(上接B025版)

联系电话:023-63786141
客户服务电话:4008096096
传真:023-63786212
网址:www.swsc.com.cn
65) 新时代证券有限责任公司
注册地址:北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501
办公地址:北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501
法定代表人:刘汝军
联系人:马俊杰
电话:010-83561329
传真:010-83561094
邮编:100086
客户服务电话:4006989898
公司网址:www.xsdzq.cn
66) 东方证券股份有限公司
注册地址:上海市中山南路318号2号楼22层-29层
办公地址:上海市中山南路318号2号楼22层-29层
法定代表人:王益民
联系人:吴宇
电话:021-63325888
传真:021-63326173
客户服务电话:021-962506或4008888506
网址:www.dfzq.com.cn
C、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:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元
法定代表人:薛峰
客服电话:4006-788-887
传真:0755-82080798
联系人:汤素雅
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:蒋意
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:周嫦旻
网址:www.fund123.cn
5) 上海长量基金销售投资顾问有限公司
办公地址:上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层
法定代表人:张跃伟
客服电话:400-089-1289
传真:021-58787698
联系人:敖玲
电话:021-58788678-8201
传真:021-58787698
客服电话:400-089-1289
公司网站:www.erichfund.com
6) 北京展恒基金销售有限公司
办公地址:北京市顺义区后沙峪镇安富街6号
法定代表人:闫振杰
联系人:张温晶
传真:(+86-10) 6202 0088 转8802
客服电话:400 888 6661
网址:www.myfund.com
7) 天相投资顾问有限公司
办公地址:北京市西城区金融街5号新盛大厦B座4层
法定代表人:林义相
客服电话:010-66045678
传真:010-66045527
联系人:林爽
网址:www.txsec.com
8) 和讯信息科技有限公司
住所:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
办公地址:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
法定代表人:王利
联系人:赵慧灵
联系电话:021-68419822
客服电话:400-920-0022
网址:licaike.hexun.com
9) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
住所:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#
办公地址:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#
法定代表人:马令海
联系人:邓洁
联系电话:010-58321388-1105
客服电话:010-58325327
网址:jrj.xinlande.com.cn
10) 诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司
办公地址:上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心8楼801室
法定代表人:汪静波
客服电话:400-821-5399
传真:021-38509777
联系人:张姚杰
网址:www.noah-fund.com
11) 万银财富(北京)基金销售有限公司
住所:北京朝阳区北四环中路27号盘古大观3201
办公地址:北京朝阳区北四环中路27号盘古大观3201
法定代表人:李招弟
联系人:毛怀营
联系电话:010-59393923
客服电话:400-808-0069
网址:www.wy-fund.com
12) 北京增财基金销售有限公司
住所:北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208室
办公地址:北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208室
法定代表人:王昌庆
联系人:罗细安
联系电话:010-67000988
客服电话:400-001-8811
网址:www.zcvc.com.cn
13) 北京恒天明泽基金销售有限公司
住所:北京市北京经济技术开发区宏达北路10号5层5122室
办公地址:北京市北京经济技术开发区宏达北路10号5层5122室
法定代表人:黄永伟
联系人:侯仁凤
联系电话:010-57756068
客服电话:400-786-8868
网址: www.chtfund.com

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代理销售本基金或变更上述代销机构,并及时公告。

2、场内发售机构: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(具体名单见基金份额发售公告及其他相关业务公告)。

(二) 注册登记机构
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) 律师事务所
名称:北京市德恒律师事务所
住所:北京市西城区金融街19号富凯大厦B座十二层负责人:王丽
办公地址:北京市西城区金融街19号富凯大厦B座十二层
联系电话:010-65232180 65269781
传真:010-65232181
联系人:徐芳
经办律师:陈静茹、苏文静

(一) 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
法定代表人:杨绍信
联系电话:(021)23238888
经办注册会计师:单峰、魏佳亮
联系人:魏佳亮

四、基金的名称

本基金名称:鹏华沪深300指数证券投资基金(LOF)

五、基金的运作方式及类型

(一)本基金运作方式
上市契约型开放式
(二)本基金类型
股票型证券投资基金

六、基金的投资目标

本基金采用指数化投资方式,追求基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间的跟踪误差最小化,力争将日平均跟踪误差控制在0.35%以内,以实现对沪深300指数的有效跟踪。

七、基金的投资方向

本基金投资于具有良好流动性的金融工具,主要投资于沪深300指数的成份股及其备选成份股(投资比例不低于基金资产净值的90%),现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。此外,为更好的实现投资目标,本基金将少量投资于非沪深300成份股、新股(首次发行或增发等)以及法律法规及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。

若法律法规或监管机构允许,本基金在履行适当程序后,可以调整上述投资比例,或将股指期货等金融衍生品纳入本基金的投资范围。

八、基金的投资策略

(一)投资策略

本基金采用被动式指数投资方法,按照成份股在沪深300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和成份股发生配股、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,并辅之以金融衍生产品投资管理等,使跟踪误差控制在限定的范围之内。

1、资产配置策略

为实现紧密跟踪业绩比较基准的投资目标,本基金将以不低于基金资产净值90%的资产投资于沪深300指数成份股和备选成份股。在正常市场情况下本基金将采用完全复制法,严格按目标指数的成份股权重构建组合,少数特殊情况下本基金将配合使用优化方法作为补充,以保证对标的指数的有效跟踪。

2、股票投资策略

本基金原则上通过指数复制法进行被动式指数化投资,根据沪深300指数成份股的基准权重构建股票投资组合,并根据成份股及其权重的变动而进行相应调整。

(1)股票投资组合的构建

本基金在建仓期内,将按照沪深300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,对基金资产进行适当调整,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沪深300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、新股增发因素等变化,对其进行适时调整,以保证基金净值增长率与基准指数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

当成份股发生增发、配股、分红等情况而影响成份股在指数中权重的行为时,本基金将根据各成份股的权重变化及时调整股票投资组合;

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、法规和基金合同的规定,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,并辅之以金融衍生产品投资管理等,最终使跟踪误差控制在限定的范围之内;

根据法律法规中针对基金投资比例的相关规定,当基金投资组合中按标的指数权重投资的股票资产比例或个股比例超过规定限制时,本基金将对其进行实时调整,并相应对其他资产或个股进行微调,以保证基金合法规范运作。

3、债券投资策略

本基金根据流动性管理的需要,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。

(二)投资决策依据及程序

1. 投资决策依据

(1)有关法律、法规、基金合同等的相关规定;
(2)经济运行态势和证券市场走势;
(3)标的指数的编制方法及其变更。

2. 投资决策程序

(1)本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理团队制。投资决策委员会负责制定基金投资方面的整体投资计划与投资原则;决定有关指数重大调整的应对决策、其他重大组合调整决策以及重大的单项投资决策;基金经理根据投资决策委员会的决策,负责投资组合的构建、调整和日常管理等工作;

(2)基金经理根据沪深300指数成份股名单及权重,考虑本基金资产规模及需保留现金比例等因素,拟定本基金指数化投资的初始方案;

(3)基金经理根据实际交易情况、申购赎回情况、对跟踪误差的监控结果、风险绩效小组风险绩效评估报告和监察稽核部风险监控和评估结果,采用相应的投资策略、优化方法对投资组合进行动态调整;

(4)基金经理在目标指数成份股定期调整信息公布前一个月内,根据对调整方案的分析预测以及成份股调整对股价影响的分析,决定采取提前调整还是事后调整的策略,增持可能进入目标指数的股票,剔除可能被调整出目标指数的股票,并向投资决策委员会提交报告,经投资决策委员会批准后方可进行;

(5)如出于更好跟踪标的指数的目的需要投资于股票期权、股指期货等金融衍生工具的,基金经理应向投资决策委员会提交报告,说明进行上述投资的目的、投资价值金额、可能产生的风险以及相应控制措施等内容,经投资决策委员会批准后方可进行;

(6)交易室根据基金经理下达的交易指令制定交易策略,完成具体证券品种的交易;

(7)风险绩效小组根据市场变化定期和不定期对基金进行投资绩效评估,并提供相关绩效评估报告;

(8)监察稽核部对投资计划在合规性方面的执行情况的执行进行日常监督和实时风险控制;

(9)本基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据市场环境变化和实际需要调整上述投资程序,并予以公告。

九、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准:

沪深300指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%

本基金为沪深300指数基金,以沪深300指数作为业绩比较基准。沪深300指数选择我国A股市场规模较大、流动性较强、基本面良好的300家上市公司的股票作为样本股,充分反映了A股市场的行业代表性,描述了沪深A股市场的总体趋势,同时该指数还具有指数编制方法透明、样本股调整规则清晰等特征,是目前市场上较有影响力的股票投资业绩比较基准。

本基金充分考虑本基金各资产投资比例要求从而构建上述业绩比较基准。

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股票指数时,本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

十、基金的风险收益特征

本基金属于采用指数化操作的股票型基金,其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金,为证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。

十一、基金的投资组合报告(未经审计)

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。

本基金的托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,已于2014年10月21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。

本报告中所列财务数据截至2014年9月30日(未经审计)。

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	451,378,093.28	94.06
	其中:股票	451,378,093.28	94.06
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	25,788,525.30	5.37
7	其他各项资产	2,717,831.51	0.57
8	合计	479,884,450.09	100.00

2、报告期末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

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	1,056,539.85	0.22
B	采矿业	27,411,181.56	5.77
C	制造业	188,946,268.50	39.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	21,142,717.39	4.45
E	建筑业	13,196,883.82	2.78
F	批发和零售业	7,462,780.45	1.57
G	交通运输、仓储和邮政业	7,134,693.96	1.50
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,673,384.33	3.09
J	金融业	117,719,495.66	24.76
K	房地产业	26,672,349.52	5.61
L	租赁和商务服务业	2,636,619.19	0.55
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	14,454,190.79	3.04
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	6,044,386.56	1.27
S	综合	1,393,339.95	0.29
	合计	449,944,831.53	94.65

(2)积极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	采掘业	208,800.00	0.04
C	制造业	256,351.40	0.05
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	5,595.00	0.00
J	金融业	650,598.55	0.14
K	房地产业	311,916.80	0.07
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	1,433,261.75	0.30

3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的指数投资前十名与积极投资的前五名股票明细

(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

代码	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	601318	中国平安	309,549	12,796,755.66	2.69
2	600036	招商银行	1,143,776	11,883,832.64	2.50
3	600016	民生银行	1,452,581	9,064,105.44	1.91
4	600887	伊利股份	257,600	6,671,840.00	1.40
5	000001	平安银行	630,540	6,393,675.60	1.34
6	601166	兴业银行	568,804	5,813,176.88	1.22
7	601939	建设银行	1,422,815	5,790,857.05	1.22
8	600832	东方明珠	504,066	5,504,400.72	1.16
9	600015	华夏银行	643,580	5,463,994.20	1.15
10	600383	金地集团	653,339	5,416,180.31	1.14

(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

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	601099	太平洋	66,185	650,598.55	0.14
2	600266	北京城建	29,992	311,916.80	0.07
3	601369	陕鼓动力	37,045	256,351.40	0.05
4	601101	昊华能源	30,000	208,800.00	0.04
5	300399	京天利	500	5,595.00	0.00

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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名的前五名债券投资明细

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名的前十名资产支持证券投资明细

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名的前五名贵金属投资明细

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名的前五名权证投资明细

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

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

(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。

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

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。

11、投资组合报告附注

(1) 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(简称"中国平安")于2013年5月22日发布公告称其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。2013年10月15日,中国平安发布公告称近日收到中国证监会《行政处罚决定书》([2013]48号),决定对平安证券予以前述行政处罚。

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。本基金为指数基金,为更好地跟踪标的指数,控制跟踪误差对该证券的投资属于按照指数成分股的权重进行配置,符合指数基金的管理规定,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	210,911.09
2	应收证券清算款	2,384,078.33
3	应收股利	-
4	应收利息	4,696.36
5	应收申购款	103,022.37
6	其他应收款	-
7	待摊费用	15,123.36
8	其他	-
9	合计	2,717,831.51

(4)报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券

(5)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	600832	东方明珠	5,504,400.72	1.16	重大资产重组

(6)期末积极投资前五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	300399	京天利	5,595.00	0.00	新股锁定

(7) 投资组合报告附注的其他文字描述部分

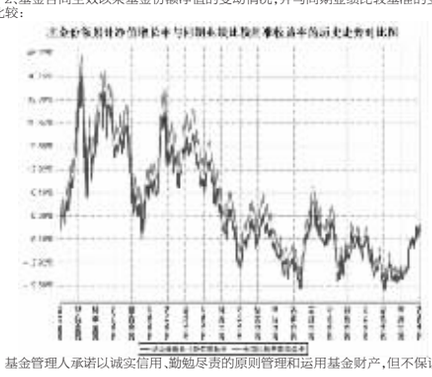
由于四舍五入的原因,投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

十二、基金的业绩

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
2009年4月3日(基金合同生效日)至2009年12月31日	31.11%	1.75%	36.80%	1.87%	-5.69%	-0.12%
2010年1月1日至2010年12月31日	-12.63%	1.51%	-11.77%	1.50%	-0.86%	0.01%
2011年1月1日至2011年12月31日	-23.60%	1.24%	-23.83%	1.23%	0.23%	0.01%
2012年1月1日至2012年12月31日	8.38%	1.22%	7.30%	1.22%	1.08%	0.00%
2013年1月1日至2013年12月31日	-5.64%	1.35%	-7.14%	1.32%	1.50%	0.03%
2014年1月1日至2014年9月30日	8.90%	1.01%	5.00%	0.94%	3.90%	0.07%
自基金合同生效日至2014年9月30日	-2.53%	1.36%	-3.81%	1.37%	1.28%	-0.01%

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:



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。

注1:业绩基准=沪深300指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%。

注2:本基金基金合同于2009年4月3日生效。

注3:基金业绩截止日为2014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》生效后与基金相关的信息披露费用;
4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;
5、基金份额持有人大会费用;
6、基金的证券交易费用;
7、基金的银行汇划费用;
8、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。

本基金终止清算时所发生费用,按实际支出额从基金财产总值中扣除。

(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0.75%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×0.75%÷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,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。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0.15%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.15%÷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,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

上述一、基金费用的种类中第3-7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、申购费

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取。本基金的申购费用不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

本基金对通过直销柜台申购的养老金客户与除此之外的其他投资者实施差别的申购费率。

养老金客户指基本养老基金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金,包括全国社会保障基金、可以投资基金的地方社会保障基金、企业年金单一计划以及集合计划。如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型,基金管理人可在招募说明书更新时或发布临时公告将其纳入养老金客户范围,并按规定向中国证监会备案。非养老金客户指除养老金客户外的其他投资者。

通过基金管理人的直销柜台申购本基金基金份额的养老金客户特定申购费率如下表:

申购金额M(元)	特定申购费率
M<100万	0.6%
100万≤M<250万	0.6%
250万≤M<500万	0.4%
M≥500万	每笔1000元

其他投资者申购本基金基金份额的申购费率(场外、场内的申购费率相同)如下表:

申购金额M(元)	申购费率
M<100万	1.2%
100万≤M<250万	0.8%
250万≤M<500万	0.4%
M≥500万	每笔1000元

投资者在一天之内如果有多笔申购,适用费率按单笔分别计算。

2、转换费

本基金目前仅可办理场外转换业务,场内暂未开通基金间转换业务。

具体转换费率、计算公式及转换业务规则详见基金管理人发布的相关公告。

3、赎回费:本基金的场外赎回费率按持有年限逐年递减,具体费率如下:

持有年限(Y)	场外赎回费率
Y<1年	0.5%
1年≤Y<2年	0.25%
Y≥2年	0

本基金的场内赎回费率为固定值0.5%。

本基金的赎回费用在投资者赎回本基金份额时收取。本基金的赎回费用由赎回申请人承担,赎回费总额的25%归基金财产,75%用于支付市场推广、注册登记费和其他手续费。

4、本基金的申购费率、转换费率、赎回费率和收费方式由基金管理人根据《基金合同》的规定确定并在《招募说明书》中列示。基金管理人和基金托管人协商后,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施日前2个工作日在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告。

5、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,针对特定地域范围、特定行业、特定职业的投资者以及以特定交易方式(如网上交易、电话交易等)等进行基金交易的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、基金赎回费率和基金转换费率。

(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,包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用;

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)费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后,可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率等费率,须召开基金份额持有人大会审议;调低基金管理费率、基金托管费率等费率,无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前2日在至少一种指定媒体和基金管理人网站上公告。

(六)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。

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》、《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及有关财务数据的截止日期。
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"十一、基金的投资"部分内容进行了更新。
6、对"十二、基金的业绩"内容进行了更新。
7、对"二十四、其他应披露事项"内容进行了更新。

鹏华基金管理有限公司
2014年11月

(上接B027版)

九、基金的业绩比较标准

本基金的整体业绩比较基准采用:

中债企业债总指数

如果上述基准指数停止计算编制或更改名称,或者今后法律法规发生变化,又或者市场推出更具权威、且更能够表征本基金风险收益特征的指数,则本基金管理人将视情况经与本基金托管人协商同意后调整本基金的业绩评价基准并报中国证监会备案,并及时公告,但不需要召开基金份额持有人大会。

十、基金的风险收益特征

本基金是一只债券型基金,在证券投资基金中属于中等风险的品种,其长期平均风险和预期收益高于货币市场基金,低于股票型基金。

十一、基金投资组合报告

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。

本基金托管人中国建设银行根据本基金合同规定,于2014年10月23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。

本报告期为2014年7月1日至2014年9月30日。本报告财务资料未经审计师审计。

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	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	1,415,115,887.55	93.69
	其中:债券	1,415,115,887.55	93.69
	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	64,818,021.52	4.29
7	其他资产	30,421,284.48	2.01
8	合计	1,510,355,193.55	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

4、报告期末按债券品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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	60,144,000.00	5.80
	其中:政策性金融债	60,144,000.00	5.80
4	企业债券	875,898,393.35	84.50
5	企业短期融资券	50,148,000.00	4.84
6	中期票据	161,387,000.00	15.57
7	可转债	267,538,494.20	25.81
8	其他	-	-
9	合计	1,415,115,887.55	136.51

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

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	1480265	14象山债	600,000	62,754,000.00	6.05
2	140204	14国开04	600,000	60,144,000.00	5.80
3	124818	14常德源	600,000	59,982,904.11	5.79
4	113005	平安转债	545,000	59,650,250.00	5.75
5	1280122	12荆州城投债	500,000	52,505,000.00	5.07

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

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

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

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

11、投资组合报告附注

(1) 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

(2)本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

(3)其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	100,352.50
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	30,169,702.49
5	应收申购款	151,229.49
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	30,421,284.48

(4)报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113005	平安转债	59,650,250.00	5.75
2	113003	重工转债	41,052,000.00	3.96
3	110024	隧道转债	37,625,444.80	3.63
4	110015	石化转债	27,257,500.00	2.63
5	110018	国电转债	23,544,000.00	2.27
6	113002	工行转债	21,774,000.00	2.10

(5)报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

(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。

十二、基金的业绩

基金业绩截止日为2014年9月30日,所载财务数据未经审计师审计。

基金管理