

鹏华中证沪港深科技龙头指数证券投资基金（LOF）（C类基金份额）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	鹏华中证沪港深科技龙头指数（LOF）C	基金代码	012809
基金管理人	鹏华基金管理有限公司	基金托管人	招商银行股份有限公司
基金合同生效日	2021年12月07日	上市交易所及上市日期（若有）	-
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	闫冬	开始担任本基金基金经理的日期	2021年12月07日
		证券从业日期	2010年07月06日
其他（若有）	《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6个月内召集基金份额持有人大会。		

注：无。

二、基金投资与净值表现

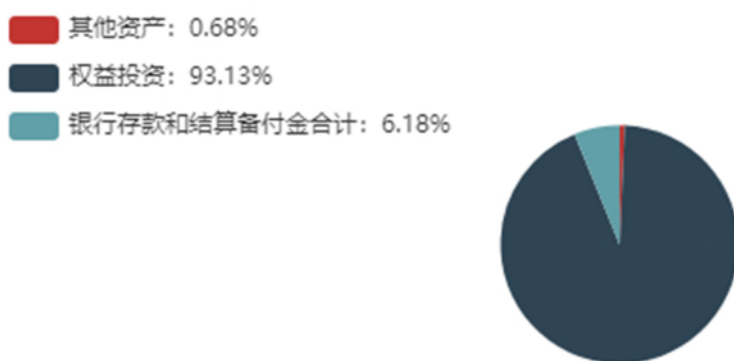
（一）投资目标与投资策略

本部分请阅读《鹏华中证沪港深科技龙头指数证券投资基金（LOF）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。
投资范围	本基金标的指数为中证沪港深科技龙头指数及其未来可能发生的变更。

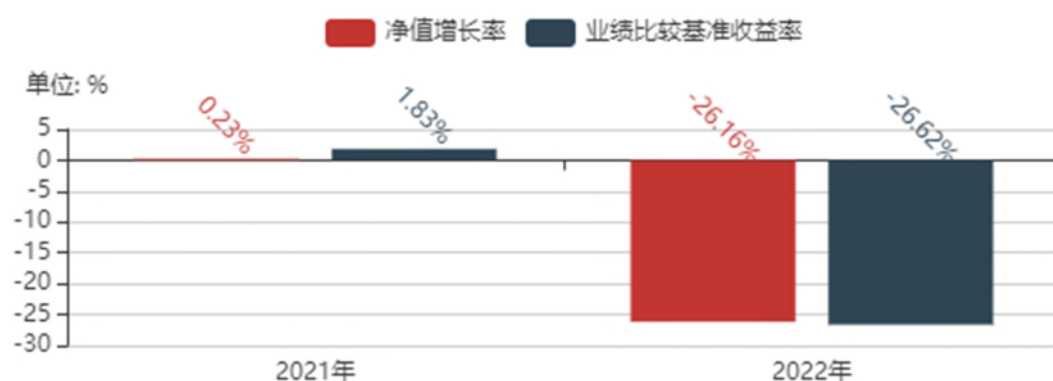
	<p>本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及其备选成份股（包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、港股通标的股票、债券（含国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券等）、债券回购、银行存款、货币市场工具、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。</p> <p>本基金可依据法律法规的规定，参与融资及转融通证券出借业务。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</p> <p>基金的投资组合比例为：投资于标的指数成份股和备选成份股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%；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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</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，本基金的投资范围会做相应调整。</p>
主要投资策略	<p>1、股票投资策略；2、债券投资策略；3、股指期货投资策略；4、资产支持证券的投资策略；5、本基金将在充分考虑风险和收益特征的基础上，审慎参与融资及转融通业务。</p>
业绩比较基准	<p>中证沪港深科技龙头指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%</p>
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。本基金为指数型基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金将投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p>

(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表



上述披露数据截止时间为2023年06月30日。

(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



合同生效当年按照实际存续期计算，上述披露数据截止时间为2022年12月31日，基金的过往业绩不代表未来表现。

三、投资本基金涉及的费用

(一) 基金销售相关费用

以下费用在申购/赎回基金过程中收取，其中，对通过直销中心申购的养老金客户适用特定费率（详情请查阅招募说明书），其他投资人适用下表一般费率：

费用类型	金额 (M) / 持有期限 (N)	收费方式/费率	备注
申购费	M	-	-
赎回费	N < 7 日	1.50%	-
	7 日 ≤ N	0	-

注：本基金 C 类基金份额不收取申购费用、不开放场内申购赎回。

(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	0.6%	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	0.3%	销售机构
审计费用	36000 元	会计师事务所
信息披露费	80000 元	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。

(三) 基金运作综合费用测算

若投资者申购本基金份额, 在持有期间, 投资者需支出的运作费率如下表:

基金运作综合费率(年化)
1.27%

注: 基金运作综合费率测算中的基金管理费率、托管费率、销售服务费率(若有)为基金现行合同费率, 不含费率优惠, 其他运作费用以最近一次基金年报披露的相关数据为基准测算。

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) 作为指数基金存在的风险

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) 标的指数变更的风险

根据基金合同规定, 如发生导致标的指数变更的情形, 基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则, 变更本基金的标的指数。若标的指数发生变更, 本基金的投资组合将相应进行调整。届时本基金的风险收益特征可能发生变化, 且投资组合调整可能产生交易成本和机会成本。投资者须承担因标的指数变更而产生的风险与成本。

3) 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控制在 0.35% 以内, 年跟踪误差控制在 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。

4) 指数编制机构停止服务的风险

本基金的标的指数由指数编制机构发布并管理和维护，未来指数编制机构可能由于各种原因停止对指数的管理和维护，本基金将根据基金合同的约定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。投资人将面临更换基金标的指数、转换运作方式，与其他基金合并、或者终止基金合同等风险。

自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定并实施前，基金管理人应按照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作，该期间由于标的指数不再更新等原因可能导致指数表现与相关市场表现存在差异，影响投资收益。

5) 成份股停牌的风险

6) 基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

(2) 作为上市基金存在的风险

本基金在基金合同生效且符合上市交易条件后，在深圳证券交易所挂牌上市交易。基金价格受到供求关系的影响，本基金份额市场交易价格与基金份额净值可能会出现较大背离，从而直接或间接地给投资者造成损失；由于上市期间可能因信息披露导致基金停牌，投资人在停牌期间不能买卖基金，产生风险；同时，可能因上市后交易对手不足导致基金流动性风险；另外，当基金份额持有人将份额转向场外交易后导致场内的基金份额或持有人数不满足上市条件时，本基金存在暂停上市或终止上市的可能。

(3) 港股通机制下，港股投资风险

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括港股通机制下允许投资的香港联合交易所（以下简称：“香港联交所”或“联交所”）上市港股通标的股票，除与其他投资于内地市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还面临港股通机制下因投资环境、投资者结构、投资标的构成、市场制度以及交易规则等差异所带来的特有风险，包括但不限于：市场联动的风险；股价波动的风险；汇率风险；港股通额度限制；港股通可投资标的的范围调整带来的风险；港股通交易日设定的风险；交收制度带来的基金流动性风险；港股通下对公司行为的处理规则带来的风险；香港联合交易所停牌、退市等制度性差异带来的风险；港股通规则变动带来的风险及其他可能的风险。

(4) 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。

(5) 本基金投资资产支持证券，资产支持证券是一种债券性质的金融工具。

资产支持证券的风险主要包括资产风险及证券化风险。资产风险源于资产本身，包括价格波动风险、流动性风险等。证券化风险主要表现为信用评级风险、法律风险等。

(6) 参与融资及转融通证券出借业务的风险

本基金可参与融资及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、信用风险、市场风险及其他风险，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。

2、普通股票型证券投资基金共有的风险，如管理风险、流动性风险、技术风险及其他风险等。

3、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深圳国际仲裁院，按照深圳国际仲裁院届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为深圳市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力，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][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。