

鹏华中证500交易型开放式指数  
证券投资基金更新的招募说明书摘要  
(2020年第2号)

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

2020年4月1日

## 重要提示

本基金经 2019 年 8 月 12 日中国证券监督管理委员会下发的《关于准予鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》注册，进行募集。

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市场前景作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金投资于证券市场，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。本基金特有风险包括：标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、标的指数波动的风险、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、标的指数变更的风险、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险、退市风险、投资者申购失败的风险、投资者赎回失败的风险、基金份额赎回对价的变现风险等。本基金属于股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。同时本基金为交易型开放式指数基金，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。

本基金投资资产支持证券，或将面临信用风险、利率风险、提前偿付风险、操作风险等；同时，本基金也投资股指期货，因为股指期货采用保证金交易制度，具有杠杆性，当市场出现不利行情时，微小的变动可能会使投资人权益遭受较大损失。

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。

本基金为交易型开放式指数证券投资基金（ETF），将在深圳证券交易所上市。本基金按照深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定进行申购、赎回，具体业务的办理时间请参见相关公告。本基金通过深圳证券交易所办理场内申购赎回的，投资者的申购、赎回申请在 T 日确认，申购所得 ETF 份额 T 日可卖出，T+1 日可赎回；赎回所得的组合证券 T 日可卖出。通过登记机构办理场外实物申购赎回的，投资者的申购、赎回申请在 T+1 日确认，申购所得 ETF 份额及赎回所得组合证券在 T+2 日可用。如投资者需要通过申购赎回代理券商参与本基金的场内申购赎回（通过深圳证券交易所办理），则应开立深圳证券交易所 A 股账户。如投资者需要通过申购赎回代理券商参与本基金的场外实物申购、赎回（通过中国证券登记结算有限责任公司办理），则应同时持有并使用深圳 A 股账户与上海 A 股账户，且该两个账户的证件号码及名称属于同一投资者所有，同时用以申购、赎回的深圳证券交易所股票的托管证券公司和上海 A 股账户的指定交易证券公司应为同一

申购赎回代理券商。

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、基金合同和基金产品资料概要。

基金合同约定的基金产品资料概要编制、披露与更新要求，自《信息披露办法》实施之日起一年后开始执行。

本次招募说明书更新仅涉及《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》第十二条中与招募说明书内容有关的一项或多项重大变更，具体事项请参考基金管理人最近三个交易日内披露的关于上述重大变更的相关公告。

## 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党委书记、董事、总裁。

周中国先生，董事，会计学硕士，高级会计师，注册会计师，国籍：中国。历任深圳华为技术有限公司定价中心经理助理、国信证券股份有限公司资金财务总部业务经理、深圳金地证券服务部财务经理、资金财务总部高级经理、总经理助理、副总经理、人力资源总部副总经理等职务。现任国信证券股份有限公司财务负责人、资金财务总部总经理兼人力资源总部总经理。

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。

杜海江先生，董事，大学本科，国籍：中国。历任国信证券股份有限公司杭州萧然东路证券营业部电子商务部经理、杭州保俶路证券营业部总经理助理、浙江营销中心总经理、浙江管理总部总经理、杭州分公司总经理、浙江分公司总经理、公司总裁助理等职务。现任国信证券股份有限公司副总裁、经纪事业部总裁。

## 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。

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，现任鹏华基金管理有限公司总裁助理、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党委副书记、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。

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纪委书记，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、固定收益总部总经理。

#### 4、本基金拟任基金经理

陈龙先生，国籍中国，经济学硕士，10 年证券从业经验。曾任杭州衡泰软件公司金融工程师，2009 年 12 月加盟鹏华基金管理有限公司，历任监察稽核部金融工程总监助理、量化及衍生品投资部量化研究总监助理，先后从事金融工程、量化研究等工作，现任量化及衍生品投资部量化研究副总监、基金经理。2015 年 09 月至 2018 年 05 月担任鹏华钢铁分级基金基金经理，2016 年 07 月至 2018 年 04 月担任鹏华创业板分级基金基金经理，2016 年 09 月至 2018 年 04 月担任鹏华地产分级基金基金经理，2016 年 09 月至 2018 年 05 月担任鹏华香港中小企业指数（LOF）基金基金经理，2016 年 10 月至 2018 年 04 月担任鹏华互联网分级基金基金经理，2019 年 03 月担任鹏华国防分级基金基金经理，2019 年 03 月担任鹏华空天一体军工指数（LOF）基金基金经理，2019 年 03 月担任鹏华证券分级基金基金经理，2019 年 03 月担任鹏华证券保险分级基金基金经理。陈龙先生具备基金从业资格。

#### 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党委书记、董事、总裁。

高阳先生，鹏华基金管理有限公司党委副书记、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，鹏华新兴产业混合基金、鹏华研究精选混合基金、鹏华创新驱动混合基金、鹏华研究驱动混合基金、鹏华研究智选混合基金基金经理。

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、基金托管人基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司（以下简称“中国工商银行”）

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：陈四清

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 2019 年 6 月，中国工商银行资产托管部共有员工 213 人，平均年龄 33 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、基本养老保险、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 2019 年 6 月，中国工商银行共托管证券投资基金 977 只。自 2003 年以来，本行连续十六年获得香港《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 68 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。

#### 四、基金托管人的内部控制制度

中国工商银行资产托管部自成立以来，各项业务飞速发展，始终保持在资产托管行业的优势地位。这些成绩的取得，是与资产托管部“一手抓业务拓展，一手抓内控建设”的做法是分不开的。资产托管部非常重视改进和加强内部风险管理工作，在积极拓展各项托管业务的同时，把加强风险防范和控制的力度，精心培育内控文化，完善风险控制机制，强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来做。继 2005、2007、2009、2010、2011、2012、2013、2014 年八次顺利通过评估组织内部控制和安全措施是否充分的最权威的 SAS70(审计标准第 70 号) 审阅后，2015 年、2016 年中国工商银行资产托管部均通过 ISAE3402(原 SAS70) 审阅，迄今已第十次获得无保留意见的控制及有效性报告，表明独立第三方对中国工商银行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可。也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨，达到国际先进水平。目前，ISAE3402 审阅已经成为年度化、常规化的内控工作手段。

##### 1、内部风险控制目标

保证业务运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，强化和建立守法经营、规范运作的经营思想和经营风格，形成一个运作规范化、管理科学化、监控制度化的内控体系；防范和化解经营风险，保证托管资产的安全完整；维护持有人的权益；保障资产托管业务安全、有效、稳健运行。

##### 2、内部风险控制组织结构

中国工商银行资产托管业务内部风险控制组织结构由中国工商银行稽核监察部门(内控合规部、内部审计局)、资产托管部内设风险控制处及资产托管部各业务处室共同组成。总行稽核监察部门负责制定全行风险管理政策，对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内部设置专门负责稽核监察工作的内部风险控制处，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，对业务的运行独立行使稽核监察职权。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

##### 3、内部风险控制原则

(1) 合法性原则。内控制度应当符合国家法律法规及监管机构的监管要求，并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。

(2) 完整性原则。托管业务的各项经营管理活动都必须有相应的规范程序和监督制约；监督制约应渗透到托管业务的全过程和各个操作环节，覆盖所有的部门、岗位和人员。

(3) 及时性原则。托管业务经营活动必须在发生时能准确及时地记录；按照“内控优先”的原则，新设机构或新增业务品种时，必须做到已建立相关的规章制度。

(4) 审慎性原则。各项业务经营活动必须防范风险，审慎经营，保证基金资产和其他委托资产的安全与完整。

(5) 有效性原则。内控制度应根据国家政策、法律及经营管理的需要适时修改完善，



并保证得到全面落实执行，不得有任何空间、时限及人员的例外。

(6) 独立性原则。设立专门履行托管人职责的管理部门；直接操作人员和控制人员必须相对独立，适当分离；内控制度的检查、评价部门必须独立于内控制度的制定和执行部门。

#### 4、内部风险控制措施实施

(1) 严格的隔离制度。资产托管业务与传统业务实行严格分离，建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度，并采取了良好的防火墙隔离制度，能够确保资产独立、环境独立、人员独立、业务制度和管理独立、网络独立。

(2) 高层检查。主管行领导与部门高级管理层作为中国工商银行托管业务政策和策略的制定者和管理者，要求下级部门及时报告经营管理情况和特别情况，以检查资产托管部在实现内部控制目标方面的进展，并根据检查情况提出内部控制措施，督促职能管理部门改进。

(3) 人事控制。资产托管部严格落实岗位责任制，建立“自控防线”、“互控防线”、“监控防线”三道控制防线，健全绩效考核和激励机制，树立“以人为本”的内控文化，增强员工的责任心和荣誉感，培育团队精神和核心竞争力。并通过进行定期、定向的业务与职业道德培训、签订承诺书，使员工树立风险防范与控制理念。

(4) 经营控制。资产托管部通过制定计划、编制预算等方法开展各种业务营销活动、处理各项事务，从而有效地控制和配置组织资源，达到资源利用和效益最大化目的。

(5) 内部风险管理。资产托管部通过稽核监察、风险评估等方式加强内部风险管理，定期或不定期地对业务运作状况进行检查、监控，指导业务部门进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施，排查风险隐患。

(6) 数据安全控制。资产托管部通过业务操作区相对独立、数据和传真加密、数据传输线路的冗余备份、监控设施的运用和保障等措施来保障数据安全。

(7) 应急准备与响应。资产托管业务建立专门的灾难恢复中心，制定了基于数据、应用、操作、环境四个层面的完备的灾难恢复方案，并组织员工定期演练。为使演练更加接近实战，资产托管部不断提高演练标准，从最初的按照预订时间演练发展到现在的“随机演练”。从演练结果看，资产托管部完全有能力在发生灾难的情况下两个小时内恢复业务。

#### 五、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《基金法》、基金合同、基金托管人与基金管理人签署的托管协议和有关基金法规的规定，基金托管人对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金费用的支付、基金申购资金的到账和赎回资金的划付、基金收益分配、基金的融资条件等行为的合法性、合规性进行监督和核查，其中对基金的投资监督和检查自基金合同生效之日开始。基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、《基金合同》、托管协议或有关基金法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对，并以书面形式对基金托管人发出回

函确认。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。基金托管人有义务要求基金管理人赔偿因其过失致使投资者遭受的损失。基金托管人发现基金管理人有重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

### 第三部分 相关服务机构

#### 一、基金份额发售机构

##### 1、网下现金发售直销机构

###### (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：张圆圆

###### (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 3305 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、网上现金发售代理机构、网下现金发售代理机构和网下股票发售代理机构

详见基金份额发售公告。

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，并在基金管理人网站公示。

## 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

负责人：周明

联系人：丁志勇

电话：0755-25941405

传真：0755-25987133

## 三、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：俞卫锋

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：021-31358666

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：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 507 单元 01 室

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：魏佳亮

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：鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

## 第五部分 基金的运作方式与类型

交易型开放式，股票型基金

## 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的最小化。

## 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（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准的股票）、债券（含国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券等）、货币市场工具、同业存单、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

本基金可依据法律法规的规定，参与融资及转融通证券出借业务。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：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。

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 0.2% 以内，年跟踪误差控制在 2% 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、股指期货投资策略

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,对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约,提高投资效率,从而更好地跟踪标的指数,实现投资目标。同时,本基金将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仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差,从而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。

#### 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、参与融资及转融通证券出借业务策略

本基金可在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素基础上，参与融资业务。

为更好地实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎经营原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与转融通证券出借业务。本基金将在分析市场环境、投资者类型与结构、基金历史申赎情况、出借证券流动性情况等因素的基础上，合理确定出借证券的范围、期限和比例。

本基金将密切跟踪国内关于基金参与融券业务法律法规的实施进展，待允许本基金参与融券业务的相关规定颁布后，将在届时相应法律法规的框架内，参与融券业务。

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

本基金业绩比较基准为中证 500 指数收益率。

如本基金调整标的指数的，本基金的业绩比较基准相应调整。如果今后法律法规发生变化，或者有更适当的、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。同时本基金为交易型开放式指数基金，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。

## 第十一部分 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、诉讼费、公证费和认证费；

- 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、基金的上市费及年费；
- 11、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 0.15% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

### 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 0.05% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

### 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 0.03% 的年费率计提。标的指数许可使用费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.03\% \div \text{当年天数}$$



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。若本基金当季日均基金资产净值大于人民币 5000 万元时，许可使用费的收取下限为每季度人民币 3.5 万元，不足 3.5 万元时按照 3.5 万元收取；若本基金当季日均基金资产净值小于或等于人民币 5000 万元时，无许可使用费的收取下限。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、计算方式和支付方式时，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基金托管人。

上述“一、基金费用的种类”中第 4—11 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、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。

### 四、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。

## 第十二部分 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》、《公开募集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”部分明确了本次招募说明书更新的内容。
- 2、对涉及本基金指数许可使用费方案的相关内容进行了更新。

鹏华基金管理有限公司

2020年4月