



鹏华丰和债券型证券投资基金 (LOF)

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：招商银行股份有限公司

二〇一六年十二月

重要提示

鹏华丰和债券型证券投资基金（LOF）由鹏华中小企业纯债债券型发起式证券投资基金转型而成。

鹏华中小企业纯债债券型发起式证券投资基金于2012年11月5日成立同时进入三年封闭运作期。根据《鹏华中小企业纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》的约定，封闭期为三年，封闭期到期后将进行基金转型。鹏华中小企业纯债债券型发起式证券投资基金封闭期于2015年11月4日到期，2015年11月5日起鹏华中小企业纯债债券型发起式证券投资基金转型为上市开放式基金（LOF），基金更名为“鹏华丰和债券型证券投资基金（LOF）”。基金的投资目标、投资范围、投资策略等依据《鹏华中小企业纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》中对转型后基金的相关约定执行。

2015年11月5日起，由《鹏华中小企业纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》修订而成的《鹏华丰和债券型证券投资基金（LOF）基金合同》生效。

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：市场风险、上市交易风险、上市公司经营风险、管理风险、流动性风险及其他风险。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金，但高于普通债券型基金。

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。

本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为 2016 年 11 月 4 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2016 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）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、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。

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、国信证券股份有限公司人力资源总部副总经理、资金财务总部副总经理；2015年6月至今任国信证券股份有限公司资金财务总部总经理。

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。

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、资金财务部副总经理等，现任国信证券资金财务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投资基金事业部副经理、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。

刘焱先生，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，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。

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、电子商务部总经理。

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，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，鹏华基金管理有限公司监察稽核部总经理，现任鹏华基金管理有限公司督察长。

4、本基金基金经理

戴钢先生，国籍中国，经济学硕士，14年证券从业经验。曾就职于广东民安证券研究发展部，担任研究员；2005年9月加盟鹏华基金管理有限公司，从事研究分析工作，历任债券研究员、专户投资经理等职；2011年12月至2016年2月担任鹏华丰泽债券（LOF）基金基金经理，2012年6月起担任鹏华金刚保本混合基金基金经理，2012年11月起兼任鹏华中小企业纯债债券（2015年11月已转型为鹏华丰和债券（LOF）基金）基金基金经理，2013年9月起兼任鹏华丰实定期开放债券基金基金经理，2013年9月起兼任鹏华丰泰定期开放债券基金基金经理，2013年10月起兼任鹏华丰信分级债券基金基金经理，2016年3月起兼任鹏华丰尚定期开放债券基金基金经理，2016年4月起兼任鹏华金鼎保本混合基金基金经

理，2016年8月起兼任鹏华丰饶定期开放债券基金基金经理，现同时担任绝对收益投资部副总经理。戴钢先生具备基金从业资格。

本基金历任基金经理：无

本基金经理管理其他基金情况：

2011年12月至2016年2月担任鹏华丰泽债券（LOF）基金基金经理；

2012年6月起担任鹏华金刚保本混合基金基金经理；

2013年9月起兼任鹏华丰实定期开放债券基金基金经理；

2013年9月起兼任鹏华丰泰定期开放债券基金基金经理；

2013年10月起兼任鹏华丰信分级债券基金基金经理；

2016年3月起兼任鹏华丰尚定期开放债券基金基金经理；

2016年4月起兼任鹏华金鼎保本混合基金基金经理；

2016年8月起兼任鹏华丰饶定期开放债券基金基金经理。

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。

冀洪涛先生，鹏华基金管理有限公司总裁助理、权益投资总监、权益投资一部总经理，社保基金组合投资经理，专户投资经理。

王宗合先生，鹏华基金管理有限公司权益投资二部总经理，鹏华消费优选混合、鹏华金刚保本混合、鹏华品牌传承混合、鹏华养老产业股票、鹏华金鼎保本混合、鹏华金城保本混合基金基金经理。

王咏辉先生，鹏华基金管理有限公司量化及衍生品投资部总经理。

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、鹏华动力增长混合（LOF）、鹏华健康环保混合、鹏华医药科技混合基金基金经理。

陈鹏先生，鹏华基金管理有限公司权益投资二部副总经理，鹏华中国50混合、鹏华消费领先混合、鹏华鹏华医疗保健股票基金基金经理。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基金托管人概况

1、基本情况

名称：招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）

成立日期：1987年4月8日

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

注册资本：252.20亿元

法定代表人：李建红

行长：田惠宇

资产托管业务批准文号：证监基金字[2002]83号

电话：0755—83199084

传真：0755—83195201

资产托管部信息披露负责人：张燕

2、发展概况

招商银行成立于1987年4月8日，是我国第一家完全由企业法人持股的股份制商业银行，总行设在深圳。自成立以来，招商银行先后进行了三次增资扩股，并于2002年3月成功地发行了15亿A股，4月9日在上交所挂牌（股票代码：600036），是国内第一家采用国际会计标准上市的公司。2006年9月又成功发行了22亿H股，9月22日在香港联交所挂牌交易（股票代码：3968），10月5日行使H股超额配售，共发行了24.2亿H股。截至2016年6月30日，本集团总资产5.5373万亿元人民币，高级法下资本充足率13.91%，权重法下资本充足率13.90%。

2002年8月，招商银行成立基金托管部；2005年8月，经报中国证监会同意，更名为资产托管部，下设业务管理室、产品管理室、业务营运室、稽核监察室、基金外包业务室5个职能处室，现有员工60人。2002年11月，经中国人民银行和中国证监会批准获得证券投资基金托管业务资格，成为国内第一家获得该项业务资格上市银行；2003年4月，正式办理基金托管业务。招商银行作为托管业务资质最全的商业银行，拥有证券投资基金托管、受托投资管理托管、合格境外机构投资者托管（QFII）、全国社会保障基金托管、保险资金托管、企业年金基金托管等业务资格。

招商银行确立“因势而变、先您所想”的托管理念和“财富所托、信守承诺”的托管核心价值，独创“6S托管银行”品牌体系，以“保护您的业务、保护您的财富”为历史使命，

不断创新托管系统、服务和产品：在业内率先推出“网上托管银行系统”、托管业务综合系统和“6心”托管服务标准，首家发布私募基金绩效分析报告，开办国内首个托管银行网站，成功托管国内第一只券商集合资产管理计划、第一只 FOF、第一只信托资金计划、第一只股权私募基金、第一家实现货币市场基金赎回资金 T+1 到账、第一只境外银行 QDII 基金、第一只红利 ETF 基金、第一只“1+N”基金专户理财、第一家大小非解禁资产、第一单 TOT 保管，实现从单一托管服务商向全面投资者服务机构的转变，得到了同业认可。

经过十四年发展，招商银行资产托管规模快速壮大。2016 年招商银行加大高收益托管产品营销力度，截至 9 月末新增托管公募开放式基金 62 只，新增首发公募开放式基金托管规模 456.94 亿元。克服国内证券市场震荡的不利形势，托管费收入、托管资产均创出历史新高，实现托管费收入 36.29 亿元，同比增长 30.06%，托管资产余额 9.42 万亿元，同比增长 59.41%。作为公益慈善基金的首个独立第三方托管人，成功签约“壹基金”公益资金托管，为我国公益慈善资金监管、信息披露进行有益探索，该项目荣获 2012 中国金融品牌「金象奖」「十大公益项目」奖；四度蝉联获《财资》“中国最佳托管专业银行”。2016 年 6 月招商银行荣膺《财资》“中国最佳托管银行奖”，成为国内唯一获奖项国内托管银行，该行“托管通”获得国内《银行家》2016 中国金融创新“十佳金融产品创新奖”；7 月荣膺 2016 年中国资产管理【金贝奖】“最佳资产托管银行”。

（二）主要人员情况

李建红先生，本行董事长、非执行董事，2014 年 7 月起担任本行董事、董事长。英国东伦敦大学工商管理硕士、吉林大学经济管理专业硕士，高级经济师。招商局集团有限公司董事长，兼任招商局国际有限公司董事会主席、招商局能源运输股份有限公司董事长、中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司董事长、招商局华建公路投资有限公司董事长和招商局资本投资有限责任公司董事长。曾任中国远洋运输（集团）总公司总裁助理、总经济师、副总裁，招商局集团有限公司董事、总裁。

田惠宇先生，本行行长、执行董事，2013 年 5 月起担任本行行长、本行执行董事。美国哥伦比亚大学公共管理硕士学位，高级经济师。曾于 2003 年 7 月至 2013 年 5 月历任上海银行副行长、中国建设银行上海市分行副行长、深圳市分行行长、中国建设银行零售业务总监兼北京市分行行长。

丁伟先生，本行副行长。大学本科毕业，副研究员。1996 年 12 月加入本行，历任杭州分行办公室主任兼营业部总经理，杭州分行行长助理、副行长，南昌支行行长，南昌分行行

长，总行人力资源部总经理，总行行长助理，2008年4月起任本行副行长。兼任招银国际金融有限公司董事长。

姜然女士，招商银行资产托管部总经理，大学本科毕业，具有基金托管人高级管理人员任职资格。先后供职于中国农业银行黑龙江省分行，华商银行，中国农业银行深圳市分行，从事信贷管理、托管工作。2002年9月加盟招商银行至今，历任招商银行总行资产托管部经理、高级经理、总经理助理等职。是国内首家推出的网上托管银行的主要设计、开发者之一，具有20余年银行信贷及托管专业从业经验。在托管产品创新、服务流程优化、市场营销及客户关系管理等领域具有深入的研究和丰富的实务经验。

（三）基金托管业务经营情况

截至2016年9月30日，招商银行股份有限公司累计托管213只开放式基金及其它托管资产，托管资产为9.42万亿元人民币。

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

联系电话：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

联系电话：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：上海市浦东新区花园石桥路33号花旗集团大厦801B室

联系电话：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 1001 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：周樱

2) 销售机构：

A 银行销售机构

(1) 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：李建红

电话：0755-83198888

传真：0755-83195049

联系人：邓炯鹏

客服电话：95555

网址：www.cmbchina.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：易会满

客户服务电话：95588（全国）

传真：010-66107913

联系人：刘秀宇

联系电话：010-66105799

网址：www.icbc.com.cn

(3) 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：王未雨

客户服务电话：95533

传真：010-66275654

网址：www.ccb.com

(4) 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：周慕冰

客户服务电话：95599

联系人：邱泽滨

网址：www.abcchina.cn

(5) 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：孔超

电话：010-66223587

传真：010-66226045

客户服务电话：95526

网站：www.bankofbeijing.com.cn

(6) 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：洪崎

客户服务电话：95568

联系人：穆婷

传真：010-58560666

网址: www.cmbc.com.cn

(7) 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: 张宏革

客户服务电话: 95559

网址: www.bankcomm.com

(8) 上海银行股份有限公司

注册(办公)地址: 上海市浦东新区银城中路 168 号

法定代表人: 金煜

客户服务电话: 95594

联系人: 汤征程

网址: www.bankofshanghai.com

(9) 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: 陈震山

联系人: 严峻

客户服务电话: 95398

网址: www.hzbank.com.cn

(10) 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

法定代表人: 何沛良

联系人: 杨亢

客户服务电话: 961122

网址: www.drcbank.com

(11) 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：李庆萍

联系人：迟卓

客服电话：95558

网站： bank.ecitic.com

(12) 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

电话：021-61618888

传真：021-63604199

公司网站：www.spdb.com.cn

(13) 中国邮政储蓄银行股份有限公司

注册（办公）地址：北京市西城区金融大街 3 号

法定代表人：李国华

客户服务电话：95580

联系人：杨涓

传真：010-68858117

公司网址：www.psbc.com

(14) 江苏江南农村商业银行股份有限公司

注册（办公）地址：江苏省常州市和平中路 413 号

法定代表人：陆向阳

客户服务电话：0519-96005

联系人：蒋娇

联系电话：0519-80585939

网址：www.jnbank.com.cn

B 券商销售机构

(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

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

办公地址：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：0755-82130833

传真：0755-82133952

联系人：周杨

客户服务电话：95536

网址：www.guosen.com.cn

(4) 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

联系电话：021-33389888

联系人：曹晔

客户服务电话：95523 或 4008895523

电话委托：021-962505

网址：www.swhysc.com

(5) 华西证券股份有限公司

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：谢国梅

联系电话：010-68716150

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 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：胡永君

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

办公地址：深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋 04、18-21 层

法定代表人：高涛

联系人：万玉琳

联系电话：0755-82023442

客户服务热线：400 600 8008、95532

网址：www.china-invs.cn

(8) 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 号标志商务中心 A 栋 11 层

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：李欣

客户服务电话：400-888-1551

网址：www.xcsc.com

(9) 广发证券股份有限公司

注册地址：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、39、41、42、43、44 楼

法定代表人：孙树明

联系人：黄岚

联系电话：020-87555888

传真：020-87553600

客服电话：95575

网址：www.gf.com.cn

(10) 中信证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

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：张于爱

联系电话：010-60833799

传真：010-60833739

网址：www.citics.com

(11) 中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层（1507-1510 室）

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层

法定代表人：杨宝林

联系人：吴忠超

联系电话：0532-85022326

传真：0532-85022605

客户服务电话：0532-96577

网址：www.zxwt.com.cn

(12) 兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 268 号证券大厦

办公地址：上海市长柳路 36 号丁香国际商业中心东塔

法定代表人：兰荣

联系人：夏中苏

联系电话：0591-38281888

客户服务电话：95562

传真：0591-38507538

网址：www.xyzq.com.cn

(13) 国都证券股份有限公司

注册地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层办公地址

办公地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层（100007）

法定代表人：王少华

联系人：汪嘉楠

客户服务电话：400-818-8118

传真：010-84183311

网址：www.guodu.com

(14) 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：上海市肇嘉浜路750号

法定代表人：俞洋

联系人：陈敏

电话：021-64339000

传真：021-54668802

客户服务电话：021-32109999；029-68918888；4001099918

网址：www.cfsc.com.cn

（15）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：崔成

电话：027-87610052

传真：027-87618863

客户服务电话：4008005000

网址：<http://www.tfzq.com>

（16）中国国际金融股份有限公司

注册地址：北京市建国门外大街1号国贸写字楼2座27层及28层

办公地址：北京市建国门外大街1号国贸写字楼2座27层及28层

法定代表人：丁学东

电话：010-65051166

传真：010-85679203

联系人：杨涵宇

客户服务电话：400-910-1166

网址：www.cicc.com.cn

（17）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号西南证券大厦

法定代表人：吴坚

联系人：张煜

联系电话：023-63786141

客户服务电话：4008096096

传真：023-63786212

网址：www.swsc.com.cn

(18) 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

客户服务电话：400-860-8866

联系电话：029-63387256

联系人：黄芳

网址：www.kysec.cn

(19) 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18楼

法定代表人：刘学民

客户服务电话：4008881888

联系电话：0755-23838751

联系人：吴军

网址：www.firstcapital.com.cn

(20) 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12-18层

法定代表人：祝献忠

联系人：李慧灵

联系电话：010-85556100

传真：010-85556088

网址：www.hrsec.com.cn

C 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 号皇冠大厦 11 楼

法定代表人：彭文德

客户服务电话：400-8877-780

联系电话：023-86769742

联系人：谭忻

网址：www.cfc108.com

(2) 中信期货有限公司

注册地址：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 室、
14 层

办公地址：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 室、
14 层

法定代表人：张皓

客服电话：400-990-8826

联系人：洪诚

联系电话：0755-23953913

公司网站：www.citicsf.com

D 第三方销售机构

(1) 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：梁越

联系人：马鹏程

联系电话：010-57756074

客服电话：400-898-0618

网址：www.chtfund.com

(2) 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

(3) 北京展恒基金销售有限公司

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

传真：010-62020355

客服电话：4008188000

网址：www.myfund.com

(4) 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：韩爱彬

网址：www.fund123.cn

(5) 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：于扬

联系电话：021-20835888

客服电话：400-920-0022

网址：licaike.hexun.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 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：戴稽汉

网址：www.ehowbuy.com

(7) 上海陆金所资产管理有限公司

住所：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：何雪

联系电话：021-20662010

客服电话：4008219031

网址：www.lu.com

(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) 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：苗明

电话：021-58788678-8201

传真：021-58787698

客服电话：400-089-1289

公司网站：www.erichfund.com

(10) 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：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座 9 层

法定代表人：陈操

联系人：文雯

联系电话：010-83363101

客服电话：400-850-7771

网址：8.jrj.com.cn

(11) 深圳众禄基金销售有限公司

注册地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼

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

(12) 众升财富（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：北京市朝阳区望京浦项中心 A 座 9 层 04-08

法定代表人：王斐

联系人：付少帅

联系电话：010-53366702

客服电话：400-081-6655

网址：www.wy-fund.com

(13) 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：沈伟桦

联系人：刘梦轩

联系电话：010-52858244

客服电话：400-6099-500

网址：www.yixinfund.com

(14) 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：凌顺平

客服电话：(0571)56768888

传真：0571-88911818

联系人：刘宁

网址：www.10jqka.com.cn

(15) 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：尹伶

网址：www.txsec.com

(16) 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

办公地址：上海市杨浦区昆明路 508 号北美广场 B 座 12 楼

法定代表人：汪静波

客服电话：400-821-5399

传真：021-38509777

联系人：李娟

网址：www.noah-fund.com

(17) 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：孙成岩

联系电话：0571-88337717

客服电话：4000680058

网址：www.jincheng-fund.com

（18）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：邓鹏

联系电话：13981713068

客服电话：400-8878-566

网址：www.pyfund.cn

（19）珠海盈米财富管理有限公司

住所：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

联系电话：020-89629099

客服电话：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。

2、场内发售机构

具有基金销售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

注册地址：北京市西城区太平桥大街17号

办公地址：北京市西城区太平桥大街17号

法定代表人：周明

联系人：崔巍

联系电话：010-59378856

传真：010-59378907

（三）律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：韩炯

电话：（021）31358666

传真：（021）31358600

联系人：黎明

经办律师：吕红、黎明

（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

执行事务合伙人：李丹

联系电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

联系人：陈熹

经办注册会计师：单峰、陈熹

四、基金的名称

基金名称：鹏华丰和债券型证券投资基金（LOF）

五、基金的运作方式和类型

本基金为上市开放式、债券型证券投资基金。

六、基金的投资

（一）基金的投资

1、投资目标

通过严格的风险控制及积极的投资策略，力求最大限度获得高于业绩比较基准的收益。

2、投资理念

本基金通过灵活运用债券投资策略，在严格控制投资风险的前提下，实现基金资产的长期稳健增值。

3、投资范围

本基金主要投资于固定收益类证券，包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、中小企业私募债、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；同时投资于股票、权证等权益类证券以及法律、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证券的投资比例不低于基金资产的80%；股票等权益类证券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%。

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。

4、投资策略

（1）资产配置策略

在资产配置方面，本基金通过对宏观经济形势、经济周期所处阶段、国内外经济形势等分析，结合债券市场整体收益率曲线变化、股票市场整体走势预判等，选择配置合适的大类资产，并动态调整大类资产之间的比例。

（2）债券投资策略

本基金灵活应用久期策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、债券选择策略等，在合理管理并控制组合风险的前提下，最大化组合收益。

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他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。

①可转换债券投资策略

可转换债券是介于股票和债券之间的投资品种，具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特征。本基金首先将根据对债券市场、股票市场的比较分析，选择股性强、债性弱或特征相反的可转债列入当期可转债核心库，然后对具体个券的股性、债性做进一步分析比较，优选最合适的券种进入组合，以获取超额收益。

在选择可转换债券品种时，本基金将与本公司的股票投研团队积极合作，深入研究，力求选择被市场低估的品种，来构建本基金可转换债券的投资组合。

②中小企业私募债券投资策略

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。本基金主要采用买入并持有策略，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。

对于含认股权证及可转股条款的中小企业私募债券，本基金将遵循以下投资原则：

a. 发行时无法确定发行主体是否可以在交易所上市的品种，本基金将视其为普通中小企业私募债，主要以债项属性为基础进行投资决策。在持有过程中，除非发行主体实现上市，否则本基金将遵循这一原则，不进行认股权证的行使或者转股操作。

b. 发行时已经确定发行主体可在交易所上市的中小企业私募债，本基金在投资时候会在债项属性的基础上，结合相关认股权证或转股条款进行分析，采用相应的模型进行投资。

c. 在持有过程中，如果发行主体实现交易所上市，本基金将分析相关认股权证或转股条款的价值，并结合债项属性制定投资决策，根据市场情况及进行相应的投资操作。

（3）资产支持证券等品种投资策略

资产支持证券包括资产抵押贷款支持证券（ABS）、住房抵押贷款支持证券（MBS）等，其定价受多种因素影响，包括市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率等。

本基金将在基本面分析和债券市场宏观分析的基础上，结合蒙特卡洛模拟等数量化方法，对资产支持证券进行定价，评估其内在价值进行投资。

（4）股票投资策略

1) 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。

2) 二级市场股票投资策略

本基金通过综合分析上市公司的行业地位、竞争优势、盈利能力、成长性、估值水平等多种因素，精选具备较高成长性及估值合理的股票构建股票资产组合。

5、本基金业绩比较基准：

本基金业绩比较基准：中债综合指数收益率

中债综合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，适合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比较基准时，本基金管理人可以在与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案后变更本基金业绩比较基准并及时公告，而无需基金

份额持有人大会审议。

6、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、股票型基金，为证券投资基金中的低风险品种。

(二) 投资决策依据

- 1、国家有关法律、法规和本基金合同的有关规定；
- 2、国家宏观经济环境及其对证券市场的影响；
- 3、货币政策的变化和利率走势。

(三) 投资决策流程

1、投资决策委员会：确定本基金总体资产配置和投资策略。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。

七、基金投资组合报告（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。

本基金的托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，已于2016年10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2016年9月30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	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,280,433,711.90	92.85
	其中：债券	1,280,433,711.90	92.85
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	48,606,146.48	3.52
8	其他资产	49,943,808.20	3.62
9	合计	1,378,983,666.58	100.00

2、 报告期末按行业分类的股票投资组合

（1） 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

无。

（2） 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

无。

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

无。

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	80,104,000.00	6.66
2	央行票据	-	-
3	金融债券	49,990,000.00	4.16
	其中：政策性金融债	49,990,000.00	4.16
4	企业债券	1,016,799,584.40	84.56
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	133,325,000.00	11.09
7	可转债（可交换债）	215,127.50	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,280,433,711.90	106.48

5、 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	160017	16 附 息国债 17	800,000	80,104,000.00	6.66
2	122809	PR 准 国资	888,810	69,424,949.10	5.77
3	122613	PR 乌 海债	1,028,500	66,708,510.00	5.55
4	112446	16 申 宏 03	600,000	60,000,000.00	4.99
5	122836	PR 盘	700,680	58,590,861.60	4.87

		锦投			
--	--	----	--	--	--

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

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

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

无。

9、 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。

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	38,023.19
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	24,099,962.22
5	应收申购款	25,805,822.79
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	49,943,808.20

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

(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。

八、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。

基金合同生效以来的投资业绩及其与同期基准的比较如下表所示：

	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	1-3	2-4

				率标准差 4		
2012年11月5日(基金合同生效日)至 2012年12月31日	0.60%	0.09%	0.66%	0.01%	-0.06%	0.08%
2013年1月1日至 2013年12月31日	-1.09%	0.17%	4.25%	0.01%	-5.34%	0.16%
2014年1月1日至 2014年12月31日	22.60%	0.29%	4.22%	0.01%	18.38%	0.28%
2015年1月1日至 2015年12月31日	12.56%	0.33%	4.71%	0.03%	7.85%	0.30%
2016年1月1日至 2016年9月30日	6.70%	0.08%	3.37%	0.06%	3.33%	0.02%
自基金合同生效日至 2016年9月30日	46.51%	0.24%	17.85%	0.03%	28.66%	0.21%

九、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、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、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) 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0.8%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.8\% \div \text{当年天数}$$

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，经基金管理人和基金托管人双方核对后，由基金托管人于次月前 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、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，经基金管理人和基金托管人双方核对后，由基金托管人于次月前 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、公休日等，支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类”中第 3—9 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。

（三）与基金销售有关的费用

1、场外申购、赎回的价格、费用及其用途

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) 场外赎回费：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 < 30 天	0.3%
30 天 ≤ 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。

2、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《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。

（四）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、基金合同生效前的律师费、会计师费和信息披露费用等相关费用；
- 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。

（四）基金管理费、基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情降低基金管理费、基金托管费，此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。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。

（五）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、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》、《公开募集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和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“十、基金的投资”部分内容进行了更新。
- 6、对“十一、基金的业绩”的内容进行了更新。
- 7、对“二十三、其他应披露事项”内容进行了更新。

鹏华基金管理有限公司

2016年12月