

# 鹏华港股通中证香港银行投资指数证券投资基金（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：中国建设银行股份有限公司

二零一七年六月

## 重要提示

本基金经 2016 年 8 月 18 日中国证券监督管理委员会下发的《关于准予鹏华港股通中证香港银行投资指数证券投资基金（LOF）注册的批复》注册，进行募集。

根据相关法律法规，本基金基金合同已于 2016 年 11 月 10 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。

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。本基金投资相关股票市场交易互联互通机制试点允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）的，将承担汇率风险以及境外市场的风险。

本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金为指数型基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。

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，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。

本招募说明书所载内容截止日为 2017 年 5 月 9 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2017 年 3 月 31 日（未经审计）。

## 第一部分基金管理人

### 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、资金财务部总部副总经理等，现任国信证券资金财务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。

刘焱先生，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。

韩亚庆先生，副总裁，经济学硕士，国籍：中国。历任国家开发银行资金局主任科员、全国社会保障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

崔俊杰先生，国籍中国，管理学硕士，9年证券从业经验。2008年7月加盟鹏华基金管理有限公司，历任产品规划部产品设计师、量化投资部量化研究员，先后从事产品设计、量化研究工作，2013年3月起担任鹏华深证民营ETF基金及其联接基金基金经理，2013年3月起兼任鹏华上证民企50ETF基金及其联接基金基金经理，2013年7月起兼任鹏华沪深300ETF基金基金经理，2014年12月起兼任鹏华资源分级基金基金经理，2014年12月起兼任鹏华传媒分级基金基金经理，2015年4月起兼任鹏华银行分级基金基金经理，2015年8月至2016年7月兼任鹏华医药分级（2016年7月已转型为鹏华中证医药卫生（LOF））基金基金经理，2016年7月起兼任鹏华中证医药卫生（LOF）基金基金经理，2016年11月起兼任鹏华香港银行指数（LOF）基金基金经理，现同时担任量化及衍生品投资部副总经理。崔俊杰先生具备基金从业资格。

本基金历任基金经理：无

本基金经理管理其他基金情况：

2013年3月起担任鹏华深证民营ETF基金及其联接基金基金经理，2013年3月起兼任鹏华上证民企50ETF基金及其联接基金基金经理，2013年7月起兼任鹏华沪深300ETF基金基金经理，2014年12月起兼任鹏华资源分级基金基金经理，2014年12月起兼任鹏华传媒分级基金基金经理，2015年4月起兼任鹏华银行分级基金基金经理，2015年8月至2016年7月兼任鹏华医药分级（2016年7月已转型为鹏华中证医药卫生（LOF））基金基金经理，2016年7月起兼任鹏华中证医药卫生（LOF）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。

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、鹏华医药科技股票基金基金经理。

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、上述人员之间均不存在近亲属关系。

## 第二部分基金托管人

### 1、基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司（简称：中国建设银行）

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

成立时间：2004年09月17日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12号

联系人：田青

联系电话：(010) 6759 5096

中国建设银行成立于1954年10月，是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行，总部设在北京。本行于2005年10月在香港联合交易所挂牌上市(股票

代码 939)，于 2007 年 9 月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码 601939)。

2015 年末，本集团资产总额 18.35 万亿元，较上年增长 9.59%；客户贷款和垫款总额 10.49 万亿元，增长 10.67%；客户存款总额 13.67 万亿元，增长 5.96%。净利润 2,289 亿元，增长 0.28%；营业收入 6,052 亿元，增长 6.09%，其中，利息净收入增长 4.65%，手续费及佣金净收入增长 4.62%。平均资产回报率 1.30%，加权平均净资产收益率 17.27%，成本收入比 26.98%，资本充足率 15.39%，主要财务指标领先同业。

物理与电子渠道协同发展。营业网点“三综合”建设取得新进展，综合性网点数量达 1.45 万个，综合营销团队 2.15 万个，综合柜员占比达到 88%。启动深圳等 8 家分行物理渠道全面转型创新试点，智慧网点、旗舰型、综合型和轻型网点建设有序推进。电子银行主渠道作用进一步凸显，电子银行和自助渠道账务性交易量占比达 95.58%，较上年提升 7.55 个百分点；同时推广账号支付、手机支付、跨行付、龙卡云支付、快捷付等五种在线支付方式，成功实现绝大多数主要快捷支付业务的全行集中处理。

转型业务快速增长。信用卡累计发卡量 8,074 万张，消费交易额 2.22 万亿元，多项核心指标继续保持同业领先。金融资产 1,000 万以上的私人银行客户数量增长 23.08%，客户金融资产总量增长 32.94%。非金融企业债务融资工具累计承销 5,316 亿元，承销额市场领先。资产托管业务规模 7.17 万亿元，增长 67.36%；托管证券投资基金数量和新增只数均为市场第一。人民币国际清算网络建设再获突破，继伦敦之后，再获任瑞士、智利人民币清算行资格；上海自贸区、新疆霍尔果斯特殊经济区主要业务指标居同业首位。

2015 年，本集团先后获得国内外各类荣誉总计 122 项，并独家荣获美国《环球金融》杂志“中国最佳银行”、香港《财资》杂志“中国最佳银行”及香港《企业财资》杂志“中国最佳银行”等大奖。本集团在英国《银行家》杂志 2015 年“世界银行品牌 1000 强”中，以一级资本总额位列全球第二；在美国《福布斯》杂志 2015 年度全球企业 2000 强中位列第二。

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII 托管处、养老金托管处、清算处、核算处、跨境托管运营处、监督稽核处等 10 个职能处室，在上海设有投资托管服务上海备份中心，共有员工 220 余人。自 2007 年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

## 2、主要人员情况

赵观甫，资产托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行郑州市分行、总行信贷

部、总行信贷二部、行长办公室工作，并在中国建设银行河北省分行营业部、总行个人银行业务部、总行审计部担任领导职务，长期从事信贷业务、个人银行业务和内部审计等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行总行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室，长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张力铮，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行建筑经济部、信贷二部、信贷部、信贷管理部、信贷经营部、公司业务部，并在总行集团客户部和中国建设银行北京市分行担任领导职务，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

### 3、基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2016年一季度末，中国建设银行已托管584只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行自2009年至今连续六年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”。

## 第三部分相关服务机构

### 一、基金份额销售机构

#### 场外销售机构：

##### 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

联系电话：0755-82021233

传真：0755-82021155

联系人：吕奇志



网址: [www.phfund.com](http://www.phfund.com)

(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

联系电话: 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 号花旗集团大厦 801B 室

联系电话: 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、银行销售机构:

(1) 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](http://www.ccb.com)

(2) 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

（3）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

（4）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

（5）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

（6）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

（7）南京银行股份有限公司

住所：江苏省南京市玄武区中山路 288 号

法定代表人：林复

客服电话：40088-96400

公司网址：www.njcb.com.cn

### 3、证券公司销售机构

#### （1）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

#### （2）中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层（1507-1510 室）

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层

法定代表人：杨宝林

联系人：吴忠超

联系电话：0532-85022326

传真：0532-85022605

客户服务电话：0532-96577

网址：www.zxwt.com.cn

#### （3）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

联系电话：010-66568430

联系人：邓颜

客户服务电话：400-8888-888 或 95551

网址：www.chinastock.com.cn

#### （4）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

(5) 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 层-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 04、18-21 层

法定代表人：高涛

联系人：万玉琳

联系电话：0755-82023442

客户服务热线：400 600 8008、95532

网址：www.china-invs.cn

(6) 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

(7) 光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：薛峰

联系人：李芳芳

电话：021-22169999

传真：021-22169134

客户服务电话：95525

公司网站：www.ebscn.com

(8) 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

网址：www.csc108.com

(9) 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

(10) 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/>

(11) 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

（12）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

（13）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：芮敏祺

联系电话：021-38676666

传真：021-38670666

网址：www.gtja.com

（14）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 40 层

法定代表人：李梅

联系电话：021-33388229

联系人：李玉婷

客户服务电话：95523 或 4008895523

传真：021-33388224

网址：www.swhysc.com

（15）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

联系电话：010-63081493

传真：010-63081344

客服热线：95321

网址：www.cindasc.com

（16）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

（17）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：梁薇

联系电话：020-88836999

传真号码：020-88836654

客服热线：95396

网址：www.gzs.com.cn

（18）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

（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

联系人：李欣

联系电话：021—38784580

传真：021-68865680

客户服务电话：95351（主）/400-888-1551

网址：www.xcsc.com

（20）西部证券股份有限公司

注册地址：西安市东新街 232 号陕西信托大厦 16-17 楼

办公地址：西安市东新街 232 号陕西信托大厦 6 楼

法定代表人：刘建武

联系人：梁承华

电话：029-87406649

传真：029-87406710

客户服务电话：95582

网址：www.westsecu.com

（21）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>

（22）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：杨莉娟

电话：021-54967552

传真：021-54967032

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



网址: [www.cfsc.com.cn](http://www.cfsc.com.cn)

(23) 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

网址: [www.gjzq.com.cn](http://www.gjzq.com.cn)

(24) 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](http://www.zts.com.cn)

(25) 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

联系人: 周一涵

联系电话: 021-38637463

传真: 0755-82435367

客户服务电话: 95511-8

网址: [stock.pingan.com](http://stock.pingan.com)

(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: 天津市南开区云际道立达公寓 F 座渤海证券

法定代表人: 王春峰

联系人: 蔡霆

电话: 022-28451991

传真：022-28451892

网址：www.ewww.com.cn

(27) 中国国际金融有限公司

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

(28) 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：95358

联系电话：0755-23838750

传真：0755-25838701

联系人：毛诗莉

网址：www.firstcapital.com.cn

(29) 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

(30) 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](http://www.swsc.com.cn)

（31）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

客服电话：95390

网址：[www.hrsec.com.cn](http://www.hrsec.com.cn)

（32）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](http://www.newone.com.cn)

（33）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](http://www.gf.com.cn)

（34）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16-18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 16-18 层

法定代表人：冯鹤年

联系人：周照清

电话：010-85127561

服务热线：400-619-8888

公司网站：www.msza.com

（35）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

（36）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

联系人：庞晓芸

联系电话：0755-82492193

传真：0755-82492962

客户服务电话：95597

网址：www.htsc.com.cn

（37）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

#### 4、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：400-8877-780-0

联系电话：023-86769637

传真：023-86769629

联系人：刘芸

网址：[www.cfc108.com](http://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](http://www.citicsf.com)

#### 5、第三方销售机构

##### (1) 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：[danjuanapp.com](http://danjuanapp.com)

##### (2) 北京乐融多源投资咨询有限公司

住所：北京市朝阳区西大望路1号1号楼1603

办公地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙房2层222单元

法定代表人：董浩

联系人：陈铭洲

联系电话：010-56580666

传真：010-56580660

客服电话：400-618-0707

网址：[www.hongdianfund.com](http://www.hongdianfund.com)

(3) 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](http://www.xincai.com)

(4) 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](http://www.myfund.com)

(5) 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：周瑾旻

网址：[www.fund123.cn](http://www.fund123.cn)

(6) 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

(7) 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

办公地址：上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 8 楼 801 室

法定代表人：汪静波

客服电话：400-821-5399

传真：021-38509777

联系人：何菁菁

网址：www.noah-fund.com

(8) 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

(9) 上海利得基金销售有限公司

住所：上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼

办公地址：上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼

法定代表人：李兴春

联系人：曹怡晨

联系电话：021-50583533

客服电话：400-921-7755

网址：a.leadbank.com.cn

(10) 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

(11) 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

(12) 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

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

(13) 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：400-116-1188

网址：8.jrj.com.cn

(14) 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](http://www.zlfund.cn)、[www.jjmmw.com](http://www.jjmmw.com)

(15) 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

联系电话: 010-59497361

传真: 010-64788016

客服电话: 400-059-8888

网址: [www.zscffund.com](http://www.zscffund.com)

(16) 宜信普泽投资顾问(北京)有限公司

住所: 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 9 号楼 15 层 1809

法定代表人: 唐宁

联系人: 王巨明

联系电话: 010-52855650

客服电话: 400-6099-200

网址: [www.yixinfund.com](http://www.yixinfund.com)

(17) 浙江同花顺基金销售有限公司

办公地址: 浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903

法定代表人: 李晓涛

客服电话: (0571)56768888

传真: 0571-88911818

联系人: 蒋泽君

网址: [www.10jqka.com.cn](http://www.10jqka.com.cn)

(18) 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](http://www.yingmi.cn)

(19) 北京肯特瑞财富投资管理有限公司

住所：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

注册资本：2000 万元

法定代表人：陈超

客服电话：95118

网址：fund.jd.com

联系人：江卉

传真：010-89189566

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。

场内发售机构：

(1) 本基金的场内发售机构为具有基金销售业务资格的上海证券交易所会员单位（具体名单可在上海证券交易所网站查询）。

(2) 本基金募集结束前获得基金销售资格的上海证券交易所会员单位可新增为本基金的场内发售机构。

二、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

办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：周明

联系电话：010-59378835

传真：010-59378839

联系人：朱立元

三、出具法律意见书的律师事务所

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

负责人：俞卫锋

办公地址：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：黎明、陈颖华

#### 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

#### 第四部分基金的名称

本基金名称：鹏华港股通中证香港银行投资指数证券投资基金（LOF）

#### 第五部分基金的运作方式与类型

上市契约型开放式（LOF），股票型证券投资基金

#### 第六部分基金的投资目标

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，力争将日均跟踪偏离度控制在 0.5% 以内，年跟踪误差控制在 6% 以内。

#### 第七部分基金的投资范围

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（包括港股通标的股票和中国证监会核准发行的股票）、固定收益资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、资产支持证券、质押及买断式回购、银行存款（包括银行定期存款、银行协议存款、银行通知存款等）等）、股指期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具（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：

投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或者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%。

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。

## 第八部分基金的投资策略

本基金采用被动式指数化投资方法，按照成份股在标的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。

本基金力争将日均跟踪偏离度控制在 0.5% 以内，年跟踪误差控制在 6% 以内。

如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

### 1、股票投资策略

#### （1）股票投资组合的构建

本基金在建仓期内，将按照标的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，对基金财产进行适当调整，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标的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，对其进行适时调整，以保证基金份额净值增长率与标的指数收益率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，当标的指数成份股因增发、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。

## 2、债券投资策略

本基金基于流动性管理及策略性投资的需要，将投资于国债、金融债等债券，债券投资的目的是保证基金资产流动性，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。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。

## 3、衍生品投资策略

本基金可投资股指期货、权证和其他经中国证监会允许的金融衍生产品。

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低申购赎回时现金资产对投资组合的影响及投资组合仓位调整的交易成本，达到稳定投资组合资产净值的目的。

基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项，同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。

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。

## 4、资产支持证券的投资策略

本基金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理，并根据信用风险、利率风险和流动性风险变化积极调整投资策略，严格遵守法律法规和基金合同的约定，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。

## 5、融资及转融通投资策略

本基金将在充分考虑风险和收益特征的基础上，审慎参与融资及转融通业务。本基金将根据市场情况和组合风险收益，确定投资时机、标的证券以及投资比例。若相关融资及转融通业务的法律法规发生变化，本基金将从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。

本基金通过港股通投资标的指数的成份股、备选成份股，未来如果港股通业务规则发生变化或出现法律法规或监管部门允许投资的其他模式，基金管理人可相应调整，不需召开基

金份额持有人大会。

未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，本基金可相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书中更新公告。

#### 第九部分基金的业绩比较基准

中证香港银行投资指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%

中证香港银行投资指数在满足港股通资格的香港上市公司中挑选属于银行行业的股票作为成份股。该指数反映港股通标的股票范围内的银行发行的股票的整体表现，同时也为市场提供相关的投资标的。

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告，但不需要召开基金份额持有人大会。

#### 第十部分基金的风险收益特征

本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金为指数型基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金将投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。

#### 第十一部分基金的投资组合报告

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年4月19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。

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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年1月1日起至3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 28,424,483.40 90.46

其中：股票 28,424,483.40 90.46

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 2,867,343.19 9.12

8 其他资产 131,777.27 0.42

9 合计 31,423,603.86 100.00

## 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

注：无。

(2) 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

注：无。

(3) 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

行业类别 公允价值（元） 占基金资产净值比例（%）

1. 金融 2. 28,424,483.40 3. 97.31

4. 合计 5. 28,424,483.40 6. 97.31

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

## 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 H00939 建设银行 773,000 4,289,135.44 14.68

2 H01398 工商银行 939,000 4,234,864.83 14.50

3 H03988 中国银行 1,189,000 4,074,547.72 13.95

4	H00005	汇丰控股	72,000	4,046,191.70	13.85
5	H02888	渣打集团	45,900	3,025,654.90	10.36
6	H02388	中银香港	60,000	1,691,239.95	5.79
7	H00011	恒生银行	10,800	1,511,089.60	5.17
8	H03968	招商银行	64,000	1,167,621.41	4.00
9	H01288	农业银行	351,000	1,115,579.16	3.82
10	H03328	交通银行	150,000	804,337.74	2.75

(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

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：无。

(2) 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低申购赎回时现金资产对投资组合的影响及投资组合仓位调整的交易成本，达到稳定投资组合资产净值的目的。

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 27,597.40

2 应收证券清算款 -

3 应收股利 103,171.88

4 应收利息 1,007.99

5 应收申购款 -

6 其他应收款 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 131,777.27

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

(5) 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

(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

注：无。

(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。

## 第十二部分基金的业绩

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

2016年11月10日

(基金合同生效日)至2016年12月31日 -1.80% 0.60% 5.49% 0.82% -7.29% -0.22%

2017年1月1日至2017年3月31日 7.78% 0.89% 7.42% 0.85% 0.36% 0.04%

自基金合同生效日至2017年3月31日 5.84% 0.79% 13.32% 0.83% -7.48% -0.04%

## 第十三部分基金的费用与税收

### 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》生效后的标的指数许可使用费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《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；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券/期货交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、证券/期货账户开户费用、账户维护费用；
- 10、基金上市费用和年费；
- 11、因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用；
- 12、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 0.75%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，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

### 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，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

### 3、标的指数许可使用费

本基金的标的指数许可使用费按前一日基金资产净值的 0.02%的年费率计提。标的指数许可使用费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.02\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的标的指数许可使用费

E 为前一日的基金资产净值

标的指数许可使用费每日计算，逐日累计至每季季末，按季支付（当季不足 50,000 元的，按 50,000 元计算），计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。由基金管理人向基金托管人发送标的指数许可使用费划款指令，基金托管人复核后于次季前 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给标的指数供应商。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

标的指数供应商根据相应指数许可协议变更标的指数许可使用费率和计算方式时，基金管理人需依照有关规定最迟于新的费率和计费方式实施日前 2 日在指定媒介公告并书面通知托管人。

上述“一、基金费用的种类中第 4—12 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

##### (1) 场外申购

投资者可以多次申购本基金，申购费按每笔申购申请单独计算。

本基金基金份额对通过直销中心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保险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险基金、企业年金单一计划以及集合计划、商业养老保险组合。如将来出现经养老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中心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 1.20% 0.48%

100 万 ≤ M < 500 万 0.60% 0.18%

M ≥ 500 万 每笔 1000 元 每笔 1000 元

申购费用由投资者承担，在申购基金份额时收取，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。

##### (2) 场内申购

投资者可以多次申购本基金，申购费按每笔申购申请单独计算。

本基金场内申购费率如下表：

申购金额 M（元） 申购费率

M < 100 万 1.20%

100 万 ≤ M < 500 万 0.60%

M ≥ 500 万 每笔 1000 元

申购费用由投资者承担，在申购基金份额时收取，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。

## 2、赎回费

### （1）场外赎回

本基金的场外赎回费率如下表所示：

持有年限（Y） 赎回费率

$Y < 1$  年 0.50%

$1 \text{ 年} \leq Y < 2$  年 0.25%

$Y \geq 2$  年 0.00%

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。其中赎回费总额的 25% 应归基金财产，其余用于支付市场推广、注册登记费和其他必要的手续费。

### （2）场内赎回

本基金的场内赎回费率为固定值 0.50%。

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。其中赎回费总额的 25% 应归基金财产，其余用于支付市场推广、注册登记费和其他必要的手续费。

## 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；
- 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、基金税收

本基金运作过程中涉及各纳税主体，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。

## 第十四部分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和基金合同生效日期。
- 2、对“第三部分基金管理人”部分内容进行了更新。
- 3、对“第五部分相关服务机构”内容进行了更新。
- 4、对“第六部分基金的募集与基金合同的生效”内容进行了更新。
- 5、对“第七部分基金份额的上市交易”部分内容进行了更新。
- 6、对“第八部分基金份额的申购与赎回”部分内容进行了更新。
- 7、对“第九部分基金的投资”部分内容进行了更新。
- 8、新增了“第十部分基金的业绩”的内容。
- 9、对“第二十二部分其他应披露事项”部分内容进行了更新。

鹏华基金管理有限公司

2017年6月