

鹏华丰腾债券型证券投资基金更新的招募说明书摘要

(2020 年第 2 号)

基金管理人:鹏华基金管理有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司
2020 年 4 月 20 日

重要提示
本基金经 2016 年 9 月 9 日中国证券监督管理委员会下发的《关于准予鹏华丰腾债券型证券投资基金注册的批复》注册,进行募集。根据相关法律法规,本基金合同已于 2016 年 10 月 27 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注册,但中国证监会对本基金募集的注册,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,也不表明其对本基金没有风险。

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较低风险收益特征的品种。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,充分认知基金的风险承受能力,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。

本基金投资范围包括中小企业私募债券,中小企业私募债券的流动性风险在于该类债券采取非公开方式发行和交易,由于不公开资料,外部评级机构一般不对这类债券进行外部评级,可能会降低市场对该类债券的认可度,从而影响该类债券的流动性。中小企业私募债券的信用风险在于该类债券发行主体的资产规模较小、经营的波动性较大,同时,各类募集说明书信息披露不充分,审计报告不公开发布,也大大提高了分析并跟踪发债主体信用基本面的难度。

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业绩的保证。

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,由投资者自行承担。投资有风险,在投资本基金前应认真阅读该基金的招募说明书、基金合同和基金产品资料概要。

招募说明书约定的基金产品资料概要编制、披露与更新要求,自《信息披露办法》实施之日起一年开始执行。

本次招募说明书更新仅涉及《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》第十二条中与招募说明书内容有关的一项或多项重大变更,具体事项请参考基金管理人最近三个交易日内披露的关于上述重大变更的相关公告。

第一部分 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)182012133 传真:(0755)1820121155
- 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%
意大利欧利盛资产管理股份公司(Eurizon Capital 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、副董事长、投资部总经理、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副主任科员、中共贵州省委政策研究室副主任、深圳证券结算公司常务副总经理、深圳证券交易基金部总经理、香港证券(集团)有限公司助理总经理、香港兴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(Enurzon Capital SGR,S.p.A.)首席执行长兼首席财务官。

Massimo Mazzini 先生,董事,经济和商科学士,国籍:意大利。曾在安达仕集团(Arthur Andersen MBA)从事风险管理和资产管理工作,历任 CA-IPMG SGR 投资总监、CAAM AF SGR 及 CA-IPMG 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(Euro AM SCAR)投资副总监、农银汇理另类投资基金(Credic Agricole Alternative Investments Group)国际执行长兼首席意大利和欧洲资产管理股份股份公司(Eurizon Capital SGR,S.p.A.)投资方兼首席投资总监、Epsilon 资产管理股份股份公司(Epsilon SGR)首席执行官和投资总监、欧利盛资本股份股份公司(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股份公司(Eurizon Capital SGR,S.p.A.)市场及业务发展总监。

Andrea Visman 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银行(Credit Agricole Group)东方汇理资产管理股份股份公司(CAAM AF SGR)法律部、农产品开发、欧利盛资本资产管理股份股份公司(Eurizon Capital SGR,S.p.A.)治理与股权部门工作,现任意大利欧利盛资本资产管理股份股份公司(Eurizon Capital SGR,S.p.A.)董事会秘书兼兼任企业事务部总经理、欧利盛资本股份股份公司(Eurizon Capital S.A.) (卢森堡)首席财务官兼财务总监。

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部总部业务经理、深圳国际证券服务有限责任公司、资金财务部高级经理、总经理助理、副总经理、人力资源部高级经理兼人力资源部、国信证券股份有限公司人力资源部负责人、资金财务部总部经理兼人力资源部高级经理。

史广东先生,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,大学本科学士,国籍:中国。曾任新疆军区干事、秘书、编辑,甘肃省委研究室主任、副处长、处长、副主任,中央金融工委办公室研究室主任,中国银监会政策法规部(研究局)主任(主持)等职务,2005 年 6 月至 2010 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。曾在中国进出口银行副行长、负责贷款管理和运营,项目涉及制造业、能源、电力、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(中国)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,现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计、上海营业部财务科副科长、资金财务部财务科助理、资金财务部资金财务部计、资金财务部主任会计师兼经理助理、资金财务部基金运营助理、资金财务部总部总经理等,现任国信证券股份有限公司总部副经理兼运营管理部总经理、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院部、税务事务处等,从事特汽车发动机和变速器生产管控管理团队工作、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门工作,曾任欧利盛资本资产管理股份股份公司(Eurizon Capital SGR,S.p.A.)财务和管理助理,现任欧利盛资本资产管理股份股份公司(Eurizon Capital SGR,S.p.A.)财务负责人。

尹丹女士,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专员,现任监察稽核部总经理助理。

杨文先生,职工监事,大专学历,国籍:中国。历任深圳奥尊电脑电子有限公司基金业务部副经理,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。

刘悦先生,职工监事,管理学硕士,国籍:中国。历任华信(中国)资源顾问公司咨询顾问,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、首席市场营销兼市场发展部、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、党委书记、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,财通基金管理有限公司助理价值增长基金基金经理,固定收益部总经理,基金估值与核算、基金法律合规经理、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)副主任等,并于 2014 年至 2015 年期间担任中国证监会第 16 届上市公司并购重组专家咨询委员会委员,鹏华基金管理有限公司。

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经理、监察稽核部副

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、投资管理部、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监助理助理,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、基金管理部副经理。

高永先生,纪委书记、督察长、法律事务,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、秘书及副处级秘书,发行监管部中央分办秘书,人事教育部处长、处长,现任鹏华基金管理有限公司纪委书记、督察长。

郝卫先生,副总裁,经济学博士,国籍:中国。历任中央银行发行银行局主任科员,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基金经理,固定收益部总监,现任鹏华基金管理有限公司副经理、固定收益部总监。

4、本基金基金经理

刘涛先生,国籍:中国,金融学硕士,6 年证券基金从业经验。2013 年 4 月加盟鹏华基金管理有限公司,从事债券投资研究工作,担任固定收益部债券研究员,现任担任公募债券投资部基金基金经理。2016 年 05 月担任鹏华丰腾定期开放债券基金基金经理。2016 年 05 月至 2018 年 08 月担任鹏华国金债券基金基金经理。2016 年 11 月担任鹏华丰腾债券基金基金经理,2017 年 02 月于 2017 年 09 月担任鹏华丰安债券基金基金经理。2017 年 02 月至 2019 年 02 月担任鹏华丰达债券基金基金经理。2017 年 02 月至 2019 年 05 月担任鹏华丰利债券基金基金经理。2017 年 02 月担任鹏华丰腾债券基金基金经理,2017 年 05 月担任鹏华丰瑞债券基金基金经理。2017 年 05 月担任鹏华晋发债券基金基金经理,2018 年 03 月担任鹏华弘盛混合基金基金经理,2018 年 03 月至 2018 年 12 月担任鹏华实业债基金基金经理,2018 年 07 月担任鹏华晋悦发起式定开债券基金基金经理,2018 年 10 月担任鹏华 3 个月中短债基金基金经理。2018 年 12 月担任鹏华永诚一年定期开放债券基金基金经理,2019 年 03 月担任鹏华永融一年定期开放债券基金基金经理。2019 年 03 月担任鹏华永润一年定期开放债券基金基金经理。刘涛先生具备基金从业资格。

2016 年 05 月担任鹏华丰腾定期开放债券基金基金经理
2016 年 05 月至 2018 年 08 月担任鹏华国金债券基金基金经理
2016 年 11 月担任鹏华丰利债券基金基金经理
2017 年 02 月至 2017 年 09 月担任鹏华丰安债券基金基金经理
2017 年 02 月至 2018 年 06 月担任鹏华丰达债券基金基金经理
2017 年 02 月至 2019 年 02 月担任鹏华丰利债券基金基金经理
2017 年 05 月担任鹏华晋发债券基金基金经理
2017 年 05 月担任鹏华弘盛混合基金基金经理
2018 年 03 月担任鹏华实业债基金基金经理
2018 年 03 月至 2018 年 12 月担任鹏华实业债基金基金经理
2018 年 07 月担任鹏华晋悦发起式定开债券基金基金经理
2018 年 10 月担任鹏华 3 个月中短债基金基金经理
2018 年 12 月担任鹏华永诚一年定期开放债券基金基金经理
2019 年 03 月担任鹏华永融一年定期开放债券基金基金经理
2019 年 03 月担任鹏华永润一年定期开放债券基金基金经理
张丽娟女士,国籍:中国,金融学硕士,9 年证券从业经验。2011 年 6 月加盟鹏华基金管理有限公司,历任营销策划助理兼营销策划助理、高级营销策划助理,2015 年 6 月任职于固定收益部,历任研究员,高级研究员,现任担任公募债券投资部,从事研

究分析工作。2020 年 02 月担任鹏华丰华债券基金基金经理,2020 年 02 月担任鹏华纯债债券基金基金经理,2020 年 02 月担任鹏华丰腾债券基金基金经理

张女士具备基金从业资格;
本基金基金经理管理的其他基金情况:
2020 年 02 月担任鹏华丰华债券基金基金经理
2020 年 02 月担任鹏华纯债债券基金基金经理
本基金历任基金经理:
2016 年 10 月至 2018 年 05 月 刘太阳先生
2018 年 07 月至 2020 年 02 月 方昶先生

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。2016 年 05 月担任鹏华丰腾定期开放债券基金基金经理,2016 年 05 月至 2018 年 08 月担任鹏华国金债券基金基金经理。2016 年 11 月担任鹏华丰腾债券基金基金经理,2017 年 02 月于 2017 年 09 月担任鹏华丰安债券基金基金经理。2017 年 02 月至 2019 年 02 月担任鹏华丰达债券基金基金经理。2017 年 02 月至 2019 年 05 月担任鹏华丰利债券基金基金经理。2017 年 02 月担任鹏华丰腾债券基金基金经理,2017 年 05 月担任鹏华丰瑞债券基金基金经理。2017 年 05 月担任鹏华晋发债券基金基金经理,2018 年 03 月担任鹏华弘盛混合基金基金经理,2018 年 03 月至 2018 年 12 月担任鹏华实业债基金基金经理,2018 年 07 月担任鹏华晋悦发起式定开债券基金基金经理,2018 年 10 月担任鹏华 3 个月中短债基金基金经理。2018 年 12 月担任鹏华永诚一年定期开放债券基金基金经理,2019 年 03 月担任鹏华永融一年定期开放债券基金基金经理。2019 年 03 月担任鹏华永润一年定期开放债券基金基金经理。刘涛先生具备基金从业资格。

6、上述人员之间不存在近亲属关系。
第二部分 基金托管人
(一)基金托管人概况
1、基本情况
名称:中国民生银行股份有限公司(以下简称“中国民生银行”)
住所: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
成立时间:1996 年 2 月 7 日
基金托管业务批准文号:证监基金字[2004]101 号
组织形式:其他有限责任公司(上市)
注册资本:28,365,585,227 元人民币
存续期间:持续经营
电话:010-58560666
联系人:罗菲菲

中国民生银行是我国首家主要由非公有制企业入股的全股份制商业银行,同时又是严格按照《公司法》和《商业银行法》建立的股份制金融企业。多种经济成份在中国金融业的规范和实现规范的现代企业制度,使中国民生银行有别于国有银行和其他商业银行,更利于提高经济效益、金融界所关注。中国民生银行成立十多年来,业务不断拓展,规模不断扩大,效益逐年递增,并保持了快速健康的发展势头。

2000 年 12 月 19 日,中国民生银行 A 股股票(600016)在上海证券交易所挂牌上市。2003 年 3 月 18 日,中国民生银行 40 亿可转换公司债券在上交所正式挂牌发行。2004 年 11 月 8 日,中国民生银行通过银行间债券市场成功发行了 58 亿元人民币次级债券,成为中国第一家在全国银行间债券市场成功私募发行次级债券的商业银行。2005 年 10 月 26 日,民生银行成功完成股权分置改革,成为国内首家完成股权分置改革的商业银行。为中国资本市场股权分置改革提供了成功范例。2009 年 11 月 26 日,中国民生银行在香港交易所挂牌上市。

中国民生银行自上市以来,按照“团结奋进,开拓创新,培育人才;严格管理,规范行为,敬业守规;讲究质量,提高效益,健康发展”的经营发展方针,在改革发展与管理等方面进行了有益探索,先后推出了“大集中”科技平台、“两率”考核机制、“三卡”工程、直联授信制度、八大基础管理系统、集中处理商业模式及事业部改革等制度创新,实现了低风险、低增长、高效益的战略目标,树立了充满生机与活力的崭新的商业银行新形象。

民生银行荣获第十三届上市公司“金圆桌”优秀董事会奖;
民生银行在华夏时报社主办的第十一届金蝉奖评选中荣获“2017 年度小微金融服务先锋”奖;

民生银行荣获《亚洲货币》杂志颁发的“2016 中国最佳财富管理私人银行”奖项;
民生银行荣获新浪财经颁发的“年度最佳电子银行”及“年度直销银行十强”奖项;
民生银行荣获 VISA 颁发的“最佳产品设计创新奖”;

民生银行在财经观察网举办的“中国卓越金融奖”评选中荣获“年度卓越资产管理银行”;

民生银行荣获全球银行同业协会颁给的“2016 年度银行间本币市场优秀交易商”、“2016 年度银行间本币市场优秀衍生品交易商”及“2016 年度银行间本币市场优秀债券交易商”奖项;

民生银行荣获中国银行业间交易协会授予的“2016 年度优秀综合做市机构”和“2016 年度优秀信用做市机构”奖项;

民生银行荣获美国 WPP(全球最大的传媒集团之一)颁发的“2017 年度最具品牌价值中国品牌 100 强”;

民生银行在中国资产证券化论坛会上被授予“2016 年度优秀融资奖”。

2、主要人员情况

张庆先生,中国民生银行资产托管部总经理,博士研究生,具有基金托管人高级管理从业资格,从事过金融租赁、证券投资、银行管理等工作,具有 25 年金融从业经历,不仅有多年的一线实战经验,还有扎实的总部管理经验。历任中国民生银行西安分行副行长、中国民生银行沈阳分行筹备组组长、行长、党委书记。

中国民生银行股份有限公司于 2004 年 7 月 9 日获得基金托管资格,成为《中华人民共和国证券投资基金法》颁布后首家获批从事基金托管业务的银行。为了更好地发挥后发优势,大力发展托管业务,中国民生银行股份有限公司资产托管部从成立伊始就本着充分保护基金持有人利益、为客户提供全面综合金融服务的原则,高起点地建立系统、完善制度、组织人员。资产托管部目前共有员工 71 人,平均年龄 37 岁,100%以上拥有大学本科以上学历,62.5%以上员工具有硕士以上文化。

中国民生银行资产托管部配备了完善、专业的业务支持系统,搭建了专业的经营管理体系,依托丰富的资产管理经验,依托专业的托管平台及先进的托管业务平台,为境内外客户提供安全、准确、及时、高效的专项托管服务。截至 2019 年 3 月 31 日,中国民生银行已托管 182 只证券投资基金。中国民生银行资产托管部于 2018 年 2 月 6 日发布了“爱托管”品牌,近百条业务渠道及服务客户代表的受邀参加启动仪式。资产托管部始终坚持以客户为中心,致力于为客户提供全面综合金融服

务。对内大力整合内外部资源,对外广泛搭建客户服务平台,向各类托管客户提供专业、增值、综合的托管综合金融服务,得到业内广泛认可,也在市场上树立了品牌口碑。成为市场一致认可的托管银行。自 2010 年以来,中国民生银行荣获《金融理财》杂志颁发的“最具潜力托管银行”、“最佳创新托管银行”、“金牌理财产品托管银行”奖和“年度金牌托管银行”奖,荣获《21 世纪经济报道》颁发的“最佳金融理财产品托管银行”奖。

(二)基金托管人的内部控制制度

1、内部风险控制目标
(1)建立完整、密、高效的风险控制体系,形成科学的决策机制、执行机制和监督机制,防范和化解经营风险,保障资产托管业务的稳健运行和托管财产的安全完整。

(2)大力培育合规文化,自觉形成合规经营、规范运作的经营思想和经营理念,严格控制合规风险,保证资产托管业务符合国家和有关法律法规和行业监管制度。

(3)以相互制衡健全有效的风险控制组织结构为保障,以完善健全的制度为基础,以落实到位的过程控制为着眼点,以先进的信息技术手段为支撑,建立全面、系统、动态、主动、有利于差错防、堵塞漏洞、消除隐患,保证业务稳健运行的风险控制制度,确保托管业务运行安全、准确、及时。

2、内部风险控制原则
总行高级管理层负责部署全行的风险管理工作。总行风险管理委员会是总行高级管理层下设的风险管理专业委员会,对高级管理层负责,支持高级管理层开展职责。资产托管业务风险控制工作在总行风险管理委员会的统一部署和指导下去开展。

3、总行各部门紧密配合,共同把控资产托管业务运行中的风险,具体职责分工如下:总行风险管理部与质量监控部作为总行风险管理委员会秘书机构,是总行风险管理的统筹部门,对资产托管部的风险控制工作进行指导;总行法律合规部负责资产托管业务外部法律法规、监管政策等合规问题,负责制定资产托管业务合规审查、检查与评估整改;总行审计部对资产托管业务进行内部审计,包括定期和不定期审计,现场和非现场检查;总行办公室(品牌管理中心)与资产托管部共同制定声誉风险应对预案。资产托管部需求对与资产托管业务有关的声誉风险事件进行及时舆情监测,由由托管业务引起的声誉风险进行应急处置,包括有全国性媒体进行沟通、避免负面报道、组织正面回应等。

4、内部风险控制措施
(1)合法合规原则。风险控制应符合和体现国家法律、法规、规章和各级政策。

(2)风险性原则。风险控制覆盖资产托管的各个业务中心、各个岗位和各级人员,并涵盖资产管理业务各环节。

(3)有效性原则。资产托管业务人员应全力维护内部控制制度的有效执行,任何人不得有超越制度和内控操作的权利。

(4)预防性原则。必须树立“预防为主”的管理理念,控制资产托管业务中风险发生的源头,防患于未然,尽量避免业务操作中各种问题的产生。

(5)及时性原则。资产托管业务风险控制制度的制定应当具有前瞻性,并且随着托管资产经营规模、业务创新、内部环境和管理制度的变化而及时修订或完善,确保制度的全面性和有效性。

(6)独立性原则。各业务中心、各岗位职能须保持相对独立性,风险管理部门是资产托管部下设的执行机构,不受其他业务中心和个人的干涉。风险监督和检查人员严格分离,以保证风险控制机构的工作不受干扰。

(7)相互制约原则。各业务中心、各岗位职能明确,相互牵制,通过切实可行的相互制衡措施来消除风险控制的盲点。

(8)防火墙原则。托管银行前台业务财务与托管资产财务严格分开;托管业务日常操作部门与风险管理、稽核和稽核部门隔离。

4、内部风险控制措施
(1)制度建设: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。

(2)建立建全的组织管理结构:前后台分离,不同部门、岗位相互牵制。

(3)风险控制与评估:风险监督中心指导业务中心进行风险识别、评估,制定并实施风险控制措施。

(4)相对独立的业务操作空间:业务操作区域相对独立,实施门禁管理和音像监控。

(5)人员管理:进行定期的业务与职业道德培训,使员工树立风险意识和控制意识,并签订承诺书。

(6)应急预案:制定完善的《应急预案》,并组织员工定期演练;建立异地灾难中心,确保业务不中断。

5、资产托管部内部风险控制
中国民生银行银行股份有限公司从控制环境、风险评估、控制活动、信息与沟通、监督等五个方面构建了资产托管业务风险控制体系。

(1)坚持风险管理与发展同重要的理念。托管业务是商业银行新兴的中间业务,中国民生银行股份有限公司资产托管部从成立之日起就特别强调规范运作,一直将建立一系系统、高效的风险防控和内控体系作为工作重点。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,中国民生银行股份有限公司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资产托管业务生存和发展的生命线。

(2)实施全面风险管理。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。中国民生银行股份有限公司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中心和业务岗位,每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责。

(3)建立分工明确、相互牵制的风险控制组织结构。托管部通过建立双向双人制,横向多中心制,内部组织结构,形成不同中心、不同岗位相互制衡的组织结构。

(4)以制度约束作为风险管理的核心。中国民生银行股份有限公司资产托管部十分重视内部风险控制制度的建设,已建立了一整套内部风险控制制度,包括业务管理、内部控制、内部稽核制度、员工行为规范、岗位职责及薪酬福利等项处理制度、操作手册。以上制度随着外部环境和业务的发展不断完善和增加。

(5)制度的执行和监督是风险控制的关键。制度执行与编写制度同等重要,制度落实检查是风险控制管理的有效保证。中国民生银行股份有限公司资产托管部内部设置专职风险监督中心,依照有关法律法规,定期对业务的运行进行稽核检查。总行审计部也不定期对资产托管部进行稽核检查。

(6)将先进的信息技术手段运用于风险控制中。在风险管理中,技术控制风险比制度控制风险更可靠,可将人为不确定因素降至最低。托管业务系统需求不仅以业务方面而且从风险控制方面都要经过多方论证,托管业务系统具有较严格的自动风险控制功能。

(一)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》、《运作办法》、基金合同和有关法律法规的规定,对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金申购资金的到账和赎回资金的划付、基金收益分配等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

基金管理人应保证向基金托管人提供的一切书面文件和相关资料应当是真实、准确、完整的,基金管理人应对其提供的资料的真实性、准确性和完整性承担责任。基金管理人应遵守法律法规的规定,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确认并以书面形式对基金托管人作出回。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。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在规定时间内纠正的,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存在重大违规行为,应立即报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正。

第三部分 相关服务机构

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:0755-82012133
传真:0755-82021155
联系人:吕奇志

网址:www.phfund.com
(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:张圆

(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 号花旗集团大厦 801B 室
联系电话:021-68876878
传真:021-68876921
联系人:李化怡

(4)鹏华基金管理有限公司武汉分公司
办公地址:武汉市江汉区建设大道 568 号新世界国贸大厦 1 座 3305 室
联系电话:027-85557881
传真:027-85557973
联系人:叶明

(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:周媛

2、其他销售机构
(1)银行销售机构
1)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

(2)第三方销售机构
1)北京百度盈益基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区上地十街 10 号百度大厦 2 层
办公地址:北京市海淀区上地十街 10 号
法定代表人:梁文举
联系人:王笑宇
客户服务电话:95055-9
网址:https://www.baiyingfund.com/

2)上海基煜基金销售有限公司
注册地址:上海市崇明县长兴镇潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室(上海泰和经济发展区)
办公地址:上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1503 室
法定代表人:王翔
联系人:吴鸿飞
客户服务电话:400-820-5369
网址:www.jiyufund.com.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基金或变更上述销售机构,并在基金管理人网站公告。

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)18201877
传真:(0755)18201165
负责人:范伟博

3、出具法律意见书的律师事务所
名称:广东嘉得信律师事务所
住所:深圳市罗湖区笋岗东路中民时代广场 A 座 201
法定代表人:闵齐双
办公地址:深圳市罗湖区笋岗东路中民时代广场 A 座 201
联系电话:(0755)133391280
传真:0755-33033086
联系人:闵齐双
经办律师:闵齐双、王德森

4、会计师事务所
名称:瑞华会计师事务所
住所:北京市东城区永定门西滨河路 8 号院 7 号楼中海地产广场西塔 5-11 层
法定代表人:顾刚
办公地址:广东深圳市福田区益田路 6001 号太平金融大厦 8-10 层
联系电话:010-88095588+586(755)188999233
传真:010-88091190
联系人:邵向京
经办会计师:邵向京、等

第四部分 基金的投资
本基金的投资目标:鹏华丰腾债券型证券投资基金
第三部分 基金的投资方式与类型
第一部分 基金的投资策略
一、资产配置策略
在严格风险预算的基础上,通过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。

二、债券投资策略
本基金的投资范围具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、企业债、可转债、地方政府债、中期票据、短期融资券、可分离交易可转债的纯债部分、资产支持证券、中小企业私募债、次级债、同业存单、债券回购、银行存款等固定收益类品种以及法律法规或中国证监会允许基金投资的金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金不投资于股票、权证等权益类资产,也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券。

三、资产支持证券投资策略
如法律法规或监管机构以后允许基金投资该品种,基金管理人将在履行适当程序后,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%,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变更投资品种的投资比例限制,基金管理人将在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

第八部分 基金的投资策略
本基金债券投资将采取久期策略,同时辅之以信用利差策略、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,在严格控制风险的基础上,通过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。

三、资产配置策略
在严格风险预算的基础上,通过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。