鹏华优势企业股票型证券投资基金更新的招募说明书摘要

(2020年第1号)

基金管理人:鹏华基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
2020年4月20日

重要提示

本基金经2015年7月13日中国证券监督管理委员会下发的《关于准予鹏华优势企业股票型证券投资基金注册的批复》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。

本基金属于股票型基金,其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金,属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种。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。

本基金投资范围包括中小企业私募债,中小企业私募债券的流动性风险在于该类债券采取非公开方式发行和交易,由于不公开资料,外部评级机构一般不对这类债券进行外部评级,可能会降低市场对该类债券的认可度,从而影响该类债券的市场流动性。中小企业私募债券的信用风险在于该类债券发行主体的资产规模较小、经营的波动性较大,同时,各类材料(包括招募说明书、审计报告)不公开发布,也大大提高了分析并跟踪发债主体信用基本面的难度。

本基金投资股指期货等金融衍生品。金融衍生品是一种金融合约,其价值取决于一种或多种基础资产或指数,其评价主要源自于对挂钩资产的价格与价格波动的预期。投资于衍生品需承受市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险和法律风险等。由于衍生品通常具有杠杆效应,价格波动比标的工具更为剧烈,有时候比投资标的资产要承担更高的风险。并且由于衍生品定价相当复杂,不适当的估值有可能使基金资产面临损失风险。股指期货采用保证金交易制度,由于保证金交易具有杠杆性,当出现不利行情时,股价指数微小的变动就可能会使投资人权益遭受较大损失。股指期货采用每日无负债结算制度,如果没有在规定的时间内补足保证金,按规定将被强制平仓,可能给投资带来损失。

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。

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。

本次招募说明书更新仅涉及《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》第十二条中与招募说明书内容有关的一项或多项重大变更,具体事项请参考基金管理人最近三个交易日内披露的关于上述重大变更的相关公告。

第一部分 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,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,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党委书记、总裁。

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。

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、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。

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)企业服务部总经理。

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、总经理助理、副总经理、人力资源总部副总经理等职务。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兼人力资源总部总经理。

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.)财务管控和投资经理,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(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,现任鹏华基金管理有限公司总裁助理、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,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,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党委书记、总裁。

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,现任鹏华基金管理有限公司党委副书记、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。

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,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,现任鹏华基金管理有限公司纪委书记、督察长。

韩亚庆先生,副总经理,经济学硕士。国籍:中国。历任国家开发银行资金局主任科员,全国社保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,现任鹏华基金管理有限公司副总裁、固定收益投资总监、固定收益部总经理。

4、本基金基金经理

陈璇淼女士,国籍中国,经济学硕士,7年证券基金从业经验。2012年7月加盟鹏华基金管理有限公司,从事行业研究工作,历任研究部基金经理助理/高级研究员,现担任权益投资二部基金经理。2016年03月担任鹏华外延成长混合基金基金经理,2017年11月担任鹏华优势企业基金基金经理,2018年08月担任鹏华优质治理混合(LOF)基金基金经理。陈璇淼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:

2016年03月担任鹏华外延成长混合基金基金经理
2018年08月担任鹏华优质治理混合(LOF)基金基金经理

本基金历任的基金经理:

2017年12月至2018年11月　　蒋鑫女士

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,鹏华新兴产业混合、鹏华研究精选混合、鹏华创新驱动混合基金经理。
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。

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

第二部分 基金托管人

(一)基本情况

名称:中国银行股份有限公司(简称"中国银行")
住所及办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号
首次注册登记日期:1983年10月31日
注册资本:人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整
法定代表人:陈四清
基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字【1998】24 号
托管部门信息披露联系人:王永民
传真:(010)66594942
中国银行客服电话:95566

(二)基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年,现有员工110余人,大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验,且具有海外工作、学习或培训经历,60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务,中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行,中国银行拥有证券投资基金、基金(一对多、一对一)、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内,中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务,为各类客户提供个性化的托管增值服务,是国内领先的大型中资托管银行。

(三)证券投资基金托管情况

截至2019年3月31日,中国银行已托管710只证券投资基金,其中境内基金670只,QDII基金40只,覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、FOF等多种类型的基金,满足了不同客户多元化的投资理财需求,基金托管规模位居同业前列。

(四)托管业务的内部控制制度

中国银行托管业务部风险管理与控制工作是中国银行全面风险控制工作的组成部分,秉承中国银行风险控制理念,坚持"规范运作、稳健经营"的原则。中国银行托管业务部风险控制工作贯穿业务各环节,通过风险识别与评估、风险控制措施设定及制度建设、内外部检查及审计等措施强化托管业务全员、全面、全程的风险管控。

2007年起,中国银行连续聘请外部会计会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作。先后获得基于"SAS70"、"AAF01/06""ISAE3402"和"SSAE16"等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2017年,中国银行继续获得了基于"ISAE3402"和"SSAE16"双准则的内部控制审计报告。中国银行托管业务内控制度完善,内控措施严密,能够有效保证托管资产的安全。

(五)托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

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》的相关规定,基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定,或者违反基金合同约定的,应当拒绝执行,及时通知基金管理人,并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定,或者违反基金合同约定的,应当及时通知基金管理人,并及时向国务院证券监督管理机构报告。

第三部分 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)福建海峡银行股份有限公司
注册地址:福建省福州市台江区江滨中大道358号海峡银行大厦
办公地址:福建省福州市台江区江滨中大道358号海峡银行大厦
法定代表人:俞敏
联系人:黄钰雯
客户服务电话:400-893-9999
网址:www.fjhxbank.com

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:彭纯
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)上海浦东发展银行股份有限公司
注册地址:上海市中山东一路12号
办公地址:上海市中山东一路12号
法定代表人:高国富
联系人:唐苑
客户服务电话:95528
网址:www.spdb.com.cn

6)上海银行股份有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区银城中路168号
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区银城中路168号
法定代表人:金煜
联系人:汤征程
客户服务电话:95594
网址:www.bosc.cn

7)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

8)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
联系人:邓炯鹏
客户服务电话:95555
网址:www.cmbchina.com

9)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

10)中国银行股份有限公司
注册地址:北京市复兴门内大街1号
办公地址:北京市复兴门内大街1 号
法定代表人:陈四清
联系人:陈洪源
客户服务电话:95566
网址:www.boc.cn

11)中信银行股份有限公司
注册地址:北京市东城区朝阳门北大街9号
办公地址:北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座
法定代表人:李庆萍
联系人:迟卓
客户服务电话:95558
网址:bank.ecitic.com

12)珠海华润银行股份有限公司
注册地址:中国广东珠海市吉大九洲大道东1346号
办公地址:中国广东珠海市吉大九洲大道东1346号
法定代表人:刘晓勇
联系人:李阳
客户服务电话:400-880-0338或96588(广东省外请加拨0756)
网址:www.crbank.com.cn

(2)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
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)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
联系人:何耀
客户服务电话:95525
网址:www.ebscn.com

8)广州证券股份有限公司
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:邱三发
联系人:梁微
客户服务电话:95396
网址:www.gzs.com.cn

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
联系人:芮敏祺
客户服务电话:400-8888-666/95521
网址:www.gtja.com

11)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

12)海通证券股份有限公司
注册地址:上海市广东路689号
办公地址:上海市黄浦区广东路689号
法定代表人:周杰
联系人:赵洋洋
客户服务电话:95553
网址:www.htsec.com

13)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

14)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号华西证券大厦
办公地址:四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦
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

15)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:95323/4001099918(全国)/029-68918888(西安)
网址:www.cfsc.com.cn

16)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

17)平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:曹实凡
联系人:周一涵
客户服务电话:95511-8
网址:stock.pingan.com

18)上海华信证券有限责任公司
注册地址:上海浦东新区世纪大道100号环球金融中心9楼
办公地址:上海市黄埔区南京西路399号明天广场20楼
法定代表人:陈灿辉
联系人:徐璐
客户服务电话:400-820-5999
网址:www.shhxzq.com

19)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

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:夏旻
客户服务电话:95391/4008005000
网址:www.tfzq.com

21)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

22)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

23)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

24)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

25)浙商证券股份有限公司
注册地址:浙江省杭州市西湖区杭大路1号黄龙世纪广场A座
办公地址:杭州市江干区五星路201号浙商证券大楼8楼
法定代表人:吴承根
联系人:陈姗姗
客户服务电话:95345
网址:www.stocke.com.cn

26)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:毕明建(代)
联系人:杨涵宇
客户服务电话:4009101166
网址:www.cicc.com.cn

27)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:4008-888-888/95551
网址:www.chinastock.com.cn

28)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18-21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:95532/4006008008
网址:www.china-invs.cn

29)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

30)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

31)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

32)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:刘晓明
客户服务电话:95548
网址:http://sd.citics.com

(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:彭文德
联系人:刘芸
客户服务电话:400-8877-780
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

(4)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:95055-9
网址:https://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)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:王诗玙
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)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01、02/03室
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02/03室
法定代表人:胡燕亮
联系人:李娟
客户服务电话:021-50810673
网址:www.wacaijijin.com

7)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

8)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:凌顺平
联系人:吴强
客户服务电话:4008773772
网址:www.5ifund.com

9)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。

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:吕红、黎明

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
法定代表人: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:魏佳亮
经办会计师:许康玮、陈熹

第四部分 基金的名称

本基金的名称:鹏华优势企业股票型证券投资基金

第五部分 基金的运作方式与类型

契约型开放式,股票型基金

第六部分 基金的投资目标

在有效控制风险的前提下,精选具备竞争优势的优质企业进行投资,力求获取超额收益与长期资本增值。

第七部分 基金的投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、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、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、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不低于80%;投资于具备竞争优势的公司的证券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,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%。

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。

第八部分 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的绝对水平和增长率、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,在此基础上对各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估,制定股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。

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的公司,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)"具备竞争优势的公司"的定义

本基金所述的"具备竞争优势的公司"是指所处行业的领先者,一般在以下一个或多个领域具有优势:定价能力、创新技术、公司治理、品牌价值、销售渠道、服务品质、市场占有率等,这使得公司在所处行业中具备较强的核心竞争力,难以被竞争对手轻易模仿、替代或超越。这类公司在经济增长时能创造持续性的成长,经济不振时亦能度过难关,享有高于行业长期平均水平的盈利能力。

除上述描述之外,如果某些细分行业和公司同样符合"具备竞争优势的公司"的定义,本基金也会酌情将其纳入"具备竞争优势的公司"的投资范围。

未来如果基金管理人认为有更适当的"具备竞争优势的公司"的划分标准,基金管理人有权对上述界定方法进行变更。本基金由于上述原因变更界定方法不需经基金份额持有人大会通过,但应及时告知基金托管人并公告。

若因基金管理人界定方法的调整等原因导致本基金持有的 "具备竞争优势的公司" 的证券的比例低于非现金基金资产的80%,本基金将在三十个交易日之内进行调整。

(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、历史比较和增长性分析,确定具有上升基础的股价水平。

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。

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。

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。

第九部分 基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准:沪深300指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20%

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的指数时,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。

第十部分 基金的风险收益特征

本基金属于股票型基金,其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金,属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种。

第十一部分 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年4月18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1月1日起至2019年3月31日止。

1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	492,420,998.76	90.93
	其中:股票	492,420,998.76	90.93
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,020,000.00	0.19
	其中:债券	1,020,000.00	0.19
	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	47,972,024.28	8.86
8	其他资产	102,812.44	0.02
9	合计	541,515,835.48	100.00

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	26,430,924.80	4.90
B	采矿业	-	-
C	制造业	403,595,513.16	74.88
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	24,148,544.40	4.48
J	金融业	33,521,280.40	6.22
K	房地产业	4,724,736.00	0.88
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	492,420,998.76	91.36

(2)报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注: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

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	000661	长春高新	142,965	45,318,475.35	8.41
2	002475	立讯精密	1,129,330	28,007,384.00	5.20
3	000063	中兴通讯	958,446	27,986,623.20	5.19
4	300498	温氏股份	651,008	26,430,924.80	4.90
5	600566	济川药业	712,047	24,579,862.44	4.56
6	002463	沪电股份	1,962,178	22,623,912.34	4.20
7	603338	浙江鼎力	263,940	21,896,462.40	4.06
8	000858	五 粮 液	228,600	21,717,000.00	4.03
9	603517	绝味食品	439,534	21,633,863.48	4.01
10	000651	格力电器	445,699	21,041,449.79	3.90

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)	1,020,000.00	0.19
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,020,000.00	0.19

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	113529	绝味转债	10,200	1,020,000.00	0.19

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。

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

(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)济川药业

本次公告原因为泰州环保局对公司进行全面检查,公司收到泰州市环保出具的违规情况的《泰州市环境保护局行政处罚决定书(泰环罚字[2018]2-335号)》。

2018年7月4日,泰州环保局对济川有限废水、废渣及废气的处理情况进行了现场检查,发现以下3个问题:1)济川有限开发区分厂污水处理设施尾气非甲烷总烃排放浓度均值超标0.08倍;2)中药车间两套乙醇回收装置的不凝性尾气(主要成份乙醇)经收集后未使用污染防治设施直接高空排放;3)两个车间出渣室含挥发性有机物废气(主要成份乙醇)也未收集处理。2018年7月10日,泰州环保局下发了《责令改正违法行为决定书》(责令济川有限立即停止超标排放大气污染物的行为。)

泰州市环保局根据《中华人民共和国大气污染防治法》第十八条和第四十五条的规定,判断公司未采取有效措施防治含挥发性有机物废气、废气超标排放的违法行为。鉴于济川有限积极改正环境违法行为,且情节轻微,根据相关规定中关于从轻行政处罚的情形,泰州环保局作出对济川有限未采取有效措施防治含挥发性有机物废气的行为罚款8万元,对废气超标排放的行为罚款10万元的处罚决定。

此事件发生以来到现在,在环保局的指导下,公司坚持规范环保要求,今后公司将进一步加强日常管理,合规地开展各项业务。目前,公司的经营情况正常。

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。上述通告对该公司债券的投资价值不产生重大影响。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。

中兴通讯

本基金前十大持仓中的中兴通讯股份有限公司于2018年6月12日公告:本公司和全资子公司深圳市中兴康讯电子有限公司(以下简称"中兴康讯",与本公司合称"中兴通讯")已与BIS达成《替代的和解协议》(以下简称"协议")以替代中兴通讯于2017年3月与BIS达成的《和解协议》。BIS已于2018年6月8日(美国时间)通过《关于中兴通讯的替代命令》(以下简称"2018年6月8日命令")批准协议立即生效。根据协议,中兴通讯将支付合计14亿美元民事罚款,包括在BIS签发2018年6月8日命令后60日内一次性支付10亿美元,以及在BIS签发2018年6月8日命令后90日内支付至由中兴通讯选择、经BIS批准的美国银行托管账户并在监察期内(定义见下文)暂缓的额外的4亿美元罚款(监察期内若中兴通讯遵守协议约定的监察条件和2018年6月8日命令,监察期届满后4亿美元罚款将被豁免支付)。在中兴通讯根据协议和2018年6月8日命令(1)及时全额支付10亿美元及(2)将额外的4亿美元支付至美国银行托管账户后,BIS将终止其于2018年4月15日(美国时间)激活的拒绝令(以下简称"2018年4月15日拒绝令")并将中兴通讯从《禁止出口人员清单》中移除。如果上述条件均满足且中兴通讯已从《禁止出口人员清单》中移除,BIS将对外公布。协议还包括以下主要条款:1、BIS将做出自其签发2018年6月8日命令起为期十年(以下简称"监察期")的新拒绝令(以下简称"新拒绝令"),包括限制及禁止中兴通讯申请、获取、或使用任何许可证、许可例外,或出口管制文件、及以任何方式从事任何涉及受《美国出口管理条例》(以下简称 "条例")约束的任何物品、软件、或技术等交易,但在中兴通讯遵守协议和2018年6月8日命令的前提下,新拒绝令在监察期内将被暂缓执行,并在监察期届满后予以豁免。2、中兴通讯将在BIS签发2018年6月8日命令后30日内更换本公司和中兴康讯的全部董事会成员。更换董事会成员后30日内,中兴通讯应在董事会设立由三位或以上的新独立董事组成的特别审计/合规委员会。董事长可担任该委员会委员但不可担任该委员会主席。3、中兴通讯将在BIS签发2018年6月8日命令后30日内与本公司和中兴康讯的现任高级副总裁及以上所有的高层领导,以及任何参与、监督BIS于2017年3月签发的建议指控函或2018年4月15日拒绝令所涉行为或其他对该等所涉行为负有责任的管理层或高级职员解除合同,并且禁止中兴通讯及其子公司或关联企业再聘用上述人员。中兴通讯应及时向BIS通报本条款的执行情况,BIS可以自由裁量是否对相关人员进行豁免。4、中兴通讯将在BIS签发2018年6月8日命令后30日内自费聘任一名独立特别合规协调员(以下简称"协调员"),协调员将负责协调、监察、评估和汇报中兴通讯及其全球子公司或关联企业在监察期内遵守1979年《美国出口管理法案》、条例、协议和2018年6月8日命令的情况,并平等向中兴通讯总裁和董事会、BIS汇报。5、中兴通讯将完成并提交九份遵守美国出口管制法律的审计报告,在根据本公司与美国司法部达成的协议(请见本公司于2017年3月7日发布的公告)及任何相关法院命令而设置的独立合规监察官任期满后,剩余六份审计报告将由协调员完成。6、中兴通讯将为其领导、管理层及雇员、全球子公司、关联企业及中兴通讯所有及控制的其他实体的领导、管理层及雇员提供广泛的适用的出口管制培训。本公司将在BIS终止2018年4月15日拒绝令后尽快恢复受2018年4月15日拒绝令影响的经营活动。本公司将全面评估2018年4月15日拒绝令和协议对2018年第一季度报告的影响,重新编制及披露2018年第一季度报告。

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,认为公司的上述行为尽管会对公司的短期经营状况及业绩产生一定影响,但我们认同该公司的长期价值。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)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(人民币元)
1	存出保证金	86,436.22
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	11,327.39
5	应收申购款	5,048.83
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	102,812.44

(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。

第十二部分 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。

	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
2017年11月29日(基金合同生效日)至2017年12月31日	0.15%	0.23%	-0.42%	0.68%	0.57%	-0.45%
2018年01月01日至2018年12月31日	-26.02%	1.56%	-19.28%	1.07%	-6.74%	0.49%
2019年01月01日至2019年03月31日	33.58%	1.41%	22.78%	1.24%	10.80%	0.17%
自基金合同生效日至2019年03月31日	-1.03%	1.49%	-1.31%	1.09%	0.28%	0.40%

第十三部分 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、律师费和诉讼费;
5、基金份额持有人大会费用;
6、基金的证券交易费用;
7、基金的银行汇划费用;
8、证券账户开户费用、账户维护费用;
9、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:

$H = E \times 1.50\% \div$ 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,逐日累计至每个月月末,按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起2-5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

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:

$H = E \times 0.25\% \div$ 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,逐日累计至每个月月末,按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起2-5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

上述"一、基金费用的种类中第3-9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

本基金对通过直销柜台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,包括全国社会保障基金、可以投资基金的地方社会保障基金、企业年金单一计划以及集合计划。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柜台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	1.5%	0.6%
100万≤M＜500万	1.0%	0.3%
500万≤M＜1000万	0.3%	0.06%
M≥1000万	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天	1.5%
7天≤Y＜30天	0.75%
30天≤Y＜1年	0.5%
1年≤Y＜2年	0.25%
Y≥2年	0

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(1年以365天记)。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。

第十四部分 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"部分明确了本次招募说明书更新的内容。
2、对涉及信息披露相关的内容进行了更新。

鹏华基金管理有限公司
2020年4月