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
二〇一四年九月

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日为2014年8月4日,有关财务数据和净值表现截止日为2014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)82021233 传真:(0755)82021155
7、联系人:吕奇志
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。

邓召明先生,董事,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、中国兵器工业总公司主任科员、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。

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。

周中国先生,董事,会计学硕士研究生,国籍:中国。曾任深圳市华为技术有限公司定价中心经理助理;2000年7月起历任国信证券有限责任公司资金财务总部业务经理、外派财务经理、高级经理、总经理助理、副总经理;2009年2月至今任国信证券股份有限公司人力资源总部副总经理。

Massimo Mazzini先生,董事,经济和商学学士。国籍:意大利。曾在安达信(Arthur Andersen MBA)从事风险管理和资产管理工作,历任CA AIPG SGR投资总监、CAAM AI SGR及CA AIPG SGR首席执行官和投资总监、东方汇理资产管理股份有限公司(CAAM SGR)投资副总监、农业信贷另类投资集团(Credit Agricole Alternative Investments Group)国际执行委员会委员、欧利盛资本资产管理股份公司(Eurizon Capital SGR S.p.A.)投资方案部投资总监、Epsilon 资产管理股份公司(Epsilon SGR)首席执行官,现任欧利盛资本股份公司(Eurizon Capital S.A.)(卢森堡)首席执行官和总经理,同时兼任欧利盛AI资产管理股份公司(Eurizon AI SGR)首席执行官。

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财务风险管理部意大利企业法人风险管理业务负责人,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,现任意大利联合圣保罗银行股份有限公司(Intesa Sanpaolo S.p.A.)储蓄、投资和养老金产品部负责人。

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。

张元先生,独立董事,大学本科,国籍:中国。曾任新疆军区干事、秘书、编辑,甘肃省委研究室干事、副处长、处长、副主任,中央金融工作委员会研究室主任,中国银监会政策法规部(研究局)主任(局长)等职务;2005年6月至2007年12月,任中央国债登记结算有限责任公司董事长兼党委书记;2007年12月至2010年12月,任中央国债登记结算有限责任公司监事长兼党委副书记。

高臻女士,独立董事,工商管理硕士,国籍:中国。曾任中国进出口银行处长,负责贷款管理和运营,项目涉及制造业、能源、电信、跨国并购;2007年加入曼达林投资顾问有限公司,现任曼达林投资顾问有限公司执行合伙人。

2、基金管理人监事会成员

黄俞先生,监事会主席,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、监事,现任深圳市北融信投资发展有限公司董事长。

Andrea Vismara先生,监事,法学学士,律师,国籍:意大利。曾在意大利多家律师事务所担任律师,先后在法国农业信贷集团(Credit Agricole Group)东方汇理资产管理股份有限公司(CAAM SGR)法务部、产品开发部,欧利盛资本资产管理股份公司(Eurizon Capital SGR S.p.A.)治理与股权部工作,现在欧利盛资本资产管理股份公司运营部工作。

李国阳先生,监事,硕士研究生,高级会计师,国籍:中国。曾任深圳国投证券有限公司资金财务部财务科副科长、审计科副经理、稽核审计部副总经理、第二证券交易部副总经理、资金财务部总经理,国信证券有限责任公司资金财务部总经理、公司副总会计师兼资金财务部总经理、上海管理总部总经理、首席会计师兼资金财务部总经理,曾任鹏华基金管理有限公司董事、监事会召集人,现任国信证券股份有限公司副总裁兼首席会计师、资金财务总部总经理。

苏波先生,职工监事,博士,国籍:中国。历任深圳经济特区证券公司研究所副所长、投资部经理,南方基金管理有限公司投研部研究员、客户服务主管、西部理财中心总经理、渠道服务二部总监助理,易方达基金管理有限公司信息技术部总经理助理;2008年11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机构理财部总经理。

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,历任登记结算部副总经理,现任公司登记结算部执行总经理。

于丹女士,职工监事,法学硕士,国籍:中国。历任北京市金杜(深圳)律师事务所律师;2011年7月加盟鹏华基金管理有限公司,现任监察稽核部法务主管。

3、高级管理人员情况

何如先生,董事长,简历同前。

邓召明先生,董事,总裁,简历同前。

高阳先生,副总裁,特许金融分析师(CFA),经济学硕士,国籍:中国。历任中国国际金融有限公司经理,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。

胡湘先生,副总裁,经济学硕士,国籍:中国。曾就职于全国社会保障基金理事会投资部、境外投资部,历任副主任科员、主任科员、副处长,鹏华基金管理有限公司总裁助理,现任鹏华基金管理有限公司副总裁。

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

4、本基金基金经理

杨靖先生,国籍中国,理学硕士,14年证券从业经验。曾在长城证券公司从事证券研究工作,先后任研究员、行业研究小组组长;2001年6月加盟鹏华基金管理有限公司从事行业研究工作,2005年开始先后任鹏华中国50 开放式证券投资基金、鹏华行业成长证券投资基金基金经理助理,2006年9月至2007年4月任原鹏华普润基金(2007年4月已转型为鹏华优质治理股票型证券投资基金(LOF))基金经理,2007年4月至2009年10月担任鹏华优质治理股票型证券投资基金(LOF)基金经理,2009年4月起至今担任鹏华沪深300指数证券投资基金(LOF)基金经理,2012年9月起至今兼任鹏华中证A股资源产业指数分级证券投资基金基金经理,2013年3月起至今兼任鹏华中证500 指数证券投资基金(LOF)基金经理。杨靖先生具备基金从业资格。

本基金历任的基金经理:

2010年2月至2013年3月由方南先生担任本基金基金经理。

本基金基金经理管理其它基金情况:

2009年4月起至今担任鹏华沪深300指数证券投资基金(LOF)基金经理,

2012年9月起至今兼任鹏华中证A股资源产业指数分级证券投资基金基金经理。

王咏辉先生,英国牛津大学工程和计算机专业硕士,16年证券基金从业经验。曾担任伦敦摩根大通(JP Morgan)投资基金管理公司分析员、高级分析师,汇丰投资基金管理公司(HSBC)高级分析师,伦敦巴克莱国际投资基金管理公司基金经理、部门负责人,巴克莱资本公司(Barclays Capital) 部门负责人,泰达宏利基金公司国际投资部副总监、产品与金融工程部副总经理等职,2010年4月至2012年8月担任泰达宏利中证财富大盘指数型证券投资基金基金经理,2011年7月至2012年8月担任泰达宏利全球新格局证券投资QDII基金基金经理,2011年12月至2012年8月担任泰达宏利中证500指数分级证券投资基金基金经理;2012年11月加盟鹏华基金管理有限公司,现任量化投资部总经理、投资决策委员会成员,2013年12月起担任鹏华中证500 指数证券投资基金(LOF)基金经理。王咏辉先生具备基金从业资格,英国基金经理从业资格(IMC)。

本基金历任的基金经理:

2010年2月至2013年3月由方南先生担任本基金基金经理。

本基金基金经理管理其它基金情况:无

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董事、总裁、党总支书记。

高阳先生,鹏华基金管理有限公司副总裁。

初冬女士,鹏华基金管理有限公司总裁助理、固定收益投资总监、固定收益部总经理,社保基金组合投资经理及鹏华丰盛稳固收益债券基金、鹏华双债增利债券基金、鹏华双债加利债券基金基金经理。

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。

冀洪涛先生,鹏华基金管理有限公司机构投资部总经理,社保基金组合投资经理。

王咏辉先生,鹏华基金管理有限公司量化投资部总经理,鹏华中证500指数(LOF)基金基金经理。

黄鑫先生,鹏华基金管理有限公司研究部总经理,鹏华动力增长基金基金经理、鹏华品牌传承混合基金基金经理。

阳先伟先生,鹏华基金管理有限公司固定收益部执行总经理,鹏华丰收债券基金基金经理、鹏华双债保利债券基金基金经理。

陈鹏先生,鹏华基金管理有限公司基金管理部副总经理,鹏华中国50混合基金基金经理。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

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349,018,545,827元
联系电话:010-66105799
联系人:赵会军

(二)主要人员情况

截至2014年6月末,中国工商银行资产托管部共有员工170人,平均年龄30岁,95%以上员工拥有大学本科以上学历,高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

(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年在国内首家提供托管服务以来,秉承"诚实信用、勤勉尽责"的宗旨,依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队,严格履行资产托管人职责,为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务,展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、安心账户资金、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、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系,同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务,可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2014年6月,中国工商银行共托管证券投资基金380只。自2003 年以来,本行连续十年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的44项最佳托管银行大奖;是获得奖项最多的国内托管银行,优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

三、相关服务机构

(一) 基金销售机构

1、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号金融街中心南楼502房
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

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)38010789
联系人:周樱

(2)代销机构:

a.银行代销机构

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)
传真:010-66107913
联系人:刘秀宇
网址:www.icbc.com.cn

2)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
法定代表人:王洪章
联系人:王嘉朔
客户服务电话:95533
传真:010-66275654
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:蒋超良
客户服务电话:95599
联系人:刘一宁
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:田国立
客户服务电话:95566
联系人:宋亚苹
公司网站:www.boc.cn

5)交通银行股份有限公司
注册(办公)地址:上海市浦东新区银城中路188号
法定代表人:牛锡明
电话:021-58781234
传真:021-58408483
联系人:曹榕
客户服务电话:95559
网址:www.bankcomm.com

6)中国邮政储蓄银行有限责任公司
注册地址:北京市西城区金融大街3号
办公地址:北京市西城区金融大街3号
法定代表人:李国华
联系人:王硕
传真:010-68858117
客户服务电话:95580
网址www.psbc.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:傅育宁
电话:0755-83198888
传真:0755-83195049
联系人:邓炯鹏
客服电话:95555
网址:www.cmbchina.com

8)平安银行股份有限公司
注册(办公)地址:深圳市深南东路5047号
法定代表人:肖遂宁
联系人:张莉
电话:021-38637673
客服电话:95511-3
网址:http://bank.pingan.com

9)上海银行股份有限公司
注册(办公)地址:上海市浦东新区银城中路168号
法定代表人:范一飞
客户服务电话:95594
联系人:汤征程
网址:www.bankofshanghai.com

10) 中国民生银行股份有限公司
注册(办公)地址:北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人:董文标
客户服务电话:95568
联系人:董云巍
传真:010-58560666
网址:www.cmbc.com.cn

11)上海浦东发展银行股份有限公司
注册(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
联系人:唐苑
公司网站:www.spdb.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) 广发银行股份有限公司
注册(办公)地址:广州市东风东路713号
法定代表人:董建岳
联系人:李静筠
客服电话:400-830-8003
网址:www.cgbchina.com.cn

14)北京银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街甲17号首层
办公地址:北京市西城区金融大街丙17号
法定代表人:闫冰竹
联系人:谢小华
电话:010-66223587
传真:010-66226045
客户服务电话:95526
网站:www.bankofbeijing.com.cn

15)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:上海市江宁路168号
法定代表人:高建平
联系人:刘玲
客户服务电话:95561
网址:www.cib.com.cn

16)中信银行股份有限公司
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:常振明
联系人:郭伟
客服电话:95558
网站:http://bank.ecitic.com

17)华夏银行股份有限公司
办公地点:北京市东城区建国门内大街22号
法定代表人:吴建
客户服务电话:95577;
联系人:郑鹏
网站:www.hxb.com.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:吴太普
联系人:严峻
客户服务电话: 0571-96523,4008888508
网址:www.hzbank.com.cn

19)东莞银行股份有限公司
注册(办公)地址:东莞市莞城区体育路21号
法定代表人:廖玉林
联系人:陈幸
客户服务电话:96228
网址:www.dongguanbank.cn

20)宁波银行股份有限公司
注册(办公)地址: 宁波市鄞州区宁南南路700号
法定代表人:陆华裕
电话:0574-89068340
传真:0574-87050024
联系人: 胡技勋
客户服务电话:96528(上海、北京地区962528)
网址:www.nbcb.com.cn

21)浙商银行股份有限公司
注册(办公)地址:中国杭州市庆春路288号
法定代表人:张达洋
联系人:毛真海
客户服务热线:95527
传真: 0571-87659188
公司网站:www.czbank.com

22)浙江民泰商业银行股份有限公司
办公地址:温岭市三星大道168号
法定代表人:江建法
客户服务电话:4008896521
联系人:刘兴龙
网址:www.mintaibank.com

23)厦门银行股份有限公司
住所:厦门市思明区湖滨北路101号商业银行大厦
法定代表人:吴世群
联系人:方伟强
客户服务电话:400-858-8888
网址:http://www.xmccb.com

24)洛阳银行股份有限公司
住所:河南洛阳洛龙区开元大道256号
法定代表人:王建甫
联系人:李亚洁
客户服务电话:96699
网址:http://www.bankofluoyang.com.cn

25)东莞农村商业银行股份有限公司
注册地址:广东省东莞市城区南城路2号
法定代表人:何沛良
联系人:何茂才
客户服务电话:961122
网址: www.drcbank.com

b.券商代销机构

1)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

2)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

3)海通证券股份有限公司
注册地址: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

4)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

5)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６６号４号楼
办公地址:北京市东城区朝内大街１８８号
法定代表人:王常青
联系人:许梦园
传真:010-65182261
客服电话:4008888108
公司网站:www.csc108.com

6)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

7)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

8)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

9)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

10)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: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

11)湘财证券股份有限公司
注册地址:湖南省长沙市天心区湘府中路198号标志商务中心A栋11层
办公地址:湖南省长沙市天心区湘府中路198号标志商务中心A栋11层
法定代表人:林俊波
联系电话:021－68634518
传真:021-68865680
联系人:钟康莺
客户服务电话:400-888-1551
网址:www.xcsc.com

12)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

13)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

14)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

15)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

16)国都证券有限责任公司
注册地址:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层办公地址
办公地址:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层(100007)
法定代表人:常喆
联系人:黄静
客户服务电话:400-818-8118
网址:www.guodu.com

17)金元证券股份有限公司
注册地址:海口市南宝路36号证券大厦4楼
办公地址:深圳市深南大道4001号时代金融中心17层
法定代表人:陆涛
电话:0755-83025666
传真:0755-83025625
联系人 马贤清
客户服务热线:400-8888-228
网址:www.jyzq.cn

18)东莞证券有限责任公司
注册地址: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:张运勇
联系人:张巧玲
联系电话: 0769-22119426
公司网址:www.dgzq.com.cn

19) 宏源证券股份有限公司
注册地址:新疆乌鲁木齐市文艺路233号
办公地址:北京市西城区太平桥大街19号
法定代表人:冯戎
联系电话:010-88085201
联系人:李巍
客户服务电话:4008-000-562
网址:www.hysec.com

20)东北证券股份有限公司
注册地址:长春市自由大路1138号
办公地址:长春市自由大路1138号
法定代表人:杨树财
联系电话:0431-85096517
传真:0431-85096795
联系人:安岩岩
网址:www.nesc.cn

21)上海证券有限责任公司
注册地址:上海市黄浦区西藏中路336 号
办公地址:上海市黄浦区西藏中路336 号
法定代表人:郁忠民
联系电话:021-53519888
传真:021-63608300
联系人:张瑾
客服热线:4008-918-918
公司网站:www.962518.com

22)东海证券股份有限公司
注册地址:江苏省常州市延陵西路23号投资广场18-19楼
办公地址:江苏省常州市延陵西路23号投资广场18-19楼
法定代表人:朱科敏
联系电话:0519-88157761
传真:0519-88157761
联系人:梁旭
客服热线:95531、400-8888-588
公司网站:www.longone.com.cn

23)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:浙江省杭州市解放东路29号迪凯银座22层
法定代表人:沈强
联系人:王霈霈
联系电话:0571-86078823
传真:0571-85783771
客户服务电话:0571-96598
网址:www.bigsun.com.cn

24)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:薛峰
联系电话:021-22169081
传真:021-68817271
联系人:刘晨
客户服务电话:95525
公司网站:www.ebscn.com

25)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

26)西部证券股份有限公司
注册地址:西安市东新街232号陕西信托大厦16－17层
办公地址: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:029-87416787
传真:029-87417012
客服热线:95582
联系人:冯萍
网址:www.westsecu.com.cn

27)华安证券有限责任公司
注册地址:安徽省合肥市长江中路357号
办公地址:安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号财智中心B1座
法定代表人:李工
电话:0551-65161821
传真:0551-65161672
联系人:甘霖
公司网址:www.hazq.com

28)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

29)渤海证券股份有限公司
注册地址:天津市经济技术开发区第二大街42号写字楼101室
办公地址:天津市南开区宾水西道8号
法定代表人:杜庆平
联系人:王兆权
电话:022-28451861
传真:022-28451892
网址:www.bhzq.com

30)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
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:周晖
联系电话:0731-84403319
传真:0731-84403439
联系人:郭磊
客户服务热线:0731-84403343
网址:www.cfzq.com

31)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:广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F栋18、19层
法定代表人:张建军
联系人:罗创斌
联系电话:020-37865070
客户服务电话:400-8888-133
网址:www.wlzq.com.cn

32)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

33)浙商证券有限责任公司
注册地址:杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座6-7楼
办公地址: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
电话:021-64718888
传真:021-64713795
联系人:李凌芳
客户服务热线:0571-967777
网址:www.stocke.com.cn

34)华林证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区民田路178号华融大厦5、6楼
办公地址:深圳市福田区民田路178号华融大厦5、6楼
法定代表人:薛荣年
联系人:王叶平
联系电话:0755-82707705
客服电话:400-880-2888
公司网站:www.chinalions.com

35)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号长安兴融中心西座11层
法定代表人:孔佑杰
联系人:苏江
电话:010- 88086830-652
网址:www.rxzq.com.cn

36)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

37)江海证券有限公司
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
联系人:张背北
联系电话:0451-82336863
客服热线:4006662288
网址:www.jhzq.com.cn

38)华西证券股份有限公司
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

39)红塔证券股份有限公司
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.hongtazq.com

40)厦门证券有限公司
注册地址:厦门市莲前西路2号莲富大厦十七楼
办公地址:厦门市莲前西路2号莲富大厦十七楼
法定代表人:傅毅辉
电话:0592-5161642
传真:0592-5161140
联系人:卢金文
客户服务热线:0592-5163588
网址:www.xmzq.cn

41)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:高颂
联系人:林文宇
联系电话:0755-83703759
咨询电话:0755-83710885
公司网址:www.ytzq.net

42)爱建证券有限责任公司
注册地址:上海市浦东新区世纪大道1600号32楼
办公地址:上海市浦东新区世纪大道1600号32楼
法定代表人:张建华
电话:(021)32229888
传真:(021)68728703
联系人:戴莉丽
客户服务电话:(021)63340678
网址:www.aizq.com

43)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:冉云
联系人:金喆
电话:028-86690126
传真:028-86690126
服务热线:4006-600109
公司网站:www.gjzq.com.cn

44)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

45)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至10层
法定代表人:黄金琳
邮政编码:350003
联系人:张腾
联系电话:0591-87383623
业务传真:0591-87383610
统一客户服务电话:96326(福建省外请先拨0591)。
公司网址:www.hfzq.com.cn

46)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:徐勇力
联系人:汤漫川
电话:010-66555316
服务热线:4008888993
公司网站:www.dxzq.net

47)国海证券股份有限公司
注册地址:广西南宁市滨湖路46号国海大厦
办公地址:深圳市福田区竹子林四路光大银行大厦3F
法定代表人:张雅锋
联系电话:0755－83709350
传真:0755－83704850
联系人:牛孟宇
网址:www.ghzq.com.cn

48)五矿证券有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心办公室47层01单元
办公地址:深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心办公室47层01单元
法定代表人:高竹
联系电话:0755-82545555
传真:0755-82545500
联系人:赖君伟
网址:www.wkzq.com.cn

49)西南证券股份有限公司
注册地址:重庆市江北区桥北苑8号
办公地址:重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦
法定代表人:余维佳
联系人:张煜
联系电话:023-63786141
客户服务电话:4008096096
传真:023-63786212
网址:www.swsc.com.cn

50)新时代证券有限责任公司
注册地址:北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501
办公地址:北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501
法定代表人:刘汝军
联系人:马俊杰
电话:010-83561329
传真:010-83561094
邮编:100086
客户服务电话:4006989898
公司网址:www.xsdzq.cn

c.第三方代销机构

1)上海天天基金销售有限公司
住所:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
办公地址:上海市徐汇区龙田路195号3C座10楼
法定代表人:其实
联系人:高莉莉
联系电话:020-87599527
客服电话:4001818188
网址:www.1234567.com.cn

2)深圳众禄基金销售有限公司
注册地址:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元
法定代表人:薛峰
客服电话:4006-788-887
传真:0755-82080798
联系人:汤素雅
网址:www.zlfund.cn、www.jjmmw.com

3)上海好买基金销售有限公司
办公地址:上海市浦东南路1118号鄂尔多斯大厦903～906室
住所:上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室
法定代表人:杨文斌
客服电话:400-700-9665
传真:021-50325989
联系人:蒋章
网址:www.ehowbuy.com

4)杭州数米基金销售有限公司
办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼
法定代表人:陈柏青
客服电话:4000-766-123
传真:0571-26698533
联系人:周嬿旻
网址:www.fund123.cn

5)上海长量基金销售投资顾问有限公司
办公地址:上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层
法定代表人:张跃伟
客服电话:400-089-1289
传真:021-58787698
联系人:敖玲
电话:021-58788678-8201
传真:021—58787698
客服电话:400-089-1289
公司网站: www.erichfund.com

6)北京展恒基金销售有限公司
办公地址: 北京市顺义区后沙峪镇安富街6号
法定代表人:闫振杰
联系人:张晶晶
传真:(+86-10) 6202 0088 转8802
客服电话:400 888 6661
网址:www.myfund.com

7)天相投资顾问有限公司
办公地址:北京市西城区金融街5号新盛大厦B座4层
法定代表人:林义相
客服电话:010-66045678
传真:010-66045527
联系人:林爽
网址:www.txsec.com

8)和讯信息科技有限公司
住所: 北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
办公地址:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
法定代表人: 王莉
联系人:赵慧灵
联系电话:021-68419822
客服电话:400-920-0022
网址:licaike.hexun.com

9)深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
住所: 深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#
办公地址:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#
法定代表人: 马令海
联系人:邓洁
联系电话:010-58321388-1105
客服电话:010-58325327
网址:jrj.xinlande.com.cn

10)诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司
办公地址:上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心8楼801室
法定代表人:汪静波
客服电话:400-821-5399
传真:021-38509777
联系人:张姚杰
网址:www.noah-fund.com

11)万银财富(北京)基金销售有限公司
住所:北京朝阳区北四环中路27号盘古大观3201
办公地址:北京朝阳区北四环中路27号盘古大观3201
法定代表人:李招弟
联系人:毛怀营
联系电话:010-59393923
客服电话:400-808-0069
网址:www.wy-fund.com

12)北京增财基金销售有限公司
住所:北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208室
办公地址:北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208室
法定代表人:王昌庆
联系人:罗细安
联系电话:010-67000988
客服电话:400-001-8811
网址:www.zcvc.com.cn

13)北京恒天明泽基金销售有限公司
住所:北京市北京经济技术开发区宏达北路10号5层5122室
办公地址:北京市北京经济技术开发区宏达北路10号5层5122室
法定代表人:黄永伟
联系人:侯仁凤
联系电话:010-57756068
客服电话:400-786－8868
网址: www.chtfund.com

(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

(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(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
经办注册会计师:单峰、魏佳亮
联系人:魏佳亮

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%。

中证500指数扣除了沪深300指数样本股及最近一年日均总市值排名前300名的股票,再按照最近一年(新股为上市以来)的日均成交金额由高到低排名,剔除排名后20%的股票,然后将剩余股票按照日均总市值由高到低进行排名,选取排名在前500名的股票作为该指数样本股。该指数以调整股本为权重,采用派许加权综合价格指数公式进行计算,其中调整股本根据分级靠档方法获得。该指数综合反映了沪深证券市场内小市值公司的整体状况。本基金充分考虑本基金各资产投资比例要求从而构建上述业绩比较基准。

如果中证500指数被停止编制及发布,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。

本基金的托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,已于2014年7月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本报告中所列财务数据截至2014年6月30日(未经审计)。

1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	528,286,700.78	94.11
	其中:股票	528,286,700.78	94.11
2	固定收益投资	–	–
	其中:债券	–	–
	资产支持证券	–	–
3	贵金属投资	–	–
4	金融衍生品投资	–	–
5	买入返售金融资产	–	–
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	–
6	银行存款和结算备付金合计	31,834,175.26	5.67
7	其他资产	1,258,674.50	0.22
8	合计	561,379,550.54	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

(1)报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	7,637,951.11	1.37
B	采矿业	18,450,819.46	3.31
C	制造业	320,644,669.83	57.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,555,221.13	2.97
E	建筑业	12,070,260.08	2.17
F	批发和零售业	37,577,665.62	6.75
G	交通运输、仓储和邮政业	14,560,984.03	2.61
H	住宿和餐饮业	1,322,153.70	0.24
I	信息传输、软件和信息技术服务业	30,303,830.91	5.44
J	金融业	10,562,160.92	1.90
K	房地产业	35,556,309.25	6.38
L	租赁和商务服务业	7,218,414.35	1.30
M	科学研究和技术服务业	1,173,797.25	0.21
N	水利、环境和公共设施管理业	4,951,199.03	0.89
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	–	–
R	文化、体育和娱乐业	6,086,459.39	1.09
S	综合	3,601,974.72	0.65
	合计	528,273,870.78	94.86

(2)报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	–	–
B	采掘业	–	–
C	制造业	12,830.00	0.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	–	–
G	交通运输、仓储和邮政业	–	–
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	–	–
J	金融业	–	–
K	房地产业	–	–
L	租赁和商务服务业	–	–
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	–	–
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	–	–
R	文化、体育和娱乐业	–	–
S	综合	–	–
	合计	12,830.00	0.00

3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

(1)报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002152	广电运通	294,683	5,021,398.32	0.90
2	600570	恒生电子	163,159	4,796,874.60	0.86
3	600879	航天电子	310,895	3,662,343.10	0.66
4	600761	安徽合力	357,589	3,518,675.76	0.63
5	002063	远光软件	163,972	3,353,227.40	0.60
6	002250	联化科技	235,249	3,340,535.80	0.60
7	600563	法拉电子	98,740	3,283,105.00	0.59
8	600675	中华企业	627,326	3,042,531.10	0.55
9	002405	四维图新	179,883	2,989,655.46	0.54
10	000559	万向钱潮	286,903	2,949,362.84	0.53

(2)报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300385	雪浪环境	500	12,830.00	0.00

注:上述股票明细为本基金本报告期末持有的积极投资的全部股票。

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(1)报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

(2)本基金投资股指期货的投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1)本期国债期货投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

(2)报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

(3)本期国债期货投资评价

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

11、投资组合报告附注

(1)本基金投资的前十名证券之一的恒生电子的发行人恒生电子股份有限公司(以下简称 "恒生电子公司")的控股子公司杭州数米基金销售有限公司(以下简称"数米公司")收到浙江证监局【2013】13 号行政监管措施决定书(以下简称"决定书")。决定书主要内容为:经查,数米公司自2013年12 月9 日始通过公司网站等渠道,宣传"数米胜百八"活动,对通过数米公司购买货币市场基金产品的投资者进行收益补贴,宣传资料中存在"最高可享8.8%年化收益"等不当用语,根据《证券投资基金销售管理办法》相关规定,责令数米公司限期改正。

数米公司系恒生电子公司的控股子公司,根据恒生电子公司发布的公告,数米公司将依照监管部门的要求进行整改与报告,上述事项对恒生电子的日常经营、管理、业绩不构成重大影响。

对该股票的投资决策程序的说明:本次行政监管措施对该股票的投资价值不产生重大影响。本基金为指数基金,为更好地跟踪标的指数,控制跟踪误差对该证券的投资属于按照指数成分股的权重进行配置,符合指数基金的管理规定,该证券的投资已执行内部严格的投资决策流程,符合法律法规和公司制度的规定。

本基金投资的前十名证券中的其他证券本期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)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	249,830.58
2	应收证券清算款	971,902.19
3	应收股利	–
4	应收利息	7,184.26
5	应收申购款	29,757.47
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	1,258,674.50

(4)报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

(5)报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

(6)报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

(7)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,投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

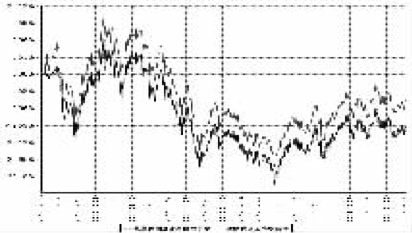
十二、基金的业绩

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资人在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

1、本基金基金合同生效以来的投资业绩与同期基准的比较如下表所示:

成立时间	净值增长率1	净值增长率标准差2	业绩比较基准收益率3	业绩比较基准收益率标准差4	1-3	2-4
2010年2月5日至2010年12月31日	2.90%	1.64%	11.58%	1.72%	-8.68%	-0.08%
2011年1月1日至2011年12月31日	-33.24%	1.45%	-32.33%	1.45%	-0.91%	0.00%
2012年1月1日至2012年12月31日	-0.29%	1.45%	0.44%	1.46%	-0.73%	-0.01%
2013年1月1日至2013年12月31日	16.50%	1.37%	16.16%	1.37%	0.34%	0.00%
2014年1月1日至2014年6月30日	0.75%	1.18%	2.44%	1.19%	-1.69%	-0.01%
自基金合同生效至2014年6月30日	-19.60%	1.45%	-9.76%	1.47%	-9.84%	-0.02%

2、基金合同生效以来基金份额净值的变动情况,并与同期业绩比较基准的变动进行比较:



注1:本基金业绩比较基准=中证500指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%;
注2:本基金基金合同于2010年2月5日生效;
注3:本基金业绩截止日为2014年6月30日。

十三、基金的费用与税收

(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》生效后与基金相关的信息披露费用;
4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;
5、基金份额持有人大会费用;
6、基金的证券交易费用;
7、基金的银行汇划费用;
8、《基金合同》生效后与基金相关的指数使用费;
9、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。

本基金终止清算时所发生费用,按实际支出额从基金财产总值中扣除。

(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0.75%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×0.75%÷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,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。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0.15%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.15%÷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,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

上述一、基金费用的种类中第3—8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)与基金销售有关的费用

1、申购费

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取。本基金的申购费用不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。本基金采取金额申购的方式。

本基金对通过直销柜台申购的养老金客户与除此之外的其他投资者实施差别的申购费率。

养老金客户指基本养老基金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金,包括全国社会保障基金、可以投资基金的地方社会保障基金、企业年金单一计划以及集合计划。如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型,基金管理人可在招募说明书更新时或发布临时公告将其纳入养老金客户范围,并按规定向中国证监会备案。非养老金客户指除养老金客户外的其他投资者。

通过基金管理人的直销柜台申购本基金基金份额的养老金客户特定申购费率如下表:

申购金额M(元)	特定申购费率
M<100万	0.6%
100万≤ M <500万	0.6%
M≥ 500万	每笔1000元

其他投资者申购本基金基金份额的申购费率(场外、场内的申购费率相同)如下表:

申购金额M(元)	申购费率
M<100万	1.2%
100万≤ M <500万	0.6%
M≥ 500万	每笔1000元

投资者在一天之内如果有多笔申购,适用费率按单笔分别计算。

2、转换费

本基金目前仅可办理场外转换业务,场内暂未开通基金间转换业务。

具体转换费率、计算公式及转换业务规则详见基金管理人的相关公告。

3、赎回费:本基金的场外赎回费率按持有年限逐年递减,具体费率如下:

持有年限(Y)	场外赎回费率
Y<1年	0.5%
1年≤Y<2年	0.25%
Y≥2年	0

本基金的场内赎回费率为固定值0.5%。

本基金的赎回费用在投资者赎回本基金份额时收取。本基金的赎回费用由赎回申请人承担,赎回费总额的25%归基金财产,75%用于支付市场推广、注册登记费和其他手续费。

4、本基金的申购费率、转换费率、赎回费率和收费方式由基金管理人根据《基金合同》的规定确定并在《招募说明书》中列示。基金管理人和基金托管人协商后,可以根据《基金合同》的相关约定调整费率或收费方式,基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前2个工作日在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告。

5、基金管理人可以在不违背法律法规规定及《基金合同》约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划,针对特定地域范围、特定行业、特定职业的投资者以及以特定交易方式(如网上交易、电话交易等)等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间,按相关监管部门要求履行相关手续后基金管理人可以适当调低基金申购费率、基金赎回费率和基金转换费率。

(四)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,包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用;
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。

(五)费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后,可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率等费率,须召开基金份额持有人大会审议;调低基金管理费率、基金托管费率等费率,无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前2日在至少一种指定媒体和基金管理人网站上公告。

(六)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。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人根据《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》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的规定,结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动,对本基金管理人原公告的本基金招募说明书进行了更新,主要更新的内容如下:

1、在"重要提示"部分明确了更新招募说明书内容的截止日期及有关财务数据的截止日期。
2、对"三、基金管理人"部分内容进行了更新。
3、对"四、基金托管人"部分内容进行了更新。
4、对"五、相关服务机构"部分内容进行了更新。
5、对"十一、基金的投资" 部分内容进行了更新。
6、对"十二、基金的业绩" 部分内容进行了更新。
7、更新了"二十四、其他应披露事项"的相关内容。

鹏华基金管理有限公司
2014年9月17日