（上接B78版）

客户服务电话：95118
网址：fund.jd.com
5）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
6）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
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
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
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.snjijin.com
10）诺亚正行基金销售有限公司
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
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
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：王诗玙
客户服务电话：400-700-9665
网址：www.howbuy.com
13）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
14）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
15）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：陈铭洲
客户服务电话：400-821-9031
网址：www.lu.com
16）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
17）上海万得基金销售有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路33号11楼B座
办公地址：上海市浦东新区浦明路1500号万得大厦11楼
法定代表人：王廷富
联系人：徐亚丹
客户服务电话：400-821-0203
网址：www.520fund.com.cn
18）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：400-166-1188
网址：8.jrj.com.cn
19）深圳众禄基金销售股份有限公司
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：深圳市罗湖区笋岗街道梨园路物资控股置地大厦8楼801
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
20）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/
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
22）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
23）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代理销售本基金或变更上述代销机构，并及时公告。

2.场内发售机构：具有基金代销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及其他相关业务公告）。

（二） 注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司
住所：北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人：周明
办公室地址：北京市西城区太平桥大街17号
联系电话：010-50938782
传真：010-50938907
负责人：赵亦清

（三） 律师事务所

名称：北京市德恒律师事务所
住所：北京市西城区 金融街19号富凯大厦B座十二层
法定代表人：王丽
办公室地址：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座十二层
联系电话：010-65232180 65269781
传真：010-65232181
联系人：徐芳
经办律师：陈静茹、苏文静

（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：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1318 号星展银行大厦507 单元01 室
法定代表人：李丹
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：魏佳宪
经办会计师：许康玮、陈熹

四、基金的名称

本基金名称：鹏华沪深300指数证券投资基金（LOF）

五、基金运作方式及类型

本基金为股票型基金

六、基金的投资目标

本基金采用指数化投资方式，追求基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间的跟踪误差最小化，力争将日平均跟踪误差控制在0.35%以内，以实现对沪深300指数的有效跟踪。

七、基金的投资方向

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，主要投资于沪深300指数的成份股及其备选成份股（投资比例不低于基金资产净值的90%），现金或者到期日在一年以内的政府债券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。此外，为更好的实现投资目标，本基金将少量投资于非沪深300成份股、新股（首次发行或增发等）以及法律法规及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。

若法律法规或监管机构允许，本基金在履行适当程序后，可以调整上述投资比例，或将股指期货等金融衍生品纳入本基金的投资范围。

八、基金的投资策略

本基金采用被动式指数投资方法，按照成份股在沪深300指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。

当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，并辅之以金融衍生产品投资管理等，使跟踪误差控制在限定的范围之内。

1、资产配置策略

为实现紧密跟踪业绩比较基准的投资目标，本基金将以不低于基金资产净值90%的资产投资于沪深300指数成份股和备选成份股。在正常市场情况下本基金将采用完全复制法，严格按目标指数的成份股权重构建组合，少数特殊情况下本基金将配合使用优化方法作为补充，以保证对标的指数的有效跟踪。

2、股票投资策略

本基金原则上通过指数复制法进行被动式指数化投资，根据沪深300指数成份股的基准权重构建股票投资组合，并根据成份股及其权重的变动而进行相应调整。

（1）股票投资组合的构建

本基金在建仓期内，将按照沪深300指数各成份股的基准权重对其逐步买入，在力求跟踪误差最小化的前提下，本基金可采取适当方法，以降低买入成本，当遇到成份股停牌、流动性不足等其他市场因素而无法依指数权重购买某成份股及预期标的指数的成份股即将调整或其他影响指数复制的因素时，本基金可以根据市场情况，结合研究分析，对基金资产进行适当调整，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。

（2）股票投资组合的调整

本基金所构建的股票投资组合将根据沪深300指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、新股增发因素等变化，对其进行适时调整，以保证基金净值增长率与基准指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。基金管理人将对成份股的流动性进行分析，如发现流动性欠佳的个股将可能采用合理方法寻求替代。由于受到各项持股比例限制，基金可能不能按照成份股权重持有成份股，基金将会采用合理方法寻求替代。

① 定期调整

根据标的指数的调整规则和备选股票的预期，对股票投资组合及时进行调整。

② 不定期调整

当成份股发生增发、配股、分红等情况而影响成份股在指数中权重的行为时，本基金将根据各成份股的权重变化及时调整股票投资组合；

根据本基金的申购和赎回情况，对股票投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数；

根据法律、法规和基金合同的规定，成份股在标的指数中的权重因其它特殊原因发生相应变化的，本基金可以对投资组合管理进行适当变通和调整，并辅之以金融衍生产品投资管理等，最终使跟踪误差控制在限定的范围之内；

根据法律法规中针对基金投资比例的相关规定，当基金投资组合中按标的指数权重投资的股票资产比例或个股比例超过规定限制时，本基金将对其进行实时调整，并相应对其他资产或个股进行微调，以保证基金合法规范运作。

3、债券投资策略

本基金根据流动性管理的需要，选取到期日在一年以内的政府债券进行配置。本基金债券投资组合将采用自上而下的投资策略，根据宏观经济分析、资金面动向分析等判断未来利率变化，并利用债券定价技术，进行个券选择。

九、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准：

沪深300指数收益率×95%＋银行同业存款利率×5%

本基金为沪深300指数基金，以沪深300指数作为业绩比较基准。沪深300指数选择我国A股市场规模较大、流动性较强、基本面良好的300家上市公司的股票作为样本股，充分反映了A股市场的行业代表性，描述了沪深A股市场的总体趋势，同时该指数还具有指数编制方法透明、样本股调整规则清晰等特征，是目前市场上较有影响力的股票投资业绩比较基准。

本基金充分考虑本基金各资产投资比例要求从而构建上述业绩比较基准。

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股票指数时，本基金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。

十、基金的风险收益特征

本基金属于采用指数化操作的股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金，为证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年10月25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2018年07月01日起至09月30日。

1.报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	324,980,121.29	92.75
	其中：股票	324,980,121.29	92.75
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	24,981,653.04	7.13
8	其他资产	416,171.14	0.12
9	合计	350,377,945.47	100.00

2.报告期末按行业分类的股票投资组合

（1）报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	403,222.12	0.12
B	采矿业	9,345,654.47	2.70
C	制造业	134,819,490.60	38.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,516,124.45	2.75
E	建筑业	9,976,260.14	2.88
F	批发和零售业	4,584,622.44	1.32
G	交通运输、仓储和邮政业	11,399,904.94	3.29
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,995,834.64	3.17
J	金融业	112,224,486.50	32.40
K	房地产业	12,443,179.82	3.59
L	租赁和商务服务业	4,409,152.18	1.27
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	525,455.50	0.15
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,585,919.95	0.46
R	文化、体育和娱乐业	2,660,575.44	0.77
S	综合	-	-
	合计	324,889,883.19	93.79

（2）报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	90,238.10	0.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	90,238.10	0.03

（3）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

（1）指数投资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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	353,385	24,206,872.50	6.99
2	600519	贵州茅台	16,118	11,766,140.00	3.40
3	600036	招商银行	319,555	9,807,142.95	2.83
4	601166	兴业银行	512,552	8,175,204.40	2.36
5	000858	五粮液	94,080	6,392,736.00	1.85
6	600016	民生银行	948,934	6,016,241.56	1.74
7	600887	伊利股份	233,187	5,988,242.16	1.73
8	000651	格力电器	146,906	5,905,621.20	1.70
9	000333	美的集团	139,036	5,849,244.52	1.69
10	601398	工商银行	953,200	5,499,964.00	1.59

（2）积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002937	兴瑞科技	2,114	36,593.34	0.01
2	300749	顶固集创	1,316	30,833.88	0.01
3	300748	金力永磁	2,008	22,810.88	0.01

注：上述股票明细为本基金本报告期末持有的全部积极投资的股票。

4.报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：无。

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

注：无。

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股指期货交易情况说明

（1）报告期末本基金投资的股指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股指期货投资

（2）本基金投资股指期货的投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资

10.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。

11.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证券没有超出基金合同规定的证券备选库

（3）其他资产构成

序号	名称	金额（人民币元）
1	存出保证金	55,468.05
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,058.87
5	应收申购款	356,644.22
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	416,171.14

（4）报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

（5）报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	000333	美的集团	5,849,244.52	1.69	重大事项

（6）报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

（7）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。

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
2009年04月03日(基金合同生效日)至2009年12月31日	31.11%	1.75%	36.80%	1.87%	-5.69%	-0.12%
2010年01月01日至2010年12月31日	-12.63%	1.51%	-11.77%	1.50%	-0.86%	0.01%
2011年01月01日至2011年12月31日	-23.60%	1.24%	-23.83%	1.23%	0.23%	0.01%
2012年01月01日至2012年12月31日	8.38%	1.22%	7.30%	1.22%	1.08%	0.00%
2013年01月01日至2013年12月31日	-5.64%	1.35%	-7.14%	1.32%	1.50%	0.03%
2014年01月01日至2014年12月31日	51.87%	1.18%	48.71%	1.15%	3.16%	0.03%
2015年01月01日至2015年12月31日	7.02%	2.49%	5.72%	2.36%	1.30%	0.13%
2016年01月01日至2016年12月31日	-6.12%	1.39%	-10.61%	1.33%	4.49%	0.06%
2017年01月01日至2017年12月31日	24.64%	0.62%	20.65%	0.60%	3.99%	0.02%
2018年01月01日至2018年09月30日	-11.33%	1.16%	-13.93%	1.17%	2.60%	-0.01%
自基金合同生效日至2018年09月30日	50.92%	1.46%	33.71%	1.44%	17.21%	0.02%

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。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

（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0.75%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×0.75%÷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0.15%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.15%÷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。

（三）与基金销售有关的费用

1、申购费

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。

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者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，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者。

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特定申购费率如下表：

申购金额M（元）	特定申购费率
M〈100万	0.6%
100万≤M〈250万	0.6%
250万≤M〈500万	0.4%
M≥500万	每笔1000元

其他投资者申购本基金基金份额的场外申购费率如下表：

申购金额M（元）	申购费率
M〈100万	1.2%
100万≤M〈250万	0.8%
250万≤M〈500万	0.4%
M≥500万	每笔1000元

本基金场内申购费率自2015年9月21日起进行调整，调整后费率如下表：

申购金额M（元）	申购费率
M<500万	0
M≥500 万	按笔收取，每笔1000 元

投资者在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。

2、转换费

本基金目前仅可办理场外转换业务，场内暂未开通基金间转换业务。

具体转换费率、计算公式及转换业务规则详见基金管理人发布的相关公告。

3、赎回费：本基金的场外赎回费率按持有期限递减，具体费率如下：

持有期限（Y）	场外赎回费率
Y<7天	1.5%
7天≤Y<1年	0.5%
1年≤Y<2年	0.25%
Y≥2年	0

本基金的场内赎回费率按持有期限递减，具体费率如下：

持有期限（Y）	场内赎回费率
Y<7天	1.5%
Y≥7天	0.5%

本基金的赎回费用在投资者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。本基金对持续持有期少于7日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产；对于持续持有期不少于7日的投资者收取的赎回费总额的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。

4、本基金的申购费率、转换费率、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，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前2个工作日在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告。

5、当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。

6、基金管理人可以在不违背法律法规规定及《基金合同》约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对特定地域范围、特定行业、特定职业的投资者以及以特定交易方式（如网上交易、电话交易等）等进行基金交易的投资者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相关手续后基金管理人可以适当调低基金申购费率、基金赎回费率和基金转换费率。

（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，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用；

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）费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率等费率，须召开基金份额持有人大会审议；调低基金管理费率、基金托管费率等费率，无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前2日在至少一种指定媒体和基金管理人网站上公告。

（六）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、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“第十一部分 基金投资”部分内容进行了更新。

6、在“第十二部分 基金业绩”部分内容进行了更新。

7、在“第二十四部分 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
2018年11月

证券代码：002711 证券简称：欧浦智网 公告编号：2018-099

欧浦智网股份有限公司 股票交易异常波动公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

一、股票交易异常波动的情况介绍

欧浦智网股份有限公司（以下简称“公司”）股票交易价格于2018年11月12日、11月13日、11月14日连续三个交易日收盘价格涨幅偏离值累计超过20%，根据《深圳证券交易所股票交易规则》的有关规定，属于股票交易异常波动的情况。

二、公司关注并核实相关情况

针对公司股票交易异常波动，公司对有关事项进行了核查，并询问了公司控股股东和实际控制人，现将有关事项说明如下：

1、公司前期披露的信息不存在需要更正、补充之处。

2、公司未发现近期公共传媒报道可能或已经对公司股票交易价格产生较大影响的未公开重大信息。

3、受大股东债务危机以及外部融资环境变化影响，公司资金状况紧张，已出现部分债务逾期的情形，同时公司部分银行账户被冻结和强制划扣、土地房产被查封，导致公司资金周转和生产经营出现较大困难，为防止流动性风险，公司正在收缩业务规模。

4、公司于2018年11月10日在指定信息披露媒体刊登了《关于签署〈承债式资产收购框架协议〉的公告》（公告编号：2018-092）和《关于控股股东签署〈股份转让框架协议〉和〈表决权委托协议〉暨控股股东、实际控制人拟发生变更的提示性公告》（公告编号：2018-093）。为解决公司的债务危机，保持公司的经营稳定，促进企业的发展和社会稳定，在不影响公司正常生产经营的情况下，广东顺控城投置业有限公司（以下简称“顺控城投置业”）或其指定主体拟承债式收购公司房屋建筑物、土地使用权等资产。同时，公司控股股东佛山市中基投资有限公司拟向顺控城投置业进行股份转让并委托表决权。截至本公告日，交易各方仍在就具体交易方案进行磋商，该事项有关方案尚待进一步论证，存在较大不确定性。

除上述事项外，公司控股股东、实际控制人不存在关于公司的应披露而未披露的重大事项，或处于筹划阶段的重大事项。

5、公司控股股东、实际控制人在股票交易异常波动期间（即2018年11月12日-11月14日）不存在买卖公司股票的行为。

三、是否存在应披露而未披露信息的说明

公司董事会确认：除本公告第二部分所述事项外，本公司目前没有任何根据深交所《股票上市规则》规定应予以披露而未披露的事项或与该事项有关的筹划、商谈、意向、协议等；董事会也未获悉本公司有根据深交所《股票上市规则》的规定应予以披露而未披露的、对本公司股票及其衍生品种交易价格产生较大影响的信息；公司前期披露的信息不存在需要更正、补充之处。

四、风险提示

1、公司不存在违反信息公平披露的情形。

2、陈倩盈控制的信托计划所持股份存在的风险

截至2018年11月14日收盘，陈倩盈控制的信托计划持有公司股份24,243,867股，占公司股份总数的2.30%。根据信托协议约定，云南信托不排除后续会履行平仓程序。

3、中基投资所持股份存在的风险

中基投资持有公司551,359,678股股份，占公司股份总数的52.2086%。中基投资所持有的公司股份累计被质押的数量为551,353,986股，占其持有公司股份总数的99.9990%，占公司股份总数的52.2081%；其所持有的公司股份累计被司法冻结的数量为517,626,548股，占其持有公司股份总数的93.8818%，占公司股份总数的49.0144%；中基投资持有的420,444,934股股份已被轮候冻结3次。

截至2018年11月14日收盘，中基投资已触及平仓线的质押股份数为437,753,986股，占公司股份总数的41.45%，占其持有公司股份总数的79.40%。

中基投资目前仍在与债权方进行沟通，采取补充资金、提前归还融资款项、与相关金融机构协商展期等多项措施应对平仓风险，但不排除在协商过程中出现强制平仓的情形。

4、英顺管理所持股份存在的风险

英顺管理持有公司42,510,619股股份，占公司股份总数的4.0254%。英顺管理所持有的公司股份累计被质押的数量为42,491,120股，占其持有公司股份总数的99.9541%，占公司股份总数的4.0235%；其所持有的公司股份累计被司法冻结的数量为42,510,619股，占其持有公司股份总数的100%，占公司股份总数的4.0254%。

截至2018年11月14日收盘，英顺管理已触及平仓线的质押股份数为42,491,120股，占公司股份总数的4.02%，占其持有公司股份总数的99.95%。

英顺管理目前仍在与债权方进行沟通，采取补充资金、提前归还融资款项、与相关金融机构协商展期等多项措施应对平仓风险，但不排除在协商过程中出现强制平仓的情形。

5、持股5%以上股东吕小奇所持股份存在的风险

股东吕小奇持有公司股份63,945,583股，占公司股份总数的6.055%，其中通过证券公司融资融券账户持有63,363,203股，占其持有公司股份总数的99.09%。融资融券账户所持股份实际上是以担保品的形式向证券公司进行了抵押融资，截至2018年11月14日收盘，公司股价已触及吕小奇融资融券账户平仓线。

针对潜在的平仓风险，吕小奇仍在与证券公司进行沟通，采取相关措施进行补仓安排，但不排除后续存在被证券公司强制平仓的可能。

6、本公告第二部分所述的承债式资产收购相关事项，各方签署的《承债式资产收购框架协议》为框架性协议，仅为各方对于本次收购事宜作出的初步意向，不表示本次收购成功，本次收购具体事宜以最终签署的正式协议为准。目前相关土地资产已被司法查封，本次交易尚需进一步论证和沟通协商，尚需相关各方就各项具体安排协商一致，最终能否顺利实施尚存在较大不确定性。

7、本公告第二部分所述的控股股东拟向顺控城投置业进行股份转让并委托表决权相关事项，各方签署的《股份转让框架协议》、《股份转让框架协议》之补充协议和《表决权委托协议》为框架性协议，仅为各方的意向性约定，不代表各方能够最终完成本次股权转让，该事项具体事宜以最终签署的正式协议为准。鉴于中基投资所持公司股份已被质押或冻结，其债权债务较为复杂，该事项有关方案尚待进一步论证，最终能否顺利实施尚存在较大不确定性。

8、因资金状况紧张，公司目前存在债务逾期情形，公司可能会面临需支付相关违约金、滞纳金和罚息等情况，将会增加公司的财务费用，受公司债务逾期事项影响公司融资能力下降、资金紧张，同时对公司主营业务的生产经营造成一定的不利影响。

9、截至本公告日，公司部分银行账户已被冻结和强制划扣，导致公司资金周转和生产经营出现较大困难，为防止流动性风险，公司正在收缩业务规模。在本次账户被冻结事项解除之前，尚不排除后续或有公司其他账户资金被冻结的情形。公司目前仅通过网银、银行柜台查询以及与银行电话沟通的方式获悉上述公司银行帐号被冻结事宜，并未收到有关的法院民事裁定书等法律文书，尚不能确认账户被冻结的具体原因，公司正在就账户冻结、资产查封、诉讼情况以及是否存在违规担保和大股东资金占用等情况开展内部核查，并将按照相关规定及时履行信息披露义务。

10、截至本公告日，公司部分土地房产已被查封，目前被司法查封的土地、房产资产未被限制正常使用，仍可用于日常生产经营，但后续不排除存在查封土地、房产被司法拍卖的可能，一旦上述土地被拍卖将导致公司仓储加工业务陷入停滞。公司目前仅向国土以及房管等资产登记管理部门查询获悉上述土地房产被查封事宜，并未收到有关的法院民事裁定书等法律文书，尚不能确认资产查封的具体原因，公司正在就账户冻结、资产查封、诉讼情况以及是否存在违规担保和大股东资金占用等情况开展内部核查，并将按照相关规定及