

# 鹏华丰盛稳固收益债券型证券投资基金 2024 年第 4 季度报告

2024 年 12 月 31 日

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：2025 年 1 月 21 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。

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 2025 年 01 月 20 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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 10 月 01 日起至 2024 年 12 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	鹏华丰盛债券
基金主代码	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	116,131,506.73 份
投资目标	注重风险控制，力争获取超越存款利率的绝对收益。
投资策略	<p>本基金力争获取超越存款利率的绝对收益，并认为对风险的敏感把握和精准控制是创造绝对收益的关键。在控制风险方面，本基金将通过投资组合保险策略对系统性风险进行管理，通过构建投资组合对非系统性风险进行分散，在此基础上，重视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。这一理念和目标，将通过投资策略的三个层面得到体现和实现。</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金主要运用优化的投资组合保险策略确定和调整基金资产在高风险资产和低风险资产之间的配置比例，这是本基金控制系统性风险、追求绝对收益的第一步。</p> <p>本基金将主要运用投资组合保险策略中的固定比例组合保险策略（CPPI）和时间不变性投资组合保险策略（TIPP）来实现基金的投资目标。</p> <p>运用固定比例组合保险策略（CPPI）时，需要事先设</p>

定一个保险底线，在此基础上确定组合安全垫。将安全垫乘以一定的风险乘数，确定基金投资于高风险资产的比例，将剩余资产投资于低风险资产，从而完成一次资产配置。它通过动态调整资产组合，以保证高风险资产的损失额不超过预先设定的投资者可承受能力。

运用时间不变性投资组合保险策略（TIPP）时，需要假设当资产价值上升时，投资者更关心当前资产价值的保障，希望能够锁定浮动盈利，而非仅仅考虑投资本金。TIPP 策略把保险底线从固定改为可变，保险底线为某一时点资产净值最高的一个固定比例。具体来说，当资产净值变动时可求出新的保险底线，将新的保险底线与原来的保险底线相比较，取其中较大的作为资产净值变动后的保险底线。可以看出，在整个投资过程中，TIPP 策略的保险底线只升不降。通俗来讲，TIPP 策略是一种“落袋为安”的策略。

本基金在投资组合保险策略的基础上还将进行一定的优化，主要体现在参数的设定和不同策略的选择运用上。本基金将以定量分析为基础，结合基金管理人宏观经济的研究和判断进行参数设定。在不同策略的选择运用上，本基金将综合运用 CIPP 策略和 TIPP 策略，从出发点上看，采用 CPPI 策略主要是为了避免基金初始资产遭受本金损失，而采用 TIPP 策略则主要是对基金已实现收益的锁定。

## 2、债券投资策略

债券投资是本基金资产投资的主要方向。本基金将从风险和收益两方面进行考虑来构建债券投资组合。

在风险控制方面，本基金分析基金下方风险来源，重点关注债券的利率风险、信用风险和流动性风险。对于利率风险，基金管理人将根据对宏观经济周期所处阶段及其它相关因素的研判调整组合久期；对于信用风险，基金管理人主要依靠自身专业的信用分析团队，参考国家有权机构批准或认可的信用评级机构的信用评级，对发债主体的信用风险进行评价；对于流动性风险，本基金将对投资者需求进行跟踪与了解，结合历史经验，在构建投资组合时注重不同流动性水平资产的配合，并在久期、信用等因素类似的情况下选择流动性最好的券种进行投资。

本基金还将采取久期策略、收益率曲线策略、骑乘策略、利差策略、息差策略等积极投资策略，在为风险资产的投资创造安全垫的同时，力争在债券投资层面为基金追求超越基准的绝对收益产生正向贡献。

### （1）久期策略

本基金将通过自上而下的组合久期管理策略，以实现

观经济周期所处阶段及其它相关因素的研判调整组合久期。如果预期利率下降，本基金将增加组合的久期，以较多地获得债券价格上升带来的收益；反之，如果预期利率上升，本基金将缩短组合的久期，以减小债券价格下降带来的风险。

#### (2) 收益率曲线策略

收益率曲线的形状变化是判断市场整体走向的依据之一，本基金将据此调整组合长、中、短期债券的搭配。本基金将通过对收益率曲线变化的预测，适时采用子弹式、杠铃或梯形策略构造组合，并进行动态调整。

#### (3) 骑乘策略

本基金将采用骑乘策略增强组合的持有期收益。这一策略即通过对收益率曲线的分析，在可选的目标久期区间买入期限位于收益率曲线较陡峭处右侧的债券。在收益率曲线不变动的情况下，随着其剩余期限的衰减，债券收益率将沿着陡峭的收益率曲线有较大幅度的下滑，从而获得较高的资本收益；即使收益率曲线上升或进一步变陡，这一策略也能够提供更多的安全边际。

#### (4) 息差策略

本基金将利用回购利率低于债券收益率的情形，通过正回购将所获得的资金投资于债券，利用杠杆放大债券投资的收益。

#### (5) 利差策略

本基金通过对两个期限相近的债券的利差进行分析，从而对利差水平的未来走势作出判断，进而相应的进行债券置换。影响两期限相近债券的利差水平的因素主要有息票因素、流动性因素及信用评级因素等。当预期利差水平缩小时，买入收益率高的债券同时卖出收益率低的债券，通过两债券利差的缩小获得投资收益；当预期利差水平扩大时，则进行相反的操作。

### 3、股票投资策略

股票资产是本基金高风险资产最重要的构成部分。本基金通过优化的投资组合保险策略进行大类资产配置，决定对于高风险资产的投资比例，之后将通过以下方式进行个股的分散化投资。

#### (1) 新股申购策略

本基金根据新股发行人的基本情况，结合对申购中签率和新股上市后表现的预期，谨慎参与新股申购，获取股票一级市场与二级市场的价差收益。

#### (2) 二级市场股票投资策略

本基金股票投资以精选个股为主，发挥基金管理人专业研究团队的研究能力，从定量和定性两方面考察上市公司的增值潜力。

	<p>定量方面综合考虑盈利能力、成长性、估值水平等多种因素，包括净资产与市值比率 (B/P)、每股盈利/每股市价 (E/P)、年现金流/市值 (cashflow-to-price) 以及销售收入/市值 (S/P) 等价值指标，以及净资产收益率 (ROE)、每股收益增长率以及主营业务收入增长率等成长指标。</p> <p>定性方面考察上市公司所属行业发展前景、行业地位、竞争优势等多种因素，精选流动性好、成长性强、估值水平低的股票进行投资。</p> <p>4、权证的投资策略</p> <p>本基金将权证看作是辅助性投资工具，权证的投资原则为有利于基金资产保值、增值，有利于加强基金风险控制。</p> <p>本基金在权证投资中将对权证标的证券的基本面进行研究，同时综合考虑权证定价模型、市场供求关系、交易制度设计等多种因素对权证进行定价，主要运用的投资策略为：杠杆交易策略、对冲保底组合投资策略、保底套利组合投资策略、买入跨式投资策略、Delta 对冲策略等。</p>		
业绩比较基准	三年期银行定期存款利率（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		
下属分级基金的基金简称	鹏华丰盛债券 A	鹏华丰盛债券 B	鹏华丰盛债券 D
下属分级基金的交易代码	022510	206008	022511
报告期末下属分级基金的份额总额	30,326.18 份	116,100,981.23 份	199.32 份
下属分级基金的风险收益特征	风险收益特征同上	风险收益特征同上	风险收益特征同上

注：无。

### § 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（2024 年 10 月 31 日-2024 年 12 月 31 日）	报告期（2024 年 10 月 1 日-2024 年 12 月 31 日）	报告期（2024 年 10 月 31 日-2024 年 12 月 31 日）
	鹏华丰盛债券 A	鹏华丰盛债券 B	鹏华丰盛债券 D
1. 本期已实现收益	94.26	-5,543,120.67	0.72

2. 本期利润	88.08	663,662.09	0.83
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0083	0.0052	0.0076
4. 期末基金资产净值	30,578.93	123,287,112.91	200.83
5. 期末基金份额净值	1.0083	1.0619	1.0076

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益等未实现收益。

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 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

鹏华丰盛债券 A

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
自基金合同 生效起至今	0.83%	0.04%	0.74%	0.01%	0.09%	0.03%

鹏华丰盛债券 B

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	0.65%	0.40%	1.10%	0.01%	-0.45%	0.39%
过去六个月	3.50%	0.44%	2.19%	0.01%	1.31%	0.43%
过去一年	1.42%	0.42%	4.36%	0.01%	-2.94%	0.41%
过去三年	-8.14%	0.34%	13.06%	0.01%	-21.20%	0.33%
过去五年	6.47%	0.37%	21.77%	0.01%	-15.30%	0.36%
自基金合同	65.92%	0.31%	66.54%	0.02%	-0.62%	0.29%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

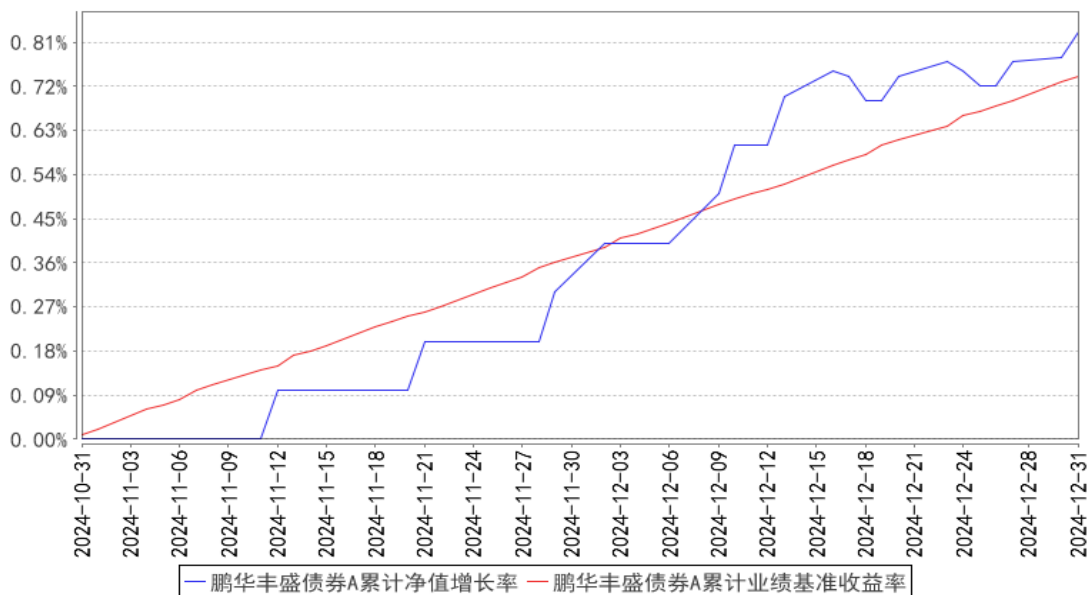
鹏华丰盛债券 D

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
自基金合同 生效起至今	0.76%	0.04%	0.74%	0.01%	0.02%	0.03%

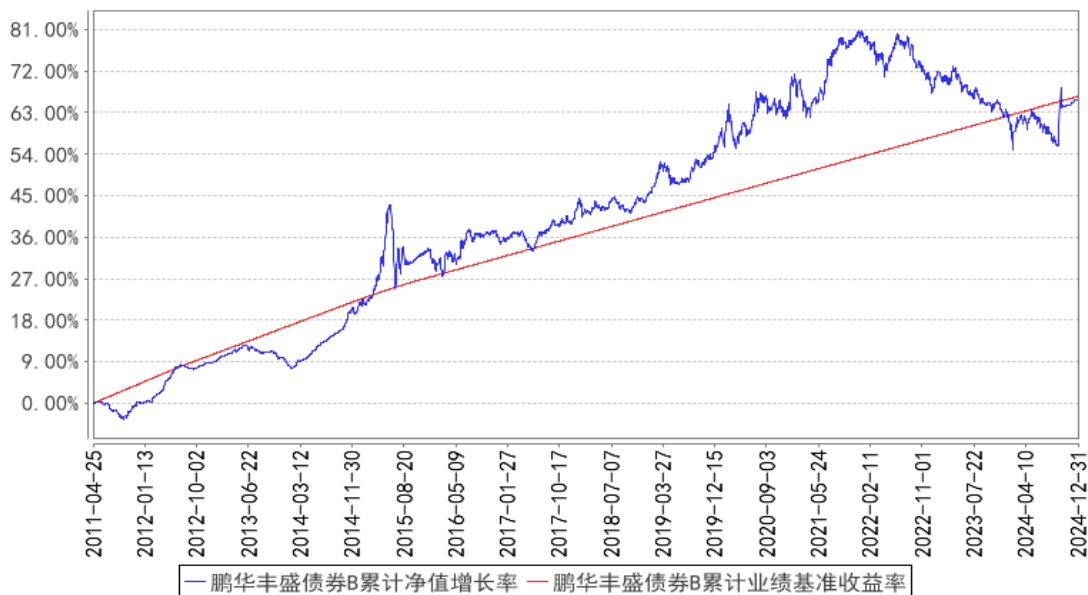
注：业绩比较基准=三年期银行定期存款利率（税后）+1.6%。

### 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

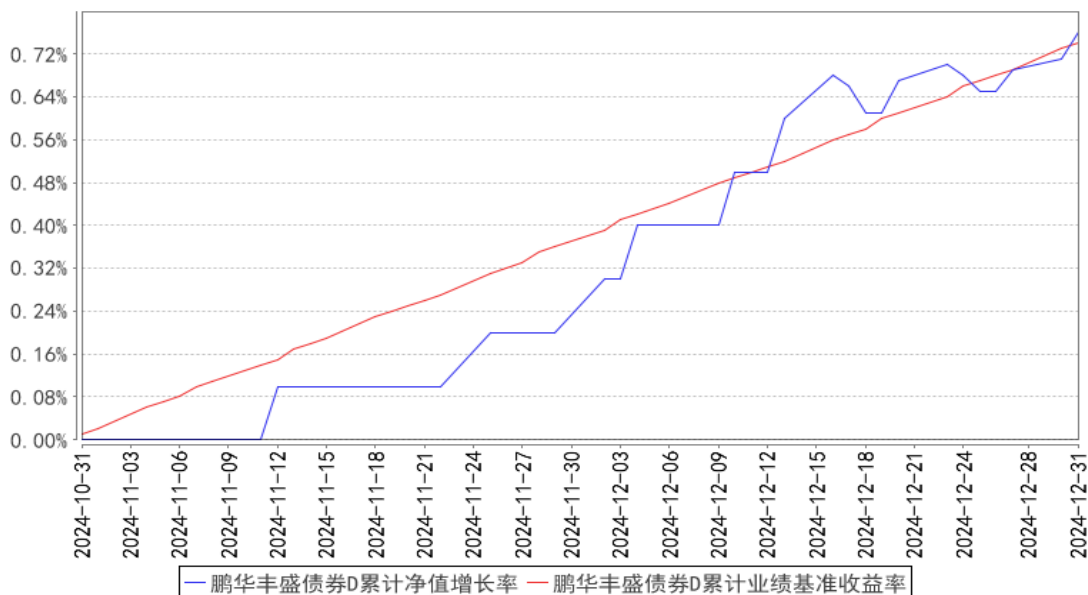
鹏华丰盛债券A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



鹏华丰盛债券B累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



鹏华丰盛债券D累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2011 年 04 月 25 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。

### 3.3 其他指标

注：无。

## § 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	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		



汤志彦	基金经理	2023-08-30	2024-10-16	14 年	<p>汤志彦先生, 国籍中国, 理学硕士, 14 年证券从业经验。历任 SAP 中国研究院项目经理, 伊藤忠 IT 咨询顾问, 国泰君安证券研究所研究员, 上海彤源投资有限公司高级研究员; 2017 年 2 月加盟鹏华基金管理有限公司, 历任绝对收益投资部基金经理助理/资深研究员, 现担任稳定收益投资部副总监/基金经理/投资经理。2017 年 07 月至 2020 年 08 月担任鹏华弘益灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2017 年 11 月至 2018 年 05 月担任鹏华兴锐定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2017 年 12 月至今担任鹏华弘嘉灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2018 年 10 月至今担任鹏华尊惠 18 个月定期开放混合型证券投资基金基金经理, 2020 年 06 月至今担任鹏华安和混合型证券投资基金基金经理, 2020 年 06 月至今担任鹏华安庆混合型证券投资基金基金经理, 2021 年 09 月至 2024 年 10 月担任鹏华安荣混合型证券投资基金基金经理, 2023 年 03 月至今担任鹏华安锦一年持有期混合型证券投资基金基金经理, 2023 年 07 月至 2024 年 08 月担任鹏华丰和债券型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2023 年 08 月至 2024 年 10 月担任鹏华丰盛稳固收益债券型证券投资基金基金经理, 汤志彦先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理发生变动, 增聘刘方正为本基金基金经理, 汤志彦不再担任本基金基金经理。</p>
刘方正	基金经理	2024-10-16	-	14 年	<p>刘方正先生, 国籍中国, 理学硕士, 14 年证券从业经验。2010 年 6 月加盟鹏华基金管理有限公司, 从事债券研究工作, 历任固定收益部高级研究员、基金经理助理, 现任稳定收益投资部副总经理/基金经理。2015 年 03 月至 2017 年 01 月担任鹏华弘利灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2015 年 03 月至 2015 年 08 月担任鹏华行业成长证券投资基金基金经理, 2015 年 04 月至 2017 年 01 月担任鹏华弘润灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2015 年 05 月至今担任鹏华弘和灵活配置混合型证券投资基金</p>

				<p>基金经理，2015 年 05 月至今担任鹏华弘华灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015 年 05 月至 2017 年 01 月担任鹏华弘益灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015 年 06 月至 2017 年 01 月担任鹏华弘鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015 年 08 月至今担任鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金基金经理，2015 年 08 月至 2017 年 01 月担任鹏华弘泰灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 03 月至 2017 年 05 月担任鹏华弘实灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 03 月至 2018 年 05 月担任鹏华弘锐灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 03 月至 2022 年 12 月担任鹏华弘信灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 08 月至 2023 年 12 月担任鹏华弘达灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 08 月至 2017 年 12 月担任鹏华弘嘉灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 09 月至 2022 年 08 月担任鹏华弘惠灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 11 月至 2018 年 01 月担任鹏华兴裕定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 11 月至 2024 年 11 月担任鹏华兴泰定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 12 月至 2024 年 04 月担任鹏华兴悦定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017 年 09 月至 2018 年 08 月担任鹏华兴益定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2018 年 05 月至今担任鹏华睿投灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2023 年 02 月至 2024 年 02 月担任鹏华永瑞一年封闭式债券型证券投资基金基金经理，2023 年 09 月至 2024 年 11 月担任鹏华弘实灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2024 年 07 月至今担任鹏华金城灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2024 年 09 月至今担任鹏华弘润灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2024 年 10 月至今担任鹏华丰盛稳固收益债券型证券投资基</p>
--	--	--	--	--

					金基金经理, 刘方正先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理发生变动, 增聘刘方正为本基金基金经理, 汤志彦不再担任本基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

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。

#### 4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注: 无。

#### 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。公司对不同投资组合在不同时间窗口下(日内、3日内、5日内)的同向交易价差进行专项分析, 未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

##### 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且对基金财产造成损失的异常交易行为。本报告期内未发生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% 的情况。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2024 年四季度, 随着政府对经济支撑力度的持续发力, 经济总需求呈现出一定触底回升的走势。房地产行业整体限制政策持续退出, 二级市场的看房量和成交量均有较大幅度的环比改善, 但一级市场土地和房产开发仍然较为疲弱。基建投资也有一定发力, 但受限于地方政府的财力整体效果也较弱。消费方面, 有一定回暖的表现, 尤其是一二线城市的消费有所修复, 同时伴随着政府补贴的落地, 对经济整体起到支撑作用。外需保持相对稳定, 但考虑到特朗普胜选即将

就任下一任美国总统，贸易摩擦的预期持续升温，外需的不确定性持续增强。金融方面，货币政策延续了宽松的基调，信贷需求持续偏弱的趋势并没有得到明显的解决，虽然货币政策进一步的宽松预期仍然较强，但效果有待持续跟进。

2024 年四季度，权益市场在三季度末爆发式上涨以后进入震荡阶段，成长、小盘股票占优，中小盘指数和科创板创业板表现相对突出。另外，高分红资产在市场资金向小盘股迁移过程中阶段性受到了一定压制，略有调整以后临近年底再次走出较强趋势。随着政治局会议和财政货币等政策配合发力，市场流动性处于较好状况，风险偏好也有利于权益类资产。债券方面，受益于流动性持续较好，且货币宽松预期持续较强，收益率水平延续回落走势，整体收益率曲线平坦化下行，信用利差和期限利差都处于较低水平。

本基金以追求稳定收益为主要投资策略，控制基金净值回撤幅度。在操作上，以固定收益资产为主要投资方向，保持积极的债券久期和信用配置结构，严控仓位的情况下参与各类固定收益资产投资。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期 B 类份额净值增长率为 0.65%，同期业绩比较基准增长率为 1.10%；D 类份额净值增长率为 0.76%，同期业绩比较基准增长率为 0.74%；A 类份额净值增长率为 0.83%，同期业绩比较基准增长率为 0.74%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

### § 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	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	106,148,340.34	85.87
	其中：债券	106,148,340.34	85.87
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	10,000,400.59	8.09
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-

	产		
7	银行存款和结算备付金合计	1,443,544.86	1.17
8	其他资产	6,016,353.25	4.87
9	合计	123,608,639.04	100.00

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注：无。

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

## 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

注：无。

## 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	1,518,950.96	1.23
2	央行票据	-	-
3	金融债券	49,226,102.02	39.92
	其中：政策性金融债	10,148,460.27	8.23
4	企业债券	10,199,262.47	8.27
5	企业短期融资券	5,053,986.03	4.10
6	中期票据	40,150,038.86	32.56
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	106,148,340.34	86.08

## 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	148600	24TCLK1	100,000	10,199,262.47	8.27
2	220207	22 国开 07	100,000	10,148,460.27	8.23
3	2228041	22 农业银行二级 01	90,000	9,534,326.30	7.73
4	2128047	21 招商银行永续债	90,000	9,348,497.26	7.58
5	102100446	21 濂溪城投 MTN001	85,000	8,814,602.00	7.15

## 5.6 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资产支持证券投资 明细

注：无。

## 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：无。

## 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：无。

## 5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

### 5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

### 5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

## 5.10 投资组合报告附注

### 5.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

国家开发银行在报告编制日前一年内受到国家金融监管总局北京监管局的处罚。  
交通银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局的处罚。  
兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局福建监管局的处罚。  
招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局的处罚。  
以上证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

### 5.10.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券备选库。

### 5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	14,865.17

2	应收证券清算款	6,000,858.08
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	630.00
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	6,016,353.25

#### 5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

#### 5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

#### 5.10.6 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。

### § 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	鹏华丰盛债券 A	鹏华丰盛债券 B	鹏华丰盛债券 D
报告期期初基金份额总额	-	162,237,021.82	-
报告期期间基金总申购份额	35,423.55	231,954.30	199.32
减：报告期期间基金总赎回份额	5,097.37	46,367,994.89	-
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-	-
报告期期末基金份额总额	30,326.18	116,100,981.23	199.32

### § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

#### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：无。

#### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：无。

### § 8 影响投资者决策的其他重要信息

#### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：无。

## 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- (一) 《鹏华丰盛稳固收益债券型证券投资基金基金合同》；
- (二) 《鹏华丰盛稳固收益债券型证券投资基金托管协议》；
- (三) 《鹏华丰盛稳固收益债券型证券投资基金 2024 年第 4 季度报告》（原文）。

### 9.2 存放地点

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。

### 9.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅，也可按工本费购买复印件，或通过本基金管理人网站（<http://www.phfund.com.cn>）查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人鹏华基金管理有限公司，本公司已开通客户服务系统，咨询电话：4006788999。

鹏华基金管理有限公司

2025 年 1 月 21 日