

鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 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：中国工商银行股份有限公司

二〇一七年三月

重要提示

本基金经 2009 年 12 月 15 日中国证券监督管理委员会下发的《关于核准鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 募集的批复》（证监许可[2009]1374 号文）核准，进行募集，并经中国证监会基金部 2010 年 2 月 5 日基金部函[2010]62 号文件《关于鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 备案确认的函》确认合法备案。根据相关法律法规，本基金基金合同已于 2010 年 2 月 5 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。

本摘要根据本基金的基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

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：市场风险、基金交易价格与份额净值发生偏离的风险、基金管理风险、流动性风险、本基金指数投资有关风险、技术风险、上市交易的风险及其他风险，等等。

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者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。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。投资有风险，投资者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2017年2月4日，有关财务数据和净值表现截止日为2016年12月31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、成立日期：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，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、党总支书记。

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。

周中国先生，董事，会计学硕士研究生，国籍：中国。曾任深圳市华为技术有限公司定价中心经理助理；2000年7月起历任国信证券有限责任公司资金财务总部业务经理、外派财务经理、高级经理、总经理助理、副总经理、国信证券股份有限公司人力资源总部副总经理、资金财务总部副总经理；2015年6月至今任国信证券股份有限公司资金财务总部总经理。

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。

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。

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、菲亚特汽车发动机和变速器平台管控管理团队工作、圣保罗IMI资产管理SGR企业经管部、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。

刘崧先生，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，简历同前。

邓召明先生，董事，总裁，简历同前。

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、电子商务部总经理。

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，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督察长。

4、本基金基金经理

张羽翔先生，国籍中国，工学硕士，10年金融证券从业经验。曾任招商银行软件中心（原深圳市融博技术公司）数据分析师；2011年3月加盟鹏华基金管理有限公司，历任监察稽核部资深金融工程师、量化及衍生品投资部资深量化研究员，先后从事金融工程、量化研究等工作；2015年9月起担任鹏华上证民企50ETF基金及其联接基金基金经理，2016年6月起兼任鹏华新丝路分级基金基金经理，2016年7月起兼任鹏华高铁产业分级基金基金经理，2016年9月起兼任鹏华中证500指数（LOF）、鹏华沪深300指数（LOF）基金基金经理，2016年11月起兼任鹏华一带一路分级、鹏华新能源分级基金基金经理。张羽翔先生具备基金从业资格。

本基金历任基金经理：

2010年2月至2013年3月 方南先生

2013年3月至2013年12月 杨靖先生

2013年12月至2014年12月 杨靖先生、王咏辉先生

2014年12月至2016年9月 王咏辉先生

2016年9月至本招募说明书更新截止日 张羽翔先生

本基金基金经理管理其它基金情况：

2015年9月起担任鹏华上证民企50ETF基金及其联接基金基金经理；
2016年6月起兼任鹏华新丝路分级基金基金经理；
2016年7月起兼任鹏华高铁产业分级基金基金经理；
2016年9月起兼任鹏华沪深300指数（LOF）基金基金经理；
2016年11月起兼任鹏华一带一路分级、鹏华新能源分级基金基金经理。

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。

冀洪涛先生，鹏华基金管理有限公司总裁助理、权益投资总监、权益投资一部总经理，社保基金组合投资经理，专户投资经理。

王宗合先生，鹏华基金管理有限公司权益投资二部总经理，鹏华消费优选混合、鹏华金刚保本混合、鹏华品牌传承混合、鹏华养老产业股票、鹏华金鼎保本混合、鹏华金城保本混合基金基金经理。

王咏辉先生，鹏华基金管理有限公司资产配置与基金投资部 FOF 投资总监。

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、鹏华动力增长混合（LOF）、鹏华健康环保混合、鹏华医药科技混合基金基金经理。

陈鹏先生，鹏华基金管理有限公司权益投资二部副总经理，鹏华中国50混合、鹏华消费领先混合、鹏华鹏华医疗保健股票基金基金经理。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基金托管人基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号

成立时间：1984年1月1日

法定代表人：易会满

注册资本：人民币35,640,625.71万元

联系电话：010-66105799

联系人：郭明

（二）主要人员情况

截至2016年9月末，中国工商银行资产托管部共有员工210人，平均年龄30岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

（三）基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自 1998 年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、企业年金基金、QFII 资产、QDII 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII 专户资产、ESCROW 等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至 2016 年 9 月，中国工商银行共托管证券投资基金 624 只。自 2003 年以来，本行连续十一年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的 51 项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

三、相关服务机构

（一）基金销售机构

1、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 号金融街中心南楼 502 房

电话：（010）88082426

传真：（010）88082018

联系人：李筠

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 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

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：广州市珠江新城华夏路 10 号富力中心 24 楼 07 单元

电话：（020）38927993

传真：（020）38927990

联系人：周樱

（2）其他销售机构

a. 银行销售机构

1) 中国工商银行股份有限公司

注册（办公）地址：北京复兴门内大街 55 号

法定代表人：易会满

客户服务电话：95588（全国）

传真：010-66107913

联系人：刘秀宇

联系电话：010-66105799

网址：www.icbc.com.cn

2) 中国建设银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：王洪章

联系人：王未雨

客户服务电话：95533

传真：010-66275654

网址：www.ccb.com

3) 中国农业银行股份有限公司

注册（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

客户服务电话：95599

联系人：邱泽滨

网址：www.abcchina.cn

4) 中国银行股份有限公司

注册（办公）地址：北京市复兴门内大街 1 号

法定代表人：田国立

统一客户服务电话：95566

联系人：陈洪源

公司网站：www.boc.cn

5) 交通银行股份有限公司

注册（办公）地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：牛锡明

电话：021-58781234

传真：021-58408483

联系人：张宏革

客户服务电话：95559

网址：www.bankcomm.com

6) 中国邮政储蓄银行股份有限公司

注册（办公）地址：北京市西城区金融大街 3 号

法定代表人：李国华

客户服务电话：95580

联系人：杨涓

传真：010-68858117

公司网址：www.psbc.com

7) 招商银行股份有限公司

注册（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

电话：0755-83198888

传真：0755-83195049

联系人：邓炯鹏

客服电话：95555

网址：www.cmbchina.com

8) 平安银行股份有限公司

注册（办公）地址：深圳市深南东路 5047 号

法定代表人：谢永林

联系人：张莉

电话：021-38637673

客服电话：95511-3

网址：bank.pingan.com

9) 上海银行股份有限公司

注册（办公）地址：上海市浦东新区银城中路 168 号

法定代表人：金煜

客户服务电话：95594

联系人：汤征程

网址：www.bankofshanghai.com

10) 中国民生银行股份有限公司

注册（办公）地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：洪崎

客户服务电话：95568

联系人：穆婷

传真：010-58560666

网址：www.cmbc.com.cn

11) 上海浦东发展银行股份有限公司

注册（办公）地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：吉晓辉

客户服务热线：95528

联系人：唐苑

电话：021-61618888

传真：021-63604199

公司网站：www.spdb.com.cn

12) 中国光大银行股份有限公司

注册（办公）地址：北京市西城区复兴门外大街 6 号光大大厦

法定代表人：唐双宁

联系人：李伟

电话：010-68098778

传真：010-68560661

客服电话：95595（全国）

网址：www.cebbank.com

13) 广发银行股份有限公司

注册（办公）地址：广州市东风东路 713 号

法定代表人：董建岳

联系人：陈涇渭

客服电话：400-830-8003

网址：www.cgbchina.com.cn

14) 北京银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街甲 17 号首层

办公地址：北京市西城区金融大街丙 17 号

法定代表人：闫冰竹

联系人：孔超

传真：010-66226045

客户服务电话：95526

网站：www.bankofbeijing.com.cn

15) 兴业银行股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 154 号中山大厦

办公地址：上海市江宁路 168 号

法定代表人：高建平

联系人：刘玲

客户服务电话：95561

网址：www.cib.com.cn

16) 中信银行股份有限公司

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

客服电话：95558

网站：bank.ecitic.com

17) 华夏银行股份有限公司

办公地点：北京市东城区建国门内大街 22 号

法定代表人：吴建

客户服务电话：95577

联系人：董金

网站：www.hxb.com.cn

18) 杭州银行股份有限公司

地址：杭州市庆春路 46 号杭州银行大厦

法定代表人：陈震山

联系人：严峻

客户服务电话：95398

网址：www.hzbank.com.cn

19) 东莞银行股份有限公司

注册（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

20) 宁波银行股份有限公司

注册（办公）地址：宁波市鄞州区宁南南路 700 号

法定代表人：陆华裕

电话：0574-89068340

传真：0574-87050024

联系人：胡技勋

客户服务电话：96528（上海、北京地区 962528）

网址：www.nbcb.com.cn

21) 浙商银行股份有限公司

注册（办公）地址：中国杭州市庆春路 288 号

法定代表人：沈仁康

联系人：唐燕

客户服务热线：95527

传真：0571-87659554

公司网站：www.czbank.com

22) 浙江民泰商业银行股份有限公司

办公地址：温岭市三星大道 168 号

法定代表人：江建法

客户服务电话：4008896521

联系人：刘兴龙

网址：www.mintaibank.com

23) 厦门银行股份有限公司

住所：厦门市思明区湖滨北路 101 号商业银行大厦

法定代表人：吴世群

联系人：刘冬阳

客户服务电话：400-858-8888

网址：www.xmccb.com

24) 洛阳银行股份有限公司

住所：河南洛阳洛龙区开元大道 256 号

法定代表人：王建甫

联系人：李亚洁

客户服务电话：96699

网址：www.bankofluoyang.com.cn

25) 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

法定代表人：何沛良

联系人：杨亢

客户服务电话：961122

网址：www.drcbank.com

26) 江苏江南农村商业银行股份有限公司

注册（办公）地址：江苏省常州市和平中路 413 号

法定代表人：陆向阳

客户服务电话：0519-96005

联系人：蒋娇

网址：www.jnbank.com.cn

传真：010-85556088

网址：www.hrsec.com.cn

b. 券商销售机构

1) 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 号国际企业大厦 C 座

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：陈有安

客户服务电话：400-8888-888

联系电话：010-66568430

联系人：田薇

网址：www.chinastock.com.cn

2) 中信证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

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：张于爱

联系电话：010-60833799

传真：010-60833739

网址：www.citics.com

3) 海通证券股份有限公司

注册地址：上海广东路 689 号

办公地址：上海广东路 689 号

法定代表人：王开国

联系电话：021-23219275

联系人：李笑鸣

客户服务电话：95553

网址：www.htsec.com

4) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人：杨德红

客服电话：400-8888-666 / 95521

联系人：朱雅岚

联系电话：021-38676666

网址：www.gtja.com

5) 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 6 号楼

办公地址：北京市东城区朝内大街 188 号

法定代表人：王常青

联系人：权唐

传真：010-65182261

客服电话：4008888108

公司网站：www.csc108.com

6) 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 16—26 层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16—26 层

法定代表人：何如

联系电话：0755—82130833

传真：0755-82133952

联系人：周杨

客户服务电话：95536

网址：www.guosen.com.cn

7) 兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 268 号证券大厦

办公地址：上海市长柳路 36 号丁香国际商业中心东塔

法定代表人：兰荣

联系人：夏中苏

联系电话：0591-38281888

客户服务电话：95562

传真：0591-38507538

网址：www.xyzq.com.cn

8) 华泰证券股份有限公司

注册地址：南京市江东中路 228 号

办公地址：南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场

法定代表人：周易

联系电话：0755-82492193

联系人：庞晓芸

网址：www.htsc.com.cn

9) 招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

法定代表人：宫少林

联系电话：0755-82943666

联系人：林生迎

客户服务电话：95565

网址：www.newone.com.cn

10) 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：杨泽柱

联系电话：027-65799999

传真：027-85481900

联系人：李良

客户服务电话：95579 或 4008888999

网址：www.95579.com

11) 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号标志商务中心A栋11层

办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路198号标志商务中心A栋11层

法定代表人：林俊波

联系电话：021-38784580-8918

传真：021-68865680

联系人：李欣

客户服务电话：400-888-1551

网址：www.xcsc.com

12) 广发证券股份有限公司

注册地址：广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼（4301-4316房）

办公地址：广东省广州天河北路大都会广场5、18、19、36、38、39、41、42、43、44楼

法定代表人：孙树明

联系人：黄岚

联系电话：020-87555888

传真：020-87553600

客服电话：95575

网址：www.gf.com.cn

13) 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

联系电话：021-33389888

联系人：曹晔

客户服务电话：95523 或 4008895523

电话委托：021-962505

网址：www.swhysc.com

14) 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 16、17 层

办公地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

法定代表人：黄耀华

联系电话：0755-83516289

联系人：胡永君

网址：www.cgws.com

15) 中泰证券股份有限公司

注册地址：山东省济南市经七路 86 号

办公地址：山东省济南市经七路 86 号 2316 室

法定代表人：李玮

联系电话：021-20315290

联系人：许曼华

客户服务电话：95538

网址：www.zts.com.cn

16) 国都证券股份有限公司

注册地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

办公地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

法定代表人：王少华

联系人：汪嘉楠

客户服务电话：400-818-8118

传真：010-84183311

网址：www.guodu.com

17) 金元证券股份有限公司

注册地址：海口市南宝路 36 号证券大厦 4 楼

办公地址：深圳市深南大道 4001 号时代金融中心 17 层

法定代表人：陆涛

电话：0755-83025666

传真：0755-83025625

联系人 马贤清

客户服务热线：400-8888-228

网址：www.jyzq.cn

18) 东莞证券股份有限公司

注册地址：东莞市莞城区可园南路一号

办公地址：广东省东莞市莞城区可园南路一号金源中心 22 楼

法定代表人：张运勇

联系人：李荣

联系电话：0769-22115712

客户服务电话：95328

传真：0769-22115712

网址：<http://www.dgzq.com.cn/>

19) 东北证券股份有限公司

注册地址：长春市自由大路 1138 号

办公地址：长春市自由大路 1138 号

法定代表人：杨树财

联系电话：0431-85096517

传真：0431-85096795

联系人：安岩岩

网址：www.nesc.cn

20) 上海证券有限责任公司

注册地址：上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼

办公地址：上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼

法定代表人：李俊杰

联系电话：021-53686888

客户服务电话：021-962518

传真：021-53686100-7008，021-53686200-7008

业务联系人：邵珍珍

联系电话：021-53686262

网址：www.962518.com

21) 东海证券股份有限公司

注册地址：江苏省常州延陵西路 23 号投资广场 18 层

办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦

法定代表人：赵俊

电话：021-20333333

传真：021-50498825

联系人：王一彦

客服电话：95531；400-8888-588

网址：www.longone.com.cn

22) 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

联系电话：021-22169081

传真：021-68817271

联系人：刘晨

客户服务电话：95525

公司网站：www.ebscn.com

23) 平安证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

办公地址：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

法定代表人：詹露阳

客户服务电话：95511

联系电话：021-38637463

联系人：周一涵

网址：stock.pingan.com

24) 华安证券股份有限公司

注册地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

办公地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

法定代表人：李工

联系人：范超

联系电话：0551-65161821

客户服务电话：95318

传真：0551-65161672

网址：www.hazq.com

25) 安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 2222 号安联大厦 34 层、28 层 A02 单元

办公地址：深圳市福田区金田路 2222 号安联大厦 34 层、28 层 A02 单元

深圳市福田区深南大道 2008 号中国凤凰大厦 1 栋 9 层

法定代表人：牛冠兴

联系电话：0755-82825551

传真：0755-82558355

联系人：陈剑虹

客户服务电话：4008001001

网址：www.essence.com.cn

26) 渤海证券股份有限公司

注册地址：天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

办公地址：天津市南开区宾水西道 8 号

法定代表人：王春峰

联系人：王兆权

电话：022-28451861

传真：022-28451892

网址：www.bhzq.com

27) 财富证券有限责任公司

注册地址：长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 层

办公地址：长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 层

法定代表人：蔡一兵

联系电话：0731-84403319

传真：0731-84403439

联系人：郭磊

客户服务热线：4008835316

网址：www.cfzq.com

28) 万联证券有限责任公司

注册地址：广州市中山二路 18 号电信广场 36、37 层

办公地址：广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 栋 18、19 层

法定代表人：张建军

联系人：罗创斌

联系电话：020-37865070

客户服务电话：400-8888-133

网址：www.wlzq.com.cn

29) 广州证券股份有限公司

注册地址：广州市天河区珠江新城珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层

办公地址：广州市天河区珠江新城珠江西路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

联系电话：020-88836999

传真号码：020-88836654

客服热线：95396

网址：www.gzs.com.cn

30) 浙商证券有限责任公司

注册地址：杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座6-7楼

办公地址：杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座6-7楼

法定代表人：吴承根

电话：021-64718888

传真：021-64713795

联系人：李凌芳

客户服务热线：0571-967777

网址：www.stocke.com.cn

31) 华林证券股份有限公司

注册地址：西藏自治区拉萨市柳梧新区察古大道1-1号君泰国际B栋一层3号

办公地址：深圳市福田区民田路178号华融大厦6楼

法定代表人：林立

联系人：郑琢

联系电话：18627985979

客户服务电话：400-188-3888

传真：0755-82707700

网址：www.chinalions.com

32) 日信证券有限责任公司

注册地址：内蒙古呼和浩特市新城区锡林南路18号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号长安兴融中心西座11层

法定代表人：孔佑杰

联系人：苏江

电话：010-88086830-652

网址：www.rxzq.com.cn

33) 方正证券股份有限公司

注册地址：湖南长沙市芙蓉中路二段200号华侨国际大厦22-24层

办公地址：北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦11层

法定代表人：雷杰

联系人：郭军瑞

联系电话：010-57398063

客户服务电话：95571

网址：www.foundersc.com

34) 江海证券有限公司

注册地址：哈尔滨市香坊区赣水路56号

办公地址：哈尔滨市香坊区赣水路56号

法定代表人：孙名扬

联系人：张背北

联系电话：0451-82336863

客服热线：4006662288

网址：www.jhzq.com.cn

35) 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

联系电话：010-52723273

传真：028-86150040

客户服务咨询电话：95584

网址：www.hx168.com.cn

36) 红塔证券股份有限公司

注册地址：昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼

办公地址：昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼

法定代表人：况雨林

联系人：刘晓明

电话：0871- 3577942

客户服务电话：0871-3577930

网址：www.hongtazq.com

37) 长城国瑞证券有限公司

注册地址：厦门市思明区莲前西路2号莲富大厦17楼

办公地址：厦门市思明区莲前西路2号莲富大厦17楼

法定代表人：王勇

联系人：赵钦

联系电话：0592-5161642

客户服务电话：:400-0099-886

传真：0592-5161763

网址：www.gwgsc.com

38) 银泰证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区竹子林四路紫竹七道18号光大银行大厦18楼

办公地址：深圳市福田区竹子林四路紫竹七道18号光大银行大厦18楼

法定代表人：高颂

联系人：林文字

联系电话：0755-83703759

咨询电话：0755-83710885

公司网址：www.ytzq.net

39) 爱建证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道1600号32楼

办公地址：上海市浦东新区世纪大道1600号32楼

法定代表人：张建华

电话：(021) 32229888

传真：(021) 68728703

联系人：戴莉丽

客户服务电话：(021) 63340678

网址：www.aizq.com

40) 国金证券股份有限公司

注册地址：成都市东城根上街95号

办公地址：成都市东城根上街 95 号

法定代表人：冉云

联系人：刘婧漪

电话：028-86690057

传真：028-86690126

服务热线：95310

公司网站：www.gjzq.com.cn

41) 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 号楼信达金融中心

办公地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼信达金融中心

法定代表人：张志刚

联系人：唐静

联系电话：010-63080985

客服热线：95321

网址：www.cindasc.com

42) 华福证券有限责任公司

注册地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层

办公地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7 至 10 层

法定代表人：黄金琳

邮政编码：350003

联系人：张腾

联系电话：0591-87383623

业务传真：0591-87383610

统一客户服务电话：96326（福建省外请先拨 0591）。

公司网址：www.hfzq.com.cn

43) 东兴证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 12-15 层

办公地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 12-15 层

法定代表：徐勇力

联系人：汤漫川

电话：010-66555316

服务热线：4008888993

公司网站：www.dxzq.net

44) 国海证券股份有限公司

注册地址：广西桂林市辅星路 13 号

办公地址：广西南宁市滨湖路 46 号

法定代表人：何春梅

联系人：牛孟宇

联系电话：0755-83709350

客户服务电话：95563

传真：0755-83704850

网址：<http://www.ghzq.com.cn/>

45) 五矿证券有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4028 号荣超经贸中心办公室 47 层 01 单元

办公地址：深圳市福田区金田路 4028 号荣超经贸中心办公室 47 层 01 单元

法定代表人：赵立功

联系电话：0755-83219494

传真：0755-82545500

联系人：王鹏宇

客户服务电话：4001840028

网址：www.wkzq.com.cn

46) 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 号西南证券大厦

法定代表人：吴坚

联系人：张煜

联系电话：023-63786141

客户服务电话：4008096096

传真：023-63786212

网址：www.swsc.com.cn

47) 新时代证券股份有限公司

注册地址：北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501

办公地址：北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501

法定代表人：田德军

联系人：田芳芳

联系电话：010-83561146

客户服务电话：95399

传真：010-83561001

网址：<http://www.xsdzq.com.cn/>

48) 西部证券股份有限公司

注册地址：西安市东大街 232 号陕西信托大厦 16-17 楼

办公地址：西安市东大街 232 号陕西信托大厦 6 楼

法定代表人：刘建武

联系人：刘莹

电话：029-87406649

传真：029-87406710

客户服务电话：95582

网址：www.westsecu.com

49) 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：上海市肇嘉浜路 750 号

法定代表人：俞洋

联系人：陈敏

电话：021-64339000

传真：021-54668802

客户服务电话：021-32109999；029-68918888；4001099918

网址：www.cfsc.com.cn

50) 联讯证券股份有限公司

注册地址：广东省惠州市惠城区江北东江三路 55 号惠州广电大楼三、四层

办公地址：北京市朝阳区红旗营南路天畅园 6 号楼二层

法定代表人：徐刚

联系人：张悦

电话：010-64408820

传真：010-64408834

客户服务电话：95564

网址：www.lxzq.com.cn

51) 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：崔成

电话：027-87610052

传真：027-87618863

客户服务电话：4008005000

网址：<http://www.tfzq.com>

52) 中国国际金融股份有限公司

注册地址：北京市建国门外大街1号国贸写字楼2座27层及28层

办公地址：北京市建国门外大街1号国贸写字楼2座27层及28层

法定代表人：丁学东

电话：010-65051166

传真：010-85679203

联系人：杨涵宇

客户服务电话：400-910-1166

网址：www.cicc.com.cn

53) 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

客户服务电话：400-860-8866

联系电话：029-63387256

联系人：黄芳

网址：www.kysec.cn

54) 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号院5号楼

办公地址：北京市朝阳区北四环中路27号盘古大观A座40F-43F

法定代表人：赵大建

联系人：齐冬妮

联系电话：010-59355807

传真：010-56437013

网址：<http://www.e5618.com/>

55) 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 12-18 层

法定代表人：祝献忠

联系人：李慧灵

联系电话：010-85556100

传真：010-85556088

网址：www.hrsec.com.cn

56) 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 18 楼

法定代表人：刘学民

客户服务电话：4008881888

联系电话：0755-23838751

联系人：吴军

网址：www.firstcapital.com.cn

c. 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

客户服务电话：400-8877-780

联系电话：023-86769742

联系人：谭忻

网址：www.cfc108.com

2) 中信期货有限公司

注册地址：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 室、14 层

办公地址：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 室、14 层

法定代表人：张皓

客服电话：400-990-8826

联系人：洪诚

联系电话：0755-23953913

公司网站: www.citicsf.com

d. 第三方销售机构

1) 北京恒天明泽基金销售有限公司

住所: 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

联系电话: 010-57756068

客服电话: 400-786-8868

网址: www.chtfund.com

2) 北京增财基金销售有限公司

住所: 北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208 室

办公地址: 北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208 室

法定代表人: 王昌庆

联系人: 罗细安

联系电话: 010-67000988

客服电话: 400-001-8811

网址: www.zcvc.com.cn

3) 北京展恒基金销售有限公司

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

传真: 010-62020355

客服电话: 4008188000

网址: www.myfund.com

4) 杭州数米基金销售有限公司

办公地址: 浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼

法定代表人: 陈柏青

客服电话: 4000-766-123

传真: 0571-26698533

联系人: 周曦旻

网址: www.fund123.cn

5) 和讯信息科技有限公司

住所：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
联系电话：021-20835888
客服电话：400-920-0022
网址：licaike.hexun.com

6) 上海好买基金销售有限公司

办公地址：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯大厦 903~906 室
住所：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室
法定代表人：杨文斌
客服电话：400-700-9665
传真：021-50325989
联系人：陶怡
网址：www.ehowbuy.com

7) 上海陆金所资产管理有限公司

住所：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：何雪
联系电话：021-20662010
客服电话：4008219031
网址：www.lu.com

8) 上海天天基金销售有限公司

住所：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
联系电话：020-87599527
客服电话：4001818188
网址：www.1234567.com.cn

9) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

办公地址：上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

法定代表人：张跃伟

客服电话：400-089-1289

传真：021-58787698

联系人：刘琼

电话：021-58788678-8201

传真：021—58787698

客服电话：400-089-1289

公司网站：www.erichfund.com

10) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

住所：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

联系电话：010-58321388-1105

客服电话：010-58325327

网址：jrj.xinlande.com.cn

11) 深圳众禄基金销售有限公司

注册地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼

法定代表人：薛峰

客服电话：4006-788-887

传真：0755-82080798

联系人：邓爱萍

网址：www.zlfund.cn、www.jjmmw.com

12) 天相投资顾问有限公司

办公地址：北京市西城区金融街 5 号新盛大厦 B 座 4 层

法定代表人：林义相

客服电话：010-66045678

传真：010-66045527

联系人：林爽

网址：www.txsec.com

13) 珠海盈米财富管理有限公司

住所：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

联系电话：020-89629099

客服电话：020-89629066

网址：www.yingmi.cn

14) 北京蛋卷基金销售有限公司

住所：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：北京市朝阳区阜通东大街望京SOHO，T2，B座2507

法定代表人：钟斐斐

联系人：翟相彬

联系电话：010-61840688

客服电话：4000-618-518

网址：<http://danjuanapp.com>

15) 北京汇成基金销售有限公司

住所：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：丁向坤

联系电话：010-56282140

客服电话：4006199059

网址：www.fundzone.cn

16) 北京新浪仓石基金销售有限公司

住所：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：付文红

联系电话：010-62676405

客服电话：010-62675369

网址：www.xincai.com

17) 北京肯特瑞财富投资管理有限公司

注册地址：北京市海淀区海淀东三街2号4层401-15

注册资本： 2000 万元

法定代表人： 江卉

客服电话： 95118

网址： fund.jd.com

联系人： 徐伯宇

电话： 4000988511/ 4000888816

传真： 010-89188000

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。

（二） 注册登记机构

名称： 中国证券登记结算有限责任公司

注册地址： 北京市西城区太平桥大街 17 号

办公地址： 北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人： 周明

联系人： 崔巍

联系电话： 010-59378856

传真： 010-59378907

（三） 律师事务所

名称： 北京市竞天公诚律师事务所

住所： 北京市朝阳区朝阳门外大街 20 号联合大厦 15 层

负责人： 张绪生

办公地址： 北京市朝阳区朝阳门外大街 20 号联合大厦 15 层

联系电话： （010） 65882200， （0755） 23982200

传真： （010） 65882211， （0755） 23982211

联系人： 黄亮

经办律师： 孔雨泉、黄亮

（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： 上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址： 上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人： 李丹

联系电话： （021） 23238888

传真： （021） 23238800

联系人：陈熹

经办注册会计师：单峰、陈熹

四、基金的名称

本基金名称：鹏华中证 500 指数证券投资基金（LOF）

五、基金的运作方式及类型

（一）本基金运作方式

上市契约型开放式

（二）本基金类型

股票型证券投资基金

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，力争将日均跟踪偏离度控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内，以实现中证 500 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，主要投资于中证 500 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%。此外，为更好的实现投资目标，本基金将少量投资于非中证 500 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。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

八、基金的投资策略

本基金采用被动式指数投资方法，原则上按照成份股在中证 500 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或成份股发生配股、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，力求降低跟踪误差。

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%的资产投资于中证 500 指数成份股和备选成份股，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%。

2、股票投资策略

（1）股票投资组合的构建

本基金在建仓期内，将按照中证 500 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中证 500 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

根据指数编制规则，当中证 500 指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重新调整时，本基金将根据各成份股的权重变化进行相应调整；

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，力求降低跟踪误差。

3、债券投资策略

本基金可以根据流动性管理需要，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为：中证 500 指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%。

中证 500 指数扣除了沪深 300 指数样本股及最近一年日均总市值排名前 300 名的股票，再按照最近一年（新股为上市以来）的日均成交金额由高到低排名，剔除排名后 20%的股票，然后将剩余股票按照日均总市值由高到低进行排名，选取排名在前 500 名的股票作为该指数样本股。该指数以调整股本为权重，采用派许加权综合价格指数公式进行计算，其中调整股本根据分级靠档方法获得。该指数综合反映了沪深证券市场内小市值公司的整体状况。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。

如果中证 500 指数被停止编制及发布，或中证 500 指数由其他指数替代（单纯更名除外），或由于指数编制方法等重大变更导致中证 500 指数不宜继续作为本基金的标的指数，本基金管理人在履行适当程序后，可以变更基金的标的指数和业绩比较基准，并在变更前提前 2 个工作日在中国证监会指定的媒体上公告。

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预期风险、较高预期收益品种。

十一、基金的投资组合报告（未经审计）

本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。

本基金的托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，已于 2017 年 1 月

16 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。

本报告中所列财务数据截至 2016 年 12 月 31 日（未经审计）。

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	253,384,539.83	93.91
---	------	----------------	-------

	其中：股票	253,384,539.83	93.91
--	-------	----------------	-------

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	16,096,420.90	5.97
8 其他资产	349,732.68	0.13
9 合计	269,830,693.41	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	3,216,792.10	1.20
B	采矿业	10,082,824.46	3.75
C	制造业	155,217,227.83	57.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,822,071.59	2.91
E	建筑业	7,139,051.95	2.66
F	批发和零售业	15,035,167.08	5.59
G	交通运输、仓储和邮政业	7,110,952.06	2.64
H	住宿和餐饮业	--	
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,119,517.28	5.62
J	金融业	2,121,800.88	0.79
K	房地产业	15,794,886.03	5.87
L	租赁和商务服务业	3,719,543.53	1.38
M	科学研究和技术服务业	761,974.20	0.28
N	水利、环境和公共设施管理业	1,220,790.35	0.45
O	居民服务、修理和其他服务业	--	
P	教育	133,221.00	0.05
Q	卫生和社会工作	672,640.00	0.25
R	文化、体育和娱乐业	3,714,040.49	1.38
S	综合	2,269,356.50	0.84
	合计	251,151,857.33	93.41

(2) 报告期末积极投资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	--	
B	采掘业	--	
C	制造业	1,859,159.39	0.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	--	
E	建筑业	15,592.23	0.01
F	批发和零售业	--	
G	交通运输、仓储和邮政业	9,458.68	0.00
H	住宿和餐饮业	--	
I	信息传输、软件和信息技术服务业	241,692.20	0.09
J	金融业	106,780.00	0.04
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	2,232,682.50	0.83

3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

(1) 报告期末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	600522	中天科技	121,143	1,275,635.79	0.47
2	000656	金科股份	238,000	1,247,120.00	0.46
3	600201	生物股份	39,000	1,232,010.00	0.46

4	300136	信维通信	42,400	1,208,400.00	0.45
5	600682	南京新百	31,300	1,166,551.00	0.43
6	600584	长电科技	65,241	1,151,503.65	0.43
7	600079	人福医药	57,100	1,139,145.00	0.42
8	600219	南山铝业	362,850	1,121,206.50	0.42
9	600643	爱建集团	89,072	1,105,383.52	0.41
10	600487	亨通光电	57,572	1,074,293.52	0.40

(2) 报告期末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	603589	口子窖	19,000	610,470.00	0.23
2	603528	多伦科技	4,000	261,400.00	0.10
3	600996	贵广网络	12,500	234,875.00	0.09
4	603986	兆易创新	982	174,766.54	0.07
5	603868	飞科电器	3,000	140,580.00	0.05

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资
 明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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：本基金本报告期末未持有贵金属。

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

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之一生物技术

生物技术股份有限公司 关于收到中国证券监督管理委员会内蒙古监管局 行政监管措施决定书的公告 本公司及董事会全体成员保证公告内容不存在虚假记载、误导性陈述或者 重大遗漏，并对其内容的真实、准确和完整承担个别及连带责任。 2016 年 12 月 1 日，金宇生物技术股份有限公司（以下简称“公司”）收到中国证券监督管理委员会内蒙古监管局（以下简称“内蒙古证监局”）《关于对 金宇生物技术股份有限公司采取责令改正措施的决定》（[2016] 7 号，以下简称“《决定书》”）。现将《决定书》主要内容公告如下：“近期，我局对你公司进行了现场检查，发现你公司存在如下问题： 一、公司会计估计变更未披露。根据财税[2014]75 号文件，2015 年，公司 子公司金宇保灵生物药品有限公司本期将 100 万元以下研发用固定资产折旧一 次性进费用，子公司扬州优邦生物制药有限公司对生物制药专用设备采用加速折 旧，两家子公司固定资产折旧方法与生物股份年报披露的固定资产折旧政策不一 致（公司 2015 年年报中披露的固定资产折旧方法为年限平均法），共计影响当期 固定资产折旧金额 1,557.39 万元，上述事项应属会计估计变更。公司未对上述 会计估计变更事项进行披露，年报中在重要会计政策和会计估计变更中选定为不 适用。违反《上市公司信息披露管理办法》第三十条规定。 二、公司财务报表列 报不准确。公司 2015 年年报中，将预付技术使用费 1,196 万元和外购用友 ERP 系 统费用 268.27 万元在“在建工程”项目进行核算。合并 现金流量表时，将销售费 用中技术推广费、疫苗补偿费等现金流出 7,375.68 万元计入“购买商品接受劳务 支付的现金”。上述行为与《企业会计准则第 30 号—财务报表列报》第九条不符， 违反《上市公司信息披露管理办法》第二条规 定。 三、内幕信息知情人登记执行不 到位。公司没有对分配股利、董事及三分之 一以上监事发生变化的情况制作内幕信 息知情人档案；2015 年进行非公开发行 时未制作重大事项进程备忘录；没有对内幕

信息知情人买卖本公司股票进行自查 的相关记录，内幕信息知情人登记制度中也没有规定进行自查的相关条款。违反 《关于上市公司建立内幕信息知情人登记管理制度的规定》第六条、第十条、第十二条的规定。 针对上述问题，根据《上市公司信息披露管理办法》第五十九条及《关于上市公司建立内幕信息知情人登记管理制度的规定》第十五条的规定，我局决定对 你公司采取责令改正的行政监管措施。 你公司应当在收到本决定书之日起 30 日内向我局提交书面整改报告，我局 将适时组织检查验收。 如果对本监督管理措施不服的，可以在收到本决定书之日起 60 日内向中国 证券监督管理委员会提出行政复议申请，也可以在收到本决定书之日起 6 个月内 向有管辖权的人民法院提起诉讼。复议与诉讼期间，上述监督管理措施不停止执行。” 公司董事会对上述问题高度重视，将按照《决定书》要求在规定时间内提交整改报告，同时进一步规范公司治理，并根据相关规定及时履行信息披露义务。

本基金投资的前十名证券中的其它证券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。

本基金为指数基金，为更好地跟踪标的指数和控制跟踪误差，按照成份股权重进行配置该证券，符合指数基金的管理规定。该证券的投资已严格执行内部投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

(2) 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

(3) 其他资产构成

序号 名称 金额（元）

1	存出保证金	35,883.53
2	应收证券清算款	58,822.90
3	应收股利	-
4	应收利息	3,205.65
5	应收申购款	251,820.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	349,732.68

(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

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

(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

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 603986 兆易创新 174,766.54 0.07 重大事项

(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。

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：

成立时间 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

2010年2月5日（基金合同生效日）至2010年12月31日 2.90% 1.64% 11.58%

1.72% -8.68% -0.08%

2011年1月1日至2011年12月31日 -33.24% 1.45% -32.33% 1.45% -0.91%

0.00%

2012年1月1日至2012年12月31日 -0.29% 1.45% 0.44% 1.46% -0.73% -0.01%

2013年1月1日至2013年12月31日 16.50% 1.37% 16.16% 1.37% 0.34% 0.00%

2014年1月1日至2014年12月31日 37.84% 1.19% 36.91% 1.18% 0.93% 0.01%

2015年1月1日至2015年12月31日 35.82% 2.93% 41.29% 2.68% -5.47% 0.25%

2016年1月1日至2016年12月31日 -14.12% 1.85% -16.76% 1.81% 2.64% 0.04%

自基金合同生效日至2016年12月31日 28.30% 1.78% 41.85% 1.73% -13.55%

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、《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事务所费、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、《基金合同》生效后与基金相关的指数使用费；
- 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。

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：

$$H=E \times 0.75\% \div \text{当年天数}$$

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：

$$H=E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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—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）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。本基金采取金额申购的方式。

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 < 500 万 0.6%

M ≥ 500 万 每笔 1000 元

其他投资者申购本基金基金份额的申购费率（场外）如下表：

申购金额 M（元） 申购费率

M < 100 万 1.2%

100 万 ≤ M < 500 万 0.6%

M ≥ 500 万 每笔 1000 元

本基金的场内申购费率自 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 100 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的相关公告。

3、赎回费：本基金的场外赎回费率按持有年限逐年递减，具体费率如下：

持有年限（Y） 场外赎回费率

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为固定值 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，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、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项纳税主体，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及有关财务数据的截止日期。
- 2、对“三、基金管理人”部分内容进行了更新。
- 3、对“四、基金托管人”部分内容进行了更新。
- 4、对“五、相关服务机构”部分内容进行了更新。
- 5、对“十一、基金的投资”部分内容进行了更新。
- 6 遂宁 66644、对“十二、基金的业绩”部分内容进行了更新。
- 7、对“二十四、其他应披露事项”相关内容进行了更新。

鹏华基金管理有限公司

2017年3月