鹏华永诚一年定期开放债券型证券投资基金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:中国建设银行股份有限公司
2020年4月20日

重要提示

鹏华永诚一年定期开放债券型证券投资基金由鹏华实业债纯债债券型证券投资基金经2018年4月28日中国证券监督管理委员会下发的《关于准予鹏华实业债纯债债券型证券投资基金变更注册的批复》(证监许可[2018]771号文)变更注册而来。根据相关法律法规,本基金基金合同已于2018年12月19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变更注册,但中国证监会对鹏华实业债纯债债券型证券投资基金转型为本基金的变更注册,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。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。

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。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。

基金合同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。

第一部分 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经理、资金财务总部经理助理、资金财务总部副总经理等,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

刘涛先生,国籍中国,金融学硕士,6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,担任固定收益部债券研究员,现担任公募债券投资部基金经理。2016年05月担任鹏华丰融定期开放债券基金基金经理,2016年05月至2018年08月担任鹏华国企债债券基金基金经理,2016年11月担任鹏华丰禄债券基金基金经理,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月担任鹏华丰达债券基金基金经理,2017年02月至2019年02月担任鹏华丰恒债券基金基金经理,2017年02月担任鹏华丰腾债券基金基金经理,2017年05月担任鹏华丰瑞债券基金基金经理,2017年05月担任鹏华普天债券基金基金经理,2018年03月担任鹏华弘盛混合基金基金经理,2018年03月至2018年12月担任鹏华实业债基金基金经理,2018年07月担任鹏华尊悦发起式定开债券基金基金经理,2018年10月担任鹏华3个月中短债基金基金经理,2018年12月担任鹏华永诚一年定期开放债券基金基金经理,2019年03月担任鹏华永融一年定期开放债券基金基金经理,2019年03月担任鹏华永润一年定期开放债券基金基金经理。刘涛先生具备基金从业资格。

本基金基金经理管理的其他基金情况:
2016年05月担任鹏华丰融定期开放债券基金基金经理
2016年05月至2018年08月担任鹏华国企债债券基金基金经理
2016年11月担任鹏华丰禄债券基金基金经理
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月担任鹏华丰达债券基金基金经理
2017年02月至2019年02月担任鹏华丰恒债券基金基金经理
2017年02月担任鹏华丰腾债券基金基金经理
2017年05月担任鹏华丰瑞债券基金基金经理
2017年05月担任鹏华普天债券基金基金经理
2018年03月担任鹏华弘盛混合基金基金经理
2018年03月至2018年12月担任鹏华实业债基金基金经理
2018年07月担任鹏华尊悦发起式定开债券基金基金经理
2018年10月担任鹏华3个月中短债基金基金经理
2019年03月担任鹏华永融一年定期开放债券基金基金经理
2019年03月担任鹏华永润一年定期开放债券基金基金经理

本基金历任的基金经理:
2018年12月至2019年01月 刘太阳先生

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、上述人员之间不存在近亲属关系。

第二部分 基金托管人

一、基金托管人情况
(一)基本情况
名称:中国建设银行股份有限公司(简称:中国建设银行)
住所:北京市西城区金融大街25号
办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人:田国立
成立时间:2004年09月17日
组织形式:股份有限公司
注册资本:贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整
存续期间:持续经营
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]12号
联系人:田 青
联系电话:(010)6759 5096

中国建设银行成立于1954年10月,是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行,总部设在北京。本行于2005年10月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码939),于2007年9月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码601939)。

2018年6月末,本集团资产总额228,051.82亿元,较上年末增加6,807.99亿元,增幅3.08%。上半年,本集团盈利平稳增长,利润总额较上年同期增加93.27亿元至1,814.20亿元,增幅5.42%;净利润较上年同期增加84.56亿元至1,474.65亿元,增幅6.08%。

2017年,本集团先后荣获香港《亚洲货币》"2017年中国最佳银行",美国《环球金融》"2017最佳转型银行"、新加坡《亚洲银行家》"2017年中国最佳数字银行"、"2017年中国最佳大型零售银行奖"、《银行家》"2017最佳金融创新奖" 及中国银行业协会 "年度最具社会责任金融机构" 等多项重要奖项。本集团在英国《银行家》"2017全球银行1000强"中列第2位;在美国《财富》"2017年世界500强排行榜"中列第28名。

中国建设银行总行设资产托管业务部,下设综合与合规管理处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII托管处、养老金托管处、清算处、核算处、跨境托管运营处、监督稽核处等10个职能处室,在安徽合肥设有托管运营中心,在上海设有托管运营中心上海分中心,共有员工315余人。自2007年起,托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计,并已经成为常规化的内控工作手段。

(二)主要人员情况

纪伟,资产托管业务部总经理,曾先后在中国建设银行南通分行、总行计划财务部、信贷经营部任职,并在总行公司业务部、投资托管业务部、授信审批部担任领导职务。其拥有八年托管从业经历,熟悉各项托管业务,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

龚毅,资产托管业务部资深经理(专业技术一级),曾就职于中国建设银行北京市分行国际部、营业部并担任副行长,长期从事信贷业务和集团客户业务等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲,资产托管业务部资深经理(专业技术一级),曾就职于中国建设银行总行会计部,长期从事托管业务管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

郑绍平,资产托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部、战略客户部,长期从事客户服务、信贷业务管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

原玎,资产托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行国际业务部,长期从事海外机构及海外业务管理、境内外汇业务管理、国外金融机构客户营销拓展等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

(三)基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行,中国建设银行一直秉持"以客户为中心"的经营理念,不断加强风险管理和内部控制,严格履行托管人的各项职责,切实维护资产持有人的合法权益,为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展,中国建设银行托管资产规模不断扩大,托管业务品种不断增加,已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、(R)QFII、(R)QDII、企业年金等产品在内的托管业务体系,是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2018年二季度末,中国建设银行已托管857只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平,赢得了业内的高度认同。中国建设银行先后9次获得《全球托管人》"中国最佳托管银行"、4次获得《财资》"中国最佳次托管银行"、连续5年获得中债登"优秀资产托管机构"等奖项,并在2016年被《环球金融》评为中国市场唯一一家"最佳托管银行"、在2017年荣获《亚洲银行家》"最佳托管系统实施奖"。

二、基金托管人的内部控制制度
(一)内部控制目标

作为基金托管人,中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和本行内有关管理规定,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。

(二)内部控制组织结构

中国建设银行设有风险与内控管理委员会,负责全行风险管理与内部控制工作,对托管业务风险控制工作进行检查指导。资产托管业务部配备了专职内控合规人员负责托管业务的内控合规工作,具有独立行使内控合规工作职权和能力。

(三)内部控制制度及措施

资产托管业务部具备系统、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;业务人员具备从业资格;业务管理严格实行复核、审核、检查制度,授权工作实行集中控制,业务印章按规程保管、存放、使用,账户资料严格保管,制约机制严格有效;业务操作区专门设置,封闭管理,实施音像监控;业务信息由专职信息披露人负责,防止泄密;业务实现自动化操作,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
(一)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。利用自行开发的"新一代托管应用监督子系统",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。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中,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开支情况进行检查监督。

(二)监督流程

1.每工作日按时通过新一代托管应用监督子系统,对各基金投资运作比例控制等情况进行监控,如发现投资异常情况,向基金管理人进行风险提示,与基金管理人进行情况核实,督促其纠正,如有重大异常事项及时报告中国证监会。

2.收到基金管理人的划款指令后,对指令要素等内容进行核查。

3.通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易,电话或书面要求基金管理人进行解释或举证,如有必要将及时报告中国证监会。

第三部分相关服务机构

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
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)大连银行股份有限公司
注册地址:大连市中山区中山路88号天安国际大厦49楼
办公地址:大连市中山区中山路88号天安国际大厦9楼
法定代表人:崔磊
联系人:朱珠
客户服务电话:4006640099
网址:www.bankofdl.com
3)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
4)东亚银行(中国)有限公司
注册地址:上海浦东新区花园石桥路66号东亚银行金融大厦29楼
办公地址:上海浦东新区花园石桥路66号东亚银行金融大厦29楼
法定代表人:李国宝
联系人:李杰
客户服务电话:0512-38663866
网址: www.hkbea.com.cn
5)福建海峡银行股份有限公司
注册地址:福建省福州市台江区江滨中大道358号海峡银行大厦
办公地址:福建省福州市台江区江滨中大道358号海峡银行大厦
法定代表人:俞敏
联系人:黄钰雯
客户服务电话:400-893-9999
网址:www.fjhxbank.com
6)广东顺德农村商业银行股份有限公司
注册地址:佛山市顺德区大良德和居委会拥翠路2号
办公地址:佛山市顺德区大良德和居委会拥翠路2号
法定代表人:姚真勇
客户服务电话:0757-22223388
网址:www.sdebank.com
7)广州农村商业银行股份有限公司
注册地址:广州市天河区珠江新城华夏路1号信合大厦
办公地址:广州市天河区珠江新城华夏路1号信合大厦
法定代表人:王继康
客户服务电话:95313
网址:www.grcbank.com
8)徽商银行股份有限公司
注册地址:合肥市安庆路79号天徽大厦A座
办公地址:合肥市安庆路79号天徽大厦A座
法定代表人:吴学民
联系人:叶卓伟
客户服务电话:4008896588
网址:www.hsbank.com.cn
9)吉林银行股份有限公司
注册地址:吉林省长春市经济技术开发区东南湖大路1817号
办公地址:吉林省长春市经济技术开发区东南湖大路1817号
法定代表人:张宝祥
联系人:孟明
客户服务电话:400-889-6666
网址:www.jlbank.com.cn
10)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
11)江苏张家港农村商业银行股份有限公司
注册地址:江苏省张家港市人民中路66号
办公地址:江苏省张家港市人民中路66号
法定代表人:季颖
联系人:朱芳
客户服务电话:0512-96065
网址:www.zrcbank.com
12)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
13)南京银行股份有限公司
注册地址:江苏省南京市玄武区中山路288号
办公地址:江苏省南京市玄武区中山路288号
法定代表人:胡升荣
客户服务电话:95302
网址:www.njcb.com.cn
14)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
15)天津银行股份有限公司
注册地址:天津市河西区友谊路25号
办公地址:天津市河西区友谊路25号
法定代表人:李宗唐
联系人:李岩
客户服务电话:4006960296
网址:www.bank-of-tianjin.com.cn
16)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
17)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
18)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
19)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)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:陈剑虹
客户服务电话:95517
网址:www.essence.com.cn
2)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
3)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
4)光大证券股份有限公司
注册地址:上海市静安区新闸路1508号
办公地址:上海市静安区新闸路1508号
法定代表人:薛峰
联系人:何耀
客户服务电话:95525
网址:www.ebscn.com
5)广州证券股份有限公司
注册地址:广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层
办公地址:广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层
法定代表人:邱三发
联系人:梁微
客户服务电话:95396
网址:www.gzs.com.cn
6)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
7)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
8)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
9)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
10)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
11)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
12)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
13)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
14)西部证券股份有限公司
注册地址:西安市新城区东新街232号陕西信托大厦
办公地址:西安市新城区东新街232号陕西信托大厦16-17层
法定代表人:刘建武
联系人:梁承华
客户服务电话:95582
网址:www.westsecu.com
15)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
16)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
17)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:尹旭航
客户服务电话:95321
网址:www.cindasc.com
18)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
19)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
20)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
(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
(4)第三方销售机构
1)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
2)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
3)北京虹点基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区工人体育场北路甲2号盈科中心东门2层222单元
办公地址:北京市朝阳区工人体育场北路甲2号盈科中心东门2层
法定代表人:胡伟
联系人:陈铭洲
客户服务电话:400-618-0707
网址:www.hongdianfund.com
4)北京汇成基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区中关村大街11号11层1108
办公地址:北京市海淀区中关村大街11号11层1108
法定代表人:王伟刚
联系人:王晓晓
客户服务电话:400-619-9059
网址:www.hcjijin.com
5)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:北京市大兴区亦庄经济开发区科创十一街18号院京东总部A座17层
法定代表人:江卉
联系人:韩锦星
客户服务电话:95118
网址:fund.jd.com
6)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
客户服务电话:010-62675369
网址:www.xincai.com
7)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
8)北京植信基金销售有限公司
注册地址:北京市密云县兴盛南路8号院2号楼106室-67
办公地址:北京市朝阳区惠河南路盛世龙源10号
法定代表人:于龙
联系人:张喆
客户服务电话:4006-802-123
网址:https://www.zhixin-inv.com/
9)成都华羿恒信基金销售有限公司
注册地址:中国(四川)自由贸易试验区成都高新区蜀锦路88号1号楼32楼2号
办公地址:中国(四川)自由贸易试验区成都高新区蜀锦路88号1号楼32楼2号
法定代表人:赵壁
联系人:徐莉
客户服务电话:028-87326832
网址:www.huayihengxin.com/
10)海银基金销售有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区银城中路8号402室
办公地址:上海市浦东新区银城中路8号4楼
法定代表人:刘惠
联系人:刘晖
客户服务电话:400-808-1016
网址:www.fundhaiyin.com
11)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
12)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
13)南京苏宁基金销售有限公司
注册地址:南京市玄武区苏宁大道1-5号
办公地址:南京市玄武区苏宁大道1-5号
法定代表人:刘汉青
联系人:王锋
客户服务电话:95177
网址:www.snjijin.com
14)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
15)浦领基金销售有限公司
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
16)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:400-820-2899
网址:www.erichfund.com
17)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
18)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:李一梅
联系人:仲秋玥
客户服务电话:400-817-5666
网址:www.amcfortune.com
19)上海汇付金融服务有限公司
注册地址:上海市中山南路100号金外滩国际广场19楼
办公地址:上海市宜山路700号普天信息产业园2期C5栋汇付天下总部大楼2楼
法定代表人:金佶
联系人:钱诗雯
客户服务电话:440-8202-819
网址:www.chinapnr.com
20)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
21)上海利得基金销售有限公司
注册地址:上海市宝山区蕴川路5475号1033室
办公地址:上海浦东新区峨山路91弄61号陆家嘴软件园10号楼12楼
法定代表人:李兴春
联系人:陈孜明
客户服务电话:95733
网址:www.leadfund.com.cn
22)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
23)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
24)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
25)上海中正达广基金销售有限公司
注册地址:上海市徐汇区龙腾大道2815号302室
办公地址:上海市徐汇区龙腾大道2815号302室
法定代表人:黄欣
联系人:戴珉微
客户服务电话:400-6767-523
网址:www.zzwealth.cn
26)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
27)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
28)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/
29)宜信普泽(北京)基金销售有限公司
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
30)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
31)中期时代基金销售(北京)有限公司
注册地址:北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢11层1103号
办公地址:北京市朝阳区建国门外光华路16号1幢11层
法定代表人:路瑶
联系人:侯英建
客户服务电话:400-8888-160
网址:www.cifcofund.com
32)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。

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
办公室地址: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

三、出具法律意见书的律师事务所
名称:北京市竞天公诚律师事务所
住所:北京市朝阳区建国路 77 号华贸中心 3 号写字楼 34 层
法定代表人:赵洋
办公室地址:北京市朝阳区建国路 77 号华贸中心 3 号写字楼 34 层
联系电话:(010) 58091000;(0755) 23982200
传真:(010) 58091100;(0755) 23982211
联系人:黄亮
经办律师:孔雨泉、黄亮

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

第四部分 基金的名称

本基金的名称:鹏华永诚一年定期开放债券型证券投资基金

第五部分 基金的运作方式与类型

契约型开放式债券型基金

第六部分 基金的投资目标

在严格控制风险的基础上,通过定期开放的形式保持适度流动性,力求取得超越基金业绩比较基准的收益。

第七部分 基金的投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,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、超短期融资券、资产支持证券、公开发行的次级债、债券回购、银行存款、同业存单等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)。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,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:对债券的投资比例不低于基金资产的80%,但在每次开放期前一个月(首个开放期除外)、开放期内及开放期结束后一个月的期间内,基金投资不受上述比例限制;开放期内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%。前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如果法律法规对该比例要求有变更的,以变更后的比例为准,基金管理人在履行适当程序后,本基金的投资比例会做相应调整。

第八部分 基金的投资策略

本基金债券投资将主要采取久期策略, 同时辅之以信用利差策略、收益率曲线策略、收益率利差策略、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,通过定期开放的形式保持适度流动性,力求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,及债券与现金类资产之间进行动态调整。

2、久期策略

本基金将主要采取久期管理策略,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严格控制。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"的战略性配置由投资决策委员会确定, 主要根据对宏观经济和资本市场的预测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、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。

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、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。

7、资产支持证券的投资策略

本基金将综合运用战略资产配置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、利率风险和流动性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,在保证本金安全和基金资产流动性的基础上获得稳定收益。

8、开放期投资策略

本基金以定期开放方式运作,即采取在封闭期内封闭运作、封闭期与封闭期之间定期开放的运作方式。开放期内,基金规模将随着投资人对本基金份额的申购与赎回而不断变化。因此本基金在开放期将保持资产适当的流动性,以应付当时市场条件下的赎回要求,并降低资产的流动性风险,做好流动性管理。

第九部分 基金的业绩比较基准

中债总指数收益率

中债总指数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,主要投资于债券等金融工具,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,本基金管理人与基金托管人协商一致后可以在报中国证监会备案以后变更业绩比较基准并及时公告,但不需要召开基金份额持有人大会。

第十部分 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。

第十一部分 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。

基金托管人中国建设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	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	306,318,807.80	96.38
	其中:债券	306,318,807.80	96.38
	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	-	-
	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	4,770,153.11	1.50
8	其他资产	6,729,223.17	2.12
9	合计	317,818,184.08	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
无。
(2)报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
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
无。
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	1,019,700.00	0.47
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	173,120,717.80	79.50
5	企业短期融资券	48,948,000.00	22.48
6	中期票据	83,230,390.00	38.22
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	306,318,807.80	140.66

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	011802560	18大足国资SCP002	140,000	14,106,400.00	6.48
2	1480187	14温高新债02	204,160	12,815,123.20	5.88
3	101900031	19兴化城投MTN001	125,000	12,651,250.00	5.81
4	1480262	14太仓港债	200,000	12,556,000.00	5.77
5	1580098	15阳江债	150,000	12,469,500.00	5.73

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
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
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
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
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)
本基金投资的前十名证券中本期没有发行主体被监管部门立案调查的、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。
(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	4,529.04
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,724,694.13
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,729,223.17

(4)报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
无。
(5)报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
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。

第十二部分 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,也不保证最低收益。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。

本基金基金合同生效以来的投资业绩与同期基准的比较如下表所示(本报告中所列财务数据未经审计):

	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12月19日(基金合同生效日)至2018年12月31日	0.34%	0.04%	0.80%	0.09%	-0.46%	-0.05%
2019年01月01日至2019年03月31日	2.22%	0.05%	1.11%	0.09%	1.11%	-0.04%
自基金合同生效日至2019年03月31日	2.57%	0.05%	1.91%	0.09%	0.66%	-0.04%

第十三部分 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、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;
4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费;
5、基金份额持有人大会费用;
6、基金的证券交易费用;
7、基金的银行汇划费用;
8、证券账户开户费用、账户维护费用;
9、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0.3%年费率计提。管理费的计算方法如下:
$H=E\times 0.3\%\div$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
基金管理费每日计提,按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等,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0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下:
$H=E\times 0.1\%\div$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
基金托管费每日计提,按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。
上述"一、基金费用的种类中第3-9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、与基金销售有关的费用
1、申购费率
本基金对通过直销中心申购的养老金客户与除此之外的其他投资人实施差别的申购费率。
养老金客户指基本养老基金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金等,包括但不限于全国社会保障基金、可以投资基金的地方社会保险基金、企业年金单一计划以及集合计划、商业养老保险组合。如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型,基金管理人可在招募说明书更新时或发布临时公告将其纳入养老金客户范围。非养老金客户指除养老金客户外的其他投资人。
通过基金管理人的直销中心申购本基金基金份额的养老金客户适用下表特定申购费率,其他投资人申购本基金基金份额的适用下表一般申购费率:

申购金额M(元)	一般申购费率	特定申购费率
M<100万	0.80%	0.32%
100万≤M<500万	0.40%	0.12%
M≥500万	每笔1000元	每笔1000元

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取。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。
申购费用由投资人承担,不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。
2、赎回费率
本基金的赎回费率如下表所示:

持有年限(Y)	赎回费率
Y<7天	1.5%
7天≤Y<1年	0.1%
Y≥1年	0

由原实业债纯债债券型证券投资基金基金份额转型而来的基金份额的持有期从其持有鹏华实业债纯债债券型证券投资基金之日起连续计算。
赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担,在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费总额的100%计入基金财产。(注:1年为365天)
五、基金税收
本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。
基金财产投资的相关税收,由基金份额持有人承担,基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

第十四部分 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