

上证民营企业50交易型开放式指数证券投资基金

2011 第四季度 报告

2011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:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2012年1月18日

基金管理人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。
基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年1月16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。

基金产品概况
基金名称:上证50ETF(场内简称:上证50ETF)
基金代码:510070
交易代码:510070
基金运作方式:交易所开放式

基金合同生效日:2010年8月5日
报告期末基金份额总额:364,624,067.00份

主要财务指标
1.本期已实现收益: -20,474,525.20
2.本期利润: -46,406,998.96
3.加权平均基金份额本期利润: -0.1286

业绩比较基准
上证民营企业50指数
风险收益特征
本基金股票型基金,其预期的风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金,为证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种。

基金经理小简历
姓名:方南
职务:基金经理
任职日期:2010年8月5日
证券从业年限:9

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:2012年1月18日

基金管理人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。
基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年1月16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。

基金产品概况
基金名称:鹏华动力增长混合(L0F)(场内简称:鹏华动力)
基金代码:160610
交易代码:160610
基金运作方式:上市型开放式基金

主要财务指标
1.本期已实现收益: -247,576,748.72
2.本期利润: -449,490,480.31
3.加权平均基金份额本期利润: -0.0724

业绩比较基准
沪深300指数收益率*70%+中证综合债指数收益率*30%
风险收益特征
本基金属于混合型“稳健”基金,其预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金,高于债券型基金、货币市场基金。

基金经理小简历
姓名:方南
职务:基金经理
任职日期:2010年7月26日
证券从业年限:9

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:2012年1月18日

基金管理人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。

除包含经济增长模式转变及货币政策等原因外,未来中国经济增速在一定程度上放缓是个大概率事件,这也会对股市的估值产生负面影响,因此,基金管理人认为,中长期来看,未来市场的超额收益在很大程度上取决于企业盈利改善带来的估值修复和盈利效率的提升,这类公司值得关注。

§5 投资组合报告
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

§6 投资组合报告
6.1 报告期末基金资产组合情况
6.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
6.3 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

§7 开放式基金份额变动
报告期末基金份额总额:362,124,067.00
本报告期间基金份额净增加:60,500,000.00

§8 基金管理人报告
8.1 基金经理小简历
8.2 基金经理小简历
8.3 基金经理小简历

§9 基金产品概况
基金名称:鹏华动力增长混合(L0F)(场内简称:鹏华动力)
基金代码:160610
交易代码:160610
基金运作方式:上市型开放式基金

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:2012年1月18日

基金管理人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。
基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年1月16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。

基金产品概况
基金名称:鹏华动力增长混合(L0F)(场内简称:鹏华动力)
基金代码:160610
交易代码:160610
基金运作方式:上市型开放式基金

主要财务指标
1.本期已实现收益: -247,576,748.72
2.本期利润: -449,490,480.31
3.加权平均基金份额本期利润: -0.0724

业绩比较基准
沪深300指数收益率*70%+中证综合债指数收益率*30%
风险收益特征
本基金属于混合型“稳健”基金,其预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金,高于债券型基金、货币市场基金。

基金经理小简历
姓名:方南
职务:基金经理
任职日期:2010年7月26日
证券从业年限:9

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:2012年1月18日

基金管理人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。

鹏华上证民营企业50交易型开放式指数证券投资基金联接基金

2011 第四季度 报告

2011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:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2012年1月18日

基金管理人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。
基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年1月16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。

基金产品概况
基金名称:鹏华上证50ETF联接
基金代码:206005
交易代码:206005
基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2010年8月5日
报告期末基金份额总额:338,252,821.25份

主要财务指标
1.本期已实现收益: -393,680.23
2.本期利润: -36,375,891.86
3.加权平均基金份额本期利润: -0.1062

业绩比较基准
上证民营企业50指数收益率*95%+银行活期存款利率*5%
风险收益特征
本基金股票型基金,其预期的风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金,为证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种。

基金经理小简历
姓名:方南
职务:基金经理
任职日期:2010年8月5日
证券从业年限:9

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:2012年1月18日

基金管理人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。
基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年1月16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。

基金产品概况
基金名称:鹏华上证50ETF联接
基金代码:206005
交易代码:206005
基金运作方式:契约型开放式

主要财务指标
1.本期已实现收益: -393,680.23
2.本期利润: -36,375,891.86
3.加权平均基金份额本期利润: -0.1062

业绩比较基准
上证民营企业50指数收益率*95%+银行活期存款利率*5%
风险收益特征
本基金股票型基金,其预期的风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。

基金经理小简历
姓名:方南
职务:基金经理
任职日期:2010年8月5日
证券从业年限:9

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:2012年1月18日

基金管理人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。

除包含经济增长模式转变及货币政策等原因外,未来中国经济增速在一定程度上放缓是个大概率事件,这也会对股市的估值产生负面影响,因此,基金管理人认为,中长期来看,未来市场的超额收益在很大程度上取决于企业盈利改善带来的估值修复和盈利效率的提升,这类公司值得关注。

§5 投资组合报告
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

§6 投资组合报告
6.1 报告期末基金资产组合情况
6.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
6.3 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

§7 开放式基金份额变动
报告期末基金份额总额:338,252,821.25份
本报告期间基金份额净增加:60,500,000.00

§8 基金管理人报告
8.1 基金经理小简历
8.2 基金经理小简历
8.3 基金经理小简历

§9 基金产品概况
基金名称:鹏华动力增长混合(L0F)(场内简称:鹏华动力)
基金代码:160610
交易代码:160610
基金运作方式:上市型开放式基金

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:2012年1月18日

基金管理人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。
基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年1月16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。

基金产品概况
基金名称:鹏华动力增长混合(L0F)(场内简称:鹏华动力)
基金代码:160610
交易代码:160610
基金运作方式:上市型开放式基金

主要财务指标
1.本期已实现收益: -247,576,748.72
2.本期利润: -449,490,480.31
3.加权平均基金份额本期利润: -0.0724

业绩比较基准
沪深300指数收益率*70%+中证综合债指数收益率*30%
风险收益特征
本基金属于混合型“稳健”基金,其预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金,高于债券型基金、货币市场基金。

基金经理小简历
姓名:方南
职务:基金经理
任职日期:2010年7月26日
证券从业年限:9

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:2012年1月18日

基金管理人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。