

# 鹏华中证 800 地产指数分级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：中国建设银行股份有限公司

二零一七年四月

### 重要提示

本基金经 2014 年 1 月 26 日中国证券监督管理委员会下发的《关于核准鹏华中证 800

地产指数分级证券投资基金募集的批复》（证监许可[2014]150 号文）注册，进行募集。

根据相关法律法规，本基金基金合同已于 2014 年 9 月 12 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、管理风险、操作

风险、流动性风险、信用风险、本基金特有风险（包括作为指数基金的风险、作为上市基

金的风险和作为分级基金的风险）及其他风险，等等。

本基金单笔场内认购/申购金额不得低于五万元。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。

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。

本招募说明书与基金托管人相关信息更新部分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 3 月 11 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）820212332 2 2 2 2 2 2 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= AIPG2

SGR 投资

总监、CAAM2 AI2 SGR 及 CA2 AIPG2 SGR 首席执行官和投资总监、东方汇理资产

管理有限公司 (CAAM2 SGR) 投资副总监、农业信贷另类投资集团 (Credit2

Agricole2

Alternative2 Investments2 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 (Eurizon2 Capital2 SGR2 S.p.A.) 投资方案部投资总监、Epsilon2

资产管理股

份公司 (Epsilon2 SGR) 首席执行官，欧利盛资本股份公司 (Eurizon2

Capital2 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

(Eurizon2

Capital2 SGR2 S.p.A.) 市场及业务发展总监。  
Andrea2 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 (Credit2 Agricole2 Group) 东方

汇理资产

管理股份有限公司 (CAAM2 SGR) 法务部、产品开发部，欧利盛资本资产管理股

份公

司 (Eurizon2 Capital2 SGR2 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 (Eurizon2 Capital2 SGR2 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 (Eurizon2 Capital2 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。

SANDRO2 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（Eurizon2 Capital2 SGR2 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（Eurizon2 Capital2 SGR2 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

陈龙先生，国籍中国，经济学硕士，8 年证券从业经验。曾任杭州衡泰软件公司

理，2016年9月起兼任鹏华地产分级、鹏华香港中小企业指数（LOF）基金经理，  
2016年

10月起兼任鹏华互联网分级基金基金经理。陈龙先生具备基金从业资格。

本基金历任基金经理：

2014年9月至2016年9月王咏辉先生

2016年9月至本招募说明书更新日陈龙先生

本基金基金经理管理其它基金情况：

2015年9月起担任鹏华钢铁分级基金基金经理；

2016年7月起兼任鹏华创业板分级基金基金经理；

2016年9月起兼任鹏华香港中小企业指数（LOF）基金经理；

2016年10月起兼任鹏华互联网分级基金基金经理。

#### 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。

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总裁办公室顾问。

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。

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。

## 二、基金托管人

### （一）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)67592 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。

## （二）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。

### （三）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”。

## 三、相关服务机构

### （一）基金份额销售机构

## 1、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

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 502 室

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：上海市浦东花园石桥路 33 号花旗大厦 801B

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) 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

2) 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：张东宁

联系人：孔超

传真：010-66226045

客户服务电话：95526

网站：www.bankofbeijing.com.cn

3) 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

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) 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：王硕

传真：010-68858117

公司网址：www.psbc.com

6) 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](http://www.drcbank.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](http://www.cmbchina.com)

8) 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](http://www.icbc.com.cn)

9) 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](http://www.spdb.com.cn)

10) 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

11) 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

### （3）券商销售机构

1) 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

2) 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

3) 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

4) 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.foundersec.com

5) 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

6) 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

7) 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

8) 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

9) 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

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) 华西证券股份有限公司

注册地址：四川省成都市陕西街 239 号

办公地址：深圳市深南大道 4001 号时代金融中心 18 楼

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

12) 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

联系电话：021-22169081

传真：021-68817271

联系人：刘晨

客户服务电话：95525

网址：www.ebscn.com

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) 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](http://www.chinastock.com.cn)

15) 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)

16) 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: 朱雅崑

联系电话: 021-38676666

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

17) 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)

18) 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

19) 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

20) 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

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：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

23) 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

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) 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

26) 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

27) 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

28) 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/>

29) 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

30) 国联证券股份有限公司

注册地址：江苏省无锡市县前东街 168 号国联大厦 6 层

办公地址：江苏省无锡市太湖新城金融一街八号国联金融大厦 702

法定代表人：雷建辉

电话：0510-82832919

传真：0510-82833124

联系人：沈刚

联系电话：0510-82831662

网址：www.glsc.com.cn

31) 平安证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

办公地址：深圳市福田区金田路 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

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.msyzq.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

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](http://www.citicsf.com)

（5）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](http://www.chtfund.com)

2) 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>

网址：[www.zcvc.com.cn](http://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：周瑾旻

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：licaikexun.com

6) 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

7) 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

8) 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

9) 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

10) 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

11) 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

12) 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

13) 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

14) 2 万银财富(北京)基金销售有限公司

住所: 北京朝阳区北四环中路 27 号盘古大观 3201

办公地址: 北京朝阳区北四环中路 27 号盘古大观 3201

法定代表人: 李招弟

联系人: 毛怀营

联系电话: 010-59393923

客服电话: 400-808-0069

网址: www.wy-fund.com

15) 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

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:2 95118

网址：fund.jd.com

联系人：徐伯宇

电话： 4000988511/2 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销售  
本

基金或变更上述销售机构，并及时公告。

## 2、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深圳证券交易所会员单位

(具体名单可在深交所网站查询)。

(2) 本基金募集结束前获得基金销售资格的深交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

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：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：韩炯

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：黎明

经办律师：黎明、孙睿

### （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

基金名称：鹏华中证 800 地产指数分级证券投资基金

## 五、基金的运作方式与类型

本基金为契约型开放式，股票型证券投资基金，存续期为不定期。

## 六、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

0.35%以内，年跟踪误差控制在 4%以内。

## 七、基金的投资方向

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及其备选成

成份股（含中小板、创业板股票及其他中国证监会核准上市的股票）、债券、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：投资于标的指数成份股及其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%；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，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例  
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。

#### 八、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。

本基金力争鹏华地产份额净值增长率与同期业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度  
不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。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、申购赎回变动情况等变化，对其进

行适时调整，以保证鹏华地产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。

## 3、股指期货、权证等投资策略

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。

## 九、基金的业绩比较基准

中证 800 地产指数收益率 $\times 95\%$  + 商业银行活期存款利率（税后） $\times 5\%$

中证 800 地产指数从中证 800 指数样本股中挑选属于地产行业的公司股票组成样本股，可以综合反映沪深两市属于地产行业的公司股票的整体走势，同时为投资者提供

新的投资标的。

## 十、基金的风险收益特征

本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币



市场基金，为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。同时本基金为指数基金，

通过跟踪标的指数表现，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。

从本基金所分拆的两类基金份额来看，鹏华地产 A 份额为稳健收益类份额，具有低

风险且预期收益相对较低的特征；鹏华地产 B 份额为积极收益类份额，具有高风险且预

期收益相对较高的特征。

#### 十一、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。

本基金的托管人中国建设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 215,158,104.49 93.48

其中：股票 215,158,104.49 93.48

2 基金投资--

3 固定收益投资 311,674.62 0.14

其中：债券 311,674.62 0.14

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 14,223,099.90 6.18

8 其他资产 459,911.53 0.20

9 合计 230,152,790.54 100.00

## 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--

B 采矿业--

C 制造业--

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 206,245,994.30 90.08

L 租赁和商务服务业 1,743,710.80 0.76

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 5,845,076.33 2.55

合计 213,834,781.43 93.39

### (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 919,717.72 0.40

D

电力、热力、燃气及水生产和

供应业  
 37,917.66 0.02  
 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  
 233,856.77 0.10  
 J 金融业 106,780.00 0.05  
 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 1,323,323.06 0.58

### 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	000002	万科A	1,347,748	27,696,221.40	12.10
2	600048	保利地产	2,274,067	20,762,231.71	9.07
3	001979	招商蛇口	757,905	12,422,062.95	5.43
4	600649	城投控股	524,753	9,970,307.00	4.35

5	600383	金地集团	719,224	9,321,143.04	4.07
6	600606	绿地控股	777,800	6,774,638.00	2.96
7	600340	华夏幸福	283,298	6,770,822.20	2.96
8	000540	中天城投	1,051,533	6,540,535.26	2.86
9	000656	金科股份	1,196,222	6,268,203.28	2.74
10	600663	陆家嘴	234,338	5,185,899.94	2.26

(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	600996	贵广网络	12,083	227,039.57	0.10
2	603986	兆易创新	1,133	201,640.01	0.09
3	603823	百合花	3,762	123,167.88	0.05
4	601375	中原证券	26,695	106,780.00	0.05
5	002832	比音勒芬	1,158	70,290.60	0.03

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	--

其中：政策性金融债 --

4	企业债券	--
5	企业短期融资券	--
6	中期票据	--

7 可转债 (可交换债) 311,674.62 0.14

8 同业存单 --

9 其他 --

10 合计 311,674.62 0.14

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 127003 海印转债 2,747 311,674.62 0.14

注：上述债券明细为本基金本报告期末持有的全部债券。

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

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  
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序的前五名权证投资明细  
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

本基金本报告期内未发生股指期货投资。

（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

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

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

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 192,484.23
- 2 应收证券清算款 172,069.89
- 3 应收股利-
- 4 应收利息 3,859.26
- 5 应收申购款 91,498.15
- 6 其他应收款-
- 7 待摊费用-
- 8 其他-
- 9 合计 459,911.53

(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 311,674.62 0.14

(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

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 600649 城投控股 9,970,307.00 4.35 重大事项
- 2 000540 中天城投 6,540,535.26 2.86 重大事项

(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 201,640.01 0.09 重大事项

2 601375 中原证券 106,780.00 0.05 新股锁定

(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。

本基金基金合同生效以来的投资业绩与同期基准的比较如下表所示（本报告中所列财务数据未经审计）：

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

2014 年 9 月 12 日（基金合

同生效日）至 2014 年 12

月 31 日

41.30% 1.92% 45.78% 1.89% -4.48% 0.03%

2015 年 1 月 1 日至 2015 年

12 月 31 日

29.99% 2.84% 39.16% 2.65% -9.17% 0.19%

2016 年 1 月 1 日至 2016 年

12 月 31 日

-19.19% 1.91% -16.71% 1.53% -2.48% 0.38%

自基金合同生效日至

2016年12月31日

48.42% 2.36% 68.98% 2.13% -20.56% 0.23%

### 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、律师费和诉讼费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、证券账户开户费用、账户维护费用；
- 10、基金的上市费和年费；
- 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1.00%年费率计提。管理费的计算方法如下：

下：

$$H = E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

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，由托管人根据与管理人核

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，管理人无需再出具资金划拨指令。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0.22%的年费率计提。托管费的计算方法

如下：



$$H=E \times 0.22\% \div \text{当年天数}$$

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，由托管人根据与管理人核

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，管理

人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

### 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 日在至少

一家指

定媒体公告。

上述“一、基金费用的种类中第 4—10 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、基金份额的场外申购与赎回

###### （1）申购费用

本基金的场外申购费率最高不超过申购金额的 1.2%，且随投资者申购金额的增加

而减少。投资者可以多次申购本基金，申购费率按每笔申购申请单独计算。

本基金场外申购费率如下表：

申购金额 M（元） 申购费率

$M < 100$  万 1.2%

$100$  万  $\leq M < 500$  万 0.6%

$M \geq 500$  万每笔 100 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）赎回费用

本基金的场外赎回费率最高不超过赎回金额的 0.50%，且随投资者持有基金份额

期限的增加而减少。

本基金场外赎回费率如下表（1 年为 365 日）：

持有年限 Y 赎回费率

$Y < 1$  年 0.50%

$1$  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、基金份额的场内申购与赎回

#### （1）申购费用

本基金的场内申购费率由深圳证券交易所会员单位按照场外认购费率设定。投资者可以多次申购本基金，申购费率按每笔申购申请单独计算。

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）赎回费用

本基金的场内赎回费率为固定费率 0.50%，不按持有期限设置分段赎回费率。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。

#### 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、有关财务数据和净值表现的截止日期。
- 2、对“三、基金管理人”部分内容进行了更新。
- 3、对“五、相关服务机构”内容进行了更新。
- 4、更新了“十三、基金的投资”投资组合报告内容，披露截止至 2016 年 12 月

31 日

的数据。

5、对“十四、基金的业绩”部分内容进行了更新

6、对“二十七、其他应披露事项”内容进行了更新。

鹏华基金管理有限公司

2017 年 4 月