

鹏扬景兴混合型证券投资基金  
更新的招募说明书  
(2019 年第 1 号)

基金管理人：鹏扬基金管理有限公司  
基金托管人：兴业银行股份有限公司  
截止日：2019 年 3 月 27 日

## 【重要提示】

1、本基金根据 2017 年 6 月 16 日中国证券监督管理委员会《关于准予鹏扬景兴混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2017] 939 号）进行募集。本基金基金合同于 2017 年 9 月 27 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、本基金可投资股指期货，股指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，股价指数微小的变动就可能会使投资人权益遭受较大损失。股指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。

6、本基金可投资国债期货，国债期货采用保证金交易制度，由于保证金交易具有杠杆性，当相应期限国债收益率出现不利变动时，可能会导致投资人权益遭受较大损失。国债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、本基金目标客户不包括特定的机构投资者。

11、本招募说明书所载内容截止日为 2019 年 3 月 27 日，有关财务数据和净值表现数据截止日为 2018 年 12 月 31 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	26
第七部分	基金合同的生效	27
第八部分	基金份额的申购与赎回	28
第九部分	基金的投资	39
第十部分	基金的业绩	49
第十一部分	基金的财产	51
第十二部分	基金资产的估值	52
第十三部分	基金的收益与分配	57
第十四部分	基金费用与税收	59
第十五部分	基金的会计与审计	61
第十六部分	基金的信息披露	62
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	70
第十九部分	基金合同的内容摘要	72
第二十部分	基金托管协议的内容摘要	73
第二十一部分	对基金份额持有人的服务	74
第二十二部分	招募说明书存放及查阅方式	76
第二十三部分	其他应披露事项	77
第二十四部分	备查文件	78
附件一	基金合同的内容摘要	79
附件二	基金托管协议的内容摘要	99

## 第一部分 绪言

《鹏扬景兴混合型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《鹏扬景兴混合型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。

鹏扬景兴混合型证券投资基金（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：指鹏扬景兴混合型证券投资基金
- 2、基金管理人：指鹏扬基金管理有限公司
- 3、基金托管人：指兴业银行股份有限公司
- 4、基金合同：指《鹏扬景兴混合型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《鹏扬景兴混合型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 6、招募说明书：指《鹏扬景兴混合型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《鹏扬景兴混合型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、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

52、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

53、**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**

54、**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

55、**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

56、**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



## 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：1.18 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、资金营运部高级交易员、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。

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

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。鹏扬景泰成长混合型发起式证券投资基金基金经理（2018年3月16日起任职）。

焦翠女士：固定收益部基金经理，中国人民大学金融学硕士，曾任北京鹏扬投资管理有限公司交易管理部债券交易员。2016年8月加入鹏扬基金管理有限公司，历任交易管理部债券交易员、固定收益部投资组合经理。鹏扬汇利债券型证券投资基金基金经理（2018年3月16日起任职），鹏扬利泽债券型证券投资基金基金经理（2018年8月23日起任职），鹏扬泓利债券型证券投资基金基金经理（2019年1月4日起任职），鹏扬淳享债券型证券投资基金（2019年3月22日起任职）。

历任基金经理：卢安平先生，任职时间为2017年9月至2019年1月。

## 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。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。

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。

张望先生：股票投资部研究总监，清华大学生物系理学硕士。历任华夏基金化工行业研究员、研究部周期组组长。2015年加入拾贝投资并担任基金经理。

### （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，历任银河期货研究员，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学硕士。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、不得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：兴业银行股份有限公司（以下简称“兴业银行”）

注册地址：福州市湖东路154号

办公地址：上海市江宁路168号

法定代表人：高建平

成立时间：1988年8月22日

注册资本：207.74亿元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基金字[2005]74号

托管部门联系人：刘洁

电话：021-52629999

传真：021-62159217

#### （二）发展概况及财务状况

兴业银行成立于1988年8月，是经国务院、中国人民银行批准成立的首批股份制商业银行之一，总行设在福建省福州市，2007年2月5日正式在上海证券交易所挂牌上市（股票代码：601166），注册资本207.74亿元。

开业二十多年来，兴业银行始终坚持“真诚服务，相伴成长”的经营理念，致力于为客户提供全面、优质、高效的金融服务。截至2017年12月31日，兴业银行资产总额达6.42万亿元，实现营业收入1399.75亿元，全年实现归属于母公司股东的净利润572.00亿元。根据2017年英国《银行家》杂志“全球银行1000强”排名，兴业银行按一级资本排名第28位，按总资产排名第30位，跻身全球银行30强。按照美国《财富》杂志“世界500强”最新榜单，兴业银行以426.216亿美元总营收排名第230位。同时，过去一年在国内外权威机构组织的各项评比中，先后获得“亚洲卓越商业银行”“年度最佳股份制银行”“中国最受尊敬企业”等多项殊荣。

#### （三）托管业务部的部门设置及员工情况

兴业银行股份有限公司总行设资产托管部，下设综合管理处、市场处、委托资产管理处、产品管理处、稽核监察处、运行管理处、养老金管理中心等处室，共有员工100余人，业务岗位人员均具有基金从业资格。

#### （四）基金托管业务经营情况

兴业银行股份有限公司于2005年4月26日取得基金托管资格。基金托管业务批准文号：证监基金字[2005]74号。截至2018年12月31日，兴业银行已托管开放式基金248只，托管基金财产规模8964.38亿元。

## 二、基金托管人的内部控制制度

### （一）内部风险控制目标

作为基金托管人，兴业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）内部风险控制组织结构

兴业银行基金托管业务内部风险控制组织结构由兴业银行审计部、资产托管部内设稽核监察处及资产托管部各业务处室共同组成。总行审计部对托管业务风险控制工作进行指导和监督；资产托管部内设独立、专职的稽核监察处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，具有独立行使监督稽核工作职权和能力。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

### （三）内部风险控制原则

（1）全面性原则：风险控制必须覆盖基金托管部的所有处室和岗位，渗透各项业务过程和业务环节；风险控制责任应落实到每一业务部门和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责。

（2）独立性原则：资产托管部设立独立的稽核监察处，该处室保持高度的独立性和权威性，负责对托管业务风险控制工作进行指导和监督。

（3）相互制约原则：各处室在内部组织结构的设计上要形成一种相互制约的机制，建立不同岗位之间的制衡体系。

（4）定性和定量相结合原则：建立完备的风险管理指标体系，使风险管理更具客观性和操作性。

（5）防火墙原则：托管部自身财务与基金财务严格分开；托管业务日常操作部门与行政、研发和营销等部门严格分离。

（6）有效性原则：内部控制体系同所处的环境相适应，以合理的成本实现内控目标，内部制度的制订应当具有前瞻性，并应当根据国家政策、法律及经营管理的需要，适时进行相应修改和完善；内部控制应当具有高度的权威性，任何人不得拥有不受内部控制约束的权力，内部控制存在的问题应当能够得到及时反馈和纠正。

（7）审慎性原则：内控与风险管理必须以防范风险，审慎经营，保证托管资产的安全与完整为出发点；托管业务经营管理必须按照“内控优先”的原则，在新设机构或新增业务时，做到先期完成相关制度建设。



(8) 责任追究原则：各业务环节都应有明确的责任人，并按规定对违反制度的直接责任人以及对负有领导责任的主管领导进行问责。

### 三、内部风险控制措施实施

1、制度建设：建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度。

2、建立健全的组织管理结构：前后台分离，不同部门、岗位相互牵制。

3、风险识别与评估：稽核监察处指导业务处室进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施。

4、相对独立的业务操作空间：业务操作区相对独立，实施门禁管理和音像监控。

5、人员管理：进行定期的业务与职业道德培训，使员工树立风险防范与控制理念，并签订承诺书。

6、应急预案：制定完备的《应急预案》，并组织员工定期演练；建立异地灾备中心，保证业务不中断。

### 四、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

基金托管人负有对基金管理人的投资运作行使监督权的职责。根据《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定，托管人对基金的投资对象和范围、投资组合比例、投资限制、费用的计提和支付方式、基金会计核算、基金资产估值和基金净值的计算、收益分配、申购赎回以及其他有关基金投资和运作的事项，对基金管理人进行业务监督、核查。

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议和有关法律法规规定的行为，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，基金管理人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内，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。基金管理人违反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。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，通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。

基金托管人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的，应当立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。

## 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

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

网址：www.pyamc.com

#### 2、其他销售机构

(1) 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

(2) 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

(3) 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：宁博宇

电 话：021-20665952

传 真：021-22066653

客服电话：4008219031

网址：www.lufunds.com

(4) 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：徐超逸

电话：021-20613988-6671

传真：021-68596919

客户服务电话：400-700-9665

网址：www.ehowbuy.com

(5) 万家财富基金销售（天津）有限公司

注册地址：天津自贸区（中心商务区）迎宾大道1988号滨海浙商大厦公寓2-2413室

办公地址：北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦5层

法定代表人：李修辞

联系人：王芳芳

电话：010-59013842

传真：021-38909659

客户服务电话：010-59013825

网址：www.wanjiawealth.com

(6) 济安财富（北京）资本管理有限公司

注册地址：北京市朝阳区东三环中路7号4号楼40层4601室

办公地址：北京市朝阳区东三环中路7号北京财富中心A座46层

法定代表人：杨健

联系人：李海燕

电话：010-65309516

传真：010-65330699

客户服务电话：400-673-7010

网址：www.jianfortune.com

(7) 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：fund.jd.com

（8）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

（9）通华财富（上海）基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区同丰路 667 弄 107 号 201 室

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴世纪金融广场杨高南路 799 号 3 号楼 9 楼

法定代表人：马刚

联系人：杨徐霆

电话：021-60818249

客户服务电话：400-66-95156

网址：www.tonghuafund.com

（10）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>

（11）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

(12) 一路财富（北京）信息科技股份有限公司

注册地址：北京市西城区阜成门外大街2号1幢A2208室

办公地址：北京市西城区阜成门外大街2号1幢A2208室

法定代表人：吴雪秀

联系人：徐越

电话：(010)88312877

客户服务电话：400-001-1566

网址：www.yilucaifu.com

(13) 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：021-52629999-21105

传真：021-62565787

客户服务电话：95561

网址：www.cib.com.cn

(14) 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：戚晓强

电话：15810005516

客户服务电话：4000-618-518

网址：danjuanapp.com

(15) 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

(16) 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：毛淮平

联系人：仲秋玥

电话：010-88066632

客户服务电话：400-817-5666

网址：www.amcfortune.com

(17) 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

(18) 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

(19) 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

(20) 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

(21) 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>

(22) 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：[www.yingmi.cn/](http://www.yingmi.cn/)

## (23) 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：[www.zscffund.com/](http://www.zscffund.com/)

## (24) 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

电话：0755-83516289

电子邮件：[jinxia@cgws.com](mailto:jinxia@cgws.com)

客服电话：4006666888

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

## (25) 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)

## (26) 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：余永健

电话：010-85097570

客户服务电话：400-021-8850

网址：[www.harvestwm.cn/](http://www.harvestwm.cn/)

## (27) 国都证券股份有限公司



注册地址:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层

办公地址:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层

法定代表人:王少华

联系人:黄静

电话:010-84183389

传真:010-84183311-3389

客户服务电话:400-818-8118

网址:www.guodu.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)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:www.antfortune.com/

(30)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

客户服务电话:95532

网址:www.china-invs.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

## (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

## (33) 宜信普泽（北京）基金销售有限公司

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

## (34) 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

联系人：吴鸿飞

电话：021-65370077\*268

客服电话：4008205369

网址：www.jiyufund.com.cn

## (35) 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

联系人：陆纪青

电话：021-80234888-6813

客服电话：400-699-1888

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

(36) 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)

(37) 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：杭州市文二西路 1 号 903 室

办公地址：杭州市余杭区五常街道同顺街 18 号同花顺大楼

法定代表人：凌顺平

联系人：洪泓

联系电话：0571-88911818-8659

客服电话：4008-773-772

网址：[www.5ifund.com](http://www.5ifund.com)

(38) 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

电话：021-20315290

客服电话：95538

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

## 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《关于准予鹏扬景兴混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2017] 939号）注册募集。

### 一、基金类型

混合型基金

### 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法，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8月21日至2017年9月22日止。

### 六、基金的最低募集份额和募集金额总额

本基金的最低募集份额总额为2亿份，基金募集金额不少于2亿元人民币。

### 七、基金的初始面值

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9月27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2017年10月31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。

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。具体规定请参见招募说明书或相关公告。

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1.00%，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	1.00%
100 万 ≤ M < 500 万	0.50%
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：

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} / (1 + \text{申购费率})$$

$$\text{申购费用} = \text{申购金额} - \text{净申购金额}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{申购当日 A 类基金份额净值}$$

申购费用适用固定金额时：

$$\text{申购费用} = \text{固定金额}$$

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} - \text{申购费用}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{申购当日 A 类基金份额净值}$$

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 1.00%，则可得到的申购份额为：

$$\text{净申购金额} = 100,000 / (1 + 1.00\%) = 99,009.90 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 100,000 - 99,009.90 = 990.10 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 99,009.90 / 1.0160 = 97,450.69 \text{ 份}$$

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 97,450.69 份 A 类基金份额。

#### (2) C 类基金份额

$$\text{申购份额} = \text{申购金额} / \text{申购当日 C 类基金份额净值}$$

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：

$$\text{申购份额} = 5,000,000 / 1.0112 = 4,944,620.25 \text{ 份}$$

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

$$\text{赎回总金额} = \text{赎回份额} \times \text{赎回当日 A 类基金份额净值}$$

$$\text{赎回费用} = \text{赎回总金额} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{净赎回金额} = \text{赎回总金额} - \text{赎回费用}$$

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：

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

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

$$\text{净赎回金额} = 101,750.00 - 1526.25 = 100,223.75 \text{ 元}$$

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

$$\text{赎回总金额} = \text{赎回份额} \times \text{赎回当日 C 类基金份额净值}$$

$$\text{赎回费用} = \text{赎回总金额} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{净赎回金额} = \text{赎回总金额} - \text{赎回费用}$$

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 =  $100,000 \times 1.0185 = 101,850.00$  元

赎回费用 =  $101,850 \times 0 = 0$  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运转。
- 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，且与基金托管人协商一致，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0.5%，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：

$$\text{净申购金额} = 1,000,000 / (1 + 0.5\%) = 995,024.88$$

$$\text{申购费用} = 1,000,000 - 995,024.88 = 4,975.12$$

$$\text{申购份额} = 995,024.88 / 1.01745001 = 977,959.48$$

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977,959.48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。

#### **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2017年10月31日起开通本基金的转换业务，具体内容详见2017年10月28日发布的《鹏扬景兴混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换业务的公告》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2017年11月6日起开通本基金的定期定额投资业务，具体内容详见2017年11月3日发布的《鹏扬景兴混合型证券投资基金开放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**0-50%**，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，本基金将增加股票投资比例，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。

### （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。

#### 3、权证投资策略

本基金权证投资将以价值分析为基础，在采用数量化模型分析其合理定价的基础上，把握市场的短期波动，进行积极操作，追求在风险可控的前提下实现稳健的超额收益。

### （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 **0-50%**；
- (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；

(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）不得超过基金资产的 50%；

(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%；

(18) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的 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本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；

(19) 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；

(20) 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）、（12）、（18）、（19）项外，因证券市场波动、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 \*25%+中债综合指数收益率 \*75%

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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年1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。

以下内容摘自本基金2018年第4季度报告，所列财务数据未经审计。

### 8.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	121,671,123.88	28.01
	其中：股票	121,671,123.88	28.01
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	271,381,244.00	62.48
	其中：债券	271,381,244.00	62.48
	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	23,600,000.00	5.43
	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	2,371,735.37	0.55
8	其他资产	15,312,023.34	3.53
9	合计	434,336,126.59	100.00

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末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	3,565,000.00	1.02
B	采矿业	1,436,045.00	0.41
C	制造业	70,190,104.28	20.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,997,668.00	0.57
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,766,878.00	1.07
J	金融业	30,532,378.60	8.71
K	房地产业	10,183,050.00	2.90
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	-	-
	合计	121,671,123.88	34.70



注：以上行业分类以 2018 年 12 月 31 日的证监会行业分类标准为依据。

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通标的股票。

### 8.3 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

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	600036	招商银行	489,069	12,324,538.80	3.52
2	000002	万科 A	427,500	10,183,050.00	2.90
3	601318	中国平安	168,200	9,436,020.00	2.69
4	600612	老凤祥	154,524	6,953,580.00	1.98
5	002304	洋河股份	73,000	6,914,560.00	1.97
6	600741	华域汽车	366,200	6,738,080.00	1.92
7	601398	工商银行	1,250,600	6,615,674.00	1.89
8	002372	伟星新材	414,421	6,427,669.71	1.83
9	000895	双汇发展	255,973	6,038,403.07	1.72
10	601012	隆基股份	287,500	5,014,000.00	1.43

### 8.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	3,662,000.00	1.04
2	央行票据	-	-
3	金融债券	82,596,000.00	23.56
	其中：政策性金融债	82,596,000.00	23.56
4	企业债券	64,764,000.00	18.47
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	113,112,000.00	32.26
7	可转债（可交换债）	7,247,244.00	2.07
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	271,381,244.00	77.41

### 8.5 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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	101800134	18 首创 MTN001	300,000	31,131,000.00	8.88
2	018006	国开 1702	250,000	25,525,000.00	7.28
3	180406	18 农发 06	200,000	21,386,000.00	6.10
4	108901	农发 1801	210,000	21,002,100.00	5.99
5	101455009	14 浦发集 MTN001	200,000	20,894,000.00	5.96

### 8.6 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：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 8.7 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：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

#### **8.8 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：本基金本报告期末未持有权证。

#### **8.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

##### **8.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

##### **8.9.2 本基金投资股指期货的投资政策**

注：本报告期内，本基金未参与股指期货投资。

#### **8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

##### **8.10.1 本期国债期货投资政策**

注：本报告期内，本基金未参与国债期货投资。

##### **8.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

##### **8.10.3 本期国债期货投资评价**

注：本报告期内，本基金未参与国债期货投资。

#### **8.11 投资组合报告附注**

**8.11.1 基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的投资决策程序说明：**

招商银行（600036.SH）为鹏扬景兴混合型证券投资基金的前十大持仓证券。2018年7月5日深圳保监局针对招商银行存在电话销售欺骗投保人违法行为，罚款30万元。2018年2月12日中国银监会针对招商银行存在以下主要违法违规事实，罚款6570万元，没收违法所得3.024万元，罚没合计6573.024万元。主要违法违规事实：（一）内控管理严重违反审慎经营规则；（二）违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款；（三）同业投资业务违规接受第三方金融机构信用担保；（四）销售同业非保本理财产品时违规承诺保本；（五）违规将票据贴现资金直接转回出票人账户；（六）为同业投资业务违规提供第三方金融机构信用担保；（七）未将房地产企业贷款计入房地产开发贷款科目；（八）高管人员在获得任职资格核准前履职；（九）未严格审查贸易背景真实性办理银行承兑业务；（十）未严格审查贸易背景真实性开立信用证；（十一）违规签订保本合同销售同业非保本理财产品；（十二）非真实转让信贷资产；（十三）违规向典当行发放贷款；（十四）违规向关系人发放信用贷款。

本基金投资招商银行的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除招商银行外，本报告期内本基金投资的前十名证券发行主体未出现被监管部门立案调查的情况，在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

**8.11.2 基金投资前十名股票中投资于超出基金合同规定备选股票库之外的投资决策程序说明：**

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 8.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	38,434.01
2	应收证券清算款	10,337,942.08
3	应收股利	-
4	应收利息	4,871,302.09
5	应收申购款	64,345.16
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,312,023.34

### 8.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 8.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注：由于四舍五入的原因，各比例的分项之和与合计可能有尾差。

## 第十部分 基金的业绩

基金管理人承诺以恪尽职守、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，也不向投资者保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。本基金合同生效日为 2017 年 9 月 27 日，基金合同生效以来（截至 2018 年 12 月 31 日）的投资业绩及同期基准的比较如下表所示：

鹏扬景兴混合 A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 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
自基金合 同生效之 日- 2017 年 12 月 31 日	4.64%	0.52%	0.53%	0.20%	4.11%	0.32%
2018 年 1 月 1 日 -2018 年 12 月 31 日	-5.52%	0.72%	-3.31%	0.33%	-2.21%	0.39%
自基金合 同生效之 日-2018 年 12 月 31 日	-1.14%	0.69%	-2.79%	0.31%	1.65%	0.38%

鹏扬景兴混合 C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 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
自基金合 同生效之 日- 2017 年 12 月 31 日	4.47%	0.52%	0.53%	0.20%	3.94%	0.32%
2018 年 1 月 1 日 -2018 年	-5.93%	0.72%	-3.31%	0.33%	-2.62%	0.39%

12月31日						
自基金合同生效之日-2018年12月31日	-1.73%	0.69%	-2.79%	0.31%	1.06%	0.38%

## 第十一部分 基金的财产

### 一、基金资产总值

基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息和基金应收款项以及其他资产的价值总和。

### 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、基金财产的保管和处分

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。

## 第十二部分 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、期货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、国债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，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) 交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（基金合同另有规定的除外），选取估值日第三方估值机构提供的相应品种对应的估值净价估值；

(3) 交易所上市交易的可转换债券按估值日收盘价减去债券收盘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减去债券收盘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，调整最近交易市价，确定公允价格；

交易所上市实行全价交易的债券（可转债除外），选取第三方估值机构提供的估值全价减去估值全价中所含的债券应收利息（税后）得到的净价进行估值。

(4) 对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的有价证券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为计量日的公允价值进行估值；对于活跃市场报价未能代表计量日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整，确认计量日的公允价值；

(5) 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、配股和公开增发的股票，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, 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, 按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种, 回售登记截止日(含当日)后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。对银行间市场未上市, 且第三方估值机构未提供估值价格的债券, 按成本估值。

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、投资证券衍生品的估值方法

(1) 从持有确认日起到卖出日或行权日止, 上市交易的权证按估值日在证券交易所挂牌的该权证的收盘价估值; 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估值; 如最近交易日后经济环境发生了重大变化的, 将参考监管机构或行业协会有关规定, 或者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, 确定公允价值;

(2) 首次发行未上市的权证, 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) 股指期货合约, 一般以估值当日结算价进行估值, 估值当日无结算价的, 且最近交易日后经济环境未发生重大变化的, 采用最近交易日结算价估值。

(4) 国债期货合约, 一般以估值当日结算价进行估值, 估值当日无结算价的, 且最近交易日后经济环境未发生重大变化的, 采用最近交易日结算价估值。

6、持有的银行定期存款或通知存款以本金列示, 按协议或合同利率逐日确认利息收入。

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, 按照基金管理人对于基金资产净值的计算结果对外予以公布。



#### 四、估值程序

1、各类基金份额净值是按照每个工作日闭市后，各类基金资产净值除以当日该类基金份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人每个工作日计算基金资产净值及各类基金份额净值，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，由基金管理人按规定对外公布。

#### 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。当任一类基金份额净值小数点后 4 位以内(含第 4 位)发生估值错误时，视为该类基金份额净值错误。

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。

### 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) 错误偏差达到该类基金份额净值的 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；错误偏差达到该类基金份额净值的 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，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) 前述内容如法律法规或者监管部门另有规定的，从其规定。如果行业另有通行做法，双方当事人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。

## 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、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一致的，基金管理人应当暂停估值；
- 4、法律法规、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工作日交易结束后计算当日的基金资产净值和各类基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人按规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、由于不可抗力原因，或由于证券、期货交易所及登记结算公司发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等，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，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

## 第十三部分 基金的收益与分配

### 一、基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额，基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

### 二、基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

### 三、基金收益分配原则

1、本基金的同一类别的每份基金份额享有同等分配权，由于本基金各类基金份额收取费用情况不同，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；若投资人选择红利再投资方式进行收益分配，收益的计算以权益登记日当日收市后计算的各类基金份额净值为基准转为相应类别的基金份额进行再投资；

3、基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益每年最多分配2次，基金每次收益分配比例最低不低于收益分配基准日可供分配利润的60%，若基金合同生效不满3个月则可不进行收益分配；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在符合法律法规及基金合同约定，并对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，经与基金托管人协商一致后，基金管理人可对基金收益分配原则和支付方式进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

### 四、收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。由于不同基金份额类别对应的可分配收益不同，基金管理人可相应制定不同的收益分配方案。

### 五、收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在2个工作日内在指定媒介公告并报中国证监会备案。

基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过15个工作日。

### 六、基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为相应类别的基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

## 第十四部分 基金费用与税收

### 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、销售服务费；
- 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、诉讼费和仲裁费；
- 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、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 0.70% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.70\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。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 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 3、销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费率，C 类基金份额的年销售服务费率为 0.40%，本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务。

本基金 C 类基金份额销售服务费计算方法如下：

$$H=E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日 C 类基金份额应计提的销售服务费

E 为前一日 C 类基金份额的基金资产净值

销售服务费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人自动于次月初五个工作日内从基金财产中一次性支付至登记机构，基金管理人无需再出具资金划拨指令。销售服务费由登记机构代收并按照相关合同规定支付给基金销售机构。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

销售服务费主要用于本基金持续销售以及基金份额持有人服务等各项费用。

上述“一、基金费用的种类”中第 4—10 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

### 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。

## 第十五部分 基金的会计与审计

### 一、基金会计政策

- 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披露；
- 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日内在指定媒介公告并报中国证监会备案。



## 第十六部分 基金的信息披露

一、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。相关法律法规关于信息披露的规定发生变化时，本基金从其最新规定。

### 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，并保证投资人能够按照《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、本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

- 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、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：

#### （一）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投资人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投资人决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资；拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估；巨额赎回情形下的流动性风险管理措施；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；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。

#### （二）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。

#### （三）《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。

#### （四）基金资产净值、基金份额净值

《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和各类基金份额净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。

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和各类基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、各类基金份额净值和各类基金份额累计净值登载在指定媒介上。

#### （五）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基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资人能够在基金份额发售网点查阅或者复制前述信息资料。

#### （六）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。

报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额 20% 的情形，为保障其他投资者利益，基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告文件中“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。

本基金持续运作过程中，应当在基金年度报告和半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。

### （七）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、涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼或仲裁；
- 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、托管费和销售服务费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- 17、任一类基金份额净值计价错误达该类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缓支付；
- 24、本基金暂停接受申购、赎回申请；
- 25、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；
- 26、本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
- 27、调整基金份额类别的设置；
- 28、基金推出新业务或服务；
- 29、中国证监会规定的其他事项。

#### （八）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。

#### （九）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。

#### （十）基金投资国债期货的信息披露

若本基金投资了国债期货，需按照法规要求在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露国债期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示国债期货交易对本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。

#### （十一）投资于资产支持证券的信息披露

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。

#### （十二）基金投资股指期货相关信息

本基金将在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露股指期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示股指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。

(十三) 中国证监会规定的其他信息

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、各类基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告和定期更新的招募说明书等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人出具书面文件或者盖章确认。

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媒介。

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。

八、当出现下述情况时，基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金相关信息：

- 1、基金投资所涉及的证券、期货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、法律法规、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

## 第十七部分 风险揭示

本基金的风险主要包括：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、本基金特有的风险及其他风险等。

### 一、市场风险

基金主要投资于证券市场，而证券市场价格因受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响而产生波动，从而导致基金收益水平发生变化，产生风险。主要的风险因素包括：

股票投资风险：

- 1、国家货币政策、财政政策、产业政策等的变化对证券市场产生一定的影响，导致市场价格水平波动的风险。
- 2、宏观经济运行周期性波动，对股票市场的收益水平产生影响的风险。
- 3、上市公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务等都会导致公司盈利发生变化，从而导致股票价格变动的风险。

债券投资风险：

- 1、市场平均利率水平变化导致债券价格变化的风险。
- 2、债券市场不同期限、不同类属债券之间的利差变动导致相应期限和类属债券价格变化的风险。

### 二、信用风险

基金所投资债券的发行人如出现违约、无法支付到期本息，或由于债券发行人信用等级降低导致债券价格下降，将造成基金资产损失。

### 三、管理风险

基金管理人的专业技能、研究能力及投资管理水平直接影响到其对信息的占有、分析和对经济形势、证券价格走势的判断，进而影响基金的投资收益水平。同时，基金管理人的投资管理制度、风险管理和内部控制制度是否健全，能否有效防范道德风险和其他合规性风险，以及基金管理人的职业道德水平等，也会对基金的风险收益水平造成影响。

### 四、流动性风险

在开放式基金交易过程中，可能会发生巨额赎回的情形。巨额赎回可能会产生基金仓位调整的困难，导致流动性风险，甚至影响基金份额净值。

除此之外，基金持有的债券、资产支持证券、同业存单、股票等会因各种原因面临一定的流动性风险，使证券交易的执行难度提高，买入成本或变现成本增加。

- 1、拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

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。

从投资范围上看，本基金投资的金融工具基本上都具备良好的流动性。对于资产支持证券、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票等流动性受限的资产，本基金严格按照《流动性管理规定》的要求进行设定。因此本基金投资标的的流动性风险可控。

## 2、巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

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延缓支付赎回款项。

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。

## 3、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

基金管理人经与基金托管人协商一致，在确保投资者得到公平对待的前提下，可依照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。本基金可采用如下流动性风险管理工具：

### （1）收取短期赎回费：

对持续持有期少于7日的投资者收取不低于1.5%的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。实施此项工具可能导致投资者的赎回成本提高。

### （2）暂停基金估值：

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一致的，基金管理人应当暂停估值，并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。实施此项工具可能导致投资者不能及时获得赎回款项。

## 五、操作和技术风险

基金的相关当事人在各业务环节的操作过程中，可能因内部控制不到位或者人为因素造成操作失误或违反操作规程而引致风险，如越权交易、内幕交易、交易错误和欺诈等。

此外，在开放式基金的后台运作中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行甚至导致基金份额持有人利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理人、基金托管人、登记机构、销售机构、证券交易所和证券登记结算机构等。

## 六、合规性风险

指基金管理或运作过程中，违反国家法律、法规的规定，或者基金投资违反法规及基金合同有关规定的风险。

## 七、本基金特有风险

1、本基金可投资股指期货，股指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，股价指数微小的变动就可能会使投资人权益遭受较大损失。股指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。

2、本基金可投资国债期货，国债期货采用保证金交易制度，由于保证金交易具有杠杆性，当相应期限国债收益率出现不利变动时，可能会导致投资人权益遭受较大损失。国债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。

3、本基金可投资资产支持证券，资产支持证券可能面临的信用风险、利率风险、流动性风险、提前偿付风险等风险、操作风险和法律风险，由此可能增加本基金净值的波动性。

## 八、其他风险

1、因基金业务快速发展而在制度建设、人员配备、风险管理和内控制度等方面不完善而产生的风险；

2、因金融市场危机、行业竞争压力可能产生的风险；

3、战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，可能严重影响证券市场运行，导致基金资产损失；

4、其他意外导致的风险。



## 第十八部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### 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。对于法律法规规定和基金合同约定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须报中国证监会备案，自表决通过之日起生效，自决议生效后两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、《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、在基金财产清算小组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照《基金合同》和本托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

3、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。

4、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。

#### 5、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) 对基金剩余财产进行分配。

6、基金财产清算的期限为6个月，但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的，清算期限相应顺延。

#### **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剩余财产中支付。

#### **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，按基金份额持有人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。

## 第十九部分 基金合同的内容摘要

基金合同的内容摘要见附件一。

## 第二十部分 基金托管协议的内容摘要

基金托管协议的内容摘要见附件二。

## 第二十一部分 对基金份额持有人的服务

对本基金份额持有人的服务主要由基金管理人、基金销售机构提供。基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务，根据基金份额持有人的需要和市场的变化，有权增加和修改服务项目，主要提供的服务内容如下：

### 一、基金份额持有人交易资料的寄送服务

#### 1、交易确认单

基金合同生效后，对 T 日提交的有效申请，投资人可在 T+2 个工作日后通过销售机构的网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询和打印交易确认单，或在 T+1 个工作日后通过鹏扬客服电话 4009686688、鹏扬网站（www.pyamc.com）查询交易确认情况。基金管理人向投资者寄送交易确认单。

#### 2、基金交易对账单

每月结束后，基金管理人向所有订制了电子邮件对账单的投资人发送电子邮件对账单。投资人可以登录鹏扬网站（www.pyamc.com）自助订制；也可直接拨打鹏扬客服电话 4009686688 订制。

3、由于投资人提供的手机号码、电子邮箱不详、错误、未及时变更或电子邮箱设置、通讯故障、延误等原因有可能造成对账单无法按时或准确送达。因上述原因无法正常收取对账单的投资人，请及时通过鹏扬网站，或拨打鹏扬客服电话查询、核对、变更您的预留联系方式。

### 二、短信、邮件信息发送服务

基金管理人为基金投资人提供手机短信和电子邮件的信息订制服务，基金投资人可根据需要，通过基金管理人客服热线或官方网站订制、修改或取消该服务。

1、手机短信服务可提供的订制内容包括每周净值通知、基金交易确认、分红确认、月末账户余额等信息。

2、电子邮件服务可提供的订制内容包括每周净值通知、基金交易确认、分红确认、月末账户余额、电子对账单等信息。

3、除发送基金投资人订制的上述信息外，基金管理人会不定期向留有手机号码和电子邮箱地址的基金投资人，发送节日及生日问候、产品推广等信息。若基金投资人不需要接收到该类信息，可通过基金管理人客服热线取消该项服务。

4、手机短信依托于外部通讯服务商发送，电子邮件通过互联网进行信息传送，基金管理人根据服务规则发送相关信息，但不对信息的送达做出承诺和保证。

### 三、鹏扬客服电话服务

鹏扬客服电话自动语音系统提供 7×24 小时交易情况、基金账户余额、基金产品与服务等信息查询。

鹏扬客服电话人工座席每个交易日（9：00-17：00）为基金投资人提供服务，客服热线服务内容包括业务咨询、信息查询、服务投诉、信息订制、资料修改等专项服务。

客服热线：4009686688

#### **四、电子查询服务**

基金投资人可通过基金管理人网上查询系统完成基金账户的查询业务。

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

#### **五、投诉受理服务**

基金投资人可以拨打鹏扬客服电话或以电子邮件等方式，对基金管理人和销售网点所提供的服务进行投诉。

对于工作日期间受理的投诉，以“及时回复”为处理原则，对于不能及时回复的投诉，基金管理人承诺在3个工作日之内对基金投资人的投诉做出回复。对于非工作日提出的投诉，基金管理人将在顺延到下1个工作日进行回复。

客服邮箱：[service@pyamc.com](mailto:service@pyamc.com)

#### **六、网上直销交易系统开户与交易服务**

基金投资人可以登录基金管理人网上交易系统进行开户与交易。适用业务范围包括：基金账户开户、认购、申购、赎回、账户资料变更、分红方式变更、信息查询等业务。网上交易业务规则以公告为准。

**七、如本招募说明书存在任何您/贵机构无法理解的内容，请通过上述方式联系基金管理人。请确保投资前，您/贵机构已经全面理解了本招募说明书。**

## 第二十二部分 招募说明书存放及查阅方式

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；投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件或复印件。对投资人按此种方式所获得的文件及其复印件，基金管理人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

投资人还可以直接登录基金管理人的网站（[www.pyamc.com](http://www.pyamc.com)）查阅和下载招募说明书。

## 第二十三部分 其他应披露事项

本基金招募说明书更新期间，本基金及基金管理人的有关公告如下：

公告事项	披露日期
鹏扬基金管理有限公司关于增加旗下基金合作销售机构并参加费率优惠活动的公告	2018-10-18
鹏扬基金管理有限公司关于旗下基金销售机构名称变更的公告	2018-10-18
鹏扬基金管理有限公司关于增加基金销售机构并参加费率优惠活动的公告	2018-10-25
鹏扬景兴混合型证券投资基金 2018 年第 3 季度报告	2018-10-26
鹏扬基金管理有限公司旗下部分基金参与销售机构费率优惠活动的公告	2018-10-30
鹏扬景兴混合型证券投资基金更新的招募说明书及摘要	2018-11-1
鹏扬基金管理有限公司关于旗下基金销售机构名称变更的公告	2018-12-18
鹏扬基金管理有限公司关于旗下基金销售机构名称变更的公告	2019-1-4
鹏扬基金管理有限公司关于鹏扬景兴混合型证券投资基金变更基金经理的公告	2019-1-5
鹏扬景兴混合型证券投资基金 2018 年第 4 季度报告	2019-1-21
鹏扬基金管理有限公司关于旗下基金合作销售机构名称变更的公告	2019-1-23
鹏扬基金管理有限公司关于增加基金销售机构并参加费率优惠活动的公告	2019-02-19
鹏扬基金管理有限公司关于增加基金销售机构并参加费率优惠活动的公告	2019-3-4
鹏扬基金管理有限公司关于增加基金合作销售机构并参加费率优惠活动的公告	2019-3-19
鹏扬景兴混合型证券投资基金 2018 年年度报告及摘要	2019-3-27



## 第二十四部分 备查文件

以下备查文件存放在基金管理人的办公场所，在办公时间可供免费查阅。

- （一）中国证监会准予鹏扬景兴混合型证券投资基金注册的文件
- （二）《鹏扬景兴混合型证券投资基金基金合同》
- （三）《鹏扬景兴混合型证券投资基金托管协议》
- （四）基金管理人业务资格批件、营业执照
- （五）基金托管人业务资格批件、营业执照
- （六）法律意见书
- （七）中国证监会要求的其他文件

查阅方式：投资人可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

鹏扬基金管理有限公司

2019年4月26日

## 附件一 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、基金管理人

##### (一) 基金管理人简况

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

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

联系电话：010-68105888

##### (二) 基金管理人的权利与义务

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投资人的利益；
- (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、赎回与转换申请；
- (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) 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;

(14) 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;

(15) 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、定期定额投资和非交易过户等业务规则;

(16) 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, 确定基金份额申购、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) 确保需要向投资人提供的各项文件或资料在规定时间发出,并且保证投资人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活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。

## 二、基金托管人

### (一) 基金托管人简况

名称: 兴业银行股份有限公司

住所: 福建省福州市湖东路154号

法定代表人: 高建平

成立时间: 1988年8月22日

批准设立机关和批准设立文号: 中国人民银行总行银复〔1988〕347号

组织形式: 股份有限公司

注册资本: 207.74亿元人民币

存续期间: 持续经营

基金托管业务批准文号: 中国证监会证监基金字〔2005〕74号

### (二) 基金托管人的权利与义务

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和证券账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
  - (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管理人、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。

### 三、基金份额持有人

投资人持有本基金基金份额的行为即视为对基金合同的承认和接受，投资人自依据基金合同取得基金份额，即成为本基金份额持有人和基金合同的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为基金合同当事人并不以在基金合同上书面签章或签字为必要条件。

同一类别每份基金份额具有同等的合法权益。本基金A类基金份额与C类基金份额由于基金份额净值的不同，基金收益分配的金额以及参与清算后的剩余基金财产分配的数量将可能有所不同。

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) 依法申请赎回或转让其持有的基金份额；
- (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（及其更新）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，自主做出投资决策，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) 缴纳基金认购、申购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。

## 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。基金份额持有人持有的同一类别每一基金份额拥有平等的投票权。

本基金份额持有人大会不设日常机构。

### 一、召开事由

1、除法律法规和中国证监会另有规定或《基金合同》另有约定外，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；
- (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；
- (5) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准或提高销售服务费率；
- (6) 变更基金类别；
- (7) 本基金与其他基金的合并；
- (8) 变更基金投资目标、范围或策略；
- (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) 单独或合计持有本基金总份额10%以上(含10%)基金份额的基金份额持有人(以基金管理人收到提议当日的基金份额计算,下同)就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会;

(12) 对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项;

(13) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

2、在法律法规和基金合同规定的范围内,且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下,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) 调低销售服务费率;

(2) 法律法规要求增加的基金费用的收取;

(3) 调整本基金的申购费率、赎回费率或变更收费方式;

(4) 因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改;

(5) 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;

(6) 根据基金实际运作情况,在履行适当程序后,基金管理人经与基金托管人协商,调整本基金份额类别的设置;

(7) 基金管理人、登记机构、基金销售机构在法律法规规定或中国证监会许可的范围内调整有关认购、申购、赎回、转换、基金交易、非交易过户、转托管等业务规则;

(8) 基金推出新业务或服务;

(9) 按照法律法规和基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

## 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,并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、代表基金份额10%以上(含10%)的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会,应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集,并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的,应当自出具书面决定之日起60日内召开;基金管理人决定不召集,代表基金份额10%以上(含10%)的基金份额持有人仍认为有必要召开的,应当向基金托管人提出书



面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

5、代表基金份额10%以上（含10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表基金份额10%以上（含10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前30日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

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）、授权方式、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、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、监管机构允许的其他方式召开，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书符合法律法规、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，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）；若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一（含三分之一）。

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或大会公告载明的其他方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或大会公告载明的其他方式进行表决。

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表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取表决意见的，不影响表决效力；

(3) 本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）；若本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）基金份额的持有人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见；

(4) 上述第(3)项中直接出具表决意见的基金份额持有人或受托代表他人出具表决意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具表决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书符合法律法规、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，经会议通知载明，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，授权方式可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

4、在会议召开方式上，本基金亦可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。基金份额持有人可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式进行表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

## 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同一类别每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1、一般决议，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过方为有效；除下列第2项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均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。除基金合同另有约定外，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、本基金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人身份文件的表决视为有效出席的投资人，表面符合会议通知规定的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，但应当计入出具表决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或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人与基金托管人协商一致并提前公告后，可直接对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 基金收益分配原则、执行方式

### 一、基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额，基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

### 二、基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

### 三、基金收益分配原则

1、本基金的同一类别的每份基金份额享有同等分配权，由于本基金各类基金份额收取费用情况不同，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；若投资人选择红利再投资方式进行收益分配，收益的计算以权益登记日当日收市后计算的各类基金份额净值为基准转为相应类别的基金份额进行再投资；

3、基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益每年最多分配2次，基金每次收益分配比例最低不低于收益分配基准日可供分配利润的60%，若基金合同生效不满3个月则可不进行收益分配；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在符合法律法规及基金合同约定，并对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，经与基金托管人协商一致后，基金管理人可对基金收益分配原则和支付方式进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

#### 四、收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。由于不同基金份额类别对应的可分配收益不同，基金管理人可相应制定不同的收益分配方案。

#### 五、收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在2个工作日内在指定媒介公告并报中国证监会备案。

基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过15个工作日。

#### 六、基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为相应类别的基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

### 第四部分 与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

#### 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、销售服务费；
- 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、诉讼费和仲裁费；
- 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、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0.70%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.70\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提,按月支付,由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在次月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令。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0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

$$H=E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提,按月支付,由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在次月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

## 3、销售服务费

本基金A类基金份额不收取销售服务费率,C类基金份额的年销售服务费率为0.40%,本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务。

本基金C类基金份额销售服务费计算方法如下:

$$H=E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H为每日C类基金份额应计提的销售服务费

E为前一日C类基金份额的基金资产净值

销售服务费每日计提,按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人自动于次月初五个工作日内从基金财产中一次性支付至登记机构,基金管理人无需再出具资金划拨指令。销售服务费由登记机构代收并按照相关合同规定支付给基金销售机构。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

销售服务费主要用于本基金持续销售以及基金份额持有人服务等各项费用。

上述“一、基金费用的种类”中第4—10项费用,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

## 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。

### 第五部分 基金财产的投资方向和投资限制

#### 一、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0-50%，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。

#### 二、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 0-50%；
- （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；

(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）不得超过基金资产的50%；

(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%；

(18) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的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本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；

(19) 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；

(20) 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)、(12)、(18)、(19)项外，因证券市场波动、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，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。

## 第六部分 基金资产净值的计算方法和公告方式

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

《基金合同》生效后, 在开始办理基金份额申购或者赎回前, 基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和各类基金份额净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后, 基金管理人应当在每个开放日的次日, 通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介, 披露开放日的各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。

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和各类基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日, 将基金资产净值、各类基金份额净值和各类基金份额累计净值登载在指定媒介上。

## 第七部分 基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产的清算方式

### 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。对于法律法规规定和基金合同约定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须报中国证监会备案, 自表决通过之日起生效, 自决议生效后两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、《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、在基金财产清算小组接管基金财产之前, 基金管理人和基金托管人应按照《基金合同》和本托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

3、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。

4、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。

5、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) 对基金剩余财产进行分配。

6、基金财产清算的期限为6个月，但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的，清算期限相应顺延。

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剩余财产中支付。

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，按基金份额持有人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。

## 第八部分 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，应提交【中国国际经济贸易仲裁委员会】根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为【北京市】，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，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和托管协议规定的义务，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。

### 第九部分 基金合同存放地和投资者取得合同的方式

《基金合同》正本一式三份，除上报有关监管机构一份外，基金管理人、基金托管人各持有一份，每份具有同等的法律效力。

《基金合同》可印制成册，供投资人在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅。

## 附件二 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

名称：鹏扬基金管理有限公司

注册地址：上海市中国(上海)自由贸易试验区栖霞路 120 号 3 层 302 室

办公地址：北京市西城区复兴门外大街 A2 号中化大厦 16 层

邮政编码：100045

法定代表人：杨爱斌

成立日期：2016 年 07 月 06 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

存续期间：持续经营

经营范围：公开募集证券投资基金管理、基金销售、特定客户资产管理和中国证监会许可的其他业务。

#### (二) 基金托管人

名称：兴业银行股份有限公司（简称：兴业银行）

注册地址：福建省福州市湖东路 154 号

办公地址：上海市江宁路 168 号

邮政编码：350013

法定代表人：高建平

成立日期：1988 年 8 月 22 日

批准设立机关和批准设立文号：中国人民银行总行银复〔1988〕347 号

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基金字〔2005〕74 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：207.74 亿元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；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、金融债券；代理发行股票以外的有价证券；买卖、代理买卖股票以外的有价证券；资产托管业务；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；结汇、售汇业务；从事银行卡业务；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；财务顾问、资信调查、咨询、见证业

务；经中国银行业监督管理机构批准的其他业务（以上范围凡涉及国家专项专营规定的从其规定）。

## 二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

### （一）基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权

基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池，以便基金托管人运用相关技术系统，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，对存在疑义的事项进行核查。

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。

其中，本基金在进行国债期货实物交割前，基金管理人需事先与基金托管人就国债期货实物交割的具体运营及操作达成一致。

本基金股票投资占基金资产的比例为 0-50%，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。

（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，对基金投资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督：

- （1）本基金股票资产占基金资产的比例为 0-50%；
- （2）本基金每个交易日日终在扣除股指期货和国债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；
- （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，其市值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；

(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）不得超过基金资产的 50%；

(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%；



(18) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的 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本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；

(19) 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；

(20) 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)、(12)、(18)、(19)项外，因证券市场波动、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。法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起六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。

(三) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对本托管协议项下的基金投资禁止行为进行监督。基金托管人通过事后监督方式对基金管理人基金投资禁止行为进行监督。

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，应当符合本基金的投资目标和投资策略，遵循持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人同意，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。

根据法律法规有关基金从事的关联交易的规定，基金管理人和基金托管人应事先相互提供与本机构有控股关系的股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司名单及有关关联方发行的证券名单，加盖公章并书面提交，并确保所提供的关联交易名单的真实性、完整性、全面性。基金管理人及基金托管人有责任保管真实、完整、全面的关联交易名单，并负责及时更新该名单。名单变更后基金管理人及基金托管人应及时发送另一方，另一方于 2 个工作日内进行回函确认已知名单的变更。一方收到另一方书面确认后，新的关联交易名单开始生效。

(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。基金管理人可以每半年对银行间债券市场交易对手名单及结算方式进行更新,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情况需要临时调整银行间债券市场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个工作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,基金托管人不承担由此造成的任何法律责任及损失。若未履约的交易对手在基金托管人与基金管理人确定的时间前仍未承担违约责任及其他相关法律责任的,基金管理人有权向相关交易对手追偿,基金托管人应予以必要的协助与配合。基金托管人根据银行间债券市场成交单对本基金银行间债券交易的交易对手及其结算方式进行监督。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或交易方式进行交易时,基金托管人应及时书面或以双方认可的其他方式提醒基金管理人,经提醒后仍未改正时造成基金财产损失的,基金托管人不承担由此造成的相应损失和责任。如果基金托管人未能切实履行监督职责,导致基金出现风险或造成基金资产损失的,基金托管人应承担相应责任。

(五) 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、各类基金份额净值计算、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。

(六) 基金托管人对基金投资银行存款进行监督。

本基金投资银行存款应符合如下规定:

1、基金管理人、基金托管人应当与存款银行建立定期对账机制,确保基金银行存款业务账目及核算的真实、准确。

2、基金管理人应当按照有关法规规定,与基金托管人、存款机构签订相关书面协议。基金托管人应根据有关相关法规及协议对基金银行存款业务进行监督与核查,严格审查、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。

3、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。

4、基金投资银行存款的,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。基金管理人对于定期存款提前支取的损失由其承担。

(七) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对基金投资流通受限证券进行监督。

1. 基金投资流通受限证券,应遵守《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。

2. 流通受限证券,包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券,不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。

3. 在首次投资流通受限证券之前,基金管理人应当制定相关投资决策流程、风险控制等规章制度并提交给基金托管人。基金管理人应当根据基金的投资风格和流动性的需要合理安排流通受限证券的投资比例,并在相关制度中明确具体比例,避免基金出现流动性风险。基金投资非公开发行股票,基金管理人还应提供流动性风险处置预案。上述资料应包括但不限于基金投资流通受限证券的投资额度和投资比例控制情况。

4. 在投资流通受限证券之前,基金管理人应至少提前一个交易日向基金托管人提供有关流通受限证券的相关信息,具体应当包括但不限于如下文件(如有):拟发行数量、定价依据、监管机构的批准证明文件复印件、基金管理人与承销商签订的销售协议复印件、缴款通知书、基金拟认购的数量、价格、总成本、划款账号、划款金额、划款时间文件等。基金管理人应保证上述信息的真实、完整。

5. 基金管理人应在本基金投资非公开发行股票后两个交易日内,在中国证监会指定媒介披露所投资非公开发行股票的名称、数量、总成本、账面价值,以及总成本和账面价值占基金资产净值的比例、锁定期等信息。

6. 基金托管人应对基金管理人是否遵守法律法规、投资决策流程、风险控制制度、流动性风险处置预案情况进行监督,并审核基金管理人提供的有关书面信息。基金托管人认为上述资料可能导致基金出现风险的,有权要求基金管理人在投资流通受限证券前就该风险的消除或防范措施进行补充书面说明,并保留查看基金管理人风险管理部门就基金投资流通受限证券出具的风险评估报告等备查资料的权利。

如基金管理人和基金托管人无法达成一致,应及时上报中国证监会请求解决。如果基金托管人切实履行监督职责,则不承担任何责任。如果基金托管人没有切实履行监督职责,导致基金出现风险,基金托管人应承担连带责任。

7. 相关法律法规对基金投资流通受限证券有新规定的,从其规定。

(八) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对基金投资中期票据进行监督

1、基金管理人管理的基金在投资中期票据前，基金管理人须根据法律、法规、监管部门的规定，制定严格的关于投资中期票据的风险控制制度、流动性风险和信用风险处置预案，并书面提供给基金托管人，基金托管人依据上述文件对基金管理人投资中期票据的额度和比例进行监督。

2、如未来有关监管部门发布的法律法规对证券投资基金投资中期票据另有规定的，从其约定。

3、基金托管人有权监督基金管理人在相关基金投资中期票据时的法律法规遵守情况，有关制度、信用风险、流动性风险处置预案的完善情况，有关额度、比例限制的执行情况。基金托管人发现基金管理人的上述事项违反法律法规和基金合同以及本协议的规定，应及时以书面形式通知基金管理人纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人应按相关托管协议要求向基金托管人及时发出回函，并及时改正。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。如果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。如果基金托管人未能切实履行监督职责，导致基金出现风险或造成基金资产损失的，基金托管人应承担相应责任。

（九）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，并保证在规定期限内及时改正。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。基金管理人对于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。如果基金托管人未能切实履行监督职责，导致基金出现风险或造成基金资产损失的，基金托管人应承担相应责任。

（十）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。对基金托管人发出的书面提示，基金管理人应在规定时间内答复并改正，或就基金托管人的疑义进行解释或举证；对基金托管人按照法律法规、基金合同和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。

（十一）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，应当立即以书面或以双方认可的其他方式通知基金管理人，由此造成的相应损失由基金管理人承担。

（十二）基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。基金管理人无正当理由，拒绝、阻

绕对方根据本托管协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的，基金托管人应报告中国证监会。

### 三、基金管理人对基金托管人的业务核查

(一) 基金管理人对基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括但不限于基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户、证券账户及投资所需的其他账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和各类基金份额净值、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、本托管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。基金托管人收到通知后应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。基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交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，在规定时间内答复基金管理人并改正。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正或未在合理期限内确认的，基金管理人应报告中国证监会。基金管理人有权要求基金托管人赔偿基金管理人及基金财产因此所遭受的损失。

(三) 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。基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经基金管理人提出警告仍不改正的，基金管理人应报告中国证监会。

### 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的资金账户、证券账户及投资所需的其他账户。
- 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.基金托管人按照基金合同和本协议的约定保管基金财产，如有特殊情况双方可另行协商解决。基金托管人未经基金管理人的合法合规指令，不得自行运用、处分、分配本基金的任何资产（不包含基金托管人依据中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中登公司”）结算数据完成场内交易交收、托管资产开户银行扣收结算费和账户维护费等费用）。
- 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。由此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，基金托管人应予以必要的协助与配合，但对此不承担相应责任。
- 7.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存于基金管理人开立的“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提前结束募集时，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》、基金合同等有关规定后，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本基金开立的基金银行账户，同时在规定时间内，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或基金停止募集时，未能达到基金备案的条件，由基金管理人按规定办理退款等事宜，基金托管人应提供充分协助。

### （三）基金银行账户的开立和管理

1.基金托管人以基金托管人名义开设本基金的基金托管专户，也称为资金账户，保管基金财产的银行存款。该基金托管专户同时也是基金托管人在法人集中清算模式下，代表所托管的包括本基金财产在内的所有托管资产与中登公司进行一级结算的专用账户。该账户的开设和管理由基金托管人承担。本基金的一切货币收支活动，均需通过基金托管人的基金托管专户进行。

2.基金托管人可根据实际情况需要，为本基金开立资金清算辅助账户，以办理相关的资金汇划业务。

3.基金托管专户的开立和使用，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。

4.基金托管专户的开立和管理应符合银行业监督管理机构的有关规定。

5.在符合法律法规规定的条件下，基金托管人可以通过基金托管专户办理基金资产的支付。

### （四）定期存款账户

基金财产投资定期存款在存款机构开立的银行账户，包括实体或虚拟账户，其预留印鉴经各方商议后预留。对于任何的定期存款投资，基金管理人都必须和存款机构签订定期存款协议，约定双方的权利和义务，该协议作为划款指令附件。在取得存款证实书后，基金托管人保管证实书正本或者复印件。基金管理人应该在合理的时间内进行定期存款的投资和支取事宜，若基金管理人提前支取或部分提前支取定期存款，若产生息差（即本基金已计提的资金利息和提前支取时收到的资金利息差额），该息差的处理方法由基金管理人和基金托管人双方协商解决。

对于任何的定期存款投资，基金管理人都必须和存款机构签订定期存款协议，约定双方的权利和义务，该协议作为划款指令附件。该协议中必须有如下明确条款：“存款证实书不得被质押或以任何方式被抵押，并不得用于转让和背书；本息到期归还或提前支取的所有款项必须划至托管专户（明确户名、开户行、账号等），不得划入其他任何账户”。如定期存款协议中未体现前述条款，基金托管人有权拒绝定期存款投资的划款指令。

### （五）债券托管账户的开设和管理

基金合同生效后，基金托管人根据中国人民银行、银行间市场登记结算机构的有关规定，以本基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司和银行间市场清算所股份有限公司开立

债券托管账户、资金结算账户，持有人账户和资金结算账户，并代表基金进行银行间市场债券的结算。

#### （六）基金证券账户和结算备付金账户的开立和管理

1. 基金托管人在中登公司上海分公司、深圳分公司为基金开立基金托管人与本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登公司开立结算备付金账户，并代表所托管的基金完成与中登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登公司的规定执行。

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。

#### （七）期货结算账户的开立和管理

基金托管人、基金管理人应当代表本基金，按照相关规定开立期货结算账户、期货资金账户，在中国金融期货交易所获取交易编码。期货结算账户名称、期货资金账户名称及交易编码对应名称应按照有关规定设立。

#### （八）其他账户的开立和管理

1. 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，由基金托管人开立。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。

#### （九）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、银行存款开户证实书等有价凭证由基金托管人存放于基金托管人的保管库，也可存入中央国债登记结算有限责任公司、中登公司上海分公司/深圳分公司、银行间市场清算所股份有限公司或票据营业中心的代保管库，保管凭证由基金托管人持有。实物证券、银行存款开户证实书等有价凭证的购买和转让，由基金管理人和基金托管人共同办理。属于基金托管人控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、灭失，由此产生的责任应由基金托管人承担。基金托管人对由基金托管人以外机构实际有效控制的资产不承担保管责任。

#### （十）与基金财产有关的重大合同的保管

与基金财产有关的重大合同的签署，由基金管理人负责。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包括但不限于基金年度审计合同、基金信息披露协议及基金投资业务中产生的重大合同，基金管理人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。重大合同的保管期限为基金合同终止后 15 年，法律法规另有规定或有权机关另有要求的除外。

对于无法取得二份以上的正本的，基金管理人应向基金托管人提供加盖公章的合同传真件或复印件，未经双方协商一致或未在合同约定范围内，合同原件不得转移，由基金管理人保管。

## 五、基金资产净值计算与会计核算

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。各类基金份额净值是指计算日该类基金资产净值除以计算日该类基金份额总数，各类基金份额净值的计算，均精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入，国家另有规定的，从其规定。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值。基金管理人每个工作日计算基金资产净值及各类基金份额净值，经基金托管人复核，按规定公告。

### 2. 复核程序

基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将各类基金份额净值结果以双方约定的方式提交给基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人按规定对外公布，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。

## 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和持有的基金份额。基金份额持有人名册由基金注册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，法律法规另有规定或有权机关另有要求的除外。如不能妥善保管，则按相关法规承担责任。

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，并保证其真实性、准确性和完整性。基金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、争议解决方式

因本协议产生或与之相关的争议，双方当事人应通过协商、调解解决，协商、调解不能解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，仲裁地点为北京市，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力，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、基金托管协议的变更、终止与基金财产的清算

### 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、基金托管协议终止的情形

- 1.基金合同终止；
- 2.基金托管人解散、依法被撤销、破产或由其他基金托管人接管基金资产；
- 3.基金管理人解散、依法被撤销、破产或由其他基金管理人接管基金管理权；
- 4.发生法律法规或基金合同规定的终止事项。