

鹏华深证民营交易型开放式指数
证券投资基金联接基金更新的
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

二零一二年四月

重要提示

本基金经 2011 年 6 月 20 日中国证券监督管理委员会下发的《关于核准深证民营交易型开放式指数证券投资基金及联接基金募集的批复》（证监许可[2011]969 号文）核准，进行募集。根据相关法律法规，本基金基金合同已于 2011 年 9 月 2 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核准，但中国证监会对本基金募集的核准，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。

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，投资人在投资本基金前，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、本基金特有风险及其他风险，等等。

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。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。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。

本招募说明书与基金托管人相关信息更新部分已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为 2012 年 3 月 1 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2011 年 12 月 31 日（未经审计）。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：鹏华基金管理有限公司

住所：深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心 43 层

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

邮政编码：518048

法定代表人：何如

成立时间：1998 年 12 月 22 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字[1998]31 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：壹亿伍仟万元

存续期间：持续经营

联系电话：0755-82021102

传真：0755-82021155

联系人：梁静

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。

胡继之先生，董事，金融学博士，高级经济师，国籍：中国。历任中国人民银行武汉市分行办公室科长、金融研究所副所长、所长，中国人民银行深圳分行办公室负责人，深圳证券交易所总经理助理兼办公室主任、理事会秘书长、策划总监、纪委书记、党委委员、副总经理，现任国信证券股份有限公司总裁、党委副书记。

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，现任国信证券股份有限公司副总裁。

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、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，现任欧利盛资本股份公司（Eurizon Capital S.A.）（卢森堡）首席执行官和总经理，同时兼任欧利盛 AI 资产管理股份公司（Eurizon AI SGR）首席执行官。

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、北京市人民政府顾问。

李相启先生，独立董事，高级经济师、研究员，国籍：中国。历任陕西省委办公厅秘书、省委政策研究室财贸处处长、副主任，陕西省经济体制改革委员会副书记、副主任、党组书记、主任，陕西省证券监管委员会主席，中国证监会济南证管办党委书记、主任、济南稽查局局长，山东证监局局长，上海证券交易所理事会理事、产品委员会主任。

宋泓先生，独立董事，经济学博士，国籍：中国。曾在美国哥伦比亚大学作访问学者，并在陕西省社科院工作，现任中国社会科学院世界经济与政治研究所国际贸易研究室主任、研究员、教授、博士生导师。

黄善端，独立董事，法学硕士，国籍：中国。历任澳门科技大学法学院中国民商事法律讲师，李陈郑律师行中国事务顾问，杜威路博国际律师事务所香港办事处中国事务理事，广东竞德律师事务所律师，现任广东海埠律师事务所涉外法律总监。

2、基金管理人监事会成员

孙枫先生，监事会主席，国际金融专业硕士，高级会计师，中国注册会计师，国籍：中国。历任武汉市经济研究所副所长，武汉市轻工业局副局长，武汉友谊复印机制造公司副经理，深圳市财政局企财处处长、办公室主任、副局长，深圳市商业银行董事长、党委书记，深圳发展银行董事长、党委书记，鹏华基金管理有限公司董事长、党总支书记，现任鹏华基金管理有限公司监事会主席。

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。

黄俞先生，监事，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，现任深圳市北融信投资发展有限公司董事长。

苏波先生，职工监事，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投研部研究员、客户服务主管、西部理财中心总经理、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；2008年11月加盟鹏华基金管理有限公司，现任鹏华基金管理有限公司机构理财部总经理。

刘慧红女士，职工监事，本科学历，国籍：中国。曾在中国工商银行深圳分行、平安证券公司工作，1998年12月加盟鹏华基金管理有限公司，现任鹏华基金管理有限公司登记结算部副总经理。

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，总裁，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。

高阳先生，副总裁，经济学硕士，CFA，国籍：中国。历任中国国际金融有限公司债券投资经理，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。

曹毅先生，副总裁，经济学博士，国籍：中国。历任中国人民银行广州分行科员，中国人民银行深圳中心支行副主任科员，南方基金管理有限公司市场拓展部副总监、渠道部总监，现任鹏华基金管理有限公司副总裁。

胡湘先生，副总裁，经济学硕士，国籍：中国。历任全国社会保障基金理事会投资部、境外投资部副主任科员、主任科员、副处长，鹏华基金管理有限公司总裁助理，现任鹏华基金管理有限公司副总裁。

毕国强先生，副总裁，特许金融分析师（CFA），工商管理硕士（MBA），国籍：中国。历任广州文冲船厂经营部船舶科科长、美国景顺集团(Invesco Ltd.)加拿大 AIM Trimark 投资管理有限公司分析师，中国证监会基金监管部四处调研员，鹏华基金管理有限公司总裁助理，现任鹏华基金管理有限公司副总裁。

高鹏先生，督察长，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。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

方南先生，国籍中国，工商管理硕士，10年证券从业经验。曾任职于杭州恒生电子股份有限公司，上海新利多数字技术有限公司。2001年11月加盟鹏华基金管理有限公司，历任金融工程部（原）研究员、金融工程部（原）总经理助理、鹏华沪深300指数证券投资基金（LOF）基金经理助理。2010年2月至今担任鹏华中证500指数证券投资基金（LOF）基金经理，2010年8月至今兼任鹏华上证民企50ETF基金及其联接基金基金经理，2011年9月起兼任鹏华深证民营ETF基金及其联接基金基金经理。方南先生具备基金从业资格。

本基金历任的基金经理：

2011年9月基金合同生效至今由方南先生担任本基金基金经理。

本基金基金经理管理其它基金情况：

2010年2月至今由方南先生担任鹏华中证500指数基金基金经理。

2010年8月至今兼任鹏华上证民企50ETF基金及其联接基金基金经理。

2011年9月起兼任鹏华深证民营ETF基金基金经理。

本报告期内本基金基金经理未发生变更。

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总裁、党总支部书记。

高阳先生，鹏华基金管理有限公司副总裁。

冀洪涛先生，鹏华基金管理有限公司机构投资部总经理、鹏华社保基金组合投资经理。

程世杰先生，鹏华基金管理有限公司基金管理部总经理、鹏华价值优势基金基金经理。

黄鑫先生，鹏华基金管理有限公司基金管理部副总经理，鹏华动力增长基金基金经理。

初冬女士，鹏华基金管理有限公司固定收益部总经理，鹏华社保基金组合投资经理、鹏华货币市场基金经理和丰盛债券基金基金经理。

杨俊先生，鹏华基金管理有限公司研究部总经理、鹏华普惠基金基金经理。

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：贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元

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：尹 东

联系电话：(010) 6759 5003

中国建设银行股份有限公司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2011年9月30日，中国建设银行资产总额117,723.30亿元，较上年末增长8.90%。截至2011年9月30日止九个月，中国建设银行实现净利润1,392.07亿元，较上年同期增长25.82%。年化平均资产回报率为1.64%，年化加权平均净资产收益率为24.82%。利息净收入2,230.10亿元，较上年同期增长22.41%。净利差为2.56%，净利息收益率为2.68%，分别较上年同期提高0.21和0.23个百分点。手续费及佣金净收入687.92亿元，较上年同期增长41.31%。

中国建设银行在中国内地设有1.3万余个分支机构，并在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京、首尔、纽约、胡志明市及悉尼设有分行，在莫斯科、台北设有代表处，海外机构已覆盖到全球13个国家和地区，基本完成在全球主要金融中心的网络布局，24小时不间断服务能力和基本服务架构已初步形成。中国建设银行筹建、设立村镇银行33家，拥有建行亚洲、建银国际，建行伦敦、建信基金、建信金融租赁、建信信托、建信人寿、中德住房储蓄银行等多家子公司，为客户提供一体化全面金融服务能力进一步增强。

中国建设银行得到市场和业界的支持和广泛认可。2011年上半年，中国建设银行主要国际排名位次持续上升，先后荣获国内外知名机构授予的50多个重要奖项。中国建设银行在英国《银行家》2011年“世界银行品牌500强”中位列第10，较去年上升3位；在美国《财富》世界500强中排名第108位，较去年上升8位。中国建设银行连续第三年获得香港《亚洲公司治理》杂志颁发的“亚洲企业管治年度大奖”，先后摘得《亚洲金融》、《财资》、

《欧洲货币》等颁发的“中国最佳银行”、“中国国内最佳银行”与“中国最佳私人银行”等奖项。

中国建设银行总行设投资托管服务部，下设综合制度处、基金市场处、资产托管处、QFII 托管处、基金核算处、基金清算处、监督稽核处和投资托管团队、涉外资产核算团队、养老金托管服务团队、养老金托管市场团队、上海备份中心等 12 个职能处室、团队，现有员工 130 余人。自 2008 年以来中国建设银行托管业务持续通过 SAS70 审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

（二）主要人员情况

杨新丰，投资托管服务部副总经理（主持工作），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，投资托管服务部副总经理，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，投资托管服务部副总经理，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。

（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 2011 年 12 月 31 日，中国建设银行已托管 224 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。2011 年，中国建设银行以总分第一的成绩被国际权威杂志《全球托管人》评为 2011 年度“中国最佳托管银行”；并获和讯网 2011 年中国“最佳资产托管银行”奖。

三、相关服务机构

(一) 基金销售机构

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

联系电话：0755-82021102

传真：0755-82021155

联系人：梁静

(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 号金融街中心南楼 502 房

联系电话：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：上海市浦东新区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 801B 室

联系电话：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

联系电话：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：广州市天河区珠江新城华夏路 10 号富力中心 24 楼 07 单元

联系电话：020-38927993

传真：020-38927990

联系人：蔡颖

2、代销机构

(1) 代销银行

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

法定代表人：王洪章

联系人：何奕

客户服务电话：95533

传真：010-66275654

网址：www.ccb.com

2) 中国工商银行股份有限公司

注册（办公）地址：北京复兴门内大街 55 号

法定代表人：姜建清

客户服务电话：95588（全国）

传真：010-66107913

联系人：查樱

网址：www.icbc.com.cn

3) 中国农业银行股份有限公司

注册（办公）地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：蒋超良

客户服务电话：95599

联系人：张令玮

网址：www.95599.cn

4) 中国银行股份有限公司

注册地址：北京市复兴门内大街 1 号

办公地址：北京市复兴门内大街 1 号

法定代表人：肖钢

统一客户服务电话：95566

公司网站：www.boc.cn

5) 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：胡怀邦

电话：021-58781234

传真：021-58408483

联系人：韩璞

客户服务电话：95559

网址：www.bankcomm.com

6) 中国邮政储蓄银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 3 号

办公地址：北京市西城区金融大街 3 号

法定代表人：李国华

客户服务电话：95580

联系人：陈春林

传真：（010）68858117

公司网址：www.psbc.com

7) 中信银行股份有限公司

地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

法定代表人：田国立

联系人：丰靖

客服电话：95558

网站：<http://bank.ecitic.com>

8) 深圳发展银行股份有限公司

注册（办公）地址：深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦

法定代表人：肖遂宁

联系人：张青

电话：0755-82088888

传真：0755-82080406

客服电话：95501

网址：www.sdb.com.cn

9) 平安银行股份有限公司

注册（办公）地址：深圳市深南中路 1099 号平安银行大厦

法定代表人：孙建一

联系人：芮蕊

电话：0755-25879756

客服电话：95511-3

网址：<http://bank.pingan.com/>

10) 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：宁黎明

开放式基金咨询电话：021-962888

开放式基金业务传真：021-68476111

联系人：夏雪

网址：www.bankofshanghai.com

11) 中国民生银行股份有限公司

注册（办公）地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：董文标

客户服务电话：95568

联系人：董云巍

传真：010-58560666

网址：www.cmbc.com.cn

12) 上海浦东发展银行股份有限公司

注册（办公）地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：吉晓辉

客户服务热线：95528

联系人：唐苑

公司网站：www.spdb.com.cn

13) 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

办公地址：广东省东莞市旗峰路 2 号

法定代表人：何沛良

联系人：何茂才

客户服务电话：961122

网址：www.drcbank.com

14) 广发银行股份有限公司

注册（办公）地址：广州市东风东路 713 号

法定代表人：董建岳

联系人：李静筠

客服电话：400-830-8003

网址：www.gdb.com.cn

15) 杭州银行股份有限公司

地址：杭州市庆春路 46 号杭州银行大厦

法定代表人：吴太普

联系人：严峻

客户服务电话：0571-96523, 4008888508

网址：www.hzbank.com.cn

16) 大连银行股份有限公司

注册地址：大连市中山区中山路 88 号天安国际大厦 49 楼

办公地址：大连市中山区中山路 88 号天安国际大厦 9 楼

法定代表人：陈占维

联系人：李鹏

客户服务电话：4006640099

网址：<http://www.bankofdl.com/>

17) 浙江民泰商业银行股份有限公司

办公地址：温岭市三星大道 168 号

法定代表人：江建法

客户服务电话：4008896521

联系人：刘兴龙

网址：www.mintaibank.com

18) 徽商银行股份有限公司

住所：合肥市安庆路 79 号天徽大厦 A 座

法定代表人：王晓昕

办公地址：合肥市安庆路 79 号天徽大厦 A 座

客户服务电话：4008896588(安徽省外)、96588(安徽省内)

网址：www.hsbank.com.cn

(2) 代销券商

(1) 海通证券股份有限公司

住所：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

(2) 国信证券股份有限公司

住所：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：齐晓燕

客户服务电话：95536

网址：www.guosen.com.cn

(3) 光大证券股份有限公司

住所：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：徐浩明

联系电话：021-22169081

传真：021-68817271

联系人：刘晨

客户服务电话：95525

公司网站：www.ebscn.com

(4) 中国银河证券股份有限公司

住所：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：顾伟国

联系电话：010-66568430

传真：010-66568532

联系人：田薇

网址：www.chinastock.com.cn

(5) 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 4 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：许梦园

传真：010-65182261

客服电话：4008888108

公司网站：www.csc108.com

(6) 招商证券股份有限公司

住所：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

法定代表人：宫少林

联系电话：0755-82960223

联系人：林生迎

客户服务电话：95565

网址：www.newone.com.cn

(7) 齐鲁证券有限公司

住所：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：王霖

客户服务电话：95538

网址：www.qlzq.com.cn

(8) 方正证券股份有限公司

住所：湖南长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦 22-24 层

办公地址：湖南长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦 22-24 层

法定代表人：雷杰

联系人：郭军瑞

联系电话：0731-85832503

客户服务电话：95571

网址：www.foundersc.com

(9) 兴业证券股份有限公司

住所：福州市湖东路268号

法定代表人：兰荣

办公地址：浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼21层

联系电话：021-38565785

传真：021-38565955

联系人：谢高得

客户服务电话：95562

网址：www.xyzq.com.cn

(10) 渤海证券股份有限公司

住所：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：天津市南开区滨水西道8号

法定代表人：杜庆平

联系人：王兆权

联系电话：022-28451861

传真 022-28451892

网址: www.bhzq.com

(11) 宏源证券股份有限公司

住所: 新疆乌鲁木齐市文艺路 233 号

办公地址: 北京市西城区太平桥大街 19 号

法定代表人: 冯戎

联系电话: 010-88085201

联系人: 李巍

客户服务电话: 4008-000-562

网址: www.hysec.com

(12) 申银万国股份有限公司

住所: 上海市常熟路 171 号

办公地址: 上海市常熟路 171 号

法定代表人: 丁国荣

联系电话: 021-54047892

联系人: 曹晔

客户服务电话: 95523 或 4008895523

电话委托: 021-962505

网址: www.sywg.com

(13) 广发证券股份有限公司

住所: 广州天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼 (4301-4316 房)

办公地址: 广东省广州天河北路大都会广场 5、18、19、36、38、41、42 楼

法定代表人: 林治海

联系人: 黄岚

联系电话: 020-87555888

传真: 020-87553600

客服电话: 95575

网址: www.gf.com.cn

(14) 国泰君安证券股份有限公司

住所：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

(15) 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：上武汉市新华路特8号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

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

(16) 中信证券股份有限公司

住所：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

(17) 安信证券股份有限公司

住所：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

(18) 长城证券有限责任公司

住所：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、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：李春芳

网址：www.ccl68.com.cn

(19) 华泰联合证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第五层

办公地址：深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第五层

法定代表人：马昭明

电话：0755-82492000

传真：0755-82492962

客户服务热线：95513

联系人：盛宗凌

公司网址：www.lhzq.com

(20) 华西证券有限责任公司

注册地址：四川省成都市陕西街239号

办公地址：深圳市深南大道4001号时代金融中心18楼

法定代表人：杨炯洋

联系人：金达勇

联系电话：028-86137782

传真：028-86150615

客户服务咨询电话：400-8888-818

网址：www.hx168.com.cn

(21) 华泰证券股份有限公司

住所：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦

办公地址：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦

法定代表人：吴万善

联系电话：025-83290575

联系人：张威

网址：www.htsc.com.cn

(22) 东北证券股份有限公司

住所：长春市自由大路1138号

办公地址：长春市自由大路1138号

法定代表人：矫正中

联系电话：0431-85096709

传真：0431-85096795

联系人：潘锴

网址：www.nesc.cn

(23) 上海证券有限责任公司

住所：上海市黄浦区西藏中路336号

办公地址：上海市黄浦区西藏中路336号

法定代表人：郁忠民

联系电话：021-53519888

传真：021-65081434

联系人：刘乔

客服热线：4008-918-918

公司网站：www.962518.com

(24) 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

网站：www.pingan.com

(25) 山西证券股份有限公司

注册地址：太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼

办公地址：太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼

法定代表人：侯巍

联系电话：0351—8686659

联系人：郭熠

网址：www.i618.com.cn

客服电话：400-666-1618、95573

(26) 东莞证券有限责任公司

住所：广东省东莞市莞城区可园南路1 号金源中心30 楼

办公地址：广东省东莞市莞城区可园南路1 号金源中心30 楼

法定代表人：张运勇

联系人：张巧玲

联系电话：0769-22119426

公司网址：www.dgzq.com.cn

(27) 财富证券有限责任公司

住所：长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26层

地址：长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26层

法定代表人：周晖

联系电话：0731-84403319

传真：0731-84403439

联系人：郭磊

客户服务热线：0731-84403343

网址：www.cfzq.com

(28) 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

法定代表人：高冠江

联系人：唐静

联系电话：010-63080985

客服热线：400-800-8899

网址：www.cindasc.com

(29) 财通证券有限责任公司

注册地址：杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心

办公地址：杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心

法定代表人：沈继宁

联系人：乔骏

联系电话：0571-87925129

客户服务电话：96336（上海地区：962336）

网址：www.ctsec.com

(30) 广州证券有限责任公司

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19、20楼

邮政编码：510623

法定代表人：刘东

公司总机：020-88836999

传真号码：020-88836654

客服热线：961303

网址：www.gzs.com.cn

(31) 爱建证券有限责任公司

注册地址：上海市南京西路758号23楼

办公地址：上海市南京西路758号20-25楼

法定代表：郭林

联系人：陈敏

电话：021-62171984

传真：021-62878783

服务热线：021-63340678

公司网站：www.ajzq.com

(32) 东吴证券股份有限公司

注册地址：苏州工业园区翠园路 181 号

办公地址：苏州工业园区翠园路 181 号

法定代表人：吴永敏

电话：0512-65581136

传真：0512-65588021

联系人：方晓丹

客户服务热线：0512-33396288

网址：www.dwzq.com.cn

(33) 江海证券有限公司

注册地址：哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

办公地址：哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

法定代表人：孙名扬

联系人：张宇宏

联系电话：0451-82336863

客服热线：4006662288

网址：www.jhzq.com.cn

(34) 华福证券有限责任公司

注册地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层

办公地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7 至 10 层

法定代表人：黄金琳

邮政编码：350003

联系人：张腾

联系电话：0591-87383623

业务传真：0591-87383610

统一客户服务电话：96326（福建省外请先拨 0591）。

公司网址: www.hfzq.com.cn

(35) 万联证券有限责任公司

注册地址: 广州市中山二路18号电信广场36、37层

办公地址: 广州市中山二路18号电信广场36、37层

法定代表人: 张建军

联系人: 罗创斌

联系电话: 020-37865070

客户服务电话: 400-8888-133

网址: www.wlzq.com.cn

36) 中信万通证券有限责任公司

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: 张智河

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

37) 中信证券(浙江)有限责任公司(原中信金通证券有限责任公司)

注册地址: 浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19层、20层

办公地址: 浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19层、20层

法定代表人: 沈强

联系人: 丁思聪

联系电话: 0571-87112510

传真: 0571-87696598

客户服务电话: 0571-96598

网址: www.bigsun.com.cn

38) 五矿证券有限公司

住所: 深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心办公室47层01单元

办公地址：深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心办公室47层01单元

法定代表人：高竹

联系电话：0755-82545555

传真：0755-82545500

联系人：赖君伟

网址：www.wkzq.com.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代理销售本基金或变更上述代销机构，并及时公告。

（二）注册登记机构

鹏华基金管理有限公司

住所：深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心 43 层

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

法定代表人：何如

联系电话：0755-82021109

传真：0755-82021146

联系人：潘艳梅

（三）律师事务所

北京市金杜律师事务所

住所：北京市朝阳区东三环中路 7 号北京财富中心写字楼 A 座 40 层

办公地址：北京市朝阳区东三环中路 7 号北京财富中心写字楼 A 座 40 层

负责人：王玲

联系电话：0755-22163333

传真：0755-22163390

联系人：宋萍萍

经办律师：靳庆军、宋萍萍

（四）会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所有限公司

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：金毅

经办会计师：薛竞、金毅

四、基金的名称

本基金名称：鹏华深证民营交易型开放式指数证券投资基金联接基金

五、基金的类型

本基金类型：契约型开放式，ETF 联接基金

六、基金的投资目标

通过投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

七、基金的投资范围

本基金主要投资于目标 ETF（投资比例不低于基金资产净值的 90%）、标的指数成份股及其备选成份股，并保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券。此外，为更好的实现投资目标，本基金将少量投资于非标的指数成份股（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、新股（首次发行或增发等）及法律法规和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允许，基金管理人可以在履行适当程序后调整上述投资范围，或将新出现的允许基金投资的其他品种纳入投资范围。

八、基金的投资策略

本基金为被动式指数基金，以目标 ETF 作为主要投资标的，方便特定客户群通过本基金投资目标 ETF。本基金不参与目标 ETF 的管理。

本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过 0.3%，年跟踪误差不得超过 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、投资组合的构建

构建基金投资组合的过程主要分为三步：确定目标组合、制定建仓策略和逐步调整组合。

本基金通过投资于目标 ETF 跟踪标的指数，主要投资范围为目标 ETF、标的指数成份股及其备选成份股。基金管理人将对目标 ETF 份额流动性、目标 ETF 份额折溢价、以及标的指

数成份股的流动性和交易成本等因素进行分析，制定合理的建仓策略，并在基金合同生效之日起 3 个月内达到合同约定的投资比例。此后，如因标的指数成份股调整、基金申购或赎回带来现金等因素导致基金不符合这一投资比例的，基金管理人将在 10 个工作日内进行调整。

2、目标 ETF 的投资方式

本基金投资目标 ETF 的两种方式如下：

(1) 一级市场申购和赎回：目标 ETF 开放申购赎回后，通过其申购赎回代理券商以组合证券进行申购赎回。

(2) 二级市场买入和卖出：目标 ETF 上市交易后，通过深圳证券交易所会员机构在二级市场进行目标 ETF 份额的交易。

在遵守深圳证券交易所相关规定的前提下，基金将综合考虑上述两种方式的价格因素，以及基金规模、市场交易量等其他相关因素，选择合适的方式投资目标 ETF。当目标 ETF 申购、赎回或交易模式进行了变更或调整后，本基金也将作相应的变更或调整。

3、目标 ETF 的调整

本基金将根据开放日申购和赎回情况，决定投资目标 ETF 的时间和方式。

(1) 当收到净申购时，基金将根据净申购规模及仓位情况，决定股票组合的构建、目标 ETF 的申购或买入等；

(2) 当收到净赎回时，基金将根据净赎回规模及仓位情况，决定目标 ETF 的赎回或卖出等；

4、标的指数成份股、备选成份股投资策略

本基金对标的指数成份股、备选成份股的投资目的是为准备构建股票组合以申购目标 ETF。因此对投资于标的指数成份股、备选成份股的资金头寸按照完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

5、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。基金的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。

九、基金的业绩比较基准

深证民营价格指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%

深证民营价格指数挑选深圳证券市场规模大、流动性好、具有代表性的 100 家民营上市公司股票为样本，选样时综合考虑股票的流通市值及成交金额，能够较好的反映深圳证券市场上民营企业股票价格变动的趋势，并向投资者提供投资标的。

标的指数发生变更时，业绩比较基准随之发生变更，基金管理人应在取得基金托管人同意后，报中国证监会备案并公告。

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预期风险、较高预期收益的品种。同时本基金为 ETF 联接基金，通过投资于目标 ETF 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。

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。

本基金的托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，已于 2012 年 1 月 16 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 2011 年 12 月 31 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	672,018.92	0.41
	其中：股票	672,018.92	0.41
2	基金投资	150,637,529.55	92.81
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
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	8,533,992.16	5.26
7	其他资产	2,455,817.66	1.51
8	合计	162,299,358.29	100.00

2、报告期末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	30,887.00	0.02
B	采掘业	-	-
C	制造业	358,135.92	0.22
C0	食品、饮料	15,206.00	0.01
C1	纺织、服装、皮毛	14,830.00	0.01
C2	木材、家具	1,976.00	0.00
C3	造纸、印刷	8,017.00	0.00
C4	石油、化学、塑胶、塑料	31,274.00	0.02
C5	电子	8,287.00	0.01
C6	金属、非金属	7,809.00	0.00
C7	机械、设备、仪表	189,736.92	0.12
C8	医药、生物制品	78,428.00	0.05
C99	其他制造业	2,572.00	0.00
D	电力、煤气及水的生产和供应业	14,420.00	0.01
E	建筑业	10,426.00	0.01
F	交通运输、仓储业	2,604.00	0.00
G	信息技术业	72,002.00	0.04
H	批发和零售贸易	60,744.00	0.04
I	金融、保险业	37,400.00	0.02
J	房地产业	35,555.00	0.02
K	社会服务业	16,520.00	0.01
L	传播与文化产业	7,905.00	0.00

M	综合类	25,420.00	0.02
	合计	672,018.92	0.42

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

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	000816	江淮动力	9,198	64,753.92	0.04
2	002024	苏宁电器	5,700	48,108.00	0.03
3	000063	中兴通讯	2,300	38,870.00	0.02
4	000527	美的电器	2,400	29,376.00	0.02
5	000776	广发证券	1,100	23,100.00	0.01
6	000783	长江证券	2,000	14,300.00	0.01
7	000623	吉林敖东	700	14,273.00	0.01
8	000009	中国宝安	1,300	14,170.00	0.01
9	002422	科伦药业	300	13,020.00	0.01
10	002073	软控股份	800	12,104.00	0.01

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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

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十名基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值(人民币 元)	占基金 资产净 值比例 (%)
----	------	------	------	-----	----------------	--------------------------

1	深证民营交易 型开放式指数 证券投资基金	股票型基 金	交易型开放 式	鹏华基金管 理有限公司	150,637,529.55	93.05
---	----------------------------	-----------	------------	----------------	----------------	-------

注：上述基金明细为本基金本报告期末持有的全部基金。

9、投资组合报告附注

(1) 2011年6月15日，本基金投资的前十名证券之一的中国宝安的发行主体中国宝安集团股份有限公司公告了深交所处分决定的有关内容。

本基金是ETF联接基金，主要投资于目标ETF（投资比例不低于基金资产净值的90%）、标的指数成份股及其备选成份股，而此股票是深证民营价格指数成份股，属于投资范围，按产品特点和投资要求在基金成立后（2011-9-2成立），对此股票进行了投资，投资该股票的决策程序符合相关法律法规的要求。

报告期内本基金投资的前十名证券中的其他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、处罚的股票。

(2) 报告期内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	2,453,054.82
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,762.84
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,455,817.66

(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) 报告期末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	000816	江淮动力	64,753.92	0.04	筹划重大资产重组事项

(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，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

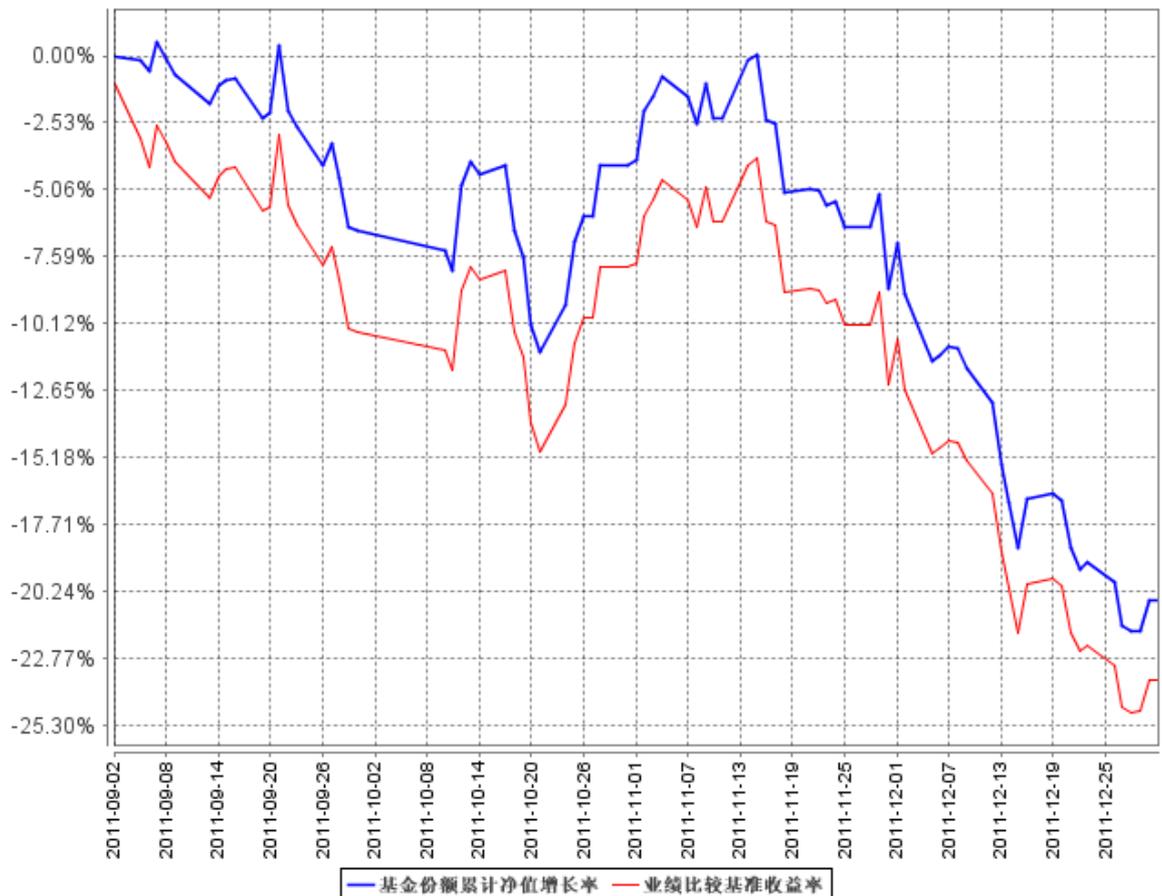
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资人在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

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（本报告中列财务数据未经审计）：

成立时间	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
自基金合同生效至 2011年12月31日	-20.54%	1.45%	-23.56%	1.51%	3.02%	-0.06%

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：

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、鹏华深证民营交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同于 2011 年 9 月 2 日生效；

注 2：业绩比较基准=深证民营价格指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%；

注 3：本基金业绩截止日为 2011 年 12 月 31 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、基金财产划拨支付的银行费用；
- 4、基金合同生效后的基金信息披露费用；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、依法可以在基金财产中列支的其他费用。

(二) 上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

(三) 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

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值扣除所持有的目标 ETF 份额部分基金资产后的余额（若为负值，则取零）的 0.5% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值扣除所持有的目标 ETF 份额部分基金资产后的余额，若为负值，则取零

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 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、休息日，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值扣除所持有的目标 ETF 份额部分基金资产后的余额（若为负值，则取零）的 0.1% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值扣除所持有的目标 ETF 份额部分基金资产后的余额，若为负值，则取零

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

3、除管理费和托管费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

(四) 与基金销售有关的费用

1、申购费

本基金的申购费率最高不超过申购金额的 5%，投资人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 1000 元

申购费用由投资人承担，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

本基金的赎回费率最高不超过赎回金额的 5%，且随投资人持有基金份额期限的增加而减少。

本基金赎回费率如下表（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，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

3、基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并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体上公告。

4、基金管理人可以在不违反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人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必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

5、基金管理人可以根据相关法律法规以及基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的、且由同一注册登记机构办理注册登记的其他基金之间的转换业务，具体转换业务规则、转换费率和计算公式等参见基金管理人于 2011 年 9 月 23 日发布的《鹏华深证民营交易型

开放式指数证券投资基金联接基金关于开放申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告》。

（五）不列入基金费用的项目

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费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

（六）基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日 2 日前在指定媒体上刊登公告。

（七）基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

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，本基金管理人对本基金原公告的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“六、基金的募集与基金合同生效”内容进行了更新。
- 6、对“七、基金份额的申购与赎回”部分内容进行了更新。
- 7、在“八、基金的投资”一章，增加了投资组合报告的相关内容，数据截至日期为 2011 年 12 月 31 日。
- 8、新增了“九、基金的业绩”一章的投资业绩内容，数据截至日期为 2011 年 12 月 31 日。
- 9、对“十五、基金的信息披露”部分内容进行了更新。
- 10、对“十九、基金托管协议的内容摘要”部分内容进行了更新。

11、鉴于本基金管理人投资者服务方面措施的进一步提升，在“二十、对基金份额持有人的服务”一章，更新了服务中的相关内容。

12、对“二十一、其他应披露事项”一章内容进行了更新。

鹏华基金管理有限公司

2012年4月14日