鹏华基金管理有限公司
PENGHUA FUND MANAGEMENT CO.,LTD

鹏华中证环保产业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

2020 年 06 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《关于核准鹏华中证环保产业指数分级证券投资基金募集的批复》（证监许可〔2015〕506 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 2015 年 6 月 16 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，鹏华环保 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；鹏华环保 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、基金产品资料概要等信息披露文件，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。

基金合同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。

本招募说明书中涉及的与托管相关的基金信息已经本基金托管人中国建设银行股份有限公司复核。本招募说明书所载内容截止日为 2020 年 05 月 15 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2020 年 03 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。

刘嵚先生,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、首席市场官兼机构理财部总经理、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

闫冬先生，国籍中国，理学硕士，10 年证券基金从业经验。曾任招商期货有限公司资产管理部投资经理；2018 年 5 月加盟鹏华基金管理有限公司，现任量化及衍生品投资部基金经理。2019 年 03 月担任鹏华信息分级基金基金经理，2019 年 03 月担任鹏华环保分级基金基金经理，2019 年 03 月担任鹏华酒分级基金基金经理，2019 年 04 月担任鹏华地产分级基金基金经理，2019 年 11 月担任鹏华银行分级基金基金经理，2019 年 11 月担任鹏华资源分级基金基金经理。闫冬先生具备基金从业资格。

本基金基金经理管理的其他基金情况：

2019 年 03 月担任鹏华信息分级基金基金经理

2019 年 03 月担任鹏华酒分级基金基金经理

2019 年 04 月担任鹏华地产分级基金基金经理

2019 年 11 月担任鹏华银行分级基金基金经理

2019 年 11 月担任鹏华资源分级基金基金经理

本基金历任的基金经理：

2015 年 06 月至 2019 年 03 月　　余斌先生

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、上述人员之间均不存在近亲属关系。

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。

原玎，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、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：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 3305 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）东莞银行股份有限公司

注册地址：东莞市莞城区体育路 21 号

办公地址：东莞市莞城区体育路 21 号

法定代表人：卢国锋

联系人：陈幸

客户服务电话：4001196228

网址：www.dongguanbank.cn

2）江苏江南农村商业银行股份有限公司

注册地址：江苏省常州市和平中路 413 号

办公地址：江苏省常州市和平中路 413 号

法定代表人：陆向阳

联系人：蒋娇

客户服务电话：0519-96005

网址：www.jnbank.com.cn

3）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

4）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

5）招商银行股份有限公司

注册地址：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

客户服务电话：95555

网址：www.cmbchina.com

6）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

（3）证券公司销售机构

1）安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

办公地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

法定代表人：王连志

联系人：陈剑虹

客户服务电话：95517 或 4008-001-001

网址：www.essence.com.cn

2）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：蔡霆

客户服务电话：400-651-5988

网址：www.ewww.com.cn

3）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 楼-17 楼

办公地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14 楼、16 楼、17 楼

法定代表人：曹宏

联系人：金夏

客户服务电话：400-666-6888

网址：www.cgws.com

4）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：尤习贵

联系人：奚博宇

客户服务电话：95579/4008-888-999

网址：www.95579.com

5）大同证券有限责任公司

注册地址：山西省大同市城区迎宾街 15 号桐城中央 21 层

办公地址：山西省太原市小店区长治路世贸中心 12 层

法定代表人：董祥

联系人：薛津

客户服务电话：4007-121212

网址：www.dtsbc.com.cn

6）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 20 楼

法定代表人：刘学民

联系人：毛诗莉

客户服务电话：95358

网址：www.firstcapital.com.cn

7）方正证券股份有限公司

注册地址：湖南省长沙市天心区湘江中路二段 36 号华远华中心 4、5 号楼 3701-3717

办公地址：北京市朝阳区北四环中路盘古大观 A 座 40 层

法定代表人：高利

联系人：丁敏

客户服务电话：95571

网址：www.foundersc.com

8）光大证券股份有限公司

注册地址：上海市新闸路 1508 号

办公地址：上海市新闸路 1508 号

法定代表人：周健男

联系人：龚俊涛

客户服务电话：95525

网址：www.ebscn.com

9）国金证券股份有限公司

注册地址：四川省成都市东城根上街 95 号

办公地址：四川省成都市东城根上街 95 号

法定代表人：冉云

联系人：贾鹏

客户服务电话：95310

网址：www.gjzq.com.cn

10）国联证券股份有限公司

注册地址：无锡市金融一街 8 号

办公地址：无锡市金融一街 8 号国联大厦

法定代表人：姚志勇

联系人：祁昊

客户服务电话：95570

网址：www.glsc.com.cn

11）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：上海市静安区南京西路 768 号国泰君安大厦

法定代表人：贺青

联系人：钟伟镇

客户服务电话：95521/400-8888-666

网址：www.gtja.com

12）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 号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人：何如

联系人：李颖

客户服务电话：95536

网址：www.guosen.com.cn

13）海通证券股份有限公司

注册地址：上海市黄浦区广东路 689 号海通证券大厦

办公地址：上海市黄浦区广东路 689 号海通证券大厦

法定代表人：周杰

联系人：赖奕欣

客户服务电话：95553

网址：www.htsec.com

14）恒泰证券股份有限公司

注册地址：内蒙古自治区呼和浩特市新城区海拉尔东街满世尚都办公商业综合楼

办公地址：呼和浩特市新城区海拉尔东街满世书香苑恒泰证券办公楼

法定代表人：庞介民

联系人：熊丽

客户服务电话：4001966188

网址：www.cnht.com.cn

15）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 11 至 18 层

法定代表人：祝献忠

联系人：孙燕波

客户服务电话：95390

网址：www.hrsec.com.cn

16）华西证券股份有限公司

注册地址：四川省成都市高新区天府二街 198 号

办公地址：四川省成都市高新区天府二街 198 号

法定代表人：杨炯洋

联系人：谢国梅

客户服务电话：95584

网址：www.hx168.com.cn

17）华鑫证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区莲花街道福中社区深南大道 2008 号中国凤凰大厦 1 栋 20C-1 房

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 8 号

法定代表人：俞洋

联系人：杨莉娟

客户服务电话：021-32109999；029-68918888；4001099918

网址：www.cfsc.com.cn

18）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

联系人：袁伟涛

客户服务电话：95325/400-860-8866

网址：www.kysec.cn

19）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 16-20 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 16-20 层

法定代表人：冯鹤年

联系人：韩秀萍

客户服务电话：95376

网址：www.mszq.com

20）平安证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路 5033 号平安金融中心 61 层-64 层

办公地址：深圳市福田区益田路 5033 号平安金融中心 61 层-64 层

法定代表人：何之江

联系人：周一涵

客户服务电话：95511-8

网址：stock.pingan.com

21）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

联系人：李玉婷

客户服务电话：95523/4008895523

网址：www.swhysc.com

22）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：夏旻

客户服务电话：95391/4008005000

网址：www.tfzq.com

23）西部证券股份有限公司

注册地址：西安市新城区东新街 232 号陕西信托大厦

办公地址：西安市新城区东新街 232 号陕西信托大厦 16-17 层

法定代表人：刘建武

联系人：梁承华

客户服务电话：95582

网址：www.westsecu.com

24）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

法定代表人：廖庆轩

联系人：周青

客户服务电话：4008096096/95355

网址：www.swsc.com.cn

25）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 号新南城商务中心 A 栋 11 楼

办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼

法定代表人：孙永祥

联系人：李欣

客户服务电话：95351

网址：www.xcsc.com

26）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

办公地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人：张志刚

联系人：尹旭航

客户服务电话：95321

网址：www.cindasc.com

27）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

联系人：林生迎

客户服务电话：95565

网址：www.newone.com.cn

28）中国国际金融股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

办公地址：北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

法定代表人：沈如军

联系人：杨涵宇

客户服务电话：4009101166

网址：www.cicc.com.cn

29）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 号盘古大观 40-43 层

办公地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼

法定代表人：何亚刚

联系人：胡创

客户服务电话：40088-95618

网址：www.e5618.com

30）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 2-6 层

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：陈共炎

联系人：辛国政

客户服务电话：4008-888-888 或 95551

网址：www.chinastock.com.cn

31）中国中金财富证券有限公司

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 18-21 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 栋第 4、18 层至 21 层

法定代表人：高涛

联系人：万玉琳

客户服务电话：95532

网址：www.ciccwm.com

32）中泰证券股份有限公司

注册地址：济南市市中区经七路 86 号

办公地址：上海市花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 18 层

法定代表人：李玮

联系人：朱琴

客户服务电话：95538

网址：www.zts.com.cn

33）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

34）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

35）中信证券华南股份有限公司

注册地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层

办公地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层

法定代表人：胡伏云

联系人：梁微

客户服务电话：95548

网址：www.gzs.com.cn

36）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

（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：王广学

联系人：刘芸

客户服务电话：4008877780

网址：www.cfc108.com

2）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

（5）第三方销售机构

1）北京百度百盈基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区上地十街 10 号百度大厦 2 层

办公地址：北京市海淀区上地十街 10 号

法定代表人：梁志祥

联系人：王笑宇

客户服务电话：95055

网址：www.baiyingfund.com

2）北京蛋卷基金销售有限公司

注册地址：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：北京市朝阳区望京 SOHO T3 A 座 19 层

法定代表人：钟斐斐

联系人：戚晓强

客户服务电话：400-159-9288

网址：danjuanapp.com

3）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.hcjijin.com

4）北京肯特瑞基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区西三旗建材城中路 12 号 17 号平房 157

办公地址：北京市通州区亦庄经济技术开发区科创十一街 18 号院京东集团总部 A 座 15 层

法定代表人： 王苏宁

联系人：韩锦星

客户服务电话：95118

网址：kenterui.jd.com

5）北京新浪仓石基金销售有限公司

注册地址：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

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：吴翠

客户服务电话：010-62675369

网址：www.xincai.com

6）和讯信息科技有限公司

注册地址：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

客户服务电话：400-920-0022

网址：licaike.hexun.com

7）华瑞保险销售有限公司

注册地址：上海市嘉定区南翔镇众仁路 399 号运通星财富大厦 1 号楼 B 座 13、14 层

办公地址：上海市浦东新区向城路 288 号国华人寿金融大厦 8 层 806

法定代表人：路昊

联系人：茆勇强

客户服务电话： 952303

网址：www.huaruisales.com

8）蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路 969 号 3 幢 5 层 599 室

办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代广场 B 座 6F

法定代表人：祖国明

联系人：韩爱彬

客户服务电话：4000-766-123

网址：www.fund123.cn

9）南京苏宁基金销售有限公司

注册地址：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

办公地址：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

法定代表人：王锋

联系人：张云飞

客户服务电话：95177

网址：www.snjijin.com

10）诺亚正行基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

办公地址：上海市杨浦区秦皇岛路 32 号 c 栋

法定代表人：汪静波

联系人：朱了

客户服务电话：400-821-5399

网址：www.noah-fund.com

11）上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区东方路 1267 号 11 层

法定代表人：张跃伟

联系人：张佳琳

客户服务电话：400-820-2899

网址：www.erichfund.com

12）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：王诗玥

客户服务电话：400-700-9665

网址：www.howbuy.com

13）上海华夏财富投资管理有限公司

注册地址：上海市虹口区东大名路 687 号 1 幢 2 楼 268 室

办公地址：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

法定代表人：李一梅

联系人：仲秋玥

客户服务电话：400-817-5666

网址：www.amcfortune.com

14）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

15）上海陆金所基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号

法定代表人：王之广

联系人：宁博宇

客户服务电话：400-821-9031

网址：www.lufunds.com

16）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

17）上海挖财基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 04 室

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 04 室

法定代表人：吕柳霞

联系人：曾芸

客户服务电话：021-50810673

网址：www.wacaijijin.com

18）上海万得基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

办公地址：上海市浦东新区浦明路 1500 号万得大厦 11 楼

法定代表人：王廷富

联系人：徐亚丹

客户服务电话：400-799-1888

网址：www.520fund.com.cn

19）深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道民田路 178 号华融大厦 27 层 2704

办公地址：北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 A 座 7 层

法定代表人：马勇

联系人：文雯

客户服务电话：400-166-1188

网址：8.jrj.com.cn

20）深圳众禄基金销售股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼

办公地址：深圳市罗湖区笋岗街道梨园路物资控股置地大厦 8 楼 801

法定代表人：薛峰

联系人：邓爱萍

客户服务电话：4006-788-887

网址：www.zlfund.cn、 www.jjmmw.com

21）奕丰基金销售有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一号 1 号 A 栋 201 室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市南山区海德三道航天科技广场 A 座 17 楼 1704 室

法定代表人：TEO WEE HOWE

联系人：叶健

客户服务电话：400-684-0500

网址：www.ifastps.com.cn

22）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

23）珠海盈米基金销售有限公司

注册地址：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

客户服务电话：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，并在基金管理人网站公示。

3、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

住所：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：周明

办公室地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

联系电话：010-50938782

传真：010-50938907

负责人：丁志勇

（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、孙睿

（四）审计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

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、潘晓怡

四、基金的名称

本基金名称：鹏华中证环保产业指数分级证券投资基金

五、基金运作方式及类型

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%，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

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。

本基金力争鹏华环保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，对其进行适时调整，以保证鹏华环保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、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

中证环保产业指数收益率×95%＋商业银行活期存款利率（税后）×5%

中证环保产业指数是根据联合国环境与经济综合核算体系对于环保产业的界定方法，将符合资源管理、清洁技术和产品、污染管理的公司纳入环保产业主题，采用等权重加权方式，反映上海和深圳市场环保产业公司表现的指数。

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基准的指数时，本基金管理人可以在取得基

金托管人同意后变更业绩比较基准，不需要召集基金份额持有人大会，但需报中国证监会备案并及时公告。

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，鹏华环保 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；鹏华环保 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

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 04 月 21 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 2020 年 01 月 01 日起至 03 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	71,676,703.73	93.64
	其中：股票	71,676,703.73	93.64
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	4,708,742.14	6.15
8	其他资产	159,235.68	0.21
9	合计	76,544,681.55	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	-	-
C	制造业	48,074,464.47	63.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,277,825.60	14.84
E	建筑业	1,613,860.65	2.12
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	1,144,289.00	1.51
J	金融业	-	-
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	884,260.00	1.16
N	水利、环境和公共设施管理业	8,635,454.72	11.36
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	71,630,154.44	94.23

（2）报告期末积极投资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	-	-
C	制造业	9,849.00	0.01
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	19,147.31	0.03
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	-	-

L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	17,552.98	0.02
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	46,549.29	0.06

（3）报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

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

（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	300457	赢合科技	26,100	1,374,165.00	1.81
2	002460	赣锋锂业	25,500	1,026,375.00	1.35
3	002056	横店东磁	102,200	1,020,978.00	1.34
4	002594	比亚迪	16,600	995,502.00	1.31
5	300316	晶盛机电	50,410	963,335.10	1.27
6	002129	中环股份	67,000	957,430.00	1.26
7	000400	许继电气	72,200	945,098.00	1.24
8	603568	伟明环保	33,015	941,587.80	1.24
9	300750	宁德时代	7,800	939,042.00	1.24
10	300724	捷佳伟创	19,800	917,730.00	1.21

（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	603353	和顺石油	689	19,147.31	0.03
2	300825	阿尔特	1,642	17,552.98	0.02
3	002979	雷赛智能	1,005	9,849.00	0.01

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

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

无。

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

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

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

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

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。

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

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） 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	6,612.02
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,028.31
5	应收申购款	151,595.35
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	159,235.68

（4）报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

（5）报告期末股票中存在流通受限情况的说明

1）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

无。

2）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	603353	和顺石油	19,147.31	0.03	新股未上市
2	002979	雷赛智能	9,849.00	0.01	新股未上市

（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招募说明书。

基金合同生效以来的投资业绩及其与同期基准的比较如下表所示：

	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
2015 年 06 月 16 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日	-14.34%	3.00%	-30.78%	3.22%	16.44%	-0.22%
2016 年 01 月 01 日至 2016 年 12 月 31 日	-13.03%	1.89%	-16.18%	1.81%	3.15%	0.08%

2017 年 01 月 01 日至 2017 年 12 月 31 日	4.71%	0.95%	-0.91%	0.93%	5.62%	0.02%
2018 年 01 月 01 日至 2018 年 12 月 31 日	-38.03%	1.29%	-37.38%	1.33%	-0.65%	-0.04%
2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日	20.25%	1.41%	18.72%	1.43%	1.53%	-0.02%
2020 年 01 月 01 日至 2020 年 03 月 31 日	-6.03%	2.27%	-6.39%	2.28%	0.36%	-0.01%
自基金合同生效日至 2020 年 03 月 31 日	-45.37%	1.73%	-60.00%	1.76%	14.63%	-0.03%

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、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：

H＝E×1.00％÷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，自动在次月初 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、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×0.22％÷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，自动在次月初 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、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×0.02％÷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 日在指定媒介公告。

上述“一、基金费用的种类中第 4－11 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、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	1.20％
100 万≤M＜500 万	0.60％
M≥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＜7 日	1.5%
7 日≤Y＜1 年	0.50％
1 年≤Y＜2 年	0.25％
Y≥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。本基金对持续持有期少于 7 日的投资者收取的赎回费将全额计入基金财产，对持续持有期不少于 7 日的投资者收取的赎回费总额的 25％应归入基金财产，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自 2015 年 9 月 21 日起进行调整，调整后费率如下表。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。

基金场内申购费率：

申购金额 M（元）	申购费率
M＜500 万	0
M≥500 万	按笔收取，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

本基金的场内赎回费率随投资者持有基金份额期限的增加而减少。

本基金场内赎回费率如下表：

持有期限 Y	赎回费率
Y＜7 日	1.50%
Y≥7 日	0.50％

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。本基金对持续持有期少于 7 日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产，对持续持有期不少于 7 日的投资者收取的赎回费总额的 25％应归入基金财产，其余用于支付市场推广、注册登记费和其他必要的手续费。

（五）基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，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。

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“第十三部分 基金投资”部分内容进行了更新。

6、在“第十四部分 基金业绩”部分内容进行了更新。

7、在“第二十七部分 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 06 月