鹏扬利泽债券型证券投资基金更新的招募说明书摘要

（2018年第2号）

基金管理人：鹏扬基金管理有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司
截止日：2018年12月15日

【重要提示】

1、本基金根据2017年4月17日中国证券监督管理委员会《关于准予鹏扬利泽债券型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2017] 532号）进行募集。本基金基金合同于2017年6月15日正式生效，自该日起基金管理人正式开始管理本基金。

2、基金管理人保证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投资价值、市场前景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。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。

3、投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应认真阅读基金合同、本招募说明书等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。投资人需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险。投资本基金可能遇到的风险包括：市场风险、信用风险、管理风险、流动性风险、操作和技术风险、合规性风险、本基金特有的风险及其他风险等等。此外，本基金以1元初始面值进行募集，在市场波动等因素的影响下，存在基金份额净值跌破1元初始面值的风险。

4、本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金、股票型基金，属于中低风险/收益的产品。

5、本基金可投资国债期货，国债期货采用保证金交易制度，由于保证金交易具有杠杆性，当相应期限国债收益率出现不利变动时，可能会导致投资人权益遭受较大损失。国债期货采用每日无负债结算制度，如果没有在规定的时间内补足保证金，按规定将被强制平仓，可能给投资带来较大损失。

6、基金不同于银行储蓄与债券，投资人有可能获得较高的收益，也有可能损失本金。投资有风险，投资人在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的招募说明书及《基金合同》。

7、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新基金业绩表现的保证。

8、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，由投资人自行负责。

9、本招募说明书所载内容截止日为2018年12月15日，有关财务数据和净值表现数据截止日为2018年9月30日（财务数据未经审计）。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：鹏扬基金管理有限公司
住所：中国（上海）自由贸易试验区栖霞路120号3层302室
办公地址：北京市西城区复兴门外大街A2号中化大厦16层
邮政编码：100045
法定代表人：杨爱斌
成立日期：2016年7月6日
批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可[2016]1453号
组织形式：有限责任公司
注册资本：壹亿零伍佰壹拾捌万元人民币
存续期限：持续经营
联系人：李雯婷
联系电话：010-68105888

（二）主要人员情况

1、基金管理人董事会成员

范勇宏先生：董事长，经济学博士。现任香山财富研究院联席理事长、宏实资本管理有限公司执行董事兼总经理。曾先后在中国建设银行、华夏证券股份有限公司、华夏基金管理有限公司、中国人寿资产管理有限公司等单位工作。从事金融工作近30年，具有比较丰富的金融工作经历。

杨爱斌先生：董事，复旦大学国际金融专业经济学硕士。现任鹏扬基金管理有限公司总经理。历任上海浦东发展银行信贷员、中国平安保险（集团）股份有限公司组合管理部副总经理、华夏基金管理有限公司固定收益投资总监、北京鹏扬投资管理有限公司董事长兼总经理。

姜山先生：董事，美国印第安纳大学商学院工商管理硕士。现任上海华石投资有限公司执行董事兼总经理，北京鹏扬企业管理有限公司执行董事兼总经理。历任安达信华强会计师事务所审计师、美国Sara Lee公司内部审计师、瑞银投资银行董事、高盛亚洲有限公司执行董事、美国德州太平洋集团董事及北京代表处首席代表、摩根士丹利华鑫证券有限责任公司投资银行部董事总经理。

董建瑾女士：独立董事，美国伊利诺伊理工学院肯特法学院法学硕士。现任北京观韬律师事务所合伙人。历任北京市新闻出版局科员、北京高华证券有限公司执行董事、上海国际能源交易中心首席律师、北京市君泽君律师事务所合伙人。

邱峻女士：独立董事，美国波士顿学院工商管理硕士。现任信达金誉（上海）投资管理有限公司财务总监。历任安永会计师事务所美国纽约分所高级审计师、高级经理、安永华明会计师事务所上海分所高级经理、蓝山投资咨询（北京）有限公司财务总监。

王鹤菲女士：独立董事，美国斯坦福大学商学院金融系哲学博士。现任中国人民大学国际学院金融学教授。历任美国伊利诺伊大学芝加哥分校商学院金融系助理教授、美联储芝加哥银行访问经济学家、清华大学经济管理学院金融系访问学者、中国投资有限责任公司风险管理部访问经济学家、中国人民大学汉青研究院金融系副教授、副系主任。

2、基金管理人监事会成员

王徽先生：监事，江苏大学经济学学士。现任中钰资本管理（北京）股份有限公司合伙人、首席风控官。历任中国华晶电子集团会计、爱韩华电子（无锡）电子有限公司财务经理、江苏苏亚会计师事务所南方分所审计经理、北京中星微电子有限公司财务经理、无锡东林会计师事务所合伙人、利安达会计师事务所（特殊普通合伙）合伙人。王徽先生现担任北京注册会计师协会经济责任审计专业委员会专家委员及北京总会计师协会理事。

吉瑞女士：监事（职工监事），对外经济贸易大学管理学学士。现任鹏扬基金管理有限公司监察稽核部总监。历任安永华明会计师事务所金融审计部审计师，毕马威华振会计师事务所风险咨询部助理经理及高级经理、高瓴资本管理有限公司法律合规部高级经理。

曹铮女士：监事（职工监事），北京大学经济学学士。现任鹏扬基金管理有限公司人力资源及行政管理部总监。历任国家电网公司监察局文员、北京科舵整合创意咨询有限公司人事助理、索尼爱立信（中国）有限公司人事专员、微软亚洲研究院人事经理、北京鹏扬投资管理公司人力资源及行政管理部总监。

3、高级管理人员

杨爱斌先生：总经理，复旦大学国际金融专业经济学硕士。历任上海浦东发展银行信贷员、中国平安保险（集团）股份有限公司组合管理部副总经理、华夏基金管理有限公司固定收益投资总监、北京鹏扬投资管理有限公司董事长兼总经理。

李刚先生：副总经理，中国社科院经济学博士，天津大学金融工程硕士。历任中国农业银行股份有限公司资金运营部高级交易员、金融市场部处长、副总经理等职务。

卢安平先生：副总经理兼首席投资官，清华大学工商管理硕士。历任全国社保基金理事会资产配置处长、风险管理处长，中国平安保险（集团）股份有限公司委托与绩效评估部总经理，平安人寿保险股份有限公司委托投资部总经理。

李操纲先生：副总经理，南京大学管理学博士。历任华夏证券股份有限公司资金清算中心总经理、华夏基金管理有限公司副总经理、中国金融在线有限公司首席运营官、阳光保险集团股份有限公司执行委员会委员。

宋震先生：督察长，北京大学数学学院理学学士，中国经济研究中心经济学双学士，北京大学信息科学技术学院工学硕士，曾任Schlumberger Ltd工程师、龙翌创富顾问有限公司副总裁、中国证监会北京监管局主任科员。

4、本基金基金经理

杨爱斌先生：总经理，复旦大学国际金融专业经济学硕士。历任上海浦东发展银行信贷员、中国平安保险（集团）股份有限公司组合管理部副总经理、华夏基金管理有限公司固定收益投资总监、北京鹏扬投资管理有限公司董事长兼总经理。鹏扬汇利债券型证券投资基金基金经理（2017年6月2日起任职）

陈钟闻先生：固定收益部执行总经理、现金策略总监，北京理工大学工商管理硕士。曾任北京鹏扬投资管理有限公司交易主管、投资经理。鹏扬现金通利货币市场基金基金经理（2017年8月10日起任职），鹏扬淳优一年定期开放债券型证券投资基金基金经理（2018年1月19日起任职），鹏扬淳利定期开放债券型证券投资基金（2018年8月9日起任职）

5、投资决策委员会成员情况

（1）固定收益投资决策委员会

王华先生：固定收益总监、固定收益投资决策委员会主任委员，清华大学理学学士，CFA、FRM，历任银河期货有限公司研究员，银河期货有限公司自营子公司固定收益部总经理，北京鹏扬投资管理有限公司衍生品策略部总经理。

杨爱斌先生：总经理，复旦大学国际金融专业经济学硕士。历任上海浦东发展银行信贷员、中国平安保险（集团）股份有限公司组合管理部副总经理、华夏基金管理有限公司固定收益投资总监、北京鹏扬投资管理有限公司董事长兼总经理。

李刚先生：副总经理，中国社科院经济学博士。历任中国农业银行股份有限公司资金运营部高级交易员、资金运营部高级交易员、金融市场部处长、副总经理。

陈钟闻先生：固定收益部执行总经理、现金策略总监，北京理工大学工商管理硕士。曾任北京鹏扬投资管理有限公司交易主管、投资经理。

（2）股票投资决策委员会

卢安平先生：副总经理兼首席投资官，股票投资决策委员会主任委员，清华大学工商管理硕士，西安交通大学工学学士。曾任全国社保基金理事会资产配置处长、风险管理处长，中国平安保险（集团）股份有限公司委托与绩效评估部总经理，平安人寿保险股份有限公司委托投资部总经理。

杨爱斌先生：总经理，复旦大学国际金融专业经济学硕士。历任上海浦东发展银行信贷员、中国平安保险（集团）股份有限公司组合管理部副总经理、华夏基金管理有限公司固定收益投资总监、北京鹏扬投资管理有限公司董事长兼总经理。

罗成先生：股票投资部基金经理，北京大学计算数学系硕士。历任全国社保基金理事会规划研究部主任科员、中国平安保险（集团）股份有限公司委托投资部投资经理。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

名称：中国工商银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号
成立时间：1984年1月1日
法定代表人：易会满
注册资本：人民币35,640,625.71万元
联系电话：010-66105799
联系人：郭明

三、相关服务机构

（一）基金份额销售机构

1、直销机构

（1）鹏扬基金管理有限公司直销柜台
办公地址：北京市西城区复兴门外大街A2号中化大厦16层
法定代表人：杨爱斌
全国统一客户服务电话：4009686688
联系人：吴瑞
传真：010-68105966

（2）鹏扬基金管理有限公司电子直销交易
客服电话：4009686688
网址：www.pyamc.com

2、其他销售机构

（1）中国工商银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街55号
法定代表人：易会满
联系人：王磊
电话：010-66104094
传真：010-66107738
客户服务电话：95588
网址：www.icbc.com.cn

（2）招商银行股份有限公司
注册地址：深圳市福田区深南大道7088号
办公地址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦
法定代表人：李建红
联系人：周嘉谊
电话：0755-83271192
传真：0755-83195049
客户服务电话：95555
网址：www.cmbchina.com

（3）中信银行股份有限公司
注册地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座
办公地址：北京市东城区朝阳门北大街9号
法定代表人：李庆萍
联系人：王晓琳
电话：010-89937325
传真：010-85230049
客户服务电话：95558
网址：http://bank.ecitic.com

（4）中信建投证券股份有限公司
注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址：北京东城区朝内大街2号凯恒中心B座18层
法定代表人：王常青
联系人：刘芸
电话：010-85156310
传真：010-65182261
客户服务电话：95587/4008-888-108
网址：www.csc108.com

（5）国都证券股份有限公司
注册地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层
办公地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层
法定代表人：王少华
联系人：黄静
电话：010-84183389
传真：010-84183311-3389
客户服务电话：400-818-8118
网址：www.guodu.com

（6）中国国际金融股份有限公司
注册地址：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
办公地址：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
代理法定代表人：毕明建
联系人：杨菡宇
电话：010-65051166
传真：010-85679203
客户服务电话：400-910-1166
网址：www.cicc.com

（7）华泰证券股份有限公司
注册地址：南京市江东中路228号
办公地址：南京市建邺区江东中路228号华泰证券广场
法定代表人：周易
联系人：庞晓芸
电话：0755-82492193
传真：0755-82492962
客户服务电话：95597
网址：www.htsc.com.cn

（8）上海好买基金销售有限公司
注册地址：上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号
办公地址：上海市浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903-906室
法定代表人：杨文斌
联系人：陆敏
电话：021-20613999
传真：021-68596919
客户服务电话：400-700-9665
网址：www.ehowbuy.com

（9）济安财富（北京）资本管理有限公司
注册地址：北京市朝阳区东三环中路7号4号楼40层4601室
办公地址：北京市朝阳区东三环中路7号北京财富中心A座46层
法定代表人：杨健
联系人：李海燕
电话：010-65309516
传真：010-65330699
客户服务电话：400-673-7010
网址：www.jianfortune.com

（10）天津万家财富资产管理有限公司
注册地址：天津自贸区（中心商务区）迎宾大道1988号滨海浙商大厦公寓2-2413室
办公地址：北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦5层
法定代表人：李修辞
联系人：王芳芳
电话：18519215322
传真：021-38909659
客户服务电话：010-59013825
网址：www.wanjiawealth.com

（11）上海陆金所基金销售有限公司
注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元
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：鲍东华
联系人：程晨
电　话：021-20665952
传　真：021-22066653
客服电话：4008219031
网址：www.lufunds.com

（12）北京肯特瑞基金销售有限公司
注册地址：北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06
办公地址：北京市亦庄经济开发区科创十一街十八号院京东集团总部
法定代表人：江卉
联系人：黄立影
电话：010-89188345
客户服务电话：95118（个人业务）；400 088 8816（企业业务）
网址：http://fund.jd.com

（13）深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#
办公地址：北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦A座7层
法定代表人：张蓉
联系人：文雯
电话：010-83363101
客户服务电话：400-116-1188
网址：8.jrj.com.cn

（14）上海天天基金销售有限公司
注册地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
办公地址：上海市徐汇区宛平南路88号金座东方财富大厦
法定代表人：其实
联系人：何薇
电话：010-65980380-8011
客户服务电话：95021 / 4001818188
网址：http://www.1234567.com.cn

（15）深圳众禄基金销售股份有限公司
注册地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼801
办公地址：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
联系人：童彩平
电话：0755-33227950
客户服务电话：4006-788-887
网址：www.zlfund.cn ；www.jjmmw.com

（16）一路财富（北京）信息科技股份有限公司
注册地址：北京市西城区阜成门外大街2号1幢A2208室
办公地址：北京市西城区阜成门外大街2号1幢A2208室
法定代表人：吴雪秀
联系人：徐越
电话：(010)88312877
客户服务电话：400-001-1566
网址：http://www.yilucaifu.com

（17）通华财富（上海）基金销售有限公司
注册地址：上海市虹口区同丰路667弄107号201室
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴世纪金融广场杨高南路799号3号楼9楼
法定代表人：马刚
联系人：杨徐霆
电话：021-60818249
客户服务电话：400-66-95156
网址：https://www.tonghuafund.com

（18）北京蛋卷基金销售有限公司
注册地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507
办公地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507
法定代表人：钟斐斐
联系人：袁永姣
电话：15011386983
客户服务电话：4000-618-518
网址：http://danjuanapp.com

（19）凤凰金信（银川）基金销售有限公司
注册地址：宁夏回族自治区银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路142号14层1402(750000)
办公地址：北京市朝阳区紫月路18号院 朝来高科技产业园18号楼(100000)
法定代表人：程刚
联系人：张旭
电话：010-58160168
客户服务电话：400-810-5919
网址：www.fengfd.com

（20）上海华夏财富投资管理有限公司
注册地址：上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268室
办公地址：北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层
法定代表人：毛准平
联系人：仲秋玥
电话：010-88066632
客户服务电话：400-817-5666
网址：www.amcfortune.com

（21）北京新浪仓石基金销售有限公司
注册地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层518室
办公地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层518室
法定代表人：李昭琛
联系人：吴翠
电话：010-62675369
客户服务电话：010-62675369
网址：www.xincai.com

（22）上海浦东发展银行股份有限公司
注册地址：上海市浦东新区浦东南路500号
办公地址：上海市中山东一路12号
法定代表人：高国富
联系人：张佳乐
电话：021-61162071
传真：021-63604199
客户服务电话：95528
网址：http://www.spdb.com.cn/

（23）珠海盈米基金销售有限公司
注册地址：珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
办公地址：广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔1201-1203室
法定代表人：肖雯
联系人：邱湘湘
电话：020-89629099
传真：020-89629011
客户服务电话：020-89629066
网址：https://www.yingmi.cn/

（24）奕丰基金销售有限公司
注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入住深圳市前海商务秘书有限公司）
办公地址：深圳市南山区海德三道航天科技广场A座17楼1704室
法定代表人：TAN YIK KUAN
联系人：叶健
电话：0755-89460500
客户服务电话：400-684-0500
网址：https://www.ifastps.com.cn

（25）众升财富（北京）基金销售有限公司
注册地址：北京市朝阳区望京东园四区13号楼A座9层908室
办公地址：北京市朝阳区望京浦项中心A座9层04-08
法定代表人：李招弟
联系人：李艳
电话：010-59497361
客户服务电话：400-876-9988
网址：http://www.zscffund.com/

（26）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14楼、16楼、17楼
办公地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14楼、16楼、17楼
法定代表人：丁益
联系人：金夏
电话：0755-83516289
电子邮件：jinxia@cgws.com
客服电话：4006666888
网址：www.cgws.com

（27）上海挖财基金销售有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室
办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室
法定代表人：胡燕亮
联系人：孙琦
电话：021-50810687
客户服务电话：021-50810673
网址：www.wacaijijin.com

（28）嘉实财富管理有限公司
注册地址：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心办公楼二期53层5312-15单元
办公地址：北京市朝阳区建国路91号金地中心A座6层
法定代表人：赵学军
联系人：余永键
电话：010-85097570
客户服务电话：400-021-8850
网址：https://www.harvestwm.cn/

（29）蚂蚁（杭州）基金销售有限公司
注册地址：杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1栋202室
办公地址：中国杭州市西湖区西溪路556号蚂蚁Z空间
法定代表人：陈柏青
联系人：傅强
电话：13811165370
客户服务电话：95188
网址：http://www.antfortune.com/

（30）广州银行股份有限公司
注册地址：广州市天河区珠江东路30号
办公地址：广州市天河区珠江东路30号
法定代表人：黄子励
联系人：张倩
电话：020-28302668
电子邮件：zhangqian@gzcb.com.cn
客服电话：4008396699
网址：www.gzcb.com.cn

（31）上海朝阳永续基金销售有限公司
注册地址：浦东新区上丰路977号1幢B座812室
办公地址：上海市浦东新区碧波路690号4号楼2楼
法定代表人：廖冰
注册资本：壹亿元人民币
联系人：裘爱萍
电话：021-802348888-6693
客服电话：400-699-1888
网址：www.998fund.com

（32）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座18-21层
法定代表人：高涛
联系人：胡芷境
电话：0755-88320851
传真：0755-82026942
客户服务电话：95532
网址：www.china-invs.cn

（33）上海基煜基金销售有限公司
注册地址：上海市崇明县长兴镇潘园公路1800号2号楼6153室（上海泰和经济发展区）
办公地址：上海浦东新区银城中路488号太平金融大厦1503室
法定代表人：王翔
联系人：吴鸿飞
电话：021-65370077*268
电子邮件：wuhongfei@fofund.com.cn
客服电话：4008205369
网址：https://www.jiyufund.com.cn/

（34）国泰君安证券股份有限公司可
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号
办公地址：上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼
法定代表人：杨德红
客户服务电话：95521/4008888666 95521 / 4008888666 95521 / 4008888666
总机：021 -38676666
传真：021 -38670666
网址：www.gtja.com

（35）中国光大银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
办公地址：北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
法定代表人：李晓鹏
联系人：刘昭宇
电话：01063639681
电子邮件：liuzhaoyu@cebbank.com
客服电话：95595
网址：www.cebbank.com

（36）安信证券股份有限公司
注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
办公地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
法定代表人：王连志
联系人：郑向溢
电话：0755-82558305
电子邮件：
客服电话：95517
网址：www.essence.com.cn

（37）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
联系人：陈宇
电话：021-33388252
传真：021-33388224
客户服务电话：95523/400-889-5523
网址：www.swhysc.com

（38）申万宏源西部证券有限公司
注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室
办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼
法定代表人：韩志谦
联系人：陈宇
电话：021-33388214
传真：021-33388224
客户服务电话：400-800-0562
网址：www.hysec.com

（39）西藏东方财富证券股份有限公司
注册地址：拉萨市北京中路101号
办公地址：上海市徐汇区宛平南路88号金座
法定代表人：陈宏
联系人：付佳
电话：021-23586603
客服电话：95357
网址：www.18.cn

（40）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
办公地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表人：张志刚
联系人：唐静
客户服务电话：95321
网址：www.cindasc.com

（41）中信期货有限公司
注册地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层
办公地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层
法定代表人：张皓
联系人：刘宏莹
电话：010-60833754
传真：0755-83217421
客户服务电话：400-990-8826
网址：www.citicsf.com

（42）中信证券股份有限公司
注册地址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座
办公地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦
法定代表人：张佑君
联系人：郑慧
电话：010-60838888
传真：010-6083 6029
客户服务电话：95548
网址：www.cs.ecitic.com

（43）中信证券（山东）有限责任公司
注册地址：青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001
办公地址：青岛市市南区东海西路28号龙翔广场东座5层
法定代表人：姜晓林
联系人：刘晓明
电话：0531-89606165
传真：传真：0532-85022605
客户服务电话：95548
网址：www.zxwt.com.cn

（44）中国农业银行股份有限公司
注册地址：北京市东城区建国门内大街69号
办公地址：北京市东城区建国门内大街69号
法定代表人：周慕冰
联系人：韩涛
电话：010-85108226
电子邮件：hantao@abchina.com
客服电话：95599
网址：www.abchina.com

（45）兴业银行股份有限公司
注册地址：福建省福州市湖东路154 号中山大厦
办公地址：上海市江宁路168 号兴业大厦
法定代表人：高建平
联系人：李玮琳
电话：021-52629999-211054
电子邮件：liweilin@cib.com.cn
客服电话：95561
网址：www.cib.com.cn

（46）中国银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号
法定代表人：陈四清
联系人：文晓波
电话：010-66592240
电子邮件：wenxbbj_bj@mail.notes.bank-of-china.com
客服电话：95566
网址：www.boc.cn

（47）上海联泰基金销售有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路277号3层310室
办公地址：上海市长宁区福泉北路518号8座3层
法定代表人：燕斌
联系人：陈东
电话：021-52822063
客服电话：400-166-6788
网址：www.66liantai.com

（48）腾安基金销售（深圳）有限公司
注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）
办公地址：深圳市南山区科技中一路腾讯大厦
法定代表人：刘明军
联系人：郑骏锋
联系电话：0755-86013388-77386
客服电话：95017
网址：www.tenganxinxi.com

（49）宜信普泽投资顾问（北京）有限公司
注册地址：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SOHO现代城C座1809
法定代表人：戎兵
联系人：魏晨
电话：010-52413385
客服电话：400-6099-200
网址：www.yixinfund.com

（二）登记机构

名称：鹏扬基金管理有限公司
办公地址：北京市西城区复兴门外大街A2号中化大厦16层
法定代表人：杨爱斌
全国统一客户服务电话：4009686688
联系人：韩欢
传真：010-68105932

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称：上海源泰律师事务所
注册地址：上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦14楼
办公地址：上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦14楼
负责人：廖海
电话：021- 51150298
传真：021- 51150398
联系人：刘佳
经办律师：刘佳、范佳斐

（四）会计师事务所

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
住所：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
办公地址：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
执行事务合伙人：毛鞍宁
联系电话：（010）58153000
传真电话：（010）85188298
经办注册会计师：王珊珊、贺耀
联系人：贺耀

四、基金的名称

鹏扬利泽债券型证券投资基金

五、基金的运作方式和类型

契约型开放式、债券型

六、基金的投资目标

本基金把投资组合的久期控制在3年以内，在追求本金安全和保持基金资产流动性的基础上，力争实现超越比较基准的投资收益。

七、基金的投资范围

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、可转债（不包括分离交易可转债）、可交换债、债券质押式及买断式回购、国债期货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相关规定）。本基金对可转债、可交换债的投资仅限于一级市场申购，且申购获得的可转债、可交换债不得转换成股票。

本基金投资于债券的比例不低于基金资产的80%，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有现金以及到期日在1年以内的政府债券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。

八、基金的投资策略

本基金的投资策略包括买入持有策略、久期调整策略、收益率曲线配置策略、债券类属和板块轮换策略、骑乘策略、价值驱动的个券选择策略、可转债申购投资策略、国债期货投资策略以及适度的融资杠杆策略等，在有效管理风险的基础上，达成投资目标。

1、买入持有策略

以简单、低交易成本为原则，挑选符合投资需求的标的债券，持有到期后再转而投资新的标的债券。

2、久期调整策略

根据对市场利率水平的预期，在预期利率下降时，增加组合久期，以较多地获得债券价格上升带来的收益，在预期利率上升时，减小组合久期，以规避债券价格下降的风险。

3、收益率曲线配置

在久期确定的基础上，根据对收益曲线形状变化的预测，确定采用子弹型策略、哑铃型策略和梯形策略，在长期、中期和短期债券间进行配置，以从长、中、短期债券的相对价格变化中获利。

4、板块轮换策略

根据国债、金融债、信用债等不同债券板块之间的相对投资价值分析，增持相对低估的板块，减持相对高估的板块，借以取得较高收益。

5、骑乘策略

通过分析收益率曲线各期限段的利差情况，买入收益率曲线最陡峭处所对应的期限债券，随着所持有债券的剩余期限下降，债券的到期收益率将下降，从而获得资本利得。

6、个券选择策略

用自下而上的方法选择价值相对低估的债券。通过考察收益率曲线的相对位置和形状，对比不同信用等级、在不同市场交易债券的到期收益率等方法，结合票息、税收、可否回购、嵌入期权等其他决定债券价值的因素，从而发现市场中个券的价值相对低估状况。

7、可转债申购投资策略

选择公司基本素质优良、其对应的基础证券有着较高上涨潜力的可转换债券进行申购，并且原则上在其上市交易首日择机卖出。

8、国债期货投资策略

在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，并积极采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对国债市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

9、融资杠杆策略

通过分析回购品种之间的利差及其变动，结合对年末效应和长假效应的灵活使用，进行中长期回购品种的比例配置，同时在严格控制风险的基础上利用跨市场套利和跨期限套利的机会。

九、业绩比较基准

中债总财富（1-3年）指数收益率

中债总财富（1-3年）指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制的中债总财富细分指数之一。该指数同时覆盖了上海证券交易所、深圳证券交易所、银行间以及银行柜台债券市场上的待偿期限在1-3年(含1年)的国债、央行票据、政策性金融债，具有一定的代表性，适合作为本基金的债券投资业绩比较基准。

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基准的指数，或者市场发生变化导致本业绩比较基准不再适用或本业绩比较基准停止发布时，本基金管理人在与基金托管人协商一致，可调整或变更业绩比较基准并及时公告，而无需召开基金份额持有人大会。

十、风险收益特征

本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金、股票型基金，属于中低风险/收益的产品。

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规定，于2018年10月24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。

以下内容摘自本基金2018年第3季度报告，所列财务数据未经审计。

8.1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	7,913,337,973.54	97.62
	其中：债券	7,650,363,886.40	94.38
	资产支持证券	262,974,087.14	3.24
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	57,693,222.92	0.71
8	其他资产	135,197,812.91	1.67
9	合计	8,106,229,009.37	100.00

8.2报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票。

8.2.2报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

8.3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：本基金本报告期末未持有股票。

8.4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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,162,280,000.00	14.68
	其中：政策性金融债	1,162,280,000.00	14.68
4	企业债券	856,968,086.40	10.82
5	企业短期融资券	4,307,869,800.00	54.39
6	中期票据	841,184,000.00	10.62
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	482,062,000.00	6.09
9	其他	-	-
10	合计	7,650,363,886.40	96.60

8.5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	018007	国开1801	3,100,000	310,279,000.00	3.92
2	108603	国开1804	3,000,000	300,180,000.00	3.79
3	011801846	18赣高速SCP003	2,600,000	259,818,000.00	3.28
4	111809285	18浦发银行CD285	2,000,000	196,760,000.00	2.48
4	111809289	18浦发银行CD289	2,000,000	196,760,000.00	2.48
5	180312	18进出12	1,900,000	189,753,000.00	2.40

8.6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

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	146560	花呗40A1	800,000	80,918,936.99	1.02
2	146729	17花03A1	500,000	50,684,273.98	0.64
3	146674	花呗45A1	500,000	50,624,952.06	0.64
4	149138	18花04A1	300,000	30,271,776.16	0.38
5	146671	花呗44A1	200,000	20,247,205.48	0.26
6	146472	花呗38A1	200,000	20,226,942.47	0.26
7	149284	18花呗1A	100,000	10,000,000.00	0.13

注：本基金本报告期末仅持有上述资产支持证券。

8.7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：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.8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：本基金本报告期未未持有权证。

8.9报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.9