

鹏华中证新能源指数分级  
证券投资基金  
更新的招募说明书

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

2018年7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《关于核准鹏华中证新能源指数分级证券投资基金募集的批复》（证监许可〔2015〕768 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 5 月 29 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，鹏华新能源 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；鹏华新能源 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 5 月 28 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2018 年 3 月 31 日（未经审计）。

# 目 录

- [一、绪 言](#)
- [二、释 义](#)
- [三、基金管理人](#)
- [四、基金托管人](#)
- [五、相关服务机构](#)
- [六、基金份额的分级](#)
- [七、基金份额的净值计算](#)
- [八、基金的募集与基金合同的生效](#)
- [九、基金份额的上市与交易](#)
- [十、基金份额的申购与赎回](#)
- [十一、基金的非交易过户、转托管、冻结与解冻、转让](#)
- [十二、基金份额的配对转换](#)
- [十三、基金的投资](#)
- [十四、基金的业绩](#)
- [十五、基金的财产](#)
- [十六、基金资产的估值](#)
- [十七、基金的收益分配](#)
- [十八、基金份额的折算](#)
- [十九、基金的费用与税收](#)
- [二十、基金的会计与审计](#)
- [二十一、基金的信息披露](#)
- [二十二、风险揭示](#)
- [二十三、基金的终止与清算](#)
- [二十四、基金合同的内容摘要](#)
- [二十五、基金托管协议的内容摘要](#)
- [二十六、对基金份额持有人的服务](#)
- [二十七、其他应披露事项](#)
- [二十八、招募说明书的存放及查阅方式](#)
- [二十九、备查文件](#)

## 一、绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性规定》”）等有关法律法规的规定，以及《鹏华中证新能源指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）的约定编写。

本招募说明书阐述了鹏华中证新能源指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”或“基金”）的投资目标、策略、风险、费率等与投资人投资决策有关的必要事项，投资人在做出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

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

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

## 二、释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 1、基金或本基金：指鹏华中证新能源指数分级证券投资基金
- 2、基金管理人：指鹏华基金管理有限公司
- 3、基金托管人：指招商银行股份有限公司
- 4、基金合同：指《鹏华中证新能源指数分级证券投资基金基金合同》及对该基金合同的任何有效修订和补充
- 5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《鹏华中证新能源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

6、招募说明书或本招募说明书：指《鹏华中证新能源指数分级证券投资基金招募说明书》及其定期的更新

7、基金份额发售公告：指《鹏华中证新能源指数分级证券投资基金基金份额发售公告》

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

9、《基金法》：指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，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

10、《销售办法》：指中国证监会2013年3月15日颁布、同年6月1日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

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

12、《运作办法》：指中国证监会2014年7月7日颁布、同年8月8日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

13、《流动性规定》：指中国证监会2017年8月31日颁布、同年10月1日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订

14、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

15、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会

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

17、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

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

19、合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理办法》及相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者

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

21、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，可区分为鹏华新能源份额持有人、鹏华新能源 A 份额持有人及鹏华新能源 B 份额持有人

22、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，发售基金份额，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

23、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，以及可通过深圳证券交易所交易系统办理基金销售业务的会员单位

24、场外：指通过深圳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

25、场内：指通过具有相应业务资格的深圳证券交易所会员单位利用深圳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

26、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/深圳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

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

28、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

29、证券登记系统：指中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记系统，登记在该系统的基金份额也称为场内份额

30、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

31、深圳证券账户：指投资人在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开设的深圳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

32、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

33、标的指数：指中证新能源指数

34、基金份额：指鹏华新能源份额、鹏华新能源 A 份额和/或鹏华新能源 B 份额

35、鹏华新能源份额：指鹏华中证新能源指数分级证券投资基金之基础份额

36、鹏华新能源 A 份额：指鹏华中证新能源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

37、鹏华新能源 B 份额：指鹏华中证新能源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

38、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

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

40、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

41、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

42、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

43、T 日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日

44、T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日(不包含 T 日)

45、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

46、开放时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

47、认购：指在基金募集期内，投资人申请购买基金份额的行为

48、上市交易：指基金投资者通过深圳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

49、申购：指基金合同生效后，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

50、赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为

51、巨额赎回：指本基金单个开放日，鹏华新能源份额净赎回申请（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(包括鹏华新能源份额、鹏华新能源 A 份额、鹏华新能源 B 份额)的 10%

52、配对转换:指鹏华新能源份额与鹏华新能源 A 份额、鹏华新能源 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

53、分拆:指基金份额持有人将其持有的场内鹏华新能源份额按照 2 份场内鹏华新能源份额对应 1 份鹏华新能源 A 份额与 1 份鹏华新能源 B 份额的比例进行转换的行为

54、合并:指基金份额持有人将其持有的鹏华新能源 A 份额与鹏华新能源 B 份额按照 1 份鹏华新能源 A 份额与 1 份鹏华新能源 B 份额对应 2 份场内鹏华新能源份额的比例进行转换的行为

55、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能源份额净值、鹏华新能源 A 份额参考净值和/或鹏华新能源 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

56、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的行为

57、不定期折算:指当鹏华新能源份额净值、鹏华新能源 A 份额参考净值和/或鹏华新能源 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

58、基金转换:指基金份额持有人按照基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件,申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金基金份额的行为

59、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

60、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)之间或证券登记系统内不同会员单位(交易单元)之间进行转托管的行为

61、跨系统转托管:指投资者将持有的鹏华新能源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

62、定期定额投资计划:指投资人通过有关销售机构提出申请,约定每期申购日、扣款金额及扣款方式,由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式

63、元:指人民币元

64、流动性受限资产:指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产,包括但不限于到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款(含

协议约定有条件提前支取的银行存款)、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等

65、摆动定价机制：指当开放式基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待

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

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

68、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

69、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，可区分为鹏华新能源份额净值、鹏华新能源 A 份额净值、鹏华新能源 B 份额净值

70、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，可区分为鹏华新能源 A 份额参考净值、鹏华新能源 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

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

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

73、不可抗力：指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

## 三、基金管理人

### (一) 基金管理人概况

- 1、名称：鹏华基金管理有限公司
- 2、住所：深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心 43 层
- 3、成立日期：1998 年 12 月 22 日
- 4、法定代表人：何如
- 5、办公地址：深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心 43 层
- 6、电话：(0755) 82021233 传真：(0755) 82021155

7、联系人：吕奇志

8、注册资本：人民币 1.5 亿元

9、股权结构：

出资人名称	出资额（万元）	出资比例
国信证券股份有限公司	7,500	50%
意大利欧利盛资本资产管理股份公司 (Eurizon Capital SGR S.p.A.)	7,350	49%
深圳市北融信投资发展有限公司	150	1%
总计	15,000	100%

## （二）主要人员情况

### 1、基金管理人董事会成员

何如先生，董事长，硕士，高级会计师，国籍：中国。历任中国电子器件公司深圳公司副总会计师兼财务处处长、总会计师、常务副总经理、总经理、党委书记，深圳发展银行行长助理、副行长、党委委员、副董事长、行长、党委副书记，现任国信证券股份有限公司董事长、党委书记，鹏华基金管理有限公司董事长。

邓召明先生，董事，经济学博士，讲师，国籍：中国。历任北京理工大学管理与经济学院讲师、中国兵器工业总公司主任科员、中国证监会处长、南方基金管理有限公司副总经理、中国证监会第六、七届发审委委员，现任鹏华基金管理有限公司总裁、党总支书记。

孙煜扬先生，董事，经济学博士，国籍：中国。历任贵州省政府经济体制改革委员会主任科员、中共深圳市委政策研究室副处长、深圳证券结算公司常务副总经理、深圳证券交易所首任行政总监、香港深业（集团）有限公司助理总经理、香港深业控股有限公司副总经理、中国高新技术产业投资管理有限公司董事长兼行政总裁、鹏华基金管理有限公司董事总裁，国信证券股份有限公司副总裁，国信证券股份有限公司公司顾问。

Massimo Mazzini 先生，董事，经济和商学学士。国籍：意大利。曾在安达信（Arthur Andersen MBA）从事风险管理和资产管理工作，历任 CA AIPG SGR 投资总监、CAAM AI SGR 及 CA AIPG SGR 首席执行官和投资总监、东方汇理资产管理股份有限公司（CAAM SGR）投资副总监、农业信贷另类投资集团（Credit Agricole Alternative Investments Group）国际执行委员会委员、意大利欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）

投资方案部投资总监、Epsilon 资产管理股份公司（Epsilon SGR）首席执行官，欧利盛资本股份公司（Eurizon Capital S.A.）（卢森堡）首席执行官和总经理。现任意大利欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）市场及业务发展总监。

Andrea Vismara 先生，董事，法学学士，律师，国籍：意大利。曾在意大利多家律师事务所担任律师，先后在法国农业信贷集团（Credit Agricole Group）东方汇理资产管理股份有限公司（CAAM SGR）法务部、产品开发部，欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）治理与股权部工作，现在担任意大利欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）董事会秘书兼任企业事务部总经理，欧利盛资本股份公司（Eurizon Capital S.A.）（卢森堡）企业服务部总经理。

周中国先生，董事，会计学硕士，高级会计师，注册会计师，国籍：中国。历任深圳华为技术有限公司定价中心经理助理、国信证券股份有限公司资金财务总部业务经理、深圳金地证券服务部财务经理、资金财务总部高级经理、总经理助理、副总经理、人力资源总部副总经理等职务。现任国信证券股份有限公司财务负责人、资金财务总部总经理兼人力资源总部总经理。

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、资金财务部副总经理等，现任国信证券资金财务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。

刘崧先生，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，现任鹏华基金管理有限公司总裁助理、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。

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基金基金经理，2015年09月担任鹏华上证民企50ETF联接基金基金经理，2016年06月至2018年05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月担任鹏华一带一路分级基金基金经理，2016年11月担任鹏华新能源分级基金基金经理，2018年04月担任鹏华互联网分级基金基金经理，2018年04月担任鹏华创业板分级基金基金经理，2018年05月担任鹏华沪深300指数增强基金基金经理。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基金基金经理

2015年09月担任鹏华上证民企50ETF联接基金基金经理

2016年06月至2018年05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月担任鹏华一带一路分级基金基金经理

2018年04月担任鹏华互联网分级基金基金经理

2018年04月担任鹏华创业板分级基金基金经理

2018年05月担任鹏华沪深300指数增强基金基金经理

本基金历任的基金经理：

2015年05月至2016年12月 焦文龙先生

---

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

### (三) 基金管理人的职责

- 1、依法募集资金，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募集、申购、赎回和登记事宜；
- 2、办理基金备案手续；
- 3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；
- 4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；
- 5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- 6、编制季度、半年度和年度基金报告；
- 7、计算并公告基金资产净值，确定鹏华新能源份额申购、赎回价格；
- 8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；
- 9、按照规定召集基金份额持有人大会；
- 10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- 11、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- 12、中国证监会规定的其他职责。

#### **（四）基金管理人的承诺**

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

2、基金管理人的禁止行为：

- （1）将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
- （2）不公平地对待公司管理的不同基金财产；
- （3）利用基金财产或者职务之便为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
- （4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- （5）侵占、挪用基金财产；
- （6）泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- （7）玩忽职守，不按照规定履行职责；
- （8）法律、行政法规以及中国证监会禁止的其他行为。

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



- (1) 越权或违规经营；
- (2) 违反法律法规、基金合同或托管协议；
- (3) 故意损害基金份额持有人或基金合同其他当事人的合法权益；
- (4) 在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；
- (5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- (6) 玩忽职守、滥用职权，不按照规定履行职责；
- (7) 泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- (8) 除按本基金管理人制度进行基金运作投资外，直接或间接进行其他股票投资；
- (9) 协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易；
- (10) 违反证券交易所业务规则，利用对敲、倒仓等非法手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；
- (11) 贬损同行，以提高自己；
- (12) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成份；
- (13) 以不正当手段谋求业务发展；
- (14) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
- (15) 其他法律、行政法规禁止的行为。

#### 4、基金经理承诺

- (1) 依照有关法律法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；
- (2) 不得利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者牟取利益；
- (3) 不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- (4) 不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

#### **(五) 基金管理人的内部控制制度**

##### 1、内部控制的原则

基金管理人的内部控制遵循以下原则：

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

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

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

(4) 相互制约原则：公司内部部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡；

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

## 2、制订内部控制制度应当遵循以下原则：

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

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

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

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

## 3、内部控制体系

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

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

(3) 公司经营管理层、督察长、监察稽核部、公司各部门总经理定期召开会议对各类风险予以充分的评估和防范，对业务过程中潜在和存在的风险进行通报、讨论，并及时采取防范和控制措施。

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

(5) 业务部门：对本部门业务范围内的业务风险负有管控和及时报告的义务。

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

#### 4、内部控制措施

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

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

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

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

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

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

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

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

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

(10) 不断强化投资纪律，严格实施股票库制度：公司不断强化投资纪律，加强集体决策机制，各基金的行业配置比例、基金经理个股授权、基准仓位等由投资决策委员会决

定。同时，公司建立了严格的股票库制度、禁止和限制投资股票制度，并由研究小组负责维护，所有股票投资必须完全从股票库中选择。公司还建立了契约风险评估制度，定期对各基金遵守基金合同的情况进行评估，防范契约风险。

#### 5、基金管理人关于内部合规控制书的声明

(1) 基金管理人确知建立、实施和维持内部控制制度是基金管理人董事会及管理层的责任；

(2) 本基金管理人承诺以上关于内部控制的披露真实、准确；

(3) 本基金管理人承诺根据市场变化和公司发展不断完善内部控制体系和内部控制制度。

## 四、基金托管人

### (一) 基金托管人概况

#### 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2018年3月31日，本集团总资产62,522.38亿元人民币，高级法下资本充足率15.51%，权重法下资本充足率12.79%。

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81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”，2018年1月获得中央国债登记结算有限责任公司“2017年度优秀资产托管机构”奖项，同月招商银行“托管大数据平台风险管理系统”荣获2016-2017年度银监会系统“金点子”方案一等奖，以及中央金融团工委、全国金融青联第五届“双提升”金点子方案二等奖；3月招商银行荣获公募基金20年“最佳基金托管银行”奖。

## （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2018年3月31日，招商银行股份有限公司累计托管364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制度，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：

一级风险防范是在招商银行总行层面对风险进行预防和控制；

二级风险防范是招商银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；

三级风险防范是招商银行资产托管部在设置专业岗位时，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。内部控制覆盖各项业务过程和操作环节、覆盖所有室和岗位，并由全体人员参与。

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

（3）独立性原则。招商银行资产托管部各室、各岗位职责保持相对独立，不同托管资产之间、托管资产和自有资产之间相互分离。内部控制的检查、评价部门独立于内部控制的建立和执行部门。

（4）有效性原则。内部控制具有高度的权威性，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能够得到及时的反馈和纠正。

（5）适应性原则。内部控制适应招商银行托管业务风险管理的需要，并能够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。

（6）防火墙原则。招商银行资产托管部配备独立的托管业务技术系统，包括网络系统、应用系统、安全防护系统、数据备份系统。

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

（8）制衡性原则。内部控制能够实现在托管组织体系、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。

#### 4、内部控制措施

(1) 完善的制度建设。招商银行资产托管部从资产托管业务操作流程、会计核算、资金清算、岗位管理、档案管理和信息管理等方面制定一系列规章制度，保证资产托管业务科学化、制度化、规范化运作。

(2) 经营风险控制。招商银行资产托管部制定托管项目审批、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在数据传输和保存方面有严格的加密和备份措施，采用加密、直连方式传输数据，数据执行异地实时备份，所有的业务信息须经过严格的授权方能进行访问。

(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、托管业务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，对信息技术系统采取两地三中心的应急备份管理措施等，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级队伍及人才储备机制，有效的进行人力资源管理。

#### (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》等有关法律法规的规定及基金合同、托管协议的约定，对基金投资范围、投资比例、投资组合等情况的合法性、合规性进行监督和核查。

在为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，基金托管人对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与支付情况进行检查监督，对违反法律法规、基金合同的指令拒绝执行，并立即通知基金管理人。

基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定，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律法规及基金合同允许的调整期限。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。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

## 五、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 3305 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) 东莞农村商业银行股份有限公司

注册地址：广东省东莞市城区南城路2号

办公地址：广东省东莞市城区南城路2号

法定代表人：王耀球

联系人：杨亢

客户服务电话：961122

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

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](http://www.jnbank.com.cn)

3) 交通银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路188号

办公地址：上海市浦东新区银城中路188号

法定代表人：彭纯

联系人：王菁

客户服务电话：95559

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

4) 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

5) 中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：田国立

联系人：王未雨

客户服务电话：95533

网址：www.ccb.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：95517

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：天津市南开区滨水西道 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](http://www.firstcapital.com.cn)

7) 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](http://www.foundersc.com)

8) 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](http://www.ebscn.com)

9) 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

10) 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.gjq.com.cn

11) 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

12) 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

13) 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

14) 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

15) 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

16) 华安证券股份有限公司

注册地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

办公地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

法定代表人：李工

联系人：范超

客户服务电话：95318

---

---

网址：www.hazq.com

17) 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

18) 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

19) 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

20) 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

21) 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

22) 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

23) 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

---

---

24) 天风证券股份有限公司

注册地址：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦4楼

办公地址：湖北省武汉市武昌区中南路99号保利广场A座37楼

法定代表人：余磊

联系人：夏旻

客户服务电话：95391/4008005000

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

25) 西部证券股份有限公司

注册地址：西安市新城东大街232号陕西信托大厦

办公地址：西安市新城东大街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](http://www.westsecu.com)

26) 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：[www.swsc.com.cn](http://www.swsc.com.cn)

27) 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

28) 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

29) 兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路268号

办公地址：上海市浦东新区长柳路36号兴业证券大厦

法定代表人：兰荣

联系人：乔琳雪

客户服务电话：95562

网址：www.xyzq.com.cn

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) 北京蛋卷基金销售有限公司

---

---

注册地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507

办公地址：北京市朝阳区望京 SOHO T3 A 座 19 层

法定代表人：钟斐斐

联系人：戚晓强

客户服务电话：4000-618-518

网址：danjuanapp.com

2) 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.hcjjin.com

3) 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

4) 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

5) 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

6) 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

7) 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

---



---

8) 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

办公地址：上海市杨浦区秦皇岛路 32 号 c 栋

法定代表人：汪静波

联系人：朱了

客户服务电话：400-821-5399

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

9) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区东方路 1267 号 11 层

法定代表人：张跃伟

联系人：张佳琳

客户服务电话：400-089-1289

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

10) 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.howbuy.com](http://www.howbuy.com)

11) 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

12) 上海基煜基金销售有限公司

注册地址：上海市崇明县长兴镇潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室（上海泰和经济发展区）

办公地址：上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1503 室

法定代表人：王翔

联系人：吴鸿飞

客户服务电话：400-820-5369

网址：www.jiyufund.com.cn

13) 上海陆金所资产管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法定代表人：郭坚

联系人：陈铭洲

客户服务电话：400-821-9031

网址：www.lu.com

14) 上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

办公地址：上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 10 楼

法定代表人：其实

联系人：高莉莉

客户服务电话：400-1818-188

网址：www.1234567.com.cn

---

---

15) 上海万得基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

办公地址：上海市浦东新区浦明路 1500 号万得大厦 11 楼

法定代表人：王廷富

联系人：徐亚丹

客户服务电话：400-821-0203

网址：[www.520fund.com.cn](http://www.520fund.com.cn)

16) 深圳众禄基金销售股份有限公司

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：深圳市罗湖区笋岗街道梨园路物资控股置地大厦 8 楼 801

法定代表人：薛峰

联系人：邓爱萍

客户服务电话：4006-788-887

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

17) 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](http://www.5ifund.com)

18) 中欧钱滚滚基金销售（上海）有限公司

注册地址：上海自由贸易试验区陆家嘴环路 333 号 729S 室

办公地址：上海市浦东新区商城路 618 号良友大厦 B301-305

法定代表人：许欣

---

---

联系人：屠帅颖

客户服务电话：400-700-9700

网址：www.qiangungun.com

19) 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深圳证券交易所会员单位（具体名单可在深圳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深圳证券交易所会员单位可新增为本基金的场内发售机构。

### (二) 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：黎明、孙睿

#### **（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

## **六、基金份额的分级**

### **（一）基金份额结构**

本基金的基金份额包括鹏华新能源份额、鹏华新能源 A 份额、鹏华新能源 B 份额。根据对基金财产及收益分配的不同安排，本基金的基金份额具有不同的风险收益特征。

鹏华新能源 A 份额与鹏华新能源 B 份额的配比始终保持 1：1 的比率不变。

### **（二）基金份额分级规则**

#### **1、基金份额的发售**

本基金通过场外和场内两种方式公开发售。基金份额发售结束后，场外认购的全部份额将确认为鹏华新能源份额；场内认购的份额将按照 1：1 的比例确认为鹏华新能源 A 份额与鹏华新能源 B 份额。

#### **2、基金份额的申购赎回**

基金合同生效后，鹏华新能源份额接受场外、场内申购和赎回，待条件允许后上市交易；鹏华新能源 A 份额与鹏华新能源 B 份额不接受单独申购、赎回，只能进行上市交易。

#### **3、基金份额的配对转换**

基金合同生效后，场内鹏华新能源份额与鹏华新能源 A 份额、鹏华新能源 B 份额之间可以按约定的规则进行场内份额配对转换，包括基金份额的分拆和合并两种转换行为。

基金份额的分拆，指基金份额持有人将其持有的场内鹏华新能源份额按照 2 份场内鹏华新能源份额对应 1 份鹏华新能源 A 份额与 1 份鹏华新能源 B 份额的比例进行转换的行为；基金份额的合并，指基金份额持有人将其持有的鹏华新能源 A 份额与鹏华新能源 B 份额按照 1 份鹏华新能源 A 份额与 1 份鹏华新能源 B 份额对应 2 份场内鹏华新能源份额的比例进行转换的行为。

场内份额的配对转换遵循深圳证券交易所、基金登记机构的最新业务规则。场外份额通过跨系统转托管至场内后，方可按照上述规则进行基金份额配对转换。

## 七、基金份额的净值计算

### （一）基金份额的净值计算规则

根据对基金财产和收益分配的不同安排，鹏华新能源份额、鹏华新能源 A 份额、鹏华新能源 B 份额具有不同的风险收益特性，体现为不同的净值计算规则。

1、鹏华新能源份额的基金份额净值为净值计算日的基金资产净值除以基金份额总数，其中基金份额总数为鹏华新能源份额、鹏华新能源 A 份额、鹏华新能源 B 份额的份额数之和。

2、鹏华新能源 A 份额的基金份额净值为鹏华新能源 A 份额的本金及约定应得收益之和。鹏华新能源 A 份额的约定应得收益依据鹏华新能源 A 份额的约定年基准收益率和截至净值计算日鹏华新能源 A 份额应计收益的天数占当年实际天数的比例确定。

基金合同生效日后，鹏华新能源 A 份额的约定年基准收益率为“基金合同生效日中国人民银行公布的金融机构人民币一年期存款基准利率（税后）+3%”。第一次份额折算基准日后，鹏华新能源 A 份额的约定年基准收益率为“同期银行人民币一年期定期存款利率（税后）+3%”，同期银行人民币一年期定期存款利率以最近一次份额折算基准日次日中国人民银行公布的金融机构人民币一年期存款基准利率为准。约定年基准收益均以 1.00 元为基准进行计算。

鹏华新能源 A 的份额净值在净值计算日应计收益的天数按基金合同生效日至净值计算日或自最近一次基金份额折算日（定期折算日或不定期折算日）次日至净值计算日的实际天数累加计算。

3、每 2 份鹏华新能源份额所对应的基金资产净值等于 1 份鹏华新能源 A 份额与 1 份鹏华新能源 B 份额所对应的基金资产净值之和。

基金管理人并不承诺或保证鹏华新能源 A 份额持有人的本金及约定应得收益，如在某一会计年度内本基金资产出现损失情况下，鹏华新能源 A 份额持有人可能会面临无法取得约定应得收益甚至损失本金的风险。

## （二）基金份额净值的计算

基金管理人按照基金份额的净值计算规则依据以下公式在各自的基金份额净值计算日分别计算鹏华新能源份额、鹏华新能源 A 份额、鹏华新能源 B 份额的基金份额的净值。

### 1、鹏华新能源份额的基金份额净值计算

设 T 日为鹏华新能源份额的基金份额净值计算日，则鹏华新能源份额的基金份额净值为：

$$NAV_{\text{鹏华新能源份额}} = \frac{\text{基金资产净值}}{\text{基金份额总数}}$$

其中，基金资产净值是指 T 日收市后基金资产总值减去负债后的价值，基金份额总数为 T 日鹏华新能源份额、鹏华新能源 A 份额、鹏华新能源 B 份额的份额数之和。

鹏华新能源份额净值的计算，保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

T 日的鹏华新能源份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日公告。如遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

### 2、鹏华新能源 A 份额与鹏华新能源 B 份额的基金份额净值计算

设 T 日为鹏华新能源 A 份额与鹏华新能源 B 份额的基金份额净值计算日，则鹏华新能源 A 份额和鹏华新能源 B 份额的基金份额净值为：

$$NAV_{\text{鹏华新能源 A 份额}} = 1 + R \times \frac{t}{N}$$

$$NAV_{\text{鹏华新能源 B 份额}} = 2 \times NAV_{\text{鹏华新能源份额}} - NAV_{\text{鹏华新能源 A 份额}}$$

其中，N 为 T 日当年实际天数； $t = \min\{\text{自基金合同生效日至 T 日，自最近一次基金份}$

额折算日次日至 T 日}； $NAV_{\text{鹏华新能源份额}}$  为 T 日鹏华新能源份额净值； $NAV_{\text{鹏华新能源 A 份额}}$

为 T 日鹏华新能源 A 份额净值； $NAV_{\text{鹏华新能源 B 份额}}$  为 T 日鹏华新能源 B 份额净值；R 为鹏华新能源 A 份额约定年基准收益率。

鹏华新能源 A 份额净值与鹏华新能源 B 份额净值的计算，均保留到小数点后 8 位，小数点后第 9 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

### （三）基金份额参考净值的计算

基金管理人在基金份额净值计算的基础上计算鹏华新能源 A 份额与鹏华新能源 B 份额的基金份额参考净值。基金份额参考净值是对相应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。

设 T 日为鹏华新能源 A 份额与鹏华新能源 B 份额的基金份额参考净值计算日，则鹏华新能源 A 份额与鹏华新能源 B 份额的基金份额参考净值为：

$$NAV_{\text{鹏华新能源 A 份额}}^{\text{参考}} = 1 + R \times \frac{t}{N}$$

$$NAV_{\text{鹏华新能源 B 份额}}^{\text{参考}} = 2 \times NAV_{\text{鹏华新能源份额}}^{\text{参考}} - NAV_{\text{鹏华新能源 A 份额}}^{\text{参考}}$$

其中，N 为 T 日当年实际天数； $t = \min\{\text{自基金合同生效日至 T 日，自最近一次基金份$

额折算日次日至 T 日}\}； $NAV_{\text{鹏华新能源份额}}^{\text{参考}}$  为 T 日鹏华新能源份额净值； $NAV_{\text{鹏华新能源 A 份额}}^{\text{参考}}$

为 T 日鹏华新能源 A 份额参考净值； $NAV_{\text{鹏华新能源 B 份额}}^{\text{参考}}$  为 T 日鹏华新能源 B 份额参考净值；

R 为鹏华新能源 A 份额的约定年基准收益率。

鹏华新能源 A 份额参考净值与鹏华新能源 B 份额参考净值的计算，均保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入。

T 日的鹏华新能源 A 份额参考净值与鹏华新能源 B 份额参考净值在当天收市后计算，并在 T+1 日公告。如遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

## 八、基金的募集与基金合同的生效

### （一）基金的募集与基金合同的生效

本基金由基金管理人依照《基金法》和其他有关法律法规，以及基金合同的规定，经中国证监会 2015 年 4 月 29 日证监许可〔2015〕768 号文注册。募集期间有效认购份额 211,446,100.80 份，利息结转份额 15,367.03 份，合计 211,461,467.83 份，募集户数为 3,586 户。

本基金的基金合同已于 2015 年 5 月 29 日正式生效。

### （二）基金运作方式和类别



契约型开放式，股票型证券投资基金

### **（三）基金的存续期间**

不定期

### **（四）基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模**

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。

法律法规另有规定时，从其规定。

## **九、基金份额的上市与交易**

基金合同生效后，在本基金符合法律法规和深圳证券交易所规定的上市条件的情况下，鹏华新能源 A 份额与鹏华新能源 B 份额分别在深圳证券交易所上市与交易。鹏华新能源 A 份额与鹏华新能源 B 份额登记在证券登记系统基金份额持有人深圳证券账户下。

本部分中，如无特别说明，本基金或基金份额特指鹏华新能源 A 份额与鹏华新能源 B 份额。

### **（一）上市交易的地点**

深圳证券交易所。

### **（二）上市交易的时间**

上市交易时间 2015 年 6 月 5 日。

上市交易份额简称及代码：新能 A，基金代码：150279；新能 B，基金代码：150280。

在确定上市交易的时间后，基金管理人应依据法律法规规定在指定媒介刊登基金份额上市交易公告书。

### **（三）上市交易的规则**

- 1、鹏华新能源 A 份额与鹏华新能源 B 份额分别采用不同的交易代码上市交易；
- 2、本基金上市首日的开盘参考价为前一交易日的基金份额参考净值；
- 3、本基金上市交易的其他规则遵循《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》、《深圳证券交易所交易规则》及其他相关规定。

### **（四）上市交易的费用**

本基金上市交易的费用按照深圳证券交易所相关规则及有关规定执行。

### **（五）上市交易的行情揭示**

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

#### **（六）上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市**

本基金的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市按照深圳证券交易所的相关规定执行。

#### **（七）其他事项**

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

若深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司增加了基金上市交易的新功能，基金管理人可以在履行适当的程序后增加相应功能。

## **十、基金份额的申购与赎回**

基金合同生效后，鹏华新能源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能源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能源份额登记在证券登记系统基金份额持有人深圳证券账户下。

本章中，如无特别说明，本基金或基金份额特指鹏华新能源份额，基金份额净值特指鹏华新能源份额净值。

自 2015 年 6 月 2 日起开始办理鹏华新能源份额的申购与赎回业务。

#### **（一）基金份额的场外申购与赎回**

##### **1、申购和赎回的场所**

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机构和基金管理人委托的其他销售机构的销售网点。

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。

##### **2、申购和赎回的开放日及时间**

本基金于 2015 年 6 月 2 日起每个开放日开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务。

申购和赎回的开放日为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日（基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购或赎回时除外），投资者应当在开放日办理申购和赎回申请。开放日的具体业务办理时间见基金管理人届时发布的相关公告。

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。

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。

### 3、申购和赎回的原则

(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；

(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；

(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；

(4) 场外赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人认购、申购、跨系统转托管时基金份额登记的先后次序进行顺序赎回。

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。

### 4、申购和赎回的程序

#### (1) 申购和赎回的申请方式

基金投资者必须根据基金销售机构规定的程序，在开放日的具体业务办理时间向基金销售机构提出申购或赎回的申请。

投资者在申购本基金时须按销售机构规定的方式备足申购资金，投资者在提交赎回申请时，必须有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回的申请无效而不予成交。

#### (2) 申购和赎回申请的确认

T日规定时间受理的申请，正常情况下，基金登记机构在T+1日内为投资者对该交易的有效性进行确认，在T+2日后（包括该日）投资者应及时向销售机构或以销售机构规定的其他方式查询申购与赎回的成交情况并妥善行使合法权利。

基金销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申购、赎回申请。申购、赎回的确认以基金登记机构或基金管理公司的确认结果为准。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。

#### (3) 申购和赎回的款项支付

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。

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。

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

投资者 T 日赎回申请成功后，基金管理人将通过基金登记机构及其相关基金销售机构在 T+7 日（包括该日）内将赎回款项划往基金份额持有人账户。在发生巨额赎回、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基金合同的有关条款处理。

#### 5、申购与赎回的数额限制

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

（2）投资者单个交易账户最低基金份额余额为 5 份，若某笔赎回将导致投资者在某一场外销售机构的某一交易账户内托管的单只基金份额余额不足 5 份时，该笔赎回业务应包括账户内全部基金份额，否则，剩余部分的基金份额将被强制赎回；

（3）本基金对单个投资者累计持有的基金份额不设限制；

（4）当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益，具体请参见相关公告。

（5）基金管理人可根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整上述对申购的金额和赎回的份额等数量限制，基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告并报中国证监会备案。

#### 6、申购费用和赎回费用

##### （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）：

持有期限 Y	赎回费率
Y < 7 日	1.50%
7 日 ≤ 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。本基金对持续持有期少于 7 日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产，对持续持有期不少于 7 日的投资者收取的赎回费总额的 25% 应归入基金财产，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，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基金赎回费率。

(5) 当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。

## 7、申购份额与赎回金额的计算

### (1) 基金份额净值的计算

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。本基金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。

### (2) 申购份额的计算

基金的申购采用“金额申购”方式，申购金额包括申购费用和净申购金额，计算公式如下：

1) 当申购费用适用比例费率时，申购份额的计算方法为：

净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率)；

申购费用 = 申购金额 - 净申购金额；

申购份额 = 净申购金额 / 申购当日基金份额净值。

2) 当申购费用为固定金额时，申购份额的计算方法为：

申购费用 = 固定金额

净申购金额 = 申购金额 - 申购费用

申购份额 = 净申购金额 / 申购当日基金份额净值。

申购的有效份额由按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后，以当日基金份额净值为基准计算。场外申购份额计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

例：某投资者在场外申购本基金 50,000 元，对应的申购费率为 1.20%。假设申购当日基金份额净值为 1.386 元，则可得到的申购份额为：

净申购金额 = 50,000 / (1 + 1.20%) = 49,407.11 元；

申购费用 = 50,000 - 49,407.11 = 592.89 元；

申购份额 = 49,407.11 / 1.386 = 35,647.27 份。

即，若该投资者在场外申购本基金 50,000 元，假设申购当日基金份额净值为 1.386 元，则可得到基金份额 35,647.27 份。

### (3) 赎回金额的计算

基金的赎回采用“份额赎回”方式，赎回价格以T日的基金份额净值为基准进行计算，计算公式如下：

赎回总金额 = 赎回份额 × T日基金份额净值；

赎回费用 = 赎回总金额 × 赎回费率；

净赎回金额 = 赎回总金额 - 赎回费用。

赎回金额为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后的余额。场外赎回金额计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

例：某投资者在场外赎回本基金 100,000 份，持有时间为一年六个月，对应的赎回费率为 0.25%。假设赎回当日基金份额净值为 1.483 元，则可得到的赎回金额为：

赎回金额 =  $100,000 \times 1.483 = 148,300.00$  元；

赎回费用 =  $148,300.00 \times 0.25\% = 370.75$  元；

净赎回金额 =  $148,300.00 - 370.75 = 147,929.25$  元。

即，若该投资者在场外赎回本基金 100,000 份，持有时间为一年六个月，假设赎回当日基金份额净值为 1.483 元，则可得到 147,929.25 元。

#### 8、申购和赎回的注册登记

投资者申购基金成功后，基金登记机构在 T+1 日为投资者登记权益并办理注册登记手续，投资者自 T+2 日（含该日）后有权赎回该部分基金份额。

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

基金登记机构可以在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，但不得实质影响投资者的合法权益，并最迟于开始实施前 3 个工作日在指定媒介公告。

#### 9、拒绝或暂停申购的情形及处理方式

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

- (1) 因不可抗力导致基金无法正常运作。
- (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。
- (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。
- (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。
- (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，或发生其他损害现有基金份额持有人利益的情形。
- (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。

(7) 发生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。

(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。

(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。

(10) 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

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全部或部分拒绝的，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。

#### 10、暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

(1) 因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

(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。

(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。

(4) 连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

(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。

(6) 发生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。

(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。

(8) 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形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。基金份额持有人可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。

#### 11、巨额赎回的情形及处理方式

##### （1）巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的鹏华新能源份额净赎回申请（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）超过上一开放日基金总份额（包括鹏华新能源份额、鹏华新能源 A 份额、鹏华新能源 B 份额）的 10%，即认为是发生了巨额赎回。

##### （2）巨额赎回的处理方式

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

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。

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（包括鹏华新能源份额、鹏华新能源 A 份额、鹏华新能源 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。

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，但不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒介上进行公告。

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（包括鹏华新能源份额、鹏华新能源 A 份额、鹏华新能源 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。

5) 当出现巨额赎回时，场内赎回申请按照深圳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。

（3）巨额赎回的公告：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。

## 12、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

（1）发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人当日应立即向中国证监会备案，并在规定期限内指定媒介上刊登暂停公告。

（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。

（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。

（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。

## （二）基金份额的场内申购与赎回

### 1、申购和赎回的场所

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深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的深圳证券交易所会员单位。

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。

## 2、申购和赎回的开放日及时间

本基金的申购、赎回自基金合同生效后不超过 3 个月的时间内开始办理，基金管理人应在开始办理申购赎回的具体日期前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

申购和赎回的开放日为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日（基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购或赎回时除外），投资者应当在开放日办理申购和赎回申请。开放日的具体业务办理时间为深圳证券交易所交易时间。

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。投资者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。

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。

## 3、申购和赎回的原则

(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础进行计算；

(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；

(3) 当日的场内申购与赎回申请可以在深圳证券交易所规定的时间以内撤销；

(4) 场内申购与赎回业务遵循深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定。

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。

## 4、申购和赎回的程序

### (1) 申购和赎回的申请方式

基金投资者必须根据基金销售机构规定的程序，在开放日的具体业务办理时间向基金销售机构提出申购或赎回的申请。

投资者在申购本基金时须按销售机构规定的方式备足申购资金，投资者在提交赎回申请时，必须有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回的申请无效而不予成交。

## （2）申购和赎回申请的确认

T日规定时间受理的申请，正常情况下，基金登记机构在T+1日内为投资者对该交易的有效性进行确认，在T+2日后（包括该日）投资者应及时向销售机构或以销售机构规定的其他方式查询申购与赎回的成交情况并妥善行使合法权利。

基金销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申购、赎回申请。申购、赎回的确认以基金登记机构或基金管理公司的确认结果为准。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。

## （3）申购和赎回的款项支付

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。

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。

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

投资者T日赎回申请成功后，基金管理人将通过基金登记机构及其相关基金销售机构在T+7日（包括该日）内将赎回款项划往基金份额持有人账户。在发生巨额赎回、基金合同载明的暂停赎回或其他延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照基金合同的有关条款处理。

## 5、申购与赎回的数额限制

（1）投资者通过深圳证券交易所会员单位申购本基金，单笔最低申购金额为50,000元；

（2）当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益，具体请参见相关公告；

（3）基金管理人、深圳证券交易所、基金登记机构可根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整上述对申购的金额和赎回的份额等数量限制，基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告并报中国证监会备案。

## 6、申购费用和赎回费用

### （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随投资者持有基金份额期限的增加而减少。

本基金场内赎回费率如下表：

持有期限 Y	赎回费率
Y < 7 日	1.50%
Y ≥ 7 日	0.50%

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。本基金对持续持有期少于 7 日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产，对持续持有期不少于 7 日的投资者收取的赎回费总额的 25% 应归入基金财产，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) 当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。

(5) 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。

### 7、申购份额与赎回金额的计算

#### (1) 基金份额净值的计算

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。本基金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。

### （2）申购份额的计算

基金的申购采用“金额申购”方式，申购金额包括申购费用和净申购金额，计算公式如下：

1) 当申购费用适用比例费率时，申购份额的计算方法为：

净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率)；

申购费用 = 申购金额 - 净申购金额；

申购份额 = 净申购金额 / 申购当日基金份额净值。

2) 当申购费用为固定金额时，申购份额的计算方法为：

申购费用 = 固定金额

净申购金额 = 申购金额 - 申购费用

申购份数 = 净申购金额 / 申购当日基金份额净值。

申购的有效份额由按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后，以当日基金份额净值为基准计算。场内申购份额计算结果先按四舍五入的原则保留到小数点后两位，再按截位法保留到整数位，小数部分对应的资金返还至投资者资金账户（返还金额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，余额计入基金资产）。

例：某投资者在场内申购本基金 50,000 元，对应的申购费率为 0%。假设申购当日基金份额净值为 1.386 元，则可得到的申购份额为：

净申购金额 = 50,000 / (1 + 0%) = 50,000 元；

申购费用 = 50,000 - 50,000 = 0 元；

申购份额（保留两位） = 50,000 / 1.386 = 36,075.04 份；

申购份额（实际） = 36,075 份；

返还金额 = 0.4 × 1.386 = 0.55 元。

即，若该投资者在场内申购本基金 50,000 元，假设申购当日基金份额净值为 1.386 元，则可得到基金份额 36,075 份，申购资金返还 0.55 元。

### （3）赎回金额的计算

基金的赎回采用“份额赎回”方式，赎回价格以 T 日的基金份额净值为基准进行计算，计算公式如下：

赎回总金额 = 赎回份额 × T 日基金份额净值；

赎回费用 = 赎回总金额 × 赎回费率；

净赎回金额 = 赎回总金额 - 赎回费用。

赎回金额为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后的余额。场内赎回金额计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

例：某投资者在场内赎回本基金 100,000 份，持有时间为 1 个月，对应的赎回费率为 0.50%。假设赎回当日基金份额净值为 1.383 元，则可得到的赎回金额为：

赎回金额 =  $100,000 \times 1.383 = 138,300.00$  元；

赎回费用 =  $138,300.00 \times 0.50\% = 691.50$  元；

净赎回金额 =  $138,300.00 - 691.50 = 137,608.50$  元。

即，若该投资者在场内赎回本基金 100,000 份，假设赎回当日基金份额净值为 1.383 元，则可得到 137,608.50 元。

## 8、其他

有关场内拒绝或暂停申购的情形及处理方法、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形及处理方式、巨额赎回的情形及处理方式、重新开放申购或赎回的公告等内容请参见本招募说明书中关于“基金份额的场外申购与赎回”部分的相关规定以及深圳证券交易所、基金登记机构的有关规定，并据此执行。

### （三）基金的转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及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。

### （四）定期定额投资计划

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。

## 十一、基金的非交易过户、转托管、冻结与解冻、转让

### （一）基金的非交易过户

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。

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。

## （二）基金的转托管

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。

### 1、系统内转托管

（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）之间或证券登记系统内不同会员单位（交易单元）之间进行转托管的行为。

（2）基金份额登记在登记结算系统的基金份额持有人在变更办理鹏华新能源份额赎回业务的销售机构（网点）时，须办理已持有鹏华新能源份额的系统内转托管。

（3）基金份额登记在证券登记系统的基金份额持有人在变更办理鹏华新能源份额场内赎回或鹏华新能源 A 份额与鹏华新能源 B 份额上市交易的会员单位（交易单元）时，须办理已持有基金份额的系统内转托管。

（4）募集期内不得办理系统内转托管。

### 2、跨系统转托管

（1）跨系统转托管是指基金份额持有人将持有的鹏华新能源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。

（2）场内份额跨系统转托管至场外后，持有期限将重新计算，赎回时按变更后的持有期限计算适用赎回费率。

（3）鹏华新能源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。

（4）处于质押、冻结状态、基金份额折算基准日至折算处理日及深圳证券交易所、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。

3、基金管理人、基金登记机构或深圳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。

## （三）基金份额的冻结和解冻



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。

#### **（四）基金份额的转让**

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。

## **十二、基金份额的配对转换**

基金合同生效后，基金管理人将为场内基金份额持有人办理基金份额配对转换。基金份额的配对转换是指鹏华新能源份额与鹏华新能源 A 份额、鹏华新能源 B 份额之间的转换，包括基金份额的分拆与合并。

鹏华新能源份额的场内份额可以直接申请分拆与合并，场外份额通过跨系统转托管至场内后方可申请分拆与合并。

#### **（一）配对转换场所**

基金份额配对转换业务的办理机构见招募说明书或基金管理人届时发布的相关公告。

基金投资者应当在配对转换业务办理机构的营业场所或按办理机构提供的其他方式办理本基金的份额配对转换。深圳证券交易所、基金登记机构或基金管理人可根据情况变更或增减该业务的办理机构，并予以公告。

#### **（二）配对转换的开放日及时间**

本基金已于 2015 年 6 月 2 日起开通基金的份额配对转换业务。

配对转换的开放日为深圳证券交易所交易日（基金管理人公告暂停配对转换时除外），投资者应当在开放日办理配对转换业务。具体业务办理时间在招募说明书中载明或另行公告。

若深圳证券交易所交易时间更改或实际情况需要，基金管理人可对配对转换业务的办理时间进行调整，但此项调整应在实施日 2 日前在指定媒介公告。

#### **（三）配对转换的原则**

- 1、配对转换以份额申请；
- 2、申请进行分拆的鹏华新能源份额的场内份额数必须为偶数；
- 3、申请进行合并的鹏华新能源 A 份额与鹏华新能源 B 份额必须同时配对申请，且基金份额数必须为整数且相等；

4、鹏华新能源份额的场外份额如需申请进行分拆，须跨系统转托管为鹏华新能源份额的场内份额后方可进行；

5、配对转换应遵循届时相关机构发布的相关业务规则。

基金管理人、基金登记机构或深圳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。

#### **（四）配对转换的程序**

配对转换的程序遵循届时相关机构发布的相关业务规则，具体见相关业务公告。

#### **（五）暂停配对转换的情形**

1、深圳证券交易所、基金登记机构、配对转换业务办理机构因异常情况无法办理该业务的情形；

2、基金管理人认为继续接受配对转换可能损害基金份额持有人利益的情形；

3、法律法规、深圳证券交易所规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一的，基金管理人应当在指定媒介刊登暂停基金份额配对转换公告。

在暂停配对转换的情况消除时，基金管理人应及时恢复该业务的办理，并依照有关规定在指定媒介公告。

#### **（六）配对转换费用**

配对转换业务的办理机构可对该业务的办理酌情收取一定的费用，具体见相关业务公告。

#### **（七）其他事项**

基金管理人、深圳证券交易所、基金登记机构有权调整上述规则，本基金基金合同将相应予以修改，且此项修改无须召开基金份额持有人大会，并在本基金更新的招募说明书中列示。

## **十三、基金的投资**

### **（一）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。

### **（二）投资范围**

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及其备选成份股（含中小板、创业板股票及其他中国证监会核准上市的股票）、债券、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。

### （三）标的指数

中证新能源指数

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：

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 股市场新能源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、更具代表性的反映该类股票走势的指数时；

2、当标的指数出现下列问题时：

（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；

（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；

（3）标的指数由其他指数替代；

（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；

（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；

（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；

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。

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。

#### **（四）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。

本基金力争鹏华新能源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，以保证鹏华新能源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。

## (五) 投资限制

### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

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

(2) 每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，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。

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

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

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

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

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并履行信息披露义务。

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

#### **（六）业绩比较基准**

中证新能源指数收益率×95%+商业银行活期存款利率（税后）×5%

中证新能源指数从可再生能源生产，能源应用、存储及交互设备以及其他相关行业上市公司中选取代表性的 80 只股票，反映新能源产业在 A 股的整体走势，为投资者提供新的投资标的。

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。

#### **（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，鹏华新能源 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；鹏华新能源 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。

#### **（八）基金的融资融券及转融通**

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。

#### **（九）基金的投资组合报告（未经审计）**

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 4 月 18 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 2018 年 01 月 01 日起至 03 月 31 日。

### 1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	45,045,281.23	93.57
	其中：股票	45,045,281.23	93.57
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	3,051,419.19	6.34
8	其他资产	44,059.16	0.09
9	合计	48,140,759.58	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	37,938,829.77	79.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,371,226.11	7.09
E	建筑业	820,585.00	1.73
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,098,495.10	4.41
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-

M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	816,145.25	1.72
	合计	45,045,281.23	94.73

**(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) 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	600703	三安光电	107,260	2,502,375.80	5.26
2	002594	比亚迪	39,800	2,240,740.00	4.71
3	601012	隆基股份	61,200	2,097,324.00	4.41
4	002466	天齐锂业	30,140	1,775,246.00	3.73
5	002460	赣锋锂业	22,400	1,733,312.00	3.65
6	002202	金风科技	89,140	1,615,216.80	3.40
7	300124	汇川技术	43,800	1,548,768.00	3.26
8	600089	特变电工	162,888	1,436,672.16	3.02
9	601985	中国核电	203,800	1,369,536.00	2.88
10	600406	国电南瑞	73,710	1,239,065.10	2.61

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

注：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）

#### 赣锋锂业

本基金投资的前十名证券之一的发行主体江西赣锋锂业股份有限公司（以下简称“赣锋锂业”）于2017年7月3日收到深圳证券交易所中小板公司管理部下发的《关于对江西赣锋锂业股份有限公司及相关当事人的监管函》（中小板监管函【2017】第111号），于2017年7月6日收到深圳证券交易所中小板公司管理部下发的《关于对江西赣锋锂业股份有限公司的监管函》（中小板监管函【2017】第115号）。监管函主要内容如下：

#### （1）中小板监管函【2017】第111号

2016年10月25日，赣锋锂业披露2016年第三季度报告，预计2016年度归属于上市公司股东的净利润（以下简称“净利润”）为62,577万元至68,835万元。2017年2月28日，赣锋锂业披露业绩快报，预计2016年度净利润为45,626万元。2017年4月12日，赣锋锂业披露2016年度经审计的净利润为46,437万元。赣锋锂业2016年度经审计的净利

润与业绩预告中披露的净利润存在较大差异，且未在规定期限内对业绩预告作出修正。赣锋锂业上述行为违反了深交所《股票上市规则（2014年修订）》第2.1条、第2.5条、第2.7条和第11.3.3条的规定。赣锋锂业董事长兼总裁李良彬、副总裁兼财务总监杨满英违反了深交所《股票上市规则（2014年修订）》第2.2条和第3.1.5条的规定，对赣锋锂业上述违规行为负有重要责任。

(2) 中小板监管函【2017】第115号

赣锋锂业属于“深圳100指数”公司，但未按规定在披露2016年度报告的同时披露社会责任报告，直至2017年7月4日才对外披露《2016年度社会责任报告》，且社会责任报告未经公司董事会审议。赣锋锂业的上述行为违反了本所《股票上市规则》第1.4条和第2.1条以及《中小企业板信息披露业务备忘录第2号：定期报告披露相关事项》第二条第七款第一项的规定。

对上述股票的投资决策程序的说明：本基金为指数基金，为更好地跟踪标的指数，控制跟踪误差，对该证券的投资属于按照指数成分股的权重进行配置，符合指数基金的管理规定，该证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

本基金投资的前十名证券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。

(2)

本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券备选库。

(3) 其他资产构成

序号	名称	金额（人民币元）
1	存出保证金	13,209.52
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	726.45
5	应收申购款	30,123.19
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	44,059.16

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

**(6) 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。

## 十四、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05月29日 (基金合同生效日) 至2015年12月31日	-36.57%	3.60%	-21.78%	3.39%	-14.79%	0.21%
2016年1月1日至 2016年12月31日	-16.56%	1.99%	-18.60%	1.98%	2.04%	0.01%
2017年1月1日至 2017年12月31日	5.48%	1.03%	7.82%	1.01%	-2.34%	0.02%
2018年1月1日至 2018年3月31日	-4.75%	1.49%	-3.87%	1.52%	-0.88%	-0.03%
自基金合同生效日至 2018年3月31日	-46.82%	2.16%	-34.01%	2.08%	-12.81%	0.08%

## 十五、基金的财产

### (一) 基金资产总值

基金资产总值是指购买的各类证券及票据价值、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和。

### (二) 基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### (三) 基金财产的账户

基金托管人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立资金账户、证券账户以及投资所需的其他专用账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

#### **（四）基金财产的处分**

本基金财产独立于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人、基金登记机构和基金销售机构以其自有的财产承担其自身的法律责任，其债权人不得对本基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除依法律法规和基金合同的规定处分外，基金财产不得被处分。

基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。基金管理人管理运作基金财产所产生的债权，不得与其固有资产产生的债务相互抵销；基金管理人管理运作不同基金的基金财产所产生的债权债务不得相互抵销。

## **十六、基金资产的估值**

### **（一）估值日**

本基金的估值日为本基金相关的证券交易场所的交易日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非交易日。

### **（二）估值对象**

基金所拥有的股票、权证、债券、股指期货合约和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

### **（三）估值方法**

#### **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。

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

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

#### **（四）估值程序**

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。

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。

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。

#### **（五）估值错误的处理**

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

基金合同的当事人应按照以下约定处理：

##### **1、估值错误类型**

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或登记机构、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。

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。

##### **2、估值错误处理原则**

（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。

(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。

(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。

(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。

(5) 按法律法规规定的其他原则处理估值错误。

### 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

(1) 查明估值错误发生的原因，列明所有的当事人，并根据估值错误发生的原因确定估值错误的责任方；

(2) 根据估值错误处理原则或当事人协商的方法对因估值错误造成的损失进行评估；

(3) 根据估值错误处理原则或当事人协商的方法由估值错误的责任方进行更正和赔偿损失；

(4) 根据估值错误处理的方法，需要修改基金登记机构交易数据的，由基金登记机构进行更正，并就估值错误的更正向有关当事人进行确认。

### 4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

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

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

(3) 当基金份额净值计算差错给基金和基金份额持有人造成损失需要进行赔偿时，基金管理人和基金托管人应根据实际情况界定双方承担的责任，经确认后按以下条款进行赔偿：

①本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，与本基金有关的会计问题，如经双方在平等基础上充分讨论后，尚不能达成一致时，按基金管理人的建议执行，由此给基金份额持有人和基金财产造成的损失，由基金管理人负责赔付。

②若基金管理人计算的基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告，由此给基金份额持有人造成损失的，应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金，就实际向投资者或基金支付的赔偿金额，基金管理人与基金托管人按照过错程度各自承担相应的责任。

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。

④由于基金管理人提供的信息错误（包括但不限于基金申购或赎回金额等），进而导致基金份额净值计算错误而引起的基金份额持有人和基金财产的损失，由基金管理人负责赔付。

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

(5) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

#### **(六) 暂停估值的情形**

- 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；
- 2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；
- 3、占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障投资人的利益，已决定延迟估值时；
- 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；
- 5、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

#### **(七) 基金净值的确认**

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。

#### **（八）特殊情况的处理**

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，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

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。

## **十七、基金的收益分配**

在存续期内，本基金（包括鹏华新能源份额、鹏华新能源A份额、鹏华新能源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。

## **十八、基金份额的折算**

#### **（一）定期份额折算**

在鹏华新能源A份额、鹏华新能源份额存续期内的每个会计年度9月第一个工作日，本基金将按照以下规则进行基金的定期份额折算。

##### **1、基金份额折算基准日**

正常情况下，基金份额定期折算基准日为每个会计年度9月第一个工作日。

##### **2、基金份额折算对象**

基金份额折算基准日登记在册的鹏华新能源A份额、鹏华新能源份额。

##### **3、基金份额折算频率**

每年折算一次（可不进行定期折算的除外）。

##### **4、基金份额折算方式**

鹏华新能源 A 份额与鹏华新能源 B 份额按照本招募说明书第七章“基金份额参考净值的计算”进行基金份额参考净值计算，对鹏华新能源 A 份额的约定应得收益进行定期份额折算。

在基金份额折算前与折算后，鹏华新能源 A 份额与鹏华新能源 B 份额的份额配比保持 1: 1 的比例。对于鹏华新能源 A 份额的约定应得收益，即鹏华新能源 A 份额每个会计年度 8 月最后一个自然日基金份额参考净值超出 1.000 元部分，将折算为场内鹏华新能源份额分配给鹏华新能源 A 份额持有人。鹏华新能源份额持有人持有的每 2 份鹏华新能源份额将按 1 份鹏华新能源 A 份额获得新增鹏华新能源份额的分配。持有场外鹏华新能源份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外鹏华新能源份额的分配；持有场内鹏华新能源份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内鹏华新能源份额的分配。经过上述份额折算，鹏华新能源 A 份额的基金份额参考净值调整为 1.000 元，鹏华新能源份额的基金份额净值将相应调整。

每个会计年度 9 月第一个工作日为基金份额折算基准日，本基金将对鹏华新能源 A 份额和鹏华新能源份额进行定期份额折算。以下公式中“定期份额折算前鹏华新能源 A 份额的基金份额参考净值”为每个会计年度 8 月最后一个自然日鹏华新能源 A 份额基金份额参考净值。有关计算公式如下：

(1) 鹏华新能源 A 份额

定期份额折算不改变鹏华新能源 A 份额的份额数，即

$$NUM_{\text{鹏华新能源 A 份额}}^{\text{定期后}} = NUM_{\text{鹏华新能源 A 份额}}^{\text{定期前}}$$

其中，

$NUM_{\text{鹏华新能源 A 份额}}^{\text{定期前}}$ ：定期份额折算前鹏华新能源 A 份额的份额数，

$NUM_{\text{鹏华新能源 A 份额}}^{\text{定期后}}$ ：定期份额折算后鹏华新能源 A 份额的份额数。

因持有鹏华新能源 A 份额而新增的场内鹏华新能源份额的份额数为

$$NUM_{\text{鹏华新能源份额}}^{\text{定期新增, 鹏华新能源 A 份额}} = \frac{NUM_{\text{鹏华新能源 A 份额}}^{\text{定期前}} \times \left( NAV_{\text{鹏华新能源 A 份额}}^{\text{参考, 定期前}} - 1.000 \right)}{NAV_{\text{鹏华新能源份额}}^{\text{定期后}}}$$

其中，

$NUM_{\text{鹏华新能源 A 份额}}^{\text{定期前}}$ ：定期份额折算前鹏华新能源 A 份额的份额数，

$NAV_{\text{鹏华新能源 A 份额}}^{\text{参考, 定期前}}$ ：定期份额折算前鹏华新能源 A 份额的基金份额参考净值，

$NUM_{\text{鹏华新能源份额}}^{\text{定期前}}$ ：定期份额折算前鹏华新能源份额的份额数，

$NAV_{\text{鹏华新能源份额}}^{\text{定期后}}$ ：定期份额折算后鹏华新能源份额的基金份额净值，计算公式为

$NAV_{\text{鹏华新能源份额}}^{\text{定期后}}$

$$= \frac{\text{定期折算前全部鹏华新能源份额的基金资产净值} - 0.5 \times \left( NAV_{\text{鹏华新能源 A 份额}}^{\text{参考, 定期前}} - 1.000 \right) \times NUM_{\text{鹏华新能源 A 份额}}^{\text{定期前}}}{NUM_{\text{鹏华新能源份额}}^{\text{定期前}}}$$

定期份额折算后的鹏华新能源份额的基金份额净值，保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

### (2) 鹏华新能源 B 份额

定期份额折算不改变鹏华新能源 B 份额的基金份额参考净值及其份额数，即

$$NAV_{\text{鹏华新能源 B 份额}}^{\text{参考, 定期后}} = NAV_{\text{鹏华新能源 B 份额}}^{\text{参考, 定期前}}$$

$$NUM_{\text{鹏华新能源 B 份额}}^{\text{定期后}} = NUM_{\text{鹏华新能源 B 份额}}^{\text{定期前}}$$

### (3) 鹏华新能源份额

定期份额折算后鹏华新能源份额的份额数等于定期折算前鹏华新能源份额的份额数与新增的鹏华新能源份额的份额数之和，即

$$NUM_{\text{鹏华新能源份额}}^{\text{定期后}} = NUM_{\text{鹏华新能源份额}}^{\text{定期前}} + NUM_{\text{鹏华新能源份额}}^{\text{定期新增}}$$

鹏华新能源份额持有人新增的鹏华新能源份额数为

$$NUM_{\text{鹏华新能源份额}}^{\text{定期新增}} = \frac{0.5 \times \left( NAV_{\text{鹏华新能源 A 份额}}^{\text{参考, 定期前}} - 1.000 \right) \times NUM_{\text{鹏华新能源 A 份额}}^{\text{定期前}}}{NAV_{\text{鹏华新能源份额}}^{\text{定期后}}}$$

其中，

$NAV_{\text{鹏华新能源 A 份额}}^{\text{参考, 定期前}}$ ：定期份额折算前鹏华新能源 A 份额的基金份额参考净值，

$NUM_{\text{鹏华新能源份额}}^{\text{定期前}}$ ：定期份额折算前鹏华新能源份额的份额数，

$NAV_{\text{鹏华新能源份额}}^{\text{定期后}}$ ：定期份额折算后鹏华新能源份额的基金份额净值，计算公式同上。

#### 5、定期份额折算示例

假设本基金成立后第 2 年 9 月第一个工作日为定期份额折算基准日，鹏华新能源份额当天折算前资产净值为 8,661,250,000 元。当天场外鹏华新能源份额、场内鹏华新能源份额、鹏华新能源 A 份额、鹏华新能源 B 份额的份额数分别为 55 亿份、10 亿份、20 亿份、20 亿份。本次定期份额折算基准日每份鹏华新能源 A 份额参考净值为 1.065 元，且未进行不定期份额折算。

定期份额折算的对象为基准日登记在册的鹏华新能源 A 份额和鹏华新能源份额，即 20 亿份和 65 亿份。

##### (1) 鹏华新能源 A 份额持有人

定期折算后持有的鹏华新能源 A 份额为

$$NUM_{\text{鹏华新能源 A 份额}}^{\text{定期后}} = NUM_{\text{鹏华新能源 A 份额}}^{\text{定期前}} = 20 \text{ 亿份}$$

定期份额折算后鹏华新能源份额的份额净值为

$$NAV_{\text{鹏华新能源份额}}^{\text{定期后}}$$

$$\begin{aligned} &= \frac{\text{定期折算前全部鹏华新能源份额的基金资产净值} - 0.5 \times \left( NAV_{\text{鹏华新能源 A 份额}}^{\text{参考, 定期前}} - 1.000 \right) \times NUM_{\text{鹏华新能源份额}}^{\text{定期前}}}{NUM_{\text{鹏华新能源份额}}^{\text{定期前}}} \\ &= \frac{8,661,250,000 - 0.5 \times (1.065 - 1.000) \times 6,500,000,000}{6,500,000,000} = 1.300 \text{ 元} \end{aligned}$$

因持有鹏华新能源 A 份额而新增的场内鹏华新能源份额的份额数为

$$\begin{aligned} \text{NUM}_{\text{鹏华新能源 A 份额}}^{\text{定期新增, 鹏华新能源 A 份额}} &= \frac{\text{NUM}_{\text{鹏华新能源 A 份额}}^{\text{定期前}} \times (\text{NAV}_{\text{鹏华新能源 A 份额}}^{\text{参考, 定期前}} - 1.000)}{\text{NAV}_{\text{鹏华新能源 A 份额}}^{\text{定期后}}} \\ &= \frac{2,000,000,000 \times (1.065 - 1.000)}{1.300} = 100,000,000 \text{ 份} \end{aligned}$$

鹏华新能源 A 份额持有人在定期折算后总共持有 20 亿份鹏华新能源 A 份额，基金份额净值为 1.000 元；新增持有 100,000,000 份鹏华新能源份额，基金份额净值为 1.300 元。

## (2) 鹏华新能源份额持有人

鹏华新能源份额持有人新增的鹏华新能源份额数为

$$\begin{aligned} \text{NUM}_{\text{鹏华新能源 A 份额}}^{\text{定期新增}} &= \frac{0.5 \times (\text{NAV}_{\text{鹏华新能源 A 份额}}^{\text{参考, 定期前}} - 1.000) \times \text{NUM}_{\text{鹏华新能源 A 份额}}^{\text{定期前}}}{\text{NAV}_{\text{鹏华新能源 A 份额}}^{\text{定期后}}} \\ &= \frac{0.5 \times (1.065 - 1.000) \times 6,500,000,000}{1.300} = 162,500,000 \text{ 份} \end{aligned}$$

鹏华新能源份额持有人在定期折算后持有的鹏华新能源份额为

$$\begin{aligned} \text{NUM}_{\text{鹏华新能源 A 份额}}^{\text{定期后}} &= \text{NUM}_{\text{鹏华新能源 A 份额}}^{\text{定期前}} + \text{NUM}_{\text{鹏华新能源 A 份额}}^{\text{定期新增}} = 6,500,000,000 + 162,500,000 \\ &= 6,662,500,000 \text{ 份} \end{aligned}$$

## (二) 不定期份额折算

除以上定期份额折算外，本基金还将在以下两种情况进行份额折算，即当鹏华新能源份额的基金份额净值达到 1.500 元时或当鹏华新能源 B 份额的基金份额参考净值跌至 0.250 元时。

### 1、基金份额折算基准日

当达到不定期折算条件时，基金管理人可根据市场情况确定折算基准日。

### 2、基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的鹏华新能源份额、鹏华新能源 A 份额、鹏华新能源 B 份额。

### 3、基金份额折算频率

不定期。

### 4、基金份额折算方式

当达到不定期折算条件时，本基金将分别对鹏华新能源份额、鹏华新能源 A 份额、鹏华新能源 B 份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保鹏华新能源 A 份额与鹏华新能源 B 份额的比例为 1: 1，份额折算后鹏华新能源份额的基金份额净值、鹏华新能源 A 份额与鹏华新能源 B 份额的基金份额参考净值均调整为 1.000 元。

(1) 当鹏华新能源份额的份额净值达到 1.500 元时，鹏华新能源份额、鹏华新能源 A 份额、鹏华新能源 B 份额将按照如下公式进行份额折算：

1) 鹏华新能源 A 份额

① 份额折算前鹏华新能源 A 份额的份额数与份额折算后鹏华新能源 A 份额的份额数相等，即

$$NUM_{\text{鹏华新能源 A 份额}}^{\text{不定期后}} = NUM_{\text{鹏华新能源 A 份额}}^{\text{不定期前}}$$

其中，

$NUM_{\text{鹏华新能源 A 份额}}^{\text{不定期前}}$ ：不定期份额折算前鹏华新能源 A 份额的份额数，

$NUM_{\text{鹏华新能源 A 份额}}^{\text{不定期后}}$ ：不定期份额折算后鹏华新能源 A 份额的份额数。

② 份额折算前鹏华新能源 A 份额持有人在份额折算后将持有鹏华新能源 A 份额与新增场内鹏华新能源份额，且所对应的基金资产净值不变。

鹏华新能源 A 份额持有人新增的场内鹏华新能源份额的份额数为

$$NUM_{\text{鹏华新能源份额}}^{\text{不定期新增, 鹏华新能源 A 份额}} = \frac{NUM_{\text{鹏华新能源 A 份额}}^{\text{不定期前}} \times \left( NAV_{\text{鹏华新能源 A 份额}}^{\text{参考, 不定期前}} - 1.000 \right)}{1.000}$$

其中，

$NUM_{\text{鹏华新能源 A 份额}}^{\text{不定期前}}$ ：不定期份额折算前鹏华新能源 A 份额的份额数，

$NAV_{\text{鹏华新能源 A 份额}}^{\text{参考, 不定期前}}$ ：不定期份额折算前鹏华新能源 A 份额的基金份额参考净值。

2) 鹏华新能源 B 份额

① 份额折算前鹏华新能源 B 份额的份额数与份额折算后鹏华新能源 B 份额的份额数相等



$$\text{NUM}_{\text{鹏华新能源 B 份额}}^{\text{不定期后}} = \text{NUM}_{\text{鹏华新能源 B 份额}}^{\text{不定期前}}$$

其中，

$\text{NUM}_{\text{鹏华新能源 B 份额}}^{\text{不定期前}}$ ：不定期份额折算前鹏华新能源 B 份额的份额数，

$\text{NUM}_{\text{鹏华新能源 B 份额}}^{\text{不定期后}}$ ：不定期份额折算后鹏华新能源 B 份额的份额数。

②份额折算前鹏华新能源 B 份额持有人在份额折算后将持有鹏华新能源 B 份额与新增场内鹏华新能源份额，且所对应的基金资产净值不变。

鹏华新能源 B 份额持有人新增的场内鹏华新能源份额的份额数为

$$\text{NUM}_{\text{鹏华新能源 B 份额}}^{\text{不定期新增, 鹏华新能源 B 份额}} = \frac{\text{NUM}_{\text{鹏华新能源 B 份额}}^{\text{不定期前}} \times \left( \text{NAV}_{\text{鹏华新能源 B 份额}}^{\text{参考, 不定期前}} - 1.000 \right)}{1.000}$$

其中，

$\text{NUM}_{\text{鹏华新能源 B 份额}}^{\text{不定期前}}$ ：不定期份额折算前鹏华新能源 B 份额的份额数，

$\text{NAV}_{\text{鹏华新能源 B 份额}}^{\text{参考, 不定期前}}$ ：不定期份额折算前鹏华新能源 B 份额的基金份额参考净值。

### 3) 鹏华新能源份额

鹏华新能源份额持有人份额折算前后所持有的鹏华新能源份额的资产净值不变。场外鹏华新能源份额持有人份额折算后获得新增场外鹏华新能源份额，场内鹏华新能源份额持有人份额折算后获得新增场内鹏华新能源份额。

鹏华新能源份额持有人不定期份额折算后的鹏华新能源份额的份额数为

$$\text{NUM}_{\text{鹏华新能源份额}}^{\text{不定期后}} = \frac{\text{NUM}_{\text{鹏华新能源份额}}^{\text{不定期前}} \times \text{NAV}_{\text{鹏华新能源份额}}^{\text{不定期前}}}{1.000}$$

其中，

$\text{NUM}_{\text{鹏华新能源份额}}^{\text{不定期前}}$ ：不定期份额折算前鹏华新能源份额的份额数，

$\text{NAV}_{\text{鹏华新能源份额}}^{\text{不定期前}}$ ：不定期份额折算前鹏华新能源份额的基金份额净值，

$NUM_{\text{鹏华新能源份额}}^{\text{不定期后}}$ ：不定期份额折算后鹏华新能源份额的份额数。

具体内容详见招募说明书。

(2) 当鹏华新能源 B 份额的基金份额参考净值跌至 0.250 元时，鹏华新能源份额、鹏华新能源 A 份额、鹏华新能源 B 份额将按照如下公式进行份额折算：

1) 鹏华新能源 B 份额

份额折算前后鹏华新能源 B 份额所对应的基金资产净值不变，即

$$NUM_{\text{鹏华新能源 B 份额}}^{\text{不定期后}} = \frac{NUM_{\text{鹏华新能源 B 份额}}^{\text{不定期前}} \times NAV_{\text{鹏华新能源 B 份额}}^{\text{参考, 不定期前}}}{1.000}$$

其中，

$NUM_{\text{鹏华新能源 B 份额}}^{\text{不定期前}}$ ：不定期份额折算前鹏华新能源 B 份额的份额数，

$NAV_{\text{鹏华新能源 B 份额}}^{\text{参考, 不定期前}}$ ：不定期份额折算前鹏华新能源 B 份额的基金份额参考净值，

$NUM_{\text{鹏华新能源 B 份额}}^{\text{不定期后}}$ ：不定期份额折算后鹏华新能源 B 份额的份额数。

2) 鹏华新能源 A 份额

①份额折算后鹏华新能源 A 份额与鹏华新能源 B 份额的份额数保持 1: 1 配比，即

$$NUM_{\text{鹏华新能源 A 份额}}^{\text{不定期后}} = NUM_{\text{鹏华新能源 B 份额}}^{\text{不定期后}}$$

其中，

$NUM_{\text{鹏华新能源 A 份额}}^{\text{不定期后}}$ ：不定期份额折算后鹏华新能源 A 份额的份额数，

$NUM_{\text{鹏华新能源 B 份额}}^{\text{不定期后}}$ ：不定期份额折算后鹏华新能源 B 份额的份额数。

②份额折算前鹏华新能源 A 的持有人在份额折算后将持有鹏华新能源 A 份额与新增场内鹏华新能源份额，且所对应的基金资产净值不变。

鹏华新能源 A 份额持有人新增的场内鹏华新能源份额的份额数为

$$\text{NUM}_{\text{鹏华新能源份额}}^{\text{不定期新增}} = \frac{\text{NUM}_{\text{鹏华新能源 A 份额}}^{\text{不定期前}} \times \text{NAV}_{\text{鹏华新能源 A 份额}}^{\text{参考, 不定期前}} - \text{NUM}_{\text{鹏华新能源 A 份额}}^{\text{不定期后}} \times 1.000}{1.000}$$

其中，

$\text{NUM}_{\text{鹏华新能源 A 份额}}^{\text{不定期前}}$ ：不定期份额折算前鹏华新能源 A 份额的份额数，

$\text{NAV}_{\text{鹏华新能源 A 份额}}^{\text{参考, 不定期前}}$ ：不定期份额折算前鹏华新能源 A 份额的基金份额参考净值，

$\text{NUM}_{\text{鹏华新能源 A 份额}}^{\text{不定期后}}$ ：不定期份额折算后鹏华新能源 A 份额的份额数。

### 3) 鹏华新能源份额

鹏华新能源份额持有人份额折算前后所持有的鹏华新能源份额的资产净值不变。场外鹏华新能源份额持有人份额折算后获得新增场外鹏华新能源份额，场内鹏华新能源份额持有人份额折算后获得新增场内鹏华新能源份额。

鹏华新能源份额持有人不定期份额折算后的鹏华新能源份额的份额数为

$$\text{NUM}_{\text{鹏华新能源份额}}^{\text{不定期后}} = \frac{\text{NUM}_{\text{鹏华新能源份额}}^{\text{不定期前}} \times \text{NAV}_{\text{鹏华新能源份额}}^{\text{不定期前}}}{1.000}$$

其中，

$\text{NUM}_{\text{鹏华新能源份额}}^{\text{不定期前}}$ ：不定期份额折算前鹏华新能源份额的份额数，

$\text{NAV}_{\text{鹏华新能源份额}}^{\text{不定期前}}$ ：不定期份额折算前鹏华新能源份额的基金份额净值，

$\text{NUM}_{\text{鹏华新能源份额}}^{\text{不定期后}}$ ：不定期份额折算后鹏华新能源份额的份额数。

## 5、不定期份额折算示例

### (1) 鹏华新能源份额的基金份额净值达到 1.500 元

设在本基金的不定期份额折算日，鹏华新能源份额的基金份额净值、鹏华新能源 A 份额与鹏华新能源 B 份额的基金份额参考净值如下表所示，折算后，鹏华新能源份额的基金份额净值、鹏华新能源 A 份额与鹏华新能源 B 份额的基金份额参考净值均调整为 1.000 元，则各持有鹏华新能源份额、鹏华新能源 A 份额、鹏华新能源 B 份额 10,000 份的基金份额持有人所持基金份额的变化如下表所示：

	折算前		折算后	
	份额净值/ 份额参考净 值	份额数	份额净值/ 份额参考净 值	份额数
鹏华新能源 份额	1.536 元	10,000 份	1.000 元	15,360 份鹏华新能源份额
鹏华新能源 A 份额	1.028 元	10,000 份	1.000 元	10,000 份鹏华新能源 A 份额 +280 份鹏华新能源份额
鹏华新能源 B 份额	2.044 元	10,000 份	1.000 元	10,000 份鹏华新能源 B 份额 +10,440 份鹏华新能源份额

(2) 鹏华新能源 B 份额的基金份额参考净值达到 0.250 元

设在本基金的不定期份额折算日，鹏华新能源份额的基金份额净值、鹏华新能源 A 份额与鹏华新能源 B 份额的基金份额参考净值如下表所示，折算后，鹏华新能源份额的基金份额净值、鹏华新能源 A 份额、鹏华新能源 B 份额的基金份额参考净值均调整为 1.000 元，则各持有鹏华新能源份额、鹏华新能源 A 份额、鹏华新能源 B 份额 10,000 份的基金份额持有人所持基金份额的变化如下表所示：

	折算前		折算后	
	份额净值/ 份额参考净 值	份额数	份额净值/ 份额参考净 值	份额数
鹏华新能源 份额	0.617 元	10,000 份	1.000 元	6,170 份鹏华新能源份额
鹏华新能源 A 份额	1.028 元	10,000 份	1.000 元	2,060 份鹏华新能源 A 份额 +8,220 份鹏华新能源份额
鹏华新能源 B 份额	0.206 元	10,000 份	1.000 元	2,060 份鹏华新能源 B 份额

### (三) 基金份额折算余额的处理方法

份额折算后场外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；场内基金份额的份额数计算结果保留到整数位，余额的处理方法按照深圳证券交易所或基金登记机构的相关规则及有关规定执行。

### (四) 基金份额折算期间的基金业务办理

为保证基金份额折算期间本基金的平稳运作，届时基金管理人可根据深圳证券交易所、基金登记机构的相关业务规定暂停鹏华新能源 A 份额与鹏华新能源 B 份额的上市交易、鹏华新能源份额的申购与赎回、鹏华新能源份额与鹏华新能源 A 份额、鹏华新能源 B 份额的份额配对转换等相关业务，具体见基金管理人届时发布的相关公告。

### (五) 基金份额折算结果的公告

基金份额折算结束后，基金管理人应按照《信息披露办法》在指定媒介公告，并报中国证监会备案。

#### **（六）特殊情形的处理**

若在本基金的定期折算日发生基金合同约定的本基金不定期份额折算的情形时，基金管理人本着维护基金份额持有人利益的原则，可根据具体情况选择按照定期份额折算的规则或者不定期份额折算的规则进行份额折算。

若定期折算日前3个月（含）内发生过不定期折算或基金合同生效日至第1个定期折算日不足3个月的，则可不进行定期折算。若基金管理人在前述情况下决定不进行定期折算的，基金管理人应按信息披露办法的规定在指定媒介上公告不进行定期折算的提示性公告。

#### **（七）其他事项**

基金管理人、深圳证券交易所、基金登记机构有权调整上述规则，本基金基金合同将相应予以修改，且此项修改无须召开基金份额持有人大会，并在本基金更新的招募说明书中列示。

## **十九、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。

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。

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

### **（三）不列入基金费用的项目**

下列费用不列入基金费用：

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

### **（四）基金税收**

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，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。

## **二十、基金的会计与审计**

### **（一）基金的会计政策**

- 1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；
- 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；
- 3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
- 4、会计制度执行国家有关会计制度；
- 5、本基金独立建账、独立核算；
- 6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；
- 7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

## （二）基金的年度审计

1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券从业资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。

2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意。

3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需在 2 个工作日内在指定媒介公告并报中国证监会备案。

# 二十一、基金的信息披露

## （一）信息披露法律依据

本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他有关规定。

## （二）信息披露义务人

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和其他组织。

本基金信息披露义务人按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的媒介和基金管理人、基金托管人的互联网网站（以下简称“网站”）等媒介披露，并保证基金投资者能够按照基金合同约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

## （三）信息披露禁止行为

- 1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
- 2、对证券投资业绩进行预测；
- 3、违规承诺收益或者承担损失；
- 4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构；
- 5、登载任何自然人、法人或者其他组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；
- 6、中国证监会禁止的其他行为。

## （四）信息披露形式

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



本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

## **（五）公开披露的基金信息**

公开披露的基金信息包括：

### **1、基金招募说明书、基金合同、基金托管协议**

（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。

（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。

（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。

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。

### **2、基金份额发售公告**

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。

### **3、基金合同生效公告**

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。

### **4、基金份额上市交易公告书**

鹏华新能源 A 份额与鹏华新能源 B 份额获准在深圳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。

### **5、基金资产净值、基金份额净值、基金份额参考净值**

基金合同生效后，在鹏华新能源 A 份额与鹏华新能源 B 份额开始上市交易前或鹏华新能源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、鹏华新能源份额的基金份额净值、鹏华新能源 A 份额与鹏华新能源 B 份额的基金份额参考净值。

在鹏华新能源 A 份额与鹏华新能源 B 份额开始上市交易后或鹏华新能源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、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日鹏华新能源份额的基金份额净值和基金份额累计净值、鹏华新能源 A 份额与鹏华新能源 B 份额的基金份额参考净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值、鹏华新能源份额的基金份额净值、鹏华新能源 A 份额与鹏华新能源 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、鹏华新能源份额的基金份额净值和基金份额累计净值、鹏华新能源 A 份额与鹏华新能源 B 份额的基金份额参考净值登载在指定媒介上。

#### 6、基金份额申购、赎回价格

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能源份额申购、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。

#### 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

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。

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。

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。

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。

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。

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。

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（包括鹏华新能源份额、鹏华新能源 A 份额、鹏华新能源 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。

#### 8、临时报告

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。

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：

- （1）基金份额持有人大会的召开；
- （2）终止基金合同；
- （3）转换基金运作方式；
- （4）更换基金管理人、基金托管人；
- （5）基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- （6）基金管理人股东及其出资比例发生变更；
- （7）基金募集期延长；
- （8）基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动；
- （9）基金管理人的董事在一年内变更超过百分之五十；
- （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；
- （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；
- （12）基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查；
- （13）基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚，基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚；
- （14）重大关联交易事项；
- （15）基金收益分配事项；

- (16) 管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- (17) 基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；
- (18) 基金改聘会计师事务所；
- (19) 变更基金销售机构；
- (20) 更换基金登记机构；
- (21) 本基金开始办理申购、赎回；
- (22) 本基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；
- (23) 本基金发生巨额赎回并延期支付；
- (24) 本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；
- (25) 本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
- (26) 本基金发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；
- (27) 基金管理人采用摆动定价机制进行估值；
- (28) 本基金开始办理或暂停接受份额配对转换申请；
- (29) 本基金暂停接受份额配对转换申请后重新接受份额配对转换；
- (30) 本基金进行基金份额折算；
- (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；
- (32) 本基金停复牌、暂停上市、恢复上市或终止上市；
- (33) 中国证监会规定的其他事项。

## 9、澄清公告

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。

## 10、基金份额持有人大会决议

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。

## 11、中国证监会规定的其他信息。

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。

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。

#### **（六）信息披露事务管理**

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。

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。

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、鹏华新能源份额申购赎回价格、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。

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。

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。

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。

#### **（七）信息披露文件的存放与查阅**

招募说明书公布后，应当分别置备于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的住所，供公众查阅、复制。

基金定期报告公布后，应当分别置备于基金管理人和基金托管人的住所，以供公众查阅、复制。

## 二十二、风险揭示

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，鹏华新能源 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；鹏华新能源 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。

本基金面临的主要风险有市场风险、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。

### （一）市场风险

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

#### 1、政策风险

因国家宏观政策发生变化，导致市场价格波动而产生风险。

#### 2、经济周期风险

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

#### 3、利率风险

利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动，也影响着企业的融资成本和利润，基金收益水平会受到利率变化的影响。

#### 4、汇率风险

汇率的变化可能对国民经济不同部门造成不同的影响，从而导致基金所投资的上市公司业绩及其股票价格发生波动，使得基金的收益产生变化。

#### 5、上市公司经营风险

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

## 6、购买力风险

因为通货膨胀的影响而导致货币购买力下降，从而使基金的实际收益下降。

### （二）管理风险

在基金管理运作过程中基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的占有和对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平。因此，本基金的收益水平与基金管理人的管理水平、管理手段和管理技术等相关性较大。因此本基金可能因为基金管理人的因素而影响基金收益水平。

### （三）操作风险

在本基金的投资、交易、服务与后台运作等业务过程中，可能因为技术系统的故障或差错导致投资者的利益受到影响。这种风险可能来自基金管理人、基金托管人、证券交易所、登记机构及销售机构等。

### （四）流动性风险

本基金属于开放式基金，在基金的所有开放日，基金管理人都有义务接受投资者的申购和赎回。如果基金资产不能迅速转变成现金，或者变现为现金时使资金净值产生不利的影 响，都会影响基金运作和收益水平。尤其是在发生巨额赎回时，如果基金资产变现能力差，可能会产生基金仓位调整的困难，导致流动性风险，可能影响基金份额净值。

#### （1）拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

本基金是一只股票型基金，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%。本基金的标的指数为中证新能源指数，该指数从可再生能源生产，能源应用、存储及交互设备以及其他相关行业上市公司中选取代表性的 80 只股票，反映新能源产业在 A 股的整体走势，标的指数的成份股及其备选成份股一般情况下具有较好的流动性。

#### （2）实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响

开放式基金要随时应对投资人的赎回，如果基金资产不能迅速转变成现金，或者变现为现金时对基金净值产生不利的影 响，都会影响基金运作和收益水平。尤其是在发生巨额赎回时，如果基金资产变现能力差，可能会产生基金仓位调整的困难，导致流动性风险。

基金管理人经与基金托管人协商，将根据法律法规及基金合同的约定，综合运用各类流动性风险管理工具，对赎回申请等进行适度调整，作为特定情形下基金管理人流动性风险管理的辅助措施，包括但不限于延期办理巨额赎回申请、暂停接受赎回申请、延缓支付赎回款项、收取短期赎回费、暂停基金估值、摆动定价机制及中国证监会认定的其他措施。

基金管理人实施前述备用流动性风险管理工具时，投资者可能面临无法及时赎回、无法全部赎回、或赎回成本相对较高的风险。

### （3）巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

基金管理人已建立内部巨额赎回应对机制，对基金巨额赎回情况进行严格的事前监测、事中管控与事后评估。当基金发生巨额赎回时，基金管理人需要根据实际情况进行流动性评估，确认是否可以接受所有赎回申请。当发现现金类资产不足以支付赎回款项时，需充分评估基金组合资产变现能力、投资比例变动与基金单位份额净值波动的基础上，审慎接受、确认赎回申请，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。巨额赎回情形下，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、部分延期赎回或暂停赎回。同时，如本基金单个基金份额持有人在单个开放日申请赎回基金份额超过上一开放日基金总份额（包括鹏华新能源份额、鹏华新能源 A 份额、鹏华新能源 B 份额）10%以上的，基金管理人可对其采取延期办理赎回申请的措施。

## （五）信用风险

基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，都可能导致基金资产损失和收益变化，从而产生风险。

## （六）投资本基金特有的风险

### 1、作为指数基金存在的风险

#### （1）标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险

标的指数并不能完全代表整个股票市场。标的指数成份股的平均回报率与整个股票市场的平均回报率可能存在偏离。

#### （2）标的指数变更的风险

尽管可能性很小，但根据基金合同规定，如出现变更标的指数的情形，本基金将变更标的指数。基于原标的指数的投资政策将会改变，投资组合将随之调整，基金的收益风险特征将与新的标的指数保持一致，投资者须承担此项调整带来的风险与成本。

#### （3）基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

以下因素可能使基金投资组合的收益率与标的指数的收益率发生偏离：

1) 由于标的指数调整成份股或变更编制方法，使本基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度与跟踪误差；

2) 由于标的指数成份股发生配股、增发等行为导致成份股在标的指数中的权重发生变化，使本基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度和跟踪误差；



3) 成份股派发现金红利等将导致基金收益率超过标的指数收益率, 产生正的跟踪偏离度;

4) 由于成份股停牌、摘牌或流动性差等原因使本基金无法及时调整投资组合或承担冲击成本而产生跟踪偏离度和跟踪误差;

5) 由于基金投资过程中的证券交易成本, 以及基金管理费和托管费的存在, 使基金投资组合与标的指数产生跟踪偏离度与跟踪误差;

6) 在本基金指数化投资过程中, 基金管理人的管理能力, 例如跟踪指数的水平、技术手段、买入卖出的时机选择等, 都会对本基金的收益产生影响, 从而影响本基金对标的指数的跟踪程度;

7) 其他因素, 如因受到最低买入股数的限制, 基金投资组合中个别股票的持有比例与标的指数中该股票的权重可能不完全相同; 因缺乏卖空、对冲机制及其他工具造成的指数跟踪成本较大; 因基金申购与赎回带来的现金变动; 因指数发布机构指数编制错误等, 由此产生跟踪偏离度与跟踪误差。

## 2、作为上市基金存在的风险

### (1) 暂停上市或终止上市的风险

在基金合同生效且本基金符合上市交易条件后, 鹏华新能源 A 份额和鹏华新能源 B 份额在深圳证券交易所挂牌上市交易。由于上市期间可能因信息披露导致基金停牌, 投资者在停牌期间不能买卖基金, 产生风险; 同时, 可能因上市后交易对手不足导致基金流动性风险; 另外, 当基金份额持有人将鹏华新能源 A 份额和鹏华新能源 B 份额通过份额配对转换为鹏华新能源份额并转托管至场外后导致场内的基金份额或持有人数不满足上市条件时, 本基金存在暂停上市或终止上市的可能。

### (2) 基金份额折溢价的风险

本基金鹏华新能源 A 份额和鹏华新能源 B 份额在证券交易所的交易价格可能不同于基金份额净值, 从而产生折价或者溢价的情况, 虽然份额配对转换套利机制设计已将基金份额折溢价的风险降至较低水平, 但是该制度不能完全规避该风险的存在。

## 3、作为分级基金存在的风险

### (1) 分级机制风险

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。但由于本基金存在分拆的两类基金份额, 分级机制令两类基金份额具有不同的风险收益特征, 从而带来不同于跟踪标的指数的指数基金的风险: 鹏华新

能源 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；鹏华新能源 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。

#### （2）份额折算风险

1) 本基金份额折算时，投资者所持基金份额可能发生变化，形成与之前所持基金份额组合不同的风险收益特征，从而产生风险；

2) 本基金份额折算时，场外份额数保留至小数点后两位，场内份额数保留至整数位，剩余部分舍弃并计入基金资产。该尾差处理原则可能给投资者带来损失，从而产生风险；

3) 当投资者通过不具有基金销售业务资格的深圳证券交易所会员单位买卖基金份额时，可能无法赎回份额折算后新增的基金份额，从而产生风险。

#### （3）配对转换风险

基金合同生效后，在本基金的存续期内，基金管理人将根据基金合同的约定办理鹏华新能源份额与鹏华新能源 A 份额、鹏华新能源 B 份额之间的配对转换。配对转换业务的办理可能改变鹏华新能源 A 份额和鹏华新能源 B 份额的市场供求关系，影响基金份额的交易价格，从而产生风险；该业务也可能出现暂停办理或申请无法确认的情形，从而产生风险。

#### （七）其他风险

战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金管理人、基金托管人、证券交易所、登记机构及销售代理机构等机构无法正常工作，从而有影响基金的申购和赎回按正常时限完成的风险。

## 二十三、基金的终止与清算

### （一）基金合同的变更

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

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

### （二）基金合同的终止

有下列情形之一的，基金合同应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止的；

2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；

3、基金合同约定的其他情形；

4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### **（三）基金财产的清算**

1、基金财产清算小组：自出现基金合同终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

4、基金财产清算程序：

（1）基金合同终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；

（2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；

（3）对基金财产进行估值和变现；

（4）制作清算报告；

（5）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

（6）将清算报告报中国证监会备案并公告；

（7）对基金财产进行分配。

5、基金财产清算的期限为 6 个月。

### **（四）清算费用**

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

### **（五）基金财产清算剩余资产的分配**

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，分别计算鹏华新能源份额、鹏华新能源 A 份额、鹏华新能源 B 份额各自的应计分配比例，并据此向鹏华新能源份额、鹏华新能源 A 份额、鹏华新能源 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。

## **（六）基金财产清算的公告**

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

## **（七）基金财产清算账册及文件的保存**

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

（八）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。

# **二十四、基金合同的内容摘要**

## **第一部分 基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务**

### **一、基金份额持有人的权利、义务**

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：

- （1）分享基金财产收益；
- （2）参与分配清算后的剩余基金财产；
- （3）依法转让或申请赎回其持有的基金份额；
- （4）按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会；
- （5）出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- （6）查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- （7）监督基金管理人的投资运作；
- （8）对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；
- （9）法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

- （1）认真阅读并遵守基金合同，招募说明书等信息披露文件；

(2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主作出投资决策，自行承担投资风险；

(3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；

(4) 交纳基金认购、申购、赎回款项及法律法规和基金合同所规定的费用；

(5) 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；

(6) 不从事任何有损基金及其他基金合同当事人合法权益的活动；

(7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；

(9) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

## 二、基金管理人的权利、义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

(1) 依法募集资金；

(2) 自基金合同生效之日起，根据法律法规和基金合同独立运用并管理基金财产；

(3) 依照基金合同收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；

(4) 销售基金份额；

(5) 按照规定召集基金份额持有人大会；

(6) 依据基金合同及有关法律规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了基金合同及国家有关法律规规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

(7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

(8) 选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；

(9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得基金合同规定的费用；

(10) 依据基金合同及有关法律规规定决定基金收益的分配方案；

(11) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；

(12) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

(13) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、融券及转融通；

(14) 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

(15) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；

(16) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换和非交易过户等业务的业务规则；

(17) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

(1) 依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

(2) 办理基金备案手续；

(3) 自基金合同生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；

(4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

(5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

(6) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

(7) 依法接受基金托管人的监督；

(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、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，确定鹏华新能源份额申购、赎回的价格；

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(10) 编制季度、半年度和年度基金报告；

(11) 严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

(12) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；

(13) 按基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；

(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

(15) 依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

(16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上；

(17) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照基金合同规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件；

(18) 组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

(19) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

(20) 因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(21) 监督基金托管人按法律法规和基金合同规定履行自己的义务，基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

(22) 当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；

(23) 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；

(24) 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；

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(26) 建立并保存基金份额持有人名册；

(27) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

### 三、基金托管人的权利、义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：

(1) 自基金合同生效之日起，依法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产；

(2) 依基金合同约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用；

(3) 监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人违反基金合同及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

(4) 根据相关市场规则，为基金开设资金账户、证券账户，为基金办理证券交易资金清算；

(5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

(6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(7) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

(2) 设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；

(3) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

(4) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；

(5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

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

(7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；

(8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值、基金份额参考净值、鹏华新能源份额申购、赎回价格；

(9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

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

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



- (12) 建立并保存基金份额持有人名册；
- (13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- (14) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；
- (15) 依据《基金法》、基金合同及其他有关规定，召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
- (16) 按照法律法规和基金合同的规定监督基金管理人的投资运作；
- (17) 参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- (18) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；
- (19) 因违反基金合同导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- (20) 按规定监督基金管理人按法律法规和基金合同规定履行自己的义务，基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿；
- (21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- (22) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

## **第二部分 基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则**

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人大会的审议事项应分别由鹏华新能源份额、鹏华新能源 A 份额、鹏华新能源 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。

本基金份额持有人大会不设日常机构。

### **一、召开事由**

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

- (1) 终止基金合同（法律法规、中国证监会另有规定的除外）；
- (2) 更换基金管理人；
- (3) 更换基金托管人；
- (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）；
- (5) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；
- (6) 变更基金类别；
- (7) 本基金与其他基金的合并（法律法规、中国证监会另有规定的除外）；

- (8) 变更基金投资目标、范围或策略（法律法规、中国证监会另有规定的除外）；
- (9) 变更基金份额持有人大会程序；
- (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；
- (11) 单独或合计持有鹏华新能源份额、鹏华新能源 A 份额、鹏华新能源 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；
- (12) 终止鹏华新能源 A 份额、鹏华新能源 B 份额上市，但因基金不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的除外；
- (13) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
- (14) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

2、以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

- (1) 调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；
- (2) 法律法规要求增加的基金费用的收取；
- (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；
- (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；
- (5) 因相应的法律法规、深圳证券交易所或登记机构的相关业务规则发生变动而应当对基金合同进行修改；
- (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；
- (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。

## 二、会议召集人及召集方式

- 1、除法律法规规定或基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集；
- 2、基金管理人未按规定召集或不能召开时，由基金托管人召集；
- 3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，

基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

4、单独或合计持有鹏华新能源份额、鹏华新能源 A 份额、鹏华新能源 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能源份额、鹏华新能源 A 份额、鹏华新能源 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；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。

5、单独或合计持有鹏华新能源份额、鹏华新能源 A 份额、鹏华新能源 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能源份额、鹏华新能源 A 份额、鹏华新能源 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。

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

### 三、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

- （1）会议召开的时间、地点和会议形式；
- （2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；
- （3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
- （4）授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；
- （5）会务常设联系人姓名及联系电话；
- （6）出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- （7）召集人需要通知的其他事项。

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

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

#### 四、基金份额持有人出席会议的方式

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

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

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

(2) 经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的鹏华新能源份额、鹏华新能源 A 份额、鹏华新能源 B 份额各自基金份额不少于本基金在权益登记日鹏华新能源份额、鹏华新能源 A 份额、鹏华新能源 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能源份额、鹏华新能源 A 份额、鹏华新能源 B 份额各自基金份额少于本基金在权益登记日鹏华新能源份额、鹏华新能源 A 份额、鹏华新能源 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能源份额、鹏华新能源 A 份额、鹏华新能源 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能源份额、鹏华新能源 A 份额、鹏华新能源 B 份额各自基金总份额的三分之一（含三分之一）。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式在表决截至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。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

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

(3) 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的鹏华新能源份额、鹏华新能源 A 份额、鹏华新能源 B 份额各自基金份额不小于在权益登记日鹏华新能源份额、鹏华新能源 A 份额、鹏华新能源 B 份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能源份额、鹏华新能源 A 份额、鹏华新能源 B 份额各自基金份额小于在权益登记日鹏华新能源份额、鹏华新能源 A 份额、鹏华新能源 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）以上鹏华新能源份额、鹏华新能源 A 份额、鹏华新能源 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；

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

3、在法律法规和监管机关允许的情况下，本基金的基金份额持有人亦可采用其他非书面方式授权其代理人出席基金份额持有人大会；在会议召开方式上，本基金亦可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。

## 五、议事内容与程序

### 1、议事内容及提案权

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

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

## 2、议事程序

### (1) 现场开会

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

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

### (2) 通讯开会

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

## 六、表决

基金份额持有人所持每份鹏华新能源份额、鹏华新能源 A 份额、鹏华新能源 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能源份额、鹏华新能源 A 份额、鹏华新能源 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二分之一以上（含二分之一）通过方为有效；除下列第 2 项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的鹏华新能源份额、鹏华新能源 A 份额、鹏华新能源 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。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

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

## 七、计票

### 1、现场开会

（1）如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

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

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

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

### 2、通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证

机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

#### 八、生效与公告

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

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

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

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

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

### **第三部分 基金合同变更和终止的事由、程序**

#### 一、基金合同的变更

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

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

#### 二、基金合同的终止事由

有下列情形之一的，基金合同应当终止：

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



### 三、基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现基金合同终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

#### 4、基金财产清算程序：

- (1) 基金合同终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；
- (2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- (3) 对基金财产进行估值和变现；
- (4) 制作清算报告；
- (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- (6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；
- (7) 对基金财产进行分配。

5、基金财产清算的期限为 6 个月。

### 四、清算费用

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

### 五、基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，分别计算鹏华新能源份额、鹏华新能源 A 份额、鹏华新能源 B 份额各自的应计分配比例，并据此向鹏华新能源份额、鹏华新能源 A 份额、鹏华新能源 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。

### 六、基金财产清算的公告

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

## 七、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

八、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。

## 第四部分 争议解决方式

各方当事人同意，因基金合同而产生的或与基金合同有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，任何一方均有权将争议提交华南国际经济贸易仲裁委员会，按照华南国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为深圳市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

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

基金合同受中国法律管辖。

## 第五部分 基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

基金合同可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅；投资者也可按工本费购买基金合同复制件或复印件，但内容应以基金合同正本为准。

# 二十五、基金托管协议的内容摘要

## 一、托管协议当事人

### （一）基金管理人（也可称资产管理人）

名称：鹏华基金管理有限公司

住所：深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心 43 层

办公地址：深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心 43 层

邮政编码：518048

法定代表人：何如

成立时间：1998 年 12 月 22 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：证监基字〔1998〕31 号文

组织形式：有限责任公司

注册资本：1.5 亿元

存续期间：持续经营

经营范围：基金募集；基金销售；资产管理以及中国证监会许可的其它业务。

（二）基金托管人（也可称资产托管人）

名称：招商银行股份有限公司（简称：招商银行）

住所：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

邮政编码：518040

法定代表人：李建红

成立时间：1987 年 4 月 8 日

基金托管业务批准文号：证监基金字[2002]83 号

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务。外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外币兑换；国际结算；结汇、售汇；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营和代客外汇买卖；资信调查、咨询、见证业务；离岸金融业务。经中国人民银行批准的其他业务。

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币 252.20 亿元

存续期间：持续经营

## 二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

（一）基金托管人根据有关法律法规的规定以及基金合同的约定，对基金投资范围、投资比例、投资风格、投资限制、关联方交易等，进行严格监督。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应事先或定期向基金托管人提供投资品种池，以便基金托管人对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督。

1. 本基金的投资范围为：

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。

2. 本基金各类品种的投资比例、投资限制为：

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。

基金的投资组合应遵循以下限制：

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

（2）每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，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。

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

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

3. 本基金财产不得用于以下投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但是国务院证券监督管理机构另有规定的除外；
- (5) 向基金管理人、基金托管人出资；
- (6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (7) 法律、行政法规或者国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

4. 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其他重大利害关系的公司发行或承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当遵循基金份额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，符合国务院证券监督管理机构的规定，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。

5. 基金管理人应当自基金合同生效日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。因证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致投资组合不符合上述规定的，基金管理人应在 10 个交易日内进行调整。法律法规另有规定的，从其规定。

6. 如果法律法规及监管政策等对基金合同约定的投资禁止行为和投资组合比例限制进行变更的，本基金可相应调整禁止行为和投资比例限制规定，不需经基金份额持有人大会审议。《基金法》及其他有关法律法规或监管部门取消上述限制的，履行适当程序后，基金不受上述限制。

(二) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定, 对基金管理人选择存款银行进行监督。基金投资银行定期存款的, 基金管理人应根据法律法规的规定及基金合同的约定, 确定符合条件的所有存款银行的名单, 并及时提供给基金托管人, 基金托管人应据以对基金投资银行存款的交易对手是否符合有关规定进行监督。对于不符合规定的银行存款, 基金托管人可以拒绝执行, 并通知基金管理人。

本基金投资银行存款应符合如下规定:

1. 本基金的存款银行应是具有证券投资基金托管资格、证券投资基金代销业务资格或合格境外基金投资人托管人资格的商业银行。

2. 单只基金投资定期存款的比例不得超过基金资产净值的 30%; 存放在具有基金托管资格的同一银行存款不得超过基金资产净值的 30%。

有关法律法规或监管部门制定或修改新的定期存款投资政策, 基金公司履行适当程序后, 可相应调整投资组合限制的规定。

3. 基金管理人负责对本基金存款银行的评估与研究, 建立健全银行定期存款的业务流程、岗位职责、风险控制措施和监察稽核制度, 切实防范有关风险。基金托管人负责对本基金银行定期存款业务的监督与核查, 审查、复核相关协议、账户资料、投资指令、存款证实书等有关文件, 切实履行托管职责。

(1) 基金管理人负责控制信用风险。信用风险主要包括存款银行的信用等级、存款银行的支付能力等涉及到存款银行选择方面的风险。因选择存款银行不当造成基金财产损失的, 由基金管理人承担责任。

(2) 基金管理人负责控制流动性风险, 并承担因控制不力而造成的损失。流动性风险主要包括基金管理人要求全部提前支取、部分提前支取或到期支取而存款银行未能及时兑付的风险、基金投资银行存款不能满足基金正常结算业务的风险、因全部提前支取或部分提前支取而涉及的利息损失影响估值等涉及到基金流动性方面的风险。

(3) 基金管理人须加强内部风险控制制度的建设。如因基金管理人员的个人行为导致基金财产受到损失的, 需由基金管理人承担由此造成的损失。

(4) 基金管理人投资银行存款时, 应就相关事宜在更新招募说明书中予以披露, 进行风险揭示。

(5) 基金管理人与基金托管人在开展基金存款业务时, 应严格遵守《基金法》、《运作办法》等有关法律法规, 以及国家有关账户管理、利率管理、支付结算等的各项规定。

（三）基金投资银行存款协议的签订、账户开设与管理、投资指令与资金划拨、账目核对、到期兑付、提前支取和文件保管

#### 1. 基金投资银行存款协议的签订

（1）符合资格的存款银行，基金管理人应与存款银行总行或其授权分行签订《基金存款业务总体合作协议》（以下简称《总体合作协议》），确定《存款协议书》的格式范本。《总体合作协议》和《存款协议书》的格式范本由基金托管人与基金管理人共同商定。

（2）基金管理人应在《存款协议书》中明确存款证实书或其他有效存款凭证的办理方式、邮寄地址、联系人和联系电话，以及存款证实书或其他有效凭证在邮寄过程中遗失后，存款余额的确认及兑付办法。

（3）由存款银行指定的存放存款的分支机构（以下简称“存款分支机构”）寄送存款证实书或其他有效存款凭证的，基金管理人应在《存款协议书》中规定基金托管人可向存款分支机构的上级行发出存款余额询证函，存款分支机构及其上级行应予配合。

（4）基金管理人应在《存款协议书》中规定，基金存放到期或提前兑付的资金应全部划转到指定的基金托管账户，并在《存款协议书》写明账户名称和帐号，未划入指定账户的，由存款银行承担一切责任。

（5）基金托管人依据相关法规对《总体合作协议》和《存款证实书》的内容进行复核，审查存款银行资格等。

#### 2. 基金投资银行存款时的账户开设与管理

（1）基金投资于银行存款时，基金管理人应当依据基金管理人与存款银行签订的《总体合作协议》，以基金的名义在存款银行总行或授权分行指定的分支机构开立银行账户。

（2）银行存款的预留印鉴由基金托管人保管和使用。

#### 3. 存款投资指令的发送与执行

（1）基金管理人发送投资指令应采用加密传真方式或双方约定的其他方式。

存款投资指令包括存款资金划拨指令、提前支取存款指令等。

基金管理人应按照法律法规和基金合同及托管协议的规定向基金托管人发送存款投资指令。对于基金管理人依约定程序发出的指令，基金管理人不得否认其效力。

指令发出后，基金管理人应及时以电话方式向基金托管人确认。

基金管理人在发送投资指令时，应为基金托管人执行投资指令留出执行指令所必需的时间。投资指令传输不及时、未能留出足够的划款时间，导致资金未能及时到账所造成的损失由基金管理人承担。



## （2）投资指令的确认

基金托管人应指定专人接收基金管理人的指令，预先通知基金管理人其名单，并与基金管理人商定指令发送和接收方式。投资指令到达基金托管人后，基金托管人应指定专人立即审慎验证有关内容及印鉴和签名的表面一致性。

## （3）投资指令的执行

基金托管人验证投资指令后，应及时执行。

若因基金托管人过错致使资金未能及时到账或者投资指令执行差错所造成的损失由基金托管人承担。投资指令执行完毕，基金托管人应及时通知基金管理人。

若基金托管人未能执行或仅可部分执行投资指令（无论因基金托管人原因还是基金管理人原因），基金托管人应及时电话通知基金管理人。

## 4. 资金划拨、账目核对及到期兑付

### （1）资金划拨

基金管理人的划拨指令，经基金托管人审核无误后应在规定期限内执行。存款资金只能存放于存款银行总行或者其授权分行指定的分支机构。

### （2）存款证实书等存款凭证领取

存款银行分支机构应为基金开具存款证实书或其他有效存款凭证名称，该存款证实书为基金托管人存款确认或到期提款的有效凭证。资金到账当日，由存款银行分支机构指定的会计主管传真一份存款证实书复印件并与基金托管人电话确认收妥后，用特快专递将存款证实书原件寄送基金托管人指定联系人；若开户行代为保管存单的，由存款行分支机构指定会计主管传真一份存款证实书复印件并与基金托管人电话确认收妥。

### （3）存款证实书等存款凭证的遗失补办

存款证实书在邮寄过程中遗失的，由基金托管人向存款银行提出补办申请，基金管理人应督促存款银行尽快补办存款证实书或基金托管人兑付时可作为兑付依据的存款证明文件，并按以上（2）的方式特快专递给托管人。

### （4）账目核对

每个工作日，基金管理人应与基金托管人核对各项银行存款投资余额及应计利息。

定期存款行应配合基金托管人招商银行股份有限公司对“存款证实书”的询证，并在询证函上加盖定期存款行公章寄送至基金托管人指定联系人。

### （5）到期兑付

基金管理人提前通知基金托管人通过特快专递将存款证实书原件或其他存款证明原件寄给存款银行分支机构指定的会计主管。存款行未收到存款证实书原件的，应与基金托管人电话询问。存款到期前基金管理人与存款行确认存款证实书收到并于到期日兑付存款本息事宜。

基金托管人在存款到期日未收到存款本息或存款本息金额不符时，通知基金管理人与存款行接洽存款到账时间及利息补付事宜。基金管理人应将接洽结果告知基金托管人，基金托管人收妥存款本息的当日通知基金管理人。

存款证实书在邮寄过程中遗失的，存款行应立即通知基金托管人，基金托管人在原存款证实书复印件上加盖公章并出具相关证明文件后，与存款行指定会计主管电话确认后，存款行分支机构应在到期日将存款本息划至指定基金的资金账户。

如果存款到期日为法定节假日，存款行顺延至到期后第一个工作日支付，存款行需按当期利率和实际延期天数支付延期利息。

#### 5. 提前支取

如果在存款期限内，由于基金规模发生缩减的原因或者出于流动性管理的需要等原因，经向存款行说明理由，基金管理人可以提前支取全部或部分资金，但应继续按原有利率计提利息，因提前支取导致的利息损失应由基金管理人承担。

提前支取的具体事项按照基金管理人与存款行签订的《存款协议书》执行。

#### 6. 基金投资银行存款的相关文件保管

(1) 基金资金存入存款银行当日，存款行分支机构开具存款证实书或其他有效存款凭证，同时传真复印件给基金托管人和基金管理人，并寄送原件给基金托管人代为保管；若存款行代为保管存单原件，存款行传真复印件给基金托管人和基金管理人

(2) 存款证实书或其他有效存款凭证原件由基金托管人保管。基金托管人发现基金管理人在选择存款银行时有违反有关法律法规的规定及基金合同的约定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人在 10 个工作日内纠正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在 10 个工作日内纠正的，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有关重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人在 10 个工作日内纠正或拒绝结算，若基金管理人拒不执行造成基金财产的损失，基金托管人不承担任何责任。

(四) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的、经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单并约定各交

易对手所适用的交易结算方式。基金管理人有责任确保及时将更新后的交易对手名单发送给基金托管人，否则由此造成的损失应由基金管理人承担。基金管理人应严格按照交易对手名单的范围在银行间债券市场选择交易对手。基金托管人监督基金管理人是否按事前提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。在基金存续期间基金管理人可以调整交易对手名单，但应将调整结果至少提前一个工作日书面通知基金托管人。新名单确定前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。如基金管理人根据市场需要临时调整银行间债券交易对手名单及结算方式的，应向基金托管人说明理由，并在与交易对手发生交易前3个交易日内与基金托管人协商解决。

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

(五) 基金管理人应当对投资中期票据业务进行研究，认真评估中期票据投资业务的风险，本着审慎、勤勉尽责的原则进行中期票据的投资业务。基金管理人根据法律、法规、监管部门的规定，制定了经公司董事会批准的《中期票据投资管理办法》（以下简称《制度》），以规范对中期票据的投资决策流程、风险控制。基金管理人《制度》的内容与本协议不一致的，以本协议的约定为准。

1. 基金投资中期票据应遵循以下投资限制：

(1) 中期票据属于固定收益类证券，基金投资中期票据应符合法律、法规及基金合同中关于该基金投资固定收益类证券的相关比例；

(2) 基金管理人管理的全部公募基金投资于一家企业发行的单期中期票据合计不超过该期证券的10%。

2. 基金托管人对基金管理人流动性风险处置的监督职责限于：

基金托管人对基金投资中期票据是否符合比例限制进行事后监督，如发现异常情况，应及时以书面形式通知基金管理人。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人接到通知后应及时核对并向基金托管人说明原因和解决措施。基金托管人

有权随时对所通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

3. 如因市场变化，基金管理人投资的中期票据超过投资比例的，基金托管人有权要求基金管理人在 10 个工作日内将中期票据调整至规定的比例要求。

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

（七）基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作违反法律法规、基金合同和本托管协议的规定，应及时以电话提醒或书面提示等方式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到通知后应及时核对并回复基金托管人，对于收到的书面通知，基金管理人应以书面形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限。在上述规定期限内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

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

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

（十）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。

### **三、基金管理人对于基金托管人的业务核查**

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

(二) 基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、基金合同、本协议及其他有关规定时，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正。基金托管人收到书面通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金管理人发出回函，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。

(三) 基金托管人有义务配合和协助基金管理人依照法律法规、基金合同和本托管协议对基金业务执行核查，包括但不限于：对基金管理人发出的书面提示，基金托管人应在规定时间内答复并改正，或就基金管理人的疑义进行解释或举证；基金托管人应积极配合提供相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性。

(四) 基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金托管人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

#### **四、基金财产的保管**

##### **(一) 基金财产保管的原则**

1. 基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。
2. 基金托管人应安全保管基金财产。
3. 基金托管人按照规定开设基金财产投资所需的相关账户。
4. 基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立。
5. 基金托管人根据基金管理人的指令，按照基金合同和本协议的约定保管基金财产。未经基金管理人的正当指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何资产。不属于基金托管人实际有效控制下的资产及实物证券等在基金托管人保管期间的损坏、灭失，基金托管人不承担由此产生的责任。

6. 对于因为基金投资产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金账户的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。基金管理人未及时催收给基金财产造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金财产的损失。

7. 基金托管人对因为基金管理人投资产生的存放或存管在基金托管人以外机构的委托财产，或交由期货公司或证券公司负责清算交收的委托资产（包括但不限于期货保证金账户内的资金、期货合约等）及其收益；由于该等机构或该机构会员单位等本合同当事人外第三方的欺诈、疏忽、过失或破产等原因给委托财产造成的损失等不承担责任。

8. 除依据法律法规和基金合同的规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

## （二）基金募集期间及募集资金的验资

1. 基金募集期间募集的资金应开立“基金募集专户”。该账户由基金管理人开立并管理。

2. 基金募集期满或基金停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，基金管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人为基金开立的基金资金账户，同时在规定时间内，基金管理人应聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的 2 名或 2 名以上中国注册会计师签字方为有效。

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

## （三）基金资金账户的开立和管理

1. 基金托管人以本基金的名义在其营业机构开立基金的银行账户（也可称为“托管账户”），保管基金的银行存款，并根据基金管理人的指令办理资金收付。托管账户名称应为“鹏华中证新能源指数分级证券投资基金”，预留印鉴为托管人印章。

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

3. 基金资金账户的开立和管理应符合法律法规及银行业监督管理机构的有关规定。

## （四）基金证券账户和结算备付金账户的开立和管理

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

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

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

4. 基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，并代表所托管的基金完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清算工作，

基金管理人应予以积极协助。结算备付金、结算互保基金、交收价差资金等的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

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

#### （五）债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后，基金托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司的有关规定，以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司开立债券托管账户，并代表基金进行银行间市场债券的结算。

#### （六）其他账户的开立和管理

1. 基金管理人根据投资需要按照规定开立期货保证金账户及期货交易编码等，基金托管人按照规定开立期货结算账户等投资所需账户。完成上述账户开立后，基金管理人应以书面形式将期货公司提供的期货保证金账户的初始资金密码和保证金监控中心的登录用户名及密码告知基金托管人。资金密码和保证金监控中心登录密码重置由管理人进行，重置后务必及时通知托管人。

基金托管人和基金管理人应当在开户过程中相互配合，并提供所需资料。管理人保证所提供的账户开户材料的真实性和有效性，且在相关资料变更后及时将变更的资料提供给托管人。

2. 因业务发展需要而开立的其他账户，可以根据法律法规和基金合同的规定，由基金管理人协助基金托管人按照有关法律法规和本协议的约定协商后开立。新账户按有关规定使用并管理。

2. 法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

#### （七）基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券等有价凭证按约定由基金托管人存放于基金托管人的保管库，或存入中央国债登记结算有限责任公司、中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司或票据营业中心的代保管库，实物保管凭证由基金托管人持有。实物证券等有价凭证的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。基金托管人对由上述存放机构及基金托管人以外机构实际有效控制的有价凭证不承担保管责任。

#### （八）与基金财产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的、与基金财产有关的重大合同的原件分别由基金管理人、基金托管人保管。除本协议另有规定外，基金管理人代表基金签署的与基金财产有关的重大合同应保证基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人应在重大合同签署后及时将重大合同传真给基金托管人，并在三十个工作日内将正本送达基金托管人处。因基金管理人发送的合同传真件与事后送达的合同原件不一致所造成的后果，由基金管理人负责。重大合同的保管期限为基金合同终止后 15 年。

## 五、基金资产净值计算与复核

### （一）基金资产净值的计算、复核与完成的时间及程序

#### 1. 基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的金额。

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

基金管理人每个工作日计算基金资产净值、各类基金份额的基金份额净值和基金份额参考净值，经基金托管人复核，按规定公告。

#### 2. 复核程序

基金管理人每工作日对基金资产进行估值后，将基金资产净值、各类基金份额的基金份额净值和基金份额参考净值发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

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

### （二）基金资产的估值

基金管理人及基金托管人应当按照基金合同的约定进行估值。

### （三）基金份额净值错误的处理方式

基金管理人及基金托管人应当按照基金合同的约定处理份额净值错误。

### （四）基金会计制度

按国家有关部门规定的会计制度执行。

### （五）基金账册的建立



基金管理人和基金托管人在基金合同生效后，应按照双方约定的同一记账方法和会计处理原则，分别独立地设置、登录和保管本基金的全套账册，对相关各方各自的账册定期进行核对，互相监督，以保证基金资产的安全。若基金管理人和基金托管人对会计处理方法存在分歧，应以基金管理人的处理方法为准。若当日核对不符，暂时无法查找到错账的原因而影响到基金资产净值的计算和公告的，以基金管理人的账册为准。

#### （六）基金财务报表与报告的编制和复核

##### 1. 财务报表的编制

基金财务报表由基金管理人编制，基金托管人复核。

##### 2. 报表复核

基金托管人在收到基金管理人编制的基金财务报表后，进行独立的复核。核对不符时，应及时通知基金管理人共同查出原因，进行调整，直至双方数据完全一致。

##### 3. 财务报表的编制与复核时间安排

基金管理人、基金托管人应当在每月结束后 5 个工作日内完成月度报表的编制及复核；在每个季度结束之日起 15 个工作日内完成基金季度报告的编制及复核；在上半年结束之日起 60 日内完成基金半年度报告的编制及复核；在每年结束之日起 90 日内完成基金年度报告的编制及复核。基金托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，基金管理人和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以国家有关规定为准。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。基金合同生效不足两个月的，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。

（八）基金管理人应每季度向基金托管人提供基金业绩比较基准的基础数据和编制结果。

#### 六、基金份额持有人名册的登记与保管

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

在基金托管人要求或编制半年报和年报前，基金管理人应将有关资料送交基金托管人，不得无故拒绝或延误提供，并保证其的真实性、准确性和完整性。基金管理人和托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。

#### 七、争议解决方法

各方当事人同意，因基金合同而产生的或与基金合同有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，任何一方均有权将争议提交华南国际经济贸易仲裁委员会，按照华南国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为深圳市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

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

本协议受中国法律管辖。

## 八、托管协议的变更与终止

### （一）托管协议的变更程序

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

### （二）基金托管协议终止出现的情形

- 1、基金合同终止；
- 2、基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在6个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务；
- 3、基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在6个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务；
- 4、发生法律法规或基金合同规定的终止事项。

## 二十六、对基金份额持有人的服务

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

### 一、营销创新及网上交易服务

为丰富投资者的交易方式和渠道，基金管理人为投资者提供多种形式的交易服务。

在营销渠道创新方面，本基金管理人大力发展基金电子商务，并已开通基金网上交易系统，投资者可登陆本基金管理人的网站（[www.phfund.com](http://www.phfund.com)），更加方便、快捷地办理基金交易及信息查询等已开通的各项基金网上交易业务。同时，投资者可关注鹏华基金官方微信账号（微信号：[penghuajijin](https://www.phfund.com)），快速实现净值查询功能，绑定个人账户之后，还可实现

账户查询功能和交易功能。基金管理人也将不断努力完善现有技术系统和销售渠道，为投资者提供更加多样化的交易方式和手段。

## 二、信息定制服务

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

## 三、在线咨询服务

投资者可通过在线客服、短信接收平台、鹏华基金官方微信（微信号：penghuajijin）等网络通讯工具进行业务咨询，基金管理人 7\*24 小时提供智能机器人咨询服务，在工作时间内有专人在线提供咨询服务。

## 四、客户服务中心（CALL-CENTER）电话服务

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

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

## 五、客户投诉受理服务

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

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

## 二十七、其他应披露事项

本基金的其他应披露事项将严格按照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》等相关法律法规规定的的内容与格式进行披露，并在指定媒介上公告。

公告内容	报纸	日期
鹏华基金管理有限公司关于调整旗下基金对账单	《证券时报》、《中	2017 年

公告内容	报纸	日期
服务形式的公告	国证券报》、《上海证券报》	11月30日
鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2017年12月12日
鹏华基金管理有限公司关于调整流通受限股票估值方法的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2017年12月26日
鹏华基金管理有限公司关于旗下证券投资基金适用《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》等规范性文件的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2017年12月30日
鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行股份有限公司手机银行渠道基金申购费率优惠活动的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2017年12月30日
鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与东莞农村商业银行股份有限公司手机银行基金认/申购费率优惠活动的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2017年12月30日
鹏华中证新能源指数分级证券投资基金更新的招募说明书摘要	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018年1月11日
鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国国际金融股份有限公司申购费率优惠活动的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018年1月12日
鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018年1月17日
2017年第四季度报告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018年1月22日
鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与湘财证券股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018年1月24日
鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018年1月24日
鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金在上海华信证券有限责任公司开展基金转换费率优惠活动的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018年1月30日
鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018年2月3日
鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018年2月6日

公告内容	报纸	日期
	证券报》	
鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018年2月7日
鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018年2月8日
鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018年2月10日
鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018年3月10日
鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018年3月21日
关于鹏华旗下 139 只基金修改基金合同的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018年3月23日
鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018年3月24日
2017 年年度报告摘要	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018年3月29日
鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与东莞农村商业银行股份有限公司手机银行基金认/申购费率优惠活动的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018年3月31日
鹏华基金管理有限公司关于增加上海万得投资顾问有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018年4月4日
鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中信建投证券股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018年4月9日
鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018年4月11日
鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018年4月14日
鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018年4月18日

公告内容	报纸	日期
2018年第一季度报告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018年4月21日
鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018年4月24日
鹏华基金管理有限公司关于增加上海基煜基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018年4月27日
鹏华基金管理有限公司关于调整旗下部分基金单笔最低转换份额和账户最低余额限制的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018年5月9日
鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018年5月9日
鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国银河证券股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018年5月21日
鹏华基金管理有限公司关于提请投资者及时更新身份证件或者身份证明文件的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018年5月28日

上述披露事项的披露期间自2017年11月29日至2018年5月28日止。

## 二十八、招募说明书的存放及查阅方式

本招募说明书按相关法律法规，分别存放在基金管理人、基金托管人和基金销售机构的住所，投资人可在办公时间免费查阅；也可在支付工本费后在合理时间内获取本招募说明书复制件或复印件，但应以招募说明书正本为准。投资人也可以直接登录基金管理人的网站进行查阅。

基金管理人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

## 二十九、备查文件

### （一）备查文件包括：

- 1、《关于核准鹏华中证新能源指数分级证券投资基金募集的批复》
- 2、《鹏华中证新能源指数分级证券投资基金基金合同》
- 3、《鹏华中证新能源指数分级证券投资基金托管协议》
- 4、法律意见书
- 5、注册登记协议

- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照
- 8、中国证监会要求的其他文件

**(二) 备查文件的存放地点和投资人查阅方式：**

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

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

鹏华基金管理有限公司

2018年7月