

# 鹏华核心优势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：中国建设银行股份有限公司

2020年04月

## 重要提示

本基金经 2018 年 8 月 3 日中国证券监督管理委员会下发的《关于准予鹏华核心优势混合型证券投资基金注册的批复》注册，进行募集。本基金的基金合同于 2019 年 4 月 3 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。

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。

基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股，基金资产并非必然投资港股。

基金资产若投资于港股，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，包括港股市场股价波动较大的风险（港股市场实行 T+0 回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对基金的投资收益造成损失）、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险（在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险）等，详见本招募说明书第十六部分。

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。

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、基金合同和基金产品资料概要。

招募说明书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。

本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为 2020 年 03 月 15 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2019 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、设立日期：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、党委副书记等职务。现任国信证券股份有限公司董事长、党委书记。自 2008 年 12 月开始担任鹏华基金管理有限公司董事长。

邓召明先生, 党委书记、董事、总裁, 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裁、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董事、总裁、党委书记。自 2012 年 12 月开始担任鹏华基金管理有限公司董事。

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。自 2019 年 8 月开始担任鹏华基金管理有限公司董事。

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、资金财务总部总经理助理、资金财务总部副总经理、人力资源总部副总经理、人力资源总部总经理等职务。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。自 2012 年 12 月开始担任鹏华基金管理有限公司董事。

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) 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。自 2010 年 11 月开始担任鹏华基金管理有限公司董事。

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和战略发展部总经理。自 2016 年 2 月开始担任鹏华基金管理有限公司董事。

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。自 2008 年 9 月开始担任鹏华基金管理有限公司董事。

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。自 2012 年 12 月开始担任鹏华基金管理有限公司董事。

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。自 2012 年 12 月开始担任鹏华基金管理有限公司董事。

## 2、基金管理人监事会成员

黄俞先生, 监事会主席, 管理学硕士, 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, 深圳市北融信投资发展有限公司董事长。自 2013 年 11 月开始担任鹏华基金管理有限公司监事会主席。

陈冰女士, 监事, 管理学学士, 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、资金财务总部副总经理、融资融券部总经理等职务。现任国信证券总裁助理, 兼证券金融事业部总裁、资金运营部总经理。自 2015 年 6 月开始担任鹏华基金管理有限公司监事。

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。自 2016 年 2 月开始担任鹏华基金管理有限公司监事。

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。自 2015 年 9 月开始担任鹏华基金管理有限公司监事。

刘嵌先生, 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, 现任总裁助理、首席市场官兼市场发展部、北京分公司总经理。自 2015 年 9 月开始担任鹏华基金管理有限公司监事。

左彬先生, 职工监事, 法学硕士, 国籍: 中国。历任中国平安保险 (集团) 股份有限公司法律事务部律师; 2016 年 4 月加盟鹏华基金管理有限公司, 历任监察稽核部高级合规经理, 现任监察稽核部高级合规官。自 2019 年 9 月开始担任鹏华基金管理有限公司监事。

## 3、高级管理人员情况

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、党委副书记等职务。现任国信证券股份有限公司董事长、党委书记。自 2008 年 12 月开始担任鹏华基金管理有限公司董事长。。

邓召明先生, 党委书记、董事、总裁, 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裁、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董事、总裁、党委书记。自 2012 年 12 月开始担任鹏华基金管理有限公司董事。

高阳先生, 党委副书记、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, 自 2008 年 12 月起担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, 自 2015 年 10 月起担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, 自 2014 年 12 月起担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机构理财部总经理、职工监事、总裁助理, 自 2015 年 9 月起担任鹏华基金管理有限公司副总裁。

高永杰先生, 纪委书记, 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, 自 2015 年 2 月担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, 自 2017 年 3 月起担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、本基金基金经理

谢书英女士，国籍中国，经济学硕士，12年证券基金从业经验。曾任职于高盛高华证券有限公司投资银行部；2009年4月加盟鹏华基金管理有限公司，历任研究部高级研究员、投资经理助理，现担任权益投资一部副总经理、基金经理。2014年04月至2017年03月担任鹏华金刚保本混合基金基金经理，2015年06月担任鹏华价值优势混合（LOF）基金基金经理，2016年01月至2019年05月担任鹏华文化传媒娱乐股票基金基金经理，2016年09月至2018年09月担任鹏华增瑞混合基金基金经理，2017年07月担任鹏华精选成长混合基金基金经理，2018年09月担任鹏华增瑞混合（LOF）基金基金经理，2019年04月担任鹏华核心优势混合基金基金经理。谢书英女士具备基金从业资格。

本基金基金经理管理的其他基金情况：

2014年04月至2017年03月担任鹏华金刚保本混合基金基金经理

2015年06月担任鹏华价值优势混合（LOF）基金基金经理

2016年01月至2019年05月担任鹏华文化传媒娱乐股票基金基金经理

2016年09月至2018年09月担任鹏华增瑞混合基金基金经理

2017年07月担任鹏华精选成长混合基金基金经理

2018年09月担任鹏华增瑞混合（LOF）基金基金经理

本基金历任的基金经理：

无

#### 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/董事总经理（MD）/基金经理，鹏华新兴产业混合、鹏华研究精选混合、鹏华创新驱动混合、鹏华研究智选混合、鹏华价值驱动混合基金、鹏华科技创新混合基金经理。

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/基金经理,鹏华养老 2045 混合发起式 (FOF) 基金经理。

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

### 一、基金托管人情况

#### (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:田国立

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)。

2018 年末,集团资产规模 23.22 万亿元,较上年增长 4.96%。2018 年度,集团实现净利润 2,556.26 亿元,较上年增长 4.93%;平均资产回报率和加权平均净资产收益率分别为 1.13% 和 14.04%;不良贷款率 1.46%,保持稳中有降;资本充足率 17.19%,保持领先同业。

2018 年,本集团先后荣获新加坡《亚洲银行家》“2018 年中国最佳大型零售银行奖”、“2018 年中国全面风险管理成就奖”;美国《环球金融》“全球贸易金融最具创新力银行”、《银行家》“2018 最佳金融创新奖”、《金融时报》“2018 年金龙奖—年度最佳普惠金融服务银行”等多项重要奖项。本集团同时获得英国《银行家》、香港《亚洲货币》杂志“2018 年中国最佳银行”称号,并在中国银行业协会 2018 年“陀螺”评价中排名全国性商业银行第一。

中国建设银行总行设资产托管业务部,下设综合与合规管理处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、养老金托管处、全球托管处、新兴业务处、运营管理处、托

管应用系统支持处、跨境托管运营处、合规监督处等 11 个职能处室，在安徽合肥设有托管运营中心，在上海设有托管运营中心上海分中心，共有员工 300 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

蔡亚蓉，资产托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行总行资金计划部、信贷经营部、公司业务部以及中国建设银行重组改制办公室任职，并在总行公司业务部担任领导职务。长期从事公司业务，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

龚毅，资产托管业务部资深经理（专业技术一级），曾就职于中国建设银行北京市分行国际部、营业部并担任副行长，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，资产托管业务部资深经理（专业技术一级），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。

郑绍平，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部、战略客户部，长期从事客户服务、信贷业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

原玗，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行国际业务部，长期从事海外机构及海外业务管理、境内外汇业务管理、国外金融机构客户营销拓展等工作，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、(R)QFII、(R)QDII、企业年金、存托业务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 2019 年二季度末，中国建设银行已托管 924 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。中国建设银行先后 9 次获得《全球托管人》“中国最佳托管银行”、4 次获得《财资》“中国最佳次托管银行”、连续 5 年获得中债登“优秀资产托管机构”等奖项，并在 2016 年被《环球金融》评为中国市场唯一一家“最佳托管银行”、在 2017 年荣获《亚洲银行家》“最佳托管系统实施奖”。

## 二、基金托管人的内部控制制度

### （一）内部控制目标

作为基金托管人，中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和

本行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

## （二）内部控制组织结构

中国建设银行设有风险与内控管理委员会，负责全行风险管理与内部控制工作，对托管业务风险控制工作进行检查指导。资产托管业务部配备了专职内控合规人员负责托管业务的内控合规工作，具有独立行使内控合规工作职权和能力。

## （三）内部控制制度及措施

资产托管业务部具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理严格实行复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

## 三、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

### （一）监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的“新一代托管应用监督子系统”，严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

### （二）监督流程

1. 每工作日按时通过新一代托管应用监督子系统，对各基金投资运作比例控制等情况进行监控，如发现投资异常情况，向基金管理人进行风险提示，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，如有重大异常事项及时报告中国证监会。

2. 收到基金管理人的划款指令后，对指令要素等内容进行核查。

3. 通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求基金管理人进行解释或举证，如有必要将及时报告中国证监会。

## 三、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：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、其他销售机构

(1) 银行销售机构

1) 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

办公地址：广东省东莞市城区南城路 2 号

法定代表人：王耀球

联系人：杨亢

客户服务电话：0769-961122

网址：www.drcbank.com

2) 江苏银行股份有限公司

注册地址：南京市秦淮区中华路 26 号

办公地址：南京市秦淮区中华路 26 号

法定代表人：夏平

客户服务电话：95319

网址：www.jsbchina.cn

3) 交通银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：任德奇

联系人：王菁

客户服务电话：95559

网址：www.bankcomm.com

4) 平安银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南东路 5047 号

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

客户服务电话：95511-3

网址：bank.pingan.com

5) 兴业银行股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 154 号中山大厦

办公地址：上海市江宁路 168 号

法定代表人：高建平

联系人：刘玲

客户服务电话：95561

网址：www.cib.com.cn

6) 中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京复兴门内大街 55 号

办公地址：北京复兴门内大街 55 号

法定代表人：陈四清

联系人：刘秀宇

客户服务电话：95588

网址：www.icbc.com.cn

7) 中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区金融大街 25 号

法定代表人：田国立

联系人：王未雨

客户服务电话：95533

网址：www.ccb.com

(2) 证券公司销售机构

1) 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 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：王常青

联系人：刘畅

客户服务电话：95587/4008-888-108

网址：www.csc108.com

2) 中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座

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：郑慧

客户服务电话：95548

网址：www.cs.ecitic.com

3) 中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001

办公地址：青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座 5 层

法定代表人：姜晓林

联系人：焦刚

客户服务电话：95548

网址：sd.citics.com

(3) 期货公司销售机构

1) 中信期货有限公司

注册地址：广东省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、14 层

办公地址：广东省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、14 层

法定代表人：张皓

联系人：刘宏莹

客户服务电话：400-990-8826

网址：www.citicsf.com

(4) 第三方销售机构

1) 北京汇成基金销售有限公司

注册地址：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：王晓晓

客户服务电话：400-619-9059

网址：www.hcjjin.com

2) 北京肯特瑞基金销售有限公司

注册地址：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

法定代表人：江卉

联系人：韩锦星

客户服务电话：95118

网址：fund.jd.com

3) 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号

办公地址：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯大厦 903~906 室

法定代表人：杨文斌

联系人：王诗琦

客户服务电话：400-700-9665

网址：www.howbuy.com

4) 上海基煜基金销售有限公司

注册地址：上海市崇明县长兴镇潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室（上海泰和经济发展区）

办公地址：上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1503 室

法定代表人：王翔

联系人：吴鸿飞

客户服务电话：400-820-5369

网址：www.jiyufund.com.cn

5) 上海天天基金销售有限公司

注册地址：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

客户服务电话：400-1818-188

网址：www.1234567.com.cn

6) 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903

办公地址：杭州市余杭区五常街道同顺路 18 号同花顺大楼

法定代表人：吴强

联系人：洪泓

客户服务电话：4008773772

网址：www.5ifund.com

7) 中证金牛（北京）投资咨询有限公司

注册地址：北京市丰台区东管头 1 号 2 号楼 2-45 室

办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲 1 号环球财讯中心 A 座 5 层

法定代表人：钱昊旻

联系人：沈晨

客户服务电话：4008-909-998

网址：www.jnlc.com

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：鹏华基金管理有限公司

住所：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

办公室地址：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）82021877

传真：（0755）82021165

负责人：范伟强

## 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

法定代表人：俞卫锋

办公室地址：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

执行事务合伙人：李丹

办公室地址：上海市湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼

联系电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

联系人：潘晓怡

经办会计师：单峰、陈熹

## 四、基金的名称

本基金名称：鹏华核心优势混合型证券投资基金

## 五、基金运作方式及类型

契约型开放式，混合型基金

## 六、基金的投资目标

在严格控制风险的前提下，精选核心优势主题的优质企业进行投资，力求超额收益与长期资本增值。

## 七、基金的投资方向

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括境内依法发行的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、港股通标的股票、债券（含国债、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、中小企业私募债等）、货币市场工具（含同业存单等）、权证、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）。

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：股票资产占基金资产的比例为 60%—95%（投资于港股通标的股票占股票资产的比例不超过 50%）；投资于核心优势主题相关的公司发行的证券占非现金基金资产的比例不低于 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。

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

### 1、资产配置策略

本基金将通过跟踪考量通常的宏观经济变量（包括 GDP 增长率、CPI 走势、M2 的绝对水平 and 增长率、利率水平与走势等）以及各项国家政策（包括财政、货币、税收、汇率政策等）来判断经济周期目前的位置以及未来将发展的方向，在此基础上分析研判 A 股市场以及港股市场、债券市场、货币市场的预期收益与风险，并据此进行大类资产的配置与组合构建，合理确定本基金在股票（包括 A 股和港股）、债券、现金等金融工具上的投资比例，并随着各类资产风险收益特征的相对变化，适时动态地调整各资产投资比例。

### 2、股票投资策略

本基金通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘 A 股和港股的优质公司，构建股票投资组合。核心思路在于：1) 自上而下地分析行业的增长前景、行业结构、商业模式、竞争要素等分析把握其投资机会；2) 自下而上地评判企业的核心竞争力、管理层、治理结构等以及其所提供的产品和服务是否契合未来行业增长的大趋势，对企业基本面和估值水平进行综合的研判，深度挖掘优质的个股。

#### (1) 核心优势主题的定义

本基金所称的核心优势是指政策优势、资源优势、成本优势以及技术优势。核心优势行业及上市公司遴选的标准在于：

1) 行业：本基金深入研究全球宏观经济和区域经济环境，结合我国实际情况，主要评价行业是否符合经济发展趋势、景气度向上、有政策支持以及在国内具备相应的配套，从而形成的成本优势或者技术优势；

2) 上市公司的评估从盈利和估值两方面进行：①盈利指标：营业利润率、净资产收益率、主营业务收入增长率之一在行业中从大到小排名前 25% 的上市公司；②估值指标：市盈率 (P/E)、市净率 (P/B)、市盈率相对盈利增长比率 (PEG) 之一在行业中从小到大排名前 50% 的上市公司。

本基金对行业核心优势及其持续性进行全面系统的研判，结合估值和盈利两个方面的定量评估，选择盈利增长潜力大、估值合理的核心优势公司进行投资。

#### (2) 自上而下的行业遴选

本基金将自上而下地进行行业遴选，重点关注行业增长前景、行业利润前景和行业成功要素。对行业增长前景，主要分析行业的外部发展环境、行业的生命周期以及行业波动与经济周期的关系等；对行业利润前景，主要分析行业结构，特别是业内竞争的方式、业内竞争的激烈程度、以及业内厂商的谈判能力等。基于对行业结构的分析形成对业内竞争的关键成功要素的判断，为预测企业经营环境的变化建立起扎实的基础。

#### (3) 自下而上的个股选择

本基金通过定性和定量相结合的方法进行自下而上的个股选择，对企业基本面和估值水平进行综合的研判，精选优质个股。

##### 1) 定性分析

本基金通过以下两方面标准对股票的基本面进行研究分析并筛选出优质的公司：

一方面是竞争力分析，通过对公司竞争策略和核心竞争力的分析，选择具有可持续竞争优势的公司或未来具有广阔成长空间的公司。就公司竞争策略，基于行业分析的结果判断策略的有效性、策略的实施支持和策略的执行成果；就核心竞争力，分析公司的现有核心竞争力，并判断公司能否利用现有的资源、能力和定位取得可持续竞争优势。

另一方面是管理层分析，通过着重考察公司的管理层以及管理制度，选择具有良好治理结构、管理水平较高的优质公司。

## 2) 定量分析

本基金通过对公司定量的估值分析，挖掘优质的投资标的。通过对估值方法的选择和估值倍数的比较，选择股价相对低估的股票。就估值方法而言，基于行业的特点确定对股价最有影响力的关键估值方法（包括 PE、PEG、PB、PS、EV/EBITDA 等）；就估值倍数而言，通过业内比较、历史比较和成长性分析，确定具有上升基础的股价水平。

### （4）港股通标的股票投资策略

本基金所投资港股通标的股票除适用上述个股投资策略外，本基金投资港股通标的股票还将关注：

- 1) 在港股市场上市、具有行业代表性的优质中资公司；
- 2) 具有行业稀缺性的香港本地和外资公司；
- 3) 港股市场在行业结构、估值、AH 股折溢价、分红率等方面具有吸引力的投资标的。

## 3、债券投资策略

本基金债券投资将采取久期策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、个券选择策略、信用策略等积极投资策略，自上而下地管理组合的久期，灵活地调整组合的券种搭配，同时精选个券，以增强组合的持有期收益。

### （1）久期策略

久期管理是债券投资的重要考量因素，本基金将采用以“目标久期”为中心、自上而下的组合久期管理策略。

### （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一个重要依据，本基金将据此调整组合长、中、短期债券的搭配，并进行动态调整。

### （3）骑乘策略

本基金将采用基于收益率曲线分析对债券组合进行适时调整的骑乘策略，以达到增强组合的持有期收益的目的。

### （4）息差策略

本基金将采用息差策略，以达到更好地利用杠杆放大债券投资的收益的目的。

### （5）个券选择策略

本基金将根据单个债券到期收益率相对于市场收益率曲线的偏离程度，结合信用等级、流动性、选择权条款、税赋特点等因素，确定其投资价值，选择定价合理或价值被低估的债券进行投资。

#### (6) 信用策略

本基金通过主动承担适度的信用风险来获取信用溢价，根据内、外部信用评级结果，结合对类似债券信用利差的分析以及对未来信用利差走势的判断，选择信用利差被高估、未来信用利差可能下降的信用债进行投资。

#### 4、权证投资策略

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。

#### 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、股指期货投资策略

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。

#### 7、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。

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。

## 九、基金的业绩比较基准

沪深 300 指数收益率×70%+中证综合债指数收益率×30%

沪深 300 指数选样科学客观，行业代表性好，流动性高，抗操纵性强，是目前市场上较有影响力的股票投资业绩比较基准。中证综合债指数的选样债券的信用类别覆盖全面，期限构成宽泛，适于做基金债券资产的业绩比较基准。基于本基金的投资范围和投资比例限制，选用上述业绩比较基准能够忠实反映本基金的风险收益特征。

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。

## 十、基金的风险收益特征

本基金属于混合型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。本基金将投资港股通标的股票，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。

## 十一、基金的投资组合报告

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 2020 年 01 月 17 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 10 月 01 日起至 12 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	128,880,381.63	91.33
	其中：股票	128,880,381.63	91.33
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	516,889.00	0.37
	其中：债券	516,889.00	0.37
	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	11,227,235.77	7.96
8	其他资产	493,827.53	0.35
9	合计	141,118,333.93	100.00

注：本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 2013.75 元，占净值比 0.00%。

### 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	8,031,282.01	5.84
C	制造业	74,262,166.37	54.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,987,241.74	1.45
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	3,100,645.00	2.26
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	6,868,600.60	5.00
J	金融业	8,553,830.28	6.22
K	房地产业	18,293,646.80	13.31
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	158,153.04	0.12
N	水利、环境和公共设施管理业	6,578.04	0.00
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	7,616,224.00	5.54
S	综合	-	-
	合计	128,878,367.88	93.79

(2) 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
能源	-	-
原材料	-	-
工业	2,013.75	0.00
非日常生活消费品	-	-
日常消费品	-	-
医疗保健	-	-
金融	-	-
信息技术	-	-
通讯服务	-	-
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	2,013.75	0.00

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	000651	格力电器	152,600	10,007,508.00	7.28
2	000661	长春高新	20,400	9,118,800.00	6.64
3	600438	通威股份	685,100	8,995,363.00	6.55
4	600036	招商银行	203,000	7,628,740.00	5.55
5	300144	宋城演艺	246,400	7,616,224.00	5.54
6	601155	新城控股	179,100	6,934,752.00	5.05
7	603806	福斯特	134,260	6,525,036.00	4.75
8	002250	联化科技	376,169	6,443,774.97	4.69
9	600340	华夏幸福	204,704	5,875,004.80	4.28
10	000961	中南建设	519,800	5,483,890.00	3.99

### 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）	516,889.00	0.38
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	516,889.00	0.38

### 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	113551	福特转债	4,010	516,889.00	0.38

### 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,降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差,达到有效跟踪标的指数的目的。

## 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

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

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的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。**

中南建设 中南建设本次公告原因为收到此前违规情况的《行政处罚事先告知书》,未在本报告期至前一个完整年度内有新增违规受罚情况,具体情况说明如下。

2017年11月11日,中南建设与深圳市和润达投资有限公司(以下简称“深圳和润达”)、深圳三瑞房地产开发有限公司(以下简称“深圳三瑞”)签署《深圳市罗湖区草埔城中村城市更新项目合作协议》,中南建设与深圳三瑞分别将持有的中南(深圳)房地产开发有限公司(以下简称“中南房地产”)47%和20%的股权转让与深圳和润达。2017年11月16日,中南建设完成了转让中南房地产47%股权转让的工商变更手续。2017年12月8日,中南建设收到交易方深圳和润达支付的股权转让款。本次交易所产生的投资收益共计金额为50,100万元,此次交易在扣除所得税影响后,股权转让产生的净利润为37,357万元,占中南建设2016年度归母净利润的92.16%。对于上述重大交易事项,中南建设迟至2018年6月7日才履行信息披露义务,并迟至2019年1月17日才履行股东大会审议程序。

中南建设上述行为违反了深圳证券交易所《股票上市规则(2014年修订)》第2.1条、第7.3条、第9.3条的规定和深圳证券交易所《股票上市规则(2018年11月修订)》第2.1条、第7.3条、第9.3条的规定。中南建设董事长兼总经理陈锦石、时任财务总监钱军未能恪尽职守、履行诚信勤勉义务,违反了深圳交易所《股票上市规则(2014年修订)》第1.4

条、第 3.1.5 条的规定和深圳交易所《股票上市规则（2018 年 11 月修订）》第 1.4 条、第 3.1.5 条的规定，对中南建设上述违规行为负有重要责任。

鉴于上述违规事实及情节，深圳证券交易所对此做出的处分决定如下：

一、对江苏中南建设集团股份有限公司给予通报批评的处分。

二、对江苏中南建设集团股份有限公司董事长兼总经理陈锦石、时任财务总监钱军、现任董事辛琦、时任董事会秘书张伟给予通报批评的处分。

对该证券的投资决策程序的说明：本基金管理人长期跟踪研究该公司，认为公司的上述违规行为对公司并不产生实质性影响。上述通告对该公司股票的投资价值不产生重大影响，且该证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

#### **(2) 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。**

本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券备选库。

#### **(3) 其他资产构成**

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	122,304.82
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,257.59
5	应收申购款	369,265.12
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	493,827.53

#### **(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。

## **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
2019年04月03日(基金合同生效日)至2019年12月31日	28.00%	0.66%	3.48%	0.77%	24.52%	-0.11%
自基金合同生效日至2019年12月31日	28.00%	0.66%	3.48%	0.77%	24.52%	-0.11%

### 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、仲裁费、诉讼费、公证费和认证费；
- 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/期货账户开户费用、账户维护费用；
- 9、因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用；
- 10、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 1.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

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 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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。

上述“一、基金费用的种类中第 3—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、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、与基金销售有关的费用

### 1、申购费率

本基金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基金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，包括但不限于全国社会保障基金、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。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	1.50%	0.60%
100 万≤M<500 万	1.00%	0.30%
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。

## 2、赎回费率

本基金的赎回费率如下表所示：

持有年限 (Y)	赎回费率
Y<7 日	1.50%
7 日≤Y<30 日	0.75%
30 日≤Y<1 年	0.50%
1 年≤Y<2 年	0.25%
Y≥2 年	0

注：1 个月为 30 日，1 年为 365 日

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。对持续持有期少于 30 日的投资人收取的赎回费全额计入基金财产；对持续持有期不少于 30 日但少于 3 个月的投资人收取的赎回费总额的 75% 计入基金财产；对持续持有期不少于 3 个月但少于 6 个月的投资人收取的赎回费总额的 50% 计入基金财产；对持续持有期不少于 6 个月的投资人，将赎回费总额的 25% 计入基金财产。上述未纳入基金财产的赎回费用于支付登记费和其他必要的手续费。

## 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。

## 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》、《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。

2、在“第三部分 基金管理人”部分内容进行了更新。

3、在“第四部分 基金托管人”部分内容进行了更新。

4、在“第五部分 相关服务机构”部分内容进行了更新。

5、在“第七部分 基金份额的申购与赎回”部分内容进行了更新。

6、在“第八部分 基金的投资”部分内容进行了更新。

7、增加“第九部分 基金的业绩”部分内容。

8、在“第二十部分 对基金份额持有人的服务”部分内容进行了更新。

9、在“第二十一部分 其他披露事项”部分内容进行了更新。

**鹏华基金管理有限公司**

**2020年04月**