

■ 2019年12月26日 星期四

## 鹏华基金2019年年度报告摘要

基金管理人：鹏华基金管理有限公司  
基金托管人：平安银行股份有限公司  
2019年12月26日

**重要提示**

本基金经2016年6月28日中国证券监督管理委员会下发的《关于准予鹏华丰盈债券型证券投资基金注册的批复》（[2016]1441号文）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11月22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。

本基金属于债券型货币，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，从而影响到该类债券的流动性。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（包括招募说明书、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状况的难度。

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中的“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。

本次招募说明书更新仅涉及《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》第十二条规定的重大变更，即：（一）基金合同、基金托管协议相关内容变更；（二）变更基金简称（含场内简称）、基金代码（含场内代码）；（三）变更基金管理人、基金托管人的法定名称；（四）变更基金经理；（五）变更认购、申购费、赎回费率等；（六）其他对投资者有重大影响的事项。变更事项涉及上述一或多种情形，具体事项请参见基金管理人最近三个交易日内披露的关于上述重大变更的相关公告，其他内容请以上一次更新的招募说明书为准。

**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
鹏华证券股份有限公司	7,500	50%
光大证券股份有限公司（Euronext China）（SICAP S.P.A.）	7,500	49%
鹏华国际信托投资有限公司	300	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分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。

邓昭明先生,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。

孙煜梅先生,董事,经济学博士,国籍:中国。历任广东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主任、深圳市证券委副主任、深圳证券交易所首任行政总监、香港联交所（集团）有限公司助理总经理、香港东亚报业及印刷有限公司总经理、中国新技术产业投资管理有限公司董事长兼执行董事、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党委第一书记。

Massimo Mazzini先生,董事,经济和商科学士。国籍:意大利。曾在安达信（Arthur Andersen MBA）从事风险管理和资产管理 work,历任CA AIGP SGR 投资总监、CAAM AI SGR及 CA AIGP SGR首席执行官和运营总监、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）国际执行委员会委员、意大利欧洲资产管理股份有限公司（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。现任意大利欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）董事、意大利发展。

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,先后在法国农业信贷银行（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.）法律与合规部工作,现任担任意大利欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）董事会秘书兼意大利企业事务部总经理,欧利盛资本股份公司（Eurizon Capital S.A.）（卢森堡）企业法务部总经理。

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。历任深圳华为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账经理、深圳金地证券服务部财务经理、资金财务部高级经理、总经理助理、副总经理、人力资源部总部副经理等职务。现任国信证券股份有限公司财务负责人、资金财务部总部助理兼人力资源部副经理。

史际春先生,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,国务院参事,兼任中国法学会法社会学研究会副会长、全国人大常委会委员和法学会委员会委员。

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、军师、编辑,甘肃省省委研究室干事、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（处长）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。

高臻女士,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,现任曼达林投资有限公司,跨行业高管。

**2.基金管理人监事会成员**

李长生先生,监事会主席,研究生学历,国籍:中国。曾任农信信公司,正兴财务公司工作,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,上海证监局材料科副科长,资金财务部财务科副经理,资金财务部资金科经理,资金财务部主任会计师兼科长,财务部经理,资金财务部总经理助理,资金财务部副经理等,现任国信证券资金部副经理兼融资融券部副经理、融资融券部总经理。

SANDRO VESPRINI先生,监事,工商管理学士学位,国籍:意大利。先后在米兰军医院出诊、税务师事务所,菲亚特汽车发动机和变速器意大利管理团队经理工作、圣保罗马资产管理SGR企业经理部、圣保罗财富管理企业管控部工作、曾任欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）财务管理和投资管理,现任欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）财务负责人。

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

刘文高先生,职工监事,大专学历,国籍:中国。历任深圳奥美电子股份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,现任登记结算部副经理。

刘庆先生,职工监事,管理学硕士,国籍:中国。历任华马威（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分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。

邓昭明先生,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,特許金融分析師（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,基金法律部总经理,基金法律部兼基金运营部总经理,现任鹏华基金管理有限公司党委书记、副总裁。

邢彪先生,副总裁,工商管理硕士,法学硕士,国籍:中国。历任中国人民大学法律系、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处处长、股权投资部（实业投资部）副主任,并于2014年至2015年期间担任中国证监会第16届主板发审委专家委员,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所长、投资管理部,南方基金管理有限公司渠道服务部第二总部总监助理,南方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、中国证监会办公厅、中国证券监督管理委员会,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。历任中国证监会办公厅秘书二处,中国证监会办公厅秘书处干部、秘书处助理处长,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。

韩彦庆先生,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副总裁、固定收益部总

# 鹏华丰盈债券型证券投资基金更新的招募说明书摘要

(2019年第1号)

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

监、固定收益部总经理。  
4、本基金基金经理  
李晖宇先生,国籍:中国,经济学硕士,7年证券基金从业经验。曾任银华基金管理有限公司固定收益部基金经理助理,从事债券投资研究工作;2016年8月加盟鹏华基金管理有限公司,历任固定收益部投资经理,现任公开募集证券投资基金基金经理。2016年12月担任鹏华丰盈债券型证券投资基金基金经理,2016年12月至2018年07月担任鹏华丰惠债券基金基金经理,2017年02月至2018年07月担任鹏华可转债基金基金经理,2017年06月担任鹏华丰盈债券基金基金经理,2017年06月担任鹏华金城保本混合基金基金经理,2018年06月担任鹏华尊定定期开放发起式债券基金基金经理,2018年06月担任鹏华安益增强固合基金基金经理,2018年12月担任鹏华丰华债券基金基金经理,2019年03月担任鹏华中债1-3年期国开行债券指数基金基金经理,2019年06月担任鹏华9-10年期利率发起式债券基金基金经理。

本基金基金经理管理的其他基金情况：  
2016年12月至2018年07月担任鹏华丰惠债券基金基金经理  
2017年02月至2018年07月担任鹏华可转债基金基金经理  
2017年06月担任鹏华丰惠债券基金基金经理  
2018年06月担任鹏华尊定定期开放发起式债券基金基金经理  
2018年06月担任鹏华安益增强固合基金基金经理  
2018年12月担任鹏华丰华债券基金基金经理  
2019年03月担任鹏华中债1-3年期国开行债券指数基金基金经理  
2019年06月担任鹏华9-10年期利率发起式债券基金基金经理

本基金历任的基金经理为：  
2016年11月至2018年07月 刘太阳先生  
2016年12月至2018年07月 祝松先生  
5、投资决策委员会成员情况  
邓昭明先生,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。  
郭晓涛先生,鹏华基金管理有限公司副总裁。  
高天凯先生,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,鹏华新兴产业混合、鹏华研究精选混合基金、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、基金托管人情况

1、基本情况  
名称：平安银行股份有限公司  
住所：广东省深圳市罗湖区深南东路5047号  
办公地址：广东省深圳市罗湖区深南东路5047号  
法定代表人：谢永林  
成立日期：1987年12月22日  
组织形式：股份有限公司  
注册资本：17,170,411,366元  
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[2008]1037号  
联系人：高希泉  
联系电话：(0755) 2219 7701

#### 1、平安银行基本情况

平安银行股份有限公司是一家总部设在深圳的全国性股份制商业银行（深圳证券交易所简称：平安银行，证券代码000001）。其前身是深圳发展银行股份有限公司,于2012年6月吸收合并原平安银行于同年7月更名成为平安银行（中国）股份有限公司及其子公司合计持有平安银行58%的股份,为平安银行的控股股东。截至2018年末,平安银行有80家分行,共1,057家营业机构。

2018年,平安银行实现营业收入1,167.16亿元（同比增长10.3%）、净利润248.18亿元（同比增长7.0%）、资产总额34,186.92亿元（较上年末增65.2%）、吸收存款余额21,285.57亿元（较上年末增长6.4%）、发放贷款和垫款总额（含贴现）19,975.29亿元（较上年末增幅17.2%）。

平安银行总行设资产托管事业部,下设市场拓展处、创新发展处、估值核算处、资金清算处、绩效发展处、IT系统支持处、督察合规处、基金服务中心8个处室,目前部门人员为60人。

#### 2、主要人员情况

陈正晖,男,中共党员,经济学硕士、高级经济师,高级理财规划师、国际注册私人银行家,具备《中国证券业执业证书》。长期从事商业银行业务,具有本外币资金清算、银行经营管理及基金托管业务的经营管理经验。1986年7月至1993年2月在武汉金融高等专科学校任教;1993年3月至1993年7月在招商银行武汉分行任客户经理;1993年8月至1999年2月在招商银行武汉分行计划信贷部经理、行长助理;1999年3月-2000年1月在招商银行武汉分行青山支行任行长助理;2000年2月至2001年7月在招商银行武汉分行银行部任副经理;2001年8月至2003年2月在招商银行武汉分行解放公园支行任行长;2003年3月至2006年4月在招商银行武汉机构业务部任总经理;2006年5月至2007年6月在招商银行武汉分行硚口支行任行长;2007年7月至2008年1月在招商银行武汉分行同业银行部任总经理;自2008年2月加盟平安银行先后任公司业务部总经理助理、产品及交易银行部副经理,一直负责公银行产品开发与管理,全面掌握银行产品包括托管业务产品的运作、营销和管理,尤其是对于商业银行有关的所有监管政策法规较熟悉。2011年12月平安银行资产托管部副经理;2013年5月起任平安银行资产托管事业部副经理（主持工作）;2015年3月5日起任平安银行资产托管事业部总监。

#### 3、基金托管业务情况

2008年8月16日获得中国证监会、银监会核准开办证券投资基金托管业务。截至2018年12月末,平安银行股份有限公司托管净值规模合计5.59万亿,托管证券投资基金共110只,具体包括货币净值型增长灵活配置混合型证券投资基金、华夏基金生命动力股票型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金、招商保证金快线货币市场基金、平安定期开放货币市场基金、新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金、东吴中证可转换债券分级证券投资基金、平安财富宝货币市场基金、红塔红土盛世普益灵活配置混合型证券投资基金、新华活期添利货币市场基金、民生加信优选回报证券投资基金、南方增鑫回报债券型证券投资基金、鹏华安盈货币市场基金、平安鑫森灵活配置型证券投资基金、新华广利多元策略灵活配置混合型证券投资基金、中海蓝筹收益灵活配置混合型证券投资基金、东吴移动互联灵活配置混合型证券投资基金、平安智选中国灵活配置混合型证券投资基金、国金鑫源新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、嘉合石磊混合型证券投资基金、平安鑫享混合型证券投资基金、广发聚盛混合型证券投资基金、鹏华弘安灵活配置混合型证券投资基金、博时裕荣纯债债券型证券投资基金、鹏华增利货币市场基金、中海鑫睿保本混合型证券投资基金、东方红轩轩沪港深灵活配置混合型证券投资基金、浙商汇金转型升级灵活配置混合型证券投资基金、广发安源回报债券型证券投资基金、博时裕和纯债债券型证券投资基金、平安惠理纯债债券型证券投资基金、嘉实稳鑫债券型证券投资基金、长信先声债券型证券投资基金、华润元大现金货币市场基金、平安鼎信定期开放债券型证券投资基金、平安鼎泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、南方欢欣定期开放混合型发起式证券投资基金、长信富平纯债一年定期开放债券型证券投资基金、中海合源增强收益债券型证券投资基金、富兰克林国海新动力灵活配置混合型证券投资基金、南方元兴债券型发起式证券投资基金、鹏华弘惠灵活配置混合型证券投资基金、鹏华兴安定期开放灵活配置混合型证券投资基金、西部利得天添利货币市场基金、鹏华弘安灵活配置混合型证券投资基金、博时安祺一年定期开放债券型证券投资基金、平安富利货币市场基金、广发鑫源灵活配置混合型证券投资基金、平安惠享纯债债券型证券投资基金、广发沪港深新起点股票型证券投资基金、平安鑫安定期开放债券型证券投资基金、鹏华弘腾成长多策略灵活配置混合型证券投资基金、博时广达纯债1年定期开放债券型发起式证券投资基金、英大鑫鑫灵活配置混合型证券投资基金、西部利得新动力灵活配置混合型证券投资基金、平安惠利纯债债券型证券投资基金、广发安盈18个月定期开放混合型证券投资基金、长盛盛丰灵活配置型证券投资基金、鹏华丰盈债券型证券投资基金、平安盛源纯债债券型证券投资基金、平安金管家货币市场基金、平安鑫利定期开放灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞新动力灵活配置混合型证券投资基金、广发汇平一年定期开放债券型证券投资基金、平安中证沪港深高股息精选指数证券投资基金、前海开源聚财宝货币市场基金、招商稳阳定期开放灵活配置混合型证券投资基金、前海开源沪港深鑫源灵活配置混合型证券投资基金、金鹰添荣债券型证券投资基金、平安可转债汇享债券型证券投资基金、鹏华丰玉债券型证券投资基金、平安鑫安定期开放混合型证券投资基金、西部利得久安回报灵活配置混合型证券投资基金、广发汇安18个月定期开放债券型证券投资基金、上投摩根岁岁金定期开放债券型证券投资基金、平安转型创新灵活配置混合型证券投资基金、南方和元债券型证券投资基金、中金丰沃灵活配置混合型证券投资基金、兴银消费升级灵活配置混合型证券投资基金、南方元丰灵活配置型证券投资基金、易方达恒安定期开放债券型证券投资基金、平安中证沪港深500指数基金、南方中证500交易型开放式指数证券投资基金、平安中债1-3年期高等级公司债利率债于交易型开放式指数证券投资基金。

#### 二、基金托管人的内部控制制度说明

#### 1、内部控制目标

作为基金托管人,平安银行股份有限公司严格遵守国家有关托管业务的法律法规,行业监管要求,自觉形成守法经营、规范运作的经营理念和经营风格,确保基金财产的安全完整,确保有关信息的真实、准确、完整,及时,保护基金份额持有人的合法权益;确保内部控制和风险管理体系的有效性;防范和化解经营风险,确保业务的安全、稳健运行,促进经目标的实现。

#### 2、内部控制组织结构

平安银行股份有限公司设有独立一级部门资产托管事业部,是履行资产托管业务的管理和运营部门,配备了专职内控稽核人员负责托管业务的内部控制风险管理工作,具有独立行使监督稽核工作的职权和能力。

3、内部控制制度及措施  
资产托管事业部配备系统、完善的制度控制体系,建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程,可以保证托管业务的规范操作和顺利进行;取得基金从

业资格的人员配备要求,业务管理严格实行复核、检查、检查制度,授权工作实行集中控制,业务操作程序化和留痕管理;存在、使用,账户资料严格保管,制衡机制严格执行;业务操作区与行政区,物理隔离,实施监控;业务资料与专职人员严格隔离负责,防止泄密;业务实现自动化处理,防止人为事故的发生;技术系统完整、独立。

三、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

#### 1、监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定,监督所托管基金的投资运作。利用行业普遍使用的“资产托管业务系统—监控系统”,严格按照现行法律法规以及基金合同规定,对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督,并定期编写基金投资运作监督报告,报送中国证监会。在日常为基金投资运作所提供的基础清算和核算服务过程中,对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对其基金管理人指令的提取与开支情况进行检查监督。

#### 2、监督流程

（1）每日工作日按时通过监控系统,对各基金投资运作比例控制指标进行例行监控,发现投资比例超标等异常情况,向基金管理人发出书面通知,与基金管理人进行情况沟通,督促其纠正,并及时报告中国证监会。

（2）收到基金管理人发出的投资指令后,涉及各基金的投资范围、投资对象及交易对手等内容进行合法合规性监督。

（3）根据基金投资运作监督情况,定期编写基金投资运作监督报告,对各基金投资运作的合法合规性、投资独立性和风格显著性等方面进行评价,报送中国证监会。

（4）通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易,电话或书面要求管理人进行解释或举证,并及时报告中国证监会。

### 三、相关服务机构

#### 一、基金份额发售机构

##### 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42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：李华怡

（4）鹏华基金管理有限公司武汉分公司  
办公地址：武汉市汉江区建设大道668号新世界国贸大厦3306室  
联系电话：027-85565781

传真：027-85565793

联系人：栾博民

（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：020-38827993  
传真：020-38827990

联系人：周樱

##### 2、代销机构情况

##### （1）银行销售机构

1）平安银行股份有限公司  
注册地址：深圳前海深港路5047号  
办公地址：深圳前海深港路5047号  
法定代表人：谢永林  
联系人：张莉

客户服务电话：95611-3  
网址：bank.pingan.com

##### （2）第三方销售机构

1）北京百度百盈基金销售有限公司  
注册地址：北京市海淀区上地十街10号百度大厦2层  
办公地址：北京市海淀区上地十街10号  
法定代表人：梁志祥  
联系人：王笑宇  
客户服务电话：90605-9  
网址：http://www.baiyingfund.com/

2）上海煜星基金销售有限公司  
注册地址：上海市崇明县长兴镇路66号11楼B1615室（上海东滩金融发展区）  
办公地址：上海市浦东新区银城中路488号太平金融大厦1503室  
法定代表人：王翔  
联系人：吴鸣飞

客户服务电话：400-820-5369  
网址：www.yjfund.com

3）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：上海市徐汇区龙田路190号3-301室  
法定代表人：其实  
联系人：高莉莉

客户服务电话：400-1818-188  
网址：www.1234567.com.cn

基金管理人可根据法律法规要求,根据实际情况,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  
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42-43层  
联系电话:(0755)82021877  
传真:(0755)82021165

负责人:范伟强

#### 三、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:深圳市福田区笋岗中路中民时代广场A座201  
法定代表人:闵齐双  
办公地址:深圳市福田区笋岗中路中民时代广场A座201  
联系电话:(0755)33391280  
传真:(0755-33033086

联系人:闵齐双

经办律师:闵齐双、王德森

#### 四、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:顾国忠  
办公地址:广东省深圳市福田区益田路6001号平安金融大厦10-14层  
联系电话:+86(0)89096568+86(755)18989223  
传真:+86(0)89091190

联系人:邢向京

#### 四、基金名称

本基金名称:鹏华丰盈债券型证券投资基金

五、基金运作方式及基金类型  
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,提高资金运用和收益水平,力争取得超越基金业绩比较基准的收益。

#### 七、基金的投资范围

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的固定收益类品种,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、可分离交易可转债、同业存单、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及中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具（但须符合中国证监会的规定），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,基金管理人将在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为:本基金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变更投资品种的投资比例限制,基金管理人将在履行适当程序后,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,以实现其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”的策略性配置由投资决策委员会确定,主要根据宏观经济情况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短、久期、中期债券的配置,本基金将通过调整收益率曲线的预测,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,随着其剩余期限的衰减,债券收益率将沿着陡峭的收益率曲线向较平缓的下滑,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、期权特征等因素,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现发行人资信及公司运营情况,与中小企业私募债承销券商紧密合作,合理合规严格地进行中小企业私募债投资。本基金在投资过程中密切跟踪债券信用等级及发行人信用等级变化情况,力求发现可能存在债券违约,并获取超额收益。

九、基金的业绩比较基准  
中债总指数收益率  
本基金业绩比较基准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;该指数样本债券涵盖央票、国债和政策性金融债,能较好地反映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,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,本基金管理人将在履行适当程序后,对业绩比较基准进行变更,并及时公告,而无需召开基金份额持有人大会。

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对标的预期收益率,在基金规定的投资比例范围内对不同信用特征、期限及债券与货币之间进行动态调整。

#### 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,以实现其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”的策略性配置由投资决策委员会确定,主要根据宏观经济情况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短、久期、中期债券的配置,本基金将通过调整收益率曲线的预测,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,随着其剩余期限的衰减,债券收益率将沿着陡峭的收益率曲线向较平缓的下滑,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、期权特征等因素,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现发行人资信及公司运营情况,与中小企业私募债承销券商紧密合作,合理合规严格地进行中小企业私募债投资。本基金在投资过程中密切跟踪债券信用等级及发行人信用等级变化情况,力求发现可能存在债券违约,并获取超额收益。

九、基金的业绩比较基准  
中债总指数收益率  
本基金业绩比较基准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;该指数样本债券涵盖央票、