鹏华沪深300交易型开放式指数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: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:2013年8月16日
公告日期:2013年8月13日

一、重要声明与提示

鹏华沪深300交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)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号之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、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,请投资者详细查阅2013年6月13日刊登在《证券时报》和本公司指定销售机构网站上的《鹏华沪深300交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》。

二、基金概览

1、基金简称及代码:基金代码:159927,场内简称:A300ETF
2、基金类别:股票型证券投资基金
3、基金运作方式:交易型开放式
4、基金存续期限:不定期
5、基金份额总额:截至2013年8月9日,本基金的基金份额总额为578,192,168.00份。
6、本次上市交易的基金份额简称及代码:场内简称:A300ETF,基金代码:159927
7、本次上市交易的基金份额总额:578,192,168.00份
8、基金份额净值:截至2013年8月9日,本基金的基金份额净值为2.2861元。
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:2013年8月16日
11、基金管理人:鹏华基金管理有限公司
12、基金托管人:中国建设银行股份有限公司
13、本次上市交易的基金份额注册登记机构:中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司
14、申赎代理券商:国信证券、中投证券、银河证券、光大证券、中信建投证券、华西证券、招商证券、中信证券、申银万国证券、长江证券、中信证券(浙江)、中信万通证券。

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[2013]640号
2、基金运作方式:交易型开放式
3、基金合同期限:不定期
4、发售日期:本基金自2013年6月17日起至2013年7月12日止,通过销售机构公开发售。网上现金认购的日期为2013年6月17日起至2013年7月12日;网下股票认购的日期为2013年7月8日起至2013年7月12日。
5、发售价格:1.00元人民币
6、发售方式:网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购。
7、发售机构:
(1)网下现金发售直销机构:
鹏华基金管理有限公司
(2)网上现金发售代理机构:
具有基金销售业务资格及深圳证券交易所会员资格的证券公司
(3)网下股票认购代理机构:
安信证券、长城证券、长江证券、东北证券、方正证券、光大证券、广发证券、广州证券、国海证券、国泰君安证券、国信证券、海通证券、宏源证券、华泰证券、华西证券、平安证券、齐鲁证券、上海证券、申银万国证券、湘财证券、信达证券、兴业证券、银河证券、招商证券、中投证券、中信建投证券、中信万通证券、中信证券(浙江)、中信证券
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:
本次募集的有效认购户数为13821户,有效净认购金额为1,306,495,157元人民币,折合基金份额1,306,495,157份;利息结转份额87,694份,总确认份额为1,306,582,851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沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金托管专户。
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》、《证券投资基金运作管理办法》等相关法律、法规的规定以及《鹏华沪深300交易型开放式指数证券投资基金合同》(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2013年7月19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:2013年7月19日
12、基金合同生效日的基金份额总额:1,306,582,851.00份
(二)本基金份额折算
根据《鹏华沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《鹏华沪深300交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定,鹏华基金管理有限公司(以下简称“本基金管理人”)确定2013年8月8日为鹏华沪深300交易型开放式指数证券投资基金的基金份额折算日。当日鹏华沪深300指数收盘值为2276.782点,基金资产净值为1,316,433,799.64元,折算前基金份额总额为1,306,582,851.00份,折算前基金份额净值为1.0075元。
根据《鹏华沪深300交易型开放式指数证券投资基金份额折算的公告》中约定的基金份额折算公式,基金份额比例为0.44252786(以四舍五入的方法保留到小数点后8位),折算后基金份额总额为578,192,168.00份,折算后基金份额净值为2.2768元。
本基金管理人已根据上述折算比例,对各基金份额持有人认购的基金份额进行了折算,并由中国证券登记结算有限公司深圳分公司于2013年8月9日进行了变更登记。折算后的基金份额保留到整数位。
(三)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[2013]266号
2、上市交易日期:2013年8月16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、上市交易基金简称:A300ETF
5、上市交易基金代码:159927
6、上市交易基金份额:578,192,168.00份
7、未上市交易份额的流通规定:本基金上市交易后,所有的基金份额均可进行交易,不存在未上市交易的基金份额。

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2013年8月9日,A300ETF基金份额持有情况:
总份额:578,192,168.00份;
机构投资者持有的基金份额及占基金总份额比例:机构持有111,954,161份,占19.3628%;
个人投资者持有的基金份额及占场内基金总份额比例:个人持有466,238,007份,占80.6372%。
(二)截止到2013年8月9日,基金份额前十名持有人情况:
本次上市交易前十名持有人情况:

序号	持有人名称(全称)	证券帐户号	持有基金份额(份)	占场内基金份额的比例(%)
1	全国社保基金四零二组合	0899046596	18,481,841	3.2
2	全国社保基金四零七组合	0899046601	18,481,347	3.2
3	中信建投证券股份有限公司	0899043601	12,883,147	2.23
4	北京市金石庄源投资管理公司	0800056729	11,063,519	1.91
5	中银保险有限公司-传统保险产品	0899055302	8,855,646	1.53
6	王淑珍	0153381659	4,426,569	0.77
7	李坤壹	0052110364	4,426,569	0.77
8	李国斌	0000261325	4,425,536	0.77
9	都邦财产保险股份有限公司-传统保险产品	0899045437	4,381,323	0.76
10	中信证券股份有限公司	0899046209	4,176,282	0.72
合计			91,601,779	15.86

(三)截止到2013年8月9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0,占该基金总份额的比例为0%。
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。
量化投资部
负责公司量化投资管理工作。
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。
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。
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、券商渠道销售管理及服务工作。
渠道业务部
负责公司第三方机构基金销售及公司电子商务平台的管理、业务推广等工作。
营销策划部
负责公司品牌宣传、产品营销策划。
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、人事劳资管理、日常行政事务管理。
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。
固定收益部
负责公司固定收益证券的研究、投资工作。
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。
12、人员情况
截至2013年6月30日,公司员工总数261人,其中:正式员工228人,外包员工33人。学历构成如下:博士12人占比4.6%,硕士152人占比58.2%,本科86人占比33.0%,大专及以下11人占比4.2%。
13、信息披露负责人及咨询电话
张戈 0755-82825720
14、基金管理业务情况
截至2013年6月30日,鹏华基金管理有限公司共管理36只开放式基金和2只封闭式基金及七只社保投资组合。旗下管理的开放式基金有鹏华货币市场证券投资基金、鹏华普天系列开放式证券投资基金(普天债券A、普天债券B、普天收益)、鹏华行业成长开放式证券投资基金、鹏华中国50开放式证券投资基金、鹏华价值优势股票型证券投资基金(LOF)、鹏华动力增长混合型证券投资基金(LOF)、鹏华优质治理股票型证券投资基金(LOF)、鹏华丰收债券型证券投资基金、鹏华盛世创新股票型证券投资基金(LOF)、鹏华沪深300指数证券投资基金(LOF)、鹏华精选成长股票型证券投资基金、鹏华中证500指数证券投资基金(LOF)、鹏华信用增利债券型证券投资基金、鹏华新兴产业股票型证券投资基金、鹏华深证民营交易型开放式指数证券投资基金及联接基金、鹏华环球发现证券投资基金、鹏华丰润债券型证券投资基金、鹏华消费优选股票型证券投资基金、鹏华丰盛稳固收益债券型证券投资基金、鹏华新兴产业股票型证券投资基金、鹏华深证民营交易型开放式指数证券投资基金及联接基金、鹏华美国房地产证券投资基金、鹏华丰泽分级债券型证券投资基金、鹏华价值精选股票型证券投资基金、鹏华金融地产混合型证券投资基金、鹏华纯债债券型证券投资基金、鹏华中证A股资源产业指数分级证券投资基金、鹏华中小企业纯债债券型发起式证券投资基金、鹏华产业债债券型证券投资基金、鹏华国有企业债债券型证券投资基金、鹏华双债增利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、鹏华实业债纯债债券型证券投资基金、鹏华双债加利债券型证券投资基金。封闭式基金有基金普惠、普丰;以及全国社会保障基金七个委托投资组合。
15、本基金基金经理
崔俊杰先生,国籍中国,金融工程专业管理学硕士,5年证券基金从业经验。2008年7月加盟鹏华基金管理有限公司,历任产品规划部产品设计师、量化投资部量化研究员,先后从事产品设计、量化研究工作,2013年3月起至今担任鹏华深证民营ETF基金及其联接基金基金经理,2013年3月起至今兼任鹏华上证民企50 ETF基金及其联接基金基金经理。
(二)基金托管人
1、基金托管人情况
名称:中国建设银行股份有限公司(简称:中国建设银行)
设立日期:2004年09月17日
注册地址: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
注册资本:贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元
法定代表人:王洪章
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]12号
电话:010-67595096
联系人:田青
2、主要人员情况
杨新丰,投资托管业务部总经理,曾就职于中国建设银行江苏省分行、广东省分行、中国建设银行总行会计部、营运管理部,长期从事计划财务、会计结算、营运管理等工作,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。
郑绍平,投资托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部,长期从事客户服务、信贷业务管理等工作,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2012年12月31日,中国建设银行已托管285只证券投资基金。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。中国建设银行在2005年及自2009年起连续四年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”,在2007年及2008年连续被《财资》杂志评为“国内最佳托管银行”奖,并获和讯网2011年度和2012年度中国“最佳资产托管银行”奖,和境内权威经济媒体《每日经济观察》2012年度“最佳基金托管银行”奖。
(三)注册登记人
名称:中国证券登记结算有限责任公司
住所:北京西城区太平桥大街17号
法定代表人:金颖
办公地址:北京西城区太平桥大街17号
联系电话:(010)59378919
传真:(010)59378907
联系人:刘少君
(四)验资机构
名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
办公地址:上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
法定代表人:杨绍信
联系电话:(021)23238888
经办注册会计师:单峰、刘颖
联系人:魏佳亮

基金合同的内容摘要见附件。

六、基金合同摘要

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2013年8月9日资产负债表如下:

资产	2013年8月9日	负债和所有者权益	2013年8月9日
	余额		余额
资产:		负债:	
银行存款	7,542,780.93	短期借款	
结算备付金	12,354,799.36	交易性金融负债	
存出保证金	165,905.73	衍生金融负债	
交易性金融资产	1,302,180,536.63	卖出回购金融资产款	
其中:股票投资	1,302,180,536.63	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	161,061.85
基金投资		应付托管费	32,212.36
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	1,074,994.51
应收证券清算款		应付税费	
应收利息	215,596.88	应付利息	
应收股利	696,098.29	应付利润	
应收申购款		其他负债	54,154.47
其他资产		负债合计	1,322,423.19
		所有者权益:	
		实收基金	1,306,582,851.00
		未分配利润	15,250,443.63
		所有者权益合计	1,321,833,294.63
资产合计:	1,323,155,717.82	负债与持有人权益总计:	1,323,155,717.82

注:报告截止日2013年8月9日,A300ETF基金份额净值2.2861元,基金份额总额578,192,168.00份。

八、基金投资组合

截止到2013年8月9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	1,302,180,536.63	98.41
	其中:股票	1,302,180,536.63	98.41
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	19,897,580.29	1.50
6	其他资产	1,077,600.90	0.08
7	合计	1,323,155,717.82	100.00

(二)按行业分类的股票投资组合
1、按照证券业协会发布的最新行业分类标准,本基金股票投资组合的情况如下:

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	8,065,710.44	0.61
B	采掘业	93,308,395.39	7.06
C	制造业	478,773,372.51	36.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	42,489,632.46	3.21
E	建筑业	50,350,165.52	3.81
F	批发和零售业	36,928,210.79	2.79
G	交通运输、仓储和邮政业	27,238,362.92	2.06
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	30,855,050.26	2.33
J	金融业	424,200,071.78	32.09
K	房地产业	73,484,184.11	5.56
L	租赁和商务服务业	9,047,358.70	0.68
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	8,636,341.00	0.65
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	4,494,880.00	0.34
S	综合	14,308,800.75	1.08
	合计	1,302,180,536.63	98.51

2、按投资按行业分类的股票投资组合
本基金本报告期未未持有积极投资的股票。
(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、按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	600016	民生银行	6,180,068	52,036,172.56	3.94
2	600036	招商银行	3,866,822	41,336,327.18	3.13
3	601318	中国平安	916,751	30,271,118.02	2.29
4	601166	兴业银行	3,127,700	29,087,610.00	2.20
5	000002	万 科A	2,648,500	25,822,875.00	1.95
6	600837	海通证券	2,214,049	24,642,365.37	1.86
7	600000	浦发银行	3,062,100	24,527,421.00	1.86
8	600030	中信证券	1,884,300	20,482,341.00	1.55
9	600519	贵州茅台	113,500	19,616,205.00	1.48
10	000651	格力电器	658,349	17,775,423.00	1.34

2、按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明细
本基金本报告期未未持有积极投资的股票。
(四)按券种分类的债券投资组合
截至2013年8月9日,本基金未持有债券。
(五)截至公告前两个工作日即2013年8月9日按公允价值占净值比例大小排序的前五名债券明细
截至2013年8月9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
本基金截至2013年8月9日止未持有资产支持证券。
(七)按公允价值占净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金截至2013年8月9日止未持有权证。
(八)投资组合报告附注
1、本基金投资的前十名证券之一的贵州茅台的发行主体贵州茅台酒股份有限公司之控股子公司贵州茅台酒销售有限公司因违反了《中华人民共和国反垄断法》的有关规定,于2013年2月22日收到贵州省物价局《行政处罚决定书》,被处以罚款二亿四十七百万元人民币。本报告期内,贵州茅台股份有限公司未再就该事项发布新公告。
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,认为高端白酒虽然短期内面临各种压力,但贵州茅台酒因为品质卓越、品牌力强大,仍然拥有深厚的消费潜力。行政处罚不改变该股票的长期投资价值。该证券的投资已执行内部严格的投资决策流程,符合法律法规和公司制度的规定。
本基金投资的前十名证券之一的中国平安的发行主体中国平安保险(集团)股份有限公司控股子公司平安证券收到中国证监会《行政处罚和市场禁入事先告知书》,中国证监会决定对平安证券给予警告并没收其在万福生科发行上市项目中的业务收入人民币2,555万元,并处以人民币5,110万元的罚款,暂停其保荐机构资格3个月。
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,认为中国平安作为国内最大的保险机构之一将长期受益于我国保险行业的发展,从处罚公告中知悉,2012年平安证券投行业务承销佣金收入占平安集团营业收入的0.19%,净利润的0.66%,对平安集团的财务状况及经营成果并不产生实质性影响。本次行政处罚对该股票的投资价值不产生重大影响。该证券的投资已执行内部严格的投资决策流程,符合法律法规和公司制度的规定。
本基金投资的前十名证券中的其它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、截至公告前两个工作日即2013年8月9日,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	165,905.73
2	应收证券清算款	
3	应收股利	696,098.29
4	应收利息	215,596.88
5	应收申购款	
6	其他应收款	
7	待摊费用	
8	其他	
9	合计	1,077,600.90

4、本基金持有的处于转股期的可转换债券明细及资产支持证券、分离交易可转债
截至公告前两个工作日即2013年8月9日,本基金未持有处于转股期的可转换债券,未持有资产支持证券,未持有分离交易可转债。
5、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

十、基金管理人承诺

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。
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份额持有人的基金财产托管事宜。
(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;
(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沪深300交易型开放式指数证券投资基金募集的文件
2、《鹏华沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
3、《鹏华沪深300交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
4、《鹏华沪深300交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》
5、法律意见书
6、基金管理人业务资格批件、营业执照
7、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
2013年8月13日

附件:

鹏华沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金合同摘要

一、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;
(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、基金销售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;
(2)了解所投资基金产品,了解自身风险承受能力,自行承担投资风险;
(3)不干涉基金信息披露、及时行使权利和履行义务;
(4)缴纳基金认购款项及限量、申购对价、赎回对价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定;
(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)依法募集基金;
(2)启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)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份额持有人的利益;
(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或参与转融通;
(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、赎回和非交易过户的业务规则;
(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)依法募集基金,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)启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,按有关规定编制并公告市申购赎回清单,计算并公告基金资产净值,确定基金份额申购对价、赎回对价;
(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、足额支付赎回对价;
(15)依照《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定;
(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。
二、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。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。
如果本基金推出联接基金,鉴于本基金和本基金的联接基金的相关性,本基金召开基金份额持有人大会时,联接基金应当提前召开联接基金的基金份额持有人大会,就本基金基金份额持有人大会的表决意见征求联接基金持有人意见。联接基金的基金管理人(或基金托管人)应当分别按照权益登记日联接基金的基金份额持有人大会各类表决意见的具体比例参加本基金基金份额持有人大会投票表决。
联接基金的基金管理人代表联接基金的基金份额持有人提议召开或召集本基金份额持有人大会的,须先遵照联接基金基金合同的约定召开联接基金的基金份额持有人大会;联接基金的基金份额持有人大会决定提议召开或召集本基金份额持有人大会的,由联接基金基金管理人代表联接基金的基金份额持有人提议召开或召集本基金份额持有人大会。
(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;
(2)更换基金管理人;
(3)更换基金托管人;
(4)转换基金运作方式,但被深圳证券交易所决定终止上市的除外;
(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;
(8)终止基金上市,但被深圳证券交易所决定终止上市的除外;
(9)变更基金投资目标、范围或策略,但被深圳证券交易所决定终止上市的除外;
(10)变更基金份额持有人大会程序;
(11)基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会;
(12)单独或合计持有本基金总份额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;
(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;
(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调整本基金的申购费率、调低赎回费率;
(4)因相应的法律法规、相关证券交易所或者登记机构的相关业务规则发生变动以及中国证监会的相关规定,而应当对基金合同进行修改;
(5)因基金不再具备上市条件而被深圳证券交易所决定终止上市,从而由交易型开放式指数证券投资基金转为跟踪标的指数的非上市契约型开放式指数证券投资基;
(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)召集人和召集方式
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集时,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。
4、代表基金份额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,代表基金份额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