鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金之券商A级与券商B级上市交易公告书

基金管理人:鹏华基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
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:2015年5月15日
公告日期:2015年5月12日

一、重要声明与提示

鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金(以下简称"本基金")之券商A级份额与券商B级份额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、深圳证券交易所对本基金之券商A级与券商B级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,请仔细阅读2015年4月24日刊登在《上海证券报》和本公司指定销售机构网站上的《鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金招募说明书》。

二、基金概览

1、基金名称:鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金
2、基金类型:股票型
3、基金运作方式:契约型开放式
4、本基金的基金份额包括鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金之基础份额(场内简称:券商指基)、鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金之A份额(场内简称:券商A级)、鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金之B份额(场内简称:券商B级)。其中,鹏华券商A级份额、鹏华券商B级份额的基金份额配比始终保持1:1的比例不变。
5、本基金的存续期限为不定期。
6、鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金之基础份额的申购和赎回:投资者可通过场外或场内两种方式对本基金进行申购与赎回。场外申购和赎回业务的场所为基金管理人直销机构和场外代销机构。场内申购和赎回业务的场所为具有基金销售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,具体销售网点和会员单位的名单由基金管理人在招募说明书或其他公告中列明。鹏华券商A级份额与鹏华券商B级份额只上市交易,不接受申购和赎回。
7、鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金之基础份额的跨系统转托管:通过场内、场外方式认购本基金的基金份额持有人可以通过认购本基金的销售机构办理跨系统转托管业务。
8、份额配对转换是指场内鹏华券商指基份额与鹏华券商A级份额、鹏华券商B级份额之间按约定的转换规则进行转换的行为,包括基金份额的分拆和合并两个方面。分拆是指基金份额持有人将其持有的场内鹏华券商指基份额按照2份场内鹏华券商指基份额对应1份鹏华券商A级份额与1份鹏华券商B级份额的比例进行转换的行为;基金份额的合并,指基金份额持有人将其持有的鹏华券商A级份额与鹏华券商B级份额按照1份鹏华券商A级份额与1份鹏华券商B级份额对应2份场内鹏华券商指基份额的比例进行转换的行为。

本基金的场内份额可以直接申请分拆与合并,场外份额通过跨系统转托管至场内后方可申请分拆与合并。

9、定期份额折算

在基金份额折算前与折算后,鹏华券商A级份额与鹏华券商B级份额的份额配比保持1:1的比例。对于鹏华券商A级份额的约定应得收益,即鹏华券商A级份额每个定期折算基准日基金份额参考净值超出1.000元部分,将折算为场内鹏华券商指基份额分配给鹏华券商A级份额持有人。鹏华券商指基份额持有人持有的每2份鹏华券商指基份额将按1份鹏华券商A级份额获得新增鹏华券商指基份额的分配。持有场外鹏华券商指基份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外鹏华券商指基份额的分配;持有场内鹏华券商指基份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内鹏华券商指基份额的分配。经过上述份额折算,鹏华券商A级份额的基金份额参考净值调整为1.000元,鹏华券商指基份额的基金份额净值将相应调整。

10、不定期份额折算

除以上定期份额折算外,本基金还将在以下两种情况进行份额折算,即当鹏华券商指基份额的基金份额净值达到1.500元时或当鹏华券商B级份额的基金份额参考净值跌至0.250元时。当达到不定期折算条件时,本基金将分别对鹏华券商指基份额、鹏华券商A级份额、鹏华券商B级份额进行份额折算,份额折算后本基金将确保鹏华券商A级份额与鹏华券商B级份额的比例为1:1,份额折算后鹏华券商指基份额的基金份额净值、鹏华券商A级份额与鹏华券商B级份额的基金份额参考净值均调整为1.000元。

11、基金份额总额:截至2015年5月8日,本基金的基金份额总额为1,030,790,724.11份,其中,鹏华券商指基份额358,183,733.11份,鹏华券商A级份额为336,303,495.00份,鹏华券商B级份额为336,303,496.00份。
12、基金份额净值:截至2015年5月8日,鹏华券商指基份额的基金份额净值为1.000元,鹏华券商A级份额的基金份额参考净值为1.000元,鹏华券商B级份额的基金份额参考净值为1.000元。
13、本次上市交易的基金份额简称及其基金代码:券商A级,基金代码:150235;券商B级,基金代码:150236
14、本次上市交易的基金份额总额:鹏华券商A级336,303,495.00份;鹏华券商B级336,303,496.00份。
15、上市交易的证券交易所:深圳证券交易所
16、上市交易日期:2015年5月15日
17、基金管理人:鹏华基金管理有限公司
18、基金托管人:中国建设银行股份有限公司
19、本次上市交易的基金份额登记机构: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2015[505]号
2、基金运作方式:契约型开放式
3、基金合同期限:不定期
4、发售日期:2015年4月27日至2015年4月30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销售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
建设银行、交通银行、东莞农商行、众禄基金、数米基金、好买基金、上海天天基金、中信(山东)、中信(浙江)、中信证券、银河证券、安信证券、长江证券、光大证券、中信建投、方正证券、国信证券、海通证券、国泰君安、申万宏源、信达证券、长城证券、广州证券、华西证券、湘财证券、西部证券、天风证券、华鑫证券、国金证券、齐鲁证券、平安证券、渤海证券、中金公司
8、验资机构名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
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1,030,703,657.95元人民币,折合基金份额1,030,703,657.95份;有效认购款项在募集期间产生的利息折算份额为87,066.16份,总确认份额为1,030,790,724.11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2015年5月6日全额划入本基金在基金托管人中国建设银行股份有限公司开立的鹏华中证全指证券公司指数分级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1,030,790,724.11份基金份额,其中场外认购的基金份额为357,183,733.11份;场内认购的基金份额为672,606,991.00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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等相关法律、法规的规定以及《鹏华中证全指证券公司指数分级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2015年5月6日获中国证监会书面确认,本基金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:2015年5月6日
12、基金合同生效日的基金份额总额:1,030,790,724.11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[2015]188号
2、上市交易日期:2015年5月15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、基础份额简称及代码:鹏华券商指基,场内简称:券商指基,基金代码:160633。
上市交易份额简称及代码:券商A级,基金代码:150235;券商B级,基金代码:150236。
5、本次上市交易份额:鹏华券商A级336,303,495.00份;鹏华券商B级336,303,496.00份。
6、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。基金管理人应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,因此基金会计责任方由基金管理人对公布的基金净值负责。
7、未上市交易份额的流通规定:对于托管在场内的券商指基份额,基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下,将其分拆为鹏华券商A级份额和鹏华券商B级份额即可上市流通;对于托管在场外的份额,基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下,将其跨系统转托管至深圳证券交易所场内后分拆为鹏华券商A级份额和鹏华券商B级份额即可上市流通。
8、本基金开通跨系统转托管业务日期:2015年5月15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2015年5月8日,券商指基基金份额持有人户数为7,046户,平均每户持有的基金份额为50,835.05份;鹏华券商A级为3,294户,平均每户持有的基金份额102,095.78份;鹏华券商B级为3,294户,平均每户持有的基金份额为102,095.78份。

机构投资者持有的本次上市交易的鹏华券商A级与鹏华券商B级的基金份额分别为64,739,802.00份和64,739,805.00份,分别占本次鹏华券商A级与鹏华券商B级上市交易基金份额比例为19.25%和19.25%;个人投资者持有的本次上市交易的鹏华券商A级与鹏华券商B级的基金份额分别为271,563,693.00份和271,563,691.00份,分别占本次鹏华券商A级与鹏华券商B级上市交易基金份额比例为80.75%和80.75%。

(二)截止到2015年5月8日,基金份额前十名持有人情况:
本次上市交易的鹏华券商A级、鹏华券商B级前十名持有人情况

序号	持有人名称	持有鹏华券商A级份额	占鹏华券商A级份额比(%)	持有鹏华券商B级份额	占鹏华券商B级份额比(%)
1	鹏华资产—工商银行—以太十号资产管理计划	43,000,836	12.79	43,000,836	12.79
2	朱俭娥	7,500,267	2.23	7,500,267	2.23
3	李怡名	5,000,097	1.49	5,000,097	1.49
4	祁冬	5,000,097	1.49	5,000,097	1.49
5	东方汇智资产—兴业银行—以太8号特定客户资产管理计划	5,000,097	1.49	5,000,097	1.49
6	罗相斌	4,999,791	1.49	4,999,792	1.49
7	北京千石创富—华泰证券—艾方多策略对冲增强1号资产管理计划	4,000,233	1.19	4,000,233	1.19
8	北京千石创富—华泰证券—千石资本—艾方多策略对冲增强3号资产管理计划	4,000,233	1.19	4,000,233	1.19
9	蔺海鹰	3,285,063	0.98	3,285,064	0.98
10	包宇杰	3,274,063	0.97	3,274,063	0.97
合计		85,033,777	25.31	85,033,779	25.31

(三)截止到2015年5月8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2,970.96份,占该基金总份额的比例为0.0003%。其中,本基金管理人高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量为0份,该只基金的基金经理持有该只基金份额总量为0份。

注:以上信息依据中国证券登记结算有限责任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。
量化及衍生品投资部
负责公司量化投资与衍生品投资等相关业务。
固定收益部
负责公司固定收益证券的研究、投资工作。
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。
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。
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。
渠道业务部
负责公司券商渠道销售管理及服务工作。
电子商务部
负责公司电子商务平台的建设,业务推广以及公司网站的建设、更新、内容维护等工作。
营销策划部
负责公司品牌管理、媒体和广告管理、营销策划与销售支持。
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、日常行政事务管理。
人力资源部
负责公司人事劳资管理。
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。
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。
鹏华资产管理(深圳)有限公司
负责特定客户资产管理业务及中国证监会许可的其他业务
12、人员情况
截至2015年3月31日,公司员工总数281人,其中:正式员工246人,外包员工35人。学历构成如下:博士14人占比5.0%,硕士169人占比60.1%,本科89人占比31.7%,大专及以下9人占比3.2%。
13、信息披露负责人及咨询电话
张戈 0755—82825720
14、本基金基金经理
余斌先生,国籍中国,经济学硕士,7年证券从业经验。曾任职于招商证券股份有限公司,担任风险控制部市场风险分析师;2009年10月加盟鹏华基金管理有限公司,历任机构理财部大客户经理、量化投资部量化研究员,先后从事特定客户资产管理业务产品设计、量化研究等工作;2014年5月起担任鹏华中证信息技术指数分级证券投资基金基金经理,2014年5月起担任鹏华中证800证券保险指数分级证券投资基金基金经理,2014年11月起担任鹏华中证国防指数分级证券投资基金基金经理,2015年5月起担任鹏华中证银行指数分级证券投资基金基金经理。余斌先生具备基金从业资格。

(二)基金托管人
1、基本情况
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
成立时间:2004年09月17日
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
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)6759 5096

中国建设银行拥有悠久的经营历史,其前身"中国人民建设银行"于1954年成立,1996年易名为"中国建设银行"。中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于2004年9月分立而成立,承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行(股票代码:601939)于2005年10月27日在香港联合交易所主板上市,是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006年9月11日,中国建设银行又作为第一家H股公司晋身恒生指数。2007年9月25日中国建设银行A股在上海证券交易所上市并开始交易。A股发行后中国建设银行的已发行股份总数为:250,010,977,486股(包括240,417,319,880股H股及9,593,657,606股A股)。

2014年上半年,本集团实现利润总额1,695.16亿元,较上年同期增长9.23%;净利润1,309.70亿元,较上年同期增长9.17%。营业收入2,870.97亿元,较上年同期增长14.20%;其中,利息净收入增长12.59%,净利息收益率(NIM)2.80%;手续费及佣金净收入增长8.39%,在营业收入中的占比达20.96%。成本收入比24.17%,同比下降0.45个百分点。资本充足率与核心一级资本充足率分别为13.89%和11.21%,同业领先。

截至2014年6月末,本集团资产总额163,997.90亿元,较上年末增长6.75%,其中,客户贷款和垫款总额91,906.01亿元,增长6.99%;负债总额152,527.78亿元,较上年末增长6.75%,其中,客户存款总额129,569.56亿元,增长6.00%。

截至2014年6月末,中国建设银行公司机构客户326.89万户,较上年末增加20.35万户,增长6.64%;个人客户近3亿户,较上年末增加921万户,增长3.17%;网上银行客户1.67亿户,较上年末增长9.23%,手机银行客户数1.31亿户,增长12.56%。

截至2014年6月末,中国建设银行境内营业机构总量14,707个,服务覆盖面进一步扩大;自助设备72,128台,较上年末增加3,115台。电子银行和自助渠道账务性交易量占比达86.55%,较上年末提高1.15个百分点。

2014年上半年,本集团各方面良好表现,得到市场与业界广泛认可,先后荣获国内外知名机构授予的40余个重要奖项。在英国《银行家》杂志2014年"世界银行1000强排名"中,以一级资本总额位列全球第2,较上年上升3位;在美国《福布斯》杂志2014年全球上市公司2000强排名中位列第2;在美国《财富》杂志世界500强排名第38位,较上年上升12位。

中国建设银行总行设投资托管业务部,下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII托管处、养老金托管处、清算处、核算处、监督稽核处等9个职能处室,在上海设有投资托管服务上海备份中心,共有员工240余人。自2007年起,托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计,并已经成为常规化的内控工作手段。

2、主要人员情况

赵观甫,投资托管业务部总经理,曾先后在中国建设银行郑州市分行、总行信贷部、总行信贷二部、行长办公室工作,并在中国建设银行河北省分行营业部、总行个人银行业务部、总行审计部担任领导职务,长期从事信贷业务、个人银行业务和内部审计等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟,投资托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部,长期从事大客户的客户管理及服务工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红,投资托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行总行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室,长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张力铮,投资托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行建筑经济部、信贷二部、信贷部、信贷管理部、信贷经营部、公司业务部,并在总行集团客户部和中国建设银行北京市分行担任领导职务,长期从事信贷业务和集团客户业务等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲,投资托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行会计部,长期从事托管业务管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

3、基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行,中国建设银行一直秉持"以客户为中心"的经营理念,不断加强风险管理和内部控制,严格履行托管人的各项职责,切实维护资产持有人的合法权益,为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展,中国建设银行托管资产规模不断扩大,托管业务品种不断增加,已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系,是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2014年9月末,中国建设银行已托管389只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平,赢得了业内的高度认同。中国建设银行自2009年至今连续五年被国际权威杂志《全球托管人》评为"中国最佳托管银行";获和讯网的中国"最佳资产托管银行"奖;境内权威经济媒体《每日经济观察》的"最佳基金托管银行"奖;中央国债登记结算有限责任公司的"优秀托管机构"奖。

(三)登记机构
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:周明
联系电话:010—50938856
传真:010—50938907
联系人:崔巍

(四)验资机构
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:单峰
经办会计师:单峰、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

(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2015年5月8日资产负债表如下:

资 产	2015年5月8日	负债和所有者权益	2015年5月8日
	余额		余额
资 产:		负债:	
银行存款	1,030,703,297.95	短期借款	
结算备付金		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		卖出回购金融资产款	
其中:股票投资		应付证券清算款	
债券投资		应付赎回款	
资产支持证券投资		应付管理人报酬	56,482.30
基金投资		应付托管费	12,426.10
衍生金融资产		应付销售服务费	
买入返售金融资产		应付交易费用	
应收证券清算款		应付税费	
应收利息	148,908.37	应付利息	
应收股利		应付利润	
应收申购款		其他负债	5,129.67
其他资产		负债合计	74,038.07
		所有者权益:	
		实收基金	1,030,790,724.11
		未分配利润	−12,555.86
		所有者权益合计	1,030,778,168.25
资产合计	1,030,852,206.32	负债与持有人权益总计:	1,030,852,206.32

八、基金投资组合

截止到2015年5月8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		
	其中:债券		
	资产支持证券		
3	金融衍生品投资		
4	买入返售金融资产		
	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	1,030,703,297.95	99.99
6	其他各项资产	148,908.37	0.01
7	合计	1,030,852,206.32	100.00

(二)按行业分类的股票投资组合
1、指数投资按行业分类的股票投资组合
注:截至2015年5月8日,本基金未持有股票。
2、积极投资按行业分类的股票投资组合
注:截至2015年5月8日,本基金未持有股票。
(三)按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细
1、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
注:截至2015年5月8日,本基金未持有股票。
2、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
注:截至2015年5月8日,本基金未持有股票。
(四)按券种分类的债券投资组合
注:截至2015年5月8日,本基金未持有债券。
(五)按公允价值占净值比例大小排序的前五名债券明细
注:截至2015年5月8日,本基金未持有债券。
(六)按公允价值占净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细
注:截至2015年5月8日,本基金未持有资产支持证券。
(七)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
截至2015年5月8日,本基金未持有贵金属。
(八)按公允价值占净值比例大小排序的前五名权证投资明细
注:截至2015年5月8日,本基金未持有权证。
(九)本基金投资的股指期货交易情况说明
1、本基金本报告期内未发生股指期货投资。
2、本基金投资股指期货的投资政策
本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低申购赎回时现金资产对投资组合的影响及投资组合仓位调整的交易成本,达到稳定投资组合资产净值的目的。
(十)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。
(十一)投资组合报告附注
1、截至2015年5月8日,本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。
2、基金投资的前十名股票中,没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。
3、其他各项资产构成

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	148,908.37
5	应收申购款	
6	其他应收款	
7	待摊费用	
8	其他	
9	合计	148,908.37

4、截至2015年5月8日,本基金未持有处于转股期的可转换债券。
5、截至2015年5月8日,本基金指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明。
截至2015年5月8日,本基金未持有股票。
6、截至2015年5月8日,本基金积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明
截至2015年5月8日,本基金未持有股票。
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,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证全指证券公司指数分级证券投资基金募集的文件
2、《鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金合同》
3、《鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金托管协议》
4、法律意见书
5、基金管理人业务资格批件、营业执照
6、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)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
2015年5月12日

附件:鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金合同摘要

第一部分 基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务
一、基金份额持有人的权利、义务
1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金份额持有人的权利包括但不限于:
(1)分享基金财产收益;
(2)参与分配清算后的剩余基金财产;
(3)依法转让或申请赎回其持有的基金份额;
(4)按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会;
(5)出席或者委派代表出席基金份额持有人大会,对基金份额持有人大会审议事项行使表决权;
(6)查阅或者复制公开披露的基金信息资料;
(7)监督基金管理人的投资运作;
(8)对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁;
(9)法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。
2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金份额持有人的义务包括但不限于:
(1)认真阅读并遵守基金合同,招募说明书等信息披露文件;
(2)了解所投资基金产品,了解自身风险承受能力,自主判断基金的投资价值,自主作出投资决策,自行承担投资风险;
(3)关注基金信息披露,及时行使权利和履行义务;
(4)交纳基金认购、申购、赎回款项及法律法规和基金合同所规定的费用;
(5)在其持有的基金份额范围内,承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任;
(6)不从事任何有损基金及其他基金合同当事人合法权益的活动;
(7)执行生效的基金份额持有人大会的决议;
(8)返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利;
(9)法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。
二、基金管理人的权利、义务
1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金管理人的权利包括但不限于:
(1)依法募集资金;
(2)自基金合同生效之日起,根据法律法规和基金合同独立运用并管理基金财产;
(3)依照基金合同收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用;
(4)销售基金份额;
(5)按照规定召集基金份额持有人大会;
(6)依据基金合同及有关法律规定监督基金托管人,如认为基金托管人违反了基金合同及国家有关法律规定,应呈报中国证监会和其他监管部门,并采取必要措施保护基金投资者的利益;
(7)在基金托管人更换时,提名新的基金托管人;
(8)选择、更换基金销售机构,对基金销售机构的相关行为进行监督和处理;
(9)担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得基金合同规定的费用;
(10)依据基金合同及有关法律规定决定基金收益的分配方案;
(11)在基金合同约定的范围内,拒绝或暂停受理申购与赎回申请;
(12)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;
(13)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、融券及转融通;
(14)以基金管理人的名义,代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;
(15)选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构;
(16)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、转换和非交易过户等业务的业务规则;
(17)法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。
2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金管理人的义务包括但不限于:
(1)依法募集资金,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、谨慎勤勉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基金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,不得利用基金财产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)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,按有关规定计算并公告基金资产净值、基金份额净值、基金份额参考净值,确定鹏华证券份额申购、赎回的价格;
(9)进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;
(10)编制季度、半年度和年度基金报告;
(11)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;
(12)保守基金商业秘密,不泄露基金投资计划、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,不向他人泄露;
(13)按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基金收益;
(14)按规定受理申购与赎回申请,及时、足额支付赎回款项;
(15)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;
(16)按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料15年以上;
(17)确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出,并且保证投资者能够按照基金合同规定的时间和方式,随时查阅到与基金有关的公开资料,并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件;
(18)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;
(19)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;
(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时,应当承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;
(21)监督基金托管人按法律法规和基金合同规定履行自己的义务,基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时,基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿;
(22)当基金管理人将其义务委托第三方处理时,应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任;
(23)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实施其他法律行为;
(24)基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件,基金合同不能生效,基金管理人承担全部募集费用,将已募集资金并加计银行同期存款利息在基金募集期结束后30日内退还基金认购人;
(25)执行生效的基金份额持有人大会的决议;
(26)建立并保存基金份额持有人名册;
(27)法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。
三、基金托管人的权利、义务
1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金托管人的权利包括但不限于:
(1)自基金合同生效之日起,依法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产;
(2)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费用;
(3)监督基金管理人对本基金的投资运作,如发现基金管理人有违反基金合同及国家法律法规行为,对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形,应呈报中国证监会,并采取必要措施保护基金投资者的利益;
(4)根据相关市场规则,为基金开设资金账户、证券账户等投资所需账户,为基金办理证券交易资金清算;
(5)提议召开或召集基金份额持有人大会;
(6)在基金管理人更换时,提名新的基金管理人;
(7)法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。
2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金托管人的义务包括但不限于:
(1)以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产;
(2)设立专门的基金托管部门,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)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,确保基金财产的安全,保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立;对所托管的不同的基金分别设置账户,独立核算,分账管理,保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立;
(4)除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外,不得利用基金财产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、证券账户等投资所需账户,按照基金合同的约定,根据基金管理人的投资指令,及时办理清算、交割事宜;
(7)保守基金商业秘密,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予以保密,不得向他人泄露;
(8)复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值、基金份额参考净值、鹏华证券份额申购、赎回价格;
(9)办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项;
(10)对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见,说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行;如果基金管理人有未执行基金合同规定的行为,还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施;
(11)保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料15年以上;
(12)建立并保存基金份额持有人名册;
(13)按规定制作相关账册并与基金管理人核对;
(14)依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项;
(15)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份额持有人依法召集基金份额持有人大会;
(16)按照法律法规和基金合同的规定监督基金管理人的投资运作;
(17)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;
(18)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和银行监管机构,并通知基金管理人;
(19)因违反基金合同导致基金财产损失时,应承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;
(20)按规定监督基金管理人按法律法规和基金合同规定履行自己的义务,基金管理人因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管理人追偿;
(21)执行生效的基金份额持有人大会的决议;
(22)法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

第二部分 基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成,基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人大会的审议事项应分别由鹏华证券份额、鹏华证券A份额、鹏华证券B份额的基金份额持有人独立进行表决。基金份额持有人持有的每一基金份额在其对应的份额类别内拥有平等的投票权。

本基金份额持有人大会不设日常机构。

一、召开事由
1、当出现或需要决定下列事由之一的,应当召开基金份额持有人大会:
(1)终止基金合同(法律法规、中国证监会或基金合同另有约定的除外);
(2)更换基金管理人;
(3)更换基金托管人,但因涉及本基金与其它基金合并的除外;
(4)转换基金运作方式(法律法规、中国证监会或基金合同另有约定的除外);
(5)提高基金管理人、基金托管人的报酬标准;
(6)变更基金类别;
(7)本基金与其他基金的合并(法律法规、中国证监会或基金合同另有约定的除外);
(8)变更基金投资目标、范围或策略(法律法规、中国证监会或基金合同另有约定的除外);
(9)变更基金份额持有人大会程序;
(10)基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会;
(11)单独或合计持有鹏华证券份额、鹏华证券A份额、鹏华证券B份额各自基金份额10%以上(含10%)基金份额的基金份额持有人(以基金管理人收到提议当日的基金份额计算,下同)就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会;
(12)终止鹏华证券A份额、鹏华证券B份额上市,但因基金不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的除外;
(13)对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项;
(14)法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。
2、以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改,不需召开基金份额持有人大会:
(1)调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用;
(2)法律法规要求增加的基金费用的收取;
(3)在法律法规和基金合同规定的范围内且在对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下调整本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式;
(4)在法律法规和基金合同规定的范围内,在不提高现有基金份额持有人适用的费率的前提下,设立新的基金份额级别,增加新的收费方式;
(5)因相应的法律法规、深圳证券交易所或登记机构的相关业务规则发生变动而应当对基金合同进行修改;
(6)对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生重大变化;
(7)按照法律法规和基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。
二、会议召集人及召集方式
1、除法律法规规定或基金合同另有约定外,基金份额持有人大会由基金管理人召集;
2、基金管理人未按规定召集或不能召开时,由基金托管人召集;
3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的,应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集,并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的,应当自出具书面决定之日起60日内召开;基金管理人决定不召集,基金托管人仍认为有必要召开的,应当由基金托管人自行召集,应当自出具书面决定之日起60日内召开并告知基金管理人,基金管理人应当配合。
4、单独或合计持有鹏华证券份额、鹏华证券A份额、鹏华证券B份额各自基金份额10%以上(含10%)的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会,应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集,并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的,应当自出具书面决定之日起60日内召开;基金管理人决定不召集,单独或合计持有鹏华证券份额、鹏华证券A份额、鹏华证券B份额各自基金份额10%以上(含10%)的基金份额持有人仍认为有必要召开的,应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集,并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人;基金托管人决定召集的,应当自出具书面决定之日起60日内召开。
5、单独或合计持有鹏华证券份额、鹏华证券A份额、鹏华证券B份额各自基金份额10%以上(含10%)的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会,而基金管理人、基金托管人都不召集的,单独或合计持有鹏华证券份额、鹏华证券A份额、鹏华证券B份额各自基金份额10%以上(含10%)的基金份额持有人有权自行召集,并至少提前30日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的,基金管理人、基金托管人应当配合,不得阻碍、干扰。
6、基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。
三、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式
1、召开基金份额持有人大会,召集人应于会议召开前30日,在指定媒介公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容:
(1)会议召开的时间、地点和会议形式;
(2)会议拟审议的事项、议事程序和表决方式;
(3)有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日;
(4)授权委托证明的内容要求(包括但不限于代理人身份,代理权限和代理有效期限等)、送达时间和地点;
(5)会务常设联系人姓名及联系电话;
(6)出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续;
(7)召集人需要通知的其他事项。
2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下,由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。
3、如召集人为基金管理人,还应另行书面通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督;如召集人为基金托管人,则应另行书面通知基金管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督;如召集人为基金份额持有人,则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对表决意见的计票进行监督的,不影响表决意见的计票效力。
四、基金份额持有人出席会议的方式
基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规和监管机关允许的其他方式召开,基金管理人、基金托管人须为基金份额持有人行使投票权提供便利。会议的召开方式由会议召集人确定。
1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席,现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会,基金管理人或基金托管人不派代表列席的,不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时,可以进行基金份额持有人大会议程:
(1)亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、基金合同和会议通知的规定,并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符;
(2)经核对,汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示,有效的鹏华证券份额、鹏华证券A份额、鹏华证券B份额各自基金份额不少于本基金在权益登记日鹏华证券份额、鹏华证券A份额、鹏华证券B份额各自基金总份额的二分之一(含二分之一)。若到会者在权益登记日代表的有效的鹏华证券份额、鹏华证券A份额、鹏华证券B份额各自基金份额少于本基金在权益登记日鹏华证券份额、鹏华证券A份额、鹏华证券B份额各自基金总份额的二分之一,召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内,就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的鹏华证券份额、鹏华证券A份额、鹏华证券B份额各自基金份额应不少于本基金在权益登记日鹏华证券份额、鹏华证券A份额、鹏华证券B份额各自基金总份额的三分之一(含三分之一)。
2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式在表决截至日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式进行表决。
在同时符合以下条件时,通讯开会的方式视为有效:
(1)会议召集人按基金合同约定公布会议通知后,在2个工作日内连续公布相关提示性公告;
(2)召集人按基金合同约定通知基金托管人(如果基金托管人为召集人,则为基金管理人)到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人(如果基金托管人为召集人,则为基金管理人)和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见;基金托管人或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的,不影响表决效力;
(3)本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的,基金份额持有人所持有的鹏华证券份额、鹏华证券A份额、鹏华证券B份额各自基金份额不小于在权益登记日鹏华证券份额、鹏华证券A份额、鹏华证券B份额各自基金总份额的二分之一(含二分之一);若本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所持有的鹏华证券份额、鹏华证券A份额、鹏华证券B份额各自基金份额小于在权益登记日鹏华证券份额、鹏华证券A份额、鹏华证券B份额各自基金总份额的二分之一,召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内,就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一(含三分之一)以上鹏华证券份额、鹏华证券A份额、鹏华证券B份额各自基金份额的持有人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见;
(4)上述第(3)项中直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人,同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、基金合同和会议通知的规定,并与基金登记机构记录相符。
3、在法律法规和监管机关允许的情况下,本基金的基金份额持有人亦可采用其他非书面方式授权其代理人出席基金份额持有人大会;在会议召开方式上,本基金亦可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会,会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。
五、议事内容与程序
1、议事内容及提案权
议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项,如基金合同的重大修改、决定终止基金合同、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及基金合同规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。
基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后,对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开前及时公告。
基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。
2、议事程序
(1)现场开会
在现场开会的方式下,首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人,然后由大会主持人宣读提案,经讨论后进行表决,并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表,在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下,由基金托管人授权其出席会议的代表主持;如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会,则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的二分之一以上(含二分之一)选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会,不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。
会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名(或单位名称)、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名(或单位名称)和联系方式等事项。
(2)通讯开会
在通讯开会的情况下,首先由召集人提前30日公布提案,在所通知的表决截止日期后2个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决,在公证机关监督下形成决议。
六、表决
基金份额持有人所持每份鹏华证券份额、鹏华证券A份额、鹏华证券B份额在其对应的份额类别内有一票表决权。
基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议:
1、一般决议,一般决议须经参加大会的鹏华证券份额、鹏华证券A份额、鹏华证券B份额各自基金份额的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上(含二分之一)通过方为有效;除下列第2项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。
2、特别决议,特别决议应当经参加大会的鹏华证券份额、鹏华证券A份额、鹏华证券B份额各自基金份额的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上(含三分之二)通过方可做出。除本基金合同另有约定的,转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止基金合同、与其他基金合并以特别决议通过方为有效。
基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。
采取通讯方式进行表决时,除非在计票时有充分的相反证据证明,否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者,表面符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决,表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决,但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。
基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。
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表决通过之日起生效。
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介上公告。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。

第三部分 基金收益分配原则、执行方法

在存续期内,本基金(包括鹏华证券份额、鹏华证券A份额、鹏华证券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。

第四部分 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、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,由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在次月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付,基金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,由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在次月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付,基金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日在指定媒介公告。
上述"一、基金费用的种类中第4—11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。

第五部分 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、资产支持证券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:投资于股票部分的比例不低于基金资产的80%,其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例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)投资于股票部分的比例不低于基金资产的80%,其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金资产的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)本基金非指数化投资部分持有一家公司发行的证券,其市值不超过基金资产净值的10%;
(4)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%;
(5)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%;
(6)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%;
(7)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%;
(8)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%,中国证监会规定的特殊品种除外;
(9)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%;
(10)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%;
(11)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;
(12)基金财产参与股票发行申购,本基金所申报的金额不超过本基金的总资产,本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;
(13)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%;
(14)基金总资产不得超过基金净资产的140%;
(15)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%;
(16)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;
(17)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%;
(18)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)应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定;
(19)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%;
(20)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/期货市场波动、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,但中国证监会规定的特殊情形除外。
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。期间,基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。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或变更上述限制,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或按变更后的规定执行。
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。
基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券,或者从事其他重大关联交易的,应当符合基金的投资目标和投资策略,遵循基金份额持有人利益优先的原则,防范利益冲突,相关交易必须事先得到基金托管人的同意,并按法律法规予以披露,并履行信息披露义务。
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。

第六部分 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负债后的价值。
二、基金资产净值、基金份额净值的公告方式
基金合同生效后,在鹏华证券A份额与鹏华证券B份额开始上市交易前或鹏华证券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、鹏华证券份额的基金份额净值、鹏华证券A份额与鹏华证券B份额的基金份额参考净值。
在鹏华证券A份额与鹏华证券B份额上市交易后或鹏华证券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,披露开放日鹏华证券份额的基金份额净值和基金份额累计净值、鹏华证券A份额与鹏华证券B份额的基金份额参考净值。
基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值、鹏华证券份额的基金份额净值、鹏华证券A份额与鹏华证券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的次日,将基金资产净值、鹏华证券份额的基金份额净值和基金份额累计净值、鹏华证券A份额与鹏华证券B份额的基金份额参考净值登载在指定媒介上。

第七部分 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生效后方可执行,并自决议生效后两个工作日内在指定媒介公告。
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,分别计算鹏华证券份额、鹏华证券A份额、鹏华证券B份额各自的应计分配比例,并据此向鹏华证券份额、鹏华证券A份额、鹏华证券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。

第八部分 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,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,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。

第九部分 基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

基金合同可印制成册,供投资者在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅;投资者也可按工本费购买基金合同复制件或复印件,但内容应以基金合同正本为准。

签署人:鹏华基金管理有限公司
签署日期:二零一五年五月

关于鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金开通跨系统转托管业务的公告

鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金(基金简称:鹏华证券,基金代码:160633,场内简称:券商指基)基金合同于2015年5月6日正式生效。在本基金募集期间,投资者通过场内、场外两种方式进行了认购。

为保护基金份额持有人的利益,根据本基金基金合同的约定,经本基金管理人向深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司申请,将自2015年5月15日起开始办理本基金的跨系统转托管业务。自2015年5月15日起,通过场内、场外方式认购本基金的基金份额持有人可以通过认购本基金的销售机构办理本基金的跨系统转托管业务。本基金跨系统转托管的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。

投资者可以通过以下途径咨询有关详情:
1、鹏华基金管理有限公司网站: www.phfund.com
2、鹏华基金管理有限公司客户服务热线:400-6788-999、0755-82353668

风险提示:本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资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。投资者投资于本基金前应认真阅读本基金的基金合同和招募说明书。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

鹏华基金管理有限公司
2015年5月12日

关于鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金开通份额配对转换业务的公告

根据《鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金合同》(以下简称"基金合同")的相关规定,鹏华基金管理有限公司(简称"本公司")决定自2015年5月15日起,开通鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金的份额配对转换业务。具体事项公告如下:

一、份额配对转换业务

份额配对转换是指鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金之基础份额(场内简称:券商指基,基金代码:160633)与鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金之A份额(场内简称:券商A级,基金代码:150235)、鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金之B份额(场内简称:券商B级,基金代码:150236)之间的场内配对转换,包括分拆和合并两个方面。

分拆:指基金份额持有人将其持有的场内鹏华券商指基份额按照2份场内鹏华券商指基份额对应1份券商A级份额与1份券商B级份额的比例进行转换的行为;基金份额的合并,指基金份额持有人将其持有的券商A级份额与券商B级份额按照1份券商A级份额与1份券商B级份额对应2份场内鹏华券商指基份额的比例进行转换的行为。

鹏华券商A级份额与鹏华券商B级份额的配比始终保持1:1的比率不变。

鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金的场内份额可以直接申请分拆与合并,场外份额通过跨系统转托管至场内后方可申请分拆与合并。

二、份额配对转换的业务办理机构

投资者可以通过依据中国证券登记结算有限责任公司(以下简称"中登")有关规定获得业务办理资格的深圳证券交易所会员单位办理份额配对转换业务。具有配对转换业务资格的深圳证券交易所会员单位为:爱建证券、安信证券、渤海证券、财达证券、财富证券、财富里昂、财通证券、长城证券、长江证券、川财证券、大通证券、大同证券、德邦证券、第一创业、东北证券、东方证券、东海证券、东莞证券、东吴证券、东兴证券、高华证券、方正证券、光大证券、广发证券、广州证券、国都证券、国海证券、国金证券、国开证券、国联证券、国盛证券、国泰君安、国信证券、国元证券、海通证券、恒泰长财、恒泰证券、红塔证券、宏源证券、宏信证券、华安证券、华宝证券、华创证券、华福证券、华林证券、华龙证券、华融证券、华泰联合、华泰证券、华西证券、华鑫证券、江海证券、金元证券、开源证券、联讯证券、民生证券、民族证券、南京证券、平安证券、齐鲁证券、日信证券、瑞银证券、山西证券、上海证券、申银万国、世纪证券、首创证券、天风证券、天源证券、万和证券、万联证券、西部证券、西藏同信、西南证券、厦门证券、湘财证券、新时代证券、信达证券、兴业证券、银河证券、银泰证券、英大证券、招商证券、浙商证券、中航证券、中金公司、中山证券、中投证券、中天证券、中信建投、中信浙江、中信山东、中信证券、中银证券、中邮证券、中原证券、太平洋证券(排名不分先后)。中登将对具备基金分拆转换及合并转换业务资格的证券公司名单进行更新,投资者可登陆中登网站(www.chinaclear.cn)查询最新名单,本公司对该名单的更新不再另行公告。

三、份额配对转换的业务办理时间

深圳证券交易所交易日上午9:30-11:30和下午13:00-15:00(本公司公告暂停份额配对转换业务时除外)。

若深圳证券交易所交易时间更改或实际情况需要,本公司将对份额配对转换业务的办理时间进行相应调整并公告。

四、份额配对转换业务规则
1、份额配对转换以份额申请。
2、申请进行分拆的鹏华券商指基份额的场内份额必须是偶数。
3、申请合并为鹏华券商指基的券商A级份额和券商B级份额必须同时配对申请,且基金份额数必须同为整数且相等。
4、鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金场外份额如需申请进行分拆,须跨系统转托管为鹏华券商指基的场内份额方可进行。
5、份额配对转换应遵循届时相关机构发布的相关业务规则。
基金管理人、基金注册登记机构或深圳证券交易所可视情况对上述规定作出调整,并在正式实施前2日在至少一家指定媒体公告。

五、份额配对转换的业务办理费用

投资者申请办理份额配对转换业务时,份额配对转换业务办理机构暂不收取业务办理费用。

六、重要提示
1、本公司有权根据市场情况或法律法规变化调整上述份额配对转换的业务规则,并按照相关规定进行公告。
2、投资者若希望了解基金份额配对转换业务详情,请登陆本公司网站:www.phfund.com或者拨打本公司客服电话:400-6788-999(免长途费)或0755-82353668。
3、风险提示:本公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。投资者投资于基金前应认真阅读基金的基金合同、招募说明书等文件。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

鹏华基金管理有限公司
2015年5月12日

鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告

根据中国证监会[2008]38号公告《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》的规定,鹏华基金管理有限公司(以下简称"本公司")于2008年9月16日发布了《鹏华关于进一步规范旗下基金估值业务的公告》,说明本公司于2008年9月16日起对旗下基金持有的停牌股票等估值日无市价且对基金净值影响超过0.25%的投资品种的公允价值按照"指数收益法"估值确定。

2015年3月26日,本公司旗下基金持有的股票"远望谷"(股票代码002161)停牌,本公司依据指导意见等法规规定,经与托管银行协商一致,决定于2015年5月11日起对本公司旗下基金(ETF基金除外)所持有的该股票采用"指数收益法"进行估值。待"远望谷"股票复牌且其交易体现了活跃市场交易特征之日起,恢复采用当日收盘价进行估值,届时不再另行公告。敬请投资者予以关注。

本公司旗下基金将严格按照《企业会计准则》、指导意见、中国证监会相关规定和基金合同中关于估值的约定对基金所持有的投资品种进行估值,请广大投资者关注。

投资者可登陆我公司网站(http://www.phfund.com)或拨打客户服务电话400-6788-999咨询或查阅相关信息。

特此公告。

鹏华基金管理有限公司
2015年5月12日

鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告

根据中国证监会[2008]38号公告《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》的规定,鹏华基金管理有限公司(以下简称"本公司")于2008年9月16日发布了《鹏华关于进一步规范旗下基金估值业务的公告》,说明本公司于2008年9月16日起对旗下基金持有的停牌股票等估值日无市价且对基金净值影响超过0.25%的投资品种的公允价值按照"指数收益法"估值确定。

2015年4月7日,本公司旗下基金持有的股票"长电科技"(股票代码600584)停牌,本公司依据指导意见等法规规定,经与托管银行协商一致,决定于2015年5月11日起对本公司旗下基金(ETF基金除外)所持有的该股票采用"指数收益法"进行估值。待"长电科技"股票复牌且其交易体现了活跃市场交易特征之日起,恢复采用当日收盘价进行估值,届时不再另行公告。敬请投资者予以关注。

本公司旗下基金将严格按照《企业会计准则》、指导意见、中国证监会相关规定和基金合同中关于估值的约定对基金所持有的投资品种进行估值,请广大投资者关注。

投资者可登陆我公司网站(http://www.phfund.com)或拨打客户服务电话400-6788-999咨询或查阅相关信息。

特此公告。

鹏华基金管理有限公司
2015年5月12日

鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告

根据中国证监会[2008]38号公告《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》的规定,鹏华基金管理有限公司(以下简称"本公司")于2008年9月16日发布了《鹏华关于进一步规范旗下基金估值业务的公告》,说明本公司于2008年9月16日起对旗下基金持有的停牌股票等估值日无市价且对基金净值影响超过0.25%的投资品种的公允价值按照"指数收益法"估值确定。

2015年4月7日,本公司旗下基金持有的股票"劲胜精密"(股票代码300083)停牌,本公司依据指导意见等法规规定,经与托管银行协商一致,决定于2015年5月11日起对本公司旗下基金(ETF基金除外)所持有的该股票采用"指数收益法"进行估值。待"劲胜精密"股票复牌且其交易体现了活跃市场交易特征之日起,恢复采用当日收盘价进行估值,届时不再另行公告。敬请投资者予以关注。

本公司旗下基金将严格按照《企业会计准则》、指导意见、中国证监会相关规定和基金合同中关于估值的约定对基金所持有的投资品种进行估值,请广大投资者关注。

投资者可登陆我公司网站(http://www.phfund.com)或拨打客户服务电话400-6788-999咨询或查阅相关信息。

特此公告。

鹏华基金管理有限公司
2015年5月12日

鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告

根据中国证监会[2008]38号公告《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》的规定,鹏华基金管理有限公司(以下简称"本公司")于2008年9月16日发布了《鹏华关于进一步规范旗下基金估值业务的公告》,说明本公司于2008年9月16日起对旗下基金持有的停牌股票等估值日无市价且对基金净值影响超过0.25%的投资品种的公允价值按照"指数收益法"估值确定。

2015年5月5日,本公司旗下基金持有的股票"新天科技"(股票代码300259)停牌,本公司依据指导意见等法规规定,经与托管银行协商一致,决定于2015年5月11日起对本公司旗下基金(ETF基金除外)所持有的该股票采用"指数收益法"进行估值。待"新天科技"股票复牌且其交易体现了活跃市场交易特征之日起,恢复采用当日收盘价进行估值,届时不再另行公告。敬请投资者予以关注。

本公司旗下基金将严格按照《企业会计准则》、指导意见、中国证监会相关规定和基金合同中关于估值的约定对基金所持有的投资品种进行估值,请广大投资者关注。

投资者可登陆我公司网站(http://www.phfund.com)或拨打客户服务电话400-6788-999咨询或查阅相关信息。

特此公告。

鹏华基金管理有限公司
2015年5月12日