

# 鹏华丰收债券型证券投资基金 更新的招募说明书

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

2020年05月

## 重要提示

本基金经中国证券监督管理委员会 2008 年 3 月 21 日证监许可 [2008]405 号文《关于核准鹏华丰收债券型证券投资基金募集的批复》进行募集，并经中国证监会基金部 2008 年 5 月 28 日基金部函[2008]438 号文件《关于鹏华丰收债券型证券投资基金备案确认的函》确认合法备案。根据相关法律法规，本基金基金合同已于 2008 年 5 月 28 日正式生效，基金管理人于该日起正式开始对基金财产进行运作管理。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。请投资者根据自身风险承受能力谨慎选择适合自己的基金产品。

证券投资基金（以下简称“基金”）是一种长期投资工具，其主要功能是分散投资，降低投资单一证券所带来的个别风险。基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具，投资人购买基金，既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益，也可能承担基金投资所带来的损失。

基金在投资运作过程中可能面临各种风险，既包括市场风险，也包括基金自身的管理风险、技术风险和合规风险等。巨额赎回风险是开放式基金所特有的一种风险，即当单个交易日基金的净赎回申请超过基金总份额的百分之十时，投资人将可能无法及时赎回持有的全部基金份额。

基金分为股票基金、混合基金、债券基金、货币市场基金等不同类型，投资人投资不同类型的基金将获得不同的收益预期，也将承担不同程度的风险。一般来说，基金的收益预期越高，投资人承担的风险也越大。

投资有风险，投资人申购基金时应当认真阅读《基金合同》、《招募说明书》、《基金产品资料概要》等基金法律文件，了解基金的风险收益特征，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资人的风险承受能力相适应。

投资人应当充分了解基金定期定额投资和零存整取等储蓄方式的区别。定期定额投资是引导投资人进行长期投资、平均投资成本的一种简单易行的投资方式。但是定期定额投资并不能规避基金投资所固有的风险，不能保证投资人获得收益，也不是替代储蓄的等效理财方式。

基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎和勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。基金过往业绩并不预示基金未来表现，基金管

理人管理的其他基金的业绩不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行承担。

本基金以 1 元初始面值开展基金募集或因拆分、分红等行为导致基金份额净值调整至 1 元初始面值或 1 元附近，在证券市场波动等因素的影响下，基金投资仍有可能出现亏损或基金份额净值仍有可能低于初始面值。

投资人应当通过基金管理人或具有基金代销业务资格的其他机构购买和赎回基金，基金代销机构名单详见本基金《招募说明书》以及相关公告。

基金合同约定的基金产品资料概要编制、披露与更新要求，自《信息披露办法》实施之日起一年后开始执行。

本招募说明书所载内容截止日为 2020 年 04 月 15 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2019 年 12 月 31 日（未经审计）。

## 目 录

- 一、绪 言
- 二、释 义
- 三、基金管理人
- 四、基金托管人
- 五、相关服务机构
- 六、基金的募集与基金合同生效
- 七、基金份额的申购与赎回
- 八、基金的转换、非交易过户、转托管、定期定额投资计划和基金的冻结解冻
- 九、基金的投资
- 十、基金的业绩
- 十一、基金的财产
- 十二、基金资产的估值
- 十三、基金的收益分配
- 十四、基金的费用与税收
- 十五、基金的会计与审计
- 十六、基金的信息披露
- 十七、风险揭示
- 十八、基金的终止与清算
- 十九、基金合同的内容摘要
- 二十、基金托管协议的内容摘要
- 二十一、对基金份额持有人的服务
- 二十二、其他应披露事项
- 二十三、招募说明书的存放及查阅方式
- 二十四、备查文件

## 一、绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《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》）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称《流动性规定》）等有关法律法规的规定，以及《鹏华丰收债券型证券投资基金基金合同》（以下简称基金合同）的约定编写。

本招募说明书阐述了鹏华丰收债券型证券投资基金(以下简称“本基金”或“基金”)的投资目标、策略、风险、费率等与投资人投资决策有关的必要事项，投资人在做出投资决策前应仔细阅读本招募说明书，并根据自身风险承受能力选择适合自己的基金产品。

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

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

## 二、释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语具有以下含义：

- 1、基金或本基金:指鹏华丰收债券型证券投资基金
- 2、基金管理人或本基金管理人:指鹏华基金管理有限公司
- 3、基金托管人或本基金托管人:指中国建设银行股份有限公司
- 4、基金合同或本基金合同:指《鹏华丰收债券型证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充
- 5、托管协议:指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《鹏华丰收债券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《鹏华丰收债券型证券投资基金招募说明书》及其更新
- 7、基金份额发售公告:指《鹏华丰收债券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、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,自 2004 年 6 月 1 日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订

10、《销售办法》:指中国证监会 2011 年 6 月 9 日颁布、同年 10 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 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日实施的《公开募集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 2004 年 6 月 29 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

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

14、中国证监会:指中国证券监督管理委员会

15、银行业监督管理机构:指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会

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

17、个人投资者:指年满 18 周岁,合法持有现时有效的中华人民共和国居民身份证、军人证件等有效身份证件的中国公民,以及中国证监会批准的其他可以投资基金的自然人

18、机构投资者:指依法可以投资开放式证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法注册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:指符合现实有效的相关法律法规规定可以投资于中国境内证券市场的中国境外的机构投资者

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

21、基金份额持有人:指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

22、基金销售业务:指基金管理人或代销机构宣传推介基金,发售基金份额,办理基金份额的申购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务

23、销售机构:指直销机构和代销机构

24、直销机构:指鹏华基金管理有限公司

25、代销机构:指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件,取得基金代销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

26、基金销售网点:指直销机构的直销中心及代销机构的代销网点

27、登记结算业务: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、基金份额注册登记、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等

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

29、基金账户:指登记结算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

30、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买卖鹏华丰收债券型证券投资基金基金份额的变动及结余情况的账户

31、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

32、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

33、基金募集期限: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

34、存续期:指基金合同生效至终止之间的不定期期限

35、工作日:指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

36、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工作日

37、T+n日:指自T日起第n个工作日(不包含T日)

38、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

39、交易时间:指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段，具体时间见基金份额发售公告

40、业务规则:指《鹏华基金管理有限公司开放式基金业务规则》，是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金登记结算方面的业务规则，由基金管理人和投资人共同遵守

41、认购:指在基金募集期间，投资人申请购买基金份额的行为

42、申购: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

43、赎回:指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同规定的条件要求基金管理人购回基金份额的行为

44、基金转换:指基金份额持有人按照本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、且由同一登记结算机构办理登记结算的其他基金基金份额的行为

45、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

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

47、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)超过上一日基金总份额的 10%

48、元:指人民币元

49、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

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

51、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

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

53、基金资产净值:指基金资产总值减去基金负债后的价值

54、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

55、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

56、指定媒介:指中国证监会指定的用以进行信息披露的全国性报刊及指定互联网网站(包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站)等媒介

57、基金产品资料概要:指《鹏华丰收债券型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新

58、不可抗力:指本基金合同当事人不能预见、不能抗拒、不能避免且在本基金合同由基金管理人、基金托管人签署之日后发生的,使本基金合同当事人无法全部或部分履行本基金合



同的任何事件，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、恐怖袭击、传染病传播、法律法规变化、突发停电或其他突发事件、证券交易所非正常暂停或停止交易

### 三、基金管理人

#### (一) 基金管理人概况

- 1、名称：鹏华基金管理有限公司
- 2、住所：深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心 43 层
- 3、设立日期：1998 年 12 月 22 日
- 4、法定代表人：何如
- 5、办公地址：深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心 43 层
- 6、电话：(0755) 82021233 传真：(0755) 82021155
- 7、联系人：吕奇志
- 8、注册资本：人民币 1.5 亿元
- 9、股权结构：

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

#### (二) 主要人员情况

##### 1、基金管理人董事会成员

何如先生, 董事长, 硕士, 高级会计师, 国籍: 中国。历任中国电子器件公司深圳公司副总会计师兼财务处处长、总会计师、常务副总经理、总经理、党委书记, 深圳发展银行行长助理、副行长、党委委员、副董事长、行长、党委副书记等职务。现任国信证券股份有限公司董事长、党委书记。自 2008 年 12 月开始担任鹏华基金管理有限公司董事长。

邓召明先生, 党委书记、董事、总裁, 经济学博士, 讲师, 国籍: 中国。历任北京理工大学管理与经济学院讲师、中国兵器工业总公司主任科员、中国证监会处长、南方基金管理有限公

司副总裁、中国证监会第六、七届发审委委员，现任鹏华基金管理有限公司董事、总裁、党委书记。自 2012 年 12 月开始担任鹏华基金管理有限公司董事。

杜海江先生, 董事, 大学本科, 国籍: 中国。历任国信证券股份有限公司杭州萧然东路证券营业部电子商务部经理、杭州保俶路证券营业部总经理助理、浙江营销中心总经理、浙江管理总部总经理、杭州分公司总经理、浙江分公司总经理、公司总裁助理等职务。现任国信证券股份有限公司副总裁、经纪事业部总裁。自 2019 年 8 月开始担任鹏华基金管理有限公司董事。

周中国先生, 董事, 会计学硕士, 高级会计师, 注册会计师, 国籍: 中国。历任深圳华为技术有限公司定价中心经理助理, 国信证券股份有限公司资金财务总部业务经理、深圳金地证券服务部财务经理、资金财务总部高级经理、资金财务总部总经理助理、资金财务总部副总经理、人力资源总部副总经理、人力资源总部总经理等职务。现任国信证券股份有限公司财务负责人、资金财务总部总经理。自 2012 年 12 月开始担任鹏华基金管理有限公司董事。

Massimo Mazzini 先生, 董事, 经济和商学学士, 国籍: 意大利。曾在安达信 (Arthur Andersen) 从事风险管理和资产管理工作, 历任 CA AIPG SGR 投资总监、CAAM AI SGR 及 CA AIPG SGR 首席执行官和投资总监、东方汇理资产管理股份有限公司 (CAAM SGR) 投资副总监、农业信贷另类投资集团 (Credit Agricole Alternative Investments Group) 国际执行委员会委员、意大利欧利盛资本资产管理股份公司 (Eurizon Capital SGR S.p.A.) 投资方案部投资总监、Epsilon 资产管理股份公司 (Epsilon SGR) 首席执行官, 欧利盛资本股份公司 (Eurizon Capital S.A.) (卢森堡) 首席执行官和总经理。现任意大利欧利盛资本资产管理股份公司 (Eurizon Capital SGR S.p.A.) 市场及业务发展总监。自 2010 年 11 月开始担任鹏华基金管理有限公司董事。

Andrea Vismara 先生, 董事, 法学学士, 律师, 国籍: 意大利。曾在意大利多家律师事务所担任律师, 先后在法国农业信贷集团 (Credit Agricole Group) 东方汇理资产管理股份有限公司 (CAAM SGR) 法务部、产品开发部, 欧利盛资本资产管理股份公司 (Eurizon Capital SGR S.p.A.) 治理与股权部工作。现任意大利欧利盛资本资产管理股份公司 (Eurizon Capital SGR S.p.A.) 董事会秘书兼任企业事务和战略发展部总经理。自 2016 年 2 月开始担任鹏华基金管理有限公司董事。

史际春先生, 独立董事, 法学博士, 国籍: 中国。历任安徽大学讲师、中国人民大学副教授, 现任中国人民大学法学院教授、博士生导师, 国务院特殊津贴专家, 兼任中国法学会经济法学研究会副会长、北京市人大常委会和法制委员会委员。自 2008 年 9 月开始担任鹏华基金管理有限公司董事。

张元先生, 独立董事, 大学本科, 国籍: 中国。曾任新疆军区干事、秘书、编辑, 甘肃省委研究室干事、副处长、处长、副主任, 中央金融工作委员会研究室主任, 中国银监会政策法规部(研究局)主任(局长)等职务; 2005年6月至2007年12月, 任中央国债登记结算有限责任公司董事长兼党委书记; 2007年12月至2010年12月, 任中央国债登记结算有限责任公司监事长兼党委副书记。自2012年12月开始担任鹏华基金管理有限公司董事。

高臻女士, 独立董事, 工商管理硕士, 国籍: 中国。曾任中国进出口银行副处长, 负责贷款管理和运营, 项目涉及制造业、能源、电信、跨国并购; 2007年加入曼达林投资顾问有限公司, 现任曼达林投资顾问有限公司执行合伙人。自2012年12月开始担任鹏华基金管理有限公司董事。

## 2、基金管理人监事会成员

黄俞先生, 监事会主席, 管理学硕士, 国籍: 中国。曾在中农信公司、正大财务公司工作, 曾任鹏华基金管理有限公司董事、监事, 深圳市北融信投资发展有限公司董事长。自2013年11月开始担任鹏华基金管理有限公司监事会主席。

陈冰女士, 监事, 管理学学士, 国籍: 中国。曾任国信证券股份有限公司资金财务部会计、上海营业部财务科副科长、资金财务部财务科副经理、资金财务部资金科经理、资金财务部主任会计师兼科经理、资金财务部总经理助理、资金财务部副总经理、融资融券部总经理等职务。现任国信证券总裁助理, 兼证券金融事业部总裁、资金运营部总经理。自2015年6月开始担任鹏华基金管理有限公司监事。

SANDRO VESPRINI 先生, 监事, 工商管理学士, 国籍: 意大利。先后在米兰军医院出纳部、税务师事务所、菲亚特汽车发动机和变速器平台管控管理团队工作、圣保罗 IMI 资产管理 SGR 企业经管部、圣保罗财富管理企业管控部工作、曾任欧利盛资本资产管理股份公司 (Eurizon Capital SGR S.p.A.) 财务管理和投资经理, 现任欧利盛资本资产管理股份公司 (Eurizon Capital SGR S.p.A.) 财务负责人。自2016年2月开始担任鹏华基金管理有限公司监事。

郝文高先生, 职工监事, 大专学历, 国籍: 中国。历任深圳奥尊电脑有限公司证券投资基金事业部副经理、招商基金管理有限公司基金事务部总监; 2011年7月加盟鹏华基金管理有限公司, 现任登记结算部总经理。自2015年9月开始担任鹏华基金管理有限公司监事。

刘焯先生, 职工监事, 管理学硕士, 国籍: 中国。历任毕马威(中国)管理顾问公司咨询顾问, 南方基金管理有限公司北京分公司副总经理; 2014年10月加入鹏华基金管理有限公司, 现任总裁助理、机构理财部总经理、北京分公司总经理。自2015年9月开始担任鹏华基金管理有限公司监事。

左彬先生, 职工监事, 法学硕士, 国籍: 中国。历任中国平安保险(集团)股份有限公司法律事务部律师; 2016年4月加盟鹏华基金管理有限公司, 历任监察稽核部高级合规经理, 现任监察稽核部高级合规官。自2019年9月开始担任鹏华基金管理有限公司监事。

### 3、高级管理人员情况

何如先生, 董事长, 硕士, 高级会计师, 国籍: 中国。历任中国电子器件公司深圳公司副总会计师兼财务处处长、总会计师、常务副总经理、总经理、党委书记, 深圳发展银行行长助理、副行长、党委委员、副董事长、行长、党委副书记等职务。现任国信证券股份有限公司董事长、党委书记。自2008年12月开始担任鹏华基金管理有限公司董事长。。

邓召明先生, 党委书记、董事、总裁, 经济学博士, 讲师, 国籍: 中国。历任北京理工大学管理与经济学院讲师、中国兵器工业总公司主任科员、中国证监会处长、南方基金管理有限公司副总裁、中国证监会第六、七届发审委委员, 现任鹏华基金管理有限公司董事、总裁、党委书记。自2012年12月开始担任鹏华基金管理有限公司董事。

高阳先生, 党委副书记、副总裁, 特许金融分析师(CFA), 经济学硕士, 国籍: 中国。历任中国国际金融有限公司经理, 博时基金管理有限公司博时价值增长基金基金经理、固定收益部总经理、基金裕泽基金经理、基金裕隆基金经理、股票投资部总经理, 自2008年12月起担任鹏华基金管理有限公司副总裁。

邢彪先生, 副总裁, 工商管理硕士、法学硕士, 国籍: 中国。历任中国人民大学校办科员, 中国证监会办公厅副处级秘书, 全国社保基金理事会证券投资部处长、股权资产部(实业投资部)副主任, 并于2014年至2015年期间担任中国证监会第16届主板发审委专职委员, 自2015年10月起担任鹏华基金管理有限公司副总裁。

高鹏先生, 副总裁, 经济学硕士, 国籍: 中国。历任博时基金管理有限公司监察法律部监察稽核经理, 鹏华基金管理有限公司监察稽核部副总经理、监察稽核部总经理、职工监事、督察长, 自2014年12月起担任鹏华基金管理有限公司副总裁。

苏波先生, 副总裁, 管理学博士, 国籍: 中国。历任深圳经济特区证券公司研究所副所长、投资部经理, 南方基金管理有限公司渠道服务二部总监助理, 易方达基金管理有限公司信息技术部总经理助理, 鹏华基金管理有限公司机构理财部总经理、职工监事、总裁助理, 自2015年9月起担任鹏华基金管理有限公司副总裁。

高永杰先生, 纪委书记, 督察长, 法学硕士, 国籍: 中国。历任中共中央办公厅秘书局干部, 中国证监会办公厅新闻处干部、秘书处副处级秘书、发行监管部副处长、人事教育部副处长、处长, 自2015年2月担任鹏华基金管理有限公司纪委书记、督察长。

韩亚庆先生, 副总裁, 经济学硕士, 国籍: 中国。历任国家开发银行资金局主任科员、全国社会保障基金理事会投资部副调研员、南方基金管理有限公司固定收益部基金经理、固定收益部总监, 自 2017 年 3 月起担任鹏华基金管理有限公司副总裁、固定收益投资总监、固定收益总部总经理。

#### 4、本基金基金经理

刘太阳先生, 国籍中国, 理学硕士, 14 年证券基金从业经验。曾任中国农业银行金融市场部高级交易员, 从事债券投资交易工作; 2011 年 5 月加盟鹏华基金管理有限公司, 从事债券研究工作, 担任固定收益部研究员, 现担任公募债券投资部总经理、基金经理。2012 年 09 月至 2018 年 04 月担任鹏华纯债债券基金基金经理, 2012 年 12 月至 2015 年 04 月担任鹏华月月发短期理财债券基金基金经理, 2013 年 04 月至 2016 年 04 月担任鹏华丰利分级债券基金基金经理, 2013 年 05 月至 2018 年 12 月担任鹏华实业债基金基金经理, 2015 年 03 月担任鹏华丰盛债券基金基金经理, 2016 年 02 月至 2018 年 03 月担任鹏华弘盛混合基金基金经理, 2016 年 04 月至 2018 年 04 月担任鹏华丰利债券 (LOF) 基金基金经理, 2016 年 08 月至 2020 年 02 月担任鹏华双债保利债券基金基金经理, 2016 年 08 月担任鹏华丰收债券基金基金经理, 2016 年 08 月至 2017 年 09 月担任鹏华丰安债券基金基金经理, 2016 年 08 月至 2018 年 06 月担任鹏华丰达债券基金基金经理, 2016 年 09 月至 2018 年 04 月担任鹏华丰恒债券基金基金经理, 2016 年 10 月至 2018 年 05 月担任鹏华丰禄债券基金基金经理, 2016 年 10 月至 2018 年 05 月担任鹏华丰腾债券基金基金经理, 2016 年 11 月至 2018 年 07 月担任鹏华丰盈债券基金基金经理, 2016 年 12 月至 2018 年 05 月担任鹏华普泰债券基金基金经理, 2016 年 12 月至 2018 年 07 月担任鹏华丰惠债券基金基金经理, 2017 年 02 月至 2018 年 06 月担任鹏华安益增强混合基金基金经理, 2017 年 03 月至 2018 年 06 月担任鹏华丰享债券基金基金经理, 2017 年 03 月至 2018 年 06 月担任鹏华丰玉债券基金基金经理, 2017 年 03 月至 2017 年 12 月担任鹏华丰嘉债券基金基金经理, 2017 年 03 月至 2018 年 04 月担任鹏华丰康债券基金基金经理, 2017 年 04 月至 2018 年 05 月担任鹏华丰瑞债券基金基金经理, 2017 年 06 月至 2018 年 06 月担任鹏华丰源债券基金基金经理, 2017 年 06 月至 2018 年 03 月担任鹏华丰玺债券基金基金经理, 2018 年 10 月担任鹏华双债增利债券基金基金经理, 2018 年 12 月至 2019 年 01 月担任鹏华永诚一年定期开放债券基金基金经理, 2019 年 09 月担任鹏华丰润债券 (LOF) 基金基金经理, 2019 年 09 月担任鹏华丰源债券基金基金经理, 2019 年 09 月担任鹏华丰华债券基金基金经理, 2019 年 09 月担任鹏华丰玉债券基金基金经理, 2019 年 10 月担任鹏华丰庆债券基金基金经理, 2020 年 03 月担任鹏华安泽混合基金基金经理。刘太阳先生具备基金从业资格。

本基金基金经理管理的其他基金情况:

2012年09月至2018年04月担任鹏华纯债债券基金基金经理

2012年12月至2015年04月担任鹏华月月发短期理财债券基金基金经理

2013年04月至2016年04月担任鹏华丰利分级债券基金基金经理

2013年05月至2018年12月担任鹏华实业债基金基金经理

2015年03月担任鹏华丰盛债券基金基金经理

2016年02月至2018年03月担任鹏华弘盛混合基金基金经理

2016年04月至2018年04月担任鹏华丰利债券（LOF）基金基金经理

2016年08月至2020年02月担任鹏华双债保利债券基金基金经理

2016年08月至2017年09月担任鹏华丰安债券基金基金经理

2016年08月至2018年06月担任鹏华丰达债券基金基金经理

2016年09月至2018年04月担任鹏华丰恒债券基金基金经理

2016年10月至2018年05月担任鹏华丰禄债券基金基金经理

2016年10月至2018年05月担任鹏华丰腾债券基金基金经理

2016年11月至2018年07月担任鹏华丰盈债券基金基金经理

2016年12月至2018年05月担任鹏华普泰债券基金基金经理

2016年12月至2018年07月担任鹏华丰惠债券基金基金经理

2017年02月至2018年06月担任鹏华安益增强混合基金基金经理

2017年03月至2018年06月担任鹏华丰享债券基金基金经理

2017年03月至2018年06月担任鹏华丰玉债券基金基金经理

2017年03月至2017年12月担任鹏华丰嘉债券基金基金经理

2017年03月至2018年04月担任鹏华丰康债券基金基金经理

2017年04月至2018年05月担任鹏华丰瑞债券基金基金经理

2017年06月至2018年06月担任鹏华丰源债券基金基金经理

2017年06月至2018年03月担任鹏华丰玺债券基金基金经理

2018年10月担任鹏华双债增利债券基金基金经理

2018年12月至2019年01月担任鹏华永诚一年定期开放债券基金基金经理

2019年09月担任鹏华丰润债券（LOF）基金基金经理

2019年09月担任鹏华丰源债券基金基金经理

2019年09月担任鹏华丰华债券基金基金经理

2019年09月担任鹏华丰玉债券基金基金经理

2019年10月担任鹏华丰庆债券基金基金经理

2020年03月担任鹏华安泽混合基金基金经理

本基金历任的基金经理：

2008年05月至2016年08月 阳先伟先生

#### 5、投资决策委员会成员情况

邓召明先生,鹏华基金管理有限公司党委书记、董事、总裁。

高阳先生,鹏华基金管理有限公司党委副书记、副总裁。

邢彪先生,鹏华基金管理有限公司副总裁。

高鹏先生,鹏华基金管理有限公司副总裁。

韩亚庆先生,鹏华基金管理有限公司副总裁。

梁浩先生,鹏华基金管理有限公司研究部总经理/董事总经理(MD)/基金经理,鹏华新兴产业混合、鹏华研究精选混合、鹏华创新驱动混合、鹏华研究智选混合、鹏华价值驱动混合基金、鹏华科技创新混合基金经理。

赵强先生,鹏华基金管理有限公司资产配置与基金投资部 FOF 投资副总监/基金经理,鹏华养老 2045 混合发起式 (FOF) 基金经理。

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

### (三) 基金管理人的职责

1、依法募集基金,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募集、申购、赎回和登记事宜;

2、办理基金备案手续;

3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账,进行证券投资;

4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配收益;

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;

6、编制季度报告、中期报告和年度报告;

7、计算并公告基金净值信息,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《证券法》、《基金法》、《销售办法》、《运作办法》、《信息披露办法》等法律法规的行为，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违法行为的发生。

2、基金管理人的禁止行为：

- （1）将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
- （2）不公平地对待公司管理的不同基金财产；
- （3）利用基金财产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）法律法规以及中国证监会禁止的其他行为。

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

- （1）越权或违规经营；
- （2）违反法律法规、基金合同或托管协议；
- （3）故意损害基金份额持有人或本基金合同其他当事人的合法权益；
- （4）在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；
- （5）拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- （6）玩忽职守、滥用职权；
- （7）泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；
- （8）除按本基金管理人制度进行基金运作投资外，直接或间接进行其他股票投资；
- （9）协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易；
- （10）违反证券交易所业务规则，利用对敲、倒仓等非法手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；
- （11）贬损同行，以提高自己；
- （12）在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；



- (13) 以不正当手段谋求业务发展；
- (14) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
- (15) 其他法律、行政法规禁止的行为。

#### 4、基金经理承诺

- (1) 依照有关法律法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；
- (2) 不得利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者谋取利益；
- (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；
- (4) 不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

### **(五) 基金管理人的内部控制制度**

#### 1、内部控制的原则

基金管理人的内部控制遵循以下原则：

- (1) 健全性原则：内部控制应当包括公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员，并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节；
- (2) 有效性原则：通过科学的内控手段和方法，建立合理的内控程序，维护内控制度的有效执行；
- (3) 独立性原则：公司各机构、部门和岗位职责应当保持相对独立，公司基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离；
- (4) 相互制约原则：公司内部部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡；
- (5) 成本效益原则：公司运用科学化的经营管理方法降低运作成本，提高经济效益，以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

#### 2、制订内部控制制度应当遵循以下原则：

- (1) 合法合规性原则：基金管理人内控制度应当符合国家法律、法规、规章和各项规定；
- (2) 全面性原则：内部控制制度应当涵盖基金管理人经营管理的各个环节，不得留有制度上的空白或漏洞；
- (3) 审慎性原则：制定内部控制制度应当以审慎经营、防范和化解风险为出发点；
- (4) 适时性原则：内部控制制度的制定应当随着有关法律法规的调整和基金管理人经营战略、经营方针、经营理念等内外部环境的变化进行及时的修改或完善。

#### 3、内部控制体系

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

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

(3) 公司定期召开全体中层及以上管理人员会议对各类风险予以充分的评估和防范，对业务过程中潜在和存在的风险进行通报、讨论，并及时采取防范和控制措施。

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

(5) 业务部门：对本部门业务范围内的业务风险负有管控和及时报告的义务。

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

#### 4、内部控制措施

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

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

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

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

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

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

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

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

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

(10) 不断强化投资纪律，严格实施股票库制度：公司不断强化投资纪律，加强集体决策机制，各基金的行业配置比例、基金经理个股授权、基准仓位等由投资决策委员会决定。同时，公司建立了严格的股票库制度、禁止和限制投资股票制度，并由研究小组负责维护，所有股票投资必须完全从股票库中选择。公司还建立了契约风险评估制度，定期对各基金遵守基金合同的情况进行评估，防范契约风险。

#### 5、基金管理人关于内部合规控制书的声明

- (1) 基金管理人确知建立、实施和维持内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任；
- (2) 本基金管理人承诺以上关于内部控制的披露真实、准确；
- (3) 本基金管理人承诺根据市场变化和公司发展不断完善内部控制体系和内部控制制度。

## 四、基金托管人

### 一、基金托管人情况

#### (一) 基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：田国立

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

联系人：田 青

联系电话：(010)6759 5096

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

2018 年末，集团资产规模 23.22 万亿元，较上年增长 4.96%。2018 年度，集团实现净利润 2,556.26 亿元，较上年增长 4.93%；平均资产回报率和加权平均净资产收益率分别为 1.13% 和 14.04%；不良贷款率 1.46%，保持稳中有降；资本充足率 17.19%，保持领先同业。

2018 年，本集团先后荣获新加坡《亚洲银行家》“2018 年中国最佳大型零售银行奖”、“2018 年中国全面风险管理成就奖”；美国《环球金融》“全球贸易金融最具创新力银行”、《银行家》“2018 最佳金融创新奖”、《金融时报》“2018 年金龙奖—年度最佳普惠金融服务银行”等多项重要奖项。本集团同时获得英国《银行家》、香港《亚洲货币》杂志“2018 年中国最佳银行”称号，并在中国银行业协会 2018 年“陀螺”评价中排名全国性商业银行第一。

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合与合规管理处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、养老金托管处、全球托管处、新兴业务处、运营管理处、托管应用系统支持处、跨境托管运营处、合规监督处等 11 个职能处室，在安徽合肥设有托管运营中心，在上海设有托管运营中心上海分中心，共有员工 300 余人。自 2007 年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

## (二) 主要人员情况

蔡亚蓉，资产托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行总行资金计划部、信贷经营部、公司业务部以及中国建设银行重组改制办公室任职，并在总行公司业务部担任领导职务。长期从事公司业务，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

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

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

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

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

户服务和业务管理经验。

### （三）基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、(R)QFII、(R)QDII、企业年金、存托业务等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至 2019 年二季度末，中国建设银行已托管 924 只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行先后 9 次获得《全球托管人》“中国最佳托管银行”、4 次获得《财资》“中国最佳次托管银行”、连续 5 年获得中债登“优秀资产托管机构”等奖项，并在 2016 年被《环球金融》评为中国市场唯一一家“最佳托管银行”、在 2017 年荣获《亚洲银行家》“最佳托管系统实施奖”。

## 二、基金托管人的内部控制制度

### （一）内部控制目标

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

### （二）内部控制组织结构

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

### （三）内部控制制度及措施

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

## 三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

### （一）监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。利用自行

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

## （二）监督流程

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

2. 收到基金管理人的划款指令后，对指令要素等内容进行核查。

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

# 五、相关服务机构

## （一）基金销售机构

### 1、直销机构

#### （1）鹏华基金管理有限公司

注册（办公）地址：深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心 43 层

法定代表人：何如

电话：（0755）82021233

传真：（0755）82021155

联系人：吕奇志

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

#### （2）鹏华基金管理有限公司北京分公司

办公地址：北京市西城区金融大街甲 9 号金融街中心南楼 502 房

电话：（010）88082426-178

传真：（010）88082018

联系人：张圆圆

#### （3）鹏华基金管理有限公司上海分公司

办公地址：上海市浦东新区花园石桥路 33 号花旗银行大厦 801B 室

电话：（021）68876878

传真：（021）68876821

联系人：李化怡

(4) 鹏华基金管理有限公司武汉分公司

办公地址：武汉市江汉区建设大道 568 号新世界国贸大厦 I 座 3305 室

电话：(027) 85557881

传真：(027) 85557973

联系人：祁明兵

(5) 鹏华基金管理有限公司广州分公司

办公地址：广州市天河区珠江新城华夏路 10 号富力中心 24 楼 07 单元

联系电话：(020) 38927993

传真：(020) 38927990

联系人：周樱

## 2、其他销售机构

(1) 银行销售机构

1) 北京银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街甲 17 号首层

办公地址：北京市西城区金融大街丙 17 号

法定代表人：张东宁

联系人：张喆

客户服务电话：95526

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

2) 东莞农村商业银行股份有限公司

注册地址：广东省东莞市城区南城路 2 号

办公地址：广东省东莞市城区南城路 2 号

法定代表人：王耀球

联系人：杨亢

客户服务电话：0769-961122

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

3) 东莞银行股份有限公司

注册地址：东莞市莞城区体育路 21 号

办公地址：东莞市莞城区体育路 21 号

法定代表人：卢国锋

联系人：陈幸

客户服务电话：4001196228

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

4) 广发银行股份有限公司

注册地址：广州市东风东路 713 号

办公地址：北京市东城区东长安街甲 2 号

法定代表人：杨明生

联系人：陈涇渭

客户服务电话：4008308003

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

5) 杭州银行股份有限公司

注册地址：杭州市庆春路 46 号杭州银行大厦

办公地址：杭州市庆春路 46 号杭州银行大厦

法定代表人：吴太普

联系人：严峻

客户服务电话：95398

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

6) 华夏银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

法定代表人：李民吉

联系人：董金

客户服务电话：95577

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

7) 江苏江南农村商业银行股份有限公司

注册地址：江苏省常州市和平中路 413 号

办公地址：江苏省常州市和平中路 413 号

法定代表人：陆向阳

联系人：蒋娇

客户服务电话：0519-96005

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

8) 江苏银行股份有限公司

注册地址：南京市秦淮区中华路 26 号



办公地址：南京市秦淮区中华路 26 号

法定代表人：夏平

客户服务电话：95319

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

9) 交通银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：任德奇

联系人：王菁

客户服务电话：95559

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

10) 洛阳银行股份有限公司

注册地址：河南洛阳洛龙区开元大道 256 号

办公地址：河南洛阳洛龙区开元大道 256 号

法定代表人：王建甫

联系人：李亚洁

客户服务电话：96699

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

11) 南京银行股份有限公司

注册地址：江苏省南京市玄武区中山路 288 号

办公地址：江苏省南京市玄武区中山路 288 号

法定代表人：胡昇荣

客户服务电话：95302

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

12) 宁波银行股份有限公司

注册地址：浙江省宁波市鄞州区宁东路 345 号

办公地址：浙江省宁波市鄞州区宁东路 345 号

法定代表人：陆华裕

联系人：胡技勋

客户服务电话：95574

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

13) 平安银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南东路 5047 号

办公地址：深圳市深南东路 5047 号

法定代表人：谢永林

联系人：张莉

客户服务电话：95511-3

网址：bank.pingan.com

14) 上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市中山东一路 12 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：高国富

联系人：唐苑

客户服务电话：95528

网址：www.spdb.com.cn

15) 上海银行股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 168 号

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 168 号

法定代表人：金煜

联系人：汤征程

客户服务电话：95594

网址：www.bosc.cn

16) 厦门银行股份有限公司

注册地址：厦门市思明区湖滨北路 101 号商业银行大厦

办公地址：厦门市思明区湖滨北路 101 号商业银行大厦

法定代表人：吴世群

联系人：刘冬阳

客户服务电话：400-858-8888

网址：www.xmccb.com

17) 兴业银行股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 154 号中山大厦

办公地址：上海市江宁路 168 号

法定代表人：高建平

联系人：刘玲

客户服务电话：95561

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

18) 招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：李建红

联系人：邓炯鹏

客户服务电话：95555

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

19) 浙江民泰商业银行股份有限公司

注册地址：浙江省台州市温岭市三星大道 168 号

办公地址：浙江省台州市温岭市三星大道 168 号

法定代表人：江建法

联系人：刘兴龙

客户服务电话：4008896521

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

20) 浙商银行股份有限公司

注册地址：中国杭州市庆春路 288 号

办公地址：中国杭州市庆春路 288 号

法定代表人：沈仁康

联系人：沈崑杰

客户服务电话：95527

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

21) 中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京复兴门内大街 55 号

办公地址：北京复兴门内大街 55 号

法定代表人：陈四清

联系人：刘秀宇

客户服务电话：95588

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

22) 中国光大银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心

办公地址：北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心

法定代表人：李晓鹏

联系人：穆欣欣

客户服务电话：95595

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

23) 中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区金融大街 25 号

法定代表人：田国立

联系人：王未雨

客户服务电话：95533

网址：[www.ccb.com](http://www.ccb.com)

24) 中国民生银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：洪崎

联系人：穆婷

客户服务电话：95568

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

25) 中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：周慕冰

联系人：邱泽滨

客户服务电话：95599

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

26) 中国银行股份有限公司

注册地址：北京市复兴门内大街 1 号

办公地址：北京市复兴门内大街 1 号

法定代表人：陈四清

联系人：陈洪源

客户服务电话：95566

网址: [www.boc.cn](http://www.boc.cn)

27) 中国邮政储蓄银行股份有限公司

注册地址: 北京市西城区金融大街 3 号

办公地址: 北京市西城区金融大街 3 号

法定代表人: 张金良

联系人: 王硕

客户服务电话: 95580

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

28) 中信银行股份有限公司

注册地址: 北京市东城区朝阳门北大街 9 号

办公地址: 北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

法定代表人: 李庆萍

联系人: 迟卓

客户服务电话: 95558

网址: [bank.ecitic.com](http://bank.ecitic.com)

## (2) 证券公司销售机构

1) 爱建证券有限责任公司

注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 1600 号 1 幢 32 楼

办公地址: 中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 1600 号 1 幢 32 楼

法定代表人: 祝健

联系人: 王冠昌

客户服务电话: 4001-962-502

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

2) 安信证券股份有限公司

注册地址: 深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

办公地址: 深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

法定代表人: 王连志

联系人: 陈剑虹

客户服务电话: 95517 或 4008-001-001

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

3) 渤海证券股份有限公司

注册地址: 天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

办公地址：天津市南开区宾水西道 8 号

法定代表人：王春峰

联系人：蔡霆

客户服务电话：400-651-5988

网址：www.ewww.com.cn

4) 财富证券有限责任公司

注册地址：长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26-28 层

办公地址：长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 36 层

法定代表人：蔡一兵

联系人：郭静

客户服务电话：95317

网址：www.cfzq.com

5) 财通证券股份有限公司

注册地址：杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心 201、501、502、1103、1601-1615、  
1701-1716

办公地址：杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心 201、501、502、1103、1601-1615、  
1701-1716

法定代表人：沈继宁

联系人：陶志华

客户服务电话：95336

网址：www.ctsec.com

6) 长城国瑞证券有限公司

注册地址：厦门市思明区莲前西路 2 号莲富大厦 17 楼

办公地址：厦门市思明区深田路 46 号深田国际大厦 20F

法定代表人：王勇

联系人：邱震

客户服务电话：400-0099-886

网址：www.gwgsc.com

7) 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 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：曹宏

联系人：金夏

客户服务电话：400-666-6888

网址：www.cgws.com

8) 长江证券股份有限公司

注册地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

办公地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：尤习贵

联系人：奚博宇

客户服务电话：95579/4008-888-999

网址：www.95579.com

9) 第一创业证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼

办公地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼

法定代表人：刘学民

联系人：毛诗莉

客户服务电话：95358

网址：www.firstcapital.com.cn

10) 东北证券股份有限公司

注册地址：长春市生态大街 6666 号

办公地址：长春市生态大街 6666 号

法定代表人：李福春

联系人：安岩岩

客户服务电话：95360

网址：www.nesc.cn

11) 东海证券股份有限公司

注册地址：江苏省常州延陵西路 23 号投资广场 18 层

办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦

法定代表人：钱俊文

联系人：王一彦

客户服务电话：95531；400-8888-588

网址：www.longone.com.cn

12) 东莞证券股份有限公司

注册地址：广东省东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心

办公地址：广东省东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心

法定代表人：陈照星（代）

联系人：李荣

客户服务电话：95328

网址：www.dgzq.com.cn

13) 东吴证券股份有限公司

注册地址：苏州工业园区星阳街 5 号

办公地址：苏州工业园区星阳街 5 号

法定代表人：范力

联系人：陆晓

客户服务电话：95330

网址：www.dwzq.com.cn

14) 东兴证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 12-15 层

办公地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 12-15 层

法定代表人：魏庆华

联系人：汤漫川

客户服务电话：95309

网址：www.dxzq.net

15) 方正证券股份有限公司

注册地址：湖南省长沙市天心区湘江中路二段 36 号华远华中心 4、5 号楼 3701-3717

办公地址：北京市朝阳区北四环中路盘古大观 A 座 40 层

法定代表人：高利

联系人：丁敏

客户服务电话：95571

网址：www.foundersc.com

16) 光大证券股份有限公司

注册地址：上海市新闸路 1508 号

办公地址：上海市新闸路 1508 号

法定代表人：周健男

联系人：龚俊涛



客户服务电话：95525

网址：www.ebscn.com

17) 广发证券股份有限公司

注册地址：广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街2号618室

办公地址：广州市天河区马场路26号广发证券大厦

法定代表人：孙树明

联系人：黄岚

客户服务电话：95575 或 (020) 95575

网址：www.gf.com.cn

18) 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

客户服务电话：400-818-8118

网址：www.guodu.com

19) 国海证券股份有限公司

注册地址：广西桂林市辅星路13号

办公地址：广西南宁市滨湖路46号

法定代表人：何春梅

联系人：牛孟宇

客户服务电话：95563

网址：www.ghzq.com.cn

20) 国金证券股份有限公司

注册地址：四川省成都市东城根上街95号

办公地址：四川省成都市东城根上街95号

法定代表人：冉云

联系人：贾鹏

客户服务电话：95310

网址：www.gjq.com.cn

21) 国联证券股份有限公司

注册地址：无锡市金融一街8号

办公地址：无锡市金融一街 8 号国联大厦

法定代表人：姚志勇

联系人：祁昊

客户服务电话：95570

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

22) 国融证券股份有限公司

注册地址：内蒙古自治区呼和浩特市武川县腾飞大道 1 号 4 楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号长安兴融中心西座 11 层

法定代表人：张智河

联系人：郭一非

客户服务电话：95385

网址：<http://www.grzq.com>

23) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号

办公地址：上海市静安区南京西路 768 号国泰君安大厦

法定代表人：贺青

联系人：钟伟镇

客户服务电话：95521/400-8888-666

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

24) 国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人：何如

联系人：李颖

客户服务电话：95536

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

25) 海通证券股份有限公司

注册地址：上海市黄浦区广东路 689 号海通证券大厦

办公地址：上海市黄浦区广东路 689 号海通证券大厦

法定代表人：周杰

联系人：赖奕欣

客户服务电话：95553

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

26) 红塔证券股份有限公司

注册地址: 云南省昆明市北京路 155 号附 1 号

办公地址: 云南省昆明市北京路 155 号附 1 号

法定代表人: 况雨林

联系人: 刘晓明

客户服务电话: 400-871-8880

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

27) 华安证券股份有限公司

注册地址: 安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号财智中心 B

办公地址: 安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

法定代表人: 章宏韬

联系人: 范超

客户服务电话: 95318

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

28) 华宝证券有限责任公司

注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 100 号 57 层

办公地址: 中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 100 号 57 层

法定代表人: 陈林

联系人: 胡星煜

客户服务电话: 400-820-9898

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

29) 华福证券有限责任公司

注册地址: 福州市鼓楼区温泉街道五四路 157 号 7-8 层

办公地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路 1088 号招商银行大厦 18 楼

法定代表人: 黄金琳

联系人: 王虹

客户服务电话: 95547(福建省外电信、联通用户暂加拨 0593-95547)

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

30) 华林证券股份有限公司

注册地址: 西藏自治区拉萨市柳梧新区察古大道 1-1 君泰国际 B 栋一层 3 号

办公地址: 深圳市福田区民田路 178 号华融大厦 6 楼

法定代表人：林立

联系人：胡倩

客户服务电话：400-188-3888

网址：www.chinalin.com

31) 华龙证券股份有限公司

注册地址：兰州市城关区东岗西路 638 号兰州财富中心 21 楼

办公地址：兰州市城关区东岗西路 638 号 19 楼

法定代表人：李晓安

联系人：范坤

客户服务电话：95368

网址：www.hlzq.com

32) 华融证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 8 号

办公地址：北京市朝阳区朝阳门北大街 18 号中国人保寿险大厦 11 至 18 层

法定代表人：祝献忠

联系人：孙燕波

客户服务电话：95390

网址：www.hrsec.com.cn

33) 华泰证券股份有限公司

注册地址：南京市江东中路 228 号

办公地址：南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场、广东省深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 10 楼

法定代表人：周易

联系人：胡子豪

客户服务电话：95597

网址：www.htsc.com.cn

34) 华西证券股份有限公司

注册地址：四川省成都市高新区天府二街 198 号

办公地址：四川省成都市高新区天府二街 198 号

法定代表人：杨炯洋

联系人：谢国梅

客户服务电话：95584

网址: [www.hx168.com.cn](http://www.hx168.com.cn)

35) 华鑫证券有限责任公司

注册地址: 深圳市福田区莲花街道福中社区深南大道 2008 号中国凤凰大厦 1 栋 20C-1 房

办公地址: 上海市徐汇区宛平南路 8 号

法定代表人: 俞洋

联系人: 杨莉娟

客户服务电话: 021-32109999; 029-68918888; 4001099918

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

36) 江海证券有限公司

注册地址: 黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

办公地址: 黑龙江省哈尔滨市松北区创新三路 833 号

法定代表人: 孙名扬

联系人: 姜志伟

客户服务电话: 956007

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

37) 金元证券股份有限公司

注册地址: 海口市南宝路 36 号证券大厦 4 楼

办公地址: 深圳市福田区深南大道 4001 号时代金融中心 17 层

法定代表人: 王作义

联系人: 马贤清

客户服务电话: 95372

网址: [www.jyzq.cn](http://www.jyzq.cn)

38) 开源证券股份有限公司

注册地址: 西安市高新区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层

办公地址: 西安市高新区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层

法定代表人: 李刚

联系人: 袁伟涛

客户服务电话: 95325/400-860-8866

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

39) 民生证券股份有限公司

注册地址: 北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-20 层

办公地址: 北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-20 层

法定代表人：冯鹤年

联系人：韩秀萍

客户服务电话：95376

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

40) 平安证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路 5033 号平安金融中心 61 层-64 层

办公地址：深圳市福田区益田路 5033 号平安金融中心 61 层-64 层

法定代表人：何之江

联系人：周一涵

客户服务电话：95511-8

网址：[stock.pingan.com](http://stock.pingan.com)

41) 上海证券有限责任公司

注册地址：上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼

办公地址：上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼

法定代表人：李俊杰

联系人：魏熠珩

客户服务电话：4008918918

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

42) 申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人：李梅

联系人：李玉婷

客户服务电话：95523/4008895523

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

43) 世纪证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区深南大道招商银行大厦 40/42 层

办公地址：深圳市福田区深南大道招商银行大厦 40/42 层

法定代表人：李强

联系人：王雯

客户服务电话：4008323000

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

44) 天风证券股份有限公司

注册地址：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦4楼

办公地址：湖北省武汉市武昌区中南路99号保利广场A座37楼

法定代表人：余磊

联系人：夏旻

客户服务电话：95391/4008005000

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

45) 万联证券股份有限公司

注册地址：广东省广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F座18、19层

办公地址：广东省广州市天河区珠江东路13号高德置地广场E座12层

法定代表人：张建军

联系人：甘蕾

客户服务电话：95322

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

46) 五矿证券有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心办公室47层01单元

办公地址：深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心办公室47层01单元

法定代表人：赵立功

联系人：马国栋

客户服务电话：4001840028

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

47) 西部证券股份有限公司

注册地址：西安市新城东大街232号陕西信托大厦

办公地址：西安市新城东大街232号陕西信托大厦16-17层

法定代表人：刘建武

联系人：梁承华

客户服务电话：95582

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

48) 西南证券股份有限公司

注册地址：重庆市江北区桥北苑8号

办公地址：重庆市江北区桥北苑8号

法定代表人：廖庆轩

联系人：周青

客户服务电话：4008096096/95355

网址：www.swsc.com.cn

49) 湘财证券股份有限公司

注册地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼

办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼

法定代表人：孙永祥

联系人：李欣

客户服务电话：95351

网址：www.xcsc.com

50) 新时代证券股份有限公司

注册地址：北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501

办公地址：北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501

法定代表人：叶顺德

联系人：田芳芳

客户服务电话：95399

网址：www.xsdzq.cn

51) 信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人：张志刚

联系人：尹旭航

客户服务电话：95321

网址：www.cindasc.com

52) 兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 268 号

办公地址：上海市浦东新区长柳路 36 号

法定代表人：杨华辉

联系人：乔琳雪

客户服务电话：95562

网址：www.xyzq.com.cn

53) 银泰证券有限责任公司



注册地址：深圳市福田区竹子林四路紫竹七道 1 8 号光大银行大厦 1 8 楼

办公地址：深圳市福田区竹子林四路紫竹七道 1 8 号光大银行大厦 1 8 楼

法定代表人：黄冰

联系人：林文宇

客户服务电话：4008-505-505/0755-28810131

网址：www.ytzq.net

54) 粤开证券股份有限公司

注册地址：惠州市江北东江三路 55 号广播电视新闻中心西面一层大堂和三、四层

办公地址：深圳市福田区深南中路 2002 号中广核大厦北楼 10 层

法定代表人：严亦斌

联系人：彭莲

客户服务电话：95564

网址：www.ykzq.com

55) 招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

法定代表人：宫少林

联系人：林生迎

客户服务电话：95565

网址：www.newone.com.cn

56) 浙商证券股份有限公司

注册地址：浙江省杭州市西湖区杭大路 1 号黄龙世纪广场 A 座

办公地址：杭州市江干区五星路 201 号浙商证券大楼 8 楼

法定代表人：吴承根

联系人：陈姗姗

客户服务电话：95345

网址：www.stocke.com.cn

57) 中国国际金融股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

办公地址：北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

法定代表人：沈如军

联系人：杨涵宇

客户服务电话：4009101166

网址：www.cicc.com.cn

58) 中国民族证券有限责任公司

注册地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号盘古大观 40-43 层

办公地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼

法定代表人：何亚刚

联系人：胡创

客户服务电话：40088-95618

网址：www.e5618.com

59) 中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 35 号 2-6 层

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：陈共炎

联系人：辛国政

客户服务电话：4008-888-888 或 95551

网址：www.chinastock.com.cn

60) 中国中金财富证券有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18-21 层及第 04 层

01. 02. 03. 05. 11. 12. 13. 15. 16. 18. 19. 20. 21. 22. 23 单元

办公地址：深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 4、18 层至 21 层

法定代表人：高涛

联系人：万玉琳

客户服务电话：95532

网址：www.ciccwm.com

61) 中航证券有限公司

注册地址：江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼

办公地址：江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼

法定代表人：王宜四

联系人：何志华

客户服务电话：95335

网址：www.avicsec.com

62) 中山证券有限责任公司

注册地址：深圳市南山区创业路 1777 号海信南方大厦 21、22 层

办公地址：深圳市南山区创业路 1777 号海信南方大厦 21、22 层

法定代表人：林炳城

联系人：罗艺琳

客户服务电话：95329

网址：www.zszq.com

63) 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：朱琴

客户服务电话：95538

网址：www.zts.com.cn

64) 中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：王常青

联系人：刘畅

客户服务电话：95587/4008-888-108

网址：www.csc108.com

65) 中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人：张佑君

联系人：郑慧

客户服务电话：95548

网址：www.cs.ecitic.com

66) 中信证券华南股份有限公司

注册地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层

办公地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层

法定代表人：胡伏云

联系人：梁微

客户服务电话：95396

网址：www.gzs.com.cn

67) 中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001

办公地址：青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座 5 层

法定代表人：姜晓林

联系人：焦刚

客户服务电话：95548

网址：sd.citics.com

(3) 期货公司销售机构

1) 中信建投期货有限公司

注册地址：重庆市渝中区中山三路 107 号上站大楼平街 11-B，名义层 11-A，8-B4，9-B、

C

办公地址：重庆市渝中区中山三路 107 号皇冠大厦 11 楼

法定代表人：王广学

联系人：刘芸

客户服务电话：4008877780

网址：www.cfc108.com

2) 中信期货有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305、14 层

办公地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305、14 层

法定代表人：张皓

联系人：刘宏莹

客户服务电话：400-990-8826

网址：www.citicsf.com

(4) 第三方销售机构

1) 北京百度百盈基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区上地十街 10 号百度大厦 2 层

办公地址：北京市海淀区上地十街 10 号

法定代表人：梁志祥

联系人：王笑宇

客户服务电话：95055

网址：www.baiyingfund.com

2) 北京创金启富基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区白纸坊东街2号院6号楼712室

办公地址：北京市西城区白纸坊东街2号院6号楼712室

法定代表人：梁蓉

联系人：马浩

客户服务电话：400-6262-818

网址：www.5irich.com

3) 北京蛋卷基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507

办公地址：北京市朝阳区望京SOHO T3 A座19层

法定代表人：钟斐斐

联系人：戚晓强

客户服务电话：400-159-9288

网址：danjuanapp.com

4) 北京恒天明泽基金销售有限公司

注册地址：北京市北京经济技术开发区宏达北路10号5层5122室

办公地址：北京市北京经济技术开发区宏达北路10号5层5122室

法定代表人：黄永伟

联系人：侯仁凤

客户服务电话：400-8980-618

网址：www.chtfund.com

5) 北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1108

办公地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1108

法定代表人：王伟刚

联系人：王晓晓

客户服务电话：400-619-9059

网址：www.hcjijin.com

6) 北京肯特瑞基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区西三旗建材城中路 12 号 17 号平房 157

办公地址：北京市通州区亦庄经济技术开发区科创十一街 18 号院京东集团总部 A 座 15 层

法定代表人：王苏宁

联系人：韩锦星

客户服务电话：95118

网址：kenterui.jd.com

7) 北京展恒基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区安苑路 15-1 号邮电新闻大厦 2 层

办公地址：北京市朝阳区安苑路 15-1 号邮电新闻大厦 2 层

法定代表人：闫振杰

联系人：马林

客户服务电话：4008188000

网址：www.myfund.com

8) 北京植信基金销售有限公司

注册地址：北京市密云县兴盛南路 8 号院 2 号楼 106 室-67

办公地址：北京市朝阳区惠河南路盛世龙源 10 号

法定代表人：于龙

联系人：张喆

客户服务电话：4006-802-123

网址：www.zhixin-inv.com

9) 海银基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 8 号 402 室

办公地址：上海市浦东新区银城中路 8 号 4 楼

法定代表人：刘惠

联系人：刘晖

客户服务电话：400-808-1016

网址：www.fundhaiyin.com

10) 和讯信息科技有限公司

注册地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

办公地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人：王莉

联系人：于扬

客户服务电话：400-920-0022

网址：licaike.hexun.com

11) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路 969 号 3 幢 5 层 599 室

办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代广场 B 座 6F

法定代表人：祖国明

联系人：韩爱彬

客户服务电话：4000-766-123

网址：www.fund123.cn

12) 诺亚正行基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

办公地址：上海市杨浦区秦皇岛路 32 号 c 栋

法定代表人：汪静波

联系人：朱了

客户服务电话：400-821-5399

网址：www.noah-fund.com

13) 浦领基金销售有限公司

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

客户服务电话：400-012-5899

网址：www.zscffund.com

14) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区东方路 1267 号 11 层

法定代表人：张跃伟

联系人：张佳琳

客户服务电话：400-820-2899

网址：www.erichfund.com

15) 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号

办公地址：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯大厦 903~906 室

法定代表人：杨文斌

联系人：王诗琦

客户服务电话：400-700-9665

网址：www.howbuy.com

16) 上海基煜基金销售有限公司

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

办公地址：上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1503 室

法定代表人：王翔

联系人：吴鸿飞

客户服务电话：400-820-5369

网址：www.jiyufund.com.cn

17) 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：尹彬彬

联系人：兰敏

客户服务电话：400-118-1188

网址：www.66liantai.com

18) 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

法定代表人：王之广

联系人：宁博宇

客户服务电话：400-821-9031

网址：www.lufunds.com

19) 上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

办公地址：上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 10 楼

法定代表人：其实

联系人：高莉莉

客户服务电话：400-1818-188



网址: [www.1234567.com.cn](http://www.1234567.com.cn)

20) 上海万得基金销售有限公司

注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

办公地址: 上海市浦东新区浦明路 1500 号万得大厦 11 楼

法定代表人: 王廷富

联系人: 徐亚丹

客户服务电话: 400-799-1888

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

21) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址: 深圳市福田区福田街道民田路 178 号华融大厦 27 层 2704

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: 马勇

联系人: 文雯

客户服务电话: 400-166-1188

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

22) 深圳众禄基金销售股份有限公司

注册地址: 深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼

办公地址: 深圳市罗湖区笋岗街道梨园路物资控股置地大厦 8 楼 801

法定代表人: 薛峰

联系人: 邓爱萍

客户服务电话: 4006-788-887

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

23) 天相投资顾问有限公司

注册地址: 北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701

办公地址: 北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座 505 室

法定代表人: 林义相

联系人: 谭磊

客户服务电话: 010-66045678

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

24) 阳光人寿保险股份有限公司

注册地址: 海南省三亚市迎宾路 360-1 号三亚阳光金融广场 16 层

办公地址: 北京市朝阳区朝阳门外大街乙 12 号院 1 号昆泰国际大厦 12 层

法定代表人：李科

联系人：王超

客户服务电话：95510

网址：fund.sinosig.com

25) 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号1号A栋201室（入驻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：TEO WEE HOWE

联系人：叶健

客户服务电话：400-684-0500

网址：www.ifastps.com.cn

26) 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903

办公地址：杭州市余杭区五常街道同顺路18号同花顺大楼

法定代表人：吴强

联系人：洪泓

客户服务电话：4008773772

网址：www.5ifund.com

27) 中证金牛（北京）投资咨询有限公司

注册地址：北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室

办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲1号环球财讯中心A座5层

法定代表人：钱昊旻

联系人：沈晨

客户服务电话：4008-909-998

网址：www.jnlc.com

28) 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12楼B1201-1203

法定代表人：肖雯

联系人：黄敏嫦

客户服务电话：020-89629066

网址：www.yingmi.cn

本基金管理人可根据有关法律法规要求，根据实际情况，选择其它符合要求的机构代理销售本基金或变更上述销售机构，并在基金管理人网站公示。

## **(二) 注册登记机构**

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：周明

办公室地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

联系电话：010-50938782

传真：010-50938907

负责人：丁志勇

## **(三) 律师事务所**

名称：北京市德恒律师事务所

住所：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座十二层

法定代表人：王丽

办公室地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座十二层

联系电话：010-65232180 65269781

传真：010-65232181

联系人：徐芳

经办律师：陈静茹、苏文静

## **(四) 会计师事务所**

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

执行事务合伙人：李丹

办公室地址：上海市湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼

联系电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

联系人：潘晓怡

经办会计师：单峰、潘晓怡

## 六、基金的募集与基金合同生效

### （一）基金的募集

本基金由基金管理人依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、基金合同及其他有关规定，并经中国证监会证监许可字[2008]405号文批准募集发售。募集期从2008年4月21日起到5月21日止，共募集2,100,410,489.38份基金份额，募集户数为6,276户。

本基金为债券型证券投资基金，存续期间为不定期。

### （二）基金合同的生效

本基金的基金合同已于2008年5月28日正式生效。

### （三）基金存续期内的基金份额持有人数量和资金数额

基金合同生效后的存续期内，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，基金管理人应当及时报告中国证监会；基金份额持有人数量连续20个工作日达不到200人，或连续20个工作日基金资产净值低于5000万元，基金管理人应当向中国证监会说明出现上述情况的原因并提出解决方案。

## 七、基金份额的申购与赎回

### （一）申购和赎回业务办理的场所

- 1、本基金管理人设在深圳、北京、上海、武汉和广州的直销中心；
- 2、中国建设银行的指定网点以及基金管理人指定的其他代销机构营业网点；
- 3、本基金管理人的基金网上交易系统（具体业务规则与说明参见相关公告）。

具体销售网点由基金管理人在本招募说明书或基金份额发售公告等公告中列明。基金管理人可根据情况变更增减基金销售机构或办理本基金申购、转换与赎回的场所，并在基金管理人网站公示。

### （二）申购和赎回的开放日及时间

- 1、开放日及开放时间

投资人可在开放日办理基金份额的申购、转换和赎回，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。基金管理人根据法律法规或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

基金管理人不在开放日之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回，投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购赎回申请的，其基金份额申购、赎回价格为下次办理基金份额申购、赎回时间所在开放日的价格。

基金合同生效后，若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

## 2、申购的开始时间

本基金已于 2008 年 6 月 13 日开始办理申购业务。

## 3、赎回的开始时间

本基金已于 2008 年 7 月 21 日开始办理赎回业务。

### **(三) 申购限制**

1、本基金对单个基金份额持有人不设置最高申购金额限制。

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

3、转换的最低份额为 2 份基金份额，基金份额持有人可将其全部或部分基金份额转换。

4、账户最低余额为 0.01 份基金份额，若某笔转换或赎回将导致投资者在销售机构托管的单只基金份额余额不足 0.01 份时，该笔转换或赎回业务应包括账户内全部基金份额，否则，剩余部分的基金份额将被强制赎回。

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

6、基金管理人可根据市场情况，调整申购、转换、赎回份额的数量限制及相关业务规则，并在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

### **(四) 申购和赎回的原则**

1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算；

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、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；

4、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。

基金管理人可根据基金运作的实际情况依法对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

## **（五） 申购和赎回的程序**

### **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。

投资人在提交申购申请时须按销售机构规定的方式备足申购资金，投资人在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回申请无效。

### **2、 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，本基金注册登记机构在T+1日内对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请，投资人可在T+2日后(包括该日)到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。

在法律法规允许的范围内，基金管理人可根据业务规则，对上述业务办理时间进行调整并公告。

### **3、 申购和赎回的款项支付**

申购采用全额缴款方式，若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功。若申购不成功或无效，基金管理人或基金管理人指定的代销机构将投资人已缴付的申购款项退还给投资人，本基金销售机构不负责承担投资人由此产生的利息等损失。

投资人赎回申请成功后，基金管理人将在T+7日(包括该日)内支付赎回款项。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。

## **（六） 申购、转换和赎回的数额和价格**

1、 申购份额余额的处理方式：申购的有效份额为净申购金额除以当日的基金份额净值，有效份额单位为份。上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

2、 转换份额余额的处理方式：本基金的转换所得份额由实际转出的基金份额当日净资产总值在扣除相应的转换费用后，除以转入基金当日的基金份额净值后确定。基金份额份数按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

3、 赎回金额的处理方式：赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

## **（七） 申购费用和赎回费用**

1、 申购费率：本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金采取金额申购的方式。

本基金对通过直销柜台申购的养老金客户与除此之外的其他投资者实施差别的申购费率。

养老金客户指基本养老保险与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老金，包括全国社会保障基金、可以投资基金的地方社会保障基金、企业年金单一计划以及集合计划。如将来出现经养老金监管部门认可的新的养老金类型，基金管理人可在招募说明书更新时或发布临时公告将其纳入养老金客户范围。非养老金客户指除养老金客户外的其他投资者。

通过基金管理人的直销柜台申购本基金基金份额的养老金客户特定申购费率如下表：

| 申购金额 M (元)        | 特定申购费率    |
|-------------------|-----------|
| M < 50 万          | 0.32%     |
| 50 万 ≤ M < 250 万  | 0.15%     |
| 250 万 ≤ M < 500 万 | 0.06%     |
| M ≥ 500 万         | 每笔 1000 元 |

其他投资者申购本基金基金份额的申购费率如下表：

| 申购金额 M (元)        | 申购费率      |
|-------------------|-----------|
| M < 50 万          | 0.8%      |
| 50 万 ≤ M < 250 万  | 0.5%      |
| 250 万 ≤ M < 500 万 | 0.3%      |
| M ≥ 500 万         | 每笔 1000 元 |

投资者在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。

2、转换费率：本基金已于 2008 年 11 月 17 日开通了日常转换业务，基金转换费率、适用基金及转换业务规则等参见本公司发布的相关公告。

3、赎回费率：本基金的赎回费率按持有时间递减，具体费率如下：

| 持有时间 (Y)       | 赎回费率  |
|----------------|-------|
| Y < 7 天        | 1.5%  |
| 7 天 ≤ Y < 30 天 | 0.75% |
| 30 天 ≤ Y < 1 年 | 0.1%  |
| 1 年 ≤ Y < 2 年  | 0.05% |

|              |   |
|--------------|---|
| $Y \geq 2$ 年 | 0 |
|--------------|---|

赎回费用由赎回申请人承担，其持有期不满 30 天的，赎回费全额计入基金财产；其持有期等于或高于 30 天的，赎回费总额的 25% 归基金财产，75% 用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

4、基金管理人可以在不违反相关法律、法规及中国证监会强制规定以及不违反基金合同约定的前提下，在本基金合同约定的范围内调整上述费率及/或收取方式，无须召开基金份额持有人大会，并应最迟于新的费率实施前 3 个工作日依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。调整后的上述费率还将在最新的招募说明书中列示。

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

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，针对以特定交易方式(如网上交易、电话交易等)等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以针对活动适用对象适当调低上述基金申购费率、基金转换费率和基金赎回费率。

#### (八) 申购份额与赎回金额的计算公式

##### 1、基金申购份额的计算

本基金以申购金额为基数采用比例费率计算申购费用。本基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。其中：

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

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

$$\text{申购份数} = \text{净申购金额} / T \text{ 日基金份额净值}$$

例，某投资者（非养老金客户）投资 10,000 元申购本基金，对应费率为 0.8%，假设申购当日基金份额净值为 1.050 元，则其可得到的申购份额为：

$$\text{净申购金额} = 10,000 / (1 + 0.8\%) = 9,920.63 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 10,000 - 9,920.63 = 79.37 \text{ 元}$$

$$\text{申购份数} = 9,920.63 / 1.050 = 9,448.22 \text{ 份}$$

即：某投资者（非养老金客户）投资 10,000 元申购本基金，假设申购当日基金份额净值为 1.050 元，则可得到 9,448.22 份基金份额。

##### 2、基金赎回金额的计算

本基金以赎回总额为基数采用比例费率计算赎回费用。本基金的赎回金额为赎回总额扣减赎回费用。其中，



赎回总额=赎回份数×T日基金份额净值

赎回费用=赎回总额×赎回费率

赎回金额=赎回总额-赎回费用

例：某基金份额持有人持有本基金 10,000 份基金份额一年后(未满 2 年)决定赎回，对应的赎回费率为 0.05%，假设赎回当日基金份额净值是 1.100 元，则可得到的赎回金额为：

赎回总额=10,000×1.100=11,000 元

赎回费用=11,000×0.05%=5.50 元

赎回金额=11,000-5.50=10,994.50 元

即：某基金份额持有人持有 10,000 份本基金基金份额一年后（未满 2 年）赎回，假设赎回当日基金份额净值是 1.100 元，则可得到的赎回金额为 10,994.50 元。

3、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。

#### 4、基金份额净值的计算公式

基金份额净值=计算日基金资产净值/计算日发行在外的基金份额总数

本基金份额净值的计算，保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

### （九） 申购和赎回的注册登记

投资人申购基金成功后，注册登记机构在 T+1 日为投资者增加权益并办理注册登记手续，投资者自 T+2 日后（含该日）有权赎回该部分基金份额。

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

注册登记机构可以在法律法规允许或未明确禁止的范围内，对上述注册登记业务办理时间进行调整，并最迟于开始实施前 3 个工作日在指定媒介上刊登公告。

### （十） 拒绝或暂停接受申购申请的情形及处理方式

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受、办理投资人的申购申请，若届时本基金已开放基金转换业务或定期定额投资计划的，且办理此等业务亦可能发生如下情形的，本基金管理人亦可按照同样方式处理：

- （1）因不可抗力导致基金无法正常运作。
- （2）证券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。
- （3）发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况。
- （4）基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害其他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。

(7) 当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金申购申请。

(8) 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)、(7)、(8)项暂停申购情形时，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全部或部分拒绝的，被拒绝的申购款项将退还给投资人，本基金销售机构不负责承担投资人由此产生的利息等损失。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。

#### **(十一) 暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形及处理方式**

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项，若届时本基金已开放基金转换业务的，且办理此等业务亦可能发生如下情形的，本基金管理人亦可按照同样方式处理：

1、因不可抗力导致基金无法正常运作。

2、证券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。

3、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

4、发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况。

5、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请。

6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已接受的赎回申请，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已被接受的申请量占接受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，并以后续开放日的基金份额净值为依据计算赎回金额。若连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回，延期支付最长不得超过 20 个工作日，并在指定媒介上公告。投资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；未选择的，未能赎回部分系统默认为延期赎回处理。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并予以公告。

#### **(十二) 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顺延赎回。

(1) 全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资人的赎回申请时，按正常赎回程序执行。

(2) 部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的 10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

(3) 暂停赎回：连续 2 日以上(含本数)发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒介上进行公告。

(4) 若基金发生巨额赎回，在当日存在单个基金份额持有人超过上一开放日基金总份额 10%以上的赎回申请（“大额赎回申请人”）的情形下，基金管理人可以延期办理赎回申请。对其他赎回申请人（“小额赎回申请人”）和大额赎回申请人 10%以内的赎回申请在当日根据前述“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”的约定方式办理，在仍可接受赎回申请的范围内对大额赎回申请人超过 10%的赎回申请按比例确认。对当日未予确认的赎回申请进行延期办理。对于未能赎回部分，基金份额持有人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销；选择延期赎回的，当日未获受理的赎回申请将与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推。如基金份额持有人在提交赎回申请时未作明确选择，基金份额持有人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

### 3、巨额赎回的公告

当发生上述延期赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者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，并在 2 日内在指定媒介上刊登公告。

### **(十三) 暂停和重新开放申购和赎回业务的公告**

1、发生上述暂停申购和赎回情况的，基金管理人应在规定期限内指定媒介上刊登暂停公告。

2、如发生暂停的时间为 1 日，基金管理人应于重新开放日，在指定媒介上刊登基金重新开放申购和赎回公告，并公布最近 1 个开放日的基金份额净值。

3、如发生暂停的时间超过 1 日但少于 2 周，暂停结束，基金重新开放申购和赎回时，基金管理人应提前 2 日在指定媒介上刊登基金重新开放申购和赎回公告，并公告最近 1 个开放日的基金份额净值。

4、如发生暂停的时间超过 2 周，暂停期间，基金管理人应每 2 周至少刊登暂停公告 1 次。暂停结束，基金重新开放申购和赎回时，基金管理人应提前 2 日在指定媒介上连续刊登基金重新开放申购和赎回公告，并公告最近 1 个开放日的基金份额净值。

## **八、基金的转换、非交易过户、转托管、定期定额投资计划和基金的冻结解冻**

### **(一) 基金转换**

本基金已于 2008 年 11 月 17 日开通了日常转换业务，基金转换费率、适用基金及转换业务规则等相关规定详见基金管理人发布的相关公告。

### **(二) 基金的非交易过户**

基金的非交易过户是指基金注册登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行而产生的非交易过户以及注册登记机构认可、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注册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注册登记机构的规定办理，并按基金注册登记机构规定的标准收费。

### **(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。

#### **(四) 定期定额投资计划**

本基金已于 2008 年 6 月 13 日开通了基金定期定额投资计划，具体事项详见相关业务公告。投资人在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额，每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。具体事项详见 2010 年 12 月 31 日刊登的《鹏华基金管理有限公司关于调整旗下开放式证券投资基金定期定额投资业务最低申购金额的公告》。

#### **(五) 基金的冻结和解冻**

基金注册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，以及注册登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的基金份额冻结与解冻。

## **九、基金的投资**

### **(一) 投资目标**

在严格控制投资风险的基础上, 通过主要投资债券等固定收益类品种，同时兼顾部分被市场低估的权益类品种, 力求使基金份额持有人获得持续稳定的投资收益。

### **(二) 投资范围**

本基金投资范围包括：国债、金融债、次级债、企业债、可转换公司债券、央行票据、短期融资券、资产支持证券、债券回购和股票（含一级市场新股申购）、权证（仅限于通过投资可分离转债而获得的权证）等权益类品种，以及中国证监会允许基金投资的其它固定收益类金融工具。

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

基金的投资组合比例为：本基金投资于债券等固定收益类品种的比例不低于基金资产的 80%；本基金投资于股票等权益类品种的比例为基金资产的 0—20%；本基金投资可转换公司债券的比例不超过基金资产净值的 30%；现金和到期日在一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。

### **(三) 投资策略**

#### **1、固定收益类品种投资策略**

##### **(1) 利率策略**

利率是固定收益类品种最主要的风险来源和收益来源。因此利率策略的选择对基金的投资风险与收益尤为重要。利率策略的选择取决于利率的走势和收益率曲线变动两个方面。

本基金通过对宏观经济状况和货币政策等因素的研究，形成对未来市场利率变动方向的预期，主动地调整债券投资组合的久期，提高债券投资组合的收益水平；通过对债券市场具体情况的分析判断，形成对未来收益率曲线形状变化的预期，相应地选择子弹型、哑铃型或梯形的组合期限配置，获取因收益率曲线的形变所带来的投资收益。

#### (2) 类属配置策略

本基金根据对金融债、企业债等债券品种与同期限国债之间收益率利差的历史数据比较，结合当时的市场环境，形成利差预期，主动地增加预期利差将收窄的债券类属品种的投资比例，降低预期利差将扩大的债券类属品种的投资比例，获取不同债券类属之间利差变化所带来的投资收益。

#### (3) 券种的选择策略

在以上债券资产久期、期限和类属配置的基础上，本基金根据债券定价模型，选择最具有投资价值优势的债券品种进行投资。

#### (4) 动态增强策略

在以上债券投资策略的基础上，本基金还将根据债券市场的动态变化，采取多种灵活策略，获取超额收益，主要包括：

##### 1) 骑乘策略

骑乘策略是指当收益率曲线相对陡峭时，买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券，即收益率水平处于相对高位的债券，随着债券剩余期限缩短，债券的收益率水平将会较投资期初有所下降，通过债券的收益率的下滑，获得资本利得收益。

##### 2) 息差策略

息差策略是指通过不断正回购融资并持续买入债券的操作，只要回购资金成本低于债券收益率，就可以达到杠杆放大的套利目标。

##### 3) 套利策略

a.利用同一债券品种在不同债券市场上的价格差异，通过无风险套利操作获得由于市场分割带来的超额收益；

b.利用同期限债券回购品种在不同市场上的利率差异，通过开展无风险套利操作，提高投资组合的盈利能力；

c.利用同期限债券品种在一、二级市场上的收益率差异，通过投资品种的转换获得一、二级市场的差价收入；

d.随着未来利率期货、利率期权、利率互换等可以有效规避利率风险的金融衍生产品的推出，在主管机关批准后积极开展套利操作。

##### 4) 可转换公司债的投资策略

可转换公司债券是一种介于股票和债券之间的债券衍生投资品种，具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点。本基金在对可转换公司债券条款和发行债券公司基本面进行深入研究的基础上，利用可转换公司债券定价模型进行估值分析，选择合适的品种买入持有。本基金持有的可转换债券可以转换为股票。本基金投资于可转换债券的比例不超过基金资产净值的30%。同时，本基金可以投资认购可分离交易的可转换公司债券。

#### 5) 资产支持证券等品种投资策略

资产支持证券由于受到诸多因素影响，定价更为复杂。本基金将根据资产支持证券自身的特点，建立相应的定价模型，并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型，评估其内在价值后再进行投资。

### 2、股票投资策略

股票投资采用“行业配置”与“个股选择”双线并行的投资策略，并通过灵活的仓位调控等手段来避免市场中的系统风险。

#### (1) 仓位控制策略

对于股票的投资，本基金主要根据股票市场的走势进行仓位控制：当股票市场处于上涨波段时，本基金将在限定的股票投资比例范围内提高股票投资比例，实现较高回报；当市场震荡运行时，利用市场失衡，重点投资低估的行业、个股，进行波段操作；当市场将下跌或风险较高时，减少股票投资比例甚至不投资股票，尽量回避股市风险。

#### (2) 行业配置策略

本基金行业配置采取适度分散、相对集中的配置策略。重点投资景气周期处于拐点或者景气度处于上升阶段的相关行业，同时通过投资于五个以上行业来避免过大的非系统风险。

#### (3) 精选个股策略

本基金的选股将主要考虑紧密联系我国目前的宏观经济背景和制度变迁，把握以下三个指标选择股票：管理优秀、治理结构完善；具有稳定、持续的增长能力；公司资产负债率较低、现金流充裕。

#### (4) 止盈止损策略

当股票市场基本面没有好转的情况下，基金股票资产跌幅超过投资委员会规定的风险线时，本基金将逐步减少股票仓位，把损失控制在有限范围内；当基金股票资产盈利超过投资委员会规定的止盈线时，本基金将主动梯度式降低股票仓位，以锁定收益。

#### (5) 新股申购策略

本基金将研究首次发行股票及增发新股的上市公司基本面，估计新股上市交易的合理价格，并参考一级市场资金供求关系，制定相应新股申购策略。本基金对于通过参与新股申购所获得的股票，将比较市场价格与其内在合理价值，决定继续持有或者卖出。

### 3、基金投资决策

#### (1) 决策依据

- 1) 国家有关法律、法规和基金合同的有关规定；
- 2) 国内国际宏观经济环境、国家货币政策、利率走势及通货膨胀预期、国家产业政策；
- 3) 各行业发展状况、市场波动和风险特征；
- 4) 上市公司研究，包括上市公司成长性的研究和市场走势；
- 5) 证券市场走势。

#### (2) 投资流程

1) 行业研究小组：行业研究小组对于宏观经济、行业、上市公司、投资策略等与投资决策有关的内容都会进行全面深入的研究，作为投资决策的依据。

2) 投资决策委员会：确定本基金总体资产配置和投资策略。投资决策委员会定期召开会议，由公司总经理或指定人员召集。如需做出及时重大决策或基金经理小组提议，可临时召开投资决策委员会会议。

3) 基金管理小组：设计和调整投资组合。设计和调整投资组合需要考虑的基本因素包括：每日基金申购和赎回净现金流量；基金合同的投资限制和比例限制；研究员的投资建议；基金经理的独立判断；绩效与风险评估小组的建议等。

4) 集中交易室：基金经理向集中交易室下达投资指令，集中交易室经理收到投资指令后分发予交易员，交易员收到基金投资指令后准确执行。

5) 金融工程分析师：对开放式基金投资组合进行评估，向基金管理小组提出调整建议。

6) 监察稽核部：对投资指令、流程等进行合法合规审核、监督和检查。

#### (四) 业绩比较基准

本基金的业绩比较基准=中债总指数收益率

使用该业绩比较基准主要基于如下原因：

中央国债登记结算有限责任公司编制的系列指数已经广泛的被市场参与者所接受，成为衡量债券市场收益的标准。其中中债总指数的样本具有广泛的市场代表性，能够很好的反映债券市场总体走势，适合作为本基金的债券投资业绩比较基准。

如果今后证券市场中有其他代表性更强或者更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时，本基金管理人依据维护基金份额持有人合法权益的原则，根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整时，需与基金托管人协商一致，报中国证监会备案后及时公告，并在更新的招募说明书中列示。



## (五) 风险收益特征

本基金属于债券型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金，低于混合型基金、股票型基金，为证券投资基金中的较低风险品种。

## (六) 投资限制

### 1、组合限制

本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点，通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。基金的投资组合将遵循以下限制：

- (1) 本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%；
- (2) 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%；
- (3) 本基金管理人管理的全部基金持有一家上市公司发行的证券，不超过该证券的 10%；
- (4) 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%；
- (5) 本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；
- (6) 本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；
- (7) 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%；
- (8) 本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%；本基金投资于股票等权益类品种比例不超过基金资产的 20%；本基金投资可转换公司债券的比例不超过基金资产净值的 30%；
- (9) 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%；
- (10) 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%；
- (11) 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%；
- (12) 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%；
- (13) 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；
- (14) 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；

(15) 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%；

(16) 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；

(17) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的 15%。因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前述所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(18) 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；

(19) 如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

除上述第（13）、（16）、（17）、（18）条外，因证券市场波动、上市公司合并、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。

对于因基金份额拆分、大比例分红等集中持续营销活动引起的基金净资产规模在 10 个交易日内增加 10 亿元以上的情形，而导致证券投资比例低于基金合同约定的，基金管理人履行相关程序后可将调整时限从 10 个交易日延长到 3 个月。法律法规如有变更，从其变更。

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。除投资资产配置比例外，基金托管人对基金的投资比例的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

## 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) 向他人贷款或者提供担保；

(3) 从事承担无限责任的投资；

(4) 买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；

(5) 向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；

(6) 买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；

(7) 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；

(8) 依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动；

(9) 法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

#### (七) 基金管理人代表基金行使股东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股东权利，保护基金份额持有人的利益；

2、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；

3、有利于基金财产的安全与增值；

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) 基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关规定进行融资、融券。

#### (九) 基金投资组合报告（未经审计）

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 01 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 10 月 01 日起至 12 月 31 日止。

#### 1、报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额（元）            | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|------------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 600,420,611.76   | 11.38        |
|    | 其中：股票             | 600,420,611.76   | 11.38        |
| 2  | 基金投资              | -                | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 4,439,704,970.34 | 84.18        |
|    | 其中：债券             | 4,374,704,970.34 | 82.95        |
|    | 资产支持证券            | 65,000,000.00    | 1.23         |
| 4  | 贵金属投资             | -                | -            |
| 5  | 金融衍生品投资           | -                | -            |
| 6  | 买入返售金融资产          | -                | -            |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -                | -            |

|   |              |                  |        |
|---|--------------|------------------|--------|
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 110,834,912.68   | 2.10   |
| 8 | 其他资产         | 123,194,281.11   | 2.34   |
| 9 | 合计           | 5,274,154,775.89 | 100.00 |

## 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

### (1) 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）        | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|----------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -              | -            |
| B  | 采矿业              | -              | -            |
| C  | 制造业              | 413,060,974.06 | 10.20        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -              | -            |
| E  | 建筑业              | 14,728,162.00  | 0.36         |
| F  | 批发和零售业           | -              | -            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -              | -            |
| H  | 住宿和餐饮业           | -              | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 78,468,531.00  | 1.94         |
| J  | 金融业              | 54,077,245.05  | 1.34         |
| K  | 房地产业             | -              | -            |
| L  | 租赁和商务服务业         | 19,395,358.00  | 0.48         |
| 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        | 20,690,341.65  | 0.51         |
| S  | 综合               | -              | -            |
|    | 合计               | 600,420,611.76 | 14.83        |

### (2) 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

## 3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 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  | 603986 | 兆易创新 | 113,600   | 23,275,504.00 | 0.57         |
| 2  | 002415 | 海康威视 | 679,700   | 22,253,378.00 | 0.55         |
| 3  | 002624 | 完美世界 | 469,000   | 20,701,660.00 | 0.51         |
| 4  | 603103 | 横店影视 | 1,099,965 | 20,690,341.65 | 0.51         |
| 5  | 002027 | 分众传媒 | 3,098,300 | 19,395,358.00 | 0.48         |

|    |        |      |           |               |      |
|----|--------|------|-----------|---------------|------|
| 6  | 300315 | 掌趣科技 | 3,116,200 | 19,226,954.00 | 0.47 |
| 7  | 300624 | 万兴科技 | 300,000   | 18,930,000.00 | 0.47 |
| 8  | 000977 | 浪潮信息 | 619,953   | 18,660,585.30 | 0.46 |
| 9  | 002475 | 立讯精密 | 501,154   | 18,292,121.00 | 0.45 |
| 10 | 300570 | 太辰光  | 647,900   | 17,642,317.00 | 0.44 |

#### 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      | 54,753,640.00    | 1.35         |
| 2  | 央行票据      | -                | -            |
| 3  | 金融债券      | 154,253,000.00   | 3.81         |
|    | 其中：政策性金融债 | 134,247,000.00   | 3.32         |
| 4  | 企业债券      | 1,822,871,140.00 | 45.03        |
| 5  | 企业短期融资券   | 116,696,700.00   | 2.88         |
| 6  | 中期票据      | 1,902,415,500.00 | 46.99        |
| 7  | 可转债（可交换债） | 323,714,990.34   | 8.00         |
| 8  | 同业存单      | -                | -            |
| 9  | 其他        | -                | -            |
| 10 | 合计        | 4,374,704,970.34 | 108.07       |

#### 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  | 101800428 | 18 复星高科 MTN002 | 1,200,000 | 122,880,000.00 | 3.04         |
| 2  | 101900093 | 19 溧水城建 MTN001 | 900,000   | 92,106,000.00  | 2.28         |
| 3  | 101900065 | 19 宜春城投 MTN001 | 800,000   | 81,568,000.00  | 2.01         |
| 4  | 101900433 | 19 淮安国投 MTN002 | 800,000   | 81,272,000.00  | 2.01         |
| 5  | 190307    | 19 进出 07       | 800,000   | 80,056,000.00  | 1.98         |

#### 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

| 序号 | 证券代码   | 证券名称    | 数量（份）   | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|---------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 139975 | 锦绣 01A  | 350,000 | 35,000,000.00 | 0.86         |
| 2  | 138020 | 绿城 15 优 | 300,000 | 30,000,000.00 | 0.74         |

#### 7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：无。

## 8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:无。

## 9、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### (1) 本期国债期货投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

### (2) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

### (3) 本期国债期货投资评价

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

## 10、投资组合报告附注

(1) 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

本基金投资的前十名证券中本期没有发行主体被监管部门立案调查的、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

### (2) 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券备选库。

### (3) 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(元)          |
|----|---------|----------------|
| 1  | 存出保证金   | 365,484.88     |
| 2  | 应收证券清算款 | 9,058,812.95   |
| 3  | 应收股利    | -              |
| 4  | 应收利息    | 93,440,537.28  |
| 5  | 应收申购款   | 20,329,446.00  |
| 6  | 其他应收款   | -              |
| 7  | 待摊费用    | -              |
| 8  | 其他      | -              |
| 9  | 合计      | 123,194,281.11 |

### (4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 公允价值(元)       | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------------|--------------|
| 1  | 123003 | 蓝思转债 | 44,287,397.21 | 1.09         |
| 2  | 127012 | 招路转债 | 25,258,042.39 | 0.62         |
| 3  | 123019 | 中来转债 | 21,812,185.13 | 0.54         |
| 4  | 128057 | 博彦转债 | 21,538,264.32 | 0.53         |
| 5  | 127005 | 长证转债 | 18,802,555.20 | 0.46         |

|    |        |       |               |      |
|----|--------|-------|---------------|------|
| 6  | 113011 | 光大转债  | 17,456,139.80 | 0.43 |
| 7  | 110056 | 亨通转债  | 15,602,722.80 | 0.39 |
| 8  | 110052 | 贵广转债  | 14,780,453.10 | 0.37 |
| 9  | 113517 | 曙光转债  | 14,607,564.40 | 0.36 |
| 10 | 113530 | 大丰转债  | 13,384,519.40 | 0.33 |
| 11 | 128066 | 亚泰转债  | 13,061,741.89 | 0.32 |
| 12 | 128020 | 水晶转债  | 10,625,624.80 | 0.26 |
| 13 | 110048 | 福能转债  | 9,029,955.20  | 0.22 |
| 14 | 128016 | 雨虹转债  | 9,014,184.90  | 0.22 |
| 15 | 113020 | 桐昆转债  | 7,647,000.00  | 0.19 |
| 16 | 123022 | 长信转债  | 6,682,000.00  | 0.17 |
| 17 | 123017 | 寒锐转债  | 5,702,000.00  | 0.14 |
| 18 | 128061 | 启明转债  | 4,576,250.00  | 0.11 |
| 19 | 123011 | 德尔转债  | 4,120,929.00  | 0.10 |
| 20 | 123021 | 万信转 2 | 3,600,900.00  | 0.09 |
| 21 | 128058 | 拓邦转债  | 484,010.60    | 0.01 |
| 22 | 123016 | 洲明转债  | 306,025.20    | 0.01 |
| 23 | 113531 | 百姓转债  | 1,243.90      | 0.00 |

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

(6) 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## 十、基金的业绩

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资人在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

基金合同生效以来的投资业绩与同期基准的比较如下表所示（未经审计）：

|                                  | 净值增长率 1 | 净值增长率标准差 2 | 业绩比较基准收益率 3 | 业绩比较基准收益率标准差 4 | 1-3    | 2-4    |
|----------------------------------|---------|------------|-------------|----------------|--------|--------|
| 2008年05月28日(基金合同生效日)至2008年12月31日 | 7.91%   | 0.15%      | 11.43%      | 0.25%          | -3.52% | -0.10% |

|                         |        |       |        |       |        |       |
|-------------------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 2009年01月01日至2009年12月31日 | 12.18% | 0.26% | -1.24% | 0.10% | 13.42% | 0.16% |
| 2010年01月01日至2010年12月31日 | 3.12%  | 0.21% | 1.92%  | 0.10% | 1.20%  | 0.11% |
| 2011年01月01日至2011年12月31日 | 4.36%  | 0.17% | 5.72%  | 0.11% | -1.36% | 0.06% |
| 2012年01月01日至2012年12月31日 | 6.11%  | 0.11% | 2.51%  | 0.07% | 3.60%  | 0.04% |
| 2013年01月01日至2013年12月31日 | -2.27% | 0.12% | -2.10% | 0.11% | -0.17% | 0.01% |
| 2014年01月01日至2014年12月31日 | 12.97% | 0.15% | 11.23% | 0.15% | 1.74%  | 0.00% |
| 2015年01月01日至2015年12月31日 | 11.51% | 0.34% | 8.03%  | 0.11% | 3.48%  | 0.23% |
| 2016年01月01日至2016年12月31日 | -0.62% | 0.36% | 1.30%  | 0.12% | -1.92% | 0.24% |
| 2017年01月01日至2017年12月31日 | 4.03%  | 0.19% | -1.19% | 0.09% | 5.22%  | 0.10% |
| 2018年01月01日至2018年12月31日 | 3.42%  | 0.20% | 9.63%  | 0.11% | -6.21% | 0.09% |



|                         |        |       |        |       |        |       |
|-------------------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 2019年01月01日至2019年12月31日 | 8.49%  | 0.27% | 4.36%  | 0.08% | 4.13%  | 0.19% |
| 自基金合同生效日至2019年12月31日    | 97.43% | 0.23% | 63.74% | 0.12% | 33.69% | 0.11% |

## 十一、基金的财产

### （一）基金财产的构成

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、基金应收申购款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负债后的价值。

### （三）基金财产的账户

本基金财产以基金名义开立银行存款账户，以基金托管人的名义开立证券交易清算资金的结算备付金账户，以基金托管人和本基金联名的方式开立基金证券账户，以本基金的名义开立银行间债券托管账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和注册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）基金财产的保管及处分

基金财产独立于基金管理人、基金托管人和代销机构的固有财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益归入基金财产。基金管理人、基金托管人可以按基金合同的约定收取管理费、托管费以及其他基金合同约定的费用。基金财产的债权、不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相抵销，不同基金财产的债权债务，不得相互抵销。基金管理人、基金托管人以其自有资产承担法律责任，其债权人不得对基金财产行使请求冻结、扣押和其他权利。

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。

除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定处分外，基金财产不得被处分。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

## 十二、基金资产的估值

### （一）估值目的

基金资产的估值目的是客观、准确地反映基金资产的价值，并为基金份额的申购、赎回与转换等提供计价依据。

### （二）估值日

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

### （三）估值方法

#### 1、股票估值方法：

(1) 上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。

(2) 发行未上市股票的估值：

1) 首次发行未上市的股票，按成本计量；

2) 送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价估值；

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市价估值；

4) 非公开发行有明确锁定期的流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值；

(3) 在任何情况下，基金管理人如采用本项第(1)－(2)小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第(1)－(2)小项规定的方法对基金资产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，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值；

(4) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

#### 2、债券估值方法：

(1) 证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，按最近交易日的收盘价估值；

(2) 证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的应收利息得到的净价进行估值，估值日没有交易的，以最近交易日的收盘净价估值；

(3) 发行未上市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，按成本进行后续计量；

(4) 在全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值；

(5) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值；

(6) 在任何情况下，基金管理人如采用本项第(1)－(5)小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第(1)－(5)小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上形成的债券估值，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；

(7) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

### 3、权证估值方法：

(1) 基金持有的权证，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，按最近交易日的收盘价估值；

未上市交易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，按成本计量；

(2) 在任何情况下，基金管理人如采用本项第(1)小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第(1)小项规定的方法对基金资产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，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值；

(3) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

4、当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。

5、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。

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

根据中国证监会《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》规定，本基金管理人进一步明确了本基金持有资产的估值方法，具体内容详见本基金管理人于2008年9月16日刊登的《鹏华基金管理有限公司关于进一步规范旗下基金估值业务的公告》。

#### **（四）估值对象**

基金所拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产。

#### **（五）估值程序**

1、基金份额净值是按照每个开放日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到0.001元，小数点后第四位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

每工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值。基金管理人每工作日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

#### **（六）估值错误的确认与处理**

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

本基金合同的当事人应按照以下约定处理：

##### **1、差错类型**

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或注册登记机构、或代销机构、或投资人自身的过错造成差错，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该差错遭受损失的当事人(“受损方”)按下述“差错处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

上述差错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；对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平不能预见、不能避免、不能克服，则属不可抗力，按照下述规定执行。

由于不可抗力原因造成投资人的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

##### **2、差错处理原则**

(1) 差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的，由差错责任方承担；若差错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。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正。

(2) 差错的责任方对可能导致有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对差错的有关直接当事人负责，不对第三方负责。

(3) 因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责。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”)，则差错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差错责任方。

(4) 差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。

(5) 差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人过错造成基金财产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人过错造成基金财产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。基金管理人和托管人之外的第三方造成基金财产的的损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错方追偿；追偿过程中产生的有关费用，应列入基金费用，从基金资产中支付。

(6) 如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律法规、基金合同或其他规定，基金管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任，则基金管理人有权向出现过错的当事人进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失。

(7) 按法律法规规定的其他原则处理差错。

### 3、差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

(1) 查明差错发生的原因，列明所有的当事人，并根据差错发生的原因确定差错的责任方；

(2) 根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；

(3) 根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；

(4) 根据差错处理的方法，需要修改基金注册登记机构交易数据的，由基金注册登记机构进行更正，并就差错的更正向有关当事人进行确认。

### 4、基金份额净值差错处理的原则和方法如下：

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

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

(3) 因基金份额净值计算错误，给基金或基金份额持有人造成损失的，应由基金管理人先行赔付，基金管理人按差错情形，有权向其他当事人追偿。

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

(5) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

### **(七) 暂停估值的情形**

1、基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力或其它情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

3、如出现基金管理人认为属于紧急事故的任何情况，会导致基金管理人不能出售或评估基金资产的；

4、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停估值；

5、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

### **(八) 基金净值的确认**

用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金资产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，由基金管理人对基金净值予以公布。

### **(九) 特殊情况的处理**

1、基金管理人或基金托管人按股票估值方法的第(3)项或债券估值方法的第(6)项或权证估值方法的第(2)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，本基金管理人和本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或对基金财产、基金份额持有人利益造成损失的，本基金管理人和本基金托管人可以免除赔偿责任。但本基金管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

## 十三、基金的收益分配

### （一）基金收益的构成

- 1、买卖证券差价；
- 2、基金投资所得红利、股息、债券利息；
- 3、银行存款利息；
- 4、已实现的其他合法收入。
- 5、持有期间产生的公允价值变动。

因运用基金财产带来的成本或费用的节约应计入收益。

### （二）基金净收益

基金净收益为基金收益扣除按国家有关规定应（或可以）在基金收益中扣除的费用后的余额。

### （三）收益分配原则

本基金收益分配应遵循下列原则：

- 1、本基金的每份基金份额享有同等分配权；
- 2、基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值；
- 3、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。
- 4、本基金收益每年最多分配 12 次，每年基金收益分配比例不低于当年可分配收益的 50%；
- 5、若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配；
- 6、本基金收益分配方式分为两种：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按除权后的基金份额净值自动转为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。
- 7、基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；
- 8、基金当年收益应先弥补上期亏损后，方可进行当年收益分配；
- 9、法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

### （四）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额、分配方式、支付方式等内容。

### （五）收益分配的时间和程序

1、基金收益分配方案由基金管理人拟订，由基金托管人复核，依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告；

2、在收益分配方案公布后，基金管理人依据具体方案的规定就支付的现金红利向基金托管人发送划款指令，基金托管人按照基金管理人的指令及时进行分红资金的划付。

## 十四、基金的费用与税收

### （一）与基金运作有关的费用

#### 1、基金费用的种类

- （1）基金管理人的管理费；
- （2）基金托管人的托管费；
- （3）基金财产拨划支付的银行费用；
- （4）基金合同生效后的信息披露费用；
- （5）基金份额持有人大会费用；
- （6）基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
- （7）基金的证券交易费用；
- （8）依法可以在基金财产中列支的其他费用。

上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

#### 2、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

基金管理费按前一日基金资产净值的 0.60%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

##### （2）基金托管人的托管费

基金托管费按前一日基金资产净值的 0.20%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

(3) 除管理费和托管费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

## (二) 与基金销售有关的费用

### 1、认购费：

本基金的认购费不列入基金财产，主要用于基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金采取金额认购的方式，以认购金额为基数采用比例费率计算认购费用。认购费由认购申请人承担，投资者在一天之内如果有多笔认购，适用费率按单笔分别计算。具体费率如下：

| 认购金额 M (元)        | 认购费率      |
|-------------------|-----------|
| M < 50 万          | 0.6%      |
| 50 万 ≤ M < 250 万  | 0.4%      |
| 250 万 ≤ M < 500 万 | 0.2%      |
| M ≥ 500 万         | 每笔 1000 元 |

计算公式：

净认购金额 = 认购金额 / (1 + 认购费率)

认购费用 = 认购金额 - 净认购金额

认购份额 = (净认购金额 + 认购金额利息) / 基金份额面值

### 2、申购费：

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金对通过直销柜台申购的养老金客户与除此之外的其他投资者实施差别的申购费率。

养老金客户指基本养老金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金，包括全国社会保障基金、可以投资基金的地方社会保障基金、企业年金单一计划以及集合计划。如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，基金管理人可在招募说明书更新时或发布临时公告将其纳入养老金客户范围，并按规定向中国证监会备案。非养老金客户指除养老金客户外的其他投资者。

通过基金管理人的直销柜台申购本基金基金份额的养老金客户特定申购费率如下表：

| 申购金额 M (元) | 特定申购费率 |
|------------|--------|
| M < 50 万   | 0.32%  |

|                   |           |
|-------------------|-----------|
| 50 万 ≤ M < 250 万  | 0.15%     |
| 250 万 ≤ M < 500 万 | 0.06%     |
| M ≥ 500 万         | 每笔 1000 元 |

其他投资者申购本基金基金份额的申购费率费率如下表：

| 申购金额 M (元)        | 申购费率      |
|-------------------|-----------|
| M < 50 万          | 0.8%      |
| 50 万 ≤ M < 250 万  | 0.5%      |
| 250 万 ≤ M < 500 万 | 0.3%      |
| M ≥ 500 万         | 每笔 1000 元 |

投资者在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。

计算公式：

净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率)

申购费用 = 申购金额 - 净申购金额

申购份数 = 净申购金额 / T 日基金份额净值

3、转换费率：本基金已于 2008 年 11 月 17 日开通了日常转换业务，具体转换费率和相关业务规则等参见本公司发布的相关公告。

4、赎回费率：本基金的赎回费率按持有时间递减，具体费率如下：

| 持有时间 (Y)       | 赎回费率  |
|----------------|-------|
| Y < 7 天        | 1.5%  |
| 7 天 ≤ Y < 30 天 | 0.75% |
| 30 天 ≤ Y < 1 年 | 0.1%  |
| 1 年 ≤ Y < 2 年  | 0.05% |
| Y ≥ 2 年        | 0     |

赎回费用由赎回申请人承担，其持有期不满 30 天的，赎回费全额计入基金财产；其持有期等于或高于 30 天的，赎回费总额的 25% 归基金财产，75% 用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

计算公式：

赎回总额 = 赎回份数 × T 日基金份额净值

赎回费用 = 赎回总额 × 赎回费率

赎回金额=赎回总额-赎回费用

5、基金管理人可以在不违反相关法律、法规及中国证监会强制规定以及不违反基金合同约定的前提下，在本基金合同约定的范围内调整上述费率及/或收取方式，无须召开基金份额持有人大会，并应最迟于新的费率实施前3个工作日依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。调整后的上述费率还将在最新的招募说明书中列示。

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

7、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，针对以特定交易方式(如网上交易、电话交易等)等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以针对活动适用对象适当调低上述基金申购费率、基金转换费率和基金赎回费率。

### **(三) 其他费用**

按照国家有关规定可以列入的其他费用根据相关法律及中国证监会相关规定列支。

### **(四) 不列入基金费用的项目**

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，以及处理与基金运作无关事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前发生的律师费、会计师费、信息披露费以及其他费用不得从基金财产中支付。

### **(五) 费用调整**

基金管理人和基金托管人协商一致后可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。降低基金管理费率和基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日2日前在指定媒介上刊登公告。

### **(六) 税收**

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

## **十五、基金的会计与审计**

### **(一) 基金的会计政策**

- 1、基金管理人为本基金的会计责任方；
- 2、本基金的会计年度为公历每年的1月1日至12月31日，如果基金首次募集的会计年度，基金合同生效少于2个月，可以并入下一个会计年度；
- 3、本基金的会计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的会计制度；
- 5、本基金独立建账、独立核算；

6、基金管理人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、基金托管人定期与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并书面确认。

## **(二) 基金的审计**

1、基金管理人聘请具有从事证券、期货相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金年度财务报表及其他规定事项进行审计。会计师事务所及其注册会计师与基金管理人、基金托管人相互独立。

2、会计师事务所更换经办注册会计师时，应事先征得基金管理人同意。

3、基金管理人(或基金托管人)认为有充足理由更换会计师事务所，经基金托管人(或基金管理人)同意可以更换。就更换会计师事务所，基金管理人应当依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

## **十六、基金的信息披露**

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。

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及其日常机构（如有）等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和自然人组织。

本基金信息披露义务人以保护基金份额持有人利益为根本出发点，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、完整性、及时性、简明性和易得性。

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全国性报刊（以下简称“指定报刊”）和指定互联网网站（以下简称“指定网站”，包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介披露，并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

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份额发售机构；
5. 登载任何自然人、法人和非法人组织的祝贺性、恭维性或推荐性文字；
6. 中国证监会禁止的其他行为。

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不同文本的内容一致。不同文本之间发生歧义的，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。

公开披露的基金信息包括：

#### **(一) 招募说明书**

招募说明书是基金向社会公开发售时对基金情况进行说明的法律文件。

基金管理人按照《基金法》、《信息披露办法》、基金合同编制并在基金份额发售的 3 日前，将基金招募说明书登载在指定媒介上。基金合同生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在指定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。

#### **(二) 基金合同、托管协议**

基金管理人应在基金份额发售的 3 日前，将基金合同摘要登载在指定媒介上；基金管理人、基金托管人应将基金合同、托管协议登载在各自网站上。

#### **(三) 基金产品资料概要**

基金产品资料概要是基金招募说明书的摘要文件，用于向投资者提供简明的基金概要信息。《基金合同》生效后，基金产品资料概要的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金产品资料概要，并登载在指定网站及基金销售机构网站或营业网点；基金产品资料概要其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金产品资料概要。

#### **(四) 基金份额发售公告**

基金管理人将按照《基金法》、《信息披露办法》的有关规定，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。

#### **(五) 基金合同生效公告**

基金管理人将在基金合同生效的次日在指定媒介上登载基金合同生效公告。基金合同生效公告中将说明基金募集情况。

#### **(六) 基金净值信息公告**

1. 本基金的基金合同生效后，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在指定网站披露一次基金份额净值和基金份额累计净值；

2. 在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过指定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值；

3. 基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在指定网站披露半年度和年度最后一日的基金份额净值和基金份额累计净值。

#### **(七)基金份额申购、赎回价格公告**

基金管理人应当在本基金的基金合同、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销售机构网站或营业网点查阅或者复制前述信息资料。

#### **(八)基金年度报告、基金中期报告、基金季度报告**

1. 基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载在指定网站上，并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计。

2. 基金管理人应当在上半年结束之日起两个月内，编制完成基金中期报告，将中期报告登载在指定网站上，并将中期报告提示性公告登载在指定报刊上。

3. 基金管理人应当在季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，将季度报告登载在指定网站上，并将季度报告提示性公告登载在指定报刊上。

4. 基金合同生效不足 2 个月的，本基金管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。

5. 基金管理人应当在中期报告和年度报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。

6. 报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额 20% 的情形，为保障其他投资者的权益，基金管理人至少应当在基金定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及产品的特有风险。

#### **(九)临时报告与公告**

在基金运作过程中发生如下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事件时，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，并登载在指定报刊和指定网站上。

- 1、基金份额持有人大会的召开及决定的事项；
- 2、《基金合同》终止、基金清算；
- 3、转换基金运作方式、基金合并；
- 4、更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；

5、基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；

6、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；

7、基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更；

8、基金募集期延长或提前结束募集；

9、基金管理人高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；

10、基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十，基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；

11、涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或者仲裁；

12、基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；

13、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事项，但中国证监会另有规定的除外；

14、基金收益分配事项；

15、管理费、托管费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；

16、基金份额净值计价错误达基金份额净值 0.5%；

17、本基金开始办理申购、赎回；

18、本基金发生巨额赎回并延期办理；

19、本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；

20、本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；

21、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；

22、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；

23、基金信息披露义务人认为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其他事项或中国证监会规定的其他事项。

#### **(十)澄清公告**

在本基金合同期限内，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，以及可能损害基金份额持有人权益的，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。

#### **(十一)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。

#### **(十二) 清算报告**

基金合同终止的，基金管理人应当依法组织基金财产清算小组对基金财产进行清算并作出清算报告。基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

#### **(十三) 中国证监会规定的其他信息**

#### **(十四) 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，指定专门部门及高级管理人员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等法规的规定。

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告、更新的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人进行书面或电子确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定报刊中选择一家报刊披露本基金信息。基金管理人、基金托管人应当向中国证监会基金电子披露网站报送拟披露的基金信息，并保证相关报送信息的真实、准确、完整、及时。

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。

基金管理人、基金托管人除按法律法规要求披露信息外，也可着眼于为投资者决策提供有用信息的角度，在保证公平对待投资者、不误导投资者、不影响基金正常投资操作的前提下，自主提升信息披露服务的质量。具体要求应当符合中国证监会及自律规则的相关规定。前述自主披露如产生信息披露费用，该费用不得从基金财产中列支。

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。

#### **(十五) 信息披露文件的存放与查阅**

依法必须披露的信息发布后，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于公司住所，供社会公众查阅、复制。

#### **(十六) 本基金信息披露事项以法律法规规定及本章节约定的内容为准。**



## 十七、风险揭示

本基金属于债券型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、低于混合型基金、股票型基金，为证券投资基金中的较低风险品种。投资本基金面临的主要风险有市场风险、投资风险、管理风险、流动性风险、本基金特有风险、技术风险、合规性风险、操作风险及其他风险等。

基金业绩受证券市场价格波动的影响，投资者持有本基金可能盈利，也可能亏损。

### （一）市场风险与对策

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

1、政策风险。因国家宏观政策（如货币政策、财政政策、行业政策、地区发展政策及股权分置改革与非流通股流通政策等）发生变化，导致市场价格波动而产生风险。

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

3、利率风险。金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着债券的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。基金投资于债券和股票，其收益水平会受到利率变化的影响。

4、信用风险。信用风险是指债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下降的风险，另外，信用风险也包括证券交易对手因违约而产生的证券交割风险。信用风险是债券投资中所面临的重要风险之一。

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

6、购买力风险。基金的利润将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀的影响而导致购买力下降，从而使基金的实际收益下降。

针对以上市场风险，本基金管理人将努力通过加强对宏观经济与国家政策的分析，研究并预测经济周期、利率水平的走势，作为债券与股票投资的依据；同时，股票投资部分根据动量原理设置买入卖出线，同时通过可投资股票备选库制度，加强对上市公司和所在行业的研究，采用财务分析、实地调研等多种方法判断上市公司的经营风险，选择具有长期投资价值的上市公司。

### （二）投资风险与对策

本基金作为债券型开放式基金，依据对超额收益的贡献大小，本基金债券投资的风险依次可划分为久期风险、期限结构风险、类属配置风险和个券选择风险，国外和国内的研究表明久期风险占债券投资总风险 85%以上。如果债券组合久期与基准久期相差太多，一旦市场利率发生明显不同于预期的变化，将导致组合收益率与基准收益率出现较大偏差。

股票投资的风险包括资产配置风险、行业配置风险、证券选择风险、流动性风险、收益性风险等。

为控制上述风险，本基金管理人使用了“北方之星债券投资决策分析系统”进行债券投资的收益分析和风险监控，使用“Barra Aegis Portfolio Management 系统”和“鹏华风险绩效评估系统”进行股票投资的动态风险监控。

### **（三）管理风险与对策**

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

为控制此类风险，本基金管理人高度重视提高研究能力和管理水平，将投资建立在研究的基础上，对宏观经济、行业发展、上市公司和市场走势四个层次进行深入研究，不断总结投资经验；同时通过在实践中对制度的持续检验和完善，以及加强自身的业务学习和与国外同行交流，不断引进新的管理技术和方法，提高投资管理水平，努力为基金份额持有人带来更好的投资回报。

### **（四）流动性风险与对策**

本基金属于开放式基金，在基金的所有开放日，基金管理人都有义务接受投资者的申购和赎回，如果出现较大数额的基金赎回或转换申请，则使基金资产变现困难，基金面临流动性风险。

为控制这类风险，基金管理人充分借鉴国外证券流动性理论，建立了本基金的流动性风险管理系统，用数量化指标衡量基金流动性，对基金投资组合的流动性进行监控。

#### **（1）拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估**

本基金的投资市场主要为证券交易所、全国银行间债券市场等流动性较好的规范型交易场所，主要投资对象为具有良好流动性的金融工具（包括国内依法发行上市的债券、股票和货币市场工具等），同时本基金基于分散投资的原则在行业 and 个券方面未有高集中度的特征，综合评估在正常市场环境下本基金拟投资市场、行业及资产的流动性良好，流动性风险相对可控。

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

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

基金管理人经与基金托管人协商，将根据法律法规及基金合同的约定，综合运用各类流动性风险管理工具，对赎回申请等进行适度调整，作为特定情形下基金管理人流动性风险管理的辅助措施，包括但不限于延期办理巨额赎回申请、暂停接受赎回申请、延缓支付赎回款项、收取短期赎回费、暂停基金估值、摆动定价机制及中国证监会认定的其他措施。基金管理人实施前述备用流动性风险管理工具时，投资者可能面临无法及时赎回、无法全部赎回、或赎回成本相对较高的风险。

### （3）巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

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

### （五）本基金特有风险与对策

本基金为债券型基金，在具体投资管理中，本基金主要投资债券类资产，同时积极参与新股申购，因此，本基金可能因投资债券类资产而面临较高的市场系统性风险，也可能面临新股发行放缓甚至停滞，或者新股申购收益率下降甚至出现亏损所带来的风险。本基金将深入研判新股发行的有关政策，严格控制新股投资的参与程度。本基金禁止从二级市场买入权证。所持有的权证全部来自认购可分离交易的可转换公司债券。对于此类权证，我们将在权证上市之日起，五个交易日内全部卖出。

本基金股票投资比例最高可达基金资产的 20%，本基金也可能由于股票部分投资使组合波动性加大，甚至出现较大亏损的情况。为控制这类风险，基金管理人将根据动量理论（Momentum），设定合理的买入卖出线，同时严格控制组合股票投资部分仓位。

### （六）技术风险和对策

当计算机、通讯系统、交易网络等技术保障系统或信息网络支持出现异常情况，可能导致基金日常的申购赎回无法按正常时限完成、注册登记系统瘫痪、核算系统无法按正常时限产生净值、基金的投资交易指令无法及时传输等风险。

这类风险的控制和防范主要依赖于系统的可靠性以及完备的备份策略。

### **（七）其他风险和对策**

战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金管理人、基金销售代理人等机构无法正常工作，从而有影响基金的申购和赎回按正常时限完成的风险。

为控制这类风险，本基金管理人建立了完备的灾难恢复计划，通过每个工作日对业务数据的异地备份，防范和控制不可抗力因素造成的风险。

## **十八、基金的终止与清算**

### **（一）本基金终止的情形及处理方式**

有下列情形之一的，本基金合同经中国证监会核准后将终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在 6 个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务；
- 3、基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在 6 个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务；
- 4、中国证监会规定的其他情况。

### **（二）基金财产的清算**

#### **1、基金财产清算组**

(1) 基金合同终止时，成立基金财产清算组，基金财产清算组在中国证监会的监督下进行基金清算。

(2) 基金财产清算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。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

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

#### **2、基金财产清算程序**

基金合同终止，应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。基金财产清算程序主要包括：

- (1) 基金合同终止后，发布基金财产清算公告；
- (2) 基金合同终止时，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- (3) 对基金财产进行清理和确认；
- (4) 对基金财产进行估价和变现；
- (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行审计；

- (6) 聘请律师事务所出具法律意见书;
- (7) 将基金财产清算结果报告中国证监会;
- (8) 参加与基金财产有关的民事诉讼;
- (9) 公布基金财产清算结果;
- (10) 对基金剩余财产进行分配。

### 3、清算费用

清算费用是指基金财产清算组在进行基金财产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组优先从基金财产中支付。

### 4、基金财产按下列顺序清偿：

- (1) 支付清算费用；
- (2) 交纳所欠税款；
- (3) 清偿基金债务；
- (4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款(1)－(3)项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

### 5、基金财产清算的公告

基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算结果经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算组报中国证监会备案并公告。

### 6、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。

## 十九、基金合同的内容摘要

### (一) 基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

#### 1、基金份额持有人的权利与义务

##### (1) 基金份额持有人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的权利为：

- 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；
- 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、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼;

9) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

每份基金份额具有同等的合法权益。

#### (2) 基金份额持有人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的义务为：

- 1) 遵守法律法规、基金合同及其他有关规定;
- 2) 交纳基金认购、申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用;
- 3) 在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;
- 4) 不从事任何有损基金及其他基金份额持有人合法权益的活动;
- 5) 执行生效的基金份额持有人大会决议;
- 6) 返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人及基金管理人的代理人、基金托管人、代销机构、其他基金份额持有人处获得的不当得利;
- 7) 法律法规和基金合同规定的其他义务。

#### 2、基金管理人的权利与义务

##### (1) 基金管理人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的权利为：

- 1) 自本基金合同生效之日起，依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用基金财产;
- 2) 依照基金合同获得基金管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入;
- 3) 发售基金份额;
- 4) 依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利;
- 5) 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、非交易过户、转托管等业务的规则，在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金的除调高托管费率和管理费率之外的相关费率结构和收费方式;
- 6) 根据本基金合同及有关规定监督基金托管人，对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益;
- 7) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回申请;
- 8) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、融券;

9) 自行担任或选择、更换注册登记机构, 获取基金份额持有人名册, 并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查;

10) 选择、更换代销机构, 并依据基金销售服务代理协议和有关法律法规, 对其行为进行必要的监督和检查;

11) 选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构;

12) 在基金托管人更换时, 提名新的基金托管人;

13) 依法召集基金份额持有人大会;

14) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

## (2) 基金管理人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规, 基金管理人的义务为:

1) 依法募集基金, 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、勤勉尽责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) 计算并公告基金净值信息, 确定基金份额申购、赎回价格;

9) 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;

10) 按规定受理申购和赎回申请, 及时、足额支付赎回款项;

11) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;

12) 编制季度报告、中期报告和年度报告;

13) 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;

14) 保守基金商业秘密, 不得泄露基金投资计划、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, 不得向他人泄露;

15) 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;

16) 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；

17) 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；

18) 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；

19) 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；

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，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

21) 基金托管人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托管人追偿；

22) 按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；

23) 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；

24) 执行生效的基金份额持有人大会决议；

25) 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

26) 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，不谋求对上市公司的控股和直接管理；

27) 法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

### 3、基金托管人的权利与义务

#### (1) 基金托管人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的权利为：

1) 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收入；

2) 监督基金管理人对本基金的投资运作；

3) 自本基金合同生效之日起，依法保管基金资产；

4) 在基金管理人更换时，提名新任基金管理人；

5) 根据本基金合同及有关规定监督基金管理人，对于基金管理人违反本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；

6) 依法召集基金份额持有人大会；

7) 按规定取得基金份额持有人名册资料；

8) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

#### (2) 基金托管人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的义务为：



- 1) 安全保管基金财产;
- 2) 设立专门的基金托管部, 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) 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;
- 4) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外, 不得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;
- 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应予保密, 不得向他人泄露;
- 8) 对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告出具意见, 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;
- 9) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料;
- 10) 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;
- 11) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项;
- 12) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值和基金份额申购、赎回价格;
- 13) 按照规定监督基金管理人的投资运作;
- 14) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对;
- 15) 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;
- 16) 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会;
- 17) 因违反基金合同导致基金财产损失, 应承担赔偿责任, 其赔偿责任不因其退任而免除;
- 18) 基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时, 应为基金向基金管理人追偿;
- 19) 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;
- 20) 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业监督管理机构, 并通知基金管理人;
- 21) 执行生效的基金份额持有人大会决议;
- 22) 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动;
- 23) 建立并保存基金份额持有人名册;

24) 法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

## **(二) 基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则**

1、 基金份额持有人大会由基金份额持有人或基金份额持有人的合法授权代表共同组成。基金份额持有人持有的每一基金份额具有同等的投票权。

### **2、 召开事由**

(1) 当出现或需要决定下列事由之一的，经基金管理人、基金托管人或持有基金份额10%以上(含 10%，下同)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)提议时，应当召开基金份额持有人大会：

- 1) 终止基金合同；
- 2) 转换基金运作方式；
- 3) 变更基金类别；
- 4) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略；
- 5) 变更基金份额持有人大会程序；
- 6) 更换基金管理人、基金托管人；
- 7) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；
- 8) 本基金与其他基金的合并；
- 9) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；
- 10) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

(2) 出现以下情形之一的，可由基金管理人和基金托管人协商后修改基金合同，不需召开基金份额持有人大会：

- 1) 调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；
- 2) 在法律法规和本基金合同规定的范围内变更基金的申购费率、赎回费率或收费方式；
- 3) 因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；
- 4) 对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化；
- 5) 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；
- 6) 按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

### **3、 召集人和召集方式**

(1) 除法律法规或本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。基金管理人未按规定召集或者不能召集时，由基金托管人召集。

(2) 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，应当自行召集。

(3) 代表基金份额 10%以上的基金份额持有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。

(4) 代表基金份额 10%以上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，代表基金份额 10%以上的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会，但应当至少提前 30 日向中国证监会备案。

(5) 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。

#### 4、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) 基金份额持有人大会的召集人(以下简称“召集人”)负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。召开基金份额持有人大会，召集人必须于会议召开日前 30 日在指定媒介公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容：

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

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

(3) 如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对书面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书面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书面表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

## 5、基金份额持有人出席会议的方式

### (1) 会议方式

1) 基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会，会议的召开方式由召集人确定。

2) 现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席，如基金管理人或基金托管人拒不派代表出席的，不影响表决效力。

3) 通讯方式开会指按照本基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。

### (2) 召开基金份额持有人大会的条件

#### 1) 现场开会方式

在同时符合以下条件时，现场会议方可举行：

a. 对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示，全部有效凭证所对应的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50%以上(含 50%，下同)；

b. 到会的基金份额持有人身份证明及持有基金份额的凭证、代理人身份证明、委托人持有基金份额的凭证及授权委托书代理手续完备，到会者出具的相关文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的注册登记资料相符。

#### 2) 通讯开会方式

在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

a. 召集人按本基金合同规定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；

b. 召集人按基金合同规定通知基金托管人或/和基金管理人(分别或共同称为“监督人”)到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；

c. 召集人在监督人和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的书面表决意见，如基金管理人或基金托管人经通知拒不到场监督的，不影响表决效力；

d. 本人直接出具书面意见和授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的 50%以上；

e. 直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人提交的持有基金份额的凭证、授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与注册登记机构记录相符。

## 6、议事内容与程序

### (1) 议事内容及提案权

1) 议事内容为本基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容。

2) 基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日本基金总份额 10%以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前就召开事由向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案。

3) 对于基金份额持有人提交的提案，大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

关联性。大会召集人对于基金份额持有人提案涉及事项与基金有直接关系，并且不超出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在本次基金份额持有人大会上解释和说明。

程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题做出决定。如将其提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

4) 单独或合并持有权益登记日基金总份额 10%以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于 6 个月。法律法规另有规定的除外。

5) 基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后，如果需要对原有提案进行修改，应当在基金份额持有人大会召开前 30 日及时公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有 30 日的间隔期。

### (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规定程序宣布会议议事程序及注意事项，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，经合法执业的律师见证后形成大会决议。

大会由召集人授权代表主持。基金管理人为召集人的，其授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权代表主持；如果基金管理人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以所代表的基金份额 50%以上多数选举产生一名代表作为该次基金份额持有人大会的主持人。

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)、身份证号码、持有或代表有表决权的基金份额数量、委托人姓名(或单位名称)等事项。

## 2) 通讯方式开会

在通讯表决开会的方式下, 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第 2 个工作日在公证机关及监督人的监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。如监督人经通知但拒绝到场监督, 则在公证机关监督下形成的决议有效。

(3) 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。

## 7、决议形成的条件、表决方式、程序

(1) 基金份额持有人所持每一基金份额享有平等的表决权。

(2) 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

一般决议须经出席会议的基金份额持有人(或其代理人)所持表决权的 50%以上通过方为有效, 除下列 2) 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

特别决议须经出席会议的基金份额持有人(或其代理人)所持表决权的三分之二以上(含三分之二)通过方为有效; 涉及更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、终止基金合同必须以特别决议通过方为有效。

(3) 基金份额持有人大会决定的事项, 应当依法报中国证监会核准或者备案, 并予以公告。

(4) 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, 否则表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决, 表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决, 但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

(5) 基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

(6) 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。

## 8、计票

### (1) 现场开会

1) 如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集, 则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推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, 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推举两名基金份额持有人代表与基金管理人、基金托管人授权的一名监督员共同担任监票人；但如果基金管理人和基金托管人的授权代表未出席，则大会主持人可自行选举三名基金份额持有人代表担任监票人。

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

3) 如大会主持人对于提交的表决结果有异议，可以对投票数进行重新清点；如大会主持人未进行重新清点，而出席大会的基金份额持有人或代理人对大会主持人宣布的表决结果有异议，其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，大会主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

## (2) 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监票人在监督人派出的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；如监督人经通知但拒绝到场监督，则大会召集人可自行授权 3 名监票人进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

## 9、基金份额持有人大会决议报中国证监会核准或备案后的公告时间、方式

(1) 基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。关于本章第 2 条所规定的第 1)-8) 项召开事由的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准生效后方可执行，关于本章第 2 条所规定的第 9)、10) 项召开事由的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准或出具无异议意见后方可执行。

(2) 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。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决议。

(3) 基金份额持有人大会决议应自生效之日起 2 日内在指定媒介公告。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。

10、法律法规或监管部门对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

## (三) 基金合同解除和终止的事由、程序

### 1、基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同经中国证监会核准后将终止：

(1) 基金份额持有人大会决定终止的；

(2) 基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在 6 个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务；

(3) 基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在 6 个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务；

(4) 中国证监会规定的其他情况。

## 2、基金财产的清算

### (1) 基金财产清算组

1) 基金合同终止时，成立基金财产清算组，基金财产清算组在中国证监会的监督下进行基金清算。

2) 基金财产清算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人员组成。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

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

### (2) 基金财产清算程序

基金合同终止，应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。基金财产清算程序主要包括：

- 1) 基金合同终止后，发布基金财产清算公告；
- 2) 基金合同终止时，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- 3) 对基金财产进行清理和确认；
- 4) 对基金财产进行估价和变现；
- 5) 聘请会计师事务所对清算报告进行审计；
- 6) 聘请律师事务所出具法律意见书；
- 7) 将基金财产清算结果报告中国证监会；
- 8) 参加与基金财产有关的民事诉讼；
- 9) 公布基金财产清算结果；
- 10) 对基金剩余财产进行分配。

### (3) 清算费用

清算费用是指基金财产清算组在进行基金财产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组优先从基金财产中支付。

### (4) 基金财产按下列顺序清偿：

- 1) 支付清算费用；
- 2) 交纳所欠税款；



3) 清偿基金债务；

4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款 1)－3) 项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

(5) 基金财产清算的公告

基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算结果经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算组报中国证监会备案并公告。

(6) 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。

#### **(四) 争议解决方式**

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，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，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。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

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

本基金合同受中国法律管辖。

#### **(五) 基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式**

依法必须披露的信息发布后，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于公司住所和基金上市交易的证券交易所，供社会公众查阅、复制。

## **二十、基金托管协议的内容摘要**

### **(一) 托管协议当事人**

#### **1、基金管理人**

名称：鹏华基金管理有限公司

注册（办公）地址：深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心 43 层

邮政编码：518048

法定代表人：何如

成立日期：1998 年 12 月 22 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字[1998]31 号

组织形式：有限责任公司（中外合资）

注册资本：1.5 亿元

存续期间：持续经营

经营范围：基金募集；基金销售；资产管理；中国证监会许可的其他业务。

## 2、基金托管人

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：田国立

成立时间：2004 年 09 月 17 日

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、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；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；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；经中国银行业监督管理机构等监管部门批准的其他业务。

### (二) 基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

1、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和交易对手库，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。

本基金投资范围包括：国债、金融债、次级债、企业债、可转换公司债券、央行票据、短期融资券、资产支持证券、债券回购和股票（含一级市场新股申购）、权证（仅限于通过投资可分离转债而获得的权证）等权益类品种，以及中国证监会允许基金投资的其它固定收益类金融工具。

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

基金的投资组合比例为：本基金投资于债券等固定收益类品种的比例不低于基金资产的 80%；本基金投资于股票等权益类品种的比例为基金资产的 0—20%；本基金投资可转换公司债券的比例不超过基金资产净值的 30%；现金和到期日在一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。

2、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、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督：

(1) 本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%；

(2) 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%；

(3) 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%；

(4) 本基金管理人管理且由本基金托管人托管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%；

(5) 本基金管理人管理且由本基金托管人托管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%；

(6) 本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%；本基金投资于股票等权益类品种比例不超过基金资产的 20%；本基金投资可转换公司债券的比例不超过基金资产净值的 30%；

(7) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

(8) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

(9) 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；

(10) 本基金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；

(11) 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；

(12) 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%；

(13) 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；

(14) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的 15%。因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前述所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(15) 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；

(16)如果法律法规对上述投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

除上述第(10)、(13)、(14)、(15)条外，因证券市场波动、上市公司合并、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。

对于因基金份额拆分、大比例分红等集中持续营销活动引起的基金净资产规模在10个交易日内增加10亿元以上的情形，而导致证券投资比例低于基金合同约定的，基金管理人履行相关程序后可将调整时限从10个交易日延长到3个月。法律法规如有变更，从其变更。除投资资产配置比例外，基金托管人对基金的投资比例的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。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。

3、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对本托管协议第十五条第九款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和关联交易进行监督。根据法律法规有关基金禁止从事关联交易的规定，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、与本机构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。基金管理人和基金托管人有责任确保关联交易名单的真实性、准确性、完整性，并负责及时将更新后的名单发送给对方。

若基金托管人发现基金管理人与关联交易名单中列示的关联方进行法律法规禁止基金从事的关联交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人采取必要措施阻止该关联交易的发生，如基金托管人采取必要措施后仍无法阻止关联交易发生时，基金托管人有权向中国证监会报告。对于基金管理人已成交的关联交易，基金托管人事前无法阻止该关联交易的发生，只能进行事后结算，基金托管人不承担由此造成的损失，并向中国证监会报告。

4、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，基金管理人可以对相应损失先行予以承担，然后再向相关交易对手追偿。基金托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督。如基金托管人

事后发现基金管理人没有按照事先约定的交易对手或交易方式进行交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人，基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任。

5、本基金投资流通受限证券，基金管理人应事先根据中国证监会相关规定，与基金托管人就相关事项签订补充协议，明确基金投资流通受限证券的比例。基金管理人应制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险。基金托管人对基金管理人是否遵守相关制度、流动性风险处置预案以及相关投资额度和比例等的情况进行监督。

6、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金资产净值计算、基金份额净值计算、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。

7、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。

8、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。

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

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

据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

1、基金管理人**对基金托管人履行托管职责情况进行核查**，核查事项包括基金托管人**安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、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。

2、基金管理人**发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、基金合同、本协议及其他有关规定时**，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正。基金托管人收到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。

3、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

#### 1、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和证券账户。

（4）基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立。

（5）基金托管人根据基金管理人的指令，按照基金合同和本协议的约定保管基金财产，如有特殊情况双方可另行协商解决。

（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的损失，基金托管人对此不承担任何责任。

（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。

#### 2、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在基金托管人的营业机构开立的“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停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，基金管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人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。

全部资金划入基金托管人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，未能达到基金合同生效的条件，由基金管理人按规定办理退款等事宜。

### 3、基金银行账户的开立和管理

(1) 基金托管人可以基金的名义在其营业机构开立基金的银行账户，并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。

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

(3) 基金银行账户的开立和管理应符合银行业监督管理机构的有关规定。

(4) 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人专用账户办理基金资产的支付。

### 4、基金证券账户的开立和管理

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

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

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

(4) 基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，并代表所托管的基金完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清算工作，基金管理人应予以积极协助。结算备付金、结算互保基金、交收价差资金等的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

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

#### 5、债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后，基金托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司的有关规定，在中央国债登记结算有限责任公司开立债券托管账户，并代表基金进行银行间市场债券的结算。基金管理人和基金托管人同时代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议。

#### 6、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，由基金托管人负责开立。新账户按有关规则使用并管理。

(2) 法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

#### 7、基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券等有价凭证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、中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司或票据营业中心的代保管库，保管凭证由基金托管人持有。实物证券等有价凭证的购买和转让，由基金管理人和基金托管人共同办理。基金托管人对由基金托管人以外机构实际有效控制的证券不承担保管责任。

#### 8、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以加密方式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。

### (五) 基金资产净值计算与复核

#### 1、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的金额。

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

基金管理人每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，经基金托管人复核，按规定公告。



## 2、复核程序

基金管理人每个开放日对基金资产进行估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

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

### **（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。如不能妥善保管，则按相关法规承担责任。

### **（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）托管协议的修改与终止**

#### 1、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报中国证监会核准或备案后生效。

#### 2、基金托管协议终止出现的情形

- （1）基金合同终止；
- （2）基金托管人解散、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。

## 二十一、对基金份额持有人的服务

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

### 一、营销创新及网上交易服务

为丰富投资者的交易方式和渠道，基金管理人为投资者提供多种形式的交易服务。

在营销渠道创新方面，本基金管理人大力发展基金电子商务，并已开通基金网上交易系统，投资者可登陆本基金管理人的网站（www.phfund.com），更加方便、快捷地办理基金交易及信息查询等已开通的各项基金网上交易业务。同时，投资者可关注鹏华基金官方微信账号（微信号：penghua jijin），快速实现净值查询功能，绑定个人账户之后，还可实现账户查询功能和交易功能。基金管理人也将不断努力完善现有技术系统和销售渠道，为投资者提供更加多样化的交易方式和手段。

### 二、信息定制服务

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

### 三、在线咨询服务

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

### 四、客户服务中心（CALL-CENTER）电话服务

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

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

### 五、客户投诉受理服务

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

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

## 二十二、其他应披露事项

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

| 公告内容  | 报纸      | 日期         |
|---|---------|------------|
| 关于鹏华丰收债券型证券投资基金恢复大额申购、转换转入和定期定额投资业务的公告                  | 《证券时报》  | 2019年5月29日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与徽商银行股份有限公司认、申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告 | 《上海证券报》 | 2019年6月24日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与徽商银行股份有限公司认、申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告 | 《中国证券报》 | 2019年6月24日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与徽商银行股份有限公司认、申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告 | 《证券日报》  | 2019年6月24日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与徽商银行股份有限公司认、申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告 | 《证券时报》  | 2019年6月24日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国银行股份有限公司定期定额申购费率优惠活动的公告           | 《上海证券报》 | 2019年6月27日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国银行股份有限公司定期定额申购费率优惠活动的公告           | 《中国证券报》 | 2019年6月27日 |

|  |         |            |
|--|---------|------------|
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国银行股份有限公司定期定额申购费率优惠活动的公告      | 《证券日报》  | 2019年6月27日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国银行股份有限公司定期定额申购费率优惠活动的公告      | 《证券时报》  | 2019年6月27日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与长城国瑞证券有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告 | 《上海证券报》 | 2019年7月1日  |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与长城国瑞证券有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告 | 《中国证券报》 | 2019年7月1日  |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与长城国瑞证券有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告 | 《证券时报》  | 2019年7月1日  |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告                      | 《上海证券报》 | 2019年7月2日  |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告                      | 《中国证券报》 | 2019年7月2日  |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告                      | 《证券时报》  | 2019年7月2日  |
| 鹏华丰收债券型证券投资基金更新的招募说明书摘要                            | 《证券时报》  | 2019年7月6日  |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与上海浦东发展银行股份有限公司定期定额申购费率优惠活动的公告  | 《上海证券报》 | 2019年7月16日 |

|  |         |            |
|--|---------|------------|
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与上海浦东发展银行股份有限公司定期定额申购费率优惠活动的公告        | 《中国证券报》 | 2019年7月16日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与上海浦东发展银行股份有限公司定期定额申购费率优惠活动的公告        | 《证券日报》  | 2019年7月16日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与上海浦东发展银行股份有限公司定期定额申购费率优惠活动的公告        | 《证券时报》  | 2019年7月16日 |
| 2019年第二季度报告  | 《证券时报》  | 2019年7月16日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于提醒网上直销个人投资者及时上传有效身份证件照片并完善、更新身份信息以免影响业务办理的公告 | 《上海证券报》 | 2019年8月9日  |
| 鹏华基金管理有限公司关于提醒网上直销个人投资者及时上传有效身份证件照片并完善、更新身份信息以免影响业务办理的公告 | 《中国证券报》 | 2019年8月9日  |
| 鹏华基金管理有限公司关于提醒网上直销个人投资者及时上传有效身份证件照片并完善、更新身份信息以免影响业务办理的公告 | 《证券日报》  | 2019年8月9日  |
| 鹏华基金管理有限公司关于提醒网上直销个人投资者及时上传有效身份证件照片并完善、更新身份信息以免影响业务办理的公告 | 《证券时报》  | 2019年8月9日  |
| 鹏华基金管理有限公司关于提醒网上直销个人投资者及时上传有效身份证件照片并完善、更新身份信息以免影响业务办理的公告 | 《上海证券报》 | 2019年8月10日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于提醒网上直销个人投资者及时上传有效身份证件照片并完善、更新身份信息以免影响业务办理的公告 | 《中国证券报》 | 2019年8月10日 |

|  |         |            |
|--|---------|------------|
| 鹏华基金管理有限公司关于提醒网上直销个人投资者及时上传有效身份证件照片并完善、更新身份信息以免影响业务办理的公告 | 《证券日报》  | 2019年8月10日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于提醒网上直销个人投资者及时上传有效身份证件照片并完善、更新身份信息以免影响业务办理的公告 | 《证券时报》  | 2019年8月10日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于提醒网上直销个人投资者及时上传有效身份证件照片并完善、更新身份信息以免影响业务办理的公告 | 《上海证券报》 | 2019年8月12日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于提醒网上直销个人投资者及时上传有效身份证件照片并完善、更新身份信息以免影响业务办理的公告 | 《中国证券报》 | 2019年8月12日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于提醒网上直销个人投资者及时上传有效身份证件照片并完善、更新身份信息以免影响业务办理的公告 | 《证券日报》  | 2019年8月12日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于提醒网上直销个人投资者及时上传有效身份证件照片并完善、更新身份信息以免影响业务办理的公告 | 《证券时报》  | 2019年8月12日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于提醒网上直销个人投资者及时上传有效身份证件照片并完善、更新身份信息以免影响业务办理的公告 | 《上海证券报》 | 2019年8月13日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于提醒网上直销个人投资者及时上传有效身份证件照片并完善、更新身份信息以免影响业务办理的公告 | 《中国证券报》 | 2019年8月13日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于提醒网上直销个人投资者及时上传有效身份证件照片并完善、更新身份信息以免影响业务办理的公告 | 《证券日报》  | 2019年8月13日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于提醒网上直销个人投资者及时上传有效身份证件照片并完善、更新身份信息以免影响业务办理的公告 | 《证券时报》  | 2019年8月13日 |

|  |         |            |
|--|---------|------------|
| 份信息以免影响业务办理的公告   |         |            |
| 鹏华基金管理有限公司关于提醒网上直销个人投资者及时上传有效身份证件照片并完善、更新身份信息以免影响业务办理的公告 | 《上海证券报》 | 2019年8月14日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于提醒网上直销个人投资者及时上传有效身份证件照片并完善、更新身份信息以免影响业务办理的公告 | 《中国证券报》 | 2019年8月14日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于提醒网上直销个人投资者及时上传有效身份证件照片并完善、更新身份信息以免影响业务办理的公告 | 《证券日报》  | 2019年8月14日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于提醒网上直销个人投资者及时上传有效身份证件照片并完善、更新身份信息以免影响业务办理的公告 | 《证券时报》  | 2019年8月14日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于提醒网上直销个人投资者及时上传有效身份证件照片并完善、更新身份信息以免影响业务办理的公告 | 《上海证券报》 | 2019年8月15日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于提醒网上直销个人投资者及时上传有效身份证件照片并完善、更新身份信息以免影响业务办理的公告 | 《中国证券报》 | 2019年8月15日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于提醒网上直销个人投资者及时上传有效身份证件照片并完善、更新身份信息以免影响业务办理的公告 | 《证券日报》  | 2019年8月15日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于提醒网上直销个人投资者及时上传有效身份证件照片并完善、更新身份信息以免影响业务办理的公告 | 《证券时报》  | 2019年8月15日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于提醒网上直销个人投资者及时上传有效身份证件照片并完善、更新身份信息以免影响业务办理的公告 | 《上海证券报》 | 2019年8月16日 |

|  |         |            |
|--|---------|------------|
| 鹏华基金管理有限公司关于提醒网上直销个人投资者及时上传有效身份证件照片并完善、更新身份信息以免影响业务办理的公告 | 《中国证券报》 | 2019年8月16日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于提醒网上直销个人投资者及时上传有效身份证件照片并完善、更新身份信息以免影响业务办理的公告 | 《证券日报》  | 2019年8月16日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于提醒网上直销个人投资者及时上传有效身份证件照片并完善、更新身份信息以免影响业务办理的公告 | 《证券时报》  | 2019年8月16日 |
| 2019年半年度报告摘要   | 《证券时报》  | 2019年8月23日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与万联证券股份有限公司申购费率优惠活动的公告                | 《上海证券报》 | 2019年8月31日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与万联证券股份有限公司申购费率优惠活动的公告                | 《中国证券报》 | 2019年8月31日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与万联证券股份有限公司申购费率优惠活动的公告                | 《证券日报》  | 2019年8月31日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与万联证券股份有限公司申购费率优惠活动的公告                | 《证券时报》  | 2019年8月31日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于鹏华丰收债券型证券投资基金暂停大额申购、转换转入和定期定额投资业务的公告         | 《证券时报》  | 2019年9月16日 |
| 关于鹏华丰收债券型证券投资基金恢复大额申购、转换转入和定期定额投资业务的公告                   | 《证券时报》  | 2019年9月23日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与腾安基金销售（深圳）有限公司认\申购费率优惠活动的公告          | 《上海证券报》 | 2019年9月28日 |



|   |         |             |
|---|---------|-------------|
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与腾安基金销售（深圳）有限公司认\申购费率优惠活动的公告   | 《中国证券报》 | 2019年9月28日  |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与腾安基金销售（深圳）有限公司认\申购费率优惠活动的公告   | 《证券日报》  | 2019年9月28日  |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与腾安基金销售（深圳）有限公司认\申购费率优惠活动的公告   | 《证券时报》  | 2019年9月28日  |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与上海浦东发展银行股份有限公司定期定额申购费率优惠活动的公告 | 《上海证券报》 | 2019年10月18日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与上海浦东发展银行股份有限公司定期定额申购费率优惠活动的公告 | 《中国证券报》 | 2019年10月18日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与上海浦东发展银行股份有限公司定期定额申购费率优惠活动的公告 | 《证券日报》  | 2019年10月18日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与上海浦东发展银行股份有限公司定期定额申购费率优惠活动的公告 | 《证券时报》  | 2019年10月18日 |
| 鹏华基金管理有限公司旗下证券投资基金 2019 年第 3 季度报告提示性公告            | 《上海证券报》 | 2019年10月25日 |
| 鹏华基金管理有限公司旗下证券投资基金 2019 年第 3 季度报告提示性公告            | 《中国证券报》 | 2019年10月25日 |
| 鹏华基金管理有限公司旗下证券投资基金 2019 年第 3 季度报告提示性公告            | 《证券日报》  | 2019年10月25日 |

|  |         |                  |
|--|---------|------------------|
| 鹏华基金管理有限公司旗下证券投资基金 2019 年第 3 季度报告提示性公告           | 《证券时报》  | 2019 年 10 月 25 日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于鹏华丰收债券型证券投资基金暂停大额申购、转换转入和定期定额投资业务的公告 | 《证券时报》  | 2019 年 10 月 31 日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于增加北京创金启富基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告       | 《上海证券报》 | 2019 年 11 月 18 日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于增加北京创金启富基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告       | 《中国证券报》 | 2019 年 11 月 18 日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于增加北京创金启富基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告       | 《证券日报》  | 2019 年 11 月 18 日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于增加北京创金启富基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告       | 《证券时报》  | 2019 年 11 月 18 日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于鹏华丰收债券型证券投资基金 2019 年第 2 次分红公告        | 《证券时报》  | 2019 年 11 月 22 日 |
| 鹏华丰收债券型证券投资基金恢复大额申购、转换转入和定期定额投资业务的公告             | 《证券时报》  | 2019 年 11 月 26 日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与浙江同花顺基金销售有限公司认\申购费率优惠活动的公告   | 《上海证券报》 | 2019 年 12 月 9 日  |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与浙江同花顺基金销售有限公司认\申购费率优惠活动的公告   | 《中国证券报》 | 2019 年 12 月 9 日  |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与浙江同花顺基金销售有限公司认\申购费率优惠活动的公告   | 《证券日报》  | 2019 年 12 月 9 日  |

|   |                               |             |
|---|-------------------------------|-------------|
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与浙江同花顺基金销售有限公司认\申购费率优惠活动的公告              | 《证券时报》                        | 2019年12月9日  |
| 鹏华基金管理有限公司澄清公告  | 《上海证券报》                       | 2019年12月11日 |
| 鹏华基金管理有限公司澄清公告  | 《中国证券报》                       | 2019年12月11日 |
| 鹏华基金管理有限公司澄清公告  | 《证券日报》                        | 2019年12月11日 |
| 鹏华基金管理有限公司澄清公告  | 《证券时报》                        | 2019年12月11日 |
| 鹏华基金管理有限公司澄清公告  | 《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》 | 2019年12月18日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国工商银行股份有限公司“2020倾心回馈”基金定期定额申购费率优惠活动的公告 | 《上海证券报》                       | 2019年12月31日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国工商银行股份有限公司个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告         | 《上海证券报》                       | 2019年12月31日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行股份有限公司手机银行渠道基金申购及定期定额投资费率优惠活动的公告    | 《上海证券报》                       | 2019年12月31日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国工商银行股份有限公司“2020倾心回馈”基金定期定额申购费率优惠活动的公告 | 《中国证券报》                       | 2019年12月31日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国工商银行股份有限公司个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告         | 《中国证券报》                       | 2019年12月31日 |

|   |         |             |
|---|---------|-------------|
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行股份有限公司手机银行渠道基金申购及定期定额投资费率优惠活动的公告    | 《中国证券报》 | 2019年12月31日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国工商银行股份有限公司“2020倾心回馈”基金定期定额申购费率优惠活动的公告 | 《证券时报》  | 2019年12月31日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国工商银行股份有限公司个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告         | 《证券时报》  | 2019年12月31日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行股份有限公司手机银行渠道基金申购及定期定额投资费率优惠活动的公告    | 《证券时报》  | 2019年12月31日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国农业银行股份有限公司基金申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告      | 《上海证券报》 | 2020年1月4日   |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国农业银行股份有限公司基金申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告      | 《中国证券报》 | 2020年1月4日   |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国农业银行股份有限公司基金申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告      | 《证券日报》  | 2020年1月4日   |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国农业银行股份有限公司基金申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告      | 《证券时报》  | 2020年1月4日   |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下证券投资基金招募说明书的补充提示                              | 《上海证券报》 | 2020年1月16日  |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与青岛意才基金销售有限公司认、申购（含定期定额                  | 《上海证券报》 | 2020年1月17日  |

|   |         |            |
|---|---------|------------|
| 申购) 费率优惠活动的公告   |         |            |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与青岛意才基金销售有限公司认、申购(含定期定额申购) 费率优惠活动的公告 | 《中国证券报》 | 2020年1月17日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与青岛意才基金销售有限公司认、申购(含定期定额申购) 费率优惠活动的公告 | 《证券日报》  | 2020年1月17日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于增加奕丰基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告                  | 《上海证券报》 | 2020年1月20日 |
| 鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2019 年第 4 季度报告提示性公告                    | 《上海证券报》 | 2020年1月20日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于增加奕丰基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告                  | 《中国证券报》 | 2020年1月20日 |
| 鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2019 年第 4 季度报告提示性公告                    | 《中国证券报》 | 2020年1月20日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于增加奕丰基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告                  | 《证券时报》  | 2020年1月20日 |
| 鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2019 年第 4 季度报告提示性公告                    | 《证券时报》  | 2020年1月20日 |
| 鹏华丰收债券型证券投资基金暂停大额申购、转换转入和定期定额投资业务的公告                    | 《证券时报》  | 2020年1月22日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于调整旗下基金 2020 年春节假期清算交收安排及申购赎回等交易业务的提示性公告     | 《上海证券报》 | 2020年2月3日  |
| 鹏华基金管理有限公司关于调整旗下基金 2020 年春节假期清算交收安排及申购赎回等交易业务的          | 《证券时报》  | 2020年2月3日  |

|   |         |                 |
|---|---------|-----------------|
| 提示性公告   |         |                 |
| 鹏华基金管理有限公司关于调整旗下基金 2020 年春节假期清算交收安排及申购赎回等交易业务的提示性公告 | 《证券日报》  | 2020 年 2 月 3 日  |
| 鹏华基金管理有限公司关于使用不低于 5000 万元自有资金购买本公司旗下偏股型公募基金的公告      | 《上海证券报》 | 2020 年 2 月 5 日  |
| 鹏华基金管理有限公司关于使用不低于 5000 万元自有资金购买本公司旗下偏股型公募基金的公告      | 《中国证券报》 | 2020 年 2 月 5 日  |
| 鹏华基金管理有限公司关于使用不低于 5000 万元自有资金购买本公司旗下偏股型公募基金的公告      | 《证券日报》  | 2020 年 2 月 5 日  |
| 鹏华基金管理有限公司关于使用不低于 5000 万元自有资金购买本公司旗下偏股型公募基金的公告      | 《证券时报》  | 2020 年 2 月 5 日  |
| 鹏华丰收债券型证券投资基金调整大额申购、转换转入和定期定额投资业务的公告                | 《证券时报》  | 2020 年 2 月 19 日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于增加中证金牛（北京）投资咨询有限公司为旗下部分基金销售机构的公告        | 《上海证券报》 | 2020 年 2 月 24 日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于增加中证金牛（北京）投资咨询有限公司为旗下部分基金销售机构的公告        | 《中国证券报》 | 2020 年 2 月 24 日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于增加中证金牛（北京）投资咨询有限公司为旗下部分基金销售机构的公告        | 《证券时报》  | 2020 年 2 月 24 日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于增加上海联泰基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告            | 《上海证券报》 | 2020 年 3 月 3 日  |

|  |         |            |
|--|---------|------------|
| 鹏华基金管理有限公司关于增加上海联泰基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告 | 《中国证券报》 | 2020年3月3日  |
| 鹏华基金管理有限公司关于增加上海联泰基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告 | 《证券时报》  | 2020年3月3日  |
| 鹏华基金管理有限公司关于鹏华丰收债券型证券投资基金2020年第1次分红公告    | 《证券时报》  | 2020年3月25日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于延期披露旗下基金2019年年度报告的提示性公告      | 《上海证券报》 | 2020年3月28日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于延期披露旗下基金2019年年度报告的提示性公告      | 《中国证券报》 | 2020年3月28日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于延期披露旗下基金2019年年度报告的提示性公告      | 《证券日报》  | 2020年3月28日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于延期披露旗下基金2019年年度报告的提示性公告      | 《证券时报》  | 2020年3月28日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于增加阳光人寿保险股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告 | 《上海证券报》 | 2020年4月9日  |
| 鹏华基金管理有限公司关于增加阳光人寿保险股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告 | 《中国证券报》 | 2020年4月9日  |
| 鹏华基金管理有限公司关于增加阳光人寿保险股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告 | 《证券日报》  | 2020年4月9日  |
| 鹏华基金管理有限公司关于增加阳光人寿保险股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告 | 《证券时报》  | 2020年4月9日  |
| 鹏华基金管理有限公司修改旗下88只证券投资基金基金合同的公告           | 《上海证券报》 | 2020年4月15日 |

|                                  |         |                 |
|----------------------------------|---------|-----------------|
| 鹏华基金管理有限公司修改旗下 88 只证券投资基金基金合同的公告 | 《中国证券报》 | 2020 年 4 月 15 日 |
| 鹏华基金管理有限公司修改旗下 88 只证券投资基金基金合同的公告 | 《证券日报》  | 2020 年 4 月 15 日 |
| 鹏华基金管理有限公司修改旗下 88 只证券投资基金基金合同的公告 | 《证券时报》  | 2020 年 4 月 15 日 |

上述披露事项的披露期间自 2019 年 05 月 28 日至 2020 年 04 月 15 日。

## 二十三、招募说明书的存放及查阅方式

本招募说明书按相关法律法规，存放在基金管理人、基金代销机构等的办公场所，投资者可在办公时间免费查阅；也可在支付工本费后在合理时间内获取本招募说明书复制件或复印件，但应以招募说明书正本为准。投资者也可以直接登录基金管理人的网站进行查阅。

基金管理人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

## 二十四、备查文件

### （一）备查文件包括：

- 1、中国证监会核准鹏华丰收债券型证券投资基金募集的文件
- 2、《鹏华丰收债券型证券投资基金基金合同》
- 3、《鹏华丰收债券型证券投资基金注册与登记过户委托代理协议》
- 4、《鹏华丰收债券型证券投资基金托管协议》
- 5、法律意见书
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照

### （二）备查文件的存放地点和投资者查阅方式：

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

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

鹏华基金管理有限公司

2020 年 05 月