基金管理人:鹏华基金管理有限公司
基金托管人:中国邮政储蓄银行股份有限公司
送出日期:2013年3月29日

鹏华丰泽分级债券型证券投资基金

【2012】年度报告摘要

§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。

基金托管人中国邮政储蓄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	鹏华丰泽分级债券,场内简称"鹏华丰泽"	
基金主代码	160618	
基金运作方式	契约型基金,本基金合同生效后三年内(含三年)为基金分级运作期,丰泽A自基金合同生效日起于丰泽A的开放日接受申购赎回,丰泽B封闭运作并在深圳证券交易所上市交易。基金分级运作期届满,本基金转为上市开放式基金(LOF)。	
基金合同生效日	2011年12月8日	
基金管理人	鹏华基金管理有限公司	
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,945,115,731.35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	2011年12月26日	
下属分级基金的基金简称:	丰泽A	丰泽B
下属分级基金的交易代码:	160619	150061
报告期末下属分级基金的份额总额	1,045,023,434.99份	900,092,296.36份

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,上市交易并封闭运作的基金份额可简称为"丰泽B"。

2.2 基金产品说明

投资目标	在适度控制风险的基础上,通过严格的信用分析和对信用利差变动趋势的判断,力争获取信用溢价,以最大程度上取得超越基金业绩比较基准的收益。	
投资策略	本基金债券投资将主要采取信用策略,同时辅之以久期策略、收益率曲线策略、收益率利差策略、息差策略、债券选择策略等积极投资策略,在适度控制风险的基础上,通过严格的信用分析和对信用利差变动趋势的判断,力争获取信用溢价,以最大程度上取得超越基金业绩比较基准的收益。	
业绩比较基准	中债总指数收益率	
风险收益特征	本基金是债券型证券投资基金,属于具有中低风险收益特征的基金品种,其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金,高于货币市场基金。	
	丰泽A	丰泽B
下属分级基金的风险收益特征	丰泽A份额将表现出低风险、低收益的明显特征,其预期收益和预期风险低于普通的债券型基金份额。	丰泽B份额将表现出高风险、高收益的显著特征,其预期收益和预期风险要高于普通的债券型基金份额。

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	中国邮政储蓄银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张戈	宗庆丰
	联系电话	0755-82825720	010-68858109
	电子邮箱	zhangge@phfund.com.cn	zongqingfeng@psbcoa.com.cn
客户服务电话		4006788999	95580
传真		0755-82021126	010-68858120

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 北京市西城区金融大街3号A座中国邮政储蓄银行股份有限公司

§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12月8日(基金合同生效日)-2011年12月31日
本期已实现收益	287,886,018.96	5,435,378.18
本期利润	284,887,685.12	15,747,684.89
加权平均基金份额本期利润	0.0985	0.0054
本期基金份额净值增长率	9.90%	0.50%
3.1.2 期末数据和指标	**2012年末**	**2011年末**
期末可供分配基金份额利润	0.1282	0.0019
期末基金资产净值	2,148,691,891.68	2,914,159,275.79
期末基金份额净值	1.105	1.005

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)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)本基金合同于2011年12月8日生效,至2011年12月31日未满1年,故2011年的数据和指标为非完整会计年度数据。

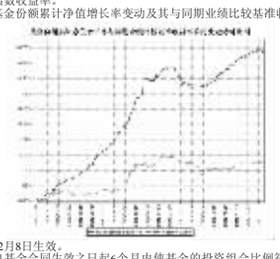
3.2 基金净值表现

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	1.96%	0.09%	0.56%	0.03%	1.40%	0.06%
过去六个月	1.49%	0.09%	0.16%	0.05%	1.33%	0.04%
过去一年	9.90%	0.10%	2.51%	0.07%	7.39%	0.03%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	10.45%	0.10%	2.89%	0.07%	7.56%	0.03%

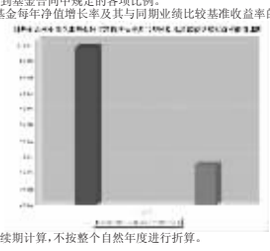
注:业绩比较基准为中债总指数收益率。

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



注:1、本基金合同于2011年12月8日生效。
2、按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定,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。

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



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 其他指标

单位:人民币元

其他指标	报告期末(2012年12月31日)
丰泽A与丰泽B基金份额配比	1.161018086:1
期末丰泽A参考净值	1.003
期末丰泽A累计参考净值	1.051
丰泽A累计折算份额	97,059,209.68
期末丰泽B参考净值	1.223
期末丰泽B累计参考净值	1.223
丰泽A年收益率(单利)	4.05%

3.4 过去三年基金的利润分配情况
根据本基金基金合同约定,基金合同生效之日起3年内,本基金不对丰泽A和丰泽B进行收益分配。

§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		
戴钢	本基金基金经理	2011年12月8日	-	10	戴钢先生,国籍中国,厦门大学经济学硕士,10年证券从业经验。曾就职于广东民安证券研究发展部,担任研究员;2005年9月加盟鹏华基金管理有限公司,从事研究分析工作,历任债券研究员、专户投资经理等职;2011年12月起至今担任鹏华丰泽分级债券型证券投资基金基金经理,2012年6月起至今兼任鹏华金刚保本混合型证券投资基金基金经理,2012年11月起兼任鹏华中小企业纯债债券型发起式证券投资基金基金经理。戴钢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授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、公管投资副总裁、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"朱委托数量"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《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》、《定收益投资管理流程》和《非公开定向增发流程》实施交易,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及权证等品种流动性较好。

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

2012年债券市场表现较好,中值总财富指数上涨了2.51%,但不同类属债券的走势差异明显,信用债走势明显好于国债及其金融债等利率品种。具体来看,上半年在资金面较为宽松的环境下,债券市场整体走强,各类属债券收益率都出现了不同程度的下降。从三季度开始,由于市场对降准的预期未能兑现,导致资金面趋紧,加上通胀开始触底回升,债券市场出现了一定程度的调整。其中利率品种调整幅度相对较小,信用品种尤其是中低评级的信用品种调整幅度相对较大。进入四季度,资金面较为平稳,债券市场趋于稳定,但分类属走势出现明显分化。其中中低评级的信用品种表现最好,收益率回落明显,利率品种和高评级信用品种整体上收益率有所上行。

由于对债市总体较为乐观,因此本组合在操作上较为积极,保持了较高的杠杆水平,采取了以持有为主的策略。品种选择上,以交易所可回购的中等评级的信用债为主。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2012年本基金的净值增长率为9.90%。其中分级A类净值增长率为4.86%,分级B类的净值增长率为20.97%,同期业绩基准增长率为2.51%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2013年,我们认为宏观经济的走势将较为平稳。一方面,在房地产政策调控不动摇的大背景下,暂时无法看到推动中国经济增长的强劲动力;另一方面,四季度宏观经济的反弹是在利率水平、尤其是短端利率水平明显偏高的情况下出现的。这就表明如果政府适度放松货币政策则将对宏观经济的增长产生进一步的支持。此外,2013年是政府换届的第一年,预计政府投资热情将维持较高水平,这也有利于经济的平稳增长。

在货币政策有望继续宽松的大背景下,我们对债券市场谨慎乐观,债券仍有较好的持有期价值。因此在操作上,我们仍将以中等评级的债券资产为核心,持有为主并维持较高的杠杆水平。

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、专业胜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。

注:(1)本基金自2011年11月2日至2011年12月2日止期间公开发售,于2011年12月8日基金合同正式生效。
(2)本基金管理人在募集期间认购本基金份额19,301,028.20份。
(3)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。

7.4.8.4.2 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	丰泽B			
	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	91,005,027.00	10.11%	96,500,608.00	10.72%

注:本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金A级份额。

7.4.8.5 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12月8日(基金合同生效日)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
中国邮储银行	5,066,818.28	211,318.53	6,293,565.93	655,185.80

7.4.8.6 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 2012年1月1日至2012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:张)	总金额
国信证券	041252021	12桂铁股CP001	网下申购	300,000	30,000,000.00

注:本基金上年度可比期间未参与关联方承销的证券。

7.4.9 期末 2012年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

7.4.9.1.1受限证券类别:债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
112144	12晨鸣债	2012年12月28日	2013年2月4日	新债未上市	100.00	100.00	1,000,000	100,000,000.00	100,000,000.00	-

注: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的股票及权证等其他证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票
截至本报告期末,本基金没有持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券
7.4.9.3.1 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。
7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购
截至本报告期末2012年12月31日止,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额2,876,360,000.00元,于2013年1月4日(先后)到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

§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	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	4,702,161,938.36	93.19
	其中:债券	4,702,161,938.36	93.19
	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	245,296,176.71	4.86
6	其他各项资产	98,057,680.60	1.94
7	合计	5,045,515,795.67	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合
本基金本报告期末未持有股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细
本基金本报告期末未持有股票。

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
本基金本报告期内未发生任何股票买卖。

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
本基金本报告期内未发生任何股票买卖。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额
本基金本报告期内未发生任何股票买卖。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	48,765,000.00	2.27
	其中:政策性金融债	48,765,000.00	2.27
4	企业债券	4,096,605,938.36	190.66
5	企业短期融资券	120,022,000.00	5.59
6	中期票据	436,769,000.00	20.33
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	4,702,161,938.36	218.84

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

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	122115	11华锐01	2,493,790	243,144,525.00	11.32
2	122780	11长高新	2,100,000	213,150,000.00	9.92
3	1182340	11华强MTN1	2,000,000	204,600,000.00	9.52
4	112060	12金风01	2,000,000	202,960,000.00	9.45
5	122102	11广汇01	1,900,010	195,701,030.00	9.11

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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
本基金投资的前十名证券中本期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、处罚的证券。

8.9.2
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	250,000.00
2	应收证券清算款	18,307,578.09
3	应收股利	-
4	应收利息	79,500,102.51
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	98,057,680.60

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
本基金本报告期末未持有股票。

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

份额级别	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
丰泽A	28,499	36,668.78	1,659,323.67	0.16%	1,043,364,111.32	99.84%
丰泽B	744	1,209,801.47	893,053,891.60	99.22%	7,038,404.76	0.78%
合计	29,243	66,515.60	894,713,215.27	46.00%	1,050,402,516.08	54.00%

9.2 期末上市基金前十名持有人

丰泽B

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	国信证券股份有限公司	91,005,027.00	23.14%
2	嘉禾人寿保险股份有限公司-传统-普通保险产品	64,376,982.00	16.37%
3	华宝投资有限公司	54,398,339.00	13.83%
4	天平汽车保险股份有限公司	30,004,050.00	7.63%
5	中国太平洋人寿保险股份有限公司-传统-普通保险产品	16,618,731.00	4.23%
6	新华人寿保险股份有限公司	14,157,231.00	3.60%
7	山西晋城无烟煤矿业集团有限责任公司企业年金计划-中国工商银行	12,597,482.00	3.20%
8	全国社保基金一零零八组合	11,613,165.00	2.95%
9	长江金色晚晴(集合型)企业年金计划-浦发银行	11,127,472.00	2.83%
10	信诚人寿保险有限公司-分红-个险分红	10,001,350.00	2.54%
11	信诚人寿保险有限公司-成长先锋账户	10,001,350.00	2.54%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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基金	丰泽A	2,243.49	0.0002%
	丰泽B	50,945.75	0.0057%
	合计	53,189.24	0.0027%

注:(1)本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金B级份额总量的数量区间为0-10万份(含)。
(2)本基金的基金经理本报告期末未持有本基金份额。
(3)截至本报告期末,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

项目	丰泽A	丰泽B
基金合同生效日(2011年12月8日)基金份额总额	1,998,319,294.54	900,092,296.36
本报告期期初基金份额总额	1,998,319,294.54	900,092,296.36
本报告期基金总申购份额	1,248,847,207.16	-
减:本报告期基金总赎回份额	2,299,202,276.39	-
本报告期基金拆分变动份额	97,059,209.68	-
本报告期期末基金份额总额	1,045,023,434.99	900,092,296.36

§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 报告期内基金管理人的重大人事变动:
2012年12月8日,经公司2012年第五次股东会审议通过,周中国、张元、高续、邓召明任公司新任董事,胡继之、李相启、黄善瑞、宋凯不再担任公司董事,胡继之、于丹任公司新任监事,孙枫不再担任公司监事,本公司已于2012年12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说明书中披露。

11.2.2本基金托管人-中国邮政储蓄银行股份有限公司的专门基金托管部门本报告期内未发生重大人事变动。

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
本基金本报告期内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
本基金基金合同生效日为2011年12月8日,本基金管理人聘请普华永道中天会计师事务所为本基金审计的会计师事务所。报告年度应支付给普华永道中天会计师事务所有限公司的审计费100,000.00元,该审计机构第1年为本基金提供审计服务。

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进行的有关情况

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	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
银河证券	2	-	-	-173,275.67	100.00%	-

注:1、本基金本报告期未通过券商交易单元进行股票交易、权证交易。
2、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估,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,向券商租用交易单元作为基金专用交易单元。本报告期内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

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
银河证券	8,276,091,469.63	100.00%	535,932,053,000.00	100.00%	-	-

鹏华基金管理有限公司
2013年3月29日

2012年12月31日止期间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2012年1月1日至2012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以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动作为公允价值变动损益计入当期损益;在资产持有期间所取得的利息或现金股利以及处置时产生的处置损益计入当期损益。

7.4.4.4.4金融资产满足下列条件之一的,予以终止确认:(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止;(2)该金融资产已转移,且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方;或者(3)该金融资产已转移,虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬,但是放弃了对该金融资产控制。

7.4.4.4.5金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。

7.4.4.4.6当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时,终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额,计入当期损益。

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