（上接B53版）

注册地址：北京市东城区建国门内大街69号
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
联系人：邱泽滨
客户服务电话：95599
网址：www.abcchina.cn
13）中信银行股份有限公司
注册地址：北京市东城区朝阳门北大街9号
办公地址：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
客户服务电话：95558
网址：bank.ecitic.com
（2）证券公司销售机构
1）安信证券股份有限公司
注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
办公地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
法定代表人：王连志
联系人：陈剑虹
客户服务电话：95517
网址：www.essence.com.cn
2）长城证券股份有限公司
注册地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14楼、16楼、17楼
办公地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14楼、16楼、17楼
法定代表人：丁益
联系人：金夏
客户服务电话：400-666-6888
网址：www.cgws.com
3）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
4）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
5）光大证券股份有限公司
注册地址：上海市静安区新闸路1508号
办公地址：上海市静安区新闸路1508号
法定代表人：薛峰
联系人：何耀
客户服务电话：95525
网址：www.ebscn.com
6）广州证券股份有限公司
注册地址：广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层
办公地址：广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层
法定代表人：邱三发
联系人：梁微
客户服务电话：95396
网址：www.gzs.com.cn
7）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号国信证券大厦十六层至二十六层
办公地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
法定代表人：何如
联系人：周杨
客户服务电话：95536
网址：www.guosen.com.cn
8）海通证券股份有限公司
注册地址：上海市广东路689号
办公地址：上海市黄浦区广东路689号
法定代表人：周杰
联系人：赵洋洋
客户服务电话：95553
网址：www.htsec.com
9）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
10）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
11）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）/029-68918888（西安）
网址：www.cfsc.com.cn
12）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：95325/400-860-8866
网址：www.kysec.cn
13）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.mszq.com
14）平安证券股份有限公司
注册地址：深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层
办公地址：深圳市福田中心区金田路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
15）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
16）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
17）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
18）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：廖庆轩
联系人：周青
客户服务电话：4008096096/95355
网址：www.swsc.com.cn
19）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号新南城商务中心A栋11楼
办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼
法定代表人：孙永祥
联系人：李欣
客户服务电话：95351
网址：www.xcsc.com
20）信达证券股份有限公司
注册地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
办公地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表人：张志刚
联系人：尹旭航
客户服务电话：95321
网址：www.cindasc.com
21）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
22）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2-6层
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：陈共炎
联系人：辛国政
客户服务电话：4008-888-888/95551
网址：www.chinastock.com.cn
23）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18-21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栋第4、18层至21层
法定代表人：高涛
联系人：万玉琳
客户服务电话：95532/4006008008
网址：www.china-invs.cn
24）中信证券股份有限公司
注册地址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座
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：郑慧
客户服务电话：95548
网址：www.cs.ecitic.com
25）中信证券（山东）有限责任公司
注册地址：青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001
办公地址：青岛市市南区东海西路28号龙翔广场东座5层
法定代表人：姜晓林
联系人：刘晓明
客户服务电话：95548
网址：http://sd.citics.com
（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
2）中信期货有限公司
注册地址：广东省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、14层
办公地址：广东省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、14层
法定代表人：张皓
联系人：刘宏莹
客户服务电话：400-990-8826
网址：www.citicsf.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：王晓晓
客户服务电话：400-619-9059
网址：www.hcjijin.com
4）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
5）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
6）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
7）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：朱了
客户服务电话：400-821-5399
网址：www.noah-fund.com
8）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
9）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：王诗玲
客户服务电话：400-700-9665
网址：www.howbuy.com
10）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
11）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
12）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
13）深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
注册地址：深圳市福田区福田街道民田路178号华融大厦27层2704
办公地址：北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦A座7层
法定代表人：马勇
联系人：文雯
客户服务电话：400-166-1188
网址：8.jrj.com.cn
14）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
15）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/
16）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：4008773772
网址：www.5ifund.com
17）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
18）珠海盈米基金销售有限公司
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
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：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：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：魏佳亮
经办会计师：许康玮、陈熹

四、基金的名称

本基金名称：鹏华丰利债券型证券投资基金(LOF)

五、基金运作方式及类型

本基金为契约型发起式债券型基金

六、基金的投资目标

本基金在有效控制风险、保持适当流动性的前提下，通过积极主动的投资管理，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，包括国内依法发行交易的国债、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）、资产支持证券、次级债、中小企业私募债、债券回购、银行存款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）。本基金不直接买入股票、权证等权益类金融工具，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品种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。

八、基金的投资策略

本基金债券投资将主要采取久期策略，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，在有效控制风险、保持适当流动性的前提下，通过积极主动的投资管理，力争取得超越基金业绩比较基准的收益。

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、信用特征的券种及债券与现金之间进行动态调整。

2.久期策略

本基金将主要采取久期策略，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。为控制风险，本基金采用以“目标久期”为中心的资产配置方式。目标久期的设定划分为两个层次：战略性配置和战术性配置。“目标久期”的战略性配置由投资决策委员会确定，主要根据对宏观经济和资本市场的预测分析决定组合的目标久期。“目标久期”的战术性配置由基金经理根据市场短期因素的影响在战略性配置预先设定的范围内进行调整。如果预期利率下降，本基金将增加组合的久期，直至接近目标久期上限，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，直至目标久期下限，以减小债券价格下降带来的风险。

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.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。

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）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。

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。

从投资人具体持有的基金份额来看，由于基金收益分配的安排，基金分级运作期内，丰利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；丰利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。

基金托管人招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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	967,032,621.71	96.56
	其中：债券	930,032,621.71	92.87
	资产支持证券	37,000,000.00	3.69
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	21,753,055.64	2.17
8	其他资产	12,689,560.84	1.27
9	合计	1,001,475,238.19	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	156,559,910.00	20.31
	其中：政策性金融债	147,571,610.00	19.15
4	企业债券	445,548,148.60	57.80
5	企业短期融资券	124,056,550.00	16.09
6	中期票据	136,339,300.00	17.69
7	可转债（可交换债）	67,528,713.11	8.76
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	930,032,621.71	120.66

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	180210	18国开10	740,000	73,060,200.00	9.48
2	101800367	18皖秀金融MTN003	400,000	40,772,000.00	5.29
3	136348	16国机债	410,000	40,048,800.00	5.20
4	018005	国开1701	386,600	38,891,960.00	5.05
5	011801818	18高速地产SCP003	375,000	37,503,750.00	4.87

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

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	139092	深借呗3A	300,000	30,000,000.00	3.89
2	139059	万科22A1	70,000	7,000,000.00	0.91

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
注：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
注：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	28,098.25
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	12,661,462.59
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,689,560.84

（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（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	132009	17中油EB	10,246,500.00	1.33
2	132012	17巨化EB	7,446,230.00	0.97
3	110033	国贸转债	6,714,035.20	0.87
4	113018	常熟转债	6,372,075.60	0.83
5	113009	广汽转债	1,777,885.20	0.23
6	128034	江银转债	1,566,275.00	0.20
7	110032	三一转债	1,543,468.80	0.20
8	128019	久立转2	733,284.85	0.10
9	128017	金禾转债	370,699.56	0.05

（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04月23日(基金合同生效日)至2013年12月31日	-7.14%	0.19%	-3.78%	0.13%	-3.36%	0.06%
2014年01月01日至2014年12月31日	16.55%	0.24%	11.23%	0.15%	5.32%	0.09%
2015年01月01日至2015年12月31日	13.03%	0.21%	8.03%	0.11%	5.00%	0.10%
2016年01月01日至2016年12月31日	3.15%	0.10%	1.30%	0.12%	1.85%	-0.02%
2017年01月01日至2017年12月31日	-1.01%	0.08%	-1.19%	0.09%	0.18%	-0.01%
2018年01月01日至2018年09月30日	4.82%	0.09%	5.99%	0.11%	-1.17%	-0.02%
自基金合同生效日至2018年09月30日	30.93%	0.17%	22.66%	0.12%	8.27%	0.05%

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.丰利A销售服务费；
4.基金的上市费用；
5.基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；
6.基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费；
7.基金份额持有人大会费用；
8.基金的证券交易费用；
9.基金的银行汇划费用；
10.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0.7%年费率计提。管理费的计算方法如下：
H＝E×0.7%÷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首日起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，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首日起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.丰利A销售服务费
本基金在分级运作期内丰利A收取销售服务费，丰利B不收取销售服务费。丰利A的销售服务费年费率为0.35%，分级运作期满后不再收取销售服务费。
丰利A销售服务费计提的计算公式如下：
H＝E×0.35%÷当年天数
H为丰利A每日应计提的销售服务费
E为前一日丰利A基金份额参考净值或基金份额净值与丰利A份额数的乘积
丰利A销售服务费每日计算，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首日起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、公休日等，支付日期顺延。
上述“一、基金费用的种类”中第4—10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）基金管理费和基金托管费的调整
基金管理人和基金托管人可协商酌情降低基金管理费和基金托管费，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）与基金销售有关的费用
1.场外申购、赎回的费用
（1）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：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。本基金由原有丰利A、丰利B持有人转入的场外份额不收取赎回费。具体费率如下：

持有期限（Y）	赎回费率
Y＜7日	1.50%
7日≤Y＜1年	0.50%
1年≤Y＜2年	0.25%
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，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。
2.场内申购和赎回的费用
（1）场内申购费参照场外一般申购费率。
（2）赎回费：
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日	1.50%
Y≥7日	0.50%

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，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。
（六）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“第九部分基金份额的申购与赎回”部分内容进行了更新。
6、在“第十部分基金投资”部分内容进行了更新。
7、在“第十一部分基金业绩”部分内容进行了更新。
8、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12月

证券代码：002626 证券简称：金达威 公告编号：2018-091

厦门金达威集团股份有限公司 关于全资子公司投资iHerb Holdings，LLC的进展公告

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。

厦门金达威集团股份有限公司（以下简称“公司”）全资子公司KUC Holding（以下简称“KUC”）于2018年6月28日在美国与iHerb Holdings，Inc.（以下简称“iHerb”）签订《股权购买协议》（以下简称 “协议”），iHerb以每股24.78美元的价格向KUC新发行T类优先股4,036,155股，交易完成后，KUC将持有iHerbT类优先股4,036,155股，占iHerb已发行股份总数的4.80%，占完全稀释后的股份总数的4.77%。本次交易对价为1亿美元。本次投资事项具体内容详见公司于2018年6月29日刊登于《证券时报》、《证券日报》和巨潮资讯网上的《关于对外投资的公告》（公告编号：2018-044）。

现将本次交易进展情况公告如下：

1、交割的情况

本次交易已经完成交割。根据本次交易安排，在交割前，iHerb的组织形式及名称已由iHerb Holdings，Inc.变更为iHerb Holdings，LLC，注册地已变更为美国特拉华州，公司根据本次交易认购的股份最终为iHerb Holdings，LLC的股权，持股比例不变。

公司已支付了上述交割款项并收到权益持有的相关凭证及协议要求的所有文件。

2、本次交割后iHerb的股权结构如下：

权益类别	持有人名称	持有数量	持股比例（%）	完全稀释后的比例（%）
普通股	Reza	80,000,000	95.20	94.52
T类优先股	KUC	4,036,155	4.80	4.77
已发行股份总数		84,036,155	100	---
已授予未行权股票期权	管理层及核心关键人员	600,000	---	0.71
完全稀释后的股份总数		84,636,155	---	100

注：上表中的个别数据加总后与合计数据存在尾数差异，系数据计算时四舍五入造成。

特此公告。

厦门金达威集团股份有限公司
董事会
二〇一八年十二月四日

证券代码：002422 证券简称：科伦药业 公告编号：2018-126

四川科伦药业股份有限公司 关于公司氢溴酸西酞普兰片首家通过仿制药一致性评价的公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整，对公告的虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏负连带责任。

四川科伦药业股份有限公司（以下简称“公司”或“我公司”或“科伦药业”）于近日获得国家药品监督管理局核准签发的化学药品 “氢溴酸西酞普兰片” 的《药品补充申请批件》，该药品通过仿制药质量和疗效一致性评价。现将相关情况公告如下：

一、药品基本情况

1.药品名称：氢溴酸西酞普兰片
剂型：片剂
规格：20mg（按C20H21FN20计）
申请事项：国产药品注册一致性评价
注册分类：化学药