

鹏华新丝路指数分级
证券投资基金
更新的招募说明书摘要

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

2018年3月

重要提示

本基金经 2015 年 4 月 29 日中国证券监督管理委员会下发的《关于核准鹏华新丝路指数分级证券投资基金募集的批复》（证监许可〔2015〕766 号文）注册，进行募集。根据相关法律法规，本基金基金合同已于 2015 年 8 月 13 日正式生效，基金管理人于该日起正式开始对基金财产进行运作管理。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但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作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和市场前景等作出实质性判断或保证。

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，包括但不限于：市场风险、管理风险、操作风险、流动性风险、信用风险、本基金特有风险（包括作为指数基金的风险、作为上市基金的风险和作为分级基金的风险）及其他风险，等等。

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。

基金的过往业绩并不预示其未来表现，基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金表现的保证。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行承担。投资有风险，投资人在投资本基金前应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同等信息披露文件，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。

本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为 2018 年 2 月 12 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2017 年 12 月 31 日（未经审计）。

一、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的工作，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，现任鹏华基金管理有限公司副总裁、固定收益投资总监、固定收益部总经理。

4、本基金基金经理

张羽翔先生，国籍中国，工学硕士，11年证券基金从业经验。曾任招商银行软件中心（原深圳市融博技术公司）数据分析师；2011年3月加盟鹏华基金管理有限公司，历任监察稽核部资深金融工程师、量化及衍生品投资部资深量化研究员，先后从事金融工程、量化研究等工作。2015年09月担任鹏华上证民企50ETF联接基金基金经理，2015年09月担任鹏华上证民企50ETF基金基金经理，2016年06月担任鹏华新丝路分级基金基金经理，2016年07月担任鹏华高铁分级基金基金经理，2016年09月担任鹏华沪深300指数（LOF）基金基金经理，2016年09月担任鹏华中证500指数（LOF）基金基金经理，2016年11月担任鹏华新能源分级基金基金经理，2016年11月担任鹏华一带一路分级基金基金经理。张羽翔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09月担任鹏华上证民企50ETF联接基金基金经理

2015年09月担任鹏华上证民企50ETF基金基金经理

2016年07月担任鹏华高铁分级基金基金经理

2016年09月担任鹏华沪深300指数（LOF）基金基金经理

2016年09月担任鹏华中证500指数（LOF）基金基金经理

2016年11月担任鹏华新能源分级基金基金经理

2016年11月担任鹏华一带一路分级基金基金经理

本基金历任的基金经理：

2015年08月至2016年12月 焦文龙先生

2015年08月至2016年09月 崔惠军先生

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。

二、基金托管人

（一）基金托管人概况

1、基本情况

名称：招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）

设立日期：1987年4月8日

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

注册资本：252.20亿元

法定代表人：李建红

行长：田惠宇

资产托管业务批准文号：证监基金字[2002]83号

电话：0755—83199084

传真：0755—83195201

资产托管部信息披露负责人：张燕

2、发展概况

招商银行成立于1987年4月8日，是我国第一家完全由企业法人持股的股份制商业银行，总行设在深圳。自成立以来，招商银行先后进行了三次增资扩股，并于2002年3月成功地发行了15亿A股，4月9日在上交所挂牌（股票代码：600036），是国内第一家采用国际会计标准上市的公司。2006年9月又成功发行了22亿H股，9月22日在香港联交所挂牌交易（股票代码：3968），10月5日行使H股超额配售，共发行了24.2亿H股。截至2017年9月30日，本集团总资产61,692.39亿元人民币，高级法下资本充足率15.01%，权重法下资本充足率12.26%。

2002年8月，招商银行成立基金托管部；2005年8月，经报中国证监会同意，更名为资产托管部，下设业务管理室、产品管理室、业务营运室、稽核监察室、基金外包业务室

5 个职能处室，现有员工 76 人。2002 年 11 月，经中国人民银行和中国证监会批准获得证券投资基金托管业务资格，成为国内第一家获得该项业务资格上市银行；2003 年 4 月，正式办理基金托管业务。招商银行作为托管业务资质最全的商业银行，拥有证券投资基金托管、受托投资管理托管、合格境外机构投资者托管（QFII）、合格境内机构投资者托管（QDII）、全国社会保障基金托管、保险资金托管、企业年金基金托管等业务资格。

招商银行确立“因势而变、先您所想”的托管理念和“财富所托、信守承诺”的托管核心价值，独创“6S 托管银行”品牌体系，以“保护您的业务、保护您的财富”为历史使命，不断创新托管系统、服务和产品：在业内率先推出“网上托管银行系统”、托管业务综合系统和“6 心”托管服务标准，首家发布私募基金绩效分析报告，开办国内首个托管银行网站，成功托管国内第一只券商集合资产管理计划、第一只 FOF、第一只信托资金计划、第一只股权私募基金、第一家实现货币市场基金赎回资金 T+1 到账、第一只境外银行 QDII 基金、第一只红利 ETF 基金、第一只“1+N”基金专户理财、第一家大小非解禁资产、第一单 TOT 保管，实现从单一托管服务商向全面投资者服务机构的转变，得到了同业认可。

招商银行资产托管业务持续稳健发展，社会影响力不断提升，四度蝉联获《财资》“中国最佳托管专业银行”。2016 年 6 月招商银行荣膺《财资》“中国最佳托管银行奖”，成为国内唯一获奖项国内托管银行；“托管通”获得国内《银行家》2016 中国金融创新“十佳金融产品创新奖”；7 月荣膺 2016 年中国资产管理【金贝奖】“最佳资产托管银行”；2017 年 6 月再度荣膺《财资》“中国最佳托管银行奖”，“全功能网上托管银行 2.0”荣获《银行家》2017 中国金融创新“十佳金融产品创新奖”；8 月荣膺国际财经权威媒体《亚洲银行家》“中国年度托管银行奖”，进一步扩大我行托管业务在国际资管和托管业界的影响力。

（二）主要人员情况

李建红先生，本行董事长、非执行董事，2014 年 7 月起担任本行董事、董事长。英国东伦敦大学工商管理硕士、吉林大学经济管理专业硕士，高级经济师。招商局集团有限公司董事长，兼任招商局国际有限公司董事会主席、招商局能源运输股份有限公司董事长、中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司董事长、招商局华建公路投资有限公司董事长和招商局资本投资有限责任公司董事长。曾任中国远洋运输（集团）总公司总裁助理、总经济师、副总裁，招商局集团有限公司董事、总裁。

田惠宇先生，本行行长、执行董事，2013年5月起担任本行行长、本行执行董事。美国哥伦比亚大学公共管理硕士学位，高级经济师。曾于2003年7月至2013年5月历任上海银行副行长、中国建设银行上海市分行副行长、深圳市分行行长、中国建设银行零售业务总监兼北京市分行行长。

王良先生，本行副行长，货币银行学硕士，高级经济师。1991年至1995年，在中国科技国际信托投资公司工作；1995年6月至2001年10月，历任招商银行北京分行展览路支行、东三环支行行长助理、副行长、行长、北京分行风险控制部总经理；2001年10月至2006年3月，历任北京分行行长助理、副行长；2006年3月至2008年6月，任北京分行党委书记、副行长（主持工作）；2008年6月至2012年6月，任北京分行行长、党委书记；2012年6月至2013年11月，任招商银行总行行长助理兼北京分行行长、党委书记；2013年11月至2014年12月，任招商银行总行行长助理；2015年1月起担任本行副行长；2016年11月起兼任本行董事会秘书。

姜然女士，招商银行资产托管部总经理，大学本科毕业，具有基金托管人高级管理人员任职资格。先后供职于中国农业银行黑龙江省分行，华商银行，中国农业银行深圳市分行，从事信贷管理、托管工作。2002年9月加盟招商银行至今，历任招商银行总行资产托管部经理、高级经理、总经理助理等职。是国内首家推出的网上托管银行的主要设计、开发者之一，具有20余年银行信贷及托管专业从业经验。在托管产品创新、服务流程优化、市场营销及客户关系管理等领域具有深入的研究和丰富的实务经验。

（三）基金托管业务经营情况

截至2017年9月30日，招商银行股份有限公司累计托管316只开放式基金。

（四）托管人的内部控制制度

1、内部控制目标

确保托管业务严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念；形成科学合理的决策机制、执行机制和监督机制，防范和化解经营风险，确保托管业务的稳健运行和托管资产的安全完整；建立有利于查错防弊、堵塞漏洞、消除隐患，保证业务稳健运行的风险控制制度，确保托管业务信息真实、准确、完整、及时；确保内控机制、体制的不断改进和各项业务制度、流程的不断完善。

2、内部控制组织结构

招商银行资产托管业务建立三级内控风险防范体系：

一级风险防范是在总行层面对风险进行预防和控制。

二级防范是总行资产托管部设立稽核监察室，负责部门内部风险预防和控制。稽核监察室在总经理室直接领导下，独立于部门内其他业务室和托管分部、分行资产托管业务主管部门，对各岗位、各业务室、各分部、各项业务中的风险控制情况实施监督，及时发现内部控制缺陷，提出整改方案，跟踪整改情况。

三级风险防范是总行资产托管部在专业岗位设置时，必须遵循内控制衡原则，监督制衡的形式和方式视业务的风险程度决定。

3、内部控制原则

(1) 全面性原则。内部控制应覆盖各项业务过程和操作环节、覆盖所有室和岗位，并由全部人员参与。

(2) 审慎性原则。内部控制的核心是有效防范各种风险，托管组织体系的构成、内部管理制度的建立都要以防范风险、审慎经营为出发点，应当体现“内控优先”的要求。

(3) 独立性原则。各室、各岗位职责应当保持相对独立，不同托管资产之间、托管资产和自有资产之间应当分离。内部控制的检查、评价部门应当独立于内部控制的建立和执行部门，稽核监察室应保持高度的独立性和权威性，负责对部门内部控制工作进行评价和检查。

(4) 有效性原则。内部控制应当具有高度的权威性，任何人不得拥有不受内部控制约束的权利，内部控制存在的问题应当能够得到及时的反馈和纠正。

(5) 适应性原则。内部控制应适应我行托管业务风险管理的需要，并能随着托管业务经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律、法规、政策制度等外部环境的改变及时进行修订和完善。内部控制应随着托管业务经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律、法规、政策制度等外部环境的改变及时进行相应的修订和完善。

(6) 防火墙原则。业务营运、稽核监察等相关室，应当在制度上和人员上适当分离，办公网和业务网分离，部门业务网和全行业务网分离，以达到风险防范的目的。

(7) 重要性原则。内部控制应当在全面控制的基础上，关注重要托管业务事项和高风险领域。

(8) 制衡性原则。内部控制应当在托管组织体系、机构设置及权责分配、业务流程等方面形成相互制约、相互监督，同时兼顾运营效率。

(9) 成本效益原则。内部控制应当权衡托管业务的实施成本与预期效益，以适当的成本实现有效控制。

4、内部控制措施

(1) 完善的制度建设。招商银行资产托管部制定了《招商银行证券投资基金托管业务管理办法》、《招商银行资产托管业务内控管理办法》、《招商银行基金托管业务操作规程》和等一系列规章制度，从资产托管业务操作流程、会计核算、岗位管理、档案管理、保密管理和信息管理等方面，保证资产托管业务科学化、制度化、规范化运作。为保障托管资产安全和托管业务正常运作，切实维护托管业务各当事人的利益，避免托管业务危机事件发生或确保危机事件发生后能够及时、准确、有效地处理，招商银行还制定了《招商银行托管业务危机事件应急处理办法》，并建立了灾难备份中心，各种业务数据能及时在灾难备份中心进行备份，确保灾难发生时，托管业务能迅速恢复和不间断运行。

(2) 经营风险控制。招商银行资产托管部托管项目审批、资金清算与会计核算双人双岗、大额资金专人跟踪、凭证管理、差错处理等一系列完整的操作规程，有效地控制业务运作过程中的风险。

(3) 业务信息风险控制。招商银行资产托管部采用加密方式传输数据。数据执行异地同步灾备，同时，每日实时对托管业务数据库进行备份，托管业务数据每日进行备份，所有的业务信息须经过严格的授权才能进行访问。

(4) 客户资料风险控制。招商银行资产托管部对业务办理过程中形成的客户资料，视同会计资料保管。客户资料不得泄露，有关人员如需调用，须经总经理室成员审批，并做好调用登记。

(5) 信息技术系统风险控制。招商银行对信息技术系统管理实行双人双岗双责、机房24小时值班并设置门禁管理、电脑密码设置及权限管理、业务网和办公网、与全行业务网双分离制度，与外部业务机构实行防火墙保护等，保证信息技术系统的安全。

(6) 人力资源控制。招商银行资产托管部通过建立良好的企业文化和员工培训、激励机制、加强人力资源管理及建立人才梯队队伍及人才储备机制，有效的进行人力资源控制。

(五) 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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关证券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、基金投融资比例、基金投资禁止行为、基金管理人参与银行间债券市场、基金管理人选择存款银行、

基金资产净值计算、基金份额净值计算、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的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人对上述事项的监督与核查中发现基金管理人的实际投资运作违反《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议、上述监督内容的约定和其他有关法律法规的规定，应及时以书面形式通知基金管理人进行整改，整改的时限应符合法规允许的投资比例调整期限。基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式向基金托管人发出回函并改正。在规定时间内，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。基金管理人未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人的投资指令违反《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律法规规定，应当拒绝执行，立即通知基金管理人限期改正，如基金管理人未能在通知期限内纠正的，基金托管人应向中国证监会报告。

基金管理人应配合和协助基金托管人依照法律法规基金合同和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。

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、相关服务机构

（一）基金份额销售机构

1、场外销售机构

（1）直销机构

1) 鹏华基金管理有限公司直销中心

办公地址：深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心 43 层

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502室

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：上海市浦东花园石桥路33号花旗大厦801B

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

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）38927990

联系人：周樱

(2) 银行销售机构

1) 东莞银行股份有限公司

注册地址：东莞市莞城区体育路21号

办公地址：东莞市莞城区体育路21号

法定代表人：卢国锋

联系人：陈幸

客户服务电话：4001196228

网址: www.dongguanbank.cn

2) 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

3) 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

(3) 证券公司销售机构

1) 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

2) 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

3) 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

4) 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

5) 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

6) 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

7) 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

8) 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

9) 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

10) 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

11) 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

12) 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

13) 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.glsc.com.cn

14) 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

15) 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

16) 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

17) 恒泰证券股份有限公司

注册地址：呼和浩特市赛罕区敕勒川大街东方君座 D 座-14F

办公地址：呼和浩特市赛罕区敕勒川大街东方君座 D 座-14F

法定代表人：庞介民

联系人：熊丽

客户服务电话：4001966188

网址：www.cnht.com.cn

18) 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

19) 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

20) 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

21) 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

22) 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.msza.com

23) 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

24) 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

25) 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

26) 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

27) 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

28) 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号新南城商务中心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

29) 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

30) 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

31) 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

32) 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：40088-95618

网址：www.e5618.com

33) 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

34) 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：95532/4006008008

网址：www.china-invs.cn

35) 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

36) 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

37) 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

38) 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

(4) 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

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

(5) 第三方销售机构

1) 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.hcjijin.com

2) 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

3) 北京新浪仓石基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2 地块新浪总部
科研楼 5 层 518 室

办公地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2 地块新浪总部
科研楼 5 层 518 室

法定代表人：李昭琛

联系人：吴翠

客户服务电话：010-62675369

网址：www.xincai.com

4) 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

5) 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

6) 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

7) 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

8) 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

9) 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

10) 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

11) 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

12) 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：400-1818-188

网址：www.1234567.com.cn

13) 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：400-166-1188

网址：8.jrj.com.cn

14) 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、 www.jjmmw.com

15) 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

16) 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销售本基金或变更上述销售机构，并及时公告。

2、场内发售机构

(1) 本基金的场内发售机构为具有基金销售业务资格的上海证券交易所会员单位（具体名单可在上海证券交易所网站查询）。

(2) 本基金募集结束前获得基金销售资格的上海证券交易所会员单位可新增为本基金的场内发售机构。

(二) 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

(三) 出具法律意见书的律师事务所

名称：上海通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

法定代表人：俞卫锋

办公室地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

联系电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：陈颖华

经办律师：吕红、黎明

(四) 审计基金资产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 507 单元 01 室

法定代表人：李丹

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：魏佳亮

经办会计师：许康玮、陈熹

四、基金的名称

本基金名称：鹏华新丝路指数分级证券投资基金

五、基金运作方式及类型

契约型开放式，股票型证券投资基金

六、基金的投资目标

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。

七、基金的投资方向

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%。

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。

八、基金的投资策略

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。

九、基金的业绩比较基准

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。

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。

十、基金的风险收益特征

本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，为证券投资基金中较高风险、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。

十一、基金的投资组合报告

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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 1 月 17 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。

本报告期自 2017 年 10 月 1 日起至 12 月 31 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	7,895,879.76	89.90
	其中：股票	7,895,879.76	89.90
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	878,834.39	10.01

8	其他资产	8,385.61	0.10
9	合计	8,783,099.76	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

(1) 报告期末指数投资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	151,210.80	1.82
B	采矿业	819,074.00	9.84
C	制造业	5,264,609.68	63.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	202,572.00	2.43
E	建筑业	85,603.40	1.03
F	批发和零售业	256,602.00	3.08
G	交通运输、仓储和邮政业	12,504.00	0.15
H	住宿和餐饮业	23,730.00	0.29
I	信息传输、软件和信息技术服务业	38,399.00	0.46
J	金融业	748,324.88	8.99
K	房地产业	95,364.00	1.15
L	租赁和商务服务业	153,280.00	1.84
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	24,612.00	0.30
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	19,994.00	0.24
S	综合	-	-
	合计	7,895,879.76	94.84

(2) 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

注：无。

(3) 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

(1) 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601012	隆基股份	13,900	506,516.00	6.08
2	002202	金风科技	24,280	457,678.00	5.50
3	600089	特变电工	36,288	359,614.08	4.32
4	600516	方大炭素	12,300	355,224.00	4.27
5	000166	申万宏源	65,860	353,668.20	4.25
6	002673	西部证券	21,699	267,331.68	3.21
7	000768	中航飞机	15,200	256,728.00	3.08
8	600893	航发动力	9,200	247,572.00	2.97
9	601225	陕西煤业	29,000	236,640.00	2.84
10	000792	盐湖股份	15,900	221,169.00	2.66

(2) 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

注：无。

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：无。

(2) 本基金投资股指期货的投资政策

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

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）

本组合投资的前十名证券之一西部证券股份有限公司

关于最近五年被证券监管部门和交易所采取监管措施或处罚的情况以及相应整改措施的公告 本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。西部证券股份有限公司（以下简称“西部证券”或“公司”）向原股东配售股份（以下简称“配股”）已经公司第四届董事会第十三次会议和2015年度股东大会审议通过，按照相关监管要求，现将公司最近五年被证券监管部门和交易所采取监管措施或处罚及相应整改情况公告如下：

一、2013年8月9日，中国证监会北京监管局下发[2013]9号行政监管措施决定书

（一）具体情况 公司于2013年8月9日收到了中国证监会北京监管局下发的[2013]9号行政监管措施决定书《关于对西部证券股份有限公司北京德胜门外大街证券营业部采取出具警示函措施的决定》。其主要内容为：“经查，我局发现你营业部存在以下违规行为：一是营业部总经理持续缺位未按规定报备。二是内部管理混乱。三是投资者适当性管理机制不健全。上述行为违反了《证券公司分支机构监管规定》（中国证监会公告〔2013〕17号）第十七条第二款等相关规定。根据《证券公司分支机构监管规定》（中国证监会公告〔2013〕17号）第二十条之规定，我局决定对你营业部采取出具警示函的行政监管措施。”

(二) 整改情况 收到警示函之后, 公司高度重视, 立即召开紧急会议, 并在公司进行了通报, 要求全公司以此为戒, 严格按照法律法规、公司章程及各项制度的规定, 加强合规经营, 充分认识信息披露的重要性。安排专项小组到营业部协助整改, 作出以下整改措施: 1、经与北京监管局机构二处充分沟通后, 免去盘金顺同志营业部总经理的职务, 并任命尹学强同志为西部证券北京德外大街证券营业部总经理, 并以书面形式向北京监管局报备, 并在北京证券业协会网站对营业部负责人进行了登记更新。2、在公司总部专项小组的帮助下, 营业部对公司现有的合规、内控及业务制度进行了全面梳理, 将营业部的制度与公司总部逐一对比, 完善了不足之处, 并修订了关于投诉回访部分的相关细则; 安排专人负责, 完成五个机构客户组织机构代码证的更新工作, 四户办理了销户手续; 联系对应的银行和客户, 补齐银行章; 营业部已加强该岗位的岗前培训和再教育, 以确保认真、及时地完成回访工作, 公司每季度要求营业部报送完整的回访记录, 以此保证监督回访工作的顺利完成; 及时制定了《信息技术关联单位联系制度》。3、在公司总部专项小组的帮助下, 营业部对公司现行的《经纪业务客户适当性管理办法》进行了整理, 对经纪业务客户适当性管理的分类原则、客户特征及行为分析、客户分类标准与适配产品及客户适当性管理要求进行了详细规定, 并规定公司客户风险等级评测工作至少两年进行一次后续评估; 修订了营业部的信访应急处理预案, 妥善解决信访及投诉问题。2013年12月, 公司北京德外大街证券营业部向中国证监会北京监管局提交了《西部证券股份有限公司北京德外大街证券营业部关于〈中国证券监督管理委员会北京监管局行政监管措施决定书〉事项的整改报告》。

二、2016年8月2日, 中国证监会湖北监管局下发[2016]9号行政监管措施决定书

(一) 具体情况 公司于2016年8月2日收到了中国证监会湖北监管局下发的[2016]9号行政监管措施决定书《关于对西部证券股份有限公司湖北分公司采取责令增加内部合规检查次数的监管措施的决定》。其主要内容为: “经查, 你分公司防范和控制风险的内部控制制度在运行中存在缺陷, 规范负责人行为的监督机制不够完善。上述行为违反了《证券公司监督管理条例》第二十七条关于“证券公司应当按照审慎经营的原则, 建立健全风险管理与内部控制制度, 防范和控制风险”的规定。按照《证券公司监督管理条例》第七十条的规定, 我局决定: 责令你公司在2016年8月1日至2017年7月31日期间, 每3个月开展一次内部合规检查, 并在每次检查后10个工作日内, 向我局报送合规检查报告。”

（二）整改情况 收到《决定》之后，公司高度重视，进行深刻的反思和总结，举一反三，组织合规总监、首席风险官以及相关部门，全面梳理风险隐患，认真研究和严格落实《决定》要求，并进一步提出以下整改措施：1、强化分公司内部控制和风险防范工作

（1）建立健全员工道德风险防范制度。2016年6月13日，公司制定并下发了《西部证券股份有限公司员工道德风险管理规定（暂行）》，从新员工选聘、入职审批管理、岗位聘用、道德和法制教育培训、试用期和绩效考核管理、监督举报渠道和信息反馈等多个方面强化内部监督管理。同时，加强和细化了员工（尤其是中层以上管理岗位和关键岗位）的道德风险监督措施。当前，由公司监察部门统筹员工道德风险防范工作，组织人力资源部、企业文化部等相关部门严格落实制度要求。（2）有序开展公司监察巡查工作。公司监察部门牵头建立公司监察巡查工作机制，运营管理总部负责组织对公司经纪业务体系分支机构的巡查工作，及时向监察部门报告巡回检查情况。当前公司业务部门已成立经验丰富的巡回检查组，进一步完善巡回检查的计划、内容及方式，每年按工作计划和目标对全国经纪业务分支机构合规运营情况（重点是分支机构负责人履职情况）开展巡回检查工作。2、完善公司各级管理人员的人事考察和管理（1）公司人力资源部加快落实了人事考察任命的风险排查工作。公司人力资源部对近三年以来的人事考察任命工作进行了风险排查，对于分支机构负责人的任命，公司按照《证券公司董事、监事和高级管理人员任职资格监管办法》等监管规定，严格审查任职资格，向监管机构履行任职资格申报或者任职后报备手续。其中，在人事考察环节将拟任人选的道德品质和诚信表现列为首要考察内容，并把廉政意见、个人信用报告、工作鉴定等列为人事考察的必备文件。（2）完善公司各级管理人员的人事考察和管理工作。公司人力资源部加强了各级管理人员甄选工作，通过背景调查、人员访谈等方式，结合廉政意见、人民银行征信系统的个人信用报告、原单位工作鉴定等书面文件，对拟任人选进行多角度的道德层面和守法情况的考察了解；针对管理人员设定任职试用期。公司合规与法律事务部在拟聘各级管理人员人事考察环节增加了针对性的法律法规及准则的学习和合规考试环节，考试结果可作为公司人事聘用决策的重要参考；实际工作中，公司还将持续加强道德风险、守法合规教育课程的开发和培训，从源头防范管理人员道德风险。目前，公司已向中国证监会湖北监管局提交了《西部证券股份有限公司湖北分公司关于被采取行政监管措施的整改报告》。公司将严格按照《决定》要求，自2016年8月1日至2017年7月31日期间，每3个月开展一次内部合规检查，并在每次检查后10个工作日内形成合规检查报告报送湖北监管局。

三、2016年8月30日，中国证监会陕西监管局下发[2016]8号行政监管措施决定书

（一）具体情况 公司于2016年8月30日收到了中国证监会陕西监管局下发的[2016]8号行政监管措施决定书《关于对西部证券股份有限公司采取出具警示函措施的决定》。其主要内容为：“经查，你公司在担任宝信国际融资租赁有限公司（以下简称“宝信租赁”）于2015年7月7日公开发行的公司债券（以下简称“15宝信债”）受托管理机构过程中，存在以下问题：2015年1月至9月，宝信租赁累计新增借款16.18亿元，超过2014年期末净资产6.11亿元的20%，但宝信租赁未按照《公司债券发行与交易管理办法》（证监会令第113号）第四十五条第（五）项规定及时对此进行信息披露。作为“15宝信债”受托管理机构，你公司未能在债券存续期内持续有效督导宝信租赁履行信息披露义务。上述行为违反了《公司债券发行与交易管理办法》第五十条第（四）项的规定。根据《公司债券发行与交易管理办法》第五十八条，我局决定对你公司采取出具警示函的监督管理措施。请你公司加强公司债券持续督导工作，完善受托管理人履职机制，杜绝此类事件再次发生。”

（二）整改情况 收到《决定》之后，公司高度重视，安排业务部门对相关项目情况进行认真核查，同时组织项目组人员认真学习《公司债券发行与交易管理办法》等相关法律、法规、部门规章，就存在的问题进行研究讨论，仔细查找和分析问题原因，认真研究和严格落实《决定》要求，并进一步提出以下整改措施：1、成立专项小组，做好问题整改和持续督导工作 公司安排由固定收益部成立专项小组，成员包括固定收益部总经理、“15宝信债”项目组负责人和经办人员、合规风控专员，具体负责“15宝信债”问题核查、整改和监督工作。专项小组通过查阅受托管理工作底稿、受托管理事务报告和其他披露的文件、访谈受托管理工作经办人员等方式对“15宝信债”项目组受托管理工作开展情况、与监管机构和发行人的沟通情况、发行人收到监管措施后的整改措施及我司履职情况等方面进行了排查。“15宝信债”项目组认真总结受托管理工作中容易忽视的环节，举一反三，持续做好“15宝信债”后期的受托管理工作；相关业务部门提高对债券受托管理工作的重视程度，领会监管机构从严监管的精神，提高与发行人沟通效率，及时做好信息披露工作并督促发行人履行信息披露义务；加强与监管机构沟通，进一步了解和学习对于公司债券发行人新增借款计算口径的最新标准和要求。公司按照《西部证券股份有限公司合规问责办法》启动合规问责程序，结合“15宝信债”受托管理工作中业务部门和人员的履职情况对相关人员进行合规问责。2、组织学习监管文件，提高业务人员专业素质 公司前期已结合监管要求和业务需要，对公司债券业务制度体系进行了完善，于2016年6月印发了《西部证券股份有限公司公司债券受托管理制度》、《西部证券股份有限公司固定收益承

销项目持续督导及重大风险事项处置预案管理办法》等多个公司债券受托管理工作相关制度。公司已要求相关业务部门和人员加强对《公司债券发行与交易管理办法》、《公司债券受托管理人执业行为准则》等监管文件和公司相关制度的学习，及时了解、掌握监管机构和公司内部对于公司债券受托管理工作的最新要求，提高业务人员的专业素质和合规意识。

3、全面加强公司债券受托管理工作管理公司要求相关业务部门加强对监管要求和公司制度的执行力度。项目组应严格按照监管要求、公司制度规定和受托管理协议的约定，勤勉尽责，做好对发行人和增信机构资信状况的持续跟踪，关注担保物及其他增信机制、偿债保障措施的变化情况。定期对公司债券募集资金的接收、存储、划转与本息兑付情况进行监督，定期检查使用情况是否与募集说明书约定相一致。持续督导发行人履行信息披露义务及重大事项报告义务，及时披露定期受托管理事务报告、临时受托管理事务报告、中国证监会及自律组织要求披露的其他文件，做好受托管理工作的记录留痕等工作。受托管理工作中需对外披露的文件，还要求上报公司投资银行业务质量控制及内部审核办公室（以下简称“质控办”）进行审核把关。公司要求相关业务部门定期向风险管理部、合规与法律事务部填报《债券运行情况表》，及时报告已发行公司债券的存续期状况。若公司债券发生兑付风险等重大情况时，应作为重大事项及时上报公司。公司将加大对公司债券受托管理工作的检查力度，合规与法律事务部、质控办等监督检查部门将不定期组织业务部门对由我司担任受托管理人的公司债券项目开展自查工作并进行现场检查。公司已向中国证监会陕西监管局提交了《西部证券股份有限公司关于被采取行政监管措施的整改报告》。公司将严格按照《决定》要求，加强公司债券持续督导工作，完善受托管理人履职机制，杜绝此类事件再次发生。对于最近五年被监管部门采取监管措施的事项，公司均按照监管要求进行了相应整改，完善了内部控制制度，落实了风险合规管理的长效机制。

除上述情况外，公司最近五年不存在被其他证券监管部门和交易所采取监管措施或处罚的情形。在未来日常经营中，公司将在证券监督管理部门、深圳证券交易所和行业自律性组织的监管和指导下，继续完善公司法人治理机制，加强规范运作，进一步健全和完善全面风险管理体系，促进公司健康持续发展。特此公告。

西部证券股份有限公司（以下简称“公司”）收到中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）行政监管措施决定书《关于对西部证券股份有限公司采取责令改正措施的决定》（[2017]6号），原文如下：“经查，我会发现你公司个别营业部利用同名微信公众号向不特定对象公开宣传推介私募资产管理产品。上述行为违反了《证券公司客户资产管理业务管理办法》第三十九条、《私募投资基金监督管理暂行办法》第十四条、

《证券公司监督管理条例》第二十七条的规定。按照《私募投资基金监督管理暂行办法》第三十三条、《证券公司监督管理条例》第七十条的规定，我会决定对你公司采取责令改正的行政监督管理措施。你公司应按照相关法律、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。我会将在日常监管中持续关注并检查你公司的整改情况。如果对本监督管理措施不服，可以在收到本决定书之日起60日内向我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。我公司将按照相关法律、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，敬请广大投资者注意投资风险。特此公告。

本组合投资的前十名证券之一申万宏源集团股份有限公司

申万宏源集团股份有限公司（以下简称“公司”或“申万宏源”）于2017年8月14日收到中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）出具的《中国证监会行政许可项目审查一次反馈意见通知书》（171135号）。根据上述通知书的要求，现将公司最近五年被证券监管部门和交易所处罚或采取监管措施的情况，以及相应的整改措施公告如下：

一、申万宏源母公司最近五年内不存在被证券监管部门和交易所处罚或采取监管措施的情况。

二、申万宏源所属子公司最近五年被证券监管部门和交易所处罚或采取监管措施以及整改情况如下：

（一）2014年11月10日，中国证监会上海监管局（以下简称“上海证监局”）向申银万国期货有限公司下发《关于对申银万国期货有限公司采取责令改正措施的决定》（沪证监决[2014]37号）

申银万国期货有限公司（以下简称“申万期货”）一名从业人员通过公司交易电脑和交易专线，私自为某经纪客户从事证券及期货交易，资产管理业务内控制度存在缺陷，存在一定风险隐患，违反了《期货公司资产管理业务试点办法》第二十九条规定，责令申万期货按照《期货公司资产管理业务试点办法》第四十八条规定，梳理资产管理业务制度及流程，健全内控制度，强化从业人员职业操守，防范利益冲突和道德风险。收到上述决定后，申万期货高度重视，严肃追究了有关人员的责任，采取了一系列措施落实监管要求，并于2014年12月4日向上海证监局提交了《申银万国期货有限公司关于资产管理业务整

改情况的报告》（申银万国期字[2014]136号）。整改措施主要包括：切实加强合规文化建设，加强合规培训，做到培训工作常态化、专业化、全覆盖，要求员工定期签署依法合规执业承诺书，建立“每月一课”学习制度，学习法规、制度和案例；切实加强制度建设，修订了《申银万国期货有限公司资产管理业务总部交易室管理细则》规范交易室日常管理及交易业务流程管理，强化IP地址、门禁权限设置管理，加装摄像头，修订客户回访制度，增加大额亏损客户跟踪回访要求；切实加强技术防范手段，确认宽带路由器启用防火墙功能、重申入网电脑设备报备要求、严禁私人电脑设备擅自接入公司网络、上线网络监测系统、上线恒生交易系统；进一步调整充实人员，对相关责任人进行处分，进一步调整并充实信息技术、资产管理、研究所、合规等重要部门重要岗位人员，为合规发展提供人力资源保障。

2015年1月5日，上海证监局出具了《关于申银万国期货有限公司整改验收情况的通知》（沪证监期货字[2015]2号），该通知指出：“我局认为你司已按照要求梳理完善了公司资产管理业务制度流程，健全了相关内控制度，强化相关技术防范手段，基本达到整改要求。我局决定解除对你司采取的监管措施。”

（二）2015年11月6日，中国证监会向申万宏源证券有限公司下发《关于对申万宏源证券有限公司采取暂停新开证券账户1个月措施的决定》（[2015]78号）

申万宏源证券有限公司（以下简称“申万宏源证券”）外部接入具有分账户功能的第三方交易终端软件，未对外部系统接入实施有效管理，对相关客户身份情况缺乏了解，在自查过程中存在向中国证监会漏报信息系统外部接入账户的情形。中国证监会责令申万宏源证券暂停新开证券账户1个月，暂停期间申万宏源证券不得新增经纪业务客户。收到上述决定后，申万宏源证券高度重视，积极落实整改工作，下发了《关于落实〈关于对申万宏源证券有限公司采取暂停新开证券账户1个月措施的决定〉的通知》，限制开户时间为2015年11月7日至2015年12月6日；并进一步完善外部信息系统接入流程，加强合规管理意识，切实做好了解客户等相关工作。

（三）2015年11月19日，中国证监会湖北监管局（以下简称“湖北证监局”）下发《关于对申万宏源证券有限公司武汉珞瑜路证券营业部采取责令增加内部合规检查次数的监管措施的决定》（[2015]18号）因申万宏源证券武汉珞瑜路证券营业部防范和控制风险的内部控制制度在运行中存在缺陷，规范员工行为的监督机制不够完善，湖北证监局决定采取增加内部合规检查次数的监管措施。

根据湖北证监局的要求，武汉珞瑜路营业部进行了认真的整改，并按季向湖北证监局上报了营业部内部合规检查的报告。营业部持续加强了内部管理，完善了内控机制，优化了绩效考核，特别是重点加强了员工执业行为监督管理、客户投诉管理、投资者权益保护等相关工作。

（四）2016年4月28日，全国中小企业股份转让系统有限责任公司向申万宏源证券下发《关于对申万宏源证券有限公司采取出具警示函自律监管措施的决定》（股转系统发[2016]123号）申万宏源证券为投资者贾某开通合格投资者权限前，未按照相关规定要求报送该投资者账户信息，全国中小企业股份转让系统有限责任公司（以下简称“股转公司”）决定对申万宏源证券采取出具警示函的自律监管措施。

收到上述决定后，申万宏源证券积极落实整改工作，已取消了该客户的股转交易权限，仔细检查相关系统漏洞，加强内部管理，规范使用交易系统临时调整的权限，杜绝今后出现类似问题。

（五）2016年5月20日，中国证监会北京监管局下发《关于对申万宏源证券有限公司北京分公司采取责令增加内部合规检查次数措施的决定》（[2016]25号）

申万宏源证券北京分公司所辖东四环中路营业部、安定路营业部存在从业人员代客操作行为，营业部在知悉员工的违法违规行为并作出处理后，未及时报告；东四环中路营业部存在回访内容不完整等情况；安定路营业部存在客户资料保存不完善的情况。中国证监会北京监管局（以下简称“北京证监局”）决定采取增加内部合规检查次数的监管措施。

根据北京证监局的要求，申万宏源证券北京分公司成立检查小组，于2016年8月、11月、2017年2月、5月对在京6家营业部开展四轮合规检查，合规检查涵盖营业部各类业务如：综合、财务、营销、双融、客服咨询、IB业务、柜台业务、非现场业务、信息技术、反洗钱，并按季向北京证监局上报了内部合规检查的报告。同时，督促辖内营业部持续加强内部管理，完善了内控机制，特别是重点加强了员工执业行为监督管理、客户回访管理、客户资料管理等相关工作。

（六）2016年7月27日，上海证监局向申万菱信（上海）资产

管理有限公司下发《关于对申万菱信（上海）资产管理有限公司采取责令改正措施的决定》（沪证监决[2016]61号）申万菱信（上海）资产管理有限公司（以下简称“申万菱信资管公司”）多个专户产品由投资顾问或劣后级委托人通过讯投系统直接下达投资指令，申万菱信资管公司未对上述产品的异常交易进行有效监控并向监管部门报告。上海证监局决定责令申万菱信资管公司进行为期3个月的整改，在整改期间将暂停办理申万菱信资管

公司特定客户资产管理计划备案。收到决定后，申万菱信资管公司积极落实整改工作，并于2016年9月1日向上海证监局提交了《关于整改工作落实情况的报告》。主要整改情况如下：一是产品增设投资经理，由投资经理负责与外部投资顾问和委托人进行沟通协调；二是新设交易部；三是加强产品交易管控，定期对交易指令/投资建议进行评估，定期对异常交易类型归纳并给予特别关注和汇报；四是加强一线风控管理。

2016年10月，上海证监局对申万菱信资管公司的整改情况进行了现场验收，验收结果为无异议，并恢复办理申万菱信资管公司特定客户资产管理计划备案。

（七）2016年8月3日，上海证监局向申万菱信基金管理有限公司下发《关于对申万菱信基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》（沪证监决[2016]66号）申万菱信基金管理有限公司（以下简称“申万菱信基金”）存在投资研究管理内控薄弱，个别基金投资运作违反基金合同关于投资比例和投资策略的约定；基金销售管理薄弱，盘后交易控制存在缺陷，存在与基金销售挂钩的不当激励行为；人员行为管理不到位，电话录音存在缺失情况，对员工使用的公司外部邮箱未进行监控，通讯工具管理弱化，邮件监控系统的查询功能弱化等问题。

收到决定后，申万菱信基金积极落实整改工作，并于2016年8月19日向上海证监局提交了《关于整改工作落实情况的报告》。主要整改情况如下：一是进一步加强投资人员管理，安排对基金经理的年度岗位培训，进一步加强投资比例风控阈值管理，完善了事中风控阈值修改的流程，进一步加强基金建仓期的投资比例管理，设置合规风控岗位执行一线合规管理工作；二是加强盘后交易内部控制，完善流程，增强直销柜台业务处理能力，直销柜台改为封闭办公环境，加装监控设备，完善销售费用预算管理，进一步严格销售费用报销流程管控，加强销售人员业务行为合规管理，设置合规风控岗位执行一线合规管理工作；三是增强对录音系统关键进程的监控，增加邮件监控模块、对外部邮箱进行监控、归档或阻断，对外地分公司的固定电话进行录音，升级邮件监控系统，大幅提高查询速度。

（八）2016年11月25日，深圳证券交易所会员管理部向申万宏源证券下发《约见谈话函》（会员部字[2016]183号）

2016年6月15日，四川三新创业投资有限责任公司（以下简称“三新创投”）通过深圳证券交易所证券交易系统以大宗交易方式买入红旗连锁股份16,880万股，占红旗连锁总股本的12.41%。三新创投在通过深圳证券交易所证券交易系统买入红旗连锁股份达到5%时，未及时向深圳证券交易所提交书面报告并披露权益变动报告书，未在履行报告和披

露义务前停止买入红旗连锁股份。深圳证券交易所于6月22日、10月14日分别对三新创投采取限制交易的监管措施和公开谴责的纪律处分。三新创投系申万宏源证券成都火车南站东路营业部客户，其以《大宗交易委托单》书面授权方式，委托申万宏源证券于2016年6月15日通过深圳证券交易所大宗交易系统一次性买入红旗连锁股份16,880万股。申万宏源证券机构事业部据此进行了申报并成交。申万宏源证券对客户的违法违规交易行为未进行规范和约束，存在客户交易行为管理履职不到位的问题，违反了《会员管理规则》第4.1条的规定，决定采取约见谈话的监管措施。

收到《约见谈话函》后，申万宏源证券对大宗交易相关管理制度重新进行了梳理，进一步明确了内部审核流程，并向深圳证券交易所、上海证监局提交了《关于大宗交易业务管理及整改情况说明》。申万宏源证券吸取教训、提高认识，提升业务人员水平；完善制度、加强管理，向各分支机构下发了《关于进一步明确大宗交易申报有关要求的通知》，业务主管部门内部进一步明确了大宗交易的执行流程；持续培训、建立长效机制，深入理解掌握大宗交易业务的法律法规、规章制度，落实各项监管要求，提升业务人员专业素质，防范客户违法、违规交易风险。

(九) 2017年1月10日，上海证监局向申万宏源证券下发《关于对申万宏源证券有限公司采取出具警示函措施的决定》(沪证监决[2017]6号)作为资产支持专项计划管理人，申万宏源证券个别尽职调查报告存在调查分析前后不一、报告结论缺乏充分证据支撑等情形，未能全面反映重要债务人偿付能力和资信水平，不符合《证券公司及基金管理公司子公司资产证券化业务管理规定》十三条等相关规定，上海证监局决定对申万宏源证券予以警示。

收到决定后，申万宏源证券积极落实整改工作，向上海证监局提交了《关于对〈关于对申万宏源证券有限公司采取出具警示函措施的决定〉整改落实情况的报告》。主要整改情况如下：对资产证券化业务进行了全面自查，全面梳理存续资产证券化项目以及正在推进的项目，对自查发现的情况及时进行整改；进一步加强资产证券化业务的管控，加强学习，提高业务能力，强化尽职调查工作管理，加强文件审核，提高信息披露工作水平。

(十) 2017年1月14日，中国证监会向申万宏源证券下发《关于对申万宏源证券有限公司采取责令改正、出具警示函措施的决定》([2017]5号)

申万宏源证券及个别营业部分别利用官方网站、同名微信公众号向不特定对象公开宣传推介私募资产管理产品，对从业人员买卖股票交易行为的内部管控存在漏洞，中国证监会决定对申万宏源证券采取责令改正、出具警示函的行政监督管理措施。

收到决定后，申万宏源证券积极落实整改工作，立即删除了网站、微信公众号上相关私募产品的宣传推介信息，改造了公司网站，避免私募资产管理产品向不特定对象推介的情况；完善信息披露的管控机制，进一步做好信息披露的管理工作；逐一检查全部分支机构微信公众号的内容，加强对分支机构微信公众号的事前、事中及事后的管理，确保分支机构微信公众号发布内容的规范合规；进一步加强对员工执业行为的管控力度，明确工作职责，进一步加强日常监测的核查力度，强化问责和处罚机制，进一步规范员工的执业行为。

（十一）2017年6月28日，股转公司向申万宏源证券下发《关于对申万宏源证券有限公司采取自律监管措施的决定》（股转系统发[2017]308号）上海誉德动力技术集团股份有限公司（以下简称“誉德股份”）提交的《2013-2014年度财务报表审计报告》为北京兴华会计师事务所上海分所的签章，分所不具有证券期货相关业务资格。申万宏源证券作为誉德股份推荐挂牌的主办券商，未审慎关注誉德股份审计报告出具主体的资质瑕疵问题，未勤勉尽责履行核查义务。股转公司决定采取出具警示函的自律监管措施。

收到决定后，申万宏源证券积极落实整改工作，主要整改情况如下：及时要求誉德股份整改，获取了由北京兴华会计师事务所出具的

正确报告，并已在股转公司指定信息披露平台上披露。同时，进一步加强与其他中介机构的业务协作，合理安排项目时间和进度，确保有充分时间完成复核工作。

（十二）2017年6月30日，中国证监会向申万宏源证券承销保荐有限责任公司下发《关于对申万宏源证券承销保荐有限责任公司采取出具警示函措施的决定》（[2017]57号）申万宏源证券承销保荐有限责任公司（以下简称“承销保荐公司”）在保荐千乘影视股份有限公司首次公开发行股票并上市项目过程中，对发行人的销售收入、应收账款和重大合同核查不充分。上述行为违反了《保荐人尽职调查工作准则》的相关规定和《证券发行上市保荐业务管理办法》第四条、第二十四条的规定，中国证监会决定采取出具警示函的监管措施。

收到决定后，承销保荐公司积极落实整改工作，主要整改情况如下：进一步强化员工对工作底稿收集、编制的重视程度，督促业务部门在执业过程中加强对工作底稿留存文件的规范管理；通过发布有关业务提示、组织员工参加内外部培训等多种方式，传递动态发展的监管审核要求，提升项目承做人员的执业质量；按规定对项目组相关人员进行相关问责处理。

(十三) 2017年7月1日,上海证监局向申万期货下发《关于对申银万国期货有限公司采取责令改正措施的决定》(沪证监决[2017]53号)2016年3月申万期货在对客户i1605合约进行强行平仓过程中,未能及时有效地控制风险,致使客户出现穿仓。根据《期货交易管理条例》第五十五条第一款的规定,上海证监局决定采取责令改正的监管措施。

收到决定后,申万期货积极落实整改工作,切实举一反三,加强细节管理。主要整改情况如下:尽快从制度完善、流程优化、人员配置、技术支持等方面拟定整改措施,并按照监管要求在规定时间内完成整改。

(十四) 2017年7月7日,上海证监局下发《关于对申万宏源证券有限公司上海奉贤区人民中路证券营业部采取责令改正监管措施的决定》(沪证监决[2017]58号)根据申万宏源证券上海奉贤区人民中路证券营业部公示的自2011年11月1日起执行的佣金方案,客户通过非现场方式(含电话、网上和手机)进行交易的佣金费率区间为万分之二点零一至千分之一点八,而营业部对部分客户通过手机委托交易分级基金等品种所收取的佣金费率为千分之三,超出所公示佣金方案的最高上限,上海证监局决定采取责令改正的监管措施。

收到决定后,申万宏源证券上海奉贤区人民中路营业部积极落实整改工作,主要整改情况如下:根据申万宏源证券最新佣金收取方案指导文件,将营业部佣金方案重新向同业公会进行报备并在营业场所公示。同时,进一步完善佣金设置模式,加强与客户之间沟通,妥善处理客户投诉纠纷事宜。

除上述情况外,公司不存在其他被证券监管部门和交易所处罚或采取监管措施的情形。公司将在证券监管部门和交易所的监督和指导下,不断健全和完善公司内部控制机制,提升公司规范运作水平。

本基金投资的前十名证券中的其它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。

本基金为指数基金,为更好地跟踪标的指数和控制跟踪误差,按照成份股权重进行配置该证券,符合指数基金的管理规定。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。

(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	1,771.35
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	192.21
5	应收申购款	6,422.05
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,385.61

(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

(6) 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

(7) 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

(8) 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招募说明书。

基金合同生效以来的投资业绩及其与同期基准的比较如下表所示：

	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
2015年08月13日（基 金合同生效日）至 2015年12月31日	13.30%	1.50%	-7.93%	2.90%	21.23%	-1.40%
2016年1月1日至	-21.01%	1.85%	-16.27%	1.82%	-4.74%	0.03%

2016年12月31日						
2017年1月1日至 2017年12月31日	-6.78%	1.00%	-1.84%	1.00%	-4.94%	0.00%
自基金合同生效日至 2017年12月31日	-16.56%	1.49%	-24.32%	1.77%	7.76%	-0.28%

十三、基金的费用与税收

(一) 基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金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。

(二) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.00%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，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付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.22% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.22\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，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。

3、标的指数许可使用费

本基金的标的指数许可使用费按前一日基金资产净值的 0.02% 的年费率计提。标的指数许可使用费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的标的指数许可使用费

E 为前一日的基金资产净值

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

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

上述“一、基金费用的种类中第 4—11 项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

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。

（三）与基金销售有关的费用

1、基金份额的场外申购与赎回

（1）申购费用

本基金的场外申购费率随投资者申购金额的增加而减少。投资者可以多次申购本基金，申购费率按每笔申购申请单独计算。

本基金场外申购费率如下表：

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

申购费用由投资者承担，在申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

(2) 赎回费用

本基金的场外赎回费率随投资者持有基金份额期限的增加而减少。

本基金场外赎回费率如下表（1 年为 365 日）：

持有年限 Y	赎回费率
Y < 1 年	0.50%
1 年 ≤ Y < 2 年	0.25%
Y ≥ 2 年	0.00%

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。其中赎回费总额的 25% 应归基金财产，其余用于支付市场推广、注册登记费和其他必要的手续费。

(3) 基金管理人可以根据基金合同的相关约定调整费率或收费方式，基金管理人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公告。

(4) 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，针对投资者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。

2、基金份额的场内申购与赎回

(1) 申购费用

本基金的场内申购费率自 2015 年 9 月 21 日起进行调整，调整后费率如下表。投资者可以多次申购本基金，申购费率按每笔申购申请单独计算。

基金场内申购费率：

申购金额 M (元)	申购费率
------------	------

M<500 万	0
M≥500 万	按笔收取，每笔 100 元

申购费用由投资者承担，在申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

(2) 赎回费用

本基金的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。

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。其中赎回费总额的 25% 应归基金财产，其余用于支付市场推广、注册登记费和其他必要的手续费。

(3) 基金管理人可以根据基金合同的相关约定调整费率或收费方式，基金管理人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公告。

(4) 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，针对投资者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。

(四) 不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、基金合同生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

(五) 基金税收

本基金运作过程中涉及各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

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

十四、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的规定，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对本基金管理人原公告的本基金招募说明书进行了更新，主要更新的内容如下：

- 1、在“重要提示”部分明确了更新招募说明书内容的截止日期和有关财务数据的截止日期。
- 2、在“第三部分 基金管理人”部分内容进行了更新。
- 3、在“第四部分 基金托管人”部分内容进行了更新。
- 4、在“第五部分 相关服务机构”部分内容进行了更新。
- 5、在“第十部分 基金份额的申购与赎回”部分内容进行了更新。
- 6、在“第十三部分 基金投资”部分内容进行了更新。
- 7、在“第十四部分 基金业绩”部分内容进行了更新。
- 8、在“第二十六部分 对基金份额持有人的服务”部分内容进行了更新。
- 9、在“第二十七部分 其他披露事项”部分内容进行了更新。

鹏华基金管理有限公司

2018年3月