

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、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运用基金资产，但不保证本基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。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2012年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称:鹏华丰泽分级债券基金,场内简称“鹏华丰泽”
交易代码:160618

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至丰泽B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

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,以最大程度上取得收益。本基金将根据市场情况,同时铺之以久期策略、收益曲线策略、收益率差策略、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

下属两级基金的基金简称:丰泽A 丰泽B
下属两级基金的交易代码:160619 150061

报告期末下属两级基金的份额总额:1,045,023,434.99份 900,092,296.36份

下属两级基金的风险收益特征:低风险低收益的定期开放式基金,低风险低预期风险基金要高于普通的债券型基金风险。

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“丰泽A”。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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: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。

3.2所列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。

3.3基金净值表现

3.3.1本基金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② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率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=沪深300指数收益率*50%+银行同业存款利率*5%

3.3.2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

鹏华丰泽分级债券型证券投资基金

2012 第四季度报告



2.证券从业的道德从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

4.2.4. 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,本基金未发生违法违规并给基金财产造成损失的异常交易行为。

本基金由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、勤勉尽责的原则运用基金财产,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。

4.3.1 公平交易专章的说明

4.3.1.1 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,本基金未发生违法违规并给基金财产造成损失的异常交易行为。

本基金由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、勤勉尽责的原则运用基金财产,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。

4.3.3 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金未发生违法违规并给基金财产造成损失的异常交易行为。

本基金由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、勤勉尽责的原则运用基金财产,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。

4.3.4 报告期内基金投资组合情况

4.3.4.1 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

4.3.4.2 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

4.3.4.3 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债券投资明细

4.3.4.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

4.3.4.5 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基金投资明细

4.3.4.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名其他投资品种投资明细

4.3.4.7 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贵金属投资明细

4.3.4.8 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权证投资明细

4.3.4.9 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指期货投资明细

4.3.4.10 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国债期货投资明细

4.3.4.11 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期权投资明细

4.3.4.12 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商品期货投资明细

4.3.4.13 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外汇投资品种投资明细

4.3.4.14 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其他投资品种投资明细

4.3.4.15 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其他投资品种投资明细

4.3.4.16 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其他投资品种投资明细

4.3.4.17 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其他投资品种投资明细

4.3.4.18 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其他投资品种投资明细

4.3.4.19 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其他投资品种投资明细

4.3.4.20 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其他投资品种投资明细

4.3.4.21 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其他投资品种投资明细

4.3.4.22 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其他投资品种投资明细

4.3.4.23 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其他投资品种投资明细

4.3.4.24 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其他投资品种投资明细

4.3.4.25 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其他投资品种投资明细

4.3.4.26 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其他投资品种投资明细

4.3.4.27 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其他投资品种投资明细

4.3.4.28 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其他投资品种投资明细

4.3.4.29 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其他投资品种投资明细

4.3.4.30 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其他投资品种投资明细

4.3.4.31 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其他投资品种投资明细

4.3.4.32 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其他投资品种投资明细

4.3.4.33 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其他投资品种投资明细

4.3.4.34 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其他投资品种投资明细

4.3.4.35 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其他投资品种投资明细

4.3.4.36 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其他投资品种投资明细

4.3.4.37 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其他投资品种投资明细

4.3.4.38 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其他投资品种投资明细

4.3.4.39 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其他投资品种投资明细

4.3.4.40 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其他投资品种投资明细

4.3.4.41 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其他投资品种投资明细

4.3.4.42 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其他投资品种投资明细

4.3.4.43 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其他投资品种投资明细

4.3.4.44 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其他投资品种投资明细

4.3.4.45 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其他投资品种投资明细

4.3.4.46 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其他投资品种投资明细

4.3.4.47 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其他投资品种投资明细

4.3.4.48 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其他投资品种投资明细

4.3.4.49 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其他投资品种投资明细

4.3.4.50 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其他投资品种投资明细

4.3.4.51 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其他投资品种投资明细

4.3.4.52 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其他投资品种投资明细

4.3.4.53 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其他投资品种投资明细

4.3.4.54 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其他投资品种投资明细

4.3.4.55 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其他投资品种投资明细

4.3.4.56 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其他投资品种投资明细

4.3.4.57 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其他投资品种投资明细

4.3.4.58 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其他投资品种投资明细

4.3.4.59 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其他投资品种投资明细

4.3.4.60 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其他投资品种投资明细

4.3.4.61 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其他投资品种投资明细

4.3.4.62 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其他投资品种投资明细

4.3.4.63 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其他投资品种投资明细

4.3.4.64 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其他投资品种投资明细

4.3.4.65 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其他投资品种投资明细

4.3.4.66 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其他投资品种投资明细

4.3.4.67 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其他投资品种投资明细

4.3.4.68 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其他投资品种投资明细

4.3.4.69 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其他投资品种投资明细

4.3.4.70 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的