鹏华中证银行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

二零一六年五月

重要提示

本基金经2015年3月31日中国证券监督管理委员会下发的《关于核准鹏华中证银行指数分级证券投资基金募集的批复》（证监许可〔2015〕500号文）批准，进行募集。根据相关法律法规，本基金基金合同已于2015年4月17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。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，通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相联的风险收益特征。

从本基金所分列的两类基金份额来看，鹏华银行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；鹏华银行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。

基金的过往业绩并不预示未来表现，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，投资者风险，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等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。

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2016年4月16日，有关财务数据和净值表现截止日为2016年3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（亿元）	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，现任鹏华基金管理有限公司总裁、党总支书记。

孙煜纶先生，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监、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顾问。

熊中国先生，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CAIPG SGR投资总监、CAAM AI SGR投资总监、意大利工商银行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.）机场及业务发展总监。

Andrea Vismara先生，董事，硕士学士，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）所在巴黎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）公证股务部总经理。

史所荣先生，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司（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，负责贸款管理和运营，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

黄南先生，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、资金财务部财务科经理、资金财务部证券结算经理、资金财务部总经理助理、资金财务总部副总经理等，现任国信证券资金财务总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、税务部事务所、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企业经营部、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（KWM）律师事务所律师；2011年7月加盟鹏华基金管理有限公司，历任监察稽核副总务主管、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。

刘筱先生，职工监事，管理学硕士，国籍：中国。历任华夏城（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。

邢起先生，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、股权投产部（农业投资部）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。

高永东先生，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，鹏华基金管理有限公司监察稽核部总经理，现任鹏华基金管理有限公司督察长。

4、本基金基金经理

胡东健先生，国籍：中国，经济学硕士，5年金融证券从业经验。历任融通基金管理有限公司研究员；2015年1月加盟鹏华基金管理有限公司，担任高级研究员，从事股票研究工作；2015年6月起担任鹏华价值精选股票基金基金经理，2015年12月起兼任鹏华优质治理混合（LOF）基金基金经理。胡东健先生具备基金从业资格。

本基金历任基金经理：

2012年4月至2014年7月　程世杰、王学兵
2014年7月至2015年6月　彭建辉
2015年6月至2015年9月　彭建辉、胡东健
2015年9月至今　胡东健

本基金基金经理管理其他基金情况：

2015年12月起兼任鹏华优质治理混合（LOF）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。

初冬女士，鹏华基金管理有限公司总助理、固定收益投资总监、固定收益部总经理，社保基金组合投资经理及鹏华丰盛稳固收益债券、鹏华双债增利债券、鹏华双债加利债券基金基金经理。

窦洪涛先生，鹏华基金管理有限公司总裁助理、权益投资总监，权益投资一部总经理，社保基金组合投资经理，专户投资经理。

王宗合先生，鹏华基金管理有限公司权益投资二部总经理，鹏华消费优选混合、鹏华金刚保本混合、鹏华品牌传承混合、鹏华养老产业股票基金基金经理。

王映辉先生，鹏华基金管理有限公司量化及衍生品投资部总经理，鹏华中证500指数（LOF）、鹏华地产分级、鹏华沪深300指数（LOF）、鹏华创业板分级、鹏华互联网分级基金基金经理。

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）、鹏华健康环保混合基金基金经理。

阳先伟先生，鹏华基金管理有限公司固定收益部执行总经理，鹏华短债基金、鹏华双债保利债券、鹏华可转债债券基金基金经理。

陈鹏扬先生，鹏华基金管理有限公司基础投资一部副总经理，鹏华中国50指数、鹏华消费领先混合基金基金经理。

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：人民币伍亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整
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。中国建设银行于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6月末，本集团资产总额182,192亿元，较上年末增长8.81%；客户贷款和垫款总额101,571亿元，增长7.20%；客户存款总额136,970亿元，增长6.19%，净利润1,322亿元，同比增长0.97%；营业收入3,110亿元，同比增长8.34%，其中，利息净收入同比增长6.31%，手续费及佣金净收入同比增长5.76%，成本收入比23.23%，同比下降0.94个百分点，资本充足率14.70%，处于同业领先地位。

物理网络子渠道协同发展，总行成立了渠道与运营管理部，全面推进渠道整合；营业网点“三综合”建设取得新进展，综合性网点达到1.44万个，综合营销团队达到19,934个，综合柜员占比达到84%；客户可在转型网点享受便捷舒适的“一站式”服务，加快打造电子银行的主渠道建设，有力支持物理渠道的综合化转型；电子银行和自助渠道账务性交易量占比达94.32%，较上年末提高6.29个百分点；个人网上银行客户、企业网上银行客户、手机银行客户分别增长8.19%、10.78%和11.47%；善融商务推出移动平台，个人商城手机客户端“随行善融商城”正式上线。

转型重点业务快速发展，2015年6月末，累计承销非金融企业债务融资工具2,374.76亿元，承销金额继续保持同业第一；证券投资基金托管只数和新发基金托管只数均列市场第一，成为首批香港基金内地销售机构之一唯一一家银行代理人；多模式现金池、票据池、银银单位结算卡等战略性产品市场份额不断扩大；现金管理品牌“凤道”的市场影响力持续提升；代理中央财政授权支付业务、代理中央非税收入收缴业务客户数保持同业第一，在同业中首家按照财政部要求实现中央非税收入收缴电子化上线试点。“鑫存管”证券客户保证金第三方存管客户数3,076万户，管理资金总额7,417.41亿元，均为行业第一。

2015年上半年，本集团在方面良好表现，得到市场与业界广泛认可，先后荣获国内外知名机构授予的40多项重要奖项，在英国《银行家》杂志2015年“世界银行1000强排名”中，以一级资本总额继续位列全球第2；在美国《福布斯》杂志2015年全球上市公司2000强排名中继续位列第2；在美国《财富》杂志2015年世界500强排名第29位，较上年上升9位；荣获美国《环球金融》杂志颁发的“2015年中国最佳银行”奖项；荣获美国银行业协会授予的“年度最具社会责任金融机构奖”和“年度社会责任最佳民生金融奖”两个综合大奖。

中国建设银行在行业投资管理业务部、下设部门主要业务：基金保险资产托管处、证券投资基金托管处、理财产品托管处、QFII托管处、养老金托管处、清算处、核算处、监督稽核处等9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210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

赵海雨，投资托管业务部总经理，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，投资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。

张力修，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行建设经济部、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，投资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2015年末，中国建设银行已托管556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年至今连续五年被国际权威杂志《证券托管人》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：李鸿

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：021-68876678
传真：021-68876821
联系人：李化恒

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4312室
电话：027-85557881
传真：027-85557973
联系人：邹坪民

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、其他销售机构

①银行销售机构

1 中信建设证券股份有限公司
注册/办公地址：上海市浦东新区银城中路168号
法定代表人：牛锦明
电话：021-58718234
传真：021-58408483
联系人：张宏革
客户服务电话：95559
网址：www.bankcomm.com

3 招商银行股份有限公司
住所：深圳市深南大道7088号招商银行大厦
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
成立时间：1987年4月8日
联系电话：0755-83198888

4 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：杨元
客户服务电话：961122
网址：www.drcbank.com

5 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：徐征程
网址：www.bankofshanghai.com

6 中国农业银行股份有限公司
注册/办公地址：北京市东城区建国门内大街69号
法定代表人：蒋超良
客户服务电话：95599
联系人：邱泽滨
网址：www.abchina.cn

②券商销售机构

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：权益
传真：010-65182261
客服电话：4008888108
公司网站：www.csc108.com

2 万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：曲杰
联系人：郭军瑞
联系电话：010-57398063
客服电话：95571
网址：www.foundersc.com

3 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：400-800-8899
网址：www.cindasc.com

4 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

5 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：刘阳
网址：www.cgws.com

6 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：梁鹿
联系电话：020-88836999
传真号码：020-88836654
客服热线：020-961303
网址：www.gzs.com.cn

7 光大证券股份有限公司
注册地址：上海市静安区新闸路1508号
办公地址：上海市静安区新闸路1508号
法定代表人：薛峰
联系电话：021-22169081
传真：021-68817271
联系人：刘丽
客户服务电话：95525
公司网站：www.ebscn.com

8 国泰君安证券股份有限公司
注册地址：深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层
办公地址：深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层
法定代表人：谢永林
客户服务电话：95511
联系电话：021-38637463
联系人：瞿一骏
网址：stock.pingan.com

9 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

10 知乎芝源证券有限公司
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.shwjsc.com

11 万位证券股份有限公司
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

12 国泰君安证券股份有限公司
注册地址：中国　仁海　珥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
联系电话：021-38676666
传真：021-38670666
联系人：内敏棋
客户服务电话：95521
网址：www.gtja.com

13 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　单元
办公地址：上海市徐汇区宛平南路88号
法定代表人：俞洋
联系人：陈敏
电话：021-64339000
传真：021-54967293
客户服务电话：021-32109999；029-68918888；4001099918
网址：www.cfsc.com.cn

14 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：金喆
电话：028-86690126
传真：028-86690126
服务热线：95310
公司网站：www.gjzq.com.cn

15 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

16 万联证券（山东）有限责任公司
注册地址：青岛市崂山区香港路29号澳柯玛大厦15层（0507-1510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

17 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
联系人：周杨
客户服务电话：95536
网址：www.guosen.com.cn

18 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：021-68634518
传真：021-68865680
联系人：李欣
客户服务电话：400-888-1551
网址：www.xcsc.com

19 西部证券股份有限公司
注册地址：西安市东新街232号陕西信托大厦16-17楼
办公地址：西安市东新街232号陕西信托大厦16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

20 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

21 知信证券股份有限公司
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

22 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

23 平安证券股份有限公司
注册地址：山东省济南市经七路86号
办公地址：山东省济南市经七路86号2316室
法定代表人：李玮
联系电话：0531-68889157
联系人：马晓男
客户服务电话：95538
网址：http://www.zts.com.cn

24 渤海证券股份有限公司
注册地址：天津市经济技术开发区第二大街42号写字楼101室
办公地址：天津市南开区宾水西道8号
法定代表人：王春峰
联系人：王凯权
电话：022-28451861
传真：022-28451892
网址：www.bhzq.com

25 联讯证券股份有限公司
注册地址：广东省惠州市惠城区江北东江三路55号惠州广电大楼三、四层
办公地址：北京市朝阳区红旗营南路天鹅园6号楼二层
法定代表人：徐刚
联系人：张佐
电话：010-64408820
传真：010-64408834
客户服务电话：95564
网址：www.lxzq.com.cn

26 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：杨丽宇
客户服务电话：400-910-1166
网址：www.cicc.com.cn

27 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：余维佳
联系人：张俊
联系电话：023-63786141
客户服务电话：4008096096
传真：023-63786212
网址：www.swsc.com.cn

28 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
传真号码：029-63387256
联系人：黄芳
网址：www.kysec.cn

29 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：万玉鹏
联系电话：0755-82023442
客户服务热线：400　600　8008.95532
网址：www.china-invs.cn

③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：张文彬
客户服务电话：400-8877-780
联系电话：023-86769742
联系人：谭沂
网址：www.cfe.108.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：张姣
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

④第三方销售机构

1 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：周施圣
网址：www.fund123.cn

2 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

3 上海陆金所资产管理有限公司
住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼
法定代表人：郭坚
联系人：何雪
联系电话：021-20662010
客服电话：4008219031
网址：www.lu.com

4 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

5 深圳众禄基金销售有限公司
注册地址：深圳市罗湖区桂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

6 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

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（具体名单可在深圳证券交易所网站查询）。

②本基金募集结束前获得基金销售资格的深圳证券交易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）为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
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：021-31358600
联系人：乔睿
经办律师：黎明、孙睿

（四）为计算基金资产的会计师事务所

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

本基金名称：鹏华中证银行指数分级证券投资基金

本基金的基金份额包括鹏华中证银行指数分级证券投资基金之基础份额（简称：鹏华银行分级），基金代码：160631；场内简称：银行指基A）、鹏华中证银行指数分级证券投资基金之A份额（简称：银行A，基金代码：150227）、鹏华中证银行指数分级证券投资基金之B份额（简称：银行B，基金代码：150228）。

五、基金的运作方式与类型

契约型开放式，股票型证券投资基金

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。

本基金力争鹏华银行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回转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，以保证鹏华银行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、适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、衍生品投资策略

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