（上接B73版）

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）北京肯特瑞财富投资管理有限公司
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：陈超
联系人：江卉
客户服务电话：95118
网址：fund.jd.com
6）北京新浪仓石基金销售有限公司
注册地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层518室
办公地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层518室
法定代表人：李昭琛
联系人：吴翠
客户服务电话：010-62675369
网址：www.xincai.com
7）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
8）北京展恒基金销售有限公司
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
9）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：黄飚
客户服务电话：400-8878-566
网址：www.pyfund.cn
10）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
11）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
12）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
13）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：朱丁
客户服务电话：400-821-5399
网址：www.noah-fund.com
14）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
15）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.ehowbuy.com
16）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
17）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
18）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：陈玫玥
客户服务电话：400-921-7755
网址：www.leadfund.com.cn
19）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
20）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
21）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
22）深圳腾元基金销售有限公司
注册地址：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：卓紘淼
联系人：王妮萍
客户服务电话：4006-877-899
网址：www.dowinfund.com
23）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、www.jjmmw.com
24）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/
25）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
26）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
27）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
28）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
29）珠海益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：北京市竞天公诚律师事务所
住所：北京市朝阳区建国路 77 号华贸中心 3 号写字楼 34 层
法定代表人：赵洋
办公室地址：北京市朝阳区建国路 77 号华贸中心 3 号写字楼 34 层
联系电话：（010） 58091000；（0755）23982200
传真：（010）58091100；（0755）23982211
联系人：黄亮
经办律师：孔雨泉、黄亮

（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：鹏华实业债纯债债券型证券投资基金

五、基金运作方式及类型

本基金为契约型开放式债券型基金

六、基金的投资目标

在合理控制信用风险、保持适当流动性的基础上，以实业债为主要投资标的，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

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的固定收益类品种，包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、地方政府债、中期票据、短期融资券、可转换债券（含分离交易可转债）、中小企业私募债、资产支持证券、次级债、债券回购、银行存款等。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，也不参与一级市场新股申购、股票增发，因所持可转换公司债券转股形成的股票、因投资于分离交易可转债而产生的权证，在其可上市交易后不超过10个交易日的时间内卖出。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，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%；对实业债的投资比例不低于固定收益类资产的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%。

本基金所指实业债是指实体经济领域的企业发行的债券，包括这类企业所发行的公司债、企业债、中期票据、短期融资券等。

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

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、利率曲线变化趋势和信用利差变化趋势的重点分析，比较未来一定时间内不同债券品种和债券市场的相对预期收益率，在基金规定的投资比例范围内对不同久期、信用特征的券种进行动态调整。

2、债券投资策略

本基金在债券投资中以实业债投资为主，一般情况下，在债券类投资产品中，实业债的收益率要高于国债、央行票据等其他债券的收益率。投资实业债是通过主动承担适度的信用风险来获取较高的收益，所以在个券的选择当中特别重视信用风险的评估和防范。

本基金将主要采取久期策略，同时辅之以信用策略、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，在合理控制信用风险、保持适当流动性的基础上，以实业债为主要投资标的，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）信用策略

本基金通过主动承担适度的信用风险来获取信用溢价，主要关注信用债收益率受信用利差曲线变动趋势和信用变化两方面影响，相应地采用以下两种投资策略：

1）信用利差曲线变化策略：首先分析经济周期和相关市场变化情况，其次分析标的债券市场容量、结构、流动性等变化趋势，最后综合分析信用利差曲线整体及分行业走势，确定本基金信用债分行业投资比例。

2）信用变化策略：信用债信用等级发生变化后，本基金将采用最新信用级别所对应的信用利差曲线对债券进行重新定价。

本基金将根据内、外部信用评级结果，结合对类似债券信用利差的分析以及对未来信用利差走势的判断，选择信用利差被高估、未来信用利差可能下降的信用债进行投资。

（3）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。

（4）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。

（5）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。

（6）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。

（7）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债款支持证券（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。

（8）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。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，基金管理人将根据审慎原则，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。

九、基金的业绩比较基准

中债企业债总指数×80%+ 中债国债总指数×20%

中债企业债总指数、中债国债总指数是由中央国债登记结算有限责任公司（简称“中债公司”）编制的、分别反映企业债和国债市场整体价格和投资回报情况的指数。其中，中债国债总指数样本券包括在银行间债券市场、柜台以及上海证券交易所流通交易的所有记帐式国债；中债企业债总指数样本券包括在银行间债券市场、柜台以及上海证券交易所流通交易的所有中央企业债和地方企业债。该两个指数具有广泛的市场代表性，能够分别反映我国国债、企业债市场的总体走势。

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

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。

基金托管人中国建设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	25,265,350.00	94.29
	其中：债券	25,265,350.00	94.29
	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	1,096,340.96	4.09
8	其他资产	432,882.77	1.62
9	合计	26,794,573.73	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港股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	379,810.00	1.46
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	17,642,500.00	67.94
5	企业短期融资券	4,018,400.00	15.47
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	3,224,640.00	12.42
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	25,265,350.00	97.30

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	011758002	17深圳特发SCP001	20,000	2,010,400.00	7.74
2	041653066	16首机场股CP001	20,000	2,008,000.00	7.73
3	122395	15富力债	20,000	1,990,800.00	7.67
4	122209	12中油01	19,000	1,900,000.00	7.32
5	113011	光大转债	10,000	1,114,200.00	4.29

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之一的债券发行人山西永东化工股份有限公司，收到稷山县环境保护局《行政处罚决定书》，主要内容如下：

“经调查核实，你公司烟气在线监测数据显示氮氧化物超出排放标准。该行为违反了《中华人民共和国大气污染防治法》第十八条（企业事业单位和其他生产经营者建设对大气环境有影响的项目，应当依法进行环境影响评价、公开环境影响评价文件；向大气排放污染物的，应当符合大气污染物排放标准，遵守重点大气污染物排放总量控制要求）之规定。

依据《中华人民共和国大气污染防治法》第九十九条 第二款（违反本法规定，有下列行为之一的，由县级以上人民政府环境保护主管部门责令改正或者限制生产、停产整治，并处十万元以上一百万元以下的罚款；情节严重的，报经有批准权的人民政府批准，责令停业、关闭：（二）超过大气污染物排放标准或者超过重点大气污染物排放总量控制指标排放大气污染物的；）之规定，我局对你公司决定作出如下行政处罚：

1、立即改正该违法行为，限期九十日内完成。

2、罚款人民币壹佰万元整。”

对该证券的投资决策程序的说明：本次处罚对该债券的投资价值不产生重大影响。从公告中知悉，公司收到通知后，即刻召开环保整治专题会议，严格按照通知要求逐条整改。目前公司生产经营正常，本行政处罚不会对公司的生产、经营造成重大影响。

本基金投资的前十名证券中的其他证券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	13,518.56
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	409,045.44
5	应收申购款	10,318.77
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	432,882.77

（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	113011	光大转债	1,114,200.00	4.29

（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。

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05月03日（基金合同生效日）至2013年12月31日	-2.80%	0.20%	-2.00%	0.10%	-0.80%	0.10%
2014年1月1日至2014年12月31日	36.15%	0.65%	11.52%	0.12%	24.63%	0.53%
2015年1月1日至2015年12月31日	11.06%	0.70%	10.43%	0.08%	0.63%	0.62%
2016年1月1日至2016年12月31日	-7.43%	0.25%	2.42%	0.10%	-9.85%	0.15%
2017年1月1日至2017年9月30日	-0.22%	0.06%	1.52%	0.06%	-1.74%	0.00%
自基金合同生效日至2017年9月30日	35.75%	0.48%	25.48%	0.10%	10.27%	0.38%

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、证券账户开户费用、银行账户维护费用；
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0.3%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×0.3%÷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，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×0.2%÷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，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3－8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、申购费率

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	0.8%	0.32%
100万≤M<500万	0.4%	0.12%
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。

2、赎回费率

本基金的赎回费率如下表所示：

持有时间（Y）	赎回费率
Y<7天	1.50%
7天≤Y<30天	0.75%
30天≤Y<3个月	0.5%
3个月≤Y<6个月	0.3%
6个月≤Y<2年	0.1%
Y≥2年	0

注：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。对持续持有期少于3个月的投资人收取的赎回费全额计入基金财产；对持续持有期长于3 个月的投资人收取的赎回费总额的 50%计入基金财产。

（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）基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，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“第七部分 基金份额的申购与赎回”部分内容进行了更新。
6、在“第八部分 基金投资”部分内容进行了更新。
7、在“第九部分 基金业绩”部分内容进行了更新。
8、在“第二十部分 对基金份额持有人的服务”部分内容进行了更新。
9、在“第二十一部分 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

证券代码：002741　证券简称：光华科技　公告编号：2017-075

广东光华科技股份有限公司第三届董事会第十四次会议决议公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

广东光华科技股份有限公司（以下简称"公司"）第三届董事会第十四次会议于2017年12月14日在公司会议室以现场和通讯结合方式召开，会议通知于2017年12月6日通过电话、邮件及书面形式发出，本次会议由董事长郑创发先生主持。出席本次董事会会议的应到董事为9人，实际出席会议董事9人。公司监事、高级管理人员列席了本次会议。本次会议的召集、召开以及参会董事人数均符合相关法律、法规、规则及《公司章程》的有关规定，会议合法有效。

经出席会议的董事审议及表决，审议通过如下决议：

一、会议以9票同意、0票反对、0票弃权，审议通过《关于投资设立全资子公司的议案》。

公司以自有资金10,000万元在珠海设立珠海中力新能源材料有限公司（具体名称以工商注册为准）。本次投资设立全资子公司，主要目的是为了促进公司产业升级，丰富公司的产品结构，为公司带来新的利润增长点，进一步提高核心竞争力，保证公司发展战略的顺利实施；将有利于发挥公司综合业务优势，切实提升公司锂电池材料项目建设及运营能力，符合公司的发展战略和全体股东的利益，不会对公司财务状况及经营业绩产生重大影响。

本次对外投资事项不构成关联交易，亦不构成重大资产重组。本次对外投资 事项属董事会决策权限范围，无需提交股东大会审批。

《关于投资设立全资子公司的公告》（公告编号：2017-076）详见公司指定信息披露媒体《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及巨潮资讯网（http://www.cninfo.com.cn）。

备查文件：

1、第三届董事会第十四次会议决议；
2、深圳证券交易所要求的其他文件。

特此公告。

广东光华科技股份有限公司董事会
2017年12月15日

证券代码：002741　证券简称：光华科技　公告编号：2017-076

广东光华科技股份有限公司关于投资设立全资子公司的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

一、对外投资概述

1、根据广东光华科技股份有限公司（以下简称"公司"或"光华科技"）的战略布局，公司拟以自有资金10,000万元人民币在珠海市设立珠海中力新能源材料有限公司（暂定名，以工商部门核准登记的名称为准，以下简称"珠海中力"）。

2、公司于2017年12月14日召开第三届董事会第十四次会议，会议以9票同意、0票反对、0票弃权审议通过了《关于投资设立全资子公司的议案》。

3、根据《深圳证券交易所股票上市规则》和《公司章程》等有关规定，本次设立全资子公司事项在公司董事会决策权限内，无需提交股东大会审议。公司董事会授权公司经营管理层具体办理相关事宜。

4、本次对外投资事项不涉及关联交易，也不构成《上市公司重大资产重组管理办法》规定的重大资产重组。

二、拟投资设立全资子公司的基本情况

1、注册名称：珠海中力新能源材料有限公司（暂定名，具体名称以工商部门核准登记的名称为准）

2、注册资本：人民币10,000万元

3、出资方式：公司以自有资金出资

4、企业类型：有限责任公司

5、法定代表人：郭文辉

6、拟申请经营范围：电子专用材料制造；专用化学品制造；化工产品及化工原料的制造、销售；货物进出口、技术进出口。

7、持股比例：公司持股比例 100%

上述拟设立全资子公司的基本情况具体以工商部门登记注册的内容为准，待登记注册相关事宜完成后，公司将另行公告。

三、对外投资的目的、存在的风险和对公司的影响

（一）对外投资的目的和对公司的影响

本次投资设立全资子公司，主要目的是为了促进公司产业升级，丰富公司的产品结构，为公司带来新的利润增长点，进一步提高核心竞争力，保证公司发展战略的顺利实施；将有利于发挥公司综合业务优势，切实提升公司锂电池材料项目建设及运营能力，符合公司的发展战略和全体股东的利益，不会对公司财务状况及经营业绩产生重大影响。

本次拟投资设立全资子公司的资金来源为公司自有资金，珠海中力的设立预计将对公司未来的经营成果产生积极影响。本次设立完成后，珠海中力将成为公司的全资子公司，纳入公司合并报表范围。

（二）存在的风险

1、审批风险

珠海中力的设立登记、批准经营、相关资质的获得尚需相关政府部门审批核准，该公司能否成功注册、正常开展经营业务存在不确定性。

2、管理风险

随着公司下属子公司的增加，对公司的管理提出了更高要求。公司将持续完 善管理流程，强化管理力度，保证对各下属子公司的有效管控。

3、经营风险

珠海中力设立后，受宏观经济政策、行业环境、市场竞争等因素影响，能否达到预期经营目标存在不确定性。本公司将不断完善子公司的治理结构，加强内部协作机制的建立和运行，并建立完善的内部控制流程，组建良好的经营管理团队，积极防范和应对风险。

敬请广大投资者理性投资，注意投资风险。

四、其他事项

公司董事会将积极关注本次投资事项的进展情况，并根据《深圳证券交易所 股票上市规则》及《公司章程》等相关规定及时披露相关进展。敬请投资者关注 公司在指定信息披露媒体披露的公告。

特此公告。

广东光华科技股份有限公司
董事会
2017年12月15日

申万菱信基金管理有限公司关于旗下申万菱信价值优选灵活配置混合型证券投资基金参加中信建投证券股份有限公司开展的费率优惠活动的公告

为了答谢广大投资者的支持和厚爱，经与中信建投证券股份有限公司（以下简称“中信建投”）协商一致，申万菱信基金管理有限公司（以下简称“本公司”）决定自2017年12月15日起，旗下申万菱信价值优选灵活配置混合型证券投资基金参加中信建投开展的认购费率优惠活动，详情如下：

一、适用基金范围

基金名称	基金代码
申万菱信价值优选灵活配置混合型证券投资基金	003370

二、费率优惠活动

自2017年12月15日起至2017年12月22日止，投资者通过中信建投认购我司旗下申万菱信价值优选灵活配置混合型证券投资基金，可享受本基金认购费率1折优惠，原费率为固定费用的，则按原费率执行。本基金费率标准详见基金合同、招募说明书（更新）等法律文件以及本公司发布的最新业务公告。

费率优惠活动期间内，若本基金提前终止或延长发售时间，本次费率优惠活动的截止日期以本公司届时发布的实际发售截止日为准。

三、重要提示

1、本费率优惠仅适用于本基金在中信建投处于基金募集期的基金认购费，不包含本基金处于正常申购期间的前端收费模式的申购手续费，也不包括基金赎回、转换等其他业务的基金手续费。

2、本次所开通业务办理的相关规则及流程以中信建投的安排和规定为准，费率优惠活动的解释权归中信建投所有，投资者在中信建投办理上述业务应遵循中信建投的具体规定，以上费率优惠政策如有变更，请以中信建投公告为准。

3、投资者应认真阅读拟投资基金的《基金合同》、《招募说明书》等法律文件，了解所投资基金的风险收益特征，并根据自身情况购买与本人风险承受能力相匹配的产品。

四、投资者可通过以下渠道咨询详情

1、中信建投证券股份有限公司
网站：www.csc108.com
客服电话：400-8888-108
2、申万菱信基金管理有限公司
网站：www.swsmu.com
客服电话：400 880 8588（免长途话费）或021-962299

五、风险提示

本公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益，敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

申万菱信基金管理有限公司
2017年12月15日

申万菱信基金管理有限公司申万菱信价值优先混合型证券投资基金基金合同生效公告

公告送出日期：2017年12月15日

1、公告基本信息

基金名称	申万菱信价值优先混合型证券投资基金
基金简称	申万菱信价值优先混合
基金主代码	004769
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年12月14日
基金管理人名称	申万菱信基金管理有限公司
基金托管人名称	中国农业银行股份有限公司
公告依据	《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法规、《申万菱信价值优先混合型证券投资基金基金合同》、《申万菱信价值优先混合型证券投资基金招募说明书》

2、基金募集情况

基金募集申请获中国证监会核准的文号		中国证监会证监许可【2017】737号
基金募集期间		自2017年11月13日至2017年12月8日止
验资机构名称		普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
募集资金划入基金托管专户的日期		2017年12月13日
募集有效认购总户数（单位：户）		7,169
募集期间净认购金额（单位：人民币元）		362,765,015.94
认购资金在募集期间产生的利息（单位：人民币元）		219,258.52
募集份额（单位：份）	有效认购份额	362,765,015.94
	利息结转的份额	219,258.52
	合计	362,984,274.46
其中：募集期间基金管理人运用固有资金认购本基金情况	认购的基金份额（单位：份）	-
	占基金总份额比例	-
	其他需要说明的事项	无
其中：募集期间基金