鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金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:中国建设银行股份有限公司

二零一五年十二月

重要提示

本基金经2015年3月31日中国证券监督管理委员会下发的《关于核准鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金募集的批复》(证监许可〔2015〕505号文)注册,进行募集。根据相关法律法规,本基金基金合同已于2015年5月6日正式生效,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注册,但中国证监会对本基金募集的注册,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。中国证监会不对基金的投资价值和市场前景等作出实质性判断或保证。

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、管理风险、操作风险、流动性风险、信用风险、本基金特有风险(包括作为指数基金的风险、作为上市基金的风险和作为分级基金的风险)及其他风险,等等。

本基金属于股票型基金,其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金,为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。同时本基金为指数基金,通过跟踪标的指数表现,具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。

从本基金所分拆的两类基金份额来看,鹏华证券A份额为稳健收益类份额,具有低风险且预期收益相对较低的特征;鹏华证券B份额为积极收益类份额,具有高风险且预期收益相对较高的特征。

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人基金投资的“买者自负”原则,在投资人作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资人自行承担。投资有风险,投资人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等信息披露文件,自主判断基金的投资价值,自主做出投资决策,自行承担投资风险。

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2015年11月5日,有关财务数据和净值表现截止日为2015年9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、国信证券股份有限公司副总裁,现任国信证券股份有限公司顾问。
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、国信证券股份有限公司人力资源总部副总经理、资金财务总部副总经理;2015年6月至今任国信证券股份有限公司资金财务总部总经理。
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、意大利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、欧利盛资本股份公司(Eurizon Capital S.A.)(卢森堡)首席执行官、欧利盛AI资产管理股份公司(Eurizon AI SGR)首席执行官。现任意大利欧利盛资本资产管理股份公司(Eurizon Capital SGR S.p.A.)市场及业务发展总监、欧利盛资本股份公司(Eurizon Capital S.A.)(卢森堡)董事、VUB资产管理有限公司监事会成员。
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。
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副处长,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。
陈冰女士,监事,本科学历,国籍:中国。曾在国信证券股份有限公司资金财务部会计、上海营业部财务科副科长、资金财务部财务科副经理、资金财务部资金科经理、资金财务部主任会计师兼科经理、资金财务部总经理助理、资金财务总部副总经理等,现任国信证券资金财务总部副总经理兼资金运营部总经理、融资融券部总经理。
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,历任监察稽核部法务主管,现任监察稽核部总经理助理。
郝文高先生,职工监事,大专学历,国籍:中国。历任深圳奥尊电脑有限公司证券基金事业部副经理、招商基金管理有限公司基金事务部总监;2011年7月加盟鹏华基金管理有限公司,现任登记结算部总经理。
刘嵚先生,职工监事,管理学硕士,国籍:中国。历任毕马威(中国)管理顾问公司咨询顾问,南方基金管理有限公司北京分公司副总经理;2014年10月加入鹏华基金管理有限公司,现任北京分公司总经理。
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。
高鹏先生,副总裁,工商管理硕士、法学硕士,国籍:中国。历任中国人民大学校办科员,中国证监会办公厅副处级秘书,全国社保基金理事会证券投资部处长、股权资产部(实业投资部)副主任,并于2014年至2015年期间担任中国证监会第16届主板发审委专职委员,现任鹏华基金管理有限公司副总裁。
高鹏先生,副总裁,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、督察长,现任鹏华基金管理有限公司副总裁。
苏波先生,副总裁,管理学博士,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,鹏华基金管理有限公司总裁助理、机构理财部总经理、职工监事,现任鹏华基金管理有限公司副总裁。
高永杰先生,督察长,法学硕士,国籍:中国。历任中共中央办公厅秘书局干部,中国证监会办公厅新闻处干部、秘书处副处级秘书、发行监管部副处长、人事教育部副处长、处长,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
余斌先生,国籍中国,经济学硕士,8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月起兼任鹏华中证800证券保险指数分级证券投资基金基金经理,2014年11月起兼任鹏华中证国防指数分级证券投资基金基金经理,2015年4月起兼任鹏华中证酒指数分级证券投资基金基金经理,2015年5月起兼任鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金经理,2015年6月起兼任鹏华中证环保产业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。
本基金历任基金经理:无
本基金经理管理其他基金情况:
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月起兼任鹏华中证800证券保险指数分级证券投资基金基金经理;
2014年11月起兼任鹏华中证国防指数分级证券投资基金基金经理;
2015年4月起兼任鹏华中证酒指数分级证券投资基金基金经理;
2015年6月起兼任鹏华中证环保产业指数分级证券投资基金基金经理。
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。
冀洪涛先生,鹏华基金管理有限公司总裁助理、机构投资部总经理,社保基金组合投资经理,专户投资经理。
王咏辉先生,鹏华基金管理有限公司量化及衍生品投资部总经理,鹏华中证500指数(LOF)基金、鹏华地产分级基金、鹏华沪深300指数(LOF)基金、鹏华创业板分级、鹏华互联网分级基金基金经理。
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、鹏华双债保利债券基金、鹏华可转债债券基金基金经理。
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、鹏华消费领先混合基金基金经理。
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
中国建设银行成立于1954年10月,是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行,总部设在北京。中国建设银行于2005年10月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码939),于2007年9月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码601939)。
2015年6月末,本集团资产总额182,192亿元,较上年末增长8.81%;客户贷款和垫款总额101,571亿元,增长7.20%;客户存款总额136,970亿元,增长6.19%。净利润1,322亿元,同比增长0.97%;营业收入3,110亿元,同比增长8.34%,其中,利息净收入同比增长6.31%,手续费及佣金净收入同比增长5.76%。成本收入比23.23%,同比下降0.94个百分点。资本充足率14.70%,处于同业领先地位。
物理与电子渠道协同发展。总行成立了渠道与运营管理部,全面推进渠道整合;营业网点“三综合”建设取得新进展,综合性网点达到1.44万个,综合营销团队达到19,934个,综合柜员占比达到84%,客户可在转型网点享受便捷舒适的“一站式”服务。加快打造电子银行的主渠道建设,有力支持物理渠道的综合化转型,电子银行和自助渠道账务性交易量占比达94.32%,较上年末提高6.29个百分点;个人网上银行客户、企业网上银行客户、手机银行客户分别增长8.19%、10.78%和11.47%;善融商务推出精品移动平台,个人商城手机客户端“建行善融商城”正式上线。
转型重点业务快速发展。2015年6月末,累计承销非金融企业债务融资工具2,374.76亿元,承销金额继续保持同业第一;证券投资基金托管只数和新发基金托管只数均列市场第一,成为首批香港基金内地销售代理人中唯一一家银行代理人;多模式现金池、票据池、银联单位结算卡等战略性产品市场份额不断扩大,现金管理品牌“禹道”的市场影响力持续提升;代理中央财政授权支付业务、代理中央非税收入收缴业务客户数保持同业第一,在同业中首家按照财政部要求实现中央非税收入收缴电子化上线试点。“鑫存管”证券客户保证金第三方存管客户数3,076万户,管理资金总额7,417.41亿元,均为行业第一。
2015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多项重要奖项。在英国《银行家》杂志2015年“世界银行1000强排名”中,以一级资本总额继续位列全球第2;在美国《福布斯》杂志2015年全球上市公司2000强排名中继续位列第2;在美国《财富》杂志2015年世界500强排名第29位,较上年上升9位;荣获美国《环球金融》杂志颁发的“2015年中国最佳银行”奖项;荣获中国银行业协会授予的“年度最具社会责任金融机构奖”和“年度社会责任最佳民生金融奖”两个综合大奖。
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210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。
(二)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。
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。
(三)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2015年9月末,中国建设银行已托管537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”。

三、相关服务机构

(一)基金份额销售机构
1、场外销售机构
(1)直销机构
1)鹏华基金管理有限公司直销中心
办公地址:深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心43层
电话:(0755)82021233
传真:(0755)82021155
联系人:吕奇志
2)鹏华基金管理有限公司北京分公司
办公地址:北京市西城区金融大街甲9号502室
电话:(010)88082426
传真:(010)88082018
联系人:李筠
3)鹏华基金管理有限公司上海分公司
办公地址:上海市浦东花园石桥路33号花旗大厦801B
电话:(021)68876878
传真:(021)68876821
联系人:李化怡
4)鹏华基金管理有限公司武汉分公司
办公地址:武汉市江汉区建设大道568号新世界国贸大厦I座4312室
电话:(027)85557881
传真:(027)85557973
联系人:祁明兵
5)鹏华基金管理有限公司广州分公司
办公地址:广州市珠江新城华夏路10号富力中心24楼07单元
电话:(020)38927993
传真:(020)38927990
联系人:周樱
(2)银行销售机构
1)中国建设银行股份有限公司
住所:北京市西城区金融大街25号
办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码:100033
法定代表人:王洪章
客户服务电话:95533
联系人:王未雨
2)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
3)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:杨亢
客户服务电话:961122
网址: www.drcbank.com
4)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
5)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:金煜
客户服务电话:95594
联系人:汤征程
网址:www.bankofshanghai.com
(3)券商销售机构
1)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6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:权唐
传真:010-65182261
客服电话:4008888108
网址:www.csc108.com
2)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200号华侨国际大厦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
3)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
办公地址: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:张志刚
联系人:唐静
联系电话:010-63080985
客服热线:400-800-8899
网址:www.cindasc.com
4)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
5)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:刘阳
网址:www.cgws.com
6)广州证券股份有限公司
注册地址:广州市天河区珠江新城珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层
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主塔19层、20层
法定代表人:邱三发
联系人 :林洁茹
联系电话:020-88836999
传真号码:020-88836654
客服热线:021-961303
网址:www.gzs.com.cn
7)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
网址:www.ebscn.com
8)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
网址:www.pingan.com
9)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:杨泽柱
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
10)申万宏源证券有限公司
注册地址:上海市徐汇区长乐路989号45层
办公地址:上海市徐汇区长乐路989号45层
法定代表人:李梅
联系电话:021-33389888
联系人:曹晔
客户服务电话:95523或4008895523
电话委托:021-962505
网址:www.swhysc.com
11)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
12)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
13)华鑫证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01(b)单元
办公地址:上海市肇嘉浜路750号
法定代表人:俞洋
联系人:陈敏
电话:021-64339000
传真:021-54668802
客户服务电话: 021-32109999;029-68918888;4001099918
网址:www.cfsc.com.cn
14)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:刘婧漪
电话:028-86690057
传真:028-86690126
服务热线:4006-600109
公司网站:www.gjzq.com.cn
15)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
16)中信证券(山东)有限责任公司
注册地址:青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层(1507-1510室)
办公地址:青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层
法定代表人:杨宝林
联系人:吴忠超
联系电话:0532-85022326
传真:0532-85022605
客户服务电话:0532-96577
网址:www.zxwt.com.cn
17)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
办公地址: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:0755-82130833
传真:0755-82133952
联系人:周杨
客户服务电话:95536
网址:www.guosen.com.cn
18)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:李欣
客户服务电话:400-888-1551
网址:www.xcsc.com
19)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楼
办公地址:西安市东新街232号陕西信托大厦6楼
法定代表人:刘建武
联系人:刘莹
电话:029-87406649
传真:029-87406710
客户服务电话:95582
网址:www.westsecu.com
20)天风证券股份有限公司
注册地址:湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦4楼
办公地址:湖北省武汉市武昌区中南路99号保利广场A座37楼
法定代表人:余磊
联系人:崔成
电话:027-87610052
传真:027-87618863
客户服务电话:4008005000
网址:http://www.tfzq.com
21)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
22)中泰证券股份有限公司
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:陈曦
客户服务电话:95538
网址:www.zts.com.cn
23)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:王春峰
联系人:王兆权
电话:022-28451861
传真:022-28451892
网址:www.bhzq.com
24)中国国际金融股份有限公司
注册地址:北京市建国门外大街1号国贸写字楼2座27层及28层
办公地址:北京市建国门外大街1号国贸写字楼2座27层及28层
法定代表人:丁学东
电话:010-65051166
传真:010-85679203
联系人:杨涵宇
客户服务电话:400-910-1166
网址:www.cicc.com.cn
(4)期货公司销售机构
1)中信建投期货有限公司
注册地址:重庆市渝中区中山三路107号上站大楼平街11-B,名义层11-A,8-B4,9-B、C
办公地址:重庆市渝中区中山三路107号皇冠大厦11楼
法定代表人:彭文德
客户服务电话:400-8877-780
联系电话:023-86769742
联系人:谭忻
网址: www.cfc108.com
2)中信期货有限公司
注册地址:深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座13层1301-1305室、14层
办公地址:深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座13层1301-1305室、14层
法定代表人:张皓
客服电话:400-990-8826
联系人: 洪诚
联系电话:0755-23953913
公司网站:www.citicsf.com
(5)第三方销售机构
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:深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼
法定代表人:薛峰
客服电话:4006-788-887
传真:0755-82080798
联系人:邓爱萍
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)珠海盈米财富管理有限公司
住所: 珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
办公地址:广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼B1201-1203
法定代表人: 肖雯
联系人:黄敏嫦
联系电话:020-89629099
客服电话:020-89629066
网址:www.yingmi.cn
基金管理人可根据有关法律法规要求,根据实情,选择其他符合要求的机构销售本基金或变更上述销售机构,并及时公告。
2、场内发售机构
(1)本基金的场内发售机构为具有基金销售业务资格的深圳证券交易所会员单位(具体名单可在深圳证券交易所网站查询)。
(2)本基金募集结束前获得基金销售资格的深圳证券交易所会员单位可新增为本基金的场内发售机构。
(二)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)出具法律意见书的律师事务所
名称:上海通力律师事务所
住所:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
负责人:俞卫锋
办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
联系电话:021-31358666
传真:021-31358600
联系人:孙睿
经办律师:黎明、孙睿
(四)审计基金资产的会计师事务所
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
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

四、基金的名称

本基金名称:鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金
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(简称“鹏华证券分级”,基金代码:160633;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(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(简称“券商B级”,基金代码:150236)。

五、基金的运作方式与类型

契约型开放式,股票型证券投资基金

六、基金的投资目标

紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化,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。

七、基金的投资范围

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。

八、基金的投资策略

本基金采用被动式指数化投资方法,按照成份股在标的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或成份股发生配股、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。
本基金力争鹏华证券份额净值增长率与同期业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。
1、股票投资策略
(1)股票投资组合的构建
本基金在建仓期内,将按照标的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,对基金财产进行适当调整,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标的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,对其进行适时调整,以保证鹏华证券份额净值增长率与标的指数收益率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,当标的指数成份股因增发、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。
2、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。
3、衍生品投资策略
本基金可投资股指期货、权证和其他经中国证监会允许的金融衍生产品。
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。
基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组,授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项,同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。
本基金通过对权证标的证券基本面的研究,并结合权证定价模型及价值挖掘策略、价差策略、双向权证策略等寻求权证的合理估值水平,追求稳定的当期收益。

九、基金的业绩比较基准

中证全指证券公司指数收益率×95%+商业银行活期存款利率(税后)×5%
中证全指证券公司指数由中证全指指数成份中归属于证券公司四级行业的全部股票组成,反映了沪深A股市场中证券公司行业股票的整体表现,并为指数化产品提供新的标的指数。
如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时,本基金管理人可以在取得基金托管人同意后变更业绩比较基准,不需要召集基金份额持有人大会,但需报中国证监会备案并及时公告。

十、基金的风险收益特征

本基金属于股票型基金,其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金,为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。同时本基金为指数基金,通过跟踪标的指数表现,具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。
从本基金所分拆的两类基金份额来看,鹏华证券A份额为稳健收益类份额,具有低风险且预期收益相对较低的特征;鹏华证券B份额为积极收益类份额,具有高风险且预期收益相对较高的特征。

十一、基金的投资组合报告

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。
基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10月22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。
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。
基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。
本报告中财务资料未经审计。
本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。
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	54,800,511.12	9.75
	其中:股票	54,800,511.12	9.75
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	505,770,102.23	90.01
7	其他资产	1,319,436.15	0.23
8	合计	561,890,049.50	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
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	54,800,511.12	9.86
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	54,800,511.12	9.86

(2)报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合
注:本基金本报告期末未持有积极投资的股票。
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	000712	锦龙股份	671,200	10,698,928.00	1.93
2	600837	海通证券	548,574	6,994,318.50	1.26
3	600030	中信证券	465,582	6,322,603.56	1.14
4	601688	华泰证券	222,100	3,091,632.00	0.56
5	000776	广发证券	200,600	2,627,860.00	0.47
6	000166	申万宏源	302,162	2,592,549.96	0.47
7	600999	招商证券	157,473	2,524,292.19	0.45
8	601377	兴业证券	282,000	2,208,060.00	0.40
9	000783	长江证券	225,102	2,086,695.54	0.38
10	601901	方正证券	279,000	1,771,650.00	0.32

(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
注:本基金本报告期末未持有积极投资的股票。
4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合
注: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序的前五名债券投资明细
注: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序的前十名资产支持证券投资明细
注: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
注: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序的前五名权证投资明细
注: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
注: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。
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
注: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
注: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
注: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)
1)广发证券
本组合投资的前十名证券之一广发证券股份有限公司(以下简称“广发证券”)在中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)2014年四季度两融检查时,存在向不符合条件的客户融资融券、违规为到期融资融券合约展期问题,且涉及客户数量较多,受到采取责令限期改正的行政监管措施。2015年8月24日,广发证券收到中国证监会《调查通知书》(鄂证调查字2015023号)。因涉嫌未按规定审查、了解客户身份等违法违规行为,根据《中华人民共和国证券法》的有关规定,中国证监会决定对广发证券立案调查。2015年9月10日,广发证券收到中国证监会《行政处罚事先告知书》(处罚字[2015]71号)。根据《告知书》,广发证券未按照《证券登记结算管理办法》第二十四条,《关于加强证券期货经营机构客户交易终端信息等客户信息管理的规定》第六条、第八条、第十三条,《中国证监会关于加强证券经纪业务管理的规定》第三条第(四)项,《中国证券登记结算有限责任公司证券账户管理规则》第五十条的规定对客户的身份信息进行审查和了解,违反了《证券公司监督管理条例》第二十八条第一款的规定,构成《证券公司监督管理条例》第八十四条第(四)项所述的行为。中国证监会对广发证券责令整改,给予警告,没收违法所得6,805,135.75 元,并处以20,415,407.25元罚款。
对该股票的投资决策程序的说明:本基金管理人长期跟踪研究广发证券,认为本次行政处罚对该证券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和控制跟踪误差,按照成份股权重进行配置该证券,符合指数基金的管理规定。该证券的投资已严格执行内部投资决策流程,符合法律法规和公司制度的规定。
2)海通证券
本组合投资的前十名证券之一海通证券股份有限公司(以下简称“海通证券”)于2015年9月10日收到中国证券监督管理委员会(以下简称“证监会”)《行政处罚事先告知书》(处罚字【2015】73号)(以下简称《告知书》)。根据《告知书》,海通证券未按照《证券登记结算管理办法》第二十四条,《关于加强证券期货经营机构客户交易终端信息等客户信息管理的规定》第六条、第八条、第十三条,《中国证监会关于加强证券经纪业务管理的规定》第三条第(四)项,《中国证券登记结算有限责任公司证券账户管理规则》第五十条的规定对客户的身份信息进行审查和了解,违反了《证券公司监督管理条例》第二十八条第一款的规定,构成《证券公司监督管理条例》第八十四条第(四)项所述的行为。中国证监会对海通证券责令改正,给予警告,没收违法所得28,653,000元,并处以85,959,000元罚款。
对该股票的投资决策程序的说明:本基金管理人长期跟踪研究海通证券,认为本次行政处罚对该证券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和控制跟踪误差,按照成份股权重进行配置该证券,符合指数基金的管理规定。该证券的投资已严格执行内部投资决策流程,符合法律法规和公司制度的规定。
3)华泰证券
本组合投资的前十名证券之一华泰证券股份有限公司(以下简称“华泰证券”)于2015年9月10日收到中国证券监督管理委员会(以下简称“证监会”)《行政处罚事先告知书》(处罚字【2015】72号)(以下简称《告知书》)。根据《告知书》,华泰证券未按照《关于加强证券期货经营机构客户交易终端信息等客户信息管理的规定》第六条、第八条、第十三条,《中国证券登记结算有限责任公司证券账户管理规则》第五十条的规定对客户的身份信息进行审查和了解,违反了《证券公司监督管理条例》第二十八条第一款的规定,构成《证券公司监督管理条例》第八十四条第(四)项所述的行为。中国证监会对华泰证券责令改正,给予警告,没收违法所得18,235,275.00元,并处以54,705,825.00元罚款。
对该股票的投资决策程序的说明:本基金管理人长期跟踪研究华泰证券,认为本次行政处罚对该证券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和控制跟踪误差,按照成份股权重进行配置该证券,符合指数基金的管理规定。该证券的投资已严格执行内部投资决策流程,符合法律法规和公司制度的规定。
4)长江证券
本基金投资的前十名证券之一的长江证券股份有限公司(以下简称“长江证券”)于2015年5月6日受到中国证监会对长江证券相关研究报告的制作、审批和发布等情况的合规性核查。从检查情况看,媒体转载内容来源于5月4日长江证券发布的题为《上证成交可上1.4万亿,创业板已达巅峰——从交易成本看当前市场系列之二》的研究报告。检查中发现,长江证券未与转载机构签订协议,未明确转载责任,致使转载机构篡改了研究报告标题;研报报送审核人员不符合公司内部规定,未能严格执行其内部管理制度。上述行为反映出公司内部控制制度未能有效执行, 并违反了中国证监会《发布证券研究报告暂行规定》(证监会公告[2010]28号)第二十一条、“证券公司、证券投资咨询机构授权其他机构刊载或者转发证券研究报告或者摘要,应当与相关机构作出协议约定,明确刊载或者转发责任”之规定。根据《发布证券研究报告暂行规定》(证监会公告[2010]28号)第二十二条的规定,中国证监会对长江证券采取了出具警示函的行政监管措施。根据长江证券公告,长江证券已按照相关规定和中国证监会的要求,采取了措施,严格执行内部控制制度,加强研报刊载或者转发管理,确保业务开展依法合规。
对该股票的投资决策程序的说明:本基金管理人长期跟踪研究长江证券,认为本次行政监管措施对该证券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和控制跟踪误差,按照成份股权重进行配置该证券,符合指数基金的管理规定。该证券的投资已严格执行内部投资决策流程,符合法律法规和公司制度的规定。
5)方正证券
本基金投资的前十名证券之一的方正证券股份有限公司(以下简称“方正证券”)于2015年1月30日收到中国证监会湖南监管局《关于对方正证券股份有限公司采取责令改正等监管措施的决定》([2015]3号,以下简称《决定》),称方正证券2013年年度股东大会按照特别决议的表决方式,审议通过了《方正证券股份有限公司与中国民族证券有限责任公司股东发行股份购买资产协议》,该协议约定:“本次重大资产重组交易完成后,方正证券将根据其内部治理规则及决策机制适时召开股东大会重新选举董事会”;同时审议通过了《方正证券股份有限公司发行股份购买资产报告书》,该报告书披露:“本次交易完成后,方正证券将根据其内部治理规则及决策机制适时召开股东大会进行必要的董事会、监事会改选工作”。《决定》指出方正证券有关各方未就执行上述股东大会决议达成共识,并且出现了治理结构不健全、内部控制不完善的情况。《决定》还指出,方正证券监事会发布《关于召开2015年第二次临时股东大会的通知》,但该次股东大会前提条件已不存在且没有审议事项,方正证券未及时发布取消公告,违反了《公司法》第一百零二条的规定。《决定》责令方正证券取消2015年第二次临时股东大会;责令方正证券在2015年2月16日前改选第二届董事会全部董事和第二届监事会全部非职工代表监事,改选董事、监事的股东大会由有权召集股东大会的主体依法依规召集;责令方正证券董事、监事和董事会秘书勤勉尽责,切实负责或配合做好召开股东大会的各项工作。方正证券于7月14日收到中国证券监督管理委员会(以下简称“证监会”)《调查通知书》(湘证调查字0335号)。因公司涉嫌未披露控股股东与其他股东间关联关系等信息披露违法违规,证监会根据《中华人民共和国证券法》的有关规定,决定对公司立案调查。方正证券全资子公司中国民族证券有限责任公司(以下简称“民族证券”)及其相关高级管理人员于2015年7月24日分别收到中国证券监督管理委员会北京监管局(以下简称“北京证监局”)下发的《关于对中国民族证券有限责任公司采取限制业务活动、暂停核准业务申请以及遣责措施的决定》(【2015】48号)、《关于对中国民族证券有限公司董事长赵大建采取遣责措施的决定》(【2015】46号)、《关于对中国民族证券有限责任公司财务总监杨英采取遣责措施的决定》(【2015】47号)、《关于对中国民族证券有限责任公司合规总监蔡晓昕采取遣责措施的决定》(【2015】45号)和《关于对中国民族证券有限责任公司副总经理何东采取遣责措施的决定》(【2015】44号)。主要内容包括:一、按照《证券公司监督管理条例》第70条、《证券公司风险控制指标管理办法》第35条的规定,北京证监局对民族证券采取以下行政监管措施:1、暂停民族证券证券自营业务(固定收益证券自营除外);2、暂停核准民族证券新业务的申请;3、对民族证券予以遣责。二、按照《证券公司监督管理条例》第70条的规定,北京证监局对民族证券董事长赵大建、财务总监杨英、合规总监蔡晓昕、副总经理何东均采取以下行政监管措施:通过北京证监局官方网站,对其予以遣责。方正证券于2015年9月10日收到中国证券监督管理委员会(以下简称“证监会”)《行政处罚事先告知书》(处罚字【2015】74号)(以下简称《告知书》),根据《告知书》,公司未按照《证券登记结算管理办法》第二十四条,《关于加强证券期货经营机构客户交易终端信息等客户信息管理的规定》第六条、第八条、第十三条,《中国证监会关于加强证券经纪业务管理的规定》第三条第(四)项,《中国证券登记结算有限公司证券账户管理规则》第五十条的规定对客户的身份信息进行审查和了解,违反了《证券公司监督管理条例》第二十八条第一款的规定,构成《证券公司监督管理条例》第八十四条第(四)项所述的行为。中国证监会对方正证券责令改正,给予警告,没收违法所得8,717,089.13元,并处以17,434,178.26元罚款。
对该股票的投资决策程序的说明:本基金管理人长期跟踪研究方正证券,认为本次行政监管措施对该证券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和控制跟踪误差,按照成份股权重进行配置该证券,符合指数基金的管理规定。该证券的投资已严格执行内部投资决策流程,符合法律法规和公司制度的规定。
6)兴业证券
本基金投资的前十名证券之一的兴业证券股份有限公司(以下简称“兴业证券”)于2015年5月9日发布《兴业证券股份有限公司关于最近五年被证券监管部门和交易所采取监管措施或处罚的情况以及相应整改措施的公告》(以下简称《公告》)。《公告》称,经自查,兴业证券母公司在最近五年内不存在被证券监管部门和交易所采取监管措施或处罚的情形。公司的控股子公司兴业全球基金管理有限公司(以下简称“兴全基金”)和兴证期货有限公司(以下简称“兴证期货”)在最近五年存在被相关监管部门或行业自律性组织采取监管措施的情形。(1)兴全基金于2013年5月24日收到了中国证监会上海监管局下发的[2013]13号行政监管措施决定书《关于对兴业全球基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》。兴全基金在聘任兴全商业模式优选股票型证券投资基金的基金经理过程中违反了《证券投资基金运作管理办法》第八条的规定,被监管机构责令于2013年5月30日前予以改正。经整改,兴全基金对事件发生过程中的责任原因进行认真总结、深刻反省,并对相关责任人进行责任追究,进一步加强内控制度管理,强化业务人员合规培训机制。(2)兴全基金及其全资子公司上海兴全睿众资产管理有限公司(以下简称“兴全睿众”)于2015年2月15日收到中国证券投资基金业协会下发的[2015]3号纪律处分决定书。纪律处分决定书认为兴全睿众旗下资产管理计划在参与大宗交易时存在异常情形,而未引起兴全基金足够警觉,也未向监管部门报告。经整改,兴全基金及兴全睿众对现有的特定客户资产管理计划业务进行了全面自查,对特定客户资产管理业务的制度建设、日常执行方面明确整改责任人和整改期限。(3)兴证期货于2014年6月18日收到中国证监会大连监管局下发的[2014]1号行政监管措施决定书《关于对兴证期货有限公司采购责令整改措施的决定》,对营业部员工违反《期货从业人员管理办法》违规操作客户账户进行期货交易提出了整改说明和要求。经整改,兴证期货对该问题高度重视,组织人员进行合规培训,梳理和完善公司内控制度,切实防范风险,采取有效措施加强从业人员执业行为管理,有效执行居间关系审核流程,并对违反规定人员采取零容忍。
对该股票的投资决策程序的说明:本基金管理人长期跟踪研究该股票,认为兴业证券是国内运作良好的证券公司,经营稳健,发展势头良好。兴业证券的自查报告显示,兴业证券母公司不存在受监管处罚情形,对兴业证券的财务状况及经营成果并不产生实质性影响。本基金为指数基金,为更好地跟踪标的指数和控制跟踪误差,对该证券的投资按照指数成份股权重进行配置,符合指数基金的管理规定。该证券的投资已严格执行内部投资决策流程,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	987,701.75
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	99,437.53
5	应收申购款	205,464.03
6	其他应收款	-
7	待摊费用	26,832.84
8	其他	-
9	合计	1,319,436.15

(4)报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注: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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000712	锦龙股份	10,698,928.00	1.93	重大事项

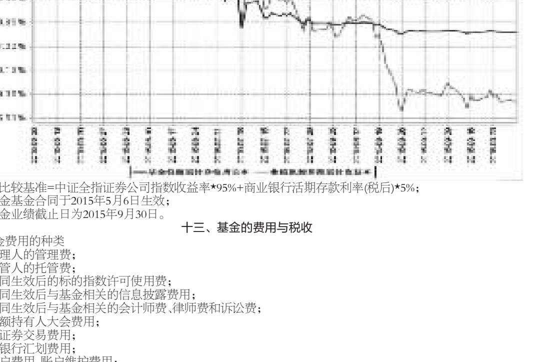
(6)报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明
注:本基金本报告期末未持有积极投资的股票。
(7)投资组合报告附注的其他文字描述部分
由于四舍五入的原因,投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

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(本报告中所列财务数据未经审计):

	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
2015年5月6日(基金合同生效日)至2015年9月30日	-33.40%	2.70%	-50.99%	4.09%	17.59%	-1.39%

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:业绩比较基准=中证全指证券公司指数收益率*95%+商业银行活期存款利率(税后)*5%;
注2:本基金基金合同于2015年5月6日生效;
注3:本基金业绩截止日为2015年9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)与基金销售有关的费用
1、基金份额的场外申购与赎回
(1)申购费用
本基金的场外申购费率随投资者申购金额的增加而减少。投资者可以多次申购本基金,申购费率按每笔申购申请单独计算。
本基金场外申购费率如下表:

申购金额M(元)	申购费率
M＜100万	1.20%
100万≤M＜500万	0.60%
M≥500万	每笔100元

申购费用由投资者承担,在申购基金份额时收取,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。
(2)赎回费用
本基金的场外赎回费率最高不超过赎回金额的0.50%,且随投资者持有基金份额期限的增加而减少。
本基金场外赎回费率如下表(1年为365日):

持有年限Y	赎回费率
Y＜1年	0.50%
1年≤Y＜2年	0.25%
Y≥2年	0.00%

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担,在基金份额持有人赎回基金份额时收取。其中赎回费总额的25%应归基金财产,其余用于支付市场推广、注册登记费和其他必要的手续费。
(3)基金管理人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依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。
(4)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和基金赎回费率。
2、基金份额的场内申购与赎回
(1)申购费用
本基金的场内申购费率自2015年9月21日起进行调整,调整后费率如下表。投资者可以多次申购本基金,申购费率按每笔申购申请单独计算。
基金场内申购费率:

申购金额M(元)	申购费率
M＜500万	0
M≥500 万	按笔收取,每笔100 元

申购费用由投资者承担,在申购基金份额时收取,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。
(2)赎回费用
本基金的场内赎回费率为固定费率0.50%,不按持有期限设置分段赎回费率。
赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担,在基金份额持有人赎回基金份额时收取。其中赎回费总额的25%应归基金财产,其余用于支付市场推广、注册登记费和其他必要的手续费。
(3)基金管理人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依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。
(4)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和基金赎回费率。
(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;
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)基金税收
本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。
基金财产投资的相关税收,由基金份额持有人承担,基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

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》、《公开募集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、有关财务数据的截止日期和基金合同生效日期。
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”内容进行了更新。
5、对“八、基金的募集与基金合同的生效”内容进行了更新。
6、对“九、基金份额的上市与交易” 部分内容进行了更新。
7、对“十、基金份额的申购与赎回”部分内容进行了更新。
8、对“十二、基金份额的配对转换”部分内容进行了更新。
9、更新了“十三、基金的投资”投资组合报告内容,披露截止至2015年9月30日的数据。
10、新增了“十四、基金的业绩”的内容。
11、对“二十六、对基金份额持有人的服务”部分内容进行了更新。
12、对“二十七、其他应披露事项”部分内容进行了更新。

鹏华基金管理有限公司
2015年12月