

鹏华丰腾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：中国民生银行股份有限公司
2018年12月
重要提示

本基金经2016年9月9日中国证券监督管理委员会下发的《关于准予鹏华丰腾债券型证券投资基金注册的批复》注册，进行募集。根据相关法律法规，本基金基金合同已于2016年10月27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注册，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。

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，投资者在投资本基金前，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，并承担本基金投资出现的各类风险，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，中小企业私募债券的流动性风险在于该类债券采取非公开方式发行和交易，由于不公开资料，外部评级机构一般不对这类债券进行外部评级，可能会降低市场对该类债券的认可度，从而影响该类债券的市场流动性。中小企业私募债券的信用风险在于该类债券发行主体的资产规模较小、经营的波动性较大，同时，各类材料（包括招股说明书、审计报告）不公开发布，也大大提高了分析和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。基金管理人提醒投资者基金投资的“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。

本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为2018年10月26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

- (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1.5亿元
 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%
意大利欧利资本资产管理有限公司 (Eurizon Capital SGR S.p.A.)	7,360	48%
深圳市北融信投资有限公司	150	1%
合计	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。

邓明忠先生，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。

孙煜扬先生，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、深圳证券交易所首任行政总监、香港深业(集团)有限公司助理总经理、香港深业投资有限公司副总经理、中国高新技术产业投资管理有限公司董事长兼执行总裁、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、国信证券股份有限公司公司副司。

Massimo Mazzini先生，董事，经济和商学士，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 AIFP SGR投资总监、CAAM AI SGR及CA AIFP 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、农业信贷另类投资部门（Credit Agricole Alternative Investments Group）国际执行委员会委员、意大利欧利资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）投资方案部投资总监、Epsilon 资产管理股份公司（Epsilon SGR）首席执行官、欧利资本资产管理股份公司（Eurizon Capital S.p.A.）（卢森堡）首席执行官和总经理。现任意大利欧利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 Vismanà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，先后在英国农业信贷集团（Credit Agricole Group）东方汇理资产管理股份有限公司（CAAM SGR）市场与产品部、产品开发部、欧利资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）的融资及股权工作，现在担任意大利欧利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，欧利资本资产管理股份公司（Eurizon Capital S.p.A.）（卢森堡）企业服务部总经理。

周中国先生，董事，会计学硕士，高级会计师，注册会计师，国籍：中国。历任深圳华力技术有限公司定价中心经理助理、国信证券股份有限公司资金财务部总部业务经理、深圳金地证券财务部财务管理、资金财务部高级经理、总经理助理、副总经理、人力资源总部副总经理等职务。现任国信证券股份有限公司财务负责人、资金财务部总部总经理兼人力资源部总经理。

史广春先生，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，现任中国人民大学法学院教授、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，大学本科学，国籍：中国。曾任宁夏军区主任、秘书、编辑，甘肃省委研究室主任、副处长、处长、副主任，中央金融工作委员会宁夏区主任，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。

高懿女士，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
 黄俞先生，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，现任深圳市广信信证科技发展有限公司董事长。

陈欣女士，监事，本科学历，国籍：中国。曾任深圳市融通信息股份有限公司财务部经理、上海耀华资产财务部副科长、资金财务部财务副经理、资金财务部资金经理、资金财务部主任会计师兼稽核经理、资金财务部助理助理、资金财务部副经理等，现任国信证券股份有限公司财务部副总经理兼运营部副经理、融资融券部副经理。

SANDRO VERPRIN先生，监事，工商管理学士，国籍：意大利。先后在米兰军医院出纳部、税务师事务所、菲亚特汽车发动机变速器平台管理团队工作，圣保罗IMI资产管理SGR企业经理职务，圣保罗资产管理企业管控工作，曾任欧利资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）财务管理与投资经理，现任欧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；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专员，现任监察稽核部总经理助理。

郝文女士，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。

刘悦先生，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。

邓明忠先生，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。

高阳先生，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博士后价值增长基金经理，固定收益部总经理，基金裕隆基金经理，基金裕隆基金经理、鹏华投资管理有限公司党委书记、鹏华基金管理有限公司副总裁。

邢彪先生，副总裁，工商管理硕士、法律硕士，国籍：中国。历任中国人民大学校办科员，中国证监会办公厅主任科员，全国社保基金理事会证券投资部处长、股权管理部（实业部）副主任；自2014年起至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稽核部监察稽核经理，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总裁。

苏波先生，副总裁，管理学博士，国籍：中国。历任深圳国际技术证券公司产品研究部副科长、投资部副经理，南方基金管理有限公司渠道服务部二部副经理助理，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，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局主任科员，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总裁、固定收益部总监、固定收益部副经理。

4. 本基金基金经理
 刘涛先生，国籍中国，理学硕士，5年证券基金从业经验。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，担任固定收益部研究员。2016年05月至2018年08月担任鹏华国信联合债券基金基金经理，2016年05月担任鹏华丰腾定期开放债券基金基金经理，2016年11月担任鹏华丰腾债券基金基金经理，2017年02月至2018年06月担任鹏华丰腾债券基金基金经理，2017年02月至2017年09月担任鹏华丰安债券基金基金经理，2017年02月至2018年06月担任鹏华丰腾债券基金基金经理，2017年02月至2018年06月担任鹏华丰恒债券基金基金经理，2017年05月担任鹏华丰腾债券基金基金经理，2017年02月担任鹏华丰恒债券基金基金经理，2017年03月担任鹏华丰恒债券基金基金经理，2018年03月担任鹏华丰安债券基金基金经理，2018年03月担任鹏华丰安债券基金基金经理，2018年07月担任鹏华丰安债券基金基金经理，2018年10月担任鹏华3个月短债基金基金经理，刘涛先生具备基金从业资格。

本基金基金经理的其他基金情况：
 2016年05月至2018年08月担任鹏华国信联合债券基金基金经理
 2016年05月担任鹏华丰腾定期开放债券基金基金经理
 2016年11月担任鹏华丰腾债券基金基金经理
 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月至2017年09月担任鹏华丰安债券基金基金经理
 2017年02月至2018年06月担任鹏华丰恒债券基金基金经理
 2017年05月担任鹏华丰腾债券基金基金经理
 2017年02月至2018年06月担任鹏华丰恒债券基金基金经理
 2017年03月担任鹏华丰恒债券基金基金经理
 2018年03月担任鹏华丰安债券基金基金经理
 2018年03月担任鹏华丰安债券基金基金经理
 2018年07月担任鹏华丰安债券基金基金经理
 2018年10月担任鹏华3个月短债基金基金经理

方刚先生，国籍中国，经济学硕士，4年证券基金从业经验。曾任中国工商银行资产管理部投资经理；2016年12月加盟鹏华基金管理有限公司，现任固定收益部担任基金经理。2018年07月担任鹏华丰腾债券基金基金经理，2018年10月担任鹏华信用增利债券基金基金经理。方刚先生具备基金从业资格。

本基金基金经理管理的其他基金情况：
 2018年10月担任鹏华信用增利债券基金基金经理
 本基金历任的基金经理：
 2016年10月至2018年06月 刘太阳先生
 5. 投资决策委员会成员情况
 邓明忠先生，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。
 邢彪先生，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总裁。
 韩亚庆先生，鹏华基金管理有限公司副总裁。
 梁浩先生，鹏华基金管理有限公司研究部总经理，鹏华新兴产业融合、鹏华研究精选组合、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：中国民生银行股份有限公司（以下简称“中国民生银行”）
 住所：北京市西城区复兴门内大街2号
 办公地址：北京市西城区复兴门内大街2号
 法定代表人：洪崎
 成立时间：1996年2月7日
 基金托管业务批准文号：证监基金字[2004]1101号
 组织形式：其他股份有限公司（上市）
 注册资本：23,365,585,227元人民币
 存续期间：持续经营
 电话：010-58560666
 联系人：罗菲菲

中国民生银行是我国首家主要由非国有企业入股的全股份制商业银行，同时也是严格按照《公司法》和《商业银行法》建立的规范的股份制金融企业。多种经济成份在中国金融业的涉足和实现规范的现代企业制度，使中国民生银行有别于国有银行和其他商业银行，而为国内外经济界、金融界所关注。中国民生银行成立二十年来，业务不断拓展，规模不断扩大，效益逐年递增，并保持了快速稳健的发展势头。

2006年12月19日，中国民生银行A股股票（600016）在上海证券交易所挂牌上市。2003年9月18日，中国民生银行40亿可转换公司债券在上交所正式挂牌发行。2004年11月8日，中国民生银行通过银行间债券市场发行了68亿元人民币次级债券，成为中国第一家在全国银行间债券市场成功发行次级债券的商业银行。2006年10月26日，民生银行成功完成股权分置改革，成为中国首家完成股权分置改革的商业银行，为中国资本市场股权分置改革提供了成功范例。2009年11月26日，中国民生银行在香港交易所挂牌上市。

中国民生银行自上市以来，按照“团结奋进，开拓创新，培育人才，严格管理，规范行为，敬业守诺；讲求实效，提高效率，健康发展”的经营发展方针，在改革发展与独立运行之间进行了有益探索，先后推出了“大集中”科技平台、“双核”考核机制、“三三”工程、独立评审制度、八大基础管理系统、集中处理商业模式及事业部改革等制度创新，实现了低风险、快增长、高效益的战略目标，树立了充满生机与活力的崭新商业银行形象。

2013年度，民生银行荣获中国银行业协会股权和创业投资专业委员会年度中国优秀股权和创业投资中介机构“最佳资产管理银行”及由21世纪传媒颁发的2013年PE/VC最佳金融服务托管银行奖。

2013年荣获中国内部审计协会民营企业内部审计优秀企业。
 在第八届“21世纪亚洲金融年会”上，民生银行荣获“2013-亚洲最佳金融服务银行”大奖。
 在“2013第五届卓越竞争力金融机构评选”中，民生银行荣获“2013卓越竞争力品牌建设银行”奖。

在中国社科院发布的《中国企业社会责任蓝皮书（2013）》中，民生银行荣获“中国企业上市公司社会责任指数第一名”、“中国民营企业社会责任指数第一名”、“中国银行业社会责任指数第一名”。

在2013年第16届中国最佳企业公民评选中，民生银行荣获“2013年度中国最佳企业公民大奖”。
 2013年还获得年度品牌金博奖“品牌贡献奖”。
 2014年荣获《亚洲企业业协会》“最佳金融最佳”、“年度公益慈善优秀项目奖”。
 2014年荣获《亚洲企业业协会》“第四届最佳投资公司”大奖和“2014亚洲企业管治典范奖”。

2014年被《中国》《金融时报》、《博鳌观察》联合授予“亚洲贸易金融创新服务”称号。
 2014年还荣获《亚洲银行家》“中国最佳中小企业贸易金融银行奖”，获得《21世纪经济报道》颁发的“最佳资产管理私人银行”奖，获评《经济观察报》“年度最佳私人银行”等。

2015年度，民生银行在《金融时报》举办的2015年度金融理财金貔貅奖评选中荣获“金牌创新力托管银行”奖。
 2015年度，民生银行荣获《EUROMONEY》2015年度“中国最佳实物黄金投资银行”称号。

2015年度，民生银行连续第四次获评《企业社会责任蓝皮书（2015）》“中国银行业社会责任发展指数第一名”。
 2015年度，民生银行在《经济观察报》主办的2014-2015年度中国卓越金融奖评选中荣获“年度卓越创新战略创新银行”和“年度卓越直销银行”两项大奖。

2016年度，民生银行荣获2016胡润中国新金融50强和2016中国最具创新模式新金融企业奖。

2. 主要人员情况
 张庆先生，中国民生银行资产管理部总经理，博士研究生，具有基金托管人高级管理人员任职资格，从事过金融租赁、证券托管、银行管理等工作，具有25年金融从业经历，不仅有丰富的一线实操经验，还有扎实的总行管理经验。历任中国民生银行西安分行副行长、中国民生银行沈阳分行筹备组组长、行长、党委书记。

3. 基金托管业务经营情况
 中国民生银行股份公司于2004年7月9日获得基金托管资格，成为《中华人民共和国证券投资基金法》颁布后首家获批从事基金托管业务的银行。为了更加地发挥后发优势，大力发展托管业务，中国民生银行股份有限公司资产管理部从成立伊始就本着充分保护基金持有人的利益，为持有人提供高品质托管服务的原则，高起点地建立系统、完善制度、组织人员。资产管理部目前共有员工70人，平均年龄37岁，100%员工拥有大学本科以上学历，65%以上员工具有硕士以上学历。基金业务人员100%都具有基金从业资格。

中国民生银行坚持以客户需求为导向，秉承“诚信、严谨、高效、务实”的经营理念，依托丰富的资产托管经验、专业的托管业务服务和先进的托管业务平台，为海内外客户提供安全、准确、及时、高效的专项托管服务。截至2018年9月30日，中国民生银行已托管178只证券投资基金。中国民生银行于2007年推出“托付行动·享财富”托管业务品牌，塑造专业品牌，提升服务水平。此外，高效的专项托管服务，截至2018年9月30日，中国民生银行已托管178只证券投资基金。中国民生银行于2007年推出“托付行动·享财富”托管业务品牌，塑造专业品牌，提升服务水平。

(一) 基金托管人内部控制目标
 1. 内部风险控制目标
 强化内部治理，保障国家金融方针政策及相关法律法规贯彻执行，保证自觉合规经营，形成一套运作规范、管理科学化、监控制度化的内控体系，保障业务正常运行，维护基金份额持有人的合法权益。
 2. 内部风险控制组织结构
 中国民生银行股份有限公司基金托管业务内部控制组织结构由中国民生银行股份有限公司审计部、资产管理部内设风险管理部及资产管理部内设中心共同组成。总行审计部对各业务部、风险管理部进行监督检查。资产管理部内设独立、专业的风险监控中心，负责提供托管业务风险控制工作总体思路与计划、组织、指导、协调、监督各业务中心风险控制工作的实施。各业务中心在各岗位职责范围内实施具体的风险控制措施。

3. 内部风险控制原则
 (1) 全面性原则：风险控制必须覆盖资产管理业务的所有中心和岗位，渗透各项业务过程和业务环节，对风险控制责任落实到每一位业务中心和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的控制责任。
 (2) 独立性原则：资产管理部设立独立的风险监督中心，该中心保持高度的独立性和权威性，负责对托管业务风险控制工作进行指导和监督。
 (3) 相互制约原则：各中心在内部控制结构的设计上要形成一种相互制约的机制，建立不同岗位之间的制衡体系。
 (4) 成本效益原则：建立完备的风险管理指标体系，使风险管理更具客观性和可操作性。

(5) 防火墙原则：托管部自身财务与基金财务严格分开，托管业务日常操作部门与行政、研发和营销等部门严格分离。
 4. 内部控制缺陷控制和措施
 (1) 制度建设—建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度。
 (2) 建立健全的组织管理架构：前中后台分离，不同部门、岗位相互牵制。
 (3) 识别与评估风险：风险管理中心指导业务中心进行风险识别、评估、制定并实施风险控制措施。
 (4) 对独立的操作业务操作：业务操作相对独立，实施门禁管理和音像监控。
 (5) 人员管理：进行定期的业务与职业道德培训，使人员树立风险意识与控制理念，并签订承诺书。
 (6) 应急预案：制定完善的应急预案，并组织员工定期演练；建立独立灾难备份中心，保证业务不中断。

5. 资产管理部内部控制
 中国民生银行股份有限公司控制环境、风险评估、控制活动、信息沟通、监控等五个方面构建了托管业务风险控制体系。
 (1) 坚持风险管理与业务发展同等重要的理念。托管业务是商业银行新兴的中间业务，中国民生银行股份有限公司资产管理部从成立之日起就特别强调规范运作，一直将建立一系统、高效的防范风险内部控制体系作为工作之重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展，新问题新情况不断出现，中国民生银行股份有限公司资产管理部始终将风险管理放在与业务发展同等重要的位置，风险防范和控制为托管业务生存和发展的生命线。

(2) 实施全员风险管理。完善的风险管理体系需要从上至下每个员工的共同参与，只有这样，风险控制措施和措施才能全面、有效。中国民生银行股份有限公司资产管理部实施全员风险管理，将风险控制责任落实到具体业务中心和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责。
 (3) 建立分工明确、相互牵制的风险控制组织结构。托管部通过建立纵向双人制，横向多中心制的内部组织结构，形成不同中心、不同岗位相互制衡的组织结构。
 (4) 制定详细的风险管理计划，中国民生银行股份有限公司资产管理部十分重视内部控制制度的建设，已经建立了一整套内部风险控制制度，包括业务管理办法、内部控制制度、员工行为规范、岗位职责及标准操作流程，以及内控部门的操作手册。以上制度随着外部环境和业务的发展还会不断完善和补充。

(5) 制度的执行和监督是风险控制的关键。制度执行力编写制度更重要，制度落实检查是风险控制管理的有力保证。中国民生银行股份有限公司资产管理部内部设置专职风险监督中心，依照有关法律法规，定期对业务的运行进行稽核检查。总行审计部也不定期对资产管理部运行稽核检查。

(6) 更先进的技术手段运用于风险控制中。在风险管理中，技术控制比制度控制且风险更加可靠，可将人为的不确定因素降至最低。托管业务系统需求不仅从业务方面而且从风险控制方面都要经过多方论证，托管业务技术系统具有较较强的内部控制功能。

(二) 基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序
 根据《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法规的规定，对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金申购资金的到账和赎回资金的划付、基金收益分配等行为的合法性、合规性进行监督和核查。
 基金托管人发现基金管理人的违反《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正。基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人拒不改正的，基金托管人有权在限期

内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。
 基金托管人发现基金管理人有关重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

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
 联系电话：0755-82021233
 传真：0755-82021155
 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号金融街中心南座502房
 联系电话：010-88024226
 传真：010-88082018
 联系人：张圆

(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：武汉市江阳区建设大道568号新世界国贸大厦D座3305室
 联系电话：027-885557881
 传真：027-88555793
 联系人：胡碧飞

(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) 江苏销售机构
 1) 江苏银行股份有限公司
 注册地址：南京市秦淮区中华路26号
 办公地址：南京市秦淮区中华路26号
 法定代表人：夏平
 客户服务电话：96319
 网址：www.jsbchina.cn
 基金管理人有关基金法律法规要求，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。

2. 登记机构
 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
 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) 82021165
 负责人：范伟强

3. 出具法律意见书的律师事务所
 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
 法定代表人：闵齐双
 办公地址：深圳市罗湖区笋岗东路中民时代广场A座201
 联系电话：(0755) 33391280
 传真：0755-33033068
 联系人：闵齐双

经办律师：闵齐双、王德森
 4. 会计师事务所
 名称：瑞华会计师事务所
 住所：北京市东城区永定门西滨河路8号院7号楼中海地产广场西塔6-11层
 法定代表人：顾仁荣
 办公地址：广东省深圳市福田区益田路6001号平安金融大厦8-10层
 联系电话：+86(0)1890965588 +86(755) 88999233
 传真：+86(0)1088091190
 联系人：邢向京
 经办会计师：邢向京、邹雪

四、基金的名称
 本基金名称：鹏华丰腾债券型证券投资基金

五、基金运作方式及类型
 契约型开放式、债券型基金

六、基金的投资目标
 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，力争取得超越基金业绩比较基准的收益。

七、基金的投资方向
 本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、企业债、央行票据、地方政府债、中期票据、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、银行存款等固定收益类品种以及法律法规和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，本基金管理人将视市场开放后程序，将其纳入本基金投资范围。

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。

如法律法规或监管机构以后变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

八、基金的投资策略
 本基金债券投资策略将采取久期策略、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，力争取得超越基金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不同久期、信用特征的券种及市场与现金之间进行动态调整。

2. 久期策略
 本基金将采取久期策略，通过自上而下的组合久期管理策略，以实现投资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”为中心的策略。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，主要根据宏观经济和资本市场的预测对未来组合的目标久期。“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，以减少目标久期下降，以减少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，本基金将根据此调整组合长短、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。

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内买入预期位于收益率曲线陡峭处右侧的债券。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利得；即使用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收益。
 6. 债券选择策略
 根据单一个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、期权等特征因素，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商紧密合作，合理确定发行人及中小企业私募债券投资。本基金在投资过程中密切跟踪债券信用等级或发行人支持等级变化情况，力求发现可能存在的债券违约，并获取超额收益。

8. 资产支持证券的投资策略
 本基金将综合运用利率策略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、流动性风险和提前偿付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，在保证本金安全及基金资产流动性的基础上获得稳定收益。

九、基金业绩比较基准
 中债总指数收益率由中国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；该指数样本券涵盖央票、国债和政策性金融债，能较好地反映我国债券市场的整体收益。本基金是债券型基金，主要投资于固定收益类金融工具，因此，本基金业绩比较基准选择为该指数的收益率。本基金业绩比较基准为：中债总指数收益率×90%+银行活期存款利率×10%。

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。
 基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年10月26日复核了本报告中的财务数据、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。

本报告中财务资料未经审计。
 本报告自2018年10月31日起至2019年3月31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	--	--
2	其中:股票	--	--
3	基金投资	2,002,324,000.00	96.82
4	其中:债券	2,002,324,000.00	96.82
5	其中:资产支持证券</		