

鹏扬景泰成长混合型发起式证券投资基金  
更新的招募说明书  
(2018 年第 2 号)

基金管理人：鹏扬基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

截止日：2018 年 12 月 20 日

## 【重要提示】

1、本基金根据 2017 年 6 月 22 日中国证券监督管理委员会《关于准予鹏扬景泰成长混合型发起式证券投资基金注册的批复》（证监许可[2017] 988 号）进行募集。本基金基金合同于 2017 年 12 月 20 日正式生效，自该日起基金管理人正式开始管理本基金。

2、基金管理人保证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投资价值、市场前景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。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。

3、投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应认真阅读基金合同、本招募说明书等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。投资人需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险。投资本基金可能遇到的风险包括：市场风险、信用风险、管理风险、流动性风险、操作和技术风险、合规性风险等等。

4、本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

5、本基金为发起式基金，在基金募集时，使用基金管理人的股东资金、基金管理人固有资金、基金管理人高级管理人员或基金经理等人员参与认购本基金的金额不低于 1000 万元，认购的基金份额持有期限不低于三年。基金管理人认购的基金份额持有期限满三年后，基金管理人将根据自身情况决定是否继续持有，届时，基金管理人有可能赎回认购的本基金份额。另外，本基金的基金合同生效三年后（指基金合同生效之日起三年后的对应日），若基金资产净值低于两亿元的，基金合同自动终止。投资者将面临基金合同可能终止的不确定性风险。

6、本基金可投资股指期货和国债期货，期货采用保证金交易制度，由于保证金交易具有杠杆性，当出现不利行情时，相关行情微小的变动就可能会使投资人权益遭受较大损失。期货采用每日无负债结算制度，如果没有在规定的时间内补足保证金，按规定将被强制平仓，可能给投资带来重大损失。

7、基金不同于银行储蓄与债券，投资人有可能获得较高的收益，也有可能损失本金。投资有风险，投资人在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的招募说明书及《基金合同》。

8、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新基金业绩表现的保证。

9、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，由投资人自行负责。

10、本招募说明书所载内容截止日为 2018 年 12 月 20 日，有关财务数据和净值表现数据截止日为 2018 年 9 月 30 日（财务数据未经审计）。

## 目 录

第一部分	绪言	1
第二部分	释义	2
第三部分	基金管理人	6
第四部分	基金托管人	12
第五部分	相关服务机构	15
第六部分	基金的募集	25
第七部分	基金合同的生效	26
第八部分	基金份额的申购与赎回	27
第九部分	基金的投资	38
第十部分	基金的业绩	49
第十一部分	基金的财产	50
第十二部分	基金资产的估值	51
第十三部分	基金的收益与分配	56
第十四部分	基金费用与税收	58
第十五部分	基金的会计与审计	60
第十六部分	基金的信息披露	61
第十七部分	风险揭示	67
第十八部分	基金合同的变更、终止与基金财产的清算	71
第十九部分	基金合同的内容摘要	73
第二十部分	基金托管协议的内容摘要	74
第二十一部分	对基金份额持有人的服务	75
第二十二部分	招募说明书存放及查阅方式	77
第二十三部分	其他应披露事项	78
第二十四部分	备查文件	79
附件一	基金合同的内容摘要	80
附件二	基金托管协议的内容摘要	94

## 第一部分 绪言

《鹏扬景泰成长混合型发起式证券投资基金招募说明书》（以下简称“招募说明书”或“本招募说明书”）依照《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“《流动性风险管理规定》”）以及《鹏扬景泰成长混合型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”或《基金合同》）编写。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。

鹏扬景泰成长混合型发起式证券投资基金（以下简称“基金”或“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，并经中国证券监督管理委员会（以下简称“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、义务关系的法律文件。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。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。

## 第二部分 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：指鹏扬景泰成长混合型发起式证券投资基金
- 2、基金管理人：指鹏扬基金管理有限公司
- 3、基金托管人：指中国建设银行股份有限公司
- 4、基金合同：指《鹏扬景泰成长混合型发起式证券投资基金基金合同》及对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《鹏扬景泰成长混合型发起式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：指《鹏扬景泰成长混合型发起式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《鹏扬景泰成长混合型发起式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，并在 2012 年 12 月 28 日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自 2013 年 6 月 1 日起实施，并经 2015 年 4 月 24 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修改的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 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、《流动性管理规定》：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、投资者、投资人：指个人投资者、机构投资者、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

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、转托管及定期定额投资等业务

23、销售机构：指鹏扬基金管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议，代为办理基金销售业务的机构

24、登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等

25、登记机构：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为鹏扬基金管理有限公司或接受鹏扬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鹏扬基金管理有限公司

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

27、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

28、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

29、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

30、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

31、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

32、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

33、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

34、T+n日：指自T日起第n个工作日(不包含T日)

35、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

36、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

37、《业务规则》：指《鹏扬基金管理有限公司开放式基金业务规则》，是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金登记方面的业务规则，由基金管理人、销售机构和投资人共同遵守

38、认购：指在基金募集期内，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

39、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

40、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

41、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

42、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

43、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受理基金申购申请的一种投资方式

44、巨额赎回：指本基金单个开放日，基金净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过上一开放日基金总份额的 10%

45、元：指人民币元

46、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

47、基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收款项及其他资产的价值总和

48、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

49、基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

50、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

51、发起式基金：指符合《运作办法》和中国证监会规定的相关条件而募集、运作，由基金管理人、基金管理人股东、基金管理人高级管理人员或基金经理（指基金管理人员中依法具有基金经理资格者，包括但不限于本基金的基金经理，下同）承诺认购一定金额并持有一定期限的证券投资基金



52、发起资金：指基金管理人股东资金、基金管理人固有资金、基金管理人高级管理人员或者基金经理等人员参与认购的资金。发起资金认购本基金的金额不低于 1000 万元，且发起资金认购的基金份额持有期限不低于三年

53、发起资金提供方：指以发起资金认购本基金且承诺以发起资金认购的基金份额持有期限不少于三年的基金管理人股东、基金管理人、基金管理人高级管理人员或基金经理等人员

54、基金份额的类别：本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别：A 类基金份额和 C 类基金份额。各类基金份额分设不同的基金代码，并分别计算和公布各类基金份额净值和各类基金份额累计净值

55、A 类基金份额：在投资人认购/申购时收取认购/申购费用，而不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额

56、C 类基金份额：在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用，但从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额

57、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

58、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

59、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

60、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

## 第三部分 基金管理人

### 一、基金管理人概况

名称：鹏扬基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区栖霞路 120 号 3 层 302 室

邮政编码：100045

法定代表人：杨爱斌

成立日期：2016 年 7 月 6 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可[2016]1453 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：1.0518 亿元人民币

存续期限：持续经营

联系人：李雯婷

联系电话：010-68105888

### 二、主要人员情况

#### 1、基金管理人董事会成员

范勇宏先生：董事长，经济学博士。现任香山财富研究院联席理事长、宏实资本管理有限公司执行董事兼总经理。曾先后在中国建设银行、华夏证券股份有限公司、华夏基金管理有限公司、中国人寿资产管理有限公司等单位工作。从事金融工作近 30 年，具有比较丰富的金融工作经历。

杨爱斌先生：董事，复旦大学国际金融专业经济学硕士。现任鹏扬基金管理有限公司总经理。历任上海浦东发展银行信贷员、中国平安保险（集团）股份有限公司组合管理部副总经理、华夏基金管理有限公司固定收益投资总监、北京鹏扬投资管理有限公司董事长兼总经理。

姜山先生：董事，美国印第安纳大学商学院工商管理硕士。现任上海华石投资有限公司执行董事兼总经理，北京鹏扬企业管理有限公司总经理。历任安达信华强会计师事务所审计师、美国 Sara Lee 公司内部审计师、瑞银投资银行董事、高盛亚洲有限公司执行董事、美国德州太平洋集团董事及北京代表处首席代表、摩根士丹利华鑫证券有限责任公司投资银行部董事总经理。

李刚先生：董事，中国社科院经济学博士。现任鹏扬基金管理有限公司副总经理。历任中国农业银行资产负债管理部交易员、资金营运部高级交易员、金融市场部处长、副总经理。

董建瑾女士：独立董事，美国伊利诺伊理工学院肯特法学院法学硕士。现任北京观韬律师事务所合伙人。历任北京市新闻出版局科员、北京高华证券有限公司执行董事、上海国际能源交易中心首席律师、北京市君泽君律师事务所合伙人。

邱峻女士：独立董事，美国波士顿学院工商管理硕士。现任信达金誉（上海）投资管理有限公司财务总监。历任安永会计师事务所美国纽约分所高级审计师、高级经理、安永华明会计师事务所上海分所高级经理、蓝山投资咨询（北京）有限公司财务总监。

王鹤菲女士：独立董事，美国斯坦福大学商学院金融系哲学博士。现任中国人民大学国际学院金融学教授。历任美国伊利诺伊大学芝加哥分校商学院金融系助理教授、美联储芝加哥银行访问经济学家、清华大学经济管理学院金融系访问学者、中国投资有限责任公司风险管理部访问经济学家、中国人民大学汉青研究院金融系副教授、副系主任。

## 2、基金管理人监事会成员

王徽先生：监事，江苏大学经济学学士。现任中钰资本管理（北京）股份有限公司合伙人、首席风控官。历任中国华晶电子集团会计、爱韩华电子（无锡）电子有限公司财务经理、江苏苏亚会计师事务所南方分所审计经理、北京中星微电子有限公司财务经理、无锡东林会计师事务所合伙人、利安达会计师事务所（特殊普通合伙）合伙人。王徽先生现担任北京注册会计师协会经济责任审计专业委员会专家委员及北京总会计师协会理事。

吉瑞女士：监事（职工监事），对外经济贸易大学管理学学士。现任鹏扬基金管理有限公司监察稽核部总监。历任安永华明会计师事务所金融审计部审计师，毕马威华振会计师事务所风险咨询部助理经理及高瓴资本管理有限公司法律合规部高级经理。

曹铮女士：监事（职工监事），北京大学经济学学士。现任鹏扬基金管理有限公司人力资源及行政管理部总监。历任国家电网公司监察局文员、北京科舵整合创意咨询有限公司人事助理、索尼爱立信（中国）有限公司人事专员、微软亚洲研究院人事经理、北京鹏扬投资管理公司人力资源及行政管理部总监。

## 3、高级管理人员

杨爱斌先生：总经理，复旦大学国际金融专业经济学硕士。历任上海浦东发展银行信贷员、中国平安保险（集团）股份有限公司组合管理部副总经理、华夏基金管理有限公司固定收益投资总监、北京鹏扬投资管理有限公司董事长兼总经理。

李刚先生：副总经理，中国社科院经济学博士。历任中国农业银行资产负债管理部交易员、资金运营部高级交易员、金融市场部处长、副总经理。

卢安平先生：副总经理兼首席投资官，清华大学工商管理硕士。历任全国社保基金理事会资产配置处长、风险管理处长，中国平安保险（集团）股份有限公司委托与绩效评估部总经理，平安人寿保险股份有限公司委托投资部总经理。

李操纲先生：副总经理，南京大学管理学博士。历任华夏证券股份有限公司资金清算中心总经理、华夏基金管理有限公司副总经理、中国金融在线有限公司首席运营官、阳光保险集团股份有限公司执行委员会委员。

宋震先生：督察长，北京大学数学学院理学学士，中国经济研究中心经济学双学士，北京大学信息科学技术学院工学硕士，曾任 Schlumberger Ltd 工程师、龙翌创富顾问有限公司副总裁、中国证监会北京监管局主任科员。

#### 4、本基金基金经理

卢安平先生：副总经理兼首席投资官，股票投资决策委员会主任委员，清华大学工商管理硕士，西安交通大学工学学士。曾任全国社保基金理事会资产配置处长、风险管理处长，中国平安集团公司委托与绩效评估部总经理，平安人寿保险股份有限公司委托投资部总经理。鹏扬景兴混合型证券投资基金基金经理（2017年9月27日起任职）。鹏扬景升灵活配置混合型证券投资基金基金经理（2018年4月3日起任职）。鹏扬景欣混合型证券投资基金基金经理（2018年5月10日起任职）。

罗成先生：股票投资部基金经理，北京大学计算数学系硕士。历任全国社保基金理事会规划研究部主任科员、中国平安保险（集团）股份有限公司委托投资部投资经理。鹏扬景兴混合型证券投资基金基金经理（2018年3月16日起任职）。

#### 5、投资决策委员会成员情况

##### （1）股票投资决策委员会

卢安平先生：副总经理兼首席投资官，股票投资决策委员会主任委员，清华大学工商管理硕士，西安交通大学工学学士。历任全国社保基金理事会资产配置处长、风险管理处长，中国平安集团公司委托与绩效评估部总经理，平安人寿保险股份有限公司委托投资部总经理。

杨爱斌先生：总经理，复旦大学国际金融专业经济学硕士。历任上海浦东发展银行信贷员、中国平安保险（集团）股份有限公司组合管理部副总经理、华夏基金管理有限公司固定收益投资总监、北京鹏扬投资管理有限公司董事长兼总经理。

罗成先生：股票投资部基金经理，北京大学计算数学系硕士。历任全国社保基金理事会规划研究部主任科员、中国平安保险（集团）股份有限公司委托投资部投资经理。

##### （2）固定收益投资决策委员会

王华先生：固定收益总监、固定收益投资决策委员会主任委员，清华大学理学学士，CFA、FRM，曾任银河期货研究员，银河期货自营子公司固定收益部总经理，北京鹏扬投资管理有限公司衍生品策略部总经理。

杨爱斌先生：总经理，复旦大学国际金融专业经济学硕士。历任上海浦东发展银行信贷员、中国平安保险（集团）股份有限公司组合管理部副总经理、华夏基金管理有限公司固定收益投资总监、北京鹏扬投资管理有限公司董事长兼总经理。

李刚先生：副总经理，中国社科院经济学博士。历任中国农业银行资产负债管理部交易员、资金营运部高级交易员、金融市场部处长、副总经理。

陈钟闻先生：固定收益部执行总经理、现金策略总监，北京理工大学工商管理硕士。曾任北京鹏扬投资管理有限公司交易主管、投资经理。

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

2、办理基金备案手续。

3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资。

4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益。

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告。

6、编制中期和年度基金报告。

7、计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格。

8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项。

9、召集基金份额持有人大会。

10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料。

11、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为。

12、国务院证券监督管理机构规定的其他职责。

### 四、基金管理人的承诺

1、基金管理人承诺不从事违反《中华人民共和国证券法》的行为，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反《中华人民共和国证券法》行为的发生；

2、基金管理人承诺不从事违反《基金法》的行为，并承诺建立健全内部风险控制制度，采取有效措施，防止下列行为的发生：

(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、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。

3、基金管理人承诺严格遵守基金合同，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反基金合同行为的发生；

4、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；

5、基金管理人承诺不从事其他法规规定禁止从事的行为。

### **五、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、不以任何形式为除基金管理人以外的其他组织或个人进行证券交易。

### **六、基金管理人的内部控制制度**

#### **1、内部控制的原则**

(1) 健全性原则：内部控制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、部门和岗位职责保持相对独立，公司基金资产、自有资产、其它资产的运作分离。

(4) 相互制约原则：公司内部部门和岗位的设置权责分明、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、内部控制的主要内容**

##### **(1) 控制环境**

公司董事会高度重视建立完善的公司治理结构与内部控制体系，充分发挥独立董事和监事职能，保护投资人利益和公司合法权益。本公司在董事会下设立了风险管理委员会，负责对公司在经营管理和基金业务运作的合法性、合规性和风险状况进行检查和评估，对公司监察稽核制度的有效性进行评价，监督公司的财务状况，评价公司的财务表现，保证公司的财务运作符合法律法规的要求和通行的会计标准，对公司风险管理制度进行评价和对公司风险管理制度的实施进行检查，评估公司风险管理状况。

公司管理层在总经理领导下，认真执行董事会确定的内部控制战略，为了有效贯彻公司董事会制定的经营方针及发展战略，设立了投资决策委员会。投资决策委员会是公司负责基金投资决策的最高权力机构，根据基金合同和公司的有关规定，确定基金的投资目标和投资原则，决定基金投资的程序与权限设置，审定基金的投资策略与资产配置方案及设定基金投资的限制性指标等。

此外，公司设有督察长，全权负责公司的监察与稽核工作，对公司和基金运作的合法性、合规性及合理性进行全面检查与监督，参与公司风险控制工作，发生重大风险事件时向公司董事长和中国证监会报告。

## （2）风险评估

董事会下属的风险管理委员会和督察长负责对公司内外部风险进行评估。总经理下设风险决策委员会，负责对公司日常经营及基金运作中的风险监测、评估与防范提供意见及建议，审议公司风险控制制度与风险管理流程，对公司经营管理中的重大突发性事件和重大危机情况进行评估，制定危机处理方案并监督实施。公司各部门根据具体情况制定本部门的作业流程及风险控制制度，加强对风险的控制，将风险控制在最小范围内。

## （3）控制活动

控制活动包括授权控制、自我控制、职责分离、实物控制、业绩评价、资产分离及监察稽核等程序或措施。

公司依据自身经营特点设立顺序递进、权责统一、严密有效的三道内控防线：

（1）建立以各岗位目标责任制为基础的第一道监控防线；各岗位均制定详实的操作流程、明确岗位职责，各岗位人员上岗前必须声明已知悉并承诺遵守，在授权范围内承担各自职责；

（2）建立相关部门、相关岗位之间相互监督制衡的第二道监控防线；公司建立重要业务处理凭据传递和信息沟通制度，相关部门和岗位之间相互监督制衡；

（3）建立以督察长和监察稽核部对各岗位、各部门、各机构、各项业务全面实施监督反馈的第三道监控防线；督察长、监察稽核部独立于其它部门和业务活动，并对内部控制制度的执行情况实行严格的检查、反馈和监督。

## （4）信息沟通

公司建立双向的信息交流途径，形成了自上而下的信息传播渠道和自下而上的信息呈报渠道。通过建立有效的信息交流渠道，保证了公司员工及各级管理人员可以充分了解与其职责相关的信息，并及时送达适当的人员进行处理。公司根据组织架构和授权制度，建立了清晰的业务报告系统。

## （5）内部监控

公司设立了独立于各业务部门的监察稽核部，履行监督、稽核职能，检查、评价公司内部控制制度合理性、完备性和有效性，监督公司内部控制制度的执行情况，揭示公司内部管理及基金运作中的相关风险，及时提出改进意见，促进公司内部管理制度有效地执行。监察稽核人员具有相对的独立性，定期不定期出具监察稽核报告。

## （6）法律法规指引

公司严格贯彻基金管理相关的法律法规，严格依法经营。督察长和监察稽核部负责对内部各职能部门和员工的业务活动及岗位行为的合法合规性实施监督检查。

## 第四部分 基金托管人

### 一、基金托管人基本情况

#### (一) 基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司（简称“中国建设银行”）

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：田国立

成立时间：2004 年 9 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

联系人：田青

联系电话：010-67595096

中国建设银行成立于 1954 年 10 月，是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行，总部设在北京。本行于 2005 年 10 月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码 939)，于 2007 年 9 月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码 601939)。

2018 年 6 月末，本集团资产总额 228,051.82 亿元，较上年末增加 6,807.99 亿元，增幅 3.08%。上半年，本集团盈利平稳增长，利润总额较上年同期增加 93.27 亿元至 1,814.20 亿元，增幅 5.42%；净利润较上年同期增加 84.56 亿元至 1,474.65 亿元，增幅 6.08%。

2017 年，本集团先后荣获香港《亚洲货币》“2017 年中国最佳银行”，美国《环球金融》“2017 最佳转型银行”、新加坡《亚洲银行家》“2017 年中国最佳数字银行”、“2017 年中国最佳大型零售银行奖”、《银行家》“2017 最佳金融创新奖”及中国银行业协会“年度最具社会责任金融机构”等多项重要奖项。本集团在英国《银行家》“2017 全球银行 1000 强”中列第 2 位；在美国《财富》“2017 年世界 500 强排行榜”中列第 28 名。

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合与合规管理处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII 托管处、养老金托管处、清算处、核算处、跨境托管运营处、监督稽核处等 10 个职能处室，在安徽合肥设有托管运营中心，在上海设有托管运营中心上海分中心，共有员工 315 余人。自 2007 年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

#### (二) 主要人员情况



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

龚毅，资产托管业务部资深经理（专业技术一级），曾就职于中国建设银行北京市分行国际部、营业部并担任副行长，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，资产托管业务部资深经理（专业技术一级），曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

郑绍平，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部、战略客户部，长期从事客户服务、信贷业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

原玗，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行国际业务部，长期从事海外机构及海外业务管理、境内外汇业务管理、国外金融机构客户营销拓展等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

### （三）基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、(R)QFII、(R)QDII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2018年二季度末，中国建设银行已托管857只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行先后9次获得《全球托管人》“中国最佳托管银行”、4次获得《财资》“中国最佳次托管银行”、连续5年获得中债登“优秀资产托管机构”等奖项，并在2016年被《环球金融》评为中国市场唯一一家“最佳托管银行”、在2017年荣获《亚洲银行家》“最佳托管系统实施奖”。

## 二、基金托管人的内部控制制度

### （一）内部控制目标

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

### （二）内部控制组织结构

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

### （三）内部控制制度及措施

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

## 三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

### （一）监督方法

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

### （二）监督流程

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

2.收到基金管理人的划款指令后，对指令要素等内容进行核查。

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

## 第五部分 相关服务机构

### 一、基金份额销售机构

#### 1、直销机构

(1) 鹏扬基金管理有限公司直销柜台

办公地址：北京市西城区复兴门外大街 A2 号中化大厦 16 层

法定代表人：杨爱斌

全国统一客户服务电话：4009686688

联系人：吴瑞

传真：010-68105966

(2) 鹏扬基金管理有限公司直销电子交易平台

客服电话：4009686688

官方网站：[www.pyamc.com](http://www.pyamc.com)

#### 2、其他销售机构

(1) 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

电 话：0755-82026907

传 真：0755-82026539

客服电话：95532

网址：[www.china-invs.cn](http://www.china-invs.cn)

(2) 上海陆金所基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

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：鲍东华

联系人：程晨

电 话：021-20665952

传 真：021-22066653

客服电话：4008219031

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

## (3) 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 号鄂尔多斯国际大厦 903~906 室

法定代表人：杨文斌

联系人：陆敏

电话：021-20613999

传真：021-68596919

客户服务电话：400-700-9665

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

## (4) 北京肯特瑞基金销售有限公司

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：北京市亦庄经济开发区科创十一街十八号院京东集团总部

法定代表人：江卉

联系人：黄立影

电话：010-89188345

客户服务电话：95118（个人业务）；400 088 8816（企业业务）

网址：<http://fund.jd.com>

## (5) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#

办公地址：北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 A 座 7 层

法定代表人：张彦

联系人：文雯

电话：010-83363101

客户服务电话：：400-116-1188

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

## (6) 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：上海市徐汇区宛平南路 88 号金座东方财富大厦

法定代表人：其实

联系人：何薇

电话：010-65980380-8011

客户服务电话：95021 / 4001818188

网址：<http://www.1234567.com.cn>

## (7) 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 801

办公地址:深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼

法定代表人:薛峰

联系人:童彩平

电话:0755-33227950

客户服务电话:4006-788-887

网址:www.zlfund.cn; www.jjmmw.com

(8) 兴业银行股份有限公司

注册地址:福建省福州市湖东路 154 号中山大厦

办公地址:上海市江宁路 168 号兴业大厦

法定代表人:高建平

联系人:李玮琳

电话:021-52629999-211054

传真:021-62565787

客户服务电话:95561

网址:www.cib.com.cn

(9) 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:北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507

法定代表人:钟斐斐

联系人:袁永姣

电话:15011386983

客户服务电话:4000-618-518

网址: <http://danjuanapp.com>

(10) 凤凰金信(银川)基金销售有限公司

宁夏回族自治区银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路 142 号 14 层 1402(750000)

办公地址:北京市朝阳区紫月路 18 号院 朝来高科技产业园 18 号楼 (100000)

法定代表人:程刚

联系人:张旭

电话:010-58160168

客户服务电话:400-810-5919

网址:www.fengfd.com

(11) 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

电话:010-62675369

客户服务电话:010-62675369

网址:www.xincai.com

(12) 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:北京东城区朝内大街 2 号凯恒中心 B 座 18 层

法定代表人:王常青

联系人:刘芸

电话:010-85156310

传真:010-65182261

客户服务电话:95587/4008-888-108

网址:www.csc108.com

(13) 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:王叔胤

电话:021-33388252

传真:021-33388224

客户服务电话:95523/400-889-5523

网址:www.swhysc.com

(14) 申万宏源西部证券有限公司

注册地址:新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室

办公地址:新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼

法定代表人:韩志谦

联系人:王叔胤

电话:021-33388252

传真：021-33388224

客户服务电话：400-800-0562

网址：www.hysec.com

(15) 奕丰基金销售有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入住深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市南山区海德三道航天科技广场A座17楼1704室

法定代表人：TAN YIK KUAN

联系人：叶健

电话：0755-89460500

客户服务电话：400-684-0500

网址：<https://www.ifastps.com.cn>

(16) 珠海盈米基金销售有限公司

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1201-1203室

法定代表人：肖雯

联系人：邱湘湘

电话：020-89629099

传真：020-89629011

客户服务电话：020-89629066

网址：<https://www.yingmi.cn/>

(17) 众升财富（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区望京东园四区13号楼A座9层908室

办公地址：北京市朝阳区望京浦项中心A座9层04-08

法定代表人：李招弟

联系人：李艳

电话：010-59497361

客户服务电话：400-876-9988

网址：<http://www.zscffund.com/>

(18) 上海挖财基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室

法定代表人：胡燕亮

联系人：孙琦

电话：021-50810687

客户服务电话：021-50810673

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

(19) 上海朝阳永续基金销售有限公司

注册地址：浦东新区上丰路 977 号 1 幢 B 座 812 室

办公地址：上海市浦东新区碧波路 690 号 4 号楼 2 楼

法定代表人：廖冰

注册资本：壹亿元人民币

联系人：裘爱萍

电话：021-80234888-6693

客服电话：400-699-1888

网址：[www.998fund.com](http://www.998fund.com)

(20) 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

注册资本：2000 万元人民币

联系人：吴鸿飞

电话：021-65370077\*268

电子邮件：[wuhongfei@fofund.com.cn](mailto:wuhongfei@fofund.com.cn)

客服电话：4008205369

网址：<https://www.jiyufund.com.cn/>

(21) 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：中国杭州市西湖区西溪路 556 号蚂蚁 Z 空间

法定代表人：陈柏青

联系人：傅强

电话：13811165370

客户服务电话：95188

网址：<http://www.antfortune.com/>

(22) 嘉实财富管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心办公楼二期 53 层 5312-15 单元

办公地址：北京市朝阳区建国路 91 号金地中心 A 座 6 层

法定代表人：赵学军



联系人：余永键

电话：010-85097570

客户服务电话：400-021-8850

网址：<https://www.harvestwm.cn/>

(23) 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

代理法定代表人：毕明建

联系人：杨涵宇

电话：010-65051166

传真：010-85679203

客户服务电话：400-910-1166

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

(24) 上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东南路500号

办公地址：上海市中山东一路12号

法定代表人：高国富

联系人：周志杰

电话：021-61162071

客户服务电话：95528

网址：<http://www.spdb.com.cn/>

(25) 招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道7088号

办公地址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦

法定代表人：李建红

联系人：周嘉谊

电话：0755-83271192

传真：0755-83195049

客户服务电话：95555

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

(26) 中信期货有限公司

注册地址：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室、

14层

办公地址：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室、14层

法定代表人：张皓

联系人：刘宏莹

电话：010-60833754

传真：0755-83217421

客户服务电话：400-990-8826

网址：www.citicsf.com

（27）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

电话：010-60838888

传真：010-6083 6029

客户服务电话：95548

网址：www.cs.ecitic.com

（28）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38-45层

办公地址：深圳市益田路江苏大厦38-46层

法定代表人：霍达

联系人：黄婵君

电话：0755-82943666

传真：0755-83734343

客户服务电话：95565、4008888111

网址：www.newone.com.cn

（29）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

电话：0531-89606165

传真：0532-85022605

客户服务电话：95548

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

(30) 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：郑向溢

电话：0755-82558305

客户服务电话：95517

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

(31) 西藏东方财富证券股份有限公司

注册地址：拉萨市北京中路 101 号

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号金座

法定代表人：陈宏

联系人：付佳

电话：021-23586603

客服电话：95357

网址：[www.18.cn](http://www.18.cn)

(32) 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：唐静

客户服务电话：95321

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

(33) 上海联泰基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

办公地址：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 层

法定代表人：燕斌

联系人：陈东

电话：021-52822063

客服电话：400-166-6788

网址：[www.66liantai.com](http://www.66liantai.com)

(34) 宜信普泽投资顾问（北京）有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809

办公地址：北京市朝阳区建国路 88 号 SOHO 现代城 C 座 1809

法定代表人：戎兵

联系人：魏晨

电话：010-52413385

客服电话：400-6099-200

网址：www.yixinfund.com

## 二、登记机构

名称：鹏扬基金管理有限公司

法定代表人：杨爱斌

全国统一客户服务电话：4009686688

联系人：韩欢

传真：010-68105932

## 三、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海源泰律师事务所

注册地址：上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼

负责人：廖海

电话：021-51150298

传真：021-51150398

联系人：刘佳

经办律师：刘佳、范佳斐

## 四、会计师事务所

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室

办公地址：北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室

执行事务合伙人：毛鞍宁

联系电话：（010）58153000

传真电话：（010）85188298

经办注册会计师：王珊珊、贺耀

联系人：贺耀

## 第六部分 基金的募集

本基金由基金管理人按照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同的相关规定，并经中国证监会《关于准予鹏扬景泰成长混合型发起式证券投资基金注册的批复》（证监许可[2017] 988号）注册募集。

### 一、基金类型

混合型发起式证券投资基金

### 二、基金运作方式和类型

契约型开放式

### 三、基金存续期限

不定期

### 四、募集方式及场所

通过各销售机构的基金销售网点或按基金管理人、销售机构提供的其他方式公开发售。基金销售机构办理基金发售业务的地区、网点的具体情况和联系方式，请参见基金份额发售公告以及当地基金销售机构的公告。基金管理人可以根据情况变更、增减销售机构，并另行公告。

### 五、募集对象与募集期

符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、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者。募集期自2017年11月20日至2017年12月15日止。

### 六、发起资金认购

本基金发起资金认购的金额不少于1000 万元，且发起资金认购的基金份额持有期限不少于3 年。其中发起资金指基金管理人的股东资金、基金管理人固有资金、基金管理人高级管理人员或基金经理等人员参与认购的资金。

本基金发起资金的认购情况见《鹏扬景泰成长混合型发起式证券投资基金基金合同生效公告》。

### 七、基金份额类别设置

本基金每份基金份额的初始发售面值为人民币 1.00 元。

## 第七部分 基金合同的生效

### 一、基金合同生效

本基金基金合同于2017年12月20日起正式生效。自基金合同正式生效之日起，本基金管理人正式管理本基金。

### 二、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

基金合同生效之日起三年后的对应日，若基金资产净值低于2亿元，基金合同自动终止并按照本基金合同约定的程序进行清算，且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。

基金合同生效后继续存续的，基金存续期内，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5000万元情形的，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。

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

## 第八部分 基金份额的申购与赎回

### 一、申购与赎回的场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售机构将由基金管理人在相关公告中列明。

基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并予以公告。投资人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。

### 二、申购与赎回的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

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。

#### 2、申购、赎回开始日及业务办理时间

本基金自2018年2月23日起开始办理日常申购和赎回业务。

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。

### 三、申购与赎回的原则

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、赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人认购、申购的先后次序进行顺序赎回；

5、遵循“基金份额持有人利益优先”原则，基金管理人在办理基金份额申购、赎回业务时，如果发生申购、赎回损害持有人利益的情形时，应当及时暂停申购、赎回业务。

6、当本基金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，摆动定价机制的相关原理与操作方法遵循相关法律法规及监管部门、自律组织的规定，具体请参见招募说明书或相关公告。

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。

#### 四、申购与赎回的程序

##### 1、申购和赎回的申请方式

投资人必须根据销售机构规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

##### 2、申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时，必须在规定时间内全额交付申购款项，投资人在规定时间前全额交付申购款项，申购成立；基金份额登记机构确认基金份额时，申购生效。

基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；基金份额登记机构确认赎回时，赎回生效。投资人赎回申请生效后，基金管理人将在 T+7 日(包括该日)内支付赎回款项。在发生巨额赎回或基金合同约定的延缓支付赎回款项时，款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。

遇交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其它非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程，则赎回款项划付时间相应顺延。

##### 3、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T 日)，在正常情况下，本基金登记机构在 T+1 日内对该交易的有效性进行确认。T 日提交的有效申请，投资人应在 T+2 日后(包括该日)及时到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功或无效，则申购款项本金退还给投资人。

销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购、赎回的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资者应及时查询并妥善行使合法权利。

基金管理人可以在法律法规和基金合同允许的范围内，对上述业务办理时间进行调整，并在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

##### 4、申购与赎回的登记

投资人申购基金成功后，登记机构在 T+1 日为投资人登记权益并办理登记手续，投资人自 T+2 日(含该日)后有权赎回该部分基金份额。

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



基金管理人可以在法律法规允许的范围内，对上述登记办理时间进行调整，但不得实质影响投资人的合法权益，并最迟于开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

## 五、申购与赎回的数额限制

1、本基金目前对单个投资人累计持有份额不设上限限制，但单个投资人累计份额（各类份额合并计算）占基金总份额（各类份额合并计算）的比例不得达到或超过50%，若单个投资人某笔申购后导致该投资人累计份额占基金总份额比例达到或超过50%，基金管理人有权对此笔申购部分确认或不予确认，以确保单个投资人累计份额占基金总份额比例低于50%。基金管理人可以规定单个投资人累计持有的基金份额数量限制，具体规定见定期更新的招募说明书或相关公告；

2、投资人通过基金管理人的直销电子交易平台（目前仅对个人投资者开通）和其他销售机构首次申购本基金A类、C类基金份额的单笔最低限额为人民币10元，追加购买本基金A类、C类基金份额的最低金额为人民币10元；投资人通过基金管理人的直销柜台首次申购本基金A类、C类基金份额的单笔最低限额为人民币5万元，追加购买本基金A类、C类基金份额的最低金额为人民币10元。各销售机构对最低申购限额及交易级差有其他规定的，以各销售机构的业务规定为准。投资人将当期分配的基金收益再投资或采用定期定额投资计划时，不受最低申购金额限制。

3、投资人赎回本基金各类基金份额时，可申请将其持有的部分或全部基金份额赎回，每类基金份额单笔赎回不得少于10份；本基金A类、C类基金份额账户最低余额为10份，若某笔赎回将导致投资人在销售机构托管的A类、C类基金份额余额不足10份时，该笔赎回业务应包括账户内全部该类基金份额，否则基金管理人有权将剩余部分的该类基金份额强制赎回。

各销售机构对赎回份额限制有其他规定的，以各销售机构的业务规定为准。

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，基金管理人将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。

5、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定进行公告并报中国证监会备案。

## 六、申购和赎回的价格、费用及计算方式

### 1、申购费率

（1）本基金A类基金份额在申购时收取申购费用，申购费率最高不超过1.20%，且随申购金额的增加而递减，如下表所示：

A类基金份额	
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1,000 元

(2) 本基金C类基金份额不收取申购费用。

(3) 申购费用不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用，投资人一天内有多笔申购A类基金份额的，须按每次申购所应对的费率档次分别计费。

## 2、赎回费率

本基金A类，C类基金份额的赎回费率见下表。

A类基金份额		C类基金份额
持有期限（Y）	赎回费率	赎回费率
Y < 7 日	1.5%	1.5%
7 日 ≤ Y < 30 日	0.75%	0.5%
30 日 ≤ Y < 180 日	0.50%	0%
Y ≥ 180 日	0%	

对于A类基金份额持有人，对持续持有期少于30日的投资人收取的赎回费全额计入基金财产；对持续持有期不少于30日但少于90日的投资人收取的赎回费的75%计入基金财产；对持续持有期不少于90日但少于180日的投资人收取的赎回费的50%计入基金财产。

对C类基金份额持有人收取的赎回费全额计入基金财产。

基金管理人可以在法律法规和基金合同规定范围内调整费率或收费方式。费率或收费方式如发生变更，基金管理人最迟应在新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

## 3、本基金申购份额的计算方式

### (1) A类基金份额

申购费用适用比例费率时：

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A类基金份额净值

申购费用适用固定金额时：

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A类基金份额净值

申购份额的计算结果均按照四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

例1：假设某投资人投资10万元申购本基金A类基金份额，申购当日本基金A类基金份额净值为1.0160元，对应的本次申购费率为1.20%，则可得到的申购份额为：

净申购金额 =  $100,000 / (1 + 1.20\%) = 98,814.23$ 元

申购费用 =  $100,000 - 98,814.23 = 1,185.77$ 元

申购份额 =  $98,814.23 / 1.0160 = 97,258.10$ 份

即：投资人投资10万元申购本基金A类基金份额，假设申购当日本基金A类基金份额净值为1.0160元，则其可得到97,258.10份A类基金份额。

## （2）C类基金份额

申购份额 = 申购金额 / 申购当日C类基金份额净值

申购份额的计算结果均按照四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

例2：假设某投资人投资500万元申购本基金C类基金份额，申购当日本基金C类基金份额净值为1.0112元，则可得到的申购份额为：

申购份额 =  $5,000,000 / 1.0112 = 4,944,620.25$ 份

即：投资人投资500万元申购本基金C类基金份额，假设申购当日本基金C类基金份额净值为1.0112元，则其可得到4,944,620.25份C类基金份额。

（3）出现巨额赎回时，申购份额计算按照巨额赎回的条款执行。

## 4、赎回金额的计算方式：

### （1）赎回A类基金份额

赎回总金额 = 赎回份额 × 赎回当日A类基金份额净值

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

赎回金额计算结果均按照四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

例3：某投资人赎回本基金10万份A类基金份额，持有时间为5天，对应的赎回费率为1.50%，假设赎回当日A类基金份额净值是1.0175元，则其可得到的赎回金额为：

赎回总金额 =  $100,000 \times 1.0175 = 101,750.00$ 元

赎回费用 =  $101,750 \times 1.50\% = 1526.25$ 元

净赎回金额 =  $101,750.00 - 1526.25 = 100,223.75$ 元

即：投资人赎回本基金10万份A类基金份额，持有时间为5天，假设赎回当日A类基金份额净值是1.0175元，则其可得到的赎回金额为100,223.75元。

#### (2) 赎回C类基金份额

赎回总金额=赎回份额×赎回当日C类基金份额净值

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

赎回金额计算结果均按照四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

例4：某投资人赎回本基金10万份C类基金份额，持有时间为35天，对应的赎回费率为0，假设赎回当日C类基金份额净值是1.0185元，则其可得到的赎回金额为：

赎回总金额=100,000×1.0185=101,850.00 元

赎回费用=101,850×0=0 元

净赎回金额=101,850.00－0=101,850.00元

即：投资人赎回本基金10万份C类基金份额，持有时间为35天，假设赎回当日C类基金份额净值是1.0185元，则其可得到的赎回金额为101,850.00元。

(3) 出现巨额赎回时，赎回金额的计算按照巨额赎回的条款执行。

#### 5、基金份额净值的计算

本基金各类基金份额净值的计算，保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。出现巨额赎回时，基金份额净值按照巨额赎回的条款执行。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。

6、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金的销售费率。

#### 七、拒绝或暂停申购的情形及处理

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工作。
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况。
- 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，从而损害现有基金份额持有人利益的情形。

6、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或登记机构的异常情况导致基金销售系统、基金登记结算系统、基金会计系统或证券登记结算系统无法正常运行。

7、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。

8、某笔或者某些申购申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单个投资人单日或单笔申购金额上限的。

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，且与基金托管人协商一致的，基金管理人应当暂停接受申购申请。

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、9、10项暂停申购情形之一且基金管理人决定拒绝或暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项本金将退还给投资人。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。

#### **八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形及处理**

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。

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、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、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或登记机构的异常情况导致基金销售系统、基金登记结算系统、基金会计系统或证券登记结算系统无法正常运行。

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，基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金申购赎回申请的措施。

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接受赎回申请或延缓支付赎回款项时，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，并以受理赎回申请当日的该类基金份额净值为依据计算赎回金额。若出现上述第4项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份

额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

## 九、巨额赎回的情形及处理方式

### 1、巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过前一开放日的基金总份额的10%，即认为是发生了巨额赎回。

### 2、巨额赎回的处理方式

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

(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，申购份额及赎回金额的计算按照如下方案执行：

(a) 赎回申请日，若已披露的基金份额净值不会影响基金份额持有人相对利益的，按正常赎回程序执行；

例5：某日基金出现巨额赎回，假设基金全部份额均为A类基金份额，赎回申请日前一日共有A类基金份额10亿零1000万份，赎回申请日投资人合计申请赎回10亿份，所赎回基金份额均持有时间超过180日，对应的赎回费率为0，赎回申请日投资人合计申请申购1000万元，适用申购费用为1000元，假设赎回申请当日A类基金份额公布的基金份额净值是1.0175元，赎回申请当日的A类基金份额净值若保留八位小数为1.01750032，则投资人可得到的赎回金额为：

赎回总金额 =  $1,000,000,000 \times 1.0175 = 1,017,500,000.00$  元

赎回费用 =  $1,017,500,000 \times 0 = 0$  元

净赎回金额 =  $1,017,500,000.00 - 0 = 1,017,500,000.00$ 元

投资人申购份额为：

申购费用 = 1,000

净申购金额 =  $10,000,000 - 1,000 = 9,999,000$

申购份额 =  $9,999,000 / 1.0175 = 9,827,027.03$ 份

即：赎回申请日，若已披露的基金份额净值不会影响基金份额持有人相对利益的，按正常赎回程序执行，赎回总金额为1,017,500,000.00 元，申购总份额为9,827,027.03份。

(b) 赎回申请日，若已披露的基金份额净值会影响基金份额持有人相对利益的，遵循“基金份额持有人利益优先”原则，基金管理人有权采用更精确的基金份额净值计算当日的赎回金额和申购、定期定额申购份额。在这种情况下，基金管理人应当通过

邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在3个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在指定媒介上刊登公告。

例6：某日基金出现巨额赎回，假设基金全部份额均为A类基金份额，赎回申请日前一日共有A类基金份额10亿零100万份，赎回申请日投资人合计申请赎回10亿份，所赎回基金份额均持有时间超过180日，对应的赎回费率为0，赎回申请日投资人合计申请申购100万元，适用申购费率为0.60%，假设赎回申请当日A类基金份额公布的基金份额净值是1.0175元，赎回申请当日的A类基金份额净值若保留八位小数为1.01745001，若按照1.0175的份额净值进行赎回，则赎回申请日次日A类基金份额的基金份额净值变为0.9923，基金管理人决定采用保留八位小数的基金份额净值计算当日的赎回金额和申购份额，则投资人可得到的赎回金额为：

$$\text{赎回总金额} = 1,000,000,000 \times 1.01745001 = 1,017,450,010.00 \text{ 元}$$

$$\text{赎回费用} = 1,017,450,010 \times 0 = 0 \text{ 元}$$

$$\text{净赎回金额} = 1,017,450,010.00 - 0 = 1,017,450,010.00 \text{ 元}$$

投资人申购份额为：

$$\text{净申购金额} = 1,000,000 / (1 + 0.60\%) = 994,035.79$$

$$\text{申购费用} = 1,000,000 - 994,035.79 = 5,964.21$$

$$\text{申购份额} = 994,035.79 / 1.01745001 = 976,987.35$$

即：赎回申请日，若按照已披露的基金份额净值计算赎回总金额，会影响剩余基金份额持有人相对利益的，基金管理人决定采用保留八位小数的基金份额净值计算当日的赎回金额和申购份额，赎回总金额为1,017,450,010.00元，申购总份额为976,987.35份。次日A类的基金份额净值为1.0175，未产生对持有人的较大影响。

(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的10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。若基金发生巨额赎回，对于单个基金份额持有人当日赎回申请超过上一开放日基金总份额10%以上的部分，将自动进行延期办理。对于其余当日非自动延期办理的赎回申请，应当按单个账户非自动延期办理的赎回申请量占非自动延期办理的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该类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。

### 3、巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回并延缓支付赎回款项时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个工作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。

## 十、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，并在规定期限内在指定媒介上刊登暂停公告。

2、上述暂停申购或赎回情况消除的，基金管理人应于重新开放日公布最近 1 个开放日各类基金份额的基金份额净值。

3、基金管理人可以根据暂停申购或赎回的时间，依照《信息披露办法》的有关规定，最迟于重新开放日在指定媒介上刊登重新开放申购或赎回的公告；也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间，届时不再另行发布重新开放的公告。

## 十一、基金转换

基金管理人已于 2018 年 2 月 23 日起开通本基金的转换业务，具体内容详见 2018 年 2 月 22 日发布的《鹏扬景泰成长混合型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告》和其他有关本基金转换业务公告。

## 十二、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。

## 十三、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的标准收取转托管费。

## 十四、定期定额投资计划



基金管理人已于 2018 年 2 月 23 日起开通本基金的定期定额投资业务，具体内容详见 2018 年 2 月 22 日发布的《鹏扬景泰成长混合型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告》和其他有关本基金定期定额投资业务的公告。

#### **十五、基金份额的冻结、解冻与质押**

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。基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益一并冻结，被冻结部分份额仍然参与收益分配与支付。法律法规另有规定的除外。

如相关法律法规允许基金管理人办理基金份额的质押业务或其他基金业务，基金管理人将制定和实施相应的业务规则。

#### **十六、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。

## 第九部分 基金的投资

### 一、投资目标

本基金在控制风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争实现基金资产的长期稳健增值。

### 二、投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持债券、可转债、可交换债、可分离交易可转债的纯债部分及其他经中国证监会允许投资的债券）、衍生品（包括权证、股指期货、国债期货等）、货币市场工具（含同业存单）、资产支持证券、债券质押式及买断式回购以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金股票投资占基金资产的比例为50%-95%，每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有现金以及到期日在1年以内的政府债券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。

### 三、投资策略

#### （一）类属资产配置策略

基金管理人通过对经济周期及资产价格发展变化的理解，在把握经济周期性波动的基础上，动态评估不同资产类别在不同时期的投资价值、投资时机以及其风险收益特征，追求稳健增长。

1、当宏观基本面向好、GDP稳步增长且预期股票市场趋于上涨时，本基金将主要投资于股票市场，分享股票市场上涨带来的收益；

2、当宏观基本面一般、GDP增长缓慢且预期股票市场趋于下跌时，本基金将采取相对稳健的做法，减少股票投资比例，增加债券或现金类资产比例，避免投资组合的损失；

3、在预期股票市场和债券市场都存在下跌风险时，本基金将减少股票和债券的持有比例，除现金资产外，增加债券回购、央行票据等现金类资产的比例。

基于基金管理人对经济周期及资产价格发展变化的深刻理解，通过定性和定量的方法分析宏观经济、资本市场、政策导向等各方面因素，建立基金管理人对各大类资产收益的绝对或相对预期，决定各大类资产配置权重。

## （二）股票投资策略

本基金基于成长投资的理念，本基金的股票资产主要投资于优选行业中的绩优股票。本基金将选择在行业中具备竞争优势、成长性良好和估值合理的股票。具体策略如下：

### 1、行业精选策略

本基金将把握中长期中国经济结构调整的方向，通过对宏观经济运行趋势、产业环境、产业政策和行业竞争格局等因素的分析，确定宏观及行业经济变量对不同行业的潜在影响，判断各行业的相对投资价值与投资时机。本基金从经济周期因素、行业政策因素和行业基本面（包括行业生命周期、行业发展趋势和发展空间、行业内竞争态势、行业收入及利润增长情况等）三个方面评估行业的成长性。

### 2、个股精选策略

公司的成长性最终体现为利润的增长。因此，本基金将预期主营业务收入增长率和预期主营业务利润率作为企业成长性考察的主指标，并结合税后利润增长率、净资产收益率等指标，筛选出盈利能力超过市场平均水平的上市公司。

### 3、事件投资策略

随着资本市场的发展壮大，对资本市场有冲击效应的事件也发生的越来越频繁，投资者面临的实践性投资机会也层出不穷。对相关行业有影响力的事件通常有利率政策、行业政策、汇率政策、突发事件等；对股票价格变动有影响力的事件通常有增发、收购兼并、资产注入、整体上市、发行可转债、上市公司业绩公告等；对债券市场有影响力的事件通常有货币政策、利率政策、重要经济数据发布等。通常这些事件都会短暂打破市场均衡价格，本基金通过对历史数据的定量和定性分析，把握事件投资机会。

### 4、定向增发策略

定向增发是指上市公司向特定投资者（包括大股东、机构投资者、自然人等）非公开发行股票融资的方式。本基金将对进行非公开发行的上市公司进行基本面分析，结合市场未来走势进行判断，从战略角度评估参与定向增发的预期中签情况、预期损益和风险水平，积极参与风险较低的定向增发项目。在定向增发股票锁定期结束后，本基金将根据对股票内在投资价值和成长性的判断，结合股票市场环境的分析，选择适当的时机卖出。

## （三）债券投资策略

### 1、买入持有策略

以简单、低交易成本为原则，挑选符合投资需求的标的债券，持有到期后再转而投资新的标的债券。

### 2、久期调整策略

根据对市场利率水平的预期，在预期利率下降时，增加组合久期，以较多地获得债券价格上升带来的收益，在预期利率上升时，减小组合久期，以规避债券价格下降的风险。

### 3、收益率曲线配置

在久期确定的基础上，根据对收益曲线形状变化的预测，确定采用子弹型策略、哑铃型策略和梯形策略，在长期、中期和短期债券间进行配置，以从长、中、短期债券的相对价格变化中获利。

### 4、板块轮换策略

根据国债、金融债、信用债等不同债券板块之间的相对投资价值分析，增持相对低估的板块，减持相对高估的板块，借以取得较高收益。

### 5、骑乘策略

通过分析收益率曲线各期限段的利差情况，买入收益率曲线最陡峭处所对应的期限债券，随着所持有债券的剩余期限下降，债券的到期收益率将下降，从而获得资本利得。

### 6、个券选择策略

用自下而上的方法选择价值相对低估的债券。通过考察收益率曲线的相对位置和形状，对比不同信用等级、在不同市场交易债券的到期收益率等方法，结合票息、税收、可否回购、嵌入期权等其他决定债券价值的因素，从而发现市场中个券的价值相对低估状况。

### 7、可转债/可交换债投资策略

综合分析可转债/可交换债的债性特征、股性特征等因素的基础上，利用BS公式或二叉树定价模型等量化估值工具评定其投资价值，重视对可转债/可交换债对应股票的分析与研究，选择那些公司和行业景气趋势回升、成长性好、安全边际较高的品种进行投资。对于含回售及赎回选择权的债券，本基金将利用债券市场收益率数据，运用期权调整利差（OAS）模型分析含赎回或回售选择权的债券的投资价值，作为此类债券投资的主要依据。

### 8、融资杠杆策略

通过分析回购品种之间的利差及其变动，结合对年末效应和长假效应的灵活使用，进行中长期回购品种的比例配置，同时在严格控制风险的基础上利用跨市场套利和跨期限套利的机会。

## （四）衍生品投资策略

### 1、股指期货投资策略

在股指期货的投资方面，本基金以投资组合的避险保值和有效管理为目标，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，适当参与股指期货的投资。

(1) 避险保值：利用股指期货，调整投资组合的风险暴露，改善组合的风险收益特性。

(2) 有效管理：利用股指期货流动性好，交易成本低等特点，对投资组合的仓位进行及时调整，提高投资组合的运作效率。

## 2、国债期货投资策略

在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，并积极采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对国债市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

## (五) 资产支持证券投资策略

本基金资产支持证券投资将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析，并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型，评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。

## 四、投资限制

### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

- (1) 本基金股票资产占基金资产的比例为 50%-95%；
- (2) 本基金每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；
- (3) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；
- (4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；
- (5) 本基金持有的全部权证，不得超过基金资产净值的 3%；
- (6) 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%；
- (7) 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%；
- (8) 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%；
- (9) 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%；
- (10) 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%；

(11) 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%；

(12) 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；

(13) 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；

(14) 基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

(15) 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中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

(16) 本基金参与国债期货、股指期货交易时，需遵守下列投资比例限制：

(a) 本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的 15%；本基金在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%；本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债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 30%；

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

(c) 本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货和股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等，如基金未参与股指期货、国债期货交易，则不受上述投资限制；

(d) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）不低于基金资产的 50%且不超过基金资产的 95%；

(e) 本基金所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合关于债券投资比例的有关约定。

(17) 本基金持有的所有流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的 20%；本基金持有的同一流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的 10%；

(18) 本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；

(19) 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款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(20) 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；

(21) 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。

除第(2)、(12)、(19)、(20)条外另有约定外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动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。法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

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。在上述期间内，本基金的投资范围、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，则本基金投资可不再受相关限制或以变更后的规定为准，但须提前公告，不需要经基金份额持有人大会审议。

## 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有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

如法律、行政法规或监管部门取消上述禁止性规定，则本基金可不受上述规定的限制。

## 五、业绩比较基准

沪深 300 指数收益率 \*70%+中债综合指数收益率 \*30%

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,或者市场发生变化导致本业绩比较基准不再适用或本业绩比较基准停止发布、变更名称时,本基金管理人在与基金托管人协商一致,可调整或变更业绩比较基准并及时公告,而无需召开基金份额持有人大会。

## 六、风险收益特征

本基金属于混合型基金,风险与收益高于债券型基金与货币市场基金,低于股票型基金。

## 七、基金管理人代表基金行使相关权利的处理原则及方法

1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使相关权利,保护基金份额持有人的利益;

2、有利于基金财产的安全与增值;

3、不谋求对上市公司的控股,不参与所投资上市公司的经营管理;

4、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

## 八、基金的投资组合报告

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月24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。

以下内容摘自本基金2018年第3季度报告,所列财务数据未经审计。

### (一) 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	624,887,762.39	87.66
	其中:股票	624,887,762.39	87.66
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	50,425,000.00	7.07
	其中:债券	50,425,000.00	7.07
	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	29,000,000.00	4.07
	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	1,226,008.06	0.17
8	其他资产	7,321,675.80	1.03
9	合计	712,860,446.25	100.00

### (二) 报告期末按行业分类的股票投资组合

1、报告期末按行业分类的境内股票投资组合