鹏华丰盛稳固收益债券型证券投资基金
2026 年第 3 季度报告

2026 年 9 月 30 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：2026 年 10 月 26 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约定，于 2026 年 10 月 23 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 2026 年 07 月 01 日起至 2026 年 09 月 30 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	49,384,733.37 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	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。 1、资产配置策略 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。 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。 运用固定比例组合保险策略（CPPI）时，需要事先设

	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，结合基金管理人对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，以实现对组合利率风险的有效控制。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。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。

	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。 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、成长性高、估值水平低的股票进行投资。 4、权证的投资策略 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。 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。		
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	1,971,026.42 份	46,793,800.99 份	619,905.96 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（2026 年 7 月 1 日-2026 年 9 月 30 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	23,968.19	1,096,065.45	1,606.45
2.本期利润	-102,796.06	-2,222,120.66	-67,033.36
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0645	-0.0474	-0.0905
4.期末基金资产净值	2,041,584.07	51,031,245.98	639,503.84
5.期末基金份额净值	1.0358	1.0906	1.0316

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
过去三个月	-4.21%	0.97%	1.10%	0.01%	-5.31%	0.96%
过去六个月	5.33%	0.94%	2.18%	0.01%	3.15%	0.93%
过去一年	1.96%	0.70%	4.35%	0.01%	-2.39%	0.69%
自基金合同生效起至今	3.58%	0.50%	8.34%	0.01%	-4.76%	0.49%

鹏华丰盛债券 B

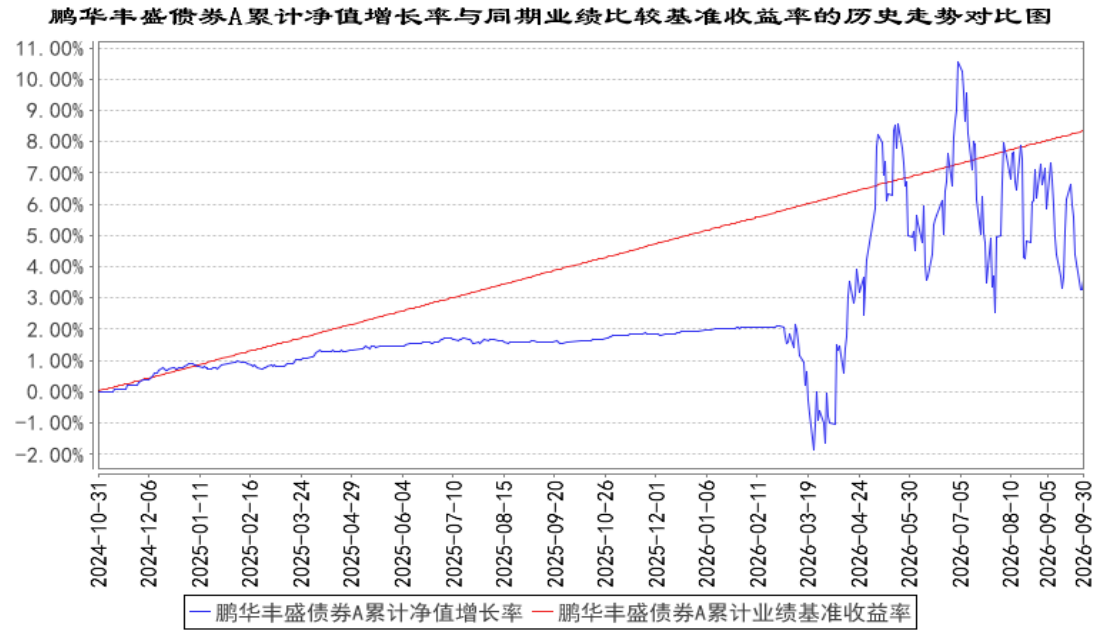
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-4.21%	0.97%	1.10%	0.01%	-5.31%	0.96%
过去六个月	5.33%	0.94%	2.18%	0.01%	3.15%	0.93%
过去一年	1.94%	0.70%	4.35%	0.01%	-2.41%	0.69%
过去三年	3.18%	0.47%	13.06%	0.01%	-9.88%	0.46%
过去五年	-4.50%	0.41%	21.76%	0.01%	-26.26%	0.40%
过去七年	12.69%	0.41%	30.47%	0.01%	-17.78%	0.40%
过去十年	25.07%	0.37%	43.52%	0.01%	-18.45%	0.36%
自基金合同生效起至今	70.40%	0.34%	74.14%	0.02%	-3.74%	0.32%

鹏华丰盛债券 D

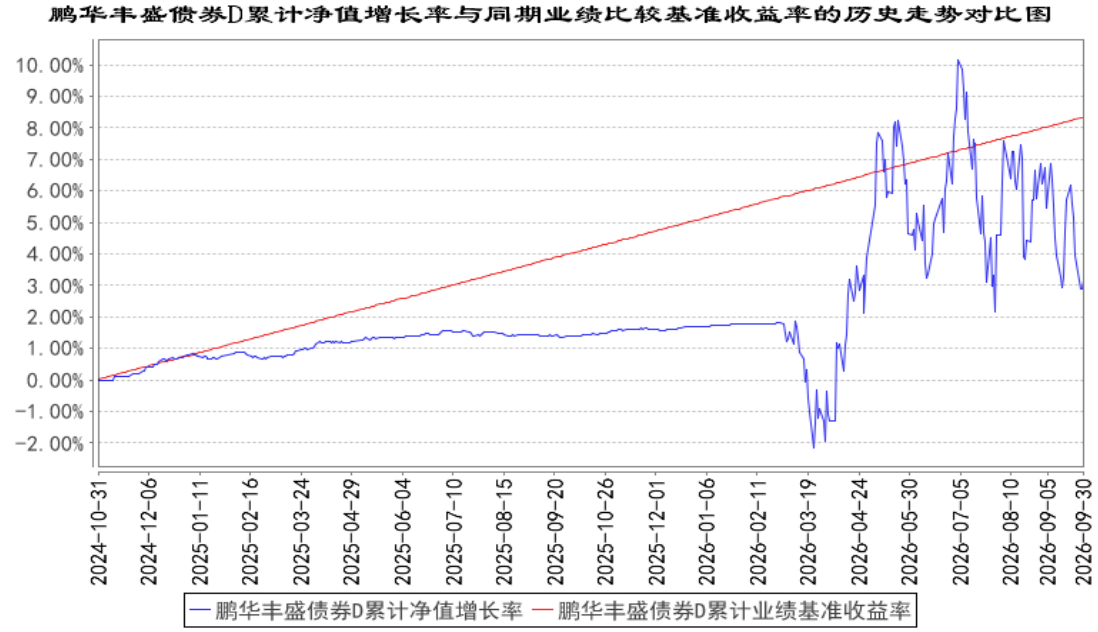
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-4.25%	0.97%	1.10%	0.01%	-5.35%	0.96%
过去六个月	5.22%	0.94%	2.18%	0.01%	3.04%	0.93%
过去一年	1.75%	0.70%	4.35%	0.01%	-2.60%	0.69%
自基金合同生效起至今	3.16%	0.50%	8.34%	0.01%	-5.18%	0.49%

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







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		

刘方正	本基金的基金经理	2024-10-16	-	16 年	刘方正先生,国籍中国,理学硕士,16 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 月至今担任鹏华弘华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 2025 年 07 月担任鹏华前海万科 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金基金经理,2025 年 07 月至今担任鹏华丰锐债券型证券投资基金（LOF）基金经理,2025 年 08 月至今担任鹏华宁华一年持有期混合型证券投资基金基金经理,2026 年 09 月至今担任鹏华丰和债券型证券投资基金（LOF）基金经理,2026 年 09 月至今担任鹏华弘惠灵活配置混合型证券投资基金基金经理,刘方正先生具备基金从业资格。
闫思倩	本基金的基金经理	2026-02-13	-	16 年	闫思倩女士,国籍中国,工程硕士,16 年证券从业经验。曾任华创证券分析师，中银国际证券业务经理，工银瑞信基金研究部基金经理。2022 年 1 月加盟鹏华基金管理有限公司，现担任董事总经理（MD）/权益投资三部总经理/投资总监/基金经理。2022 年 05 月至今担任鹏华沪深港新兴成长灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2022 年 07 月至今担任鹏华新能源汽车主题混合型证券投资基金基金经理，2023 年 03 月至今担任鹏华创新未来混合型证券投资基金（LOF）基金经理，2023 年 05 月至今担任鹏华碳中和主题混合型证券投资基金基金经理，2024 年 08 月至今担任鹏华科技驱动混合型发起式证券投资基金基金经理，2025 年 10 月至今担任鹏华制造升级混合型证券投资基金基金经理，2026 年 02 月至今担任鹏华丰盛稳固收益债券型证券投资基金基金经理,闫思倩女士具备基金从业资格。

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

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
闫思倩	公募基金	7	10,678,029,385.62	2022-05-07
	私募资产管理计划	3	595,603,757.45	2025-10-22
	其他组合	-	-	-
	合计	10	11,273,633,143.07	-

注：报告期内，闫思倩于 2026 年 08 月 18 日新任一只私募资产管理计划的投资经理。

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

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%的交易共有 6 次，为投资组合的投资策略需要而发生的同日反向交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2026 年三季度，宏观经济仍维系弱复苏走势，结构上有亮点，整体下行压力持续存在。以出口为导向的制造业仍是支撑经济的重要亮点，考虑结构占比，整体制造业相对稳定。随着年初信贷投放周期给经济的支撑作用逐步趋缓，基建、房地产等仍然偏弱，新质生产力等高质量发展维系投融资需求运转，科技领域投资相对较好。消费方面，整体社零也展现出一定压力。金融方

面，货币政策保持宽松，结构上调控金融体系杠杆率，贷款需求偏弱，金融体系流动性保持良好。

2026 年三季度，权益市场压力较大，呈现持续回落走势，在二季度末至三季度初的一个高位回调以后，市场信心整体不足，科创板和创业板等成长方向也有较大幅度调整，上证 50 相对调整幅度较小，中证 500 和中证 1000 等前期表现强势指数都有明显回落。但 AI 的发展依然在早期阶段，当前经济和行业基本面依然较好，三季报业绩超预期个股也较多。成长和科技股短期下跌较多。长期我们继续看好制造业和科技的成长股。债券方面，收益率曲线持续降低，尤其是长久期资产的利差压缩更为明显，债券走出一波较强势的行情。

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-4.21%，同期业绩比较基准增长率为 1.10%；A 类份额净值增长率为-4.21%，同期业绩比较基准增长率为 1.10%；D 类份额净值增长率为-4.25%，同期业绩比较基准增长率为 1.10%。

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	10,175,917.00	13.74
	其中：股票	10,175,917.00	13.74
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	57,055,209.48	77.05
	其中：债券	57,055,209.48	77.05
	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	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	6,784,586.94	9.16
8	其他资产	31,116.20	0.04
9	合计	74,046,829.62	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

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	10,175,917.00	18.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	10,175,917.00	18.95

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	603667	五洲新春	77,300	3,820,939.00	7.11
2	603009	北特科技	57,300	2,628,924.00	4.89
3	301529	福赛科技	11,100	1,560,660.00	2.91
4	301398	星源卓镁	15,000	570,000.00	1.06
5	002164	宁波东力	42,800	567,528.00	1.06
6	688017	绿的谐波	1,988	544,215.00	1.01
7	603286	日盈电子	6,300	287,406.00	0.54
8	300489	光智科技	700	194,845.00	0.36

9	300382	斯莱克	100	1,400.00	0.00

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	35,094,287.40	65.34
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	21,960,922.08	40.89
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	57,055,209.48	106.22

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	019835	26 国债 09	180,000	18,074,115.62	33.65
2	019846	26 国债 14	170,000	17,020,171.78	31.69
3	110090	爱迪转债	39,070	4,879,307.79	9.08
4	127037	银轮转债	10,590	4,348,238.04	8.10
5	113673	岱美转债	19,930	3,881,299.25	7.23

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

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。

5.10.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名证券没有超出基金合同约定的证券备选库。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	30,650.32
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	465.88
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	31,116.20

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	110090	爱迪转债	4,879,307.79	9.08
2	127037	银轮转债	4,348,238.04	8.10
3	113673	岱美转债	3,881,299.25	7.23
4	111022	锡振转债	3,798,204.42	7.07
5	123260	卓镁转债	2,659,319.00	4.95
6	127050	麒麟转债	2,349,827.53	4.37
7	127088	赫达转债	44,726.05	0.08

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	783,077.31	48,814,331.91	846,310.12
报告期期间基金总申购份额	2,789,677.24	4,843,379.03	1,569,846.08
减:报告期期间基金总赎回份额	1,601,728.13	6,863,909.95	1,796,250.24
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	1,971,026.42	46,793,800.99	619,905.96

§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 2026 年第 3 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：400-6788-533。

鹏华基金管理有限公司

2026 年 10 月 26 日