



# 鹏华丰信分级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：上海银行股份有限公司 2017年12月

## 重要提示

鹏华丰信分级债券型证券投资基金（以下简称本基金）经 2013 年 7 月 18 日中国证券监督管理委员会《关于核准鹏华丰信分级债券型证券投资基金募集的批复》（证监许可[2013]938 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 10 月 22 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。

自基金合同生效之日起，丰信 A 自基金合同生效日起每半年开放一次，于丰信 A 的申购开放日接受申购，于丰信 A 的赎回开放日接受赎回，丰信 B 自基金合同生效日起每年开放一次接受投资者的申购或赎回。

总体来看，本基金属于具有中低风险收益特征的基金品种，其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金。从投资者具体持有的基金份额来看，由于基金收益分配的安排，丰信 A 份额将表现出低风险、低收益的明显特征，其预期收益和预期风险要低于普通的债券型基金份额，但基金管理人并不承诺或保证丰信 A 的约定收益，在极端情形下，比如基金资产在短期内发生大幅度的投资亏损时，丰信 A 的基金份额持有人可能会面临无法取得约定收益甚至损失本金的风险。丰信 B 份额则表现出高风险、高收益的显著特征，其预期收益和预期风险要高于普通的债券型基金份额。

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。

本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为 2017 年 10 月 21 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2017 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、成立日期：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、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。

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经理、资金财务总部副经理；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。

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。刘嵌先生，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，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，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总裁、党总支书记。

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，现任鹏华基金管理有限公司督察长。

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

戴钢先生，国籍中国，经济学硕士，15年证券基金从业经验。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02月担任鹏华丰泽债券

(LOF)基金基金经理，2012年06月担任鹏华金刚保本混合基金基金经理，2012年11月至2015年11月担任鹏华中小企债基金基金经理，2013年09月担任鹏华丰实定期开放债券基金基金经理，2013年09月担任鹏华丰泰定期开放债券基金基金经理，2013年10月担任鹏华丰信分级债券基金基金经理，2015年11月担任鹏华丰和基金基金经理，2016年03月担任鹏华丰尚定期开放债券基金基金经理，2016年04月担任鹏华金鼎保本混合基金基金经理，2016年08月担任鹏华丰饶债券基金基金经理。戴钢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：

2011年12月至2016年02月担任鹏华丰泽债券（LOF）基金基金经理

2012年06月担任鹏华金刚保本混合基金基金经理

2012年11月至2015年11月担任鹏华中小企债基金基金经理

2013年09月担任鹏华丰实定期开放债券基金基金经理

2013年09月担任鹏华丰泰定期开放债券基金基金经理

2015年11月担任鹏华丰和基金基金经理

2016年03月担任鹏华丰尚定期开放债券基金基金经理

2016年04月担任鹏华金鼎保本混合基金基金经理

2016年08月担任鹏华丰饶债券基金基金经理本基金历任的基金经理：

2013年10月至本更新招募书截止日戴钢先生

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。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

1、基本情况名称：上海银行股份有限公司（以下简称“上海银行”）

住所：中国(上海)自由贸易试验区银城中路 168 号办公地址：中国(上海)自由贸易试验区银城中路 168 号法定代表人：金煜

成立时间：1995 年 12 月 29 日

组织形式：股份有限公司（中外合资、上市）注册资本：

人民币 78.05785 亿元存续期间：持续经营

基金托管业务批准文号：中国证监会证监许可[2009]814 号

托管部门联系人：闻怡电话：021-68475888 传真：021-68476936

上海银行成立于 1995 年 12 月 29 日，是一家由国有股份、中资法人股份、外资股份及个人股份共同组成的股份制商业银行，总行位于上海，是上海证券交易所主板上市公司，股票代码 601229。

近年来，上海银行以“精品银行”为战略愿景，以“精诚至上，信义立行”为企业核心价值观，以“总体形成特色、区域兼顾差异、局部凸显亮点”为指导思想，持续推进专业化经营和精细化管理，经营实力和发展能力明显提升。根据市场和自身优势，上海银行形成了“中小企业综合金融服务”、“城市居民财富管理和养老金融服务”、“金融市场领先交易服务”、“两岸三地跨境金融服务”以及“最佳在线金融服务”等特色定位，通过培育和塑造经营特色，推动结构调整和转型发展，增强可持续发展能力。

目前，上海银行在上海、宁波、南京、杭州、天津、成都、深圳、北京、苏州、无锡、绍兴、南通、盐城等地拥有分支机构和营业网点 311 个，设有自助银行 211 个，布放自助服务类终端设备 2167 台，初步形成了覆盖长三角、环渤海、珠三角、中西部重点城市的网络布局框架。上海银行还发起设立闵行上银、衢江上银、江苏江宁上银和崇州上银村镇银行，发起成立上银基金管理有限公司，在香港地区设立上海银行（香港）有限公司，并与全球 130 多个国家和地区近 1600 多家境内外银行及其分支机构建立了代理行关系。

成立 20 年来，上海银行市场竞争力和影响力不断提高，在英国《银行家》2017 年公布的“全球前 1000 家银行”排名中，按一级资本和总资产计算，上海银行分别位列全球银行业第 85 位和 89 位；多次被《亚洲银行家》杂志评为“中国最佳城市零售银行”，先后荣获“上海市著名商标”、“全国银行间市场优秀交易成员”、“最佳企业形象奖”、“中国银行业发展论坛-最佳城市商业银行”、“上海清算所 2015 年度优秀清算会员”、“债券净额清算优秀奖”、“2015 年度上海市金融创新二等奖”、“2015 年度银行间本币市场交易 200 强”等荣誉称号，并当选第二届中国银行业协会城商行工作委员会主任单位。

截至 2016 年底，上海银行资产总额 17,553.71 亿元，较期初增长 21.13%；客户存款余额为 8,490.73 亿元，较期初增长 7.11%；客户贷款和垫款总额为 5,540 亿元，较期初增长 3.26%；资本充足率为 13.17%；拨备覆盖率 255.50%。



## 2、主要人员情况

上海银行总行下设资产托管部，是从事资产托管业务的职能部门，内设产品管理部、托管运作部（下设托管运作团队和运行保障团队）、稽核监督部，平均年龄 30 岁左右，100%员工拥有大学本科以上学历，业务岗位人员均具有基金从业资格。

## 3、基金托管业务经营情况

上海银行于 2009 年 8 月 18 日获得中国证监会、中国银监会核准开办证券投资基金托管业务，批准文号：中国证监会证监许可[2009]814 号。

截至 2017 年 9 月 30 日，上海银行已托管 28 只证券投资基金，分别为天治成长精选混合型证券投资基金、浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金（LOF）、中证财通中国可持续发展 100（ECPI ESG）指数增强型证券投资基金、鹏华双债增利债券型证券投资基金、浦银安盛季季添利定期开放债券型证券投资基金、鹏华双债保利债券型证券投资基金、鹏华丰信分级债券型证券投资基金、前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金、万家现金宝货币市场证券投资基金、中银安心回报半年定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛月月盈安心养老定期支付债券型证券投资基金、申万菱信中证申万传媒行业投资指数分级证券投资基金、华安添颐养老混合型发起式证券投资基金、万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞兴灵活配置混合型证券投资基金基金、博时裕荣纯债债券型证券投资基金、浙商惠盈纯债债券型证券投资基金、兴业福益债券型证券投资基金、大成慧成货币市场证券投资基金、嘉实稳瑞纯债债券型证券投资基金、嘉实稳祥纯债债券型证券投资基金、博时裕弘纯债债券型证券投资基金、鹏华兴益定期开放灵活配置混合型基金、博时悦楚纯债债券型证券投资基金、华泰柏瑞爱利灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞富灵活配置混合型证券投资基金、博时富海纯债债券型证券投资基金以及博时盈海纯债债券型证券投资基金，托管基金的资产净值合计 418.21 亿元。

## 基金托管人的内部控制制度

### 1、内部控制目标

严格遵守国家有关法律法规、行业监管规章和本行有关规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金资产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

### 2、内部控制组织结构

上海银行基金托管业务内部风险控制组织结构是由总行风险管理部门和资产托管部共同组成。托管业务风险控制纳入全行的风险管理体系；资产托管部配备专职人员负责托管业务内控稽核工作，各业务部室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

### 3、内部控制的原则

（1）全面性原则：监督制约必须渗透到托管业务的全过程和各个操作环节，覆盖到资产托管部所有的部室、岗位和人员。（2）独立性原则：资产托管部内设独立的稽核监督团队，保持高度的独立性和权威性，负责对托管业务风险控制工作进行指导和监督。

（3）相互制约原则：各业务部室在内部组织结构上形成相互制约，建立不同岗位之间的制衡体系。

（4）审慎性原则：内控与风险管理必须以防范风险、审慎经营为前提，保证托管资产的安全与完整；托管业务经营管理必须按照“内控优先”的原则，在新设机构或新增业务时，做到先期完成相关制度建设。

（5）有效性原则：内部控制体系应与所处的环境相适应，以合理的成本实现内控目标，内部制度的制订应当具有前瞻性，并应当根据国家政策、法律及经营管理的需要，适时进行相应修改和完善；内部控制应当具有高度的权威性，任何人不得拥有不受内部控制约束的权力，内部控制存在的问题应当能够得到及时反馈和纠正。

### 4、内部控制制度及措施

- (1) 建立明确的岗位职责、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。
- (2) 建立托管业务前后台分离，不同岗位相互牵制的管理结构。
- (3) 专门的稽核监督人员组织各业务部室进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施。
- (4) 托管业务操作间实施门禁管理和音像监控。
- (5) 定期开展业务与职业道德培训，使员工树立风险防范与控制理念，并签订承诺书。
- (6) 制定完备的应急预案，并组织员工定期演练；建立异地灾备，保证业务连续不中断。

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

基金托管人负有对基金管理人的投资运作行使监督权的职责。根据《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定，托管人对基金的投资对象和范围、投资组合比例、投资限制、费用的计提和支付方式、基金会计核算、基金资产估值和基金净值的计算、收益分配、申购赎回以及其他有关基金投资和运作的事项，对基金管理人进行业务监督、核查。

基金托管人发现基金管理人违反法律法规和基金合同的行为，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。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。基金托管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，并将纠正结果报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。

基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。

### 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：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 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、其他销售机构

### (1) 银行销售机构

1) 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](http://www.drcbank.com)

2) 福建海峡银行股份有限公司注册地址：福建省福州市晋安区六一北路 158 号办公地址：福建省福州市晋安区六一北路 158 号法定代表人：苏素华

联系人：黄钰雯

客户服务电话：400-893-9999 网址：[www.fjhxbank.com](http://www.fjhxbank.com)

3) 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](http://www.sdebank.com)

4) 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

5) 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：  
李宏鸣  
联系人：叶卓伟  
客户服务电话：4008896588 网址：www.hsbank.com.cn

6) 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

7) 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

8) 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：  
牛锡明  
联系人：张宏革  
客户服务电话：95559

网址: [www.bankcomm.com](http://www.bankcomm.com) 9) 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](http://bank.pingan.com)

10) 上海银行股份有限公司注册地址: 中国(上海)自

由贸易试验区银城中路 168 号办公地址: 中国(上海)自由

贸易试验区银城中路 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](http://www.bankofshanghai.com)

11) 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](http://www.cib.com.cn)

12) 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](http://www.cmbchina.com)

13) 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](http://www.icbc.com.cn)

14) 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](http://www.ccb.com)

15) 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](http://www.cmbc.com.cn)

16) 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](http://www.psbc.com)

17) 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](http://www.crbank.com.cn)

## (2) 证券公司销售机构

1) 大同证券有限责任公司注册地址：山西省大同市城区迎宾街 15 号桐城中央 21

层办公地址：山西省太原市小店区长治路世贸中心 12 层法定代表人：董祥

联系人：薛津

客户服务电话：4007-121212 网址：www.dtsbc.com.cn

2) 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

3) 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

4) 华西证券股份有限公司注册地址：四川省成都市高新区天府二街 198 号华西证

券大厦办公地址：四川省成都市高新区天府二街 198 号华西证券大厦法定代表人：杨炯洋

联系人：谢国梅

客户服务电话：95584

网址：www.hx168.com.cn

5) 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) /021-32109999/029-68918888 网址：

www.cfsc.com.cn

6) 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：400-860-8866

网址：www.kysec.cn

7) 民生证券股份有限公司注册地址：北京市东城区建国门内大街28号民生金融

中心A座16-20层办公地址：北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心

A座16-20层法定代表人：冯鹤年

联系人：韩秀萍

客户服务电话：95376 网址：www.msyzq.com

8) 平安证券股份有限公司注册地址：深圳市福田区中心区金田路4036号荣超大厦

16-20层办公地址：深圳市福田区中心区金田路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

9) 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

10) 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



11) 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

12) 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：吴坚

联系人：张煜

客户服务电话：4008096096、95355 网址：swsc.com.cn

13) 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

（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 号皇冠大厦 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

（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

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：熊小满

客户服务电话：010-56282140 网址：www.hcjijin.com

5) 北京增财基金销售有限公司注册地址：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

客户服务电话：400-001-8811 网址：www.zcvc.com.cn

6) 泛华普益基金销售有限公司注册地址：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

客户服务电话：400-8878-566

网址：www.pyfund.cn

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](http://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](http://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.snjjjin.com](http://www.snjjjin.com)

10) 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司注册地址：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](http://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/websiteIII/html/index.html](http://www.erichfund.com/websiteIII/html/index.html)

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：王诗琦  
客户服务电话：400-700-9665 网址：www.ehowbuy.com

13) 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

14) 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：何雪  
客户服务电话：400-821-9031  
网址：www.lu.com

15) 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

16) 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  
客户服务电话：010-58325327  
网址：8.jrj.com.cn

17) 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 楼办公地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼法定代表人：薛峰联系人：邓爱萍

客户服务电话：4006-788-887

网址：[www.zlfund.cn](http://www.zlfund.cn)、[www.jjmmw.com](http://www.jjmmw.com)

18) 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/](http://www.jjm.com.cn/)

19) 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：400-6099-500 网址：[www.yixinfund.com](http://www.yixinfund.com)

20) 浙江金观诚财富管理有限公司注册地址：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 楼金观诚法定代表人：徐黎云

联系人：来舒岚

客户服务电话：400-068-0058 网址：[www.jincheng-fund.com](http://www.jincheng-fund.com)

21) 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：(0571)56768888

网址：[www.5ifund.com](http://www.5ifund.com)

22) 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

23) 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

24) 珠海盈米财富管理有限公司注册地址: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)  
82021106

传真:(0755)82021165 负责人:吴群莉

## (三) 律师事务所

名称:上海通力律师事务所

住所:上海市银城中路68号时代金融中心19楼法定代表人:俞卫锋

办公室地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼联系电话：021-31358666

传真：021-31358600 联系人：陈颖华

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 楼法定代表人：杨绍信

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：陈熹

经办会计师：许康玮、陈熹

## 四、基金的名称

本基金名称：鹏华丰信分级债券型证券投资基金

## 五、基金运作方式及类型

债券型证券投资基金

## 六、基金的投资目标

通过对宏观经济和固定收益市场的研究分析，在严格控制风险的基础上采取积极主动的投资策略，力争取得超越基金业绩比较基准的收益。

## 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、中小企业私募债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股票增发，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%。

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。

### （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类资产之间进行动态调整。

### （2）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) 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。

### (3) 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。

### (4) 中小企业私募债的投资策略

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，合理合规合格地进行中小企业私募债券投资。本基金将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，尽力避免可能存在的债券违约。

### (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。

## 九、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准为：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](http://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，本基金管理人可以在报中国证监会备案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

本基金是债券型证券投资基金，属于具有中低风险收益特征的基金品种，其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金。从投资者具体持有的基金份额来看，由于基金收益分配的安排，丰信 A 份额将表现出低风险、低收益的明显特征，其预期收益和预期风险要低于普通的债券型基金份额；丰信 B 份额则表现出高风险、高收益的显著特征，其预期收益和预期风险要高于普通的债券型基金份额。

## 十一、基金的投资组合报告

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。

基金托管人上海银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

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	1,261,196,691.60	93.11
	其中：债券	1,261,196,691.60	93.11
	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	41,530,243.55	3.07
	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	25,187,821.11	1.86
8	其他资产	26,575,173.23	1.96
9	合计	1,354,489,929.49	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

注：无。

(2) 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合注：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注：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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	50,110,000.00	3.70
	其中：政策性金融债	50,110,000.00	3.70

4	企业债券	798,619,911.60	59.01
5	企业短期融资券	371,621,000.00	27.46
6	中期票据	40,484,000.00	2.99
7	可转债（可交换债）	361,780.00	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,261,196,691.60	93.19

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	011761026	17 柯桥国资 SCP002	1,300,000	130,572,000.00	9.65
2	122806	11 渭南 02	504,000	50,883,840.00	3.76
3	041662053	16 沪世茂 CP002	500,000	50,230,000.00	3.71
4	150207	15 国开 07	500,000	50,110,000.00	3.70
5	112323	16 投资 01	500,000	47,960,000.00	3.54

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注：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注：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注：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注：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	369,644.42
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	26,205,528.81
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	26,575,173.23

(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	128013	洪涛转债	101,190.00	0.01

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明注：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。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，也不保证最低收益。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。

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）：

	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
2013年10月22日（基金合同生效日）至2013年12月31日	-0.80%	0.18%	-2.12%	0.15%	1.32%	0.03%

2014年1月1日至2014年12月31日	20.67%	0.26%	11.23%	0.15%	9.44%	0.11%
2015年1月1日至2015年12月31日	14.52%	0.34%	8.03%	0.11%	6.49%	0.23%
2016年1月1日至2016年12月31日	2.27%	0.12%	1.30%	0.12%	0.97%	0.00%
2017年1月1日至2017年9月30日	1.49%	0.08%	-0.32%	0.09%	1.81%	-0.01%
自基金合同生效日至2017年9月30日	42.69%	0.23%	18.76%	0.13%	23.93%	0.10%

### 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、丰信A销售服务费；
- 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、律师费和诉讼费；
- 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0.4%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$$

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0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

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 5 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。

### 3. 丰信 A 销售服务费

自本基金合同生效之日起，丰信 A 收取销售服务费，丰信 B 不收取销售服务费。丰信 A 的销售服务费年费率为 0.35%。

丰信 A 销售服务费计提的计算公式如下：

$$H=E \times 0.35\% \div \text{当年天数}$$

H 为丰信 A 每日应计提的销售服务费

E 为前一日丰信 A 基金份额参考净值或基金份额净值与丰信 A 份额数的乘积

丰信 A 销售服务费每日计算，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丰信 A 销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 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。

自 2017 年 3 月 6 日起，基金管理人 对鹏华丰信分级债券型证券投资基金 A 类份额开展销售服务费费率优惠活动，销售服务费费率由 0.35% 调整为 0.01%。

上述“一、基金费用的种类中第 4—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) 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。

(五) 与基金销售有关的费用

(1) 申购费用丰信 A 的申购费率为 0。

丰信 B 的申购费率按照申购金额递减，即申购金额越大，所适用的申购费率越低。丰信 B 的申购费率如下：

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保险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。如将来出现经养老金监管部门认可的新的养老金类型，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丰信 B 的养老金客户适用下表特定申购费率，其他投资人申购本基金基金份额的适用下表一般申购费率：

申购金额 M (元)	一般申购费率	特定申购费率
M < 100 万	0.6%	0.24%
100 万 ≤ M < 500 万	0.3%	0.09%
M ≥ 500 万	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、登记等各项费用。

丰信 B 的申购费用由申购人承担，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用，不列入基金财产。费率如发生变更，基金管理人应在调整实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在至少一种指定媒体上公告。对特定交易方式（如网上交易、电话交易等），基金管理人可以对丰信 B 采用低于柜台交易方式的申购费率，并另行公告。

## （2）赎回费率

### 1) 丰信 A 的赎回费

丰信 A 的赎回费率按照持有期限递减，即持有期限越长，所适用的赎回费率越低。丰信 A 持有期限为丰信 A 的一个开放周期的，赎回费率为 0.1%；持有期限超过丰信 A 的 1 个开放周期的，赎回费率为 0。赎回费全额归入基金资产。

### 2) 丰信 B 的赎回费丰信 B 的赎回费率为 0。

## （六）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》、《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、 在“第三部分基金管理人”部分内容进行了更新。
- 3、 在“第四部分基金托管人”部分内容进行了更新。
- 4、 在“第五部分相关服务机构”部分内容进行了更新。
- 5、 在“第八部分基金份额的申购与赎回”部分内容进行了更新。
- 6、 在“第九部分基金投资”部分内容进行了更新。
- 7、 在“第十部分基金业绩”部分内容进行了更新。
- 8、 在“第二十一部分对基金份额持有人的服务”部分内容进行了更新。
- 9、 在“第二十二部分其他披露事项”部分内容进行了更新。

鹏华基金管理有限公司

2017年12月