

# 鹏华丰瑞债券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：招商银行股份有限公司  
2018年12月

## 重要提示

本基金经2016年9月23日中国证券监督管理委员会下发的《关于准予鹏华丰瑞债券型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2016]2173号）注册，进行募集。根据相关法律法规，本基金合同已于2017年4月26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投资管理。

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备案，但中国证监会对本基金募集的注册，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。中国证监会对本基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

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。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。

本基金投资范围包括中小企业私募债，中小企业私募债作为一种高风险资产，其信用评级一般不对这类债券进行外部评级，可能会降低市场对其的认可度，从而影响到这类债券的市场流动性；中小企业私募债的信用风险高于该类债券发行主体的资产规模较大、经营的波动性较大，同时，各种材料（包括招股说明书、审计报告）不公开发布，也大大提高了分析并跟踪发债主体信用基本面的难度。

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。基金管理人遵循基金份额持有人利益优先原则，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。投资有风险，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。

本招募说明书所载内容截止日为2018年10月24日，有关财务数据和净值表现截止日为2018年9月30日（未经审计）。

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42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) 82021156  
7. 联系人：吕奇志  
8. 注册资产：人民币15亿元  
9. 股权结构：

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。

邓明胜先生，党委书记、董事、总裁，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、中国证监会第六、七届发审委委员，现任鹏华基金管理有限公司党委书记、总裁。

罗煜扬先生，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、中共深圳市委政策研究室副处长、深圳证券结算公司常务副总经理、深圳市交易所首任行政总监、香港深业（集团）有限公司助理总经理、香港深业控股有限公司副总裁、中国高新科技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兼总裁、国信证券股份有限公司副总裁、国信证券股份有限公司副经理。

Massimo Mazzini先生，董事，经济和商科学士，国籍：意大利。曾任安达信（Arthur Andersen, MBA）在中国区风险管理及资产管理业务。历任CAIA AIGP SGR 投资总监、CAAM AI SGR及CA AIGP SGR 首席执行官投资总监、东方汇理资产管理股份有限公司（CAAM SGR）投资副总监、农业信贷另类投资集团（Credit Agricole Alternative Investments Group）欧洲执行委员会成员、意大利利 credi 资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）投资方方案部投资总监、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）首席执行官和总经理。现任意大利利 credi 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。

Andrea Vismara先生，董事，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，先后在意大利农业信贷集团（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.）治理与股权部工作。现任担任意大利利 credi 资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）董事会秘书兼任企业事务部总经理，欧利盛资本股份公司（Eurizon Capital S.A.）（卢森堡）企业服务部总经理。

中国国籍先生，董事，会计学硕士，高级会计师，注册会计师，国籍：中国。历任深圳华为技术有限公司内控中心经理助理、国信证券股份有限公司资金财务总部业务经理、深圳金地企业服务有限公司财务管理、资金财务总部高级经理、总经理助理、副总经理、人力资源部副经理兼财务、现任国信证券股份有限公司财务负责人、资金财务总部高级经理兼人力资源总部总经理。

中国国籍先生，独立董事，法学博士，国籍：中国。历任安徽大学讲师、中国人民大学副教授、法学博士、中国人民大学教授、博士生导师、国务院特殊津贴专家、兼任中国法学会经济法研究会副会长、北京市人大常委会立法专家委员会委员。

张元先生，独立董事，大学本科学历，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，中央金融工委委员会研究室主任、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。

高辉女士，独立董事，工商管理硕士，国籍：中国。曾任中国进出口银行副行长、负责贷款管理和合规，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  
俞渝先生，监事会主席，研究生学历，国籍：中国。曾在中农信公司、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。

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、上海海誉财务部财务科副科长、资金财务部财务科副经理、资金财务部资金经理、资金财务部主任会计师兼风险控制、资金财务部总经理助理、资金经理、副总经理等，现任国信证券股份有限公司总部副总经理兼资金运营部总经理、融资融券部总经理。

SANDRO VESPRINI先生，监事，工商管理学学士，国籍：意大利。先后在米兰圣学院任出纳、税务事务助理、非机动车辆发动机和变速箱生产企业管理顾问工作，圣保罗PMI资产管理SCRR企业经理，圣保罗财富管理企业管控部门经理，曾任欧洲利资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）财务管理和风险管理、现任欧洲利资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）财务负责人。

尹丹女士，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；2014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。

魏文高先生，职工监事，大学学历，国籍：中国。历任深圳奥尊电脑有限公司证券业务部副经理、招商基金管理有限公司总经理、鹏华基金总部总监；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。

刘敏先生，职工监事，管理学硕士，国籍：中国。历任毕马威（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，现任鹏华基金管理有限公司总裁助理、首席市场官兼市场发展部、北京分公司总经理。

3. 高级管理人员情况  
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。

邓明胜先生，党委书记、董事、总裁，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、中国证监会第六、七届发审委委员，现任鹏华基金管理有限公司党委书记、总裁。

罗煜扬先生，党委副书记、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副经理兼增长基金基金经理、固定收益部总经理、基金裕泽基金经理、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党委副书记、副总裁。

彭彬先生，副总裁，工商管理硕士，法学硕士，国籍：中国。历任中国人民大学校办科员，中国证监会办公厅副处级秘书，全国社保基金理事会证券投资部处长、股权投资部（弘毅投资）副主任，并于2014年至2015年期间担任中国证监会第十六届主板发审委专职委员，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经理、监察稽核部副经理、职工监事、督察长，现任鹏华基金管理有限公司副经理。

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、投资部主管，南方基金管理有限公司市场部渠道服务部二部总监助理，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、机构理财部总监、职工监事，现任鹏华基金管理有限公司副经理。

高永杰先生，纪委书记，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处长、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纪委书记、督察长。

韩亚庆先生，副总经理，经济学硕士，国籍：中国。历任国家开发银行资金部主任科员，全国社保基金理事会投资部副研究员，南方基金管理有限公司固定收益部基金经理、固定收益部总监，现任鹏华基金管理有限公司副总裁、固定收益投资总监、固定收益部总经理。

4. 本基金基金经理  
刘海先生，国籍中国，理学硕士，5年证券基金从业经历。2013年4月加盟鹏华基金管理有限公司，从事债券投资研究工作，担任固定收益部基金经理研究员。2016年05月至2018年06月担任鹏华国金债债券基金经理，2016年05月至2018年06月担任鹏华丰瑞债券基金经理，2017年02月至2018年06月担任鹏华丰华债券基金经理，2017年02月至2017年06月担任鹏华丰安债券基金经理，2017年02月担任鹏华丰恒债券基金经理，2017年06月担任鹏华丰盛债券基金经理，2017年06月担任鹏华普天债券基金经理，2018年03月担任鹏华弘盛混合基金基金经理，2018年03月担任鹏华丰源债券基金基金经理，2018年10月担任鹏华3个月中短债基金基金经理，2018年10月担任鹏华3个月中短债基金基金经理。刘涛先生具备基金从业资格。

5. 本基金基金经理的其他基本情况  
2016年05月至2018年06月担任鹏华国金债债券基金基金经理  
2016年05月担任鹏华丰瑞债券基金基金经理  
2016年11月担任鹏华丰华债券基金基金经理  
2017年02月至2018年06月担任鹏华丰安债券基金基金经理  
2017年02月担任鹏华丰恒债券基金基金经理  
2017年02月担任鹏华丰盛债券基金基金经理  
2017年06月担任鹏华普天债券基金基金经理  
2018年03月担任鹏华弘盛混合基金基金经理  
2018年03月担任鹏华丰源债券基金基金经理  
2018年07月担任鹏华丰悦发起式定开债券基金基金经理  
2018年10月担任鹏华3个月中短债基金基金经理  
2018年10月担任鹏华3个月中短债基金基金经理  
2017年04月至2018年06月 刘太阳先生

5. 投资决策委员会成员情况

邓明胜先生，鹏华基金管理有限公司党委书记、董事、总裁。  
高阳先生，鹏华基金管理有限公司党委副书记、副总裁。  
彭彬先生，鹏华基金管理有限公司副总裁。  
高鹏先生，鹏华基金管理有限公司副经理。  
姚庆先生，鹏华基金管理有限公司副经理。

魏文高先生，鹏华基金管理有限公司研究部总经理，鹏华新兴产业混合、鹏华研究精选混合、鹏华创新驱动混合基金经理。  
赵强先生，鹏华基金管理有限公司资产配置与基金投资部FOF投资副总监。

6. 上述人员之间不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

（一）基金托管人概况  
1. 基本情况  
名称：招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）  
设立日期：1987年4月8日  
注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦  
办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦  
注册资本：252.20亿元  
法定代表人：李建强  
行长：田惠宇  
资产托管业务批准文号：证监基金字[2002]83号  
电话：0755-83199084  
传真：0755-83195201  
2. 资产托管部信息披露负责人：张燕

招商银行成立于1987年4月8日，是我国第一家完全由企业法人持股的股份制商业银行，总行设在深圳。自成立以来，招商银行先后进行了三次增资扩股，并于2002年3月成功地发行了15亿A股，4月9日在上交所挂牌（股票代码：3968），10月5日行使H股超额配售，共发行了724.21万股。截至2018年6月30日，本集团总资产65,373.40亿元人民币，高级法下资本充足率15.09%，权重法下资本充足率12.44%。

2002年8月，招商银行成立基金托管部；2005年8月，经经中国证监会同意，更名为资产托管部，下设业务管理部、产品管理部、业务运营管理部、基金投资部、基金外包业务、基金估值部、基金核算部、基金业务运营部，成为国内第一家获得证券投资基金托管资格上市银行；2003年4月，正式成为基金托管业务。招商银行作为托管业务资质最全的商业银行，拥有证券投资基金托管、受托投资管理业务、合格境外机构投资者托管（QFII）、合格境内机构投资者托管（QDII）、全国社会保障基金托管、保险资金托管、企业年金基金托管等业务资格。

招商银行的“因势而变、先您所想”的托管理念和“财富所托、信守承诺”的托管核心价值，独创“6S托管银行”品牌体系，“保护您的业务、保护您的财富”为历史使命，不断创新托管系统、服务和产品：在业内率先推出“网上托管银行系统”、托管业务综合系统“6+2”托管服务标准，首家发布私募基金绩效分析报告，开办国内首个托管银行网站，成功托管国内第一只券商集合资产管理计划、第一只RFP、第一只信托资金计划、第一只股权私募基金、第一家实现货币市场基金赎回资金T+1到账、第一只境外银行ODII基金、第一只红利ETF基金、第一“1+N”基金专户理财、第一家大小非解禁资产、第一单TOT保管，实现从单一托管服务向全面投资者服务机构的转变，得到了业内认可。

招商银行资产托管业务持续稳健发展，社会影响力不断提升，四度蝉联《财富》“中国最佳托管专业奖”。2016年6月招商银行荣膺《财富》“中国最佳托管银行奖”，成为国内一获得该奖项的托管银行；“托管通”获得国内《银行家》2016中国金融创新“十佳金融创新产品奖”；“获荣膺2016年“中国资产管理”金贝奖”“最佳资产托管银行奖”；2017年6月再度荣膺《财富》“中国最佳托管银行奖”。

“全功能网上托管银行2.0”荣获《银行家》2017中国金融创新“十佳金融创新产品奖”；8月荣膺国际财经权威媒体《亚洲银行家》“中国最佳托管银行奖”；2018年1月获颁由中央国债登记结算有限责任公司与中国证券业协会共同颁发的“2017年度优秀资产托管机构”奖项。同时招商银行“托管大数据平台风险管理系统”荣获2016-2017年度银监会系统“金点子”方案一等奖，以及中央金融团工委、全国金融联盟第五届“双提升”方案一等奖；3月招商银行荣获公募基金20年“最佳基金托管银行”奖，5月荣膺国际财经权威媒体《亚洲银行家》“中国年度托管银行奖”。

（二）主要人员情况  
李建强先生，本行董事长，非执行董事，2014年7月起担任本行董事长、董事。英国伦敦大学工商管理硕士、吉林大学经济学博士。曾任2003年7月至2013年5月历任上海银行副行长、中国建设银行上海市分行副行长、深圳市分行行长、中国建设银行零售业务总监兼北京市分行行长。

王良先生，本行副行长，货币银行学硕士，高级经济师。1991年至1995年，在中国科学院国际信托投资公司工作；1996年6月至2001年10月，历任招商银行北京分行副行长兼支行主任、支行行长助理、副行长、行长、北京分行风险控制部总经理；2001年10月至2006年3月，历任北京分行风险控制助理、副行长；2006年3月至2008年6月，任北京分行党委书记、副行长（兼总行）；2008年6月至2012年6月，任北京分行行长兼党委书记；2012年6月至2013年11月，任招商银行总行行长助理兼北京分行行长、党委书记；2013年11月至2014年12月，任招商银行总行行长助理；2015年1月起担任本行副行长；2016年11月起兼任本行董事局秘书。

姜然女士，招商银行资产托管部总经理，大学本科学历，具有基金托管人高级管理人员任职资格。先后任职于中国建设银行黑龙江省分行、华商银行、中国工商银行深圳市分行，从事信贷管理、托管等工作。2002年9月加盟招商银行至今，历任招商银行总行资产托管部高级经理、高级助理、副经理，是国内首家推出的网上托管银行的主要设计、开发之一者，具有20余年银行信贷及托管专业从业经验。在托管产品创新、服务流程优化、市场营销及客户关系管理等领域具有深入的研究和丰富的实务经验。

（三）基金托管业务经营情况  
截至2018年6月30日，招商银行股份有限公司累计托管389只开放式基金。

（四）托管人的内部控制制度  
1. 内部控制目标  
招商银行确保托管业务严格遵守国家有关法律法规和行业监管制度，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念；形成科学合理的决策机制、执行机制和监督机制，防范和化解经营风险，确保托管业务的稳健运行和托管资产的安全；建立有利于澄清防弊、堵塞漏洞、消除隐患，保证业务稳健运行的风险控制制度，确保托管业务信息真实、准确、完整、及时；确保内控机制、体制的不断改进和各项业务制度、流程的及时更新。

2. 内部控制组织结构  
招商银行资产托管业务建立三级内审风险防范体系，并实施前、中、后三道防线。一级风险防范是在招商银行总行风险管控层面对风险进行预防和控制；

二级风险防范是在招商银行资产托管部设立稽核检查室，负责部门内风险预防和控制；

三级风险防范是在招商银行资产托管部设置专业岗位时，遵循内部控制制衡原则，制业务的风险制度制定相应监督制衡机制。

3. 内部控制原则  
（1）全面性原则。内部控制覆盖各项业务过程和操作环节，覆盖所有部门和岗位，不留业务死角。

（2）审慎性原则。托管组织架构的设置、内部控制制度的建立均以防范风险、审慎经营为出发点，具有有效的内部控制作为部门控制的核心，体现“内控优先”的要求。

（3）独立性原则。招商银行资产托管部各室、各岗位职责保持相对独立，不同托管资产之间、托管资产和自有资产之间相互分离。内部控制的检查、评价部门独立于内部控制的建立和执行部门。

（4）有效性原则。内部控制具有高度的权威性，任何人不得拥有不受内部控制约束的权利，内部控制存在的问题能够得到及时的反馈和纠正。

（5）适应性原则。内部控制能够适应招商银行业务风险管理的需要，并能够随着托管业务经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律、法规、政策制度等外部环境的变化及时进行修订和完善。

（6）防火墙原则。招商银行资产托管部配备独立的托管业务技术系统，包括网络系统、应用系统、安全防护系统、数据备份系统。（7）重要性原则。内部控制能够在实现全面控制的基础上，关注重要托管业务事项和高风险领域。（8）制衡性原则。内部控制能够实现对托管组织架构体系、机构设置及权责分配、业务流程等方面形成相互制约、相互监督，同时兼顾运营效率。

4. 内部控制措施  
（1）完善的制度建设。招商银行资产托管部从托管业务内部控制管理、产品管理、会计核算、资金清算、岗位管理、档案管理和信息管理等方面制定一系列规章制度，保证资产托管业务科学化、制度化、规范化运作。

（2）经营风险控制。招商银行资产托管部制定投资项目审批、资金清算与会计核算双人双岗、大额资金专人跟进、凭证管理等一系列完整的操作流程，有效地控制业务运作过程中的风险。

（3）业务信息风险控制。招商银行资产托管部在数据传输和保存方面有着严格的加密和备份措施，采用加密、直连方式传输数据，数据执行异地备份措施，所有的业务信息必须经过严格的授权方能进行传输和备份。

（4）客户资料风险控制。招商银行资产托管部对业务办理过程中形成的客户资料，视同客户个人资料，客户资料不得泄露，有关人员如需调阅，须经主管领导和审批，并做好调阅记录。

（5）信息技术系统风险控制。招商银行对信息技术系统管理实行双人双岗双责、机房24小时值班并设置门禁管理、电脑密码设置及权限管理、业务网络和办公网、托管业务网与行业务网分开等措施，与外部业务机构实行防火墙保护，对信息技术系统采取两地三中心的应急备份管理措施，保证信息传输和业务的安全。

（6）人员培训、激励机制。招商银行资产托管部建立良好的人文文化和员工培训、激励机制，加强人力资源管理及建立人才梯队及人才储备机制，有效的提升人力资源管理水平。

（五）基金托管人对基金管理人运用基金资产进行监督的方法和程序  
根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关法律法规的规定及基金合同、托管协议的约定，对基金投资范围、投资比例、投资禁止等情况的合法性、合规性进行监督和核查。

在为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，基金托管人对基金管理人发送的投资指令，基金管理人对其在各基金费用的提取与支付情况进行检查监督，对违反法律法规、基金合同的指令拒绝执行，并立即通知基金管理人。

基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规及其他有关规定，或者违反基金合同约定，及时以书面形式通知基金管理人进行整改，整改的时限应当符合法律法规及基金合同允许的调整期限。基金管理人收到通知后应及时核对，并以书面形式向基金托管人发出回函并改正。基金管理人应对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

## 三、相关服务机构

1. 基金销售机构  
（1）直销机构  
名称：招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）  
办公地址：深圳市福田區福華三路168号深圳国际商会中心43层  
联系电话：0755-82021233  
传真：0755-82021156  
联系人：吕奇志  
网址：www.phfund.com  
（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602房  
联系电话：010-88082426  
传真：010-88082018  
联系人：张圆圆  
（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号花旗集团大厦801B室  
联系电话：021-68876878  
传真：021-68876821  
联系人：李怡化  
（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668号新世界国贸大厦1座3305室  
联系电话：027-85557891  
传真：027-85557953  
联系人：胡月明  
（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：周媛  
2. 其他销售机构  
（1）证券公司销售机构  
名称：鹏华基金管理有限公司  
住所：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  
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  
联系电话：(0755) 82021877  
传真：(0755) 82021167  
负责人：范伟强  
（2）上海陆家嘴国际信托有限公司  
住所：上海市浦东新区陆家嘴世纪金融广场3号楼11楼  
法定代表人：俞卫群  
办公地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼  
联系电话：021-31358666  
传真：021-31358600  
联系人：陈丽华  
经办律师：黎明、陈丽华  
名称：毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）  
住所：北京市东城区东长安街1号东方广场东2座办公楼4层  
法定代表人：邹俊  
办公地址：北京市东城区东长安街1号东方广场东2座办公楼4层  
联系电话：(755) 2652 8930  
联系人：蔡正虹  
经办会计：吴钟鸣、胡悦

4. 基金名称：鹏华丰瑞债券型证券投资基金

5. 基金运作方式及类型  
契约型开放式、债券型基金

6. 基金的投资目标  
本基金的投资目标是：在严格控制风险的基础上，通过利差分析和对利率曲线变动趋势的判断，提高资金流动性和收益率水平，力争取得超越业绩比较基准的收益。

7. 基金的风险收益特征  
本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国债、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、超短期融资券，可分离交易可转债的纯债部分、资产支持证券、中小企业私募债、次级债、同业存单、债券回购、银行存款等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）。本基金不投资于股票、权证等权益类资产，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。

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80%，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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或中国证监会调整上述资产配置比例，基金管理人可在履行适当程序后，可对上述资产配置比例进行调整。

8. 基金的投资策略  
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、收益利率策略、息差策略、债券选择策略等积极投资策略，在严格控制风险的基础上，通过利差分析和对利率曲线变动趋势的判断，提高资金流动性和收益率水平，力争取得超越业绩比较基准的收益。

（1）资产配置策略  
在资产配置方面，本基金将对宏观经济形势、经济周期所处阶段、利率曲线变动趋势和信用利差变动趋势进行综合分析，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，在基金规定的投资比例范围内对不同久期、信用特征的券种及债券与现金之间进行动态调整。

（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，以实现相对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：战略性配置和技术性配置。“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并决定组合的目标久期。“目标久期”的技术性配置由基金经理根据市场短期利率的影响在战略性配置预先设定的范围内进行动态调整。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）收益曲线策略  
收益率曲线的形状变化是判断市场整体走向的重要依据之一，本基

金将通过对收益曲线变化进行调整，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。

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。这一策略通过在对收益率曲线的分析，在可选的目标久期区间买入预期收益率曲线斜率较陡的债券，在沿着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降，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为安全边际。

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  
根据同一债券到期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. 中小企业私募债券投资策略  
本基金将深入研究与发行人资质情况及公司运营情况，与中小企业私募债券承销商紧密合作，合理确定合格池中的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及发行人信用等级变化情况，力求规避可能存在风险的债券违约，并获取超额收益。

8. 资产支持证券的投资策略  
本基金将综合运用战略资产配置和战术资产配置进行资产支持证券的投资组合管理，并根据信用风险、利率风险和流动性风险变化积极调整投资策略，严格遵守法律法规和基金合同的约定，在保证本金安全和基金资产流动性的基础上获得投资收益。

9. 基金的业绩比较基准  
中债总指数收益率

中债总指数由中央国债登记结算公司编制，并在中国债券网（www.chinabond.com.cn）公开发布，具有较强的权威性和市场影响力；该指数按主要债券品种分类、国债和政策性金融债，能较好地反映债券市场的整体状况。本基金属债券型基金，主要投资于固定收益类金融工具，为此，本基金选取中债总指数作为本基金的业绩比较基准。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩比较基准的指数时，本基金管理人，与基金托管人协商一致后可以变更业绩比较基准，报中国证监会备案，并及时公告，但不需要召开基金份额持有人大会。

10. 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。

11. 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年10月25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。

本报告期末资产净值7,000,000.00元  
本报告期自2018年07月01日起至09月30日  
1. 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(人民币元)	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	1,446,150,952.06	90.96
	其中:债券	1,344,146,000.00	84.56
	资产支持证券	102,006,952.06	6.42
4	贵金属投资	--	--
5	买入返售金融资产	--	--
6	银行存款和结算备付金合计	110,583,957.57	6.96
7	其他资产	32,869,107.06	2.07
8	合计	1,589,594,016.68	100.00

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合  
（1）报告期末按行业分类的境内股票投资组合  
注：无。  
（2）报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
注：无。

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股票投资明细  
注：无。

4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合  
（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债券投资明细

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	227,389,000.00	14.94
3	金融债券	227,389,000.00	14.94
	其中:政策性金融债	227,389,000.00	14.94
4	企业债券	36,386,000.00	2.29
5	企业短期融资券	242,130,000.00	15.25
6	中期票据	828,177,000.00	52.13
7	可转换债(可交换债)	--	--
8	回购债券		