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

二〇一二年一月

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[2010]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21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12月1日,有关财务数据和净值表现截止日为2011年9月30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:梁静
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CAA 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)股资副总监、农业信贷类投资集团(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.)股资方案部投资总监、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.)董事、意大利联合圣保罗银行股份有限公司(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股票基金业绩考核小组主席、意大利证券交易所首席经济顾问、意大利证券监督委员会顾问、欧利盛资本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.)产品和创新部部负责人、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分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)首席市场员、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,陕西省证券监督委员会主席,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。

宋弘先生,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(CPA)。

根据2011年11月30日《鹏华基金管理有限公司关于独立董事提出辞职申请的公告》,我公司于11月27日收到张新民先生提交的辞职函,提出因个人原因辞去公司独立董事及董事会下属专业委员会相关职务。后续我公司将依法召开股东会决议上述事项,并妥善办理相关手续。

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,武汉友谊贸易时机制造公司副经理,深圳市财政局金财处处长、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。

黄商先生,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发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。

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。

殷世杰先生,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、鹏华货币市场基金经理和丰盛债券基金基金经理。

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。

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:张建国(代行)
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 杰
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2011年3月31日,中国建设银行资产总额113,125.16亿元,较上年末增加5,021.99亿元,增长4.65%。2011年一季度,中国建设银行实现净利润472.33亿元,较上年同期增长34.23%;年化平均资产回报率1.71%,年化加权平均资产收益率26.19%;利息净收入716.30亿元,较上年同期增长25.27%;净利差为2.58%,净利息收益率为2.69%,分别较上年同期提高0.28和0.30个百分点;手续费及佣金净收入231.54亿元,较上年同期增长37.29%。其中,结算、理财、电子银行、贷记卡及保理等重点产品快速增长,收入结构日趋合理。

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,在英属维京群岛有代表处,设立了湖北施江建信村镇银行、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。金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。本集团在美国《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,并被评为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《经济日报》评为"中国杰出零售银行";被中国红十字会总会授予"中国红十字杰出捐款奖章"。

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6月30日,中国建设银行已托管195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美国伦敦的《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"中国最佳托管银行"。

三、相关服务机构

(一)基金销售机构

1.场外销售机构

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
电话:0755-82021102
传真:0755-82021155
联系人:梁静

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:李四

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801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1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
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:张建国(代行)
联系人:何奕
客户服务电话:95533
传真:010-66275654
网址:www.ccb.com

②)中国工商银行股份有限公司
注册(办公)地址:北京复兴门内大街55号
法定代表人:姜建清
客户服务电话:95588(全国)
传真:010-66107913
联系人:刘证伟
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:张全伟
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
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:傅育宁
电话:0755-83198888
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:芮菡
电话:0755-25879756
客服电话:95511-3
网址:http://bank.pingan.com/

⑨)中信银行股份有限公司
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:田国立
联系人:丰靖
客服电话:95558
网站:http://bank.ecitic.com

⑩)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:闫冰竹
联系人:王巍
传真:010-66226045
客户服务电话:95526
公司网站:www.bankofbeijing.com.cn

⑪)宁波银行股份有限公司
注册(办公)地址:宁波市鄞州区宁南南路700号
法定代表人:陆华裕
电话:0574-89068340
传真:0574-87050024
联系人:胡技勤
客户服务电话:96528(上海、北京地区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:坐渝峰
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:吴太普
联系人:严峻
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(办公)地址:上海市中山东一路12号
法定代表人:吉晓辉
客户服务热线:95528
联系人:唐苑
公司网站:www.spdb.com.cn

⑮)华夏银行股份有限公司
办公地点:北京市东城区建国门内大街22号
法定代表人:吴建
客户服务电话:95577;
联系人:邓鹏
网站: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:0755-82132952
联系人:齐晓燕
客户服务电话:95536
网址:www.guosen.com.cn

⑰)华泰联合证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第五层
办公地址:深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第五层
法定代表人:马晓明
电话:0755-82492000
传真:0755-82492962
客户服务热线:95513
联系人:盛宗凌
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38-45层
办公地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
法定代表人:宫少林
联系电话:0755-82960223
联系人:林生迎
客户服务电话:95565
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:010-66568430
传真:010-83574087
联系人:田薇
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
联系电话:021-22169081
传真:021-68817271
联系人:刘晨
客户服务电话:95525
公司网址: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
联系电话: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
深圳市福田区深南大道2008号中国凤凰大厦1栋9层
法定代表人:牛冠兴
联系电话:0755-82825551
传真:0755-82555851
联系人:陈剑虹
客户服务电话:4008001001
网址:www.essence.com.cn

㉓)广州证券有限责任公司
注册地址:广州市越秀区先烈路69号东山广场主楼17楼
办公地址:广州市越秀区先烈路69号东山广场主楼17楼
法定代表人:刘东
联系人:林洁茹
联系电话:020-87323735
客服热线:961303
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86号
办公地址:山东省济南市经七路86号2316室
法定代表人:李玮
联系电话:0531-68889157
联系人:王霞
客户服务电话:95538
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
联系电话:0731-84403319
传真:0731-84403439
联系人:郭部
客户服务热线:0731-84403343
网址:www.cfzq.com

㉖)方正证券股份有限公司
住所:湖南长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层
办公地址: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:郭军刚
联系电话:0731-85832503
客户服务电话:95571
网址:www.foundersc.com

㉗)财通证券有限责任公司
注册地址:杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心
办公地址:杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心
法定代表人:沈继宁
联系人:乔毅
联系电话:0571-87925129
客户服务电话:96336(上海地区:962336)
网址:www.ctsec.com

㉘)中银万国股份有限公司
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:曹晓
客户服务电话:95523或4008895523
电话委托:021-962505
网址:www.sywg.com

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:李春芳
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
联系电话:025-83290575
联系人:张威
网址:www.htsc.com.cn

㉛)海通证券股份有限公司
住所:上海广东路689号
办公地址:上海广东路689号
法定代表人:王开国
联系电话:021-23219275
联系人:李笑鸣
客户服务电话:95553
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:湖南省长沙市天心区湘府中路198号标志商务中心A栋11层
法定代表人:林俊波
联系电话:021-68634518
传真:021-68865680
联系人:钟康莹
客户服务电话:400-888-1551
网址:www.xcsc.com

㉝)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:北京市东城区朝内大街188号
法定代表人:王常青
联系人:许梦园
传真:010-65182261
客服电话:4008888108
公司网站:www.csc108.com

㉞)德邻证券股份有限公司
住所:天津市经济技术开发区第二大街42号写字楼101室
办公地址:天津市南开区宾水西道8号
法定代表人:杜庆平
联系人:王兆权
联系电话:022-28451861
传真:022-28451892
网址:www.bhzq.com

㉟)华林证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区民田路178号华融大厦5、6楼
公司地址:深圳市福田区民田路178号华融大厦5、6楼
法定代表人:宋志江
联系电话:0755-82707855
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:长春市自由大路1138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:0431-85096795
联系人:潘俊
网址:www.nesc.cn

㊲)上海证券有限责任公司
住所:上海市黄浦区西藏中路336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:021-53519888
传真:021-65081434
联系人:刘乔
客服热线:4008-918-918
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:北京市西城区太平桥大街19号
法定代表人:冯戎
联系电话:010-88085201
联系人:李巍
客户服务电话:4008-000-562
网址:www.hysec.com

㊴)国泰君安证券股份有限公司
住所:上海市浦东新区银城中路168号上海银行厦29楼
办公地址:上海市浦东新区银城中路168号上海银行厦29楼
法定代表人:万建华
联系电话:021-38676666
传真:021-38670666
联系人:丙敏祺
客户服务电话:95521
网址:www.gtja.com

㊵)广发证券股份有限公司
住所:广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼(4301-4316房)
办公地址:广东省广州天河北路大都会广场5、18、19、36、38、41、42楼
法定代表人:林治海
联系人:黄凤
联系电话:020-87555888
传真:020-87553600
客服电话:95575
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268号
法定代表人:兰荣
办公地址:浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼21层
联系电话:021-38565785
传真:021-38565955
联系人:谢尚荷
客户服务电话:95562
网址:www.xyzq.com.cn

㊷)宏源证券有限公司
注册地址: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:张宇宏
联系电话:0451-82336863
客服热线:4006662288
网址:www.jhzq.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:甘肃省兰州市东岗路638号财富大厦
法定代表人:李晓安
电话:0931-8888088
传真:0931-4890515
联系人:李昕田
客户服务电话:0931-4890619,4890618,4890100
网址:http://www.hlzqgs.com

㊹)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至10层
法定代表人:黄金琳
邮政编码:350003
联系人:张腾
联系电话:0591-87383623
业务传真:0591-87383610
统一客户服务电话:96326(福建省外请先拨0591)。
公司网址:www.hfqz.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
法定代表人:徐勇力
联系人:沈逸川
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:高冠江
联系人:唐静
联系电话: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:无锡市太湖新城金融一街八号国联金融大厦702
法定代表人:雷建辉
电话:0510-82832919
传真:0510-82833124
联系人:徐欣
联系电话:4008885288,0510-82588168
网址:www.glsc.com.cn

㊽)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:北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701
法定代表人:林义相
联系人:姜言灵
联系电话:010-66045491
基金热线:010-66045678
网址:www.txsec.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.场内销售机构

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:沈兆杰
经办会计师:薛竞、金毅

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)期间封闭运作,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。这一策略则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有剩的债券。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

可转债具有债权和股性,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