

(上接B066版)

网址: www.fundhaiyin.com  
6)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:浙江省杭州市西湖区万塘路18号黄龙时代广场B座C座  
法定代表人:王莉  
联系人:于洁  
客户服务电话:400—920—0022  
网址:licaike.hexun.com  
7)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:上海市杨浦区秦皇岛路32号c栋  
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  
8)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:王峰  
客户服务电话:95177  
网址:www.snjfund.com  
9)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  
10)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:上海市浦东新区南1118号鄂尔多斯大厦903—906室  
法定代表人:杨文斌  
联系人:王诗琦  
客户服务电话:400—700—9695  
网址:www.howbuy.com  
11)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路公园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:吴昊飞  
客户服务电话:400—820—5369  
网址:www.jiyufund.com.cn  
12)上海利得基金销售有限公司  
注册地址:上海市虹口区临川路9475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:陈夜明  
客户服务电话:056733  
网址:www.leadfund.com.cn  
13)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:陈洁瑜  
客户服务电话:400—821—9031  
网址:www.lu.com  
14)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  
15)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.52fund.com.cn  
16)深圳众基金销售有限公司  
注册地址:深圳市福田区景田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物资控股置地大厦8楼801  
法定代表人:薛峰  
联系人:邓爱琳  
客户服务电话:4006—788—887  
网址:www.zfundcn、www.jmmw.com  
17)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  
18)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:黄敏娥  
客户服务电话:020—89620066  
网址:www.yingmi.cn  
基金管理人应根据有关法律法规要求,根据实际,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告。

(二) 登记机构  
名称:鹏华基金管理有限公司  
住所:深圳市南山区海德三路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43 层  
联系电话:(0755) 82021777  
传真:(0755) 82021165  
负责人:范伟强  
(三) 律师事务所  
名称:广东嘉盛律师事务所律师  
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、陶泽飞  
(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号展银大厦6楼C  
法定代表人:李丹  
办公地址:上海市湖滨路202号领展企业广场2座普华永道中111楼  
联系电话:(021) 22328888  
传真:(021) 22328800  
联系人:魏佳亮  
经办会计师:许康祺、陈嘉

四、基金的名称

本基金名称:鹏华丰饶定期开放债券型证券投资基金

五、基金的运作方式与类型

契约型

本基金以定期开放的方式运作,即本基金以运作周期(包含4个封闭期和3个受限开放期)和自由开放期的方式运作。

本基金以1年为一个运作周期,每个运作周期为自基金合同生效日(含)或每个自由开放结束之日起日(含)至下一开放日的前一日止。

在每个运作周期结束后进入自由开放期。本基金每个自由开放期一般为5到20个工作日。自由开放期的具体期间由基金管理人在上一个运作周期结束前公告说明。在自由开放期间本基金采取开放运作模式,投资人可办理基金份额申购、赎回或其他业务。

本基金的每个运作周期以封闭期和受限开放期相交替的方式运作,共包含为4个封闭期和3个受限开放期。

在首个运作周期中,本基金的受限开放期为自本基金合同生效日的每季度末的对应日、在第二个及以后的运作周期中,本基金的受限开放期为该运作周期首日的每季度的对应日。本基金的每个受限开放期为1个工作日。

在每个受限开放期,本基金将对净赎回数量或净申购数量进行控制,确保净赎回数量或净申购数量占该受限期前一日基金份额总数的比例不超过特定比例,且该特定比例的数量将在基金发售前或在自由开放期前通过指定媒介公告。如净赎回数量或净申购数量占比超过特定比例,基金管理人将进行比例确认。

在每个运作周期内,除受限开放期以外,均为封闭期。在封闭期内,本基金不接受基金份额的申购和赎回。

如封闭期或运作周期结束之后第一个工作日因不可抗力或其他情形致使基金无法按约开放申购与赎回业务的,开放期(含自由开放期和受限开放期,下同)自不可抗力或其他情形的影响因素消除之日起的下一个工作日开始。开放期内因发生不可抗力或其他情形而导致本基金暂停申购与赎回业务的,开放期将按因不可抗力或其他情形而暂停申购与赎回的期间相应延长。

在本基金第一个运作周期内,上述特定比例设定为15%,即本基金在受限开放期将对当日的净赎回数量或净申购数量进行控制,确保净赎回数量或净申购数量占该受限开放期前一日基金份额总数的比例不超过15%,适用于第二个运作周期的特定比例数值将在第一个自由开放期开始前在指定媒介进行公告,以此类推。

例如,假设本基金基金合同于2016年8月31日生效,因2016年8月31日后的对应日为2017年8月31日,则本基金第一个运作周期为2016年8月31日至2017年8月30日,其中受限开放期分别为2016年12月1日、2017年3月1日、2017年5月31日。在以上每个受限开放期,投资者可提出基金份额的申购、赎回申请,在此期间投资者可以办理本基金的申购、赎回业务。自2017年9月28日起进入本基金下一个运作周期,以此类推。

六、基金的投资目标

在有效控制风险的基础上,通过封闭期和开放期相结合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。

七、基金的投资范围

本基金的投资范围主要为依法发行的固定收益类品种,包括国内依法发行交易的国债、金融债、企业债、央行票据、地方政府债、中期票据、短期融资券、可转换债券(含分离交易可转债)、资产支持证券、中小企业私募债、次级债、债券回购、银行存款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)。本基金不直接参与二级市场买入股票、权证等权益类金融工具,也不参与一级市场的新股申购或增发新股,因所持可转换公司债券转股形成的股票,因投资于分离交易可转债而产生的权证,在其可上市交易后不超过10个交易日的时间内卖出。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人可在履行适当程序后,将其纳入本基金投资范围。

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%,在每个受限开放期的前10个工作日和后10个工作日、自由开放期的前3个月和后3个月以及开放期间内不受前述投资组合比例的限制。本基金在封闭期内持有现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不受限制,但在开放期末本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券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。

八、基金的投资策略

本基金债券投资将主要采取久期策略,同时辅之以债券类别配置策略、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,在有效控制风险的基础上,通过每年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.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:战略性配置和技术性配置。“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来制定组合的目标久期。“目标久期”的技术性配置由基金经理根据市场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涨带来的收益;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。

2.债券类别配置策略

本基金以等权税后息差配置为基础,以历史价格关系的数量分析为依据,同时兼顾特定类型的基金基本面分析参数不同债券板块之间的相对价值,决定债券资产在类别间的配置,并根据市场变化及进行调整,从而选择既能匹配目标久期、同时又能获得较高持有期收益的债券类别配置比例。

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中长、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有较大幅度的下滑,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。

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。

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,与中小企业私募债承销商紧密合作,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。

九、基金的业绩比较基准

一年定期存款税后利率+0.5%。

一年定期存款利率是中国人民银行制定的货币利率之一,反映了居民闲置资金在银行存入一年定期存款所能获得的年收益率,扣除利率税后为实际可得收益。该利率可反映本基金目标客户群体风险收益偏好且期限与本基金运作周期一致,可以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基准的指数时,本基金管理人经基金托管人同意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,但不需要召集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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年7月15日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合等内容,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。

本报告期间自2019年4月1日起至2019年6月30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	-	-
2	买入返售	-	-
3	基金投资	20,397,000.00	12.11
4	债券投资	29,196,000.00	60.63
5	应收利息	226,151,520.00	95.19
6	资产支持证券	-	-
7	持有待售金融资产	-	-
8	其他资产	4,015,120.00	2.03
9	负债	5,173,399.77	2.18
10	合计	227,491,191.13	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和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	国债投资	10,397,000.00	62.0
2	央行票据	-	-
3	金融债投资	20,396,000.00	12.11
4	企业债投资	29,196,000.00	60.63
5	可转债和分离债	-	-
6	中期票据	112,397,000.00	60.69
7	可转换(可分离)	4,015,120.00	2.03
8	其他债	-	-
9	合计	226,151,520.00	130.53

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	180810	18国债10	200,000	20,396,000.00	12.11
2	101700103	17国债03	100,000	10,086,000.00	6.38
3	101801006	18国债06	100,000	10,517,000.00	6.27
4	180804	18国债04	100,000	10,397,000.00	6.25
5	180809	18国债09	100,000	10,311,000.00	6.15

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

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

注: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

注: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生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选择库。

(3) 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	7,513.50
2	应收利息	-
3	应收股利	-
4	其他应收款	5,395,889.27
5	预收账款	-
6	其他应付款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,173,399.77

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	113011	光大转债	3,252,000.00	1.94

(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、基金的费用

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,投资者在做出

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

中所列财务数据未经审计):

	净值增长 率(%)	净值增长 率标准差(%)	业绩比较 基准(%)	业绩比较 基准标准差(%)	1-3	2-4
2016年01月04日至2016年12月31日(基金合同生效日至2016年12月31日)	-1.70%	0.17%	0.71%	0.01%	-2.41%	0.16%
2017年01月01日至2017年12月31日	-0.20%	0.00%	2.00%	0.01%	-2.20%	0.01%
2018年01月01日至2018年12月31日	7.24%	0.09%	2.00%	0.01%	5.24%	0.08%
2019年01月01日至2019年06月30日	2.60%	0.00%	0.00%	0.01%	1.67%	0.01%
自基金合同生效日至2019年06月30日	6.10%	0.09%	5.70%	0.01%	2.40%	0.08%

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事务所、律师事务所和诉讼费;

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、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0.7%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H= E×0.7%÷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,由托管人根据与管理人核对一致的财务数据,自动在月初个工作日内,按照指定的划款路径进行资金支付,管理人无需再出具资金划拨指令。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×0.2%÷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,由托管人根据与管理人核对一致的财务数据,自动在月初个工作日内,按照指定的划款路径进行资金支付,管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

上述“一、基金费用”种类中第3—7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

本基金对通过直销柜台申购的养老金客户与除此之外的其他投资者实施差别的申购费率。

养老金客户指基本养老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金等,包括全国社会保障基金、可以投资基金的地方社会保障基金、企业年金—计划以及集合计划。如将来出现经养老金基金监管部门认可的新的养老金基金类型,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者。

通过基金管理人直销柜台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)	一般申购费率	特定申购费率
M<100万	0.6%	0.58%
100万≤M<500万	0.2%	0.059%
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:

持有期限	赎回费率
持有期限少于7日(7日以内)	1.5%
持有期限少于7日(7日以内)且持有期间未发生赎回赎回费全额计入基金财产;持有期限在7日以上(含7日)赎回费计入基金财产	0.5%
持有期限少于30日(30日以内)	0.3%
持有期限在30日以上(含30日)	0%

赎回费用在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%归入基金财产。

(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。

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、在“第三部分 基金管理人”部分内容进行了更新。

## 鹏华成长价值混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告

公告发出日期:2020年08月14日

1公告基本信息		
基金名称	鹏华成长价值混合型证券投资基金	
基金简称	鹏华成长混合	
基金代码	000900	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日期	2009年05月04日	
基金管理人名称	鹏华基金管理有限公司	
基金托管人名称	中国建设银行股份有限公司	
基金份额登记机构名称	鹏华基金管理有限公司	
公告依据	《鹏华成长价值混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)、《鹏华基金管理有限公司开放式基金业务规则》(以下简称“业务规则”)	
申购赎回日期	2020年08月17日	
申购赎回开放时间	2020年08月17日	
申购赎回截止时间	2020年08月17日	
定期定额投资起始日期	2020年08月17日	
定期定额投资最低金额	鹏华成长混合基金A	鹏华成长混合基金C
定期定额投资最低金额	100元	100元
投资者申购费率	见招募说明书	见招募说明书
定期定额投资		

2 日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务的办理时间

鹏华成长价值混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)自2020年08月17日

起(含当日)开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务。

3 申购业务

3.1 申购金额限制