

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  
报告送出日期:2013年1月22日

§ 1 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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年1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。

本报告期自2012年10月1日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况	
基金简称	鹏华丰泽分级债券、场内简称“鹏华丰泽”
交易代码	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。
基金合同生效日	2011年12月8日
报告期末基金份额总额	1,945,115,731.35份
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。
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
下属侧偏基金的基金简称	丰泽B
下属侧偏基金的交易代码	160619
报告期末下属侧偏基金的份额总额	1,045,023,434.99份 900,092,296.36份
下属侧偏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要低于普通的债券型基金份额
注:本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息披露场合下,均可简称为“丰泽B”。	

3.1 主要财务指标		单位:人民币元				
主要财务指标	报告期(2012年10月1日—2012年12月31日)					
1.本期已实现收益	139,448,104.74					
2.本期利润	58,269,070.28					
3.加权平均基金份额本期利润	0.0213					
4.期末基金资产净值	2,148,691,891.68					
5.期末基金份额净值	1.105					
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,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 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	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%
注:业绩比较基准=中债总指数收益率						
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:本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息披露场合下,均可称为“鹏华300”。

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:2013年1月22日

§ 1 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规定,于2013年1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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2012年10月1日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况	
基金简称	鹏华沪深300指数(LOF)
基金代码	160615
交易代码	160615
基金运作方式	上市契约开放式(LOF)
基金合同生效日	2009年4月3日
报告期末基金份额总额	933,009,194.77份
投资目标	采用指数化投资策略,追求基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间的跟踪误差最小,力争将日均跟踪偏离度控制在0.5%以内,以实现对沪深300指数的有效跟踪。
投资策略	本基金采用被动式指数投资策略,按照成份股在沪深300指数中的权重配置指数化投资组合,并跟踪标的指数的收益及其权重变化进行相应调整。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%
风险收益特征	本基金属于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、混合型基金,为证券投资基金中的高风险、收益波动较大的品种。
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
注:本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息披露场合下,可简称为“鹏华300”。	

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 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	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	9.56%	1.23%	9.53%	1.22%	0.03%	0.01%
注:业绩基准=沪深300指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%。						
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						

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:2013年1月22日

§ 1 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年1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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2012年10月1日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况	
2.1 基金基本情况	
基金简称	鹏华环球发现(QDII-FOF)
基金代码	206006
交易代码	206060
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年10月12日
报告期末基金份额总额	114,737,367.87份
投资目标	积极环球寻找并发现投资机会,通过积极的战略战术资产配置进行资产在基金、股票、货币市场工具及固定收益中的分配,在分散风险的前提下,最大化地实现资本的长期增值。
投资策略	本基金采用多资产配置策略,包括自上而下和自下而上方法来增强基金收益并提升其效率。自上而下方法主要指宏观、中观和微观资产配置策略的分析框架,旨在发现经济周期及对未来经济周期的研究为基础,来决定资产配置区域(地域)选择及资产类别和权重,其后定期进行审慎调整。资产配置和权重的适度分散可以有效降低组合的相关性,从而可能产生的一揽子资产配置风险和其他相关风险。此外,本基金还将使用适当的风险控制措施来监控管理与战略资产配置相关的风险。
业绩比较基准	摩根斯坦利世界指数(MSCI World Index RMB)×50%+摩根斯坦利新兴市场指数(MSCI Emerging Markets Index RMB)×50%
风险收益特征	本基金属于投资全球市场的基金中基金(主要投资股票类公募基金),为证券投资基金中的中高风险品种,其预期的风险和预期收益要高于货币型基金、债券基金、混合型基金,长期平均的风险低于投资股票-市场的股票型基金。
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
境外投资顾问	英文名称:Eurizon Capital SGR S.p.A. 中文名称:意大利欧洲资本资产管理股份公司
境外资产托管人	英文名称:State Street Bank and Trust Company 中文名称:道富银行

**§ 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

主要财务指标	报告期(2012年10月1日 - 2012年12月31日)
1.本期已实现收益	71,898.18
2.本期利润	2,245,961.11
3.加权平均基金份额本期利润	0.0191
4.期末基金资产净值	106,603,862.32
5.期末基金份额净值	0.929

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 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	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	2.20%	0.51%	3.14%	0.54%	-0.94%	-0.03%

注:业绩比较基准=摩根斯坦利世界指数 MSCI World Index RMB×50%+摩根斯坦利新兴市场指数 MSCI Emerging Markets Index RMB×50%

**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**



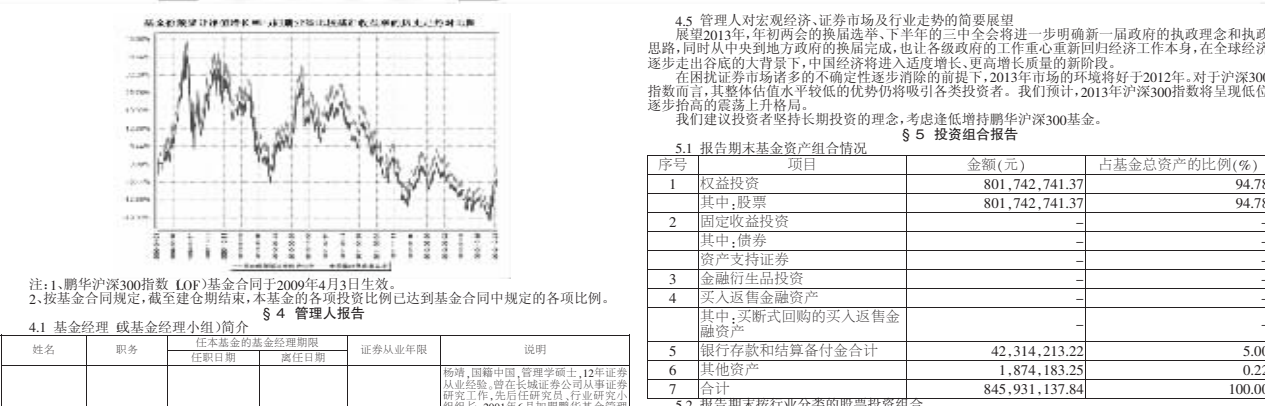
§ 4 管理人报告	
4.1 基金经理 或基金经理小组简介	
姓名	职务
任职日期	离任日期
戴钢	本基金基金经理
2011年12月8日	-
注:1. 任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日;担任新设立基金基金经理的,任职日期为基金合同生效日。	

§ 5 投资组合报告	
5.1 报告期末基金资产组合情况	
序号	项目
1	权益投资
2	固定收益投资
3	金融衍生品投资
4	买入返售金融资产
5	银行存款和结算备付金合计
6	其他资产
7	合计
注:1. 报告期末按行业分类的股票投资组合	
2. 报告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	
3. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合	
4. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	
5. 报告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	
6. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	
7. 报告期末本基金投资的股指期货投资	
8. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
9. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
10. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
11. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
12. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
13. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
14. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
15. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
16. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
17. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
18. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
19. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
20. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
21. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
22. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
23. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
24. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
25. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
26. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
27. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
28. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
29. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
30. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
31. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
32. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
33. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
34. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
35. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
36. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
37. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
38. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
39. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
40. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
41. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
42. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
43. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
44. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
45. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
46. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
47. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
48. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
49. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
50. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
51. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
52. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
53. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
54. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
55. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
56. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
57. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
58. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
59. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
60. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
61. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
62. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
63. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
64. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
65. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
66. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
67. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
68. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
69. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
70. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
71. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
72. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
73. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
74. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
75. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
76. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
77. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
78. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
79. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
80. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
81. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
82. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
83. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
84. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
85. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
86. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
87. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
88. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
89. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
90. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
91. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
92. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
93. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
94. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
95. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
96. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
97. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
98. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
99. 报告期末本基金投资的国债期货投资	
100. 报告期末本基金投资的国债期货投资	

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;担任新设立基金基金经理的,任职日期为基金合同生效日。

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;担任新设立基金基金经理的,任职日期为基金合同生效日。

## 鹏华沪深300指数证券投资基金(LOF)



§ 4 管理人报告	
4.1 基金经理 或基金经理小组简介	
姓名	职务
任职日期	离任日期
杨靖	本基金基金经理
2009年4月3日	-
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;担任新设立基金基金经理的,任职日期为基金合同生效日。	

的约定, 承诺诚实守信, 勤勉尽责的履行其职责和遵守有关法律法规, 在严格控制风险的基础上, 为基金份额持有人谋求长期、稳定的投资回报。报告期内, 本基金运作合规, 不存在违反证券法规和基金合同约定的行为, 未发生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, 本基金未发生违反法律法规及基金合同约定造成损失的异常交易行为。本报告期内基金管理人未发生交易所公开竞价同日反向交易未达交易所规定的单边交易金额或单边交易未达证券总成交量5%的异常交易行为, 主要原因在于指数投资仓位不高, 股票仓位不高, 基金管理人未发生异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内本基金投资策略和运作分析

2012年, 国内经济增速放缓, 通胀压力依然较大, 沪深300指数持续性探底, 09年8月下跌以来的新低后, 从12月初开始出现大幅反弹, 今年四季度沪深300的18.18倍升值, 给市场迅速起色的预期作风潮席卷了市场对中国经济发展的信心, 同时4季度又发生了转好的经济数据刺激了市场短期情绪的亢奋, 因此, 银行、地产等行业成为市场热点。

市场大幅波动带来频繁的大额申购赎回, 本基金基金份额的频繁变动, 给跟踪投资组合造成一定干扰, 但经精心操作, 本基金仍较好地跟踪了组合投资标的。

4.4.2 报告期内基金的投资业绩和净值

截至2012年12月31日, 本基金份额净值为0.905元, 累计净值0.965元; 本报告期基金份额净值增长率为9.56%, 同期业绩比较基准为5.33%。