鹏华丰惠债券型证券投资基金更新的招募说明书摘要

基金管理人:鹏华基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
2020年06月

重要提示

本基金经2016年9月9日中国证券监督管理委员会下发的《关于准予鹏华丰惠债券型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2016]2075号)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12月9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,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,从而影响该类债券的市场流动性。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基本面的难度。

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。

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。

本招募说明书所载内容截止日为2020年05月15日,有关财务数据和净值表现截止日为2020年03月31日(未经审计)。

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、党委副书记等职务。现任国信证券股份有限公司董事长、党委书记。自2008年12月开始担任鹏华基金管理有限公司董事。

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裁、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董事、总裁、党委书记。自2012年12月开始担任鹏华基金管理有限公司董事。

杜海江先生,董事、大学本科,国籍:中国。历任国信证券股份有限公司杭州萧然东路证券营业部电子商务部经理、杭州保俶路证券营业部总经理助理、浙江营销中心总经理、浙江管理总部总经理、杭州分公司总经理、浙江分公司总经理、公司总裁助理等职务。现任国信证券股份有限公司副总裁,经纪事业部总裁。自2019年8月开始担任鹏华基金管理有限公司董事。

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、资金财务总部总经理助理、资金财务总部副总经理、人力资源总部副总经理、人力资源总部总经理等职务。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。自2012年12月开始担任鹏华基金管理有限公司董事。

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)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。自2010年11月开始担任鹏华基金管理有限公司董事。

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和战略发展部总经理。自2016年2月开始担任鹏华基金管理有限公司董事。

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。自2008年9月开始担任鹏华基金管理有限公司董事。

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。自2012年12月开始担任鹏华基金管理有限公司董事。

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。自2012年12月开始担任鹏华基金管理有限公司董事。

2、基金管理人监事会成员

黄俞先生,监事会主席,管理学硕士,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,深圳市北融信投资发展有限公司董事长。自2013年11月开始担任鹏华基金管理有限公司监事会主席。

陈冰女士,监事,管理学学士,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、资金财务部总经理助理、资金财务总部副总经理、融资融券部总经理等职务。现任国信证券总裁助理,兼证券金融事业部总裁、资金运营部总经理。自2015年6月开始担任鹏华基金管理有限公司监事。

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IM1资产管理SGR企业经管部、圣保罗财富管理企业管控部工作、管任欧利盛资本资产管理股份公司(Eurizon Capital SGR S.p.A.)财务管理和投资经理,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。自2016年2月开始担任鹏华基金管理有限公司监事。

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。自2015年9月开始担任鹏华基金管理有限公司监事。

刘岚先生,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,现任总裁助理、首席市场官兼机构理财部总经理、北京分公司总经理。自2015年9月开始担任鹏华基金管理有限公司监事。

左彬先生,职工监事,法学硕士,国籍:中国。历任中国平安保险(集团)股份有限公司法律事务部律师;2016年 4 月加盟鹏华基金管理有限公司,历任监察稽核部高级合规经理,现任监察稽核部高级合规官。自2019年9月开始担任鹏华基金管理有限公司监事。

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、党委副书记等职务。现任国信证券股份有限公司董事长、党委书记。自2008年12月开始担任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裁、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董事、总裁、党委书记。自2012年12月开始担任鹏华基金管理有限公司董事。

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,自2008年12月起担任鹏华基金管理有限公司副总裁。

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,自2015年10月起担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,自2014年12月起担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机构理财部总经理、职工监事、总裁助理,自2015年9月起担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,自2015年2月担任鹏华基金管理有限公司纪委书记、督察长。

韩亚庆先生,副总裁,经济学硕士,国籍:中国。历任国家开发银行资金局主任科员、全国社会保障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,自2017年3月起担任鹏华基金管理有限公司副总裁、固定收益投资总监、固定收益总部总经理。

4、本基金基金经理

邓明明先生,国籍中国,金融学硕士,6年证券基金从业经验。曾任融通基金管理有限公司固定收益研究员、专户投资经理;2019年1月加盟鹏华基金管理有限公司,从事债券研究分析工作,现任公募债券投资部基金经理。2019年06月担任鹏华永安定期开放债券基金基金经理,2019年08月担任鹏华金利债券基金基金经理,2019年10月担任鹏华尊享定期开放发起式债券基金基金经理,2019年11月担任鹏华丰达债券基金基金经理,2019年11月担任鹏华丰茂债券基金基金经理,2019年11月担任鹏华丰惠债券基金基金经理。邓明明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:

2019年06月担任鹏华永安定期开放债券基金基金经理

2019年08月担任鹏华金利债券基金基金经理

2019年10月担任鹏华尊享定期开放发起式债券基金基金经理

2019年11月担任鹏华丰达债券基金基金经理

2019年11月担任鹏华丰茂债券基金基金经理

本基金历任的基金经理:

2016年12月至2018年07月	刘太阳先生
2016年12月至2018年07月	李振宇先生
2016年12月至2019年11月	祝松先生
2018年07月至2019年01月	孙柠先生

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/董事总经理(MD)/基金经理,鹏华新兴产业混合、鹏华研究精选混合、鹏华创新驱动混合、鹏华研究智选混合、鹏华价值驱动混合基金、鹏华科技创新混合基金经理。

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/基金经理,鹏华养老2045混合发起式(FOF)基金经理。

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

一、基金托管人基本情况

名称:中信银行股份有限公司(简称"中信银行")

住所: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9号

法定代表人:李庆萍

成立时间:1987年4月20日

组织形式:股份有限公司

注册资本:489.35亿元人民币

存续期间:持续经营

批准设立文号:中华人民共和国国务院办公厅国办函[1987]14号

基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字[2004]125号

联系人:中信银行资产托管部

联系电话:4006800000

传真:010-85230024

客服电话:95558

网址:bank.ecitic.com

经营范围:保险兼业代理业务(有效期至2020年09月09日);吸收公众存款;发放短期、中期和长期贷款;办理国内外结算;办理票据承兑与贴现;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;提供保管箱服务;结汇、售汇业务;代理开放式基金业务;办理黄金业务;黄金进出口;开展证券投资基金、企业年金基金、保险资金、合格境外机构投资者托管业务;经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。(企业依法自主选择经营项目,开展经营活动;依法须经批准的项目,经相关部门批准后依批准的内容开展经营活动;不得从事本市产业政策禁止和限制类项目的经营活动。)

中信银行成立于1987年,是中国改革开放中最早成立的新兴商业银行之一,是中国最早参与国内外金融市场融资的商业银行,并以屡创中国现代金融史上多个第一而蜚声海内外,为中国经济建设做出了彰极贡献。2007年4月,本行实现在上海证券交易所和香港联合交易所A+H股同步上市。

本行以建设最佳综合金融服务企业为发展愿景,充分发挥中信集团金融与实业并举的独特竞争优势,坚持"以客为尊",秉承"平安中信、合规经营、科技立行、服务实体、市场导向、创造价值"的经营理念,向企业客户和机构客户提供公司银行业务、国际业务、金融市场业务、机构业务、投资银行业务、保理业务、托管业务等综合金融解决方案,向个人客户提供零售银行、信用卡、消费金融、财富管理、私人银行、出国金融、电子银行等多元化金融产品及服务,全方位满足企业、机构及个人客户的综合金融服务需求。

截至2019年6月末,本行在国内149个大中城市设有1,410家营业网点,同时在境内外下设6家附属机构,包括中信国际金融控股有限公司、信银(香港)投资有限公司、中信金融租赁有限公司、浙江临安中信村镇银行股份有限公司、中信百信银行股份有限公司、哈萨克斯坦阿尔金银行。其中,中信国际金融控股有限公司子公司中信银行(国际)有限公司,在香港、澳门、纽约、洛杉矶、新加坡和中国内地设有37家营业网点。信银(香港)投资有限公司在香港和境内设立有3家子公司。中信百信银行股份有限公司为本行与百度公司发起设立的国内首家具有独立法人资格的直销银行。阿尔金银行在哈萨克斯坦设有6家营业网点和1个私人银行中心。

30多年来,本行坚持服务实体经济,稳健经营,与时俱进。经过30余年的发展,本行已成为一家总资产规模超6万亿元、员工人数近6万名,具有强大综合实力和品牌竞争力的金融集团。2019年,本行在英国《银行家》杂志"全球银行品牌500强排行榜"中排名第19位;本行一级资本在英国《银行家》杂志"世界1000家银行排名"中排名第26位。

二、主要人员情况

方合英先生,中信银行执行董事、行长兼财务总监。方先生于2018年9月加入本行董事会。方先生自2014年8月起任本行党委委员,2014年11月起任本行副行长,2017年1月起兼任本行财务总监,2019年2月起任本行党委副书记。方先生现同时担任信银(香港)投资有限公司、中信银行(国际)有限公司及中信国际金融控股有限公司董事。此前,方先生于2013年5月至2015年1月任本行金融市场业务总监,2014年5月至2014年9月兼任本行杭州分行党委书记、行长;2007年3月至2013年5月任本行苏州分行党委书记、行长;2003年9月至2007年3月历任本行杭州分行行长助理、党委委员、副行长;1996年12月至2003年9月在本行杭州分行工作,历任信贷部科长、副总经理,富阳支行行长、党组书记,国际结算部副总经理,零售业务部副总经理,营业部总经理;1996年7月至1996年12月任浦东发展银行杭州城东办事处副主任;1992年12月至1996年7月在浙江银行学校实验城市信用社信贷部工作,历任信贷员、经理、总经理助理;1991年7月至1992年12月在浙江银行学校任教师。方先生为高级经济师,毕业于北京大学,获高级管理人员工商管理硕士学位,拥有二十余年中国银行业从业经验。

杨毓先生,中信银行副行长,分管托管业务。杨先生自2015年7月起任本行党委委员,2015年12月起任本行副行长。此前,杨先生2011年3月至2015年6月任中国建设银行江苏省分行党委书记、行长;2006年7月至2011年2月任中国建设银行河北省分行党委书记、行长;1982年8月至2006年6月在中国建设银行河南省分行工作,历任计财处副处长、信阳分行副行长、党委委员、计财处处长、郑州市铁道分行党委书记、行长、郑州分行党委书记、行长,河南省分行党委副书记、副行长(主持工作)。杨先生为高级经济师,研究生学历,管理学博士。

杨璋琪先生,中信银行资产托管部副总经理(主持工作),硕士研究生学历。杨先生2018年1月至2019年3月,任本行金融同业部副总经理;2015年5月至2018年1月,任本行长春分行副行长;2013年4月至2015年5月,任本行机构业务部总经理助理;1996年7月至2013年4月,就职于本行北京分行(原总行营业部),历任支行行长、投资银行部总经理、贸易金融部总经理。

三、基金托管业务经营情况

2004 年8 月18 日,中信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批准,取得基金托管人资格。中信银行本着"诚实信用、勤勉尽责"的原则,切实履行托管人职责。

截至2020年一季度末,中信银行托管150只公开募集证券投资基金,以及基金公司、证券公司资产管理产品、信托产品、企业年金、股权基金、QDII等其他托管资产,托管总规模达到9.49万亿元人民币。

四、基金托管人的内部控制制度

1、内部控制目标。强化内部管理,确保有关法律法规及规章在基金托管业务中得到全面严格的贯彻执行;建立完善的规章制度和操作规程,保证基金托管业务持续、稳健发展;加强稽核监察,建立高效的风险监控体系,及时有效地发现、分析、控制和避免风险,确保基金财产安全,维护基金份额持有人利益。

2、内部控制组织结构。中信银行总行建立了风险管理委员会,负责全行的风险控制和风险防范工作;托管部内设内控台风险,专门负责托管部内部风险控制,对基金托管业务的各个工作环节和业务流程进行独立、客观、公正的稽核监察。

3、内部控制制度。中信银行严格按照《基金法》以及其他法律法规及规章的规定,以控制和防范基金托管业务风险为主线,制定了《中信银行基金托管业务管理办法》、《中信银行基金托管业务内部控制管理办法》和《中信银行托管业务内控检查实施细则》等一整套规章制度,涵盖证券投资基金托管业务的各个环节,保证证券投资基金托管业务合法、合规、持续、稳健发展。

4、内部控制措施。建立了各项规章制度、操作流程、岗位职责、行为规范等,从制度上、人员上保证基金托管业务稳健发展;建立了安全保管基金财产的物质条件,对业务运行场所实行封闭管理,在要害部门和岗位设立了安全保密区,安装了录像、录音监控系统,保证基金信息的安全;建立严密的内部控制防线和业务授权管理等制度,确保所托管的基金财产独立运行;营造良好的内部控制环境,开展多种形式的持续培训,加强职业道德教育。

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

基金托管人根据《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同、托管协议和有关法律法规及规章的规定,对基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载的基金业绩表现数据等进行监督和核查。

如基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同和有关法律法规及规章的行为,将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正。在限期内,基金托管人有权随时对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。基金托管人发现基金管理人有重大违规行为或违规事项未能在限期内纠正的,基金托管人将以书面形式报告中国证监会。

三、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1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)江苏银行股份有限公司

注册地址:南京市秦淮区中华路26号

办公地址:南京市秦淮区中华路26号

法定代表人:夏平

客户服务电话:95319

网址:www.jsbchina.cn

(2)证券公司销售机构

1)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:北京市朝阳门内大街188号

法定代表人:王常青

联系人:刘畅

客户服务电话:95587/4008-888-108

网址:www.csc108.com

2)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

3)中信证券华南股份有限公司

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:胡伏云

联系人:梁微

客户服务电话:95548

网址:www.gzs.com.cn

4)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:焦刚

客户服务电话:95548

网址:sd.citics.com

(3)期货公司销售机构

1)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

网址:www.baiyingfund.com

2)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.hcjjin.com

3)北京肯特瑞基金销售有限公司

注册地址:北京市海淀区西三旗建材城中路12号17号平房157

办公地址:北京市通州区亦庄经济技术开发区科创十一街18号院京东集团总部A座15层

法定代表人:王苏宁

联系人:韩锦星

客户服务电话:95118

网址:kenterui.jd.com

4)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:王诗玲

客户服务电话:400-700-9665

网址:www.howbuy.com

5)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:吴鸣飞

客户服务电话:400-820-5369

网址:www.jiyufund.com.cn

6)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

7)阳光人寿保险股份有限公司

注册地址:海南省三亚市迎宾路360-1号三亚阳光金融广场16层

办公地址:北京市朝阳区朝阳门外大街乙12号院1号昆泰国际大厦12层

法定代表人:李科

联系人:王超

客户服务电话:95510

网址:fund.sinosig.com

8)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:广东嘉得信律师事务所

住所:深圳市罗湖区笋岗东路中民时代广场A 座201

法定代表人:闵齐双

办公室地址:深圳市罗湖区笋岗东路中民时代广场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、刘中良

四、会计师事务所

名称:毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)

住所:中国北京东长安街1号东方广场毕马威大楼8层

法定代表人:邹俊

办公室地址:中国北京东长安街1号 东方广场毕马威大楼8层

联系电话:(755)25471000

传真:(755)82668930

联系人:蔡正轩

经办会计师:奚霞、高朋

四、基金的名称

本基金名称:鹏华丰惠债券型证券投资基金

五、基金运作方式及类型

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,提高资金流动性和收益率水平,力争取得超越基金业绩比较基准的收益。

七、基金的投资方向

本基金的投资范围主要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、可分离交易可转债的纯债部分、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:本基金对债券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,通过利差分析和对利率曲线变动趋势的判断,提高资金流动性和收益率水平,力争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、中小企业私募债投资策略

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投资。本基金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。

8、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。

九、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。

十、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,为证券投资基金中具有较低风险收益特征的品种。

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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2020年04月21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2020年01月01日起至03月31日止。

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	1,936,805,000.00	89.98
	其中:债券	1,903,305,000.00	88.43
	资产支持证券	33,500,000.00	1.56
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	146,333,830.40	6.80
8	其他资产	69,276,817.82	3.22
9	合计	2,152,415,648.22	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

注:无。

(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

注: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	161,902,000.00	10.21
	其中:政策性金融债	80,630,000.00	5.09
4	企业债券	782,638,000.00	49.36
5	企业短期融资券	100,250,000.00	6.32
6	中期票据	858,515,000.00	54.14
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,903,305,000.00	120.04

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	136872	16豫投债	1,000,000	102,390,000.00	6.46
2	112932	19长城03	800,000	81,272,000.00	5.13
3