鹏华丰和债券型证券投资基金(LOF)更新的招募说明书摘要

(2020年第1号)

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
2020年4月20日

重要提示

鹏华丰和债券型证券投资基金(LOF)由鹏华中小企业纯债债券型发起式证券投资基金转型而成。

鹏华中小企业纯债债券型发起式证券投资基金于2012 年11 月5 日成立同时进入三年封闭运作期。根据《鹏华中小企业纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》的约定,封闭期为三年,封闭期到期后将进行基金转型。鹏华中小企业纯债债券型发起式证券投资基金封闭期于2015年11月4日到期,2015年11月 5日起鹏华中小企业纯债债券型发起式证券投资基金转型为上市开放式基金(LOF),基金更名为"鹏华丰和债券型证券投资基金(LOF)"。基金的投资目标、投资范围、投资策略等依据《鹏华中小企业纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》中对转型后基金的相关约定执行。

2015年11月5日起,由《鹏华中小企业纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》修订而成的《鹏华丰和债券型证券投资基金(LOF)基金合同》生效。

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核准,但中国证监会对本基金募集的核准,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:市场风险、上市交易风险、上市公司经营风险、管理风险、流动性风险及其他风险。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金,但高于普通债券型基金。

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,由投资人自行承担。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。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、基金合同和基金产品资料概要,并根据自身风险承受能力选择适合自己的基金产品予以投资。

本招募说明书约定的基金产品资料概要编制、披露与更新要求,自《信息披露办法》实施之日起一年后开始执行。

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》第十二条中与招募说明书内容有关的一项或多项重大变更,具体事项请参考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。

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%
意大利欧利盛资本资产管理股份公司(Eurizon Capital SGR S.p.A.)	7,350	49%
深圳市北融信投资发展有限公司	150	1%
总 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。

邓召明先生,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、香港深业控股有限公司副总经理、中国高新技术产业投资管理有限公司董事长兼行政总裁、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顾问。

Massimo Mazzini先生, 董事, 经济和商学学士。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 AIPG SGR投资总监、CAAM AI SGR及CA AIPG 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、农业信贷另类投资集团(Credit Agricole Alternative Investments Group)国际执行委员会委员、意大利欧利盛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,欧利盛资本股份有限公司(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.)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,先后在法国农业信贷集团(Credit Agricole Group)东方汇理资产管理股份有限公司(CAAM SGR)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,现在担任意大利欧利盛资本资产管理股份公司(Eurizon Capital SGR S.p.A)董事会秘书兼任企业事务部总经理,欧利盛资本股份有限公司(Eurizon Capital S.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总部业务经理、深圳金地证券服务部财务经理、资金财务总部高级经理、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、资金财务总部总经理兼人力资源总部总经理。

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,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,中央金融工作委员会研究室主任,中国银监会政策法规部(研究局)主任(局长)等职务;2005年6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、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、上海营业部财务科副科长、资金财务部科员经理、资金财务部资金科经理、资金财务部主任会计师兼科经理、资金财务部总经理助理、资金财务部副总经理等,现任国信证券资金财务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、菲亚特汽车发动机和变速器平台管控管理团队工作、圣保罗IMI资产管理SGR企业经营部、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主管,现任监察稽核部总经理助理。

郝文高先生,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。

刘嵚先生,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。

邓召明先生,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时价值增长基金基金经理、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。

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、股权资产部(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总经理、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副所长、投资部经理,南方基金管理有限公司渠道服务二部总监助理,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,中国证监会办公厅新闻处干部、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调研员, 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

戴钢先生,国籍中国,经济学硕士,17年证券基金从业经验。曾就职于广东民安证券研究发展部,担任研究员;2005年9月加盟鹏华基金管理有限公司,从事研究分析工作,历任债券研究员、专户投资经理等职。2011年12月至2014年12月担任鹏华丰泽分级基金基金经理,2012年06月至2018年07月担任鹏华金刚保本混合基金基金经理,2012年11月至2015年11月担任鹏华中小企债基金基金经理,2013年09月担任鹏华丰实定期开放债券基金基金经理,2013年09月担任鹏华丰泰定期开放债券基金基金经理,2013年10月至2018年05月担任鹏华丰信分级债券基金基金经理,2014年12月至2016年02月担任鹏华丰泽债券(LOF)基金基金经理,2015年11月担任鹏华丰和债券(LOF)基金基金经理,2016年03月担任鹏华丰尚定期开放债券基金基金经理,2016年04月至2018年10月担任鹏华金鼎保本混合基金基金经理,2016年08月至2018年05月担任鹏华丰饶债券基金基金经理,2018年05月至2018年12月担任鹏华普悦债券基金基金经理,2018年07月担任鹏华宏观混合基金基金经理,2018年09月担任鹏华弘实混合基金基金经理,2018年10月担任鹏华鼎混合基金基金经理。戴钢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:

2011年12月至2014年12月担任鹏华丰泽分级基金基金经理

2012年06月至2018年07月担任鹏华金刚保本混合基金基金经理

2013年09月担任鹏华丰实定期开放债券基金基金经理

2013年09月担任鹏华丰泰定期开放债券基金基金经理

2013年10月至2018年05月担任鹏华丰信分级债券基金基金经理

2014年12月至2016年02月担任鹏华丰泽债券(LOF)基金基金经理

2016年03月担任鹏华丰尚定期开放债券基金基金经理

2016年04月至2018年10月担任鹏华金鼎保本混合基金基金经理

2016年08月至2018年05月担任鹏华丰饶债券基金基金经理

2018年05月至2018年12月担任鹏华普悦债券基金基金经理

2018年07月担任鹏华宏观混合基金基金经理

2018年09月担任鹏华弘实混合基金基金经理

2018年10月担任鹏华金鼎混合基金基金经理

本基金历任的基金经理:

无

5、投资决策委员会成员情况

邓召明先生,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。

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,鹏华新兴产业混合、鹏华研究精选混合、鹏华创新驱动混合基金基金经理。

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、上述人员之间均不存在近亲属关系。

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:李建红

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

资产托管部信息披露负责人:张燕

2、发展概况

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:600036),是国内第一家采用国际会计标准上市的公司。2006年9月又成功发行了22亿H股,9月22日在香港联交所挂牌交易(股票代码:3968),10月5日行使H股超额配售,共发行了24.2亿H股。截至2019年3月31日,本集团总资产67,943.47亿元人民币,高级法下资本充足率15.86%,权重法下资本充足率13.28%。

2002年8月,招商银行成立基金托管部;2005年8月,经报中国证监会同意,更名为资产托管部,现下设业务管理团队、产品管理团队、项目管理团队、稽核监察团队、基金外包业务团队、养老金业务团队、系统与数据团队7个职能团队,现有员工80人。2002年11月,经中国人民银行和中国证监会批准获得证券投资基金托管业务资格,成为国内第一家获得该项业务资格上市银行;2003年4月, 正式办理基金托管业务。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、受托投资管理托管、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。

招商银行确立"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,以"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"、托管业务综合系统和"6心"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,推出国内首个托管大数据平台, 成功托管国内第一只券商集合资产管理计划、第一只FOF、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QDII基金、第一只红利ETF基金、第一只"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商向全面投资者服务机构的转变,得到了同业认可。

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,四度蝉联获《财资》"中国最佳托管专业银行"。2016年6月招商银行荣膺《财资》"中国最佳托管银行奖",成为国内唯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"十佳金融产品创新奖";7月荣膺2016年中国资产管理"金贝奖""最佳资产托管银行"。2017年6月招商银行再度荣膺《财资》"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"十佳金融产品创新奖";8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"。2018年1月招商银行荣膺中央国债登记结算有限责任公司"2017年度优秀资产托管机构"奖项;同月,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、全国金融青联第五届"双提升"金点子方案二等奖;3月荣膺公募基金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";12月荣膺2018东方财富风云榜 "2018年度最佳托管银行"、"20年最值得信赖托管银行"奖。2019年3月招商银行荣获《中国基金报》"2018年度最佳基金托管银行"奖。

(二)主要人员情况

李建红先生,本行董事长、非执行董事,2014年7月起担任本行董事、董事长。英国东伦敦大学工商管理硕士、吉林大学经济管理专业硕士,高级经济师。招商局集团有限公司董事长,兼任招商局国际有限公司董事会主席、招商局能源运输股份有限公司董事长、中国国际海运集装箱(集团)股份有限公司董事长、招商局华建公路投资有限公司董事长和招商局资本投资有限责任公司董事长。曾任中国远洋运输(集团)总公司总裁助理、总经济师、副总裁,招商局集团有限公司董事、总裁。

田惠宇先生,本行行长、执行董事,2013年5月起担任本行行长、本行执行董事。美国哥伦比亚大学公共管理硕士学位,高级经济师。曾于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,在中国科技国际信托投资公司工作;1995年6月至2001年10月,历任招商银行北京分行展览路支行、东三环支行行长助理、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,历任北京分行行长助理、副行长;2006年3月至2008年6月,任北京分行党委书记、副行长(主持工作);2008年6月至2012年6月,任北京分行行长、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月起兼任本行董事会秘书。

姜然女士,招商银行资产托管部总经理,大学本科毕业,具有基金托管人高级管理人员任职资格。先后供职于中国农业银行黑龙江省分行,华商银行,中国农业银行深圳市分行,从事信贷管理、托管工作。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经理、高级经理、总经理助理等职。是国内首家推出的网上托管银行的主要设计、开发者之一,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2019年3月31日,招商银行股份有限公司累计托管450只证券投资基金。

(四) 托管人的内部控制制度

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;建立有利于查错防弊、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、流程的不断完善。

内部控制组织结构

招商银行资产托管业务建立三级内控风险防范体系:

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;

二级风险防范是招商银行资产托管部设立稽核监察团队, 负责部门内部风险预防和控制;

三级风险防范是招商银行资产托管部在设置专业岗位时,遵循内控制衡原则,视业务的风险程度制定相应监督制衡机制。

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、覆盖所有团队和岗位。

(2)审慎性原则。托管组织体系的构成、内部管理制度的建立均以防范风险、审慎经营为出发点,以有效防范各种风险作为内部控制的核心,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团队、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。内部控制适应招商银行托管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改变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。内部控制能够实现在托管组织体系、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。

内部控制措施

(1)完善的制度建设。招商银行资产托管部从资产托管业务内控管理、产品受理、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托管项目审批、资金清算与会计核算双人双岗、大额资金专人跟踪、凭证管理等一系列完整的操作规程,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,数据执行异地实时备份,所有的业务信息须经过严格的授权方能进行访问。

(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,视同会计资料保管。客户资料不得泄露,有关人员如需调用,须经总经理室成员审批,并做好调用登记。

(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、业务网和办公网、托管业务网与全行业务网双分离制度,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等,保证信息技术系统的安全。

(6)人力资源控制。招商银行资产托管部通过建立良好的企业文化和员工培训、激励机制、加强人力资源管理及建立人才梯级队伍及人才储备机制,有效的进行人力资源管理。

(五)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《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、投资组合等情况的合法性、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、行政法规和其他有关规定,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确认并以书面形式向基金托管人发出回函并改正。基金管理人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

(一)基金销售机构

(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

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502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:李化怡

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568号新世界国贸大厦I座3305室

联系电话:027-85557881

传真:027-85557973

联系人:祁明兵

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:周樱

2、其他销售机构

(1)银行销售机构

1)北京银行股份有限公司

注册地址:北京市西城区金融大街甲17号首层

办公地址:北京市西城区金融大街丙17号

法定代表人:张东宁

联系人:张喆

客户服务电话:95526

网址:www.bankofbeijing.com.cn

2)东莞农村商业银行股份有限公司

注册地址:广东省东莞市城区南城路2号

办公地址:广东省东莞市城区南城路2号

法定代表人:王耀球

联系人:杨亢

客户服务电话:0769-961122

网址:www.drcbank.com

3)杭州银行股份有限公司

注册地址:杭州市庆春路46号杭州银行大厦

办公地址:杭州市庆春路46号杭州银行大厦

法定代表人:吴太普

联系人:严峻

客户服务电话:95398

网址:www.hzbank.com.cn

4)江苏江南农村商业银行股份有限公司

注册地址:江苏省常州市和平中路413号

办公地址:江苏省常州市和平中路413号

法定代表人:陆向阳

联系人:蒋娇

客户服务电话:0519-96005

网址:www.jnbank.com.cn

5)交通银行股份有限公司

注册地址:上海市浦东新区银城中路188号

办公地址:上海市浦东新区银城中路188号

法定代表人:彭纯

联系人:王菁

客户服务电话:95559

网址:www.bankcomm.com

6)上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址:上海市中山东一路12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:唐苑

客户服务电话:95528

网址:www.spdb.com.cn

7)上海银行股份有限公司

注册地址:中国(上海)自由贸易试验区银城中路168号

办公地址:中国(上海)自由贸易试验区银城中路168号

法定代表人:金煜

联系人:汤征程

客户服务电话:95594

网址:www.bosc.cn

8)招商银行股份有限公司

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

法定代表人:李建红

联系人:邓炯鹏

客户服务电话:95555

网址:www.cmbchina.com

9)中国工商银行股份有限公司

注册地址:北京复兴门内大街55号

办公地址:北京复兴门内大街55号

法定代表人:易会满

联系人:刘秀宇

客户服务电话:95588

网址:www.icbc.com.cn

10)中国建设银行股份有限公司

注册地址:北京市西城区金融大街25号

办公地址:北京市西城区金融大街25号

法定代表人:田国立

联系人:王未雨

客户服务电话:95533

网址:www.ccb.com

11)中国民生银行股份有限公司

注册地址: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

联系人:穆婷

客户服务电话:95568

网址:www.cmbc.com.cn

12)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:邱泽滨

客户服务电话:95599

网址:www.abcchina.cn

13)中国邮政储蓄银行股份有限公司

注册地址:北京市西城区金融大街3号

办公地址:北京市西城区金融大街3号

法定代表人:李国华

联系人:王硕

客户服务电话:95580

网址:www.psbc.com

14)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9号

办公地址:北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

法定代表人:李庆萍

联系人:迟卓

客户服务电话:95558

网址:bank.ecitic.com

(2)证券公司销售机构

1)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:曹宏

联系人:金夏

客户服务电话:400-666-6888

网址:www.cgws.com

2)第一创业证券股份有限公司

注册地址:深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼

办公地址:深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼

法定代表人:刘学民

联系人:毛诗莉

客户服务电话:95358

网址:www.firstcapital.com.cn

3)广发证券股份有限公司

注册地址:广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街2号618室

办公地址:广州市天河区马场路26号广发证券大厦

法定代表人:孙树明

联系人:黄岚

客户服务电话:95575

网址:www.gf.com.cn

4)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

客户服务电话:400-818-8118

网址:www.guodu.com

5)国信证券股份有限公司

注册地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人:何如

联系人:李颖

客户服务电话:95536

网址:www.guosen.com.cn

6)海通证券股份有限公司

注册地址:上海市广东路689号

办公地址:上海市黄浦区广东路689号

法定代表人:周杰

联系人:赵洋洋

客户服务电话:95553

网址:www.htsec.com

7)华融证券股份有限公司

注册地址:北京市西城区金融大街8号

办公地址:北京市朝阳区朝阳门北大街18号中国人保寿险大厦11至18层

法定代表人:祝献忠

联系人:孙燕波

客户服务电话:95390

网址:www.hrsec.com.cn

8)华西证券股份有限公司

注册地址:四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦

办公地址:四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦

法定代表人:杨炯洋

联系人:谢国梅

客户服务电话:95584

网址:www.hx168.com.cn

9)华鑫证券有限责任公司

注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01(b)单元

办公地址:上海市徐汇区宛平南路8号

法定代表人:俞洋

联系人:杨莉娟

客户服务电话:95323/4001099918(全国)/029-68918888(西安)

网址:www.cfsc.com.cn

10)开源证券股份有限公司

注册地址:西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层

办公地址:西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层

法定代表人:李刚

联系人:袁伟涛

客户服务电话:95325/400-860-8866

网址:www.kysec.cn

11)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:李玉婷

客户服务电话:95523/4008895523

网址:www.swhysc.com

12)天风证券股份有限公司

注册地址:湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦4楼

办公地址:湖北省武汉市武昌区中南路99号保利广场A座37楼

法定代表人:余磊

联系人:夏旻

客户服务电话:95391/4008005000

网址:www.tfzq.com

13)西南证券股份有限公司

注册地址:重庆市江北区桥北苑8号

办公地址:重庆市江北区桥北苑8号

法定代表人:廖庆轩

联系人:周青

客户服务电话:4008096096/95355

网址:www.swsc.com.cn

14)湘财证券股份有限公司

注册地址:湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼

办公地址:湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼

法定代表人:孙永祥

联系人:李欣

客户服务电话:95351

网址:www.xcsc.com

15)兴业证券股份有限公司

注册地址:福州市湖东路268号

办公地址:上海市浦东新区长柳路36号兴业证券大厦

法定代表人:兰荣

联系人:乔琳雪

客户服务电话:95562

网址:www.xyzq.com.cn

16)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

法定代表人:毕明建(代)

联系人:杨涵宇

客户服务电话:4009101166

网址:www.cicc.com.cn

17)中国银河证券股份有限公司

注册地址:北京市西城区金融大街35号2-6层

办公地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

法定代表人:陈共炎

联系人:辛国政

客户服务电话:4008-888-888/95551

网址:www.chinastock.com.cn

18)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18-21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栋第4、18层至21层

法定代表人:高涛

联系人:万玉琳

客户服务电话:95532/4006008008

网址:www.china-invs.cn

19)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

客户服务电话:95548

网址:www.cs.ecitic.com

20)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

客户服务电话:95548

网址:http://sd.citics.com

(3)期货公司销售机构

1)中信建投期货有限公司

注册地址:重庆市渝中区中山三路107号上站大楼平街11-B,名义层11-A,8-B4,9-B、C

办公地址:重庆市渝中区中山三路107号皇冠大厦11楼

法定代表人:彭文德

联系人:刘芸

客户服务电话:400-8877-780

网址:www.cfc108.com

2)中信期货有限公司

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13层1301-1305、14层

办公地址: 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13层1301-1305、14层

法定代表人:张皓

联系人:刘宏莹

客户服务电话:400-990-8826

网址:www.citicsf.com

(4)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:95055-9

网址:https://www.baiyingfund.com/

2)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:北京市朝阳区望京SOHO T3 A座19层

法定代表人:钟斐斐

联系人:戚晓强

客户服务电话:400-159-9288

网址:danjuanapp.com

3)北京恒天明泽基金销售有限公司

注册地址:北京市北京经济技术开发区宏达北路10号5层5122室

办公地址:北京市北京经济技术开发区宏达北路10号5层5122室

法定代表人:黄永伟

联系人:侯仁凤

客户服务电话:400-8980-618

网址:www.chtfund.com

4)北京展恒基金销售有限公司

注册地址:北京市朝阳区安苑路15-1号邮电新闻大厦2层

办公地址:北京市朝阳区安苑路15-1号邮电新闻大厦2层

法定代表人:闫振杰

联系人:马林

客户服务电话:4008188000

网址:www.myfund.com

5)和讯信息科技有限公司

注册地址:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层

办公地址:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层

法定代表人:王莉

联系人:于扬

客户服务电话:400-920-0022

网址:licaike.hexun.com

6)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:浙江省杭州市西湖区万塘路18号黄龙时代广场B座6F

法定代表人:陈柏青

联系人:韩爱彬

客户服务电话:4000-766-123

网址:www.fund123.cn

7)诺亚正行基金销售有限公司

注册地址:上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室

办公地址:上海市杨浦区秦皇岛路32号c栋

法定代表人:汪静波

联系人:朱了

客户服务电话:400-821-5399

网址:www.noah-fund.com

8)上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址:上海市浦东新区高翔路526号2幢220室

办公地址:上海市浦东新区东方路1267号11层

法定代表人:张跃伟

联系人:张佳琳

客户服务电话:400-089-1289

网址:www.erichfund.com

9)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号鄂尔多斯大厦903~906室

法定代表人:杨文斌

联系人:王诗玙

客户服务电话:400-700-9665

网址:www.howbuy.com

10)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:吴鸿飞

客户服务电话:400-820-5369

网址:www.jiyufund.com.cn

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

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:郭坚

联系人:陈铭洲

客户服务电话:400-821-9031

网址:www.lu.com

12)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195号3C座10楼

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

13)上海万得基金销售有限公司

注册地址:中国(上海)自由贸易试验区福山路33号11楼B座

办公地址:上海市浦东新区浦明路1500号万得大厦11楼

法定代表人:王廷富

联系人:徐亚丹

客户服务电话:400-799-1888

网址:www.520fund.com.cn

14)深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址:深圳市福田区福田街道民田路178号华融大厦27层2704

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:马勇

联系人:文雯

客户服务电话:400-166-1188

网址:8.jrj.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

办公地址:深圳市罗湖区笋岗街道梨园路物资控股置地大厦8楼801

法定代表人:薛峰

联系人:邓爱萍

客户服务电话:4006-788-887

网址:www.zlfund.cn、www.jjmmw.com

16)天相投资顾问有限公司

注册地址:北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701

办公地址:北京市西城区新街口外大街28号C座505室

法定代表人:林义相

联系人:谭磊

客户服务电话:010-66045678

网址:www.jjm.com.cn/

17)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C1809

法定代表人:戎兵

联系人:魏晨

客户服务电话:400-6099-200

网址:www.yixinfund.com

18)浙江金观诚基金销售有限公司

注册地址:杭州市拱墅区登云路45号(锦昌大厦)1幢10楼1001室

办公地址:杭州市拱墅区登云路55号锦昌大厦1号楼1楼金观

法定代表人:徐黎云

联系人:来舒岚

客户服务电话:400-688-1888

网址:www.jincheng-fund.com

19)浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址:浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903

办公地址:杭州市余杭区五常街道同顺路18号同花顺大楼

法定代表人:凌顺平

联系人:吴强

客户服务电话:4008773772

网址:www.5ifund.com

20)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

客户服务电话:4008769988

网址:www.zscffund.com

21)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12楼B1201-1203

法定代表人:肖雯

联系人:黄敏嫦

客户服务电话:020-89629066

网址:www.yingmi.cn

基金管理人可根据有关法律法规要求,根据实情,选择其他符合要求的机构代理销售本基金或变更上述销售机构,并在基金管理人网站公示。

2、场内发售机构

具有基金销售业务资格且符合深圳证券交易所风险控制要求的深圳证券交易所会员单位(具体名单见基金份额发售公告)。

(二)注册登记机构

名称:中国证券登记结算有限责任公司

住所:北京市西城区太平桥大街17号

法定代表人:周明

办公室地址:北京市西城区太平桥大街17号

联系电话:010-50938782

传真:010-50938907

负责人:赵亦清

(三)律师事务所

名称:上海通力律师事务所

住所:上海市银城中路68号时代金融中心19楼

法定代表人:俞卫锋

办公室地址: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:陈颖华

经办律师:吕红、黎明

(四)会计师事务所

名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

法定代表人:李丹

办公室地址:上海市湖滨路202号领展企业广场2座普华永道中心11楼

联系电话:(021)23238888

传真:(021)23238800

联系人:魏佳亮

经办会计师:许康玮、陈熹

四、基金的名称

鹏华丰和债券型证券投资基金(LOF)

五、基金的运作方式与类型

契约型发起式基金

六、基金的投资目标

通过严格的风险控制及积极的投资策略, 力求最大限度获得高于业绩比较基准的收益。

七、基金的投资范围

本基金主要投资于固定收益类证券,包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、中小企业私募债、短期融资券、可转债、分离交易可转债、资产支持证券、债券回购等;同时投资于股票、权证等权益类证券以及法律、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的相关规定)。

基金的投资组合比例为:本基金对债券等固定收益类证券的投资比例不低于基金资产的80%;股票等权益类证券的投资比例不超过基金资产的20%;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

(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、国内外经济形势等分析,结合债券市场整体收益率曲线变化、股票市场整体走势预判等,选择配置合适的大类资产,并动态调整大类资产之间的比例。

(2)债券投资策略

本基金灵活应用久期策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、债券选择策略等,在合理管理并控制组合风险的前提下,最大化组合收益。

1)久期策略

本基金将通过自上而下的组合久期管理策略,以实现对组合利率风险的有效控制。基金管理人将根据对宏观经济周期所处阶段及其他相关因素的研判调整组合久期。如果预期利率下降,本基金将增加组合的久期,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,以减小债券价格下降带来的风险。

2)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、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。

3)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有较大幅的下滑,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。

4)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。

5)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、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。

①可转换债券投资策略

可转换债券是介于股票和债券之间的投资品种,具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特征。本基金将根据对债券市场、股票市场的比较分析,选择股性强、债性弱或特征相反的可转债列入当期可转债核心库,然后对具体个券的股性、债性做进一步分析比较,优选最合适的券种进入组合,以获取超额收益。

在选择可转换债券品种时, 本基金将与本公司的股票投研团队积极合作, 深入研究,力求选择被市场低估的品种,来构建本基金可转换债券的投资组合。

②中小企业私募债券投资策略

中小企业私募债券是在中国境内以非公开方式发行和转让, 约定在一定期限还本付息的公司债券。由于其非公开性及条款可协商性,普遍具有较高收益。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券商紧密合作,合理合规合格地进行中小企业私募债券投资。本基金主要采用买入并持有策略,在投资过程中密切监控债券信用等级或发行人信用等级变化情况,力求规避可能存在的债券违约,并获取超额收益。

对于含认股权证及可转股条款的中小企业私募债券,本基金将遵循以下投资原则:

a. 发行时无法确定发行主体是否可以在交易所上市的品种,本基金将视其为普通中小企业私募债,主要以债项属性为基础进行投资决策。在持有过程中,除非发行主体实现上市,否则本基金将遵循这一原则,不进行认股权证的行使或者转股操作。

b. 发行时已经确定发行主体可在交易所上市的中小企业私募债,本基金在投资时候会在债项属性的基础上,结合相关认股权证或转股条款进行分析,采用相应的模型进行投资。

c. 在持有过程中,如果发行主体实现交易所上市,本基金将分析相关认股权证或转股条款的价值,并结合债项属性进行投资决策,根据市场情况及进行相应的投资操作。

(3)资产支持证券等品种投资策略

资产支持证券包括资产抵押贷款支持证券 (ABS)、住房抵押贷款支持证券(MBS)等,其定价受多种因素影响,包括市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率等。

本基金将在基本面分析和债券市场宏观分析的基础上, 结合蒙特卡洛模拟等数量化方法,对资产支持证券进行定价,评估其内在价值进行投资。

(4)股票投资策略

1)新股申购策略

本基金根据新股发行人的基本情况,结合对认购中签率和新股上市后表现的预期,谨慎参与新股申购。

2)二级市场股票投资策略

本基金通过综合分析上市公司的行业地位、竞争优势、盈利能力、成长性、估值水平等多种因素,精选具备较高成长性及估值合理的股票构建股票资产组合。

九、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准:中债综合指数收益率

中债综合指数样本具有广泛的市场代表性,涵盖主要交易市场、不同发行主体和期限的债券,是中国目前最权威、应用最广的债券指数之一,适合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时,本基金管理人可以在与基金托管人协商一致, 并报中国证监会备案后变更本基金业绩比较基准并及时公告,而无需基金份额持有人大会审议。

十、基金的风险收益特征

本基金属于债券型基金,其预期风险和预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金、股票型基金,为证券投资基金中的低风险品种。

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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定, 于2019年4月18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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年1月1日起至2019年3月31日止。

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	4,774,753.00	6.03
	其中:股票	4,774,753.00	6.03
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	68,159,842.00	86.01
	其中:债券	68,159,842.00	86.01
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	1,100,000.00	1.39
	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	3,618,918.28	4.57
8	其他资产	1,589,255.21	2.01
9	合计	79,242,768.49	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

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,715,556.00	3.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	703,392.00	1.02
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	1,355,805.00	1.97
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	4,774,753.00	6.94

(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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601688	华泰证券	60,500	1,355,805.00	1.97
2	603916	苏博特	97,900	1,346,125.00	1.96
3	600323	瀚蓝环境	40,800	703,392.00	1.02
4	600315	上海家化	21,700	685,503.00	1.00
5	300584	海辰药业	23,600	683,928.00	0.99

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	20,735,000.00	30.13
2	央行票据	-	-
3	金融债券	18,796,380.00	27.32
	其中:政策性金融债	13,716,380.00	19.93
4	企业债券	28,545,462.00	41.48
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	83,000.00	0.12
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	68,159,842.00	99.06

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	019601	18国债19	100,000	10,368,000.00	15.07
2	180019	18附息国债19	100,000	10,367,000.00	15.07
3	190205	19国开05	100,000	9,916,000.00	14.41
4	124736	PR柳龙投	72,590	6,228,222.00	9.05
5	143158	17银河G1	50,000	5,080,000.00	7.38

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

注:无。

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:无。

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:无。

9、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1)本期国债期货投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

(2)报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

(3)本期国债期货投资评价

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

10、投资组合报告附注

(1)中国银河 2018年7月5日,中国银河证券股份有限公司(以下简称"公司")收到中国人民银行出具的《行政处罚意见告知书》(银反洗罚告字[2018]4号),主要内容如下:

中国人民银行依据《中华人民共和国反洗钱法》第三十二条规定,拟对公司未按照规定履行客户身份识别义务的行为处人民币50万元罚款, 与身份不明的客户进行交易或者为客户开立匿名账户、假名账户的行为处人民币50万元罚款,合计处人民币100万元罚款。

公司在接受检查期间即立查立改,截至目前,公司已经进一步完善了反洗钱制度机制,细化了客户身份识别、客户洗钱风险等级管理、可疑交易报告等工作流程,加强了反洗钱监督检查和考核,加大了对历史存量客户持续识别力度,反洗钱相关系统功能也不断改进。公司今后将持续完善内控合规管理,切实做好反洗钱工作。

对该证券的投资决策程序的说明:本基金管理人长期跟踪研究该公司,认为公司的上述违规行为对公司并不产生实质性影响。上述通告对该公司债券的投资价值不产生重大影响。该证券的投资已执行内部严格的投资决策流程,符合法律法规和公司制度的规定。

(2)本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券备选库。

(3)其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	25,972.48
2	应收证券清算款	306,181.43
3	应收股利	-
4	应收利息	1,257,091.31
5	应收申购款	9.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,589,255.21

(4)报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:无。

(5)报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:无。

(6)投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

十二、基金的业绩

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资人在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

基金合同生效以来的投资业绩及其与同期基准的比较如下表所示:

丰和A类

	净值增长率1	净值增长率标准差2	业绩比较基准收益率3	业绩比较基准收益率标准差4	1-3	2-4
2012年11月05日(基金合同生效日)至2012年12月31日	0.60%	0.09%	0.66%	0.01%	-0.06%	0.08%
2013年01月01日至2013年12月31日	-1.09%	0.17%	4.25%	0.01%	-5.34%	0.16%
2014年01月01日至2014年12月31日	22.60%	0.29%	4.22%	0.01%	18.38%	0.28%
2015年01月01日至2015年12月31日	12.56%	0.33%	4.71%	0.03%	7.85%	0.30%
2016年01月01日至2016年12月31日	3.28%	0.12%	1.85%	0.09%	1.43%	0.03%
2017年01月01日至2017年12月31日	2.55%	0.08%	0.24%	0.06%	2.31%	0.02%
2018年01月01日至2018年12月31日	-0.83%	0.32%	8.22%	0.07%	-9.05%	0.25%
2019年01月01日至2019年03月31日	2.79%	0.12%	1.16%	0.05%	1.63%	0.07%
自基金合同生效日至2019年03月31日	48.26%	0.24%	27.43%	0.06%	20.83%	0.18%

丰和C类

	净值增长率1	净值增长率标准差2	业绩比较基准收益率3	业绩比较基准收益率标准差4	1-3	2-4
2018年06月07日(基金合同生效日)至2018年12月31日	-1.20%	0.33%	4.93%	0.06%	-6.13%	0.27%
2019年01月01日至2019年03月31日	2.43%	0.12%	1.16%	0.05%	1.27%	0.07%
自基金合同生效日至2019年03月31日	1.20%	0.28%	6.16%	0.06%	-4.96%	0.22%

十三、基金的费用与税收

(一)基金费用的种类

1、基金管理人的管理费;

2、基金托管人的托管费;

3、基金销售服务费;

4、基金的上市费用;

5、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用;

6、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费;

7、基金份额持有人大会费用;

8、基金的证券交易费用;

9、基金的银行汇划费用;

10、按照国家有关规定和基金合同约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

(二)基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.8%年费率计提。管理费的计算方法如下:

$H=E\times 0.8\% \div$ 当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,经基金管理人和基金托管人双方核对后,由基金托管人于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

$H=E\times 0.2\% \div$ 当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,经基金管理人和基金托管人双方核对后,由基金托管人于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

3、销售服务费

本基金A类基金份额不收取销售服务费,C类基金份额的销售服务费年费率为0.4%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务,基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。销售服务费计提的计算公式如下:

$H=E\times 0.4\% \div$ 当年天数

H 为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为C类基金份额前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金份额销售服务费划款指令,基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取并付给基金管理人,由基金管理人代付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

上述"一、基金费用的种类"中第4-10项费用,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

(三)不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;

3、基金合同生效前的律师费、会计师费和信息披露费用等相关费用;

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

(四)基金管理费、基金托管费、基金销售服务费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情降低基金管理费、基金托管费、基金销售服务费,此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。基金管理人必须最迟于新的费率实施日2日前在指定媒介上刊登公告。

(五)与基金销售有关的费用

1、场外申购、赎回的费用

(1)本基金A类基金份额场外申购费率如下:

申购金额M(元)	申购费率
M<50万	0.8%
50万≤M<250万	0.5%
250万≤M<500万	0.3%
M≥500万	每笔1000元

投资人在一天之内如果有多笔申购,适用费率按单笔分别计算。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取。本基金的申购费用由本基金A类基金份额的投资人承担,不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。本基金C类基金份额不收取申购费用。

(2)赎回费:本基金A类基金份额的场外赎回费率按持有期限递减。通过场外认购、申购的投资者其份额持有期限以份额实际持有期限为准;从场内转托管至场外的基金份额,从场外赎回时,其持有期限从转托管转入确认日开始计算。具体费率如下:

持有期限(Y)	场外赎回费率
Y<7日	1.5%
7日≤Y<30日	0.3%
30日≤Y<1年	0.1%
1年≤Y<2年	0.05%
Y≥2年	0

本基金C类基金份额的场外赎回费率按持有期限递减。具体费率如下:

持有期限(Y)	场外赎回费率
Y<7日	1.5%
Y≥7日	0

本基金的赎回费用在投资人赎回本基金份额时收取。本基金的赎回费用由赎回申请人承担, 本基金对持续持有期少于7日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产;对于持续持有期不少于7日的投资者收取的赎回费总额的25%归入基金财产,75%用于支付市场推广、注册登记费和其他手续费。

2、场内申购和赎回的费用

(1)本基金场内申购费率如下:

申购金额M(元)	申购费率
M<50万	0.8%
50万≤M<250万	0.5%
250万≤M<500万	0.3%
M≥500万	每笔1000元

投资人在一天之内如果有多笔申购,适用费率按单笔分别计算。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取。本基金的申购费用不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

(2)赎回费:

本基金的场内赎回费率按持有期限递减,具体费率如下:

持有期限(Y)	场内赎回费率
Y<7日	1.5%
Y≥7日	0.1%

本基金的赎回费用在投资人赎回本基金份额时收取。本基金的赎回费用由赎回申请人承担, 本基金对持续持有期少于7日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产;对于持续持有期不少于7日的投资者收取的赎回费总额的25%归入基金财产,75%用于支付市场推广、注册登记费和其他手续费。

(六)基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定,履行纳税义务

十四、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人根据《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》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的规定,结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动,对本基金管理人原公告的本基金招募说明书进行了更新,主要更新的内容如下:

1、在"重要提示"部分明确了本次招募说明书更新的内容。

2、对涉及信息披露相关的内容进行了更新。

鹏华基金管理有限公司
2020年4月