鹏华前海万科REITs封闭式混合型发起式证券投资基金上市交易公告书

基金管理人：鹏华基金管理有限公司
基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司
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9月30日
公告日期：2015年9月25日

一、重要声明与提示

鹏华前海万科REITs封闭式混合型发起式证券投资基金上市交易公告书（以下简称“本基金”）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。

本基金主要投资于目标公司股权、固定收益类资产和权益类资产，基金净值会因为目标公司经营状况变化、租户履约状况变化和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：本基金的特定风险（如，封闭运作期内集中投资风险、目标公司经营风险、租金无法回收的风险、商业物业收益的估值风险、目标公司破产风险等）、信用风险、管理风险、操作或技术风险、合规性风险和政策变更风险等等，详见本公告书“三、基金的募集与上市交易”之“7、风险揭示”。

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

凡本上市交易公告书未涉及的有关内容，请仔细阅读2015年6月23日刊登在《中国证券报》和本公司指定销售机构网站上的《鹏华前海万科REITs封闭式混合型发起式证券投资基金招募说明书》。

二、基金概览

1、基金名称：鹏华前海万科REITs封闭式混合型发起式证券投资基金
2、基金简称：鹏华前海万科REITs
3、基金运作方式：契约型，基金合同生效后10年内（含10年）为基金封闭运作期，本基金在此期间内封闭运作并在深圳证券交易所上市交易。基金封闭运作期届满，本基金转为上市开放式基金（LOF）。
4、基金二级市场交易简称：鹏华前海
5、基金二级市场交易代码：184801
6、基金份额总额：截至2015年9月23日，本基金的基金份额总额为29,995,915.35份。
7、基金份额净值：截至2015年9月23日，本基金的基金份额净值为100.511元。
8、本次上市交易的基金份额总额：3,033,156.00份。
9、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所
10、上市交易日期：2015年9月30日
11、基金管理人：鹏华基金管理有限公司
12、基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司
13、本次上市交易的登记结算机构：中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司
14、上市推荐人：无

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]1166号
2、基金运作方式：
契约型，基金合同生效后10年内（含10年）为基金封闭运作期，本基金在此期间内封闭运作并在深圳证券交易所上市交易。基金封闭运作期届满，本基金转为上市开放式基金（LOF）。
3、基金合同期限：不定期
4、发售日期：2015年6月26日至2015年7月1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）。尚未取得相应业务资格，但属于深圳证券交易所会员的其他机构，可在本基金上市后，代理投资者通过深圳证券交易所交易系统参与本基金的上市交易。
（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）其他销售机构
浦发银行、中国银行、建设银行、招商银行、平安银行、上海银行、中投证券、兴业证券、国都证券、华西证券、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）、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2,998,986,947.73元人民币，折合基金份额2,998,986,947.73份；利息结转份额604,609.99份，总确认份额为2,999,591,557.72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9月21日全额划入本基金在基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司开立的鹏华前海万科REITs封闭式混合型发起式证券投资基金托管专户。
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《鹏华前海万科REITs封闭式混合型发起式证券投资基金合同》（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7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7月6日
12、基金合同生效日的基金份额总额：2,999,591,557.72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]432号
2、上市交易日期：2015年9月30日
3、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所。投资者在具有基金销售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、上市交易份额简称及代码：鹏华前海，基金代码：184801。
5、本次上市交易份额：3,033,156.00份。
6、未上市交易份额的流通规定：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即可上市流通。（本基金的基石投资人前海金控以自有资金或其指定机构认购本基金份额3亿份（不包括利息折算的基金份额），自基金合同生效之日起2年内不得转让。同时，基金管理人以自有资金认购本基金1000万份（不包括利息折算的基金份额），自基金合同生效之日起3年内不得转让。）
7、风险揭示
除以下提示到的风险外，本基金管理人提醒投资者及时关注本基金的公告信息，了解目标公司的增资入股情况、运营情况或者其他信息。
按照基金合同的约定，本基金在封闭运作期内投资于确定的、单一的目标公司股权，获取期间的商业物业收益。封闭运作期内集中持有目标公司股权，因此存在有别于股票型基金和债券型基金的特定风险。主要的特定风险包括但不限于如下几点：
第一、封闭运作期内集中投资风险
普通公募基金往往采用分散化投资的方式减少非系统性风险对基金投资的影响，而本基金在封闭运作期内集中持有目标公司股权，获取期间的商业物业收益。因此，相对分散化投资的普通公募基金，本基金将受到所投资目标公司个体较大的影响，具有较高的非系统性风险。
第二、目标公司经营风险
目标公司以项目的商业物业收入为主营业务收入来源，而国家宏观调控、房地产行业周期的影响以及前海合作区周边其他商业物业带来的市场竞争，都会给目标公司经营带来不确定性，这种不确定性可能影响未来的项目收益，造成投资人投资不达预期的风险。
第三、租金无法回收的风险
本基金通过持有目标公司股权获取商业物业收益，以租户的租金为主。基金管理人将采用主动催收、投资顾问协助催收、目标公司服务机构保证金补偿等一系列手段力争取得租金偿付。然而受限于租户的违约风险，租金收益存在不确定性。极端情况下租金可能将无法弥补投资本金，进而可能导致本基金投资亏损。
第四、续租风险
截至2015年3月，前海企业公馆项目租户已签订的租约以三年期、五年期、约七年期为主，因此存在续租时租户退租导致项目收益波动的风险。
第五、商业物业收益的估值风险
本基金通过持有目标公司股权获取商业物业收益。基金管理人采用估值技术对目标公司股权进行估值，估值结果将通过本基金的基金份额净值体现。由于估值技术存在诸多假设且估值需要使用的参数在获取时存在滞后性，本基金公告的基金份额净值可能不能及时、准确地体现目标公司股权当前的公允价值。
第六、目标公司破产风险
极端情况下，若目标公司经营不善出现资不抵债的情况将有可能破产清算，造成目标公司破产的风险。
第七、提前终止风险
自增资完成日起6个月内，目标公司未按照约定变更为股份有限公司，或者发生招募说明书第十部分约定的基金管理人要求深圳市万科房地产有限公司（以下简称“深圳万科”）提前回购基金所持股权的情形时，深圳万科将自行或指定关联方提前回购本基金所持股权，本基金基金合同将提前终止，基金份额持有人将无法实现正常剩期情况下的全部预期收益。
第八、增信不足风险
本基金通过深圳万科提供保证金的方式为本基金的项目投资收益提供增信，但对于实际业绩收入低于目标公司业绩比较基准的差额，深圳万科仅以保证金账户资金余额为限提供补偿，超出部分将无法通过保证金得到补偿。
第九、净值回撤风险
当目标公司当期实际业绩收入高于目标公司当期业绩比较基准时，本基金将以已收到的投资收益就差额部分按一定比例向保证金账户支付深圳万科收益分成，因此可能在实施深圳万科收益分成时本基金净值出现一定幅度的下跌。

第十、政策风险
政策风险包括但不限于前海开发政策风险和房地产政策风险。
前海开发政策是指深圳市政府和前海管理局针对前海开发制定颁布的重要的影响目标公司经营的举措、法规。房地产政策是指政府有关房地产市场的政策发生重大变化或是有重要的举措、法规。这些政策的出台可能引起目标公司未来租金收益的波动，从而给投资带来风险。
第十一、基金折溢价的风险
鹏华万科前海REITs基金份额的交易价格不一定等于基金份额的净值，其交易价格会随二级市场供求关系、流动性及投资情绪出现波动。受此影响二级市场交易价格可能出现较大幅度偏离基金份额净值的情况，从而产生折价或者溢价的情况。
鹏华万科前海REITs基金主要投资于房地产项目及债券资产，具有对利率敏感的特征。由于基金投资的房地产项目及债券资产的剩余期限可能较长，基金份额将承担较高的市场利率风险，当市场利率波动较大时，基金份额的交易价格可能对基金份额净值出现较大幅度的偏离，从而产生折价或者溢价的情况。
除特定风险之外，本基金还可能存在如下风险：
一、信用风险
指基金在交易过程发生交收违约，或交易对手方可能因财务状况或其他原因不能履行付款或结算的义务，从而对基金资产价值造成不利影响，导致基金资产损失。
二、管理风险
在基金管理运作过程中，可能因基金管理人对经济形势和证券市场等判断有误、获取的信息不全等影响基金的收益水平。基金管理人的管理水平、管理手段和管理技术等对基金收益水平存在影响。
三、操作或技术风险
指相关当事人在业务各环节操作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险，例如，越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误、IT系统故障等风险。
在本基金的各种交易行为或者后台运作中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理公司、登记机构、其他销售机构、证券交易所、证券登记结算机构等等。
四、合规性风险
指基金管理或运作过程中，违反国家法律法规的规定，或者基金投资违反法规及基金合同有关规定的风险。
五、政策变更风险
因相关法律法规或监管机构政策修改等基金管理人无法控制的因素的变化，使基金或投资者利益受到影响的风险，例如，监管机构基金估值政策的修改导致基金估值方法的调整而引起基金净值波动的风险；相关法规的修改导致基金投资范围变化，基金管理人为调整投资组合而引起基金净值波动的风险等。

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9月23日，本基金持有人户数为2,819户，平均每户持有的基金份额为10,640.62份。其中场内持有人户数为2,078户，平均每户持有的基金份额为1,459.65份。
本基金场内机构投资者持有的本基金份额为23,011.00份，占基金总份额的比例为0.76%；场内个人投资者持有的本基金份额为3,010,145.00份，占基金总份额的比例为99.24%。
（二）截止到2015年9月23日，基金份额前十名持有人情况：
本次上市交易的鹏华前海前十名持有人情况：

序号	持有人名称	持有鹏华前海份额	占鹏华前海份额比（%）
1	郑洁	50,102.00	1.65%
2	王新生	27,801.00	0.92%
3	廖丽红	20,001.00	0.66%
4	贵州海恒房地产开发有限责任公司	19,001.00	0.63%
5	邓锡雄	15,001.00	0.49%
6	陈辉	11,021.00	0.36%
7	李劲鹏	11,001.00	0.36%
8	邓建英	10,931.00	0.36%
9	金义乐	10,201.00	0.34%
10	沈文侠	10,001.00	0.33%
11	马耀权	10,001.00	0.33%
12	闫晓军	10,001.00	0.33%
13	李妙云	10,001.00	0.33%
14	袁红卫	10,001.00	0.33%
15	殷岳	10,001.00	0.33%
16	吕涛	10,001.00	0.33%
17	甘万军	10,001.00	0.33%
18	朱彩琴	10,001.00	0.33%
合计		265,069.00	8.74%

（三）截止到2015年9月23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0.00份，占该基金总份额的比例为0.00%。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0.00份，该只基金的基金经理持有该只基金份额总量为0.00份。
注：以上信息依据中国证券登记结算有限公司深圳分公司提供的持有人信息编制。

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人
1、名称：鹏华基金管理有限公司
2、法定代表人：何如
3、总经理：邓召明
4、注册资本：1.5亿元人民币
5、注册地址：深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心43层
6、设立批准文号：中国证监会证监基字[1998]31号
7、工商登记注册的法人营业执照文号：4403011013037
8、经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务。
9、存续期间：持续经营
10、股东及其出资比例：公司股东由国信证券有限公司、意大利欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）、深圳市北融信投资发展有限公司组成，三家股东的出资比例分别为50%、49%、1%。
11、内部组织结构及职能：
基金管理部
负责公司公募基金的投资管理工作。
量化及衍生品投资部
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。
投资银行部
负责公司新三板和股权投资基金等相关业务工作。
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8月31日，公司员工总数293人，其中：正式员工259人，外包员工34人。学历构成如下：博士12人占比4.1%，硕士182人占比62.1%，本科90人占比30.7%，大专及以下9人占比3.1%。
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
尤柏年先生，国籍中国，经济学博士，11年证券从业经验。历任澳大利亚BConnect公司Apex投资咨询团队分析师，华宝兴业基金管理有限公司金融工程部高级数量分析师、海外投资管理部高级分析师、基金经理助理，华宝兴业成熟市场基金和华宝兴业标普油气基金基金经理等职；2014年7月加盟鹏华基金管理有限公司，任职于国际业务部，2014年8月起担任鹏华全球高收益债债券型证券投资基金基金经理，2014年9月起兼任鹏华环球发现证券投资基金基金经理，2015年7月起兼任鹏华前海万科REITs封闭式混合型发起式证券投资基金。尤柏年先生具备基金从业资格。
刘方正先生，国籍中国，理学硕士，5年证券从业经验。2010年6月加盟鹏华基金管理有限公司，从事债券研究工作，担任固定收益部高级研究员、基金经理助理，2015年3月起担任鹏华弘利灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015年3月至2015年8月兼任鹏华行业成长证券投资基金（2015年8月已转型为鹏华弘泰灵活配置混合型证券投资基金）基金经理，2015年4月起兼任鹏华弘润灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015年5月起兼任鹏华弘和灵活配置混合型证券投资基金、鹏华弘华灵活配置混合型证券投资基金、鹏华弘益灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015年6月起兼任鹏华弘鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015年8月起兼任鹏华弘泰灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015年8月起兼任鹏华前海万科REITs封闭式混合型发起式证券投资基金。刘方正先生具备基金从业资格。
（二）基金托管人
本基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司，基本信息如下：
名称：上海浦东发展银行股份有限公司
注册地址：上海市中山东一路12号
办公地址：上海市中山东一路12号
法定代表人：吉晓辉
成立时间：1992年10月19日
经营范围：经中国人民银行和中国银行业监督管理委员会批准，公司主营业务主要包括：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；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；同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱业务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外币兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；资信调查、咨询、见证业务；离岸银行业务；证券投资基金托管业务；全国社会保障基金托管业务；经中国人民银行和中国银行业监督管理委员会批准经营的其他业务。
织形式：股份有限公司
注册资本：186.53亿元人民币
存续期间：持续经营
基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基金字[2003]105号
联系人：朱萍
联系电话：021-61618888
上海浦东发展银行自2003年开展资产托管业务，是较早开展银行资产托管服务的股份制商业银行之一。经过二十年来的稳健经营和业务开拓，各项业务发展一直保持较快增长，各项经营指标在股份制商业银行中处于较好水平。
上海浦东发展银行总行于2003年设立基金托管部，2005年更名为资产托管部，2013年再次更名为资产托管与养老金业务部，目前下设证券托管处、客户资产托管处、养老金业务处、内控管理处、运营管理处五个职能处室。
目前，上海浦东发展银行已拥有客户资金托管、资金信托保管、证券投资基金托管、全球资产托管、保险资金托管、基金专户理财托管、证券公司客户资产托管、期货公司客户资产托管、私募证券投资基金托管、私募股权托管、银行理财产品托管、企业年金托管等多项托管产品，形成完备的产品体系，可满足多领域客户、境内外市场的资产托管需求。
（二）主要人员情况
吉晓辉，男，1955年出生，工商管理硕士，高级经济师。曾任中国工商银行上海浦东分行行长、党委副书记；中国工商银行上海市分行副行长、党委副书记；中国工商银行上海市分行行长、党委书记；上海市政府副秘书长、上海市金融工作党委副书记、上海市金融服务办公室主任、上海国际集团有限公司董事长、党委书记，第十届、第十一届全国政协委员。现任上海浦东发展银行股份有限公司董事长、党委书记。中共上海市第十届委员会委员。
刘信义，男，1965年出生，研究生学历，高级经济师，曾任上海浦东发展银行空港支行副行长（主持工作）、上海浦东发展银行上海地区总部副总经理、党委委员；上海市金融服务办挂职任机构处处长、市金融服务办主任助理；上海浦东发展银行副行长、财务总监；上海国盛集团有限公司总裁。现任上海浦东发展银行副董事长、行长、党委副书记。
冀光恒，男，1968年出生，博士，高级经济师。曾任上海银工房地产开发公司董事、副总经理、中国工商银行总行住房信贷部市场开发处副处长、中国工商银行总行副行长专职秘书、中国工商银行北京市分行办公室主任兼党办主任、长安支行行长、党委书记、北京市分行党委委员、副行长，上海浦东发展银行副行长兼北京分行行长、党委书记。现任上海浦东发展银行副行长。
邓从国，男，1962年出生，工商管理硕士，高级会计师。历任河南省财政厅预算处副处长、基本建设处处长，上海浦东发展银行郑州分行副行长、党委委员，参与上海浦东发展银行南昌分行的筹建工作并任分行行长、党委书记。2015年4月1日起任上海浦东发展银行资产托管与养老金业务部总经理。
（三）基金托管业务经营情况
截止2015年6月30日，上海浦东发展银行资产托管与养老金业务部共托管证券投资基金三十五只，分别为安信动态策略灵活配置基金、北信瑞丰宜投宝货币、博时安丰18个月LOF、博时产业债纯债债券、东方红稳健精选混合基金、工银瑞信目标收益一年定期开放基金、工银瑞信生态环境行业股票基金、广发小盘成长、国联安货币基金、国联安鑫富混合基金、国联安鑫享混合基金、国联安中债信用债指数增强型基金、国寿安保尊益信用纯债、国泰金龙行业精选、国泰金龙债券、华富保本债券型证券投资基金、华富国泰民安灵活配置混合、华富恒财分级债券、汇添富和聚宝货币、汇添富货币、汇添富双利增强债券、嘉实机构快线货币基金、嘉实优质企业、鹏华丰泰定期开放、天弘新价值灵活配置混合基金、天治财富增长、鑫元合丰分级债券基金、易方达裕丰回报、银华永泰债券型基金、长安鑫利优选混合基金、长信金利趋势、长信利众分级债券型证券投资基金、中海安鑫保本、中海医药健康产业、中信建投稳信债券。合计托管证券投资基金总净值为858.60亿元。
（四）基金托管人的内部控制制度
1、本行内部控制目标为：确保经营活动中严格遵守国家有关法律法规、监管部门监管规则和本行规章制度，形成守法经营、规范运作的经营思想。确保经营业务的稳健运行，保证基金资产的安全和完整，确保业务活动信息的真实、准确、完整，保护基金份额持有人的合法权益。
2、本行内部控制组织架构为：总行法律合规部是全行内部控制的牵头管理部门，指导业务部门建立并维护资产托管与养老金业务的内部控制体系。总行风险监控部是全行操作风险的牵头管理部门。指导业务部门开展资产托管和养老金业务的操作风险管控工作。总行资产托管与养老金业务部下设内控管理处。内控管理处是全行托管业务条线的内部控制具体管理实施机构，并配备专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，独立行使监督稽核职责。
3、内部控制制度及措施：本行已建立完善的内部控制制度。内控制度贯穿资产托管业务的决策、执行、监督全过程，渗透到各业务流程和各操作环节，覆盖到本行资产托管各级组织结构、岗位及人员。内部控制以防范风险、合规经营为出发点，各项业务流程体现“内控优先”要求。
具体内控措施包括：培育员工树立内控优先、制度先行、全员化风险控制的风险管理理念，营造浓厚的内控文化氛围，使风险意识贯穿到组织架构、业务岗位、人员的各个环节。制定权责清晰的业务授权管理制度，明确岗位职责和各项操作规程，员工职业道德规范、业务数据备份和保密等在内的各项业务管理制度；建立严格完善的资产隔离和资产保管制度，托管资产与托管人资产及不同托管资产之间实行独立运作、分别核算；对各类突发事件或故障，建立完备有效的应急方案，定期组织实备演练，建立重大事项报告制度；在基金运作公区域建立健全安全监控系统，利用录音、录像等技术手段实现风险控制；定期对业务情况进行自查、内部稽核等措施进行监控，通过专项/全面审计等措施实施业务监控，排查风险隐患。
（五）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序
1、监督依据
托管人严格按照有关政策法规、以及基金合同、托管协议等进行监督。监督依据具体包括：
（1）《中华人民共和国证券法》；
（2）《中华人民共和国证券投资基金法》；
（3）《证券投资基金运作管理办法》；
（4）《证券投资基金销售管理办法》
（5）《基金合同》、《基金托管协议》；
（6）法律、法规、政策的其他规定。
2、监督内容
我行根据基金合同及托管协议约定，，对基金合同生效之后所托管基金的投资范围、投资比例、投资限制等进行产格监督，及时提示基金管理人违规风险。
3、监督方法
（1）资产托管部设置核算监督岗位，配备相应的业务人员，在授权范围内独立行使对基金管理人投资交易行为的监督职责，规范基金运作，维护基金投资人的合法权益，不受任何外界力量的干预；
（2）在日常运作中，凡可量化的监督指标，由核算监督岗通过托管业务的自动处理程序进行监督，实现系统的自动跟踪和预警；
（3）对非量化指标，投资指令、管理人提供的各种报表和报告等，采取人工监督的方法。
4、监督结果的处理方式
（1）基金托管人对基金管理人的投资运作监督结果，采取定期和不定期报告形式向基金管理人和中国证监会报告。定期报告包括基金监控周报等。不定期报告包括提示函、临时日报、其他临时报告等；
（2）若基金托管人发现基金管理人违规违法操作，以电话、邮件、书面提示函的方式通知基金管理人，指明违规事项，明确纠正期限。在规定期限内基金托管人再对基金管理人违规事项进行复查，如果基金管理人对违规事项未予纠正，基金托管人将报告中国证监会。如果发现基金管理人投资运作有重大违规行为时，基金托管人应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正；
（3）针对中国证监会、中国人民银行对基金投资运作监督情况的检查，应及时提供有关情况和资料。
（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
执行事务合伙人：李丹
联系电话：021-23238888
传真：021-23238800
联系人：陈熹
经办注册会计师：单峰、陈熹
（五）房地产评估机构
名称：深圳市戴德梁行土地房地产评估有限公司
住所：深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第二座第18层03B、04室
办公地址：深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场2座18楼
法定代表人：程家龙
联系电话：0755-21518000
传真：0755-82070107
联系人：夏磊
经办注册资产评估师：黄建英

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9月23日资产负债表如下：

资　产	2015年9月23日	负债和所有者权益	2015年9月23日
	余额		余额
资 产：		负债：	
银行存款	5,350,659.02	短期借款	
结算备付金	17,998,028.00	交易性金融负债	
存出保证金	46,372.26	衍生金融负债	
交易性金融资产	2,589,745,500.00	卖出回购金融资产款	806,500,000.00
其中：股票投资		应付证券清算款	46,861.71
债券投资	2,589,745,500.00	应付赎回款	
资产支持证券投资		应付管理人报酬	1,233,867.60
基金投资		应付托管费	189,825.77
衍生金融资产		应付投资顾问费	379,651.58
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	9,420,045.58	应付利息	
应收股利		应付利润	
应收申购款		其他负债	66,269,178.02
其他资产	1,266,966,065.57	负债合计	874,619,384.68
		所有者权益：	
		实收基金	2,999,591,557.72
		未分配利润	15,315,728.03
		所有者权益合计	3,014,907,285.75
资产合计	3,889,526,670.43	负债与持有人权益总计：	3,889,526,670.43

八、基金投资组合

截止到2015年9月23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	2,589,745,500.00	66.58
	其中：债券	2,589,745,500.00	66.58
	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	23,348,687.02	0.60
6	其他各项资产	1,276,432,483.41	32.82
7	合计	3,889,526,670.43	100.00

（二）按行业分类的股票投资组合
注：截至2015年9月23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
注：截至2015年9月23日，本基金未持有股票。
（四）按券种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	98,290,000.00	3.26
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	2,491,455,500.00	82.64
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	2,589,745,500.00	85.90

（五）按公允价值占净值比例大小排序的前五名债券明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	122465	15广越01	3,000,000	300,000,000.00	9.95
2	122450	15齐鲁债	2,500,000	250,000,000.00	8.29
3	112271	15中粮01	2,000,000	200,980,000.00	6.67
4	112273	15金街01	2,000,000	200,000,000.00	6.63
5	122428	15信投01	1,800,000	180,000,000.00	5.97

（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9月23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
注：截至2015年9月23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9月23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
本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。
（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）股资组合报告附注
1、截至2015年9月23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	46,372.26
2	应收证券清算款	
3	应收股利	
4	应收利息	9,420,045.58
5	应收申购款	
6	其他应收款	
7	待摊费用	146,065.57
8	其他	1,266,820,000.00
9	合计	1,276,432,483.41

4、截至2015年9月23日，本基金未持有处于转股期的可转换债券。
注：截至2015年9月23日，本基金未持有处于转股期的可转换债券。
5、截至2015年9月23日，本基金前十名股票中存在流通受限情况的说明。
注：截至2015年9月23日，本基金未持有股票。
6、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、基金投资于目标公司股权的情况介绍

（一）概况
本基金投资于深圳市万科前海公馆建设管理有限公司（以下简称“目标公司”）及其组织形式变更后的实体的股权的比例不超过基金资产的50%。
基金管理人与“深圳万科”、目标公司、深圳市前海开发投资控股有限公司（以下简称“前海投控”）签订了《鹏华基金管理有限公司、深圳市万科前海公馆建设管理有限公司、万科企业股份有限公司、深圳市万科房地产有限公司、深圳市前海开发投资控股有限公司之合作框架协议》（以下简称“《合作框架协议》”）及相关交易文件，针对本基金对目标公司的增资入股、股权回购、业绩补偿及激励机制和各方承诺等进行了全面、完善的约定和安排，力争有效保障基金投资人的利益。具体情况详见本基金招募说明书。
本基金将于募集成立6个月之内通过增资入股的方式获得目标公司50%的股权。本基金增资入股后将依据相关协议和目标公司公司章程的约定，通过持有目标公司股权、获得目标公司利润分配以及深圳万科或其指定的关联方回购目标公司股权方式，获取自2015年1月1日起至2023年7月24日期间目标公司就前海企业公馆项目实际或应当取得的除物业管理费收入之外的营业收入，营业收入将通过业绩补偿机制和激励机制进行收益调整。增资完成日后6个月内，基金管理人、目标公司、深圳万科和万科企业将积极促成目标公司改制为股份有限公司。
（二）目标公司收益权的来源与合法性
依据前海投控与深圳市前海深港现代服务业合作区管理局（以下简称“前海管理局”）签署的《深圳市前海深港现代服务业合作区土地租赁合同书》及《深圳市前海深港现代服务业合作区土地租赁补充合同书》，前海管理局将前海合作区荔湾片区第十一开发单元的用地（宗地号：T102-0243、土地面积93192.96平方米）租赁给前海投控使用，用于前海企业公馆项目的开发和建设，租赁期限自2013年7月25日起至2023年7月24日止。
前海投控与万科企业签署的《深圳市前海开发投资控股有限公司与万科企业股份有限公司关于前海企业公馆项目之BOT协议》（以下简称“BOT协议”），约定合作期限为2013年9月8日起至2021年9月7日止。万科企业于2013年10月授权目标公司代表万科企业履行BOT协议，并以目标公司自己的名义签