鹏华新丝路指数分级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
2018年3月

重要提示

本基金经2015年4月29日中国证券监督管理委员会下发的《关于核准鹏华新丝路指数分级证券投资基金募集的批复》(证监许可[2015]706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2015年6月13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投资价值和投资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。中国证监会不对基金的投资价值和市场前景等作出实质性判断或保证。

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,投资者在投资本基金前,应全面了解本基金的产品特性,充分考虑自己的风险承受能力,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:市场风险、管理风险、操作风险、流动性风险、信用风险、本基金特有风险(包括作为指数基金的风险、作为上市基金的风险和作为分级基金的风险)及其他风险,等等。

本基金属于股票型基金,其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金,为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。同时本基金为指数基金,通过跟踪标的指数表现,具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。

从本基金所分拆的两类基金份额来看,鹏华新丝路A份额为趋势收益类份额,具有低风险且预期收益相对较低的特征;鹏华新丝路B份额为杠铃收益类份额,具有高风险且预期收益相对较高的特征。

一、基金管理人概况

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。

基金管理人经由银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年1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。

本报告所载资料截至2017年10月31日或12月31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	7,896,879.76	89.90
	其中:股票	7,896,879.76	89.90
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:买断式逆回购买入返售金融资产	–	–
7	银行存款和结算备付金合计	878,834.39	10.01
8	其他资产	8,385.61	0.10
9	合计	8,783,099.76	100.00

2.按行业分类的股票投资组合

(1)报告期末按行业分类的股票投资组合

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	151,210.80	1.82
B	采矿业	819,074.00	9.84
C	制造业	5,264,409.68	63.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	202,519.00	2.43
E	建筑业	85,603.40	1.03
F	批发和零售业	254,692.00	3.06
G	交通运输、仓储和邮政业	12,504.00	0.15
H	住宿和餐饮业	23,730.00	0.29
I	信息传输、软件和信息技术服务业	38,399.00	0.46
J	金融业	748,324.88	8.99
K	房地产业	95,364.00	1.15
L	租赁和商务服务业	153,280.00	1.84
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	24,612.00	0.30
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	19,994.00	0.24
S	综合	–	–
	合计	7,896,879.76	94.84

(2)报告期末按权益投资行业分类的境内股票投资组合

注:无。

(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)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	601012	隆基股份	13,900	506,516.00	6.08
2	002202	金风科技	24,280	467,678.00	5.60
3	600089	特变电工	36,288	369,614.08	4.32
4	600516	方大炭素	12,300	365,224.00	4.27
5	000166	申万宏源	68,860	353,668.20	4.25
6	002073	软控股份	21,699	267,331.68	3.21
7	000768	中航飞机	15,200	256,270.00	3.08
8	600893	航发动力	9,200	247,572.00	2.97
9	601225	陕西煤业	20,900	236,640.00	2.84
10	000792	盐湖股份	15,500	221,169.00	2.66

(2)报告期末按权益投资公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权益投资明细

注:无。

4.报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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十名债券投资明细

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十名权证投资明细

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:本基金本报告期内未投资股指期货。

(2)本基金投资股指期货的投资政策

本基金根据股指期货的投资目的、投资政策、投资限制等规定,并结合股指期货的市场流动性状况、交易成本、预期风险收益特征等因素,在有效控制风险的前提下,谨慎地对股指期货进行投资,以期实现基金资产的保值增值。

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:本基金本报告期内未投资国债期货。

(2)报告期末国债期货投资情况

注:本基金本报告期内未投资国债期货。

11.投资组合报告附注

(1)报告期内投资的前一名证券之一西部证券投资说明

关于最近五年被证券监管部门和交易所采取监管措施或处罚的情况以及相应整改措施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、完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,西部证券股份有限公司(以下简称"西部证券"或"公司")向所报告期内(以下简称"报告期")上证公司第四届董事会第二次会议和2015年度股东大会审议通过,按照相关监管要求,现将公司最近五年被证券监管部门和交易所采取监管措施或处罚及相应整改情况公告如下:

一、2013年度以来,公司被证券监管部门采取监管措施的情况

(一)具体情况公司于2013年8月6日收到了中国证监会北京监管局下发的2013沪号行政监管措施决定书《关于对西部证券股份有限公司北京德胜门外大街证券营业部采取责令改正措施的决定》,其主要内容为:"经查,我局发现你常业部存在以下违规行为:一是未按规定登记客户证券账户和资金账户的开户时间;二是未按规定出具客户对账单;三是未按规定保存客户证券交易和资金变动记录"。根据《证券公司分类机构监管规定》(中国证监会公告[2013]17号)第十七条第二款等相关规定,根据《证券公司分类机构监管规定》(中国证监会公告[2013]17号)第十七条第二款等相关规定,公司在收到该决定书后,公休日等,支付日期顺延。

(二)整改情况说明第一点的工作,公司高度重视,立即召开紧急会议,并在公司进行了通报,要求全公司以此为戒,严格按照法律法规,公司章程及各项制度的规定,加强合规经营,充分认识信息披露的重要性。安排专项小组到营业部协助整改,作出以下整改措施:1.结与营业部相关人员处分沟通会,对相关责任人进行了处罚;2.在公司内部开展了一次证券业务监管法规学习,并以书面形式对北京营业部进行通报,并在北京证券协会组织的关于证券业务监管法规学习会上作了自我汇报。3.在公司总部每项小组的面前,于,营业部以内应用程序内部,以及证券业务报告进行了自我检查,将营业部的制度与公司总部统一比对,发现了不足之处,并修订了关于投资顾问的部分的相关制度;安排专人负责,完成了六个机构客户经纪人的更新工作,同时为客户、客户手续;联系对方的银行和客户,补齐银行端;营业部已加强法规合规的岗前培训和再教育,以确保认真、及时地完成岗位工作,公司每季度要求营业部定期提交自查报告,公司总部不定期抽查,以确保公司内部控制制度的有效性。(三)鉴于本次监管措施涉及的相关人员已经不在公司任职,公司在内部通报了本次监管措施,并在公司内部开展了一次证券业务监管法规学习,并以书面形式对北京营业部进行了自我检查,将营业部的制度与公司总部统一比对,发现了不足之处,并修订了关于投资顾问的部分的相关制度;安排专人负责,完成了六个机构客户经纪人的更新工作,同时为客户、客户手续;联系对方的银行和客户,补齐银行端;营业部已加强法规合规的岗前培训和再教育,以确保认真、及时地完成岗位工作,公司每季度要求营业部定期提交自查报告,公司总部不定期抽查,以确保公司内部控制制度的有效性。(四)鉴于本次监管措施涉及的相关人员已经不在公司任职,公司在内部通报了本次监管措施,并在公司内部开展了一次证券业务监管法规学习,并以书面形式对北京营业部进行了自我检查,将营业部的制度与公司总部统一比对,发现了不足之处,并修订了关于投资顾问的部分的相关制度;安排专人负责,完成了六个机构客户经纪人的更新工作,同时为客户、客户手续;联系对方的银行和客户,补齐银行端;营业部已加强法规合规的岗前培训和再教育,以确保认真、及时地完成岗位工作,公司每季度要求营业部定期提交自查报告,公司总部不定期抽查,以确保公司内部控制制度的有效性。

二、2014年度以来,公司被证券监管部门采取监管措施的情况

(一)2014年11月10日,中国证监会上海监管局(以下简称"上海证监局")向中国万国证券股份有限公司(以下简称"万国证券")下发《关于对中国万国证券股份有限公司采取责令改正措施的决定》(沪证监决[2014]27号)

中国万国证券股份有限公司(以下简称"万国证券")一名从业人员通过公司交易电脑和交易专线,私自为其经纪客户从事证券及期货交易,该产品营业部存在内控制度不健全,内部管理不规范,对客户一定程度的隐瞒,违反了《期货公司管理办法》第二十九条规定,责令万国证券对上述问题进行整改,并在一定期限内提交书面报告。

中国证券监督管理委员会(以下简称"证监会")决定,根据证券期货市场监管工作需要,对万国证券开展了专项现场检查,发现万国证券内部控制不健全,内部管理不规范,对客户一定程度的隐瞒,违反了《期货公司管理办法》第二十九条规定,责令万国证券对上述问题进行整改,并在一定期限内提交书面报告。

(二)2014年11月10日,中国证监会上海监管局(以下简称"上海证监局")向中国万国证券股份有限公司下发《关于对中国万国证券股份有限公司采取责令改正措施的决定》(沪证监决[2014]27号)

中国万国证券股份有限公司(以下简称"万国证券")一名从业人员通过公司交易电脑和交易专线,私自为其经纪客户从事证券及期货交易,该产品营业部存在内控制度不健全,内部管理不规范,对客户一定程度的隐瞒,违反了《期货公司管理办法》第二十九条规定,责令万国证券对上述问题进行整改,并在一定期限内提交书面报告。

中国证券监督管理委员会(以下简称"证监会")决定,根据证券期货市场监管工作需要,对万国证券开展了专项现场检查,发现万国证券内部控制不健全,内部管理不规范,对客户一定程度的隐瞒,违反了《期货公司管理办法》第二十九条规定,责令万国证券对上述问题进行整改,并在一定期限内提交书面报告。

三、2015年度以来,公司被证券监管部门采取监管措施的情况

(一)2015年度,公司被证券监管部门采取监管措施的情况

1.2015年1月,公司收到中国证券监督管理委员会(以下简称"证监会")出具的《关于对中国万国证券股份有限公司采取责令改正措施的决定》(证监决[2015]1号)

证券期货市场是国家金融业的重要组成部分,是国家经济安全的重要组成部分,证券期货市场的稳定和发展关系国家经济安全和社会稳定,证券期货市场的稳定和发展要以法律法规为基础,以诚信为核心,以规范为保证,以监管为手段,以投资者保护为目的,以市场参与者的自律为辅助