鹏华永泽18个月定期开放债券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:招商银行股份有限公司

重要提示

本基金经2016年9月28日中国证券监督管理委员会下发的《关于准予鹏华永泽18 个月定期开放债券型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2016]2238号)注册,进行 募集。根据相关法律法规,本基金基金合同已于2018年1月24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 金速 自进入除此外日季9997月19197日494次(18947月18日) 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 初,燕亚宁国宏创为业分印刻成为中尚新广王成动力以及八江及以本强面前,这主场 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、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、中小企业私募债券的流动性风险在干该类 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,各类材料(包括招募说明书、审计报告)不公开发布,也大大提高了分析并

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。

基金管理人依昭恪尽职守.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会托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为2018年7 月23日,有关财务数据和净值表现截止日为2018年6月30日(未经审计)。 一、基金管理人

、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 7、联系人:吕奇志 8、注册资本:人民币1.5亿元

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 (EurizonCapital 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%	

1 基全管理人董事会成员 1、基並官理人重事表版页 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,总委理,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 齿黍共记 脓化其全管理有限公司董事长

国中区、兄安节记、前年基立旨建有限公司重申区。 邓召明任生、董事、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总裁、党总支书 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、深圳市海外等省章公司常务副总经业 主任科员,中共深圳市委政策研究室副处长、深圳市海外省章公司常务副总经业、深圳市 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 吸入可量单点数,国信证券股份有限公司献总裁、国信证券股份有限公司总司领司。 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 SCR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 Agricol 成份可換之可(CAM SUN)及貨幣處面,我並且另方決負集例(Gedit Aglicule Alternative Investments Group)国际执行委员会委员。意大利放利惠资本资产管理 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 apital 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 国信证证son Capital SGR SpA,治理与版技成部工作,现在担任意大利欧利盛资本资产管理股份公司(Eurizon Capital SGR SpA)治理与股技成部工作,现在担任意大利欧利盛资本资产管理股份公司(Eurizon Capital SGR SpA)道事会秘与兼任企业事务部总经理,欧利盛资本股份公司(Eurizon Capital SA)(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、调播;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 別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 第法规部(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 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

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 剪任職化其全管拥有限公司董事 监事 和任涇圳市北融信投资发展有限公司董事

、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、资金财务部总经理助理、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。

国间止券資並剪秀品部制品经理集資並返當能品经理。嚴質應券能品经理。 SANDRO VESPRINI先生,监事,工商管理学士、調籍。意大利、先后在米兰军医院 出纳部、税务师事务所,非亚特汽车发动机和变速器平台管控管理团队工作、圣保罗IMI 帝产管理SGR企业经管部、圣保罗财富管理企业管控部工作、曾任欧利威资本资产管理

の「当年の小正生で自由、主体タ列南当生正生当またり。」「下、自じか村地京年の「一当生 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月加盟鵬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

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?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

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、等务副总经职、总经职、资本书记、积功及展银行行长助理、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,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

外口的几年,重平,8%,完了不同。」,即即,自解于阳。 // 日本环堡上八千号堡马 经济学院讲师,中国兵籍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总裁、党总 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总裁、党总 高阳先生,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

|公理 ||博聞其今等理有阻八司博財价值增长其令其令公理 ||安康公司 2.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 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就上商自己的过去。 员,中国证监会办公厅副处级秘书,全国社保基金理事会部步投资搬达、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。 职上监事,现让脚平基金管理有限公司副忌裁。 高永杰先生,督督长,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督察长。 韩亚庆先生,副这经理,经济学硕士。国籍:中国。历任国家开发银行资金局主任科 员、全国社保基金理等会投资部副调研员、南方基金管理有限公司固定收益阁基金经 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 4 木其仝却任其仝经理

《八字墓正》以上参亚工程 稅於先生,围籍中国,经济学硕士,12年证券基金从业经验。曾任职于中国工商银行 深圳市分行资金营运部,从事债券投资及理财产品组合投资管理;招商银行总行金融市 场部,担任代客理财投资经理,从事人民市理财产品组合的投资管理工作。2014年1月 加盟鹏华基金管理有限公司,从事债券投资管理工作。2014年02月担任鹏华丰润债券 加品牌产品或自建市限农村,从中国分享及自建工厂。2014年02月12日期2年中间取分(几0下)基金基金经理,2014年02月至2018年03月担任期华产业债基金基金经理,2015年03月至2018年03月担任期华产业债基金基金经理,2015年03月至2018年03月担任期华产业债基金基金经理,2015年12月至2018年04月担任期华丰华债券基金基金经理, 2016年02月至2018年04月担任鹏华弘泰混合基金基金经理,2016年06月至2018年04 月担任鹏华金城保本混合基金基金经理,2016年06月担任鹏华丰茂债券基金基金经

月但江鲫毕亚城床本能百磨壶麓並总理,2016年00月但江鲫毕于戊顷乔藤亚雄蓝龙 理,2016年12月担任鄮鲜丰惠债券基金基金经理,2016年12月至2018年07月担任鹏鲜 丰盈债券基金基金经理,2016年12月担任鹏华永盛定期开放债券基金基金经理,2017 F03月担任鹏华永安定期开放债券基金基金经理、2017年05月担任鹏华永泰定期开放 债券基金基金经理,2018年01月担任鹏华永泽定期开放债券基金基金经理,2018年02 與外經並歷並至理。2016年5月月1日1日第4年7年1年,附近以外經並8 月担任聯华主送债券基金基金營理,80%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: 2014年02月担任聯华丰润债券(LOF)基金基金经理

2014年02月至2018年04月担任鹏华普天债券基金基金经理

2014年03月担任鹏华产业债基金基金经理 2015年03月至2018年03月担任鹏华双债加利债券基金基金经理

2015年12月至2018年04月担任鹏华丰华债券基金基金经理 2016年02月至2018年04月担任鹏华弘泰混合基金基金经理 2016年06月至2018年04月担任鹏华金城保本混合基金基金经理

2016年06月至2016年04月担任聯华主 城保华 2016年06月担任聯华丰茂债券基金基金经理 2016年12月担任鹏华丰惠债券基金基金经理

2016年12月至2018年07月担任鹏华丰盈债券基金基金经理

2016年12月担任鹏华永盛定期开放债券基金基金经理 2017年03月担任鹏华永安定期开放债券基金基金经理

2017年05月担任鹏华永泰定期开放债券基金基金经理

2018年02月担任鹏华丰达债券基金基金经理

周恩源先生,国籍中国,经济学博士,6年证券基金从业经验。2012年6月加盟鹏华基

周波爾元王,圖爾中國,至67年時上,69年底才維重水壓左擊。2012年6月7周萬爾宁華 營理有限公司,从事债券投资研究工作,担任固定收益部基金经理助理局級债券研 2员,2016年02月担任鵬华丰泽债券(LOF)基金基金经理,2016年02月担任鵬华弘泽

昆合基金基金经理,2016年09月担任鹏华丰饶债券基金基金经理,2016年09月担任鹏 华弘腾混合基金基金经理,2016年09月至2018年07月担任鹏华弘康混合基金基金经 十五%性日產至產至至4.2000年20万主2014年10万主2014年13年12年至產至至 理,2016年10月至2018年07月担任勝华主省協議合基金基金经理,2017年03月担任勝华 丰享债券基金基金经理,2017年03月担任勝华丰玉债券基金基金经理,2017年05月担 任勝华弘泰混合基金基金经理,2017年07月担任勝华丰高债券基金基金经理,2017年 7月至2018年03月担任鹏华丰玺债券基金基金经理、2018年02月担任鹏华永泽定期开 7/7三2416+405/1日111日第十十二版/分審立本並立工年,24/16 放债券基金基金经理。周恩源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: 2016年02月担任鹏华丰泽债券(LOF)基金基金经理

2016年02月担任鹏华弘泽混合基金基金经理

2016年10月至2018年07月担任鹏华弘尚混合基金基金经理

2016年09月担任職生主饶债券基金基金经理 2016年09月担任鹏华弘腾混合基金基金经理 2016年09月至2018年07月担任鹏华弘康混合基金基金经理

2017年03月担任鹏华丰玉债券基金基金经理 2017年05月担任鹏华弘泰混合基金基金经理 2017年07月担任職生主源债券基金基金经理 017年07月至2018年03月担任鹏华丰玺债券基金基金经理

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董事、总裁、党总支书记。 高阳先生,鹏华基金管理有限公司副总裁。 邢彪先生,鹏华基金管理有限公司副总裁。

韩亚庆先生 雕化基全管理有限公司副总裁 等也以大元工, 勝乎基金市 2年月秋公司明念來。 梁浩先生, 鵬华基金曾理有限公司研究部总经理, 鵬华新兴产业混合、鵬华研究精 选混合、鵬华创新驱动混合基金经理。

6、上述人员之间不存在近亲属关系 二、基金托管人

名称·招商银行股份有限公司(以下简称"招商银行")

名称:拍商银行取好有限公司(以下间标)拍商银 设立日期:1987年4月8日 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

资产托管业务批准文号:证监基金字[2002]83号 电话:0755?83199084 传真:0755?83195201

资产托管部信息披露负责人:张燕

总行设在深圳。自成立以来,招商银行先后进行了三次增资扩股,并于2000年3月成功地 发行了15亿A股、4月9日在上交所挂牌(股票代码;600036),是国内第一家采用国际会 计标准上市的公司,2006年9月又成功发行了22亿日股。月22日在香港联步所挂牌交易 (股票代码;3968),10月5日行使出股超额配售,共发行了242亿H股。截至2018年3月 31日,本集团总资产62,522,38亿元人民币,高级法下资本充足率15,51%,权重法下资本

70元年31.47%。 2002年8月,招商银行成立基金托管部;2005年8月,经报中国证监会同意,更名为 资产托管部,下设业务管理室,产品管理室、业务营运室、稽核监察室、基金外包业务室5 个职能处室,现有员工81人。2002年11月,经中国人民银行和中国证监会批准获得证券 投资基金托管业务资格,成为国内第一家获得该项业务资格上市银行:2003年4月,正式 汉风盛或尤语显对双针,成为副分第一多欢符及必要进力以付上印度针完加分平4万,压力,如理基金注管业务,招商课行作为托管业务资质是全的商业银行;拥有证券较资基金托管、受托投资管理托管、合格境外机构投资者托管(QFII)、合格境内机构投资者托管 (ODII)、全国社会保障基金托管、保险资金托管、企业年金基金托管等业务资格。

综合系统和"6心"托管服务标准,首家发布私募基金绩效分析报告,开办国内首个托管 银行网站,成功托管国内第一只券商集合资产管理计划、第一只FOF、第一只信托资金 资产、第一单TOT保管,实现从单一托管服务商向全面投资者服务机构的转变,得到了 "中国最佳托管专业银行"。2016年6月招商银行荣膺《财资》"中国最佳托管银行奖",成为国内唯一获奖项国内托管银行;"托管通"获得国内《银行家》2016中国金融创新

十佳金融产品创新奖";7月荣膺2016年中国资产管理【金贝奖】"最佳资产托管银 行",2017年6月再度荣膺《财资》"中国最佳托管银行奖","全功能成上托管银行20、 荣获《银行家》2017中国金融创新"十佳金融产品创新奖";8月荣膺国际财经权威媒体 《亚洲银行家》"中国年度托管银行奖",2018年1月获得中央国债登记结算有限责任公 司 "2017年度优秀资产托管机构" 奖项,同月招商银行 "托管大数据平台风险管理系 统"荣获2016-2017年度银监会系统"金点子"方案一等奖,以及中央金融团工委、全国 金融青联第五届"双提升"金点子方案二等奖;3月招商银行荣获公募基金20年"最佳 基金托管银行"奖。

李建红先生,本行董事长,非执行董事,2014年7月起担任本行董事,董事长,英国东 董事长和招商局资本投资有限责任公司董事长。曾任中国远洋运输(集团)总公司总裁

海银行副行长、中国建设银行上海市分行副行长、深圳市分行行长、中国建设银行零售 业务总监源北京市分行行长。 正良先生、本行副行长,货币银行学硕士,高级经济师。1991年至1996年,在中国科 技国际信托投资公司工作。1996年6月至2001年10月,历任招商银行北京分行展览路支 行、东三环支行行长助理、副行长、行长、北京分行风险控制部总经理;2001年10月至 2006年3月,历任北京分行行长助理、副行长:2006年3月至2008年6月,任北京分行党委 2004年3月,仍正允次7月11,2008年6月至2012年6月,任北京分行行长、党委书记;2012年6月至2013年11月,任祝商银行总行行长、党委书记;2013年11月,任祝商银行总行行长助理兼北京分行行长、党委书记;2013年11

产托管部经理、高级经理、总经理助理等职。是国内首家推出的网上托管银行的主要设 计 开始者之一 具有20余年银行信贷及托管专业从业经验。在托管产品创新、服务流程 计、开及看之一,具有20末年银行后页及代售专业从业总验。任代官产品则 优化、市场营销及客户关系管理等领域具有深入的研究和丰富的实务经验。 (三)基金托管业务经营情况

截至2018年3月31日,招商银行股份有限公司累计托管364只开放式基金。 (四) 托管人的内部控制制度

云作的经营思想和经营理念;形成科学合理的决策机制、执行机制和监督机制,防范 和化解经营风险。确保托管业务的稳健运行和托管资产的安全完整,建立有利于查错防 整、接塞漏洞、消除障患、保证业务稳健运行的风险控制制度、确保托管业务信息直立

级风险防范是在招商银行总行展而对风险进行颁防和控制; 二级风险防范是招商银行资产托管部设立稽核监察室,负责部门内部风险预防和

三级风险防范是招商银行资产托管部在设置专业岗位时,遵循内控制衡原则,监督 制衡的形式和方式视业务的风险程度决定。

(2) 申菁任职则。代管程等体系的特殊、内部管理制度的建立为以的记风磁、申菁 官为出发点。体现"内控优先"的要求,以有效防范各种风险作为内部控制的核心。 (3) 独立性原则。招商银行资产任管部格室、各岗位职责保持相对独立、不同托管 产之间、托管资产和自有资产之间相互分离。内部控制的检查、评价部门独立于内部 控制的建立和执行部门。

利,内部控制存在的问题能够得到及时的反馈和纠正。 (5)适应性原则。内部控制适应招商银行托管业务风险管理的需要,并能够随着托 管业各经营战略,经营方针,经营理令等内部环境的变化和国家法律,法规,政策制度等 外部环境的改变及时进行修订和完善

(7)重要性原则。内部控制在实现全面控制的基础上,关注重要托管业务事项和高

(8)制衡性原则。内部控制能够实现在托管组织体系、机构设置及权责分配、业务 流程等方面形成相互制约、相互监督,同时兼顾运营效率。 内部控制措施 (1)完善的制度建设。招商银行资产托管部从资产托管业务操作流程、会计核算

(2)经营风险控制。招商银行资产托管部制定托管项目审批、资金清算与会计核算 双人双岗、大额资金专人跟踪、凭证管理等一系列完整的操作规程,有效地控制业务运

3)业务信息风险控制。招商银行资产托管部在数据传输和保存方面有严格的加 密和备份措施,采用加密、直连方式传输数据,数据执行异地实时备份,所有的业务信息 须经过严格的授权方能进行访问。 (4)客户资料风险控制。招商银行资产托管部对业务办理过程中形成的客户资料。

房24小时值班并设置门禁管理、电脑密码设置及权限管理、业务网和办公网、托管业务

网与全行业务网双分离制度。与外部业务机构实行防火增保护,对信息技术系统采取两地三中心的应急备份管理措施等,保证信息技术系统的安全。 (6)人力资源控制。招商银行资产托管部通过建立良好的企业文化和员工培训、激

励机制 加强人力资源管理及建立人才梯级队伍及人才储务机制 有效的进行人力资源 五)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

法》等有关法律法规的规定及基金合同、托管协议的约定,对基金投资范围、投资比例、 投资组合等情况的合法性、合规性进行监督和核查。 及风组口 守间仍即7日 GCE、口然已在17面18和1848里。 在为基金投资运作所提供的基金消算和核算服务环节中,基金托管人对基金管理 人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与支付情况进行检查监督,对违反

基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政 法抑和其他有关规定 或者违反基金会同约定 及时以书面形式通知基金管理人进行整 在2004年使用大规定,或者证及基金百四约定,及时以寸加形式进风速至音速入近行整 效,整改的时限应符合法律法规及基金合同允许的调整期限、基金管理人收到增知后应 及时核对确认并以书面形式向基金托管人发出回函并改正。基金管理人对基金托管人 通知的违规事项未能在限期内纠正的,基金托管人应报告中国证监会。

三、相关服务机构 一、基金份额发售机构 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

联系电话:0755-82021233 传真:0755-82021155 联系人:吕奇志

図址:www.phfund.com

(2) 鵬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

(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 传真:021-68876821

联系人,张周周

联系申话:027-85557881

(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

办公地址:北京复兴门内大街55号 注定代表人:易会满 联系人:刘秀宇 客户服务电话:95588

网址:www.icbc.com.cn 3)中国银行股份有限公司 注册地址:北京市复兴门内大街1号 办公地址:北京市复兴门内大街1号

法定代表人:陈四清 联系人: 陈洪源 客户服务电话:95566 网址:www.boc.cn (2)证券公司销售机构

1)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

在加地证: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 字户服务由话·95525

网址:www.ebscn.com 2)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

伝た代表人: 土市育 联系人: 刘畅 客户服务电话: 95587/4008-888-108 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

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,何加

联系电话:(0755)82021877 传真:(0755)82021165 负责人:范伟强 贝贡人: 泡带強 三、出具法律意见书的律师事务所 名称: 上海市通力律师事务所

住所:上海市银城中路68号时代金融中心19楼 负责人:俞卫锋 公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼

经办律师:黎明、丁媛 四、会计师事务所 全称: 毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙) 住所:北京市东城区东长安街1号东方广场东2座办公楼8层 办公地址:北京市东城区东长安街1号东方广场东2座办公楼8层

联系电话:(0755)2547 1000 传真:(0755)8266 8930 联系人, 蔡正轩

五、基金运作方式及类型 契约型开放式,债券型基金

自基金合同生效之日(含)起或自每一开放期结束之日次日(含)起18个月的期间封闭 作,不办理申购与赎回业务,也不上市交易。 本基金自封闭期结束之后第一个工作日(含)起进入开放期,每个开放阴原则上不 产于五个工作日、不超过二十个工作日,开放阴的具体时间以基金管理人届时公告为 提。如发生不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放或需依据基金合同暂停申购与

本基金以定期开放方式运作,即采用封闭运作和开放运作交替循环的方式。本基金

七、基金的投资方向 本基金的投资范围主要为具有良好添加性的金融工具,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、超短期融资券、可转换债券(含可分离交易可转债)、可交换债券、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

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,可以不可求的认为[15] [15] [15] [15] 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%,但在每次开放期前两个月、开放期内及开放期结束后两个月的期间内,基金投资不受上述比例

限制;开放期内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 ni tni;注往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

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

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,及债券与现金类资产之间进行动态调整。 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

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。

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 《黑中田远》的形象、几处为同时的遗址之间,外疆显示为自由的独立与 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。

小縣並将來用到樂果與可頭租首的持有則較益。这一果會和即也以收益學曲說的 分析,在可透的目标久期区间买人期限位于收益率曲线較減夠处右侧的债券。在收益率 曲线不变动的情况下,随着其剩余期限的装減。债券收益率将沿着旋峭的收益率曲线有 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

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家相对于市场收益家由线的偏离程度 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

本基金将深入研究发行人资信及公司运营情况,与中小企业私募债券承销券商紧 密合作,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,力求规避可能存在的债券违约,并获取超额收

8、资产支持证券的投资策略 本其全将综合运用战略资产配置和战术资产配置进行资产支持证券的投资组合管 · 本語並行综合每日於問政學政學的是相似小政學成學的是近代文學、共學此學的教育 理,并根据信用风險、和德和股險和流過性风险变化的報酬數投資策略,严格遵守法律法 規和基金合同的約定,在保证本金安全和基金资产流动性的基础上获得稳定收益。

1.权宜决束依据 (1)有关法律、法规和基金合同的有关规定。 (2)经济运行态势和证券市场走势。

(3)投资对象的风险收益配比。

(1)投资决策参归会:确定本基金总体资产分配和投资策略。投资决策委员会定期 召开会议,如需做出及时重大决策或基金经理小组提议,可临时召开投资决策委员会会

走的基本因素包括,每日基份组计设计和####就及月显行。设计和####就及自己市安宁 虑的基本因素包括,每日基金申购取赎回净现金流量;基金合同的投资限制和比例限制;研究团的投资建议;基金经理的独立判断;绩效与风险评估小组的建议等。 (3)集中交易室:基金经理向集中交易室下达投资指令,集中交易室经理收到投资

指令后分发予交易员,交易员收到基金投资指令后准确执行。 (4) 绩效与风险评估小组: 对基金投资组合进行评估, 向基金经理(或管理小组)

(6)本基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据市场环境变化和

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 n.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

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的指数时,本基金管理 人与基金托管人协商一致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

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。 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7月17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证 载、误导性陈述或者重大遗漏。 本报告中财务资料未经审计。

2 基金投资 3 固定收益投 其中:债券 245.534.600 贵金属投资 买人返售金融资 其中:买断式回则 人返售金融资产 银行存款和结算备付合计

(1)报告期末按行业分类的境内股票投资组合 (2)报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合 到小数点后两位,余额部分计人基金资产;鹏华钢铁分级份额的场内份额、鹏华钢铁A

鹏华钢铁分 38,396.00 鹏华钢铁A份 8.531.00

投资者自公告之日起可查询经基金份额登记人及本公司确认的折算后份额

系统内转托管、跨系统转托管)、配对转换业务,鹏华钢铁A份额及场内鹏华钢铁分级份

二. 重要提示

1、根据上海证券交易所相关业务规则,2018年09月05日鹏华钢铁A即时行信显示 的前收盘价为2018年09月04日的鹏华钢铁A的基金份额参考净值,即1.000元,由于鹏 华钢铁A折算前存在折价交易情形,2018年09月03日的收盘价为0.976元,扣除约定收 益后为0.931元,与2018年09月05日的前收盘价存在较大差异。2018年09月05日当日鹏 华钢铁A份额可能出现交易价格波动的情形。敬请投资者注意投资风险。

2、根据上海证券交易所相关业务规则,2018年09月05日鹏华钢铁分级场内份额即 时行情显示的前收盘价为2018年09月04日的鹏华钢铁分级份额的基金份额净值,即 0.872元,由于鹏华钢铁分级场内份额折算前存在溢价交易情形,2018年09月03日的收 盘价为0.885元,与2018年09月05日的前收盘价存在较大差异。2018年09月05日当日鹏 华钢铁分级场内份额可能出现交易价格大幅波动的情形。敬请投资者注意投资风险。

3、鹏华钢铁A份额的约定应得收益将折算成鹏华钢铁分级场内份额分配给鹏华钢 铁A份额的持有人,而鹏华钢铁分级份额为跟踪国证钢铁行业指数的基础份额,其份额 净值将随市场涨跌而变化,因此鹏华钢铁A份额持有人预期收益的实现存在一定的不 确定性,可能会承担因市场下跌而遭受损失的风险。

铁分级份额的场内份额数和鹏华钢铁分级份额的场内份额经折算后的份额数取整计算 (最小单位为1份),不足1份的零碎份加总后保留至整数位(最小单位为1份),按各个 场内价额持有人零碎份从大到小的排序,依次向相应的基金份额持有人记增1份,直至 所有零碎份的合计份额分配完毕、鹏华钢铁A份额或鹏华钢铁分级场内份额的份额持 有人存在无法获得新增鹏华钢铁分级场内份额的可能性。 5、根据《鹏华国证钢铁行业指数分级证券投资基金基金合同》中关于鹏华钢铁。

的金融机构人民币一年期定期存款基准利率为准。鉴于2018年09月04日中国人民银行 公布的金融机构人民币一年期定期存款基准利率为1.5%,因此鹏华钢铁A份额约定年 基准收益率从2018年09月04日起调整为4.5%。 6、二级市场可以做交易的证券公司并不全部具备中国证监会颁发的基金销售资 格,而投资者只能通过具备基金销售资格的证券公司赎回基金份额。因此,如果投资者 通过不具备基金销售资格的证券公司购买鹏华钢铁A份额,在定期份额折算后,则折算

或者在折算后将新增的鹏华钢铁分级份额转托管到具有基金销售资格的证券公司后赎 7、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资产,但不保证基

和招募说明书及更新等相关法律文件。敬请投资者注意投资风险。 投资者若希望了解基金份额折算业务详情,请登陆本公司网站;www.phfund.co 者拨打本公司客服电话:400-6788-999 (免长途话费)。

鹏华国证钢铁行业指数分级证券 投资基金定期份额折算前收盘价 调整的公告 根据《鹏华国证钢铁行业指数分级证券投资基金基金合同》的约定,鹏华国证钢钨

09月05日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及鹏华基金管理有限公 司网站上的《鹏华国证钢铁行业指数分级证券投资基金定期份额折算结果及恢复交易 根据上海证券交易所的相关业务规则、2018年09月05日雕华钢铁A即时行情显示 的前收盘价为2018年09月04日的鹏华钢铁A的基金份额参考净值,即1.000 元,由于鹏 生钢铁A折筒前存在折价交易情形、2018年09月03日的收费价为0.976元、扣除约定收

外份额)办理了定期份额折算业务。对于定期份额折算的结果及相关事宜,详见2018年

时行情显示的前收盘价为2018年09月04日的鹏华钢铁分级份额的基金份额净值,即 0.872元、由于场内雕华钢铁分级价额折算前存在溢价交易情形,2018年09月03日的收 盘价为0.885元,与2018年09月05日的前收盘价存在较大差异。2018年09月05日当日均 内瞻华钢铁分级价额可能出现交易价格大幅波动的情形。敬请投资者注意投资风险。 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财产,但不保

在该日登记在册的雕华高铁A份额(场内简称:高铁A,基金代码:150277)和雕华中i 高铁产业指数分级证券投资基金份额(基金简称:鹏华高铁分级,场内简称:高铁分级 基金代码:160639)(以下简称"本基金")办理了定期份额折算业务,现将折算结果及 恢复交易相关事项公告如下: 一、份额折算结果 2018年09月03日,鹏华高铁分级份额的场外份额经折算后的份额数按截位法保留

行投资。敬请投资者注意投资风险。

到小数点后两位,余额部分计人基金资产;鹏华高铁分级份额的场内份额、鹏华高铁A 份额经折算后的份额数取整计算(最小单位为1份),余额部分计入基金资产。基金份额 内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。 上述"一、基金费用的种类中第3-9项费用",根据有关法规及相应协议规定,按费

基金份额 名称	折算前基金份額 (单位:份)	新增份額 折算比例	折算后基金份額 (单位:份)	折算后基金 份 額 净 值 (单位:元)
鹏华高铁 分级场外 份额	79,532,246.07	0.014579048	80,691,750.50	0.846
鹏华高铁 分级场内 份额	4,543,915.00	0.014579048	4,610,160.00	0.846
鹏华高铁 A份鄉	25,355,617.00	0.029158097	25,355,617.00	1.000

注:鹏华高铁A份额经折算后产生新增的鹏华高铁分级场内份额。 投资者自公告之日起可查询经基金份额登记人及本公司确认的折算后份额。

1、根据《深圳证券交易所证券投资基金交易和申购赎回实施细则》,2018年09月 05日鹏华高铁A即时行情显示的前收盘价为2018年09月04日的鹏华高铁A的基金份额 参考净值,即1.000元,由于鹏华高铁A折算前存在折价交易情形,2018年09月03日的收 盘价为0.961元,扣除约定收益后为0.936元,与2018年09月05日的前收盘价存在较大差 异。2018年09月05日当日鹏华高铁A份额可能出现交易价格波动的情形。敬请投资者注

铁A份额的持有人,而鹏华高铁分级份额为跟踪中证高铁产业指数的基础份额,其份额 净值将随市场涨跌而变化,因此鹏华高铁A份额持有人预期收益的实现存在一定的不 确定性,可能会承担因市场下跌而遭受损失的风险。 3、根据深圳证券交易所的相关业务规则,鹏华高铁A份额新增份额折算成鹏华高 铁分级份额的场内份额数和鹏华高铁分级份额的场内份额经折算后的份额数取整计算

2. 聽生高铁A份麵的约定应得收益将折算成雕生高铁分级场内份麵分配给廳生高

4. 根据《雕作中证高铁产业指数分级证券投资基金基金合同》中关于雕作高铁点 份额(场内简称:高铁A;基金代码:150277)约定年基准收益率的相关约定:鹏华高铁 A份麵约定在基准收益率为"同期銀行人早币—年期定期存款利率(税后)+3%"。同 期银行人民币一年期定期存款利率以最近一次份额折算基准日次日中国人民银行公布 的金融机构人民币一年期存款基准利率为准。鉴于2018年09月04日中国人民银行公布 的金融机构人民币一年期定期存款基准利率为1.5%,因此鹏华高铁A份额约定年基准

果投资者通过不具备基金销售业务资格的证券公司购买鹏华高铁A份额,在定期份额 折算后,则折算新增的鹏华高铁分级份额无法赎回。投资者可以选择在折算前将鹏华高 铁A份额卖出,或者在折算后将新增的鹏华高铁分级份额转托管到具有基金销售业务 资格的证券公司后赎回。 6、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资产,但不保证基

金一定盈利,也不保证最低收益。投资者投资于本基金前应认真阅读本基金的基金合同

和招募说明书及更新等相关法律文件。敬请投资者注意投资风险。 投资者若希望了解基金份额折算业务详情,请登陆本公司网站:www.phfund.g 或者拨打本公司客服电话:400-6788-999 (免长途话费)。

收益率从2018年09月04日起调整为4.5%。

调整的公告 根据《鹏华中证高铁产业指数分级证券投资基金基金合同》的约定,鹏华中证高铁 空业指数分级证券投资基金以2018年09月03日为基金份额折算基准日,对在该日登记 在册的鹏华高铁A份额(场内简称:高铁A,基金代码:150277)和鹏华高铁分级份额

基金简称:鹏华高铁分级,场内简称:高铁分级,基金代码:160639)办理了定期份额折 算业务。对于定期份额折算的结果及相关事宜,详见2018年09月05日刊登在《中国证券 报》、《上海证券报》、《证券时报》及鹏华基金管理有限公司网站上的《鹏华中证高铁 产业指数分级证券投资基金定期份额折算结果及恢复交易的公告》。 根据《深圳证券交易所证券投资基金交易和申购赎回实施细则》,2018年09月08 日鹏华高铁A即时行情显示的前收盘价为2018年09月04日的鹏华高铁A的基金份额参 考净值,即1.000元,由于鹏华高铁A折算前存在折价交易情形,2018年09月03日的收盘

证基金一定盈利,也不保证最低收益。投资者投资于本公司基金时应认真阅读相关基金

鹏华基金管理有限公司

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 伝足へ表へ: 字屋红 联系人: 邓炯鹏 客户服务电话: 95555

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。

高鹏先生,鹏华基金管理有限公司副总裁

注册资本:252.20亿元 法定代表人:李建红

2、发展概况 招商银行成立于1987年4月8日,是我国第一家完全由企业法人持股的股份制商业银行

(10101) 子宫时在宋序峰至江宫、序座成立七宫、正坐中亚峰五七宫寺亚为政门。 招商银行确立"因为南京、先您历想"的托管则全和"财富所先信宁承诺"的托管 核心价值、独创"63托管银行"品牌体系、以"保护您的业务、保护您的财富"为历史使 命,不断创新托管系统、服务和产品,在业内率先推出"网上托管银行系统"、托管业务

助理,总经济市 副总裁、招商局集团有限公司董事、总裁、 助理,总经济市、副总裁、招商局集团有限公司董事、总裁、 田惠字先生,本行行长,执行董事,2013年5月起担任本行行长、本行执行董事。美国 哥伦比亚大学公共管理硕士学位,高级经济师。曾于2003 年7 月至2013年5月历任上

月至2014年12月,任招商银行总行行长助理;2015年1月起担任本行副行长;2016年11 月起兼任本行董事会秘书。 券然女士、超前银行资产托管部总经理,大学本科毕业,具有基金托管人高级管理 人员任职资格。先后供职于中国农业银行黑龙江省分行,华商银行,中国农业银行深圳市分行,从事信贷管理、托管工作。2002年9月加盟招商银行至今,历任招商银行总行资

理、自靈體問題、同時問題、除此正理方德與為自由分為經歷中的問題、即即不占為並方自為與多 准确、完整、及时,確保力整机制、体制的不断改进和各項业务制度、流程的不断完善。 2、 内部控制组织结构 招商银行资产托管业务建立三级内控风险防范体系:

| 17.75とパリンスでは近夕1970/www.tange.co.cc。 | 3、内部経制原則 | (1)全面性原則。内部控制覆盖各项业务过程和操作环节、覆盖所有室和岗位,并 (2)审慎性原则。托管组织体系的构成、内部管理制度的建立均以防范风险、审慎

(4)有效性原则。内部控制且有高度的权威性、任何人不得拥有不受内部控制约束

(6) 防火槽原则。格爾根行资产托管部配备独立的托管业务技术系统,包括网络系统、应用系统、安全防护系统、数据备份系统。

资金清算,岗位管理·档案管理和信息管理等方面制定一系列规章制度,保证资产托管业务科学化、制度化、规范化运作。

视同会计资料保管。客户资料不得泄露,有关人员如需调用,须经总经理室成员审批,并

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

法律法规,基金合同的指令拒绝执行,并立即通知基金管理人。

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3305室

(1)银行销售机构 1)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

传真:021-31358666

经办会计师:吴钟鸣、胡悦 四、基金的名称 本基金名称: 鹏华永泽18个月定期开放债券型证券投资基金

赎回业务的,基金管理人有权合理调整申购或赎回业务的办理期间并予以公告。 六、基金的投资目标 严格控制风险的基础上,通过定期开放的形式保持适度流动性,力求取得超越基

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、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

間,改加等利差原則,認定原則,如外亞所原門等於改及以原則,但广州在加州區即進上,通过定則开放的形式保持通度流动性,力求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

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

本基金将采用验乘策略增强组合的持有期收益。这一策略用通过对收益案曲线的

四. 投资决策依据及程序 1. 投资决策依据

(2)基金经理(或管理小组):设计和调整投资组合。设计和调整投资组合需要考

实际需要调整上述投资决策程序,并予以公告 九、基金的业绩比较基准

本报告期自2018年04月01日起至06月30日。 、报告期末基金资产组合情况 基金总资产的H 例(%) 金額(人民币元) 项目

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

10,119,000.0 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 元。 (2)报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

数量(张)

公允价值(元)

40,858,000

20,076,000.0

公允价值(元)

144,744,600

债券品种

1行票据

业短期融资券

可转债(可交换债)

注:无。 (3)本期国债期货投资评价

10、投资组合报告附注

1、基金管理人的管理费;

2、基金托管人的托管费

H=E×0.7% ÷ 当年天数

基金份额持有人大会费用:

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。

木其全投资的前十名证券没有超出其全会同规定的证券各选库 应收证券清算款 20,653,736.3 4,996,033.3 待摊费用

) 投资组合报告附注的其他文字描述部分 由于四舍五人的原因,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 它盈利。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 57仔细阅读本基金的招募说明书

(6)报告期末前十夕股票中存在流通受阻情况的说明

3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;

11 NH M BK SHOTE TEH 21F	199 009 1	100				
	净值增 长率1			业绩比较基 准收益率标 准差4	1-3	2-4
2018年01月24日(基金合同生效日)至 2018年06月30日	2.26%	0.11%	4.94%	0.12%	-2.68%	-0.01%
自基金合同生效日 至2018年06月30日	2.26%	0.11%	4.94%	0.12%	-2.68%	-0.01%
	+	-= 其金f	初费田与新	ht/br		

、基金的银行有人人会预用; 、基金的证券交易费用; 、基金的银行汇划费用; 、证券账户开户费用、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。 、基金费用计提方法、计提标准和支付方式 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

H=E×0.7%+当年天数 出为每日应计据的基金管理费 E为前一日的基金资产单值 基金管理费有日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,经基金管理人与基金托管 人双方核对无误后,基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作口 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。

4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费:

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 H=B×U2/w===T+X数 H为每日应计量的基金托管费 B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,经基金管理人与基金托管 双方核对无误后,基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日

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

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 序定证券「均康华子FC等」可以以及以及以及资金合的地方社会保障基金、 形成的补充养老基金等。包括全国社会保障基金,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

於类型,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。

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

,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 一般申购费率 特定申购费率 每笔1000元 每笔1000元 木基全的由购费用应在投资人由购基金份额时收取。 投资人在一天之内

笔申购,适用费率按单笔分别计算。 申购费用由投资人承担,不列人基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、登记 本基金的赎回费率如下表所示

※11个封闭例 0 姚回费用由赎回基金份例的基金份额持有人承担,在基金份额持有人赎回基金份 村收取。赎回费总额的100% 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 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

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:

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证收的规定代扣代缴、 一四、对招募税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

=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

4 其他根据相关法律法规及由国证监会的有关规定不得别人其金费用的项目

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,主更更新的内容如下:
1.因基金合同变更,对相关章节的内容进行了更新。
2.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和基金合同生效日期。
3.在"第二部分基金管理人"部分内容进行了更新。
4.在"第二部分基金托管人"部分内容进行了更新。
5.在"第五部分桂光限务机构"部分内容进行了更新。

6、在"第六部分基金的募集与基金合同的生效"部分内容进行了更新。 7、在"第八部分基金份额的申购与赎回"部分内容进行了更新。

8. 在"第九部分基金投资"部分内容进行了更新。

10、在 "第二十二部分其他披露事项" 部分内容进行了更新

交易的公告 根据《鹏华国证钢铁行业指数分级证券投资基金基金合同》(简称"基金合同")及上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则,鹏华基金管理有限公司(以下简称"本公司")以2018年09月03日为基金份额折算基准日,对在该日登记在册份鹏华钢铁分级(场内简称:钢铁人基金代码:502024)和鹏华钢铁分级份额(基金简称:鹏华钢铁分级、场内简称:钢铁分级、基金代码:502023,包括场内份额、场外份额)(以下简称"本基金")办理了定期份额折算业务,现将折算结果及恢复交目批准被成金地下。

鹏华国证钢铁行业指数分级证券

投资基金定期份额折算结果及恢复

"到小级点户两位",亲德亚沙门人强速立风;"朗卡伊斯大万公员的职力"的"动"。即于斯长凡份额经折算后的份额数取整计算。最小单位为1份,不足1份的零碎份加度后保留至整数位(最小单位为1份),按各个场内份额持有人的零年份从全划小的排序。依次向相应的基金份额持有人记增的,直到所有零件的给计价物分配完毕。 折算前后鹏华钢铁分级场外份额。鹏华钢铁分级场内份额、鹏华钢铁入份额、新增 份额折算比例,以及折算后基金份额净值如下表所示: 基金份额名称 折算前基金份 新增份额折算 折算后基金份 新算后基金份 额(单位:份) 比例 斯第后基金份

2018年09月03日,鹏华钢铁分级份额的场外份额经折算后的份额数按截位法保留

自2018年09月05日起,本基金恢复申购、赎回、转换、定期定额投资、转托管(包括

。 鹏华基金管理有限公司

4、根据上海证券交易所的相关业务规则,鹏华钢铁A份额新增份额折算成鹏华钢

份额(场内简称:钢铁A;基金代码:502024)约定年基准收益率的相关规定:鹏华钢铁 A价额约定年基准收益率为"同期银行人民币一年期定期存款利率(税后)+3%"。同 期银行人民币一年期定期存款利率以最近一次份额折算基准日次日中国人民银行公布

新增的鹏华钢铁分级份额无法赎回。投资者可以选择在折算前将鹏华钢铁A份额卖出

金一定盈利,也不保证最低收益。投资者投资于本基金前应认真阅读本基金的基金合同

行业指数分级证券投资基金以2018年09月03日为基金份额折算基准日,对在该日登记 在册的鹏华钢铁A份额(场内简称:钢铁A,基金代码:502024)和鹏华钢铁分级份额 (基金简称:鹏华钢铁分级,场内简称:钢铁分级,基金代码:502023,包括场内份额、场

益后为0.931元,与2018年09月05日的前收盘价存在较大差异。2018年09月05日当日鹏 华钢铁A份额可能出现交易价格波动的情形。敬请投资者注意投资风险。 根据上海证券交易所的相关业务规则,2018年09月05日场内鹏华钢铁分级份额即

证基金一定盈利,也不保证最低收益,投资者投资于本公司基金时应认真阅读相关基金合同、招募说明书及更新等文件,并根据自身风险承受能力选择适合自己的基金产品进

鹏华中证高铁产业指数分级证券 投资基金定期份额折算结果及恢复 交易的公告 根据《鹏华中证高铁产业指数分级证券投资基金基金合同》(以下简称"基金合

同")及深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务约定,鹏华基

二、恢复交易 自2018年09月05日起,本基金恢复申购、赎回、转换、定期定额投资、转托管(包括 系统内转托管、跨系统转托管)、配对转换业务。鹏华高铁A份额将于2018年09月05日 三、重要提示

最小单位为1份),舍去部分计入基金财产,持有极小数量鹏华高铁A份额、鹏华高铁 分级份额的持有人,存在折算后份额因为不足1份而导致相应的资产被强制归入基金资

5. 在一级市场可以做交易的证券公司并不全部具备中国证监会颁发的基金销售训 务资格,而投资者只能通过具备基金销售业务资格的证券公司赎回基金份额。因此,如

鹏华中证高铁产业指数分级证券 投资基金定期份额折算前收盘价

价为0.961元,扣除约定收益后为0.936元,与2018年09月05日的前收盘价存在较大差 异。2018年09月05日当日鹏华高铁A份额可能出现交易价格波动的情形。敬请投资者注

合同、招募说明书及更新等文件,并根据自身风险承受能力选择适合自己的基金产品进 行投资。敬请投资者注意投资风险。

鹏华基金管理有限公司

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财产,但不保