鹏华中证一带一路主题指数分级证券投资基金之带路A与带路B上市交易公告书

基金管理人:鹏华基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
注册登记人:中国证券登记结算有限责任公司
上市地点:深圳证券交易所
上市时间:2015 年 5 月 25 日
公告日期:2015 年 5 月 20 日

一、 重要声明与提示

鹏华中证一带一路主题指数分级证券投资基金(以下简称"本基金")之带路 A 份额与带路 B 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带路 A 与带路 B 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 5 月 5 日刊登在《上海证券报》和本公司指定销售机构网站上的《鹏华中证一带一路主题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:鹏华中证一带一路主题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一带一路主题指数分级证券投资基金之基础份额(场内简称:带路分级)、鹏华中证一带一路主题指数分级证券投资基金之 A 份额(场内简称:带路 A)、鹏华中证一带一路主题指数分级证券投资基金之 B 份额(场内简称:带路 B)。其中,鹏华带路 A 份额、鹏华带路 B 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、鹏华中证一带一路主题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。鹏华带路 A 份额与鹏华带路 B 份额只上市交易,不接受申购和赎回。
7、鹏华中证一带一路主题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、份额配对转换是指基金合同生效后,场内鹏华一带一路份额与鹏华带路 A 份额、鹏华带路 B 份额之间可以按约定的规则进行场内份额配对转换,包括基金份额的分拆和合并两种转换行为。分拆是指指基金份额持有人将其持有的场内鹏华一带一路份额按照 2 份场内鹏华一带一路份额对应 1 份鹏华带路 A 份额与 1 份鹏华带路 B 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带路 A 份额与鹏华带路 B 份额按照 1 份鹏华带路 A 份额与 1 份鹏华带路 B 份额对应 2 份场内鹏华一带一路份额的比例进行转换的行为。本基金基础份额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,鹏华带路 A 份额与鹏华带路 B 份额的份额配比保持 1:1 的比例。对于鹏华带路 A 份额的约定应得收益,即鹏华带路 A 份额每个会计年度 8 月最后一个自然日基金份额参考净值超出 1.000 元部分,将折算为场内鹏华一带一路份额分配给鹏华带路 A 份额持有人,鹏华一带一路份额持有人持有的每 2 份鹏华一带一路份额将按 1 份鹏华带路 A 份额获得新增鹏华一带一路份额的分配。持有场外鹏华一带一路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一带一路份额的分配;持有场内鹏华一带一路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一带一路份额的分配。经过上述份额折算, 鹏华带路 A 份额的基金份额参考净值调整为 1.000 元,鹏华一带一路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,即当鹏华一带一路份额的基金份额净值达到 1.500 元时或当鹏华带路 B 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一带一路份额、鹏华带路 A 份额、鹏华带路 B 份额进行份额折算,份额折算后本基金将确保鹏华带路 A 份额与鹏华带路 B 份额的比例为 1:1,份额折算后鹏华一带一路份额的基金份额净值、鹏华带路 A 份额与鹏华带路 B 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 18 日,本基金的基金份额总额为 606,402,064.93 份,其中,鹏华带路分级份额 314,132,954.93 份,鹏华带路 A 份额为 146,134,555.00 份,鹏华带路 B 份额为 146,134,555.00 份。
12、基金份额净值:截至 2015 年 5 月 18 日,鹏华带路分级份额的基金份额净值为 1.000 元,鹏华带路 A 份额的基金份额参考净值为 1.000 元,鹏华带路 B 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:带路 A,基金代码:150273;带路 B,基金代码:150274
14、本次上市交易的基金份额总额:带路 A146,134,555.00 份;带路 B146,134,555.00 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 25 日
17、基金管理人:鹏华基金管理有限公司
18、基金托管人:招商银行股份有限公司
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[769]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 5 月 8 日至 2015 年 5 月 12 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、招商银行、众禄基金、数米基金、好买基金、上海天天基金、浙江同花顺、和讯信息科技、中信建投、方正证券、信达证券、海通证券、长城证券、广州证券、光大证券、平安证券、长江证券、申万宏源、安信证券、国泰君安、华鑫证券、国金证券、中信证券、中信(山东)、中信(浙江)、国信证券、湘财证券、西部证券、天风证券、银河证券、齐鲁证券、渤海证券、中金公司、中信建投(期货)
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 606,374,145.94 元人民币,折合基金份额 606,374,145.94 份;利息结转份额 27,918.99 份,总确认份额为 606,402,064.93 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 15 日全额划入本基金在基金托管人招商银行股份有限公司开立的鹏华中证一带一路主题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 606,402,064.93 份基金份额,其中场外认购的基金份额为 314,132,954.93 份;场内认购的基金份额为 292,269,110.00 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《鹏华中证一带一路主题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 18 日获中国证监会书面确认,本基金合同自该日起正式生效。基金合同生效之日起,本基金管理人正式开始管理本基金。
11、基金合同生效日:2015 年 5 月 18 日
12、基金合同生效日的基金份额总额:606,402,064.93 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]213 号
2、上市交易日期:2015 年 5 月 25 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:鹏华一带一路分级,场内简称:带路分级,基金代码:160638。
上市交易份额简称及代码:带路 A,基金代码:150273;带路 B,基金代码:150274。
5、本次上市交易份额:带路 A146,134,555.00 份;带路 B146,134,555.00 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。基金管理人于每个工作日交易结束后将经过基金托管人复核的基金净值传给深交所,深交所于次日通过行情系统"市盈率 I"揭示。根据《基金法》,开放式基金的基金会计责任方由基金管理人担任,因此基金管理人对公布的基金净值负责。
7、未上市交易份额的流通规定:对于托管在场内的带路分级份额,基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下,将其分拆为鹏华带路 A 份额和鹏华带路 B 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带路 A 份额和鹏华带路 B 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 25 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 18 日,带路分级基金份额持有人户数为 6,731 户,平均每户持有的基金份额为 46,669.58 份;鹏华带路 A 为 353 户,平均每户持有的基金份额 413,978.91 份;鹏华带路 B 为 353 户,平均每户持有的基金份额为 413,978.91 份。
机构投资者持有的本次上市交易的鹏华带路 A 与鹏华带路 B 的基金份额分别为 40,095,902.00 份和 40,095,903.00 份,分别占本次鹏华带路 A 与鹏华带路 B 上市交易基金份额比例为 27.44%和 27.44%;个人投资者持有的本次上市交易的鹏华带路 A 与鹏华带路 B 的基金份额分别为 106,038,653.00 份和 106,038,652.00 份,分别占本次鹏华带路 A 与鹏华带路 B 上市交易基金份额比例为 72.56%和 72.56%。
(二)截止到 2015 年 5 月 18 日,基金份额前十名持有人情况:
本次上市交易的鹏华带路 A 前十名持有人情况

序号	持有人名称	持有鹏华带路 A 份额	占鹏华带路 A 份额比例(%)
1	王毅	49,995,972	34.21%
2	鹏华资产—海通证券—鹏华资产以太量化一号资产管理计划	10,000,194	6.84%
3	丁鸥霞	6,498,625	4.45%
4	梁阿林	5,010,146	3.43%
5	国信证券股份有限公司	4,000,078	2.74%
6	张惠萍	4,000,077	2.74%
7	宝成期货有限责任公司—宝成—钱江一号资产管理计划	3,000,087	2.05%
8	富安达基金—海通证券—富安达—东海恒信10期资产管理计划	3,000,058	2.05%
9	渤海证券股份有限公司	2,505,097	1.71%
10	张平	2,505,049	1.71%
11	赵勤	2,505,049	1.71%
12	谭伟	2,505,049	1.71%
13	新疆金百胜贸易有限公司	2,505,049	1.71%
合计		98,030,530	67.06%

本次上市交易的鹏华带路 B 前十名持有人情况

序号	持有人名称	持有鹏华带路 B 份额	占鹏华带路 B 份额比例(%)
1	王毅	49,995,972	34.21%
2	鹏华资产—海通证券—鹏华资产以太量化一号资产管理计划	10,000,194	6.84%
3	丁鸥霞	6,498,626	4.45%
4	梁阿林	5,010,146	3.43%
5	张惠萍	4,000,078	2.74%
6	国信证券股份有限公司	4,000,077	2.74%
7	宝成期货有限责任公司—宝成—钱江一号资产管理计划	3,000,087	2.05%
8	富安达基金—海通证券—富安达—东海恒信10号资产管理计划	3,000,058	2.05%
9	渤海证券股份有限公司	2,505,097	1.71%
10	胡世芳	2,505,049	1.71%
11	安素珍	2,505,049	1.71%
12	史雯	2,505,049	1.71%
13	瑞恒医药科技投资有限责任公司	2,505,049	1.71%
14	江苏金财投资有限公司	2,505,049	1.71%
合计		100,535,580	68.77%

(三)截止到 2015 年 5 月 18 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 2,970.60 份, 占该基金总份额的比例为 0.0005%。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搭建、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
焦文龙先生,国籍中国,经济学硕士,6 年证券从业经验。2009 年 6 月加盟鹏华基金管理有限公司,历任监察稽核部金融工程师、量化及衍生品投资部资深量化研究员,先后从事金融工程、量化研究等工作;2015 年 5 月起至今担任鹏华中证一带一路主题指数分级证券投资基金基金经理。焦文龙先生具备基金从业资格。
(二)基金托管人
1、名称:招商银行股份有限公司(以下简称"招商银行")
设立日期:1987 年 4 月 8 日
注册地址:深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址:深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
注册资本:252.198 亿元
法定代表人:李建红
行长:田惠宇
资产托管业务批准文号:证监基金字[2002]83 号
电话:0755—83077301
传真:0755—83195201
资产托管部信息披露负责人:朱万鹏
招商银行成立于 1987 年 4 月 8 日,是我国第一家完全由企业法人持股的股份制商业银行,总行设在深圳。自成立以来,招商银行先后进行了三次增资扩股,并于 2002 年 3 月成功地发行了 15 亿 A 股,4 月 9 日在上交所挂牌(股票代码:600036),是国内第一家采用国际会计标准上市的公司。2006 年 9 月又成功发行了 22 亿 H 股,9 月 22 日在香港联交所挂牌交易 (股票代码:3968),10 月 5 日行使 H 股超额配售,共发行了 24.2 亿 H 股。截止 2014 年 9 月 30 日,本集团总资产 5.0331 万亿元人民币,高级法下资本充足率 11.45%,权重法下资本充足率 10.89%。
2002 年 8 月,招商银行成立基金托管部;2005 年 8 月,经报中国证监会同意,更名为资产托管部,下设业务支持室、产品管理室、业务营运室、稽核监察室、基金外包业务室 5 个职能处室,现有员工 60 人。2002 年 11 月,经中国人民银行和中国证监会批准获得证券投资基金托管业务资格,成为国内第一家获得该项业务资格上市银行;2003 年 4 月,正式办理基金托管业务。招商银行作为托管业务资质最全的商业银行,拥有证券投资基金托管、受托投资管理托管、合格境外机构投资者托管(QFII)、全国社会保障基金托管、保险资金托管、企业年金基金托管等业务资格。
招商银行确立"因势而变、先您所想"的托管理念和"财富所托、信守承诺"的托管核心价值,独创"6S 托管银行"品牌体系,以"保护您的业务、保护您的财富"为历史使命,不断创新托管系统、服务和产品;在业内率先推出"网上托管银行系统"、托管业务综合系统和"6 心"托管服务标准,首家发布私募基金绩效分析报告,开办国内首个托管银行网站,成功托管国内第一只券商集合资产管理计划、第一只 FOF、第一只信托资金计划、第一只股权私募基金、第一家实现货币市场基金赎回资金 T+1 到账、第一只境外银行 QDII 基金、第一只红利 ETF 基金、第一只"1+N"基金专户理财、第一家大小非解禁资产、第一单 TOT 保管,实现从单一托管服务商向全面投资者服务机构的转变,得到了同业认可。
经过十年发展, 招商银行资产托管规模快速壮大。2013 年招商银行加大高收益托管产品营销力度,新增托管公募开放式基金 18 只,新增首发公募开放式基金托管规模 377.37 亿元。克服国内证券市场震荡下行的不利形势,托管费收入、托管资产均创出历史新高,实现托管费收入 10.62 亿元,较上年增长 62.47%,托管资产余额 1.86 万亿元,较年初增长 71.86%。作为公益慈善基金的首个独立第三方托管人,成功签约"壹基金"公益资金托管,为我国公益慈善资金监管、信息披露进行有益探索,该项目荣获 2012 中国金融品牌[金象奖]"十大公益项目"奖;四度蝉联获《财资》"中国最佳托管专业银行"。
2、主要人员情况
李建红先生,本行董事长、非执行董事,2014 年 7 月起担任本行董事、董事长。英国东伦敦大学工商管理硕士、吉林大学经济管理专业硕士,高级经济师。招商局集团有限公司董事长,兼任招商局国际有限公司董事会主席,招商局能源运输股份有限公司董事长、中国国际海运集装箱(集团)股份有限公司董事长、招商局华建公路投资有限公司董事长和招商局资本投资有限责任公司董事长。曾任中国远洋运输(集团)总公司总裁助理、总经济师、副总裁,招商局集团有限公司董事、总裁。
田惠宇先生,本行行长、执行董事,2013 年 5 月起担任本行行长、本行执行董事。美国哥伦比亚大学公共管理硕士学位,高级经济师,曾于 2003 年 7 月至 2013 年 5 月历任上海银行副行长、中国建设银行上海市分行副行长、深圳市分行行长、中国建设银行零售业务总监兼北京市分行行长。
丁伟先生,本行副行长。大学本科毕业,副研究员。1996 年 12 月加入本行,历任杭州分行办公室主任兼营业部总经理,杭州分行行长助理,副行长,南昌支行行长,南昌分行行长,总行人力资源部总经理,总行行长助理,2008 年 4 月起任本行副行长。兼任招银国际金融有限公司董事长。
姜然女士,招商银行资产托管部总经理,大学本科毕业,具有基金托管人高级管理人员任职资格。先后供职于中国农业银行黑龙江省分行,华商银行,中国农业银行深圳市分行,从事信贷管理、托管工作。2002 年 9 月加盟招商银行至今,历任招商银行总行资产托管部经理、高级经理、总经理助理等职。是国内首家推出的网上托管银行的主要设计、开发者之一,具有 20 余年银行信贷及托管专业从业经验。在托管产品创新、服务流程优化、市场营销及客户关系管理等领域具有深入的研究和丰富的实务经验。3、3、基金托管业务经营情况
截至 2014 年 11 月 30 日,招商银行股份有限公司托管了招商安泰系列证券投资基金(含招商股票证券投资基金、招商平衡型证券投资基金和招商债券证券投资基金),招商现金增值开放式证券投资基金、华夏经典配置混合型证券投资基金、长城久泰沪深 300 指数证券投资基金、华夏货币市场基金、光大保德信货币市场基金、华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金、海富通强化回报混合型证券投资基金、光大保德信新增长股票型证券投资基金、富国天合稳健优选股票型证券投资基金、上证红利交易型开放式指数证券投资基金、德盛优势股票证券投资基金、华富成长趋势股票型证券投资基金、光大保德信优势配置股票型证券投资基金、益民多利债券型证券投资基金、德盛红利股票证券投资基金、上证中央企业 50 交易型开放式指数证券投资基金、上投摩根行业轮动股票型证券投资基金、中银蓝筹精选灵活配置混合型证券投资基金、南方策略优化股票型证券投资基金、兴全合润分级股票型证券投资基金、中邮核心主题股票型证券投资基金、长盛沪深 300 指数证券投资基金(LOF)、中银价值精选灵活配置混合型证券投资基金、中银稳健双利债券型证券投资基金、银河创新成长股票型证券投资基金、嘉实多利分级债券型证券投资基金、国泰保本混合型证券投资基金、华宝兴业可转债债券型证券投资基金、建信双利策略主题分级股票型证券投资基金、诺安保本混合型证券投资基金、鹏华新兴产业股票型证券投资基金、博时裕祥分级债券型证券投资基金、上证国有企业 100 交易型开放式指数证券投资基金、华安可转换债券债券型证券投资基金、中银转债增强债券型证券投资基金、富国低碳环保股票型证券投资基金、诺安油气能源股票证券投资基金(LOF)、中银中小盘成长股票型证券投资基金、国泰成长优选股票型证券投资基金、兴全轻资产投资股票型证券投资基金(LOF)、易方达纯债债券型证券投资基金、中银沪深 300 等权重指数证券投资基金(LOF)、中银保本混合型证券投资基金、嘉实增强收益定期开放债券型证券投资基金、工银瑞信 14 天理财债券型发起式证券投资基金、鹏华中小企业纯债债券型发起式证券投资基金、诺安双利债券型发起式证券投资基金、中银纯债债券型证券投资基金、南方安心保本混合型证券投资基金、中银理财 7 天债券型证券投资基金、中海惠裕纯债分级债券型发起式证券投资基金、建信双月安心理财债券型证券投资基金、中银理财 30 天债券型证券投资基金、广发新经济股票型发起式证券投资基金、中银稳健添利债券型发起式证券投资基金、博时亚洲票息收益债券型证券投资基金、工银瑞信增利分级债券型证券投资基金、鹏华丰利分级债券型发起式证券投资基金、中银消费主题股票型证券投资基金、工银瑞信用纯债一年定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛 6 个月定期开放债券型证券投资基金、工银瑞信保本 3 号混合型证券投资基金、中银标普金球精选自然资源等权重指数证券投资基金、博时月月薪定期支付债券型证券投资基金、中银保本二号混合型证券投资基金、建信安心回报两年定期开放债券型证券投资基金、中海惠利纯债分级债券型证券投资基金、富国恒利分级债券型证券投资基金、中银优秀企业股票型证券投资基金、中银多策略灵活配置混合型证券投资基金、华安新活力灵活配置混合型证券投资基金、宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金、交银施罗德新成长股票投资基金、嘉实对冲套利定期开放混合型投资基金、宝盈瑞祥养老混合型证券投资基金和银华永益分级债券型证券投资基金、中银聚利分级债券型证券投资基金、国泰新经济灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信新财富灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金、博时月月盈短期理财债券型证券投资基金、中银新经济灵活混合型证券投资基金、工银瑞信研究精选股票型证券投资基金共 86 只开放式基金及其它托管资产,托管资产为 33644.61 亿元人民币。
(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 18 日资产负债表如下:

资 产	2015年5月18日	负债和所有者权益	2015年5月18日
	余额		余额
资 产:		负债:	
银行存款	606,374,145.94	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	
基金投资		应付托管费	
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	76,428.91	应付利息	
应收股利		应付利润	
应收申购款		其他负债	1,293.87
其他资产		负债合计	1,293.87
		所有者权益:	
		实收基金	606,402,064.93
		未分配利润	47,216.05
		所有者权益合计	606,449,280.98
资产合计	606,450,574.85	负债与持有人权益总计:	606,450,574.85

八、基金投资组合

截止到 2015 年 5 月 18 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	606,374,145.94	99.99%
6	其他各项资产	76,428.91	0.01%
7	合计	606,450,574.85	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 18 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 18 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 18 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 18 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 18 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 18 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 18 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 18 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 18 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 18 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	76,428.91
5	应收申购款	
6	其他应收款	
7	待摊费用	
8	其他	
9	合计	76,428.91

4、截至 2015 年 5 月 18 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 18 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 18 日,本基金未持有股票。
6、截至 2015 年 5 月 18 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 18 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一带一路主题指数分级证券投资基金募集的文件
2、《鹏华中证一带一路主题指数分级证券投资基金合同》
3、《鹏华中证一带一路主题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 20 日

附件:鹏华中证一带一路主题指数分级证券投资基金合同摘要

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