鹏华中证800地产指数分级证券投资基金之地产A与地产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: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:2014年9月23日
公告日期:2014年9月18日

一、 重要声明与提示

鹏华中证800地产指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)之地产A份额与地产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、证券交易所对本基金之地产A与地产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2014年8月18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800地产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800地产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800地产指数分级证券投资基金之基础份额(场内简称:鹏华地产)、鹏华中证800地产指数分级基金之A份额(场内简称:地产A)、鹏华中证800地产指数分级基金之B份额(场内简称:地产B)。其中,鹏华地产A份额、鹏华地产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800地产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代销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。鹏华地产A份额与鹏华地产B份额只上市交易,不接受申购和赎回。
7、鹏华中证800地产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:份额配对转换是指本基金的鹏华地产份额与鹏华地产A份额、鹏华地产B份额之间的配对转换,包括分拆和合并两个方面。分拆指基金份额持有人将其持有的每2份鹏华地产份额的场内份额申请转换成1份鹏华地产A份额与1份鹏华地产B份额的行为;合并指基金份额持有人将其持有的1份鹏华地产A份额与1份鹏华地产B份额申请转换成2份鹏华地产场内份额的行为。
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
在鹏华地产A份额、鹏华地产份额存续期内的每个会计年度(除基金合同生效日所在会计年度外)第一个工作日,本基金将按照以下规则进行基金的定期份额折算。在基金份额折算前与折算后,鹏华地产A份额与鹏华地产B份额的份额配比保持1∶1的比例。对于鹏华地产A份额的约定应得收益,即鹏华地产A份额每个会计年度12月31日基金份额参考净值超出1.000元部分,将折算为场内鹏华地产份额分配给鹏华地产A份额持有人。鹏华地产份额持有人持有的每2份鹏华地产份额将按1份鹏华地产A份额获得新增鹏华地产份额的分配。持有场外鹏华地产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地产份额的分配;持有场内鹏华地产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地产份额的分配。经过上述份额折算,鹏华地产A份额的基金份额参考净值调整为1.000元,鹏华地产份额的基金份额净值将相应调整。
10、不定期份额折算
除定期份额折算外,本基金还将在鹏华地产份额的基金份额净值达到1.500元时或地产B份额的基金份额参考净值跌至0.250元时进行不定期份额折算。
当达到不定期折算条件时,本基金将分别对鹏华地产份额、鹏华地产A份额、鹏华地产B份额进行份额折算,份额折算后本基金将确保鹏华地产A份额与鹏华地产B份额的比例为1∶1,份额折算后鹏华地产份额的基金份额净值、鹏华地产A份额与鹏华地产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2014年9月16日,本基金的基金份额总额为258,601,782.82份,其中,鹏华地产份额为246,886,818.82份,鹏华地产A份额为5,857,482.00份,鹏华地产B份额为5,857,482.00份。
12、基金份额净值:截至2014年9月16日,鹏华地产的基金份额净值为1.000元,鹏华地产A份额的基金份额参考净值为1.001元,鹏华地产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:地产A,基金代码:150192;地产B,基金代码:150193
14、本次上市交易的基金份额总额:鹏华地产A5,857,482.00份;鹏华地产B5,857,482.00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:2014年9月23日
17、基金管理人:鹏华基金管理有限公司
18、基金托管人:中国建设银行股份有限公司
19、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

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2014[150]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:2014年8月21日至2014年9月4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、国信证券、华西证券、中银万国证券、长城证券、光大证券、安信证券、信达证券、中投证券、广州证券、中信建投证券、方正证券、长江证券、海通证券、国泰君安、华泰证券、齐鲁证券、招商证券、中信证券(浙江)、中信证券、中信证券(山东)、银河证券、湘财证券、国金证券。
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258,496,537.63元人民币,折合基金份额258,496,537.63;利息结转份额105,245.19份,总确认份额为258,601,782.82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2014年9月11日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中证800地产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258,601,782.82份基金份额,其中场外认购的基金份额为246,886,818.82份;场内认购的基金份额为11,714,964.00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》、《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800地产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向中国证监会办理完毕基金备案手续,并于2014年9月12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:2014年9月12日
12、基金合同生效日的基金份额总额:258,601,782.82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[2014]338号
2、上市交易日期:2014年9月23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:鹏华地产,基金代码:160628。
上市交易份额简称及代码:地产A,基金代码:150192;地产B,基金代码:150193。
5、本次上市交易份额:鹏华地产A5,857,482.00份;鹏华地产B5,857,482.00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:对于托管在场内的鹏华地产份额,基金份额持有人在符合相关法律条件的前提下,将其分拆为鹏华地产A份额和鹏华地产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法律条件的前提下,将其跨系统转托管至深圳证券交易所场内后分拆为鹏华地产A份额和鹏华地产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:2014年9月18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2014年9月16日,鹏华地产基金份额持有人户数为1649户,平均每户持有的基金份额为149,719.11份;鹏华地产A为67户,平均每户持有的基金份额为87,425.10份;鹏华地产B为67户,平均每户持有的基金份额为87,425.10份。
机构投资者持有的本次上市交易的鹏华地产A与鹏华地产B的基金份额分别为50,002.00份和50,003.00份,分别占本次鹏华地产A与鹏华地产B上市交易基金份额比例为0.85%和0.85%;个人投资者持有的本次上市交易的鹏华地产A与鹏华地产B的基金份额分别为5,807,480.00份和5,807,479.00份,分别占本次鹏华地产A与鹏华地产B上市交易基金份额比例为99.15%和99.15%。
(二)截止到2014年9月16日,基金份额前十名持有人情况:
本次上市交易的鹏华地产A、鹏华地产B前十名持有人情况

序号	持有人名称	持有鹏华地产A份额	占鹏华地产A份额比(%)	持有鹏华地产B份额	占鹏华地产B份额比(%)
1	张应好	1,050,153.00	17.93%	1,050,152.00	17.93%
2	钱莹	773,053.00	13.20%	773,052.00	13.20%
3	林忆虹	500,034.00	8.54%	500,034.00	8.54%
4	姜波	500,024.00	8.54%	500,024.00	8.54%
5	岳友田	250,017.00	4.27%	250,017.00	4.27%
6	陈昭旭	250,012.00	4.27%	250,012.00	4.27%
7	朱云则	250,012.00	4.27%	250,012.00	4.27%
8	冀光	117,006.00	2.00%	117,005.00	2.00%
9	崔婉华	100,005.00	1.71%	100,004.00	1.71%
10	王伟海	99,505.00	1.70%	99,506.00	1.70%
		3,889,821.00	66.41%	3,889,818.00	66.41%

(三)截止到2014年9月16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150412.59,占该基金总份额的比例为0.0582%。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,该只基金的基金经理持有该只基金份额总量为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:15亿元人民币
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
负责公司权益类公募基金的投资管理工作。
量化投资部
负责公司量化、指数基金投资管理工作。
机构投资部
负责社保权益类组合和其它委托权益类理财业务的投资管理工作。
固定收益部
负责公司固定收益证券的研究、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。
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。
监察稽核部
负责公司对外信息披露、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。
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。
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。
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。
市场发展部
负责公司银行渠道销售管理及客户服务工作。
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
负责公司第三方机构及公司电子商务平台的管理、业务推广等工作。
营销策划部
负责公司品牌管理、媒体和广告管理、营销策划与销售支持。
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12月31日,公司员工总数275人,其中:正式员工241人,外包员工34人。学历构成如下:博士12人占比4.4%,硕士160人占比58.2%,本科92人占比33.4%,大专及以下11人占比4.0%。
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
王咏辉先生,英国牛津大学工程和计算机专业硕士,15年证券基金从业经验。曾担任伦敦摩根大通(JP Morgan)投资基金管理公司分析员、高级分析师,汇丰投资基金管理公司(HSBC)高级分析师,伦敦巴克莱国际投资基金管理公司基金经理、部门负责人,巴克莱资本公司(Barclays Capital)部门负责人,泰达宏利基金公司国际投资部副总监、产品与金融工程部副总经理等职,2010年4月至2012年8月担任泰达宏利中证财富大盘指数型证券投资基金基金经理,2011年7月至2012年8月担任泰达宏利全球新格局证券投资ODII基金基金经理,2011年12月至2012年8月担任泰达宏利中证500指数分级证券投资基金基金经理;2012年11月加盟鹏华基金管理有限公司,现任量化投资部总经理、投资决策委员会成员,2013年12月起担任鹏华中证500指数证券投资基金(LOF)基金经理。王咏辉先生具备基金从业资格,英国基金经理从业资格(IMC)。
(二)基金托管人
1、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
中国建设银行拥有悠久的经营历史,其前身“中国人民建设银行”于1954年成立,1996年易名为“中国建设银行”。中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于2004年9月分立而成立,承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行(股票代码:939)于2005年10月27日在香港联合交易所主板上市,是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006年9月11日,中国建设银行又作为第一家H股公司晋身恒生指数。2007年9月25日中国建设银行A股在上海证券交易所上市并开始交易。A股发行后中国建设银行的已发行股份总数为:250,010,977,486股(包括240,417,319,880股H股及9,593,657,606股A股)。
截至2013年12月31日,中国建设银行资产总额153,632.10亿元,较上年增长9.95%;客户贷款和垫款总额85,900.57亿元,增长14.35%;客户存款总额122,230.37亿元,增长7.76%。营业收入5,086.08亿元,较上年增长10.39%,其中,利息净收入增长10.29%,净利息收益率(NIM)为2.74%;手续费及佣金净收入1,042.83亿元,增长11.52%,占营业收入比重为20.50%。成本费用开支得到有效控制,成本收入比为29.65%。实现利润总额2,798.06亿元,较上年增长11.28%;净利润2,151.22亿元,增长11.12%。资产质量保持稳定,不良贷款率0.99%,拨备覆盖率268.22%;资本充足率与核心一级资本充足率分别为13.34%和10.75%,保持同业领先。
中国建设银行在中国内地设有分支机构14,650个,服务于306.54万公司客户、2.91亿个人客户,与中国经济战略性行业的主导企业和大量高端客户保持密切合作关系;在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京、大阪、首尔、纽约、胡志明市、悉尼、墨尔本、台北、卢森堡设有海外分行,拥有建行亚洲、建银国际、建行伦敦、建行俄罗斯、建行迪拜、建行欧洲、建信基金、建信租赁、建信信托、建信人寿等多家子公司。
2013年,本集团的出色业绩与良好表现受到市场与业界的充分认可,先后荣获国内外102项奖项,多项综合排名进一步提高,在英国《银行家》杂志“全球银行1000强排名”中位列第5,较上年上升2位;在美国《福布斯》杂志发布的“2013年度全球上市公司2000强排名”中,位列第2,较上年上升13位。此外,本集团还荣获了国内外重要机构授予的包括公司治理、中小企业服务、私人银行、现金管理、托管、投行、养老金、国际业务、电子商务和企业社会责任等领域的多个专项奖。
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、消算处、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220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。
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。
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。
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。
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2013年12月31日,中国建设银行已托管349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2012年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”;获和讯网的中国“最佳资产托管银行”奖;境内权威经济媒体《每日经济观察》的“最佳基金托管银行”奖;中央国债登记结算有限责任公司的“优秀托管机构”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:金颖
联系电话:010-59378835
传真:010-59378856
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2014年9月16日资产负债表如下:

资产	2014年9月16日余额	负债和所有者权益	2014年9月16日余额
资 产:		负债:	
银行存款	258,496,537.63	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	28,340.05
基金投资		应付托管费	6,234.82
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	136,499.05	应付利息	
应收股利		应付利润	
应收申购款		其他负债	8,449.75
其他资产		负债合计	43,024.62
		所有者权益:	
		实收基金	258,601,782.82
		未分配利润	-11,770.76
		所有者权益合计	258,590,012.06
资产合计	258,633,036.68	负债与持有人权益总计:	258,633,036.68

八、 基金投资组合

截止到2014年9月16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	258,496,537.63	99.95
6	其他各项资产	136,499.05	0.05
7	合计	258,633,036.68	100.00

(二)按行业分类的股票投资组合
截至2014年9月16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
截至2014年9月16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
截至2014年9月16日,本基金未持有股票。
(四)按券种分类的债券投资组合
截至2014年9月16日,本基金未持有债券。
(五)按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细
截至2014年9月16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
截至2014年9月16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2014年9月16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
截至2014年9月16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、本基金投资的股指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股指期货投资。
2、本基金投资股指期货的投资政策
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)投资组合报告附注
1、本基金投资的前十名证券中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	136,499.05
5	应收申购款	
6	其他应收款	
7	待摊费用	
8	其他	
9	合计	136,499.05

4、截至2014年9月16日,本基金未持有处于转股期的可转换债券。
5、截至2014年9月16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2014年9月16日,本基金未持有股票。
6、截至2014年9月16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2014年9月16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800地产指数分级证券投资基金募集的文件
2、《鹏华中证800地产指数分级证券投资基金基金合同》
3、《鹏华中证800地产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
2014年9月18日

附件:鹏华中证800地产指数分级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与义务
(一)基金份额持有人的权利与义务
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》;
(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)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;
(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)基金管理人的权利与义务
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)依法募集资金;
(2)自《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)按照规定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投资者的利益;
(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;
(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、转换和非交易过户等业务的业务规则;
(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)依法募集资金,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)自《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,按有关规定计算并公告基金资产净值、基金份额净值、基金份额参考净值,确定鹏华地产份额申购、赎回的价格;
(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、足额支付赎回款项;
(15)依据《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)按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料15年以上;
(17)确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出,并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式,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;
(18)组织并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;
(19)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并通知基金托管人;
(20)因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时,应当承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;
(21)监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务,基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时,基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿;
(22)当基金管理人将其义务委托第三方处理时,应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任;
(23)以基金管理人名义,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为;(24)基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件,《基金合同》不能生效,基金管理人承担全部募集费用,将已募集资金并加计银行同期存款利息在基金募集期结束后30日内退还基金认购人;
(25)执行生效的基金份额持有人大会的决议;
(26)建立并保存基金份额持有人名册;
(27)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。
(三)基金托管人的权利与义务
1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金托管人的权利包括但不限于:
(1)自《基金合同》生效之日起,依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产;
(2)依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用;
(3)监督基金管理人对本基金的投资运作,如发现基金管理人有违反《基金合同》及国家法律法规行为,对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形,应呈报中国证监会,并采取必要措施保护基金投资者的利益;
(4)根据相关市场规则,为基金开设证券账户、为基金办理证券交易资金清算;
(5)提议召开或召集基金份额持有人大会;
(6)在基金管理人更换时,提名新的基金管理人;
(7)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,基金托管人的义务包括但不限于:
(1)以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产;
(2)设立专门的基金托管部门,