鹏华沪深300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

二〇一〇年十一月

重要提示

本基金经2009年1月16日中国证券监督管理委员会下发的《关于核准鹏华沪深300指数证券投资基金(LOF)募集的批复》(证监许可[2009]41号)文核准,进行募集,并经中国证监会基金部2009年4月3日基金部函[2009]240号文件《关于鹏华沪深300指数证券投资基金(LOF)募集确认的函》确认合法备案。根据相关法律法规,本基金基金合同已于2009年4月3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投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。

本摘要根据本基金的基金合同和基金招募说明书编写,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、基金交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时为2010年10月2日,有关财务数据和净值表现截止日为2010年9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:0755-82021233 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。

孙继扬先生,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)有限公司副总经理,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.)董事会秘书,意大利证券投资公司(意大利证券投资公司(Italfondi SGR)董事,Cr Firenze Gestion International股份公司执行董事,SICAV基金董事,现任欧利盛资本股份公司(Eurizon Capital S.A.)卢森堡)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 Spring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(意大利银行)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财务风险管理部意大利企业法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)塔斯尼斯证券投资基金177只,其中封闭式8只,开放式169只。2010年,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,先后被美国《全球托管人》杂志(Global Custodian)和《证券业务》(Securities Business)评选为2009年度中国最佳托管银行,本届《财资》(Asiamoney)连续两次评选中国工商银行为"年度最佳托管银行"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:0755-82021233
传真:0755-82021155
联系人:李娜

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:赵晓群

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:021-58825962
传真:021-68876821
联系人:李化珀

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1座4312室
联系电话:027-85557881
传真:027-85557973
联系人:邹明兵

(2)代销机构:

①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
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:蒋松云

(三)基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者,中国工商银行自1998年开展托管服务以来,秉承"诚实信用、勤勉尽责"的宗旨,严格履行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、先进的业务营运系统和专业的托管服务团队,为广大投资者、众多资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务,取得了良好业绩。建立了包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、收支账户资金、企业年金基金、QFII资产、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、银行理财产品等门内齐全的托管产品体系。截至2010年9月,中国工商银行共托管证券投资基金177只,其中封闭式8只,开放式169只。2010年,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,先后被美国《全球托管人》杂志(Global Custodian)评选为2009年度中国最佳托管银行。本届《财资》(Asiamoney)连续两次评选中国工商银行为"年度最佳托管银行"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:0755-82021233
传真:0755-82021155
联系人:李娜

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:赵晓群

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:021-58825962
传真:021-68876821
联系人:李化珀

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1座4312室
联系电话:027-85557881
传真:027-85557973
联系人:邹明兵

(2)代销机构:

①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
法定代表人:姜建清
客户服务电话:95588(全国)
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:郑万春
客户服务电话:95533
传真:010-67598409
联系人:王雅
网址:www.ccb.com

③中国农业银行股份有限公司
注册地址:北京市东城区建国门内大街69号
办公地址:北京市东城区建国门内大街69号
法定代表人:滕涛
客户服务电话:95599
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交通银行股份有限公司
注册地址:上海市银城中路188号
办公地址:上海市银城中路188号
法定代表人:胡怀邦
电话:58781234
传真:58408483
客户服务电话:95559
网址:www.bankcomm.com

⑥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:秦晓
办公地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
电话:0755-83195834,82090060
传真:0755-83195049,82090817
联系人:朱虹、刘薇
网址:www.cmbchina.com
客服电话:95555

⑦浦发银行股份有限公司
注册地址:深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦
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:肖遂宁
邮政编码:518001
联系人:周勤
传真电话:0755-82080714
客服电话:95500
网址:www.sdb.com.cn

⑧平安银行股份有限公司
注册地址:深圳市深南中路1099号平安银行大厦
办公地址:深圳市深南中路1099号平安银行大厦
法定代表人:黄立哲
电话:0755-22859591
联系人:雷先龙
客服电话:40066-99999或0755-961202
网址:www.18bank.com

⑨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8号富华大厦C座
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:金蕾
电话:010-65557013
传真:010-65550827
网址:http://bank.ecitic.com

⑩中国民生银行股份有限公司
注册地址:北京市东城区正义路甲4号
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
传真:010-58560794
网址:www.cmbc.com.cn

⑪中国光大银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦?
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?

⑫北京银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街丙17号
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

⑬宁波银行股份有限公司
注册地址:宁波市江东区中山东路294号
办公地址:宁波市江东区中山东路294号
法定代表人:陈萍裕
电话:021-63586210
传真:021-63586215
联系人:胡技勋
客户服务电话:96528(上海地区962528)
网址:www.nbcb.com.cn

⑭杭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

⑮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

⑯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
电话:021-61618888
传真:021-63604199
联系人:徐伟、虞谷云
客户服务热线:95528
公司网站:www.spdb.com.cn

⑰兴业银行股份有限公司
注册地址:福州市湖东路154号
法定代表人:高建平
电话:021-62677777-218937
传真:0755-83195049,82090817
联系人:陈晓瑾
客服电话:95561
网址:www.cib.com.cn

⑱厦门银行股份有限公司
注册地址:杭州市凤起路432号
办公地址:杭州市凤起路432号
法定代表人:吴建雄
电话:0571-85108309
传真:0571-85151339
联系人:江淑
客户服务热线:4008888508
公司网站:www.hzbank.com.cn

⑲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:邢鹏
电话:010-85238667
传真:010-85238680
客服电话:95577
网址:www.hxb.com.cn

⑳招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
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:林建闽
联系电话:0755-82130833
公司网址:www.guosen.com.cn

㉑齐鲁证券有限责任公司
注册地址:山东省济南市经十路128号
办公地址:山东省济南市千佛山路3号济南商业银行四楼
法定代表人:李玮
电话:0531-8202 4184
联系人:傅咏梅
电话:0531-81283938
公司网址:www.qlzq.com.cn

㉒招泰君安证券股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区商城路618号
办公地址:上海市银河中路168号上海银行大厦29楼
法定代表人:祝幼一
电话:021-62580818-213
传真:021-62569400
服务热线:4008888666
联系人:丙敏棋
公司网址:www.gtja.com

㉓中信建投证券有限责任公司
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:张佑君
电话:4008888108
业务传真:010-65182261
联系人:任威
电话:010-85130923
网址:www.csc108.com

㉔摩根士丹利华鑫证券有限责任公司
注册地址:深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦10、24、25层
办公地址:深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦10、24、25层
法定代表人:马国明
电话:0755-82492000
传真:0755-82492962
客户服务热线:400-888-555,95513
联系人:盛宗凌
公司网址:www.ms.com.cn

㉕湘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40层
法定代表人:寇少林
电话:0755-82943511
传真:0755-82943237
联系人:黄健
客户服务电话:400-8888-111,0755-26951111
网址:www.newone.com.cn

㉖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

㉗中信证券股份有限公司
注册地址:北京朝阳区新源南路6号京城大厦
办公地址:北京朝阳区新源南路6号京城大厦
法定代表人:王东明
电话:010-84588266
传真:010-84865560
联系人:陈忠
网址:www.cs.ecitic.com

㉘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:顾关金
客户服务电话:800-820-1868
传真:010-66568536
联系人:李洋
网址:www.chinastock.com.cn

㉙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:上海市南浦江广东路689号
法定代表人:王开国
电话:021-23219000
传真:021-63410456
联系人:李笑鸣、金芸
客户服务电话:400-8888-001、021?962503
网址:www.htsec.com

㉚招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:曹晖
客户服务电话:021?962505
网址:www.sw2000.com.cn

㉛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号万凯商务冠院楼A座
办公地址:浙江省杭州市中河南路11号万凯商务冠院楼A座
法定代表人:刘军
电话:0571-85783750
传真:0571-85783771
联系人:王勤
客户服务电话:0571?96598
网址:www.bigsun.com.cn

㉜财富证券有限责任公司
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:陈少雄
电话:021-68634518
传真:021-68865938
联系人:陈伟
客户服务电话:021-68865020
网址:www.xcsc.com

㉝海通证券有限责任公司
注册地址:天津市经济技术开发区第一大街29号
办公地址:天津市河西区宾水道3号
法定代表人:张志军
联系人:王兆权
开放式基金咨询电话:022-28455588
开放式基金业务传真:022-28451892
网址:www.htsc.com.cn

㉞中信万通证券有限责任公司
注册地址:青岛市崂山区苗岭路29号
办公地址:青岛市东海西路28号
法定代表人:杨法民
电话:0532-85022026
传真:0532-85022026
联系人:丁眉燕
客户服务电话:0532?96577
网址:www.zxwt.com.cn

㉟兴业证券股份有限公司
注册地址:福建省福州市湖东路99号
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴东路166号中保大厦19楼
法定代表人:兰荣
电话:021-68419974
传真:021-68419967
联系人:杨盛芳
客户服务电话:021?68419974
网址:www.xyzq.com.cn

㊱长城证券有限责任公司
注册地址:深圳市深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
办公地址:深圳市深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
法定代表人:黄耀华
电话:0755-83516289
传真:0755-83516199
联系人:匡婷
客户服务中心电话:0755?82288968
公司网站:www.cc168.com.cn

㊲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:上海市浦东新区浦东南路528号上海证券大厦南塔16楼
法定代表人:徐浩明
电话:021?68816000
传真:021?68815009
联系人:刘晓
客户服务电话:10108998
网址:www.ebscn.com

㊳上海证券有限责任公司
注册地址:上海市西藏中路336号
办公地址:上海市南京西路1468号中欣大厦2楼
法定代表人:蒋元真
联系电话:021-62470157
联系人:黄枫
客服电话:021-962518
公司网址:www.962518.com

㊴华泰证券股份有限责任公司
注册地址:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
办公地址:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
法定代表人:吴万善
电 话:025-84457777-882、721
联系人:李金龙
客户咨询电话:025-84579897
网址:www.htsc.com.cn

㊵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
联系人:黄晓军
咨询电话:029-87419999
网址:www.westsecu.com.cn

㊶方正证券有限责任公司
注册地址:湖南长沙开建路臻楼479号
办公地址:湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦24层
法定代表人:雷杰
联系人:荆铁英
联系电话:0571-87782047
网址:www.sunsc.com.cn

㊷国元证券有限责任公司
注册地址: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:手工
咨询电话:0551-5161670
传真:0551-5161600
网址:www.hazq.com

㊸万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36-37层
办公地址:广州市中山二路18号广东电信广场37层
法定代表人:李勤业
电话:020-37865008、37865199
传真:020-37865008
联系人:李俊
联系电话:02037865026
网址:www.wlzq.com.cn

㊹第一创业证券有限责任公司
注册地址:广东省深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25、26层
办公地址:广东省深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25、26层
法定代表人:刘学民
联系人:王万雨
客服电话:0755-25832583
网址:www.firstcapital.com.cn

㊺财富证券有限责任公司
注册地址:长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26层
办公地址:湖南长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26、27层
法定代表人:期解
电话:0731-4403366(传真:0731-4403330
联系人:郭垒
联系电话:0731-4403319
网址:www.cfzq.com

㊻长江证券股份有限公司
注册地址:湖北省武汉市江汉区新华路特8号
办公地址:湖北省武汉市江汉区新华路特8号
法定代表人:胡运钊
电话:027-65799999
传真:027-85481900
网址:www.95579.com

㊼原吉证券有限责任公司
注册地址:苏州市石路爱河桥路28号
办公地址:苏州市石路爱河桥路28号
法定代表人:吴永敏
电话:0512-65588088
传真:0512-65581101
联系人:方晓丹
联系电话:0512-65581136
网址:www.dwzq.com.cn

㊽招联证券股份有限公司
注册地址:无锡市县前东街168号
办公地址:无锡市县前东街168号
法定代表人:范炎
电话:0510-82832919
传真:0510-82833124
联系人:袁丽萍
联系电话:0510-82588168
网址:www.gjsec.com.cn

㊾新海证券有限责任公司
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.stock.com

㊿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:樊潮江
联系电话:020-87322668-347
网址:www.gzs.com.cn

(51)华林证券有限责任公司
注册地址:珠海市拱北夏湾华平路96号二层202-203房
办公地址:深圳市福田区民田路178号华融大厦5楼
法定代表人:姚怀瑾
联系电话:0755-82707855
传真:0755-82707850
联系人:杨玲
网址:www.chinalions.com

(52)财通证券股份有限责任公司
注册地址:浙江省杭州市解放路111号
办公地址:浙江省杭州市解放路111号
法定代表人:陈海略
电话:0571-87828088
传真:0571-87828033
联系人:乔晓
联系电话:0571-87925129
网址:www.goodyou.com.cn

(53)世纪证券有限责任公司
注册地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦40-42楼
办公地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦40-42楼
法定代表人:段强
电话:0755-83199511
传真:0755-83199545
联系人:刘军辉、王飞
咨询电话:0755-83199511
网址:www.csco.com.cn

(54)中山证券有限责任公司
注册地址:广东省深圳市福田区益田路江苏大厦B座15层
办公地址:广东省深圳市福田区益田路江苏大厦B座15层
法定代表人:吴示俊
联系人:胡腾
咨询电话:0755-82493750或按打各城市营业网点咨询电话
网址:www.zszq.com.cn

(55)国元证券有限责任公司
住所:山西省太原市府西街69号山西国贸中心东塔楼
办公地址:山西省太原市府西街69号山西国贸中心东塔楼
法定代表人:侯魏
联系电话:0551-8686703
联系人:张尚国

(56)欧亚证券股份有限公司
住所地址:新疆乌鲁木齐建设路2号
办公地址:新疆乌鲁木齐建设路2号
法定代表人:汤世生
联系人:张智红
电话:010-62267799-6416
咨询电话:010-62267799-6789
网址:www.ehongyuan.com.cn

(57)中国建银投资证券有限责任公司
住所地址:深圳福田区益田路与福华三路交界处深圳国际商会中心48-50层
办公地址:深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A座19楼
法定代表人:杨小阳
电话:0755-82026521
传真:0755-82026539
联系人:刘权
客户服务热线:400-600-8008
网址:www.cjis.cn

(58)日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号长安大厦中心西座11层
法定代表人:洪明
联系人:张明
电话:010-88086830
网址:www.rxzq.com.cn

(59)天元证券股份有限公司
住所地址:台肥市寿春路179号
办公地址:台肥市寿春路179号
法定代表人:凤良志
联系人:程维
联系电话:0551-2207936
开放式基金咨询电话:安徽地区:96888;全国:400-8888-777
开放式基金业务传真:0551-2634400-1171
公司网站:www.gyzq.com.cn

(60)国盛证券有限责任公司
注册地址:江西省南昌市永叔路15号
办公地址:江西省南昌市永叔路15号信达大厦10-13楼
法定代表人:管荣升
联系电话:0791-6289771
联系人:徐美云
公司网址:www.gsstock.com

(61)东方证券股份有限公司
注册地址:上海市中山南路318号2号楼22层-29层
办公地址:上海市中山南路318号2号楼22层-29层
法定代表人:王益民
电话:021-63325888
传真:021-63326173
联系人:吴宇
客户服务电话:95503
网址:www.dfzq.com.cn

(62)东海证券有限责任公司
注册地址:江苏省常州市延陵西路59号常信大厦18、19楼
办公地址:上海市浦东区东方路989号中达广场17楼
法定代表人:朱科敏
联系人:邵一明
电话:021-50586660
传真:021-50586660-8880
客户服务电话:400-888-8588、0519-8166222、0379-64912266
公司网址:www.longrone.com.cn

(63)红塔证券股份有限责任公司
注册地址:哈尔滨市香坊区赣水路56号
办公地址:哈尔滨市香坊区赣水路56号
法定代表人:孙名扬
电话:0451-82269286
传真:0451-82269286
联系人:聂鹏
全国统一热线:4006662288
公司网站:www.jhzq.com.cn

(64)西部证券有限责任公司
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:杨树宇
电话:0755-83025046
传真:0755-83025991
联系人:王应红
客户服务电话:400-8888-818
网址:www.hx168.com.cn

(65)宏信证券股份有限公司
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:倪荣林?
联系人:刘晓明
电话:0871-3577011
客户服务电话:0871-3577930
网址:www.hongtanzq.com

(66)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

(67)国泰君安证券有限责任公司
住所: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
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:万建华
联系电话:0755-83703759
咨询电话:0755-83710885
公司网址:www.ytzq.net

(68)申银万国证券股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路166号未来资产大厦23层
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路166号未来资产大厦23层
法定代表人:陈林
联系人:霍立权
客户服务电话:400-820-9898
网址:www.cnhbstock.com

(69)长江证券有限责任公司
注册地址:上海市南京西路758号20-25楼
办公地址:上海市南京西路758号20-25楼
法定代表人:张建华
联系人:陈欣
电话:021-62171984
传真:021-62878783
服务热线:021-63340678
公司网站:www.xjzq.com

(70)国金证券股份有限公司
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

(71)信达证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区三里河东路5号中商大厦10层
办公地址:北京市西城区三里河东路5号中商大厦10层
法定代表人:张志刚
联系人:唐静
电话:010-88656476
传真:010-88656290
服务热线:400-800-8899
公司网站:www.cindasc.com

(72)华龙证券股份有限责任公司
注册地址:甘肃省兰州市静宁路308号
办公地址:甘肃省兰州市静宁路308号
法定代表人:李晓安
电话:0931-8888088
传真:0931-4890515
联系人:李野田
客户服务电话:0931-4890619、4890618、4890100
网址:http://www.hlzqgs.com

(73)联讯证券有限责任公司
注册地址:北京市朝阳区朝外大街16号1901室
办公地址:北京市朝阳区朝外大街16号1901室
法定代表人:岳献春
联系人:赵阳
电话:010-85252656
服务热线:400-619-8888
公司网站:www.msnj.com

(74)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)
公司网站:www.gfhfzq.com.cn

(75)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

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代理销售本基金或变更上述代销机构,并及时公告。

2.场内发售机构:具有基金代销业务资格且符合深圳证券交易所风险控制要求的深圳证券交易所会员单位(具体名单见基金份额发售公告及其他相关业务公告)。

(二)注册登记机构

名称:中国证券登记结算有限责任公司
注册(办公)地址:北京西城区金融大街27号投资广场23层
法定代表人:金颖
电话:010-58598839
传真:010-58598907
联系人:朱立元

(三)律师事务所

名称:北京市德恒律师事务所
住所:北京市西城区金融街19号富凯大厦B座十二层
负责人:王丽
办公地址:北京市西城区金融街19号富凯大厦B座十二层
联系电话:010-65232180 65269781
传真:010-65232181
联系人:徐芳
经办律师:陈静茹、苏文静

(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1318号星展银行大厦6楼
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:杨经信
联系电话:021?61238888
传真:021?23238800
联系人:陈静(经办注册会计师):薛竞、陈熙

四、基金的名称

本基金名称:鹏华沪深300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,力争将日平均跟踪误差控制在0.35%以内,以实现对沪深300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,主要投资于沪深300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沪深300成份股、新股(首次发行或增发等)及法律法规及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。

若法律法规或监管机构允许,本基金在履行适当程序后,可以调整上述投资比例,或将股指期货等金融衍生品纳入本基金的投资范围。

八、基金的投资策略

(一)投资策略

本基金采用被动式指数投资方法,按照成份股在沪深300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,并辅之以金融衍生产品投资管理等,使跟踪误差控制在限定的范围之内。

1.资产配置策略

为实现尽量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%的资产投资于沪深300指数成份股和备选成份股。在正常市场情况下本基金将采用完全复制法,严格按目标指数的成份股权重权重构建组合,少数特殊情况下本基金将配合使用优化方法作为补充,以保证对标的指数的有效跟踪。

2.股票投资策略

本基金原则上通过指数复制法进行被动式指数化投资,根据沪深300指数成份股的基准权重构建股票投资组合,并根据成份股及其权重的变动而进行相应调整。

(1)股票投资组合的构建

本基金在建仓期内,将按照沪深300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沪深300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、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。由于受到各项指数比例限制,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。

(3)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

当成份股发生增发、配股、分红等情况而影响成份股在指数中权重的行为时,本基金将根据各成份股的权重变化及时调整股票投资组合;

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、法规和基金合同的规定,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,并辅之以金融衍生产品投资管理等,最终使跟踪误差控制在限定的范围之内;

根据法律法规中针对基金投资比例的相关规定,当基金投资组合中按标的指数权重投资的股票资产比例或个股比例超过规定限制时,本基金将对其进行实时调整,并相应对其他资产或个股进行微调,以保证基金合法规范运作。

3.债券投资策略

本基金根据流动性管理的需要,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。

(二)股票选策依据及程序

1.投资决策依据

①有关法律、法规、基金合同等的相关规定;

②经济运行态势和证券市场走势;

③系列指数的编制方法及其变更。

2.投资决策程序

①本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理团队制。投资决策委员会负责制定基金投资方面的整体投资计划与投资原则;决定有关指数重大调整的应对决策,其他重大组合调整决策以及重大的单项投资决策;基金经理根据投资决策委员会的决策,负责投资组合的构建、调整和日常管理等工作;

②基金经理根据沪深300指数成份股名单及权重,考虑本基金资产规模及需保留现金比例等因素,拟定本基金指数化投资的初始方案;

③基金经理根据实际交易情况、申购赎回情况、对跟踪误差的监控结果、风险绩效