

# 鹏华中证医药卫生指数证券投资基金（LOF）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

登记机构：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：2016年8月1日

公告日期：2016年7月27日

## 目录

- 一、 重要声明与提示 3
- 二、 基金概览 3
- 三、 基金的历史、转型及折算结果、上市交易和跨系统转托管 3
- 四、 持有人户数、持有人结构及场内前十名持有人 5
- 五、 基金主要当事人简介 6
- 六、 基金合同摘要 12
- 七、 基金财务状况 12
- 八、 基金投资组合 13
- 九、 重大事件揭示 16
- 十、 基金管理人承诺 16

十一、 基金托管人承诺 17

十二、 基金上市推荐人意见 17

十三、 备查文件目录 17

附件：鹏华中证医药卫生指数证券投资基金（LOF）基金合同摘要 19

一、 重要声明与提示鹏华中证医药卫生指数证券投资基金（LOF）（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<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。

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2016年7月15日刊登在《上海证券报》和本公司指定销售机构网站上的《鹏华中证医药卫生指数证券投资基金（LOF）招募说明书》。

二、 基金概览 1、基金名称：鹏华中证医药卫生指数证券投资基金（LOF）

2、基金类型：指数型

3、基金运作方式：契约型开放式

4、本基金的存续期限为不定期。

5、基金份额总额：截至2016年7月25日，本基金的基金份额总额为33,311,344.42份

6、基金份额净值：截至 2016 年 7 月 25 日，本基金的基金份额净值为 0.991 元

7、本次上市交易的基金份额简称及其基金代码：基金简称：医药基金，基金代码：160635

8、本次上市交易的基金份额总额：5,681,747 份

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：2016 年 8 月 1 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、基金的历史、转型及折算结果、上市交易和跨系统转托管（一）本基金的历史

鹏华中证医药卫生指数证券投资基金（LOF）由鹏华中证医药卫生指数分级证券投资基金转型而成。

鹏华中证医药卫生指数分级证券投资基金于 2015 年 3 月 31 日获中国证监会证监行政许可【2015】501 号文注册募集。

鹏华中证医药卫生指数分级证券投资基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。基金管理人于 2015 年 8 月 17 日获得中国证监会书面确认，鹏华中证医药卫生指数分级证券投资基金基金合同生效，基金募集规模 234,682,431.87 份。

#### （二）本基金的转型及折算

鹏华中证医药卫生指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会证监许可【2016】1122 号文准予变更注册，于 2016 年 6 月 18 日起至 2016 年 7 月 6 日 17:00 止以通讯方式召开了鹏华中证医药卫生指数分级证券投资基金基金份额持有人大会，审议并通过了《关于鹏华中证医药卫生指数分级证券投资基金转型并修改基金合同等相关事项的议案》。自 2016 年 7 月 15 日起，原《鹏华中证医药卫生指数分级证

券投资基金基金合同》失效，《鹏华中证医药卫生指数证券投资基金（LOF）基金合同》生效。

根据《鹏华中证医药卫生指数分级证券投资基金基金合同》、《关于鹏华中证医药卫生指数分级证券投资基金转型并修改基金合同等相关事项的议案》、《鹏华基金管理有限公司关于鹏华中证医药卫生指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》的相关内容以及深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定，鹏华基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）和本基金的托管人中国建设银行股份有限公司以2016年7月14日为本基金分级份额终止运作折算基准日，对在该日交易结束后登记在册的鹏华医药A份额（基金代码为：“150239”，基金场内简称为：“医药A级”）和鹏华医药B份额（基金代码为：“150240”，基金场内简称为：“医药B级”）实施了分级份额终止运作份额折算，将鹏华医药A份额和鹏华医药B份额折算为鹏华医药份额（基金代码为：“160635”，基金场内简称为：“医药分级”）的场内份额。

基金管理人于2016年7月18日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、深圳证券交易所网站及本基金管理人网站上披露了《关于鹏华中证医药卫生指数分级证券投资基金基金份额折算结果的公告》。

### （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[2016]479号
- 2、上市交易日期：2016年8月1日
- 3、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所
- 4、基金简称：鹏华医药指数（LOF） 场内简称：医药基金
- 5、交易代码：160635
- 6、本次上市交易份额：5,681,747份（截至2016年7月25日）
- 7、基金资产净值的披露：每个工作日的次日公布鹏华中证医药卫生指数证券投资基金（LOF）的基金份额净值，并在深圳证券交易所行情发布系

统揭示。

8、未上市交易份额的流通规定：未上市交易的份额托管在场外，基金份额持有人将其转托管至深圳证券交易所场内后即可上市流通。

（四）本基金转托管的主要内容：为了保证基金份额持有人的利益，本基金管理人已向深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司提出申请，为基金份额持有人从2016年8月1日起开通转托管业务的办理事宜。

#### 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2016年7月25日，医药基金的持有人总户数1861户，其中场外持有人总户数1812户，场内持有人总户数49户，平均每户持有的场内基金份额：115,954.02份。

场内机构投资者持有的基金份额及占场内基金总份额比例：机构持有3,272,652份，占57.60% 场内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2,409,095份，占42.40%

（二）截至2016年7月25日，场内医药基金基金份额前十名持有人情况：

序号 持有人名称 持有医药基金份额 占医药基金份额比(%)

1 东方汇智—光大银行—东方汇智—中邮鹏华鸿达量化1号资产管理计划 3,272,648 57.60%

2 刘喜生 449,986 7.92%

3 高雯 180,005 3.17%

4 许三妹 180,000 3.17%

5 李始峰 179,999 3.17%

6 崔华玉 179,501 3.17%

7 刘淑梅 170,436 3.00%

8 王俊鸿 90,673 1.60%

9 韩璞 90,659 1.60%

10 吴翔 90,652 1.60%

合计 4,884,559 86.00%

(三) 截至 2016 年 7 月 25 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%。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 0.00 份。

注:以上信息依据中国证券登记结算有限责任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股份有限公司、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:

#### 权益投资一部

负责公司公募基金产品、社保、企业年金和专户理财投资业务，在严格控制风险的前提下，实现基金持有人的投资回报最大化和委托理财合同的投资目标。

#### 权益投资二部

负责公司公募基金产品和专户理财投资业务，在严格控制风险的前提下，实现基金持有人的投资回报最大化和委托理财合同的投资目标。

#### 绝对收益投资部

以新股业务为核心，旗下包括现有以及即将发行和改造的新股产品，同时兼顾以绝对回报为目标的非保险、社保专户，实现基金持有人的投资回报最大化和委托理财合同的投资目标。

#### 研究部

研究部负责行业及上市公司研究，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。

#### 固定收益部

固定收益部负责公司固定收益类产品的研究与投资，并在严格控制风险的前提下，实现委托理财合同的投资目标。

#### 量化及衍生品投资部

量化及衍生品投资部负责公司公募、专户理财及其他委托投资业务的数量化及衍生品的研究和投资，在严格控制风险的前提下，实现产品的投资目标。

#### 国际业务部

国际业务部负责 QDII 基金海外投资研究和 QFII 业务开拓，进行相关国际业务产品研究分析。

#### 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。

#### 集中交易室

集中交易室负责及时、合规、准确地完成基金经理/投资经理下达的投资

指令，防范交易风险，提供投资建议和分析报告。

#### 机构理财部

机构理财部负责开展公募基金直销、专户理财、社保、企业年金等各项业务的营销和服务工作。

#### 市场发展部

市场发展部贯彻公司管理层的战略规划，组织基金销售工作，进行渠道管理以及客户服务工作。

#### 渠道业务部

渠道业务部负责证券公司渠道管理和服务工作。

#### 营销策划部

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等各项职能工作。

#### 电子商务部

电子商务部负责公司电子商务平台的搭建、业务推广和公司网站的建设、更新、内容维护，以及第三方销售机构的渠道管理工作。

分公司及营销中心（北京分公司、上海分公司、广州分公司、武汉分公司、华南营销中心、北方营销中心、东南营销中心、西北营销中心）

各分公司及营销中心贯彻实施公司整体营销战略，建立和维护各区域营销渠道，开展各项产品销售业务，完成公司整体销售任务。同时，北京分公司还负责公司与北京地区各家银行、券商总部及国家相关部委日常沟通、信息反馈及关系维护工作。

#### 总裁办公室

总裁办公室负责公司财务管理、日常行政事务管理等。

#### 人力资源部

人力资源部负责公司人力资源管理工作。

#### 登记结算部

登记结算部负责安全高效地完成资产组合的估值，注册登记及资金清算业务，保障后台运作正常运行。

#### 产品规划部



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。

#### 信息技术部

信息技术部负责公司信息技术系统开发、运行和维护，为公司战略和业务发展提供全面、及时、可靠的信息技术支持。

#### 监察稽核部

监察稽核部负责公司各项制度、业务的合法合规性审核，对公司内部控制制度的执行情况进行监察、稽核，以及采用定量分析的手段，对公司管理的各种资产组合的投资收益进行风险和绩效评估。

#### 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 2016 年 6 月 30 日，公司共有员工 319 人，其中，博士占比 3.4%，硕士占比 62.1%，本科占比 31.3%，其他占比 3.2%。

#### 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

崔俊杰先生，国籍中国，管理学硕士，8 年证券从业经验。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 月起兼任鹏华上证民企 50ETF 基金及其联接基金基金经理，2013 年 7 月起兼任鹏华沪深 300ETF 基金基金经理，2014 年 12 月起兼任鹏华资源分级基金基金经理，2014 年 12 月起兼任鹏华传媒分级基金基金经理，2015 年 4 月起兼任鹏华银行分级基金基金经理，2015 年 8 月至 2016 年 7 月兼任鹏华医药分级（2016 年 7 月已转型为鹏华中证医药卫生（LOF））基金基金经理，2016 年 7 月起兼任鹏华中证医药卫生（LOF）基金基金经理。崔俊杰先生具备基金从业资格。

#### （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

中国建设银行成立于 1954 年 10 月，是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行，总部设在北京。中国建设银行于 2005 年 10 月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码 939)，于 2007 年 9 月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码 601939)。

2015 年 6 月末，本集团资产总额 182,192 亿元，较上年末增长 8.81%；客户贷款和垫款总额 101,571 亿元，增长 7.20%；客户存款总额 136,970 亿元，增长 6.19%。净利润 1,322 亿元，同比增长 0.97%；营业收入 3,110 亿元，同比增长 8.34%，其中，利息净收入同比增长 6.31%，手续费及佣金净收入同比增长 5.76%。成本收入比 23.23%，同比下降 0.94 个百分点。资本充足率 14.70%，处于同业领先地位。

物理与电子渠道协同发展。总行成立了渠道与运营管理部，全面推进渠道整合；营业网点“三综合”建设取得新进展，综合性网点达到 1.44 万个，综合营销团队达到 19,934 个、综合柜员占比达到 84%，客户可在转型网点享受便捷舒适的“一站式”服务。加快打造电子银行的主渠道建设，有力支持物理渠道的综合化转型，电子银行和自助渠道账务性交易量占比达 94.32%，较上年末提高 6.29 个百分点；个人网上银行客户、企业网上银行客户、手机银行客户分别增长 8.19%、10.78%和 11.47%；

善融商务推出精品移动平台，个人商城手机客户端“建行善融商城”正式上线。

转型重点业务快速发展。2015年6月末，累计承销非金融企业债务融资工具2,374.76亿元，承销金额继续保持同业第一；证券投资基金托管只数和新发基金托管只数均列市场第一，成为首批香港基金内地销售代理人中唯一一家银行代理人；多模式现金池、票据池、银联单位结算卡等战略性产品市场份额不断扩大，现金管理品牌“禹道”的市场影响力持续提升；代理中央财政授权支付业务、代理中央非税收入收缴业务客户数保持同业第一，在同业中首家按照财政部要求实现中央非税收入收缴电子化上线试点。“鑫存管”证券客户保证金第三方存管客户数

3,076万户，管理资金总额7,417.41亿元，均为行业第一。

2015年上半年，本集团各方面良好表现，得到市场与业界广泛认可，先后荣获国内外知名机构授予的40多项重要奖项。在英国《银行家》杂志2015年“世界银行1000强排名”中，以一级资本总额继续位列全球第2；在美国《福布斯》杂志2015年全球上市公司2000强排名中继续位列第2；在美国《财富》杂志2015年世界500强排名第29位，较上年上升9位；荣获美国《环球金融》杂志颁发的“2015年中国最佳银行”奖项；荣获中国银行业协会授予的“年度最具社会责任金融机构奖”和“年度社会责任最佳民生金融奖”两个综合大奖。

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、清算处、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210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

赵观甫，投资托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行郑州市分行、总行信贷部、总行信贷二部、行长办公室工作，并在中国建设银行河北省分行营业部、总行个人银行业务部、总行审计部担任领导职务，长期

从事信贷业务、个人银行业务和内部审计等工作，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。

张力铮，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行建筑经济部、信贷二部、信贷部、信贷管理部、信贷经营部、公司业务部，并在总行集团客户部和中国建设银行北京市分行担任领导职务，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，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2015年9月末，中国建设银行已托管537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年至今连续五年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”。

#### （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：010-59378835

传真：010-59378839

联系人：朱立元

（四）出具法律意见书的律师事务所

名称：上海通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：俞卫锋

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

联系电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：陈颖华

经办律师：黎明、陈颖华

（五）会计师事务所

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

执行事务合伙人：李丹

联系电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

联系人：陈熹

经办注册会计师：单峰、陈熹

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 2016 年 7 月 25 日资产负债表如下：

资 产 2016 年 7 月 25 日 负债和所有者权益 2016 年 7 月 25 日

余额 余额

资 产： 负债：

银行存款 2,175,358.77 短期借款

结算备付金 101,524.40

交易性金融负债

存出保证金 10,127.03

衍生金融负债

交易性金融资产 31,789,311.94

卖出回购金融资产款

其中：股票投资 31,789,311.94

应付证券清算款

债券投资 应付赎回款 1,152,750.95

资产支持证券投资 应付管理人报酬 22,129.40

基金投资 应付托管费 4,716.58

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 9,080.22

应收证券清算款 应付税费

应收利息 6,210.89

应付利息

应收股利 应付利润

应收申购款 442,109.16

其他负债 322,787.64

其他资产 负债合计 1,511,464.79

所有者权益:

实收基金 36,746,339.14

未分配利润 -3,733,161.74

所有者权益合计 33,013,177.40

资产合计 34,524,642.19

负债与持有人权益总计: 34,524,642.19

八、 基金投资组合截至 2016 年 7 月 25 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 31,789,311.94

92.08%

其中: 股票 31,789,311.94

92.08%

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 2,276,883.17

6.59%

6 其他各项资产 458,447.08

1.33%

7 合计 34,524,642.19

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

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 采矿业 --

C 制造业 29,483,623.74 89.31

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 265,106.00 0.80

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 573,645.00 1.74

J 金融业

K 房地产业 --

L 租赁和商务服务业 --

M 科学研究和技术服务业 445,250.00 1.35



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 1,021,687.20 3.09  
R 文化、体育和娱乐业 --  
S 综合 --  
合计 31,789,311.94 96.29

## 2、积极投资按行业分类的股票投资组合

注：截至 2016 年 7 月 25 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

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	600276	恒瑞医药	56,760	2,432,733.60	7.37
2	000538	云南白药	21,008	1,454,383.84	4.41
3	000423	东阿阿胶	21,100	1,182,233.00	3.58
4	600535	天士力	26,100	1,038,258.00	3.14
5	600196	复星医药	46,200	992,376.00	3.01
6	002252	上海莱士	22,260	841,650.60	2.55
7	600867	通化东宝	38,480	803,077.60	2.43
8	000623	吉林敖东	28,800	727,776.00	2.20
9	002007	华兰生物	18,740	693,380.00	2.10
10	600085	同仁堂	22,100	690,404.00	2.09

#### 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 2016 年 7 月 25 日，本基金未持有积极投资的股票。

（四）按券种分类的债券投资组合

注：截至 2016 年 7 月 25 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 2016 年 7 月 25 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 2016 年 7 月 25 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 2016 年 7 月 25 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 2016 年 7 月 25 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 2016 年 7 月 25 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 10,127.03

2 应收证券清算款 -

3 应收股利 -

4 应收利息 6,210.89

5 应收申购款 442,109.16

6 其他应收款 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 458,447.08

4、截至2016年7月25日，本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5、截至2016年7月25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。

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	000538	云南白药	1,454,383.84	4.41	重大事项
---	--------	------	--------------	------	------

6、截至2016年7月25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2016年7月25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、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关重大违规行为,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、中国证监会准予鹏华中证医药卫生指数分级证券投资基金募集的文件
- 2、中国证监会准予鹏华中证医药卫生指数分级证券投资基金变更注册的文件
- 3、《鹏华中证医药卫生指数证券投资基金(LOF)基金合同》
- 4、《鹏华中证医药卫生指数证券投资基金(LOF)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
- 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

2016 年 7 月 27 日

附件:鹏华中证医药卫生指数证券投资基金(LOF)基金合同摘要一、第一部分 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

## 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) 交纳基金申购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、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、融券及转融通；
- (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，确定基金份额申购、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内发出，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前提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) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(25) 建立并保存基金份额持有人名册；

(26) 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、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，为基金开设资金账户、证券账户等投资所需账户，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，具有符合要求的营业场所，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；

(3) 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，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

(4) 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，不得委托第三人托管基金财产；

(5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

(6) 按规定开设基金财产的资金账户、证券账户等投资所需账户，按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

(7) 保守基金商业秘密，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予以保密，不得向他人泄露；

(8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回价格；

(9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

(10) 对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

(11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；

(12) 建立并保存基金份额持有人名册；

(13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

(14) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；

(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、第二部分 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。本基金暂不设置日常机构，日常机构的设置和相关规则按照法律法规的有关规定进行。

#### 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（法律法规、中国证监会或基金合同另有约定的除外）；
- ；
- (2) 更换基金管理人；
- (3) 更换基金托管人，但因涉及本基金与其它基金合并的除外；
- (4) 转换基金运作方式（法律法规、中国证监会或基金合同另有约定的除外）；
- (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（法律法规、中国证监会或基金合同另有约定的除外）；
- (8) 变更基金投资目标、范围或策略（法律法规、中国证监会或基金合同另有约定的除外）；
- (9) 变更基金份额持有人大会程序；
- (10) 终止基金份额上市，但因本基金不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的除外；
- (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) 对基金合同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) 法律法规要求增加的基金费用的收取；

(2) 在法律法规和基金合同规定的范围内且在对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下调整本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；

(3) 在法律法规和基金合同规定的范围内，在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，增加、减少、调整基金份额类别设置；

(4) 在法律法规和基金合同规定的范围内，在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金管理人、登记机构、基金销售机构调整有关申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务规则；

(5) 在法律法规和基金合同规定的范围内，在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金推出新业务或服务；

(6) 因相应的法律法规、深圳证券交易所或登记机构的相关业务规则发生变动而应当对基金合同进行修改；

(7) 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重大变化；

(8) 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、会议召集人及召集方式

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开时，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，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

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管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

5、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

6、基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

### 三、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 30 日，在指定媒介公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

- （1）会议召开的时间、地点和会议形式；
- （2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；
- （3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
- （4）授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；
- （5）会务常设联系人姓名及联系电话；

(6) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续;

(7) 召集人需要通知的其他事项。

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

3、如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

#### 四、基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规和监管机关允许的其他方式召开，基金管理人、基金托管人须为基金份额持有人行使投票权提供便利。会议的召开方式由会议召集人确定。

1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或基金托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

(1) 亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；

(2) 经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）。若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额

持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一（含三分之一）。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以会议通知载明的形式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址或系统。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

（1）会议召集人按基金合同约定公布会议通知后，在2个工作日内连续公布相关提示性公告。

（2）召集人按基金合同约定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力。

（3）本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）。若本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一（含三分之一）以上基金份额的持有人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见。

（4）上述第（3）项中直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与基金登记机构记录相符。

3、在法律法规和监管机关允许的情况下，本基金的基金份额持有人亦可



采用其他非书面方式授权其代理人出席基金份额持有人大会；在会议召开方式上，本基金亦可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。基金份额持有人亦可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式进行表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

## 五、议事内容与程序

### 1、议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如基金合同的重大修改、决定终止基金合同、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及基金合同规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开前及时公告。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

### 2、议事程序

#### （1）现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）和联系方式等事项。

## （2）通讯开会

在通讯开会的情况下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后 2 个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

## 六、表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1、一般决议，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过方为有效；除下列第 2 项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。除本基金合同另有约定的，转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止基金合同、与其他基金合并以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

## 七、计票

### 1、现场开会

（1）如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基

金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

(2) 监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

(3) 如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

(4) 计票过程应由公证机关予以公证，基金管理人或基金托管人拒不出席大会的，不影响计票的效力。

## 2、通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

## 八、生效与公告

基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 个工作日内在指定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。

## 九、本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、

表决条件等规定，凡是直接引用法律法规的部分，如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

- 三、第三部分 基金收益分配原则、执行方法
- 1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；
  - 2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，登记在登记结算系统基金份额持有人深圳开放式基金账户下的基金份额可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；登记在证券登记系统的场内基金份额持有人深圳证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；
  - 3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；
  - 4、每一基金份额享有同等分配权；
  - 5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可调整基金收益分配原则和支付方式，不需召开基金份额持有人大会。

#### 四、第四部分 基金财产管理、运用相关费用的提取、支付方式与比例一、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、基金合同生效后的标的指数许可使用费；
- 4、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；
- 6、基金份额持有人大会费用；

- 7、基金的证券/期货交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、证券账户开户费用、账户维护费用；
- 10、基金上市费用和年费；
- 11、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。

## 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：

$$H = E \times 0.75\% \div \text{当年天数}$$

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，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。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：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

### 3、标的指数许可使用费

本基金的标的指数许可使用费按前一日基金资产净值的 0.02% 的年费率

计提。标的指数许可使用费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.02\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的标的指数许可使用费

E 为前一日的基金资产净值

标的指数许可使用费每日计算，逐日累计至每季季末，按季支付（当季不足 50,000 元的，按 50,000 元计算），计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。由基金管理人向基金托管人发送标的指数许可使用费划款指令，基金托管人复核后于次季前 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给标的指数供应商。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

标的指数供应商根据相应指数许可协议变更标的指数许可使用费率和计算方式时，基金管理人需依照有关规定最迟于新的费率和计费方式实施日前 2 日在指定媒介公告。

上述“一、基金费用的种类”中第 4—11 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、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；
- 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。

### 四、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。

基金财产投资的相关税收，由基金份额持有人承担，基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

## 五、第五部分 基金财产的投资方向和投资限制一、投资范围

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及其备选成份股（含中小板、创业板股票及其他中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、股指期货、权证、资产支持证券以及法律法规或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以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：投资于股票部分的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。

如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

## 二、投资限制

### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

- （1）投资于股票部分的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%；
- （2）每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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；
- （3）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；
- （4）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；
- （5）本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；
- （6）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超

过基金资产净值的 10%；

(7) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%，中国证监会规定的特殊品种除外；

(8) 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；

(9) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

(10) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

(11) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

(12) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；

(13) 基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

(14) 本基金仅在投资股指期货时遵守下列要求：

1) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；

2) 本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%。其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

3) 本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；

4) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；

5) 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；



(15) 本基金参与融资的，每个交易日日终，本基金持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；

(16) 本基金参与转融通证券出借业务的，在任何交易日日终，参与转融通证券出借交易的资产不得超过基金资产净值的 50%，证券出借的平均剩余期限不得超过 30 天，平均剩余期限按照市值加权平均计算；

(17) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他投资限制。除上述（10）条外，因证券/期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。期间，基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按变更后的规定执行。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- (6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承

销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并履行信息披露义务。

法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

## 六、第六部分 基金资产净值的计算方法和公告方式

### 一、基金资产净值的计算方法

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。。

### 二、基金资产净值、基金份额净值的公告方式

基金合同生效后，在本基金基金份额开始上市交易前或开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。

在本基金基金份额开始上市交易后或开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒介上。

## 七、第七部分 基金合同变更和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

### 一、基金合同的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于基金合同变更的基金份额持有人大会决议生效后方可执行，并自决议生效后两个工作日内在指定媒介公告。

### 二、基金合同的终止事由

有下列情形之一的，基金合同应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 3、基金合同约定的其他情形；
- 4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### 三、基金财产的清算

- 1、基金财产清算小组：自出现基金合同终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。
- 2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。
- 3、基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。
- 4、基金财产清算程序：
  - (1) 基金合同终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；
  - (2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；
  - (3) 对基金财产进行估值和变现；
  - (4) 制作清算报告；
  - (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
  - (6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；
  - (7) 对基金财产进行分配。
- 5、基金财产清算的期限为 6 个月。

### 四、清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

## 五、基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

## 六、基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

## 七、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

八、第八部分 争议解决方式各方当事人同意，因基金合同而产生的或与基金合同有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，基金合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

基金合同受中国法律管辖。

九、第九部分 基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式基金合同可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅。