

鹏华金城保本混合型证券投资基金更新的招募说明书摘要

鹏华金城保本混合型证券投资基金
更新的招募说明书摘要

基金管理人：鹏华基金管理有限公司
基金托管人：中国银行股份有限公司
二零一七年七月

重要提示

本基金经 2016 年 4 月 14 日中国证券监督管理委员会下发的《关于准予鹏华金城保本混合型证券投资基金注册的批复》（证监会许可[2016]792 号）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 6 月 1 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、保证风险、不适用保本条款风险、到期操作期间未知价风险、金融衍生品投资风险及其他风险等。投资者投资于本基金，必须自担风险。投资者投资于保本基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构，保本基金在极端情况下仍然存在本金损失的风险。

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，但为投资者提供保本保证，并由担保人提供不可撤销的连带责任担保。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。

本摘要根据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。

本招募说明书所载内容截止日为2017年5月31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（EurizonCapitalSGRS.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、党总支部书记。

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。

MassimoMazzini先生，董事，经济和商学学士。国籍：意大利。曾在安达信（ArthurAndersenMBA）从事风险管理和资产管理工作，历任CAAIPGSGR投资总监、CAAMASGR及CAAIPGSGR首席执行官和投资总监、东方汇理资产管理股份有限公司（CAAMSGR）投资副总监、农业信贷另类投资集团（CreditAgricoleAlternativeInvestmentsGroup）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（EurizonCapitalSGRS.p.A.）投资方案部投资总监、Epsilon资产管理股份公司（EpsilonSGR）首席执行官，欧利盛资本股份公司（EurizonCapitalS.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（EurizonCapitalSGRS.p.A.）市场及业务发展总监。

AndreaVismara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（CreditAgricoleGroup）东方汇理资产管理股份有限公司（CAAMSGR）法务部、产品开发部，欧利盛资本资产管理股份公司（EurizonCapitalSGRS.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（EurizonCapitalSGRS.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（EurizonCapitalS.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。

SANDROVESPRINI 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

(EurizonCapitalSGRS.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

(EurizonCapitalSGRS.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

祝松先生，国籍中国，经济学硕士，11年金融证券从业经验。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，从事人民币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2月起担任普天债券基金基金经理，2014年2月起兼任鹏华丰润债券（LOF）基金基金经理，2014年3月起兼任鹏华产业债债券基金基金经理，2015年3月起兼任鹏华双债加利债券基金基金经理，2015年12月起兼任鹏华丰华债券基金基金经理，2016年2月起兼任鹏华弘泰混合基金基金经理，2016年6月起兼任鹏华金城保本混合基金、鹏华丰茂债券基金基金经理，2016年12月起兼任鹏华永盛定期开放债券、鹏华丰惠债券、鹏华丰盈债券基金基金经理，2017年3月起兼任鹏华永安定期开放债券基金基金经理，2017年5月起兼任鹏华永泰定期开放债券基金基金经理，现同时担任固定收益部副总经理。祝松先生具备基金从业资格。

祝松管理其他基金情况：

2014年2月起担任普天债券基金基金经理，2014年2月起兼任鹏华丰润债券（LOF）基金基金经理，2014年3月起兼任鹏华产业债债券基金基金经理，2015年3月起兼任鹏华双债加利债券基金基金经理，2015年12月起兼任鹏华丰华债券基金基金经理，2016年2月起兼任鹏华弘泰混合基金基金经理，2016年6月起兼任鹏华丰茂债券基金基金经理，2016年12月起兼任鹏华永盛定期开放债券、鹏华丰惠债券、鹏华丰盈债券基金基金经理，2017年3月起兼任鹏华永安定期开放债券基金基金经理，2017年5月起兼任鹏华永泰定期开放债券基金基金经理，现同时担任固定收益部副总经理。

王宗合先生，国籍中国，金融学硕士，11年证券从业经验，曾经在招商基金从事食品饮料、商业零售、农林牧渔、纺织服装、汽车等行业的研究。2009年5月加盟鹏华基金管理有限公司，从事食品饮料、农林牧渔、商业零售、造纸包装等行业的研究工作，担任鹏华动力增长混合（LOF）基金基金经理助理，2010年12月起担任鹏华消费优选混合基金基金经理，2012年6月起兼任鹏华金刚保本混合基金基金经理，2014年7月起兼任鹏华品牌传承混合基金基金经理，2014年12月起兼任鹏华养老产业股票基金基金经理，2016年4月起兼任鹏华金鼎保本混合基金基金经理，2016年6月起兼任鹏华金城保本混合基金基金经理，2017年2月起兼任鹏华安益增强混合基金基金经理，现同时担任权益投资二部总经理。王宗合先生具备基金从业资格。

王宗合管理其他基金情况：

2009年5月担任鹏华动力增长混合（LOF）基金基金经理助理，2010年12月起担任鹏华消费优选混合基金基金经理，2012年6月起兼任鹏华金刚保本混合基金基金经理，2014年7月起兼任鹏华品牌传承混合基金基金经理，2014年12月起兼任鹏华养老产业股票基金基金经理，2016年4月起兼任鹏华金鼎保本混合基金基金经理，2017年2月起兼任鹏华安益增强混合基金基金经理，现同时担任权益投资二部总经理。

李振宇先生，国籍中国，经济学硕士，5年证券基金从业经验。曾任银华基金管理有限公司固定收益部基金经理助理，从事债券投资研究工作；2016年8月加盟鹏华基金管理有限公司，担任固定收益部投资经理，2016年12月起担任鹏华丰惠债券、鹏华丰盈债券基金基金经理，

2017年2月起兼任鹏华可转债基金基金经理，2017年5月起兼任鹏华丰康债券、鹏华金城保本混合基金基金经理。李振宇先生具备基金从业资格。

李振宇管理其他基金情况：

2016年12月起担任鹏华丰惠债券、鹏华丰盈债券基金基金经理，2017年2月起兼任鹏华可转债基金基金经理，2017年5月起兼任鹏华丰康债券基金基金经理。

本基金历任基金经理：

2016年6月至2017年5月祝松、王宗合先生

2017年5月至本招募说明书更新日祝松、王宗合、李振宇先生

5、投资决策委员会成员情况

邓召明先生，鹏华基金管理有限公司董事、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、上述人员之间不存在近亲属关系。

第二部分基金托管人

（一）基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称中国银行）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

法定代表人：田国立

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

托管部门信息披露联系人：王永民

传真：（010）66594942

中国银行客服电话：95566

（二）基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年，现有员工110余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内，中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务，为各类客

户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

（三）证券投资基金托管情况

截至 2017 年 03 月 31 日，中国银行已托管 576 只证券投资基金，其中境内基金 541 只，QDII 基金 35 只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

第三部分相关服务机构

一、基金份额销售机构

1、直销机构

（1）鹏华基金管理有限公司直销中心

办公地址：深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心 43 层

联系电话：0755-82021233

传真：0755-82021155

联系人：吕奇志

网址：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

(2) 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

(3) 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

(4) 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

(5) 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

(6) 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

(7) 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

(8) 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

(9) 珠海华润银行股份有限公司

注册(办公)地址: 中国广东珠海市吉大九洲大道东1346号

法定代表人: 刘晓勇

客服电话: 400-880-0338 或 96588 (广东省外请加拨 0756)

联系人: 李阳

网址: www.crbank.com.cn

(10) 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

(11) 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

(12) 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

(13) 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

(14) 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

(15) 徽商银行股份有限公司

注册(办公)地址:合肥市安庆路79号天徽大厦A座

法定代表人:李宏鸣

联系人:叶卓伟

联系电话:0551-62667635

客户服务电话:4008896588

网址:www.hsbank.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) 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

(6) 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

(7) 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

(8) 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

(9) 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

(10) 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

(11) 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

(12) 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：尹旭航

联系电话：010-63081493

传真：010-63081344

客服热线：95321

网址：www.cindasc.com

(13) 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

(14) 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

(15) 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

(16) 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

（17）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：梁承华

电话：029-87406649

传真：029-87406710

客户服务电话：95582

网址：www.westsecu.com

（18）天风证券股份有限公司

注册地址：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路 2 号高科大厦 4 楼

办公地址：湖北省武汉市武昌区中南路 99 号保利广场 A 座 37 楼

法定代表人：余磊

联系人：崔成

电话：027-87618676

传真：027-87618863

客户服务电话：95391/4008005000

网址：<http://www.tfzq.com>

（19）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

（20）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：冉云

联系人：刘婧漪

电话：028-86690057

传真：028-86690126

服务热线：95310

网址：www.gjq.com.cn

(21) 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

(22) 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

(23) 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

(24) 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

(25) 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：4006008008、95532

网址：www.china-invs.cn

(26) 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

(27) 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

(28) 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

(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) 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/

(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

(32) 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：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

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

(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

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

（2）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

（3）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

（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

(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

(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) 南京苏宁基金销售有限公司

住所：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

办公地址：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

法定代表人：钱燕飞

联系人：喻明明

联系电话：025-66996699-884131

客服电话：95177

网址：www.snjijin.com

(8) 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

(9) 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.howbuy.com

(10) 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

(11) 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

(12) 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

(13) 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：02158787698
客服电话：400-089-1289
公司网站：www.erichfund.com

(14) 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

(15) 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.jmmw.com

(16) 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

(17) 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

(18) 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。

二、登记机构

名称：鹏华基金管理有限公司

注册地址：深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心 43 层

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

法定代表人：何如

联系人：吴群莉

联系电话：0755-82021106

传真：0755-82021165

三、出具法律意见书的律师事务所

名称：广东嘉得信律师事务所

住所：深圳市罗湖区笋岗东路中民时代广场 A 座 201

负责人：闵齐双

办公地址：深圳市罗湖区笋岗东路中民时代广场 A 座 201

联系电话：0733-32981099

传真：0755-33033086

联系人：鲍泽飞

经办律师：闵齐双、鲍泽飞

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：鹏华金城保本混合型证券投资基金

第五部分基金的运作方式与类型

契约型开放式，保本混合型证券投资基金

第六部分基金的投资目标

灵活运用投资组合保险策略，在保证本金安全的基础上追求基金资产的稳定增值。

第七部分基金的投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，本基金可以投资于股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、各类债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、债券回购、央行票据、中期票据、可转换债券、分离交易可转债、短期融资券、资产支持证券、中小企业私募债、可交换债券以及经法律法规或中国证监会允许投资的其他债券类金融工具）、银行存款、货币市场工具（包括同业存单、大额存单等）、权证、国债期货、股指期货及中国证监会允许投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。

如法律法规或中国证监会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。

本基金的投资组合比例由优化的 CPPI 策略决定，并对比例范围有如下限制：权益类资产占基金

资产的比例不超过 40%；债券、货币市场工具及其它资产的比例合计不低于基金资产的 60%，其中基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。

如法律法规或中国证监会允许，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

第八部分基金的投资策略

一、基金的投资策略

本基金通过灵活运用投资组合保险策略，在本金安全的基础上追求基金资产的稳定增值。本基金的整体投资策略分为三个层次：第一层次，以保本为出发点的资产配置策略；第二层次，以追求本金安全和稳定的收益回报为目的的固定收益类资产投资策略；第三层次，以股票为主要投资对象的权益类资产投资策略。

1、资产配置策略

本基金以优化的恒定比例组合保险策略（CPPI）为核心，并结合对市场时机的把握，确定和调整基金资产在风险资产和无风险资产间的投资比例，规避系统性风险，确保本基金投资目标的实现。本基金利用 CPPI 进行资产配置的主要步骤是：

综合考虑本基金到期保本增值的要求、保本周期的时间长度、合理的贴现率、基金资产净值的增长率，建立一条随时间推移呈非负增长的动态资产保障线，并以此作为本基金资产组合的价值底线（）；

计算基金资产净值（）超越动态资产保障水平的数额，该数值称为安全垫（）；

将相当于安全垫的资金规模放大一定倍数（称之为风险乘数）后，作为基金风险资产投资金额上限，其余资金投资于无风险资产；

其中，为基金资产时的风险资产投资金额上限，为基金资产在时的净值，为风险乘数（放大倍数）。

根据市场的波动情况和本基金资金的运作情况，确定和动态调整无风险资产和风险资产之间的配置比例，以确保风险资产的实际投资比例不超过风险资产的投资比例上限。

本基金采用定性和定量两种分析方法确定放大倍数。基金管理人的金融工程小组以相关波动监测工具（包括风险资产的波动率水平、为减小构造成本而确定的放大倍数波动范围等）为依据，为本基金确定放大倍数提供定量分析支持。定性分析则侧重对宏观经济运行情况、利率水平及基金管理人对风险资产风险收益水平的预测等进行分析。通常情况下，本基金放大倍数不会超过 5。

根据 CPPI 策略要求，放大倍数在一定时间内需要保持恒定。在实际应用中，如果要保持安全垫放大倍数的恒定，则需根据投资组合市值的变化随时调整风险资产与安全资产的比例，而这将给基金带来高昂的交易费用。同时，当市场发生较大变化时，为维持固定的放大倍数，基金的资产配置可能过于激进。因此，本基金放大倍数采取季度定期调整为主，特殊情况下进行不定期调整的方法。

2、债券投资策略

本基金将从风险和收益两方面进行考虑来构建债券投资组合。债券资产首先必须是足够安全的，且债券的现金流情况应与保本周期相一致；在上述前提下，基金管理人将尽量选择收益率水平高的品种，以实现安全垫的最大化。

本基金将持有一部分剩余期限与保本周期相匹配的债券，另一部分兼顾收益性和流动性。本基金将采取久期策略、收益率曲线策略、骑乘策略、利差策略、息差策略等，力争在债券投资层面为基金保本增值产生正向贡献。

（1）久期策略

本基金持有剩余期限与基金周期相匹配的债券，主要按买入并持有方式操作以保证组合收益的稳定性，有效回避利率风险。

（2）收益率曲线策略

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。

（3）骑乘策略

本基金将采用骑乘策略增强组合的持有期收益。这一策略即通过对收益率曲线的分析，在可选的目标久期区间买入期限位于收益率曲线较陡峭处右侧的债券。在收益率曲线不变动的情况下，随着其剩余期限的衰减，债券收益率将沿着陡峭的收益率曲线有较大幅度的下滑，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。

（4）息差策略

本基金将利用回购利率低于债券收益率的情形，通过正回购将所获得的资金投资于债券，利用杠杆放大债券投资的收益。

（5）利差策略

本基金通过对两个期限相近的债券的利差进行分析，从而对利差水平的未来走势作出判断，进而相应的进行债券置换。影响两期限相近债券的利差水平的因素主要有息票因素、流动性因素及信用评级因素等。当预期利差水平缩小时，买入收益率高的债券同时卖出收益率低的债券，通过两债券利差的缩小获得投资收益；当预期利差水平扩大时，则进行相反的操作。

3、股票投资策略

本基金从行业和个股两方面进行分析研究，精选具有清晰、可持续的业绩增长潜力且被市场相对低估或价格处于合理区间的股票，构建股票组合，分散非系统性风险，充分获取股市上涨收益。

（1）行业配置

本基金将结合宏观经济研究及行业特性分析，动态调整行业配置，在研究分析中重点关注行业技术水平发展、产业政策变化、产业组织分析、市场需求及全球化等新兴因素等对行业估值水平可能产生影响的变量。

（2）个股的筛选

本基金股票投资以精选个股为主。发挥基金管理人专业研究团队的研究能力，考察上市公司所属行业发展前景、行业地位、公司竞争优势、盈利能力、成长性、估值水平等多种因素，精选流动性好、成长性高、估值水平低的股票进行投资。

为评估个股的投资价值，本基金将借助于定量分析和定性分析相结合的方式，对个股进行研究。

1) 定量分析

财务分析。通过对资产负债率、流动比率、速动比率等偿债能力指标，应收账款周转率、存货周转率等营运能力指标，资本金利润率、销售利税率(营业收入利税率)、成本费用利润率等盈利能力指标的分析，比较其与行业内其他企业的相对地位，鉴别企业的投资价值。

估值分析。基金将选择运用相对估值方法和绝对估值方法，挖掘出价值低估和价值合理的企业。

2) 定性分析

在定量分析的基础上，本基金采用定性分析的方法研究并考察上市公司的品质和可靠性，以便从更长期的角度保证定量方法所选上市公司增长的持续性。

本基金通过对上市公司技术水平、资源状况、公司战略、治理结构和商业模式的分析，判断推动上市公司主营业务收入或上市公司利润增长的原因和可望保持的时间，进而判断上市公司可长期投资的价值。

4、权证投资策略

本基金将权证看作是辅助性投资工具，权证的投资原则为有利于基金资产保值、增值，有利于加强基金风险控制。

5、中小企业私募债投资策略

中小企业私募债券是在中国境内以非公开方式发行和转让，约定在一定期限还本付息的公司债券。由于其非公开性及条款可协商性，普遍具有较高收益。本基金将深入研究发行人资信及公司运营情况，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，尽力规避风险，并获取超额收益。

6、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。

7、股指期货投资策略

本基金参与股指期货的投资的，应符合基金合同规定的保本策略和投资目标。本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目标，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，充分考虑股指期货的风险收益特征，通过多头或空头的套期保值策略，以改善投资组合的投资效果，实现股票组合的超额收益。

8、国债期货投资策略

为有效控制债券投资的系统性风险，本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的，适度运用国债期货，提高投资组合的运作效率。在国债期货投资时，本基金将首先分析国债期货各合约价格与最便宜可交割券的关系，选择定价合理的国债期货合约，其次，考虑国债期货各合约的流动性情况，最终确定与现货组合的合适匹配，以达到风险管理的目标。

二、投资决策依据及程序

1、投资决策依据

- (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。

2、投资决策程序

(1) 投资决策委员会：确定本基金总体资产配置和投资策略。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议。

(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虑的基本因素包括：每日基金申购和赎回净现金流量；基金合同的投资限制和比例限制；研究员的投资建议；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给交易员，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）提出调整建议。

(5) 监察稽核部：对投资流程等进行合法合规审核、监督和检查。

(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实际需要调整上述投资决策程序，并予以公告。

第九部分基金的业绩比较基准

三年期定期存款税后利率。

本基金是保本基金，保本周期最长为三年，保本但不保证收益率。以三年期定期存款税后利率作为本基金的业绩比较基准，能够使投资者理性判断本基金产品的风险收益特征，合理衡量比较本基金保本保证的有效性。

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

本基金属于保本混合型基金，属于证券投资基金中的低风险品种。

第十一部分基金的投资组合报告

基金管理人的董事会、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的法律责任。

基金托管人中国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。

本报告中所列财务数据截至2017年3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 325,056.90 0.01

其中：股票 325,056.90 0.01

2 基金投资	--
3 固定收益投资	4,998,590,384.20 95.74
其中：债券	4,998,590,384.20 95.74
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	141,191,944.12 2.70
8 其他资产	80,899,375.70 1.55
9 合计	5,221,006,760.92 100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

(1) 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	--	
B	采矿业	--	
C	制造业	325,056.90	0.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	--	
E	建筑业	--	
F	批发和零售业	--	
G	交通运输、仓储和邮政业	--	
H	住宿和餐饮业	--	
I	信息传输、软件和信息技术服务业	--	
J	金融业	--	
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	325,056.90	0.01

(2) 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：无。

3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	603986	兆易创新	1,133	238,043.30	0.01
2	300537	广信材料	1,024	43,724.80	0.00
3	002808	苏州恒久	1,128	42,841.44	0.00
4	000401	冀东水泥	32	447.36	0.00

注：上述股票明细为本基金本报告期末持有的全部股票

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	502,201,000.00	11.21
	其中：政策性金融债	502,201,000.00	11.21
4	企业债券	2,979,147,536.60	66.49
5	企业短期融资券	80,168,000.00	1.79
6	中期票据	1,383,451,000.00	30.88
7	可转债（可交换债）	53,622,847.60	1.20
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,998,590,384.20	111.56

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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	160208	16 国开 08	3,000,000	293,580,000.00	6.55
2	136469	16 联通 01	2,000,000	195,980,000.00	4.37
3	136830	16 中信 G1	2,000,000	195,600,000.00	4.37
4	136510	16 华电 01	2,000,000	194,980,000.00	4.35
5	136544	16 联通 03	2,000,000	194,740,000.00	4.35

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

为有效控制债券投资的系统性风险，本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的，适度运用国债期货，提高投资组合的运作效率。在国债期货投资时，本基金将首先分析国债期货各合约价格与最便宜可交割券的关系，选择定价合理的国债期货合约，其次，考虑国债期货各合约的流动性情况，最终确定与现货组合的合适匹配，以达到风险管理的目标。

(2) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：无。

(3) 本期国债期货投资评价

无。

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 61,149.57

2 应收证券清算款	1,456,624.18
3 应收股利	-
4 应收利息	79,381,502.07
5 应收申购款	99.88
6 其他应收款	-
7 待摊费用	-
8 其他	-
9 合计	80,899,375.70

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	127003	海印转债	944,919.00	0.02
2	128013	洪涛转债	181,615.00	0.00

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

(6) 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

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6月1日

(基金合同生效日)至2016年12月31日 -1.20% 0.09% 1.61% 0.01% -2.81% 0.08%

2017年1月1日

至2017年3月31日 -0.20% 0.08% 0.68% 0.01% -0.88% 0.07%

自基金合同生效日起至2017年3月31日 -1.40% 0.09% 2.29% 0.01% -3.69% 0.08%

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》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券、期货交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、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。

二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.2%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.2\% \times \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

过渡期内不计提管理费。

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 0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.2\% \times \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

过渡期内不计提托管费。

3、若保本周期到期后，本基金不符合保本基金存续条件，基金份额持有人将所持有本基金份额转为转型后的鹏华金城灵活配置混合型证券投资基金的基金份额，管理费按前一日基金资产净值的 1.5%的年费率计提，托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率计提，计算方法同上。

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

本基金对通过直销柜台申购的养老金客户与除此之外的其他投资人实施差别的申购费率。

养老金客户指基本养老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障基金、企业年金单一计划以及集合计划。如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，基金管理人可在招募说明书更新时或发布临时公告将其纳入养老金客户范围，并按规定向中国证监会备案。非养老金客户指除养老金客户外的其他投资人。

通过基金管理人的直销柜台申购本基金基金份额的养老金客户适用下表特定申购费率，其他投资人申购本基金基金份额的适用下表一般申购费率：

申购金额 M（元） 一般申购费率 特定申购费率

M < 100 万 1.2% 0.48%

100 万 ≤ M < 500 万 0.8% 0.24%

M ≥ 500 万 每笔 1000 元 每笔 1000 元

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取。投资人在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。

申购费用由投资人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。

若保本周期到期后，本基金不符合保本基金存续条件，转为转型后的鹏华金城灵活配置混合型证券投资基金，申购费率以届时公告为准。

2、赎回费

1) 除保本周期提前到期的情况外，本基金的赎回费率如下表所示：

持有年限（Y） 赎回费率

Y < 1 年 2.00%

1 年 ≤ Y < 2 年 1.50%

2 年 ≤ Y < 3 年 1.00%

Y ≥ 3 年 0%

2) 提前到期

对于符合保本条件的基金份额赎回费如下表所示，其他基金份额仍按 1) 中约定的赎回费率收取赎回费。

持有年限（Y） 赎回费率

Y < 7 日 1.50%

7 日 ≤ Y < 30 日 0.75%

30 日 ≤ Y < 6 个月 0.5%

Y ≥ 6 个月 0%

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。对于持有期少于 30 日的基金份额所收取的赎回费，赎回费用全额归入基金财产；对于持有期长于 30 日（含 30 日）但少于 3 个月的基金份额所收取的赎回费，赎回费用 75% 归入基金财产；对于持有期长于 3 个月（含 3 个月）的基金份额所收取的赎回费，赎回费用 50% 归入基金财产，其余用于支付登记费和其他必要的手续费。

若保本周期到期后，符合保本基金存续条件，本基金转入下一保本周期，基金份额持有期仍按投资者取得该基金份额的确认日开始计算。

若保本周期到期后，本基金不符合保本基金存续条件，转为转型后的鹏华金城灵活配置混合型证券投资基金，赎回费率以届时公告为准。

保本周期到期日的赎回安排按本基金保本周期到期的相关规定执行。

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的各项纳税主体，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和有关财务数据的截止日期。
- 2、对第三部分基金管理人部分内容进行了更新。
- 3、对第四部分基金托管人部分内容进行了更新。
- 4、对第五部分相关服务机构内容进行了更新。
- 5、对第十部分基金的投资部分内容进行了更新。
- 6、对第十一部分基金的业绩部分内容进行了更新。
- 7、对第二十三部分对基金份额持有人的服务部分内容进行了更新。
- 8、对第二十四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7月