

鹏华碳中和主题混合型证券投资基金（A类基金份额）基金产品资料概要（更新）

编制日期：2024年06月26日

送出日期：2024年06月28日

本概要提供本基金的重要信息，是招募说明书的一部分。作出投资决定前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。

一、产品概况

| | | | |
|---------|--|----------------|-------------|
| 基金简称 | 鹏华碳中和主题混合 A | 基金代码 | 016530 |
| 基金管理人 | 鹏华基金管理有限公司 | 基金托管人 | 招商银行股份有限公司 |
| 基金合同生效日 | 2023年05月05日 | 上市交易所及上市日期（若有） | - |
| 基金类型 | 混合型 | 交易币种 | 人民币 |
| 运作方式 | 普通开放式 | 开放频率 | 每个开放日 |
| 基金经理 | 闫思倩 | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2023年05月05日 |
| | | 证券从业日期 | 2010年03月01日 |
| 其他（若有） | 《基金合同》生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 50 个工作日出现前述情形的，基金合同终止，不需召开基金份额持有人大会审议。 | | |

注：无。

二、基金投资与净值表现

（一）投资目标与投资策略

本部分请阅读《鹏华碳中和主题混合型证券投资基金招募说明书》“基金的投资”了解详细情况。

| | |
|------|--|
| 投资目标 | 本基金主要投资碳中和主题的上市公司股票，采用积极主动的投资策略，在有效控制投资组合风险的前提下，力争获取超越业绩比较基准的投资回报，实现基金资产的长期稳健增值。 |
| 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，包括境内依法发行或上市交易的股票（包含主板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、港股通标的股票、存托凭证、债券（含国债、金融债、 |

| | |
|--------|---|
| | <p>企业债、公司债、央行票据、政府支持机构债、地方政府债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券及其他中国证监会允许基金投资的债券）、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款等）、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）。</p> <p>本基金可根据相关法律法规和基金合同的约定，参与融资业务。</p> <p>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。</p> <p>基金的投资组合比例为：股票资产及存托凭证占基金资产的比例为60%-95%（其中，港股通标的股票占股票资产的比例不超过50%），投资于本基金界定的碳中和主题相关股票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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</p> <p>如果法律法规对该比例要求有变更的，本基金在履行适当程序后以变更后的比例为准，本基金的投资比例会做相应调整。</p> |
| 主要投资策略 | <p>1、资产配置策略；2、股票投资策略；3、存托凭证投资策略；4、债券投资策略；5、股指期货投资策略；6、资产支持证券的投资策略；7、参与融资业务策略。</p> <p>本基金定义的碳中和是指因人类活动产生的二氧化碳及其他温室气体，在一定时间内，被节能减排、植树造林等形式等量抵消，达到相对“净零排放”。2020年，我国在第七十五届联合国大会上提出了“二氧化碳排放力争于2030年前达到峰值，争取2060年前实现碳中和”的目标。碳中和作为国家重大决策部署，将实现中国在能源领域的革命，对于能源企业推进新能源替代、加快结构调整优化以及推进高质量发展等方面具有重要的指导意义，将进一步推动中国未来能源结构的整体转型和变革，不断助力中国现代化目标实现和经济结构转型。本基金的碳中和主题，指的是为实现碳中和目标而带来的产业投资机会，投资标的范围从能源替代出发，到节能减排，最后到循环利用和生态碳汇多管齐下。与之对应的五大领域包括电力、交通、工业、农业、建筑将同步展开，实现从高碳到低碳到零碳的转型。具体包括：</p> |

| | |
|--------|--|
| | <p>1) 电力领域：包括光伏、风电、生物质、水电、氢能、核能、智能电网、储能系统、特高压等；传统火电的清洁改造以及受益于能源体制市场化改革的公司。</p> <p>2) 交通领域：围绕公路、水路、铁路、航空四大类运输方式，公路方面，主要对应新能源汽车产业链，包括新能源车及其核心零部件（动力电池及材料、上游核心矿产资源、汽车智能化应用、智能网联、汽车电子等）；水路、铁路、航空方面，除了清洁能源（生物燃料、氢能、氢燃料电池等），还包括通过提升能效从而减少碳排放的先进装备和技术（节油发动机等）。</p> <p>3) 工业领域：对应节能减排产业链。通过技术升级与工艺改造在工业生产环节中减少碳排放量，包括钢铁（氢能炼钢、特种钢铁、电炉炼钢等），水泥（高效粉磨、余热发电、碳捕捉技术等），化工（新材料、新技术等），机械设备（光伏设备、锂电设备、水电及风电设备、天然气设备等）。</p> <p>4) 建筑领域：对应绿色建筑产业链，包括环保建材、光伏建筑一体化、LED 照明、腔壁绝缘、恒温器等。</p> <p>5) 农业领域：包括生态碳汇（通过植树造林、森林管理、植被恢复等促进碳吸收）、精准农业、秸秆综合利用等。</p> |
| 业绩比较基准 | 中证内地低碳经济主题指数收益率×70%+恒生指数收益率（经汇率估值调整）×10%+中债综合财富（总值）指数收益率×20% |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型证券投资基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金若投资港股通标的的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。 |

(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

- 权益投资：80.92%
- 银行存款和结算备付金合计：12.05%
- 其他资产：7.03%



上述披露数据截止时间为2023年09月30日。

(三) 自基金合同生效以来/最近十年(孰短)基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

三、投资本基金涉及的费用

(一) 基金销售相关费用

以下费用在申购/赎回基金过程中收取,其中,对通过直销中心申购的养老金客户适用特定费率(详情请查阅招募说明书),其他投资人适用下表一般费率:

| 费用类型 | 金额(M)/持有期限(N) | 收费方式/费率 | 备注 |
|------|---------------|---------|----|
| 申购费 | M<100万 | 1.50% | - |
| | 100万≤M<500万 | 1.00% | - |
| | 500万≤M | 每笔1000元 | - |
| 赎回费 | N<7日 | 1.50% | - |
| | 7日≤N<30日 | 0.75% | - |
| | 30日≤N<6个月 | 0.50% | - |
| | 6个月≤N | 0 | - |

注: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。

(二) 基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除:

| 费用类别 | 收费方式/年费率或金额 | 收取方 |
|-------------|-----------------------------------|------------|
| 管理费 | 1.2% | 基金管理人和销售机构 |
| 托管费 | 0.2% | 基金托管人 |
| 销售服务费 | - | 销售机构 |
| 审计费用 | 30000元 | 会计师事务所 |
| 信息披露费 | 120000.00元 | 规定披露报刊 |
| 指数许可使用费(若有) | - | 指数编制公司 |
| 其他费用 | 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 | 相关服务机构 |

注:1、本基金交易证券等产生的费用和税负,按实际发生额从基金资产扣除。

2、审计费用、信息披露费和指数许可使用费(若有)为基金整体承担费用,非单个份额类别费用,且年金额为预估值,最终实际金额以基金定期报告披露为准。

(三) 基金运作综合费用测算

若投资者申购本基金份额,在持有期间,投资者需支出的运作费率如下表:

| 基金运作综合费率(年化) |
|--------------|
| 1.59% |

注：基金运作综合费率测算中的基金管理费率、托管费率、销售服务费率（若有）为基金现行合同费率，不含费率优惠，其他运作费用以最近一次基金年报披露的相关数据为基准测算。

四、风险揭示与重要提示

（一）风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。

投资有风险，投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。

1、本基金特定风险

（1）《基金合同》生效后，连续 50 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金合同终止，不需召开基金份额持有人大会审议。因此，在本基金的运作期间，基金份额持有人面临基金合同自动终止的风险。

（2）港股通机制下，港股通标的股票的投资风险

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括港股通机制下允许投资的香港联合交易所（以下简称：“香港联交所”或“联交所”）上市的港股通标的股票，基金资产若投资于港股，除与其他投资于内地市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还面临港股通机制下因投资环境、投资者结构、投资标的构成、市场制度以及交易规则等差异所带来的特有风险，包括但不限于：市场联动的风险、股价波动的风险、汇率风险、港股通额度限制、港股通可投资标的的范围调整带来的风险、港股通交易日设定的风险、交收制度带来的基金流动性风险、港股通下对公司行为的处理规则带来的风险、香港联合交易所停牌、退市等制度性差异带来的风险、港股通规则变动带来的风险、基金资产投资港股通标的股票比例的风险、其他可能的风险。

（3）本基金投资股指期货等金融衍生品。金融衍生品是一种金融合约，其价值取决于一种或多种基础资产或指数，其评价主要源自于对挂钩资产的价格与价格波动的预期。投资于衍生品需承受市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险和法律风险等。由于衍生品通常具有杠杆效应，价格波动比标的工具更为剧烈，有时候比投资标的资产要承担更高的风险。并且由于衍生品定价相当复杂，不适当的估值有可能使基金资产面临损失风险。股指期货采用保证金交易制度，由于保证金交易具有杠杆性，当出现不利行情时，合约标的价格微小的变动就可能使投资人权益遭受较大损失。股指期货采用每日无负债结算制度，如果没有在规定的时间内补足保证金，按规定将被强制平仓，可能给投资带来损失。另外，股指期货在对冲市场风险的使用过程中，基金资产可能因为股指期货合约与合约标的的价格波动不一致而面临基差风险。

（4）本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与中国存托凭证发行机制相关的风险，包括存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律

地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险；存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；因多地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；存托凭证退市的风险；已在境外上市的基础证券发行人，在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险；境内外法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。

(5) 本基金可投资于资产支持证券。资产支持证券的投资风险主要包括流动性风险、利率风险及评级风险等。由于资产支持证券的投资收益来自于基础资产产生的现金流或剩余权益，因此资产支持证券投资还面临基础资产特定原始权益人的破产风险及现金流预测风险等与基础资产相关的风险。

(6) 本基金可参与融资交易，可能面临杠杆风险、强制平仓风险、违约风险、交易被限制的风险等，由此可能给基金净值带来不利影响或损失。

2、普通混合型证券投资基金共有的风险，如系统性风险、非系统性风险、管理风险、流动性风险及其他风险等。

3、本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险。

(二) 重要提示

中国证监会对本基金的注册或核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

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。

基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人。

基金产品资料概要信息发生重大变更的，基金管理人将在三个工作日内更新，其他信息发生变更的，基金管理人每年更新一次。因此，本文件内容相比基金的实际情况可能存在一定的滞后，如需及时、准确获取基金的相关信息，敬请同时关注基金管理人发布的相关临时公告等。

因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，任何一方均有权将争议提交深圳国际仲裁院，按照深圳国际仲裁院届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为深圳市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力。除非仲裁裁决另有规定，仲裁费用由败诉方承担。

五、其他资料查询方式

以下资料详见鹏华基金官方网站[www.phfund.com.cn][客服电话：400-6788-533]

- (1) 基金合同、托管协议、招募说明书
- (2) 定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告
- (3) 基金份额净值

(4) 基金销售机构及联系方式

(5) 其他重要资料

六、其他情况说明

无。