

## 关于鹏华新丝路指数分级证券投资基金

### 修改基金合同的公告

根据中国证监会 2017 年 8 月 31 日发布的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《规定》”），对已经存续的开放式基金，原基金合同内容不符合该《规定》的，应当在《规定》施行之日起 6 个月内予以调整。根据《规定》等法律法规，经与基金托管人招商银行股份有限公司协商一致，鹏华基金管理有限公司（以下简称“本公司”）对旗下鹏华新丝路指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）的《鹏华新丝路指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）相关条款进行修订。本次《基金合同》的修改内容包括释义、申购和赎回的数量限制、申购和赎回的价格、费用及其用途、拒绝或暂停申购的情形、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形、巨额赎回的处理方式、投资范围、投资限制、估值方法、暂停估值的情形、基金的信息披露等。具体修改内容见附件。

本次《基金合同》修订的内容系因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行的修改，且对原有基金份额持有人的利益无实质性影响，根据《基金合同》的约定，不需召开基金份额持有人大会。本次《基金合同》修订已经本基金管理人与基金托管人协商一致并已报监管机构备案。修订后的《基金合同》自本公告发布之日起生效，但为不影响原有基金份额持有人的利益，《基金合同》中“本基金对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5% 的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产”的条款将于 2018 年 3 月 6 日起正式实施。本基金将于 2018 年 3 月 6 日起，对持续持有期少于 7 日的投资者收取 1.5% 的赎回费。本基金管理人经与基金托管人协商一致，已相应修改本基金的《鹏华新丝路指数分级证券投资基金托管协议》，并将在更新的《鹏华新丝路指数分级证券投资基金招募说明书》中作相应调整。

投资者可访问鹏华基金管理有限公司网站([www.phfund.com](http://www.phfund.com))或拨打全国免长途费的客户服务电话（400—6788—999）咨询相关情况。

特此公告。

鹏华基金管理有限公司

二〇一八年二月二十七日

附件：《基金合同》修订对照表

基金合同条款	修改前内容	修改后内容
第一部分 前言	<p>一、订立本基金合同的目的、依据和原则</p> <p>2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》(以下简称“《合同法》”)、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集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》”)和其他有关法律、法规。</p>	<p>一、订立本基金合同的目的、依据和原则</p> <p>2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》(以下简称“《合同法》”)、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集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》”)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性规定》”)和其他有关法律、法规。</p>
第二部分 释义		<p>增加：</p> <p>13、《流动性规定》：指中国证监会2017年8月31日颁布、同年10月1日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订</p>
第二部分 释义		<p>增加：</p>

		<p>64、流动性受限资产：指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等</p>
<p>第二部分 释义</p>		<p>增加：</p> <p>65、摆动定价机制：指当开放式基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待</p>
<p>第九部分 基金份额的申购与赎回</p>	<p>五、申购和赎回的数量限制</p>	<p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>增加：</p> <p>4、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金</p>

		<p>申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益，具体请参见相关公告。</p>
<p>第九部分 基金份额的申购与赎回</p>	<p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>3、赎回金额的计算及余额处理方式：本基金赎回金额及余额处理方式的计算详见《招募说明书》，赎回金额单位为元。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。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。</p>	<p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>3、赎回金额的计算及余额处理方式：本基金赎回金额及余额处理方式的计算详见《招募说明书》，赎回金额单位为元。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。本基金对持续持有期少于7日的投资者收取不低于1.5%的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。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。</p> <p>增加：</p> <p>8、当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。</p>
<p>第九部分 基金份额的申购与赎回</p>	<p>七、拒绝或暂停申购的情形</p>	<p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>增加：</p> <p>8、基金管理人接受某笔或者某</p>

	<p>.....</p> <p>发生上述第 1、2、3、5、6、7、8 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购的，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。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。在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。</p>	<p>些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过 50%，或者变相规避 50%集中度的情形时。</p> <p>9、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金申购申请。</p> <p>.....</p> <p>发生上述第 1、2、3、5、6、7、9、10 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购的，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。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。在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。</p>
<p>第九部分 基金份额的申购与赎回</p>	<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p>	<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>增加：</p> <p>7、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术</p>

		<p>仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请。</p>
<p>第九部分 基金份额的申购与赎回</p>	<p>九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式</p>	<p>九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 增加： (4) 若基金发生巨额赎回，在当日存在单个基金份额持有人超过上一开放日基金总份额（包括鹏华新丝路份额、鹏华新丝路 A 份额、鹏华新丝路 B 份额）10%以上的赎回申请（“大额赎回申请人”）的情形下，基金管理人可以延期办理赎回申请。对其他赎回申请人（“小额赎回申请人”）和大额赎回申请人 10%以内的赎回申请在当日根据前述“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”的约定方式办理，在仍可接受赎回申请的范围内对大额赎回申请人超过 10%的赎回申请按比例确认。对当日未予确认的赎回申请进行延期办理。对于未能赎回部分，基金份额持有人在提交赎回申请时可以</p>

		<p>选择延期赎回或取消赎回。选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销；选择延期赎回的，当日未获受理的赎回申请将与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推。如基金份额持有人在提交赎回申请时未作明确选择，基金份额持有人未能赎回部分作自动延期赎回处理。</p>
第十七部分 基金的投资	<p>二、投资范围</p> <p>.....</p> <p>基金的投资组合比例为：投资于股票部分的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>二、投资范围</p> <p>.....</p> <p>基金的投资组合比例为：投资于股票部分的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</p>
第十七部分 基金的投资	<p>五、投资限制</p> <p>1、组合限制</p>	<p>五、投资限制</p> <p>1、组合限制</p>

	<p>基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>(2) 每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券；</p>	<p>基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>(2) 每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</p> <p>.....</p> <p>增加：</p> <p>(20) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的 15%。因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前述所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>(21) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；</p> <p>.....</p> <p>除上述第 (2)、(11)、(20)、(21) 条外，因证券</p>
--	---	---

	<p>因证券/期货市场波动、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 个工作日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。</p>	<p>/期货市场波动、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 个工作日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。</p>
第十九部分 基金资产估值	三、估值方法	<p>三、估值方法</p> <p>增加：</p> <p>6、当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。</p>
第十九部分 基金资产估值	六、暂停估值的情形	<p>六、暂停估值的情形</p> <p>增加：</p> <p>4、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停估值；</p>
第十九部分 基金资产估值	<p>八、特殊情形的处理</p> <p>1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 6 项进行估值时，所</p>	<p>八、特殊情形的处理</p> <p>1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 7 项进行估值时，</p>

	造成的误差不作为基金资产估值错误处理。	所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。
第二十四部分 基金的信息披露	<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>7、基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告</p>	<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>7、基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告</p> <p>增加： 基金管理人应当在半年度报告和年度报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。</p> <p>报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额（包括鹏华新丝路份额、鹏华新丝路 A 份额、鹏华新丝路 B 份额）20%的情形，为保障其他投资者的权益，基金管理人至少应当在基金定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及产品的特有风险。</p>
第二十四部分 基金的信息披露	8、临时报告	<p>8、临时报告</p> <p>增加： （26）本基金发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时； （27）基金管理人采用摆动定</p>

		价机制进行估值；
--	--	----------