鹏扬添利增强债券型证券投资基金招募说明书

基金管理人:鹏扬基金管理有限公司
基金托管人:中国邮政储蓄银行股份有限公司

【重要提示】

1、本基金根据2018年11月26日中国证券监督管理委员会《关于准予鹏扬添利增强债券型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2018] 1955号)进行募集。

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、本基金特有风险、基金管理人职责终止风险和其他风险等等。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,预期风险与预期收益水平低于混合型基金、股票型基金,高于货币市场基金。

5、本基金可投资国债期货,期货采用保证金交易制度,由于保证金交易具有杠杆性,当出现不利行情时,相关行情微小的变动就可能会使投资人权益遭受较大损失。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,可能给投资带来重大损失。

6、本基金可投资资产支持证券,资产支持证券可能面临的信用风险、利率风险、流动性风险、提前偿付风险、操作风险和法律风险等风险,由此可能增加本基金净值的波动性。

7、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》。

8、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。

9、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。

第一部分 绪言

《鹏扬添利增强债券型证券投资基金招募说明书》(以下简称“招募说明书”或“本招募说明书”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性管理规定》”)以及《鹏扬添利增强债券型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”或“基金合同”)编写。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。

鹏扬添利增强债券型证券投资基金(以下简称“基金”或“本基金”)是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息,或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写,并经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)注册。基金合同是约定基金合同当事人之间权利、义务关系的法律文件。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》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。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。

第二部分 释义

在本招募说明书中,除非文意另有所指,下列词语或简称具有如下含义:

1、基金或本基金:指鹏扬添利增强债券型证券投资基金
2、基金管理人:指鹏扬基金管理有限公司
3、基金托管人:指中国邮政储蓄银行股份有限公司
4、基金合同:指《鹏扬添利增强债券型证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充
5、托管协议:指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《鹏扬添利增强债券型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
6、招募说明书:指《鹏扬添利增强债券型证券投资基金招募说明书》及其定期的更新
7、基金份额发售公告:指《鹏扬添利增强债券型证券投资基金基金份额发售公告》
8、法律法规:指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
9、《基金法》:指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过,经2012年12月28日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订,自2013年6月1日起实施,并经2015年4月24日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改(中华人民共和国港口法)等七部法律的决定》修改的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
10、《销售办法》:指中国证监会2013年3月15日颁布、同年6月1日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
11、《信息披露办法》:指中国证监会2004年6月8日颁布、同年7月1日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
12、《运作办法》:指中国证监会2014年7月7日颁布、同年8月8日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
13、《流动性管理规定》:指中国证监会于2017年8月31日颁布,同年10月1日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订
14、中国证监会:指中国证券监督管理委员会
15、银行业监督管理机构:指中国人民银行和/或中国银行保险监督管理委员会
16、基金合同当事人:指受基金合同约束,根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体,包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人
17、个人投资者:指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人
18、机构投资者:指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织
19、合格境外机构投资者:指符合相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者
20、投资人:指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称
21、基金份额持有人:指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人
22、基金销售业务:指基金管理人或销售机构宣传推介基金,发售基金份额,办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务
23、销售机构:指鹏扬基金管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件,取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议,代为办理基金销售业务的机构
24、登记业务:指基金登记、存管、过户、清算和结算业务,具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等
25、登记机构:指办理登记业务的机构。基金的登记机构为鹏扬基金管理有限公司或接受鹏扬基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构,本基金的登记机构为鹏扬基金管理有限公司
26、基金账户:指登记机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户
27、基金交易账户:指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理认购、申购、赎回、转换及转托管等业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户
28、基金合同生效日:指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件,基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕,并获得中国证监会书面确认的日期
29、基金合同终止日:指基金合同规定的基金合同终止事由出现后,基金财产清算完毕,清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期
30、基金募集期:指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间,最长不得超过三个月
31、存续期:指基金合同生效至终止之间的不定期期限
32、工作日:指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日
33、T日:指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日
34、T+n日:指自T日起第n个工作日(不包含T日)
35、开放日:指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日
36、开放时间:指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段
37、《业务规则》:指《鹏扬基金管理有限公司开放式基金业务规则》,是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金登记方面的业务规则,由基金管理人、销售机构和投资人共同遵守
38、认购:指在基金募集期内,投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为
39、申购:指基金合同生效后,投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为
40、赎回:指基金合同生效后,基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为
41、基金转换:指基金份额持有人按照基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件,申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的、且由同一登记机构办理登记的其他基金基金份额的行为
42、转托管:指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的操作
43、定期定额投资计划:指投资人通过有关销售机构提出申请,约定每期申购日、扣款金额及扣款方式,由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及受理基金申购申请的一种投资方式
44、巨额赎回:指本基金单个开放日,基金净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过上一开放日基金总份额的10%
45、元:指人民币元
46、流动性受限资产:指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产,包括但不限于到期日在10个交易日以上的逆回购与银行定期存款(含协议约定有条件提前支取的银行存款)、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等
47、摆动定价机制:指当本基金遭遇大额申购赎回时,通过调整基金份额净值的方式,将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资人,从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响,确保投资人的合法权益不受损害并得到公平对待
48、基金收益:指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金投资资产带来的成本和费用的节约
49、基金资产总值:指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收款项及其他资产的价值总和
50、基金资产净值:指基金资产总值减去基金负债后的价值
51、基金份额净值:指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数
52、基金资产估值:指计算评估基金资产和负债的价值,以确定基金资产净值和基金份额净值的过程
53、基金份额的类别:本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别:A类基金份额和C类基金份额。各类基金份额分设不同的基金代码,并分别计算和公布各类基金份额净值和各类基金份额累计净值
54、A类基金份额:在投资人认购/申购时收取认购/申购费用,而不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额
55、C类基金份额:在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用,但从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额
56、销售服务费:指本基金用于持续销售和服务基金份额持有人的费用,该笔费用从基金财产中扣除,属于基金的营运费用
57、指定媒介:指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒介
58、不可抗力:指基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件。

第三部分 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:1.0518亿元人民币
存续期限:持续经营
联系人:李净
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。
李刚先生:董事,中国社科院经济学博士。现任鹏扬基金管理有限公司副总经理。历任中国农业银行资产负债管理部交易员、资金营运部高级交易员、金融市场部处长、副总经理。
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组约分所高级审计师、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资本管理有限公司会计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。历任中国农业银行资产负债管理部交易员、资金营运部高级交易员、金融市场部处长、副总经理。
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与绩效评估部总经理。
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、本基金拟任基金经理
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,曾任银河期货研究员,银河期货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。鹏扬双利债券型证券投资基金基金经理(2018年 2 月13 日起任职)、鹏扬景升灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2018年 4 月3 日起任职)、鹏扬景欣混合型证券投资基金基金经理(2018年5 月10 日起任职)、鹏扬淳合债券型证券投资基金基金经理(2018年6月21日起任职)、鹏扬淳享债券型证券投资基金(2018年12月12日起任职)。
5、投资决策委员会成员情况
(1)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。历任全国社保基金理事会资产配置处长、风险管理处长,中国平安集团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。
张望先生:股票投资部研究总监,清华大学理学硕士。历任华夏基金管理有限公司化工行业研究员、研究部周期组组长、海宁拾贝投资管理合伙企业投资经理。
(2)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,曾任银河期货研究员,银河期货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。历任中国农业银行资产负债管理部交易员、资金营运部高级交易员、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,毕业于北京理工大学,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。
6、上述人员之间均不存在近亲属关系。
三、基金管理人的职责
1、依法募集资金,办理或者委托经国务院证券监督管理机构认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜。
2、办理基金备案手续。
3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账,进行证券投资。
4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配收益。
5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告。
6、编制中期和年度基金报告。
7、计算并公告基金资产净值,确定基金份额申购、赎回价格。
8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项。
9、召集基金份额持有人大会。
10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料。
11、以基金管理人名义,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为。
12、国务院证券监督管理机构规定的其他职责。
四、基金管理人的承诺
1、基金管理人承诺不从事违反《中华人民共和国证券法》的行为,并承诺建立健全内部控制制度,采取有效措施,防止违反《中华人民共和国证券法》行为的发生;
2、基金管理人承诺不从事违反《基金法》的行为,并承诺建立健全内部风险控制制度,采取有效措施,防止下列行为的发生:
(1)将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资;
(2)不公平地对待管理的不同基金财产;
(3)利用基金财产或者职务之便为基金份额持有人以外的第三人牟取利益;
(4)向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失;
(5)侵占、挪用基金财产;
(6)泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动;
(7)玩忽职守,不按照规定履行职责;
(8)法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。
3、基金管理人承诺严格遵守基金合同,并承诺建立健全内部控制制度,采取有效措施,防止违反基金合同行为的发生;
4、基金管理人承诺加强人员管理,强化职业操守,督促和约束员工遵守国家有关法律法规及行业规范,诚实信用、勤勉尽责;
5、基金管理人承诺不从事其他法规规定禁止从事的行为。
五、基金经理承诺
1、依照有关法律法规和基金合同的规定,本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益;
2、不利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者牟取利益;
3、不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密,尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息,或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动;
4、不以任何形式为除基金管理人以外的其他组织或个人进行证券交易。
六、基金管理人的内部控制制度
1、内部控制的原则
(1)健全性原则:内部控制包括公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员,并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节。
(2)有效性原则:通过科学的内控手段和方法,建立合理的内控程序,维护内控制度的有效执行。
(3)独立性原则:公司各机构、部门和岗位职责保持相对独立,公司基金资产、自有资产、其它资产的运作分离。
(4)相互制约原则:公司内部部门和岗位的设置权责分明、相互制衡。
(5)成本效益原则:公司运用科学化的经营管理方法降低运作成本,提高经济效益,以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。
2、内部控制的主要内容
(1)控制环境
公司董事会高度重视建立完善的公司治理结构与内部控制体系,充分发挥独立董事和监事职能,保护投资人利益和公司合法权益。本公司在董事会下设立了风险管理委员会,负责对公司在经营管理和基金业务运作的合法性、合规性和风险状况进行检查和评估,对公司监察稽核制度的有效性进行评价,监督公司的财务状况,评价公司的财务表现,保证公司的财务运作符合法律法规的要求和通行的会计标准,对公司风险管理制度进行评价和对公司风险管理制度的实施进行检查, 评估公司风险管理状况。
公司管理层在总经理领导下,认真执行董事会确定的内部控制战略,为了有效贯彻公司董事会制定的经营方针及发展战略,设立了投资决策委员会。投资决策委员会是公司负责基金投资决策的最高权力机构,根据基金合同和公司的有关规定,确定基金的投资目标和投资原则,决定基金投资的程序与权限设置,审定基金的投资策略与资产配置方案及设定基金投资的限制性指标等。
此外,公司设有督察长,全权负责公司的监察与稽核工作,对公司和基金运作的合法性、合规性及合理性进行全面检查与监督,参与公司风险控制工作,发生重大风险事件时向公司董事长和中国证监会报告。
(2)风险评估
董事会下属的风险管理委员会和督察长负责对公司内外部风险进行评估。总经理下设风险决策委员会,负责对公司日常经营及基金运作中的风险监测、评估与防范提供意见及建议,审议公司风险控制制度与风险管理流程,对公司经营管理中的重大突发性事件和重大危机情况进行评估,制定危机处理方案并监督实施。公司各部门根据具体情况制定本部门的作业流程及风险控制制度,加强对风险的控制,将风险控制在最小范围内。
(3)控制活动
控制活动包括授权控制、自我控制、职责分离、实物控制、业绩评价、资产分离及监察稽核等程序或措施。
公司依据自身经营特点设立顺序递进、权责统一、严密有效的三道内控防线:
1)建立以各岗位目标责任制为基础的第一道监控防线;各岗位均制定详实的操作流程、明确岗位职责,各岗位人员上岗前必须声明已知悉并承诺遵守,在授权范围内承担各自职责;
2)建立相关部门、相关岗位之间相互监督制衡的第二道监控防线;公司建立重要业务处理凭据传递和信息沟通制度,相关部门和岗位之间相互监督制衡;
3)建立以督察长和监察稽核部对各岗位、各部门、各机构、各项业务全面实施监督反馈的第三道监控防线;督察长、监察稽核部独立于其它部门和业务活动,并对内部控制制度的执行情况实行严格的检查、反馈和监督。
(4)信息沟通
公司建立双向的信息交流途径,形成了自上而下的信息传播渠道和自下而上的信息呈报渠道。通过建立有效的信息交流渠道,保证了公司员工及各级管理人员可以充分了解与其职责相关的信息,并及时送达适当的人员进行处理。公司根据组织架构和授权制度,建立了清晰的业务报告系统。
(5)内部监控
公司设立了独立于各业务部门的监察稽核部,履行监督、稽核职能,检查、评价公司内部控制制度合理性、完备性和有效性,监督公司内部控制制度的执行情况,揭示公司内部管理及基金运作中的相关风险,及时提出改进意见,促进公司内部管理制度有效地执行。监察稽核人员具有相对的独立性,定期不定期出具监察稽核报告。
(6)法律法规指引
公司严格贯彻基金管理相关的法律法规,严格依法经营。督察长和监察稽核部负责对内部各职能部门和员工的业务活动及岗位行为的合法合规性实施监督检查。

第四部分 基金托管人

一、基金托管人基本情况
名称:中国邮政储蓄银行股份有限公司(简称“中国邮政储蓄银行”)
住所:北京市西城区金融大街3号
法定代表人:李国华
成立时间:2007年3月6日
批准设立机关和批准设立文号:中国人民银行总行,中国银监会银监复【2006】484号
组织形式:股份有限公司
注册资本:810.31亿元人民币
存续期间:持续经营
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监许可【2009】673号
联系人:马强
客服电话:010-68857221
经营范围:吸收公众存款;发放短期、中期、长期贷款;办理国内外结算;办理票据承兑和贴现;发行金融债券;代理发行、代理兑付、承销政府债券;买卖政府债券、金融债券;从事同业拆借;买卖、代理买卖外汇;从事银行卡业务;提供信用证服务及担保;代理收付款项及代理保险业务;提供保险箱服务;经中国银行业监督管理机构等监管部门批准的其他业务。
经国务院同意并经中国银行业监督管理委员会批准,中国邮政储蓄银行有限责任公司(成立于2007年3月6日)于2012年1月21日依法整体变更为中国邮政储蓄银行股份有限公司。中国邮政储蓄银行股份有限公司依法承继原中国邮政储蓄银行有限责任公司全部资产、负债、机构、业务和人员,依法承担和履行原中国邮政储蓄银行有限责任公司在有关具有法律效力的合同或协议中的权利、义务,以及相应的债权债务关系和法律责任。中国邮政储蓄银行股份有限公司坚持服务“三农”、服务中小企业、服务城乡居民的大型零售商业银行定位,发挥邮政网络优势,强化内部控制,合规稳健经营,为广大城乡居民及企业提供优质金融服务,实现股东价值最大化,支持国民经济发展和社会进步。
二、主要人员情况
中国邮政储蓄银行股份有限公司总行设托管业务部,下设资产托管处、风险管理处、运营管理处等处室。现有员工22人,全部员工拥有大学本科以上学历及基金从业资格,90%员工具有三年以上基金从业经历,具备丰富的托管服务经验。
三、托管业务经营情况
2009 年7月23日,中国邮政储蓄银行经中国证券监督管理委员会和中国银行业监督管理委员会联合批准,获得证券投资基金托管资格,是我国第 16 家托管银行。2012年7月19日,中国邮政储蓄银行经中国保险监督管理委员会批准, 获得保险资金托管资格。中国邮政储蓄银行坚持以客户为中心、以服务为基础的经营理念,依托专业的托管团队、灵活的托管业务系统、规范的托管管理制度、健全的内控体系、运作高效的业务处理模式,为广大基金份额持有人和众多资产管理机构提供安全、高效、专业、全面的托管服务,并获得了合作伙伴一致好评。截至2018年6月30日,中国邮政储蓄银行托管的证券投资基金共80只。至今,中国邮政储蓄银行已形成涵盖证券投资基金、基金公司特定客户资产管理计划、信托计划、银行理财产品(本外币)、私募基金、证券公司资产管理计划、保险资金、保险资产管理计划等多种资产类型的托管产品体系,托管规模达41789.05亿元。
四、托管人的内部控制制度
1、内部控制目标
作为基金托管人,中国邮政储蓄银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定,守法经营、规范运作、严格监察,确保业务的稳健运行,保证基金财产的安全完整,确

(下转A18版)

鹏扬添利增强债券型证券投资基金份额发售公告

基金管理人:鹏扬基金管理有限公司
基金托管人:中国邮政储蓄银行股份有限公司
二零一九年二月

重要提示

1、鹏扬添利增强债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)已经中国证监会2018年11月26日证监许可[2018]1955号文准予注册。

2、本基金是契约型开放式、债券型证券投资基金。

3、本基金的基金管理人和登记机构为鹏扬基金管理有限公司(以下简称“本公司”),基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

4、本基金的发售对象为符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。

5、本基金自2019年3月1日至2019年3月26日通过基金份额发售机构公开发售。本基金的募集期限不超过 3 个月,自基金份额开始发售之日起计算。本公司也可根据基金销售情况在募集期限内适当延长或缩短基金发售时间,并及时公告。

6、本基金的基金份额发售机构为本公司的直销机构。基金份额发售机构办理本基金开户、认购等业务的网点、日期、时间和程序等事项参照各基金份额发售机构的具体规定。

7、投资者在首次认购本基金时,需按基金份额发售机构的规定,提出开立本公司基金账户和销售机构交易账户的申请。除法律法规另有规定外,一个投资者只能开立和使用一个基金账户,已经开立本公司基金账户的投资者可免予申请开立基金账户。

投资者应保证用于认购的资金来源合法,投资者应有权自行支配,不存在任何法律上、合约上或其他方面的障碍。投资者已提交的身份证件或身份证明文件如已过有效期, 请及时办理相关更新手续,以免影响认购。

8、本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为A类和C类基金份额:在投资人认购/申购时收取认购/申购费用,而不从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为A类基金份额,在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用,但从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为C类基金份额。

9、本基金认购以金额申请。本基金每份A类、C类基金份额初始面值均为1.00元, 认购价格均为1.00元。投资者认购基金份额时,需按基金份额发售机构规定的方式全额交付认购款项。投资者可以多次认购本基金份额,累计认购金额不设上限。认购申请受理完成后,投资者不得撤销。

10、基金份额发售机构销售网点受理认购申请并不表示对该申请的成功确认,而仅代表销售网点确实收到了认购申请。申请是否成功应以登记机构的确认为准。投资者应在基金合同生效后到其办理认购业务的销售网点查询最终确认情况和有效认购份额。基金管理人及基金份额发售机构不承担对确认结果的通知义务,投资者本人应主动查询认购申请的确认结果。

11、本公告仅对本基金发售的有关事项和规定予以说明。投资者欲了解本基金的详细情况,请详细阅读《鹏扬添利增强债券型证券投资基金招募说明书》。本基金的招募说明书及本公告将同时刊登在本公司网站。投资者如有疑问,可拨打本公司客户服务电话(400-968-6688)及各发售代理机构客户服务电话。

12、风险提示

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,投资者根据所持有的基金份额享受基金收益,同时承担相应的投资风险。

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、本基金特有风险、基金管理人职责终止风险和其他风险等等。本基金为债券型基金,预期风险与预期收益水平低于混合型基金、股票型基金,高于货币市场基金。

本基金可投资国债期货,期货采用保证金交易制度,由于保证金交易具有杠杆性,当出现不利行情时,相关行情微小的变动就可能会使投资人权益遭受较大损失。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,可能给投资带来重大损失。本基金可投资资产支持证券,资产支持证券可能面临的信用风险、利率风险、流动性风险、提前偿付风险、操作风险和法律风险等风险,由此可能增加本基金净值的波动性。

投资有风险,投资者在投资本基金之前,请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同,全面认识本基金的风险收益特征和产品特性,并充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,谨慎做出投资决策。

13、本公司综合各种情况对发售安排做适当调整。本公司拥有对本基金份额发售公告的最终解释权。

一、本次发售基本情况

(一)基金的基本信息
基金名称:鹏扬添利增强债券型证券投资基金
基金代码:006832(A类)、006833(C类)
运作方式:契约型开放式
基金类别:债券型证券投资基金
存续期限:不定期
(二)基金份额的类别设置
本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为A类和C类基金份额:在投资人认购/申购时收取认购/申购费用,而不从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为A类基金份额;在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用,但从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为C类基金份额。A类、C类基金份额分别设置代码,分别计算和公告各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。
(三)基金份额初始面值、发售价格
本基金每份A 类、C 类基金份额初始面值均为 1.00 元人民币,认购价格均为 1.00 元人民币。
(四)发售对象
符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。
(五)基金份额发售机构
本公司直销机构,本公司直销机构详见本公告“五(三)1、直销机构”。
(六)发售时间安排
本基金募集期限不超过 3 个月,自基金份额开始发售之日起计算。
本基金自2019年3月1日至2019年3月26日进行发售。如果在此发售期间未达到本基金招募说明书规定的基金备案条件,基金可在募集期限内继续销售,直到达到基金备案条件。本基金管理人可根据认购的情况在募集期内适当延长或缩短募集时间,并及时公告。另外,如遇突发事件,以上基金募集期的安排也可以适当调整。
(七)发售方式
1、本基金认购以金额申请。投资者认购本基金份额时,需按基金份额发售机构规定的方式全额交付认购款项。投资者可以多次认购本基金份额,每次认购金额不得低于10元,累计认购金额不设上限。认购申请受理完成后,投资者不得撤销。销售机构可调整每次最低认购金额并进行公告。
2、投资者在首次认购本基金时,如尚未开立本公司基金账户,需按基金份额发售机构的规定,提出开立本公司基金账户和基金份额发售机构交易账户的申请。开户和认购申请可
同时办理,一次性完成,但认购申请的确认须以开户确认成功为前提条件。已开立本公司基金账户的投资者在原开户机构的网点购买本基金时不需再次开立本公司基金账户, 在新的基金份额发售机构网点购买本基金时,可办理增开交易账户业务。
(八)认购费用
1、投资者在认购A类基金份额时需交纳前端认购费,费率按认购金额递减,具体如下:

认购金额(M)	认购费率
M<100万	0.40%
100万≤M<500万	0.20%
M≥500万	每笔1000元

通过基金管理人的直销柜台认购本基金A类基金份额的特定群体认购费率如下表所示:

认购金额(M)	认购费率
M<100万	0.04%
100万≤M<500万	0.02%
M≥500万	每笔1000元

注:特定投资群体是指全国社会保障基金、依法设立的基本养老保险基金、依法制定的企业年金计划筹集的资金及其投资运营收益形成的企业补充养老保险基金 (包括企业年金单一计划以及集合计划),以及可以投资基金的其他社会保险基金。如将来出现可以投资基金的住房公积金、享受税收优惠的个人养老账户、经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型,基金管理人可将其纳入特定投资群体范围。
2、本基金C类基金份额不收取认购费用。
3、A类基金份额的认购费用不列入基金财产,主要用于