

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

送出日期:2013年3月29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的独立董事签字同意并由监事会出具书面意见。

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2013年3月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、资产配置情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，对本基金报告期内在虚增收益、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。投资人投资风险，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。

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，应阅读年度报告全文。

鹏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:鹏华丰收债券

基金主代码:160612

交易代码:160612

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2008年5月28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:2,486,458,688.10份

基金合同存续期间:不定期

2.2 基金产品说明

在严格控制投资风险的基础上，通过主要投资债券等固定收益类品种，同时兼顾部分定价低于市场的权益类品种，力求使基金份额持有人获得持续稳定的投资收益。

(1)股票投资：股票投资采用“行业配置”与“个股选择”双线并行的投资策略，并通过灵活的仓位调整等手段来避免市场中的系统风险。

(2)债券投资：债券投资通过对宏观经济、经济状况和货币政策等因素的研究，形成对未来市场利率变动方向的预期，主动地调整债券投资组合的久期，提高债券投资组合的收益率水平；通过对债券市场价格的分析判断，形成对未来的收益率曲线形状变化的预期，相应地选择子弹型、哑铃型或梯形的组合期限配置，获取因收益率曲线的变动所带来的投资收益。

业绩比较基准:中债总国债收益率

风险收益特征:本基金属于债券型基金，其预期的风险和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较低风险品种。

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

姓名 张弢 田卉

信息披露负责人 联系电话 0755-82825720 010-67595096

电子邮件 zhangle@phfund.com.cn tianqiang1.zb@cib.com

客户服务电话 4006789999 010-67595096

传真 0755-82021126 010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告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

§ 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 86,013,968.36 9,735,231.03 38,059,119.71

本期利润 72,181,645.52 12,827,679.28 31,795,750.78

加权平均基金份额本期利润 0.0309 0.0421 0.0475

本期基金份额净值增长率 6.11% 4.36% 3.12%

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 0.0321 0.0663 0.1225

期末基金资产净值 2,566,169,622.15 451,834,047.65 423,676,376.24

期末基金份额净值 1.032 1.066 1.122

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，扣减相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上基金公允价值变动收益。

2.所持基金份额持有人按其持有的基金份额，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将低于所列数字。

3.9 期间的“期末”均指报告期最后一日，即2012年1月1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标准差(③) 业绩比较基准差额(④=①-③)

过去三个月 0.49% 0.05% 0.56% 0.03% -0.07% 0.02%

过去六个月 0.00% 0.08% 0.16% 0.05% -0.16% 0.03%

过去一年 6.11% 0.11% 2.51% 0.07% 3.60% 0.04%

过去三年 14.19% 0.17% 10.46% 0.09% 3.73% 0.08%

过去五年 - - - - - -

自基金合同生效日起至今 38.24% 0.19% 21.55% 0.13% 16.69% 0.06%

数据来源:基金管理人根据基金定期报告数据重新计算得出。

注:本基金业绩比较基准为中债总国债收益率。

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

基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比

注:本基金合同于2008年5月28日生效。

2.截至基金合同结束，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

基金合同生效日至当年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比

注:1.本基金合同于2008年5月28日生效。

2.截至基金合同结束，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。

3.2.4 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

基金合同生效日至当年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比

注:1.本基金合同于2008年5月28日生效。

2.截至基金合同结束，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。

3.2.5 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

基金合同生效日至当年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比

注:1.本基金合同于2008年5月28日生效。

2.截至基金合同结束，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。

3.2.6 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

基金合同生效日至当年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比

注:1.本基金合同于2008年5月28日生效。

2.截至基金合同结束，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。

3.2.7 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

基金合同生效日至当年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比

注:1.本基金合同于2008年5月28日生效。

2.截至基金合同结束，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。

3.2.8 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

基金合同生效日至当年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比

注:1.本基金合同于2008年5月28日生效。

2.截至基金合同结束，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。

3.2.9 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

基金合同生效日至当年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比

注:1.本基金合同于2008年5月28日生效。

2.截至基金合同结束，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。

3.2.10 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

基金合同生效日至当年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比

注:1.本基金合同于2008年5月28日生效。

2.截至基金合同结束，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。

3.2.11 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

基金合同生效日至当年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比

注:1.本基金合同于2008年5月28日生效。

2.截至基金合同结束，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。

3.2.12 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

基金合同生效日至当年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比

注:1.本基金合同于2008年5月28日生效。

2.截至基金合同结束，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。

3.2.13 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

基金合同生效日至当年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比

注:1.本基金合同于2008年5月28日生效。

2.截至基金合同结束，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。

3.2.14 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

基金合同生效日至当年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比

注:1.本基金合同于2008年5月28日生效。

2.截至基金合同结束，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。

3.2.15 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

基金合同生效日至当年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比

注:1.本基金合同于2008年5月28日生效。

2.截至基金合同结束，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。

3.2.16 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

基金合同生效日至当年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比

注:1.本基金合同于2008年5月28日生效。

2.截至基金合同结束，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。

3.2.17 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

基金合同生效日至当年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比

注:1.本基金合同于2008年5月28日生效。

2.截至基金合同结束，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。

3.2.18 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

基金合同生效日至当年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比

注:1.本基金合同于2008年5月28日生效。

2.截至基金合同结束，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。

3.2.19 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

基金合同生效日至当年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比

注:1.本基金合同于2008年5月28日生效。

2.截至基金合同结束，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。

3.2.20 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

基金合同生效日至当年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比

注:1.本基金合同于2008年5月28日生效。

2