

# 鹏华丰盛稳固收益债券型证券投资基金

## 2012】第二季度报告

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7月19日

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2012年7月17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，保证复核后不存在虚假记载、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。

本报告书内容财务资料未经审计。

本报告书所载数据截止至2012年4月19日。

### § 2 基金产品概况

基金简称:鹏华丰盛债券

基金主代码:206008

交易代码:206008

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2011年4月25日

报告期末基金份额总额:843,309,975.62份

投资目标:在严格控制风险、力争获取超越存款利率的绝对收益。

本基金力争在争取获取超越存款利率的绝对收益，并力争对风险进行有效管理，同时兼顾流动性。

在控制风险方面，本基金将通过投资组合策略对投资进行分散，在此基础上，着重基金管理人自上而下投资能力的发挥，以追求超越基准的绝对收益。

业绩比较基准:三月期银行定期存款(税后)+1.6%

风险收益特征:本基金属于债券型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金、股票型基金，为证券投资基金中的中低风险品种。

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

报告期(2012年4月1日-2012年6月30日)

1.本期已实现收益 16,948,572.95

2.本期利润 46,001,024.98

3.加权平均基金份额本期利润 0.0543

4.期末基金资产净值 909,713,845.91

5.期末基金份额净值 1.078

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 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 收益率差标准差④

过去三个月 5.48% 0.14% 1.62% 0.02% 3.86% 0.12%

注:业比较基准:三月期银行定期存款(税后)+1.6%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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.鹏华丰盛稳固收益债券型证券投资基金基金合同于2011年4月26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助理简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期限 证券从业年限 说明

初冬 本基金基金经理 固定收益部总经理 2011年4月25日 - 16 初冬女士，国籍中国，经济学硕士，16年证券从业经验。曾在平安证券研究所、平安保险投资管理中心等公司从事研究与管理工作。2008年8月至今就职于鹏华基金管理有限公司，历任基金经理、研究员、鹏华丰盛稳固收益债券型证券投资基金基金经理，初冬女士具备基金从业资格。本基金公告内本基金基金经理发生变动。

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，离任日期为从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

2.管理人对报告期内本基金运作无特别情况的说明。

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人利益的行为。

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 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未发生异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内本基金运作无特别情况的说明

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人利益的行为。

4.5 管理人对宏观经济的执行情况

报告期内，本基金未发生违反法规及对基金财产造成损失的异常交易行为，未存在同日反向交易成较短的单边交易超过该股票当日成交量的5%的异常交易行为。

4.6 管理人对报告期内本基金运作无特别情况的说明

报告期内，本基金未发生违反法规及对基金财产造成损失的异常交易行为，未存在同日反向交易成较短的单边交易超过该股票当日成交量的5%的异常交易行为。

4.7 管理人对报告期内本基金运作无特别情况的说明

报告期内，本基金未发生违反法规及对基金财产造成损失的异常交易行为，未存在同日反向交易成较短的单边交易超过该股票当日成交量的5%的异常交易行为。

4.8 报告期内基金的业绩表现

本基金在2011年4月26日-2012年6月30日期间，净值增长率为1.078%，相对业绩基准增长率为1.6%。

4.9 报告期内基金的费用情况

本基金在2011年4月26日-2012年6月30日期间，费用率为0.0543%。

4.10 报告期内基金的利润分配情况

本基金在2011年4月26日-2012年6月30日期间，未进行利润分配。

4.11 报告期内基金的分红情况

本基金在2011年4月26日-2012年6月30日期间，未进行分红。

4.12 报告期内基金的费用调整情况

本基金在2011年4月26日-2012年6月30日期间，未进行费用调整。

4.13 报告期内基金的销售情况

本基金在2011年4月26日-2012年6月30日期间，未进行销售。

4.14 报告期内基金的托管费计提情况

本基金在2011年4月26日-2012年6月30日期间，未进行托管费计提。

4.15 报告期内基金的其他费用情况

本基金在2011年4月26日-2012年6月30日期间，未进行其他费用。

4.16 报告期内基金份额持有人数

本基金在2011年4月26日-2012年6月30日期间，持有人数为1,078人。

4.17 报告期内基金份额持有人户数

本基金在2011年4月26日-2012年6月30日期间，持有人户数为1,078户。

4.18 报告期内基金份额前十名持有人

本基金在2011年4月26日-2012年6月30日期间，未进行前十名持有人。

4.19 报告期内基金份额前十名持有人的名称、持有份额、占总份额比例

本基金在2011年4月26日-2012年6月30日期间，未进行前十名持有人的名称、持有份额、占总份额比例。

4.20 报告期内基金份额前十名持有人的名称、持有份额、占总份额比例

本基金在2011年4月26日-2012年6月30日期间，未进行前十名持有人的名称、持有份额、占总份额比例。

4.21 报告期内基金份额前十名持有人的名称、持有份额、占总份额比例

本基金在2011年4月26日-2012年6月30日期间，未进行前十名持有人的名称、持有份额、占总份额比例。

4.22 报告期内基金份额前十名持有人的名称、持有份额、占总份额比例

本基金在2011年4月26日-2012年6月30日期间，未进行前十名持有人的名称、持有份额、占总份额比例。

4.23 报告期内基金份额前十名持有人的名称、持有份额、占总份额比例

本基金在2011年4月26日-2012年6月30日期间，未进行前十名持有人的名称、持有份额、占总份额比例。

4.24 报告期内基金份额前十名持有人的名称、持有份额、占总份额比例

本基金在2011年4月26日-2012年6月30日期间，未进行前十名持有人的名称、持有份额、占总份额比例。

4.25 报告期内基金份额前十名持有人的名称、持有份额、占总份额比例

本基金在2011年4月26日-2012年6月30日期间，未进行前十名持有人的名称、持有份额、占总份额比例。

4.26 报告期内基金份额前十名持有人的名称、持有份额、占总份额比例

本基金在2011年4月26日-2012年6月30日期间，未进行前十名持有人的名称、持有份额、占总份额比例。

4.27 报告期内基金份额前十名持有人的名称、持有份额、占总份额比例

本基金在2011年4月26日-2012年6月30日期间，未进行前十名持有人的名称、持有份额、占总份额比例。

4.28 报告期内基金份额前十名持有人的名称、持有份额、占总份额比例

本基金在2011年4月26日-2012年6月30日期间，未进行前十名持有人的名称、持有份额、占总份额比例。

4.29 报告期内基金份额前十名持有人的名称、持有份额、占总份额比例

本基金在2011年4月26日-2012年6月30日期间，未进行前十名持有人的名称、持有份额、占总份额比例。

4.30 报告期内基金份额前十名持有人的名称、持有份额、占总份额比例

本基金在2011年4月26日-2012年6月30日期间，未进行前十名持有人的名称、持有份额、占总份额比例。

4.31 报告期内基金份额前十名持有人的名称、持有份额、占总份额比例

本基金在2011年4月26日-2012年6月30日期间，未进行前十名持有人的名称、持有份额、占总份额比例。

4.32 报告期内基金份额前十名持有人的名称、持有份额、占总份额比例

本基金在2011年4月26日-2012年6月30日期间，未进行前十名持有人的名称、持有份额、占总份额比例。

4.33 报告期内基金份额前十名持有人的名称、持有份额、占总份额比例

本基金在2011年4月26日-2012年6月30日期间，未进行前十名持有人的名称、持有份额、占总份额比例。

4.34 报告期内基金份额前十名持有人的名称、持有份额、占总份额比例

本基金在2011年4月26日-2012年6月30日期间，未进行前十名持有人的名称、持有份额、占总份额比例。

4.35 报告期内基金份额前十名持有人的名称、持有份额、占总份额比例

本基金在2011年4月26日-2012年6月30日期间，未进行前十名持有人的名称、持有份额、占总份额比例。

4.36 报告期内基金份额前十名持有人的名称、持有份额、占总份额比例

本基金在2011年4月26日-2012年6月30日期间，未进行前十名持有人的名称、持有份额、占总份额比例。

4.37 报告期内基金份额前十名持有人的名称、持有份额、占总份额比例

本基金在2011年4月26日-2012年6月30日期间，未进行前十名持有人的名称、持有份额、占总份额比例。

4.38 报告期内基金份额前十名持有人的名称、持有份额、占总份额比例

本基金在2011年4月26日-2012年6月30日期间，未进行前十名持有人的名称、持有份额、占总份额比例。

4.39 报告期内基金份额前十名持有人的名称、持有份额、占总份额比例

本基金在2011年4月26日-2012年6月30日期间，未进行前十名持有人的名称、持有份额、占总份额比例。

4.40 报告期内基金份额前十名持有人的名称、持有份额、占总份额比例

本基金在2011年4月26日-2012年6月30日期间，未进行前十名持有人的名称、持有份额、占总份额比例。

4.41 报告期内基金份额前十名持有人的名称、持有份额、占总份额比例

本基金在2011年4月26日-2012年6月30日期间，未进行