

鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF)

2012 第一季度 报告

2012年3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4月24日

\$1 重要提示

基金管理人的董事及高级管理人员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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2012年4月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金经理通过基金合同规定的途径和方式向基金份额持有人进行信息披露，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。投资须谨慎，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。

本报告期中财务资料未经审计。

本报告期自2012年1月1日起至3月31日止。

\$2 基金产品概况

鹏华沪深300指数(LOF)

基金代码 160615

交易代码 160615

基金运作方式 上市契约型开放式

基金合同生效日 2009年4月3日

报告期末基金份额总额 746,518,774.49份

投资目标 采用指数化投资方法，追求基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间的差距最小化，力求在长期的跟踪控制在0.35%以内，实现对沪深300指数的跟踪。

投资策略 本基金采取被动型指数化投资组合，根据指数的成分股及权重的变动情况，通过定期调整和部分更换，增减、分仓等手段，以及因当期市场变化调整和部分发生新股、增发、分派等变化时，或因基金的申赎和分红等对基金的跟踪的指数的成份股可能影响时，或因某些特殊情况下导致流动性不足时，或因其他导致无法以恢复复制和跟踪的指数的，基金管理人可以对投资组合进行适当调整和调整，以达到基金的生产率和投资效率，使投资组合能把握在限制的范围内。

业绩比较基准 沪深300指数*95%+银行同业存款利率*5%

风险收益特征 本基金主要采用指数化操作的股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合基金，其风险、较低收益高于股票型基金。

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

注:本基金在交易所行情系统净值提示等信息披露后,简称“鹏华300”。

\$3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币

主要财务指标 报告期(2012年1月1日-2012年3月31日)

1.本期已实现收益 -13,354,366.82

2.本期利润 25,007,375.27

3.加权平均基金份额本期利润 0.0338

4.期末基金资产净值 650,248,306.13

5.期末基金份额净值 0.971

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.上述基金业绩指标包括持有人认购或交易本基金的各项费用,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以列示。

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 业绩比较基准收益率② 收益率差额③ ①-③ ②-④

过去三个月 4.310% 1.44% 4.46% 1.44% -0.15% 0.00%

注:本基金300指数*95%+银行同业存款利率*5%

3.2.2 本基金合同生效以来基金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

基金净值增长率变动与同期业绩比较基准收益率变动对比图

注:1.鹏华沪深300指数(LOF)基金合同于2009年4月3日生效。

2.按基金合同规定,截至基金成立后,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。

5.4 营销人员报告

4.1 基金经理(基金经理小组)简介

任本基金的基金经理期限 从证券从业年限 说明

杨靖 2009年4月3日 - 楠信,国籍中国,管理学硕士,12年证券从业经验。曾在长信基金管理有限公司从事研究工作,先后担任研究员、基金经理助理、基金经理,2009年4月3日起担任鹏华国证500开放式基金基金经理,鹏华行业精选基金经理,鹏华新兴产业基金经理,鹏华策略配置基金经理,鹏华沪深300指数基金经理,2009年4月3日起至2009年10月10日担任鹏华深证成份指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2009年4月3日起至2009年10月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2009年4月3日起至2010年1月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2010年4月3日起至2010年10月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2010年4月3日起至2010年10月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2010年4月3日起至2011年1月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2011年4月3日起至2011年10月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2011年4月3日起至2012年1月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2012年4月3日起至2012年10月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2012年4月3日起至2013年1月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2013年4月3日起至2013年10月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2013年4月3日起至2014年1月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2014年4月3日起至2014年10月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2014年4月3日起至2015年1月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2015年4月3日起至2015年10月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2015年4月3日起至2016年1月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2016年4月3日起至2016年10月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2016年4月3日起至2017年1月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2017年4月3日起至2017年10月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2017年4月3日起至2018年1月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2018年4月3日起至2018年10月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2018年4月3日起至2019年1月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2019年4月3日起至2019年10月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2019年4月3日起至2020年1月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2020年4月3日起至2020年10月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2020年4月3日起至2021年1月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2021年4月3日起至2021年10月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2021年4月3日起至2022年1月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2022年4月3日起至2022年10月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2022年4月3日起至2023年1月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2023年4月3日起至2023年10月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2023年4月3日起至2024年1月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2024年4月3日起至2024年10月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2024年4月3日起至2025年1月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2025年4月3日起至2025年10月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2025年4月3日起至2026年1月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2026年4月3日起至2026年10月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2026年4月3日起至2027年1月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2027年4月3日起至2027年10月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2027年4月3日起至2028年1月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2028年4月3日起至2028年10月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2028年4月3日起至2029年1月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2029年4月3日起至2029年10月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2029年4月3日起至2030年1月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2030年4月3日起至2030年10月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2030年4月3日起至2031年1月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2031年4月3日起至2031年10月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2031年4月3日起至2032年1月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2032年4月3日起至2032年10月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2032年4月3日起至2033年1月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2033年4月3日起至2033年10月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2033年4月3日起至2034年1月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2034年4月3日起至2034年10月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2034年4月3日起至2035年1月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2035年4月3日起至2035年10月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2035年4月3日起至2036年1月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2036年4月3日起至2036年10月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2036年4月3日起至2037年1月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2037年4月3日起至2037年10月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2037年4月3日起至2038年1月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2038年4月3日起至2038年10月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2038年4月3日起至2039年1月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2039年4月3日起至2039年10月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2039年4月3日起至2040年1月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2040年4月3日起至2040年10月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2040年4月3日起至2041年1月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2041年4月3日起至2041年10月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2041年4月3日起至2042年1月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2042年4月3日起至2042年10月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2042年4月3日起至2043年1月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2043年4月3日起至2043年10月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2043年4月3日起至2044年1月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2044年4月3日起至2044年10月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2044年4月3日起至2045年1月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2045年4月3日起至2045年10月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2045年4月3日起至2046年1月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2046年4月3日起至2046年10月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2046年4月3日起至2047年1月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2047年4月3日起至2047年10月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2047年4月3日起至2048年1月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2048年4月3日起至2048年10月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2048年4月3日起至2049年1月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2049年4月3日起至2049年10月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2049年4月3日起至2050年1月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2050年4月3日起至2050年10月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2050年4月3日起至2051年1月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2051年4月3日起至2051年10月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2051年4月3日起至2052年1月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2052年4月3日起至2052年10月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2052年4月3日起至2053年1月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2053年4月3日起至2053年10月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2053年4月3日起至2054年1月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2054年4月3日起至2054年10月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2054年4月3日起至2055年1月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2055年4月3日起至2055年10月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2055年4月3日起至2056年1月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2056年4月3日起至2056年10月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2056年4月3日起至2057年1月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2057年4月3日起至2057年10月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2057年4月3日起至2058年1月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2058年4月3日起至2058年10月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2058年4月3日起至2059年1月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2059年4月3日起至2059年10月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2059年4月3日起至2060年1月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2060年4月3日起至2060年10月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2060年4月3日起至2061年1月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2061年4月3日起至2061年10月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2061年4月3日起至2062年1月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2062年4月3日起至2062年10月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2062年4月3日起至2063年1月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2063年4月3日起至2063年10月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2063年4月3日起至2064年1月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2064年4月3日起至2064年10月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2064年4月3日起至2065年1月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2065年4月3日起至2065年10月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2065年4月3日起至2066年1月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2066年4月3日起至2066年10月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2066年4月3日起至2067年1月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2067年4月3日起至2067年10月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2067年4月3日起至2068年1月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2068年4月3日起至2068年10月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2068年4月3日起至2069年1月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2069年4月3日起至2069年10月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2069年4月3日起至2070年1月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2070年4月3日起至2070年10月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2070年4月3日起至2071年1月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2071年4月3日起至2071年10月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2071年4月3日起至2072年1月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2072年4月3日起至2072年10月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2072年4月3日起至2073年1月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2073年4月3日起至2073年10月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2073年4月3日起至2074年1月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2074年4月3日起至2074年10月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2074年4月3日起至2075年1月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,鹏华策略配置型基金基金经理,2075年4月3日起至2075年10月10日担任鹏华沪深300指数基金经理,