鹏华丰泰定期开放债券型证券投资基金更新的招募说明书摘要

基金管理人:鹏华基金管理有限公司
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司

二零一五年十一月

重要提示

本基金经2013年7月8日中国证券监督管理委员会下发的《关于核准鹏华丰泰定期开放债券型证券投资基金募集的批复》(证监许可[2013]901号文)核准,进行募集。根据相关法律法规,本基金基金合同已于2013年9月24日正式生效,基金管理人于该日起正式开始对基金财产进行运作管理。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准,但中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资人在投资本基金前,应全面了解本基金的产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,并承担基金投资中出现的各类风险,包括但不限于:系统性风险、非系统性风险、管理风险、流动性风险、本基金特定风险及其他风险等。

基金的过往业绩并不预示其未来表现,基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金表现的保证。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金管理人提醒投资人基金投资的"买者自负"原则,在投资人作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资人自行承担。投资者风险,投资人在投资本基金前应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为2015年9月23日,有关财务数据和净值表现截止日为2015年6月30日(未经审计)。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况

1、名称:鹏华基金管理有限公司
2、住所:深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心43层
3、设立日期:1998年12月22日
4、法定代表人:何如
5、办公地址:深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心43层
6、电话:(0755)82021233 传真:(0755)82021155
7、联系人:吕奇志
8、注册资本:人民币15亿元
9、股权结构:

出资人名称	出资额(万元)	出资比例
国信证券股份有限公司	7,500	50%
意大利欧利盛资本资产管理股份公司(Eurizon Capital SGR S.p.A.)	7,350	49%
深圳市北融信投资发展有限公司	150	1%
总 计	15,000	100%

(二)主要人员情况

1、基金管理人董事会成员

何如先生,董事长,硕士,高级会计师,国籍:中国。历任中国电子器件公司深圳公司副总会计师兼财务处处长、总会计师、常务副总经理、总经理、党委书记,深圳发展银行行长助理、副行长、党委委员、副董事长、行长、党委副书记,现任国信证券股份有限公司董事长、党委书记,鹏华基金管理有限公司董事长。

邓召明先生,董事,经济学博士,讲师,国籍:中国。历任北京理工大学管理与经济学院讲师、中国兵器工业总公司主任科员、中国证监会处长、南方基金管理有限公司副总经理,现任鹏华基金管理有限公司总裁,党总支书记。

孙俭扬先生,董事,经济学博士,国籍:中国。历任贵州省政府经济体制改革委员会主任科员、中共深圳市委改策研究室副处长、深圳证券结算公司常务副总经理、深圳证券交易所副总经理(集团)有限公司副理事长、香港深业控股有限公司副总经理、中国高新技术产业投资管理有限公司董事长兼行政总裁、鹏华基金管理有限公司董事总裁、国信证券股份有限公司副总裁,现任国信证券股份有限公司顾问。

庞中国先生,董事,会计学硕士研究生,国籍:中国。曾任深圳市华为技术有限公司定价中心经理助理;2000年7月起历任国信证券有限责任公司资金财务总部业务经理、外汇财务经理、高级经理、总经理助理、副总经理,国信证券股份有限公司人力资源总部副总经理、资金财务总部副总经理;2015年6月至今任国信证券股份有限公司资金财务总部总经理。

Massimo Mazzini先生,董事,经济和商学学士。国籍:意大利。曾在安达信(Arthur Andersen MBA)从事风险管理和资产管理工作,历任CA AIPG SGR投资总监、CAAM AI SGR及CA AIPG SGR首席执行官和投资总监、东方汇理资产管理股份有限公司(CAAM SGR)投资副总监、农业信贷兴美投资集团(Credit Agricole Alternative Investments Group)国际执行委员会委员、意大利欧利盛资本资产管理股份公司(Eurizon Capital SGR S.p.A.)投资方案管理投资总监、Epsilon 资产管理股份公司(Epsilon SGR)首席执行官,欧利盛资本股份公司(Eurizon Capital S.A.)(卢森堡)首席执行官、欧利盛AI资产管理股份公司(Eurizon AI SGR)首席执行官。现任意大利欧利盛资本资产管理股份公司(Eurizon Capital SGR S.p.A.)市场及业务发展总监,欧利盛资本股份公司(Eurizon Capital S.A.)(卢森堡)董事、VUB投资管理有限公司监事会成员。

Alessandro Varaldo先生,董事,经济学和商业管理博士,国籍:意大利。曾任米兰德意志银行集团Finanza e Futuro Fondi Sprind股份公司投资管理部债券基金和混合业务主管、IMI Fideuram资产管理股份公司投资管理部固定收益组合和现金管理业务负责人,圣保罗银行投资公司(Banca Sanpaolo Invest S.p.A.)财务及管理策划部负责人,Capitalia股份公司(Capitalia S.p.A.)产品和销售部负责人,Capitalia投资管理股份公司(Capitalia Investment Management S.A.)董事总经理,Unicredit Holding财务风险管理部意大利企业法人风险管理业务负责人,欧利盛资本资产管理股份公司(Eurizon Capital SGR S.p.A.)首席市场官兼投资方案管理部主管,欧利盛资本股份公司(Eurizon Capital S.A.)(卢森堡)董事,现任意大利联合圣保罗银行股份有限公司(Intesa Sanpaolo S.p.A.)储蓄、投资和养老金产品部负责人。

史际春先生,独立董事,法学博士,国籍:中国。历任安徽大学经济法学系副主任、中央金融工作委员会法学院教授、博士生导师,国务院特殊津贴专家,兼任中国法学会经济法学研究会副会长、北京市人大常委会和法制委员会委员。

张元先生,独立董事,大学本科,国籍:中国。曾任新疆军区干事、秘书、编辑、甘肃省委研究室干事、副处长、处长、副主任,中央金融工作委员会研究室主任,中国银监会政策法规部(研究局)主任(局长)等职务;2005年4月至2007年12月,任中央国债登记结算有限责任公司董事长兼党委书记;2007年12月至2010年12月,任中央国债登记结算有限责任公司监事长兼党委副书记。

高雅女士,独立董事,工商管理硕士,国籍:中国。曾任中国进出口银行副处长,负责贷款管理和运营,项目涉及制造业、能源、电信、跨国并购;2007年加入曼达林投资顾问有限公司,现任曼达林投资顾问有限公司执行合伙人。

2、基金管理人监事会成员

黄命荣先,监事会主席,研究生学历,国籍:中国。曾任中农信公司、正大财务公司工作,曾任鹏华基金管理有限公司董事、监事,现任深圳市北融信投资发展有限公司董事长。

Andrea Vismara先生,监事,法学学士,律师,国籍:意大利。曾在意大利多家律师事务所担任律师,先后在法国安信信贷集团(Credit Agricole Group)东方汇理资产管理股份有限公司(CAAM SGR)法务部、产品开发部,欧利盛资本资产管理股份公司(Eurizon Capital SGR S.p.A.)合理与股权部工作,现在欧利盛资本资产管理股份公司运营部工作。

陈冰女士,监事,本科学历,国籍:中国。曾任国信证券股份有限公司资金财务部会计、上海营业部财务科副科长、资金财务部资金科科员、资金财务部资金科主任会计师兼科长、资金财务部总经理助理、资金财务总部副总经理等,现任国信证券资金财务总部副总经理兼资金运营部总经理、融资融券部总经理。

于丹女士,职工监事,法学硕士,国籍:中国。历任北京市金杜(深圳)律师事务所律师;2011年7月加盟鹏华基金管理有限公司,历任监察稽核部法务主管,现任监察稽核部总经理助理。

郝文高先生,职工监事,大专学历,国籍:中国。历任深圳奥尊电脑有限公司证券基金事业部副经理、招商基金管理有限公司基金事务部总监;2011年7月加盟鹏华基金管理有限公司,现任登记结算部总经理。

刘筱先生,职工监事,管理学硕士,国籍:中国。历任华马证券(中国)管理顾问公司咨询顾问,南方基金管理有限公司北京分公司副总经理;2014年10月加入鹏华基金管理有限公司,现任北京分公司总经理。

3、高级管理人员情况

何如先生,董事长,简历同前。

邓召明先生,董事,总裁,简历同前。

高阳先生,副总裁,特许金融分析师(CFA),经济学硕士,国籍:中国。历任中国国际金融有限公司经理,博时基金管理有限公司博时价值增长基金基金经理、固定收益部总经理、基金裕隆基金经理、基金裕隆基金经理、股票投资部总经理,现任鹏华基金管理有限公司副总裁。

胡刚先生,副总裁,经济学硕士,国籍:中国。曾就职于全国社会保障基金理事会投资部、境外投资部,历任副主任科员、主任科员、副处长,鹏华基金管理有限公司总裁助理,现任鹏华基金管理有限公司副总裁。

高鹏先生,副总裁,经济学硕士,国籍:中国。历任博时基金管理有限公司监察法律部监察稽核经理,鹏华基金管理有限公司监察稽核部副总经理、监察稽核部总经理、职工监事、督察长,现任鹏华基金管理有限公司副总裁。

苏波先生,副总裁,管理学博士,国籍:中国。历任深圳经济特区证券公司研究所副所长、投资部经理,南方基金管理有限公司渠道服务二部总监助理,易方达基金管理有限公司信息技术部总经理助理,鹏华基金管理有限公司总裁助理、机构理财部总经理、职工监事,现任鹏华基金管理有限公司副总裁。

高永杰先生,督察长,法学硕士,国籍:中国。历任中共中央办公厅秘书局干部,中国证监会办公厅新闻处干部、秘书处副处级秘书、发行监管部副处长、人事教育部副处长、处长,现任鹏华基金管理有限公司督察长、监察稽核部总经理。

4、本基金基金经理

戴钢先生,国籍:中国,厦门大学经济学硕士,13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,历任鹏华研究员、专户投资经理等职;2011年12月起担任鹏华丰泽分级债券型证券投资基金经理,2012年6月起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,2013年5月起兼任鹏华丰实定期开放债券型证券投资基金基金经理,2013年9月起兼任鹏华丰泽分级债券型证券投资基金基金经理。戴钢先生具备基金从业资格。

本基金历任的基金经理:无

本基金基金经理管理其他基金情况:

2011年12月起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;

2013年5月起兼任鹏华丰实定期开放债券型证券投资基金基金经理;

2013年10月起兼任鹏华丰泽分级债券型证券投资基金基金经理。

5、投资决策委员会成员情况

邓召明先生,鹏华基金管理有限公司董事、总裁、党总支书记。

高阳先生,鹏华基金管理有限公司副总裁。

初冬女士,鹏华基金管理有限公司总裁助理、固定收益投资总监、固定收益部总经理,社保基金组合投资经理及鹏华丰盛稳固收益债券基金、鹏华双债增利债券基金、鹏华双债加利债券基金基金经理。

黄共涛先生,鹏华基金管理有限公司总裁助理、机构投资部总经理,社保基金组合投资经理,专户投资经理。

王咏辉先生,鹏华基金管理有限公司量化及衍生品投资部总经理,鹏华中证500指数(LOF)基金、鹏华地产分级基金、鹏华沪深300指数(LOF)基金、鹏华创业板分级基金、鹏华互联网分级基金基金经理。

陈鹏先生,鹏华基金管理有限公司基金管理部副总经理,鹏华中证50混合基金基金经理,鹏华消费领先混合基金基金经理。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

名称:上海浦东发展银行股份有限公司
注册地址:上海市中山东一路12号
办公地址:上海市中山东一路12号
法定代表人:吉晓辉
成立时间:1992年10月19日
组织形式:股份有限公司
注册资本:186.5347亿元人民币
存续期间:持续经营
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基金字[2003]105号
联系人:朱萍
联系电话:(021)61618888

上海浦东发展银行自2003年开展资产托管业务,是较早开展银行资产托管服务的股份制商业银行之一。经过二十年的稳健经营和业务开拓,各项业务发展一直保持较快增长,各项经营指标在股份制商业银行中处于较好水平。

上海浦东发展银行总行设资产托管部,下设证券托管处、客户资产托管处、养老金业务处、内控管理处、运营管理处五个职能处室。

上海浦东发展银行拥有客户资金托管、资金信托保管、证券投资基金托管、全球资产托管、保险资金托管、基金专户理财托管、证券公司客户资产托管、期货公司客户资产托管、私募证券投资基金托管、私募股权托管、银行理财产品托管、企业年金托管等多项托管产品,形成完备的产品体系,可满足多领域客户、境内外市场的资产托管需求。

三、相关服务机构

(一)基金份额销售机构

1、直销机构

(1)鹏华基金管理有限公司直销中心
办公地址:深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心43层
电话:(0755)82021233
传真:(0755)82021155
联系人:吕奇志

(2)鹏华基金管理有限公司北京分公司
办公地址:北京市西城区金融大街甲9号金融街中心南楼502室
电话:(010)88082426-178
传真:(010)88082018
联系人:李腾

(3)鹏华基金管理有限公司上海分公司
办公地址:上海市浦东新区花园石桥路33号花旗银行大厦801B室
电话:(021)68876878
传真:(021)68876821
联系人:李化怡

(4)鹏华基金管理有限公司武汉分公司
办公地址:武汉市江汉区建设大道568号新世界国贸大厦1座1001室
联系电话:(027)85557881
传真:(027)85557973
联系人:邓明辰

(5)鹏华基金管理有限公司广州分公司
办公地址:广州市天河区珠江新城华夏路10号富力中心24楼07单元
联系电话:(020)38927993
传真:(020)38927990
联系人:周楷

2、银行销售机构

(1)上海浦东发展银行股份有限公司
注册地址:上海市中山东一路12号
办公地址:上海市中山东一路12号
法定代表人:吉晓辉
电话:021-61618888
传真:021-63604199
联系人:唐苑
客服电话:95528
公司网址:www.spdb.com.cn

(2)中国工商银行股份有限公司
注册(办公)地址:北京复兴门内大街55号
法定代表人:姜建清
客户服务电话:95588(全国)
传真:010-66107913
联系人:刘秀宇
网址:www.icbc.com.cn

(3)交通银行股份有限公司
注册(办公)地址:上海市浦东新区银城中路188号
法定代表人:牛锡明
电话:021-58781234
传真:021-58408483
联系人:曹辉
客户服务电话:95559
公司网址:www.bankcomm.com

(4)上海银行股份有限公司
注册(办公)地址:上海市浦东新区银城中路168号
法定代表人:范一飞
客户服务电话:95594
联系人:汤征程
网址:www.bankofshanghai.com

(5)杭州银行股份有限公司
地址:杭州市庆春路46号杭州银行大厦
法定代表人:吴太普
联系人:严峻
客户服务电话:0571-96523,4008888508
网址:www.hzbank.com.cn

(6)东莞农村商业银行股份有限公司
注册地址:广东省东莞市城区南城路2号
法定代表人:何沛良
联系人:杨元
客户服务电话:961122
网址:www.drcbank.com

(7)中国邮政储蓄银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街3号
办公地址:北京市西城区金融大街3号
法定代表人:李国华
客户服务电话:95580
联系人:杨�
传真:(010)68858117
公司网址:www.psbc.com

(8)吉林银行股份有限公司
注册地址:吉林省长春市经济技术开发区东南湖大路1817号
法定代表人:唐国兴
客服电话:400-889-6666
联系人:孟明
网址:www.jlbank.com.cn

(9)南京银行股份有限公司
住所:江苏省南京市玄武区中山路288号
法定代表人:林复
客服电话:40088-96400
公司网址:www.njcb.com.cn

(10)东莞农村商业银行股份有限公司
注册地址:广东省东莞市城区南城路2号
法定代表人:何沛良
联系人:杨元
客服服务电话:961122
网址:www.drcbank.com

(11)广东顺德农村商业银行股份有限公司
注册(办公)地址:佛山市顺德区大良德和居委会拥翠路2号
法定代表人:吴海恒
客服服务电话:0757-22223388
网址:www.rcsbank.com.cn

3、券商销售机构

(1)国信证券股份有限公司
注册地址:深圳市罗湖区红岭中路1012 号国信证券大厦16-26 层
办公地址:深圳市罗湖区红岭中路1012 号国信证券大厦16-26 层
法定代表人:何如
联系电话:0755-82130833
传真:0755-82133952
联系人:周楷
客服服务电话:95536
网址:www.guosen.com.cn

(2)长城证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦16、17层
办公地址:深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
法定代表人:黄耀华
联系电话:0755-83516289
联系人:邓国
网址:www.cgws.com

(3)华西证券股份有限公司
注册地址:四川省成都市陕西街239号
办公地址:四川省成都市陕西街239号
法定代表人:杨炯洋
联系人:张曼
联系电话:010-68716150
传真:028-86150615
客服务咨询电话:400-8888-818
网址:www.hx168.com.cn

(4)光大证券股份有限公司
注册地址:上海市静安区新闸路1508号
办公地址:上海市静安区新闸路1508号
法定代表人:薛峰
联系电话:021-22169081
传真:021-68817271
联系人:刘晨
客户服务电话:95525
公司网址:www.ebscn.com

(5)湘财证券股份有限公司
注册地址:湖南省长沙市天心区湘府中路198号标志商务中心A栋11层
办公地址:湖南省长沙市天心区湘府中路198号标志商务中心A栋11层
法定代表人:林俊波
联系电话:021-68634518
传真:021-68865680
联系人:钟康莹
客户服务电话:400-888-1551
网址:www.xcsc.com

(6)信达证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区闹市口大街9 号院1 号楼信达金融中心
办公地址:北京市西城区闹市口大街9 号院1 号楼信达金融中心
法定代表人:张志刚
联系人:唐静
联系电话:010-63080985
客服热线:400-800-8899
网址:www.cindasc.com

(7)安信证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路2222号安联大厦34层、28层A02单元
办公地址:深圳市福田区金田路2222号安联大厦34层、28层A02单元
深圳市福田区深南大道2008号中国凤凰大厦1栋5层
法定代表人:牛冠兴
联系电话:0755-82825551
传真:0755-82558355
联系人:陈剑虹
客服服务电话:4008001001
网址:www.essence.com.cn

(8)申万宏源证券有限公司
注册地址:上海市徐汇区长乐路989号45层
办公地址:上海市徐汇区长乐路989号45层
法定代表人:李梅
联系电话:021-33389888
联系人:曹晔
客户服务电话:95523或4008895523
电话委托:021-962505
网址:www.swhysc.com

(9)中国中投证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层-21层及第04层01、02、03、05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23单元
办公地址:深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋04、18-21层
法定代表人:龙增来
联系人:刘毅
联系电话:0755-82023442
客户服务热线:400 600 8008,95532
网址:www.china-invs.cn

(10)广州证券股份有限公司
注册地址:广州市天河区珠江新城珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层
办公地址:广州市天河区珠江新城珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层
法定代表人:邱三发
联系人:林洁茹
联系电话:020-88836999
传真号码:020-88836654
客服热线:021-961303
网址:www.gzs.com.cn

(11)中信建投证券股份有限公司
注册地址:北京市朝阳区安定门外大街188号6号楼
办公地址:北京市东城区朝内大街188号
法定代表人:王常青
联系人:权唐
传真:010-65182261
客服电话:4008888108
公司网站:www.csc108.com

(12)天风证券股份有限公司
注册地址:湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦4楼
办公地址:湖北省武汉市武昌区中南路99号保利广场A座37楼
法定代表人:余磊
联系人:崔成
电话:027-87610052
传真:027-87618863
客户服务电话:4008005000
网址:http://www.tfzq.com

(13)华鑫证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01(b)单元
办公地址:上海市肇嘉浜路750号
法定代表人:俞洋
联系人:陈毅
电话:021-64339000
传真:021-54668802
客户服务电话:021-32109999;029-68918888;4001099918
网址:www.cfzq.com.cn

(14)中国国际金融股份有限公司
注册地址:北京市建国门外大街1号国贸写字楼2座27层及28层
办公地址:北京市建国门外大街1号国贸写字楼2座27层及28层
法定代表人:丁学东
电话:010-65051166
传真:010-85679203
联系人:杨颖宇
客户服务电话:400-910-1166
网址:www.cicc.com.cn

4、期货公司销售机构

1)中信建投期货有限公司
注册地址:重庆市渝中区中山三路107号上站大楼平街11-B、名义层11-A、8-B4、9-B、C
办公地址:重庆市渝中区中山三路107号皇冠大厦11楼
法定代表人:彭文德
客户服务电话:400-8877-780
联系电话:023-86769742
联系人:谢宇
网址: www.cfc108.com

5、第三方销售机构

(1)深圳众禄基金销售有限公司
注册地址:深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼
法定代表人:薛峰
客服电话:4006-788-887
传真:0755-82080798
联系人:邓爱萍
网址:www.zlfund.cn、www.jjmmw.com

(2)诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司
办公地址:上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心8楼801室
法定代表人:汪静波
客服电话:400-821-5399
传真:021-38509777
联系人:何菁菁
网址:www.noah-fund.com

(3)杭州数米基金销售有限公司
办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼
法定代表人:陈柏青
联系电话:4000-766-123
传真:0571-26698533
联系人:周娟芝
网址:www.fund123.cn

(4)天相投资顾问有限公司
办公地址:北京市西城区金融街5号新盛大厦B座4层
法定代表人:林义相
客服电话:010-66045678
传真:010-66045627
联系人:林爽
网址:www.txsec.com

(5)上海长量基金销售投资顾问有限公司
办公地址:上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层
法定代表人:张跃伟
客服电话:400-089-1289
传真:021-58787698
联系人:刘凯
电话:021-58788678-8201
传真:021-58787698
客服电话:400-089-1289
网址:www.chinalong.com

(6)上海好买基金销售有限公司
办公地址:上海市浦东南路1118号鄂尔多斯大厦903-906室
住所:上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室
法定代表人:杨文斌
客服电话:400-700-9665
传真:021-50325989
联系人:陶怡
网址:www.ehowbuy.com

(7)北京展恒基金销售有限公司
办公地址:北京市顺义区后沙峪镇安富街6号
法定代表人:闫振杰
联系人:陈丽娟
传真:(+86-10)6202 0088 转8802
客服电话:400 888 6661
网址:www.myfund.com

(8)浙江同花顺基金销售有限公司
办公地址:浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903
法定代表人:李晓涛
客服电话:(0571)86768888
传真:(0571-88911818
联系人:蒋泽君
网址:www.10jqka.com.cn

(9)上海天天基金销售有限公司
住所:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
办公地址:上海市徐汇区龙田路195号3C座10楼
法定代表人:其实
联系人:陶莉莉
联系电话:020-87599527
客服电话:4001818188
网址:www.1234567.com.cn

(10)浙江金诚诚财富管理有限公司@住所:拱墅区霞湾巷239号8号楼4楼403室@办公地址:杭州市教工路18号EAC欧美中心A座D区8层@法定代表人:陆彬彬@联系人:鲁盛@联系电话:0571-56028617@客服电话:4000680058@网址:www.jincheng-fund.com

(11)和讯信息科技有限公司
住所:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
办公地址:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
法定代表人:王莉
联系人:于扬
联系电话:021-20835888
客服电话:400-920-0022
网址:licaikb.hexun.com

(12)深圳市前兰德证券投资咨询有限公司
住所:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#
办公地址:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#
法定代表人:马令海
联系人:邓洁
联系电话:010-58321388-1105
客服电话:010-58325327
网址:jrxinlande.com.cn

(13)宜信普泽投资顾问(北京)有限公司
住所:北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809
办公地址:北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809
法定代表人:唐宇
联系人:王巨明
联系电话:010-52855650
客服电话:400-6099-500
网址:www.yixinfund.com

(14)泛华普益基金销售有限公司
住所:四川省成都市成华区建设路9号高地中心1101室
办公地址:四川省成都市成华区建设路9号高地中心1101室
法定代表人:于海锋
联系人:黄曦
联系电话:028-84252471
客服电话:400-8878-566
网址:www.pyfund.cn

(15)中期时代基金销售(北京)有限公司
住所:北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢11层1103号
办公地址:北京市朝阳区建国门外光华路16号1幢11层
法定代表人:路瑶
联系人:侯英建
联系电话:010-59539888
客服电话:400-8888-160
网址:www.cifcofund.com

(16)上海汇付金融服务有限公司
住所:上海市中山南路100号金外滩国际广场19楼
办公地址:上海市中山南路100号金外滩国际广场19楼
法定代表人:张凯
联系人:黄敏儿
联系电话:020-38788832-823
客服电话:440-8202-819
网址: https://fund.bundtrade.com

(17)北京乐融多源投资咨询有限公司
住所:北京市朝阳区西大望路1号1号楼1603
办公地址:北京市朝阳区西大望路1号融科望京中心A座16层
法定代表人:董浩
联系人:于婷婷
联系电话:13811217674
客服电话:400-068-1176
网址:www.jimufund.com

(18)北京恒天明泽基金销售有限公司
住所:北京市北京经济技术开发区宏达北路10号5层5122室
办公地址:北京市北京经济技术开发区宏达北路10号5层5122室
法定代表人:黄永伟
联系人:侯仁凤
联系电话:010-57756068
客服电话:400-786-8868
网址:www.chtfund.com

(19)北京增财基金销售有限公司
住所:北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208室
办公地址:北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208室
法定代表人:王昌庆
联系人:罗细安
联系电话:010-67000988
客服电话:400-001-8811
网址:www.zcvc.com.cn

(20)上海陆金所资产管理有限公司
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼
法定代表人:郭坚
联系人:何雪
联系电话:021-20662010
客服电话:4008219031
网址:www.lu.com

(21)深圳腾元基金销售有限公司
住所:深圳市福田区福华一路卓越世纪中心1号楼1806-1810
办公地址:深圳市福田区福华一路卓越世纪中心1号楼1806-1810
法定代表人:胡越鑫
联系人:王巍萍
联系电话:0755-33376853
客服电话:4006-877-899
网址:www.ytfund.com

基金管理人可根据有关法律法规要求,根据实情,选择其他符合要求的机构销售本基金或变更上述销售机构,并及时公告。

(二)登记机构

名称:鹏华基金管理有限公司
注册地址:深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心43层
办公地址:深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心43层
法定代表人:何如
联系人:吴群莉
联系电话:0755-82021106
传真:0755-82021165

(三)律师事务所

名称:广东嘉得信律师事务所@住所:深圳市罗湖区笋岗东路中民时代广场A座201
负责人:闫齐双
办公地址:深圳市罗湖区笋岗东路中民时代广场A座201

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	固定收益投资	191,205,273.10	83.91
	其中:债券	191,205,273.10	83.91
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	6,307,677.27	2.77
7	其他资产	30,355,161.61	13.32
8	合计	227,868,111.98	100.00

2、报告期末股行业分类的股票投资组合
注:本基金本报告期末未持有股票。
3、报告期末股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:本基金本报告期末未持有股票。
4、报告期末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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	188,340,003.80	134.51
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	2,865,269.30	2.05
8	其他	-	-
9	合计	191,205,273.10	136.56

5、报告期末股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	112080	12万向债	337,530	34,482,064.80	24.63
2	122814	11东营债	292,000	30,154,840.00	21.54
3	122889	10冶色债	280,000	27,591,200.00	19.71
4	122070	11海航01	233,160	23,782,320.00	16.99
5	122806	PR大同债	284,440	19,973,376.80	14.26

6、报告期末股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:本基金本报告期末未持有资产支持证券。
7、报告期末股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:本基金本报告期末未持有贵金属。
8、报告期末股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:本基金本报告期末未持有权证。
9、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1)本期国债期货投资政策

本基金根据国债期货的投资品种为本基金的国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、地方政府债、中期票据、短期融资券、可转换债券(含分离交易可转债)、资产支持证券、中小企业私募债、次级债、债券回购、银行存款以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金不直接买入股票、权证等其他品种,其所持有可转换债券基金基金持有的股票、因投资于分离交易可转债而产生的权证,在其可上市交易后不超过10个交易日的时间内卖出。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:本基金对债券的投资比例不低于基金资产的90%,但在每次开放期前三个月、开放期内及开放期结束后三个月的期间内,基金投资不受上述比例限制;开放期内现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。

八、基金的投资策略

(一)投资策略

本基金债券投资将主要采取久期策略,同时辅之以信用利差策略、收益率曲线策略、收益率曲线策略、收益率曲线策略。

1、资产配置策略

在资产配置方面,本基金通过对宏观经济形势、经济周期所处阶段、利率曲线变化趋势和信用利差变化趋势的重点分析,比较未来一定时间内不同债券品种和债券市场的相对预期收益率,在基金规定的投资比例范围内对可转债、不同久期、信用特征的券种,及债券与现金资产之间进行动态调整。

2、久期策略

本基金将主要采取久期策略,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。为控制风险,本基金采用以"目标久期"为中心的资产配置方式。目标久期的设定划分为两个层次:战略性配置和战术性配置。"目标久期"的战略性配置由投资决策委员会确定,主要根据对宏观经济和资本市场的预期分析决定组合的目标久期。"目标久期"的战术性配置由基金经理根据市场短期因素的影响在战略性配置预先设定的范围内进行调整。如果预期利率下降,本基金将增加组合的久期,直至接近目标久期上限,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,直至目标久期下限,以减小债券价格下降带来的风险。

3、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,运用采用子弹式、杠铃或梯形策略构造组合,并进行动态调整。

4、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,随着其剩余期限的跨减,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。

5、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。

6、债券选择策略

根据单个债券利率期限收益率相对于市场收益率曲线的偏离程度,结合信用等级、流动性、选择权条款、税赋特点等因素,确定其投资价值,选择定价合理或价值被低估的债券进行投资。

7、中小企业私募债投资策略

本基金将深入研究发行人资信及公司运营情况,与中小企业私募债券承销券商紧密合作,合理合规合格地进行中小企业私募债券投资。本基金在投资过程中密切监控债券信用等级或发行人信用等级变化情况,力求规避可能存在的债券违约,并获取超额收益。

(二)投资决策依据及程序

1、投资决策依据

(1)有关法律、法规和基金合同的有关规定。

(2)经济运行态势和证券市场走势。

(3)投资对象的风险收益配比。

2、投资决策程序

(1)投资决策委员会:确定本基金总体资产分配和投资策略。投资决策委员会定期召开会议,如需做出及时重大决策或基金经理小组提议,可临时召开投资决策委员会会议。

(2)基金经理(或管理小组):设计和调整投资组合需要考虑的基本因素包括:每日基金申购和赎回净现金流量;基金合同的投资限制和比例限制;研究员的投资建议;基金经理的独立判断;绩效与风险评估小组的建议等。

(3)集中交易室:基金经理向集中交易室下达投资指令,集中交易室经理收到投资指令后分发予交易员,交易员收到基金投资指令后准确执行。

(4)绩效与风险评估小组:对基金投资组合进行评估,向基金经理(或管理小组)提出调整建议。

(5)监察稽核部:对投资流程等进行合法合规审核,监督和检查。

(6)本基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据市场环境变化和实际需要调整上述投资决策程序,并予以公告。

九、基金的业绩比较基准

一年期定期存款税后利率+0.5%。

一年期定期存款利率是中国人民银行公布的金融机构一年期人民币存款基准利率。反映了国民闲置资金在银行存入一年定期存款所能获得的年收益率,扣除利率税后为实际可得收益率。该利率可反映本基金目标客户群体风险收益偏好且期限与本基金封闭期一致,可以作为本基金的业绩比较基准。

十、基金的风险收益特征

本基金属于债券型基金,其预期的收益与风险低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金,为证券投资基金中具有较低风险收益特征的品种。

十一、基金的投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本报告