# 鹏华先进制造股票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:中国农业银行股份有限公司

2018年12月

**重要提示**

本基金经2014年7月31日中国证券监督管理委员会下发的《关于核准鹏华先进制造股票型证券投资基金募集的批复》([2014]792号文)注册,进行募集。根据相关法律法规,本基金基金合同已于2014年11月4日生效,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,也不表明投资于本基金没有风险。

本基金属于股票型基金,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,属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种。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、本基金特定风险等。

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。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。

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2018年11月3日,有关财务数据和净值表现截止日为2018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、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)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,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,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总部业务经理、深圳金地证券服务部财务经理、资金财务总部高级经理、总经理助理、副总经理、人力资源总部副总经理等职务。现任国信证券股份有限公司财务负责人、资金财务总部总经理兼人力资源总部总经理。

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、资金财务总部副总经理助理、资金财务总部副总经理等,现任国信证券资金财务总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、菲亚特汽车金融部和变速器平台管控管理团队工作、圣保罗IMI资产管理SGR企业经营部、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。

刘嵚先生,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,现任鹏华基金管理有限公司总裁助理、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,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,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,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。

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,纪委书记,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纪委书记、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

袁航先生,国籍中国,经济学硕士,9年证券基金从业经验。2009年6月加盟鹏华基金管理有限公司,从事行业研究及投资助理相关工作,担任研究部资深研究员、投资经理助理。2014年11月担任鹏华先进制造股票基金基金经理,2015年02月至2017年02月担任鹏华弘盛混合基金基金经理,2015年04月至2017年02月担任鹏华弘泽混合基金基金经理,2015年05月至2017年02月担任鹏华弘实混合基金基金经理,2015年05月至2017年02月担任鹏华弘信混合基金基金经理,2015年06月至2017年09月担任鹏华弘锐混合基金基金经理,2015年08月担任鹏华策略优选混合基金基金经理,2018年05月担任鹏华产业精选基金基金经理。袁航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:

2015年02月至2017年02月担任鹏华弘盛混合基金基金经理

2015年04月至2017年02月担任鹏华弘泽混合基金基金经理

2015年05月至2017年02月担任鹏华弘实混合基金基金经理

2015年05月至2017年02月担任鹏华弘信混合基金基金经理

2015年06月至2017年09月担任鹏华弘锐混合基金基金经理

2015年08月担任鹏华策略优选混合基金基金经理

2018年05月担任鹏华产业精选基金基金经理

本基金历任的基金经理:

2014年11月至2015年12月 梁浩先生

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、上述人员之间不存在近亲属关系。

**二、基金托管人**

(一)基金托管人情况

1、基本情况

名称:中国农业银行股份有限公司(简称中国农业银行)

住所:北京市东城区建国门内大街69号

办公地址:北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座

法定代表人:周慕冰

成立日期:2009年1月15日

批准设立机关和批准设立文号:中国银监会银监复[2009]13号

基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字[1998]23号

注册资本:32,479,411.7万元人民币

存续期间:持续经营

联系电话:010-66060069

传真:010-68121816

联系人:贺倩

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分,总行设在北京。经国务院批准,中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于2009年1月15日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡,成为国内网点最多、业务辐射范围最广、服务领域最广,服务对象最多,业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外,中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉,每年位居《财富》世界500强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行,中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念,坚持审慎稳健经营、可持续发展,立足县域和城市两大市场,实施差异化竞争策略,着力打造"伴你成长"服务品牌,依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品,致力为广大客户提供优质的金融服务,与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行,经验丰富,服务优质,业绩突出,2004年被英国《全球托管人》评为中国"最佳托管银行"。2007年中国农业银行通过了美国SAS70内部控制审计,并获得无保留意见的SAS70审计报告。自2010年起中国农业银行连续通过托管业务国际内控标准(ISAE3402)认证,表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设,品牌声誉进一步提升,在2010年首届"'金牌理财'TOP10颁奖盛典"中成绩突出,获"最佳托管银行"奖。2010年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的"最佳资产托管奖"。2012年荣获第十届中国财经风云榜"最佳资产托管银行"称号;2013年至2017年连续荣获上海清算所授予的"托管银行优秀奖"和中央国债登记结算有限责任公司授予的"优秀托管机构奖"称号;2015年、2016年荣获中国银行业协会授予的"养老金业务最佳发展奖"称号;2018年荣获中国基金报授予的公募基金20年"最佳基金托管银行"奖。

中国农业银行证券投资基金托管部于1998年5月经中国证监会和中国人民银行批准成立,2014年更名为托管业务部/养老金管理中心,内设综合管理部、业务管理部、客户一部、客户二部、客户三部、客户四部、风险合规部、产品研发与信息技术部、营运一部、营运二部、市场营销部、内控监管部、账户管理部,拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

2、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工近240名,其中具有高级职称的专家30余名,服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强,高级管理层均有20年以上金融从业经验和高级技术职称,精通国内外证券市场的运作。

3、基金托管业务经营情况

截止到2018年9月30日,中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共419只。

(二)基金托管人的内部风险控制制度说明

1、内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定,守法经营、规范运作、严格监察,确保业务的稳健运行,保证基金财产的安全完整,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

风险管理委员会总体负责中国农业银行的风险管理与内部控制工作,对托管业务风险管理和内部控制工作进行监督和评价。托管业务部专门设置了风险管理处,配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作,独立行使监督稽核职权。

3、内部控制制度及措施

具备系统、完善的制度控制体系,建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程,可以保证托管业务的规范操作和顺利进行;业务人员具备从业资格;业务管理实行严格的复核、审核、检查制度,授权工作实行集中控制,业务印章按规程保管、存放、使用,账户资料严格保管,制约机制严格有效;业务操作区专门设置,封闭管理,实施音像监控;业务信息由专职信息披露人负责,防止泄密;业务实现自动化操作,防止人为事故的发生,技术系统完整、独立。

(三)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

基金托管人通过参数设置将《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议规定的投资比例和禁止投资品种输入监控系统,每日登录监控系统监督基金管理人的投资运作,并通过基金资金账户、基金管理人的投资指令等监督基金管理人的其他行为。

当基金出现异常交易行为时,基金托管人应当针对不同情况进行以下方式的处理:

1、电话提示。对媒体和舆论反映集中的问题,电话提示基金管理人;

2、书面警示。对本基金投资比例接近超标、资金头寸不足等问题,以书面方式对基金管理人进行提示;

3、书面报告。对投资比例超标、清算资金透支以及其他涉嫌违规交易等行为,书面提示有关基金管理人并报中国证监会。

**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)大连银行股份有限公司

注册地址:大连市中山区中山路88号天安国际大厦49楼

办公地址:大连市中山区中山路88号天安国际大厦9楼

法定代表人:崔磊

联系人:朱珠

客户服务电话:4006640099

网址:www.bankofdl.com

2)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

3)东莞银行股份有限公司

注册地址:东莞市莞城区体育路21号

办公地址:东莞市莞城区体育路21号

法定代表人:卢国锋

联系人:陈幸

客户服务电话:4001196228

网址:www.dongguanbank.cn

4)福建海峡银行股份有限公司

注册地址:福建省福州市台江区江滨中大道358号海峡银行大厦

办公地址:福建省福州市台江区江滨中大道358号海峡银行大厦

法定代表人:俞敏

联系人:黄钰雯

客户服务电话:400-893-9999

网址:www.fjhxbank.com

5)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

6)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:吴学民

联系人:叶卓伟

客户服务电话:4008896588

网址:www.hsbank.com.cn

7)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

8)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

9)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:彭纯

联系人:王菁

客户服务电话:95559

网址:www.bankcomm.com

10)上海银行股份有限公司

注册地址:上海市浦东新区银城中路168号

办公地址:上海市浦东新区银城中路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

11)西安银行股份有限公司

注册地址:陕西省西安市高新路60号

办公地址:陕西省西安市高新路60号

法定代表人:郭军

客户服务电话:40086-96779

网址:www.xacbank.com

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

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

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:北京市西城区金融大街25号

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

15)中国农业银行股份有限公司

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.abchina.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

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

(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)长江证券股份有限公司

注册地址:武汉市新华路特8号长江证券大厦

办公地址:武汉市新华路特8号长江证券大厦

法定代表人:尤习贵

联系人:奚博宇

客户服务电话:95579/4008-888-999

网址:www.95579.com

4)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

5)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

6)方正证券股份有限公司

注册地址:湖南省长沙市天心区湘江中路二段36号华远华中心4、5号楼3701-3717

办公地址:北京市朝阳区北四环中路盘古大观A座40层

法定代表人:高利

联系人:丁敏

客户服务电话:95571

网址:www.foundersc.com

7)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

8)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

9)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

10)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

11)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

12)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

13)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

14)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

15)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

16)上海华信证券有限责任公司

注册地址:上海浦东新区世纪大道100号环球金融中心9楼

办公地址:上海市黄埔区南京西路399号明天广场20楼

法定代表人:陈灿辉

联系人:徐璐

客户服务电话:400-820-5999

网址:www.shhxzq.com

17)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

18)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

19)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

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)中国民族证券有限责任公司

注册地址:北京市朝阳区北四环中路27号盘古大观40-43层

办公地址:北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼

法定代表人:何亚刚

联系人:胡创

客户服务电话:40088-95618

网址:www.e5618.com

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)中山证券有限责任公司

注册地址:深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼7层、8层

办公地址:深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼7层、8层

法定代表人:黄扬录

联系人:罗艺琳

客户服务电话:95329

网址:www.zszq.com

25)中信建投证券股份有限公司

注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址:北京市朝阳门内大街188号

法定代表人:王常青

联系人:刘畅

客户服务电话:95587/4008-888-108

网址:www.csc108.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

(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:400-8980-618

网址:www.chtfund.com

3)北京虹点基金销售有限公司

注册地址:北京市朝阳区工人体育场北路甲2号盈科中心东门2层222单元

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

联系人:陈铭洲

客户服务电话:400-618-0707

网址:www.hongdianfund.com

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:王晓晓

客户服务电话:400-619-9059

网址:www.hcjijin.com

5)北京肯特瑞基金销售有限公司

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:江卉

联系人:韩锦星

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

8)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

9)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

10)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

11)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

12)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

13)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

14)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

15)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

16)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

17)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:陈孜明

客户服务电话:400-921-7755

网址:www.leadfund.com.cn

18)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

19)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

20)上海挖财基金销售有限公司

注册地址:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02/03室

办公地址:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02/03室

法定代表人:胡燕亮

联系人:李娟

客户服务电话:400-025-6569

网址:www.wacaijijin.com

21)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:400-799-1888

网址:www.520fund.com.cn

22)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

23)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

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:400-6099-200

网址:www.yixinfund.com

26)浙江金观诚基金销售有限公司

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

法定代表人:徐黎云

联系人:来舒岚

客户服务电话:400-688-1888

网址:www.jincheng-fund.com

27)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

28)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

29)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:4008769988

网址:www.zscffund.com

30)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销售本基金或变更上述销售机构,并及时公告。

二、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)82021877

传真:(0755)82021165

负责人:范伟强

三、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

办公室地址:深圳市罗湖区笋岗东路中民时代广场A座201

联系电话:(0755)33391280

传真:0755-33033086

联系人:闵齐双

经办律师:闵齐双崔卫群

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:鹏华先进制造股票型证券投资基金

**五、基金运作方式及类型**

契约型开放式,股票型基金

**六、基金的投资目标**

本基金为股票型基金,在有效控制风险前提下,精选优质的先进制造业上市公司,力求超额收益与长期资本增值。

**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,包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券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)。

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:股票资产占基金资产的比例为80%-95%;投资于先进制造业上市公司发行的股票占非现金基金资产的比例不低于80%;基金持有全部权证的市值占基金资产净值的比例不得超过3%;基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计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。

如果法律法规对该比例要求有变更的,以变更后的比例为准,本基金的投资范围会做相应调整。

**八、基金的投资策略**

1、资产配置策略

本基金将通过跟踪考量通常的宏观经济变量(包括GDP增长率、CPI走势、M2的绝对水平和增长率、利率水平与走势等)以及各项国家政策(包括财政、货币、税收、汇率政策等)来判断经济周期目前的位置以及未来将要发展的方向,在此基础上对各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估,制定股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。

2、股票投资策略

本基金通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘优质的上市公司,构建股票投资组合。核心思路在于:1)自上而下地分析行业的增长前景、行业结构、商业模式、竞争要素等分析把握其投资机会;2)自下而上地评判企业的核心竞争力、管理层、治理结构等以及其所提供的产品和服务是否契合未来行业增长的大趋势,对企业基本面和估值水平进行综合的研判,深度挖掘优质的个股。

(1)先进制造业的定义

本基金所指的先进制造业包括:先进装备制造业以及与先进装备制造业密切相关的行业。具体来说包含三类:一是用于装备制造的先进基础机械;二是先进的机械、电子基础件;三是国民经济各部门(能源、交通、原材料、医疗卫生、环保等)科学技术、军工生产所需的成套技术装备。

根据前文定义,投资标的包括机械、军工、电子、通讯设备、医疗设备、电力设备、家电等行业。对于以上行业之外的其他行业,如果其中某些细分行业符合先进制造业的定义,本基金也会酌情将其纳入先进制造业的范围。

(2)自上而下的行业遴选

本基金将自上而下地进行行业遴选,重点关注行业增长前景、行业利润前景和行业成功要素。对行业增长前景,主要分析行业的外部发展环境、行业的生命周期以及行业波动与经济周期的关系等;对行业利润前景,主要分析行业结构,特别是业内竞争的方式、业内竞争的激烈程度、以及业内厂商的谈判能力等。基于对行业结构的分析形成对业内竞争的关键成功要素的判断,为预测企业经营环境的变化建立起扎实的基础。

(3)自下而上的个股选择

本基金通过定性和定量相结合的方法进行自下而上的个股选择,对企业基本面和估值水平进行综合的研判,精选优质个股。

1)定性分析

本基金通过以下两方面标准对股票的基本面进行研究分析并筛选出优质的上市公司:

一方面是竞争力分析,通过对公司竞争策略和核心竞争力的分析,选择具有可持续竞争优势的上市公司或未来具有广阔成长空间的公司。就公司竞争策略,基于行业分析的结果判断策略的有效性、策略的实施支持和策略的执行成果;就核心竞争力,分析公司的现有核心竞争力,并判断公司能否利用现有的资源、能力和定位取得可持续竞争优势。

另一方面是管理层分析,在国内监管体系落后、公司治理结构不完善的基础上,上市公司的命运对管理团队的依赖度大大增加。本基金将着重考察公司的管理层以及管理制度。

2)定量分析

本基金通过对上市公司定量的估值分析,挖掘优质的投资标的。通过对估值方法的选择和估值倍数的比较,选择股价相对低估的股票。就估值方法而言,基于行业的特点确定对股价最有影响力的关键估值方法(包括PE、PEG、PB、PS、EV/EBITDA等);就估值倍数而言,通过业内比较、历史比较和增长性分析,确定具有上升基础的股价水平。

3、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、个券选择策略、信用策略等积极投资策略,自上而下地管理组合的久期,灵活地调整组合的券种搭配,同时精选个券,以增强组合的持有期收益。

4、权证投资策略

本基金通过对权证标的证券基本面的研究,并结合权证定价模型及价值挖掘策略、价差策略、双向权证策略等寻求权证的合理估值水平,追求稳定的当期收益。

**九、基金的业绩比较基准**

本基金业绩比较基准:

中证装备产业指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20%

中证装备产业指数是中证产业系列指数之一,反映沪深A股中装备产业公司股票的整体表现。全部样本由中证800样本中装备产业的个股组成,采用派许加权方法,按照样本股的调整股本数为权数加权计算。中证综合债指数的选样债券的信用类别覆盖全面,期限构成宽泛,适于做基金债券资产的业绩比较基准。基于本基金的投资范围和投资比例限制,选用上述业绩比较基准能够忠实反映本基金的风险收益特征。

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,属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种。

**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。

基金托管人中国农业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 | 410,792,644.74 | 57.07 |
| | 其中:股票 | 410,792,644.74 | 57.07 |
| 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 | 291,033,553.41 | 40.44 |
| 8 | 其他资产 | 17,929,810.19 | 2.49 |
| 9 | 合计 | 719,756,008.34 | 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

| 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 | 356,435,587.92 | 63.90 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 3,655,836.00 | 0.66 |
| F | 批发和零售业 | 10,365,927.00 | 1.86 |
| 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 | 17,047,959.84 | 3.06 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 6,041,592.58 | 1.08 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 5,928,882.96 | 1.06 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 6,457,252.64 | 1.16 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 4,859,605.80 | 0.87 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 410,792,644.74 | 73.65 |

(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

| 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 | 600031 | 三一重工 | 5,093,364 | 45,229,072.32 | 8.11 |
| 2 | 002013 | 中航机电 | 4,461,987 | 37,480,690.80 | 6.72 |
| 3 | 300003 | 乐普医疗 | 948,880 | 28,798,508.00 | 5.16 |
| 4 | 000338 | 潍柴动力 | 3,368,023 | 28,796,596.65 | 5.16 |
| 5 | 002507 | 涪陵榨菜 | 1,048,980 | 27,325,929.00 | 4.90 |
| 6 | 002202 | 金风科技 | 1,589,733 | 19,092,693.33 | 3.42 |
| 7 | 002531 | 天顺风能 | 4,820,994 | 18,994,716.36 | 3.41 |
| 8 | 300047 | 天源迪科 | 1,348,731 | 17,047,959.84 | 3.06 |
| 9 | 600419 | 天润乳业 | 1,101,451 | 16,940,316.38 | 3.04 |
| 10 | 002304 | 洋河股份 | 130,271 | 16,674,688.00 | 2.99 |

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

注: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

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。

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 | 216,906.92 |
| 2 | 应收证券清算款 | 17,639,349.82 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 33,595.47 |
| 5 | 应收申购款 | 39,957.98 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 17,929,810.19 |

(4)报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:无。

(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。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。

基金合同生效以来的投资业绩及其与同期基准的比较如下表所示

| | 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 2014年11月04日(基金合同生效日)至2014年12月31日 | 4.50% | 0.46% | 11.99% | 1.51% | -7.49% | -1.05% |
| 2015年01月01日至2015年12月31日 | 47.08% | 2.96% | 18.05% | 2.56% | 29.03% | 0.40% |
| 2016年01月01日至2016年12月31日 | -7.61% | 1.87% | -16.16% | 1.55% | 8.55% | 0.32% |
| 2017年01月01日至2017年12月31日 | 15.70% | 0.85% | 1.24% | 0.73% | 14.46% | 0.12% |
| 2018年01月01日至2018年09月30日 | -17.77% | 1.25% | -18.77% | 1.07% | 1.00% | 0.18% |
| 自基金合同生效日至2018年09月30日 | 35.10% | 1.90% | -8.86% | 1.65% | 43.96% | 0.25% |

**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1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下:

$H=E\times1.5\%\div$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3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0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

$H=E\times0.25\%\div$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3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、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。

四、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 | 1.5% | 0.6% |
| 100万≤M<500万 | 1.0% | 0.3% |
| 500万≤M<1000万 | 0.3% | 0.06% |
| M≥1000万 | 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:

| 持有年限(Y) | 赎回费率 |
|---|---|
| Y<7天 | 1.5% |
| 7天≤Y<30天 | 0.75% |
| 30天≤Y<1年 | 0.5% |
| 1年≤Y<2年 | 0.25% |
| Y≥2年 | 0 |

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30日的投资人收取的赎回费全额计入基金财产;对持续持有期少于3个月的投资人收取的赎回费总额的75%计入基金财产;对持续持有期长于3个月但少于6个月的投资人收取的赎回费总额的50%计入基金财产;对持续持有期长于6个月的投资人,将不低于赎回费总额的25%计入基金财产。上述未纳入基金财产的赎回费用于支付登记费和其他必要的手续费。

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。

基金财产投资的相关税收,由基金份额持有人承担,基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

**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**

2018年12月