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
送出日期:2013年3月29日

普丰证券投资基金

2012 年度 报告摘要

2012年12月31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。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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年3月26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。
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。
普华永道中天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2012年1月1日起至2012年12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	鹏华普丰封闭
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
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
报告期末基金份额总额	3,000,000,000.00份
基金合同存续期	至2014年7月14日止
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	1999年7月30日

注:本基金在交易所行情系统净值提示等其他信息披露场合下,可简称为"基金普丰"。

2.2 基金产品说明

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。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张戈	赵会军
	联系电话	0755-82825720	010-66105799
	电子邮箱	zhangge@phfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4006788999	95588
传真		0755-82021126	010-66105798

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 北京市西城区复兴门内大街55号中国工商银行股份有限公司

§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	2012年	2011年	2010年
本期已实现收益	-263,126,251.17	-311,850,573.26	197,796,154.87
本期利润	52,969,495.71	-796,561,694.69	-189,571,050.77
加权平均基金份额本期利润	0.0177	-0.2655	-0.0632
本期基金份额净值增长率	2.10%	-24.06%	-3.96%
3.1.2 期末数据和指标	2012年末	2011年末	2010年末
期末可供分配基金份额利润	-0.1828	-0.1563	0.0908
期末基金资产净值	2,584,115,292.73	2,531,145,797.02	3,573,707,491.71
期末基金份额净值	0.8614	0.8437	1.1912

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)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。

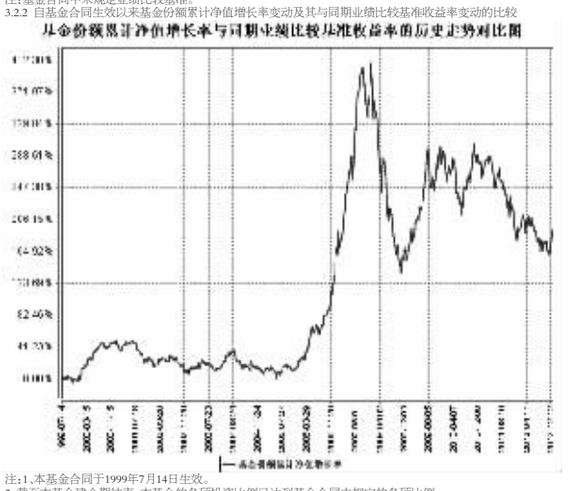
3.2 基金净值表现

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	7.06%	2.30%	-	-	-	-
过去六个月	0.34%	2.28%	-	-	-	-
过去一年	2.10%	2.13%	-	-	-	-
过去三年	-25.53%	2.18%	-	-	-	-
过去五年	-39.17%	2.76%	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	193.45%	2.49%	-	-	-	-

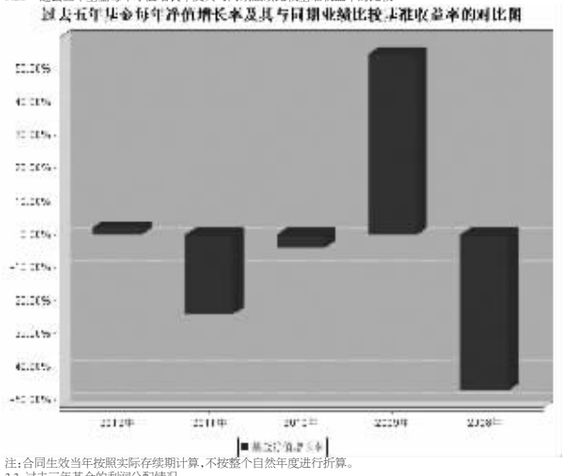
注:基金合同中未规定业绩比较基准。

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 过去五年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: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
2012	-	-	-	-	
2011	0.820	246,000,000.00	-	246,000,000.00	
2010	2.300	690,000,000.00	-	690,000,000.00	
合计	3.120	936,000,000.00	-	936,000,000.00	

§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、31只开放式基金和6只社保组合,经过14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		
吴昱村	本基金基金经理	2009年7月14日	-	8	吴昱村先生,国籍中国,管理学硕士,8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

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基金合同的约定,本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产,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,本基金运作合规,不存在违反基金合同和损害基金份额持有利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,公司制定了《鹏华基金管理有限公司公平交易管理规定》,将公司所管理的封闭式基金、开放式基金、社保组合、特定客户资产管理组合等不同资产组合的授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动均纳入公平交易管理,在业务流程和岗位职责中制定公平交易的控制规则和控制活动,建立对公平交易的执行、监督及审核流程,严禁在不同投资组合之间进行利益输送。

在投资研究环节:1、公司使用唯一的研究报告发布平台"研究报告管理平台",确保各投资组合在获得投资信息、研究支持、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会;2、公司严格按照《股票库管理规定》、《信用产品投资管理规定》,执行股票及信用产品出入库及日常维护工作,确保相关证券入库以内容严谨、观点明确的研究报告作为依据;3、在公司股票库基础上,各涉及股票投资的资产组合根据各自的投资目标、投资风格、投资范围和防范关联交易的原则分别建立资产组合股票库,基金经理在股票库基础上根据投资权以及基金合同择股方式构建具体的投资组合;4、严格执行投资授权制度,明确投资决策委员会、分管投资副总裁、基金经理等各主体的职责和权限划分,合理确定基金经理的投资权限,超过投资权限的操作,应严格履行审批程序。

在交易执行环节:1、所有公司管理的资产组合的交易必须通过集中交易室完成,集中交易室负责建立和执行交易分配制度,确保各投资组合享有公平的交易执行机会;2、针对交易所公开竞价交易,集中交易室应严格启用恒生交易系统中的公平交易程序,交易系统则自动启用公平交易功能,由系统按照"未委托数量"的比例对不同资产组合进行委托量的公平分配;如果相关基金经理坚持以不同的价格进行交易,且当前市场价格不能同时满足多个资产组合的指令价格要求时,交易系统自动按照"价格优先"原则进行委托;当市场价格同时满足多个资产组合的指令价格要求时,则交易系统自动按照"同一指令价格下的公平交易"模式,进行公平委托和交易量分配;3、银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易需依据公司《股票投资交易流程》和《固定收益投资管理流程》的规定执行;银行间市场交易、交易所大宗交易等以公司名义进行的交易,各投资组合经理应在交易前独立确定各投资组合的交易价格和数量,公司按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配;4、新股、新债申购及非公开定向增发交易需依据公司《新股申购流程》、《固定收益投资管理流程》和《非公开定向增发流程》的规定执行,对新股和新债申购方案和分配过程进行审核和监控。

在交易监控、分析与评估环节:1、为加强对日常投资交易行为的监控和管理,杜绝利益输送、不公平交易等违规交易行为,防范日常交易风险,公司明确了关注类交易的界定及对应的监控和评估措施机制:所监控的交易包括但不限于:交易所公开竞价交易中同日同向交易的交易时机和交易价差、不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差、关联交易、债券交易收益率偏离度、成交量和成交价格异常、银行间债券交易对手交易等;2、将公平交易作为投资组合业绩归因分析和交易绩效评价的重要关注内容,发现的异常情况由金融工程师进行分析;3、监察稽核部分别于每季度和每年度编写《公平交易执行情况检查报告》,内容包括关注类交易监控执行情况、不同投资组合的整体收益率差异分析和同向交易价差分析;《公平交易执行情况检查报告》需经公司基金经理、督察长和总经理签署。

4.3.2 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。

4.3.3 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。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易次数为3次,主要原因在于指数成份股交易不活跃导致。

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

回顾2012年,宏观经济维持因此前持续紧缩政策而减速的惯性,虽然1、2季度陆续发生了两次降准及降息,但固定资产投资、工业增加值及房地产开工数量等景气指标前三季度仍呈现连续下降状态;至9月起,以铁路基建等为代表的财政投资开始出现显著变松成为经济软着陆的主要支撑力量,10月后宏观经济指标开始表现出了较为明显的触底回升态势,与经济全年呈"U"型的波动相一致,A股市场同样呈现出振荡下跌然后回升的反弹态势,纵观全年,房地产、银行等权重行业的相对收益较为明显。本基金年初较好地捕捉到了早周期行业的投资机会,4季度重仓持有的房地产、汽车及白色家电等行业也有较好表现,但在2季度过早进行加仓并增加对资本品的配置导致全年主动部分净值表现落后于指数部分。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金净值增长率为2.10%,同期上证综指上涨3.17%,深证成指上涨2.22%,沪深300指数上涨7.55%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为2013年宏观经济运行表现整体将好于2012年:(1) 通胀水平处于低位为财政货币政策调整提供了较大的空间,我们看好未来财政政策逆周期调整对稳定经济的作用;(2)对房地产的调控有望从行政化转向市场化与制度化,有助于房地产投资的持续回升;(3)乘用车等行业基本结束去库存周期并重新回到温和增长通道;(4)新型城镇化及经济转型将推动相关政策友好型行业出现快速成长。相应地,我们预计 2013年资本市场表现将好于2012年,强势振荡是全年市场运行的主基调。

综上,我们将维持当前适中的仓位策略,并及时针对3月后宏观经济指标变动适时灵活调整。在行业配置上,我们将继续维持对乘用车、特高压电力设备、白色家电等行业配置,并在此基础上沿以下方向寻找机会并积极反应于组合的调整:(1)地产、银行等估值具有相对优势、景气可望继续改善的行业;(2)与经济结构调整转型、节能减排等紧密相关的环保、清洁能源等行业;以及(3)新型城镇化启动的先导受益行业。

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、专业性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长期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截至本报告期末,本基金已实现收益为-263,126,251.17元,期末基金份额净值0.8614元,不符合利润分配条件,本基金本期将不进行利润分配。

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

2012年,本基金托管人在对普丰证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何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

2012年,普丰证券投资基金的管理人——鹏华基金管理有限公司在普丰证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人依法对鹏华基金管理有限公司编制和披露的普丰证券投资基金2012年年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

普华永道中天会计师事务所有限公司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:普丰证券投资基金
报告截止日:2012年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
资 产:			
银行存款		53,962,991.04	120,051,190.97
结算备付金		1,367,882.23	4,320,076.89
存出保证金		1,733,559.69	2,419,570.10
交易性金融资产		2,523,550,228.51	2,401,733,760.88
其中:股票投资		2,003,297,588.81	1,836,781,642.28
基金投资		-	-
债券投资		520,252,639.70	564,952,118.60
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		-	27,171,598.71
应收利息		9,236,026.27	9,470,464.86
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		2,589,850,687.74	2,565,166,662.41
负债和所有者权益	附注号	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011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		999,787.73	27,902,933.61
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		2,561,052.09	2,811,339.73
应付托管费		512,210.45	562,267.93
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		1,310,286.74	2,350,266.12
应交税费		2,058.00	2,058.00
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		350,000.00	392,000.00
负债合计		5,735,395.01	34,020,865.39
所有者权益:			
实收基金		3,000,000,000.00	3,000,000,000.00
未分配利润		-415,884,707.27	-468,854,202.98
所有者权益合计		2,584,115,292.73	2,531,145,797.02
负债和所有者权益总计		2,589,850,687.74	2,565,166,662.41

注:报告截止日2012年12月31日,基金份额净值0.8614元,基金份额总额3,000,000,000.00份

7.2 利润表
会计主体:普丰证券投资基金
本报告期:2012年1月1日至2012年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
一、收入		102,745,956.35	-728,758,805.86
1.利息收入		19,596,770.32	21,595,293.85
其中:存款利息收入		1,015,277.05	897,006.91
债券利息收入		18,581,493.27	20,673,799.41
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	24,487.53
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-232,989,873.12	-265,643,230.00
其中:股票投资收益		-258,283,968.69	-277,339,386.02
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-84,359.97	-7,189,483.71
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		25,378,455.54	18,885,639.73
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		316,095,746.88	-484,711,121.43
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		43,312.27	251.72
减:二、费用		49,776,460.64	67,802,888.83
1.管理人报酬	7.4.7.2.1	31,562,028.20	39,645,365.92
2.托管费	7.4.7.2.2	6,312,405.70	7,929,073.11
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		11,421,294.84	18,999,383.68
5.利息支出		-	11,965.28
其中:卖出回购金融资产支出		-	11,965.28
6.其他费用		480,731.90	1,217,100.84
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		52,969,495.71	-796,561,694.69
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		52,969,495.71	-796,561,694.69

7.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:普丰证券投资基金
本报告期:2012年1月1日至2012年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012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)	3,000,000,000.00	-468,854,202.98	2,531,145,797.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	52,969,495.71	52,969,495.71
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)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金分配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)	3,000,000,000.00	-415,884,707.27	2,584,115,292.73
项目	上年度可比期间 2011年1月1日至2011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)	3,000,000,000.00	573,707,491.71	3,573,707,491.71
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-796,561,694.69	-796,561,694.69
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)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金分配持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-246,000,000.00	-246,000,000.00
五、期末所有者权益(基金净值)	3,000,000,000.00	-468,854,202.98	2,531,145,797.02

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 毕国强 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

普丰证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(证监基字[1999]20号文)批准于1999年7月14日募集设立。本基金为契约型封闭式,存续期15年,发行规模为30亿份基金单位。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。《普丰证券投资基金招募说明书》、《普丰证券投资基金基金合同》等文件已按规定报送中国证监会备案。本基金经深圳证券交易所(以下简称深交所)深证上[1999]63号文审核同意,于1999年7月 30日在深交所挂牌交易。

根据《证券投资基金法》及相关法律法规以及《普丰证券投资基金基金合同》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,包括国内依法公开发行上市的股票、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具,其中基金资产的50%以指数化形式、按中证指数有限公司编制的沪深300指数股票构成及配比例投资,另50%可以投资于深沪两市绩优股、成长股和具有良好发展前景的股票以及债券;债券投资中国债投资不低于基金资产的20%。

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》、《普丰证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注所列示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2012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2012年12月31日的财务状况以及2012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	基金发起人、基金管理人
中国工商银行股份有限公司(中国工商银行")	基金托管人
国信证券股份有限公司(国信证券")	基金发起人、基金管理人的股东
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
方正证券有限责任公司(方正证券")	基金发起人
安徽国元信托有限责任公司(安徽国元信托")	基金发起人
安信信托股份有限公司(安信信托")	基金发起人

注:1、本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的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

7.4.7.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年12月31日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国信证券	420,574,441.69	5.56%	264,998,935.19	2.13%

7.4.7.1.2 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年12月31日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
国信证券	-	-	3,461,198.60	2.68%

7.4.7.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比较期间未通过关联方交易单元发生债券回购交易。

7.4.7.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比较期间未通过关联方交易单元发生权证交易。

7.4.7.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国信证券	362,475.16	5.60%	6,600.37	0.50%
关联方名称	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国信证券	223,239.36	2.15%	77,618.95	3.30%

注:(1)佣金的计算公式

上海证券交易所的交易佣金=买(卖)成交金额×1‰-买(卖)经手费-买(卖)证管费

深圳证券交易所的交易佣金=买(卖)成交金额×1‰-买(卖)经手费-买(卖)证管费

(佣金比率按照与一般证券公司签订的协议条款订立。)

(2)本基金与关联方已按同业统一的基金佣金计算方式和佣金比例签订了《证券交易席位租用协议》。根据协议规定,上述单位定期或不定期地为我公司提供研究服务以及其他研究支持。

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 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	31,562,028.20	39,645,365.92

注:支付基金管理人鹏华基金的管理人报酬按前一日基金资产净值1.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日管理费=前一日基金资产净值×1.25% / 当年天数。

7.4.7.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	6,312,405.70	7,929,073.11

注:支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为: 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

本基金本报告期及上年度可比较期间没有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

份额单位:份

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
基金合同生效日(1999年7月14日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	3,750,000.00	3,750,000.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	3,750,000.00	3,750,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.13%	0.13%

注:本基金管理人投资本基金的费率标准与其他相同条件的投资者适用的费率标准相一致。

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

份额单位:份

关联方名称	本期末 2012年12月31日		上年度末 2011年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
国信证券	7,500,000.00	0.25%	7,500,000.00	0.25%
安徽国元信托	1,875,000.00	0.06%	1,875,000.00	0.06%
方正证券	1,875,000.00	0.06%	1,875,000.00	0.06%

注:(1)安徽国元信托与方正证券为本基金发起人。

(2)关联方投资本基金为基金发行期间按统一认购费率认购。

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 2012年1月1日至2012年12月31日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011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
中国工商银行	53,962,991.04	959,505.51	120,051,190.97	813,205.02

7.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未参与关联方承销的证券。

7.4.8 期末(2012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,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的债券及权证。

7.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000002	万 科A	2012年12月26日	重大事项停牌	10.12	2013年1月21日	11.13	1,738,920	12,175,925.77	17,597,870.40	-
000527	美的电器	2012年8月27日	资产重组	9.66	-	-	334,854	3,929,769.58	3,234,689.64	-
600100	同方股份	2012年12月27日	股权收购	7.48	2013年1月10日	7.90	285,231	2,041,874.59	2,133,527.88	-
601618	中国中冶	2012年12月28日	股权转让	2.26	2013年1月4日	2.33	875,862	3,275,250.59	1,979,448.12	-

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,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余额。

7.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末,本基金没有从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

§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	2,003,297,588.81	77.35
	其中:股票	2,003,297,588.81	77.35
2	固定收益投资	520,252,639.70	20.09
	其中:债券	520,252,639.70	20.09
	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	55,330,873.27	2.14
6	其他各项资产	10,969,585.96	0.42
7	合计	2,589,850,687.74	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 期末指数投资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	5,426,932.40	0.21
B	采掘业	89