

# 鹏华恒生中国央企交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 基金产品资料概要 (更新)

编制日期: 2024 年 06 月 26 日

送出日期: 2024 年 06 月 28 日

本概要提供本基金的重要信息, 是招募说明书的一部分。  
作出投资决定前, 请阅读完整的招募说明书等销售文件。

## 一、产品概况

基金简称	鹏华恒生中国央企ETF (QDII)	基金代码	513170
基金管理人	鹏华基金管理有限公司	基金托管人	中国工商银行股份有限公司
境外投资顾问 (若有)	-	境外托管人 (若有)	香港上海汇丰银行有限公司
基金合同生效日	2024 年 04 月 10 日	上市交易所及上市日期 (若有)	上海证券交易所 / 2024 年 04 月 19 日
基金类型	股票型	交易币种	人民币
运作方式	普通开放式	开放频率	每个开放日
基金经理	李悦	开始担任本基金基金经理的日期	2024 年 04 月 10 日
		证券从业日期	2018 年 07 月 13 日
	余展昌	开始担任本基金基金经理的日期	2024 年 04 月 10 日
		证券从业日期	2017 年 07 月 07 日
场内简称	恒生央企 (扩位简称: 恒生央企 ETF)		
其他 (若有)	<p>《基金合同》生效后, 连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的, 基金管理人应当在定期报告中予以披露; 连续 60 个工作日出现前述情形的, 基金管理人应当在 10 个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案, 如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等, 并在 6 个月内召集基金份额持有人大会。</p> <p>未来若出现标的指数不符合要求 (因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外)、指数编制机构退出等情形, 基金管理人应当自该情形发生之日起十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案, 如更换基金标的指数、转换运作方式, 与其他基金合并、或者终止基金合同等, 并在 6 个月内召集基金份额持有人大会进行表决, 基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的, 基金合同终止。</p>		

注：无。

## 二、基金投资与净值表现

### （一）投资目标与投资策略

本部分请阅读《鹏华恒生中国央企交易型开放式指数证券投资基金（QDII）招募说明书》“基金的投资”了解详细情况。

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资范围	<p>本基金标的指数为恒生中国央企指数收益率及其未来可能发生的变更。</p> <p>本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股（含存托凭证）。</p> <p>为更好的实现投资目标，本基金可投资于境外市场和境内市场依法发行的金融工具。本基金境外市场投资工具包括香港交易所上市的股票（含存托凭证）、在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金（包括交易型开放式指数基金（ETF））；政府债券、公司债券等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的期权、期货等金融衍生产品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。</p> <p>在投资香港市场时，本基金可通过合格境内机构投资者（QDII）境外投资额度或内地与香港股票市场交易互联互通机制进行投资。</p> <p>本基金境内市场投资工具包括国内依法发行或上市交易的股票（包含主板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、存托凭证、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、地方政府债、中期票据、短期融资券、超短期融资券）、同业存单、债券回购、银行存款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的相关规定）。本基金可依据法律法规的规定，参与融资及转融通证券出借业务。</p> <p>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。</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股</p>

	<p>（含存托凭证）的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。</p> <p>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，本基金的投资比例会做相应调整。</p>
主要投资策略	<p>本基金采用完全复制策略，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。</p> <p>因特殊情况导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可采取包括成份股（含存托凭证）替代策略在内的其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到紧密跟踪标的指数的目的。特殊情况包括但不限于以下情形：（1）法律法规的限制；（2）标的指数成份股（含存托凭证）流动性严重不足；（3）标的指数的成份股（含存托凭证）长期停牌；（4）标的指数成份股（含存托凭证）进行配股或增发；（5）标的指数成份股（含存托凭证）派发现金股息；（6）指数成份股（含存托凭证）定期或临时调整；（7）标的指数编制方法发生变化；（8）税务、外汇额度及其他监管限制；（9）其它合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等。</p> <p>1、股票投资策略；2、债券投资策略；3、金融衍生品投资策略；4、存托凭证投资策略；5、融资及转融通投资策略；6、基金投资策略。</p>
业绩比较基准	恒生中国央企指数收益率（经汇率调整后）
风险收益特征	<p>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、债券型基金、混合型基金。同时本基金为交易型开放式指数基金，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。此外，本基金投资境外市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，还面临汇率风险以及境外市场的风险。</p>

**（二）投资组合资产配置图表/区域配置图表**

**（三）自基金合同生效以来/最近十年（孰短）基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图**

**三、投资本基金涉及的费用**

**（一）基金销售相关费用**

注：投资者在申购或赎回基金份额时，申购赎回代理机构可按照不超过 0.50% 的标准收取佣金。场内交易费用以证券公司实际收取为准。

## （二）基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除：

费用类别	收费方式/年费率或金额	收取方
管理费	0.5%	基金管理人和销售机构
托管费	0.15%	基金托管人
销售服务费	-	销售机构
审计费用	50000.00 元	会计师事务所
信息披露费	-	规定披露报刊
指数许可使用费 (若有)	-	指数编制公司
其他费用	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	相关服务机构

注：1、本基金交易证券等产生的费用和税负，按实际发生额从基金资产扣除。

2、审计费用、信息披露费和指数许可使用费（若有）为基金整体承担费用，非单个份额类别费用，且年金额为预估值，最终实际金额以基金定期报告披露为准。

## 四、风险揭示与重要提示

### （一）风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。

投资有风险，投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。

#### 1、本基金特定风险

##### （1）以 ETF 方式运作的特有风险

##### 1) 标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险

标的指数并不能完全代表整个股票市场。标的指数成份股的平均回报率与整个股票市场的平均回报率可能存在偏离。

##### 2) 标的指数波动的风险

标的指数成份股的价格可能受到政治因素、经济因素、上市公司经营状况、投资者心理和交易制度等各种因素的影响而波动，导致指数波动，从而使基金收益水平发生变化，产生风险。

##### 3) 基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

##### 4) 跟踪误差控制未达约定目标的风险

本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35% 以内，年化跟踪误差控制在 4% 以内，但因标的指数编制规则调整或其他因素可能导致跟踪误差超过上述范围，本基金净值表现与指数价格走势可能发生较大偏离。

##### 5) 标的指数变更的风险

尽管可能性很小，但根据基金合同规定，如出现变更标的指数的情形，本基金将变更标的指数。基于原标的指数的投资政策将会改变，投资组合将随之调整，基金的收益风险特征将与新的标的指数保持一致，投资者须承担此项调整带来的风险与成本。

6) 指数编制机构停止服务的风险

7) 基金份额二级市场交易价格折溢价的风险

尽管本基金将通过有效的套利机制使基金份额二级市场交易价格的折溢价控制在一定范围内，但基金份额在证券交易所的交易价格受诸多因素影响，存在不同于基金份额净值的情形，即存在价格折溢价的风险。

8) 参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险

基金管理人或者基金管理人委托中证指数有限公司计算基金份额参考净值（IOPV），并由上海证券交易所交易时间发布，供投资人交易、申购、赎回基金份额时参考。IOPV 与实时的基金份额净值可能存在差异，IOPV 计算可能出现错误，投资者若参考 IOPV 进行投资决策可能导致损失，需投资者自行承担。

9) 成份股停牌的风险

10) 退市风险

因本基金不再符合证券交易所上市条件被终止上市，或被基金份额持有人大会决议提前终止上市，导致基金份额不能继续进行二级市场交易的风险。

11) 投资者申购失败的风险

如果投资者申购时未能提供符合要求的申购对价，或者基金管理人根据基金合同的规定拒绝投资者的申购申请，则投资者的申购申请失败。

12) 投资者赎回失败的风险

在投资者提交赎回申请时，如本基金投资组合内不具备足额的符合要求的赎回对价，可能导致出现赎回失败的情形。

另外，基金管理人可能根据成份股市值规模变化等因素调整最小申购赎回单位，由此可能导致投资者按原最小申购赎回单位申购并持有的基金份额，可能无法按照新的最小申购赎回单位全部赎回，而只能在二级市场卖出全部或部分基金份额。

13) 基金份额赎回对价的变现风险

本基金赎回对价包括现金替代、现金差额等，未来可能包含组合证券。在组合证券变现过程中，由于市场变化、部分成份股流动性差等因素，导致投资者变现后的价值与赎回时赎回对价的价值有差异，存在变现风险。

14) 基金管理人代理申赎投资者买券卖券的风险

15) 本基金为境内募集和上市交易、投资于境内外证券市场、跟踪特定指数的交易型开放式指数基金，涉及到境内、境外的证券市场，境外证券交易所、期货交易所、证券与期货登记机构的交易规则、业务规则和市场惯例与境内有较大差异，相关市场参与主体涉

及跨境业务的处理能力、经验、系统等有待验证，从而导致本基金的运作可能受到影响而带来风险。

#### （2）港股投资风险

本基金可通过港股通投资于港股，也可通过合格境内机构投资者（QDII）境外投资额度投资于港股，会面临因投资环境、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。

#### （3）汇率风险

本基金以人民币募集和计价，指数成份股中包含香港市场股票。港币相对于人民币的汇率变化将会影响本基金以人民币计价的基金资产价值，从而导致基金资产面临潜在风险。人民币对港币的汇率的波动也可能加大基金净值的波动，从而对基金业绩产生影响。此外，由于基金运作中的汇率取自汇率发布机构，如果汇率发布机构出现汇率发布时间延迟或是汇率数据错误等情况，可能会对基金运作或者投资者的决策产生不利影响。

#### （4）法律和政治风险

由于香港市场适用不同法律法规的原因，可能导致本基金的某些投资行为受到限制或合同不能正常执行，从而使得基金资产面临损失的可能性。此外，香港市场可能会不时采取某些管制措施，如资本或外汇管制、没收资产以及征收高额税收等，从而对基金收益以及基金资产带来不利影响。

#### （5）会计制度风险

香港市场对上市公司日常经营活动的会计处理、财务报表披露等会计核算标准的规定可能与境内存在一定差异，可能导致基金经理对公司盈利能力、投资价值的判断产生偏差，从而给本基金投资带来潜在风险。

#### （6）税务风险

香港市场在税务方面的法律法规可能与境内存在一定差异，可能会要求基金就股息、利息、资本利得等收益向当地税务机关缴纳税金，该行为会使基金收益受到一定影响。此外，香港市场的税收规定可能发生变化，或者实施具有追溯力的修订，从而导致基金向该市场所在地缴纳在基金销售、估值或者出售投资当日并未预计的额外税项。

#### （7）投资工具的相关风险

##### 1) 股票

股票投资风险主要包括：货币政策、财政政策、产业政策等的变化对证券市场产生一定的影响，导致市场价格水平波动的风险；宏观经济运行周期性波动，对股票市场的收益

水平产生影响的风险；市场挂牌交易的上市公司经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务等都会导致公司盈利发生变化，从而导致股票价格变动的风险。

#### 2) 债券

债券投资风险主要包括：市场利率水平变化导致债券价格变化的风险；债券市场不同期限、不同类属债券之间的利差变动导致相应期限和类属债券价格变化的风险；债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息，或由于债券发行人信用质量下降导致债券价格下降的风险。

#### 3) 衍生品

由于金融衍生产品具有杠杆效应，价格波动较为剧烈，在市场面临突发事件时，可能会导致投资亏损高于初始投资金额，从而对基金收益带来不利影响。此外，衍生品的交易可能不够活跃，在市场变化时，可能因无法及时找到交易对手或交易对手方压低报价，导致基金资产的额外损失。

#### 4) 正回购/逆回购

在回购交易中，交易对手方可能因财务状况或其他原因不能履行付款或结算的义务，从而对基金资产价值造成不利影响。

#### 5) 证券借贷

作为证券借出方，如果交易对手方（即证券借入方）违约，则基金可能面临到期无法获得证券借贷收入甚至借出证券无法归还的风险，从而导致基金资产发生损失。

#### 6) 存托凭证

本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于股票的基金所面临的共同风险外，还将面临存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与存托凭证发行机制相关的风险，包括存托凭证持有人与基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险；存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；因多地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；存托凭证退市的风险；已上市的基础证券发行人，在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险；法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。

#### 7) 基金参与境内融资与转融通证券出借业务的风险

本基金可根据法律法规和基金合同的约定参与境内融资，可能存在杠杆投资风险和对对手方交易风险等融资特有风险。

本基金可参与境内转融通证券出借业务，面临的风险包括但不限于：流动性风险，指面临大额赎回时，可能因证券出借原因发生无法及时变现支付赎回款项的风险；信用风险，指证券出借对手方可能无法及时归还证券、无法支付相应权益补偿及借券费用的风险；市场风险，指证券出借后可能面临出借期间无法及时处置证券的市场风险；其他风

险，如宏观政策变化、证券市场剧烈波动、个别证券出现重大事件、交易对手方违约、业务规则调整、信息技术不能正常运行等风险。

8) 第三方机构服务的风险

2、流动性风险及实施备用流动性风险管理工具的风险。

3、运作风险及其他风险，包括操作或技术风险、政策变更风险及不可抗力风险等。

4、本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险。

## **(二) 重要提示**

中国证监会对本基金的注册或核准，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。

基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人。

基金产品资料概要信息发生重大变更的，基金管理人将在三个工作日内更新，其他信息发生变更的，基金管理人每年更新一次。因此，本文件内容相比基金的实际情况可能存在一定的滞后，如需及时、准确获取基金的相关信息，敬请同时关注基金管理人发布的相关临时公告等。

因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力。除非仲裁裁决另有规定，仲裁费用由败诉方承担。

## **五、其他资料查询方式**

以下资料详见鹏华基金官方网站[[www.phfund.com.cn](http://www.phfund.com.cn)][客服电话：400-6788-533]

- (1) 基金合同、托管协议、招募说明书
- (2) 定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告
- (3) 基金份额净值
- (4) 基金销售机构及联系方式
- (5) 其他重要资料

## **六、其他情况说明**

无。