

**鹏华国有企业债债券型
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

二零一四年四月

重要提示

本基金经 2012 年 12 月 5 日中国证券监督管理委员会下发的《关于核准鹏华国有企业债债券型证券投资基金募集的批复》（证监许可[2012]1630 号文）核准，进行募集。根据相关法律法规，本基金基金合同已于 2013 年 3 月 8 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。

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。

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。

本招募说明书与基金托管人相关信息更新部分已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为 2014 年 3 月 7 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2013 年 12 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) 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，董事，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。

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。

周中国先生, 董事, 会计学硕士研究生, 国籍: 中国。曾任深圳市华为技术有限公司定价中心经理助理; 2000 年 7 月起历任国信证券有限责任公司资金财务总部业务经理、外派财务经理、高级经理、总经理助理、副总经理; 2009 年 2 月至今任国信证券股份有限公司人力资源总部副总经理。

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, 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。

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。

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。

李国阳先生，监事，硕士研究生，高级会计师，国籍：中国。曾任深圳国投证券有限公司资金财务部财务科副科长、审计科副经理、稽核审计部副总经理、第二证券交易部副总经理、资金财务部总经理，国信证券有限责任公司资金财务部总经理、公司副总会计师兼资金财务部总经理、上海管理总部总经理、首席会计师兼资金财务部总经理，曾任鹏华基金管理有限公司董事、监事会召集人，现任国信证券股份有限公司副总裁兼首席会计师、资金财务总部总经理。

苏波先生，职工监事，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投研部研究员、客户服务主管、西部理财中心总经理、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；2008年11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机构理财部总经理。

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，历任登记结算部副总经理，现任公司登记结算部执行总经理。

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，现任监察稽核部法务经理。

3、高级管理人员情况

何如先生，董事长，简历同前。

邓召明先生，董事，总裁，简历同前。

高阳先生，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副总裁。

胡湘先生，副总裁，经济学硕士，国籍：中国。曾就职于全国社会保障基金理事会投资部、境外投资部，历任副主任科员、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。

毕国强先生，副总裁，特许金融分析师（CFA），工商管理硕士（MBA），国籍：加拿大。历任广州文冲船厂经营部船舶科科长、美国景顺集团(Invesco Ltd.)加拿大 AIM Trimark 投资管理有限公司分析师，中国证监会基金监管部四处调研员，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。

高鹏先生，督察长，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，现任鹏华基金管理有限公司督察长、监察稽核部总经理。

4、本基金基金经理

刘建岩先生，国籍中国，经济学硕士，8 年证券从业经验。历任第一创业证券有限责任公司资管部投资经理；2009 年 12 月加盟鹏华基金管理有限公司，从事债券研究分析工作，担任固定收益部债券研究员，2011 年 4 月起担任鹏华信用增利债券型证券投资基金基金经理，2013 年 2 月起兼任鹏华产业债债券型证券投资基金基金经理，2013 年 3 月起兼任鹏华国有企业债债券型证券投资基金基金经理，2013 年 11 月起兼任鹏华丰融定期开放债券型证券投资基金基金经理。刘建岩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他基金情况：

2011 年 4 月起担任鹏华信用增利债券型证券投资基金基金经理；

2013 年 2 月起兼任鹏华产业债债券型证券投资基金基金经理；

2013 年 11 月起兼任鹏华丰融定期开放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董事、总裁、党总支书记。

高阳先生，鹏华基金管理有限公司副总裁。

初冬女士，鹏华基金管理有限公司总裁助理、固定收益投资总监、固定收益部总经理，社保基金组合投资经理及鹏华丰盛稳固收益债券基金、鹏华双债增利债券基金、鹏华双债加利债券基金基金经理。

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、鹏华价值精选基金基金经理。

冀洪涛先生，鹏华基金管理有限公司机构投资部总经理，社保基金组合投资经理。

王咏辉先生，鹏华基金管理有限公司量化投资部总经理、鹏华中证 500 指数（LOF）基金基金经理。

黄鑫先生，鹏华基金管理有限公司研究部总经理、鹏华动力增长基金基金经理、鹏华品牌传承混合基金基金经理。

阳先伟先生，鹏华基金管理有限公司固定收益部执行总经理，鹏华丰收债券基金基金经理、鹏华双债保利债券基金基金经理。

陈鹏先生，鹏华基金管理有限公司基金管理部副总经理，鹏华中国 50 混合基金、鹏华普丰基金基金经理。

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：姜建清

注册资本：人民币 349,018,545,827 元

联系电话：010-66105799

联系人：赵会军

（二）主要人员情况

截至 2013 年 12 月末，中国工商银行资产托管部共有员工 176 人，平均年龄 30 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、安心账户资金、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 2013 年 12 月，中国工商银行共托管证券投资基金 358 只。自 2003 年以来，本行连续十年获得香港《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 41 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。

三、相关服务机构

（一）基金份额销售机构

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 502 室

电话：（010）88082426

传真：（010）88082018

联系人：李筠

(3) 鹏华基金管理有限公司上海分公司

办公地址：上海市浦东花园石桥路 33 号花旗大厦 801B

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

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、银行代销机构

(1) 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

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

联系电话：010—66105799

联系人：刘秀宇

客户服务电话：95588

公司网址：www.icbc.com.cn

(2) 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：王洪章

联系人：王嘉朔

客户服务电话：95533

传真：010-66275654

网址：www.ccb.com

（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：蒋超良

客户服务电话：95599

联系人：刘一宁

网址：www.95599.cn

（4）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：牛锡明

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

（5）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

（6）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

（7）包商银行股份有限公司

注册（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：刘芳

联系电话 0472-5189051

传真：0472-5189057

客服电话：内蒙古地区 0472-96016；北京地区 010-96016；宁波地区 0574-967210；

深圳地区 0755-967210；成都地区 028-65558555

公司网站：www.bsb.com.cn

（8）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：常振明

联系人：郭伟

客服电话：95558

网站：http://bank.ecitic.com

（9）中国民生银行股份有限公司

注册（办公）地址：北京市西城区复兴门内大街2号

法定代表人：董文标

客户服务电话：95568

联系人：董云巍

传真：010-58560666

网址：www.cmbc.com.cn

（10）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

3、券商代销机构

（1）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 号国际企业大厦 C 座

注册地址：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：陈有安

客户服务电话：400-8888-888

联系电话：010-66568430

联系人：田薇

网址：www.chinastock.com.cn

（2）海通证券股份有限公司

注册地址：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

（3）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 16-26 层

法定代表人：何如

联系电话：0755-82133066

传真：0755-82133952

联系人：齐晓燕

客户服务电话：95536

网址：www.guosen.com.cn

（4）申银万国证券股份有限公司

注册地址：上海市常熟路 171 号

办公地址：上海市长乐路 989 号 40 楼

法定代表人：储晓明

联系电话：021-54047892

联系人：曹晔

客户服务电话：95523 或 4008895523

电话委托：021-962505

网址：www.sywg.com

(5) 华西证券有限责任公司

注册地址：四川省成都市陕西街 239 号

办公地址：深圳市深南大道 4001 号时代金融中心 18 楼

法定代表人：杨炯洋

联系人：李慧灵

联系电话：028-86137782

传真：028-86150615

客户服务咨询电话：400-8888-818

网址：www.hx168.com.cn

(6) 长城证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、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

(7) 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 层-21 层及第 04 层 01、02、03、05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23 单元

法定代表人：龙增来

联系人：刘毅

联系电话：0755-82023442

客户服务热线：400 600 8008、95532

网址：www.china-invs.cn

4、第三方代销机构

（1）深圳众禄基金销售有限公司

注册地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

法定代表人：薛峰

客服电话：4006-788-887

传真：0755-82080798

联系人：邓爱萍

网址：www.zlfund.cn、 www.jjmmw.com

（2）诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

办公地址：上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 8 楼 801 室

法定代表人：汪静波

客服电话：400-821-5399

传真：021-38509777

联系人：何菁菁

网址：www.noah-fund.com

（3）杭州数米基金销售有限公司

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼

法定代表人：陈柏青

客服电话：4000-766-123

传真：0571-26698533

联系人：周嫵旻

网址：www.fund123.cn

（4）天相投资顾问有限公司

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

客服电话：010-66045678

传真：010-66045527

联系人：林爽

网址：www.txsec.com

(5) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

办公地址：上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

法定代表人：张跃伟

客服电话：400-089-1289

传真：021-58787698

联系人：刘琼

电话：021-58788678-8201

传真：021—58787698

客服电话：400-089-1289

公司网站：www.erichfund.com

(6) 上海好买基金销售有限公司

办公地址：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯大厦 903~906 室

住所：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室

法定代表人：杨文斌

客服电话：400-700-9665

传真：021-50325989

联系人：陶怡

网址：www.ehowbuy.com

(7) 浙江同花顺基金销售有限公司

办公地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903

法定代表人：李晓涛

客服电话：(0571)56768888

传真：0571-88911818

联系人：蒋泽君

网址：www.10jqka.com.cn

(8) 上海天天基金销售有限公司

住所：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

联系电话：020-87599527

客服电话：4001818188

网址：www.1234567.com.cn

(9) 浙江金观诚财富管理有限公司

住所：拱墅区霞湾巷 239 号 8 号楼 4 楼 403 室

办公地址：杭州市教工路 18 号 EAC 欧美中心 A 座 D 区 8 层

法定代表人：陆彬彬

联系人：鲁盛

联系电话：0571-56028617

客服电话：4000680058

网址：www.jincheng-fund.com

(10) 和讯信息科技有限公司

住所：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：王英俊

联系电话：021-68419822

客服电话：400-920-0022

网址：licaikexun.com

(11) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

住所：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#

办公地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#

法定代表人：马令海

联系人：邓洁

联系电话：010-58321388-1105

客服电话：010-58325327

网址: jrj.xinlande.com.cn

(12) 宜信普泽投资顾问(北京)有限公司

住所: 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 9 号楼 15 层 1809

法定代表人: 唐宁

联系人: 王巨明

联系电话: 010-52855650

客服电话: 400-6099-500

网址: www.yixinfund.com

(13) 泛华普益基金销售有限公司

住所: 四川省成都市成华区建设路 9 号高地中心 1101 室

办公地址: 四川省成都市成华区建设路 9 号高地中心 1101 室

法定代表人: 于海锋

联系人: 黄飏

联系电话: 028-84252471

客服电话: 400-8878-566

网址: www.pyfund.cn

(14) 中期时代基金销售(北京)有限公司

住所: 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

联系电话: 010-59539888

客服电话: 400-8888-160

网址: www.cifcofund.com

(15) 万银财富(北京)基金销售有限公司

住所: 北京朝阳区北四环中路 27 号盘古大观 3201

办公地址: 北京朝阳区北四环中路 27 号盘古大观 3201

法定代表人: 李招弟

联系人：毛怀营

联系电话：010-59393923

客服电话：400-808-0069

网址：www.wy-fund.com

(16) 深圳腾元基金销售有限公司

住所：深圳市福田区福华三路卓越世纪中心 1 号楼 1806-1810

办公地址：深圳市福田区福华三路卓越世纪中心 1 号楼 1806-1810

法定代表人：卓紘磊

联系人：王妮萍

联系电话：0755-33376853

客服电话：4006-877-899

网址：www.dowinfund.com

(17) 北京增财基金销售有限公司

住所：北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208 室

办公地址：北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208 室

法定代表人：王昌庆

联系人：罗细安

联系电话：010-67000988

客服电话：400-001-8811

网址：www.zcvc.com.cn

(18) 北京恒天明泽基金销售有限公司

住所：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

联系电话：010-57756068

客服电话：400-786-8868

网址：www.chtfund.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。

（二） 注册登记机构

名称：鹏华基金管理有限公司

注册地址：深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心 43 层

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

法定代表人：何如

联系人：潘艳梅

联系电话：0755-82021109

传真：0755-82021156

（三） 律师事务所

名称：广东嘉得信律师事务所

住所：深圳市罗湖区国信证券大厦十二楼

负责人：闵齐双

办公地址：深圳市罗湖区国信证券大厦十二楼

联系电话：0755-33033027 0755-33033033

传真：0755-33033086

联系人：崔卫群

经办律师：闵齐双、崔卫群

（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

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

经办注册会计师：单峰、魏佳亮

联系人：魏佳亮

四、 基金的名称

鹏华国有企业债债券型证券投资基金（基金简称：鹏华国企债债券；基金代码：000007）

五、基金的运作方式与类型

契约型开放式债券型基金，基金存续期为不定期。

六、基金的投资目标

在严格控制投资风险、保持资产流动性的基础上，通过对国有企业债积极主动的投资管理，力争使基金份额持有人获得长期稳定的投资收益。

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、中期票据、可转债、分离交易可转债、资产支持证券、中小企业私募债、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。

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%，其中对国有企业债的投资比例不低于固定收益类资产的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%。

本基金所指国有企业债是指国有及国有控股企业发行的债券，包括这类企业所发行的金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、可转债、分离交易可转债等。

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

（一）投资策略

1、资产配置策略

作为债券型基金，本基金重点关注未来宏观经济形势及利率变化趋势。因此，对宏观经

济形势及中央银行货币政策尤其是利率政策的研判将成为投资决策的基本依据,为资产配置提供前瞻性指导。本基金将在对未来宏观经济形势及利率变动趋势进行深入研究的基础上,对固定收益类资产、权益类资产和现金资产的配置比例进行动态调整。

2、债券投资策略

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,在适度控制风险的基础上,通过严格的利差分析和对利率曲线变动趋势的判断,提高资金流动性和收益率水平,力争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和资本市场的预测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,直至目标久期下限,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。

(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）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。

（6）中小企业私募债券

中小企业私募债券是在中国境内以非公开方式发行和转让，约定在一定期限还本付息的公司债券。由于其非公开性及条款可协商性，普遍具有较高收益。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，合理合规合格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。

本基金投资中小企业私募债券，将根据审慎原则，制定严格的投资决策流程、风险控制制度和信用风险、流动性风险处置预案，并经董事会批准，以防范信用风险、流动性风险等各种风险。

3、股票投资策略

本基金股票投资以精选个股为主。发挥基金管理人专业研究团队的研究能力，考察上市公司所属行业发展前景、行业地位、竞争优势、盈利能力、成长性、估值水平等多种因素，精选流动性好、成长性高、估值水平低的股票进行投资。

（二）投资决策依据及程序

1、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。

2、投资决策程序

（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，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给交易员，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

中债总指数收益率。

中债总指数由中央国债登记结算公司编制，并在中国债券网（www.chinabond.com.cn）公开发布，具有较强的权威性和市场影响力；该指数样本券涵盖央票、国债和政策性金融债，能较好地反映债券市场的整体收益。本基金是债券型基金，主要投资于固定收益类金融工具，为此，本基金选取中债总指数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，本基金管理人协商基金托管人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中低风险收益特征的品种。

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。

本基金的托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，已于2014年1月16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

载、误导性陈述或者重大遗漏。

本报告中所列财务数据截至 2013 年 12 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	697,644,989.90	93.08
	其中：债券	697,644,989.90	93.08
	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	31,770,923.83	4.24
6	其他资产	20,075,842.32	2.68
7	合计	749,491,756.05	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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	63,839,000.00	12.83
	其中：政策性金融债	63,839,000.00	12.83
4	企业债券	545,810,882.70	109.66
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	67,610,000.00	13.58
7	可转债	20,385,107.20	4.10
8	其他	-	-
9	合计	697,644,989.90	140.17

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	122235	12 芜湖港	499,980	48,498,060.00	9.74
2	1380275	13 雅安发	500,000	48,105,000.00	9.67

		展债			
3	130204	13 国开 04	500,000	46,305,000.00	9.30
4	122587	12 遵桥债	449,890	44,417,639.70	8.92
5	124250	13 宿建投	400,000	40,284,000.00	8.09

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、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

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

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

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

9、投资组合报告附注

(1) 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) 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	14,752.27
2	应收证券清算款	1,828,342.52
3	应收股利	-
4	应收利息	18,230,763.24
5	应收申购款	1,984.29
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,075,842.32

(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	110015	石化转债	20,385,107.20	4.10

(5) 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。

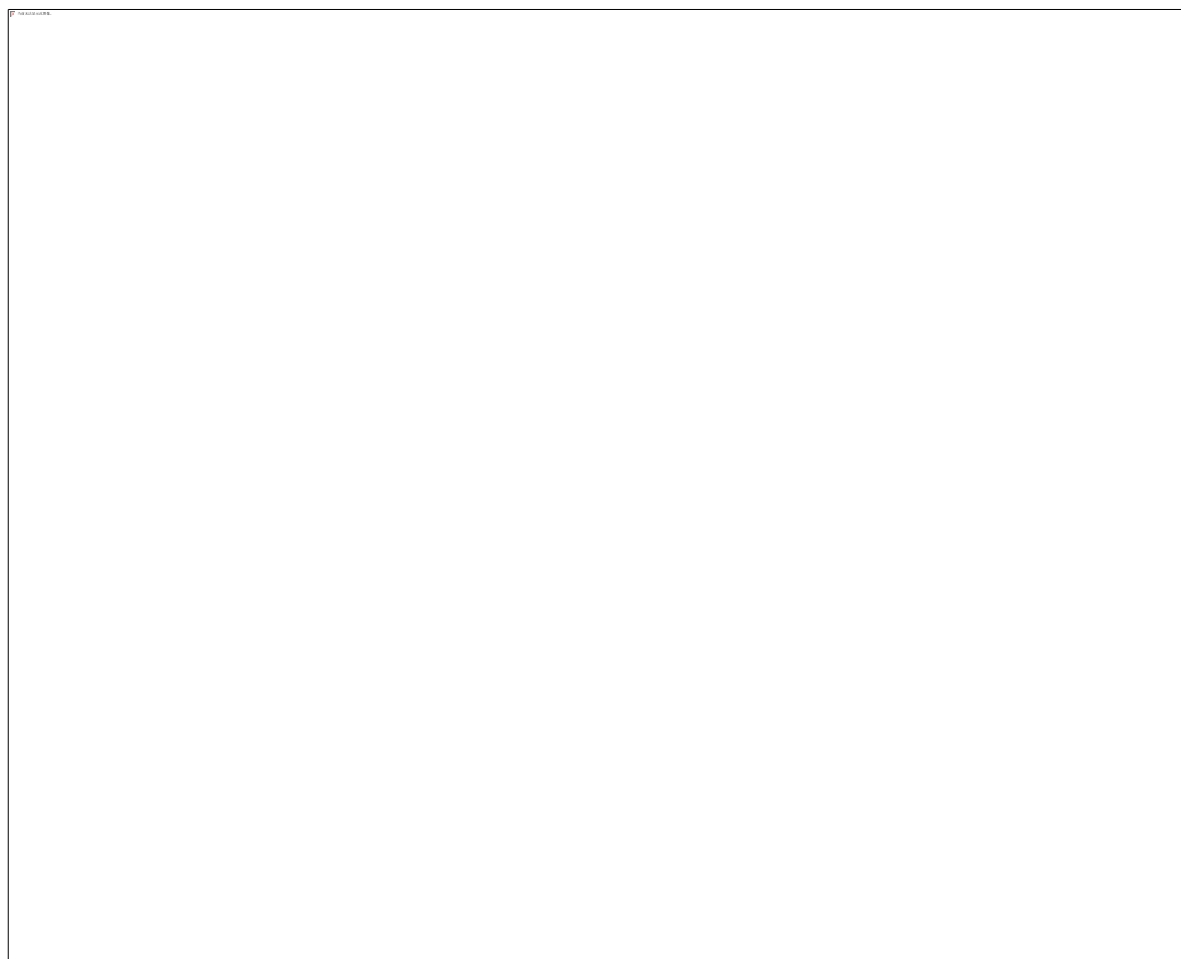
十二、 基金的业绩

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。

1、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（本报告中所列财务数据未经审计）：

成立时间	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
自基金合同生效 (2013 年 3 月 8 日) 至 2013 年 12 月 31 日	-2.50%	0.11%	-3.05%	0.12%	0.55%	-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：



注1：业绩比较基准=中债总指数收益率；

注2：本基金基金合同于2013年3月8日生效；

注3：本基金业绩截止日为2013年12月31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费、律师费和诉讼费；
- 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)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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.6%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$$

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，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前2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、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：

$$H=E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

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，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类中第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。

(四)与基金销售有关的费用

1、申购费

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人实施差别的申购费率。

养老金客户指基本养老基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基金等，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、企业年金单一计划以及集合计划。如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，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，并按规定向中国证监会备案。非养老金客户指除养老金客户外的其他投资人。

通过基金管理人的直销柜台申购本基金基金份额的养老金客户适用于特定申购费率，其他投资人申购本基金基金份额适用于一般申购费率，具体费率见下表：

申购金额 M（元）	一般申购费率	特定申购费率
M<100 万	0.8%	0.32%
100 万≤M<500 万	0.4%	0.12%
500 万≤M	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、注册登记等各项费用。

2、赎回费

本基金的赎回费率如下表所示：

持有年限（Y）	赎回费率
Y<1 年	0.50%
1 年≤Y<2 年	0.25%
Y≥2 年	0

赎回费用由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 25% 归入基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

3、基金管理人可以在基金合同约定的范围内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。

（五）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。

(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

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，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》、《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，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”部分明确了更新招募说明书内容的截止日期、有关财务数据的截止日期。
- 2、对“三、基金管理人”部分内容进行了更新。
- 3、对“四、基金托管人”部分内容进行了更新。
- 4、对“五、相关服务机构”内容进行了更新。
- 5、对“八、基金的投资”部分内容进行了更新。
- 6、对“九、基金的业绩”部分内容进行了更新。
- 7、对“二十、对基金份额持有人的服务”内容进行了更新。
- 8、对“二十一、其他应披露事项”内容进行了更新。

鹏华基金管理有限公司

2014 年 4 月 18 日