鹏华中小企业纯债债券型发起式证券投资基金上市交易公告书

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

注册登记人:中国证券登记结算有限责任公司

上市地点:深圳证券交易所

上市时间:2013年1月9日

公告日期:2013年1月4日

一、重要声明与提示

鹏华中小企业纯债债券型发起式证券投资基金(以下简称"本基金")之上市交易公告书依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称"《基金法》")、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号<上市交易公告书的内容与格式>》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制,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、误导性陈述或者重大遗漏,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。

本基金托管人保证本报告书中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性,承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见,均不表明对本基金的任何保证。

本公告书第七节"基金财务状况"未经审计。

凡本上市交易公告书未涉及的有关内容,请投资者详细查阅2012年10月12日刊登于《上海证券报》、10月13日刊登于《证券时报》和鹏华基金管理有限公司网站(www.phfund.com.cn)的本基金招募说明书。

二、基金概览

1.基金名称:鹏华中小企业纯债债券型发起式证券投资基金(基金简称:鹏华中小企业债券,场内简称:中小企债)

2.基金类型:债券型证券投资基金

3.基金运作方式:

契约型,本基金在基金合同生效后三年内(含三年)封闭运作,在深圳证券交易所上市交易;封闭期结束后若满足一定条件转为上市开放式基金(LOF)。

发起式,发起资金认购的基金份额持有期限不少于3年。

4.基金存续期限:不定期

5.基金份额总额:截至2012年12月28日,本基金的基金份额总额为986,832,699.11份。

6.基金份额净值:截至2012年12月28日,本基金的基金份额净值为1.006元。

7.本次上市交易的基金份额简称及代码:场内简称:中小企债,基金代码:160621

8.本次上市交易的基金份额总额:84,107,961.00份

9.上市交易的证券交易所:深圳证券交易所

10.上市交易日期:2013年1月9日

11.基金管理人:鹏华基金管理有限公司

12.基金托管人:招商银行股份有限公司

13.本次上市交易的基金份额注册登记机构:中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司

三、基金的募集与上市交易

(一)本基金募集情况

1.基金募集申请的核准机构和核准文号:中国证券监督管理委员会证监许可[2012]1219号

2.基金运作方式:

契约型,本基金在基金合同生效后三年内(含三年)封闭运作,在深圳证券交易所上市交易;封闭期结束后若满足一定条件转为上市开放式基金(LOF)。

发起式,发起资金认购的基金份额持有期限不少于3年。

3.基金合同期限:不定期

4.发售日期:2012年10月15日至2012年10月29日

5.发售价格:1.00元人民币

6.发售方式:场外、场内认购

7.发售机构:

①场内发售机构:

本基金场内发售的机构为具有基金代销业务资格并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的深圳证券交易所会员单位,具体名单详见深圳证券交易所网站(www.szse.cn)。

②场外发售机构:

1)直销机构

直销机构包括鹏华基金管理有限公司直销中心、鹏华基金管理有限公司北京分公司、上海分公司、武汉分公司、广州分公司及本公司网上交易系统。

2)代销机构

招商银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、北京银行股份有限公司、民生银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、上海银行股份有限公司、杭州银行股份有限公司、中国工商银行股份有限公司、东莞农村商业银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、长城证券有限责任公司、广发证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、华西证券有限责任公司、中银万国证券股份有限公司、湘财证券有限责任公司、中国银河证券股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、中信证券股份有限公司、中信证券(浙江)有限责任公司、中信万通证券有限责任公司、兴业证券股份有限公司、国都证券有限责任公司、深圳众禄基金销售有限公司、诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司、杭州数米基金销售有限公司、天相投资顾问有限公司、上海长量基金销售投资顾问有限公司、上海好买基金销售有限公司、上海天天基金销售有限公司等机构。

8.验资机构名称:普华永道中天会计师事务所有限公司

9.募集资金总额及入账情况:本次募集的有效净认购金额为986,412,589.52元人民币,折合基金份额986,412,589.52份;利息结转份额420,109.59份,总确认份额为986,832,699.11份。上述有效净认购资金及认购款项在募集期间产生的利息已于2012年11月2日全额划入本基金在基金托管人招商银行股份有限公司开立的鹏华中小企业纯债债券型发起式证券投资基金托管专户。

本基金通过场外、场内两种方式公开发售,按照每份基金份额1.00元计算,本基金募集期间含本息共募集986,832,699.11份基金份额,其中场外认购的基金份额为902,724,738.11份;场内认购的基金份额为84,107,961.00份。

10.本基金募集备案情况:根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等相关法律、法规的规定以及《鹏华中小企业纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》(以下简称"基金合同")的有关约定,本基金募集结果符合备案条件,鹏华基金管理有限公司(以下简称"本基金管理人")已向中国证监会办理完毕基金备案手续,并于2012年11月5日获中国证监会书面确认,本基金合同自该日起正式生效。基金合同生效之日起,本基金管理人正式开始管理本基金。

11.基金合同生效日:2012年11月5日

12.基金合同生效日的基金份额总额:986,832,699.11份

(二)本基金上市交易的主要内容

1.基金上市交易的核准机构和核准文号:深圳证券交易所深证上[2012]461号

2.上市交易日期:2013年1月9日

3.上市交易的证券交易所:深圳证券交易所。投资者在具有基金代销业务资格的深圳证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金交易。

4.基金简称:鹏华中小企业债券,场内简称:中小企债

5.上市交易代码:160621

6.上市交易份额:84,107,961.00份

7.基金资产净值的披露:开放式基金每日收市后对基金资产净值进行的估值。

基金管理人每个开放日对基金资产估值。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算,基金托管人复核。基金管理人于每个工作日交易结束后将经过基金托管人复核的基金净值传给深交所,深交所于次日通过行情系统"市盈率Ⅰ"揭示。根据《基金法》,开放式基金的基金会计责任方由基金管理人担任,因此基金管理人对公布的基金净值负责。

8.未上市交易份额的流通规定:未上市交易的份额托管在场外,基金份额持有人将其跨系统转托管至深圳证券交易所场内后即可上市流通。

9.本基金开通跨系统转托管业务日期:2013年1月4日,具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司的相关规定办理。

四、持有人户数、持有人结构及场内前十名持有人

(一)基金份额持有情况

截至2012年12月28日本基金场内基金份额持有情况:

场内份额持有人户数:541户

平均每户持有的场内基金份额:155,467.58份

场内机构投资者持有的基金份额及占场内基金总份额比例:机构持有75,510,275.00份,占89.78%,

场内个人投资者持有的基金份额及占场内基金总份额比例:个人持有8,597,686.00份,占10.22%

(二)截止到2012年12月28日,场内基金份额前十名持有人情况:

本次上市交易前十名持有人情况

序号	持有人名称	持有份额	占总份额比(%)
1	中意人寿保险有限公司	30,004,083	35.67
2	五矿集团财务有限责任公司	20,003,111	23.78
3	中意人寿保险有限公司—分红—团体年金	20,002,722	23.78
4	华宝投资有限公司	5,000,340	5.95
5	李皓明	1,000,087	1.19
6	谢以琼	921,035	1.10
7	张晓莉	600,093	0.71
8	厦门康立达电气工程有限公司	500,019	0.59
9	张玉赞	350,013	0.42
10	雷丽琴	300,043	0.36
合计		78,681,546	93.55

(三)截止到2012年12月28日,基金管理人的从业人员持有本基金份额的情况

本基金管理人的基金从业人员持有本基金份额总量为2,550,719.45份,占该基金总份额的比例为0.2585%。其中,本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金基金份额总量为0,该只基金的基金经理持有本基金基金份额总量为0,本公司其他基金经理等投资管理人员持有本基金基金份额总量为200,135.00份。

注:以上信息依据中国证券登记结算有限公司深圳分公司提供的持有人信息编制。

五、基金主要当事人简介

(一)基金管理人

1.名称:鹏华基金管理有限公司

2.法定代表人:何如

3.总经理:邓召明

4.注册资本:1.5亿元人民币

5.注册地址:深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心43层

6.设立批准文号:中国证监会证监基字[1998]31号

7.工商登记注册的法人营业执照文号:4403011013037

8.经营范围:基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务。

9.存续期间:持续经营

10.股东及其出资比例:公司股东由国信证券有限公司、意大利欧利盛资本资产管理股份公司(Eurizon Capital SGR S.p.A.)、深圳市北融信投资发展有限公司组成,三家股东的出资比例分别为50%、49%、1%。

11.内部组织结构及职能:

基金管理部

负责公司公募基金的投资管理工作。

量化投资部

负责公司量化投资管理工作。

机构投资部

负责社保基金和其它委托理财业务的投资管理工作。

研究部

在公司既定的投资理念和研究理念的基础上,以系统性的研究方法和高质量的研究成果为公司投资部门提供持续有效的支持。

机构理财部

负责开展专户理财、社保、企业年金等除投资以外的业务。

集中交易室

负责执行公司既定的各基金的投资指令并及时反馈市场信息。

市场发展部

负责公司银行渠道销售管理及服务工作。

渠道业务部

负责公司券商渠道、第三方机构及公司电子商务平台的管理、业务推广等工作。

营销策划部

负责公司品牌宣传、产品营销策划。

登记结算部

负责公司旗下基金的注册登记、清算和会计工作。

监察稽核部

负责对公司管理和基金运作合法合规性进行全方位的严格监控,及时防范风险事件的发生。

总裁办公室

负责公司财务管理、人事劳资管理、日常行政事务管理。

信息技术部

负责公司的计算机设备维护、系统开发及网络运行和维护。

产品规划部

负责制定公司产品规划与发展策略以及产品设计、产品管理和产品研究工作,完善公司产品线,丰富公司产品储备。

国际业务部

负责QDII等海外投资研究等相关业务。开展QDII基金投资组合管理;进行产品研究分析,构建投资组合。

固定收益部

负责公司固定收益证券的研究、投资工作。

北京分公司

主要负责北方地区的基金销售业务。

上海分公司

主要负责华东区域的基金销售业务。

武汉分公司

主要负责华中区域的基金销售业务。

广州分公司

主要负责华南区域的基金销售业务。

12.人员情况

截至2012年9月30日,公司员工总数253人,其中:正式员工225人,外包员工28人。学历构成如下:博士13人占比5.1%,硕士146人占比57.7%,本科83人占比32.8%,大专及以下11人占比4.4%。

13.信息披露负责人及咨询电话

张戈 0755-82825720

14.基金管理业务情况

截至2012年9月30日,鹏华基金管理有限公司共管理29只开放式基金和2只封闭式基金及六只社保投资组合。旗下管理的开放式基金有鹏华货币市场证券投资基金、鹏华普天系列开放式证券投资基金(普天债券A、普天债券B、普天收益)、鹏华行业成长开放式证券投资基金、鹏华中国50开放式证券投资基金、鹏华价值优势股票型证券投资基金(LOF)、鹏华动力增长混合型证券投资基金(LOF)、鹏华优质治理股票型证券投资基金(LOF)、鹏华盛世创新股票型证券投资基金(LOF)、鹏华沪深300指数证券投资基金(LOF)、鹏华精选成长股票型证券投资基金、鹏华中证500指数证券投资基金(LOF)、鹏华信用增利债券型证券投资基金、鹏华上证民营企业50交易型指数证券投资基金及联接基金、鹏华环球发现证券投资基金、鹏华丰润债券型证券投资基金、鹏华消费优选股票型证券投资基金、鹏华丰盛稳固收益债券型证券投资基金、鹏华新兴产业股票型证券投资基金、鹏华深证民营交易型开放式指数证券投资基金及联接基金、鹏华美国房地产证券投资基金、鹏华丰泽分级债券型证券投资基金、鹏华价值精选股票型证券投资基金、鹏华金刚保本混合型证券投资基金、鹏华纯债债券型证券投资基金、鹏华中证A股资源产业指数分级证券投资基金。封闭式基金有基金普惠、普丰;以及全国社会保障基金六个委托投资组合。

15.本基金基金经理

戴钢先生,厦门大学经济学硕士,10年证券从业经验。曾就职于广东民安证券研究发展部,担任研究员;2005年9月加盟鹏华基金管理有限公司,从事研究分析工作,历任债券研究员、专户投资经理等职;2011年12月起至今担任鹏华丰泽分级债券型证券投资基金基金经理,2012年6月起至今兼任鹏华金刚保本混合型证券投资基金基金经理,2012年11月起兼任鹏华中小企业纯债债券型发起式证券投资基金基金经理。

(二)基金托管人

1.基金托管人基本情况

名称:招商银行股份有限公司(以下简称"招商银行")

设立日期:1987年4月8日

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

注册资本:215.77亿元

法定代表人:傅育宁

行长:马蔚华

资产托管业务批准文号:证监基金字[2002]83号

电话:0755-83199084

传真:0755-83195201

资产托管部信息披露负责人:张燕

2.主要人员情况

傅育宁先生,招商银行董事长和非执行董事,英国布鲁诺尔大学博士学位。1999年3月开始担任本公司董事。2010年8月起任招商局集团有限公司董事长。兼任招商局国际有限公司(香港联合交易所上市公司)主席,利和经销集团有限公司(香港联合交易所上市公司)及信和置业有限公司(香港联合交易所上市公司)独立非执行董事,香港港口发展局董事,香港证券及期货事务监察委员会成员等;中国南山开发(集团)股份有限公司董事长,招商局能源运输股份有限公司(上海证券交易所上市公司)董事长,及中国国际海运集装箱(集团)股份有限公司(深圳证券交易所上市公司)董事长,及新加坡上市公司嘉德置地有限公司独立非执行董事。

马蔚华先生,招商银行执行董事、行长兼首席执行官,1999年1月加入本公司。经济学博士学位,高级经济师。第十一届全国政协委员。1999年1月起任招商银行股份有限公司行长兼首席执行官。分别自1999年9月、2003年9月、2007年11月及2008年10月起兼任招银国际金融有限公司董事长、招商信诺人寿保险有限公司董事长及招商基金管理有限公司董事长及永隆银行有限公司董事长,并自2002年7月起担任招商局集团公司董事。同时担任中国国际商会副主席、中国企业家协会执行副会长、中国金融学会常务理事、中国红十字会第八届理事会常务理事、深圳市综研软科学发展基金会理事长和北京大学、清华大学等多所高校兼职教授等职。

唐志宏先生,招商银行副行长,吉林大学本科毕业,高级经济师。1995年5月加入本公司,历任沈阳分行副行长,深圳管理部副主任,兰州分行行长,上海分行行长,深圳管理部主任,总行行长助理,2006年4月起担任本公司副行长。同时担任招商信诺人寿保险公司及中国银联股份有限公司董事。

吴晓辉先生,招商银行资产托管部总经理,硕士研究生,高级经济师。1993年10月进入招商银行工作;历任招商银行总行计划资金部副总经理,总行资金交易部总经理,招银国际金融有限公司总裁;招商银行济南分行党委书记、行长,2011年7月起担任招商银行总行资产托管部总经理。

3.基金托管业务经营情况

截至2012年6月30日,招商银行股份有限公司托管了招商安泰系列证券投资基金(含招商安泰股票型投资基金、招商安泰平衡型证券投资基金和招商安泰债券投资基金)、招商现金增值证券投资基金、华夏经典配置混合型证券投资基金、长城久泰中信标普300指数证券投资基金、中信现金优势货币市场基金、光大保德信货币市场证券投资基金、华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金、海富通强化回报混合型证券投资基金、光大保德信新增长股票型证券投资基金、富国天合稳健优选股票型证券投资基金、上证红利交易型开放式指数证券投资基金、德盛优势股票型证券投资基金、华富成长趋势股票型证券投资基金、光大保德信优势配置股票型证券投资基金、益民多利债券型证券投资基金、德盛红利股票证券投资基金、上证央企50交易型开放式指数基金、上投摩根行业轮动股票型证券投资基金、中银蓝筹精选灵活配置混合型证券投资基金、南方策略优化股票型证券投资基金、兴全合润分级股票型证券投资基金、中邮核心主题股票型证券投资基金、长盛沪深300指数证券投资基金(LOF)、中银价值精选灵活配置混合型基金、中银稳健双利债券型证券投资基金、银河创新成长股票型证券投资基金、嘉实多利分级债券型证券投资基金、国泰保本混合型证券投资基金、华宝兴可转债债券型证券投资基金、建信双利策略主题分级基金、诺安保本混合证券投资基金、鹏华新兴产业股票型证券投资基金、博时裕祥分级债券基金、中银上证国有企业100交易型开放式指数证券投资基金、华安可转换债券债券型证券投资基金、中银转债增强债券型证券投资基金、富国低碳环保股票型证券投资基金、诺安油气能源股票证券投资基金(QDII-LOF)、中银中小盘成长股票型证券投资基金、国泰成长优选股票型证券投资基金、兴全轻资产投资股票型证券投资基金(LOF)、易方达纯债债券型证券投资基金、中银沪深300等权重指数证券投资基金(LOF)共45只开放式基金及其它托管资产,托管资产为9077.79亿元人民币。

(三)注册登记人

名称:中国证券登记结算有限责任公司

住所:北京市西城区太平桥大街17号

办公地址:北京市西城区太平桥大街17号

法定代表人:金颖

电话:010-59378835

传真:010-59378907

联系人:朱立元

(四)验资机构

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:杨绍信

联系电话:021-23238888

经办注册会计师:单峰、刘颖

联系人:魏佳亮

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件。

七、基金财务状况(未经审计)

(一)基金募集期间费用

本次基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用,不从基金资产中支付。

(二)基金上市前重要财务事项

本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

(三)基金资产负债表

本基金2012年12月28日资产负债表如下:

资产	2012年12月28日	负债和所有者权益	2012年12月28日
	余额		余额
资产:		负债:	
银行存款	5,226,829.32	短期借款	-
结算备付金	12,154,611.80	交易性金融负债	-
存出保证金	-	衍生金融负债	-
交易性金融资产	1,528,076,048.80	卖出回购金融资产款	622,079,000.00
其中:股票投资	-	应付证券清算款	143,586.06
债券投资	1,528,076,048.80	应付赎回款	-
资产支持证券投资	-	应付管理人报酬	607,197.49
基金投资	-	应付托管费	151,799.39
衍生金融资产	-	应付销售服务费	303,598.75
买入返售金融资产	31,200,000.00	应付交易费用	4,050.23
应收证券清算款	-	应付税费	4,068.00
应收利息	39,676,105.00	应付利息	-
应收股利	-	应付利润	-
应收申购款	-	其他负债	-
其他资产	-	负债合计	623,293,299.92
		所有者权益:	
		实收基金	986,832,699.11
		未分配利润	6,207,595.89
		所有者权益合计	993,040,295.00
资产合计:	1,616,333,594.92	负债与持有人权益总计:	1,616,333,594.92

注:报告截止日2012年12月28日,鹏华中小企业纯债债券型发起式证券投资基金份额净值1.006,基金份额总额986,832,699.11。

八、基金投资组合

截止到2012年12月28日,本基金的投资组合如下:

(一)基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	1,528,076,048.80	94.54
	其中:债券	1,528,076,048.80	94.54
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	31,200,000.00	1.93
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	17,381,441.12	1.08
6	其他资产	39,676,105.00	2.45
7	合计	1,616,333,594.92	100.00

(二)按行业分类的股票投资组合

本基金截至2012年12月28日止未持有股票。

(三)按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

本基金截至2012年12月28日止未持有股票。

(四)按券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	1,524,864,048.80	153.56
5	企业短期融资券		
6	中期票据		
7	可转债	3,212,000.00	0.32
8	其他		
9	合计	1,528,076,048.80	153.88

(五)截至公告前两个工作日即2012年12月28日按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

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	122613	12乌海债	1,000,000	105,100,000.00	10.58
2	122809	11准国资	881,840	89,065,840.00	8.97
3	122658	12盘锦债	800,000	83,040,000.00	8.36
4	122545	12蒙高新	800,000	80,808,000.00	8.14
5	1280431	12六盘水开投债	700,000	69,958,000.00	7.04

(六)投资组合报告附注

1.本基金投资的前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

2.截至公告前两个工作日即2012年12月28日,本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

3.其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	39,676,105.00
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	39,676,105.00

4.本基金持有的处于转股期的可转换债券明细及资产支持证券、分离交易可转债

截至公告前两个工作日即2012年12月28日,本基金未持有处于转股期的可转换债券,未持有资产支持证券,未持有分离交易可转债。

5.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,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

九、重大事件揭示

本基金自合同生效至上市交易公告书公告前未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

十、基金管理人承诺

本基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出承诺:

(一)严格遵守《基金法》及其他法律法规、《基金合同》的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

(二)真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件,披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息,并接受中国证监会、深圳证券交易所的监督管理。

(三)在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后,将及时予以公开澄清。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就本基金上市交易后履行托管人职责做出如下承诺:

(一)严格遵守《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定,设立专门的基金托管部,配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员负责基金财产托管事宜。

(二)根据《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定,对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付等行为进行监督和核查。

(三)基金托管人发现基金管理人的行为违反《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定,将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正,并在限期内,随时对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。

(四)基金托管人发现基金管理人有重大违规行为,将立即报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正,并将纠正结果报告中国证监会。

十二、基金上市推荐人意见

本基金无上市推荐人。

十三、备查文件目录

(一)备查文件目录

1.中国证监会批准鹏华中小企业纯债债券型发起式证券投资基金募集的文件

2.《鹏华中小企业纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》

3.《鹏华中小企业纯债债券型发起式证券投资基金基金托管协议》

4.《鹏华中小企业纯债债券型发起式证券投资基金招募说明书》

5.法律意见书

6.基金管理人业务资格批件、营业执照

7.基金托管人业务资格批件、营业执照

(二)存放地点

深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心第43层鹏华基金管理有限公司。

(三)查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件,或通过本基金管理人网站(http://www.phfund.com.cn)查阅。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人鹏华基金管理有限公司,本公司已开通客户服务系统,咨询电话:4006788999。

鹏华基金管理有限公司
2013年1月4日

附件:鹏华中小企业纯债债券型发起式证券投资基金基金合同摘要

一、基金管理人、基金托管人和基金份额持有人的权利、义务

(一)基金管理人的权利与义务

根据《基金法》及其他有关法律法规,基金管理人的权利为:

1.自本基金合同生效之日起,依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用基金财产;

2.依照基金合同获得基金管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入;

3.发售基金份额;

4.依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利;

5.在符合有关法律法规的前提下,制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则,在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金的除调高托管费率和管理费率之外的相关费率结构和收费方式;

6.根据本基金合同及有关规定监督基金托管人,对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为,对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形,应及时呈报中国证监会,并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益;

7.在基金合同约定的范围内,拒绝或暂停受理申购和赎回申请;

8.在法律法规允许的前提下,为基金的利益依法为基金进行融资、融券;

9.自行担任或选择、更换注册登记机构,获取基金份额持有人名册,并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查;

10.选择、更换代销机构,并依据基金销售服务代理协议和有关法律法规,对其行为进行必要的监督和检查;

11.选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构;

12.在基金托管人更换时,提名新的基金托管人;

13.依法召集基金份额持有人大会;

14.法律法规和基金合同规定的其他权利。

根据《基金法》及其他有关法律法规,基金管理人的义务为:

1.依法募集基金,办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜;

2.办理基金备案手续;

3.自基金合同生效之日起,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产;

4.配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策,以专业化的经营方式管理和运作基金财产;

5.建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度,保证所管理的基金财产和管理人的财产相互独立,对所管理的不同基金分别管理,分别记账,进行证券投资;

6.除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外,不得为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人运作基金财产;

7.依法接受基金托管人的监督;

8.计算并公告基金资产净值,确定基金份额申购、赎回价格;

9.采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定;

10.按规定受理申购和赎回申请,及时、足额支付赎回款项;

11.进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;

12.编制中期和年度基金报告;

13.严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定,履行信息披露及报告义务;

14.保守基金商业秘密,不得泄露基金投资计划、投资意向等,除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前应予保密,不得向他人泄露;

15.按照基金合同的约定确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配收益;

16.依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会;

17.保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料;

18.以基金管理人名义,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;

19.组织并参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;

20.因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益,应当承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;

21.基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时,应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿;

22.按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料;

23.面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时,及时报告中国证监会并通知基金托管人;

24.执行生效的基金份额持有人大会决议;

25.不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动;

26.依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利,为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利,不谋求对上市公司的控股和直接管理;

27.法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

(二)基金托管人的权利与义务

根据《基金法》及其他有关法律法规,基金托管人的权利为:

1.依基金合同约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入;

2.监督基金管理人对本基金的投资运作;

3.自本基金合同生效之日起,依法保管基金资产;

4.在基金管理人更换时,提名新任基金管理人;

5.根据本基金合同及有关规定监督基金管理人,对于基金管理人违反本基金合同或有关法律法规规定的行为,对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的情形,应及时呈报中国证监会;

6.依法召集基金份额持有人大会;

7.按规定取得基金份额持有人名册资料;

8.法律法规和基金合同规定的其他权利。

根据《基金法》及其他有关法律法规,基金托管人的义务为:

1.安全保管基金财产;

2.设立专门的基金托管部,具有符合要求的营业场所,配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员,负责基金财产托管事宜;

3.对所托管的不同基金财产分别设置账户,确保基金财产的完整与独立;

4.除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外,不得为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人托管基金财产;

5.保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证;

6.按规定开设基金财产的资金账户和证券账户;

(下转C31版)

鹏华基金管理有限公司旗下基金2012年12月31日资产净值公告

截至2012年12月31日,鹏华基金管理有限公司旗下基金资产净值及份额净值如下:

日期	基金代码	基金名称	资产净值(元)	基金份额净值(元)	基金份额累计净值(元)
2012-12-31	150061	丰泽B	-	1.223	1.223
2012-12-31	150100	鹏华资源A	-	1.016	1.016
2012-12-31	150101	鹏华资源B	-	0.984	0.984
2012-12-31	159911	鹏华深证民营ETF	303,048,100.28	2.5197	0.7635
2012-12-31	160602	普天债券A类	992,436,769.26	1.104	1.518
2012-12-31	160603	鹏华普天收益	2,280,421,588.03	0.748	3.194
2012-12-31	160605	鹏华中国50	4,349,261,535.37	1.226	3.326
2012-12-31	160607	鹏华价值优势	10,049,544,328.24	0.794	2.473
2012-12-31	160608	普天债券B类	120,273,196.60	1.078	1.462
2012-12-31	160610	鹏华动力	5,795,678,430.35	1.036	1.456
2012-12-31	160611	鹏华优质治理	4,258,837,051.04	0.832	0.932
2012-12-31	160612	鹏华丰收债券	2,566,169,622.15	1.032	1.349
2012-12-31	160613	鹏华盛世创新	509,200,301.65	1.190	1.220
2012-12-31	160615	鹏华沪深300	844,521,091.95	0.905	0.965
2012-12-31	160616	鹏华中证500	822,238,684.41	0.685	0.685
2012-12-31	160617	鹏华丰润	1,451,047,281.09	1.086	1.108
2012-12-31	160618	鹏华丰泽分级债券	2,148,691,891.68	1.105	1.130
2012-12-31	160619	丰泽A	-	1.003	1.051
2012-12-31	160620	鹏华资源分级	175,508,820.47	1.000	1.000
2012-12-31	160621	鹏华中小企业债券	993,034,576.94	1.006	1.006
2012-12-31	184689	基金普惠	1,907,954,571.24	0.9540	3.8220
2012-12-31	184693	基金普丰	2,584,115,292.73	0.8614	2.9478
2012-12-31	206001	鹏华行业成长	710,318,550.24	0.8708	3.5244
2012-12-31	206002	鹏华精选成长	889,985,430.86	0.786	0.786
2012-12-31	206003	鹏华信用增利A类	2,029,887,359.47	1.103	1.103
2012-12-31	206004	鹏华信用增利B类	250,395,538.09	1.094	1.094
2012-12-31	206005	鹏华上证民企50ETF联接	267,154,673.83	0.845	0.845
2012-12-31	206007	鹏华消费优选	601,483,987.03	0.871	0.871
2012-12-31	206008	鹏华丰盛	1,182,424,564.10	1.090	1.090
2012-12-31	206009	鹏华新兴产业	719,939,924.27	0.984	0.984
2012-12-31	206010	鹏华深证民营ETF联接	148,626,508.92	0.7870	0.7870
2012-12-31	206012	鹏华价值精选	91,281,683.96	0.952	0.952
2012-12-31	206013	鹏华金刚保本	1,514,199,225.33	1.014	1.014
2012-12-31	206015	鹏华纯债债券	1,916,485,362.03	1.013	1.013
2012-12-31	510070	民企ETF	320,772,484.76	0.978	0.838
2012-12-31	基金代码	基金名称	资产净值(元)	每万份收益(元)	七日年化收益率(%)
2012-12-31	160606	鹏华货币A级	1,276,062,698.73	0.9665	3.909
2012-12-31	160609	鹏华货币B级	6,116,134,709.61	1.0320	4.155