鹏华丰盛稳固收益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:中国工商银行股份有限公司

2018年12月

重要提示

本基金经2011年3月8日中国证券监督管理委员会下发的《关于核准鹏华丰盛稳固收益债券型证券投资基金募集的批复》(证监许可[2011]338号文)核准,进行募集,并经中国证监会基金部2011年4月25日基金部函[2011]252号文件《关于鹏华丰盛稳固收益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2011年4月25日生效,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,投资者在投资本基金前,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:市场风险、管理风险、技术风险、流动性风险、信用风险、本基金特有风险及其他风险,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者基金投资的“买者自负”原则,在投资者作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行承担。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,投资者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。

本招募说明书中涉及与托管相关的基金信息已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为2018年10月24日,有关财务数据和净值表现截止日为2018年9月30日 (本报告中财务数据未经审计)。

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。

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经理、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党委书记、总裁。

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, 国信证券股份有限公司副总裁,国信证券股份有限公司公司顾问。

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、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。

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, 现在担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部总经理, 欧利盛资本股份公司 (Eurizon Capital S.A.)(卢森堡)企业服务部总经理。

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、总经理助理、副总经理、人力资源总部副总经理等职务。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兼人力资源总部总经理。

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。

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。

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。

2、基金管理人监事会成员

黄俞先生,监事会主席,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、监事,现任深圳市北融信投资发展有限公司董事长。

陈冰女士,监事,本科学历,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等,现任国信证券资金财务总部副总经理兼资金运营部总经理、融资融券部总经理。

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IMI资产管理SGR企业经管部、圣保罗财富管理企业管控部工作、曾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。

于丹女士,职工监事,法学硕士,国籍:中国。历任北京市金杜(深圳)律师事务所律师;2011年7月加盟鹏华基金管理有限公司,历任监察稽核部法务主管,现任监察稽核部总经理助理。

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。

刘钦先生,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,现任鹏华基金管理有限公司总裁助理、首席市场官兼市场发展部、北京分公司总经理。

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,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。

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经理、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党委书记、总裁。

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,现任鹏华基金管理有限公司党委副书记、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,现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,现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总裁助理、机构理财部总经理、职工监事,现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,现任鹏华基金管理有限公司纪委书记、督察长。

韩亚庆先生,副总经理,经济学硕士。国籍:中国。历任国家开发银行资金局主任科员,全国社保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,现任鹏华基金管理有限公司副总裁、固定收益投资总监、固定收益部总经理。

4、本基金基金经理

刘太阳先生,国籍中国,理学硕士,12年证券基金从业经验。曾任中国农业银行金融市场部高级交易员,从事债券投资交易工作;2011年5月加盟鹏华基金管理有限公司,从事债券研究工作, 担任固定收益部研究员。2012年09月至2018年04月担任鹏华纯债债券基金基金经理,2012年12月至2015年04月担任鹏华月月发短期理财债券基金基金经理,2013年04月至2016年04月担任鹏华丰利分级债券基金基金经理,2013年05月担任鹏华实业债基金基金经理,2015年03月担任鹏华丰盛债券基金基金经理,2016年02月至2018年03月担任鹏华弘盛混合基金基金经理,2016年04月至2018年04月担任鹏华丰利债券(LOF)基金基金经理,2016年08月担任鹏华双债保利债券基金基金经理,2016年08月担任鹏华丰收债券基金基金经理,2016年08月至2017年09月担任鹏华丰安债券基金基金经理,2016年08月至2018年06月担任鹏华丰达债券基金基金经理,2016年09月至2018年04月担任鹏华丰恒债券基金基金经理,2016年10月至2018年05月担任鹏华丰腾债券基金基金经理,2016年10月至2018年05月担任鹏华丰禄债券基金基金经理,2016年11月至2018年07月担任鹏华丰盈债券基金基金经理,2016年12月至2018年05月担任鹏华普泰债券基金基金经理,2016年12月至2018年07月担任鹏华丰惠债券基金基金经理,2017年02月至2018年06月担任鹏华安益增强混合基金基金经理,2017年03月至2018年06月担任鹏华丰享债券基金基金经理,2017年03月至2018年06月担任鹏华丰玉债券基金基金经理,2017年03月至2017年12月担任鹏华丰嘉债券基金基金经理,2017年03月至2018年04月担任鹏华丰康债券基金基金经理,2017年04月至2018年05月担任鹏华丰瑞债券基金基金经理,2017年06月至2018年06月担任鹏华丰源债券基金基金经理,2017年06月至2018年03月担任鹏华丰玺债券基金基金经理,2018年10月担任鹏华双债增利债券基金基金经理。刘太阳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:

2012年09月至2018年04月担任鹏华纯债债券基金基金经理
2012年12月至2015年04月担任鹏华月月发短期理财债券基金基金经理
2013年04月至2016年04月担任鹏华丰利分级债券基金基金经理
2013年05月担任鹏华实业债基金基金经理
2016年02月至2018年03月担任鹏华弘盛混合基金基金经理
2016年04月至2018年04月担任鹏华丰利债券(LOF)基金基金经理
2016年08月担任鹏华双债保利债券基金基金经理
2016年08月担任鹏华丰收债券基金基金经理
2016年08月至2017年09月担任鹏华丰安债券基金基金经理
2016年08月至2018年06月担任鹏华丰达债券基金基金经理
2016年09月至2018年04月担任鹏华丰恒债券基金基金经理
2016年10月至2018年05月担任鹏华丰腾债券基金基金经理
2016年10月至2018年05月担任鹏华丰禄债券基金基金经理
2016年11月至2018年07月担任鹏华丰盈债券基金基金经理
2016年12月至2018年05月担任鹏华普泰债券基金基金经理
2016年12月至2018年07月担任鹏华丰惠债券基金基金经理
2017年02月至2018年06月担任鹏华安益增强混合基金基金经理
2017年03月至2018年06月担任鹏华丰享债券基金基金经理
2017年03月至2018年06月担任鹏华丰玉债券基金基金经理
2017年03月至2017年12月担任鹏华丰嘉债券基金基金经理
2017年03月至2018年04月担任鹏华丰康债券基金基金经理
2017年04月至2018年05月担任鹏华丰瑞债券基金基金经理
2017年06月至2018年06月担任鹏华丰源债券基金基金经理
2017年06月至2018年03月担任鹏华丰玺债券基金基金经理
2018年10月担任鹏华双债增利债券基金基金经理

本基金历任的基金经理:

2011年04月至2016年10月	初冬女士

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,鹏华新兴产业混合、鹏华研究精选混合、鹏华创新驱动混合基金经理。

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。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

(一)基金托管人基本情况

名称:中国工商银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门内大街55号
成立时间:1984年1月1日
法定代表人:易会满
注册资本:人民币35,640,625.71万元
联系电话:010-66105799
联系人:郭明

(二)主要人员情况

截至2018年6月,中国工商银行资产托管部共有员工212人,平均年龄33岁,95%以上员工拥有大学本科以上学历,高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

(三)基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者, 中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来,秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨,依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队,严格履行资产托管人职责,为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务,展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、QFII资产、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系, 同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务,可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2018年6月,中国工商银行共托管证券投资基金874只。自2003 年以来,本行连续十五年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的61项最佳托管银行大奖;是获得奖项最多的国内托管银行,优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

(四)基金托管人的内部控制制度

中国工商银行资产托管部自成立以来,各项业务飞速发展,始终保持在资产托管行业的优势地位。这些成绩的取得,是与资产托管部“一手抓业务拓展,一手抓内控建设”的做法是分不开的。资产托管部非常重视改进和加强内部风险管理工作,在积极拓展各项托管业务的同时,把加强风险防范和控制的力度,精心培育内控文化,完善风险控制机制,强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来做。2005、2007、2009、2010、2011、2012、2013、2014、2015、2016、2017共十一次顺利通过评估组织内部控制和安全措施最权威的ISAE3402审阅,获得无保留意见的控制及有效性报告。充分表明独立第三方对我行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可,也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨,达到国际先进水平。目前,ISAE3402审阅已经成为年度化、常规化的内控工作手段。”

1、内部风险控制目标

保证业务运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则,强化和建立守法经营、规范运作的经营思想和经营风格,形成一个运作规范化、管理科学化、监控制度化的内控体系;防范和化解经营风险,保证托管资产的安全完整;维护持有人的权益;保障资产托管业务安全、有效、稳健运行。

2、内部风险控制组织结构

中国工商银行资产托管业务内部风险控制组织结构由中国工商银行稽核监察部门(内控合规部、内部审计局)、资产托管部内设风险控制处及资产托管部各业务处室共同组成。总行稽核监察部门负责制定全行风险管理政策,对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内部设置专门负责稽核监察工作的内部风险控制处,配备专职稽核监察人员,在总经理的直接领导下,依照有关法律规章,对业务的运行独立行使稽核监察职权。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

3、内部风险控制原则

(1)合法性原则。内控制度应当符合国家法律法规及监管机构的监管要求,并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。

(2)完整性原则。托管业务的各项经营管理活动都必须有相应的规范程序和监督制约;监督制约应渗透到托管业务的全过程和各个操作环节,覆盖所有的部门、岗位和人员。

(3)及时性原则。托管业务经营活动必须在发生时能准确及时地记录;按照“内控优先”的原则,新设机构或新增业务品种时,必须做到已建立相关的规章制度。

(4)审慎性原则。各项业务经营活动必须防范风险,审慎经营,保证基金资产和其他委托资产的安全与完整。

(5)有效性原则。内控制度应根据国家政策、法律及经营管理的需要适时修改完善,并保证得到全面落实执行,不得有任何空间、时限及人员的例外。

(6)独立性原则。设立专门履行托管人职责的管理部门;直接操作人员和控制人员必须相对独立,适当分离;内控制度的检查、评价部门必须独立于内控制度的制定和执行部门。

4、内部风险控制措施实施

(1)严格的隔离制度。资产托管业务与传统业务实行严格分离,建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度,并采取了良好的防火墙隔离制度,能够确保资产独立、环境独立、人员独立、业务制度和管理独立、网络独立。

(2)高层检查。主管行领导与部门高级管理层作为工行托管业务政策和策略的制定者和管理者,要求下级部门及时报告经营管理情况和特别情况,以检查资产托管部在实现内部控制目标方面的进展,并根据检查情况提出内部控制措施,督促职能管理部门改进。

(3)人事控制。资产托管部严格落实岗位责任制,建立“自控防线”、“互控防线”、“监控防线”三道控制防线,健全绩效考核和激励机制,树立“以人为本”的内控文化,增强员工的责任心和荣誉感,培育团队精神和核心竞争力。并通过进行定期、定向的业务与职业道德培训、签订承诺书,使员工树立风险防范与控制理念。

(4)经营控制。资产托管部通过制定计划、编制预算等方法开展各种业务营销活动、处理各项事务,从而有效地控制和配置组织资源,达到资源利用和效益最大化目的。

(5)内部风险管理。资产托管部通过稽核监察、风险评估等方式加强内部风险管理,定期或不定期地对业务运作状况进行检查、监控,指导业务部门进行风险识别、评估,制定并实施风险控制措施,排查风险隐患。

(6)数据安全控制。我们通过业务操作区相对独立、数据和传真加密、数据传输线路的冗余备份、监控设施的运用和保障等措施来保障数据安全。

(7)应急准备与响应。资产托管部建立专门的灾难恢复中心,制定了基于数据、应用、操作、环境四个层面的完备的灾难恢复方案,并组织员工定期演练。为使演练更加接近实战,资产托管部不断提高演练标准,从最初的按照预订时间演练发展到现在的“随机演练”。从演练结果看,资产托管部完全有能力在发生灾难的情况下两个小时内恢复业务。

5、资产托管部内部风险控制情况

(1)资产托管部内部设置专职稽核监察部门,配备专职稽核监察人员,在总经理的直接领导下,依照有关法律规章,全面贯彻落实全程监控思想,确保资产托管业务健康、稳定地发展。

(2)完善组织结构,实施全员风险管理。完善的风险管理体系需要从上至下每个员工的共同参与,只有这样,风险控制制度和措施才会全面、有效。资产托管部实施全员风险管理,将风险控制责任落实到具体业务部门和业务岗位, 每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责,通过建立纵向双人制、横向多部门制的内部组织结构,形成不同部门、不同岗位相互制衡的组织结构。

(3)建立健全规章制度。资产托管部十分重视内控制度的建设,一贯坚持把风险防范和控制的理念和方法融入岗位职责、制度建设和工作流程中。经过多年努力,资产托管部已经建立了一整套内部风险控制制度,包括:岗位职责、业务操作流程、稽核监察制度、信息披露制度等,覆盖所有部门和岗位,渗透各项业务过程,形成各个业务环节之间的相互制约机制。

(4)内部风险控制始终是托管部工作重点之一,保持与业务发展同等地位。资产托管业务是商业银行新兴的中间业务,资产托管部从成立之日起就特别强调规范运作,一直将建立一个系统、高效的风险防范和控制体系作为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展,新问题、新情况不断出现,资产托管部始终将风险管理放在与业务发展同等重要的位置,视风险防范和控制为托管业务生存和发展的生命线。

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

根据《基金法》、基金合同、托管协议和有关基金法规的规定,基金托管人对基金的投资范围和投资对象、基金投融资比例、基金投资禁止行为、基金参与银行间债券市场、基金资产净值的计算、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基金业绩表现数据等进行监督和核查,其中对基金的投资比例的监督和核查自基金合同生效之后六个月开始。

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、基金合同、基金托管协议或有关基金法律法规规定的行为,应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正,基金管理人收到通知后应及时核对,并以书面形式对基金托管人发出回函确认。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。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的,基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人有重大违规行为,应立即报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正。

三、相关服务机构

(一) 基金销售机构

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)82021233
传真:(0755)82021155
联系人:吕奇志

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: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号花旗银行大厦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
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)包商银行股份有限公司
注册地址:内蒙古包头市钢铁大街6号
办公地址:内蒙古包头市钢铁大街6号
法定代表人:李镇西
联系人:张建鑫
客户服务电话:95352
网址:www.bsb.com.cn

2)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:张东宁
联系人:张喆
客户服务电话:95526
网址:www.bankofbeijing.com.cn

3)渤海银行股份有限公司
注册地址:天津市河东区海河东路218号渤海银行大厦
办公地址:天津市河东区海河东路218号渤海银行大厦
法定代表人:李伏安
联系人:王宏
客户服务电话:95541
网址:www.cbhb.com.cn

4)大连银行股份有限公司
注册地址:大连市中山区中山路88号天安国际大厦49楼
办公地址:大连市中山区中山路88号天安国际大厦9楼
法定代表人:陈占维
联系人:朱珠
客户服务电话:4006640099
网址:www.bankofdl.com

5)东莞农村商业银行股份有限公司
注册地址:广东省东莞市城区南城路2号
办公地址:广东省东莞市城区南城路2号
法定代表人:王耀球
联系人:杨亢
客户服务电话:961122
网址:www.drcbank.com

6)东莞银行股份有限公司
注册地址:东莞市莞城区体育路21号
办公地址:东莞市莞城区体育路21号
法定代表人:卢国锋
联系人:陈幸
客户服务电话:4001196228
网址:www.dongguanbank.cn

7)福建海峡银行股份有限公司
注册地址:福建省福州市台江区江滨中大道358号海峡银行大厦
办公地址:福建省福州市台江区江滨中大道358号海峡银行大厦
法定代表人:俞敏
联系人:黄钰雯
客户服务电话:400-893-9999
网址:www.fjhxbank.com

8)广东顺德农村商业银行股份有限公司
注册地址:佛山市顺德区大良德和居委会拥翠路2号
办公地址:佛山市顺德区大良德和居委会拥翠路2号
法定代表人:姚真勇
客户服务电话:0757-22223388
网址:www.sdebank.com

9)杭州银行股份有限公司
注册地址:杭州市庆春路46号杭州银行大厦
办公地址: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:95398
网址:www.hzbank.com.cn

10)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:李民吉
联系人:董金
客户服务电话:95577
网址:www.hxb.com.cn

11)徽商银行股份有限公司
注册地址:合肥市安庆路79号天徽大厦A座
办公地址:合肥市安庆路79号天徽大厦A座
法定代表人:吴学民
联系人:叶卓伟
客户服务电话:4008896588
网址:www.hsbank.com.cn

12)吉林银行股份有限公司
注册地址:吉林省长春市经济技术开发区东南湖大路1817号
办公地址:吉林省长春市经济技术开发区东南湖大路1817号
法定代表人:张宝祥
联系人:孟明
客户服务电话:400-889-6666
网址:www.jlbank.com.cn

13)江苏江南农村商业银行股份有限公司
注册地址:江苏省常州市和平中路413号
办公地址:江苏省常州市和平中路413号
法定代表人:陆向阳
联系人:蒋娇
客户服务电话:0519-96005
网址:www.jnbank.com.cn

14)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

15)江苏张家港农村商业银行股份有限公司
注册地址:江苏省张家港市人民中路66号
办公地址:江苏省张家港市人民中路66号
法定代表人:季颖
联系人:朱芳
客户服务电话:0512-96065
网址:www.zrcbank.com

16)交通银行股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区银城中路188号
办公地址:上海市浦东新区银城中路188号
法定代表人:彭纯
联系人:王菁
客户服务电话:95559
网址:www.bankcomm.com

17)洛阳银行股份有限公司
注册地址:河南洛阳洛龙区开元大道256号
办公地址:河南洛阳洛龙区开元大道256号
法定代表人:王建甫
联系人:李亚洁
客户服务电话:96699
网址: www.bankofluoyang.com.cn

18)南京银行股份有限公司
注册地址:江苏省南京市玄武区中山路288号
办公地址:江苏省南京市玄武区中山路288号
法定代表人:胡昇荣
客户服务电话:40088-96400
网址:www.njcb.com.cn

19)宁波银行股份有限公司
注册地址:浙江省宁波市鄞州区宁东路345号
办公地址:浙江省宁波市鄞州区宁东路345号
法定代表人:陆华裕
联系人:胡技勋
客户服务电话:96528(上海、北京地区962528)
网址:www.nbcb.com.cn

20)平安银行股份有限公司
注册地址:深圳市深南东路5047号
办公地址:深圳市深南东路5047号
法定代表人:谢永林
联系人:张莉
客户服务电话:95511-3
网址:bank.pingan.com

21)上海浦东发展银行股份有限公司
注册地址:上海市中山东一路12号
办公地址:上海市中山东一路12号
法定代表人:高国富
联系人:唐苑
客户服务电话:95528
网址:www.spdb.com.cn

22)上海银行股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区银城中路168号
办公地址:上海市浦东新区银城中路168号
法定代表人:金煜
联系人:汤征程
客户服务电话:95594
网址:www.bankofshanghai.com

23)天津银行股份有限公司
注册地址:天津市河西区友谊路25号
办公地址:天津市河西区友谊路25号
法定代表人:李宗唐
联系人:李岩
客户服务电话:4006960296
网址:www.bank-of-tianjin.com.cn

24)西安银行股份有限公司
注册地址:陕西省西安市高新路60号
办公地址:陕西省西安市高新路60号
法定代表人:郭军
客户服务电话:40086-96779
网址:www.xacbank.com

25)兴业银行股份有限公司
注册地址:福州市湖东路154号中山大厦
办公地址:上海市江宁路168号
法定代表人:高建平
联系人:刘玲
客户服务电话:95561
网址:www.cib.com.cn

26)招商银行股份有限公司
注册地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
法定代表人:李建红
联系人:邓炯鹏
客户服务电话:95555
网址:www.cmbchina.com

27)浙江民泰商业银行股份有限公司
注册地址:浙江省台州市温岭市三星大道168号
办公地址:浙江省台州市温岭市三星大道168号
法定代表人:江建法
联系人:刘兴龙
客户服务电话:4008896521
网址:www.mintaibank.com

28)浙商银行股份有限公司
注册地址:中国杭州市庆春路288号
办公地址:中国杭州市庆春路288号
法定代表人:沈仁康
联系人:沈崟杰
客户服务电话:95527
网址:www.czbank.com

29)中国工商银行股份有限公司
注册地址:北京复兴门内大街55号
办公地址:北京复兴门内大街55号
法定代表人:易会满
联系人:刘秀宇
客户服务电话:95588
网址:www.icbc.com.cn

30)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:田国立
联系人:王未雨
客户服务电话:95533
网址:www.ccb.com

31)中国民生银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门内大街2号
办公地址:北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人:洪崎
联系人:穆婷
客户服务电话:95568
网址:www.cmbc.com.cn

32)中国农业银行股份有限公司
注册地址:北京市东城区建国门内大街69号
办公地址:北京市东城区建国门内大街69号
法定代表人:周慕冰
联系人:邱泽滨
客户服务电话:95599
网址:www.abchina.cn

33)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:陈四清
联系人:陈洪源
客户服务电话:95566
网址:www.boc.cn

34)中国邮政储蓄银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街3号
办公地址:北京市西城区金融大街3号
法定代表人:李国华
联系人:王硕
客户服务电话:95580
网址:www.psbc.com

35)中信银行股份有限公司
注册地址: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8号富华大厦C座
法定代表人:李庆萍
联系人:迟卓
客户服务电话:95558
网址:bank.ecitic.com

36)中原银行股份有限公司
注册地址:河南省郑州市郑东新区CBD商务外环路23号中科金座大厦
办公地址:河南省郑州市郑东新区CBD商务外环路23号中科金座大厦
法定代表人:窦荣兴
客户服务电话:95186
网址:www.zybank.com.cn

37)珠海华润银行股份有限公司
注册地址:中国广东珠海市吉大九洲大道东1346号
办公地址:中国广东珠海市吉大九洲大道东1346号
法定代表人:刘晓勇
联系人:李阳
客户服务电话:400-880-0338或96588(广东省外请加拨0756)
网址:www.crbank.com.cn

(2)证券公司销售机构

1)安信证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
办公地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
法定代表人:王连志
联系人:陈剑虹
客户服务电话:95517
网址:www.essence.com.cn

2)渤海证券股份有限公司
注册地址: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:王春峰
联系人:蔡霆
客户服务电话:400-651-5988
网址:www.ewww.com.cn

3)财达证券股份有限公司
注册地址:河北省石家庄市桥西区自强路35号庄家金融大厦
办公地址:河北省石家庄市桥西区自强路35号庄家金融大厦23-26层
法定代表人:翟建强
联系人:马辉
客户服务电话:河北省内:95363 、河北省外:0311-95363
网址:www.s10000.com

4)财富证券有限责任公司
注册地址:长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26-28层
办公地址:长沙市芙蓉中路二段 8 0 号顺天国际财富中心36层
法定代表人:蔡一兵
联系人:郭静
客户服务电话:95317
网址:www.cfzq.com

5)长城证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14楼、16楼、17楼
办公地址:深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14楼、16楼、17楼
法定代表人:丁益
联系人:金夏
客户服务电话:400-666-6888
网址:www.cgws.com

6)长江证券股份有限公司
注册地址:武汉市新华路特8号长江证券大厦
办公地址:武汉市新华路特8号长江证券大厦
法定代表人:尤习贵
联系人:奚博宇
客户服务电话:95579/4008-888-999
网址:www.95579.com

7)第一创业证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼
办公地址:深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼
法定代表人:刘学民
联系人:毛诗莉
客户服务电话:95358
网址:www.firstcapital.com.cn

8)东北证券股份有限公司
注册地址:长春市生态大街6666号
办公地址:长春市生态大街6666号
法定代表人:李福春
联系人:安岩岩
客户服务电话:95360
网址:www.nesc.cn

9)东莞证券股份有限公司
注册地址:广东省东莞市莞城区可园南路1号金源中心
办公地址:广东省东莞市莞城区可园南路1号金源中心
法定代表人:陈照星(代)
联系人:李荣
客户服务电话:95328
网址:www.dgzq.com.cn

10)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:魏庆华
联系人:汤漫川
客户服务电话:95309
网址:www.dxzq.net

11)方正证券股份有限公司
注册地址:湖南省长沙市天心区湘江中路二段36号华远华中心4、5号楼3701-3717
办公地址:北京市朝阳区北四环中路盘古大观A座40层
法定代表人:高利
联系人:丁敏
客户服务电话:95571
网址:www.foundersc.com

12)光大证券股份有限公司
注册地址: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:薛峰
联系人:何耀
客户服务电话:95525
网址:www.ebscn.com

13)广发证券股份有限公司
注册地址:广州市天河北路183号大都会广场5、7、8、17、18、19、38-44楼
办公地址:广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街2号618室
法定代表人:孙树明
联系人:黄岚
客户服务电话:95575
网址:www.gf.com.cn

14)广州证券股份有限公司
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:邱三发
联系人:梁微
客户服务电话:95396
网址:www.gzs.com.cn

15)国泰君安证券股份有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区商城路618号
办公地址:上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼
法定代表人:杨德红
联系人:芮敏祺
客户服务电话:400-8888-666/95521
网址:www.gtja.com

16)国信证券股份有限公司
注册地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
办公地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
法定代表人:何如
联系人:周杨
客户服务电话:95536
网址:www.guosen.com.cn

17)海通证券股份有限公司
注册地址:上海市广东路689号
办公地址:上海市黄浦区广东路689号
法定代表人:周杰
联系人:赵洋洋
客户服务电话:95553
网址:www.htsec.com

18)华林证券股份有限公司
注册地址:西藏自治区拉萨市柳梧新区察古大道1-1君泰国际B栋一层3号
办公地址:深圳市福田区民田路178号华融大厦6楼
法定代表人:林立
联系人:胡倩
客户服务电话:400-188-3888
网址:www.chinalin.com

19)华融证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街8号
办公地址:北京市朝阳区朝阳门北大街18号中国人保寿险大厦11至18层
法定代表人:祝献忠
联系人:孙燕波
客户服务电话:95390
网址:www.hrsec.com.cn

20)华泰证券股份有限公司
注册地址:南京市江东中路228号
办公地址:南京市建邺区江东中路228号华泰证券广场
法定代表人:周易
联系人:庞晓芸
客户服务电话:95597
网址:www.htsc.com.cn

21)华鑫证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01(b)单元
办公地址:上海市徐汇区宛平南路8号
法定代表人:俞洋
联系人:杨莉娟
客户服务电话:95323/4001099918(全国)/029-68918888(西安)
网址:www.cfsc.com.cn

22)江海证券有限公司
注册地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
办公地址:黑龙江省哈尔滨市松北区创新三路833号
法定代表人:孙名扬
联系人:姜志伟
客户服务电话:400-666-2288
网址:www.jhzq.com.cn

23)开源证券股份有限公司
注册地址:西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层
办公地址:西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层
法定代表人:李刚
联系人:袁伟涛
客户服务电话:95325/400-860-8866
网址:www.kysec.cn

24)联讯证券股份有限公司
注册地址:惠州市江北东江三路55号广播电视新闻中心西面一层大堂和三、四层
办公地址:深圳市福田区深南中路2002号中广核大厦北楼10层
法定代表人:徐刚
联系人:彭莲
客户服务电话:95564
网址:www.lxsec.com

25)平安证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层
办公地址:深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层
法定代表人:曹实凡
联系人:周一涵
客户服务电话:95511-8
网址:stock.pingan.com

26)山西证券股份有限公司
注册地址:太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼
办公地址:太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼
法定代表人:侯巍
联系人:郭熠
客户服务电话:95573/400-666-1618
网址:www.i618.com.cn

27)上海证券有限责任公司
注册地址:上海市黄浦区四川中路213号7楼
办公地址:上海市黄浦区四川中路213号7楼
法定代表人:李俊杰
联系人:邵珍珍
客户服务电话:4008-918-918
网址:www.shzq.com

28)申万宏源证券有限公司
注册地址:上海市徐汇区长乐路989号45层
办公地址:上海市徐汇区长乐路989号45层
法定代表人:李梅
联系人:李玉婷
客户服务电话:95523/4008895523
网址:www.swhysc.com

29)天风证券股份有限公司
注册地址:湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦4楼
办公地址:湖北省武汉市武昌区中南路99号保利广场A座37楼
法定代表人:余磊
联系人:夏旻
客户服务电话:95391/4008005000
网址:www.tfzq.com

30)五矿证券有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心办公室47层01单元
办公地址:深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心办公室47层01单元
法定代表人:赵立功
联系人:马国栋
客户服务电话:4001840028
网址:www.wkzq.com.cn

31)西部证券股份有限公司
注册地址:西安市新城区东新街232号陕西信托大厦
办公地址:西安市新城区东新街232号陕西信托大厦16-17层
法定代表人:刘建武
联系人:梁承华
客户服务电话:95582
网址:www.westsecu.com

32)西南证券股份有限公司
注册地址:重庆市江北区桥北苑8号
办公地址:重庆市江北区桥北苑8号
法定代表人:廖庆轩
联系人:周青
客户服务电话:4008096096/95355
网址:www.swsc.com.cn

33)湘财证券股份有限公司
注册地址:湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼
办公地址:湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼
法定代表人:孙永祥
联系人:李欣
客户服务电话:95351
网址:www.xcsc.com

34)新时代证券股份有限公司
注册地址:北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501
办公地址:北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501
法定代表人:叶顺德
联系人:田芳芳
客户服务电话:95399
网址:www.xsdzq.cn

35)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
办公地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表人:张志刚
联系人:尹旭航
客户服务电话:95321
网址:www.cindasc.com

36)兴业证券股份有限公司
注册地址:福州市湖东路268号
办公地址:上海市浦东新区长柳路36号兴业证券大厦
法定代表人:兰荣
联系人:乔琳雪
客户服务电话:95562
网址:www.xyzq.com.cn

37)招商证券股份有限公司
注册地址: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
联系人:林生迎
客户服务电话:95565
网址:www.newone.com.cn

38)中国国际金融股份有限公司
注册地址:北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
办公地址:北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
法定代表人:毕明建(代)
联系人:杨涵宇
客户服务电话:4009101166
网址:www.cicc.com.cn

39)中国民族证券有限责任公司
注册地址:北京市朝阳区北四环中路27号盘古大观40-43层
办公地址:北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼
法定代表人:何亚刚
联系人:胡创
客户服务电话:40088-95618
网址:www.e5618.com

40)中国银河证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街35号2-6层
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:陈共炎
联系人:辛国政
客户服务电话:4008-888-888/95551
网址:www.chinastock.com.cn

41)中国中投证券有限责任公司
注册地址: 深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18-21层及第04层01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23单元
办公地址:深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第4、18层至21层
法定代表人:高涛
联系人:万玉琳
客户服务电话:95532/4006008008
网址:www.china-invs.cn

42)中泰证券股份有限公司
注册地址:济南市市中区经七路86号
办公地址:上海市花园石桥路66号东亚银行金融大厦18层
法定代表人:李玮
联系人:许曼华
客户服务电话:95538
网址:www.zts.com.cn

43)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

44)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

45)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:刘晓明
客户服务电话:95548
网址:http://sd.citics.com

(3)期货公司销售机构

1)中信建投期货有限公司
注册地址:重庆市渝中区中山三路107号上站大楼平街11-B,名义层11-A,8-B4,9-B、C
办公地址:重庆市渝中区中山三路107号皇冠大楼11楼
法定代表人:彭文德
联系人:刘芸
客户服务电话:400-8877-780
网址:www.cfc108.com

2)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)北京蛋卷基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507
办公地址:北京市朝阳区望京SOHO T3 A座19层
法定代表人:钟斐斐
联系人:戚晓强
客户服务电话:4000-618-518
网址:danjuanapp.com

2)北京恒天明泽基金销售有限公司
注册地址:北京市北京经济技术开发区宏达北路10号5层5122室
办公地址:北京市北京经济技术开发区宏达北路10号5层5122室
法定代表人:黄永伟
联系人:侯仁凤
客户服务电话:400-786-8868
网址:www.chtfund.com

3)北京虹点基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区工人体育场北路甲2号盈科中心东门2层222单元
办公地址:北京市朝阳区工人体育场北路甲2号盈科中心东门2层
法定代表人:胡伟
联系人:陈铭洲
客户服务电话:400-618-0707
网址:www.hongdianfund.com

4)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.hcjijin.com

5)北京肯特瑞基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06
办公地址:北京市大兴区亦庄经济开发区科创十一街18号院京东总部A座17层
法定代表人:江卉
联系人:韩锦星
客户服务电话:95118
网址:fund.jd.com

6)北京展恒基金销售股份有限公司
注册地址:北京市朝阳区安苑路15-1号邮电新闻大厦2层
办公地址:北京市朝阳区安苑路15-1号邮电新闻大厦2层
法定代表人:闫振杰
联系人:马林
客户服务电话:4008188000
网址:www.myfund.com

7)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:王莉
联系人:于扬
客户服务电话:400-920-0022
网址:licaike.hexun.com

8)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: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:韩爱彬
客户服务电话:4000-766-123
网址:www.fund123.cn

9)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:王锋
客户服务电话:95177
网址:www.snjijin.com

10)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

11)上海长量基金销售投资顾问有限公司
注册地址:上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址:上海市浦东新区东方路1267号11层
法定代表人:张跃伟
联系人:张佳琳
客户服务电话:400-089-1289
网址:www.erichfund.com

12)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:王诗玙
客户服务电话:400-700-9665
网址:www.howbuy.com

13)上海华夏财富投资管理有限公司
注册地址:上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268室
办公地址:北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层
法定代表人:李一梅
联系人:仲秋玥
客户服务电话:400-817-5666
网址:www.amcfortune.com

14)上海汇付金融服务有限公司
注册地址:上海市中山南路100号金外滩国际广场19楼
办公地址:上海市宜山路700号普天信息产业园2期C5栋汇付天下总部大楼2楼
法定代表人:金佶
联系人:钱诗雯
客户服务电话:440-8202-819
网址:www.chinapnr.com

15)上海利得基金销售有限公司
注册地址:上海市宝山区蕴川路5475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:陈孜明
客户服务电话:400-921-7755
网址:www.leadfund.com.cn

16)上海陆金所资产管理有限公司
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

17)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

18)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:400-821-0203
网址:www.520fund.com.cn

19)深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
注册地址:深圳市福田区福田街道民田路178号华融大厦27层2704
办公地址:北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦A座7层
法定代表人:马勇
联系人:文雯
客户服务电话:400-166-1188
网址:8.jrj.com.cn

20)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:邓爱萍
客户服务电话:4006-788-887
网址:www.zlfund.cn、www.jjmmw.com

21)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:北京市西城区新街口外大街28号C座505室
法定代表人:林义相
联系人:谭磊
客户服务电话:010-66045678
网址:www.jjm.com.cn/

22)宜信普泽投资顾问(北京)有限公司
注册地址:北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809
办公地址:北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城C1809
法定代表人:戎兵
联系人:魏晨
客户服务电话:400-6099-200
网址:www.yixinfund.com

23)浙江金观诚基金销售有限公司
注册地址:杭州市拱墅区登云路45号(锦昌大厦)1幢10楼1001室
办公地址:杭州市拱墅区登云路55号锦昌大厦1号楼1楼金观
法定代表人:徐黎云
联系人:来舒岚
客户服务电话:400-688-1888
网址:www.jincheng-fund.com

24)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路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

25)中期时代基金销售(北京)有限公司
注册地址:北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢11层1103号
办公地址:北京市朝阳区建国门外光华路16号1幢11层
法定代表人:路瑶
联系人:侯英建
客户服务电话:400-8888-160
网址:www.cifcofund.com

26)众升财富(北京)基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区望京东园四区13号楼A座9层908室
办公地址:北京市朝阳区望京浦项中心A座9层04-08
法定代表人:李招弟
联系人:李艳
客户服务电话:400-059-8888
网址:www.zscffund.com

27)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代理销售本基金或变更上述销售机构,并及时公告。

(二) 注册登记机构

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) 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
法定代表人:王玲
办公室地址: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(特殊普通合伙)
住所:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路1318 号星展银行大厦507 单元01 室
法定代表人:李丹
办公室地址:上海市湖滨路202 号普华永道中心11 楼
联系电话:(021)23238888
传真:(021)23238800
联系人:魏佳亮
经办会计师:许康玮、陈熹

四、基金的名称

本基金名称:鹏华丰盛稳固收益债券型证券投资基金

五、基金运作方式及类型

本基金为债券型基金

六、基金的投资目标

本基金注重风险控制,力争获取超越存款利率的绝对收益。

七、基金的投资方向

本基金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、银行存款等;同时投资于A股股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证等权益类品种以及法律、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。

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%;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。

八、基金的投资策略

本基金力争获取超越存款利率的绝对收益,并认为对风险的敏感把握和精准控制是创造绝对收益的关键。在控制风险方面,本基金将通过投资组合保险策略对系统性风险进行管理,通过构建投资组合对非系统性风险进行分散,在此基础上,重视基金管理人自上而下投资能力的发挥,以追求超越基准的绝对收益。这一理念和目标,将通过投资策略的三个层面得到体现和实现。

1、资产配置策略

本基金主要运用优化的投资组合保险策略确定和调整基金资产在高风险资产和低风险资产之间的配置比例,这是本基金控制系统性风险、追求绝对收益的第一步。

本基金将主要运用投资组合保险策略中的固定比例组合保险策略(CPPI)和时间不变性投资组合保险策略(TIPP)来实现基金的投资目标。

运用固定比例组合保险策略(CPPI)时,需要事先设定一个保险底线,在此基础上确定组合安全垫。将安全垫乘以一定的风险乘数,确定基金投资于高风险资产的比例,将剩余资产投资于低风险资产,从而完成一次资产配置。它通过动态调整资产组合,以保证高风险资产的损失额不超过预先设定的投资者可承受能力。

运用时间不变性投资组合保险策略(TIPP)时,需要假设当资产价值上升时,投资者更关心当前资产价值的保障,希望能够锁定浮动盈利,而非仅仅考虑投资本金。TIPP策略把保险底线从固定改为可变,保险底线为某一时点资产净值最高的一个固定比例。具体来说,当资产净值变动时可求出新的保险底线,将新的保险底线与原来的保险底线相比较,取其中较大的作为资产净值变动后的保险底线。可以看出,在整个投资过程中,TIPP策略的保险底线只升不降。通俗来讲,TIPP策略是一种“落袋为安”的策略。

本基金在投资组合保险策略的基础上还将进行一定的优化,主要体现在参数的设定和不同策略的选择运用上。本基金将以定量分析为基础,结合基金管理人对宏观经济的研究和判断进行参数设定。在不同策略的选择运用上,本基金将综合运用CIPP策略和TIPP 策略,从出发点上看,采用CPPI 策略主要是为了避免基金初始资产遭受本金损失,而采用TIPP 策略则主要是对基金已实现收益的锁定。

2、债券投资策略

债券投资是本基金资产投资的主要方向。本基金将从风险和收益两方面进行考虑来构建债券投资组合。

在风险控制方面,本基金分析基金下方风险来源,重点关注债券的利率风险、信用风险和流动性风险。对于利率风险,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;对于信用风险,基金管理人主要依靠自身专业的信用分析团队,参考国家有权机构批准或认可的信用评级机构的信用评级,对发债主体的信用风险进行评价;对于流动性风险,本基金将对投资者需求进行跟踪与了解,结合历史经验,在构建投资组合时注重不同流动性水平资产的配合,并在久期、信用等因素类似的情况下选择流动性最好的券种进行投资。

本基金还将采取久期策略、收益率曲线策略、骑乘策略、利差策略、息差策略等积极投资策略, 在为风险资产的投资创造安全垫的同时,力争在债券投资层面为基金追求超越基准的绝对收益产生正向贡献。

(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

(下转B63版)