.76 |
| | 其中:债券 | 282,097,800.00 | 2.76 |
| | 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 | 368,723,633.96 | 3.61 |
| 6 | 其他资产 | 9,589,201.46 | 0.09 |
| 7 | 合计 | 10,206,949,838.23 | 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 | 采掘业 | - | - |
| C | 制造业 | 3,007,840,157.36 | 29.58 |
| C0 | 食品、饮料 | - | - |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | - | - |
| C2 | 木材、家具 | - | - |
| C3 | 造纸、印刷 | - | - |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | 416,119,343.68 | 4.09 |
| C5 | 电子 | 176,951,154.60 | 1.74 |
| C6 | 金属、非金属 | 619,919,678.96 | 6.10 |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 1,780,290,344.12 | 17.50 |
| C8 | 医药、生物制品 | 14,559,636.00 | 0.14 |
| C99 | 其他制造业 | - | - |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 297,029,663.95 | 2.92 |
| E | 建筑业 | 821,340,000.00 | 8.08 |
| F | 交通运输、仓储业 | 507,882,716.44 | 4.99 |
| G | 信息技术业 | 846,183,895.36 | 8.32 |
| H | 批发和零售贸易 | 297,899,207.22 | 2.93 |
| I | 金融、保险业 | 3,138,386,816.60 | 30.86 |
| J | 房地产业 | 356,446,968.20 | 3.50 |
| K | 社会服务业 | 273,529,777.68 | 2.69 |
| L | 传播与文化产业 | - | - |
| M | 综合类 | - | - |
| | 合计 | 9,546,539,202.81 | 93.87 |

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 | 000527 | 美的电器 | 56,267,798 | 829,387,342.52 | 8.16 |
| 2 | 601668 | 中国建筑 | 243,000,000 | 821,340,000.00 | 8.08 |
| 3 | 600036 | 招商银行 | 72,509,587 | 801,956,032.22 | 7.89 |
| 4 | 600050 | 中国联通 | 156,000,000 | 798,720,000.00 | 7.85 |
| 5 | 600016 | 民生银行 | 142,000,000 | 783,840,000.00 | 7.71 |
| 6 | 000651 | 格力电器 | 26,464,944 | 529,034,230.56 | 5.20 |
| 7 | 601166 | 兴业银行 | 35,254,311 | 436,800,913.29 | 4.29 |
| 8 | 600015 | 华夏银行 | 35,012,033 | 353,971,653.63 | 3.48 |
| 9 | 600000 | 浦发银行 | 34,499,423 | 294,625,072.42 | 2.90 |
| 10 | 600690 | 青岛海尔 | 31,999,524 | 293,755,630.32 | 2.89 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 259,714,000.00 | 2.55 |
| | 其中:政策性金融债 | 259,714,000.00 | 2.55 |
| 4 | 企业债券 | 4,850,000.00 | 0.05 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债 | 17,533,800.00 | 0.17 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 282,097,800.00 | 2.77 |

5.5 报告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

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 100231 | 10国开31 | 2,600,000 | 259,714,000.00 | 2.55 |
| 2 | 110018 | 国电转债 | 180,000 | 17,533,800.00 | 0.17 |
| 3 | 122073 | 11云维债 | 50,000 | 4,850,000.00 | 0.05 |

注:上述债券明细为本基金本报告期末持有的全部债券。

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。

5.7 报告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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.8.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 1,500,000.00 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 6,226,939.49 |
| 5 | 应收申购款 | 1,862,261.97 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 9,589,201.46 |

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

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 000527 | 美的电器 | 153,296,000.00 | 1.51 | 非公开发行 |

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。

### §6 开放式基金份额变动

单位:份

| | |
|---|---|
| 本报告期期初基金份额总额 | 13,036,331,027.07 |
| 本报告期基金总申购份额 | 973,403,291.14 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 467,969,964.27 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 13,541,764,353.94 |

### §7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

(一)《鹏华价值优势股票型证券投资基金(LOF)基金合同》; (二)《鹏华价值优势股票型证券投资基金(LOF)托管协议》; (三)《鹏华价值优势股票型证券投资基金(LOF)2011年第3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。北京市西城区闹市口大街1号院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.phfund.com.cn)查阅。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。

**鹏华基金管理有限公司**
**2011年10月25日**

---

# 鹏华精选成长股票型证券投资基金

## 2011 第三季度 报告

2011年9月30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10月25日**

### §1 重要提示

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根据本基金合同规定,于2011年10月21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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2011年7月1日起至9月30日止。

### §2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 鹏华精选成长股票 |
| 基金主代码 | 206002 |
| 交易代码 | 206002 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2009年9月9日 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,414,179,237.00份 |
| 投资目标 | 在适度控制风险并保持良好流动性的前提下,自下而上精选具有良好持续成长潜力的上市公司,力争基金资产的长期增值。 |
| 投资策略 | 1.资产配置策略<br>本基金主要根据宏观经济、政策环境、利率走势、市场技术指标、市场资金构成及流动性情况,运用定性和定量相结合的分析手段,对证券市场现阶段的系统性风险以及未来一段时期内各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估,并据此制定本基金股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。<br>2.股票投资策略<br>本基金对股票的投资采用自下而上的个股精选策略,对成长性股票进行筛选,结合定性分析与定量分析构建投资组合,并进行定期和不定期调整。<br>3.债券投资策略<br>本基金将采取久期策略、信用策略、债券选择策略等积极投资策略,在严格控制风险的前提下,发掘<br>和利用市场失衡提供的投资机会,实现债券组合增值。<br>4.权证投资策略<br>本基金在进行权证投资时,将通过对权证标的证券基本面的研究,并结合权证定价模型寻求其合理估值水平,主要考虑运用的策略包括:价值挖掘策略、价差策略、双向权证策略等。 |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20% |
| 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 |

### §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(2011年7月1日 - 2011年9月30日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | -16,775,630.06 |
| 2.本期利润 | -147,386,675.39 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.1031 |
| 4.期末基金资产净值 | 1,126,908,890.11 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.797 |

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。

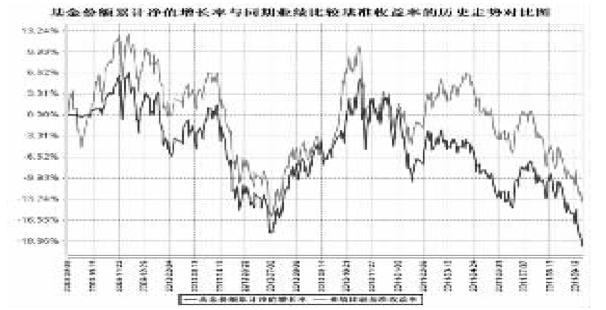
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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 | 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 | -11.54% | 1.04% | -12.22% | 1.05% | 0.68% | -0.01% |

注:沪深300 指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20%。

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、鹏华精选成长股票型证券投资基金基金合同于2009年9月9日生效;

2、按基金合同规定,本基金自基金合同生效起六个月内为建仓期,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 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 郝建国 | 本基金基金经理 | 2010年8月18日 | - | 11 | 郝建国先生,国籍中国,经济学硕士,11年证券从业经验。曾任职于长城证券有限责任公司、平安证券有限责任公司、摩根士丹利华鑫基金管理有限公司和招商基金管理有限公司,从事行业研究以及投资组合管理工作。2008年12月至2009年12月担任招商安泰系列证券投资基金基金经理。2010年5月加入鹏华基金管理有限公司,曾任机构投资部投资经理,2010年8月起至今担任鹏华精选成长股票型证券投资基金基金经理。郝建国先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理未发生变动。 |

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

在本报告期内,基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、《鹏华精选成长股票型证券投资基金基金合同》的规定。

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 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

报告期内,上证指数在短期反弹后由2827点一路下跌,季度跌幅-14.59%。在下跌过程中,前期反弹较多的中小板和创业板股票下跌较大,而食品、商业、银行等行业及大盘股相对抗跌。分析本次下跌,主要影响因素是通涨依然高企、投资者对政策放松预期落空以及欧洲债务危机等。本季度,本基金在继续坚持价值投资理念和精选个股的投资思路下,对组合结构进行了调整,在下跌初期减仓了小市值股票并适度降低仓位,增持了银行等防御类资产。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

三季度上证指数下跌14.59%,深证成指下跌15.02%,沪深300指数下跌15.20%,本基金季末净值为0.797元,较季初下跌11.54%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下一季度,我们认为,通涨或将持续回落,经济增长或将缓慢回落,欧洲债务危机还处于不确定状态。展望更长时期,中国宏观经济处于大的转型期中,新的增长极还在逐步形成中。短期看,三季度证券市场对此轮中国经济增长是否进入衰退期仍没有定论,同时中国宏观经济政策也不会出现明显改变。因此,我们认为四季度的股票市场可能仍将维持弱势震荡,在这样的市场情况下,我们将努力做好行业配置,同时加强精选个股,以期为投资者获取较好的收益。

### §5 投资组合报告

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 | 886,050,393.05 | 77.52 |
| | 其中:股票 | 886,050,393.05 | 77.52 |
| 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 | 255,383,227.31 | 22.34 |
| 6 | 其他资产 | 1,543,026.90 | 0.14 |
| 7 | 合计 | 1,142,976,647.26 | 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 | 9,449,217.00 | 0.84 |
| B | 采掘业 | 43,598,301.30 | 3.87 |
| C | 制造业 | 376,987,300.56 | 33.45 |
| C0 | 食品、饮料 | 67,178,419.83 | 5.96 |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | - | - |
| C2 | 木材、家具 | - | - |
| C3 | 造纸、印刷 | - | - |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | 41,551,831.15 | 3.69 |
| C5 | 电子 | 17,080,439.84 | 1.52 |
| C6 | 金属、非金属 | 47,772,483.78 | 4.24 |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 139,020,807.24 | 12.34 |
| C8 | 医药、生物制品 | 64,383,318.72 | 5.71 |
| C99 | 其他制造业 | - | - |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 41,816,572.16 | 3.71 |
| F | 交通运输、仓储业 | 6,420,000.00 | 0.57 |
| G | 信息技术业 | 43,829,923.92 | 3.89 |
| H | 批发和零售贸易 | 52,615,672.60 | 4.67 |
| I | 金融、保险业 | 215,945,827.01 | 19.16 |
| J | 房地产业 | 36,718,306.93 | 3.26 |
| K | 社会服务业 | 42,413,148.63 | 3.76 |
| L | 传播与文化产业 | - | - |
| M | 综合类 | 16,256,122.94 | 1.44 |
| | 合计 | 886,050,393.05 | 78.63 |

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 | 601601 | 中国太保 | 2,899,940 | 53,619,890.60 | 4.76 |
| 2 | 600015 | 华夏银行 | 4,999,991 | 50,549,909.01 | 4.49 |
| 3 | 601166 | 兴业银行 | 3,999,898 | 49,558,736.22 | 4.40 |
| 4 | 000858 | 五粮液 | 1,249,949 | 45,373,148.70 | 4.03 |
| 5 | 600000 | 浦发银行 | 4,699,917 | 40,137,291.18 | 3.56 |
| 6 | 000527 | 美的电器 | 2,100,000 | 30,954,000.00 | 2.75 |
| 7 | 600309 | 烟台万华 | 1,899,895 | 30,227,329.45 | 2.68 |
| 8 | 600729 | 重庆百货 | 699,950 | 28,347,975.00 | 2.52 |
| 9 | 601699 | 潞安环能 | 899,982 | 26,270,474.58 | 2.33 |
| 10 | 002152 | 广电运通 | 844,925 | 23,531,161.25 | 2.09 |

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名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。

5.7 报告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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 本报告期内,本基金投资的前十名证券之一的五粮液的发行主体宜宾五粮液股份有限公司,因涉及多个信息披露事项披露不及时并存在重大遗漏等违规事件,曾于2011年5月28日受到中国证监会的行政处罚。本报告期内,五粮液股份有限公司未再就该事项发布新公告.

对该股票的投资决策程序的说明:本基金管理人长期跟踪研究该股票,认为高端白酒估值合理,成长确定且业绩有保证,该股票虽受到行政处罚但长期价值仍在。该证券的投资已执行内部严格的投资决策流程,符合法律法规和公司制度的规定。

报告期内本基金投资的前十名证券中的其它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。

5.8.2 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。

5.8.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 1,272,290.60 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 51,656.23 |
| 5 | 应收申购款 | 219,080.07 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 1,543,026.90 |

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

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 000527 | 美的电器 | 30,954,000.00 | 2.75 | 非公开发行 |

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。

### §6 开放式基金份额变动

单位:份

| | |
|---|---|
| 本报告期期初基金份额总额 | 1,445,402,798.35 |
| 本报告期基金总申购份额 | 10,716,581.29 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 41,940,142.64 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 1,414,179,237.00 |

### §7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

(一)《鹏华精选成长股票型证券投资基金基金合同》;

(二)《鹏华精选成长股票型证券投资基金托管协议》;

(三)《鹏华精选成长股票型证券投资基金2011年第3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。

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.phfund.com.cn)查阅。

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。

**鹏华基金管理有限公司**
**2011年10月25日**

---

# 普丰证券投资基金

## 2011 第三季度 报告

2011年9月30日

**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:2011年10月25日**

### §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。

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2011年10月21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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2011年7月1日起至9月30日止。

### §2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 鹏华普丰封闭(场内简称:基金普丰) |
| 基金主代码 | 184693 |
| 交易代码 | 184693 |
| 基金运作方式 | 契约型封闭式 |
| 基金合同生效日 | 1999年7月14日 |
| 报告期末基金份额总额 | 3,000,000,000.00份 |
| 投资目标 | 导入指数化投资概念,增加投资广度,分散投资风险,同时贯彻绩优、成长的选股原则。通过指数化投资和优化组合投资两种模式的积极结合,实现风险与收益的有效平衡,力争使基金取得超过市场平均收益率以上的投资收益,实现基金资产的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | 本基金将指数化投资与优化组合投资有机结合,在进一步分散风险的同时,积极投资绩优股和成长股,将基金财产按一定比例分为指数化投资部分、债券投资部分和优化组合投资部分,力争在降低风险的同时,实现基金财产增值。 |
| 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 |

### §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(2011年7月1日 - 2011年9月30日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | -107,934,452.55 |
| 2.本期利润 | -365,189,728.88 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.1217 |
| 4.期末基金资产净值 | 2,824,164,418.19 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.9414 |

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,封闭式基金交易佣金等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

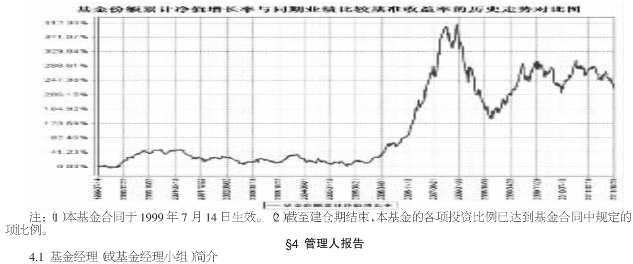
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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 | 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 | -11.45% | 1.62% | - | - | - | - |

注:基金合同中未规定业绩比较基准。

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)本基金合同于1999年7月14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 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 吴昱村 | 本基金基金经理 | 2009年7月14日 | - | 7 | 吴昱村先生,国籍中国,管理学硕士,7年证券从业经验。曾任联合证券有限责任公司研究员;2008年10月加盟鹏华基金管理有限公司从事行业研究工作,2009年7月起至今担任鹏华普丰基金基金经理。吴昱村具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理未发生变动。 |

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

在本报告期内,基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、《普丰证券投资基金基金合同》的规定。

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 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

2011年三季度市场运行仍延续震荡下行趋势,其中,汽车、机械、房地产等权重行业整体跌幅略大于非周期行业及中小市值板块。总体而言,市场及宏观经济情况基本符合我们在中期报告中的判断:首先,7、8月价格总水平指标表现持续超出预期,引发投资人对年内货币及财政政策放松的预期转向悲观;第二,三季度欧元区贷款及信用危机加深,引发市场对未来外需超预期下滑的担忧加剧;第三,江浙部分地区自9月初开始较大规模地爆发中小企业资金链断裂事件,从微观层面上同样加剧了市场对国内经济景气在4季度超预期下行的担忧。报告期内,本基金降低了对投资品、普通材料及出口型行业公司的配置比例,并增持了智能手机相关产业链与具有资源优势的化工行业公司,从实际情况看效果较好,积极部分表现好于指数部分。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2011年三季度末,本基金份额净值为0.9414元,较上季度末增长幅度为-11.45%,同期上证综指下跌了14.59%,深证成指下跌了15.02%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们预计自10月起国内CPI可能出现较为显著的环比下降,与此同时全球大宗商品材料价格也缺乏继续大幅上行的基本面支撑,四季度通胀压力可能较前3季度有较明显的释放。因此,我们判断未来货币政策继续紧缩的概率正在降低,维持现状将是大概率事件,困扰市场的政策性风险或不会继续增大。四季度市场风险将主要来自于以下两方面:一、固定资产投资紧缩的效果持续体现,投资品权重行业公司收入及盈利增速放缓,而市场对此的预期尚不充分;二、海外经济继续出现超预期恶化,导致市场对外需紧缩的担忧继续加深。总体而言,我们估计四季度市场将呈现震荡走势,趋势性的反弹不论从基本面还是博弈的角度均缺乏基础。

基于此,我们将继续维持适中的仓位策略,回避商用车、工程机械及水泥等典型的固定资产投资行业,并主要沿以下方向积极发掘投资机会:(1)智能手机尤其是受益于中低端智能终端放量的相关产业链;(2)汽车、家电等可选消费品行业中的优质公司;(3)具有资源优势的纵向一体化型化工企业;(4)稀土永磁等与节能减排密切相关的新兴材料行业。

### §5 投资组合报告

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 | 2,112,935,369.90 | 74.62 |
| | 其中:股票 | 2,112,935,369.90 | 74.62 |
| 2 | 固定收益投资 | 620,245,467.00 | 21.90 |
| | 其中:债券 | 620,245,467.00 | 21.90 |
| | 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 | 85,997,531.19 | 3.04 |
| 6 | 其他资产 | 12,354,284.53 | 0.44 |
| 7 | 合计 | 2,831,532,652.62 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资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 | 5,368,307.12 | 0.19 |
| B | 采掘业 | 123,100,542.60 | 4.36 |
| C | 制造业 | 331,468,214.01 | 11.74 |
| C0 | 食品、饮料 | 64,470,345.50 | 2.28 |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | 3,469,088.84 | 0.12 |
| C2 | 木材、家具 | - | - |
| C3 | 造纸、印刷 | - | - |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | 18,175,161.30 | 0.64 |
| C5 | 电子 | 10,494,169.85 | 0.37 |
| C6 | 金属、非金属 | 77,853,514.73 | 2.76 |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 112,908,077.74 | 4.00 |
| C8 | 医药、生物制品 | 42,197,593.65 | 1.49 |
| C99 | 其他制造业 | 1,900,262.40 | 0.07 |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 20,915,354.71 | 0.74 |
| E | 建筑业 | 25,055,427.38 | 0.89 |
| F | 交通运输、仓储业 | 37,129,555.46 | 1.31 |
| G | 信息技术业 | 31,006,272.67 | 1.10 |
| H | 批发和零售贸易 | 28,923,762.46 | 1.02 |
| I | 金融、保险业 | 264,931,367.91 | 9.38 |
| J | 房地产业 | 45,410,128.41 | 1.61 |
| K | 社会服务业 | 8,128,349.49 | 0.29 |
| L | 传播与文化产业 | 2,058,979.13 | 0.07 |
| M | 综合类 | 18,139,244.14 | 0.64 |
| | 合计 | 941,635,505.49 | 33.34 |

5.2.2 报告期末积极投资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 | 采掘业 | 97,670,171.41 | 3.46 |
| C | 制造业 | 687,214,145.98 | 24.33 |
| C0 | 食品、饮料 | 54,446,805.60 | 1.93 |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | - | - |
| C2 | 木材、家具 | - | - |
| C3 | 造纸、印刷 | - | - |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | 246,471,603.36 | 8.73 |
| C5 | 电子 | 123,070,075.95 | 4.36 |
| C6 | 金属、非金属 | 21,999,555.37 | 0.78 |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 241,226,105.70 | 8.54 |
| C8 | 医药、生物制品 | - | - |
| C99 | 其他制造业 | - | - |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 交通运输、仓储业 | - | - |
| G | 信息技术业 | 103,642,593.02 | 3.67 |
| H | 批发和零售贸易 | 92,633,120.84 | 3.28 |
| I | 金融、保险业 | 30,975,000.00 | 1.10 |
| J | 房地产业 | - | - |
| K | 社会服务业 | 49,278,262.88 | 1.74 |
| L | 传播与文化产业 | 36,962,907.52 | 1.31 |
| M | 综合类 | 72,923,662.76 | 2.58 |
| | 合计 | 1,171,299,864.41 | 41.47 |

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股票投资明细

5.3.1 报告期末指数投资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 | 600036 | 招商银行 | 2,474,372 | 27,366,554.32 | 0.97 |
| 2 | 601318 | 中国平安 | 770,230 | 25,856,621.10 | 0.92 |
| 3 | 600016 | 民生银行 | 4,519,964 | 24,950,201.28 | 0.88 |
| 4 | 600030 | 中信证券 | 1,926,812 | 21,676,635.00 | 0.77 |
| 5 | 601328 | 交通银行 | 4,581,172 | 20,523,650.56 | 0.73 |
| 6 | 600000 | 浦发银行 | 2,238,791 | 19,119,275.14 | 0.68 |
| 7 | 601166 | 兴业银行 | 1,510,504 | 18,715,144.56 | 0.66 |
| 8 | 601088 | 中国神华 | 659,814 | 16,719,686.76 | 0.59 |
| 9 | 600519 | 贵州茅台 | 83,104 | 15,838,791.36 | 0.56 |
| 10 | 601988 | 中国银行 | 5,477,360 | 15,610,476.00 | 0.55 |

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

| 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 | 002106 | 莱宝高科 | 4,000,393 | 98,609,687.45 | 3.49 |
| 2 | 600366 | 宁波韵升 | 3,999,684 | 76,273,973.88 | 2.70 |
| 3 | 000422 | 湖北宜化 | 3,827,862 | 73,724,622.12 | 2.61 |
| 4 | 600805 | 悦达投资 | 4,933,942 | 72,923,662.76 | 2.58 |
| 5 | 601699 | 潞安环能 | 2,299,881 | 67,133,526.39 | 2.38 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | 94,583,668.60 | 3.35 |
| 2 | 央行票据 | 225,733,000.00 | 7.99 |
| 3 | 金融债券 | 299,710,000.00 | 10.61 |
| | 其中:政策性金融债 | 299,710,000.00 | 10.61 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债 | 218,798.40 | 0.01 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 620,245,467.00 | 21.96 |

5.5 报告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

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 080219 | 08国开19 | 1,500,000 | 149,580,000.00 | 5.30 |
| 2 | 1001032 | 10央行票据32 | 1,300,000 | 127,673,000.00 | 4.52 |
| 3 | 080222 | 08国开22 | 1,000,000 | 99,700,000.00 | 3.53 |
| 4 | 1001042 | 10央行票据42 | 1,000,000 | 98,060,000.00 | 3.47 |
| 5 | 010203 | 02国债(3) | 650,000 | 65,162,500.00 | 2.31 |

5.6 报告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。

5.7 报告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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 本报告期内,本基金投资的前十名证券之一的五粮液的发行主体宜宾五粮液股份有限公司,因涉及多个信息披露事项披露不及时并存在重大遗漏等违规事件,曾于2011年5月28日受到中国证监会的行政处罚。本报告期内,五粮液股份有限公司未再就该事项发布新公告。

对该股票的投资决策程序的说明:本基金管理人长期跟踪研究该股票,认为高端白酒估值合理,成长确定且业绩有保证,该股票虽受到行政处罚但长期价值仍在。该证券的投资已执行内部严格的投资决策流程,符合法律法规和公司制度的规定。

报告期内本基金投资的前十名证券中的其它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。

5.8.2 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。

5.8.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 1,864,579.27 |
| 2 | 应收证券清算款 | 831,984.53 |
| 3 | 应收股利 | 109,749.92 |
| 4 | 应收利息 | 9,296,831.87 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | 251,138.94 |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 12,354,284.53 |

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 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.8.6 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

5.8.7 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。

### §6 基金管理人运用固有资金投资本封闭式基金情况

单位:份

| | |
|---|---|
| 报告期期初管理人持有的封闭式基金份额 | 3,750,000.00 |
| 报告期期间买入总份额 | - |
| 报告期期间卖出总份额 | - |
| 报告期期末管理人持有的封闭式基金份额 | 3,750,000.00 |
| 报告期期末持有的封闭式基金份额占基金总份额比例(%) | 0.13 |

### §7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

(一)《普丰证券投资基金基金合同》; (二)《普丰证券投资基金托管协议》; (三)《普丰证券投资基金2011年第3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。

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.phfund.com.cn)查阅。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。

**鹏华基金管理有限公司**
**2011年10月25日**