

# 鹏华基金管理有限公司关于以通讯方式召开 鹏华新丝路指数分级证券投资基金基金份额持有人大 会的公告

## 一、召开会议基本情况

根据《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》和《鹏华新丝路指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定，鹏华新丝路指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金管理人鹏华基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）决定以通讯开会方式召开本基金的基金份额持有人大会，会议的具体安排如下：

1、会议召开方式：通讯方式开会。

2、会议投票表决起止时间：自 2018 年 3 月 16 日起，至 2018 年 4 月 1 日 17:00 止（投票表决时间以本基金管理人委托的公证机关收到表决票时间为准）。

3、会议通讯表决票的寄达地点：

公证机构：北京市长安公证处

地址：北京市东城区朝阳门北大街 6 号首创大厦七层

邮政编码：100027

联系人：向开罗

联系电话：010-65543888 转 8823

请在信封表面注明：“鹏华新丝路指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

4、会议咨询电话：400—6788—999

## 二、会议审议事项

《关于鹏华新丝路指数分级证券投资基金转型并修改基金合同等相关事项的议案》（见附件一）。

上述议案的内容说明详见《关于鹏华新丝路指数分级证券投资基金转型并

修改基金合同等相关事项的议案的说明》（见附件四）。

### 三、基金份额持有人大会的权益登记日

本次大会的权益登记日为 2018 年 3 月 15 日，即在 2018 年 3 月 15 日下午交易时间结束后，在登记机构登记在册的本基金全体基金份额持有人均有权参加本次基金份额持有人大会并投票表决。

### 四、表决票的填写和寄交方式

1、本次会议表决票见附件二。基金份额持有人可从相关报纸上剪裁、复印表决票或登陆本基金管理人网站([www.phfund.com](http://www.phfund.com))下载并打印表决票。

2、基金份额持有人应当按照表决票的要求填写相关内容，其中：

(1) 个人投资者自行投票的，需在表决票上签字，并提供本人身份证件正反面复印件；

(2) 机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本单位公章或经授权或认可的业务章（以下合称“公章”），并提供加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）；合格境外机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本单位公章（如有）或由授权代表在表决票上签字（如无公章），并提供该授权代表的身份证件正反面复印件或者护照或其他身份证明文件的复印件，该合格境外机构投资者所签署的授权委托书或者证明该授权代表有权代表该合格境外机构投资者签署表决票的其他证明文件，以及该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件和取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件；

(3) 个人投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供该个人投资者身份证件正反面复印件，以及填妥的授权委托书原件（参照附件三）。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件正反面复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）；

(4) 机构投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供该机构投资者的加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等），以及填妥的授权委托书原件。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件正反面复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。合格境外机构投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件，以及取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件，以及填妥的授权委托书原件。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。

3、基金份额持有人或其代理人需将填妥的表决票和所需的相关文件在2018年3月16日起，至2018年4月1日17:00止的期间内通过专人送交、快递或邮寄挂号信的方式送达至本基金管理人委托的公证机关的办公地址，并在信封表面注明：“鹏华新丝路指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

送达时间以公证机关收到表决票时间为准，即：专人送达的以实际递交时间为准；快递送达的，以公证机关签收时间为准；以邮寄挂号信方式送达的，以挂号信回执上注明的收件日期为送达日期。

本基金管理人委托的公证机关：北京市长安公证处

办公地址及联系办法如下：

地址：北京市东城区朝阳门北大街6号首创大厦七层

邮政编码：100027

联系人：向开罗

联系电话：010-65543888 转 8823

## 五、计票

1、本次通讯会议的计票方式为：由基金管理人授权的两名监督员在基金托管人（招商银行股份有限公司）授权代表的监督下于本次通讯会议的表决截止日期（即 2018 年 4 月 1 日）后 2 个工作日内进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

2、基金份额持有人所持每份基金份额享有一票表决权。

3、表决票效力的认定如下：

（1）表决票填写完整清晰，所提供文件符合本会议通知规定，且在规定时间内送达公证机关的，为有效表决票；有效表决票按表决意见计入相应的表决结果，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

（2）如表决票上的表决意见未填、多填、字迹模糊不清、无法辨认或意愿无法判断或相互矛盾，但其他各项符合会议通知规定的，视为弃权表决，计入有效表决票；并按“弃权”计入对应的表决结果，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

（3）如表决票上的签字或盖章部分填写不完整、不清晰的，或未能提供有效证明基金份额持有人身份或代理人经有效授权的证明文件的，或未能在规定时间之内送达公证机关的，均为无效表决票；无效表决票不计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

（4）基金份额持有人重复提交表决票的，如各表决票表决意见相同，则视为同一表决票；如各表决票表决意见不相同，则按如下原则处理：

①送达时间不是同一天的，以最后送达日所填写的有效的表决票为准，先送达的表决票视为被撤回；

②送达时间为同一天的，视为在同一表决票上做出了不同表决意见，计入弃权表决票；

③送达时间确定原则见“四、表决票的填写和寄交方式”中相关说明。

## 六、决议生效条件

1、有效表决票所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的二分之一以上（指全部有效凭证所对应的鹏华新丝路份额、新丝路 A 份额、新丝路 B 份额分

别占权益登记日各自基金份额的二分之一以上，含二分之一）时，表明该有效表决票所代表的基金份额持有人参加了此次通讯会议，会议有效召开；在此基础上，《关于鹏华新丝路指数分级证券投资基金转型并修改基金合同等相关事项的议案》应当经参加大会的鹏华新丝路份额、新丝路 A 份额、新丝路 B 份额各自基金份额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。

2、本次基金份额持有人大会决议通过的事项，本基金管理人自通过之日起五日内报中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）备案，基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效。法律法规另有规定的，从其规定。

## **七、二次召集基金份额持有人大会及二次授权**

根据《基金法》及《鹏华新丝路指数分级证券投资基金基金合同》的规定，本次持有人大会需要出席大会的基金份额持有人或其代理人所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的二分之一以上（指全部有效凭证所对应的鹏华新丝路份额、新丝路 A 份额、新丝路 B 份额分别占权益登记日各自基金份额的二分之一以上，含二分之一）方可召开。如果本次基金份额持有人大会不符合前述要求而不能成功召开，本基金管理人可在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一（含三分之一）以上鹏华新丝路份额、新丝路 A 份额、新丝路 B 份额各自基金份额的持有人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见；重新召开基金份额持有人大会时，除非授权文件另有载明，本次基金份额持有人大会授权期间基金份额持有人作出的各类授权依然有效，但如果授权方式发生变化或者基金份额持有人重新作出授权，则以最新方式或最新授权为准，详细说明见届时发布的重新召集基金份额持有人大会的通知。

## **八、本次大会相关机构**

1、召集人：鹏华基金管理有限公司

联系人：段雨希

联系电话：400—6788—999

传真：0755—82021155

网址：www.phfund.com

2、基金托管人：招商银行股份有限公司

3、公证机构：北京市长安公证处

联系人：向开罗

联系电话：010-65543888 转 8823

4、见证律师：上海市通力律师事务所

## 九、重要提示

1、请基金份额持有人在提交表决票时，充分考虑邮寄在途时间，提前寄出表决票。

2、本次基金份额持有人大会有关公告可通过基金管理人网站查阅，投资者如有任何疑问，可致电基金管理人客户服务电话 400—6788—999（免长途话费）咨询。

3、本通知的有关内容由鹏华基金管理有限公司负责解释。

鹏华基金管理有限公司

二〇一八年三月一日

附件一：《关于鹏华新丝路指数分级证券投资基金转型并修改基金合同等相关事项的议案》

附件二：《鹏华新丝路指数分级证券投资基金基金份额持有人大会通讯表决票》

附件三：《授权委托书》

附件四：《关于鹏华新丝路指数分级证券投资基金转型并修改基金合同等相关事项的议案的说明》

## 附件一：《关于鹏华新丝路指数分级证券投资基金转型并修改基金合同等相关事项的议案》

鹏华新丝路指数分级证券投资基金份额持有人：

为了更好地满足投资者的投资需求，保护基金持有人利益，根据《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》和《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》”）的有关规定，鹏华新丝路指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金管理人——鹏华基金管理有限公司经与基金托管人——招商银行股份有限公司协商一致，提议对鹏华新丝路指数分级证券投资基金进行调整，修改基金名称、投资目标、投资范围、投资策略和限制、申购赎回规则、基金费用、收益分配方式、估值方法等相关转型事项，并根据鹏华新丝路指数分级证券投资基金成立以来法律法规的变动对《基金合同》的其他内容予以调整。具体说明见附件四《关于鹏华新丝路指数分级证券投资基金转型并修改基金合同等相关事项的议案的说明》。

本议案如获得基金份额持有人大会审议通过，基金管理人将根据基金份额持有人大会决议对《基金合同》进行修改。本基金的招募说明书及托管协议也将进行必要的修改或补充。

以上议案，请予审议。

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

## 附件二：鹏华新丝路指数分级证券投资基金基金份额持有人大会通讯表决票

基金份额持有人姓名/名称：

证件号码（身份证件号/营业执照注册号）：

基金账户号：

审议事项	同意	反对	弃权
关于鹏华新丝路指数分级证券投资基金转型并修改基金合同等相关事项的议案			

基金份额持有人/受托人（代理人）（签字或盖章）

日期： 年 月 日

说明：

- 1、请就审议事项表示“同意”、“反对”或“弃权”，并在相应栏内画“√”，同一议案基金份额持有人只能选择一种表决意见。以上表决意见是基金份额持有人或其受托人（代理人）就基金份额持有人持有的本基金全部份额做出的表决意见。
- 2、未填、多填、字迹模糊不清、无法辨认或意愿无法判断的表决票均视为投票人放弃表决权利，其所持全部基金份额的表决结果均计为“弃权”。
- 3、本表决票可从相关网站([www.phfund.com](http://www.phfund.com))下载、从报纸上剪裁、复印或按此格式打印。

### 附件三：授权委托书

兹全权委托            先生 / 女士或            机构代表本人（或本机构）参加以通讯开会方式召开的鹏华新丝路指数分级证券投资基金基金份额持有人大会，并代为全权行使所有议案的表决权。表决意见以受托人的表决意见为准。本授权不得转授权。若在法定时间内就同一议案重新召开鹏华新丝路指数分级证券投资基金基金份额持有人大会，除本人（或本机构）重新作出授权外，本授权继续有效。

委托人（签字/盖章）： \_\_\_\_\_

委托人身份证件号或营业执照注册号： \_\_\_\_\_

基金账户号： \_\_\_\_\_

受托人（代理人）（签字/盖章）： \_\_\_\_\_

受托人（代理人）身份证件号或营业执照注册号： \_\_\_\_\_

委托日期：     年     月     日

附注：

1、以上授权是基金份额持有人就其持有的本基金全部份额向受托人所做授权。

2、此授权委托书剪报、复印或按以上格式自制在填写完整并签字盖章后均为有效。

## 附件四：《关于鹏华新丝路指数分级证券投资基金转型并修改基金合同等相关事项的议案的说明》

### 一、声明

1、为提高基金资产的运作效率，保护基金持有人利益，根据《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》”）和《鹏华新丝路指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定，鹏华新丝路指数分级证券投资基金（以下简称“鹏华新丝路分级基金”）的基金管理人鹏华基金管理有限公司经与基金托管人招商银行股份有限公司协商一致，决定召开基金份额持有人大会，讨论并审议《关于鹏华新丝路指数分级证券投资基金转型并修改基金合同等相关事项的议案》。

2、本次基金份额持有人大会需由持有有效的鹏华新丝路份额、鹏华新丝路A份额、鹏华新丝路B份额各自基金份额不少于本基金在权益登记日鹏华新丝路份额、鹏华新丝路A份额、鹏华新丝路B份额各自基金总份额的二分之一的持有人出席方可召开，且《关于鹏华新丝路指数分级证券投资基金转型并修改基金合同等相关事项的议案》需经参加大会的鹏华新丝路份额、鹏华新丝路A份额、鹏华新丝路B份额各自基金份额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，存在未能达到开会条件或无法获得相关持有人大会表决通过的可能。

3、持有人大会的决议自表决通过之日起生效。中国证监会对持有人大会表决通过的事项所作的任何决定或意见，均不表明其对本基金的价值或者投资人的收益做出实质性判断或保证。

### 二、调整方案要点

#### （一）变更基金名称

基金名称由“鹏华新丝路指数分级证券投资基金”变更为“鹏华沪深300指数增强型证券投资基金”（以下简称“本基金”）。

## **(二) 调整基金类型、标的指数**

基金类型由股票指数分级证券投资基金变更为股票指数增强型证券投资基金，并删除与原分级运作方式相关的章节，包括“第四部分 基金份额的分级”、“第五部分 基金份额的净值计算”、“第十一部分 基金份额的配对转换”以及“第十二部分 基金份额的折算”。基金标的指数由新丝路指数变更为沪深300指数。

## **(三) 终止上市交易**

鹏华新丝路分级基金转型后将在上海证券交易所终止上市交易，并删除“第八部分 基金份额的上市与交易”。

## **(四) 调整申购赎回规则**

申购赎回方式由场内、场外申购和赎回调整为场外申购和赎回，并相应修改申购和赎回场所、申购与赎回的原则等相关条款。

## **(五) 调整投资目标、投资范围、投资策略、投资限制、业绩比较基准、风险收益特征**

调整了基金的投资目标、投资范围、投资策略、投资限制、业绩比较基准和风险收益特征，对基金合同的相应内容修改如下：

### **原文：**

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，力争将日均跟踪偏离度控制在0.35%以内，年跟踪误差控制在4%以内。

### **拟修改为：**

本基金为股票指数增强型基金，在力求对沪深300指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越标的指数的业绩表现，谋求基金资产的长期增值。

### **原文：**

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及其

备选成份股（含中小板、创业板股票及其他中国证监会核准上市的股票）、债券、股指期货、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

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

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

#### **拟修改为：**

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（含国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债、可转换债券、可交换债券等）、货币市场工具（含同业存单等）、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

本基金可以根据国家的有关规定进行融资及转融通。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：投资于股票资产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，基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计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。

如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投

资范围会做相应调整。

#### 原文：

本基金采用被动式指数化投资方法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。

当预期成份股发生调整或成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。

本基金力争鹏华新丝路份额净值增长率与同期业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

#### 1、股票投资策略

##### (1) 股票投资组合的构建

本基金在建仓期内，将按照标的指数各成份股的基准权重对其逐步买入，在力求跟踪误差最小化的前提下，本基金可采取适当方法，以降低买入成本。当遇到成份股停牌、流动性不足等其他市场因素而无法依指数权重购买某成份股及预期标的指数的成份股即将调整或其他影响指数复制的因素时，本基金可以根据市场情况，结合研究分析，对基金财产进行适当调整，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。

##### (2) 股票投资组合的调整

本基金所构建的股票投资组合将根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况，对其进行适时调整，以保证鹏华新丝路份额净值增长率与标的指数收益率间的高度正相关和跟踪误差最小化。基金管理人将对成份股的流动性进行分析，如发现流动性欠佳的个股将可能采用合理方法寻求替代。由于受到各项持股比例限制，基金可能不能按照成份股权重持有成份股，基金将会采用合理方法寻求替代。

##### 1) 定期调整

根据标的指数的调整规则和备选股票的预期，对股票投资组合及时进行调整。

## 2) 不定期调整

根据指数编制规则，当标的指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重新调整时，本基金将根据各成份股的权重变化进行相应调整；

根据本基金的申购和赎回情况，对股票投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数；

根据法律、法规规定，成份股在标的指数中的权重因其它特殊原因发生相应变化的，本基金可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。

## 2、债券投资策略

本基金可以根据流动性管理需要，选取到期日在一年以内的政府债券进行配置。本基金债券投资组合将采用自上而下的投资策略，根据宏观经济分析、资金面动向分析等判断未来利率变化，并利用债券定价技术，进行个券选择。

## 3、衍生品投资策略

本基金可投资股指期货、权证和其他经中国证监会允许的金融衍生产品。

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低申购赎回时现金资产对投资组合的影响及投资组合仓位调整的交易成本，达到稳定投资组合资产净值的目的。

基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项，同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。

本基金通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型及价值挖掘策略、价差策略、双向权证策略等寻求权证的合理估值水平，追求稳定的当期收益。

## 4、资产支持证券的投资策略

本基金将综合运用战略资产配置和战术资产配置进行资产支持证券的投资组合管理，并根据信用风险、利率风险和流动性风险变化积极调整投资策略，

严格遵守法律法规和基金合同的约定，在保证本金安全和基金资产流动性的基础上获得稳定收益。

### **拟修改为：**

#### **1、股票投资策略**

本基金为指数增强型基金，以沪深 300 指数为标的指数，基金股票投资方面将主要采用指数增强量化投资策略，在严格控制跟踪误差的基础上，力求获得超越标的指数的超额收益。

指数增强量化投资策略主要借鉴国内外成熟的组合投资策略，在对标的指数成份股及其他股票基本面的深入研究的基础上，运用多因子量化选股模型构建投资组合，同时优化组合交易并严格控制组合风险，力求实现超额收益。

##### **（1）多因子量化选股模型**

本基金将以多因子量化选股模型构建股票组合。多因子模型针对个股构建价值、质量、动量、成长、一致预期等因子，通过量化方法处理因子与个股超额回报之间的特征关系，挑选出具有基本面逻辑支撑和统计意义有效的因子组合，进而得出具有稳定超额回报的股票组合。本基金对因子的有效性进行持续的跟踪，分析其变化规律，基金经理根据市场状况结合因子变化趋势，对模型使用的因子结构进行动态调整。

##### **（2）风险控制与调整**

本基金为指数增强型基金。在追求超额收益的同时，需要控制跟踪偏离过大的风险。基金将根据投资组合相对标的指数的暴露度等因素的分析，对组合跟踪效果进行预估，及时调整投资组合，力求将跟踪误差控制在目标范围内。

本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%。

##### **（3）投资组合优化模型**

本基金将综合考虑预期回报、风险及交易成本进行投资组合优化。选股范围以标的指数成份股为主，也包括非成份股中与成份股相关性强，流动性好，基本面信息充足的股票。

#### **2、债券投资策略**

本基金债券投资将采取久期策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、

个券选择策略、信用策略等积极投资策略，自上而下地管理组合的久期，灵活地调整组合的券种搭配，同时精选个券，以增强组合的持有期收益。

### 3、权证投资策略

本基金通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型及价值挖掘策略、价差策略、双向权证策略等寻求权证的合理估值水平，追求稳定的当期收益。

### 4、股指期货投资策略

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目标，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，充分考虑股指期货的风险收益特征，通过多头或空头的套期保值策略，以改善投资组合的投资效果，实现股票组合的超额收益。

### 5、资产支持证券的投资策略

本基金将综合运用战略资产配置和战术资产配置进行资产支持证券的投资组合管理，并根据信用风险、利率风险和流动性风险变化积极调整投资策略，严格遵守法律法规和基金合同的约定，在保证本金安全和基金资产流动性的基础上获得稳定收益。

#### 原文：

(1) 投资于股票部分的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%；

(2) 每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

(3) 本基金非指数化投资部分持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；

(4) 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%；

(5) 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%；

(6) 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%；

(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%，中国证监会规定的特殊品种除外；

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

(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%；在全国银行间同业市场的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

(14) 基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

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

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

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

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

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

(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；

(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；

(22) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他投资限制。

除上述第(2)、(11)、(20)、(21)条外，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 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

**拟修改为：**

(1) 投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%；

(2) 每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

(3) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%，但除非法律法规另有规定，本基金指数化投资部分不受此限制；

(4) 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%，但除非法律法规另有规定，本基金指数化投资部分不受此限制；

(5) 本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 15%，本基金指数化投资部分不受此限制；

(6) 本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 30%，本基金指数化投资部分不受此限制；

(7) 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%；

(8) 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%；

(9) 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%；

(10) 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%；

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

(12) 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%；

(13) 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%；

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

(15) 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；

(16) 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%；债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

(17) 本基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

(18) 本基金参与股指期货交易，应当遵守下列要求：

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

b. 本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%。其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

c. 本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有

的股票总市值的 20%；

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

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

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

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

（21）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；

（22）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；

（23）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述第（2）、（14）、（21）、（22）条外，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外

**原文：**

#### 六、业绩比较基准

新丝路指数收益率×95%+商业银行活期存款利率（税后）×5%

新丝路指数以沪深 A 股市场注册地为陕西、甘肃、宁夏、青海与新疆 5 省的上市公司为样本空间，根据市值和成交金额的综合表现进行排名，选出前 100 只股票作为指数样本股。新丝路指数反映丝绸之路经济带区域内相关上市

公司的整体表现，同时也为市场提供相关的主题投资标的。

**拟修改为：**

五、业绩比较基准

本基金业绩比较基准=沪深 300 指数收益率×95%+1.5%（指年收益率，评价时按期间折算）。

沪深 300 指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国 A 股市场指数，它的样本选自沪深两个证券市场，覆盖了大部分流通市值，其成份股票为中国 A 股市场中代表性强、流动性高的股票，能够反映 A 股市场总体发展趋势。

**原文：**

七、风险收益特征

本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。同时本基金为指数基金，通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。

从本基金所分拆的两类基金份额来看，鹏华新丝路 A 份额为稳健收益类份额，具有低风险且预期收益相对较低的特征；鹏华新丝路 B 份额为积极收益类份额，具有高风险且预期收益相对较高的特征。

**拟修改为：**

六、风险收益特征

本基金属于股票指数增强型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金，属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种。

**（六）调整基金的费率**

**原费率结构：**

管理费：1.00%

托管费：0.22%

标的指数许可使用费：0.02%

场外申购费：

申购金额M（元）	申购费率
M<100万	1.20%
100万≤M<500万	0.60%
M≥500万	每笔100元

场外赎回费：

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%的场外赎回费；对持续持有期不少于7日的投资者，赎回费率如下表所示：

持有期限Y	赎回费率
7天≤Y<1年	0.50%
1年≤Y<2年	0.25%
Y≥2年	0.00%

场内申购费：由上海证券交易所会员单位按照场外申购费率设定。

申购金额M（元）	申购费率
M<500万	0
M≥500万	每笔100元

场内赎回费：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%的场内赎回费；对持续持有期不少于7日的投资者，场内赎回费率为固定费率0.50%，不按持有期限设置分段赎回费率。

拟修改为：

管理费：1.00%

托管费：0.15%

标的指数许可使用费：0.0112%

申购费：

申购金额M（元）	一般申购费率	特定申购费率
M<100万	1.20%	0.48%
100万≤ M <500万	0.60%	0.18%
M≥ 500万	每笔1000元	每笔1000元

赎回费：

持有期限 (Y)	赎回费率
$Y < 7$ 天	1.50%
$7 \text{ 天} \leq Y < 1$ 年	0.50%
$1 \text{ 年} \leq Y < 2$ 年	0.25%
$Y \geq 2$ 年	0.00%

### (七) 调整收益分配方式

调整了基金的收益分配方式，对基金合同的相应内容修改如下：

原文：

在存续期内，本基金（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）不进行收益分配。

法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

拟修改为：

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，经与基金托管人协商一致，基金管理人可调整基金收益分配原则和支付方式，不需召开基金份额持有人大会。

### (八) 调整估值方法

## 原文：

### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

(1) 交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

(2) 交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整并确定公允价格。

(3) 交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价减去债券收盘价或估值全价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价减去债券收盘价或估值全价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整并确定公允价格。

(4) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，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，按成本估值。

### 2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

(1) 送股、转增股和配股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值。

(2) 首次公开发行未上市的股票、债券和权证，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

易所上市的同一种股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3、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。

4、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。

5、股指期货合约，以估值日结算价估值；估值日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，以最近交易日的结算价估值。

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。

7、如有确凿证据表明按上述方法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与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

8、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

**拟修改为：**

1、交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

2、交易所市场交易的固定收益品种的估值

（1）对在交易所市场上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种（另有规定的除外），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；

（2）对在交易所市场上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种（本合同另有规定的除外），建议选取第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价。

（3）对在交易所市场上市交易的可转换债券，按估值日收盘价减去可转换

债券收盘价中所含债券应收利息后得到的净价进行估值；

(4) 对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券，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，按成本估值；

(5) 对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的固定收益品种，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，按成本估值。

### 3、银行间市场交易的固定收益品种的估值

(1) 银行间市场交易的不含权固定收益品种，选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值。

(2) 对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价。对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。

(3) 对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的固定收益品种，按成本估值。

### 4、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

(1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值。

(2) 首次公开发行未上市的股票和权证，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估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

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、股指期货合约，以估值日结算价估值；估值日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，以最近交易日的结算价估值。

7、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。

8、如有确凿证据表明按上述方法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与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

9、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### **（九）本基金新修改的基金合同的生效**

基金份额持有人大会决议生效后，新修改的基金合同正式生效，具体生效日期本基金管理人将另行公告。自新修改的基金合同生效日起，《鹏华新丝路指数分级证券投资基金基金合同》同时失效，鹏华新丝路指数分级证券投资基金正式变更为鹏华沪深300指数增强型证券投资基金，本基金的基金合同当事人将按照《鹏华沪深300指数增强型证券投资基金基金合同》享有权利并承担义务。

### **三、转型选择期的相关安排**

本次持有人大会决议生效后，鹏华新丝路指数分级证券投资基金将在转型正式实施前安排不少于二十个交易日的选择期以供基金份额持有人做出选择（如赎回、卖出、场内鹏华新丝路A份额、鹏华新丝路B份额配对合并后赎回或卖出），具体时间安排详见基金管理人届时发布的相关公告。

转型选择期期间，原鹏华新丝路指数分级证券投资基金赎回、场内鹏华新丝路A份额、鹏华新丝路B份额配对合并、场内交易业务照常办理。为保障本基金原持有人利益，本基金暂停基金申购、定投、基金份额转换、场内鹏华新丝路份额分拆、鹏华新丝路份额转托管（含系统内转托管与跨系统转托管）业务。对于在选择期内未作出选择的基金份额持有人，其持有的原鹏华新丝路份额、鹏华新丝路A份额、鹏华新丝路B份额将于份额转换基准日进行转换，最终将转换为鹏华沪深300指数增强型证券投资基金基金份额。

由于鹏华新丝路指数分级证券投资基金在选择期期间需应对赎回等情况，基金份额持有人同意在选择期豁免鹏华新丝路指数分级证券投资基金基金合同中约定的投资组合比例限制等条款。基金管理人提请基金份额持有人大会授权

基金管理人据此落实相关事项，并授权基金管理人可根据实际情况做相应调整，以及根据实际情况可暂停申购、赎回、转入、转出或调整赎回方式等。

#### 四、基金份额转换等相关说明

鹏华基金管理有限公司将在基金份额持有人大会决定的事项生效日后，在新修改的基金合同生效前对鹏华新丝路指数分级证券投资基金申请退市并进行基金份额转换，转换为鹏华沪深300指数增强型证券投资基金基金份额，基金登记机构仍为中国证券登记结算有限责任公司。

本次转型涉及到基金份额的转换，主要分成以下两个步骤进行：

1、将鹏华新丝路A份额、鹏华新丝路B份额和鹏华新丝路份额的基金份额（参考）净值均调整为1.0000元

本次基金份额转换将分别对鹏华新丝路A份额、鹏华新丝路B份额和鹏华新丝路份额进行基金份额折算，基金份额折算后鹏华新丝路份额的基金份额净值、鹏华新丝路A份额与鹏华新丝路B份额的基金份额参考净值均调整为1.0000元，且基金份额的份额数计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分舍弃，余额计入基金财产；

2、将鹏华新丝路A份额、鹏华新丝路B份额和鹏华新丝路份额转换成鹏华沪深300指数增强型证券投资基金份额

在份额转换基准日日终，在保持基金资产净值总额不变的前提下，将份额净值为1.0000元的鹏华新丝路A份额、鹏华新丝路B份额和鹏华新丝路份额统一转换为份额净值为1.0000元的鹏华沪深300指数增强型证券投资基金份额。鹏华新丝路A份额、鹏华新丝路B份额的场内份额和鹏华新丝路份额的场内份额和场外份额相应地转换成鹏华沪深300指数增强型证券投资基金的场外份额。

鹏华沪深300指数增强型证券投资基金自基金合同生效之日起不超过3个月开始办理申购、赎回等业务。因鹏华新丝路指数分级证券投资基金由可上市交易的开放式指数证券投资基金转换为纯场外指数型证券投资基金，在转型选择期结束后仍旧持有原鹏华新丝路指数分级证券投资基金场内基金份额的持有人需对其持有的鹏华沪深300指数增强型证券投资基金基金份额进行重新确认与登记，此过程即为“确权”，确权完成后，基金份额持有人方可在场外对相关基

金份额进行赎回及其他交易。

投资者在未确权前，若鹏华沪深300指数增强型证券投资基金进行收益分配，未确权投资者的收益分配方式为红利再投资方式。

本基金的基金份额转换、退市及确权等事项的实施安排将提前公告。

## **五、基金投资范围、投资策略调整后的投资可行性**

### **(一) 投资方面**

基金管理人已经对基金投资范围、投资策略调整后的投资运作进行了充分的分析。鹏华新丝路分级基金转型后，将在力求对沪深300指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越标的指数的业绩表现，谋求基金资产的长期增值。

我司于2011年正式成立量化投资部(现已更名为量化及衍生品投资部)，宽基指数管理经验丰富，目前拥有完备的数据库及量化指数增强策略，并且已有的产品鹏华沪深300指数基金、鹏华中证500指数基金近2年来有较为明显的超额收益，鹏华新丝路分级基金转型后在投资方面具有较好的可行性。

### **(二) 法律方面**

《基金合同》约定，基金调整基金名称、投资目标、投资范围、投资策略和限制、申购赎回规则、基金费用、收益分配方式、估值方法等事项需召开基金份额持有人大会，本次基金份额持有人大会决议属于特别决议，特别决议应当经参加大会的鹏华新丝路份额、鹏华新丝路A份额、鹏华新丝路B份额各自基金份额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）通过即为有效，基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

## **六、关于鹏华新丝路指数分级证券投资基金转型并修改基金合同等相关事项的议案的主要风险及预备措施**

关于鹏华新丝路指数分级证券投资基金转型并修改基金合同等相关事项的议案存在被基金份额持有人大会否决的风险。

在鹏华新丝路指数分级证券投资基金转型并修改基金合同等调整方案之前，我司已对持有人进行了走访，认真听取了持有人意见，拟定议案综合考虑了持有人的要求。议案公告后，我们还将再次征询意见。如有必要，基金管理人将

根据持有人意见，对调整方案进行适当的修订并重新公告。基金管理人可在必要情况下，预留出足够的时间，以做二次召开或推迟基金份额持有人大会的召开的充分准备。

如果本方案未获得基金份额持有人大会批准，基金管理人计划在30日内，按照有关规定重新向基金份额持有人大会提交鹏华新丝路分级基金转型并修改基金合同等方案议案。

**附表：《鹏华新丝路指数分级证券投资基金变更注册为鹏华沪深 300 指数增强型证券投资基金的基金合同修订对照表》**

	变更注册前	变更注册后
全文	鹏华新丝路指数分级证券投资基金	鹏华沪深 300 指数增强型证券投资基金
前言	<p>三、鹏华新丝路指数分级证券投资基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同及其他有关规定募集，并经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）注册。</p> <p>中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。</p>	<p>三、鹏华沪深 300 指数增强型证券投资基金由鹏华新丝路指数分级证券投资基金转型而来，鹏华新丝路指数分级证券投资基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同及其他有关规定募集，并经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）注册。《鹏华沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》生效后，原《鹏华新丝路指数分级证券投资基金基金合同》自同一日终止，原《鹏华新丝路指数分级证券投资基金基金合同》的当事人，即基金管理人、基金托管人和基金份额持有人自动转为《鹏华沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》的当事人。</p> <p>中国证监会对鹏华新丝路指数分级证券投资基金转型为本基金的变更注册，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。</p>

<p><b>前言</b></p>		<p>增加： 投资人应当认真阅读基金合同、基金招募说明书等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。</p>
<p><b>释义</b></p>	<p>1、基金或本基金：指鹏华新丝路指数分级证券投资基金</p> <p>4、基金合同或本基金合同：指《鹏华新丝路指数分级证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充</p> <p>5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《鹏华新丝路指数分级证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充</p> <p>6、招募说明书：指《鹏华新丝路指数分级证券投资基金招募说明书》及其定期的更新</p> <p>7、基金份额发售公告：指《鹏华新丝路指数分级证券投资基金基金份额发售公告》</p> <p>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，并经 2012 年 12 月 28 日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自 2013 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</p>	<p>1、基金或本基金：指鹏华沪深 300 指数增强型证券投资基金，本基金由鹏华新丝路指数分级证券投资基金转型而来</p> <p>4、基金合同或本基金合同：指《鹏华沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充</p> <p>5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《鹏华沪深 300 指数增强型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充</p> <p>6、招募说明书：指《鹏华沪深 300 指数增强型证券投资基金招募说明书》及其定期的更新</p> <p>8、《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，并经 2012 年 12 月 28 日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自 2013 年 6 月 1 日起实施，并经 2015 年 4 月 24 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议修改的《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</p>
<p><b>释义</b></p>	<p>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，按其持有的基金份额不同，可区分为鹏华新丝路份额持有人、鹏华新丝路 A 份额持有人及鹏华新丝路 B 份额持有人</p> <p>21、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，发</p>	<p>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</p> <p>21、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，办理基金份额的申购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务</p>

	<p>售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务</p> <p>22、销售机构：指鹏华基金管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售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场外机构，以及可通过上海证券交易所交易系统办理基金销售业务的会员单位</p>	<p>22、销售机构：指鹏华基金管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售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</p>
释义	<p>23、场外：指通过上海证券交易所交易系统外的销售机构利用其自身柜台或其他交易系统办理本基金基金份额的认购、申购和赎回的场所。通过该等场所办理基金份额的认购、申购和赎回也称为场外认购、场外申购和场外赎回</p> <p>24、场内：指通过具有相应业务资格的上海证券交易所会员单位利用上海证券交易所交易系统办理本基金基金份额的认购、申购、赎回和上市交易的场所。通过该等场所办理基金份额的认购、申购、赎回也称为场内认购、场内申购、场内赎回</p>	删除。
释义	<p>25、登记业务：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开放式基金账户/上海证券账户的建立和管理、基金份额登记、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和办理非交易过户等</p>	<p>23、登记业务：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和办理非交易过户等</p>
释义	<p>27、登记结算系统：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，登记在该系统的基金份额也称为场外份额</p> <p>28、证券登记系统：指中国证券登记结算有限责任公司上海分公司证券登记系统，登记在该系统的基金份额也称为场内份额</p>	删除

<p><b>释义</b></p>	<p>29、开放式基金账户：指投资人通过场外销售机构在中国证券登记结算有限责任公司注册的、用于记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户</p> <p>30、上海证券账户：指投资人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司开设的上海证券交易所人民币普通股票账户（即 A 股账户）或证券投资基金账户</p> <p>31、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办理认购、申购、赎回、转换及转托管等业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户</p> <p>32、标的指数：指新丝路指数</p> <p>33、基金份额：指鹏华新丝路份额、鹏华新丝路 A 份额和/或鹏华新丝路 B 份额</p> <p>34、鹏华新丝路份额：指鹏华新丝路指数分级证券投资基金之基础份额</p> <p>35、鹏华新丝路 A 份额：指鹏华新丝路指数分级证券投资基金之 A 份额，即低风险且预期收益相对较低的稳健收益类份额</p> <p>36、鹏华新丝路 B 份额：指鹏华新丝路指数分级证券投资基金之 B 份额，即高风险且预期收益相对较高的积极收益类份额</p> <p>37、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</p>	<p>25、基金账户：指登记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</p> <p>26、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办理申购、赎回、转换及转托管等业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户</p> <p>27、标的指数：指沪深 300 指数</p> <p>28、基金合同生效日：指《鹏华沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》生效日，原《鹏华新丝路指数分级证券投资基金基金合同》自同一日终止</p>
<p><b>释义</b></p>	<p>39、基金募集期：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</p>	<p>删除。</p>
<p><b>释义</b></p>		<p>36、《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方面的业务规则，由基金管理</p>

		人和投资人共同遵守
释义	<p>46、认购：指在基金募集期内，投资人申请购买基金份额的行为</p> <p>47、上市交易：指基金投资者通过上海证券交易所会员单位以集中竞价的方式买卖基金份额的行为</p>	删除。
释义	<p>50、巨额赎回：指本基金单个开放日，鹏华新丝路份额净赎回申请（赎回申请总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）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）的 10%</p>	<p>42、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）超过上一开放日基金总份额的 10%</p>
释义	<p>51、配对转换：指鹏华新丝路份额与鹏华新丝路 A 份额、鹏华新丝路 B 份额之间按约定的转换规则进行转换的行为，包括基金份额的分拆和合并</p> <p>52、分拆：指基金份额持有人将其持有的场内鹏华新丝路份额按照 2 份场内鹏华新丝路份额对应 1 份鹏华新丝路 A 份额与 1 份鹏华新丝路 B 份额的比例进行转换的行为</p> <p>53、合并：指基金份额持有人将其持有的鹏华新丝路 A 份额与鹏华新丝路 B 份额按照 1 份鹏华新丝路 A 份额与 1 份鹏华新丝路 B 份额对应 2 份场内鹏华新丝路份额的比例进行转换的行为</p> <p>54、折算：指在基金份额持有人所持基金资产净值不变的前提下，由基金管理人按照一定比例调整鹏华新丝路份额净值、鹏华新丝路 A 份额参考净值和/或鹏华新丝路 B 份额参考净值，使得基金份额持有人所持基金份额相应变化的行为，包括定期折算和不定期折算</p> <p>55、定期折算：指基金管理人按一定的周期进行的基金份额折算</p>	删除。

	<p>的行为</p> <p>56、不定期折算：指当鹏华新丝路份额净值、鹏华新丝路 A 份额参考净值和/或鹏华新丝路 B 份额参考净值满足一定的条件时，基金管理人进行的基金份额折算行为</p>	
<b>释义</b>	<p>58、转托管：指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的操作，包括系统内转托管和跨系统转托管</p> <p>59、系统内转托管：指投资者将持有的基金份额在登记结算系统内不同销售机构（网点）之间进行转托管的行为</p> <p>60、跨系统转托管：指投资者将持有的鹏华新丝路份额在登记结算系统和证券登记系统之间进行转托管的行为</p>	<p>40、转托管：指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的操作</p> <p>删除。</p>
<b>释义</b>	<p>66、基金份额净值：指每一份基金份额所代表的基金资产净值，按基金份额的不同，可区分为鹏华新丝路份额净值、鹏华新丝路 A 份额净值、鹏华新丝路 B 份额净值</p> <p>67、基金份额参考净值：指在基金份额净值计算的基础上，根据基金合同给定的计算公式得到的基金份额估算价值，按基金份额的不同，可区分为鹏华新丝路 A 份额参考净值、鹏华新丝路 B 份额参考净值。基金份额参考净值是对基金份额价值的一个估算，并不代表基金份额持有人可获得的实际价值</p>	<p>49、基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数</p>
<b>释义</b>	<p>70、不可抗力：指本基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件</p>	<p>52、不可抗力：指本合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件</p>
<b>基金的基本情况</b>	<p>一、基金名称</p> <p>鹏华新丝路指数分级证券投资基金</p>	<p>一、基金名称</p> <p>鹏华沪深 300 指数增强型证券投资基金</p>
<b>基金的基本情况</b>	<p>四、基金的投资目标</p> <p>紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，力争将日均跟踪偏离度控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内。</p>	<p>四、基金的投资目标</p> <p>本基金为股票指数增强型基金，在力求对沪深 300 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理</p>

	<p>五、基金的标的指数 新丝路指数</p>	<p>与风险控制，力争实现超越标的指数的业绩表现，谋求基金资产的长期增值。</p> <p>五、标的指数 沪深 300 指数</p> <p>若标的指数变更涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更，则基金管理人应就变更标的指数召开基金份额持有人大会，并报中国证监会备案。若标的指数变更对基金投资无实质性影响（包括但不限于标的指数供应商变更、指数更名等），则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人应在取得基金托管人同意后，报中国证监会备案并公告。</p> <p>标的指数更换后，基金管理人可根据需要替换或删除基金名称中与原标的指数相关的商号或字样。</p>
<p><b>基金的基本情况</b></p>	<p>六、基金的最低募集份额总额 本基金的最低募集份额总额为 2 亿份。</p> <p>七、基金份额面值和认购费用 本基金基金份额发售面值为人民币 1.00 元。</p> <p>本基金的具体认购费率按招募说明书的规定执行。</p> <p>九、基金份额的类别 本基金的基金份额包括鹏华新丝路指数分级证券投资基金之基础份额（以下简称“鹏华新丝路份额”）、鹏华新丝路指数分级证券投资基金之 A 份额（以下简称“鹏华新丝路 A 份额”）、鹏华新丝路指数分级证券投资基金之 B 份额（以下简称“鹏华新丝路 B 份额”）。根据对基金财产及收益分配的不同安排，本基金各类基金份额具有不同的风险收益特征。</p> <p>鹏华新丝路份额为可以申购、赎回且可以上市交易的基金份额，具有与标的指数相似的风险收益特征。鹏华新丝路 A 份额与鹏华新丝</p>	<p>删除。</p> <p>七、基金份额类别 在对份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，根据基金实际运作情况，在履行适当程序后，基金管理人经与基金托管人协商一致，可以增加本基金新的基金份额类别、调整现有基金份额类别的费率水平、或者停止现有基金份额类别的销售等，此项调整无需召开基金份额持有人大会，但须报中国证监会备案并提前公告。</p>

	路 B 份额为可以上市交易但不能申购、赎回的基金份额，其中鹏华新丝路 A 份额为稳健收益类份额，具有低风险且预期收益相对较低的风险收益特征，鹏华新丝路 B 份额为积极收益类份额，具有高风险且预期收益相对较高的风险收益特征。	
	<b>基金份额的分级</b>	删除。
	<b>基金份额的净值计算</b>	删除。
	<b>基金份额的发售</b>	删除。
	<b>基金备案</b>	删除。
<b>基金的历史沿革</b>		<p>鹏华沪深 300 指数增强型证券投资基金由鹏华新丝路指数分级证券投资基金转型而成。</p> <p>鹏华新丝路指数分级证券投资基金于 2015 年 4 月 29 日获中国证监会证监行政许可【2015】766 号文注册募集。鹏华新丝路指数分级证券投资基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。基金管理人于 2015 年 8 月 13 日获得中国证监会书面确认，《鹏华新丝路指数分级证券投资基金基金合同》生效。</p> <p>2017 年 XX 月 XX 日至 2017 年 XX 月 XX 日，鹏华新丝路指数分级证券投资基金的基金份额持有人大会以通讯方式召开，大会审议通过了鹏华新丝路指数分级证券投资基金的基金合同变更议案，内容包括鹏华新丝路指数分级证券投资基金调整基金名称、投资目标、投资范围、投资策略和限制、基金费用、收益分配方式、估值方法等。上述基金份额持有人大会决议事项自表决通过之日起生效。自 2017 年 XX 月 XX 日起，原《鹏华新丝路指数分级证券投资基金基金合同》失效，《鹏华沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》生效。</p>
<b>基金的存续</b>		一、基金份额的变更登记

		<p>基金合同生效后，本基金登记机构将进行本基金份额的更名以及必要信息的变更。</p> <p>二、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模</p> <p>基金合同生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。</p> <p>法律法规另有规定时，从其规定。</p>
	<b>基金份额的上市与交易</b>	删除。
<b>基金份额的申购与赎回 基金的非交易过户、转托管、冻结与解冻、转让</b>	<p>基金合同生效后，鹏华新丝路份额接受投资者的场外、场内申购与赎回。场外认购或申购的鹏华新丝路份额登记在登记结算系统基金份额持有人开放式基金账户下；场内认购或申购的鹏华新丝路份额登记在证券登记系统基金份额持有人上海证券账户下。</p> <p>本部分中，如无特别说明，本基金或基金份额特指鹏华新丝路份额，基金份额净值特指鹏华新丝路份额净值。</p> <p>一、申购和赎回场所</p> <p>投资者办理本基金场外申购、赎回业务的场所为基金管理人的直销网点和基金管理人委托的销售机构的销售网点；投资者办理本基金场内申购、赎回业务的场所为具有基金销售业务资格并经上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的上海证券交易所会员单位。</p> <p>基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并予以公告。基金</p>	<p>一、申购和赎回场所</p> <p>本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售网点将由基金管理人在招募说明书或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并予以公告。基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。</p> <p>二、申购和赎回的开放日及时间</p> <p>1、开放日及开放时间</p> <p>投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，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，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。</p> <p>基金合同生效后，若出现新的证券市场、证券交易所交</p>

	<p>投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。</p> <p>二、申购和赎回的开放日及时间</p> <p>1、开放日及开放时间</p> <p>投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，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，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。</p> <p>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》的有关规定在指定媒介上公告。</p> <p>2、申购、赎回开始日及业务办理时间</p> <p>基金管理人自基金合同生效之日起不超过三个月开始办理申购，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。</p> <p>基金管理人自基金合同生效之日起不超过三个月开始办理赎回，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。</p> <p>在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告申购与赎回的开始时间。</p> <p>基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的，其基金份额申购、赎回价格为下一开放日基金份额申购、赎回的价格。</p> <p>三、申购与赎回的原则</p>	<p>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》的有关规定在指定媒介上公告。</p> <p>2、申购、赎回开始日及业务办理时间</p> <p>基金管理人自基金合同生效之日起不超过3个月开始办理申购，具体业务办理时间在相关公告中规定。</p> <p>基金管理人自基金合同生效之日起不超过3个月开始办理赎回，具体业务办理时间在相关公告中规定。</p> <p>在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告申购与赎回的开始时间。</p> <p>基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购或者赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的，其基金份额申购、赎回价格为下一开放日基金份额申购、赎回的价格。</p> <p>三、申购与赎回的原则</p> <p>1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算；</p> <p>2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；</p> <p>3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；</p> <p>4、赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人申购的先后次序进行顺序赎回。</p>
--	--	--

	<p>1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算；</p> <p>2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；</p> <p>3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；</p> <p>4、场外赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人基金份额登记的先后次序进行顺序赎回；</p> <p>5、场内申购与赎回业务遵循上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定。</p> <p>基金管理人可在法律法规允许的情况下，对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。</p> <p>四、申购与赎回的程序</p> <p>1、申购和赎回的申请方式</p> <p>投资人必须根据销售机构规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。</p> <p>2、申购和赎回的款项支付</p> <p>投资人申购基金份额时，必须全额交付申购款项，投资人交付申购款项，申购成立；基金份额登记机构确认基金份额时，申购生效。</p> <p>投资人递交赎回申请，赎回成立；基金份额登记机构确认赎回时，赎回生效。投资人赎回申请成功后，基金管理人将在T+7日(包括该日)内支付赎回款项。在发生巨额赎回、本基金合同载明的暂停赎回或其它延缓支付赎回款的情形时，款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。</p> <p>3、申购和赎回申请的确认</p> <p>基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T日)，在正常情况下，本基金登记机构在</p>	<p>基金管理人可在法律法规允许的情况下，对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。</p> <p>四、申购与赎回的程序</p> <p>1、申购和赎回的申请方式</p> <p>投资人必须根据销售机构规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。</p> <p>2、申购和赎回的款项支付</p> <p>投资人申购基金份额时，必须全额交付申购款项，投资人交付申购款项，申购成立；基金份额登记机构确认基金份额时，申购生效。若资金在规定时间内未全额到账则申购不成立，申购款项将退回投资人账户，基金管理人不承担由此产生的利息损失。</p> <p>基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；基金份额登记机构确认赎回时，赎回生效。</p> <p>投资人赎回生效后，基金管理人将在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。</p> <p>3、申购和赎回申请的确认</p> <p>基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T日)，在正常情况下，本基金登记机构在T+1日内对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请，投资人可在T+2日后(包括该日)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。若申购不成功，则申购款项退还给投资人。</p> <p>基金销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购、赎回申请的确认</p>
--	---	--

	<p>T+1 日内对该交易的有效性进行确认。T 日提交的有效申请，投资人应在 T+2 日后(包括该日)及时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。若申购不成功，则申购款项退还给投资人。</p> <p>基金销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购、赎回申请的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利。</p> <p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>1、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，由此产生的收益或损失由基金财产承担。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。</p> <p>2、申购份额的计算及余额的处理方式：本基金申购份额及余额处理方式的计算详见《招募说明书》。本基金的申购费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。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。</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</p>	<p>以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利。</p> <p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>1、本基金份额净值的计算，保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。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。</p> <p>2、申购份额的计算及余额的处理方式：本基金申购份额的计算详见《招募说明书》。本基金的申购费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。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 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。</p> <p>3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见《招募说明书》，赎回金额单位为元。本基金的赎回费率依照相关法律法规设定，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。上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。</p> <p>4、申购费用由投资人承担，不列入基金财产。</p> <p>5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金</p>
--	---	--

	<p>回金额单位为元。</p> <p>4、申购费用由投资人承担，不列入基金财产。</p> <p>5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用归于基金财产的比例详见招募说明书。</p> <p>6、本基金的申购费率、申购份额具体的计算方法、赎回费率、赎回金额具体的计算方法和收费方式由基金管理人根据基金合同的规定确定，并在招募说明书中列示。基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。</p> <p>7、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，定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率和赎回费率。</p> <p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>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：</p> <p>1、因不可抗力导致基金无法正常运作。</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。</p> <p>3、证券/期货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。</p> <p>4、接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。</p> <p>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</p>	<p>份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用归于基金财产的比例详见招募说明书。</p> <p>6、本基金的申购费率、申购份额具体的计算方法、赎回费率、赎回金额具体的计算方法和收费方式由基金管理人根据基金合同的规定确定，并在招募说明书中列示。基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。</p> <p>7、基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行相关手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。</p> <p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>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：</p> <p>1、因不可抗力导致基金无法正常运作。</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接收投资人的申购申请。</p> <p>3、证券/期货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。</p> <p>4、接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。</p> <p>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。</p> <p>6、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投</p>
--	--	--

	<p>响，或发生其他损害现有基金份额持有人利益的情形。</p> <p>6、指数编制单位或指数发布机构因异常情况使指数数据无法正常计算、计算错误或发布异常时。</p> <p>7、发生本基金合同约定的份额折算等事项，根据相关业务规则可暂停接受申购申请的情形。</p> <p>8、基金管理人接受某笔或者某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>10、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</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>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：</p> <p>1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。</p> <p>3、证券/期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法</p>	<p>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>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>8、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p> <p>发生上述第 1、2、3、5、7、8 项暂停申购情形时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>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：</p> <p>1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接收投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。</p> <p>3、证券/期货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。</p> <p>4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。</p> <p>5、继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时，可暂停接受投资人的赎回申请。</p> <p>6、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>计算当日基金资产净值。</p> <p>4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。</p> <p>5、继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时。</p> <p>6、发生本基金合同约定的份额折算等事项，根据相关业务规则可暂停接受赎回申请的情形。</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>8、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p> <p>发生上述情形之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项的，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。若出现上述第 4 项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。对于场内赎回申请，按照上海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。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。</p> <p>九、巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>1、巨额赎回的认定</p> <p>若本基金单个开放日内的鹏华新丝路份额净赎回申请(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</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>7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p> <p>发生上述情形时且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项的，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。若出现上述第 4 项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。</p> <p>九、巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>1、巨额赎回的认定</p> <p>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）超过前一开放日的基金总份额的 10%，即认为是发生了巨额赎回。</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>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延期赎回。</p> <p>(1) 全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。</p> <p>(2) 部分延期赎回：当基金</p>
--	---	--

	<p>的余额)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)的10%，即认为是发生了巨额赎回。</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>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延期赎回。</p> <p>(1) 全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。</p> <p>(2) 部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因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)的10%的前提下，可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；对于未能赎回部分，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，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。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，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，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。</p> <p>(3) 暂停赎回：连续2个开放日以上(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，</p>	<p>管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因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开放日基金总份额的10%的前提下，可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；对于未能赎回部分，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，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。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，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，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。</p> <p>(3) 暂停赎回：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，并应当在指定媒介上进行公告。</p> <p>(4) 当基金发生巨额赎回，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10%以上的赎回申请(“大额赎回申请人”)的情形下，基金管理人有权延期办理赎回申请。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</p>
--	--	---

	<p>但不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒介上进行公告。</p> <p>(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> <p>(5) 当出现巨额赎回时，场内赎回申请按照上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相应规则进行处理，基金转换中转出份额的申请的处理方式遵照相关的业务规则及届时开展转换业务的公告。</p> <p>3、巨额赎回的公告</p> <p>当发生上述延期赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在指定媒介上刊登公告。</p>	<p>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> <p>3、巨额赎回的公告</p> <p>当发生上述延期赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在指定媒介上刊登公告。</p> <p>十、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告</p> <p>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，并在规定期限内指定媒介上刊登暂停公告。</p> <p>2、如发生暂停的时间为 1 日，基金管理人应于重新开放日，在指定媒介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。</p> <p>3、如发生暂停的时间超过 1 日但少于 2 周（含 2 周），暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人依照有关法律法规的规定在指定媒介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。</p>
--	--	---

	<p>十、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告</p> <p>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，并在规定期限内指定媒介上刊登暂停公告。</p> <p>2、如发生暂停的时间为1日，基金管理人应于重新开放日，在指定媒介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。</p> <p>3、如发生暂停的时间超过1日但少于2周（含2周），暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人依照有关法律法规的规定在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近1个工作日的基金份额净值。</p> <p>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。当连续暂停时间超过2个月的，基金管理人可以调整刊登公告的频率。暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人依照有关法律法规的规定在指定媒介上连续刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近1个工作日的基金份额净值。</p> <p>十一、基金转换</p> <p>基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换业务，基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及本基金合同的规定制定并公告，并提前告知基金托管人与相关机构。</p> <p>十二、定期定额投资计划</p> <p>基金管理人可以为投资人办理定期定额投资计划，具体规则由基金管理人另行规定。投资人在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额，每期扣款金额必须不</p>	<p>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。当连续暂停时间超过2个月的，基金管理人可以调整刊登公告的频率。暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人依照有关法律法规的规定在指定媒介上连续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。</p> <p>十一、基金转换</p> <p>基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换业务，基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及本基金合同的规定制定并公告，并提前告知基金托管人与相关机构。</p> <p>十二、基金的非交易过户</p> <p>基金的非交易过户是指基金登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资人。</p> <p>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关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按基金登记机构的规定办理，并按基金登记机构规定的标准收费。</p>
--	--	---

	<p>低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。</p> <p><b>第十部分 基金的非交易过户、转托管、冻结与解冻、转让</b></p> <p>一、基金的非交易过户</p> <p>基金的非交易过户是指基金登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资人。</p> <p>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按基金登记机构的规定办理，并按基金登记机构规定的标准收费。</p> <p>二、基金的转托管</p> <p>基金份额持有人可办理已持有基金份额在不同销售机构之间的转托管，基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。本基金的转托管包括系统内转托管和跨系统转托管。</p> <p>1、系统内转托管</p> <p>(1) 系统内转托管是指基金份额持有人将持有的基金份额在登记结算系统内不同销售机构（网点）之间进行转托管的行为。</p> <p>(2) 基金份额登记在登记结</p>	<p>十三、基金的转托管</p> <p>基金份额持有人可办理已持有基金份额在不同销售机构之间的转托管，基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。</p> <p>十四、定期定额投资计划</p> <p>基金管理人可以为投资人办理定期定额投资计划，具体规则由基金管理人另行规定。投资人在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额，每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。</p> <p>十五、基金份额的冻结和解冻</p> <p>基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。</p> <p>十六、基金份额的转让</p> <p>在法律法规允许且条件具备的情况下，基金管理人可受理基金份额持有人通过中国证监会认可的交易场所或者交易方式进行份额转让的申请并由登记机构办理基金份额的过户登记。基金管理人拟受理基金份额转让业务的，将提前公告，基金份额持有人应根据基金管理人公告的业务规则办理基金份额转让业务。</p> <p>十七、其他业务</p> <p>在不违反法律法规及中国证监会规定的前提下，基金管理人可在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情形下办理基金份额的质押业务或其他基金业务，基金管理人可制定相应的业务规则，并依照《信息披露办法》的有关规定进行公告。</p>
--	---	---

	<p>算系统的基金份额持有人在变更办理鹏华新丝路份额赎回业务的销售机构（网点）时，须办理已持有鹏华新丝路份额的系统内转托管。</p> <p>（3）募集期内不得办理系统内转托管。</p> <p>（4）鹏华新丝路份额系统内转托管的具体业务按照登记机构的相关业务规定办理。</p> <p>2、跨系统转托管</p> <p>（1）跨系统转托管是指基金份额持有人将持有的鹏华新丝路份额在登记结算系统和证券登记系统之间进行转托管的行为。</p> <p>（2）处于质押、冻结状态、基金份额折算基准日至折算处理日及上海证券交易所、注册登记机构规定的其他情形时，基金份额不能办理跨系统转托管。</p> <p>（3）鹏华新丝路份额跨系统转托管的具体业务按照基金登记机构的相关业务规定办理。</p> <p>3、基金管理人、基金登记机构或上海证券交易所可视情况对上述规定作出调整，并在正式实施前2日在指定媒介公告。</p> <p>三、基金份额的冻结和解冻</p> <p>基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。</p> <p>四、基金份额的转让</p> <p>在法律法规允许且条件具备的情况下，基金管理人可受理基金份额持有人通过中国证监会认可的交易场所或者交易方式进行份额转让的申请并由登记机构办理基金份额的过户登记。基金管理人拟受理基金份额转让业务的，将提前公告，基金份额持有人应根据基金管理人公告的业务规则办理基金份额转让业务。</p>	
	<b>基金份额的配对转换</b>	删除。

<b>基金合同当事人及权利义务</b>	<p>(13) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、融券及转融通；</p> <p>(15) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；</p>	<p>(13) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资及转融通；</p> <p>(15) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券/期货经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；</p>
<b>基金合同当事人及权利义务</b>	<p>(16) 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、转换和非交易过户等业务规则；</p>	<p>(16) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金申购、赎回、转换和非交易过户等业务规则；</p>
<b>基金合同当事人及权利义务</b>	<p>(1) 依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；</p>	<p>(1) 依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的申购、赎回和登记事宜；</p>
<b>基金合同当事人及权利义务</b>	<p>(8) 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，按有关规定计算并公告基金资产净值、基金份额净值、基金份额参考净值，确定鹏华新丝路份额申购、赎回的价格；</p>	<p>(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回的价格；</p>
<b>基金合同当事人及权利义务</b>	<p>(24) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，基金合同不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；</p>	<p>删除。</p>
<b>基金合同当事人及权利义务</b>	<p>(二) 基金托管人的权利与义务</p> <p>1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：</p> <p>(4) 根据相关市场规则，为基金开设资金账户、证券账户，为基金办理证券交易资金清算；</p> <p>2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：</p> <p>(6) 按规定开设基金财产的资金账户、证券账户，按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；</p> <p>(8) 复核、审查基金管理人</p>	<p>(二) 基金托管人的权利与义务</p> <p>1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：</p> <p>(4) 根据相关市场规则，为基金开设证券账户、为基金办理证券、期货交易资金清算；</p> <p>2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：</p> <p>(6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；</p>

	<p>计算的基金资产净值、基金份额净值、基金份额参考净值、鹏华新丝路份额申购、赎回价格；</p> <p>(12) 建立并保存基金份额持有人名册；</p> <p>(21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；</p>	<p>(8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回价格；</p> <p>(12) 保存基金份额持有人名册；</p> <p>(21) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；</p>
<b>基金合同当事人及权利义务</b>	<p>三、基金份额持有人</p> <p>基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对基金合同的承认和接受，基金投资者自依据基金合同取得基金份额，即成为本基金份额持有人和基金合同的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为基金合同当事人并不以在基金合同上书面签章或签字为必要条件。</p> <p>(4) 交纳基金认购、申购、赎回款项及法律法规和基金合同所规定的费用；</p> <p>(7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；</p>	<p>三、基金份额持有人</p> <p>基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受，基金投资者自依据《基金合同》取得的基金份额，即成为本基金份额持有人和《基金合同》的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章或签字为必要条件。</p> <p>(4) 交纳基金申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；</p> <p>(7) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；</p>
<b>基金份额持有人大会</b>	<p>基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人大会的审议事项应分别由鹏华新丝路份额、鹏华新丝路 A 份额、鹏华新丝路 B 份额的基金份额持有人独立进行表决。基金份额持有人持有的每一基金份额在其对应的份额类别内拥有平等的投票权。</p> <p>本基金份额持有人大会不设日常机构。</p>	<p>基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。</p> <p>本基金暂不设置日常机构，日常机构的设置和相关规则按照法律法规的有关规定进行。</p>
<b>基金份额持有人大会</b>	<p>一、召开事由</p> <p>1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：</p> <p>(1) 终止基金合同（法律法规、中国证监会另有规定的除外）；</p>	<p>一、召开事由</p> <p>1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会，法律法规、中国证监会或基金合同另有约定的除外：</p> <p>(1) 终止《基金合同》；</p> <p>(2) 更换基金管理人；</p>

	<p>(2) 更换基金管理人；</p> <p>(3) 更换基金托管人；</p> <p>(4) 转换基金运作方式（法律法规、中国证监会另有规定的除外）；</p> <p>(5) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；</p> <p>(6) 变更基金类别；</p> <p>(7) 本基金与其他基金的合并（法律法规、中国证监会另有规定的除外）；</p> <p>(8) 变更基金投资目标、范围或策略（法律法规、中国证监会另有规定的除外）；</p> <p>(9) 变更基金份额持有人大会程序；</p> <p>(10) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；</p> <p>(11) 单独或合计持有鹏华新丝路份额、鹏华新丝路 A 份额、鹏华新丝路 B 份额各自基金份额 10% 以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；</p> <p>(12) 终止鹏华新丝路份额、鹏华新丝路 A 份额或鹏华新丝路 B 份额上市，但因基金不再具备上市条件而被上海证券交易所终止上市的除外；</p> <p>(13) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；</p> <p>(14) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。</p> <p>2、以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：</p> <p>(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；</p> <p>(2) 法律法规要求增加的基金费用的收取；</p>	<p>(3) 更换基金托管人；</p> <p>(4) 转换基金运作方式；</p> <p>(5) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准；</p> <p>(6) 变更基金类别；</p> <p>(7) 本基金与其他基金的合并；</p> <p>(8) 变更基金投资目标、范围或策略；</p> <p>(9) 变更基金份额持有人大会程序；</p> <p>(10) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；</p> <p>(11) 单独或合计持有本基金总份额 10% 以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；</p> <p>(12) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；</p> <p>(13) 法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。</p> <p>2、以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：</p> <p>(1) 调低除基金管理费、基金托管费外其他应由基金承担的费用；</p> <p>(2) 法律法规要求增加的基金费用的收取；</p> <p>(3) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；</p> <p>(4) 在法律法规和基金合同规定的范围内，在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，增加、减少、调整基金份额类别设置；</p> <p>(5) 在法律法规和基金合同</p>
--	--	--

	<p>(3) 在法律法规和基金合同规定的范围内且在对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下调整本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；</p> <p>(4) 在法律法规和基金合同规定的范围内，在不提高现有基金份额持有人适用的费率的前提下，设立新的基金份额级别，增加新的收费方式；</p> <p>(5) 因相应的法律法规、上海证券交易所或登记机构的相关业务规则发生变动而应当对基金合同进行修改；</p> <p>(6) 对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生重大变化；</p> <p>(7) 按照法律法规和基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。</p>	<p>规定的范围内，在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金管理人、登记机构、基金销售机构调整有关申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务规则；</p> <p>(6) 在法律法规和基金合同规定的范围内，在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金推出新业务或服务；</p> <p>(7) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；</p> <p>(8) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生重大变化；</p> <p>(9) 按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。</p>
<p><b>基金份额持有人大会</b></p>	<p>二、会议召集人及召集方式</p> <p>4、单独或合计持有鹏华新丝路份额、鹏华新丝路 A 份额、鹏华新丝路 B 份额各自基金份额 10% 以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，单独或合计持有鹏华新丝路份额、鹏华新丝路 A 份额、鹏华新丝路 B 份额各自基金份额 10% 以上（含 10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管</p>	<p>二、会议召集人及召集方式</p> <p>4、代表基金份额 10% 以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10% 以上（含 10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。</p>

	<p>人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。</p> <p>5、单独或合计持有鹏华新丝路份额、鹏华新丝路 A 份额、鹏华新丝路 B 份额各自基金份额 10% 以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计持有鹏华新丝路份额、鹏华新丝路 A 份额、鹏华新丝路 B 份额各自基金份额 10% 以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。</p>	<p>5、代表基金份额 10% 以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表基金份额 10% 以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。</p>
<b>基金份额持有人大会</b>	<p>3、如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。</p>	<p>3、如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。</p>
<b>基金份额持有人大会</b>	<p>基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规和监管机关允许的其他方式召开，基金管理人、基金托管人须为基金份额持有人行使投票权提供便利。会议的召开方式由会议召集人确定。</p>	<p>基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规和监管机关允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。</p>
<b>基金份额持有人大会</b>	<p>1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，</p>	<p>1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有</p>

	<p>基金管理人或基金托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：</p> <p>（2）经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的鹏华新丝路份额、鹏华新丝路 A 份额、鹏华新丝路 B 份额各自基金份额不少于本基金在权益登记日鹏华新丝路份额、鹏华新丝路 A 份额、鹏华新丝路 B 份额各自基金总份额的二分之一（含二分之一）。若到会者在权益登记日代表的有效的鹏华新丝路份额、鹏华新丝路 A 份额、鹏华新丝路 B 份额各自基金份额少于本基金在权益登记日鹏华新丝路份额、鹏华新丝路 A 份额、鹏华新丝路 B 份额各自基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的鹏华新丝路份额、鹏华新丝路 A 份额、鹏华新丝路 B 份额各自基金份额应不少于本基金在权益登记日鹏华新丝路份额、鹏华新丝路 A 份额、鹏华新丝路 B 份额各自基金总份额的三分之一（含三分之一）。</p>	<p>人大会，基金管理人或托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：</p> <p>（2）经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）。若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一（含三分之一）。</p>
<p><b>基金份额持有人大会</b></p>	<p>2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式进行表决。</p>	<p>2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以会议通知载明的形式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址。</p>
<p><b>基金份额持有人大会</b></p>	<p>（3）本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的鹏华新丝路份额、鹏华新丝路 A 份额、鹏华新丝路 B 份额各自基金份额不小于在权益登记日鹏华新丝路份额、鹏华新丝路 A 份额、鹏华新丝路 B 份</p>	<p>（3）本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）。若本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见基金份额</p>

	<p>额各自基金总份额的二分之一（含二分之一）；若本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见基金份额持有人所持有的鹏华新丝路份额、鹏华新丝路 A 份额、鹏华新丝路 B 份额各自基金份额小于在权益登记日鹏华新丝路份额、鹏华新丝路 A 份额、鹏华新丝路 B 份额各自基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一（含三分之一）以上鹏华新丝路份额、鹏华新丝路 A 份额、鹏华新丝路 B 份额各自基金份额的持有人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见；</p>	<p>持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一（含三分之一）以上基金份额的持有人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见。</p>
<p><b>基金份额持有人大会</b></p>	<p>3、在法律法规和监管机关允许的情况下，本基金的基金份额持有人亦可采用其他非书面方式授权其代理人出席基金份额持有人大会；在会议召开方式上，本基金亦可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。</p>	<p>3、在法律法规和监管机关允许的情况下，本基金的基金份额持有人亦可采用其他非书面方式授权其代理人出席基金份额持有人大会；在会议召开方式上，本基金亦可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。基金份额持有人亦可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式进行表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。</p>
<p><b>基金份额持有人大会</b></p>	<p>六、表决          基金份额持有人所持每份鹏华新丝路份额、鹏华新丝路 A 份额、鹏华新丝路 B 份额在其对应的份额类别内有一票表决权。          基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：          1、一般决议，一般决议须经参加大会的鹏华新丝路份额、鹏华新丝路 A 份额、鹏华新丝路 B 份额各自基金份额的基金份额持有人或</p>	<p>六、表决          基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。          基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：          1、一般决议，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过方为有效；除下列第 2 项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均</p>

	<p>其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过方为有效；除下列第 2 项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。</p> <p>2、特别决议，特别决议应当经参加大会的鹏华新丝路份额、鹏华新丝路 A 份额、鹏华新丝路 B 份额各自基金份额的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。除本基金合同另有约定的，转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止基金合同、与其他基金合并以特别决议通过方为有效。</p>	<p>以一般决议的方式通过。</p> <p>2、特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。除本基金合同另有约定的，转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、与其他基金合并以特别决议通过方为有效。</p>
<b>基金管理人、基金托管人的更换条件和程序</b>	<p>（一）基金管理人的更换程序</p> <p>1、提名：新任基金管理人由基金托管人或由单独或合计持有 10%以上（含 10%）鹏华新丝路份额、鹏华新丝路 A 份额、鹏华新丝路 B 份额各自基金份额的基金份额持有人提名；</p> <p>2、决议：基金份额持有人大会在基金管理人职责终止后 6 个月内对被提名的基金管理人形成决议，该决议需经参加大会的鹏华新丝路份额、鹏华新丝路 A 份额、鹏华新丝路 B 份额各自基金份额的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）表决通过；</p>	<p>（一）基金管理人的更换程序</p> <p>1、提名：新任基金管理人由基金托管人或由单独或合计持有 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人提名；</p> <p>2、决议：基金份额持有人大会在基金管理人职责终止后 6 个月内对被提名的基金管理人形成决议，该决议需经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）表决通过；</p>
<b>基金管理人、基金托管人的更换条件和程序</b>	<p>（二）基金托管人的更换程序</p> <p>1、提名：新任基金托管人由基金管理人或由单独或合计持有 10%以上（含 10%）鹏华新丝路份额、鹏华新丝路 A 份额、鹏华新丝路 B 份额各自基金份额的基金份额持有人提名；</p> <p>2、决议：基金份额持有人大会在基金托管人职责终止后 6 个月内对被提名的基金托管人形成决议，该决议需经参加大会的鹏华新丝路份额、鹏华新丝路 A 份额、鹏华新丝路 B 份额各自基金份额的基金份</p>	<p>（二）基金托管人的更换程序</p> <p>1、提名：新任基金托管人由基金管理人或由单独或合计持有 10%以上（含 10%）基金份额的基金持有人提名；</p> <p>2、决议：基金份额持有人大会在基金托管人职责终止后 6 个月内对被提名的基金托管人形成决议，该决议需经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）表决通过；</p>

	额持有人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）表决通过；	
<b>基金管理人、基金托管人的更换条件和程序</b>	<p>（三）基金管理人与基金托管人同时更换的条件和程序。</p> <p>1、提名：如果基金管理人和基金托管人同时更换，由单独或合计持有鹏华新丝路份额、鹏华新丝路 A 份额、鹏华新丝路 B 份额各自基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人提名新的基金管理人和基金托管人；</p>	<p>（三）基金管理人与基金托管人同时更换的条件和程序</p> <p>1、提名：如果基金管理人和基金托管人同时更换，由单独或合计持有基金总份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人提名新的基金管理人和基金托管人；</p>
<b>基金管理人、基金托管人的更换条件和程序</b>	<p>（四）新基金管理人接收基金管理业务或新基金托管人接收基金财产和基金托管业务前，原基金管理人或原基金托管人应继续履行相关职责，并保证不做出对基金份额持有人的利益造成损害的行为。</p>	<p>三、本部分关于基金管理人、基金托管人更换条件和程序的约定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人与基金托管人协商一致并提前公告后，可直接对相应内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。</p>
<b>基金的托管</b>	<p>基金托管人和基金管理人按照《基金法》、基金合同及其他有关规定订立托管协议。</p>	<p>基金托管人和基金管理人按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定订立托管协议，基金托管事宜以托管协议约定为准。</p>
<b>基金份额的登记</b>	<p>二、基金登记业务办理机构</p> <p>本基金的登记业务由基金管理人或基金管理人委托的其他符合条件的机构办理。</p>	<p>二、基金登记业务办理机构</p> <p>本基金的登记业务由基金管理人或基金管理人委托的其他符合条件的机构办理，但基金管理人依法应当承担的责任不因委托而免除。</p>
<b>基金的投资</b>	<p>一、投资目标</p> <p>紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，力争将日均跟踪偏离度控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内。</p>	<p>一、投资目标</p> <p>本基金为股票指数增强型基金，在力求对沪深 300 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越标的指数的业绩表现，谋求基金资产的长期增值。</p>
<b>基金的投资</b>	<p>二、投资范围</p> <p>本基金投资范围为具有良好流</p>	<p>二、投资范围</p> <p>本基金主要投资于标的指数</p>

	<p>动性的金融工具，包括标的指数成份股及其备选成份股（含中小板、创业板股票及其他中国证监会核准上市的股票）、债券、股指期货、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</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>	<p>成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（含国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债、可转换债券、可交换债券等）、货币市场工具（含同业存单等）、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。</p> <p>本基金可以根据国家的有关规定进行融资及转融通。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</p> <p>基金的投资组合比例为：投资于股票资产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，基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计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>
<p><b>基金的投资</b></p>	<p>三、标的指数 新丝路指数</p> <p>在出现以下两种情况时，基金管理人将通过适当程序更换标的指数：</p> <p>1、如果标的指数可能存在的不合理性导致其不能很好地反映沪深 A 股市场新丝路主题相关上市公司股票的整体走势，或随着中国证券市场的进一步发展和完善，未来出现了更合理、更具代表性的反映</p>	<p>删除。</p>

	<p>该类股票走势的指数时；</p> <p>2、当标的指数出现下列问题时：</p> <p>（1）上海证券交易所或深圳证券交易所停止向标的指数供应商提供标的指数所需的数据、限制其从交易所取得数据或处理数据的权利；</p> <p>（2）标的指数被上海证券交易所及深圳证券交易所停止发布；</p> <p>（3）标的指数由其他指数替代；</p> <p>（4）标的指数供应商停止编辑、计算和公布标的指数点位或停止对基金管理人的标的指数使用授权；</p> <p>（5）标的指数由于指数编制方法等重大变更导致该指数不宜继续作为本基金的标的指数；</p> <p>（6）存在针对标的指数或标的指数供应商的商业纠纷或法律诉讼，且此类纠纷或诉讼可能对标的指数或基金管理人使用标的指数的能力产生重大不利影响；</p> <p>基金管理人可以依据审慎原则，在充分考虑基金份额持有人利益及履行适当程序的前提下，更换本基金的标的指数、业绩比较基准和投资对象，并依据市场代表性、流动性、与原标的指数的相关性等诸多因素选择确定新的标的指数，而无需召开基金份额持有人大会，基金管理人应与基金托管人协商一致后，报中国证监会备案并及时公告。</p> <p>标的指数更换后，基金管理人可根据需要替换或删除基金名称中与原标的指数相关的商号或字样。</p>	
<p><b>基金的投资</b></p>	<p>四、投资策略</p> <p>本基金采用被动式指数化投资方法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。</p> <p>当预期成份股发生调整或成份</p>	<p>三、投资策略</p> <p>1、股票投资策略</p> <p>本基金为指数增强型基金，以沪深 300 指数为标的指数，基金股票投资方面将主要采用指数增强量化投资策略，在严格控制跟踪误差的基础上，力求获得超</p>

	<p>股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。</p> <p>本基金力争鹏华新丝路份额净值增长率与同期业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。</p> <p>1、股票投资策略</p> <p>(1) 股票投资组合的构建</p> <p>本基金在建仓期内，将按照标的指数各成份股的基准权重对其逐步买入，在力求跟踪误差最小化的前提下，本基金可采取适当方法，以降低买入成本。当遇到成份股停牌、流动性不足等其他市场因素而无法依指数权重购买某成份股及预期标的指数的成份股即将调整或其他影响指数复制的因素时，本基金可以根据市场情况，结合研究分析，对基金财产进行适当调整，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。</p> <p>(2) 股票投资组合的调整</p> <p>本基金所构建的股票投资组合将根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况，对其进行适时调整，以保证鹏华新丝路份额净值增长率与标的指数收益率间的高度正相关和跟踪误差最小化。基金管理人将对成份股的流动性进行分析，如发现流动性欠佳的个股将可能采用合理方法寻求替代。由于受到各项持股比例限制，基金可能不能按</p>	<p>越标的指数的超额收益。</p> <p>指数增强量化投资策略主要借鉴国内外成熟的组合投资策略，在对标的指数成份股及其他股票基本面的深入研究的基础上，运用多因子量化选股模型构建投资组合，同时优化组合交易并严格控制组合风险，力求实现超额收益。</p> <p>(1) 多因子量化选股模型</p> <p>本基金将以多因子量化选股模型构建股票组合。多因子模型针对个股构建价值、质量、动量、成长、一致预期等因子，通过量化方法处理因子与个股超额回报之间的特征关系，挑选出具有基本面逻辑支撑和统计意义有效的因子组合，进而得出具有稳定超额回报的股票组合。本基金对因子的有效性进行持续的跟踪，分析其变化规律，基金经理根据市场状况结合因子变化趋势，对模型使用的因子结构进行动态调整。</p> <p>(2) 风险控制与调整</p> <p>本基金为指数增强型基金。在追求超额收益的同时，需要控制跟踪偏离过大的风险。基金将根据投资组合相对标的指数的暴露度等因素的分析，对组合跟踪效果进行预估，及时调整投资组合，力求将跟踪误差控制在目标范围内。</p> <p>本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%。</p> <p>(3) 投资组合优化模型</p> <p>本基金将综合考虑预期回报、风险及交易成本进行投资组合优化。选股范围以标的指数成份股为主，也包括非成份股中与成份股相关性强，流动性好，基本面信息充足的股票。</p>
--	---	--

	<p>照成份股权重持有成份股，基金将会采用合理方法寻求替代。</p> <p>1) 定期调整</p> <p>根据标的指数的调整规则和备选股票的预期，对股票投资组合及时进行调整。</p> <p>2) 不定期调整</p> <p>根据指数编制规则，当标的指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重新调整时，本基金将根据各成份股的权重变化进行相应调整；</p> <p>根据本基金的申购和赎回情况，对股票投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数；</p> <p>根据法律、法规规定，成份股在标的指数中的权重因其它特殊原因发生相应变化的，本基金可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。</p> <p>2、债券投资策略</p> <p>本基金可以根据流动性管理需要，选取到期日在一年以内的政府债券进行配置。本基金债券投资组合将采用自上而下的投资策略，根据宏观经济分析、资金面动向分析等判断未来利率变化，并利用债券定价技术，进行个券选择。</p> <p>3、衍生品投资策略</p> <p>本基金可投资股指期货、权证和其他经中国证监会允许的金融衍生产品。</p> <p>本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低申购赎回时现金资产对投资组合的影响及投资组合仓位调整的交易成本，达到稳定投资组合资产净值的目的。</p> <p>基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项，同时针对股指期货交易制定投</p>	<p>2、债券投资策略</p> <p>本基金债券投资将采取久期策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、个券选择策略、信用策略等积极投资策略，自上而下地管理组合的久期，灵活地调整组合的券种搭配，同时精选个券，以增强组合的持有期收益。</p> <p>3、权证投资策略</p> <p>本基金通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型及价值挖掘策略、价差策略、双向权证策略等寻求权证的合理估值水平，追求稳定的当期收益。</p> <p>4、股指期货投资策略</p> <p>本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目标，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，充分考虑股指期货的风险收益特征，通过多头或空头的套期保值策略，以改善投资组合的投资效果，实现股票组合的超额收益。</p> <p>5、资产支持证券的投资策略</p> <p>本基金将综合运用战略资产配置和战术资产配置进行资产支持证券的投资组合管理，并根据信用风险、利率风险和流动性风险变化积极调整投资策略，严格遵守法律法规和基金合同的约定，在保证本金安全和基金资产流动性的基础上获得稳定收益。</p>
--	--	--

	<p>资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。</p> <p>本基金通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型及价值挖掘策略、价差策略、双向权证策略等寻求权证的合理估值水平，追求稳定的当期收益。</p> <p>4、资产支持证券的投资策略</p> <p>本基金将综合运用战略资产配置和战术资产配置进行资产支持证券的投资组合管理，并根据信用风险、利率风险和流动性风险变化积极调整投资策略，严格遵守法律法规和基金合同的约定，在保证本金安全和基金资产流动性的基础上获得稳定收益。</p>	
<p><b>基金的投资</b></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>(1) 投资于股票部分的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%；</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>(3) 本基金非指数化投资部分持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；</p> <p>(4) 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%；</p> <p>(5) 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%；</p> <p>(6) 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%；</p> <p>(7) 本基金投资于同一原始</p>	<p>四、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>(1) 投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%，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%；</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>(3) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%，但除非法律法规另有规定，本基金指数化投资部分不受此限制；</p> <p>(4) 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%，但除非法律法规另有规定，本基金指数化投资部分不受此限制；</p> <p>(5) 本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家公司</p>

	<p>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%；</p> <p>(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%，中国证监会规定的特殊品种除外；</p> <p>(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%；</p> <p>(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%；</p> <p>(11) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；</p> <p>(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；</p> <p>(13) 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%；在全国银行间同业市场的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；</p> <p>(14) 基金总资产不得超过基金净资产的 140%；</p> <p>(15) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；</p> <p>(16) 本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%。其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；</p>	<p>发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金指数化投资部分不受此限制；</p> <p>(6) 本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%，本基金指数化投资部分不受此限制；</p> <p>(7) 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%；</p> <p>(8) 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%；</p> <p>(9) 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%；</p> <p>(10) 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%；</p> <p>(11) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%，中国证监会规定的特殊品种除外；</p> <p>(12) 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%；</p> <p>(13) 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%；</p> <p>(14) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；</p> <p>(15) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不</p>
--	--	---

	<p>(17) 本基金在任何交易日日终,持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%;</p> <p>(18) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值,合计(轧差计算)应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定;</p> <p>(19) 本基金在任何交易日内交易(不包括平仓)的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%;</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>(22) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他投资限制。</p> <p>除上述第(2)、(11)、(20)、(21)条外,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 个交易日内进行调整,但中国证监会规定的特殊情形除外。</p>	<p>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;</p> <p>(16) 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%;债券回购最长期限为 1 年,债券回购到期后不得展期;</p> <p>(17) 本基金总资产不得超过基金净资产的 140%;</p> <p>(18) 本基金参与股指期货交易,应当遵守下列要求:</p> <p>a. 本基金在任何交易日日终,持有的买入股指期货合约价值,不得超过基金资产净值的 10%;</p> <p>b. 本基金在任何交易日日终,持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的 95%。其中,有价证券指股票、债券(不含到期日在一年以内的政府债券)、权证、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等;</p> <p>c. 本基金在任何交易日日终,持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%;</p> <p>d. 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值,合计(轧差计算)应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定;</p> <p>e. 本基金在任何交易日内交易(不包括平仓)的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%;</p> <p>(19) 本基金参与融资的,每个交易日日终,本基金持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的 95%;</p> <p>(20) 本基金参与转融通证券出借业务的,在任何交易日日终,参与转融通证券出借交易的</p>
--	--	--

		<p>资产不得超过基金资产净值的50%，证券出借的平均剩余期限不得超过30天，平均剩余期限按照市值加权平均计算；</p> <p>（21）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>（22）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>（23）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。</p> <p>除上述第（2）、（14）、（21）、（22）条外，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。</p>
<p><b>基金的投资</b></p>	<p>法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按变更后的规定执行。</p>	<p>法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。</p>
<p><b>基金的投资</b></p>	<p>基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份</p>	<p>基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策</p>

	<p>额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并履行信息披露义务。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。</p>	<p>略，遵循持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。</p>
基金的投资	<p>六、业绩比较基准</p> <p>新丝路指数收益率×95%+商业银行活期存款利率（税后）×5%</p> <p>新丝路指数以沪深A股市场注册地为陕西、甘肃、宁夏、青海与新疆5省的上市公司为样本空间，根据市值和成交金额的综合表现进行排名，选出前100只股票作为指数样本股。新丝路指数反映丝绸之路经济带区域内相关上市公司的整体表现，同时也为市场提供相关的主题投资标的。</p> <p>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指数时，本基金管理人可以在取得基金托管人同意后变更业绩比较基准，不需要召集基金份额持有人大会，但需报中国证监会备案并及时公告。</p>	<p>五、业绩比较基准</p> <p>本基金业绩比较基准=沪深300指数收益率×95%+1.5%（指年收益率，评价时按期间折算）。</p> <p>沪深300指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国A股市场指数，它的样本选自沪深两个证券市场，覆盖了大部分流通市值，其成份股票为中国A股市场中代表性强、流动性高的股票，能够反映A股市场总体发展趋势。</p> <p>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比较基准时，本基金管理人与基金托管人协商一致后可以在报中国证监会备案以后变更业绩比较基准并及时公告，但不需要召开基金份额持有人大会。</p>
基金的投资	<p>七、风险收益特征</p> <p>本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。同时本基金为指数基金，通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。</p>	<p>六、风险收益特征</p> <p>本基金属于股票指数增强型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金，属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种。</p>

	<p>从本基金所分拆的两类基金份额来看，鹏华新丝路 A 份额为稳健收益类份额，具有低风险且预期收益相对较低的特征；鹏华新丝路 B 份额为积极收益类份额，具有高风险且预期收益相对较高的特征。</p> <p>八、基金的融资融券及转融通</p> <p>本基金可以根据届时有效的有关法律法规和政策的规定进行融资融券。</p>	
<p><b>基金资产估值</b></p>	<p>三、估值方法</p> <p>1、证券交易所上市的有价证券的估值</p> <p>(1) 交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。</p> <p>(2) 交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整并确定公允价格。</p> <p>(3) 交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价减去债券收盘价或估值全价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，</p>	<p>三、估值方法</p> <p>1、交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。</p> <p>2、交易所市场交易的固定收益品种的估值</p> <p>(1) 对在交易所市场上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种（另有规定的除外），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；</p> <p>(2) 对在交易所市场上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种（本合同另有规定的除外），建议选取第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价。</p> <p>(3) 对在交易所市场上市交易的可转换债券，按估值日收盘价减去可转换债券收盘价中所含债券应收利息后得到的净价进行估值；</p> <p>(4) 对在交易所市场挂牌转</p>

	<p>且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价减去债券收盘价或估值全价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整并确定公允价格。</p> <p>(4) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，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，按成本估值。</p> <p>2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>(1) 送股、转增股和配股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值。</p> <p>(2) 首次公开发行未上市的股票、债券和权证，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，按成本估值。</p> <p>(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估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p> <p>3、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。</p> <p>4、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。</p> <p>5、股指期货合约，以估值日结算价估值；估值日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重</p>	<p>让的资产支持证券，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，按成本估值；</p> <p>(5) 对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的固定收益品种，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，按成本估值。</p> <p>3、银行间市场交易的固定收益品种的估值</p> <p>(1) 银行间市场交易的不含权固定收益品种，选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值。</p> <p>(2) 对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价。对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。</p> <p>(3) 对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的固定收益品种，按成本估值。</p> <p>4、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>(1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值。</p> <p>(2) 首次公开发行未上市的股票和权证，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，按成本估值。</p> <p>(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估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机</p>
--	---	--

	<p>大变化的，以最近交易日的结算价估值。</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> <p>7、如有确凿证据表明按上述方法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与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。</p> <p>8、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。</p>	<p>构或行业协会有关规定确定公允价值。</p> <p>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。</p> <p>6、股指期货合约，以估值日结算价估值；估值日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，以最近交易日的结算价估值。</p> <p>7、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> <p>8、如有确凿证据表明按上述方法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与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。</p> <p>9、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。</p>
<b>基金资产估值</b>	<p>四、估值程序</p> <p>1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后，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4位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。</p> <p>基金管理人每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。</p> <p>2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或本基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将各类基金份额的基金份额（参考）净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人按约定对外公布。</p>	<p>四、估值程序</p> <p>1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到0.0001元，小数点后第5位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。</p> <p>每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。</p> <p>2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或本基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个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。</p>
<b>基金资产估值</b>	<p>五、估值错误的处理</p> <p>基金管理人和基金托管人将采</p>	<p>五、估值错误的处理</p> <p>基金管理人和基金托管人将</p>

<p>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）发生估值错误时，视为基金份额净值错误。</p> <p>本基金合同的当事人应按照以下约定处理：</p> <p>1、估值错误类型</p> <p>本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或登记机构、或销售机构、或投资人自身的过错造成估值错误，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该估值错误遭受损失当事人（“受损方”）的直接损失按下述“估值错误处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。</p> <p>上述估值错误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。</p> <p>2、估值错误处理原则</p> <p>（1）估值错误已发生，但尚未给当事人造成损失时，估值错误责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正估值错误发生的费用由估值错误责任方承担；由于估值错误责任方未及时更正已产生的估值错误，给当事人造成损失的，由估值错误责任方对直接损失承担赔偿责任；若估值错误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。估值错误责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保估值错误已得到更正。</p> <p>（2）估值错误的责任方对有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对估值错误的有关直接当事人负责，不对第三方负责。</p> <p>（3）因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得</p>	<p>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4位以内（含第4位）发生估值错误时，视为基金份额净值错误。</p> <p>本基金合同的当事人应按照以下约定处理：</p> <p>1、估值错误类型</p> <p>本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或登记机构、或销售机构、或投资人自身的过错造成估值错误，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该估值错误遭受损失当事人（“受损方”）的直接损失按下述“估值错误处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。</p> <p>上述估值错误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。</p> <p>2、估值错误处理原则</p> <p>（1）估值错误已发生，但尚未给当事人造成损失时，估值错误责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正估值错误发生的费用由估值错误责任方承担；由于估值错误责任方未及时更正已产生的估值错误，给当事人造成损失的，由估值错误责任方对直接损失承担赔偿责任；若估值错误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。估值错误责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保估值错误已得到更正。</p> <p>（2）估值错误的责任方对有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对估值错误的有关直接当事人负责，不对</p>
---	--

	<p>利的义务。但估值错误责任方仍应对估值错误负责。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”),则估值错误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估值错误责任方。</p> <p>(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。</p> <p>(5) 按法律法规规定的其他原则处理估值错误。</p>	<p>第三方负责。</p> <p>(3) 因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但估值错误责任方仍应对估值错误负责。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”),则估值错误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估值错误责任方。</p> <p>(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。</p>
基金资产估值	<p>③如基金管理人和基金托管人对基金份额净值的计算结果,虽然多次重新计算和核对或对基金管理人采用的估值方法,尚不能达成一致时,为避免不能按时公布基金份额净值的情形,以基金管理人的计算结果对外公布,由此给基金份额持有人和基金造成的损失,由基金管理人负责赔付。</p>	<p>如基金管理人和基金托管人对基金份额净值的计算结果,虽然多次重新计算和核对,尚不能达成一致时,为避免不能按时公布基金份额净值的情形,以基金管理人的计算结果对外公布,由此给基金份额持有人和基金造成的损失,由基金管理人负责赔付。</p>
基金资产估值	<p>(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。</p> <p>(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。</p>	<p>(4) 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。如果行业另有通行做法,双方当事人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。</p>
基金资产估值	<p>六、暂停估值的情形</p> <p>1、基金投资所涉及的证券/期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;</p> <p>2、因不可抗力致使基金管理</p>	<p>六、暂停估值的情形</p> <p>1、基金投资所涉及的证券/期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;</p> <p>2、因不可抗力致使基金管理</p>

	<p>人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；</p> <p>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，已决定延迟估值时；</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> <p>5、中国证监会和基金合同认定的其它情形。</p> <p>七、基金净值的确认</p> <p>用于基金信息披露的基金资产净值和各类基金份额的基金份额（参考）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开放日交易结束后计算当日的基金资产净值和各类基金份额的基金份额（参考）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，由基金管理人按约定对基金净值予以公布。</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，所造成的误差不得作为基金资产估值错误处理。</p> <p>2、由于不可抗力或证券/期货交易所、登记结算公司或标的指数供应商发送的数据错误等原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误而造成的基金资产估值错误，基金管理人、基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。</p>	<p>人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；</p> <p>3、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> <p>4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。</p> <p>七、基金净值的确认</p> <p>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开放日交易结束后计算当日的基金资产净值和基金份额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，由基金管理人按约定对基金净值予以公布。</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 8 项进行估值时，所造成的误差不得作为基金资产估值错误处理。</p> <p>2、由于证券/期货交易所、登记结算公司发送的数据错误，有关会计制度变化或由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误而造成的基金资产净值计算错误，基金管理人、基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。</p>
<p><b>基金费用与税收</b></p>	<p>一、基金费用的种类</p> <p>1、基金管理人的管理费；</p>	<p>一、基金费用的种类</p> <p>1、基金管理人的管理费；</p>

	<p>2、基金托管人的托管费； 3、基金合同生效后的标的指数许可使用费； 4、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用； 5、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费； 6、基金份额持有人大会费用；  7、基金的证券/期货交易费用；  8、基金的银行汇划费用； 9、账户开户费用、账户维护费用； 10、基金的上市费和年费； 11、按照国家有关规定和基金合同约定，可以在基金财产中列支的其他费用。</p> <p>二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式</p> <p>2、基金托管人的托管费 本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.22%的年费率计提。托管费的计算方法如下： <math>H = E \times 0.22\% \div \text{当年天数}</math> H为每日应计提的基金托管费 E为前一日的基金资产净值 基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。</p> <p>3、标的指数许可使用费 本基金的标的指数许可使用费按前一日基金资产净值的0.02%的年费率计提。标的指数许可使用费的计算方法如下： <math>H = E \times 0.02\% \div \text{当年天数}</math> H为每日应计提的标的指数许可使用费 E为前一日的基金资产净值</p>	<p>2、基金托管人的托管费； 3、《基金合同》生效后的标的指数许可使用费； 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用； 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费、诉讼费、公证费和认证费；  6、基金份额持有人大会费用；  7、基金的证券/期货交易费用； 8、基金的银行汇划费用； 9、证券账户开户费用、账户维护费用； 10、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。</p> <p>二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式</p> <p>2、基金托管人的托管费 本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.15%的年费率计提。托管费的计算方法如下： <math>H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}</math> H为每日应计提的基金托管费 E为前一日的基金资产净值 基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。</p> <p>3、标的指数许可使用费 本基金的标的指数许可使用费按前一日基金资产净值的0.0112%的年费率计提。标的指数许可使用费的计算方法如下： <math>H = E \times 0.0112\% \div \text{当年天数}</math> H为每日应计提的标的指数</p>
--	--	---

	<p>标的指数许可使用费每日计算，逐日累计至每季季末，按季支付（当季不足 50,000 元的，按 50,000 元计算），计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。由基金管理人向基金托管人发送标的指数许可使用费划款指令，基金托管人复核后于次季前 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给标的指数供应商。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。</p> <p>标的指数供应商根据相应指数许可协议变更标的指数许可使用费率和计算方式时，基金管理人需依照有关规定最迟于新的费率和计费方式实施日前 2 日在指定媒介公告。</p> <p>4、证券账户开户费用：证券账户开户费经基金管理人与基金托管人核对无误后，自本基金成立一个月内由基金托管人从基金财产中划付，如基金财产余额不足支付该开户费用，由基金管理人于本基金成立一个月后的 5 个工作日内进行垫付，基金托管人不承担垫付开户费用义务。</p> <p>上述“一、基金费用的种类中第 4—11 项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。</p>	<p>许可使用费</p> <p>E 为前一日的基金资产净值</p> <p>标的指数许可使用费每日计算，逐日累计至每季季末，按季支付（当季不足 50,000 元的，按 50,000 元计算），计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。由基金管理人向基金托管人发送标的指数许可使用费划款指令，基金托管人复核后于次季前 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给标的指数供应商。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。</p> <p>标的指数供应商根据相应指数许可协议变更标的指数许可使用费率和计算方式时，基金管理人需依照有关规定最迟于新的费率和计费方式实施日前 2 日在指定媒介公告并书面通知托管人。</p> <p>上述“一、基金费用的种类中第 4—10 项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。</p>
<p><b>基金费用与税收</b></p>	<p>三、不列入基金费用的项目</p> <p>3、基金合同生效前的相关费用；</p>	<p>三、不列入基金费用的项目</p> <p>3、《基金合同》生效前的相关费用，《基金合同》生效前的相关费用根据《鹏华新丝路指数分级证券投资基金基金合同》的约定执行；</p>
<p><b>基金的收益与分配</b></p>	<p>在存续期内，本基金（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）不进行收益分配。</p> <p>法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。</p>	<p>一、基金利润的构成</p> <p>基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额，基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。</p>

		<p>二、基金可供分配利润</p> <p>基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。</p> <p>三、基金收益分配原则</p> <p>1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；</p> <p>2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；</p> <p>3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；</p> <p>4、每一基金份额享有同等分配权；</p> <p>5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。</p> <p>在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，经与基金托管人协商一致，基金管理人可调整基金收益分配原则和支付方式，不需召开基金份额持有人大会。</p> <p>四、收益分配方案</p> <p>基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。</p> <p>五、收益分配方案的确定、公告与实施</p> <p>本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在2个工作日内在指定媒介</p>
--	--	--

		<p>公告并报中国证监会备案。</p> <p>基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日。</p> <p>六、基金收益分配中发生的费用</p> <p>基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。</p>
	<b>基金份额的折算</b>	删除。
<b>基金的会计与审计</b>	<p>2、基金的会计年度为公历年度的 1 月 1 日至 12 月 31 日；基金首次募集的会计年度按如下原则：如果基金合同生效少于 2 个月，可以并入下一个会计年度；</p>	<p>2、基金的会计年度为公历年度的 1 月 1 日至 12 月 31 日；</p>
<b>基金的信息披露</b>	<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>公开披露的基金信息包括：</p> <p>1、基金招募说明书、基金合同、基金托管协议</p> <p>（1）基金合同是界定基金合同当事人的各项权利、义务关系，明确基金份额持有人大会召开的规则及具体程序，说明基金产品的特性等涉及基金投资者重大利益的事项的法律文件。</p> <p>（2）基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。基金合同生效后，基金管理人在每 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，将更新后的招募说明书摘要登载在指定媒介上；基金管理人在公告的 15 日前向主</p>	<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>公开披露的基金信息包括：</p> <p>（一）基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议</p> <p>1、《基金合同》是界定《基金合同》当事人的各项权利、义务关系，明确基金份额持有人大会召开的规则及具体程序，说明基金产品的特性等涉及基金投资者重大利益的事项的法律文件。</p> <p>2、基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。《基金合同》生效后，基金管理人在每 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，将更新后的招募说明书摘要登载在指定媒介上；基金管理人在公告</p>

	<p>要办公场所所在地的中国证监会派出机构报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供书面说明。</p> <p>(3) 基金托管协议是界定基金托管人和基金管理人在基金财产保管及基金运作监督等活动中的权利、义务关系的法律文件。</p> <p>基金募集申请经中国证监会注册后，基金管理人在基金份额发售的3日前，将基金招募说明书、基金合同摘要登载在指定媒介上；基金管理人、基金托管人应当将基金合同、基金托管协议登载在网站上。</p> <p>2、基金份额发售公告</p> <p>基金管理人应当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媒介上。</p> <p>3、基金合同生效公告</p> <p>基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日在指定媒介上登载基金合同生效公告。</p> <p>4、基金份额上市交易公告书</p> <p>本基金基金份额获准在上海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前至少3个工作日，将基金份额上市交易公告书登载于指定媒介上。</p> <p>5、基金资产净值、基金份额净值、基金份额参考净值</p> <p>基金合同生效后，在本基金基金份额开始上市交易前或鹏华新丝路份额开始办理申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值、鹏华新丝路份额的基金份额净值、鹏华新丝路A份额与鹏华新丝路B份额的基金份额参考净值。</p> <p>在本基金基金份额开始上市交易后或鹏华新丝路份额开始办理申购或者赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金</p>	<p>的15日前向主要办公场所所在地的中国证监会派出机构报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供书面说明。</p> <p>3、基金托管协议是界定基金托管人和基金管理人在基金财产保管及基金运作监督等活动中的权利、义务关系的法律文件。</p> <p>关于审议基金转型的基金份额持有人大会决议表决通过后，基金管理人应当将经中国证监会注册的基金招募说明书、《基金合同》摘要登载在指定媒介上；基金管理人、基金托管人应当将《基金合同》、基金托管协议登载在网站上。</p> <p>(二) 《基金合同》生效公告</p> <p>基金管理人应当在指定媒介上登载《基金合同》生效公告。</p> <p>(三) 基金资产净值、基金份额净值</p> <p>《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。</p> <p>在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额销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。</p> <p>基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒介上。</p> <p>(四) 基金份额申购、赎回价格</p> <p>基金管理人应当在《基金合同》、招募说明书等信息披露文</p>
--	--	--

	<p>露开放日鹏华新丝路份额的基金份额净值和基金份额累计净值、鹏华新丝路 A 份额与鹏华新丝路 B 份额的基金份额参考净值。</p> <p>基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值、鹏华新丝路份额的基金份额净值、鹏华新丝路 A 份额与鹏华新丝路 B 份额的基金份额参考净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、鹏华新丝路份额的基金份额净值和基金份额累计净值、鹏华新丝路 A 份额与鹏华新丝路 B 份额的基金份额参考净值登载在指定媒介上。</p> <p>6、基金份额申购、赎回价格</p> <p>基金管理人应当在基金合同、招募说明书等信息披露文件上载明鹏华新丝路份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资者能够在基金份额发售网点查阅或者复制前述信息资料。</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>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媒介上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。</p> <p>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媒介上。</p> <p>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媒介上。</p> <p>基金合同生效不足 2 个月的，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。</p> <p>基金定期报告在公开披露的第</p>	<p>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，并保证投资者能够在基金份额销售网点查阅或者复制前述信息资料。</p> <p>（五）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>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媒介上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。</p> <p>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媒介上。</p> <p>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媒介上。</p> <p>《基金合同》生效不足 2 个月的，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。</p> <p>基金定期报告在公开披露的第 2 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或书面报告方式。</p> <p>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 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</p>
--	---	---

	<p>2 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或书面报告方式。</p> <p>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> <p>8、临时报告</p> <p>本基金发生重大事件，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的中国证监会派出机构备案。</p> <p>前款所称重大事件，是指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下列事件：</p> <p>(1) 基金份额持有人大会的召开；</p> <p>(2) 终止基金合同；</p> <p>(3) 转换基金运作方式；</p> <p>(4) 更换基金管理人、基金托管人；</p> <p>(5) 基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；</p> <p>(6) 基金管理人股东及其出资比例发生变更；</p> <p>(7) 基金募集期延长；</p> <p>(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；</p>	<p>化情况及产品的特有风险。</p> <p>(六) 临时报告</p> <p>本基金发生重大事件，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的中国证监会派出机构备案。</p> <p>前款所称重大事件，是指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下列事件：</p> <p>1、基金份额持有人大会的召开；</p> <p>2、终止《基金合同》；</p> <p>3、转换基金运作方式；</p> <p>4、更换基金管理人、基金托管人；</p> <p>5、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；</p> <p>6、基金管理人股东及其出资比例发生变更；</p> <p>7、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；</p> <p>8、基金管理人的董事在一年内变更超过百分之五十；</p> <p>9、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百分之三十；</p> <p>10、涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或者仲裁；</p> <p>11、基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查；</p> <p>12、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；</p> <p>13、重大关联交易事项；</p> <p>14、基金收益分配事项；</p> <p>15、管理费、托管费、标的</p>
--	--	--

	<p>(9) 基金管理人的董事在一年内变更超过百分之五十；</p> <p>(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百分之三十；</p> <p>(11) 涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或者仲裁；</p> <p>(12) 基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查；</p> <p>(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；</p> <p>(14) 重大关联交易事项；</p> <p>(15) 基金收益分配事项；</p> <p>(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；</p> <p>(17) 基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；</p> <p>(18) 基金改聘会计师事务所；</p> <p>(19) 变更基金销售机构；</p> <p>(20) 更换基金登记机构；</p> <p>(21) 本基金开始办理申购、赎回；</p> <p>(22) 本基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；</p> <p>(23) 本基金发生巨额赎回并延期支付；</p> <p>(24) 本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；</p> <p>(25) 本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；</p> <p>(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；</p> <p>(27) 基金管理人采用摆动定价机制进行估值；</p> <p>(28) 本基金开始办理或暂停接受份额配对转换申请；</p> <p>(29) 本基金暂停接受份额配</p>	<p>指数许可使用费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；</p> <p>16、基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；</p> <p>17、基金改聘会计师事务所；</p> <p>18、变更基金销售机构；</p> <p>19、更换基金登记机构；</p> <p>20、本基金开始办理申购、赎回；</p> <p>21、本基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；</p> <p>22、本基金发生巨额赎回并延期支付；</p> <p>23、本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；</p> <p>24、本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；</p> <p>25、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；</p> <p>26、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；</p> <p>27、中国证监会规定的其他事项。</p> <p>(七) 澄清公告</p> <p>在《基金合同》存续期限内，任何公共媒介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。</p> <p>(八) 基金份额持有人大会决议</p> <p>基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。</p> <p>(九) 中国证监会规定的其他信息</p> <p>若本基金投资股指期货，基金管理人应在季度报告、半年度</p>
--	--	--

	<p>对转换申请后重新接受份额配对转换；</p> <p>(30) 本基金进行基金份额折算；</p> <p>(31) 本基金在该会计年度9月第一个工作日不进行定期折算；</p> <p>(32) 本基金停复牌或终止上市；</p> <p>(33) 中国证监会规定的其他事项。</p> <p>9、澄清公告</p> <p>在基金合同存续期限内，任何公共媒介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。</p> <p>10、基金份额持有人大会决议</p> <p>基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。</p> <p>11、中国证监会规定的其他信息。</p> <p>若本基金投资股指期货等金融期货，基金管理人应在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和更新的招募说明书等文件中披露金融期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示金融期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标。</p> <p>若本基金投资资产支持证券，基金管理人应当依法披露其所管理的证券投资基金投资资产支持证券的情况，并保证所披露信息的真实性、准确性和完整性，不得有虚假记载、误导性陈述和重大遗漏。基金管理人应在基金年报及半年报中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期内所有的资产支持证</p>	<p>报告、年度报告等定期报告和更新的招募说明书等文件中披露金融期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示金融期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标。</p> <p>若本基金参与融资及转融通，基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露参与融资和转融通证券出借交易情况，包括投资策略、业务开展情况、损益情况、风险及其管理情况等。</p> <p>基金管理人应在基金年报及半年报中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。基金管理人应在基金季度报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期末按市值占基金净资产比例大小排序的前10名资产支持证券明细。</p> <p>六、信息披露事务管理</p> <p>基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度，指定专人负责管理信息披露事务。</p> <p>基金信息披露义务人公开披露基金信息，应当符合中国证监会相关基金信息披露内容与格式准则的规定。</p> <p>基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告和定期更新的招募说明书等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人出具书面文件或者盖章</p>
--	---	--

	<p>券明细。基金管理人应在基金季度报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期末按市值占基金净资产比例大小排序的前 10 名资产支持证券明细。</p> <p>六、信息披露事务管理</p> <p>基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度，指定专人负责管理信息披露事务。</p> <p>基金信息披露义务人公开披露基金信息，应当符合中国证监会相关基金信息披露内容与格式准则的规定。</p> <p>基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和基金合同的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额参考净值、鹏华新丝路份额申购赎回价格、基金定期报告和定期更新的招募说明书等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人出具书面文件或者盖章确认。</p> <p>基金管理人、基金托管人应当在指定媒介中选择披露信息的报刊。</p> <p>基金管理人、基金托管人除依法在指定媒介上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒介披露信息，但是其他公共媒介不得早于指定媒介披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。</p> <p>为基金信息披露义务人公开披露的基金信息出具审计报告、法律意见书的专业机构，应当制作工作底稿，并将相关档案至少保存到基金合同终止后 10 年。</p>	<p>确认。</p> <p>基金管理人、基金托管人应当在指定媒介中选择披露信息的媒介。</p> <p>基金管理人、基金托管人除依法在指定媒介上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒介披露信息，但是其他公共媒介不得早于指定媒介披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。</p> <p>为基金信息披露义务人公开披露的基金信息出具审计报告、法律意见书的专业机构，应当制作工作底稿，并将相关档案至少保存到《基金合同》终止后 10 年。</p>
<p><b>基金合同的变更、终止与基金财产的清算</b></p>	<p>3、本基金被其他基金吸收合并；</p>	<p>删除。</p>
<p><b>基金合同的变更、终止与基</b></p>	<p>五、基金财产清算剩余资产的分配</p>	<p>五、基金财产清算剩余资产的分配</p>

<p><b>基金财产的清算</b></p>	<p>依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，分别计算鹏华新丝路份额、鹏华新丝路 A 份额、鹏华新丝路 B 份额各自的应计分配比例，并据此向鹏华新丝路份额、鹏华新丝路 A 份额、鹏华新丝路 B 份额各自的基金份额持有人按其持有的基金份额比例进行分配。</p>	<p>依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。</p>
<p><b>基金合同的变更、终止与基金财产的清算</b></p>	<p>八、本基金被其他基金吸收合并引起本基金基金合同终止的，本基金财产可不予变现和分配，并入其他基金资产中。本基金的债权债务由合并后的基金享有和承担。本基金清算的其他事项按照基金合同的其他约定执行。</p>	<p>删除。</p>
<p><b>违约责任</b></p>	<p>三、由于基金管理人、基金托管人不可控制的因素导致业务出现差错，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现错误的，由此造成基金财产或投资人损失，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但是基金管理人和基金托管人应积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。</p>	<p>三、由于基金管理人、基金托管人不可控制的因素导致业务出现差错，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现错误的，由此造成基金财产或投资人损失，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但是基金管理人和基金托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。</p>
<p><b>基金合同的效力</b></p>	<p>一、基金合同经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字并在募集结束后经基金管理人向中国证监会办理基金备案手续，并经中国证监会书面确认后生效。</p>	<p>1、《基金合同》经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字，经 2017 年【】月【】日鹏华新丝路指数分级证券投资基金的基金份额持有人大会决议通过，并报中国证监会备案。自 2017 年【】月【】日起，《基金合同》生效，原《鹏华新丝路指数分级证券投资基金基金合同》同日起失效。</p>
<p><b>基金合同的效力</b></p>	<p>四、基金合同正本一式六份，除上报有关监管机构一式二份外，基金管理人、基金托管人各持有二份，每份具有同等的法律效力。</p>	<p>4、《基金合同》正本一式叁份，除上报有关监管机构外，基金管理人、基金托管人各持有壹份，每份具有同等的法律效力。</p>

