鹏华中证一带一路主题指数分级证券投资基金招募说明书

重要提示

本基金经2015年4月29日中国证券监督管理委员会下发的《关于核准鹏华中证一带一路主题指数分级证券投资基金募集的批复》（证监许可［2015］769号文）予以注册，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。中国证监会不对基金的投资价值和市场前景等作出实质性判断或保证。

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，通过跟踪标的指数获利，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，带路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；带路B份额为杠杆股收益类份额，具有高风险且预期收益相对较高的特征。本基金面临的主要风险有市场风险、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。本基金以工元初始面值发售，但在市场波动等因素的影响下，基金投资仍有可能出现亏损或基金净值仍有可能低于初始面值。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。投资有风险，投资者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。

一、基金募集和基金份额发售的基本情况

1、基金名称

鹏华中证一带一路主题指数分级证券投资基金（基金简称：鹏华一带一路分级；基金代码：160638；场内简称：带路分级）

2、基金运作方式和类型

契约型开放式，股票型证券投资基金

3、基金存续期

不定期

4、基金份额初始发售面值

每份基金份额初始发售面值为1.000元人民币

5、深交所挂牌价格

人民币1.000元

6、基金投资目标

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。

7、基金投资范围

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、资产支持证券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：投资于股票部分的比例不低于基金资产的80%，其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的90%；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%。

鹏华基金管理有限公司

38、基金合同终止日：指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，基金财产清算完毕，清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期

39、基金募集期：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过3个月

40、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

41、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

42、T日：指销售机构在规定期间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日

43、T+n日：指自T日起第n个工作日（不包含T日）

44、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

45、开放时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

46、认购：指在基金募集期内，投资人申请购买基金份额的行为

47、上市交易：指基金投资者通过深圳证券交易所会员单位以集中竞价的方式买卖基金份额的行为

48、申购：指基金合同生效后，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

49、赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为

50、巨额赎回：指基金单个开放日，鹏华一带一路分级份额净赎回申请（赎回申请总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一开放日基金总份额（包括鹏华一带一路分级、鹏华带路A分级、鹏华带路B分级）的10%

51、配对转换：指鹏华一带一路分级与鹏华带路A分级、鹏华带路B分级之间按约定的转换规则进行转换的行为，包括基金份额的分拆和合并

52、分拆：指基金份额持有人将其持有的场内鹏华一带一路分级份额按照2份场内鹏华一带一路分级对应1份鹏华带路A分额与1份鹏华带路B份额的比例进行转换的行为

53、合并：指基金份额持有人将其持有的鹏华带路A分额与鹏华带路B分额按照1份鹏华带路A分额与1份鹏华带路B分额对应2份场内鹏华一带一路分级份额的比例进行转换的行为

54、折算：指在基金份额持有人持有基金份额净值不变的前提下，由基金管理人按照一定比例调整鹏华一带一路分级份额、鹏华带路A分额参考净值和/或鹏华带路B分额参考净值，使得基金份额持有人持有基金份额相应变化的行为，包括定期折算和不定期折算

55、定期折算：指基金管理人按一定的周期进行的基金份额折算的行为

56、不定期折算：指当鹏华一带一路分级净值、鹏华带路A分额参考净值和/或鹏华带路B分额参考净值满足一定的条件时，基金管理人进行的基金份额折算行为

57、基金转换：指基金份额持有人按照基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金基金份额的行为

58、转托管：指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的操作，包括系统内转托管和跨系统转托管

59、系统内转托管：指投资者将持有的基金份额在登记结算系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记系统内不同会员单位（交易单元）之间进行转托管的行为

60、跨系统转托管：指投资者将持有的鹏华一带一路分级在登记结算系统和证券登记系统之间进行转托管的行为

61、定期定额投资计划：指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期申购日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式

62、元：指人民币元

63、基金资产：指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本及费用的余额

64、基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和

65、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

66、基金份额净值：指每一份基金份额所代表的基金资产净值，按基金份额的不同，可区分为鹏华一带一路分级份额净值、鹏华带路A分额净值、鹏华带路B份额净值

67、基金份额参考净值：指在基金份额净值计算的基础上，根据基金合同约定的计算公式得到的基金份额估算价值，按基金份额的不同，可区分为鹏华带路A分额参考净值、鹏华带路B份额参考净值。基金份额参考净值是对基金份额价值的一个估算，并不代表基金份额持有人可获得的实际价值

68、基金资产估值：指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程

69、指定媒介：指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒介

70、不可抗力：指基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

三、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15亿元

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%
意大利欧利威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学经济学院讲师、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、现任鹏华基金管理有限公司副总经理。

孙根标先生，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、香港联业（集团）有限公司副总经理、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、现任国信证券股份有限公司顾问。

陈中国先生，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、人力资源总监副总经理；2015年4月至今任国信证券股份有限公司资金财务总部副总经理。

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、欧利威资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR SpA）投资方案副投资总监、Epsilon 资产管理股份公司（Epsilon SGR）首席执行官，现任欧利威资本股份公司（Eurizon Capital SA）（卢森堡）首席执行官和总经理。

Alessandro Varaldo先生，董事，经济学和商业管理博士，国籍：意大利，曾任米兰德意志银行集团Finanza e Futuro Fondi Sprind股份公司投资管理部债券基金和现金头寸管理高级经理，IMI Fideuram资产管理股份公司投资管理部固定收益组合和现金管理业务负责人，圣保罗银行投资公司（Banca Sanpaolo Invest SpA）财务及营销策划部负责人，Capitalia股份公司（Capitalia SpA）产品和销售部负责人，Capitalia投资管理股份公司（Capitalia Investment Management SA）董事总经理，Unicredit Holding财务风险管理部意大利业务法人风险管理业务负责人，欧利威资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR SpA）首席市场官、欧利威资本股份公司（Eurizon Capital SA）（卢森堡）董事，现任意大利联合圣保罗银行股份有限公司（Intesa Sanpaolo SpA）储蓄、投资和养老金产品部负责人。

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，兼任中国经济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。曾任济南铁路局文干事、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，任中央国资委纪检组副组长兼党委书记；2007年12月至2010年12月，任中央国资委纪检组副组长兼国资委纪检监察局局长兼党委委员、纪检组长兼国资委委员、纪检组长兼国资委纪检监察局局长兼党委委员、纪检组长兼国资委纪检监察局局长兼党委委员、纪检组长兼国资委纪检监察局局长兼党