鹏华中证800非银行金融指数分级证券投资基金招募说明书

(上接B15版)

(七)计票

1、现场开会

(1)如大会由基金管理人或基金托管人召集,基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人;如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集,但是基金管理人或基金托管人未出席大会的,基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的,不影响计票的效力。

(2)监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

(3)如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑,可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点,重新清点以一次为限。重新清点后,大会主持人应当当场公布重新清点结果。

(4)计票过程应由公证机关予以公证,基金管理人或基金托管人拒不出席大会的,不影响计票的效力。

2、通讯开会

在通讯开会的情况下,计票方式为:由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表(若由基金托管人召集,则为基金管理人授权代表)的监督下进行计票,并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的,不影响计票和表决结果。

(八)生效与公告

基金份额持有人大会的决议,召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会的决议自完成备案手续之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起2个工作日内在指定媒体上公告。如果采用通讯方式进行表决,在公告基金份额持有人大会决议时,必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。

(九)本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定,凡是直接引用法律法规的部分,如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的,基金管理人提前公告后,可直接对本部分内容进行修改和调整,无需召开基金份额持有人大会审议。

三、基金收益分配原则、执行方法

(一)基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额,基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

(二)基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

(三)基金收益分配原则

在存续期内,本基金(包括鹏华非银行份额、鹏华非银行A份额、鹏华非银行B份额)不进行收益分配。

法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

四、基金财产管理、运用相关费用的提取、支付方式与比例

(一)基金费用的种类

1、基金管理人的管理费;
2、基金托管人的托管费;
3、《基金合同》生效后的标的指数许可使用费;
4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;
5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;
6、基金份额持有人大会费用;
7、基金的证券交易费用;
8、基金的银行汇划费用;
9、证券账户开户费用、账户维护费用;
10、基金的上市费和年费;
11、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。

(二)基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.00%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×1.00 %÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由托管人根据与管理人核对一致的财务数据,自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付,管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.22%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.22%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由托管人根据与管理人核对一致的财务数据,自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付,管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

3、标的指数许可使用费

本基金的标的指数许可使用费按前一日基金资产净值的0.02%的年费率计提。标的指数许可使用费的计算方法如下:

H=E×0.02%÷当年天数

H为每日应计提的标的指数许可使用费

E为前一日的基金资产净值

标的指数许可使用费每日计算,逐日累计至每季季末,按季支付(当季不足50,000元的,按50,000元计算),计费期间不足一季度的,根据实际天数按比例计算。由基金管理人向基金托管人发送标的指数许可使用费划款指令,基金托管人复核后于次季前10 个工作日内从基金财产中一次性支付给标的指数供应商。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

标的指数供应商根据相应指数许可协议变更标的指数许可使用费率和计算方式时, 基金管理人需依照有关规定最迟于新的费率和计费方式实施日前2日在至少一家指定媒体公告。

上述"一、基金费用的种类中第4—10项费用",根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

(三)不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;
2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;
3、《基金合同》生效前的相关费用;
4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

(四)基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

基金财产投资的相关税收,由基金份额持有人承担,基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

五、基金财产的投资方向和投资限制

(一)投资范围

本基金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(含中小板、创业板股票及其他中国证监会核准上市的股票)、债券、股指期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

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。

基金的投资组合比例为:投资于标的指数成份股及其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,现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。

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。

(二)投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制:

(1)投资于标的指数成份股及其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%;

(2)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,保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券;

(3)本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的3%;

(4)本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证,不得超过该权证的10%;

(5)本基金在任何交易日买入权证的总金额,不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%;

(6)本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例,不得超过基金资产净值的10%;

(7)本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的20%;

(8)本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的10%;

(9)本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%;

(10)本基金应投资于信用级别评级为BBB以上(含BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间,如果其信用等级下降、不再符合投资标准,应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出;

(11)本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%;

(12)本基金在任何交易日日终,持有的买入股指期货合约价值,不得超过基金资产净值的10%;

(13)本基金在任何交易日日终,持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的100%。其中,有价证券指股票、债券(不含到期日在一年以内的政府债券)、权证、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等;

(14)本基金在任何交易日日终,持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%;

(15)本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值,合计(轧差计算)应当不低于基金资产净值的90%;

(16) 本基金在任何交易日内交易 (不包括平仓) 的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%;

(17)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的,基金管理人应当在10个交易日内进行调整。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动:

(1)承销证券;
(2)违反规定向他人贷款或者提供担保;
(3)从事承担无限责任的投资;
(4)买卖其他基金份额,但是中国证监会另有规定的除外;
(5)向其基金管理人、基金托管人出资;
(6)从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;
(7)法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

法律法规或监管部门取消上述禁止性规定,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制。

六、基金资产净值的计算方法和公告方式

(一)基金资产净值的计算方法

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

(二)基金资产净值、基金份额净值和基金份额参考净值的公告方式

《基金合同》生效后,在鹏华非银行A份额与鹏华非银行B份额开始上市交易前或鹏华非银行份额开始办理申购或者赎回前,基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值、鹏华非银行份额的基金份额净值、鹏华非银行A份额与鹏华非银行B份额的基金份额参考净值。

在鹏华非银行A份额与鹏华非银行B份额开始上市交易后或鹏华非银行份额开始办理申购或者赎回后,基金管理人应当在每个开放日的次日,通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介,披露开放日鹏华非银行份额的基金份额净值和基金份额累计净值、鹏华非银行A份额与鹏华非银行B份额的基金份额参考净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日(自然日)基金资产净值、鹏华非银行份额的基金份额净值、鹏华非银行A份额与鹏华非银行B份额的基金份额参考净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日(自然日)的次日,将基金资产净值、鹏华非银行份额的基金份额净值和基金份额累计净值、鹏华非银行A份额与鹏华非银行B份额的基金份额参考净值和基金份额累计净值登载在指定媒体上。

七、基金合同变更和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

(一)《基金合同》的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的,应召开基金份额持有人大会决议通过。对于可不经基金份额持有人大会决议通过的事项,由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告,并报中国证监会备案。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自完成备案手续后方可执行,自决议生效后两日内在指定媒体公告。

(二)《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的,《基金合同》应当终止:

1、基金份额持有人大会决定终止的;
2、基金管理人、基金托管人职责终止,在6个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的;
3、《基金合同》约定的其他情形;
4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

(三)基金财产的清算

1、基金财产清算小组:自出现《基金合同》终止事由之日起30个工作日内成立清算小组,基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、基金财产清算小组组成:基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

3、基金财产清算小组职责:基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

4、基金财产清算程序:

(1)《基金合同》终止情形出现时,由基金财产清算小组统一接管基金;
(2)对基金财产和债权债务进行清理和确认;
(3)对基金财产进行估值和变现;
(4)制作清算报告;
(5)聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计,聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书;
(6)将清算报告报中国证监会备案并公告;
(7)对基金财产进行分配。

5、基金财产清算的期限为6个月。

(四)清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用,清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

(五)基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案,将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后,分别计算鹏华非银行份额、鹏华非银行A份额、鹏华非银行B份额各自的应计分配比例,并据此向鹏华非银行份额、鹏华非银行A份额、鹏华非银行B份额各自的基金份额持有人按其持有的基金份额比例进行分配。

(六)基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告;基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

(七)基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

八、争议解决方式

各方当事人同意,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,应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,仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间,基金合同当事人应恪守各自的职责,继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务,维护基金份额持有人的合法权益。

《基金合同》受中国法律管辖。

九、基金合同存放地和投资人取得基金合同的方式

基金合同可印制成册,供投资人在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅。

附件二、托管协议内容摘要

一、托管协议当事人

(一)基金管理人

名称:鹏华基金管理有限公司
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
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
邮政编码:518048
法定代表人:何如
成立日期:1998年12月22日
批准设立机关及批准设立文号:中国证监会证监基字[1998]31号
组织形式:有限责任公司
注册资本:1.5亿元
存续期间:持续经营
经营范围:基金募集;基金销售;资产管理以及中国证监会许可的其它业务。

(二)基金托管人

名称:中国建设银行股份有限公司(简称:中国建设银行)
住所: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
邮政编码:100033
法定代表人:王洪章
成立日期:2004年09月17日
基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字[1998]12号
组织形式:股份有限公司
注册资本:贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整
存续期间:持续经营
经营范围:吸收公众存款;发放短期、中期、长期贷款;办理国内外结算;办理票据承兑与贴现;发行金融债券;代理发行、代理兑付、承销政府债券;买卖政府债券、金融债券;从事同业拆借;买卖、代理买卖外汇;从事银行卡业务;提供信用证服务及担保;代理收付款项及代理保险业务;提供保管箱服务;经中国银行业监督管理机构等监管部门批准的其他业务。

二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

(一)基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定,对基金投资范围、投资对象进行监督。《基金合同》明确约定基金投资风格或证券选择标准的,基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池,以便基金托管人运用相关技术系统,对基金实际投资是否符合《基金合同》关于证券选择标准的约定进行监督,对存在疑义的事项进行核查。

本基金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(含中小板、创业板股票及其他中国证监会核准上市的股票)、债券、股指期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

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。

(二)基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定,对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督:

1. 投资于标的指数成份股及其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%;;

2. 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,保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券;

3.本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的3%;

4.本基金在任何交易日买入权证的总金额,不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%;

5.本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例,不得超过基金资产净值的10%;

6.本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的20%;

7.本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的10%;

8.本基金应投资于信用级别评级为BBB以上(含BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间,如果其信用等级下降、不再符合投资标准,应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出;

9.本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%;

10.本基金持有的所有流通受限证券,其公允价值不得超过本基金资产净值的20%;本基金持有的同一流通受限证券,其公允价值不得超过本基金资产净值的10 %;

11.本基金在任何交易日日终,持有的买入股指期货合约价值,不得超过基金资产净值的10%。

12.本基金在任何交易日日终,持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的100%。其中,有价证券指股票、债券(不含到期日在一年以内的政府债券)、权证、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等。

13.本基金在任何交易日日终,持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%。

14.本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值,合计(轧差计算)应当不低于基金资产净值的90%。

15.本基金在任何交易日内交易(不包括平仓)的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%。

本基金在开始进行股指期货投资之前,应与基金托管人就股指期货开户、清算、估值、交收等事宜另行具体协商。

如果法律法规对上述投资组合比例限制进行变更的,以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,则本基金投资不再受相关限制。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的,基金管理人应当在10个交易日内进行调整。

(三)基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定,对本托管协议第十五条第九款基金投资禁止行为进行监督。基金托管人通过事后监督方式对基金管理人基金投资禁止行为进行监督。

(四)基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定,对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的、经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单,并约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金管理人应严格按照交易对手名单的范围在银行间债券市场选择交易对手。基金托管人监督基金管理人是否按事前提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。基金管理人可以每半年对银行间债券市场交易对手名单及结算方式进行更新,新名单确定前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易,仍应按照协议进行结算。如基金管理人根据市场情况需要临时调整银行间债券市场交易对手名单及结算方式的,应向基金托管人说明理由,并在与交易对手发生交易前3个工作日内与基金托管人协商解决。

基金管理人负责对交易对手的资信控制,按银行间债券市场的交易规则进行交易,并负责解决因交易对手不履行合同而造成的纠纷及损失,基金托管人不承担由此造成的任何法律责任及损失。若未履约的交易对手在基金托管人与基金管理人确定的时间前仍未承担违约责任及其他相关法律责任的,基金管理人可以对相应损失先行予以承担,然后再向相关交易对手追偿。基金托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督。如基金托管人事后发现基金管理人没有按照事先约定的交易对手或交易方式进行交易时,基金托管人应及时提醒基金管理人,基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任。

(五)基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定,对基金管理人投资流通受限证券进行监督。

基金管理人投资流通受限证券,应事先根据中国证监会相关规定,明确基金投资流通受限证券的比例,制订严格的投资决策流程和风险控制制度,防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险。基金托管人对基金管理人是否遵守相关制度、流动性风险处置预案以及相关投资额度和比例等的情况进行监督。

1.本基金投资的受限证券须为经中国证监会批准的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券,不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。本基金不投资有锁定期但锁定期不明确的证券。

本基金投资的受限证券限于可由中国证券登记结算有限责任公司或中央国债登记结算有限责任公司负责登记和存管,并可在证券交易所或全国银行间债券市场交易的证券。

本基金投资的受限证券应保证登记存管在本基金名下,基金管理人负责相关工作的落实和协调,并确保基金托管人能够正常查询。因基金管理人原因产生的受限证券登记存管问题,造成基金托管人无法安全保管本基金资产的责任与损失,及因受限证券存管直接影响本基金安全的责任及损失,由基金管理人承担。

本基金投资受限证券,不得预付任何形式的保证金。

2.基金管理人投资非公开发行股票,应制订流动性风险处置预案并经其董事会批准。风险处置预案应包括但不限于因投资受限证券需要解决的基金投资比例限制失调、基金流动性困难以及相关损失的应对解决措施,以及有关异常情况的处置。基金管理人应在首次投资流通受限证券前向基金托管人提供基金投资非公开发行股票相关流动性风险处置预案。

基金管理人对本基金投资受限证券的流动性风险负责,确保对相关风险采取积极有效的措施,在合理的时间内有效解决基金运作的流动性问题。如因基金巨额赎回或市场发生剧烈变动等原因而导致基金现金周转困难时,基金管理人应保证提供足额现金确保基金的支付结算,并承担所有损失。对本基金因投资受限证券导致的流动性风险,基金托管人不承担任何责任。如因基金管理人原因导致本基金出现损失致使基金托管人承担连带赔偿责任的, 基金管理人应赔偿基金托管人由此遭受的损失。

3.本基金投资非公开发行股票,基金管理人应至少于投资前三个工作日向基金托管人提交有关书面资料,并保证向基金托管人提供的有关资料真实、准确、完整。有关资料如有调整,基金管理人应及时提供调整后的资料。上述书面资料包括但不限于:

(1)中国证监会批准发行非公开发行股票的批准文件。
(2)非公开发行股票有关发行数量、发行价格、锁定期等发行资料。
(3)非公开发行股票发行人与中国证券登记结算有限责任公司或中央国债登记结算有限责任公司签订的证券登记及服务协议。
(4)基金拟认购的数量、价格、总成本、账面价值。

4.基金管理人应在本基金投资非公开发行股票后两个交易日内,在中国证监会指定媒体披露所投资非公开发行股票的名称、数量、总成本、账面价值,以及总成本和账面价值占基金资产净值的比例、锁定期等信息。

本基金有关投资受限证券比例如违反有关限制规定,在合理期限内未能进行及时调整,基金管理人应在两个工作日内编制临时报告书,予以公告。

5.基金托管人根据有关规定有权对基金管理人进行以下事项监督:

(1)本基金投资受限证券时的法律法规遵守情况。
(2)在基金投资受限证券管理工作方面有关制度、流动性风险处置预案的建立与完善情况。
(3)有关比例限制的执行情况。
(4)信息披露情况。

6.相关法律法规对基金投资受限证券有新规定的,从其规定。

(六)基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定,对基金资产净值计算、各类基金份额的基金份额净值或基金份额参考净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。

(七)基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作违反法律法规、《基金合同》和本托管协议的规定,应及时以电话提醒或书面提示等方式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到书面通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函,就基金托管人的疑义进行解释或举证,说明违规原因及纠正期限,并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内,基金托管人有权随时对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的,基金托管人应报告中国证监会。

(八)基金管理人有义务配合和协助基金托管人依照法律法规、《基金合同》和本托管协议对基金业务执行核查。对基金托管人发出的书面提示,基金管理人应在规定时间内答复并改正,或就基金托管人的疑义进行解释或举证;对基金托管人按照法律法规、《基金合同》和本托管协议的要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项,基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

(九)若基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律、行政法规和其他有关规定,或者违反《基金合同》约定的,应当立即通知基金管理人,由此造成的损失由基金管理人承担。

(十)基金托管人发现基金管理人有重大违规行为,应及时报告中国证监会,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。基金管理人无正当理由,拒绝、阻挠对方根据本托管协议规定行使监督权,或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督,情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的,基金托管人应报告中国证监会。

三、基金管理人对基金托管人的业务核查

(一)基金管理人对基金托管人履行托管职责情况进行核查,核查事项包括基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值和基金份额参考净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

(二)基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、《基金合同》、本协议及其他有关规定时,应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正。基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式给基金管理人发出回函,说明违规原因及纠正期限,并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内,基金管理人有权随时对通知事项进行复查,督促基金托管人改正。基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为,包括但不限于:提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性,在规定时间内答复基金管理人并改正。

(三)基金管理人发现基金托管人有重大违规行为,应及时报告中国证监会,同时通知基金托管人限期纠正,并将纠正结果报告中国证监会。基金托管人无正当理由,拒绝、阻挠对方根据本协议规定行使监督权,或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督,情节严重或经基金管理人提出警告仍不改正的,基金管理人应报告中国证监会。

四、基金财产的保管

(一)基金财产保管的原则

1.基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。
2.基金托管人应安全保管基金财产。
3.基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。
4.基金托管人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。
5.基金托管人按照《基金合同》和本协议的约定保管基金财产,如有特殊情况双方可另行协商解决。基金托管人未经基金管理人的指令,不得自行运用、处分、分配本基金的任何资产(不包含基金托管人依据中国结算公司结算数据完成场内交易交收、托管资产开户银行扣收结算费和账户维护费等费用)。
6.对于因为基金投资产生的应收资产,应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人,到账日基金财产没有到达基金账户的,基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金财产造成损失的,基金管理人应负责向有关当事人追偿基金财产的损失,基金托管人对此不承担任何责任。
7.除依据法律法规和《基金合同》的规定外,基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

(二)基金募集期间及募集资金的验资

1.基金募集期间募集的资金应存于基金管理人在基金托管人的营业机构开立的"基金募集专户"。该账户由基金管理人开立并管理。

2.基金募集期满或基金停止募集时,募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后,基金管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人开立的基金银行账户,同时在规定时间内,聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资,出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的2名或2名以上中国注册会计师签字方为有效。

3.若基金募集期限届满,未能达到《基金合同》生效的条件,由基金管理人按规定办理退款等事宜。

(三)基金银行账户的开立和管理

1.基金托管人可以基金的名义在其营业机构开立基金的银行账户,并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。

2.基金银行账户的开立和使用,限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立任何其他银行账户;亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

3.基金银行账户的开立和管理应符合银行业监督管理机构的有关规定。

4.在符合法律法规规定的条件下,基金托管人可以通过基金托管人专用账户办理基金资产的支付。

(四)基金证券账户和结算备付金账户的开立和管理

1. 基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司为基金开立基金托管人与基金联名的证券账户。

2.基金证券账户的开立和使用,仅限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借或未经对方同意擅自转让基金的任何证券账户,亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

3.基金证券账户的开立和证券账户卡的保管由基金托管人负责,账户资产的管理和运用由基金管理人负责。

4.基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户,并代表所托管的基金完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清算工作,基金管理人应予以积极协助。结算备付金、结算互保基金、交收价差资金等的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

5. 若中国证监会或其他监管机构在本托管协议订立日之后允许基金从事其他投资品种的投资业务,涉及相关账户的开立、使用的,若无相关规定,则基金托管人比照上述关于账户开立、使用的规定执行。

(五)债券托管专户的开设和管理

《基金合同》生效后,基金托管人根据中国人民银行、银行间市场登记结算机构的有关规定,在银行间市场登记结算机构开立债券托管账户,持有人账户和资金结算账户,并代表基金进行银行间市场债券的结算。基金管理人和基金托管人共同代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议。

(六)其他账户的开立和管理

1.因业务发展需要而开立的其他账户,可以根据法律法规和《基金合同》的规定,由基金托管人负责开立。新账户按有关规定使用并管理。

2.法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的,从其规定办理。

(七)基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券、银行存款开户证实书等有价凭证由基金托管人存放于基金托管人的保管库,也可存入中央国债登记结算有限责任公司、中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司或票据营业中心的代保管库,保管凭证由基金托管人持有。有价凭证的购买和转让,由基金管理人和基金托管人共同办理。基金托管人对由基金托管人以外机构实际有效控制的资产不承担保管责任。

(八)与基金财产有关的重大合同的保管

与基金财产有关的重大合同的签署,由基金管理人负责。由基金管理人代表基金签署的、与基金财产有关的重大合同的原件分别由基金管理人、基金托管人保管。除本协议另有规定外,基金管理人代表基金签署的与基金财产有关的重大合同包括但不限于基金年度审计合同、基金信息披露协议及基金投资业务中产生的重大合同,基金管理人应保证基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人应在重大合同签署后及时以加密方式将重大合同传真给基金托管人,并在三十个工作日内将正本送达基金托管人处。重大合同的保管期限为《基金合同》终止后15年。

五、基金资产净值计算与复核

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。基金份额净值是指每一份基金份额所代表的基金资产净值。基金管理人按照《基金合同》中约定的基金份额的净值计算规则计算鹏华非银行份额、鹏华非银行A份额、鹏华非银行B份额的基金份额净值,并在基金份额净值计算的基础上计算鹏华非银行A份额与鹏华非银行B份额的基金份额参考净值。基金份额参考净值是对相应基金份额价值的一个估算,并不代表基金份额持有人可获得的实际价值。

鹏华非银行份额净值的计算,保留到小数点后3位,小数点后第4位四舍五入,由此产生的误差计入基金财产。鹏华非银行A份额参考净值、鹏华非银行B份额参考净值的计算,均保留到小数点后3位,小数点后第4位四舍五入。鹏华非银行A份额净值、鹏华非银行B份额净值的计算,均保留到小数点后8位,小数点后第9位四舍五入,由此产生的误差计入基金财产。

基金管理人应每工作日对基金资产估值。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算办法》及其他法律、法规的规定。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。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金份额资产净值并以双方认可的方式发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核后以双方认可的方式发送给基金管理人,由基金管理人对基金净值予以公布。

根据《基金法》,基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。基金管理人计算并公告基金资产净值,基金托管人复核、审查基金管理人计算的基金资产净值。因此,本基金的会计责任方是基金管理人,就与本基金有关的会计问题,如经相关各方在平等基础上充分讨论后,仍无法达成一致的意见,按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。法律法规以及监管部门有强制规定的,从其规定。如有新增事项,按国家最新规定估值。

因此,就与本基金有关的会计问题,本基金的会计责任方是基金管理人,如经相关各方在平等基础上充分讨论后,仍无法达成一致的意见,按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。

六、基金份额持有人名册的登记与保管

基金份额持有人名册至少应包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。基金份额持有人名册由基金注册登记机构根据基金管理人的指令编制和保管,基金管理人和基金托管人应分别保管基金份额持有人名册,保存期不少于15年。如不能妥善保管,则按相关法规承担责任。

在基金托管人要求或编制半年报和年报前,基金管理人应将有关资料送交基金托管人,不得无故拒绝或延误提供,并保证其的真实性、准确性和完整性。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途,并应遵守保密义务。

七、争议解决方法

因本协议产生或与之相关的争议,双方当事人应通过协商、调解解决,协商、调解不能解决的,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,仲裁地点为北京市,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。仲裁裁决是终局的,对当事人均有约束力,仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间,双方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责,各自继续忠实、勤勉、尽责地履行《基金合同》和本托管协议规定的义务,维护基金份额持有人的合法权益。

本协议受中国法律管辖。

八、托管协议的变更与终止

(一)托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致,可以对协议进行修改。修改后的新协议,其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突。基金托管协议的变更报中国证监会备案后生效。

(二)基金托管协议终止出现的情形

1.《基金合同》终止;
2.基金托管人解散、依法被撤销、破产或由其他基金托管人接管基金资产;
3.基金管理人解散、依法被撤销、破产或由其他基金管理人接管基金管理权;
4.发生法律法规或《基金合同》规定的终止事项。

签署人:鹏华基金管理有限公司(公章)
签署日期: 年 月 日

鹏华中证800非银行金融指数分级证券投资基金份额发售公告

(上接B13版)

3、如已开立证券卡,投资者可直接持证券卡、被授权人有效身份证明及复印件、印鉴、营业执照或事业社团法人证书及复印件、军队或武警开户许可证及复印件、组织机构代码证及复印件(开户单位为分支机构的,请提交法人授权其开户的书面证明)到会计柜台开立鹏华基金管理有限公司基金账户 。

4、认购程序及所需材料

(1)被授权人有效身份证明原件;

(2)填妥的"证券买入(基金认购/申购)委托单";

5、注意事项

(1)机构投资者请到原机构活期存款账户开户会计柜台办理开户和认购手续;

(2)若有其他方面的要求,请以中国建设银行《中国建设银行证券业务系统机构客户操作指南》为准。

(四)其他银行及证券公司代销网点办理开户(或账户注册)和认购流程

其他代销银行及证券公司开户和认购的相关程序以各银行和证券公司相关规定为准。

(五)本公司直销中心办理开户(或账户注册)和认购的流程

1、在本基金募集期间,本公司设在深圳、上海、北京、武汉和广州的直销中心向首次认购金额不低于50万元的投资者办理开户(或账户注册)、认购手续,追加认购单笔最低认购金额为1万元。

2、认购时间:2014年4月3日至2014年4月24日

3、认购程序:

(1)办理开户(或账户注册):

投资者认购本基金,需开立中国证券登记结算有限责任公司深圳开放式基金账户,如已开立则不需重新办理。在基金募集期间,投资者的开户和认购申请可同时办理。办理基金账户卡时请注意:

1)个人投资者必须提供以下材料:

① 基金开户申请表
② 开户人有效身份证明复印件(证件类型包括:身份证、护照、军官证、士兵证等有效的中国证件)
③ 投资者风险承受能力调查问卷

2)机构投资者必须提供以下材料:

①《基金开户申请表》
② 法人有效的营业执照(或注册登记证书)复印件并加盖单位公章
③ 法人授权委托书
④ 银行账户确认书
⑤经办人的有效身份证明复印件(证件类型包括:身份证、护照、军官证、士兵证等有效的中国国籍证件)
⑥《预留印鉴卡》
⑦传真交易协议
⑧ 投资者风险承受能力调查问卷
⑨ 法人身份证复印件

3)合格境外机构投资者

一般应由托管人负责开立基金账户,应提供以下资料

① 证监会、人民银行和国家外汇管理局关于批准托管人资格的批复的复印件(加盖托管行的托管部公章)
② 托管人在中国境内的企业法人营业执照或者金融许可证的复印件(加盖托管行的托管部公章)
③ 托管协议的首页、盖章页复印件(加盖托管行的托管部公章)
④ 托管人出具的委托经办人办理开户的授权委托书
⑤ 经办人有效身份证复印件(正反面)
⑥ QFII 委托托管人办理基金账户业务授权委托书
⑦ 中国证监会颁发的QFII证券投资业务许可证复印件以及相关投资额度的审批证明(加盖托管行托管部公章)

本公司一般不接受法定年龄在十八周岁以下的人士作为基金帐户的开户人、授权委托人、经办人;如果十八周岁以下的人士坚持要认(申)购本公司旗下未对投资者年龄做明确限制的开放式基金,本公司可以根据相关法律法规及基金合同约定,在履行相关手续后决定是否予以办理。

已在本公司代销机构开立基金账户的客户,需在直销中心开立交易账户(所需资料同开户)。

(2)认购基金:

投资者申请认购本基金,应将足额申购资金以转账方式,划入本公司销售汇总专户,并确保在当日16:30前到账,不接受除转账以外的其它缴款方式。

1)个人投资者办理认购时必须提供以下材料:

① 本人身份证件复印件(身份证、军人证或护照)
② 转账凭证复印件
③ 填妥的《基金认/申购申请表》

2)机构投资者办理认购时必须提供以下材料:

① 已填好的《基金认/申购申请表》,并加盖预留印鉴
② 转账凭证复印件

如果公司直销系统中记录的投资者风险承受能力与投资者的认、申购基金的风险不匹配,直销中心可要求客户填制《投资者风险承受能力确认书》并传真到直销中心后再做业务。

(3)投资者风险承受能力调查

①通过直销柜台新开户或以前没有做过风险承受能力测评的投资者需填写《风险承受能力调查问卷》。

②《投资者风险承受能力调查问卷》对投资者风险承受能力的测评结果与投资者希望购买的基金的风险等级不匹配,需填写《投资者风险承受能力确认书》。

(4)缴款:

投资者需按照鹏华基金管理公司直销中心的规定,在办理认购前将足额资金汇入鹏华基金管理有限公司直销清算账户。

户名:鹏华基金管理有限公司直销专户
开户银行:中国工商银行深圳星河支行
银行账号:4000040519200062443
大额实时现代支付系统号:27708405(同行),102584004055(跨行)

投资者所填写的汇款单据在汇款用途中必须注明认购的基金名称、基金代码和投资者名称,并确保募集期间工作日当日16:30前到账。投资者若未按上述规定划付资金,造成认购无效的,鹏华基金管理有限公司和直销清算账户的开户银行不承担任何责任。

若投资者当日未将足额资金划付到账,则以资金到账日作为认购申请的受理日(即有效申请日)。

至募集期结束,出现以下任一无效认购情形的,认购款项将在本基金合同生效后三个工作日内划往投资者指定的资金结算账户,该退回款项产生的利息等损失由投资者自行承担:

① 投资者划来资金,但未办理开户手续或开户不成功的;
② 投资者划来资金,但未办理认购申请或认购申请未被确认的;
③ 投资者划来的认购资金少于其申请的认购金额的;
④ 投资者在募集期结束后认购资金仍未到账的;
⑤ 本公司确认的其它无效资金。

造成无效认购的,鹏华基金管理有限公司和直销清算账户的开户银行不承担任何责任。

四、清算与交割

1、基金合同生效前,投资者的认购款项只能存入专门账户,不得动用。

2、认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有,其中利息转份额以基金注册登记机构的记录为准。

3、注册登记机构根据相关法律法规以及业务规则和基金合同的约定,办理本基金的权益登记。

五、基金的验资与基金合同的生效

本基金自基金份额发售之日起3个月内,在基金募集份额总额不少于2亿份,基金募集金额不少于2亿元人民币且基金认购户数不少于200户的条件下,基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售,并在10日内聘请法定验资机构验资,自收到验资报告之日起10日内,向中国证监会办理基金备案手续。

基金募集达到基金备案条件的, 自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起,《基金合同》生效;否则《基金合同》不生效。基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对《基金合同》生效事宜予以公告。

基金募集期届满,未达到基金备案条件,则基金募集失败。基金管理人应以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用,在基金募集期届满后30日内返还投资者已缴纳的认购款项,并加计银行同期存款利息。

六、本次募集当事人或中介机构

(一)基金管理人

名称:鹏华基金管理有限公司
住所:深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心43层
设立日期:1998年12月22日
法定代表人:何如
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:吕奇志

(二)基金托管人

名称:中国建设银行股份有限公司(简称:中国建设银行)
住所: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:王洪章
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]12号
联系人:田青
联系电话:(010) 67595096

(三)销售机构

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:吕奇志

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:李筠

3)鹏华基金管理有限公司上海分公司
办公地址:上海市浦东花园石桥路33号花旗大厦801B
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

5)鹏华基金管理有限公司广州分公司
办公地址:广州市珠江新城华夏路10号富力中心24楼07单元
电话:(020)38927993
传真:(020)38927990
联系人:潘超

(6)鹏华基金管理有限公司网上交易系统

个人投资者可通过本公司网上交易系统办理本基金的开户及认购等业务,具体交易细则请参阅本公司网站公告。网上交易网址:www.phfund.com

2、银行代销机构

中国建设银行股份有限公司
住所: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
邮政编码:100033
法定代表人:王洪章
客户服务电话:95533
网址:www.ccb.com
联系人:王嘉朔

3、券商代销机构

1) 国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16-26 层
法定代表人:何如
联系电话:0755-82133066
传真:0755-82133952
联系人:齐晓燕
客户服务电话:95536
网址:www.guosen.com.cn

2) 长城证券有限责任公司
注册地址: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:李春芳
网址:www.cgws.com

3) 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
法定代表人:杨炯洋
联系人:李慧灵
联系电话:028—86137782
传真:028-86150615
客户服务咨询电话 :400-8888-818
网址:www.hx168.com.cn

4) 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:袁长清(代行)
联系电话:021-22169081
传真:021-68817271
联系人:刘晨
客户服务电话:95525
网址:www.ebscn.com

5) 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:高冠江
联系人:唐静
联系电话:010-63080985
客服热线:400-800-8899
网址:www.cindasc.com

6) 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
深圳市福田区深南大道2008号中国凤凰大厦1栋9层
法定代表人:牛冠兴
联系电话:0755-82825551
传真:0755-82558355
联系人:陈剑虹
客户服务电话:4008001001
网址:www.essence.com.cn

7) 申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:上海市长乐路989号40楼
法定代表人:储晓明
联系电话:021-33388215
联系人:曹晔
客户服务电话:95523或4008895523
电话委托:021-962505
网址:www.sywg.com

8) 中国中投证券有限责任公司
注册地址: 深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层-21层及第04层01、02、03、05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23单元
法定代表人:龙增来
联系人:刘毅
联系电话:0755-82023442
客户服务热线:400 600 8008、95532
网址:www.china-invs.cn

9) 广州证券有限责任公司
办公地址:广州市天河区珠江新城珠江西路5号广州国际金融中心19、20楼
邮政编码:510623
法定代表人:刘东
联系人 :林洁茹
联系电话:020-88836655
公司总机:020-88836999
传真号码:020-88836654
客服热线:961303
网址:www.gzs.com.cn

10) 海通证券股份有限公司
住所:上海广东路689号
办公地址:上海广东路689号
法定代表人:王开国
联系电话:021—23219275
联系人:李笑鸣
客户服务电话:95553
网址:www.htsec.com

11) 长江证券股份有限公司
注册地址:武汉市新华路特8号长江证券大厦
办公地址:上武汉市新华路特8号长江证券大厦
法定代表人:胡运钊
联系电话:027-65799999
传真:027-85481900
联系人:李良
客户服务电话:95579或4008888999
网址:www.95579.com

12) 方正证券股份有限公司
注册地址:湖南长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层
办公地址:北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦11层
法定代表人:雷杰
联系人:郭军瑞
联系电话:010-57398063
客户服务电话:95571
网址:www.foundersc.com

13) 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C座
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:陈有安
客户服务电话:400-8888-888
联系电话:010—66568430
联系人:田薇
网址:www.chinastock.com.cn

14) 中信建投证券股份有限公司
注册地址:北京市朝阳区安立路6 6号4号楼
办公地址:北京市东城区朝内大街1 8 8号
法定代表人:王常青
联系人:许梦园
传真:010-65182261
客服电话:4008888108
网址:www.csc108.com

15) 广发证券股份有限公司
注册地址:广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼(4301-4316房)
办公地址:广东省广州天河北路大都会广场5、18、19、36、38、39、41、42、43、44楼
法定代表人:孙树明
联系人:黄岚
联系电话:020-87555888
传真:020-87553600
客服电话:95575
网址:www.gf.com.cn

16) 国泰君安证券股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼
办公地址:上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼
法定代表人:万建华
联系电话:021-38676666
传真:021-38670666
联系人:芮敏祺
客户服务电话:95521
网址:www.gtja.com

17) 华泰证券股份有限公司
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
深圳市深南大道港中旅大厦5、18、24楼
法定代表人:吴万善
联系电话:0755-82492193
联系人:庞晓芸
网址:www.htsc.com.cn

18) 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8楼
办公地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼
法定代表人:杨宇翔
联系电话:0755-22627802
传真:0755-82400862
联系人:郑舒丽
客服电话:95511—8
网站:www.pingan.com

19) 齐鲁证券有限公司
注册地址:山东省济南市经七路86号
办公地址:山东省济南市经七路86号2316室
法定代表人:李玮
联系电话:0531-68889157
联系人:王霖
客户服务电话:95538
网址:www.qlzq.com.cn

20) 兴业证券股份有限公司
注册地址:福州市湖东路268号
法定代表人:兰荣
办公地址:浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼21层
联系电话:021-38565785
传真:021-38565955
联系人:谢高得
客户服务电话:95562
网址:www.xyzq.com.cn

21) 招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38—45 层
法定代表人:宫少林
联系电话:0755-82943666
联系人:林生迎
客户服务电话:95565
网址:www.newone.com.cn

22) 中信证券(浙江)有限责任公司
注册地址:浙江省杭州市解放东路29号迪凯银座22层
办公地址:杭州市解放东路29号迪凯银座22、23楼
法定代表人:沈强
联系人:王霈霈
联系电话:0571-85783737
传真:0571-85106383
客户服务电话:95548
网址:www.bigsun.com.cn

23) 中信证券股份有限公司
注册地址:北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦
办公地址:北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦
法定代表人:王东明
联系人:张于爱
联系电话:010-60833799
传真:010-60833739
网址:www.citics.com

24) 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号澳柯玛大厦15层(1507-1510室)
办公地址:青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层
法定代表人:杨宝林
联系人:吴忠超
联系电话:0532-85022326
传真:0532-85022605
客户服务电话:0532-96577
网址:www.zxwt.com.cn

基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其它符合要求的机构代理销售本基金,并及时公告。

(四)场内基金份额发售机构

详见本公告"一、基金募集和基金份额发售的基本情况""12、场内发售机构"部分相关内容。

(五)注册登记机构

名称:中国证券登记结算有限责任公司
注册地址: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:周明
联系人:崔巍
联系电话:010-59378856
传真:010-59378907

(六)律师事务所

名称:上海市通力律师事务所
住所:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
负责人:韩炯
办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
联系电话:021-31358666
传真:021-31358600
联系人:黎明
经办律师:黎明、孙睿

(七)会计师事务所和经办注册会计师

名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
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
传真:(021)23238800
联系人:魏佳亮
经办注册会计师:单峰、魏佳亮

鹏华基金管理有限公司
2014年4月1日

鹏华中证800非银行金融指数分级证券投资基金基金合同内容摘要

(上接B13版)

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额,基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

(二)基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

(三)基金收益分配原则

在存续期内,本基金(包括鹏华非银行份额、鹏华非银行A份额、鹏华非银行B份额)不进行收益分配。

法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

四、基金财产管理、运用相关费用的提取、支付方式与比例

(一)基金费用的种类

1、基金管理人的管理费;
2、基金托管人的托管费;
3、《基金合同》生效后的标的指数许可使用费;
4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;
5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;
6、基金份额持有人大会费用;
7、基金的证券交易费用;
8、基金的银行汇划费用;
9、证券账户开户费用、账户维护费用;
10、基金的上市费和年费;
11、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。

(二)基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.00%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×1.00 %÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由托管人根据与管理人核对一致的财务数据,自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付,管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.22%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.22%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由托管人根据与管理人核对一致的财务数据,自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付,管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

3、标的指数许可使用费

本基金的标的指数许可使用费按前一日基金资产净值的0.02%的年费率计提。标的指数许可使用费的计算方法如下:

H=E×0.02%÷当年天数

H为每日应计提的标的指数许可使用费

E为前一日的基金资产净值

标的指数许可使用费每日计算,逐日累计至每季季末,按季支付(当季不足50,000元的,按50,000元计算),计费期间不足一季度的,根据实际天数按比例计算。由基金管理人向基金托管人发送标的指数许可使用费划款指令,基金托管人复核后于次季前10 个工作日内从基金财产中一次性支付给标的指数供应商。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

标的指数供应商根据相应指数许可协议变更标的指数许可使用费率和计算方式时, 基金管理人需依照有关规定最迟于新的费率和计费方式实施日前2日在至少一家指定媒体公告。

上述"一、基金费用的种类中第4—10项费用",根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

(三)不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;
2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;
3、《基金合同》生效前的相关费用;
4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

(四)基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

基金财产投资的相关税收,由基金份额持有人承担,基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

五、基金财产的投资方向和投资限制

(一)投资范围

本基金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(含中小板、创业板股票及其他中国证监会核准上市的股票)、债券、股指期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

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。

基金的投资组合比例为:投资于标的指数成份股及其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,现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。

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。

(二)投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制:

(1)投资于标的指数成份股及其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%;

(2)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,保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券;

(3)本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的3%;

(4)本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证,不得超过该权证的10%;

(5)本基金在任何交易日买入权证的总金额,不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%;

(6)本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例,不得超过基金资产净值的10%;

(7)本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的20%;

(8)本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的10%;

(9)本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%;

(10)本基金应投资于信用级别评级为BBB以上(含BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间,如果其信用等级下降、不再符合投资标准,应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出;

(11)本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%;

(12)本基金在任何交易日日终,持有的买入股指期货合约价值,不得超过基金资产净值的10%;

(13)本基金在任何交易日日终,持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的100%。其中,有价证券指股票、债券(不含到期日在一年以内的政府债券)、权证、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等;

(14)本基金在任何交易日日终,持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%;

(15)本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值,合计(轧差计算)应当不低于基金资产净值的90%;

(16) 本基金在任何交易日内交易 (不包括平仓) 的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%;

(17)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的,基金管理人应当在10个交易日内进行调整。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动:

(1)承销证券;
(2)违反规定向他人贷款或者提供担保;
(3)从事承担无限责任的投资;
(4)买卖其他基金份额,但是中国证监会另有规定的除外;
(5)向其基金管理人、基金托管人出资;
(6)从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;
(7)法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

法律法规或监管部门取消上述禁止性规定,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制。

六、基金资产净值的计算方法和公告方式

(一)基金资产净值的计算方法

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

(二)基金资产净值、基金份额净值和基金份额参考净值的公告方式

《基金合同》生效后,在鹏华非银行A份额与鹏华非银行B份额开始上市交易前或鹏华非银行份额开始办理申购或者赎回前,基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值、鹏华非银行份额的基金份额净值、鹏华非银行A份额与鹏华非银行B份额的基金份额参考净值。

在鹏华非银行A份额与鹏华非银行B份额开始上市交易后或鹏华非银行份额开始办理申购或者赎回后,基金管理人应当在每个开放日的次日,通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介,披露开放日鹏华非银行份额的基金份额净值和基金份额累计净值、鹏华非银行A份额与鹏华非银行B份额的基金份额参考净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日(自然日)基金资产净值、鹏华非银行份额的基金份额净值、鹏华非银行A份额与鹏华非银行B份额的基金份额参考净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日(自然日)的次日,将基金资产净值、鹏华非银行份额的基金份额净值和基金份额累计净值、鹏华非银行A份额与鹏华非银行B份额的基金份额参考净值和基金份额累计净值登载在指定媒体上。

七、基金合同变更和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

(一)《基金合同》的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的,应召开基金份额持有人大会决议通过。对于可不经基金份额持有人大会决议通过的事项,由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告,并报中国证监会备案。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自完成备案手续后方可执行,自决议生效后两日内在指定媒体公告。

(二)《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的,《基金合同》应当终止:

1、基金份额持有人大会决定终止的;
2、基金管理人、基金托管人职责终止,在6个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的;
3、《基金合同》约定的其他情形;
4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

(三)基金财产的清算

1、基金财产清算小组:自出现《基金合同》终止事由之日起30个工作日内成立清算小组,基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、基金财产清算小组组成:基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

3、基金财产清算小组职责:基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

4、基金财产清算程序:

(1)《基金合同》终止情形出现时,由基金财产清算小组统一接管基金;
(2)对基金财产和债权债务进行清理和确认;
(3)对基金财产进行估值和变现;
(4)制作清算报告;
(5)聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计,聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书;
(6)将清算报告报中国证监会备案并公告;
(7)对基金财产进行分配。

5、基金财产清算的期限为6个月。

(四)清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用, 清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

(五)基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案,将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后,分别计算鹏华非银行份额、鹏华非银行A份额、鹏华非银行B份额各自的应计分配比例,并据此向鹏华非银行份额、鹏华非银行A份额、鹏华非银行B份额各自的基金份额持有人按其持有的基金份额比例进行分配。

(六)基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告;基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

(七)基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

八、争议解决方式

各方当事人同意,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,应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,仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间,基金合同当事人应恪守各自的职责,继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务,维护基金份额持有人的合法权益。

《基金合同》受中国法律管辖。

九、基金合同存放地和投资人取得基金合同的方式

基金合同可印制成册,供投资人在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅。