# 鹏华新丝路指数分级证券投资基金之基础份额、A类份额、B类份额上市交易公告书

**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:上海证券交易所**
**上市时间:2015年8月24日**
**公告日期:2015年8月19日**

一、重要声明与提示

鹏华新丝路指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)之基础份额、A类份额、B类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《上海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。

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6月19日刊登在《上海证券报》和本公司指定销售机构网站上的《鹏华新丝路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:鹏华新丝路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新丝路指数分级证券投资基金之基础份额(场内简称:新丝路)、鹏华新丝路指数分级基金之A份额(场内简称:新丝路A)、鹏华新丝路指数分级基金之B份额(场内简称:新丝路B)。其中,鹏华新丝路A份额、鹏华新丝路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、鹏华新丝路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销售机构。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上海证券交易所风险控制要求的上海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。鹏华新丝路A份额与鹏华新丝路B份额只上市交易,不接受申购和赎回。

7、鹏华新丝路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、份额配对转换是指鹏华新丝路份额与鹏华新丝路A份额、鹏华新丝路B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鹏华新丝路份额按照2份鹏华新丝路份额对应1份鹏华新丝路A份额与1份鹏华新丝路B份额的比例进行转换的行为。合并是指基金份额持有人将其持有的鹏华新丝路A份额与鹏华新丝路B份额按照1份鹏华新丝路A份额与1份鹏华新丝路B份额对应2份鹏华新丝路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,鹏华新丝路A份额与鹏华新丝路B份额的份额配比保持1:1的比例。对于鹏华新丝路A份额的约定应得收益,即鹏华新丝路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,将折算为场内鹏华新丝路份额分配给鹏华新丝路A份额持有人。鹏华新丝路份额持有人持有的每2份鹏华新丝路份额按1份鹏华新丝路A份额获得新增鹏华新丝路份额的分配。持有场外鹏华新丝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新丝路份额的分配;持有场内鹏华新丝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新丝路份额的分配。经过上述份额折算,鹏华新丝路A份额的基金份额参考净值调整为1.000元,鹏华新丝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,即当鹏华新丝路份额的基金份额净值达到1.500元时或当鹏华新丝路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新丝路份额、鹏华新丝路A份额、鹏华新丝路B份额进行份额折算,份额折算后本基金将确保鹏华新丝路A份额与鹏华新丝路B份额的比例为1:1,份额折算后鹏华新丝路份额的基金份额净值、鹏华新丝路A份额与鹏华新丝路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8月17日,本基金的基金份额总额为338,553,007.95份,其中,鹏华新丝路份额256,401,269.95份,鹏华新丝路A份额为41,075,869.00份,鹏华新丝路B份额为41,075,869.00份。

12、基金份额净值:截至2015年8月17日,鹏华新丝路分级的基金份额净值为1.000元,鹏华新丝路A份额的基金份额参考净值为1.001元,鹏华新丝路B份额的基金份额参考净值为0.999元。

13、本次上市交易的基金份额简称及其基金代码:新丝路,基金代码:502026;新丝路A,基金代码:502027;新丝路B,基金代码:502028。

14、本次上市交易的基金份额总额:新丝路20,537,936.00份,新丝路A 41,075,869.00份,新丝路B 41,075,869.00份。

15、上市交易的证券交易所:上海证券交易所

16、上市推荐人:无

17、上市交易日期:2015年8月24日

18、基金管理人:鹏华基金管理有限公司

19、基金托管人:招商银行股份有限公司

20、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

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[766]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6月23日至2015年8月11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代销业务资格并经上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的上海证券交易所会员单位,具体名单详见上海证券交易所网站(www.sse.com.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)销售机构

招商银行、众禄基金、数米基金、好买基金、上海天天基金、和讯信息科技、新兰德、诺亚正行(上海)、同花顺、中信建投、方正证券、信达证券、国信证券、海通证券、长城证券、广州证券、光大证券、湘财证券、长江证券、申万宏源、安信证券、国泰君安、西部证券、华西证券、天风证券、华鑫证券、银河证券、国金证券、中信证券(山东)、中信证券(浙江)、中信证券、齐鲁证券、平安证券、渤海证券、中金公司、中信建投期货、中投证券、招商证券、东北证券。

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:本次募集的有效净认购金额为338,520,631.30元人民币,折合基金份额338,520,631.30份;利息结转份额32,376.65份,总确认份额为338,553,007.95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8月13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新丝路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338,553,007.95份基金份额,其中场外认购的基金份额为235,863,333.96份;场内认购的基金份额为102,689,674.00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《鹏华新丝路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8月13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8月13日

12、基金合同生效日的基金份额总额:338,553,007.95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:上海证券交易所自律监管决定书[2015]341号。

2、上市交易日期:2015年8月24日

3、上市交易的证券交易所:上海证券交易所。投资者在具有基金销售业务资格的上海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:鹏华新丝路分级,场内简称:新丝路,基金代码:502026。

上市交易份额简称及代码:新丝路,基金代码:502026;新丝路A,基金代码:502027;新丝路B,基金代码:502028。

5、本次上市交易份额:新丝路20,537,936.00份,新丝路A 41,075,869.00份,新丝路B 41,075,869.00份。

6、未上市交易份额的流通规定:

本基金包括场内份额与场外份额,本次上市的基金份额全部为场内份额。

未上市交易的份额登记在中国证券登记结算有限责任公司开放式基金注册登记系统基金份额持有人开放式基金账户下,可以通过跨系统转托管转至中国证券登记结算有限责任公司上海分公司证券登记结算系统持有人上海证券账户下后,在上海证券交易所上市交易。

7、本基金开通跨系统转托管业务日期:2015年8月24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8月17日,新丝路分级基金份额持有人户数为1,356户,平均每户持有的基金份额为189,086.48份;新丝路A为57户,平均每户持有的基金份额为720,629.28份;新丝路B为57户,平均每户持有的基金份额为720,629.28份。

机构投资者持有的本次上市交易的新丝路、新丝路A与新丝路B的基金份额分别为9,999,482.00份、19,998,966.00份和19,998,966.00份,分别占本次新丝路、新丝路A与新丝路B上市交易基金份额比例为48.69%、48.69%和48.69%;个人投资者持有的本次上市交易的新丝路、新丝路A与新丝路B的基金份额分别为10,538,454.00份、21,076,903.00份和21,076,903.00份,分别占本次新丝路、新丝路A与新丝路B上市交易基金份额比例为51.31%、51.31%和51.31%;

(二)基金份额前十名持有人情况:

截至2015年8月17日,本次上市交易的新丝路分级基金份额前十名持有人情况如下表。

| 序号 | 持有人名称 | 持有新丝路份额 | 占新丝路份额比(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 鹏华资产－工商银行－以太量化十二号2期资产管理计划 | 6,000,250.00 | 29.22% |
| 2 | 朱刚 | 2,000,070.00 | 9.74% |
| 3 | 李怡名 | 1,999,980.00 | 9.74% |
| 4 | 光大证券股份有限公司 | 1,400,043.00 | 6.82% |
| 5 | 方正证券股份有限公司 | 1,400,043.00 | 6.82% |
| 6 | 崔书华 | 1,200,088.00 | 5.84% |
| 7 | 中信信托有限责任公司－中信聚益之锐意进取管理型风险缓冲金融投 | 1,000,115.00 | 4.87% |
| 8 | 郭淑兰 | 1,000,070.00 | 4.87% |
| 9 | 谢淑泉 | 1,000,025.00 | 4.87% |
| 10 | 李星影 | 800,334.00 | 3.90% |
| 合计 | | 17,801,018.00 | 86.69% |

截至2015年8月17日,本次上市交易的基金份额新丝路A前十名持有人情况如下表。

| 序号 | 持有人名称 | 持有新丝路A份额 | 占新丝路A份额比(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 鹏华资产－工商银行－以太量化十二号2期资产管理计划 | 12,000,500.00 | 29.22% |
| 2 | 朱刚 | 4,000,140.00 | 9.74% |
| 3 | 李怡名 | 3,999,960.00 | 9.74% |
| 4 | 光大证券股份有限公司 | 2,800,086.00 | 6.82% |
| 5 | 方正证券股份有限公司 | 2,800,086.00 | 6.82% |
| 6 | 崔书华 | 2,400,176.00 | 5.84% |
| 7 | 中信信托有限责任公司－中信聚益之锐意进取管理型风险缓冲金融投 | 2,000,230.00 | 4.87% |
| 8 | 郭淑兰 | 2,000,140.00 | 4.87% |
| 9 | 谢淑泉 | 2,000,050.00 | 4.87% |
| 10 | 李星影 | 1,600,669.00 | 3.90% |
| 合计 | | 35,602,037.00 | 86.69% |

截至2015年8月17日,本次上市交易的新丝路B基金份额前十名持有人情况如下表。

| 序号 | 持有人名称 | 持有新丝路B份额 | 占新丝路B份额比(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 鹏华资产－工商银行－以太量化十二号2期资产管理计划 | 12,000,500.00 | 29.22% |
| 2 | 朱刚 | 4,000,140.00 | 9.74% |
| 3 | 李怡名 | 3,999,960.00 | 9.74% |
| 4 | 光大证券股份有限公司 | 2,800,086.00 | 6.82% |
| 5 | 方正证券股份有限公司 | 2,800,086.00 | 6.82% |
| 6 | 崔书华 | 2,400,176.00 | 5.84% |
| 7 | 中信信托有限责任公司－中信聚益之锐意进取管理型风险缓冲金融投 | 2,000,230.00 | 4.87% |
| 8 | 郭淑兰 | 2,000,140.00 | 4.87% |
| 9 | 谢淑泉 | 2,000,050.00 | 4.87% |
| 10 | 李星影 | 1,600,669.00 | 3.90% |
| 合计 | | 35,602,037.00 | 86.69% |

(三)截止到2015年8月17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7月31日,公司员工总数292人,其中:正式员工256人,外包员工36人。学历构成如下:博士12人占比4.1%,硕士177人占比60.6%,本科94人占比32.2%,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

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,2015年5月起兼任鹏华中证高铁产业指数分级证券投资基金基金经理,2015年5月起兼任鹏华中证新能源指数分级证券投资基金基金经理,2015年8月起兼任鹏华新丝路指数分级证券投资基金、鹏华国证钢铁行业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。

崔惠军先生,国籍中国,经济学硕士,14年证券从业经验。曾任职于世纪证券有限责任公司证券投资部,担任分析师;中金东方资产管理有限公司投资策略部,担任高级经理;东方证券股份有限公司证券投资部、金融衍生品部,先后担任高级投资经理、投资总监、总经理助理。2015年6月加盟鹏华基金管理有限公司,担任量化及衍生品投资部总经理助理,从事投研工作;2015年8月起兼任鹏华新丝路指数分级证券投资基金。崔惠军先生具备基金从业资格。

(二)基金托管人

1、基本情况

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11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,新增托管分募开放式基金18只,新增首发分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物业发展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、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、华泰柏瑞全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、博时证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、中银标普全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型证券投资基金、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8月17日资产负债表如下:

| 资产 | 2015年8月17日余额 | 负债和所有者权益 | 2015年8月17日余额 |
|---|---|---|---|
| 资 产: | | 负债: | |
| 银行存款 | 1,020,631.30 | 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 | 37,101.77 |
| 基金投资 | | 应付托管费 | 8,162.39 |
| 衍生金融资产 | | 应付销售服务费 | |
| 买入返售金融资产 | 337,500,000.00 | 应付交易费用 | |
| 应收证券清算款 | 14,372.22 | 应付税费 | |
| 应收利息 | 59,478.70 | 应付利息 | |
| 应收股利 | | 应付利润 | |
| 应收申购款 | | 其他负债 | 5,848.49 |
| 其他资产 | | 负债合计 | 51,112.65 |
| | | 所有者权益: | |
| | | 实收基金 | 338,553,007.95 |
| | | 未分配利润 | -9,638.38 |
| | | 所有者权益合计 | 338,543,369.57 |
| | | | |
| 资产合计 | 338,594,482.22 | 负债与持有人权益总计: | 338,594,482.22 |

八、基金投资组合

截止到2015年8月17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 | 337,500,000.00 | 99.68 |
| | 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 | 1,020,631.30 | 0.30 |
| 6 | 其他各项资产 | 73,850.92 | 0.02 |
| 7 | 合计 | 338,594,482.22 | 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8月17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8月17日,本基金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、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8月17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8月17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8月17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8月17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8月17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8月17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8月17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8月17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 | 14,372.22 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 59,478.70 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 73,850.92 |

4、截至2015年8月17日,本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5、截至2015年8月17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8月17日,本基金未持有股票。

6、截至2015年8月17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8月17日,本基金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,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、上海证券交易所的监督评定。

(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,将及时予以以示澄清。

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新丝路指数分级证券投资基金募集的文件

2、《鹏华新丝路指数分级证券投资基金基金合同》

3、《鹏华新丝路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8月19日**

## 附件:鹏华新丝路指数分级证券投资基金基金合同摘要

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