

(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:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
法定代表人:王珂
联系人:于扬
客户服务电话:400-920-0022
网址:icaike.hexun.com
7)蚂蚁(杭州)基金销售有限公司
注册地址:杭州市滨江区阡前街道文一西路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:韩爱铭
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.snnjfund.com
9)诺亚正行基金销售有限公司
注册地址:上海市浦东区飞虹路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:上海市徐汇区徐家汇路196号2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:王诗均
客户服务电话:400-700-9665
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1603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
12)上海利得基金销售有限公司
注册地址:上海市徐汇区肇嘉浜路645号7033室
办公地址:上海市浦东新区峨山路01弄61号16楼嘴软件园10号楼12楼
法定代表人:李春兴
联系人:陈孜明
客户服务电话:95733
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:陈铭洲
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190号3C10座801
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)上海广发基金销售有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区福山路33号11号楼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:王延富
联系人:徐丹丹
客户服务电话:400-799-1888
网址:www.520fund.com.cn
16)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:邓舜舜
客户服务电话:4006-788-887
网址:www.czfund.com、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:杭州市萧山区市北高教街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:4008777772
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106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:肖斐
联系人:黄敏
客户服务电话:020-88062906
网址:www.yingmi.com
基金管理人可根据有关法律法规要求,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:何丽
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)82021877
传真:(0755)82021165
负责人:范伟强
(三) 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:闵齐芳
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:0755-33030396
联系人:闵齐芳
经办律师:闵齐双、鲍泽飞
(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号星展银行大厦6楼
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座普华永道中心11楼
联系电话:(021)2328888
传真:(021)23238900
联系人:魏佳亮
经办会计师:许琳琪、陈熹
(五) 基金的名称
本基金的名称: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)和自由开放期相结合的方式运作。
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)或每个自由开放期结束之日次日(含)至后一个对应的日期的前一天止。
在每个运作周期结束后进入自由开放期。本基金的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。
在首个运作周期内,本基金的受让开放期为本基金合同生效后的每季度的对应日。在第二个以及以后的运作周期内,本基金的受限开放期为该运作周期内的每季度的对应日。本基金的每个受限开放期为1个工作日。
在每个受限开放期内,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开放期内一日基金份额总数的比例不超过特定比例,该特定比例不超过15%(含),且该特定比例的数值将在基金生效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使本基金无法按时开放申购与赎回业务的,开放期(含自开放首日和受限开放首日,下同)自不可抗力或其他情形的影响因素消除之日起的第一个工作日开始。开放期内因发生不可抗力或其他情形而发生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。

在本基金的第一个运作周期内,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赎回回款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上述比例数值将在第一个自开放首日开始在指定媒介进行公告,以此类推。

例:假设本基金合同于2016年8月31日生效,因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。在以每一个受限开放期,投资者可提出基金份额的申购、赎回申请,本基金将对当日起的赎回回款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在15%内。

本基金的首个运作周期结束后进入首个自由开放期,若基金首次自由开放期确定为20个工作日内,则自2017年8月31日至2017年9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。在以每一个受限开放期,投资者可提出基金份额的申购、赎回申请,本基金将对当日起的赎回回款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在15%内。

本基金的首个运作周期结束后进入首个自由开放期,若基金首次自由开放期确定为20个工作日内,则自2017年8月31日起至2017年9月27日的二十个工作日内为本基金的首个自由开放期,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产品,包括国内依法发行交易的国债、金融债、企业公司债、央行票据、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有关规定)。本基金不直接从二级市场买入股票、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。

如果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%,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者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括备用保证金、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,同时辅以债券类属配置策略、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,以实现对组合利差风险的有效控制。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及资本市场的宏观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选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.债券类属配置策略

本基金以等价税后收益为基础,以历史价格关系的数量分析为依据,同时兼顾特定期限的基本分析考察不同债券板块之间的相对价值,决定债券资产在类属间的配置,并根据市场变化及时进行调整,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属配置比例。

3.收益率曲线策略

收益率曲线形状的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期券种的搭配。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,在可选的区间内长期限位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,从而获得较高的资金收益;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货币,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、选择条款、票面特征等因素,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,合理合规地进行中小企业私募债券投资。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.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、选择条款、票面特征等因素,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。

9.基金的业绩比较基准

一年期定期存款后利率+0.5%。

一年期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率。该利率可反映本基金目标客户群体风险偏好且期限与本基金运作周期一致,可以为本基金的业绩比较基准。

如果今后法律法规发生变化,或者更有权威的、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量时,本基金管理人协商基金托管人后可以在报中国证监会备案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。

10.基金的风险收益特征

本基金属于债券型基金,其预期的收益和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产品。

十一、基金的投资组合报告

基金管理人的董事会及董事声明本基金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。

本报告中财务数据未经审计。

十二、基金的费用

投资人申购、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管理日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告

公告送出日期:2020年08月14日

鹏华基金管理有限公司 2020年8月6日

序号	债券代码	债券名称	面值(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	102210	国债附息10期	100,000	20,316,000.00	12.11%
2	10175010	Y01国债	100,000	10,696,000.00	6.28%
3	101001006	10大足银行债	100,000	10,517,000.00	6.27%
4	100204	10日通新债	100,000	10,397,000.00	6.20%
5	101000605	10日通新债	100,000	10,311,000.00	6.18%

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.报告期末未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	银行存款	7,513,000
2	货币市场基金	—
3	债券回购	—
4	应收利息	—
5	应收股利	5,165,000.27
6	应交税费	—
7	其他应收款	—
8</		