鹏华中证500指数证券投资基金(LOF)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:中国工商银行股份有限公司

二〇一〇年九月

重要提示

本基金经2009年12月15日中国证券监督管理委员会下发的《关于核准鹏华中证500指数证券投资基金(LOF)募集的批复》(证监许可[2009]1374号文)核准,进行募集,并经中国证监会基金部2010年2月5日基金部函[2010]62号文件《关于鹏华中证500指数证券投资基金(LOF)备案确认的函》确认合法备案。根据相关法律法规,本基金基金合同已于2010年2月5日生效,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核准,但中国证监会对本基金募集的核准,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。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

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、基金受易价格与份额净值发生偏离的风险、基金管理风险、流动性风险、本基金指数投资有关风险、技术风险、上市交易的风险及其他风险,等等。

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者基金投资的"买者自负"原则,在投资者作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行承担。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。投资有风险,投资者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。

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2010年8月4日,有关财务数据和净值表现截止日为2010年6月30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:0755-82021102 传真:0755-82021155

7.联系人:罗娜

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。

胡继之先生,董事,金融学博士,高级经济师,国籍:中国。历任中国人民银行武汉市分行办公室科长、金融研究所副所长、所长,中国人民银行深圳分行办公室负责人,深圳证券交易所总经理助理兼办公室主任、理事会秘书长、策划总监、纪委书记、党委委员、副总经理,现任国信证券股份有限公司总裁、党委副书记。

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,现任国信证券股份有限公司副总裁。

Ciro Beffi先生,董事,会计学博士,审计师,国籍:意大利。曾在普华会计师事务所主管银行与金融部门业务,历任那波里银行资产管理股份公司(Banco Di Napoli Asset Management SGR)总经理、圣保罗财富管理股份公司(Sanpaolo Wealth Management S.p.A.)(Eptacomsors股份公司、EPTA集团控股公司)代理执行董事、Eptafund股份公司(Eptafund SGR)董事、Cr Firenze Gestion International股份公司执行董事、SICAV集团董事,现任欧利盛资本股份公司(Eurizon Capital S.A.)(卢森堡)执行董事、Banca delle Marche Gestione Internazionale S.A.股份公司董事。

Alessandro Varaldo先生,董事,经济学和商业管理博士,国籍:意大利。曾任米兰德意志银行集团Finanza e Futuro Fondi Sprind股份公司投资管理部债券基金和现金头寸管理高级经理,IMI Fideuram资产管理股份公司投资管理部固定收益组合和现金管理业务负责人,圣保罗银行投资公司(Banca Sanpaolo Invest S.p.A.)财务及营销策划部负责人,Capitalia股份公司(Capitalia S.p.A.)产品和销售部负责人,Capitalia投资管理股份公司(Capitalia Investment Management S.A.)董事总经理,Unicredit Holding财务风险管理监督大利企业人风险管理业务负责人,现任欧利盛资本资产管理股份公司(Eurizon Capital SGR S.p.A)首席市场官、欧利盛资本股份公司(Eurizon Capital S.A.)(卢森堡)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、北京市人民政府顾问。

李相启先生,独立董事,高级经济师,研究员,国籍:中国。历任陕西省委办公厅秘书、省委政策研究室财贸处处长、副主任,陕西省经济体制改革委员会副书记、副主任、党组书记、主任,陕西省证券监管委员会主席,中国证监会济南证管办党委书记、主任,济南稽查局局长,山东证监局局长,上海证券交易所理事会理事,产品委员会主任。

宋弘先生,独立董事,经济学博士,国籍:中国。曾在美国哥伦比亚大学作访问学者,并在陕西省社科院工作,现任中国社会科学院世界经济与政治研究所国际贸易研究室主任、研究员、教授、博士生导师。

张新民先生,独立董事,管理学博士,会计学教授,博士生导师,国籍:中国。现任对外经济贸易大学副校长兼国际商学院院长,国务院特殊津贴专家,全国MBA教育指导委员会委员,英国特许公认会计师(FCCA),澳洲注册会计师(FCPA)。

2.基金管理人监事会成员

孙枫先生,监事会主席,国际金融专业硕士,高级会计师,中国注册会计师,国籍:中国。历任武汉市经济研究所副所长,武汉市轻工业局副局长,武汉友谊复印机制造公司副经理,深圳市财政局企财处处长、办公室主任、副局长,深圳市商业银行董事长、党委书记,深圳发展银行董事长、党委书记,鹏华基金管理有限公司董事长、党总支书记,现任鹏华基金管理有限公司监事会主席。

Pierre Bouchoms先生,监事,国籍:卢森堡,历任卢森堡普华会计师事务所(Price Waterhouse Luxembourg)高级审计,卢森堡TSB国际私人银行(TSB Private Bank International Luxembourg)经理助理,卢森堡圣保罗银行股份公司(SANPAOLO Bank S.A. Luxembourg)内部审计主管、组织部门主管,卢森堡圣保罗服务股份公司(SANPAOLO SERVICES LUXEMBOURG S.A.)总经理,卢森堡圣保罗财富管理股份公司(SANPAOLO WM Luxembourg S.A.)副总经理、总经理,卢森堡圣保罗资产管理股份公司(SANPAOLO AM Luxembourg S.A.)总经理,还曾担任卢森堡内部审计员机构董事会成员、职业发展部副主席,意大利Banca delle Marche国际管理部董事会成员,SUNGARD欧洲咨询委员会成员,现任欧利盛资本股份公司(Eurizon Capital S.A.)(卢森堡)副总经理。

黄前先生,监事,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,现任深圳市北融信投资发展有限公司董事长。

高鹏先生,职工监事,经济学硕士,国籍:中国。曾任博时基金管理有限公司监察法律部监察稽核经理,现任鹏华基金管理有限公司监察稽核部总经理。

刘慧红女士,职工监事,本科学历,国籍:中国。曾在中国工商银行深圳分行、平安证券公司工作,1998年12月加盟鹏华基金管理有限公司,现任鹏华基金管理有限公司登记结算部副总经理。

3.高级管理人员情况

何如先生,同上。

邓召明先生,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。

高阳先生,副总裁,经济学硕士,十年证券从业经验,CFA,国籍:中国。历任中国国际金融有限公司债券投资经理,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。

曹毅先生,副总裁,经济学博士,国籍:中国。历任中国人民银行广州分行科员,中国人民银行深圳中心支行副主任科员,南方基金管理有限公司市场拓展部副总监、渠道部总监,现任鹏华基金管理有限公司副总裁。

吴伟先生,督察长,法学博士,国籍:中国。曾任中国建设银行深圳市分行法律部副科长、2001年3月加盟鹏华基金管理有限公司,历任公司法律顾问、社保基金独立稽察员、监察稽核部总经理,现任公司督察长。

4.本基金基金经理

方南先生,工商管理硕士,8年证券从业经验。曾任职于杭州恒生电子股份有限公司,上海新利多数字技术有限公司。2001年11月加盟鹏华基金管理有限公司,历任金融工程部研究员、金融工程部总经理助理,现任鹏华沪深300指数基金基金经理助理。

本基金历任的基金经理:

2010年2月基金合同生效至今由方南先生担任本基金基金经理。

本报告期内本基金基金经理未发生变更。

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总裁、党总支书记。

高阳先生,鹏华基金管理有限公司副总裁。

冀洪涛先生,鹏华基金管理有限公司研究部总经理、鹏华普惠基金基金经理。

程世杰先生,鹏华基金管理有限公司基金管理部总经理,鹏华价值优势基金基金经理。

初冬女士,鹏华基金管理有限公司固定收益部总经理,鹏华社保基金理财经理及鹏华货币市场基金经理,投资决策委员会成员。

杨俊先生,鹏华基金管理有限公司机构投资部总经理,社保基金理财经理。

黄鑫先生,鹏华基金管理有限公司鹏华动力增长基金基金经理、鹏华中国50基金基金经理。

6.上述人员之间均不存在近亲属关系。

7.上述为本更新招募说明书所载内容截止日(2010年8月4日)前基金管理人主要人员情况。今后若发生变更,本基金管理人将按照法律法规规定及时公告。

二、基金托管人

(一)基金托管人基本情况

名称:中国工商银行股份有限公司

注册地址:北京市西城区复兴门内大街55号

成立时间:1984年1月1日

法定代表人:姜建清

注册资本:人民币334,018,850,026元

联系电话:010-66105799

联系人:蒋松元

(二)主要人员情况

截至2010年6月末,中国工商银行资产托管部共有员工121人,平均年龄30岁,95%以上员工拥有大学本科以上学历,高管人员均拥有硕士以上学位或高级职称。

(三)基金托管业务经营情况

作为中国首批开办证券投资基金托管业务的商业银行,中国工商银行始终坚持"诚实信用、勤勉尽责"的原则,严格履行着资产托管人的责任和义务,依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的业务管理模式、健全的托管业务系统、强大的市场营销能力,为广大基金份额持有人和众多资产管理机构提供安全、高效、专业的托管服务,取得了优异业绩。截至2010年6月,托管证券投资基金165只,其中封闭式9只,开放式156只。至今已形成包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社保基金、企业年金、股权投基金、QFII资产、QDII资产等产品在内的托管业务体系。2010年初,中国工商银行凭借在2009年国内外托管领域的杰出表现和品牌影响力,先后被英国《全球托管人》和香港《财资》评选为"2009年度中国最佳托管银行"。本届《财资》评选首次设立了亚太地区证券和基金服务领域有突出贡献的年度行业领导者奖项,中国工商银行资产托管部周月秋总经理荣获"年度最佳托管银行家"称号,是仅有的两位获奖人之一。自2004年以来,中国工商银行资产托管服务已经获得23项国内外大奖。

三、相关服务机构

(一)基金份额发售机构

1.场外发售机构

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:0755-82021102

传真:0755-82021155

联系人:罗娜

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:赵晓蔚

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801B室

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4312室

电话:027-85557881

传真:027-85557973

联系人:祁明兵

②代销机构:

①中国工商银行股份有限公司

注册(办公)地址:北京复兴门内大街55号

法定代表人:姜建清

客户服务电话:95588(全国)

联系人:田耕

网址:www.icbc.com.cn

②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:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

法定代表人:郭树清

传真:010-67598409

联系人:张静

客户服务电话:95533

网址:www.ccb.com

③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:项俊波

客户服务电话:95599

联系人:张令伟

网址:www.95599.cn

④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:肖钢

统一客户服务电话:95566

公司网站:www.boc.cn

⑤中国邮政储蓄银行有限责任公司

注册(办公)地址:北京市西城区宣武门西大街131号

法定代表人:刘安东

联系人:陈春林

传真:010-66415194

客户服务电话:95580

网址www.psbc.com

⑥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:胡怀邦

电话:021-58781234

传真:021-58408483

联系人:曹熔

客户服务电话:95559

网址:www.bankcomm.com

⑦招商银行股份有限公司

注册(办公)地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦

法定代表人:秦晓

电话:0755-83195475

传真:0755-83195049

联系人:丰靖

客服电话:95555

网址:www.cmbchina.com

⑧深圳发展银行股份有限公司

注册(办公)地址:深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦

法定代表人:法兰克纽曼(Frank N. Newman)

联系人:姜鹏

电话:0755-82088888

传真:0755-82080406

客服电话:95501

网址:www.sdb.com.cn

⑨平安银行股份有限公司

注册(办公)地址:深圳市深南中路1099号平安银行大厦

法定代表人:孙建一

联系人:崔兆龙

电话:0755-25859591

客服电话:40066-99999或(0755)961202

网址:www.pingan.com

⑩中信银行股份有限公司

注册(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:孔丹

客服电话:95558

联系人:郭伟

电话:010-65557013

传真:010-65550827

网址:http://bank.ecitic.com

⑪中国民生银行股份有限公司

注册(办公)地址:北京市东城区正义路甲4号

法定代表人:董文标

客户服务电话:95568

联系人:董云巍

传真:010-58560794

网址:www.cmbc.com.cn

⑫中国光大银行股份有限公司

注册(办公)地址:北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦?

法定代表人:唐双宁

联系人:李伟

电话:010-68098778

传真:010-68560661

客服电话:95595(全国)

网址:www.cebbank.com?

⑬上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址:上海市浦东新区浦东南路500号

办公地址:上海市中山东一路12号

法定代表人:吉晓辉

客户服务热线:95528

网址:www.spdb.com.cn

⑭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:北京市复兴门内大街1号

法定代表人:肖钢

统一客户服务电话:95566

公司网站:www.cib.com.cn

⑮北京银行股份有限公司

注册(办公)地址:北京市西城区金融大街丙17号

法定代表人:阎冰竹

电话:010-66226044,66223251

传真:010-66226045,66226047

客服电话:010-96169

网址:www.bankofbeijing.com.cn

⑯宁波银行股份有限公司

注册(办公)地址:宁波市江东区中山东路294号

法定代表人:陆华裕

电话:021-63586210

传真:021-63586215

联系人:胡技勤

客户服务电话:96528(上海地区962528)

网址:www.nbcb.com.cn

⑰东莞银行股份有限公司

注册(办公)地址:东莞市运河东一路193号

法定代表人:廖玉林

联系人:胡昱

客户服务电话:96228

网址:www.dongguanbank.cn

⑱杭州银行股份有限公司

地址:杭州市庆春路46号杭州银行大厦

法定代表人:马时雍

联系人:陈振峰

客户服务电话:0571-96523,4008888508

网址:www.hzbank.com.cn

⑲广东发展银行股份有限公司

住所:广州市农林下路83号

办公地址:广州市农林下路83号

法定代表人:李若虹

联系人:詹金鑫、张大奕

电话:020-38322542,38322974

传真:020-87311780

公司网址:http://ebank.gdb.com.cn

⑳浙商银行股份有限公司

注册地址:浙江省杭州市庆春路288号

办公地址:浙江省杭州市庆春路288号

法定代表人:张达洋

电话:0571-87659084

传真:0571-87659188

联系人:吴军阳

客户服务电话:95105665

㉑华夏银行股份有限公司

注册地址:北京市东城区建国门内大街22号

办公地址:北京市东城区建国门内大街22号

法定代表人:吴建

联系人:刘鹏

电话:010-85238667

传真:010-85238680

客服电话:95577

网址:www.hxb.com.cn

㉒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号国际企业大厦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:胡长金

客户服务电话:800-820-1868

传真:010-66568536

联系人:李洋

网址:www.chinastock.com.cn

㉓中银万国证券股份有限公司

注册地址:上海市常熟路171号

办公地址:上海市常熟路171号

法定代表人:丁国荣

电话:021-54033888

传真:021-54030294

联系人:曹晔

客户服务电话:021-962505

网址:www.sw2000.com.cn

㉔华泰联合证券有限责任公司

注册地址:深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦10、25层

办公地址:深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦10、25层

法定代表人:马晓明

电话:0755-82493870

传真:0755-82492062

客户服务热线:400-8888-555,0755-25125666

联系人:陶晓芸

公司网址:www.lhzq.com

㉕海通证券股份有限公司

注册地址:上海市淮海中路98号

办公地址:上海市黄浦区广东路689号

法定代表人:王开国

电话:021-23219000

传真:021-63410456

联系人:李荣鸣、金芸

客户服务电话:400-8888-001、021-962503

网址:www.htsec.com

㉖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:王明权

电话:021-68810000

传真:021-68815009

联系人:刘晓

客户服务电话:10108998

网址:www.ebscn.com

㉗宏源证券股份有限公司

住册地址:新疆乌鲁木齐市文艺路233号宏源大厦

办公地址:北京市西城区太平桥大街19号

法定代表人:汤世生

联系人:李威

电话:010-88085338

咨询电话:010-62267799-6789

网址:www.hongyuan.com.cn

㉘湘财证券有限责任公司

注册地址:湖南省长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼

办公地址:上海市浦东新区陆家嘴958号华能联合大厦5楼

法定代表人:陈学荣

电话:021-68634510-8503

传真:021-68865938

联系人:钟康莺

客户服务电话:021-68865020

网址:www.xcsc.com

㉙安信证券股份有限公司

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

法定代表人:牛冠兴

电话:0755-82825555

传真:0755-82558003

联系人:余江

客服电话:0755-82825555

网址:www.axzq.com.cn

㉚中信证券股份有限公司

住所:深圳市湖贝路1030号海龙王大厦

法定代表人:王东明

办公地址:北京朝阳区新源南路6号京城大厦

电话:010-84864818—63266

传真:010-84865560

联系人:陈忠

网址:www.citics.com

㉛万正证券有限责任公司

注册地址:湖南长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层

公司地址:湖南长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层

法定代表人:雷杰

联系人:彭博

联系电话:0571-5832343

客服电话:95571

网址:www.sunsc.com.cn

㉜中信建投证券有限责任公司

住所:北京市朝阳区安立路66号4号楼

法定代表人:张佑君

办公地址:北京市朝阳门内大街188号

联系电话:010-85130577

传真:010-65182261

联系人:权唐

客户服务电话:400-8888-108(免长途费)

网址:www.csc108.com

㉝上海证券有限责任公司

住所:上海市九江路111号

办公地址:上海市黄浦区西藏中路336号

法定代表人:蒋元真

联系电话:021-62470157

传真:021-65081434

联系人:黄枫

客服热线:800-6200-071

公司网站:www.962518.com

㉞齐鲁证券有限公司

住所:山东省济南市经十路128号

办公地址:山东省济南市经十路128号

法定代表人:李玮

电话:0531-81283906

联系人:王霖

客户服务电话:0531-82024184

网址:www.qlmq.com.cn

㉟东北证券股份有限公司

住所:长春市人民大街138-1号

办公地址:长春市自由大路1138号

法定代表人:矫正中

联系电话:0431-85096709

传真:0431-5680032

联系人:潘晋

网址:www.nesc.cn

㊱渤海证券有限责任公司

住所:天津市经济技术开发区第一大街29号

法定代表人:张志军

地址:天津市河西区宾水道3号

联系人:王兆权

电话:022-28455588

传真:022-28451892

㊲招商证券股份有限公司

住所:深圳市福田区益田路江苏大厦A座39-45层

办公地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座40层

法定代表人:宫少林

电话:0755-82943511

传真:0755-82943237

联系人:黄健

客户服务电话:4008888111.0755-26951111

网址:www.newone.com

㊳财富证券有限责任公司

住所:长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26层

地址:长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26层

法定代表人:周柳

电话:0731-4403343

传真:0731-4403439

联系人:郭磊

客户服务热线:0731-4403343

网址:www.cfzq.com

㊴华林证券有限责任公司

注册地址:广东省珠海市拱北夏湾华平路96号二层202-203房

公司地址:深圳市福田区民田路178号华融大厦6楼

法定代表人:段文清

联系电话:0755-82707888

传真:0755-82707700

联系人:杨玲

网址:www.chinalions.com

㊵华西证券有限责任公司

注册地址:四川省成都市陕西街239号

办公地址:深圳市深南大道4001号时代金融中心18楼(深圳总部)

法定代表人:杨炯洋

电话:0755-83025046

传真:0755-83025991

联系人:王京红

客户服务电话:400-8888-818

网址:www.hx168.com.cn

㊶长城证券有限责任公司

住所:深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、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:匡婷

网址:www.ec168.com.cn

㊷国信证券有限责任公司

注册地址:内蒙古呼和浩特市新城区锡林南路18号

办公地址:北京市西城区闹市口大街1号长安兴融中心西座11层

法定代表人:洪明

联系人:张利军

电话:010-88086830-652

网址:www.rxzq.com.cn

㊸东莞证券有限责任公司

住所:广东省东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼

办公地址:广东省东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼

法定代表人:唐驰辉

联系人:梁健伟

电话:0769-22100159

公司网址:www.dgzq.com.cn

㊹银泰证券有限责任公司

注册地址:深圳市福田区竹子林四路紫竹七道18号光大银行大厦18楼

办公地址:深圳市福田区竹子林四路紫竹七道18号光大银行大厦18楼

法定代表人:黄冰

联系人:曾敏宁

电话:0755-83706665

传真:0755-83704195

客户服务热线:0755-83710885

公司网站:www.ytzq.net

㊺爱建证券有限责任公司

注册地址:上海市南京西路758号23楼

办公地址:上海市南京西路758号(博爱大厦)20层-25层

法定代表人:张建华

联系人:陈敏

客服热线:021-63340678

网址:ajzq@ajzq.com

㊻平安证券有限责任公司

注册地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场裙楼8楼

办公地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场裙楼8楼

法定代表人:杨宇翔

联系电话:0755-22627802

传真:0755-82433794

联系人:袁月

客服电话:0755-95511

网站:www.pa18.com

㊼宏源证券股份有限公司

注册地址:昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼

办公地址:昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼

法定代表人:况雨林

联系人:刘晓明

电话:0871-3577942

客户服务电话:0871-3577930

网址:www.hongtaizq.com

㊽厦门证券有限公司

注册地址:厦门市莲前西路2号莲富大厦17楼

办公地址:厦门市莲前西路2号莲富大厦17楼

法定代表人:傅毅辉

联系人:卢金文

电话:0592-5161642

客户服务电话:0592-5163588

网址:www.xmzq.cn

㊾)广州证券有限责任公司

注册地址:广东省广州市先烈中路69号东山广场主楼5楼

办公地址:广东省广州市先烈中路66号东山广场主楼5楼

法定代表人:吴志明

联系人:樊刚正

联系电话:020-87322668-347

网址:www.gzs.com.cn

㊿)西部证券股份有限公司

注册地址:陕西省西安市东新街232号陕西信托大厦16-17层

办公地址:陕西省西安市东新街232号陕西信托大厦16-17层

法定代表人:刘建武

电话:029-87406172

传真:029-87406387

客服热线:029-87406132

联系人:冯萍

网址:www.westsecu.com.cn

51)新湖证券有限责任公司

注册地址:浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座6-7楼

办公地址:浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座6-7楼

法定代表人:吴承根

联系人:吴颖

联系电话:0571-87902080

网址:www.stocke.com

52)华安证券有限责任公司

住所:安徽省合肥市长江中路357号

办公地址:安徽省合肥市长江中路357号

法定代表人:汪永平

电话:0551-5161821

传真:0551-5161672

联系人:甘霖

咨询电话:0551-5161670

公司网址:www.hazq.com

53)东兴证券股份有限公司

注册地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层

办公地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层

法定代表人:崔海涛

联系人:黄英

电话:010-66555835

服务热线:010-66555262,66555382

公司网站:www.dxzq.net

54)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

法定代表人:张志刚

联系人:唐静

电话:010-63080985

客服热线:400-800-8899

网址:www.cindasc.com

55)广发华福证券有限责任公司

注册地址:福州市五四路157号新天地大厦7、8层

办公地址:福州市五四路157号新天地大厦7、8、10层

法定代表人:黄金琳

联系人:张腾

电话:0591-87383623

服务热线:96326(福建省外请加拨0591)

56)恒都证券有限责任公司

住所:北京市东城区安外大街2号安贞大厦3层

办公地址:北京市东城区安外大街2号安贞大厦3层

法定代表人:王少华

联系电话:010-84183389

联系人:黄静

全国业务咨询电话:800-810-8809

网址:http://www.guodu.com

57)中信金通证券有限责任公司

注册地址:浙江省杭州市中河南路11号万凯商务庭院楼A座

办公地址:浙江省杭州市中河南路11号万凯商务庭院楼A座

法定代表人:刘军

电话:0571-85776115

传真:0571-85783771

联系人:俞会亮

客户服务电话:0571-96598

网址:www.bigsun.com.cn

58)宏业证券股份有限公司

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:雷波

联系人:金喆

电话:028-86690126

传真:028-86690126

服务热线:4006-600109

公司网站:www.china598.com

59)东海证券有限责任公司

住所:江苏省常州市延陵西路23号投资广场18楼

办公地址:上海市浦东新区东方路989号中达广场13楼

法定代表人:朱科敏

联系电话:021-50586660-8644

传真:021-50586660-8880

联系人:霍晓菲

客服热线:021-50585609、400-888-8588

公司网站:www.longone.com.cn

60)国泰君安证券股份有限公司

住所:上海市浦东新区商城路618号

办公地址:上海市延平路135号

法定代表人:祝幼一

客户服务电话:021-962588、800-820-6888

传真:021-62583439

联系人:丙敏祺

联系电话:021-62580818-213

网址:www.gtja.com

61)金元证券股份有限公司

住所:海南省海口市南宝路36号证券大厦4层

办公地址:深圳市深南大道4001时代金融中心大厦17楼

法定代表人:陆涛

联系人:金春

联系电话:0755-83025666

传真:0755-83025511

客户服务热线:400-888-228

网址:www.jyzq.com.cn

62)万联证券有限责任公司

注册地址:广州市中山二路18号电信广场37层

办公地址:广州市中山二路18号电信广场36-37层

法定代表人:李舫金

电话:020-37865031

传真:020-37865008

联系人:刘广

联系电话:02037865026

网址:www.wlzq.com.cn

63)国信证券股份有限公司

注册(办公)地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦

法定代表人:何如

开放式基金咨询电话:800-810-8868

开放式基金业务传真:0755-82133302

联系人:齐晓燕

联系电话:0755-82133066

公司网址:www.guosen.com.cn

64)广发证券股份有限公司

注册地址:广东省珠海市吉大海滨路光大国际贸易中心26楼2611室

办公地址:广州市天河北路183号大都会广场36楼

法定代表人:王志伟

开放式基金咨询电话:020-87555888转各营业网点

开放式基金业务传真:020-87555305

联系人:肖中梅

网址:www.gf.com.cn

65)兴业证券股份有限公司

住所:福州市湖东路99号标力大厦

法定代表人:兰荣

办公地址:上海市浦东陆家嘴东路166号中保大厦19楼

电话:021-38565775

传真:021-68419867

联系人:杨盛芳

客户服务电话:021-68419125

网址:www.xyzq.com.cn

(二)注册登记机构

名称:中国证券登记结算有限责任公司

住所:北京西城区金融大街27号投资广场23层

法定代表人:金颖

办公地址:北京西城区金融大街27号投资广场23层

联系电话:010-58598839

传真:010-58598907

联系人:朱立元

(三)律师事务所

名称:北京市竞天公诚律师事务所

住所:北京市朝阳区朝阳门外大街20号联合大厦15层

负责人:张绪生

办公地址:北京市朝阳区朝阳门外大街20号联合大厦15层

联系电话:010-65882200,0755-23982200

传真:010-65882211,0755-23982211

联系人:黄亮

经办律师:孔雨泉、黄亮

(四)会计师事务所

名称:普华永道中天会计师事务所有限公司

住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1233号汇亚大厦1604-1608室

办公地址:上海市湖滨路202号普华永道中心11楼

法定代表人:杨绍信

联系电话:021-61238888

经办注册会计师:薛莹、单峰

四、基金的名称

本基金名称:鹏华中证500指数证券投资基金(LOF)

五、基金的运作方式及类型

(一)本基金运作方式

上市契约型开放式

(二)本基金类型

股票型证券投资基金

六、基金的投资目标

本基金采用指数化投资方式,追求基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间的跟踪误差最小化,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,以实现对中证500指数的有效跟踪。

七、基金的投资方向

本基金投资于具有良好流动性的金融工具,主要投资于中证500指数的成份股及其备选成份股(投资比例不低于基金资产净值的90%),现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。此外,为更好的实现投资目标,本基金将少量投资于非中证500成份股、新股(首次发行或增发等)以及法律法规及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

八、基金的投资策略

本基金采用被动式指数投资方法,原则上按照成份股在中证500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和成份股发生配股、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。

1.资产配置策略

为实现紧密跟踪业绩比较基准的投资目标,本基金将以不低于基金资产净值90%的资产投资于中证500指数成份股和备选成份股,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

2.股票投资策略

①股票投资组合的构建

本基金在建仓期内,将按照中证500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,对基金资产进行适当调整,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中证500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,申赎赎回变动情况、新股增发因素等变化,对其进行适时调整,以保证基金净值增长率与基准指数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,当中证500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。

3.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。

九、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准为:中证500指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%。

如果中证500指数被变更(编制及发布,或中证500指数由其他指数替代(单纯更名除外),或由于指数编制方法等重大变更导致中证500指数不宜继续作为本基金的标的指数,本基金管理人在履行适当程序后,可以变更基金的标的指数和业绩比较基准,并在变更前提前2个工作日在中国证监会指定的媒体上公告。

十、基金的风险收益特征

本基金属于采用指数化操作的股票型基金,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,为证券投资基金中的较高预期风险、较高预期收益品种。

十一、基金的投资组合报告(未经审计)

本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