

# 鹏华盛世创新混合型证券投资基金 (LOF)

## 更新的招募说明书

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

2017年11月

## 重要提示

本基金经中国证监会证监基金字[2008]838号文件《关于同意鹏华盛世创新股票型证券投资基金(LOF)募集的批复》进行募集，并经中国证监会基金部2008年10月10日基金部函[2008]438号文件《关于鹏华盛世创新股票型证券投资基金(LOF)备案确认的函》确认合法备案。根据相关法律法规，本基金基金合同已于2008年10月10日生效，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，投资者在投资本基金前，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：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资者连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险，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者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。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，投资者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2017年10月9日，有关财务数据和净值表现截止日为2017年9月30日（未经审计）。

# 目 录

一、绪 言

二、释 义

三、基金管理人

四、基金托管人

五、相关服务机构

六、基金的募集与基金合同生效

七、基金份额的上市交易

八、基金份额的场外申购、转换与赎回

九、基金份额的场内申购与赎回

十、基金的非交易过户和基金份额的登记、系统内转托管和跨系统转登记

十一、基金的投资

十二、基金的业绩（未经审计）

十三、基金的财产

十四、基金资产的估值

十五、基金的收益分配

十六、基金的费用与税收

十七、基金的会计与审计

十八、基金的信息披露

十九、风险揭示

二十、基金的终止与清算

二十一、基金合同的内容摘要

二十二、基金托管协议的内容摘要

二十三、对基金份额持有人的服务

二十四、其他应披露事项

二十五、招募说明书的存放及查阅方式

二十六、备查文件

## 一、绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）等有关法律法规的规定，以及《鹏华盛世创新混合型证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称基金合同）的约定编写。

本招募说明书阐述了鹏华盛世创新混合型证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”或“基金”）的投资目标、策略、风险、费率等与投资人投资决策有关的必要事项，投资人在做出投资决策前应仔细阅读本招募说明书，并根据自身风险承受能力谨慎选择适合自己的基金产品。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

## 二、释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语具有以下含义：

- 1、基金或本基金：指鹏华盛世创新混合型证券投资基金（LOF）；
- 2、基金管理人或本基金管理人：指鹏华基金管理有限公司；
- 3、基金托管人或本基金托管人：指中国建设银行股份有限公司

4、基金合同或本基金合同:指《鹏华盛世创新混合型证券投资基金（LOF）基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充；

5、托管协议:指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《鹏华盛世创新混合型证券投资基金（LOF）托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充；

6、招募说明书:指《鹏华盛世创新混合型证券投资基金（LOF）招募说明书》，招募说明书是基金向社会公开发售时对基金情况进行说明的法律文件，自基金合同生效之日起，每6个月更新1次，并于每6个月结束之日后的45日内公告，更新内容截至每6个月的最后1日；

7、基金份额发售公告:指《鹏华盛世创新股票型证券投资基金（LOF）基金份额发售公告》；

8、法律法规:指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等；

9、《基金法》:指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，自2004年6月1日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订；

10、《销售办法》:指中国证监会2011年6月9日颁布、同年10月1日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订；

11、《信息披露办法》:指中国证监会2004年6月8日颁布、同年7月1日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订；

12、《运作办法》:指中国证监会2004年6月29日颁布、同年7月1日实施的《证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订；

13、中国证监会:指中国证券监督管理委员会；

14、银行业监督管理机构:指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会；

15、基金合同当事人:指受基金合同约束，根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人；

16、个人投资者:指依据有关法律法规规定或经中国证监会核准可投资于证券投资基金的自然人；

17、机构投资者:指依法可以投资开放式证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法注册登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织；

18、合格境外机构投资者:指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》规定的条件,经中国证监会批准投资于中国证券市场,并取得国家外汇管理局额度批准的中国境外基金管理机构、保险公司、证券公司以及其他资产管理机构;

19、投资人:指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称;

20、基金份额持有人:指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

21、基金销售业务:指基金的认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务;

22、销售机构:指直销机构和代销机构;

23、直销机构:指鹏华基金管理有限公司;

24、代销机构:指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件,取得基金代销业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议,代为办理基金销售业务的机构;

25、基金销售网点:指直销机构的直销中心及代销机构的代销网点;

26、登记结算业务:指基金登记、存管、过户、清算和结算业务,具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额注册登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等;

27、登记结算机构:指办理登记结算业务的机构。基金的登记结算机构为鹏华基金管理有限公司或接受鹏华基金管理有限公司委托代为办理登记结算业务的机构。本基金的登记结算机构为中国证券登记结算有限责任公司;

28、基金账户:指登记结算机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户;

29、基金交易账户:指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构买卖鹏华盛世创新混合型证券投资基金(LOF)基金份额的变动及结余情况的账户;

30、基金合同生效日:指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件,基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕,并获得中国证监会书面确认的日期;

31、基金合同终止日:指基金合同规定的基金合同终止事由出现后,基金财产清算完毕,清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期;

32、基金募集期限:指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间,最长不得超过3个月;

33、存续期:指基金合同生效至终止之间的不定期期限;

34、工作日:指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日;

35、T日:指本基金在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的日期;

36、T+n日:指自T日起第n个工作日(不包含T日);

37、开放日:指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日;

38、交易时间:指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段,具体时间见基金份额发售公告;

39、业务规则:指《鹏华基金管理有限公司开放式基金业务规则》,是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金登记结算方面的业务规则,由基金管理人和投资人共同遵守;

40、认购:指在基金募集期间,投资人申请购买基金份额的行为;

41、申购:基金合同生效后,投资人根据基金合同和招募说明书的规定通过场内或场外申请购买基金份额的行为;

42、赎回:指基金合同生效后,基金份额持有人按基金合同规定的条件通过场内或场外要求基金管理人购回基金份额的行为;

43、销售场所:指场外销售场所和场内交易场所,分别简称场外和场内;

44、场外:指通过深圳证券交易所外的销售机构办理基金份额认购、申购和赎回的场所;

45、场内:指通过深圳证券交易所内具有相应业务资格的会员单位利用交易所开放式基金交易系统办理基金份额认购、申购、赎回和上市交易的场所;

46、发售:指通过场外认购和通过场内认购;

47、注册登记系统:指中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统;

48、证券登记结算系统:指中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记结算系统;

49、日常交易:指场外申购和赎回、转换等场外基金交易,以及场内申购和赎回及上市交易等场内基金交易;

50、上市交易:指基金合同生效后投资者通过场内会员单位以集中竞价的方式买卖基金份额的行为;

51、系统内转托管:指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构(网点)之间或证券登记结算系统内不同会员单位(席位)之间进行转托管的行为;

52、跨系统转登记:指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统间进行转登记的行为;

53、基金转换:指基金份额持有人按照本基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件,申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的、且由同一登记结算机构办理登记结算的其他基金基金份额的行为;

54、巨额赎回:指本基金单个开放日,基金净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过上一日基金总份额的 10%;

55、元:指人民币元;

56、基金收益:指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约;

57、基金资产总值:指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和;

58、基金资产净值:指基金资产总值减去基金负债后的价值;

59、基金份额净值:指计算日基金资产净值除以计算日发售在外的基金份额总数;

60、基金资产估值:指计算评估基金资产和负债的价值,以确定基金资产净值和基金份额净值的过程;

61、指定媒体:指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒体;

62、不可抗力:指本基金合同当事人无法预见、无法抗拒、无法避免且在本基金合同由基金管理人、基金托管人签署之日后发生的,使本基金合同当事人无法全部或部分履行本基金合同的任何事件,包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律法规变化、突发停电或其他突发事件、证券交易所非正常暂停或停止交易;

## 三、基金管理人

### (一) 基金管理人概况

1、名称:鹏华基金管理有限公司

2、住所:深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心 43 层



- 3、设立日期：1998年12月22日
- 4、法定代表人：何如
- 5、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
- 6、电话：（0755）82021233 传真：（0755）82021155
- 7、联系人：吕奇志
- 8、注册资本：人民币1.5亿元
- 9、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。

邓召明先生，董事，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、中国证监会第六、七届发审委委员，现任鹏华基金管理有限公司总裁、党总支书记。

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，国信证券股份有限公司副总裁，国信证券股份有限公司公司顾问。

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、意大利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，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。现任意大利欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）市场及业务发展总监。

Andrea Vismara 先生，董事，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，现在担任意大利欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）董事会秘书兼任企业事务部总经理，欧利盛资本股份公司（Eurizon Capital S.A.）（卢森堡）企业服务部总经理。

周中国先生，董事，会计学硕士研究生，国籍：中国。曾任深圳市华为技术有限公司定价中心经理助理；2000年7月起历任国信证券有限责任公司资金财务总部业务经理、外派财务经理、高级经理、总经理助理、副总经理、国信证券股份有限公司人力资源总部副总经理、资金财务总部副总经理；2015年6月至今任国信证券股份有限公司资金财务总部总经理。

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。

张元先生，独立董事，大学本科，国籍：中国。曾任新疆军区干事、秘书、编辑，甘肃省委研究室干事、副处长、处长、副主任，中央金融工作委员会研究室主任，中国银监会政策法规部（研究局）主任（局长）等职务；2005年6月至2007年12月，任中央国债登记结算有限责任公司董事长兼党委书记；2007年12月至2010年12月，任中央国债登记结算有限责任公司监事长兼党委副书记。

高臻女士，独立董事，工商管理硕士，国籍：中国。曾任中国进出口银行副处长，负责贷款管理和运营，项目涉及制造业、能源、电信、跨国并购；2007年加入曼达林投资顾问有限公司，现任曼达林投资顾问有限公司执行合伙人。

## 2、基金管理人监事会成员

黄俞先生，监事会主席，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、监事，现任深圳市北融信投资发展有限公司董事长。

陈冰女士，监事，本科学历，国籍：中国。曾任国信证券股份有限公司资金财务部会计、上海营业部财务科副科长、资金财务部财务科副经理、资金财务部资金科经理、资金财务部主任会计师兼科经理、资金财务部总经理助理、资金财务总部副总经理等，现任国信证券资金财务总部副总经理兼资金运营部总经理、融资融券部总经理。

SANDRO VESPRINI 先生，监事，工商管理学士，国籍：意大利。先后在米兰军医院出纳部、税务师事务所、菲亚特汽车发动机和变速器平台管控管理团队工作、圣保罗 IMI 资产管理 SGR 企业经管部、圣保罗财富管理企业管控部工作、曾任欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）财务管理和投资经理，现任欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）财务负责人。

于丹女士，职工监事，法学硕士，国籍：中国。历任北京市金杜(深圳)律师事务所律师；2011年7月加盟鹏华基金管理有限公司，历任监察稽核部法务主管，现任监察稽核部总经理助理。

郝文高先生，职工监事，大专学历，国籍：中国。历任深圳奥尊电脑有限公司证券基金事业部副经理、招商基金管理有限公司基金事务部总监；2011年7月加盟鹏华基金管理有限公司，现任登记结算部总经理。

刘焱先生，职工监事，管理学硕士，国籍：中国。历任毕马威（中国）管理顾问公司咨询顾问，南方基金管理有限公司北京分公司副总经理；2014年10月加入鹏华基金管理有限公司，现任首席市场官兼市场发展部、北京分公司总经理。

## 3、高级管理人员情况

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。

邓召明先生，董事，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、中国证监会第六、七届发审委委员，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，特许金融分析师（CFA），经济学硕士，国籍：中国。历任中国国际金融有限公司经理，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。

邢彪先生，副总裁，工商管理硕士、法学硕士，国籍：中国。历任中国人民大学校办科员，中国证监会办公厅副处级秘书，全国社保基金理事会证券投资部处长、股权资产部（实业投资部）副主任，并于2014年至2015年期间担任中国证监会第16届主板发审委专职委员，现任鹏华基金管理有限公司副总裁。

高鹏先生，副总裁，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、督察长，现任鹏华基金管理有限公司副总裁、电子商务部总经理。

苏波先生，副总裁，管理学博士，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，鹏华基金管理有限公司总裁助理、机构理财部总经理、职工监事，现任鹏华基金管理有限公司副总裁。

高永杰先生，督察长，法学硕士，国籍：中国。历任中共中央办公厅秘书局干部，中国证监会办公厅新闻处干部、秘书处副处级秘书、发行监管部副处长、人事教育部副处长、处长，现任鹏华基金管理有限公司督察长。

韩亚庆先生，副总经理，经济学硕士。国籍：中国。历任国家开发银行资金局主任科员，全国社保基金理事会投资部副调研员，南方基金管理有限公司固定收益部基金经理、固定收益部总监。

#### 4、本基金基金经理

伍旋先生，国籍中国，工商管理硕士，11年证券投资基金从业经验。曾任职于中国建设银行，2006年6月加盟鹏华基金管理有限公司，从事研究分析工作，历任研究部高级研究员、基金经理助理。2011年12月担任鹏华盛世创新混合（LOF）基金基金经理，2015年02月至2017年02月担任鹏华可转债基金基金经理，2015年04月担任鹏华改革红利股票基金基金经理。伍旋先生具备基金从业资格。

本基金基金经理管理的其他基金情况：

2015年02月至2017年02月担任鹏华可转债基金基金经理

2015年04月担任鹏华改革红利股票基金基金经理

本基金历任的基金经理：

2008年10月至2010年07月 黄鑫先生

2009年07月至2011年12月 唐文杰先生

2011年12月至本更新招募书截止日 伍旋先生

#### 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董事、总裁、党总支书记。

高阳先生，鹏华基金管理有限公司副总裁。

邢彪先生，鹏华基金管理有限公司副总裁。

高鹏先生，鹏华基金管理有限公司副总裁。

韩亚庆先生，鹏华基金管理有限公司副总裁。

梁浩先生，鹏华基金管理有限公司研究部总经理，鹏华新兴产业混合、鹏华研究精选混合基金经理。

赵强先生，鹏华基金管理有限公司资产配置与基金投资部 FOF 投资副总监。

6. 上述人员之间均不存在近亲属关系。

### （三）基金管理人的职责

1、依法募集基金，办理或者委托经国务院证券监督管理机构认定的其他机构代为办理基金份额的募集、申购、赎回和登记事宜；

2、办理基金备案手续；

3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；

- 4、按照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收益；
- 5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- 6、编制中期和年度基金报告；
- 7、计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；
- 8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；
- 9、召集基金份额持有人大会；
- 10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- 11、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者实施其他法律行为；
- 12、国务院证券监督管理机构规定的其他职责。

#### **（四）基金管理人的承诺**

1、基金管理人承诺不从事违反《证券法》、《基金法》、《销售办法》、《运作办法》、《信息披露办法》等法律法规的行为，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违法行为的发生。

2、基金管理人的禁止行为：

- （1）将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
- （2）不公平地对待公司管理的不同基金财产；
- （3）利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
- （4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- （5）法律法规以及中国证监会禁止的其他行为。

3、基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下活动：

- （1）越权或违规经营；
- （2）违反法律法规、基金合同或托管协议；
- （3）故意损害基金份额持有人或本基金合同其他当事人的合法权益；
- （4）在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；
- （5）拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- （6）玩忽职守、滥用职权；

(7) 泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；

(8) 除按本基金管理人制度进行基金运作投资外，直接或间接进行其他股票投资；

(9) 协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易；

(10) 违反证券交易所业务规则，利用对敲、倒仓等非法手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；

(11) 贬损同行，以提高自己；

(12) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；

(13) 以不正当手段谋求业务发展；

(14) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；

(15) 其他法律、行政法规禁止的行为。

#### 4、基金经理承诺

(1) 依照有关法律法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；

(2) 不得利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者谋取利益；

(3) 不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；

(4) 不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

#### **(五) 基金管理人的内部控制制度**

##### 1、内部控制的原则

基金管理人的内部控制遵循以下原则：

(1) 健全性原则：内部控制应当包括公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员，并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节；

(2) 有效性原则：通过科学的内控手段和方法，建立合理的内控程序，维护内控制度的有效执行；

(3) 独立性原则：公司各机构、部门和岗位职责应当保持相对独立，公司基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离；

(4) 相互制约原则：公司内部部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡；

(5) 成本效益原则：公司运用科学化的经营管理方法降低运作成本，提高经济效益，以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

## 2、制订内部控制制度应当遵循以下原则：

(1) 合法合规性原则：基金管理人内控制度应当符合国家法律、法规、规章和各项规定；

(2) 全面性原则：内部控制制度应当涵盖基金管理人经营管理的各个环节，不得留有制度上的空白或漏洞；

(3) 审慎性原则：制定内部控制制度应当以审慎经营、防范和化解风险为出发点；

(4) 适时性原则：内部控制制度的制定应当随着有关法律法规的调整和基金管理人经营战略、经营方针、经营理念等内外部环境的变化进行及时的修改或完善。

## 3、内部控制体系

(1) 董事会下设合规与风险控制委员会，主要负责制定基金管理人风险控制战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。

(2) 公司督察长负责对基金管理人各业务环节合法合规运作进行监督检查，组织、指导基金管理人内部监察稽核工作，并可向董事会和中国证监会直接报告。

(3) 公司定期召开全体中层及以上管理人员会议对各类风险予以充分的评估和防范，对业务过程中潜在和存在的风险进行通报、讨论，并及时采取防范和控制措施。

(4) 监察稽核部负责对基金管理人各部门的风险控制情况进行检查，定期不定期对业务部门内部控制制度执行情况和遵循国家法律、法规及其他规定的执行情况进行检查，并适时提出整改建议并监督整改。

(5) 业务部门：对本部门业务范围内的业务风险负有管控和及时报告的义务。

(6) 员工：依照公司“全面风险管理、全员风险控制”的理念，公司每个员工均负有一线风险控制职责，负责把公司的风险控制理念和措施落实到每一个业务环节当中，并负有把业务过程中发现的风险隐患或风险问题及时进行报告、反馈的义务。

## 4、内部控制措施

(1) 公司通过不断健全法人治理结构，充分发挥独立董事和监事会的监督职能，力争从源头上杜绝不正当关联交易、利益输送和内部人控制现象的发生，保护投资者利益和公司合法权益。



(2) 管理层牢固树立了内控优先的风险管理理念，并着力培养全体员工的风险防范意识，营造浓厚的风险管理文化氛围，保证全体员工及时了解国家法律法规和公司规章制度，使风险意识贯穿到公司各个部门、各个岗位和各个环节。

(3) 公司依据自身经营特点建立了包括岗位自控、相关部门和岗位之间相互监督制衡、督察长和监察稽核部监督的、权责统一、严密有效的三道内控防线。

(4) 建立并不断完善内部控制体系及内部控制制度：自成立来，公司不断完善内控组织架构、控制程序、控制措施以及控制职责，建立健全内部控制体系。通过不断地对内部控制制度进行修订和更新，公司的内部控制制度不断走向完善。

(5) 建立健全各项管理制度和业务规章：公司建立了包括投资管理制度、基金会计制度、信息披露制度、监察稽核制度、信息技术管理制度、公司财务制度等基本管理制度以及包括岗位设置、岗位职责、操作流程手册在内的业务流程、规章等，从基本管理制度和业务流程上进行风险控制。

(6) 建立了岗位分离、相互制衡的内控机制：公司在岗位设置上采取了严格的分离制度，实现了基金投资与交易、交易与清算、公司会计与基金会计等业务岗位的分离制度，形成了不同岗位之间的相互制衡机制，从岗位设置上减少和防范操作及操守风险。

(7) 建立健全了岗位责任制：公司通过健全岗位责任制使每位员工都能明确自己的岗位职责和风险管理责任。

(8) 构建风险管理系统：公司通过建立风险评估、预警、报告、控制以及监督程序，并经过适当的控制流程，定期或实时对风险进行评估、预警、监督，从而识别、评估和预警与公司管理及基金运作有关的风险，通过明晰的报告渠道，对风险问题进行层层监督、管理、控制，使部门和管理层即时把握风险状况并及时、快速作出风险控制决策。

(9) 建立自动化监督控制系统：公司启用了恒生交易系统以及自行开发的投资指标监控系统等计算机辅助控制系统，对投资比例限制、“禁止买入股票名单”、交叉交易等方面进行电子化控制，有效地防止了运作风险和操守风险。

(10) 不断强化投资纪律，严格实施股票库制度：公司不断强化投资纪律，加强集体决策机制，各基金的行业配置比例、基金经理个股授权、基准仓位等由投资决策委员会决定。同时，公司建立了严格的股票库制度、禁止和限制投资股票制度，并由研究小组负责维护，所有股票投资必须完全从股票库中选择。公司还建立了契约风险评估制度，定期对各基金遵守基金合同的情况进行评估，防范契约风险。

## 5、基金管理人关于内部合规控制书的声明

- (1) 基金管理人确知建立、实施和维持内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任；
- (2) 本基金管理人承诺以上关于内部控制的披露真实、准确；
- (3) 本基金管理人承诺根据市场变化和公司发展不断完善内部控制体系和内部控制制度。

## 四、基金托管人

### 一、基金托管人情况

#### (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：田国立

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。本行于 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)。

2017 年 6 月末，本集团资产总额 216,920.67 亿元，较上年末增加 7,283.62 亿元，增幅 3.47%。上半年，本集团实现利润总额 1,720.93 亿元，较上年同期增长 1.30%；净利润较上年同期增长 3.81%至 1,390.09 亿元，盈利水平实现平稳增长。

2016 年，本集团先后获得国内外知名机构授予的 100 余项重要奖项。荣获《欧洲货币》“2016 中国最佳银行”，《环球金融》“2016 中国最佳消费者银行”、“2016 亚太区最佳流动性管理银行”，《机构投资者》“人民币国际化服务钻石奖”，《亚洲银行

家》“中国最佳大型零售银行奖”及中国银行业协会“年度最具社会责任金融机构奖”。本集团在英国《银行家》2016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《财富》2016年世界500强排名第22位。

中国建设银行总行设资产托管业务部，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、跨境托管运营处、监督稽核处等10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。

## （二）主要人员情况

纪伟，资产托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行南通分行、总行计划财务部、信贷经营部任职，并在总行公司业务部、投资托管业务部、授信审批部担任领导职务。其拥有八年托管从业经历，熟悉各项托管业务，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

龚毅，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行北京市分行国际部、营业部并担任副行长，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。

郑绍平，资产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、战略客户部，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，资产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。

原玎，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行国际业务部，长期从事海外机构及海外业务管理、境内外汇业务管理、国外金融机构客户营销拓展等工作，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、(R)QFII、(R)QDII、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2017年二季度

末，中国建设银行已托管 759 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。中国建设银行连续 11 年获得《全球托管人》、《财资》、《环球金融》“中国最佳托管银行”、“中国最佳次托管银行”、“最佳托管专家——QFII”等奖项，并在 2016 年被《环球金融》评为中国市场唯一一家“最佳托管银行”。

## 二、基金托管人的内部控制制度

### （一）内部控制目标

作为基金托管人，中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和本行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

### （二）内部控制组织结构

中国建设银行设有风险与内控管理委员会，负责全行风险管理与内部控制工作，对托管业务风险控制工作进行检查指导。资产托管业务部配备了专职内控合规人员负责托管业务的内控合规工作，具有独立行使内控合规工作职权和能力。

### （三）内部控制制度及措施

资产托管业务部具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理严格实行复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

## 三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

### （一）监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的“新一代托管应用监督子系统”，严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

### （二）监督流程

1. 每工作日按时通过新一代托管应用监督子系统，对各基金投资运作比例控制等情况进行监控，如发现投资异常情况，向基金管理人进行风险提示，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，如有重大异常事项及时报告中国证监会。

2. 收到基金管理人的划款指令后，对指令要素等内容进行核查。

3. 根据基金投资运作监督情况，定期编写基金投资运作监督报告，对各基金投资运作的合法合规性和投资独立性等方面进行评价，报送中国证监会。

4. 通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求基金管理人进行解释或举证，并及时报告中国证监会。

## 五、相关服务机构

### （一） 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

电话：（0755）82021233

传真：（0755）82021155

联系人：吕奇志

#### （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：张圆圆

#### （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

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 1001 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

电话：（020）38927993

传真：（020）020-38927990

联系人：周樱

## （二）其他销售机构

### 1、银行销售机构：

#### 1) 北京银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街甲17号首层

办公地址：北京市西城区金融大街丙17号

法定代表人：张东宁

联系人：张喆

客户服务电话：95526

网址：[www.bankofbeijing.com.cn](http://www.bankofbeijing.com.cn)

#### 2) 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：广东省东莞市城区南城路2号

法定代表人：王耀球

联系人：杨亢

客户服务电话：961122

网址：[www.drcbank.com](http://www.drcbank.com)

#### 3) 东亚银行（中国）有限公司

注册地址：上海浦东新区花园石桥路66号东亚银行金融大厦29楼

办公地址：上海浦东新区花园石桥路66号东亚银行金融大厦29楼

法定代表人：李国宝

联系人：李杰

客户服务电话：0512-38663866

网址：[www.hkbea.com.cn](http://www.hkbea.com.cn)

4) 广发银行股份有限公司

注册地址：广州市东风东路 713 号

办公地址：北京市东城区东长安街甲 2 号

法定代表人：杨明生

联系人：陈泾渭

网址：[www.cgbchina.com.cn](http://www.cgbchina.com.cn)

5) 杭州银行股份有限公司

注册地址：杭州市庆春路 46 号杭州银行大厦

办公地址：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：95398

网址：[www.hzbank.com.cn](http://www.hzbank.com.cn)

6) 华夏银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

法定代表人：李民吉

联系人：董金

客户服务电话：95577

网址：[www.hxb.com.cn](http://www.hxb.com.cn)

7) 江苏江南农村商业银行股份有限公司

注册地址：江苏省常州市和平中路 413 号

办公地址：江苏省常州市和平中路 413 号

法定代表人：陆向阳

联系人：蒋娇

客户服务电话：0519-96005

网址：www.jnbank.com.cn

8) 交通银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：牛锡明

联系人：张宏革

客户服务电话：95559

网址：www.bankcomm.com

9) 洛阳银行股份有限公司

注册地址：河南洛阳洛龙区开元大道 256 号

办公地址：河南洛阳洛龙区开元大道 256 号

法定代表人：王建甫

联系人：李亚洁

客户服务电话：96699

网址：www.bankofluoyang.com.cn

10) 南京银行股份有限公司

注册地址：江苏省南京市玄武区中山路 288 号

办公地址：江苏省南京市玄武区中山路 288 号

法定代表人：胡昇荣

客户服务电话：40088-96400

网址：www.njcb.com.cn

11) 宁波银行股份有限公司



注册地址：宁波市鄞州区宁南南路 700 号

办公地址：宁波市鄞州区宁南南路 700 号

法定代表人：陆华裕

联系人：胡技勋

客户服务电话：96528（上海、北京地区 962528）

网址：[www.nbc.com.cn](http://www.nbc.com.cn)

12) 平安银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南东路 5047 号

办公地址：深圳市深南东路 5047 号

法定代表人：谢永林

联系人：张莉

客户服务电话：95511-3

网址：[bank.pingan.com](http://bank.pingan.com)

13) 上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市中山东一路 12 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：高国富

联系人：唐苑

客户服务电话：95528

网址：[www.spdb.com.cn](http://www.spdb.com.cn)

14) 上海银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 168 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号

法定代表人：金煜

联系人：汤征程

客户服务电话：95594

网址: [www.bankofshanghai.com](http://www.bankofshanghai.com)

15) 厦门银行股份有限公司

注册地址: 厦门市思明区湖滨北路 101 号商业银行大厦

办公地址: 厦门市思明区湖滨北路 101 号商业银行大厦

法定代表人: 吴世群

联系人: 刘冬阳

客户服务电话: 400-858-8888

网址: [www.xmccb.com](http://www.xmccb.com)

16) 兴业银行股份有限公司

注册地址: 福州市湖东路 154 号中山大厦

办公地址: 上海市江宁路 168 号

法定代表人: 高建平

联系人: 刘玲

客户服务电话: 95561

网址: [www.cib.com.cn](http://www.cib.com.cn)

17) 招商银行股份有限公司

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

法定代表人: 李建红

联系人: 邓炯鹏

客户服务电话: 95555

网址: [www.cmbchina.com](http://www.cmbchina.com)

18) 浙江民泰商业银行股份有限公司

注册地址: 温岭市三星大道 168 号

办公地址: 温岭市三星大道 168 号

法定代表人: 江建法

联系人：刘兴龙

客户服务电话：4008896521

网址：[www.mintaibank.com](http://www.mintaibank.com)

19) 浙商银行股份有限公司

注册地址：中国杭州市庆春路 288 号

办公地址：中国杭州市庆春路 288 号

法定代表人：沈仁康

联系人：沈崑杰

客户服务电话：95527

网址：[www.czbank.com](http://www.czbank.com)

20) 中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京复兴门内大街 55 号

办公地址：北京复兴门内大街 55 号

法定代表人：易会满

联系人：刘秀宇

客户服务电话：95588

网址：[www.icbc.com.cn](http://www.icbc.com.cn)

21) 中国光大银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门外大街 6 号光大大厦

办公地址：北京市西城区复兴门外大街 6 号光大大厦?

法定代表人：唐双宁

联系人：穆欣欣

客户服务电话：95595

网址：[www.cebbank.com](http://www.cebbank.com)

22) 中国建设银行股份有限公司

注册地址：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：王未雨

客户服务电话：95533

网址：[www.ccb.com](http://www.ccb.com)

23) 中国民生银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街2号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街2号

法定代表人：洪崎

联系人：穆婷

客户服务电话：95568

网址：[www.cmbc.com.cn](http://www.cmbc.com.cn)

24) 中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街69号

办公地址：北京市东城区建国门内大街69号

法定代表人：周慕冰

联系人：邱泽滨

客户服务电话：95599

网址：[www.abchina.cn](http://www.abchina.cn)

25) 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：田国立

联系人：陈洪源

客户服务电话：95566

网址：[www.boc.cn](http://www.boc.cn)

26) 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

联系人：王硕

客户服务电话：95580

网址：[www.psbc.com](http://www.psbc.com)

27) 中信银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区朝阳门北大街 9 号

办公地址：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：李庆萍

联系人：迟卓

客户服务电话：95558

网址：[bank.ecitic.com](http://bank.ecitic.com)

2、证券公司销售机构：

1) 爱建证券有限责任公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1600 号 1 幢 32 楼

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1600 号 1 幢 32 楼

法定代表人：钱华

联系人：王冠昌

客户服务电话：4001-962-502

网址：[www.aizq.com](http://www.aizq.com)

2) 安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

办公地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

法定代表人：王连志

联系人：陈剑虹

客户服务电话：4008-001-001

网址：www.essence.com.cn

3) 渤海证券股份有限公司

注册地址：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：天津市南开区宾水西道 8 号

法定代表人：王春峰

联系人：蔡霆

客户服务电话：400-651-5988

网址：www.ewww.com.cn

4) 财富证券有限责任公司

注册地址：长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26-28 层

办公地址：长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 36 层

法定代表人：蔡一兵

联系人：郭静

客户服务电话：95317

网址：www.cfzq.com

5) 财通证券股份有限公司

注册地址：杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心 201、501、502、1103、1601-1615、1701-1716

办公地址：杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心 201、501、502、1103、1601-1615、1701-1716

法定代表人：沈继宁

联系人：陶志华

客户服务电话：95336

网址：www.ctsec.com

6) 长城国瑞证券有限公司

注册地址：厦门市思明区莲前西路2号莲富大厦17楼

办公地址：厦门市思明区深田路46号深田国际大厦20F

法定代表人：王勇

联系人：邱震

客户服务电话：400-0099-886

网址：[www.gwgsc.com](http://www.gwgsc.com)

7) 长城证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14楼、16楼、17楼

办公地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14楼、16楼、17楼

法定代表人：丁益

联系人：金夏

客户服务电话：400-666-6888

网址：[www.cgws.com](http://www.cgws.com)

8) 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：武汉市新华路特8号长江证券大厦

法定代表人：尤习贵

联系人：奚博宇

客户服务电话：95579/4008-888-999

网址：[www.95579.com](http://www.95579.com)

9) 大同证券有限责任公司

注册地址：山西省大同市城区迎宾街15号桐城中央21层

办公地址：山西省太原市小店区长治路世贸中心12层

法定代表人：董祥

联系人：薛津

客户服务电话：4007-121212

网址：[www.dtsbc.com.cn](http://www.dtsbc.com.cn)

10) 第一创业证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼

办公地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼

法定代表人：刘学民

联系人：毛诗莉

客户服务电话：95358

网址：[www.firstcapital.com.cn](http://www.firstcapital.com.cn)

11) 东北证券股份有限公司

注册地址：长春市生态大街 6666 号

办公地址：长春市生态大街 6666 号

法定代表人：李福春

联系人：安岩岩

客户服务电话：95360

网址：[www.nesc.cn](http://www.nesc.cn)

12) 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、23 层、25 层—29 层

办公地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层、23 层、25 层—29 层

法定代表人：潘鑫军

联系人：吴宇

客户服务电话：95503

网址：[www.dfzq.com.cn](http://www.dfzq.com.cn)

13) 东海证券股份有限公司

注册地址：江苏省常州延陵西路 23 号投资广场 18 层

办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦



法定代表人：赵俊

联系人：王一彦

客户服务电话：95531/400-8888-588

网址：[www.longone.com.cn](http://www.longone.com.cn)

14) 东莞证券股份有限公司

注册地址：广东省东莞市莞城区可园南路1号金源中心

办公地址：广东省东莞市莞城区可园南路1号金源中心

法定代表人：陈照星（代）

联系人：李荣

客户服务电话：95328

网址：[www.dgzq.com.cn](http://www.dgzq.com.cn)

15) 东吴证券股份有限公司

注册地址：苏州工业园区星阳街5号

办公地址：苏州工业园区星阳街5号

法定代表人：范力

联系人：陆晓

客户服务电话：95330

网址：[www.dwzq.com.cn](http://www.dwzq.com.cn)

16) 东兴证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层

办公地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层

法定代表人：魏庆华

联系人：汤漫川

客户服务电话：95309

网址：[www.dxzq.net](http://www.dxzq.net)

17) 方正证券股份有限公司

注册地址：湖南省长沙市芙蓉中路华侨国际大厦 24 楼

办公地址：北京市朝阳区北四环中路盘古大观 A 座 40 层

法定代表人：高利

联系人：丁敏

客户服务电话：95571

网址：www.foundersc.com

18) 光大证券股份有限公司

注册地址：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：薛峰

联系人：何耀

客户服务电话：95525

网址：www.ebscn.com

19) 广发证券股份有限公司

注册地址：广州市天河北路 183 号大都会广场 5、7、8、17、18、19、38-44 楼

办公地址：广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街 2 号 618 室

法定代表人：孙树明

联系人：黄岚

客户服务电话：95575

网址：www.gf.com.cn

20) 广州证券股份有限公司

注册地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层

办公地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层

法定代表人：邱三发

联系人：梁微

客户服务电话：95396

网址：[www.gzs.com.cn](http://www.gzs.com.cn)

21) 国都证券股份有限公司

注册地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层

办公地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层

法定代表人：王少华

联系人：黄静

客户服务电话：400-818-8118

网址：[www.guodu.com](http://www.guodu.com)

22) 国海证券股份有限公司

注册地址：广西桂林市辅星路13号

办公地址：广西南宁市滨湖路46号

法定代表人：何春梅

联系人：牛孟宇

客户服务电话：95563

网址：[www.ghzq.com.cn](http://www.ghzq.com.cn)

23) 国金证券股份有限公司

注册地址：四川省成都市东城根上街95号

办公地址：四川省成都市东城根上街95号

法定代表人：冉云

联系人：刘婧漪、贾鹏

客户服务电话：95310

网址：[www.gjzq.com.cn](http://www.gjzq.com.cn)

24) 国联证券股份有限公司

注册地址：无锡市金融一街8号

办公地址：无锡市滨湖区太湖新城金融一街8号

法定代表人：姚志勇

联系人：祁昊

客户服务电话：95570

网址：[www.g1sc.com.cn](http://www.g1sc.com.cn)

25) 国融证券股份有限公司

注册地址：内蒙古自治区呼和浩特市武川县腾飞大道1号4楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号长安兴融中心西座11层

法定代表人：张智河

联系人：郭一非

客户服务电话：95385

网址：<http://www.grzq.com>

26) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路618号

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：杨德红

联系人：芮敏祺

客户服务电话：400-8888-666/95521

网址：[www.gtja.com](http://www.gtja.com)

27) 国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人：何如

联系人：周杨

客户服务电话：95536

网址：[www.guosen.com.cn](http://www.guosen.com.cn)

28) 国元证券股份有限公司

注册地址：中国安徽省合肥市梅山路18号

办公地址：安徽省合肥市梅山路 18 号安徽国际金融中心 A 座国元证券

法定代表人：蔡咏

联系人：米硕

客户服务电话：95578

网址：www.gyzq.com.cn

29) 海通证券股份有限公司

注册地址：上海市广东路 689 号

办公地址：上海市黄浦区广东路 689 号

法定代表人：周杰

联系人：赵洋洋

客户服务电话：95553

网址：www.htsec.com

30) 红塔证券股份有限公司

注册地址：云南省昆明市北京路 155 号附 1 号

办公地址：云南省昆明市北京路 155 号附 1 号

法定代表人：况雨林

联系人：刘晓明

客户服务电话：400-871-8880

网址：www.hongtastock.com

31) 华安证券股份有限公司

注册地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

办公地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

法定代表人：李工

联系人：范超

客户服务电话：95318

网址：www.hazq.com

32) 华宝证券有限责任公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号 57 层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号 57 层

法定代表人：陈林

联系人：胡星煜

客户服务电话：400-820-9898

网址：[www.cnhbstock.com](http://www.cnhbstock.com)

33) 华福证券有限责任公司

注册地址：福州市鼓楼区温泉街道五四路 157 号 7—8 层

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1088 号招商银行大厦 18 楼

法定代表人：黄金琳

联系人：王虹

客户服务电话：95547(福建省外电信、联通用户暂加拨 0593-95547)

网址：[www.hfzq.com.cn](http://www.hfzq.com.cn)

34) 华林证券股份有限公司

注册地址：西藏自治区拉萨市柳梧新区察古大道 1-1 君泰国际 B 栋一层 3 号

办公地址：深圳市福田区民田路 178 号华融大厦 6 楼

法定代表人：林立

联系人：胡倩

客户服务电话：400-188-3888

网址：[www.chinalin.com](http://www.chinalin.com)

35) 华龙证券股份有限公司

注册地址：兰州市城关区东岗西路 638 号兰州财富中心 21 楼

办公地址：兰州市城关区东岗西路 638 号 19 楼

法定代表人：李晓安

联系人：范坤

客户服务电话：95368

网址：www.hlzq.com

36) 华融证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 8 号

办公地址：北京市朝阳区朝阳门北大街 18 号中国人保寿险大厦 11 至 18 层

法定代表人：祝献忠

联系人：孙燕波

客户服务电话：95390

网址：www.hrsec.com.cn

37) 华泰证券股份有限公司

注册地址：南京市江东中路 228 号

办公地址：南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场

法定代表人：周易

联系人：庞晓芸

客户服务电话：95597

网址：www.htsc.com.cn

38) 华西证券股份有限公司

注册地址：四川省成都市高新区天府二街 198 号华西证券大厦

办公地址：四川省成都市高新区天府二街 198 号华西证券大厦

法定代表人：杨炯洋

联系人：谢国梅

客户服务电话：95584

网址：www.hx168.com.cn

39) 华鑫证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01 (b) 单元

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 8 号

法定代表人：俞洋

联系人：杨莉娟

客户服务电话：95323/4001099918（全国）/021—32109999/029-68918888

网址：[www.cfsc.com.cn](http://www.cfsc.com.cn)

40) 江海证券有限公司

注册地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

办公地址：黑龙江省哈尔滨市松北区创新三路 833 号

法定代表人：孙名扬

联系人：姜志伟

客户服务电话：400-666-2288

网址：[www.jhzq.com.cn](http://www.jhzq.com.cn)

41) 金元证券股份有限公司

注册地址：海口市南宝路 36 号证券大厦 4 楼

办公地址：深圳市福田区深南大道 4001 号时代金融中心 17 层

法定代表人：王作义

联系人：马贤清

客户服务电话：400-8888-228

网址：[www.jyz.cn](http://www.jyz.cn)

42) 开源证券股份有限公司

注册地址：西安市高新区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层

办公地址：西安市高新区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层

法定代表人：李刚

联系人：袁伟涛

客户服务电话：400-860-8866

网址：[www.kysec.cn](http://www.kysec.cn)

43) 民生证券股份有限公司



注册地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-20 层

办公地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-20 层

法定代表人：冯鹤年

联系人：韩秀萍

客户服务电话：95376

网址：[www.mszq.com](http://www.mszq.com)

44) 平安证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

办公地址：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

法定代表人：曹实凡

联系人：周一涵

客户服务电话：95511-8

网址：[stock.pingan.com](http://stock.pingan.com)

45) 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

联系人：郭熠

客户服务电话：95573/400-666-1618

网址：[www.i618.com.cn](http://www.i618.com.cn)

46) 上海证券有限责任公司

注册地址：上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼

办公地址：上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼

法定代表人：李俊杰

联系人：邵珍珍

客户服务电话：021-962518

网址: [www.962518.com](http://www.962518.com)

47) 申万宏源证券有限公司

注册地址: 上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址: 上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人: 李梅

联系人: 李玉婷

客户服务电话: 95523/4008895523

网址: [www.swhysc.com](http://www.swhysc.com)

48) 世纪证券有限责任公司

注册地址: 深圳市福田区深南大道招商银行大厦 40/42 层

办公地址: 深圳市福田区深南大道招商银行大厦 40/42 层

法定代表人: 姜昧军

联系人: 王雯

客户服务电话: 4008323000

网址: [www.cscoc.com.cn](http://www.cscoc.com.cn)

49) 天风证券股份有限公司

注册地址: 湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路 2 号高科大厦 4 楼

办公地址: 湖北省武汉市武昌区中南路 99 号保利广场 A 座 37 楼

法定代表人: 余磊

联系人: 夏旻

客户服务电话: 95391/4008005000

网址: [www.tfzq.com](http://www.tfzq.com)

50) 万联证券股份有限公司

注册地址: 广东省广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 座 18、19 层

办公地址: 广东省广州市天河区珠江东路 13 号高德置地广场 E 座 12 层

法定代表人: 张建军

联系人：甘蕾

客户服务电话：4008888133

网址：www.wlzq.com.cn

51) 五矿证券有限公司

注册地址：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

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：赵立功

联系人：马国栋

客户服务电话：4001840028

网址：www.wkzq.com.cn

52) 西部证券股份有限公司

注册地址：西安市新城区东大街 232 号陕西信托大厦

办公地址：西安市新城区东大街 232 号陕西信托大厦 16-17 层

法定代表人：刘建武

联系人：梁承华

客户服务电话：95582

网址：www.westsecu.com

53) 西南证券股份有限公司

注册地址：重庆市江北区桥北苑 8 号

办公地址：重庆市江北区桥北苑 8 号

法定代表人：吴坚

联系人：张煜

客户服务电话：4008096096、95355

网址：swsc.com.cn

54) 湘财证券股份有限公司

注册地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新城商务中心 A 栋 11 楼

办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼

法定代表人：林俊波

联系人：李欣

客户服务电话：95351

网址：www.xcsc.com

55) 新时代证券股份有限公司

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：叶顺德

联系人：田芳芳

客户服务电话：95399

网址：www.xsdzq.cn

56) 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

办公地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人：张志刚

联系人：尹旭航

客户服务电话：95321

网址：www.cindasc.com

57) 兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 268 号

办公地址：上海市浦东新区长柳路 36 号兴业证券大厦

法定代表人：兰荣

联系人：乔琳雪

客户服务电话：95562

网址：www.xyzq.com.cn

58) 银泰证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区竹子林四路紫竹七道 1 8 号光大银行大厦 1 8 楼

办公地址：深圳市福田区竹子林四路紫竹七道 1 8 号光大银行大厦 1 8 楼

法定代表人：黄冰

联系人：林文宇

客户服务电话：4008-505-505/0755-28810131

网址：[www.ytzq.net](http://www.ytzq.net)

59) 招商证券股份有限公司

注册地址：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

联系人：林生迎

客户服务电话：95565

网址：[www.newone.com.cn](http://www.newone.com.cn)

60) 浙商证券股份有限公司

注册地址：浙江省杭州市西湖区杭大路 1 号黄龙世纪广场 A 座

办公地址：杭州市江干区五星路 201 号浙商证券大楼 8 楼

法定代表人：吴承根

联系人：陈姗姗

客户服务电话：95345

网址：[www.stocke.com.cn](http://www.stocke.com.cn)

61) 中国国际金融股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

办公地址：北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

法定代表人：毕明建（代）

联系人：杨涵宇

客户服务电话：4009101166

网址：www.cicc.com.cn

62) 中国民族证券有限责任公司

注册地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号盘古大观 40-43 层

办公地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼

法定代表人：何亚刚

联系人：胡创

客户服务电话：40088-05618

网址：www.e5618.com

63) 中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 35 号 2-6 层

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：陈共炎

联系人：辛国政

客户服务电话：4008-888-888 或 95551

网址：www.chinastock.com.cn

64) 中国中投证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18-21 层及第 04 层 01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23 单元

办公地址：深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 4、18 层至 21 层

法定代表人：高涛

联系人：万玉琳

客户服务电话：95532

网址：www.china-invs.cn

65) 中航证券有限公司

注册地址：江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼

办公地址：江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼

法定代表人：王宜四

联系人：何志华

客户服务电话：95335

网址：[www.avicsec.com](http://www.avicsec.com)

66) 中山证券有限责任公司

注册地址：深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼 7 层、8 层

办公地址：深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼 7 层、8 层

法定代表人：黄扬录

联系人：罗艺琳

客户服务电话：95329

网址：[www.zszq.com](http://www.zszq.com)

67) 中泰证券股份有限公司

注册地址：济南市市中区经七路 86 号

办公地址：上海市花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 18 层

法定代表人：李玮

联系人：许曼华

客户服务电话：95538

网址：[www.zts.com.cn](http://www.zts.com.cn)

68) 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：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：王常青

联系人：刘畅

客户服务电话：95587/4008-888-108

网址：[www.csc108.com](http://www.csc108.com)

69) 中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座

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：张佑君

联系人：郑慧

客户服务电话：95548

网址：[www.cs.ecitic.com](http://www.cs.ecitic.com)

70) 中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001

办公地址：青岛市市南区东海西路28号龙翔广场东座5层

法定代表人：姜晓林

联系人：刘晓明

客户服务电话：95548

网址：[www.zxwt.com.cn](http://www.zxwt.com.cn)

3、期货公司销售机构：

1) 中信建投期货有限公司

注册地址：重庆市渝中区中山三路107号上站大楼平街11-B，名义层11-A，8-B4，9-

B、C

办公地址：重庆市渝中区中山三路107号皇冠大厦11楼

法定代表人：彭文德

联系人：刘芸

客户服务电话：400-8877-780

网址：[www.cfc108.com](http://www.cfc108.com)

2) 中信期货有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-

1305、14层



办公地址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305、14层

法定代表人：张皓

联系人：刘宏莹

客户服务电话：400-990-8826

网址：[www.citicsf.com](http://www.citicsf.com)

#### 4、第三方销售机构：

##### 1) 北京蛋卷基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507

办公地址：北京市朝阳区望京SOHO T3 A座19层

法定代表人：钟斐斐

联系人：戚晓强

客户服务电话：4000-618-518

网址：[danjuanapp.com](http://danjuanapp.com)

##### 2) 北京恒天明泽基金销售有限公司

注册地址：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

客户服务电话：400-786-8868

网址：[www.chtfund.com](http://www.chtfund.com)

##### 3) 北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1108

办公地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1108

法定代表人：王伟刚

联系人：熊小满

客户服务电话：010-56282140

网址：www.hcjjjin.com

4) 北京肯特瑞财富投资管理有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村东路 66 号 1 号楼 22 层 2603-06

办公地址：北京市大兴区亦庄经济开发区科创十一街 18 号院京东总部 A 座 17 层

法定代表人：陈超

联系人：江卉

客户服务电话：95118

网址：fund.jd.com

5) 北京展恒基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区安苑路 15-1 号邮电新闻大厦 2 层

办公地址：北京市朝阳区安苑路 15-1 号邮电新闻大厦 2 层

法定代表人：闫振杰

联系人：马林

客户服务电话：4008188000

网址：www.myfund.com

6) 和讯信息科技有限公司

注册地址：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：王莉

联系人：于扬

客户服务电话：400-920-0022

网址：licaike.hexun.com

7) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地址：杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 栋 202 室

办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代广场 B 座 6F

法定代表人：陈柏青

联系人：韩爱彬

客户服务电话：4000-766-123

网址：[www.fund123.cn](http://www.fund123.cn)

8) 南京苏宁基金销售有限公司

注册地址：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

办公地址：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

法定代表人：刘汉青

联系人：王锋

客户服务电话：95177

网址：[www.snjijin.com](http://www.snjijin.com)

9) 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

办公地址：上海市杨浦区秦皇岛路 32 号 c 栋

法定代表人：汪静波

联系人：朱了

客户服务电话：400-821-5399

网址：[www.noah-fund.com](http://www.noah-fund.com)

10) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区东方路 1267 号 11 层

法定代表人：张跃伟

联系人：张佳琳

客户服务电话：400-089-1289

网址：[www.erichfund.com/websiteIII/html/index.html](http://www.erichfund.com/websiteIII/html/index.html)

11) 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号

办公地址：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯大厦 903~906 室

法定代表人：杨文斌

联系人：王诗琦

客户服务电话：400-700-9665

网址：[www.ehowbuy.com](http://www.ehowbuy.com)

12) 上海华夏财富投资管理有限公司

注册地址：上海市虹口区东大名路 687 号 1 幢 2 楼 268 室

办公地址：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

法定代表人：李一梅

联系人：仲秋玥

客户服务电话：400-817-5666

网址：[www.amcfortune.com](http://www.amcfortune.com)

13) 上海陆金所资产管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法定代表人：郭坚

联系人：何雪

客户服务电话：400-821-9031

网址：[www.lu.com](http://www.lu.com)

14) 上海天天基金销售有限公司

注册地址：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

客户服务电话：4001818188

网址: [www.1234567.com.cn](http://www.1234567.com.cn)

15) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址: 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

客户服务电话: 010-58325327

网址: [8.jrj.com.cn](http://8.jrj.com.cn)

16) 深圳众禄基金销售有限公司

注册地址: 深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼

办公地址: 深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼

法定代表人: 薛峰

联系人: 邓爱萍

客户服务电话: 4006-788-887

网址: [www.zlfund.cn](http://www.zlfund.cn)、[www.jjmmw.com](http://www.jjmmw.com)

17) 天相投资顾问有限公司

注册地址: 北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701

办公地址: 北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座 505 室

法定代表人: 林义相

联系人: 谭磊

客户服务电话: 010-66045678

网址: [www.jjm.com.cn/](http://www.jjm.com.cn/)

18) 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址: 浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903

办公地址: 杭州市余杭区五常街道同顺路 18 号同花顺大楼

法定代表人: 凌顺平

联系人：吴强

客户服务电话：(0571)56768888

网址：www.5ifund.com

19) 众升财富（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区望京东园四区 13 号楼 A 座 9 层 908 室

办公地址：北京市朝阳区望京浦项中心 A 座 9 层 04-08

法定代表人：李招弟

联系人：李艳

客户服务电话：400-059-8888

网址：www.zscffund.com

20) 珠海盈米财富管理有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 B1201-1203

法定代表人：肖雯

联系人：黄敏嫦

客户服务电话：020-89629066

网址：www.yingmi.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。

### **（三）场内销售机构**

具有中国证监会认定的基金销售业务资格且符合风险控制要求的深交所会员单位可以办理本基金的场内申购、赎回业务。具体详见基金管理人于 2008 年 11 月 5 日发布的《鹏华盛世创新股票型证券投资基金（LOF）上市交易公告书》，于 2008 年 11 月 5 日发布的《鹏华创新关于开放申购、赎回和定期定额投资业务的公告》。

### **（四）注册登记机构**

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

法定代表人：周明

办公室地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

联系电话：010-50938782

传真：010-50938907

负责人：赵亦清

#### **（五）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

法定代表人：null

办公室地址：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

#### **（六）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

法定代表人：杨绍信

办公室地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

联系电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

联系人：陈熹

经办会计师：许康玮、陈熹

## **六、基金的募集与基金合同生效**

### **（一）基金的募集**

本基金由基金管理人依照《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》、基金合同及其他有关规定，并经中国证监会证监许可字[2008]838号文批准募集发售。募集期从2008年9月1日起到9月26日止，共募集1,144,932,018.81份基金份额，募集户数为10,243户。

本基金为混合型证券投资基金，存续期间为不定期。

## **(二) 基金合同的生效**

本基金的基金合同已于2008年10月10日正式生效。

## **(三) 基金存续期内的基金份额持有人数量和资金数额**

基金合同生效后的存续期内，基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元，基金管理人应当及时报告中国证监会；基金份额持有人数量连续20个工作日达不到200人，或连续20个工作日基金资产净值低于5000万元，基金管理人应当向中国证监会说明出现上述情况的原因并提出解决方案。

# **七、基金份额的上市交易**

基金合同生效后，基金管理人可以根据有关规定，申请本基金的基金份额上市交易。基金上市后，登记在证券登记结算系统中的基金份额可直接在深圳证券交易所上市交易；登记在注册登记系统中的基金份额可通过办理跨系统转登记业务将基金份额转登记在证券登记结算系统中，再上市交易。

## **(一) 上市交易的地点**

深圳证券交易所。

## **(二) 上市交易的时间**

本基金已于2008年11月10日在深圳证券交易所上市交易。投资者可在交易日的交易时间使用相应深圳证券账户通过各深圳证券交易所会员单位的营业网点报盘买入和卖出本基金（具体详见基金管理人于2008年11月5日发布的《鹏华盛世创新股票型证券投资基金（LOF）上市交易公告书》）。

## **(三) 上市交易的规则**

- 1、本基金上市首日的开盘参考价为前一交易日基金份额净值；
- 2、本基金实行价格涨跌幅限制，涨跌幅比例为10%，自上市首日起实行；



- 3、本基金买入申报数量为 100 份或其整数倍；
- 4、本基金申报价格最小变动单位为 0.001 元人民币；
- 5、本基金上市交易遵循《深圳证券交易所交易规则》及相关规定。

#### **（四）上市交易的费用**

本基金上市交易的费用比照封闭式基金的有关规定办理。

#### **（五）上市交易的行情揭示**

本基金在深圳证券交易所挂牌交易，交易行情通过行情发布系统揭示。行情发布系统同时揭示基金前一交易日的基金份额净值。

#### **（六）上市交易的注册登记**

投资人 T 日买入成功后，注册登记人在 T 日自动为投资人登记权益并办理注册登记手续，投资人自 T+1 日（含该日）后有权卖出该部分基金；

投资人 T 日卖出成功后，注册登记人在 T 日自动为投资人办理扣除权益的注册登记手续。

#### **（七）上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市**

本基金的停复牌、暂停上市、恢复上市按照深圳交易所的相关规定执行。

#### **（八）终止上市的情形和处理方式**

发生下列情况之一时，本基金应终止上市交易：

- （1）自暂停上市之日起半年内未能消除暂停上市原因的；
- （2）基金合同终止；
- （3）基金份额持有人大会决定终止上市；
- （4）深圳证券交易所认为须终止上市的其他情况。

发生上述终止上市情形时，由证券交易所终止其上市交易，基金管理人报经中国证监会备案后终止本基金的上市，并在至少一种指定报刊和网站上刊登终止上市公告。

（九）相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所对基金上市交易的规则等相关规定内容进行调整的，本基金上市交易规则相应进行调整，且此项修改无须召开基金份额持有人大会，并在本基金更新的招募说明书中列示。

## 八、基金份额的场外申购、转换与赎回

本章内容仅适用于本基金的场外申购、转换和赎回业务。登记在注册登记系统中的基金份额可直接办理场外申购、转换与赎回等场外基金业务；登记在证券登记结算系统中的基金份额可通过办理跨系统转登记业务将基金份额转登记到注册登记系统中，再办理场外申购、转换与赎回等场外基金业务。

### （一） 场外申购、转换和赎回业务办理的场所

- 1、本基金管理人设在深圳、北京、上海、武汉和广州的直销中心；
- 2、中国建设银行的指定网点以及基金管理人指定的其他代销机构营业网点；
- 3、本基金管理人的基金网上交易系统（具体业务规则与说明参见相关公告）。

具体销售网点由基金管理人在本招募说明书或基金份额发售公告等公告中列明。基金管理人可根据情况变更增减基金销售机构或办理本基金申购、转换与赎回的场所，并予以公告。

### （二） 场外申购、转换和赎回的开放日及时间

#### 1、 开放日及开放时间

投资人可在开放日办理基金份额的场外申购、转换和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间。目前，上海证券交易所、深圳证券交易所的交易时间为交易日上午：9:30-11:30，下午 1:00-3:00。基金管理人根据法律法规或本基金合同的规定公告暂停申购、转换或赎回时除外。

基金管理人不在开放日之外的日期或者时间办理基金份额的申购、转换或赎回，投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、转换或者赎回申请的，其基金份额申购、转换或赎回价格为下次办理基金份额申购、转换或赎回时间所在开放日的价格。

基金合同生效后，若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在中国证监会指定媒体上公告。

#### 2、 申购的开始时间

本基金自 2008 年 11 月 10 日起开始办理场外日常申购业务。

#### 3、 转换的开始时间

本基金自 2008 年 11 月 25 日开始办理场外日常转换业务，具体转换费率和相关业务规则请见本公司发布的相关公告。

#### 4、赎回的开始时间

本基金自 2008 年 11 月 10 日起开始办理场外日常赎回业务。

#### 5、定期定额投资业务的开始时间

本基金于 2008 年 11 月 10 日开通了指定代销机构的定期定额投资业务。（具体详见基金管理人于 2008 年 11 月 5 日发布的《鹏华创新关于开放申购、赎回和定期定额投资业务的公告》）

6、基金管理人如果对申购、转换或赎回时间进行调整，应报中国证监会备案，在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在中国证监会指定媒体上公告。

### （三） 场外申购限制

1、本基金对单个基金份额持有人不设置最高申购金额限制。

2、投资者通过销售机构场外申购本基金，单笔最低申购金额为 10 元(含申购费)。通过我公司直销中心场外申购本基金，首次最低金额为 100 万元，追加申购单笔最低金额为 1 万元（通过本基金管理人基金网上交易系统申购本基金暂不受此限制）。各销售机构可根据业务情况设置高于或等于本公司设定的上述单笔申购最低金额，如果销售机构业务规则规定的最低单笔申购金额高于 10 元人民币，以销售机构的规定为准。投资者办理相关业务时，请遵循销售机构的具体业务规定。

3、转换的最低份额为 200 份基金份额，基金份额持有人可将其全部或部分基金份额转换。

4、场外账户最低余额为 5 份基金份额，若某笔转换或赎回将导致投资者在销售机构托管的单只基金份额余额不足 5 份时，该笔转换或赎回业务应包括账户内全部基金份额，否则，剩余部分的基金份额将被强制赎回。

5、关于本基金定期定额投资的每次最低扣款额按照本基金管理人于 2010 年 12 月 31 日刊登的《鹏华基金管理有限公司关于调整旗下开放式证券投资基金定期定额投资业务最低申购金额的公告》执行。

6、基金管理人可根据市场情况，调整场外申购、转换、赎回份额的数量限制及相关业务规则，应报中国证监会备案，并在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在中国证监会指定媒体上公告。

#### **（四） 场外申购、转换和赎回的原则**

1、本基金采用“未知价”原则，即申购、转换和赎回价格以申请当日的基金份额净值为基准进行计算。

2、“金额申购，份额转换和赎回”原则，即申购以金额申请，转换和赎回以份额申请。赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人申(认)购的先后次序进行顺序赎回。

3、仅在转出的基金正常开放赎回，以及转入的基金正常开放申购的前提下，方可实现投资者的转换申请。

4、办理基金转换业务时，基金份额持有人转出、转入基金份额只能在同一销售机构进行，且办理基金转换业务的代理销售机构须同时具备拟转出基金及拟转入基金的合法授权代理资格，并开通了相应的基金转换业务。

5、如基金份额持有人申请转出其账户内鹏华货币市场证券投资基金基金份额，转入本基金时，注册登记机构将自动结转投资者待支付的收益。

6、基金转换后，转入的基金份额的持有期将自转入的基金份额被确认之日起重新开始计算，并按转入基金的费率计收管理费、托管费等相关基金费用。

7、当日的申购、转换和赎回申请可以在基金管理人规定的时间以前撤销。

8、基金管理人可根据基金运作的实际情况并在不影响基金份额持有人实质利益的前提下调整上述原则。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在中国证监会指定媒体上公告。

#### **（五） 场外申购、转换和赎回的程序**

##### **1、 申请方式**

基金投资者须按销售机构规定的程序，在开放日的业务办理时间提出申购、转换或赎回的申请。

投资者申购本基金，须按销售机构规定的方式备足申购资金，否则申购申请无效而不予成交。

投资者提交转换、赎回申请时，其在销售机构（网点）必须有足够的基金份额余额，否

则所提交的转换、赎回申请无效而不予成交。

##### **2、 申购、转换与赎回的确认与通知**

基金管理人应以交易时间结束前收到申购、转换或赎回申请的当天作为申购、转换或赎回申请日(T日),并在T+1日内对该交易的有效性进行确认。通常情况下,T日提交的有效申请,投资人应在T+2日到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。

### 3、申购、转换与赎回款项支付的方式与时间

申购采用全额缴款方式,若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功。若申购不成功或无效,基金管理人或基金管理人指定的代销机构将投资人已缴付的申购款项本金退还给投资人,该退还款项产生的利息等损失由投资人自行承担。

转换以份额申请,投资者转换申请成功后,基金注册登记机构将根据转换结果对投资者的权益做出相应转换。

投资者赎回申请成功后,基金托管人按有关规定将在T+7日(包括该日)内支付赎回款项。在发生巨额赎回时,款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。

## (六) 场外申购、转换和赎回的数额和价格

1、申购份额余额的处理方式:申购的有效份额为净申购金额除以当日的基金份额净值,有效份额单位为份。上述计算结果均按四舍五入方法,保留到小数点后两位,由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

2、转换份额余额的处理方式:本基金的转换所得份额由实际转出的基金份额当日净资产总值在扣除相应的转换费用后,除以转入基金当日的基金份额净值后确定。基金份额份数按四舍五入方法,保留到小数点后两位,由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

3、赎回金额的处理方式:赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用,赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法,保留到小数点后两位,由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

## (七) 场外申购份额、转换份额与赎回金额的计算公式

### 1、基金申购份额的计算

本基金以申购金额为基数采用比例费率计算申购费用。本基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。其中:

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} / (1 + \text{申购费率})$$

$$\text{申购费用} = \text{申购金额} - \text{净申购金额}$$

$$\text{申购份数} = \text{净申购金额} / \text{T日基金份额净值}$$

例，某投资者（非养老金客户）投资 5,000 元申购本基金，对应费率为 1.5%，假设申购当日基金份额净值为 1.128 元，则其可得到的申购份额为：

$$\text{净申购金额} = 5,000 / (1 + 1.5\%) = 4,926.11 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 5,000 - 4,926.11 = 73.89 \text{ 元}$$

$$\text{申购份数} = 4,926.11 / 1.128 = 4,367.12 \text{ 份}$$

即：某投资者（非养老金客户）投资 5,000 元申购本基金，假设申购当日基金份额净值为 1.128 元，则可得到 4,367.12 份基金份额。

## 2、基金转换份额的计算

基金转换计算公式如下：

$$\text{转出金额} = \text{转出份额} \times \text{转出基金当日基金份额净值}$$

$$\text{转出基金赎回手续费} = \text{转出份额} \times \text{转出净值} \times \text{转出基金赎回手续费率}$$

$$\text{补差费（外扣）} = (\text{转出金额} - \text{转出基金赎回手续费}) \times \text{补差费率} / (1 + \text{补差费率})$$

$$\text{转换费用} = \text{转出基金赎回手续费} + \text{补差费}$$

$$\text{转入金额} = \text{转出金额} - \text{转换费用}$$

$$\text{转入份额} = \text{转入金额} / \text{转入基金当日基金份额净值}$$

## 3、基金赎回金额的计算

本基金以赎回总额为基数采用比例费率计算赎回费用。本基金的赎回金额为赎回总额扣减赎回费用。其中，

$$\text{赎回总额} = \text{赎回份数} \times \text{T 日基金份额净值}$$

$$\text{赎回费用} = \text{赎回总额} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{赎回金额} = \text{赎回总额} - \text{赎回费用}$$

例：某基金份额持有人持有本基金 10,000 份基金份额一年后(未满 2 年)决定赎回，对应的赎回费率为 0.25%，假设赎回当日基金份额净值是 1.148 元，则可得到的赎回金额为：

$$\text{赎回总额} = 10,000 \times 1.148 = 11,480 \text{ 元}$$

$$\text{赎回费用} = 11,480 \times 0.25\% = 28.70 \text{ 元}$$

$$\text{赎回金额} = 11,480 - 28.70 = 11,451.30 \text{ 元}$$

即：某基金份额持有人持有 10,000 份本基金基金份额一年后（未满 2 年）赎回，假设赎回当日基金份额净值是 1.148 元，则可得到的赎回金额为 11,451.30 元。

4、T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

## 5、基金份额净值的计算公式

基金份额净值=计算日基金资产净值/计算日发行在外的基金份额总数

本基金份额净值的计算，保留到小数点后3位，小数点后第4位四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

### （八）场外申购、转换和赎回的注册登记

投资人申购基金成功后，注册登记机构在T+1日为投资者增加权益并办理注册登记手续，投资者自T+2日后（含该日）有权赎回该部分基金份额。

投资人转换基金成功之后，注册登记机构在T+1日为投资者办理权益转换的注册登记手续，投资人自T+2日（含该日）后有权赎回该部分基金份额，或就该部分基金份额再行办理转换业务。

投资人赎回基金成功后，注册登记机构在T+1日为投资者办理扣除权益的注册登记手续。

注册登记机构可以在法律法规允许或未明确禁止的范围内，对上述注册登记业务办理时间进行调整，并最迟于开始实施前3个工作日在至少一种指定媒体上刊登公告。

### （九）拒绝或暂停接受申购申请的情形及处理方式

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请，此时，本基金管理人管理的其他基金的转入申请按同样的方式处理：

- （1）不可抗力原因导致基金无法接受投资人的申购申请。
- （2）证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
- （3）发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况。
- （4）基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害其他基金份额持有人利益时。
- （5）基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人利益的情形。
- （6）法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述（1）、（2）、（3）、（5）项暂停申购情形时，基金管理人应当向中国证监会备案并公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人，基金管理人及基金托管人等不承担该退回款项产生的利息等损失。在拒绝或暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理，并按规定公告及报中国证监会备案。

## （十） 暂停转换、赎回或延缓支付赎回款项的情形及处理方式

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的转出申请、赎回申请或延缓支付赎回款项：

- （1）不可抗力的原因导致基金管理人不能支付赎回款项。
- （2）证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
- （3）发生巨额赎回，根据本基金合同的规定，可以暂停接受赎回申请的情况。
- （4）发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况。
- （5）法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形时，基金管理人应向中国证监会备案并公告，已接受的赎回、转换申请基金管理人有能力足额兑付或全额转换的，基金管理人足额兑付或全部予以转换；如暂时不能足额兑付或全部予以转换，可支付部分按单个账户已被接受的赎回、转换申请量占已接受的赎回、转换申请总量的比例分配给赎回、转换申请人，未支付部分可延期支付（基金间转换申请当日未获受理部分不能延期办理），并以后续开放日的本基金份额净值为依据计算赎回

金额，但不得超过 20 个工作日，并在中国证监会指定媒体上公告。投资者在申请赎回时可选择将当日未获受理部分予以撤销。在暂停转换、赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复转换、赎回业务的办理，并予以公告。

### 巨额赎回的情形及处理方式

#### 1、巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过前一日的基金总份额的 10%，即认为是发生了巨额赎回。

#### 2、巨额赎回的处理方式

当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分顺延赎回。

(1) 全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资人的赎回申请时，按正常赎回程序执行。

(2) 部分顺延赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日



接受赎回比例不低于上一日基金总份额的 10%的前提下，对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；投资人未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获赎回的部分申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以该开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，未能赎回部分作自动延期赎回处理。

(3) 连续 2 日以上(含本数)发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒体上进行公告。

### 3、巨额赎回的公告

当发生巨额赎回并顺延赎回时，基金管理人应立即向中国证监会备案，并在 2 日内通过指定媒体、基金管理人的公司网站或销售机构的网点刊登公告，说明有关处理方法。

## (十一) 重新开放申购、转换或赎回的公告

1、发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人当日应立即向中国证监会备案，并在规定期限内至少一种指定媒体上刊登暂停公告。

2、如发生暂停的时间为 1 日，第 2 个工作日基金管理人应在至少一种指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近 1 个开放日的基金份额净值。

3、如发生暂停的时间超过 1 日但少于 2 周，暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 2 日在至少一种指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近 1 个开放日的基金份额净值。

4、如发生暂停的时间超过 2 周，暂停期间，基金管理人应每 2 周至少刊登暂停公告 1 次。暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 2 日在至少一种指定媒体上连续刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近 1 个开放日的基金份额净值。

## 九、基金份额的场内申购与赎回

本章内容仅适用于本基金通过深交所会员单位办理的场内申购和赎回业务。登记在证券登记结算系统中的基金份额可直接办理场内申购、赎回业务；登记在注册登记系统中的

基金份额可通过办理跨系统转登记业务将基金份额转登记到证券登记结算系统中，再办理场内申购、赎回业务。

### **（一）投资者范围**

中华人民共和国境内的个人投资者、机构投资者（法律、法规及其它有关规定禁止投资证券投资基金的除外）以及合格的境外机构投资者。

### **（二）使用账户**

投资者通过深交所场内申购、赎回基金份额应当使用在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开立的人民币普通股票账户或证券投资基金账户（账户开立的具体事项详见本基金份额发售公告）。

### **（三）场内申购和赎回的办理场所**

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（具体详见基金管理人于 2008 年 11 月 5 日发布的《鹏华创新关于开放申购、赎回和定期定额投资业务的公告》）。

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名单见本基金相关业务公告。该名单调整的内容投资者可在深交所网站查询，本基金管理人可不就此再行公告。

### **（四）场内申购和赎回的开放日及开放时间**

#### **1、开放日及开放时间**

本基金的场内申购赎回开放日为深圳证券交易所的工作日。业务办理时间为深圳证券交易所交易时间。基金管理人根据法律法规或本基金合同的规定公告暂停申购或赎回时除外。

基金管理人不在开放日之外的日期或者时间办理基金份额的场内申购或赎回，投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购或者赎回申请的，其基金份额申购或赎回价格为下次办理基金份额申购或赎回时间所在开放日的价格。

基金合同生效后，若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在中国证监会指定媒体上公告。

#### **2、申购的开始时间**

本基金自 2008 年 11 月 10 日开始办理场内日常申购业务。

### 3、赎回的开始时间

本基金自 2008 年 11 月 10 日开始办理场内日常赎回业务。

4、本基金场内暂时未开通基金间的转换业务，若届时开通的，本基金管理人将及时公告。

## **(五) 场内申购和赎回的原则**

1、“未知价”原则，即申购和赎回价格以受理申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算；

2、“金额申购，份额赎回”原则，即基金份额的申购以金额申报，申报单位为一元人民币；赎回以份额申报，申报单位为一份基金份额；

3、当日的申购与赎回申请可以在当日交易结束时间前撤销，在当日的交易时间结束后不得撤销。

## **(六) 场内申购和赎回的程序**

### 1、申购和赎回的申请方式

基金投资者需遵循深交所场内申购赎回相关业务规则，在开放日的业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

投资者在申购本基金时须按业务办理单位规定的方式备足申购资金。

投资者在提交赎回申请时，应确保账户内有足够基金份额余额，否则赎回申请无效。

### 2、申购和赎回申请的确认

基金注册登记机构以交易时间结束前收到申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T日)，并在 T+1 日内对该交易的有效性进行确认。通常情况下，T 日提交的有效申请，投资人应在 T+2 日到场内申购、赎回业务办理单位或以其规定的其他方式查询申购、赎回申请的确认情况。

### 3、申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式，若资金在规定时间内未全额到账则申购不成功。若申购不成功或无效，申购款项本金将退回投资者账户，由此产生的利息等损失由投资者自行承担。

投资者赎回申请成功后，基金托管人按有关规定将在 T+7 日（包括该日）内支付赎回款项。在发生巨额赎回的情况下，当日未获受理的场内赎回将自动撤销。

## **(七) 场内申购和赎回的数额限制**

1、投资者通过代销机构场内申购本基金，单笔最低申购金额为 1,000 元。

2、基金管理人、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司可根据市场情况，在不违反相关法律法规规定的前提下，调整上述限制。基金管理人要求予以调整的，必须在调整前 3 个工作日至少在一种中国证监会指定的媒体上刊登公告并报中国证监会备案。

3、申购份额、余额的处理方式：申购的基金份额份数保留到整数位，小数点后部分将以现金形式直接退还给投资人。

4、赎回金额的处理方式：本基金的赎回金额由赎回份额乘以赎回申请当日的基金份额净值扣除赎回费用后确定。赎回金额计量单位为人民币元，赎回金额保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

#### **(八) 场内申购份额和赎回金额的计算方式**

##### 1、基金申购份额的计算

净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率)

申购手续费 = 申购金额 - 净申购金额

申购份额 = 净申购金额 / T 日基金份额净值

场内申购份额保留到整数位，计算所得整数位后小数部分的份额对应的资金返还至投资者资金账户。

例 1：某投资者通过场内投资 10,000 元申购本基金，对应的申购费率为 1.5%，假设申购当日基金份额净值为 1.025 元，则其申购手续费、可得到的申购份额及返还的资金余额为：

净申购金额 = 10,000 / (1 + 1.5%) = 9,852.22 元

申购手续费 = 10,000 - 9,852.22 = 147.78 元

申购份额 = 9,852.22 / 1.025 = 9,611.92 份

因场内申购份额保留至整数份，故投资者申购所得份额为 9,611 份，整数位后小数部分的申购份额对应的资金返还给投资者。具体计算公式为：

实际净申购金额 = 9,611 × 1.025 = 9,851.28 元

退款金额 = 10,000 - 9,851.28 - 147.78 = 0.94 元

即：投资者投资 10,000 元从场内申购本基金，假设申购当日基金份额净值为 1.025 元，则其可得到基金份额 9,611 份，退款 0.94 元。

##### 2、基金赎回金额的计算

赎回总金额=赎回份额×T日基金份额净值

赎回费用=赎回总金额×赎回费率

净赎回金额=赎回总金额-赎回费用

赎回总金额、净赎回金额按四舍五入的原则保留到小数点后两位，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

例：某投资者从深交所场内赎回本基金 10,000 份基金份额，赎回费率为 0.5%，假设赎回当日基金份额净值为 1.148 元，则其可得净赎回金额为：

赎回总金额=10,000×1.148=11,480 元

赎回费用=11,480×0.5%=57.40 元

净赎回金额=11,480-57.40=11,422.60 元

即：投资者从深交所场内赎回本基金 10,000 份基金份额，假设赎回当日基金份额净值为 1.148 元，则可得到的净赎回金额为 11,422.60 元。

3、T日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，基金份额净值可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。

#### 4、基金份额净值的计算公式

基金份额净值=计算日基金资产净值/计算日发行在外的基金份额总数

### （九）场内申购与赎回的登记结算

本基金场内申购和赎回的注册与过户登记业务，按照深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关规定办理。

（十）办理本基金份额场内申购、赎回业务应遵守深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则。若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对场内申购、赎回业务规则有新的规定，将按新规定执行。

（十一）有关拒绝或暂停基金场内申购和赎回业务的情形及处理方式参见本招募说明书第八章中关于“拒绝或暂停基金申购、赎回业务”的相关内容以及深交所有关规定，并据此执行。

## 十、基金的非交易过户和基金份额的登记、系统内转托管和跨系统转登记

### （一）基金的非交易过户

指基金注册登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行而产生的非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是合格的个人投资者或机构投资者。

继承是指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；捐赠指受理基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体；司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供基金注册登记机构要求提供的相关资料，对于符合条件的非交易过户申请自申请受理日起2个月内办理，并按基金注册登记机构规定的标准收费。具体条件、程序及收费标准以《中国证券登记结算有限责任公司开放式证券投资基金登记结算业务指南》为准。

### （二）基金份额的登记

1、本基金的份额采用分系统登记的原则。场外认购或申购买入的基金份额登记在中国结算公司注册登记系统下；场内认购、申购或上市交易买入的基金份额登记在中国结算深圳分公司证券登记结算系统下。

2、登记在证券登记结算系统中的基金份额既可在深交所上市交易，也可直接申请场内赎回。

3、登记在注册登记系统中的基金份额可申请场外赎回。

### （三）系统内转托管

1、系统内转托管是指持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（席位）之间进行转托管的行为。

2、基金份额登记在注册登记系统的基金份额持有人在变更办理基金赎回业务的销售机构（网点）时，可办理已持有基金份额的系统内转托管。

3、基金份额登记在证券登记结算系统的基金份额持有人在变更办理上市交易或场内赎回的会员单位（席位）时，可办理已持有基金份额的系统内转托管。

### （四）跨系统转登记

1、跨系统转登记是指持有人将持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统之间进行转登记的行为。

2、本基金跨系统转登记的具体业务按照中国证券登记结算有限公司的相关规定办理。

## 十一、基金的投资

### (一) 投资目标

本基金精选具有竞争力比较优势和持续盈利增长潜力的自主创新类上市公司中价值相对低估的股票，进行积极主动的投资管理，在有效控制投资风险的前提下，为基金份额持有人谋求长期、稳定的资本增值。

### (二) 投资范围

本基金的投资范围仅限于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的各类股票、债券、央行票据、权证、资产证券化产品以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如有投资需要可参与有价值的新股配售和增发。其中股票的主要投资方向为具有竞争力比较优势和持续盈利增长潜力的自主创新类上市公司中价值相对低估的股票，该部分股票的投资比例不低于本基金股票资产的80%。

本基金股票资产占基金资产的比例为60%~95%，债券资产占基金资产的比例为0~35%，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%，现金或到期日在1年期以内政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。

法律法规或中国证监会以后允许基金投资的其他金融工具或品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。如法律法规或中国证监会变更投资品种的比例限制的，基金管理人可相应调整本基金的投资比例上限规定，不需经基金份额持有人大会审议。

### (三) 投资策略

本基金的投资策略分为两个层次：第一层次是“自上而下”的资产配置策略，第二层次是“自下而上”的选股策略，主要投资于具有竞争力比较优势和持续盈利增长潜力的自主创新类上市公司中价值相对低估的股票。在充分控制投资风险的基础上，通过积极主动的投资管理，为基金份额持有人谋求长期、稳定的资本增值。

#### 1、资产配置策略

本基金主要根据宏观经济、政策环境、利率走势、市场技术指标、市场资金构成及流动性情况，运用定性和定量相结合的分析手段，对证券市场现阶段的系统性风险以及未来一段时期内各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估，并据此制定本基金股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。

## 2、股票投资策略

本基金主要投资于自主创新类上市公司，所投资的自主创新类上市公司包括两类：高新技术产业创新类上市公司和传统产业创新类上市公司。本基金所投资的高新技术产业创新类上市公司主要是指在电子与信息技术、生物医药与农业、新型材料、新能源及高效节能、光机电一体化、医药与医学工程、环境保护、航空航天、地球、空间及海洋工程、核应用等技术领域内主业突出、通过自主创新及技术产业化获得技术优势且能够保持较高利润率水平的上市公司。本基金所投资的传统产业创新类上市公司是指传统产业类中已完成或正在管理制度、商业模式、营销体系、技术开发和生产体系等方面进行创新，具有较好潜在发展前景和经济效益的上市公司。本基金将会致力于发掘那些通过在管理制度、商业模式、营销体系、技术开发和生产体系等方面进行创新而使得竞争力、盈利能力和可持续发展能力得以提升，具有较好潜在发展前景和持续盈利增长能力的传统产业创新类上市公司。

### (1) 个股选择

本基金坚持“自下而上”的个股选择策略，致力于选择具有竞争力比较优势，未来成长空间大，持续经营能力强的自主创新类上市公司中价值相对低估的股票作为主要的股票投资对象。除此以外，本基金还将高度重视和跟踪那些过去基本面情况差但现在已有明显好转的上市公司股票，深入分析其基本面发生转变的根本性原因，同时采用多种价值评估办法多角度地对其进行投资价值分析，甄选出那些基本面已得到改善，同时具有潜在高盈利增长趋势的个股作为投资对象。

本基金的个股选择的步骤如下：

#### 1) 备选股票的初筛选

首先剔除 ST、\*ST 类股票，然后剔除最近两年中公司有重大违规行为或公司的财务报告有重大问题的股票，剩下的股票构成本基金初选的备选股票库。

#### 2) 自主创新型企业的界定和初步筛选

对本基金初选的备选股票所属企业，借助于定性分析和定量分析相结合的方式，通过分析企业的研发（R&D）投入规模及其强度、企业的自主创新行为、企业的研发（R&D）能



力、企业的自主创新管理能力以及对企业的自主创新效果进行评价来衡量和识别企业是否具有自主创新型企业属性，同时对自主创新型企业进行初步筛选。

- a) 研发（R&D）投入规模及其强度分析：公司为保证技术领先地位，进而获取超额利润率，在研发资金上应确保资金支持的规模和持续性；同时，确保人力资源投入与经费投入水平适当增长。对企业 R&D 投入强度的评判，所采用的主要量化指标包括：R&D 投入强度、人均研发费用、R&D 团队强度、技术引进投入强度等；
  - b) 企业的自主创新行为辨识：通过一些可辨识的自主创新行为，对企业的自主创新进行分类和界定，比如：技术创新、产品或服务创新、商业模式创新、流程创新、管理创新（管理方法、制度）等。在辨别企业是否具有自主创新属性时，本基金管理人将从行为的预期效果来进行论证，只有能够达到相关效用、成本与价格的协调，实现成本与创新之间的有效平衡，即价值创新的行为，才能确定为创新性行为，这样的企业才能确定为具有自主创新型企业的属性；
  - c) 企业的研发（R&D）能力分析：主要采用的分析指标包括：自主创新产品率、主要产品更新周期、拥有专有技术和专利、对引进技术的消化、吸收和改进能力等；
  - d) 企业的自主创新管理能力分析：对有些企业而言，尽管不断有创新活动，却不能产生利润，究其原因，主要在于企业的自主创新管理能力欠缺，无法实现成果的商业价值。因此，本基金将对企业的自主创新管理能力的各方面进行分析，比如：企业的技术前瞻能力、企业的技术管理能力（是否具有科学规范的研发管理体系、激励和人才培养机制）、企业创新与发展战略的匹配能力、企业的资源整合能力以及企业的市场开拓能力等；
  - e) 企业的自主创新效果评价：针对具体的创新项目，本基金管理人将采用销售收入边际增长率、毛利率边际增长率、投入资本回报率等指标来衡量项目的预期投资回报率，进而对项目的创新效果进行评价；
  - f) 初筛选：通过以上步骤，筛选出具有自主创新型企业属性的股票。
- 3) 股票所属企业的竞争力评估

对按照上述步骤筛选出来的股票，行业研究小组将进一步地对股票所属企业的竞争力进行综合评估，并从中筛选出具有竞争力比较优势的企业股票作为投资备选对象。对于企业是否具有竞争力比较优势，行业研究小组将主要从以下几个方面加以分析：

- a) 企业所属产业具有较强的政策扶持力度；
- b) 企业所在行业具有相对合理的产业结构；
- c) 企业具有主业突出、通过自主创新及技术产业化获得技术优势且能够保持较高利润率水平的特征（就具有高技术含量的企业而言）；
- d) 企业通过在管理制度、商业模式、营销体系、技术开发和生产体系等方面进行创新而使得竞争力、盈利能力和可持续发展能力得以提升；
- e) 企业的 R&D 具有高投入高产出的特征，即具有较高的投资回报率；
- f) 企业能够在国内市场形成一定的进入壁垒；
- g) 与国际上同行业的类似企业相比，其技术可以保持与国际领先水平同步，同时具有成本优势；
- h) 能够将竞争力优势转化为持续盈利能力。具体体现为销售收入和净利润的增长率高于行业平均水平，并在可预期的未来仍将继续保持这种增长趋势；净资产收益率和毛利率高于行业平均水平。

#### 4) 股票所属企业的财务健康状况评估

对按照上述步骤筛选出来的股票，行业研究小组将对股票所属企业的财务健康状况进行评估，以便确保被筛选出来的股票所属企业的财务状况健康。财务健康状况的评估内容以及评估中所采用的量化指标主要包括：

- a) 盈利能力：EBITDA、净利润率、毛利润率、每股收益；
- b) 投资回报率：净资产收益率、总资产回报率；
- c) 成长能力：主营业务收入增长率、主营业务利润增长率、净利润增长率、PEG；
- d) 负债水平：权益负债比率、净债务 / EBITDA、EBIT/利息支出；
- e) 现金获取能力：每股现金流量、自由现金流量。

#### 5) 股票价值评估

对按上述步骤筛选出来的股票，行业研究小组将进一步地进行价值评估。针对股票所属产业特点的不同，本基金将采取不同的股票估值模型，同时本基金将立足全球视野，在

综合考虑股票历史的、国内的、国外的估值水平的基础上，对企业进行相对价值评估，甄选价值相对低估的个股作为本基金的投资对象。

#### 6) 备选股票库

本基金的备选股票库由三类股票组成：第一类是按照以上五个步骤筛选出来的具有竞争力比较优势，未来成长空间大，持续经营能力强的自主创新类上市公司中价值相对低估的股票；第二类是那些过去基本面情况差，但现在基本面已得到改善，同时具有潜在高盈利增长趋势的上市公司股票；第三类是新股。

行业研究小组的研究员将会定期或不定期地对该备选股票库中的股票进行维护和更新。

#### (2) 股票投资组合的构建

1) 基金管理小组确定拟买入股票名单：基金管理小组在备选股票库的基础上，通过对个股的风险收益特征以及市场状况的分析，再结合对个股的价格趋势和市场时机的判断，从备选股票库中精选拟买入股票名单。

2) 基金管理小组在确定的行业配置权重和个股权重范围内初步构建股票投资组合：基金管理小组在拟买入股票名单的基础上，结合对行业布局（如单个行业的股票集中度、行业配置的分散程度）的考虑、对股票投资基准的考虑（如投资组合的行业配置偏离投资基准过大，则组合的非系统性风险就会过高）以及对投资限制条件（如备选股票库中各类股票的投资比例限制；基金经理设定的关于大、中、小盘股票投资比例的限制条件等）的考虑，在确定的各行业配置比例和个股权重范围内，初步完成股票投资组合的构建。

3) 投资组合优化：组合优化是指在一定的限制条件下，将组合调整到具有最优风险收益特征的状态。基金管理小组在一些事先设定的投资限制条件下，利用 Barra Aegis 系统，进行组合优化。基金管理小组根据由该系统得出的优化结果，再结合对基本面、政策面以及市场状况的分析，对组合中的个股权重进行适当地调整，然后再利用 Barra Aegis 系统进行优化，多次反复，直至得到自己满意的投资组合为止。

#### 3、债券投资策略

本基金的债券投资采用久期控制下的主动投资策略，本着风险收益匹配最优、兼顾流动性的原则确定债券各类属资产的配置比例。在个券选择上，本基金综合运用利率预期、收益率曲线估值、信用等级分析、流动性评估等方法来评估个券的投资价值。

#### 4、权证投资策略

本基金将权证看作是辅助性投资工具，权证的投资原则为有利于基金资产增值，有利于加强基金风险控制。

本基金在权证投资中将权证标的证券的基本面进行研究，同时综合考虑权证定价模型、市场供求关系、交易制度设计等多种因素对权证进行定价，主要运用的投资策略为：杠杆交易策略、对冲保底组合投资策略、保底套利组合投资策略、买入跨式投资策略、Delta 对冲策略等。

#### **（四）投资决策程序**

##### 1、决策依据

- （1）国家有关法律、法规和本基金合同的有关规定；
- （2）国家宏观经济环境及其对证券市场的影响；
- （3）货币政策的变化；
- （4）利率走势与通货膨胀预期；
- （5）地区及行业发展状况；
- （6）上市公司价值发现；
- （7）国内及国际著名研究机构的研究报告。

##### 2、决策程序

本基金的投资主要参照以下流程进行运作，在有效控制投资风险的前提下，为基金份额持有人谋求长期、稳定的资本增值：

（1）行业研究小组的研究员通过自身研究以及借助外部研究机构的研究成果，形成宏观、策略方面的研究报告，为基金资产配置提供决策支持。

（2）投资决策委员会依照基金管理小组提供的投资组合建议审定投资原则与方向，即确定股票、债券以及现金等大类资产之间的配置比例，确定基金资产分散的程度和各类资产投资的比重。

（3）基金管理小组根据投资决策委员会制定的投资原则和方向，再结合行业研究小组的投资建议报告以及自己对市场时机的判断，确定行业配置比例以及个股权重，构建股票投资组合，再通过 BARRA AEGIS 风险管理系统的优化分析以及基金管理小组的判断对组合作进一步的调整优化。

（4）基金管理小组在充分考虑基金投资的安全性和基金资产的流动性的基础上，构建债券组合。

(5) 交易室按有关交易规则执行交易指令，并将有关信息反馈给基金经理。

(6) 公司风险绩效评估研究员负责对基金持仓的品种进行风险监控、风险预警以及投资业绩评估。

(7) 公司风险绩效评估研究员定期为投资决策委员会、投资总监、基金管理小组提供基金业绩评估报告，基金管理小组对于投资决策委员会和风险管理人員认为具有较大风险的投资品种拟定改进方案，并必须在规定的时间内调整投资组合。

(8) 监察稽核部对投资流程的合法合规性进行监控。

### **(五) 业绩比较基准**

沪深 300 指数收益率 75% + 中证综合债指数收益率 × 25%

本基金的股票投资部分以沪深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。

中证综合债指数的选样债券的信用类别覆盖全面，期限构成宽泛，能较好地反映我国债券市场的整体价格变动趋势，因此选择该指数作为衡量基金债券投资部分的业绩比较基准。

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。

### **(六) 风险收益特征**

本基金属于混合型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金，低于股票型基金，为证券投资基金中的中高风险、中高收益品种。

### **(七) 投资限制**

#### **1、组合限制**

本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点，通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。基金的投资组合将遵循以下限制：

(1) 本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%；

(2) 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%；

(3) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；

(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%；

(6) 股票资产占基金资产的比例为 60%~95%，债券资产占基金资产的比例为 0~35%；

(7) 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%；

(8) 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%；

(9) 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%；

(10) 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%；

(11) 本基金投资的资产支持证券须具有评级资质的资信评级机构进行持续信用评级。本基金投资于资产支持证券，根据基金合同制订相应的证券信用级别限制，若基金合同未订明相应的证券信用级别限制，应投资于信用级别评级为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。

证券投资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。

(12) 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；

(13) 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%；

(14) 保持不低于基金资产净值百分之五的现金或者到期日在一年以内的政府债券；

(15) 法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价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。

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。

## 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) 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，但是国务院另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- (6) 买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有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；
- (7) 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；
- (8) 依照法律法规有关规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

法律法规或监管部门取消上述限制或禁止行为的，本基金可不受上述限制。

### (八)基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则

- (1) 不谋求对上市公司的控股，不参与上市公司的经营管理；
- (2) 有利于本基金财产的安全和增值；
- (3) 独立行使股东权利，保护基金投资者的利益；
- (4) 基金管理人按照国家有关规定代表本基金独立行使股东权利，保护基金投资者的利益。

### (九)基金投资组合报告（未经审计）

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年10月20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。

本报告中财务资料未经审计。

本本报告期自2017年7月1日起至9月30日止。

## 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	87,850,459.02	91.92
	其中：股票	87,850,459.02	91.92
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	7,640,702.42	7.99
8	其他资产	85,431.09	0.09
9	合计	95,576,592.53	100.00

## 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

### (1) 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	49,988,716.21	53.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,300,024.00	1.39
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	387,912.72	0.42
G	交通运输、仓储和邮政业	2,018,127.15	2.16
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,196,136.00	7.70
J	金融业	18,184,690.82	19.45
K	房地产业	5,447,889.40	5.83
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	3,326,962.72	3.56
S	综合	-	-
	合计	87,850,459.02	93.99

(2) 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

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	600519	贵州茅台	10,176	5,267,504.64	5.64
2	600201	生物股份	138,400	4,628,096.00	4.95
3	000333	美的集团	103,100	4,555,989.00	4.87
4	601336	新华保险	78,246	4,434,200.82	4.74
5	601688	华泰证券	178,700	4,042,194.00	4.32
6	002624	完美世界	109,000	3,570,840.00	3.82
7	601555	东吴证券	274,300	3,349,203.00	3.58
8	600885	宏发股份	76,400	3,172,128.00	3.39
9	000056	皇庭国际	249,142	3,164,103.40	3.39
10	002048	宁波华翔	120,000	3,135,600.00	3.35

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：无。

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

注：无。

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

注：无。

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

注：无。

## 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

注：无。

## 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

注：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

注：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

注：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

注：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

注：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金宇生物技术股份有限公司（以下简称“公司”）于2016年12月3日公告，2016年12月1日，公司收到中国证券监督管理委员会内蒙古监管局（以下简称“内蒙古证监局”）《关于对金宇生物技术股份有限公司采取责令改正措施的决定》（[2016]7号，以下简称“《决定书》”）。现将《决定书》主要内容公告如下：

“近期，我局对你公司进行了现场检查，发现你公司存在如下问题：

一、公司会计估计变更未披露。根据财税[2014]75号文件，2015年，公司子公司金宇保灵生物药品有限公司本期将100万元以下研发用固定资产折旧一次性进费用，子公司扬州优邦生物制药有限公司对生物制药专用设备采用加速折旧，两家子公司固定资产折旧方法与生物股份年报披露的固定资产折旧政策不一致（公司2015年年报中披露的固定资产折旧方法为年限平均法），共计影响当期固定资产折旧金额1,557.39万元，上述事项应属会计估计变更。公司未对上述会计估计变更事项进行披露，年报中在重要会计政策和会计估计变更中选定为不适用。违反《上市公司信息披露管理办法》第三十条规定。

二、公司财务报表列报不准确。公司 2015 年年报中，将预付技术使用费 1,196 万元和外购用友 ERP 系统费用 268.27 万元在“在建工程”项目进行核算。合并现金流量表时，将销售费用中技术推广费、疫苗补偿费等现金流出 7,375.68 万元计入“购买商品接受劳务支付的现金”。上述行为与《企业会计准则第 30 号—财务报表列报》第九条不符，违反《上市公司信息披露管理办法》第二条规定。

三、内幕信息知情人登记执行不到位。公司没有对分配股利、董事及三分之一以上监事发生变化的情况制作内幕信息知情人档案；2015 年进行非公开发行时未制作重大事项进程备忘录；没有对内幕信息知情人买卖本公司股票进行自查的相关记录，内幕信息知情人登记制度中也没有规定进行自查的相关条款。违反《关于上市公司建立内幕信息知情人登记管理制度的规定》第六条、第十条、第十二条的规定。

针对上述问题，根据《上市公司信息披露管理办法》第五十九条及《关于上市公司建立内幕信息知情人登记管理制度的规定》第十五条的规定，我局决定对你公司采取责令改正的行政监管措施。

你公司应当在收到本决定书之日起 30 日内向我局提交书面整改报告，我局将适时组织检查验收。

如果对本监督管理措施不服的，可以在收到本决定书之日起 60 日内向中国证券监督管理委员会提出行政复议申请，也可以在收到本决定书之日起 6 个月内向有管辖权的人民法院提起诉讼。复议与诉讼期间，上述监督管理措施不停止执行。”

公司董事会对上述问题高度重视，将按照《决定书》要求在规定时间内提交整改报告，同时进一步规范公司治理，并根据相关规定及时履行信息披露义务。

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，从监管措施公告中知悉，相关问题对于公司经营并不构成重大实质性影响。对公司的财务状况及经营成果并不产生重大实质性影响。本次监管措施对该股票的投资价值不产生重大影响。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之一的华泰证券：2017 年 1 月 18 日公司收到中国证监会行政监管措施决定书《关于对华泰证券股份有限公司采取责令改正措施的决定》（〔2017〕3 号），原文如下：“经查，我会发现你公司营业部及资产管理子公司分别利用同名微信公众号、官方网站向不特定对象公开宣传推介私募资产管理产品。公司在公告中披露：“将按照相关法律、行政法规和中国证监会规定的要求落实整改，进一步梳理相关流程，强化有关人员守法合规意识，在今后的工作中防止此类情况的再次发生。

以上行政监管措施对公司业绩暂无重大不利影响，公司目前经营情况正常”。

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，证监会对公司给予的决定书事项，对该股票的投资价值不产生重大影响，该证券的投资已严格执行内部投资决策流程，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	33,577.32
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,608.51
5	应收申购款	50,245.26
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	85,431.09

### (4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

### (5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

### (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。

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）：

	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
2008年10月10日（基金合同生效日）至2008年12月31日	1.60%	0.17%	-5.45%	2.28%	7.05%	-2.11%
2009年1月1日至2009年12月31日	70.14%	1.76%	67.59%	1.54%	2.55%	0.22%
2010年1月1日至2010年12月31日	-7.38%	1.62%	-8.46%	1.19%	1.08%	0.43%
2011年1月1日至2011年12月31日	-31.28%	1.36%	-18.00%	0.98%	-13.28%	0.38%
2012年1月1日至2012年12月31日	11.21%	0.95%	6.95%	0.96%	4.26%	-0.01%
2013年1月1日至2013年12月31日	14.71%	1.25%	-5.48%	1.05%	20.19%	0.20%
2014年1月1日至2014年12月31日	30.01%	1.13%	40.36%	0.91%	-10.35%	0.22%
2015年1月1日至2015年12月31日	44.99%	2.62%	7.71%	1.86%	37.28%	0.76%
2016年1月1日至2016年12月31日	-5.22%	1.59%	-7.69%	1.05%	2.47%	0.54%
2017年1月1日至2017年9月30日	8.33%	0.66%	11.98%	0.43%	-3.65%	0.23%
自基金合同生效日至2017年9月30日	171.65%	1.53%	87.89%	1.23%	83.76%	0.30%

### 十三、基金的财产

#### （一）基金财产的构成

基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款以及其他资产的价值总和。

#### （二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

#### （三）基金财产的账户

本基金财产以基金名义开立银行存款账户，以基金托管人的名义开立证券交易清算资金的结算备付金账户，以基金托管人和本基金联名的方式开立基金证券账户，以本基金的名义开立银行间债券托管账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和注册登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

#### **（四）基金财产的保管及处分**

基金财产独立于基金管理人、基金托管人和代销机构的固有财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人不得将基金财产归入其固有财产。基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益归入基金财产。基金管理人、基金托管人可以按基金合同的约定收取管理费、托管费以及其他基金合同约定的费用。基金管理人、基金托管人以其固有财产承担法律责任，其债权人不得对基金财产行使请求冻结、扣押和其他权利。

基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。

除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定处分外，基金财产不得被处分。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

## **十四、基金资产的估值**

### **（一）估值目的**

基金资产的估值目的是客观、准确地反映基金资产的价值，并为基金份额的申购、赎回与转换等提供计价依据。

### **（二）估值日**

本基金的估值日为本基金相关的证券交易场所的正常营业日。

### **（三）估值方法**

#### **1.股票估值方法：**

(1)上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。

#### **(2)发行未上市股票的估值：**

1)首次发行未上市的股票，按成本计量；

2)送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价估值；

3)首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的市价估值；

4)非公开发行有明确锁定期的流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值；

(3)在任何情况下，基金管理人如采用本项第(1)–(2)小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第(1)–(2)小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值；

(4)国家有最新规定的，按其规定进行估值。

2.债券估值方法：

(1)证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，按最近交易日的收盘价估值；

(2)证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的应收利息得到的净价进行估值，估值日没有交易的，以最近交易日的收盘净价估值；

(3)发行未上市债券采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量；

(4)在全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值；

(5)同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值；

(6)在任何情况下，基金管理人如采用本项第(1)–(5)小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第(1)–(5)小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上形成的债券估值，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值；

(7)国家有最新规定的，按其规定进行估值。

(8)根据中国证监会《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》规定，本基金管理人进一步明确了本基金持有资产的估值方法，具体内容详见本基金管理人于2008年9月16日刊登的《鹏华基金管理有限公司关于进一步规范旗下基金估值业务的公告》。

### 3.权证估值方法：

(1)基金持有的权证，从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的权证按估值日在证券交易所挂牌的该权证的收盘价估值；估值日没有交易的，按最近交易日的收盘价估值；

未上市交易的权证采用估值技术确定公允价值；在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量；

(2)在任何情况下，基金管理人如采用本项第(1)小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第(1)小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值；

(3)国家有最新规定的，按其规定进行估值。

4、如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

因，双方协商解决。

5、根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。

## **(四) 估值对象**

基金所拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产。

## **(五) 估值程序**

1、基金份额净值是按照每个开放日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到0.001元，小数点后第四位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

每工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。



2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值。基金管理人每工作日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

#### （六）估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后3位以内(含第3位)发生差错时，视为基金份额净值错误。

本基金合同的当事人应按照以下约定处理：

##### 1、差错类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或注册登记机构、或代销机构、或投资人自身的过错造成差错，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该差错遭受损失的当事人（“受损方”）按下述“差错处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

上述差错的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等；对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平不能预见、不能避免、不能克服，则属不可抗力，按照下述规定执行。

由于不可抗力原因造成投资人的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

##### 2、差错处理原则

(1) 差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的，由差错责任方承担；若差错责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正。

(2) 差错的责任方对可能导致有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对差错的有关直接当事人负责，不对第三方负责。

(3) 因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当

事人的利益损失(“受损方”),则差错责任方应赔偿受损方的损失,并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利;如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方,则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给差错责任方。

(4) 差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。

(5) 差错责任方拒绝进行赔偿时,如果因基金管理人过错造成基金财产损失时,基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿,如果因基金托管人过错造成基金财产损失时,基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。基金管理人和托管人之外的第三方造成基金财产的损失,并拒绝进行赔偿时,由基金管理人负责向差错方追偿;追偿过程中产生的有关费用,应列入基金费用,从基金资产中支付。

(6) 如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿,并且依据法律法规、基金合同或其他规定,基金管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任,则基金管理人有权向出现过错的当事人进行追索,并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失。

(7) 按法律法规规定的其它原则处理差错。

### 3、差错处理程序

差错被发现后,有关的当事人应当及时进行处理,处理的程序如下:

(1) 查明差错发生的原因,列明所有的当事人,并根据差错发生的原因确定差错的责任方;

(2) 根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估;

(3) 根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失;

(4) 根据差错处理的方法,需要修改基金注册登记机构交易数据的,由基金注册登记机构进行更正,并就差错的更正向有关当事人进行确认。

### 4、基金份额净值差错处理的原则和方法如下:

(1) 基金份额净值出现错误时,基金管理人应当立即予以纠正,通报基金托管人,并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

(2) 错误偏差达到基金份额净值的 0.25%时,基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会;错误偏差达到基金份额净值的 0.5%时,基金管理人应当公告,通报基金托管人并报中国证监会备案。

(3) 因基金份额净值计算错误，给基金或基金份额持有人造成损失的，应由基金管理人先行赔付，基金管理人按差错情形，有权向其他当事人追偿。

(4) 基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差，以基金管理人计算结果为准。

(5) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

#### **(七) 暂停估值的情形**

- 1、基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 2、因不可抗力或其它情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；
- 3、占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障投资人的利益，已决定延迟估值；
- 4、如出现基金管理人认为属于紧急事故的任何情况，会导致基金管理人不能出售或评估基金资产的；
- 5、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

#### **(八) 基金净值的确认**

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，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金资产净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值予以公布。

#### **(九) 特殊情况的处理**

- 1、基金管理人或基金托管人按股票估值方法的第(3)项或债券估值方法的第(5)项或权证估值方法的第(2)项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。
- 2、由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，本基金管理人和本基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误或对基金财产、基金份额持有人利益造成损失的，本基金管理人和本基金托管人可以免除赔偿责任。但本基金管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

## 十五、基金的收益分配

### (一)基金收益的构成

- 1、买卖证券差价；
- 2、基金投资所得红利、股息、债券利息；
- 3、银行存款利息；
- 4、已实现的其他合法收入。

因运用基金财产带来的成本或费用的节约应计入收益。

### (二)基金净收益

基金净收益为基金收益扣除按国家有关规定应（或可以）在基金收益中扣除的费用后的余额。

### (三)收益分配原则

本基金收益分配应遵循下列原则：

- 1、本基金的每份基金份额享有同等分配权；
  - 2、基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值；
  - 3、收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。
  - 4、本基金收益每年最多分配 12 次，每次分配比例不低于符合上述基金分红条件的可分配收益的 50%；
  - 5、本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。
- 场内认购、申购和上市交易的基金份额的分红方式为现金红利，投资人不能选择其他的分红方式，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；
- 6、基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；
  - 7、基金当年收益应先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配；
  - 8、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年至少分配一次，但若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配；
  - 9、法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

#### (四) 收益分配方案

基金收益分配方案中应载明基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额、分配方式、支付方式等内容。

#### (五) 收益分配的时间和程序

1、基金收益分配方案由基金管理人拟订，由基金托管人复核，依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告并报中国证监会备案；

2、在收益分配方案公布后，基金管理人依据具体方案的规定就支付的现金红利向基金托管人发送划款指令，基金托管人按照基金管理人的指令及时进行分红资金的划付。

## 十六、基金的费用与税收

### (一) 与基金运作有关费用

#### 1、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) 基金财产拨划支付的银行费用；
- (4) 基金合同生效后的信息披露费用；
- (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。

上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内按照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。基金托管人根据有关法规和本基金合同、招募说明书等法律文件的规定，按费用的实际支出金额支付，列入当期基金费用。国家另有规定的从其规定。

#### 2、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

基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

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 2 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

(2) 基金托管人的托管费

基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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，基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金资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。

(二) 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，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金采取金额申购的方式。

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保险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<50 万	0.6%
50 万≤ M <250 万	0.6%
250 万≤ M <500 万	0.6%
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<50 万	1.5%
50 万≤ M <250 万	1.2%
250 万≤ M <500 万	0.8%
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、转换费率：本基金已于 2008 年 11 月 25 日开通了日常转换业务，根据中国证券监督管理委员会《开放式证券投资基金费用管理规定》的最新相关规定，具体转换费率和相关业务规则请见本公司发布的相关公告。

今后本基金开通与本基金管理人旗下其他基金的转换业务时，本基金管理人届时将及时公告，请投资者予以关注并查阅相关信息。

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%。

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%用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

4、基金管理人可以在不违反相关法律、法规及中国证监会强制规定以及不违反基金合同约定的前提下，在本基金合同约定的范围内调整上述费率及/或收取方式，无须召开基金份额持有人大会，并应最迟于新的费率实施前3个工作日依照《信息披露办法》的有关规定在中国证监会指定媒体上公告。调整后的上述费率还将在最新的招募说明书中列示。

5、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，针对特定交易对象、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上述基金申购费率、基金转换费率和基金赎回费率。

### **(三) 其他费用**

按照国家有关规定可以列入的其他费用根据相关法律及中国证监会相关规定列支。

### **(四) 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的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关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、会计师费以及其他费用不得从基金财产中支付。

### **(五) 费用调整**

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。

### **(六) 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。

## **十七、基金的会计与审计**

### **(一)基金的会计政策**

- 1、基金管理人为本基金的会计责任方；
- 2、本基金的会计年度为公历每年的1月1日至12月31日，如果基金首次募集的会计年度，基金合同生效少于2个月，可以并入下一个会计年度；
- 3、本基金的会计核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；



- 4、会计制度执行国家有关的会计制度；
- 5、本基金独立建账、独立核算；
- 6、基金管理人保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；
- 7、基金托管人定期与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并书面确认。

## (二)基金的审计

- 1、基金管理人聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金年度财务报表及其他规定事项进行审计。会计师事务所及其注册会计师与基金管理人、基金托管人相互独立。
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师时，应事先征得基金管理人同意。
- 3、基金管理人(或基金托管人)认为有充足理由更换会计师事务所，经基金托管人(或基金管理人)同意，并报中国证监会备案后可以更换。就更换会计师事务所，基金管理人应当依照《信息披露办法》的有关规定在中国证监会指定媒体上公告。

## 十八、基金的信息披露

基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他有关规定。基金管理人、基金托管人和其他基金信息披露义务人应当依法披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和其他组织。基金管理人、基金托管人和其他基金信息披露义务人应按规定将应予披露的基金信息披露事项在规定时间内通过中国证监会指定的全国性报刊(以下简称“指定报刊”)和基金管理人、基金托管人的互联网网站(以下简称“网站”)等媒介披露。

本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

- 1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
- 2、对证券投资业绩进行预测；
- 3、违规承诺收益或者承担损失；

- 4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金份额发售机构；
- 5、登载任何自然人、法人或者其他组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；
- 6、中国证监会禁止的其他行为。

本基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证两种文本的内容一致。两种文本发生歧义的，以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

公开披露的基金信息包括：

#### (一)招募说明书

招募说明书是基金向社会公开发售时对基金情况进行说明的法律文件。

基金管理人按照《基金法》、《信息披露办法》、基金合同编制并已于2008年8月28日将基金招募说明书登载在指定报刊和网站上。基金合同生效后，基金管理人应当在每6个月结束之日起45日内，更新招募说明书并登载在网站上，将更新的招募说明书摘要登载在指定报刊上。基金管理人将在公告的15日前向中国证监会报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供书面说明。更新后的招募说明书公告内容的截止日为每6个月的最后1日。

#### (二)基金合同、托管协议

基金管理人应在基金份额发售的3日前，将基金合同摘要登载在指定报刊和网站上；基金管理人、基金托管人应将基金合同、托管协议登载在各自网站上。（具体详见基金管理人于2008年8月28日公告的《鹏华盛世创新股票型证券投资基金（LOF）基金合同》及《鹏华盛世创新股票型证券投资基金（LOF）托管协议》）。

#### (三)基金份额发售公告

基金管理人将按照《基金法》、《信息披露办法》的有关规定，就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于指定报刊和网站上。

（具体详见基金管理人于2008年8月28日公告的《鹏华盛世创新股票型证券投资基金（LOF）份额发售公告》）

#### (四)基金合同生效公告

本基金管理人已于2008年10月11日刊登了本基金的基金合同生效公告，本基金基金合同于2008年10月10日生效。

#### (五)基金份额上市交易公告书

基金份额获准在证券交易所上市交易的，基金管理人应当在基金份额上市交易 3 个工作日前，将基金份额上市交易公告书登载在指定报刊和网站上。（具体详见基金管理人于 2008 年 11 月 5 日公告的《鹏华盛世创新股票型证券投资基金（LOF）上市交易公告书》）

#### (六)基金资产净值公告、基金份额净值公告、基金份额累计净值公告

1、本基金的基金合同生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人将至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值；

2、在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人将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；

3、基金管理人将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。基金管理人应当在上列市场交易日的次日，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报刊和网站上。

#### (七)基金份额申购、赎回价格公告

基金管理人应当在本基金的基金合同、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资人能够在基金份额发售网点查阅或者复制前述信息资料。

#### (八)基金年度报告、基金半年度报告、基金季度报告

1、基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定报刊上。基金年度报告需经具有从事证券相关业务资格的会计师事务所审计后，方可披露；

2、基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定报刊上；

3、基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定报刊和网站上；

4、基金合同生效不足 2 个月的，本基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。

5、基金定期报告应当在公开披露的第二个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本和书面报告两种方式。

#### (九)临时报告与公告

在基金运作过程中发生如下可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的事件时，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案：

- 1、基金份额持有人大会的召开及决议；
- 2、终止基金合同；
- 3、转换基金运作方式；
- 4、更换基金管理人、基金托管人；
- 5、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 6、基金管理人股东及其出资比例发生变更；
- 7、基金募集期延长；
- 8、基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动；
- 9、基金管理人的董事在一年内变更超过 50%；
- 10、基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过 30%；
- 11、涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼；
- 12、基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查；
- 13、基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚，基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚；
- 14、重大关联交易事项；
- 15、基金收益分配事项；
- 16、管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- 17、基金份额净值计价错误达基金份额净值 0.5%；
- 18、基金改聘会计师事务所；
- 19、基金变更、增加或减少代销机构；
- 20、基金更换登记结算机构；
- 21、本基金开始办理申购、赎回；
- 22、本基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；
- 23、本基金发生巨额赎回并延期支付；
- 24、本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；
- 25、本基金暂停接受申购、赎回申请以及其后重新接受申购、赎回；

- 26、基金推出新业务或服务；
- 27、基金暂停上市、恢复上市或终止上市；
- 28、中国证监会规定的其他事项。

#### (十)澄清公告

在本基金合同存续期限内，任何公共媒体中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会。

#### (十一)基金份额持有人大会决议

#### (十二)中国证监会规定的其他信息

#### (十三)信息披露文件的存放与查阅

基金合同、托管协议、招募说明书或更新后的招募说明书、上市交易公告书、年度报告、半年度报告、季度报告和基金份额净值公告等文本文件在编制完成后，将存放于基金管理人所在地、基金托管人所在地、有关销售机构及其网点及本基金上市交易的证券交易所供公众查阅。投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。

投资人也可在基金管理人指定的网站上进行查阅。本基金的信息披露事项将在指定媒体上公告。

本基金的信息披露将严格按照法律法规和基金合同的规定进行。

## 十九、风险揭示

本基金属于混合型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金，低于股票型基金，为证券投资基金中的中高风险、中高收益品种。面临的主要风险有市场风险、投资风险、管理风险、流动性风险、本基金特有风险、技术风险、上市交易的风险及其他风险等。

### (一) 市场风险与对策

证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响，导致基金收益水平变化，产生风险，主要包括：

1、政策风险。因国家宏观政策（如货币政策、财政政策、行业政策、地区发展政策及股权分置改革与非流通股流通政策等）发生变化，导致市场价格波动而产生风险。

2、经济周期风险。随经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化。基金投资于债券与上市公司的股票，收益水平也会随之变化，从而产生风险。

3、利率风险。金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着债券的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。基金投资于债券和股票，其收益水平会受到利率变化的影响。

4、上市公司经营风险。上市公司的经营好坏受多种因素影响，如管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争、人员素质等，这些都会导致企业的盈利发生变化。如果基金所投资的上市公司经营不善，其股票价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，使基金投资收益下降。虽然基金可以通过投资多样化来分散这种非系统风险，但不能完全规避。

5、购买力风险。基金的利润将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀的影响而导致购买力下降，从而使基金的实际收益下降。

针对以上市场风险，本基金管理人将努力通过加强对宏观经济与国家政策的分析，研究并预测经济周期、利率水平的走势，作为投资的依据；同时，通过可投资股票备选库制度，加强对上市公司和所在行业的研究，采用财务分析、实地调研等多种方法判断上市公司的经营风险，选择具有长期投资价值的上市公司。

## **（二）投资风险与对策**

本基金作为混合型的开放式基金，根据本基金的投资特点，股票投资的风险包括资产配置风险、行业配置风险、证券选择风险、流动性风险、收益性风险等。

依据对超额收益的贡献大小，本基金债券投资的风险依次可划分为久期风险、期限结构风险、类属配置风险和个券选择风险，国外和国内的研究表明久期风险占债券投资总风险85%以上。如果债券组合久期与基准久期相差太多，一旦市场利率发生明显不同于预期的变化，将导致组合收益率与基准收益率出现较大偏差。

为控制上述风险，本基金管理人使用了“北方之星债券投资决策分析系统”进行债券投资的收益分析和风险监控，使用“Barra Aegis Portfolio Management 系统”和“鹏华风险评估系统”进行股票投资的动态风险监控。

## **（三）管理风险与对策**

在基金管理运作过程中基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的占有和对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平。因此，本基金

的收益水平与本基金管理人的管理水平、管理手段和管理技术等相关性较大。因此本基金可能因为基金管理人的因素而影响基金收益水平。

为控制此类风险，本基金管理人高度重视提高研究能力和管理水平，将投资建立在研究的基础上，对宏观经济、行业发展、上市公司和市场走势四个层次进行深入研究，不断总结投资经验；同时通过在实践中对制度的持续检验和完善，以及加强自身的业务学习与国外同行交流，不断引进新的管理技术和方法，提高投资管理水平，努力为基金份额持有人带来更好的投资回报。

#### **（四）流动性风险与对策**

本基金属于开放式基金，在基金的所有开放日，基金管理人都有义务接受投资者的申购和赎回。由于开放式基金在国内尚处于发展阶段，应对基金赎回的经验不足，加之中国股票市场系统性风险较大，在市场下跌时经常出现交易量急剧减少的情况，如果在这时出现较大数额的基金赎回或转换申请，则使基金资产变现困难，基金面临流动性风险。

为控制这类风险，基金管理人充分借鉴国外证券流动性理论，建立了本基金的流动性风险管理系统，用数量化指标衡量基金流动性，对基金投资组合的流动性进行监控。

#### **（五）本基金特有风险与对策**

本基金属于混合型基金，主要投资于具有竞争力比较优势和持续盈利增长潜力的自主创新类上市公司中价值相对低估的股票，因此本基金的投资表现极大地取决于本基金管理人对上市公司的自主创新行为、自主创新管理能力和自主创新效果的研判，倘若判断失误，则会相应地导致本基金管理人对股票内在价值的判断出现失误，进而导致本基金管理人做出错误的投资决策。

本基金对这类风险的控制措施就是本基金管理人将严格遵守本基金的投资流程，同时将研究工作做精、做细，力争做出正确地投资决策，力争使本基金具有较好的投资表现。

#### **（六）技术风险和对策**

当计算机、通讯系统、交易网络等技术保障系统或信息网络支持出现异常情况，可能导致基金日常的申购赎回无法按正常时限完成、注册登记系统瘫痪、核算系统无法按正常时限产生净值、基金的投资交易指令无法及时传输等风险。

这类风险的控制和防范主要依赖于系统的可靠性以及完备的备份策略。

#### **（七）上市交易的风险**

本基金在基金合同生效且符合上市交易条件后，在深圳证券交易所挂牌上市交易。由于上市期间可能因信息披露导致基金停牌，投资人在停牌期间不能买卖基金,产生风险；同时，可能因上市后交易对手不足导致基金流动性风险；另外，当基金份额持有人将份额转向场外交易后导致场内的基金份额或持有人数不满足上市条件时，本基金存在暂停上市或终止上市的可能。

#### **（八）其他风险和对策**

战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金管理人、基金销售代理人等机构无法正常工作，从而有影响基金的申购和赎回按正常时限完成的风险。

为控制这类风险，本基金管理人建立了完备的灾难恢复计划，通过每个工作日对业务数据的异地备份，防范和控制不可抗力因素造成的风险。

## **二十、基金的终止与清算**

#### **（一）本基金终止的情形及处理方式**

有下列情形之一的，本基金合同经中国证监会核准后将终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在6个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务；
- 3、基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在6个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务；
- 4、中国证监会允许的其他情况。

本基金终止后，须按法律、法规和本基金基金合同对基金进行清算。

#### **（二）基金财产的清算**

##### **1、基金财产清算组**

(1)基金合同终止时，成立基金财产清算组，基金财产清算组在中国证监会的监督下进行基金清算。

(2)基金财产清算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人员组成。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。



(3)基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算组可以依法进行必要的民事活动。

## 2、基金财产清算程序

基金合同终止后，发布基金财产清算公告；

- (1)基金合同终止时，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- (2)对基金财产进行清理和确认；
- (3)对基金财产进行估价和变现；
- (4)聘请律师事务所出具法律意见书；
- (5)聘请会计师事务所对清算报告进行审计；
- (6)将基金财产清算结果报告中国证监会；
- (7)参加与基金财产有关的民事诉讼；
- (8)公布基金财产清算结果；
- (9)对基金剩余财产进行分配。

## 3、清算费用

清算费用是指基金财产清算组在进行基金财产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组优先从基金财产中支付。

## 4、基金财产按下列顺序清偿：

- (1)支付清算费用；
- (2)交纳所欠税款；
- (3)清偿基金债务；
- (4)按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款(1)－(3)项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

## 5、基金财产清算的公告

基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算结果经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算组报中国证监会备案并公告。

## 6、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。

## 二十一、基金合同的内容摘要

### （一）基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

#### 1、基金份额持有人的权利与义务

##### （1）基金份额持有人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的权利为：

- 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；
- 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、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
- 9) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

每份基金份额具有同等的合法权益。

##### （2）基金份额持有人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的义务为：

- 1) 遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；
- 2) 交纳基金认购、申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用；
- 3) 在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；
- 4) 不从事任何有损基金及其他基金份额持有人合法权益的活动；
- 5) 执行生效的基金份额持有人大会决议；
- 6) 返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人及基金管理人的代理人、基金托管人、代销机构、其他基金份额持有人处获得的不当得利；
- 7) 法律法规和基金合同规定的其他义务。

#### 2、基金管理人的权利与义务

##### （1）基金管理人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的权利为：

- 1) 自本基金合同生效之日起，依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用基金财产；
- 2) 依照基金合同获得基金认购和申购费用、基金赎回手续费和管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；
- 3) 发售基金份额；
- 4) 依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- 5) 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、非交易过户、转托管等业务的规则；
- 6) 根据本基金合同及有关规定监督基金托管人，对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；
- 7) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回申请；
- 8) 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；
- 9) 自行担任或选择、更换登记结算机构，获取基金份额持有人名册，并对登记结算机构的代理行为进行必要的监督和检查；
- 10) 选择、更换代销机构，并依据销售代理协议和有关法律法规，对其行为进行必要的监督和检查；
- 11) 选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；
- 12) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- 13) 依法召集基金份额持有人大会；
- 14) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

## (2) 基金管理人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的义务为：

- 1) 依法募集基金，办理或者委托经国务院证券监督管理机构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、勤勉尽责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) 计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；

9) 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；

10) 按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

11) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

12) 编制中期和年度基金报告；

13) 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；

14) 保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、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，不得向他人泄露；

15) 按照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收益；

16) 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；

17) 保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

18) 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者实施其他法律行为；

19) 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；

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，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

21) 基金托管人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托管人追偿；

22) 按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；

23) 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；

- 24) 执行生效的基金份额持有人大会决议;
- 25) 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动;
- 26) 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, 不谋求对上市公司的控股和直接管理;
- 27) 法律法规、国务院证券监督管理机构和基金合同规定的其他义务。

### 3、基金托管人的权利与义务

#### (1) 基金托管人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规, 基金托管人的权利为:

- 1) 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收入;
- 2) 监督基金管理人对本基金的投资运作;
- 3) 自本基金合同生效之日起, 依法保管基金资产;
- 4) 在基金管理人更换时, 提名新任基金管理人;
- 5) 根据本基金合同及有关规定监督基金管理人, 对于基金管理人违反本基金合同或有关法律法规规定的行为, 对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的情形, 应及时呈报中国证监会, 并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益;
- 6) 依法召集基金份额持有人大会;
- 7) 按规定取得基金份额持有人名册资料;
- 8) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

#### (2) 基金托管人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规, 基金托管人的义务为:

- 1) 安全保管基金财产;
- 2) 设立专门的基金托管部, 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) 对所托管的不同基金财产分别设置账户, 确保基金财产的完整与独立;
- 4) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外, 不得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和证券账户;
- 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应予保密, 不得向他人泄露;

8) 对基金财务会计报告、中期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;

9) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料;

10) 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;

11) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项;

12) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值和基金份额申购、赎回价格;

13) 按照规定监督基金管理人的投资运作;

14) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对;

15) 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;

16) 按照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自行召集基金份额持有人大会;

17) 因违反基金合同导致基金财产损失, 应承担赔偿责任, 其赔偿责任不因其退任而免除;

18) 基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时, 应为基金向基金管理人追偿;

19) 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;

20) 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业监督管理机构, 并通知基金管理人;

21) 执行生效的基金份额持有人大会决议;

22) 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动;

23) 建立并保存基金份额持有人名册;

24) 法律法规、国务院证券监督管理机构和基金合同规定的其他义务。

## **(二) 基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则**

1、基金份额持有人大会由基金份额持有人共同组成。基金份额持有人持有的每一基金份额具有同等的投票权。

### **2、召开事由**

(1) 当出现或需要决定下列事由之一的, 经基金管理人、基金托管人或持有基金份额10%以上(含10%, 下同)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)提议时, 应当召开基金份额持有人大会:

1) 终止基金合同;

- 2) 转换基金运作方式;
- 3) 变更基金类别;
- 4) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略;
- 5) 变更基金份额持有人大会程序;
- 6) 更换基金管理人、基金托管人;
- 7) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准, 但根据适用的相关规定提高该等报酬标准的除外;
- 8) 本基金与其他基金的合并;
- 9) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项;
- 10) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

(2) 出现以下情形之一的, 可由基金管理人和基金托管人协商后修改基金合同, 不需召开基金份额持有人大会:

- 1) 调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用;
- 2) 在法律法规和本基金合同规定的范围内变更基金的申购费率、赎回费率及转换费率等费率标准或收费方式;
- 3) 因相应的法律法规发生变动, 或按照中国证监会的规定, 必须对基金合同进行修改;
- 4) 对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化;
- 5) 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;
- 6) 按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

### 3、召集人和召集方式

(1) 除法律法规或本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, 开会时间、地点、方式和权益登记日由基金管理人选择确定。基金管理人未按规定召集或者不能召集时, 由基金托管人召集。

(2) 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, 应当自行召集并确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

(3) 代表基金份额 10%以上的基金份额持有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。

(4) 代表基金份额 10%以上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,代表基金份额 10%以上的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会,但应当至少提前 30 日向中国证监会备案。

(5) 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。

#### 4、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) 基金份额持有人大会的召集人(以下简称“召集人”)负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。召开基金份额持有人大会,召集人必须于会议召开日前 30 天在指定媒体公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容:

- 1) 会议召开的时间、地点和出席方式;
- 2) 会议拟审议的主要事项;
- 3) 会议形式;
- 4) 议事程序;
- 5) 有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人权益登记日;
- 6) 代理投票的授权委托书的内容要求(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;
- 7) 表决方式;
- 8) 会务常设联系人姓名、电话;
- 9) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续;
- 10) 召集人需要通知的其他事项。



(2) 采用通讯方式开会并进行表决的情况下，由召集人决定通讯方式和书面表决方式，并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书面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书面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书面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书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

## 5、基金份额持有人出席会议的方式

### (1) 会议方式

1) 基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。

2) 现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席，如基金管理人或基金托管人拒不派代表出席的，不影响表决效力。

3) 通讯方式开会指按照本基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。

4) 会议的召开方式由召集人确定，但决定转换基金运作方式、基金管理人更换或基金托管人更换、终止基金合同的事宜必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

### (2) 召开基金份额持有人大会的条件

#### 1) 现场开会方式

在同时符合以下条件时，现场会议方可举行：

① 对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示，全部有效凭证所对应的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50%以上(含 50%，下同)；

② 到会的基金份额持有人身份证明及持有基金份额的凭证、代理人身份证明、委托人持有基金份额的凭证及授权委托书代理手续完备，到会者出具的相关文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的注册登记资料相符。

#### 2) 通讯开会方式

在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

① 召集人按本基金合同规定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；

② 召集人按基金合同规定通知基金托管人或/和基金管理人(分别或共同称为“监督人”)到指定地点对书面表决意见的计票进行监督;

③ 召集人在监督人和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的书面表决意见,如基金管理人或基金托管人经通知拒不到场监督的,不影响表决效力;

④ 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代表的基金份额占权益登记日基金总份额的 50%以上;

⑤ 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和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证、授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定,并与登记结算机构记录相符。

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,否则表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决,表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决,但应当计入基金份额持有人所代表的基金份额总数。

## 6、议事内容与程序

### (1) 议事内容及提案权

1) 议事内容为本基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容。

2) 基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日本基金总份额 10%以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前就召开事由向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案。

3) 对于基金份额持有人提交的提案,大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核:

关联性。大会召集人对于基金份额持有人提案涉及事项与基金有直接关系,并且不超出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的,应提交大会审议;对于不符合上述要求的,不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决,应当在该次基金份额持有人大会上进行解释和说明。

程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题做出决定。如将其提案进行分拆或合并表决,需征得原提案人同意;原提案人不同意变更的,大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定,并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

4) 单独或合并持有权利登记日基金总份额 10%以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案,基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的

提案，未获基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于 6 个月。法律法规另有规定的除外。

5) 基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后，如果需要对原有提案进行修改，应当最迟在基金份额持有人大会召开前 30 日及时公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有 30 日的间隔期。

## (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规定程序宣布会议议事程序及注意事项，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，经合法执业的律师见证后形成大会决议。

大会由召集人授权代表主持。基金管理人为召集人的，其授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权代表主持；如果基金管理人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以所代表的基金份额 50%以上多数选举产生一名代表作为该次基金份额持有人大会的主持人。

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)、身份证号码、住所、持有或代表有表决权的基金份额数量、委托人姓名(或单位名称)等事项。

### 2) 通讯方式开会

在通讯表决开会的方式下，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第 2 个工作日统计全部有效表决，在公证机关及监督人的监督下形成决议。如监督人经通知但拒绝到场监督，则在公正机关监督下形成的决议有效。

(3) 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。

## 7、决议形成的条件、表决方式、程序

(1) 基金份额持有人所持每一基金份额享有平等的表决权。

(2) 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

一般决议须经出席会议的基金份额持有人(或其代理人)所持表决权的 50%以上通过方为有效，除下列(2)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

特别决议须经出席会议的基金份额持有人(或其代理人)所持表决权的三分之二以上(含三分之二)通过方为有效；涉及更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、终止基金合同等重大事项必须以特别决议通过方为有效。

(3) 基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会核准或者备案，并予以公告。

(4) 基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

(5) 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。

## 8、计票

### (1) 现场开会

1) 如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，则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推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，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推举两名基金份额持有人代表与基金管理人、基金托管人授权的一名监督员共同担任监票人；但如果基金管理人和基金托管人的授权代表未出席，则大会主持人可自行选举三名基金份额持有人代表担任监票人。

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

3) 如大会主持人对于提交的表决结果有异议，可以对投票数进行重新清点；如大会主持人未进行重新清点，而出席大会的基金份额持有人或代理人对大会主持人宣布的表决结果有异议，其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，大会主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

### (2) 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监票人在监督人派出的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；如监督人经通知但拒绝到场监督，则大会召集人可自行授权 3 名监票人进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

## 9、基金份额持有人大会决议报中国证监会核准或备案后的公告时间、方式

(1) 基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决议自中国证监会依法核准或者备案之日起生效。

(2) 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。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决议。

(3) 基金份额持有人大会决议应自生效之日起 2 日内在至少一种指定媒体公告。

10、法律法规或监管部门对基金份额持有人大会另有规定或取消上述相关限制的，从其最新规定执行。

### (三) 基金合同解除和终止的事由、程序

#### 1、基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同经中国证监会核准后将终止：

(1) 基金份额持有人大会决定终止的；

(2) 基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在 6 个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务；

(3) 基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在 6 个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务；

(4) 中国证监会允许的其他情况。

#### 2、基金财产的清算

##### (1) 基金财产清算组

1)基金合同终止时，成立基金财产清算组，基金财产清算组在中国证监会的监督下进行基金清算。

2)基金财产清算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。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

3)基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算组可以依法进行必要的民事活动。

##### (2) 基金财产清算程序

基金合同终止后，发布基金财产清算公告；

1)基金合同终止时，由基金财产清算组统一接管基金财产；

- 2)对基金财产进行清理和确认;
- 3)对基金财产进行估价和变现;
- 4)聘请律师事务所出具法律意见书;
- 5)聘请会计师事务所对清算报告进行审计;
- 6)将基金财产清算结果报告中国证监会;
- 7)参加与基金财产有关的民事诉讼;
- 8)公布基金财产清算结果;
- 9)对基金剩余财产进行分配。

### (3) 清算费用

清算费用是指基金财产清算组在进行基金财产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组优先从基金财产中支付。

### (4) 基金财产按下列顺序清偿：

- 1)支付清算费用;
- 2)交纳所欠税款;
- 3)清偿基金债务;
- 4)按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款(1)–(3)项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

(5)基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算结果经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算组报中国证监会备案并公告。

### (6)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。

## (四) 争议解决方式

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，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。

本基金合同受中国法律管辖。

#### **(五) 基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式**

本基金合同可印制成册，供投资人在基金管理人、基金托管人、代销机构和登记结算机构办公场所查阅；投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件，但其效力应以基金合同正本为准。

## **二十二、基金托管协议的内容摘要**

### **(一) 托管协议当事人**

#### **1、基金管理人**

名称：鹏华基金管理有限公司

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

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

成立日期：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

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可的基金业务

#### **2、基金托管人**

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

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12号

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

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；经中国银行业监督管理委员会等监管部门批准的其他业务。

## （二）基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

1、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池和交易对手库，以便基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。

本基金的投资范围仅限于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的各类股票、债券、央行票据、权证、资产证券化产品以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如有投资需要可参与有价值的新股配售和增发。其中股票的主要投资方向为具有竞争力比较优势和持续盈利增长潜力的自主创新类上市公司中价值相对低估的股票，该部分股票的投资比例不低于本基金股票资产的80%。

本基金股票资产占基金资产的比例为60%~95%，债券资产占基金资产的比例为0~35%，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%，现金或到期日在1年期以内政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。

法律法规或中国证监会以后允许基金投资的其他金融工具或品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。如法律法规或中国证监会变更投资品种的比例限制的，基金管理人可相应调整本基金的投资比例上限规定，不需经基金份额持有人大会审议。

2、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督：

本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点，通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。基金的投资组合将遵循以下限制：

- (1) 本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的10%；
- (2) 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%；



- (3) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；
  - (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%；
  - (6) 股票资产占基金资产的比例为 60%~95%，债券资产占基金资产的比例为 0~35%；
  - (7) 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%；
  - (8) 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%；
  - (9) 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%；
  - (10) 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%；
  - (11) 本基金投资的资产支持证券须具有评级资质的资信评级机构进行持续信用评级。本基金投资于资产支持证券，根据基金合同制订相应的证券信用级别限制，若基金合同未订明相应的证券信用级别限制，应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。
- 证券投资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。
- (12) 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；
  - (13) 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%；
  - (14) 保持不低于基金资产净值百分之五的现金或者到期日在一年以内的政府债券；
  - (15) 法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价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。

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。

3、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对本托管协议第十五条第九款基金投资禁止行为进行监督。基金托管人通过事后监督方式对基金管理人基金投资禁止行为和关联交易进行监督。根据法律法规有关基金禁止从事关联交易的规定，基金管理

人和基金托管人应事先相互提供与本机构有控股关系的股东、与本机构有其他重大利害关系的公司名单及有关关联方发行的证券名单。基金管理人有责任确保上述名单的真实性、准确性、完整性，并负责及时将更新后的名单发送基金托管人。

若基金托管人发现基金管理人与关联交易名单中列示的关联方进行法律法规禁止基金从事的关联交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人采取必要措施阻止该关联交易的发生，如基金托管人采取必要措施后仍无法阻止关联交易发生时，基金托管人有权向中国证监会报告。对于基金管理人已成交的关联交易，基金托管人事前无法阻止该关联交易的发生，只能进行事后结算，基金托管人不承担由此造成的损失，并向中国证监会报告。

4、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的、经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单，并约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金管理人应严格按照交易对手名单的范围在银行间交易市场选择交易对手。基金托管人监督基金管理人是否按事前提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。基金管理人可以每半年对银行间债券市场交易对手名单及结算方式进行更新，新名单确定前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。如基金管理人根据市场情况需要临时调整银行间债券市场交易对手名单及结算方式的，应在与交易对手发生交易前3个工作日通知基金托管人，其后据此执行。

基金管理人负责对交易对手的资信控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，并负责解决因交易对手不履行合同而造成的纠纷及损失，基金托管人不承担由此造成的任何法律责任及损失。若未履约的交易对手在基金托管人与基金管理人确定的时间前仍未承担违约责任及其他相关法律责任的，基金管理人可以对相应损失先行予以承担，然后再向相关交易对手追偿。基金托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督。如基金托管人事后发现基金管理人没有按照事先约定的交易对手或交易方式进行交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人，基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任。

5、本基金投资流通受限证券，基金管理人应事先根据中国证监会相关规定，与基金托管人就相关事项签订补充协议，明确基金投资流通受限证券的比例。基金管理人应制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险。基金托管人对基金管理人是否遵守相关制度、流动性风险处置预案以及相关投资额度和比例等的情况进行监督。

6、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。

7、基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作违反法律法规和基金合同的规定，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

8、基金管理人负有义务配合和协助基金托管人依照法律法规、基金合同和本托管协议对基金业务执行核查。对基金托管人发出的书面提示，基金管理人应在规定时间内答复并改正，或就基金托管人的疑义进行解释或举证；对基金托管人按照法律法规、基金合同和本托管协议的要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

9、若基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人，由此造成的损失由基金管理人承担。

10、基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，应及时报告中国证监会，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。基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本托管协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的，基金托管人应报告中国证监会。

### **（三）基金管理人**对**基金托管人**的业务核查

1、基金管理人应对基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

2、基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、基金合同、本协议及其他有关规定时，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正。基金托管

人收到通知后应及时核对并以书面形式给基金管理人发出回函，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复基金管理人并改正。

3、基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金托管人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经基金管理人提出警告仍不改正的，基金管理人应报告中国证监会。

#### **（四）基金财产的保管**

##### **1、基金财产保管的原则**

- （1）基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。
- （2）基金托管人应安全保管基金财产。
- （3）基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。
- （4）基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立。

（5）基金托管人根据基金管理人的指令，按照基金合同和本协议的约定保管基金财产，如有特殊情况双方可另行协商解决。

（6）对于因为基金投资产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金账户的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失，基金托管人对此不承担任何责任。

- （7）除依据法律法规和基金合同的规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。
- ##### **2、基金募集期间及募集资金的验资**

（1）基金募集期间的资金应存于基金管理人在基金托管人的营业机构开立的“基金募集专户”。该账户由基金管理人开立并管理。

（2）基金募集期满或基金停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，基金管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人开立的基金银行账户，同时在规定时间内，聘请具有从事证

券相关业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的2名或2名以上中国注册会计师签字方为有效。

(3) 若基金募集期限届满，未能达到基金合同生效的条件，由基金管理人按规定办理退款等事宜。

### 3、基金资金账户的开立和管理

(1) 基金托管人可以基金的名义在其营业机构开立基金的资金账户，并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。

(2) 基金资金账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立任何其他银行账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

(3) 基金资金账户的开立和管理应符合银行业监督管理机构的有关规定。

(4) 在符合法律法规规定的条件下，基金托管人可以通过基金托管人专用账户办理基金资产的支付。

### 4、基金证券账户的开立和管理

(1) 基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司为基金开立基金托管人与基金联名的证券账户。

(2) 基金证券账户的开立和使用，仅限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借或未经对方同意擅自转让基金的任何证券账户，亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

(3) 基金证券账户的开立和证券账户卡的保管由基金托管人负责，账户资产的管理和运用由基金管理人负责。

(4) 基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，并代表所托管的基金完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清算工作，基金管理人应予以积极协助。结算备付金、结算互保基金、交收价差资金等的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

(5) 若中国证监会或其他监管机构在本托管协议订立日之后允许基金从事其他投资品种的投资业务，涉及相关账户的开立、使用的，若无相关规定，则基金托管人比照并遵守上述关于账户开立、使用的规定。

### 5、债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后，基金托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司的有关规定，在中央国债登记结算有限责任公司开立债券托管与结算账户，并代表基金进行银行间市场债券的结算。基金管理人和基金托管人同时代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议。

#### 6、其他账户的开立和管理

(1) 因业务发展需要而开立的其他账户，可以根据法律法规和基金合同的规定，由基金托管人负责开立。新账户按有关规则使用并管理。

(2) 法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

#### 7、基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券、银行存款定期存单等有价凭证由基金托管人存放于托管银行的保管库，也可存入中央国债登记结算有限责任公司、中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司或票据营业中心的代保管库，保管凭证由基金托管人持有。实物证券、银行存款定期存单等有价凭证的购买和转让，由基金管理人和基金托管人共同办理。基金托管人对由基金托管人以外机构实际有效控制的证券不承担保管责任。

#### 8、与基金财产有关的重大合同的保管

与基金财产有关的重大合同（如基金合同、托管协议）的签署，由基金管理人负责。由基金管理人代表基金签署的、与基金有关的、重大合同的原件分别由基金管理人、基金托管人保管。除协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时应当保证基金一方持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人应在重大合同签署后及时以加密方式将重大合同传真给基金托管人，并在十个工作日内将正本送达基金托管人处。重大合同的保管期限为基金合同终止后15年。

### **（五）基金资产净值计算与复核**

#### 1、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的金额。

基金份额净值是指基金资产净值除以基金份额总数，基金份额净值的计算，精确到0.001元，小数点后第四位四舍五入，国家另有规定的，从其规定。

每工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

#### 2、复核程序

基金管理人每工作日对基金资产进行估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

3、根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致意见的，按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。

#### **（六）基金份额持有人名册的登记与保管**

基金份额持有人名册至少应包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。基金份额持有人名册由基金登记结算机构根据基金管理人的指令编制和保管，基金管理人和基金托管人应分别保管基金份额持有人名册，保存期不少于15年。如不能妥善保管，则按相关法规承担责任。

本基金份额持有人名册由基金管理人提供资料，由基金托管人按规定建立并保管。在基金托管人要求或编制半年报和年报前，基金管理人应将有关资料送交基金托管人，不得无故拒绝或延误提供，并保证其的真实性、准确性和完整性。

#### **（七）争议解决方式**

因本协议产生或与之相关的争议，双方当事人应通过协商、调解解决，协商、调解不能解决的，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，仲裁地点为北京市，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。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，双方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责，各自继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和本托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本协议受中国法律管辖。

#### **（八）托管协议的修改与终止**

##### **1、托管协议的变更程序**

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行修改。修改后的新协议，其内容不得与基金合同的规定有任何冲突。基金托管协议的变更报中国证监会核准或备案后生效。

##### **2、基金托管协议终止出现的情形**

- （1）本基金合同终止；
- （2）基金托管人解散、依法被撤销、破产或由其他基金托管人接管基金资产；
- （3）基金管理人解散、依法被撤销、破产或由其他基金管理人接管基金管理权；
- （4）发生法律法规或基金合同规定的终止事项。

## 二十三、对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务。以下服务内容，由基金管理人在正常情况下向投资人提供，基金管理人可根据实际业务情况以及基金份额持有人的需要和市场的变化，不断完善并增加和修改服务项目。

### 一、营销创新及网上交易服务

为丰富投资人的交易方式和渠道，基金管理人为投资人提供多种形式的交易服务。

在营销渠道创新方面，本基金管理人大力发展基金电子商务，并已开通基金网上交易系统，投资人可登陆本基金管理人的网站（[www.phfund.com](http://www.phfund.com)），更加方便、快捷地办理基金交易及信息查询等已开通的各项基金网上交易业务。基金管理人也将不断努力完善现有技术系统和销售渠道，为投资人提供更加多样化的交易方式和手段。

### 二、交易资料的寄送服务

基金管理人将向发生交易且基金管理人持有其真实、准确、完整联系方式的基金份额持有人以书面或电子文件形式定期或不定期寄送交易对账单、《鹏友会》等资料。

### 三、信息定制服务

投资人可以通过基金管理人网站（[www.phfund.com](http://www.phfund.com)）、短信平台、呼叫中心（400-6788-999；0755-82353668）等渠道提交信息定制申请，在申请获基金管理人确认后，基金管理人将通过手机短信、E-MAIL等方式为客户发送所定制的信息。通过手机短信可定制的信息包括：月度短信账单、公司最新公告、持有基金周末净值等；通过邮件定制的信息包括：鹏友会周刊、财经资讯、电子对账单等信息。基金管理人将根据业务发展需要和实际情况，适时调整发送的定制信息内容。

### 四、在线咨询服务

投资人可通过登录本基金管理人网站进行信息查询，通过输入基金账户号（或证件号码）和查询密码进入查询账户，享有交易查询、信息定制、资料修改、对账单打印、理财刊物查阅等服务。

投资人可通过在线客服、短信接收平台等网络通讯工具进行业务咨询，基金管理人在工作时间内有专人在线提供咨询服务。

### 五、客户服务中心（CALL-CENTER）电话服务

呼叫中心（400-6788-999、0755-82353668）自动语音系统提供每周7×24小时基金账户余额、交易情况、基金产品信息与服务等信息查询。



呼叫中心人工坐席提供工作日 8:30—21:00 的座席服务（重大法定节假日除外），投资者可以通过该热线获得业务咨询、信息查询、服务投诉、信息定制、资料修改等专项服务。

#### 六、客户投诉受理服务

投资人可以通过直销和销售机构网点柜台、基金管理人设置的投诉专线、呼叫中心人工热线、书信、电子邮件等渠道，对基金管理人和销售机构所提供的服务进行投诉。

电话、电子邮件、书信、网络在线是主要投诉受理渠道，基金管理人设专人负责管理投诉电话（0755-82353668）、信箱、网络服务。现场投诉和意见簿投诉是补充投诉渠道，由各销售机构受理后反馈给本基金管理人跟进处理。

## 二十四、其他应披露事项

本基金的其他应披露事项将严格按照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》等相关法律法规规定的内容与格式进行披露，并至少在一种指定媒体上公告。

公告内容	报纸	日期
鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2017年4月12日
鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2017年4月18日
鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2017年4月20日
鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行手机银行渠道基金申购费率优惠活动的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2017年4月22日
2017年第一季度报告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2017年4月24日
鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2017年4月25日
鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2017年5月9日
鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2017年5月11日

鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2017年5月13日
鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与财通证券股份有限公司申购费率优惠活动的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2017年5月15日
鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2017年5月20日
鹏华盛世创新混合型证券投资基金（LOF）更新的招募说明书摘要	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2017年5月20日
鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2017年5月23日
鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2017年5月24日
鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2017年6月27日
鹏华基金管理有限公司关于网上直销交易系统升级切换及启用新版网上直销交易系统的提示公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2017年6月27日
鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与东亚银行（中国）有限公司手机银行基金定期定额申购费率优惠活动的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2017年6月30日
鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行股份有限公司手机银行渠道基金申购费率优惠活动的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2017年7月1日
鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行股份有限公司网上银行渠道基金申购费率优惠活动的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2017年7月1日
鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2017年7月8日
鹏华基金管理有限公司关于调整直销中心首次认/申购单笔最低金额限制的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2017年7月10日
鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2017年7月11日
鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2017年7月18日
2017年第二季度报告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2017年7月20日
鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与华西证券股份有限公司申购（含定期定额	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2017年7月28日

申购)费率优惠活动的公告	报》	
鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2017年8月1日
鹏华基金管理有限公司关于深圳腾元基金销售有限公司终止销售本公司旗下基金的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2017年8月1日
鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与华泰证券股份有限公司认购、申购(含定期定额申购)费率优惠活动的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2017年8月1日
鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2017年8月2日
鹏华基金管理有限公司关于增加大同证券有限责任公司为旗下部分基金销售机构的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2017年8月7日
鹏华基金管理有限公司关于北京增财基金销售有限公司终止销售本公司旗下基金的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2017年8月11日
鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2017年8月15日
鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与东莞农村商业银行股份有限公司手机银行基金认/申购费率优惠活动的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2017年8月23日
2017年半年度报告摘要	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2017年8月28日
鹏华基金管理有限公司关于泛华普益基金销售有限公司终止销售本公司旗下基金的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2017年9月1日
鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2017年9月7日
鹏华基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与蚂蚁(杭州)基金销售有限公司费率优惠活动的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2017年9月8日
鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2017年9月14日
鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2017年9月20日
鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2017年9月26日

上述披露事项的披露期间自2017年4月10日至2017年10月9日止。

## 二十五、招募说明书的存放及查阅方式

本招募说明书按相关法律法规，存放在基金管理人、基金代销机构等的办公场所，投资者可在办公时间免费查阅；也可在支付工本费后在合理时间内获取本招募说明书复制件或复印件，但应以招募说明书正本为准。投资者也可以直接登录基金管理人的网站进行查阅。

基金管理人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

## 二十六、备查文件

### （一）备查文件包括：

- 1、中国证监会核准鹏华盛世创新股票型证券投资基金（LOF）募集的文件
- 2、《鹏华盛世创新混合型证券投资基金（LOF）基金合同》
- 3、《鹏华盛世创新混合型证券投资基金（LOF）注册与登记过户委托代理协议》
- 4、《鹏华盛世创新混合型证券投资基金（LOF）托管协议》
- 5、法律意见书
- 6、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）备查文件的存放地点和投资者查阅方式：

1、存放地点：《基金合同》、《托管协议》存放在基金管理人和基金托管人处；其余备查文件存放在基金管理人处。

2、查阅方式：投资者可在营业时间免费到存放地点查阅，也可按工本费购买复印件。

鹏华基金管理有限公司

2017年11月