

鹏华盛世创新股票型证券投资基金（LOF） 2010 年年度报告

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 重要提示及目录

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。

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。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
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.....	15
§6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息.....	15
6.2 审计报告的基本内容.....	15
§7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表.....	16
7.2 利润表.....	17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
7.4 报表附注.....	19
§8 投资组合报告	40
8.1 期末基金资产组合情况.....	40
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	40
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	41
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	42
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	47
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.....	47
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	47
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.....	47

8.9 投资组合报告附注	47
§9 基金份额持有人信息.....	48
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	48
9.2 期末上市基金前十名持有人	48
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	49
§10 开放式基金份额变动.....	49
§11 重大事件揭示.....	49
11.1 基金份额持有人大会决议	49
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	49
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	50
11.4 基金投资策略的改变	50
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	50
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	50
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	50
11.8 其他重大事件	51
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	57
§13 备查文件目录.....	58
13.1 备查文件目录	58
13.2 存放地点	58
13.3 查阅方式	58

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华盛世创新股票型证券投资基金（LOF）
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
注册地址	深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心第43层	北京市西城区金融街25号
办公地址	深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心第43层	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码	518048	100033
法定代表人	何如	郭树清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所	北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼（即东三办公楼）16层
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

§ 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
本期加权平均净值利润率	-14.19%	43.31%	1.39%
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
期末可供分配利润	179,710,275.19	226,624,781.78	4,560,795.06
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
3.1.3 累计期末指标	2010 年末	2009 年末	2008 年末
基金份额累计净值增长率	60.11%	72.86%	1.60%

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）期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润期末余额和未分配利润中已实现部分的期末余额的孰低数。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

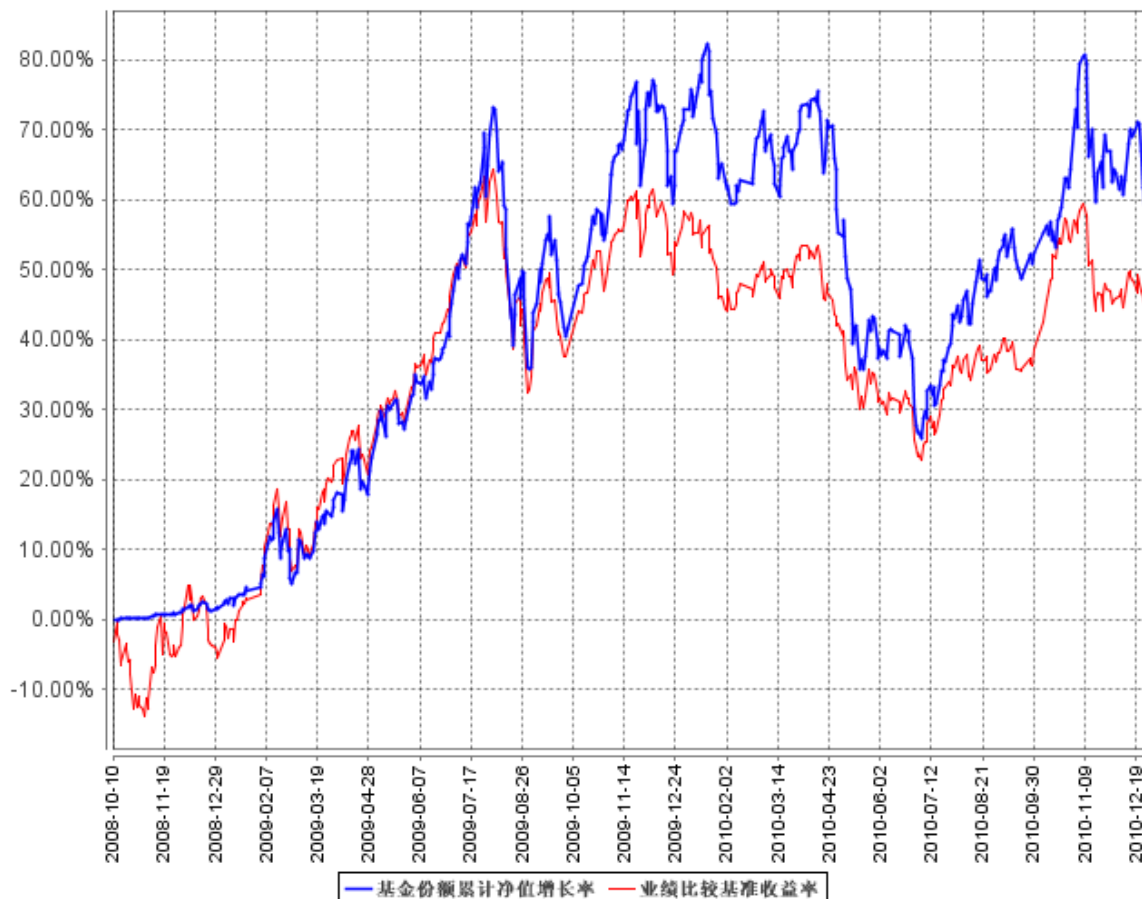
整体价格变动趋势，因此选择该指数作为衡量基金债券投资部分的业绩比较基准。

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

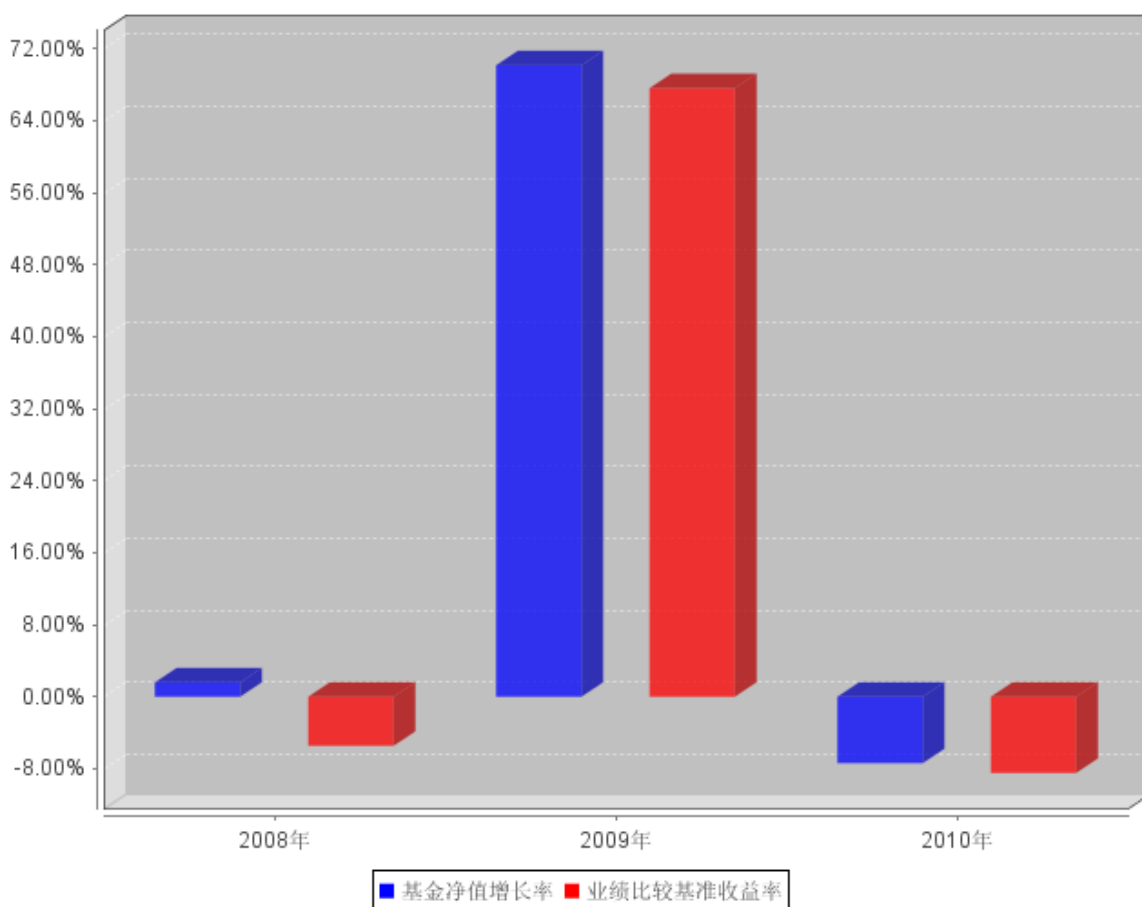


注：1、业绩比较基准为“沪深 300 指数收益率×75%+中证综合债指数收益率×25%”。

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

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对比图



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合规守信情况的说明

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，本基金延续第三季度的思路，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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人努力推动以风险管理为导向的全面内控体系建设，着重开展了以下各项工作：

1、继续完善内部控制体系

监察稽核部从政策手册、标准化操作流程手册、岗位手册和管理规定四个层面逐步建立公司内控体系，不断完善公司的风险控制矩阵和岗位职能矩阵，加强了在目标设定、风险识别、风险分析和应对等风险评估的方法和手段。

2、继续优化内部控制措施

2010 年，公司继续完善公司内控体系，制定、颁布和更新了公司基本管理规定，完成了登记结算标准化操作流程的梳理，通过信息技术手段陆续实现了部分标准化操作流程手册的系统化。

3、持续改进投资监控的方法与手段，保证基金投资业务的合法合规性

2010 年，公司继续完善电子化投资交易监控系统功能，运用信息技术手段实现投资比例监控、股票库管理、交叉交易管理、公平交易管理等合规监控事项，有效保证了本基金的合法合规运作，本报告期内被动违规的及时进行了调整，未出现主动违规行为。

4、规范基金销售业务，保证基金销售业务的合法合规性

2010 年，在基金募集和持续营销活动中，公司严格规范基金销售业务，按照《证券投资基金销售管理办法》及相关法规规定审查宣传推介材料，逐步落实反洗钱法律法规各项要求，并督促销售部门做好投资者教育工作，本报告期内没有出现主动违规行为。

5、开展以风险为导向的内部稽核

本报告期内，监察稽核部开展了对基金投资管理、市场营销管理和公司日常运作的定期监察稽核与专项监察稽核。监察稽核人员开展了以风险为导向的内部稽核，通过稽核发现，提高了公司标准化操作流程手册的执行效力，优化了标准化操作流程手册，更新了风险控制矩阵，本报告期内公司没有发生重大风险事件。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.7.1 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：

4.7.1.1 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。

4.7.1.2 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。

4.7.2 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。

4.7.3 本公司参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.7.4 本公司现没有进行任何定价服务的签约。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

4.8.1 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。

4.8.2 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关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

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明(2011)审字第 60468989_H03 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	鹏华盛世创新股票型证券投资基金（LOF）全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的鹏华盛世创新股票型证券投资基金（LOF）的财务报表，包括 2010 年 12 月 31 日的资产负债表，2010 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是鹏华盛世创新股票型证券投资基金（LOF）基金管理人鹏华基金管理有限公司的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
审计意见段	我们认为，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了鹏华盛世创新股票型证券投资基金（LOF）2010 年 12 月 31 日的财务状况以及 2010 年度的经营成果和净值

	变动情况。
注册会计师的姓名	张小东 周刚
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城安永大楼（即东三办公楼）16 层
审计报告日期	2011 年 3 月 25 日

§ 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	7.4.7.1	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	7.4.7.2	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	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	7.4.7.6	-	-
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	7.4.7.3	-	-
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	7.4.7.7	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	7.4.7.8	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	7.4.7.9	446,217,471.64	422,703,765.25
未分配利润	7.4.7.10	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	7.4.7.11	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	7.4.7.12	-78,950,726.94	139,167,595.73
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	1,661,430.00
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	5,775,207.56	1,669,111.88
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-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）	7.4.7.17	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	7.4.10.2.1	13,506,200.56	6,209,992.55
2. 托管费	7.4.10.2.2	2,251,033.42	1,034,998.74
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	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	7.4.7.19	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：

<u> 邓召明 </u>	<u> 胡湘 </u>	<u> 刘慧红 </u>
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如财务报表附注 7.4.4 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 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 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本报告期为 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记帐本位币，除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

7.4.4.3.1 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前持有的股票投资、债券投资和衍生工具（主要为权证投资）分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

7.4.4.3.2 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

7.4.4.4.1 金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，应当单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

7.4.4.4.2 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

7.4.4.4.3 当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

7.4.4.4.4 本基金金融工具的成本计价方法具体如下：

7.4.4.4.4.1 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账。

因股权分置改革而获得非流通股股东支付的现金对价，于股权分置改革方案实施后的股票复牌日，冲减股票投资成本。

卖出股票于成交日确认股票投资收益，出售股票的成本按移动加权平均法于成交日结转。

7.4.4.4.2 债券投资

买入证券交易所交易的债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本。

买入未上市债券和银行间同业市场交易的债券，于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按实际成交价款入账，应支付的相关交易费用直接计入当期损益。其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本。

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限计算应收利息，并按上述会计处理方法核算。

卖出证券交易所交易和银行间同业市场交易的债券均于成交日确认债券投资收益。

卖出债券的成本按移动加权平均法结转。

7.4.4.4.3 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账。

配股权证及由股权分置改革而被动获得的权证，在确认日记录所获分配的权证数量，该等权证初始成本为零。

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，出售权证的成本按移动加权平均法于成交日结转。

7.4.4.4.4 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本。

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述 7.4.4.4.2 和 7.4.4.4.3 中的相关方法进行计算。

7.4.4.4.5 回购协议

基金持有的回购协议（封闭式回购）以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期间内逐日计提利息。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具（主要为权证投资）按如下原则确定公允价值并

进行估值：

存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

本基金以上述原则确定的公允价值进行估值，本基金主要金融工具的估值方法如下：

7.4.4.5.1 上市证券的估值

7.4.4.5.1.1 交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

7.4.4.5.1.2 交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

7.4.4.5.1.3 交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

7.4.4.5.1.4 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

7.4.4.5.2 未上市证券的估值

7.4.4.5.2.1 送股、转增股、公开增发新股或配股的股票，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值，即依照上述 7.4.4.5.1.1 和 7.4.4.5.1.4 的相关方法进行估值。

7.4.4.5.2.2 首次公开发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

7.4.4.5.2.3 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值，即依照上述 7.4.4.5.1.1 和 7.4.4.5.1.4 的相关方法进行估值。

7.4.4.5.2.4 非公开发行有明确锁定期的股票的估值

估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价低于非公开发行股票初始取得成本时，应采用在证券交易所的同一股票的市价作为估值日该非公开发行股票的价值。

估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价高于非公开发行股票初始取得成本时，应按中国证监会相关规定处理。

7.4.4.5.2.5 在银行间同业市场交易的债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

7.4.4.5.2.6 因持有股票而享有的配股权证，采用估值技术确定公允价值进行估值。

7.4.4.5.3 分离交易可转债

分离交易可转债，上市日前，采用估值技术分别对债券和权证进行估值；自上市日起，上市流通的债券和权证分别按上述 7.4.4.5.1 中的相关方法进行估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例

计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

基金管理人的管理人报酬根据《鹏华盛世创新股票型证券投资基金（LOF）基金合同》的规定按基金资产净值的 1.50%的年费率逐日计提。

基金托管人的托管费根据《鹏华盛世创新股票型证券投资基金（LOF）基金合同》的规定按基金资产净值的 0.25%的年费率逐日计提。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

- (1) 本基金的每份基金份额享有同等分配权；
- (2) 基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值；
- (3) 收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担；
- (4) 本基金收益每年最多分配 12 次，每次分配比例不低于符合上述基金分红条件的可分配收益的 50%；
- (5) 本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；场内认购、申购和上市交易的基金份额的分红方式为现金红利，投资

人不能选择其他的分红方式，具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

(6) 基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；

(7) 基金当年收益应先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配；

(8) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年至少分配一次，但若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配；

(9) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

7.4.4.12.1 计量属性

本基金除特别说明对金融资产和金融负债采用公允价值等作为计量属性之外，一般采用历史成本计量。

7.4.4.12.2 重要会计估计及其关键假设

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

7.4.4.12.2.1 对于特殊事项停牌股票，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》，本基金采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票估值，通过停牌股票所处行业的行业指数变动以大致反映市场因素在停牌期间对于停牌股票公允价值的影响。上述指数收益法的关键假设包括所选取行业指数的变动能在重大方面基本反映停牌股票公允价值的变动，停牌股票的发行者在停牌期间的各项变化未对停牌股票公允价值产生重大影响等。

7.4.4.12.2.2 对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会基金部通知[2006]37号《关于进一步加强基金投资非公开发行股票风险控制有关问题的通知》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

7.4.4.12.2.3 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参

数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期没有发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期没有发生会计估计变更。

7.4.5.3 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 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]11号《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]103号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2007]84号《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

7.4.6.1 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。

7.4.6.2 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。

7.4.6.3 对基金取得的企业债券利息收入,由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴20%的个人所得税,暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入,由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按50%计入个人应纳税所得额,依照现行税法规定即20%代扣代缴个人所得税,暂不征收企业所得税。

7.4.6.4 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.6.5 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
活期存款	35,945,837.94	43,108,161.63
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	35,945,837.94	43,108,161.63

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2010年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	635,883,359.27	657,956,950.30	22,073,591.03
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	635,883,359.27	657,956,950.30	22,073,591.03
项目	上年度末 2009年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	602,313,613.91	656,427,399.24	54,113,785.33
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	602,313,613.91	656,427,399.24	54,113,785.33

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

截至本报告期末 2010 年 12 月 31 日止，本基金未持有衍生金融资产和衍生金融负债（2009 年：同）。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

截至本报告期末 2010 年 12 月 31 日止，本基金没有买入返售金融资产余额（2009 年：同）。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期内没有进行买断式逆回购交易（2009 年：同）。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 12 月 31 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	10,388.55	15,100.48
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	712.14	1,346.07
应收债券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
其他	-	-
合计	11,100.69	16,446.55

7.4.7.6 其他资产

截至本报告期末 2010 年 12 月 31 日止，本基金未持有其他资产余额（2009 年：同）。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 12 月 31 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	721,916.74	1,435,803.32
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	721,916.74	1,435,803.32

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 12 月 31 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	269.60	30,352.00
预提费用	100,000.00	100,000.00
合计	100,269.60	130,352.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	422,703,765.25	422,703,765.25
本期申购	750,502,609.84	750,502,609.84
本期赎回（以“-”号填列）	-726,988,903.45	-726,988,903.45
本期末	446,217,471.64	446,217,471.64

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	226,624,781.78	61,271,671.01	287,896,452.79
本期利润	-95,384,473.99	-32,040,194.30	-127,424,668.29
本期基金份额交易产生的变动数	48,469,967.40	39,807,633.52	88,277,600.92
其中：基金申购款	370,911,442.33	119,091,453.64	490,002,895.97
基金赎回款	-322,441,474.93	-79,283,820.12	-401,725,295.05
本期已分配利润	-	-	-
本期末	179,710,275.19	69,039,110.23	248,749,385.42

7.4.7.11 存款利息收入

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
	活期存款利息收入	644,891.32
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	30,918.67	29,153.00
其他	67,636.64	57,276.90
合计	743,446.63	479,897.36

注：其他为申购款利息收入

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

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
卖出股票成交总额	2,570,969,043.72	2,586,271,378.96
减：卖出股票成本总额	2,649,919,770.66	2,447,103,783.23
买卖股票差价收入	-78,950,726.94	139,167,595.73

7.4.7.13 债券投资收益

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
卖出债券（债转股及债券到 期兑付）成交总额	-	99,208,399.87
减：卖出债券（债转股及债 券到期兑付）成本总额	-	96,430,000.00
减：应收利息总额	-	1,116,969.87
债券投资收益	-	1,661,430.00

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期没有发生衍生工具收益的买卖权证差价收入（2009年：同）。

7.4.7.15 股利收益

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
股票投资产生的股利收益	5,775,207.56	1,669,111.88
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	5,775,207.56	1,669,111.88

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	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
1. 交易性金融资产	-32,040,194.30	51,867,272.66
——股票投资	-32,040,194.30	53,827,272.66

——债券投资	-	-1,960,000.00
——资产支持证券投资	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	-32,040,194.30	51,867,272.66

7.4.7.17 其他收入

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
基金赎回费收入	1,065,585.68	1,256,801.43
印花税返还	22.73	-
转换费收入	203,056.97	77,087.49
合计	1,268,665.38	1,333,888.92

7.4.7.18 交易费用

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
交易所市场交易费用	7,972,889.52	8,315,218.57
银行间市场交易费用	-	550.00
合计	7,972,889.52	8,315,768.57

7.4.7.19 其他费用

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
审计费用	100,000.00	100,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
上市年费	60,000.00	60,000.00
其他费用	-	-
帐户维护费	18,000.00	16,500.00
银行费用	12,943.12	17,131.51
合计	490,943.12	493,631.51

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2010年1月1日至2010年12月31日	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。

7.4.10.3 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 年末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2010年1月1日至2010年12月31日		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

7.4.10.6 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。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2010年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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。

7.4.12.2 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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 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。

7.4.12.3.2 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型证券投资基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人致力于全面内部控制体系的建设，建立了从董事会层面到各业务部门的风险管理组织架构。本基金的基金管理人在董事会下设风险控制和合规审计委员会，主要负责制定基金管理人风险控制战略和控制政策、协调突发重大风险等事项；督察长负责对基金管理人各业务环节合法合规运作进行监督检查，组织、指导基金管理人内部监察稽核工作，并可向董事会和中国证监会直接报告；在公司内部设立独立的监察稽核部，专职负责对基金管理人各部门、各业务的风险控制情况进行督促和检查，并适时提出整改建议。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2010 年 12 月 31 日，本基金未持有信用类债券（2009 年 12 月 31 日：未持有）。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理职能部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金

管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等，其余大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2010年12月31 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	35,945,837.94	-	-	-	-	-	35,945,837.94
结算备付金	1,849,884.04	-	-	-	-	-	1,849,884.04
存出保证金	-	-	-	-	-	17,237.17	17,237.17
交易性金融资产	-	-	-	-	-	657,956,950.30	657,956,950.30
应收利息	-	-	-	-	-	11,100.69	11,100.69
应收申购款	1,228,744.15	-	-	-	-	-	1,228,744.15
资产总计	39,024,466.13	-	-	-	-	657,985,288.16	697,009,754.29
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	74,405.24	74,405.24
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	982,547.69	982,547.69

应付托管费	-	-	-	-	-	163,757.96	163,757.96
应付交易费用	-	-	-	-	-	721,916.74	721,916.74
其他负债	-	-	-	-	-	100,269.60	100,269.60
负债总计	-	-	-	-	-	2,042,897.23	2,042,897.23
利率敏感度缺口	39,024,466.13	-	-	-	-	655,942,390.93	694,966,857.06
上年度末 2009年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	43,108,161.63	-	-	-	-	-	43,108,161.63
结算备付金	3,496,181.04	-	-	-	-	-	3,496,181.04
存出保证金	-	-	-	-	-	707,276.71	707,276.71
交易性金融资产	-	-	-	-	-	656,427,399.24	656,427,399.24
应收利息	-	-	-	-	-	16,446.55	16,446.55
应收申购款	17,704,748.91	-	-	-	-	-	17,704,748.91
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	64,309,091.58	-	-	-	-	657,151,122.50	721,460,214.08
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	8,244,365.93	8,244,365.93
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	899,549.82	899,549.82
应付托管费	-	-	-	-	-	149,924.97	149,924.97
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,435,803.32	1,435,803.32
其他负债	-	-	-	-	-	130,352.00	130,352.00
负债总计	-	-	-	-	-	10,859,996.04	10,859,996.04
利率敏感度缺口	64,309,091.58	-	-	-	-	646,291,126.46	710,600,218.04

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2010年12月31日，本基金未持有交易性债券投资（2009年12月31日：未持有），因此当利率发生合理、可能的变动时，对于本基金资产净值无重大影响（2009年12月31日：同）。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的

影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采取“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产占基金资产的比例为 60%~95%，债券资产占基金资产的比例为 0~35%，权证市值不得超过基金资产净值的 3%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR（Value at Risk）指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 12 月 31 日		上年度末 2009 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	657,956,950.30	94.67	656,427,399.24	92.38
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	657,956,950.30	94.67	656,427,399.24	92.38

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末（2010 年 12 月 31 日）	上年度末（2009 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	增加约 4,025	增加约 3,748
	业绩比较基准下降 5%	下降约 4,025	下降约 3,748

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

公允价值，是指在公平交易中，熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。本基金持有的银行存款、结算备付金、存出保证金、应收款项及其他金融负债等，因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。交易性金融资产的公允价值估值方法，请参见 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则。

本基金采用的公允价值在计量时分为以下层次：第一层次是企业在计量日能获得相同资产或负债在活跃市场上报价的，以该报价为依据确定公允价值；第二层次是企业在计量日能获得类似资产或负债在活跃市场上的报价，或相同或类似资产或负债在非活跃市场上的报价的，以该报价为依据做必要调整确定公允价值；第三层次是企业无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的，以其他反映市场参与者对资产或负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。

截至 2010 年 12 月 31 日及 2009 年 12 月 31 日，本基金持有的金融工具的公允价值计量均属于第一层次或第二层次，无属于第三层次的余额。于 2010 年度及 2009 年度，本基金持有以公允价值计量的金融工具亦无自第三层次的重大转入或转出。

除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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所有股票投资明细

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
11	600855	航天长峰	1,799,898	24,190,629.12	3.48
12	000721	西安饮食	1,999,832	23,738,005.84	3.42
13	000610	西安旅游	2,099,950	23,624,437.50	3.40
14	000982	中银绒业	1,499,942	22,274,138.70	3.21
15	600879	航天电子	1,509,890	20,292,921.60	2.92
16	600765	中航重机	1,000,000	18,940,000.00	2.73
17	600400	红豆股份	2,642,440	18,787,748.40	2.70
18	600151	航天机电	1,419,857	18,671,119.55	2.69
19	600877	中国嘉陵	1,699,993	16,438,932.31	2.37
20	002209	达意隆	999,859	14,018,023.18	2.02
21	000636	风华高科	1,000,000	12,450,000.00	1.79
22	000990	诚志股份	849,935	11,899,090.00	1.71
23	600306	商业城	719,916	10,215,608.04	1.47
24	300015	爱尔眼科	219,920	9,729,260.80	1.40
25	300059	东方财富	179,950	9,582,337.50	1.38
26	600831	广电网络	849,970	8,754,691.00	1.26
27	000564	西安民生	1,000,000	7,820,000.00	1.13
28	000419	通程控股	700,000	7,378,000.00	1.06
29	601369	陕鼓动力	299,950	7,138,810.00	1.03
30	000939	凯迪电力	400,000	6,256,000.00	0.90
31	600893	航空动力	199,910	6,253,184.80	0.90
32	300082	奥克股份	79,950	4,561,947.00	0.66
33	600343	航天动力	150,000	3,765,000.00	0.54
34	600523	贵航股份	149,990	3,587,760.80	0.52
35	002285	世联地产	100,000	3,118,000.00	0.45
36	002315	焦点科技	39,973	3,075,922.35	0.44
37	300133	华策影视	23,879	2,769,964.00	0.40
38	600592	龙溪股份	199,913	2,366,969.92	0.34
39	601179	中国西电	50,000	395,000.00	0.06

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所有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	佣金	占当期佣金	

			成交总额的比 例		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。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
----	------	--------	--------

1	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与邮政储蓄银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2010年1月4日
2	鹏华基金管理有限公司关于增加东兴证券股份有限公司为旗下开放式基金代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2010年1月5日
3	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分开放式基金继续参与湘财证券有限责任公司网上定期定额申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2010年1月7日
4	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与浦发银行电子渠道基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2010年1月8日
5	鹏华基金管理有限公司关于参与深圳发展银行开展的基金定投申购费率优惠推广活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2010年1月18日
6	鹏华基金管理有限公司关于参与深圳发展银行网上银行和电话银行基金申购费率优惠调整活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2010年1月18日
7	鹏华盛世创新股票型证券投资基金（LOF）2009年第四季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2010年1月22日
8	鹏华关于调整旗下开放式基金网上直销定期定额投资申购金额下限的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2010年1月25日
9	鹏华基金管理有限公司关于向中国工商银行借记卡持卡人开通基	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2010年2月9日

	金网上交易直销业务的公告	报》	
10	鹏华基金管理有限公司关于调整旗下开放式证券投资基金转换业务规则的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2010年3月12日
11	鹏华盛世创新股票型证券投资基金（LOF）2009年年度报告摘要	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2010年3月31日
12	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2010年4月1日
13	鹏华基金管理有限公司关于在农业银行开通旗下开放式基金转换业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2010年4月6日
14	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分开放式基金参与东方证券股份有限公司网上交易申购费率优惠的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2010年4月7日
15	鹏华基金管理有限公司关于提醒投资者谨防假冒我公司名义进行非法证券活动的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2010年4月9日
16	鹏华基金管理有限公司关于在浦发银行开通旗下部分开放式基金定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2010年4月9日
17	鹏华基金管理有限公司关于设立武汉分公司的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2010年4月20日
18	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2010年4月21日

	变更的提示性公告	报》	
19	鹏华盛世创新股票型证券投资基金（LOF）2010 年第一季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2010 年 4 月 21 日
20	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2010 年 4 月 28 日
21	鹏华基金管理有限公司关于继续参与深圳发展银行开展的基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2010 年 4 月 30 日
22	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票复牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2010 年 5 月 6 日
23	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票复牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2010 年 5 月 8 日
24	鹏华盛世创新股票型证券投资基金（LOF）更新的招募说明书摘要	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2010 年 5 月 18 日
25	鹏华基金管理有限公司关于向交通银行借记卡持卡人开通基金网上交易直销业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2010 年 5 月 24 日
26	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金在华夏银行开通定投和转换业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2010 年 6 月 28 日
27	鹏华基金管理有限公司关于新增华夏银行为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2010 年 6 月 28 日
28	鹏华基金管理有限公司关于参与	《中国证券报》、《上	2010 年 6 月 30 日

	交通银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告	海证券报》、《证券时报》	
29	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参与邮政储蓄银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2010年6月30日
30	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2010年6月30日
31	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2010年7月1日
32	鹏华基金管理有限公司北京分公司搬迁公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2010年7月9日
33	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购中国农业银行股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2010年7月10日
34	鹏华盛世创新股票型证券投资基金（LOF）2010年第2季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2010年7月19日
35	鹏华基金管理有限公司关于基金经理变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2010年7月26日
36	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票复牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2010年7月27日
37	鹏华基金管理有限公司关于继续	《中国证券报》、《上	2010年7月31日

	参与上海银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告	海证券报》、《证券时报》	
38	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2010年8月3日
39	鹏华盛世创新股票型证券投资基金（LOF）2010年半年度报告摘要	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2010年8月27日
40	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票复牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2010年9月3日
41	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票复牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2010年9月3日
42	关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2010年10月20日
43	鹏华盛世创新股票型证券投资基金（LOF）2010年第3季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2010年10月27日
44	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票复牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2010年10月30日
45	鹏华基金管理有限公司关于设立广州分公司的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2010年11月12日
46	鹏华盛世创新股票型证券投资基金（LOF）更新的招募说明书摘要	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2010年11月24日

47	鹏华基金管理有限公司关于开通开放式基金网上直销第三方支付业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2010 年 12 月 21 日
48	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与工行“2011 倾心回馈”基金定投费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2010 年 12 月 30 日
49	鹏华基金管理有限公司关于参与交通银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2010 年 12 月 31 日
50	鹏华基金管理有限公司关于调整旗下开放式证券投资基金定期定额投资业务最低申购金额的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2010 年 12 月 31 日
51	鹏华基金管理有限公司关于继续参与深圳发展银行开展的基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2010 年 12 月 31 日
52	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与浙商银行开展的网上银行申购和定期定额申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2010 年 12 月 31 日
53	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参与邮政储蓄银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2010 年 12 月 31 日

§ 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。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- （一）《鹏华盛世创新股票型证券投资基金（LOF）基金合同》；
- （二）《鹏华盛世创新股票型证券投资基金（LOF）托管协议》；
- （三）《鹏华盛世创新股票型证券投资基金（LOF）2010 年年度报告》（原文）。

13.2 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。

13.3 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 3 月 29 日