鹏华丰润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:中国建设银行股份有限公司
二○一一年七月

重要提示

鹏华丰润债券型证券投资基金(以下简称本基金)经2010年10月11日中国证券监督管理委员会《关于核准鹏华丰润债券型证券投资基金募集的批复》(证监许可1378号文)核准,进行募集,并经中国证监会基金部2010年12月02日基金部函[2010]718号文件《关于鹏华丰润债券型证券投资基金备案确认的函》确认合法备案。根据相关法律法规,本基金基金合同已于2010年12月2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。

本摘要根据本基金的基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

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: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。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和基金合同,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。

本招募说明书所载内容截止日为2011年6月1日,有关财务数据和净值表现截止日为2011年3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:0755-82021102　传真:0755-82021155
7、联系人:罗娜
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。

胡继之先生,董事,金融学博士,高级经济师,国籍:中国。历任中国人民银行武汉市分行办公室科长、金融研究所副所长、所长,中国人民银行深圳分行办公室负责人,深圳证券交易所总经理助理兼办公室主任、理事会秘书长、策划总监、纪委书记、党委委员、副总经理,现任国信证券股份有限公司总裁、党委副书记。

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,现任国信证券股份有限公司副总裁。

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、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,现任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,同时兼任欧利盛AI资产管理股份公司(Eurizon AI SGR)首席执行官。

Alessandro Varaldo先生,董事,经济学和商业管理博士,国籍:意大利。曾任米兰德意志银行集团Finanza e Futuro Fondi Sprind股份公司投资管理部债券基金和现金头寸管理高级经理,IMI Fideuram资产管理股份公司投资管理部固定收益组合和现金管理业务负责人,圣保罗银行投资公司(Banca Sanpaolo Invest S.p.A.)财务及营销策划部负责人,Capitalia股份公司(Capitalia S.p.A.)产品和销售部负责人,Capitalia投资管理股份公司(Capitalia Investment Management S.A.)董事总经理,Unicredit Holding财务风险管理部意大利企业法人风险管理业务负责人,欧利盛资本资产管理股份公司(Eurizon Capital SGR S.p.A)首席市场官、欧利盛资本股份公司(Eurizon Capital S.A.)(卢森堡)董事,现任意大利联合圣保罗银行股份有限公司(Intesa Sanpaolo S.p.A.)储蓄、投资和养老金产品部负责人。

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、北京市人民政府顾问。

李相启先生,独立董事,高级经济师、研究员,国籍:中国。历任陕西省委办公厅秘书、省委政策研究室财贸处处长、副主任,陕西省经济体制改革委员会副书记、副主任、党组书记、主任,陕西省证券监管委员会主席,中国证监会济南证管办党委书记、主任、济南稽查局局长,山东证监局局长,上海证券交易所理事会理事、产品委员会主任。

宋泓先生,独立董事,经济学博士,国籍:中国。曾在美国哥伦比亚大学作访问学者,并在陕西省社科院工作,现任中国社会科学院世界经济与政治研究所国际贸易研究室主任、研究员、教授、博士生导师。

张新民先生,独立董事,管理学博士,会计学教授,博士生导师,国籍:中国。现任对外经济贸易大学副校长兼国际商学院院长,国务院特殊津贴专家,全国MBA教育指导委员会委员,英国特许公认会计师(FCCA),澳洲注册会计师(FCPA)。

2、基金管理人监事会成员

孙枫先生,监事会主席,国际金融专业硕士,高级会计师,中国注册会计师,国籍:中国。历任武汉市经济研究所副所长,武汉市轻工业局副局长,武汉友谊复印机制造公司副经理,深圳市财政局企财处处长、办公室主任、副局长,深圳市商业银行董事长、党委书记,深圳发展银行董事长、党委书记,鹏华基金管理有限公司董事长、党总支书记,现任鹏华基金管理有限公司监事会主席。

Andrea Vismara先生,监事,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,现在欧利盛资本资产管理股份公司运营部工作。

黄俞先生,监事,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,现任深圳市北融信投资发展有限公司董事长。

高鹏先生,职工监事,经济学硕士,国籍:中国。曾任博时基金管理有限公司监察法律部监察稽核经理,现任鹏华基金管理有限公司监察稽核部总经理。

刘慧红女士,职工监事,本科学历,国籍:中国。曾在中国工商银行深圳分行、平安证券公司工作,1998年12月加盟鹏华基金管理有限公司,现任鹏华基金管理有限公司登记结算部副总经理。

3、高级管理人员情况

何如先生,同上。

邓召明先生,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,现任鹏华基金管理有限公司总裁、党总支书记。

高阳先生,副总裁,经济学硕士,十年证券从业经验,CFA,国籍:中国。历任中国国际金融有限公司债券投资经理,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副总裁。

曹毅先生,副总裁,经济学博士,国籍:中国。历任中国人民银行广州分行科员,中国人民银行深圳中心支行副主任科员,南方基金管理有限公司市场拓展部副总监、渠道部总监,现任鹏华基金管理有限公司副总裁。

胡湘先生,副总裁,经济学硕士,国籍:中国。历任全国社会保障基金理事会投资部、境外投资部副主任科员、主任科员、副处长,鹏华基金管理有限公司总裁助理,现任鹏华基金管理有限公司副总裁。

吴伟先生,督察长,法学博士,国籍:中国。曾任中国建设银行深圳市分行法律部副科长。2001年3月加盟鹏华基金管理有限公司,历任公司法律顾问、社保基金独立稽察员、监察稽核部总监,现任公司督察长。

4、本基金基金经理

阳先伟先生,经济学硕士,9年证券从业经验,先后在民生证券、国海证券等机构从事债券研究及投资组合管理工作,历任研究员、高级经理等职务。2004年9月加盟鹏华基金管理有限公司,从事债券及宏观研究工作,曾任普天债券开放式证券投资基金基金经理助理,2006年12月起至今担任普天债券基金基金经理,2008年5月起至今兼任鹏华丰收债券型证券投资基金基金经理,2010年12月起兼任鹏华丰润债券型证券投资基金基金经理。阳先伟先生具备基金从业资格。

本报告期内本基金基金经理未发生变更。

本基金基金经理管理其它基金情况:

阳先伟先生于2006年12月起至今担任鹏华普天债券开放式证券投资基金基金经理。2008年5月起至今兼任鹏华丰收债券型证券投资基金基金经理,2010年12月起兼任鹏华丰润债券型证券投资基金基金经理。

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总裁、党总支书记。
高阳先生,鹏华基金管理有限公司副总裁。
冀洪涛先生,鹏华基金管理有限公司研究部总经理、鹏华普惠基金基金经理。
程世杰先生,鹏华基金管理有限公司基金管理部总经理,鹏华价值优势基金基金经理。
初冬女士,鹏华基金管理有限公司固定收益部总经理,鹏华社保基金理财经理及鹏华货币市场基金经理。
杨俊先生,鹏华基金管理有限公司机构投资部总经理,社保基金理财经理。
黄鑫先生,鹏华动力增长混合型证券投资基金(LOF)基金经理。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

7、上述为本更新招募说明书所载内容截止日(2011年6月1日)前基金管理人主要人员情况。截止日后,上述人员若有变更,请以基金管理人届时发布的公告为准。

二、基金托管人

(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:郭树清
成立时间:2004年09月17日
组织形式:股份有限公司
注册资本:贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元
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:尹　东
联系电话:(010)6759 5003

中国建设银行股份有限公司拥有悠久的经营历史,其前身“中国人民建设银行”于1954年成立,1996年易名为“中国建设银行”。中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于2004年9月分立而成立,承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行(股票代码:939)于2005年10月27日在香港联合交易所主板上市,是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006年9月11日,中国建设银行又作为第一家H股公司晋身恒生指数。2007年9月25日中国建设银行A股在上海证券交易所上市并开始交易。A股发行后中国建设银行的已发行股份总数为:250,010,977,486股(包括240,417,319,880股H股及9,593,657,606股A股)。

截至2010年12月31日,中国建设银行实现净利润1350.31亿元,较上年同期增长26.39%。手续费及佣金净收入661.32亿元,较上年同期增长37.61%。年化平均资产回报率为1.32%,年化加权平均净资产收益率为22.61%;净利息收益率为2.49%。信贷资产质量继续稳定向好,不良贷款较上年末实现“双降”,拨备覆盖率大幅提高至221.14%。

中国建设银行在中国内地设有1.3万余个分支机构,并在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京、首尔、纽约、胡志明市及悉尼设有分行,在莫斯科设有代表处,设立了湖北桃江建信村镇银行、浙江苍南建信村镇银行、安徽繁昌建信村镇银行、浙江青田建信华侨村镇银行、浙江武义建信村镇银行、陕西安塞建信村镇银行、河北丰宁建信村镇银行、上海浦东建信村镇银行、苏州常熟建信村镇银行9家村镇银行,拥有建行亚洲、建银国际、建行伦敦、建信基金、建信金融租赁、建信信托、中德住房储蓄银行等多家子公司。全行已安装运行自动柜员机(ATM)39,874台,拥有员工313,867人,为客户提供全面的金融服务。

中国建设银行得到市场和业界的支持和广泛认可,2010年共获得100多个国内外奖项。本集团在英国《银行家》杂志公布的“全球商业银行品牌十强”列第二位,在“全球银行品牌500强”列第13位,并被评委2010年中国最佳银行;在美国《福布斯》杂志公布的“Interbrand2010年度最佳中国品牌价值排行榜”列第三位,银行业第一位;被《亚洲金融》杂志评为2010年度“中国最佳银行”;连续三年被香港《资本》杂志评为“中国杰出零售银行”;被中国红十字会总会授予“中国红十字杰出奉献奖章”。

中国建设银行总行设投资托管服务部,下设综合制度处、基金市场处、资产托管处、QFII托管处、基金核算处、基金清算处、监督稽核处和投资托管团队、涉外资产核算团队、养老金托管服务团队、养老金托管市场团队、上海备份中心等12个职能处室、团队,现有员工130余人。自2008年以来中国建设银行托管业务持续通过SAS70审计,并已经成为常规化的内控工作手段。

(二)主要人员情况

杨新丰,投资托管服务部副总经理(主持工作),曾就职于中国建设银行江苏省分行、广东省分行、中国建设银行总行会计部、营运管理部,长期从事计划财务、会计结算、营运管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟,投资托管服务部副总经理,曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部,长期从事大客户的客户管理及服务工作,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、QFII、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2011年3月31日,中国建设银行已托管189只证券投资基金。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。2010年初,中国建设银行被总部设于英国伦敦的《全球托管人》杂志评为2009年度“国内最佳托管银行”(Domestic Top Rated),并连续第三年被香港《财资》杂志评为“中国最佳次托管银行”。

三、相关服务机构

(一)基金份额发售机构

1、场外发售机构

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
电话:(0755)82021102
传真:(0755)82021155
联系人:罗娜

(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
电话:(010)88082426
传真:(010)88082018
联系人:赵晓蔚

(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801B室
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4312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:蔡颖

2)代销机构:

(1)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:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人:郭树清
电话:010-66275654
传真:010-66275654
联系人:王琳
客户服务电话:95533
网址:www.ccb.com

(2)中国工商银行股份有限公司
住所:北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址:北京市西城区复兴门内大街55号
法定代表人:姜建清
电话:010-66107900
传真:010-66107914
联系人:王佺
客户服务电话:95588
网址:www.icbc.com.cn

(3)中国农业银行股份有限公司
注册(办公)地址:北京市东城区建国门内大街69号
法定代表人:项俊波
客户服务电话:95599
联系人:张令玮
网址:www.95599.cn

(4)中国银行股份有限公司
注册地址:北京市复兴门内大街1号
办公地址:北京市复兴门内大街1号
法定代表人:肖钢
联系人:侯燕鹏
统一客户服务电话:95566
公司网站:www.boc.cn

(5)交通银行股份有限公司
注册(办公)地址:上海市浦东新区银城中路188号
法定代表人:胡怀邦
电话:021-58781234
传真:021-58408483
联系人:曹榕
客户服务电话:95559
网址:www.bankcomm.com

(6)招商银行股份有限公司
注册(办公)地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
法定代表人:秦晓
电话:0755-83195475
传真:0755-83195049
联系人:邓炯鹏
客服电话:95555
网址:www.cmbchina.com

(7)深圳发展银行股份有限公司
注册(办公)地址:深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦
法定代表人:肖遂宁
联系人:张青
电话:0755-82088888
传真:0755-82080406
客服电话:95501
网址:www.sdb.com.cn

(8)平安银行股份有限公司
注册(办公)地址:深圳市深南中路1099号平安银行大厦
法定代表人:孙建一
联系人:蔡宇洲
电话:0755-25859591
客服电话:40066-99999或(0755)961202
网址:www. pingan.com

(9)中信银行股份有限公司
注册(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:孔丹
客服电话:95558
联系人:丰靖
电话:010-65550827
传真:010-65550827
网址:http://bank.ecitic.com

(10)北京银行股份有限公司
注册(办公)地址:北京市西城区金融大街丙17号
法定代表人:阎冰竹
电话:010-66226044、66223251
传真:010-66226045、66226047
客服电话:010-96169
网址:www.bankofbeijing.com.cn

(11)宁波银行股份有限公司
注册(办公)地址:宁波市江东区中山东路294号
法定代表人:陆华裕
电话:021-63586210
传真:021-63586215
联系人:胡技勋
客户服务电话:96528(上海地区962528)
网址:www.nbcb.com.cn

(12)东莞银行股份有限公司
注册(办公)地址:东莞市运河东一路193号
法定代表人:廖玉林
联系人:胡昱
客户服务电话:96228
网址:www.dongguanbank.cn

(13)杭州银行股份有限公司
地址:杭州市庆春路46号杭州银行大厦
法定代表人:马时雍
联系人:严俊
客户服务电话:0571-96523,4008888508
网址:www.hzbank.com.cn

(14)上海浦东发展银行股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区浦东南路500号
办公地址:上海市中山东一路12号
法定代表人:吉晓辉
电话:021-61618888
传真:021-63604199
联系人:徐伟、虞谷云
客户服务热线:95528
公司网站:www.spdb.com.cn

(15)华夏银行股份有限公司
注册地址:北京市东城区建国门内大街22号
办公地址:北京市东城区建国门内大街22号
法定代表人:吴建
联系人:郑鹏
电话:010-85238667
传真:010-85238680
客服电话:95577
网址:www.hxb.com.cn

(16)国信证券股份有限公司
住所:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16-26层
法定代表人:何如
联系电话:(0755)82133066
传真:(0755)82133302
联系人:齐晓燕
客户服务电话:800-810-8868
网址:www.guosen.com.cn

(17)华泰联合证券有限责任公司
住所:深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦10、24、25层
办公地址:深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦10、24、25层
法定代表人:马昭明
联系电话:(0755)82492193
传真:(0755)82492962
联系人:庞晓芸
公司网址:www.lhzq.com

(18)招商证券股份有限公司
住所:深圳市福田区益田路江苏大厦A座39—45层
办公地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座40层
法定代表人:宫少林
电话:0755-82943511
传真:0755-82943237
联系人:林生迎
客户服务电话:4008888111、0755-26951111
网址:www.newone.com

(19)中国银河证券股份有限公司
住所:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
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:顾伟国
联系电话:010-66568047
传真:010-66568532
联系人:李洋
网址:www.chinastock.com.cn

(20)光大证券股份有限公司
住所: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:徐浩明
电话:(021)22169081
传真:(021)68817271
客服电话:(021)68823685
联系人:李芳芳
公司网站:www.ebscn.com

(21)东莞证券有限责任公司
住所:广东省东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼
办公地址:广东省东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼
法定代表人:张运勇
联系人:张巧玲
电话:(0769)22119426
公司网址:www.dgzq.com.cn

(22)安信证券股份有限公司
住所:深圳市福田区金田路2222号安联大厦34层、28层A02单元
办公地址:深圳市福田区金田路2222号安联大厦34层、28层A02单元
法定代表人:牛冠兴
电话:0755- 82558323
传真:0755-23982898
联系人:余江
咨询电话:0755-82825555
公司网址:www.axzq.com.cn

(23)广州证券有限责任公司
注册地址:广东省广州市先烈中路69号东山广场主楼5楼
办公地址:广东省广州市先烈中路69号东山广场主楼5楼
法定代表人:吴志明
联系人:林洁茹
联系电话:020-87322668-347
网址:www.gzs.com.cn

(24)齐鲁证券有限公司
住所:山东省济南市经七路128号
办公地址:山东省济南市经七路128号
法定代表人:李玮
电话:(0531)81283906
联系人:王霖
客户服务电话:(0531)82024184
网址:www.qlzq.com.cn

(25)财富证券有限责任公司
住所:长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26层
地址:长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26层
法定代表人:周晖
电话:(0731)4403343
传真:(0731)4403439
联系人:郭磊
客户服务热线:(0731)4403343
网址:www.cfzq.com

(26)方正证券有限责任公司
注册地址:湖南长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层
公司地址:湖南长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层
法定代表人:雷杰
联系人:邵艳霞
联系电话:0571-5832343
客服电话:95571
网址:www.sunsc.com.cn

(27)财通证券有限责任公司
住所:杭州市解放路111号
办公地址:杭州市解放路111号
法定代表人:沈继宁
电话:(0571)87925129
传真:(0571)87828033
联系人:乔骏
客服电话:(0571)87828018
公司网址:www.goodyou.com.cn

(28)申银万国证券股份有限公司
住所:上海市常熟路171号
办公地址:上海市常熟路171号
法定代表人:丁国荣
联系电话:021- 54047892
联 系 人:曹晔
客户服务电话:021-962505
公司网址:www.sw2000.com.cn

(29)长城证券有限责任公司
住所:深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
办公地址:深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
法定代表人:黄耀华
联系电话:0755- 83516289
联系人:匡婷
网址:www.cc168.com.cn

(30)华泰证券股份有限公司
住所:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
办公地址:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
法定代表人:吴万善
电话:(025)84457777-950
联系人:舒萌菲
网址:www.htsc.com.cn

(31)海通证券股份有限公司
住所:上海市唐山路218号
办公地址:上海市淮海中路98号
法定代表人:王开国
电话:(021)23219000
联系人:李笑鸣
客户服务电话:021-962503
网址:www.htsec.com

(32)湘财证券有限责任公司
住所:湖南省长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼
办公地址:湖南省长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼
法定代表人:林俊波
电话:021-68634518
传真:021-68865680
联系人:鲁雁先
客户服务电话:400-888-1551
网址:www.xcsc.com

(33)中信建投证券有限责任公司
住所:北京市朝阳区安立路66号4号楼
法定代表人:张佑君
办公地址:北京市朝阳门内大街188号
联系电话:(010)85130577
传真:(010)65182261
联系人:权唐
客户服务电话:400-8888-108(免长途费)
网址:www.csc108.com

(34)渤海证券有限责任公司
住所:天津市经济技术开发区第一大街29号
法定代表人:王春峰
地址:天津市河西区宾水道3号
联系人:王兆权
电话:(022)28455588
传真:(022)28451892

(35)华林证券有限责任公司
注册地址:广东省珠海市拱北夏湾华平路96号二层202-203房
公司地址:深圳市福田区民田路178号华融大厦6楼
法定代表人:段文清
联系电话:0755-82707888
传真:0755-82707700
联系人:杨玲
网址:www.chinalions.com

(36)东北证券股份有限公司
住所:长春市人民大街138-1号
办公地址:长春市自由大路1138号
法定代表人:矫正中
联系电话:0431- 85096709
传真:0431-5680032
联系人:潘锴
网址:www.nesc.cn

(37)上海证券有限责任公司
住所:上海市九江路111号
办公地址:上海市黄浦区西藏中路336号
法定代表人:郁忠民
联系电话:021- 62470157
传真:021-65081434
联系人:黄枫
客服热线:800-6200-071
公司网站:www.962518.com

(38)宏源证券股份有限公司
住所:新疆乌鲁木齐市文艺路233号
办公地址:北京市海淀区西直门北大街甲43号金运大厦B座6层
法定代表人:冯戎
联系人:李巍
电话:010- 62294608-6240
咨询电话:010-62267799-6789
网址:www.ehongyuan.com.cn

(39)国泰君安证券股份有限公司
住所:上海市浦东新区商城路618号
办公地址:上海市延平路135号
法定代表人:祝幼一
客户服务电话:(021)962588、800-820-6888
传真:(021)62583439
联系人:芮敏祺
联系电话:021-62580818-213
网址:www.gtja.com

(40)广发证券股份有限公司
住所:广东省珠海市吉大海滨路广大国际贸易中心26楼2611室
办公地址:广州市天河北路183号大都会广场36、38、41、42楼
法定代表人:王志伟
电话:(020)87555888
传真:(020)87557985
联系人:黄岚
网址:www.gf.com.cn

(41)兴业证券股份有限公司
住所:福州市湖东路99号标力大厦
法定代表人:兰荣
办公地址:上海市浦东陆家嘴东路166号中保大厦19楼
电话:(021)38565775
传真:(021)68419867
联系人:杨盛芳
客户服务电话:021-68419125
网址:www.xyzq.com.cn

(42)江海证券有限公司
住所:哈尔滨市香坊区赣水路56号
办公地址:哈尔滨市香坊区赣水路56号
法定代表人:孙名扬
联系人:徐世旺
联系电话:0451-82336863
传真:0451-82269286
客户服务热线:400-666-2288
网址:www.jhzq.com.cn
网址:www.cib.com.cn

(43)华龙证券有限责任公司
注册地址:甘肃省兰州市静宁路308号
办公地址:甘肃省兰州市静宁路308号
法定代表:李晓安
联系人:李昕田
电话:0931-8888088
传真:0931-4890515
服务热线:0931-4890619 4890618 4890100
公司网站:http://www.hlzqgs.com

(44)广发华福证券有限责任公司
注册地址:福州市五四路157号新天地大厦7、8层
办公地址:福州市五四路157号新天地大厦7、8、10层
法定代表:黄金琳
联系人:张腾
电话:0591-87383623
服务热线:96326(福建省外请加拨0591)
公司网站:www.gfhfzq.com.cn

(45)东兴证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层
办公地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层
法定代表:崔海涛
联系人:黄英
电话:010-66555835
服务热线:010-66555262,66555382
公司网站:www.dxzq.net

(46)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号楼信达金融中心
法定代表人:张志刚
联系人:唐静
电话:010-63080985
客服热线:400-800-8899
网址:www.cindasc.com

(47)国联证券股份有限公司
注册地址:无锡市县前东街168号
办公地址:无锡市县前东街168号
法定代表人:雷建辉
电话:0510-82832919
传真:0510-82833124
联系人:袁丽萍
联系电话:4008885288,0510-82588168
网址:www.glsc.com.cn

(48)天相投资顾问有限公司
住所:北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701
办公地址:北京市西城区金融街5号新盛大厦B座4层
法定代表人:林义相
咨询电话:010-66045678
公司网址:www.txsec.com;www.txjijin.com

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代销机构,并及时公告。

2、场内发售机构

具有基金代销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:北京市西城区金融大街27号投资广场23层
办公地址:北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人:金颖
电话:010-59378839
传真:010-59378907
联系人:朱立元

(三)律师事务所

名称:北京市金杜律师事务所
住所:北京市朝阳区东三环中路7号北京财富中心写字楼A座40层
负责人:王玲
办公地址:北京市朝阳区东三环中路7号北京财富中心写字楼 A 座 40层
联系电话:(0755)22163333
传真:(0755)22163390
联系人:宋萍萍
经办律师:靳庆军、宋萍萍

(四)会计师事务所

名称:普华永道中天会计师事务所有限公司
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
办公地址:上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
法定代表人:杨绍信
联系电话:(021)23238888
传真:(021)23238800
联系人:陈熹
经办会计师:薛竞、陈熹

四、基金的名称

鹏华丰润债券型证券投资基金(基金简称:鹏华丰润 基金代码:160617)

五、基金的运作方式和类型

契约型,本基金在基金合同生效后三年内(含三年)封闭运作,在深圳证券交易所上市交易;封闭期结束后转为上市开放式基金(LOF)。

债券型证券投资基金

六、基金的投资目标

在严格控制投资风险的基础上,通过积极的投资策略,力争为基金持有人创造较高的当期收益。

七、基金的投资方向

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,主要投资于固定收益类品种,包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、短期融资券、可转债、分离交易可转债、资产支持证券、债券回购等金融工具以及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具。

本基金也可投资于股票、权证以及法律法规或监管部门允许基金投资的其他权益类金融工具。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,但可以参与一级市场股票首次公开发行或新股增发,并可持有因所持可转换公司债券转股形成的股票、因持有股票被派发的权证、因投资于分离交易可转债而产生的权证。

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。

基金的投资组合比例为:本基金对债券等固定收益类品种的投资比例不低于基金资产的80%;股票等权益类品种的投资比例不超过基金资产的20%;基金转为上市开放式基金(LOF)后,本基金将保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。

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

基金管理人将采取积极的投资策略,寻找各种可能的价值增长机会,力争实现超越基准的投资收益。

(一)投资策略

1、资产配置策略

在大类资产配置方面,本基金通过对宏观经济形势及利率变化趋势的重点分析,结合对股票市场趋势的研判及新股申购收益率的预测,比较未来一定时间内债券市场和股票市场的相对预期收益率,在债券、股票一级市场及现金之间进行动态调整。

2、资产流动性纵向分配策略

鉴于投资人对投资标的流动性需求随时间呈递增分布的规律,本基金在成立后初期将在以最小成本确保合理流动性水平的前提下,适当降低资产组合的流动性水平,争取累积较高的投资收益。当预期投资人对流动性的边际需求上升到一定程度(本基金界定为基金合同生效后三年),本基金将调高投资组合的流动性水平并开放基金的申购、赎回,以优化投资回报及流动性给投资人带来的整体收益。

3、普通债券投资策略

本基金债券投资将采取久期策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、利差策略等积极投资策略,在追求本金长期安全的基础上,力争为投资人创造更高的总回报。

(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它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)利差策略

本基金通过对两个期限相近的债券的利差进行分析,从而对利差水平的未来走势作出判断,进而相应的进行债券置换。影响两期限相近债券的利差水平的因素主要有息票因素、流动性因素及信用评级因素等。当预期利差水平缩小时,买入收益率高的债券同时卖出收益率低的债券,通过两债券利差的缩小获得投资收益;当预期利差水平扩大时,则进行相反的操作。

4、附权债券投资策略

本基金可投资可转债、分离交易可转债或含赎回或回售权的债券等,这类债券赋予债权人或债务人某种期权,比普通的债券更为灵活。

(1)可转债投资策略

可转债具有债权的属性,投资人可以选择持有可转债到期,得到本金与利息收益;也具有期权的属性,可以在规定的时间内将可转债转换成股票,享受股票分红或套现。因此,可转债的价格由债权价格和期权价格两部分组成。

本基金将采用专业的分析和计算方法,综合考虑可转债的久期、票面利率、风险等债券因素以及期权价格,力求选择被市场低估的品种,获得超额收益。

(2)其他附权债券投资策略

本基金在对这类债券基本情况进行研究的同时,将结合市场状况、债券具体条款重点分析附权部分对债券估值的影响。

对于分离交易可转债的债券部分将按照债券投资策略进行管理,权证部分将在可交易之日起不超过3个月的时间内卖出。

5、资产证券化产品投资策略

本基金将深入分析资产支持证券的市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等基本面因素,估计资产违约风险和提前偿付风险,并根据资产证券化的收益结构安排,模拟资产支持证券的本金偿还和利息收益的现金流过程,辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型,评估其内在价值。

6、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,获取股票一级市场与二级市场的价差收益,申购所得的股票在可上市交易或流通受限解除后不超过3个月的时间内卖出。

(二)投资决策依据

1、国家有关法律、法规和基金合同的有关规定;
2、国内国际宏观经济环境、国家货币政策、利率走势及通货膨胀预期、国家产业政策;
3、固定收益市场发展及各类属间利差情况;
4、各行业发展状况、市场波动和风险特征;
5、上市公司研究,包括上市公司成长性的研究和市场走势;
6、证券市场走势。

(三)投资决策流程

1、投资决策委员会:确定本基金总体资产分配和投资策略。投资决策委员会定期召开会议,由公司总经理或指定人员召集。如需做出及时重大决策或基金经理小组提议,可临时召开投资决策委员会会议。

2、基金经理(或管理小组):设计和调整投资组合。设计和调整投资组合需要考虑的基本因素包括:每日基金申购和赎回净现金流量;基金合同的投资限制和比例限制;研究员的投资建议;基金经理的独立判断;绩效与风险评估小组的建议等。

3、集中交易室:基金经理向集中交易室下达投资指令,集中交易室经理收到投资指令后分发予交易员,交易员收到基金投资指令后准确执行。

4、绩效与风险评估小组:对基金投资组合进行评估,向基金经理(或管理小组)提出调整建议。

5、监察稽核部:对投资流程等进行合法合规审核、监督和检查。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:中债综合指数收益率。

中债综合指数由中央国债登记结算有限责任公司编制并发布,该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。中债综合指数的构成品种完全覆盖了本基金的投资范围,反映了债券全市场的整体价格和投资回报情况,适合作为本基金的业绩比较基准。

如果今后证券市场中有其他代表性更强或者更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时,本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则,根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准应经基金托管人同意,并报中国证监会备案。基金管理人应在调整前2个工作日在至少一种指定媒体上予以公告。

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,低于混合型基金及股票型基金,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(未经审计)

本基金管理人的董事会、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的法律责任。

本基金的托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,已于2011年4月20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。

本报告中所列财务数据截至2011年3月31日(未经审计)。

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	固定收益投资	1,689,300,173.10	94.27
	其中:债券	1,689,300,173.10	94.27
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	11,411,847.48	0.64
6	其他资产	91,338,847.45	5.10
7	合计	1,792,050,868.03	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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	114,217,652.00	8.44
2	央行票据	-	-
3	金融债券	464,822,000.00	34.34
	其中:政策性金融债	464,822,000.00	34.34
4	企业债券	1,055,170,260.00	77.94
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	55,090,261.10	4.07
7	其他	-	-
8	合计	1,689,300,173.10	124.79

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	100308	10进出08	2,000,000	195,400,000.00	14.43
2	122033	09富力债	1,800,000	187,830,000.00	13.87
3	1181003	11魏桥CP01	1,000,000	100,320,000.00	7.41
4	100312	10进出12	1,000,000	99,600,000.00	7.36
5	1080151	10北部湾债	1,000,000	98,550,000.00	7.28

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8、投资组合报告附注

(1)报告期内本基金投资的前十名证券中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、处罚的股票。

(2)报告期内本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

(3)其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	18,373.77
2	应收证券清算款	69,989,913.90
3	应收股利	-
4	应收利息	21,330,559.78
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	91,338,847.45

(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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	125709	唐钢转债	18,257,660.00	1.35
2	113001	中行转债	6,423,600.00	0.47

(5)报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

(6)投资组合报告附注的其他文字描述部分

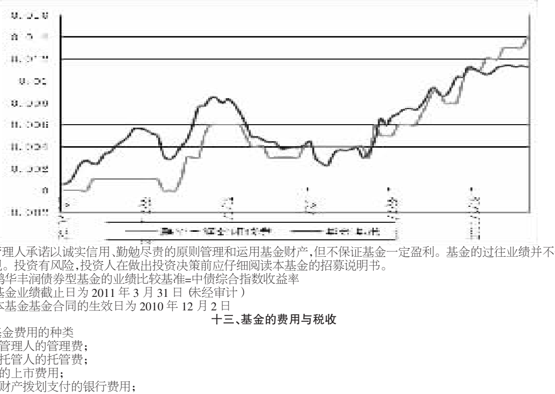
由于四舍五入的原因,投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

十二、基金的业绩

1、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(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
2010年12月2日至2010年12月31日	0.30%	0.06%	0.46%	0.06%	-0.16%	0.00%
2011年1月1日至2011年3月31日	1.10%	0.07%	0.67%	0.06%	0.43%	0.01%
自基金合同生效起至2011年3月31日	1.40%	0.07%	1.13%	0.06%	0.27%	0.01%

2、基金合同生效以来基金份额净值的变动情况,并与同期业绩比较基准的变动进行比较:



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。

注1:鹏华丰润债券型基金的业绩比较基准=中债综合指数收益率
注2:基金业绩截止日为2011年3月31日(未经审计)
注3:本基金基金合同的生效日为2010年12月2日

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.基金的上市费用;
4.基金财产拨划支付的银行费用;
5.基金合同生效后的基金信息披露费用;
6.基金份额持有人大会费用;
7.基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费;
8.基金的证券交易费用;
9.证券账户开户费用和银行账户维护费;
10.依法可以在基金财产中列支的其他费用。

(二)上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定,法律法规另有规定时从其规定。

(三)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

在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的0.6%年费率计提。计算方法如下:

H=E×年管理费率÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起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、休息日,支付日期顺延。

2.基金托管人的托管费

在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的0.2%年费率计提。计算方法如下:

H=E×年托管费率÷当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起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、休息日,支付日期顺延。

3.除管理费和托管费之外的基金费用,由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定,按费用支出金额支付,列入或摊入当期基金费用。

(四)与基金销售有关的费用

1、场外申购、赎回的费用

(1)本基金场外申购费率如下:

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:本基金的场外赎回费率按持有年限逐年递减。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:

持有年限(Y)	场外赎回费率
Y<1年	0.1%
1年≤Y<2年	0.05%
Y≥2年	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,赎回费总额的25%归基金财产,75%用于支付市场推广、注册登记费和其他手续费。

(3)本基金的申购费率、赎回费率和收费方式由基金管理人根据《基金合同》的规定确定并在《招募说明书》中列示。基金管理人和基金托管人协商后,可以根据《基金合同》的相关约定调整费率或收费方式,并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

(4)基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划,针对以特定交易方式(如网上交易、电话交易等)等进行基金交易的投资人定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间,按相关监管部门要求履行必要手续后,基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

(5)在法律法规和基金合同规定的范围内,在不提高现有基金份额持有人适用的费率的前提下,设立新的基金份额级别、增加新的收费方式等情况,可由基金管理人和基金托管人协商,并报中国证监会备案后修改基金合同并及时公告,但不需要召开基金份额持有人大会。

2、场外申购份额、赎回金额的计算公式

(1)基金申购份额的计算

基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。其中:

净申购金额=申购金额/(1+申购费率)
申购费用=申购金额-净申购金额
申购份额=净申购金额/申购当日基金份额净值

(2)基金赎回金额的计算

本基金的净赎回金额为赎回总金额扣减赎回费用。其中,

赎回总金额=赎回份额×赎回当日基金份额净值
赎回费用=赎回总金额×赎回费率
净赎回金额=赎回总金额-赎回费用

3、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为固定值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,赎回费总额的25%归基金财产,75%用于支付市场推广、注册登记费和其他手续费。

(3)本基金的申购费率、赎回费率和收费方式由基金管理人根据相关法律法规及基金合同的规定确定并在招募说明书中列示。基金管理人和基金托管人协商后,可以根据《基金合同》的相关约定调整费率或收费方式,并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

(4)基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划,针对以特定交易方式(如网上交易、电话交易等)等进行基金交易的投资人定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间,按相关监管部门要求履行必要手续后,基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

(5)在法律法规和基金合同规定的范围内,在不提高现有基金份额持有人适用的费率的前提下,设立新的基金份额级别、增加新的收费方式等情况,可由基金管理人和基金托管人协商,并报中国证监会备案后修改基金合同并及时公告,但不需要召开基金份额持有人大会。

4、场内申购份额和赎回金额的计算

(1)基金申购份额的计算

净申购金额=申购金额/(1+申购费率)
申购费用=申购金额-净申购金额
申购份额=净申购金额/申购当日基金份额净值
申购份额计算结果保留到整数位,整数位后小数部分的份额对应的资金返还至投资人资金账户。

(2)基金赎回金额的计算

赎回总金额=赎回份额×赎回当日基金份额净值
赎回费用=赎回总金额×赎回费率
净赎回金额=赎回总金额-赎回费用
赎回金额计算结果保留到小数点后2位,小数点后两位以后的部分四舍五入,由此产生的误差计入基金财产。

(五)不列入基金费用的项目

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,以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

(六)基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日2日前在指定媒体上刊登公告。

(七)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》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《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,本基金管理人对本基金于2010年11月1日公告的招募说明书进行了更新,主要更新的内容如下:

1、因原董事Ciro Beffi先生于辞去本公司董事职务,原监事Pierre Bouchoms先生于辞去本公司监事职务,欧利盛资本资产管理股份公司推荐Massimo Mazzini先生担任本公司董事,推荐Andrea Vismara先生担任本公司监事。2010年11月,本公司召开2010年第三次临时股东会会议,同意由Massimo Mazzini先生担任本公司董事,Ciro Beffi先生不再担任本公司董事职务;同意Andrea Vismara先生担任本公司监事,Pierre Bouchoms先生不再担任本公司监事职务。本公司已将董事、监事任免的有关材料上报深圳证监局备案,据此对“三、基金管理人”的“(二)主要人员情况”中“1、基金管理人董事会成员”和“2、基金管理人监事会成员”的相关内容进行了更新。

2、根据公司业务发展所需,本基金管理人于2011年4月30刊登了《鹏华基金管理有限公司关于增聘副总经理的公告》,上述事项已按有关规定向中国证券监督管理委员会及深圳监管局报告,并经中国证券监督管理委员会核准(证监许可[2011]613号)。据此对“三、基金管理人”的“(二)主要人员情况”中“3、高级管理人员情况”的相关内容进行了更新。

3、更新了“四、基金托管人”部分的相关内容。

4、因公司业务发展需要,根据本基金管理人2010年11月12日刊登的《鹏华基金管理有限公司关于设立广州分公司的公告》,在“五、相关服务机构”一章中增加了广州分公司等内容。

5、根据本基金管理人刊登的增加代销机构的相关公告,在“五、相关服务机构”一章,新增3家机构为本基金的代销机构.

6、根据本基金管理人于2010年12月3日刊登的《鹏华丰润债券型证券投资基金基金合同生效的公告》,对“六、基金的募集与基金合同生效”一章中的相关内容进行了更新。

7、根据本基金管理人于2010年12月13日发布的《鹏华丰润债券型证券投资基金上市交易公告书》,对“七、基金的上市交易”一章中的相关内容进行了更新。

8、根据本基金管理人于2010年12月10日刊登的《鹏华基金管理有限公司关于鹏华丰润债券型证券投资基金办理跨系统转托管业务的公告》,对“八、基金份额的申购与赎回”一章中的相关内容进行了更新。

9、在“九、基金的投资”部分,更新了本基金投资组合报告的相关内容,数据截止日期为2011年3月31日。

10、更新了“十、基金的业绩”的相关内容,数据截止日期为2011年3月31日。

11、根据本基金管理人于2010年12月3日刊登的《鹏华丰润债券型证券投资基金基金合同生效的公告》和2010年12月13日发布的《鹏华丰润债券型证券投资基金上市交易公告书》对“十七、基金的信息披露”中的相关内容进行了更新。

12、更新了“二十三、其他应披露事项”的相关内容,具体内容为2010年10月29日至2011年6月1日期间的信息披露情况,包括公告事项、信息披露的媒体与披露时间。

鹏华基金管理有限公司
2011年7月13日