

**鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型  
发起式证券投资基金  
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：上海浦东发展银行股份有限公司**

**2021年07月**

## 重要提示

鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会 2015 年 6 月 5 日证监许可[2015]1166 号文注册募集。根据相关法律法规，本基金基金合同已于 2015 年 7 月 6 日生效，基金管理人于该日起正式开始对基金财产进行运作管理。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

证券投资基金（以下简称“基金”）是一种长期投资工具，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，投资者购买基金，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。

基金合同生效后 10 年内（含 10 年）为本基金封闭运作期，本基金在此期间内封闭运作并在深圳证券交易所上市交易。基金封闭运作期届满，本基金转为上市开放式基金（LOF）。

封闭运作期内，本基金主要投资于目标公司股权、固定收益类资产和权益类资产，基金净值会因为目标公司经营状况变化、租户履约状况变化和证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：本基金的特定风险（如，封闭运作期内集中投资风险、目标公司经营风险、租金无法回收的风险、商业物业收益的估值风险、目标公司破产风险等）、信用风险、管理风险、操作或技术风险、合规性风险和政策变更风险等等，详见本招募说明书第十八部分。

本基金在封闭运作期内投资于目标公司股权，以获取商业物业租金收益为目标，因此与股票型基金和债券型基金有不同的风险收益特征，本基金预期风险和收益高于债券型基金和货币型基金，低于股票型基金。

封闭运作期结束后，本基金转型成为债券型基金，其预期的收益与风险低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金，为证券投资基金中具有较低风险收益特征的品种。

本基金封闭运作期届满，转为上市开放式基金（LOF）后，当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，基金管理人履行相应程序后，可以启用侧袋机制，具体详见基金合同和招募说明书的有关章节。侧袋机制实施期间，基金管理人将对基金简称进行特殊标识，投资者不得办理侧袋账户份额的申购赎回等业务。请基金份额持有人仔细阅读相关内容并关注本基金启用侧袋机制时的特定风险。

本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与中国存托凭证发行机制相关的风险，包括存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差

异可能引发的风险；存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；因多地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；存托凭证退市的风险；已在境外上市的基础证券发行人，在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险；境内外法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。

投资者在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书、基金合同和基金产品资料概要，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策。

投资者应当通过本基金管理人和/或销售机构认购基金。本基金在募集期内按 1.00 元面值发售并不改变基金的风险收益特征。投资者按 1.00 元面值购买基金份额以后，有可能面临基金份额净值跌破 1.00 元、从而遭受损失的风险。

本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资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。

本基金管理人提醒投资者及时关注本基金的公告信息，了解目标公司的增资入股情况、运营情况或者其他信息，遵循基金投资的“买者自负”原则，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。

本招募说明书所载内容截止日为 2021 年 06 月 15 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2021 年 03 月 31 日（未经审计）。

# 目 录

- 第一部分 绪 言
- 第二部分 释 义
- 第三部分 基金管理人
- 第四部分 基金托管人
- 第五部分 相关服务机构
- 第六部分 基金的募集
- 第七部分 基金合同的生效
- 第八部分 基金份额的上市交易
- 第九部分 基金封闭运作期内的投资
- 第十部分 交易基础和产品结构
- 第十一部分 项目价值和投后管理
- 第十二部分 基金的财产
- 第十三部分 基金资产的估值
- 第十四部分 基金的收益分配
- 第十五部分 基金的费用与税收
- 第十六部分 基金的会计与审计
- 第十七部分 基金的信息披露
- 第十八部分 风险揭示
- 第十九部分 基金封闭运作期届满后的安排
- 第二十部分 侧袋机制
- 第二十一部分 基金的合并、终止与清算
- 第二十二部分 基金合同的内容摘要
- 第二十三部分 基金托管协议的内容摘要
- 第二十四部分 对基金份额持有人的服务
- 第二十五部分 其他应披露事项
- 第二十六部分 招募说明书的存放及查阅方式
- 第二十七部分 备查文件

## 第一部分 绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》（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《鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式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前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”或“基金”）的投资目标、策略、风险、费率等与投资人投资决策有关的必要事项，投资人在做出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

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

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证监会注册。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件，其他与本基金相关的涉及基金合同当事人之间权利义务关系的任何文件或表述，均以基金合同为准。基金合同的当事人包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受。基金份额持有人作为基金合同当事人并不以在基金合同上书面签章为必要条件。基金合同当事人按照《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。

## 第二部分 释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 1、基金或本基金：指鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金
- 2、基金管理人或本公司：指鹏华基金管理有限公司
- 3、基金托管人：指上海浦东发展银行股份有限公司
- 4、基金合同或本基金合同：指《鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金基金合同》及对该基金合同的任何有效修订和补充

5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充

6、招募说明书：指《鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式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《鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金基金份额发售公告》

8、上市交易公告书：指《鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金上市公告书》

9、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章、有权机关颁发的其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等，以及前述文件的不时更新或修订的版本

10、《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，并经 2012 年 12 月 28 日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自 2013 年 6 月 1 日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订

11、《销售办法》：指中国证监会 2020 年 8 月 28 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

12、《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，并经 2020 年 3 月 20 日中国证监会《关于修改部分证券期货规章的决定》修正的《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

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

14、《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

15、封闭式基金：指基金份额总额在基金合同期限内固定不变，基金份额持有人不得申请赎回的证券投资基金

16、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

17、前海金控或基石投资人：指深圳市前海金融控股有限公司

18、前海投控：指深圳市前海开发投资控股有限公司

19、投资顾问：指符合法律法规规定的条件，为本基金证券投资提供证券买卖建议或投资组合管理等服务并取得收入的金融机构；投资顾问由基金管理人选择、增补、更换和撤销

20、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

21、基金合同当事人：指受基金合同约定，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、基金份额持有人和基金投资顾问

22、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

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

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

25、发起资金：指来源于基金管理公司股东资金、公司固有资金、公司高级管理人员或基金经理等人员的资金

26、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

27、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

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

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

30、登记结算机构：指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

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：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、《业务规则》：指中国证券登记结算有限责任公司发布的适用于封闭式证券投资基金的业务规则、细则、规定及其不时修订的版本

37、项目或前海企业公馆项目：指深圳市万科前海企业公馆建设项目，项目具体信息详见招募说明书

38、万科企业：指万科企业股份有限公司

39、深圳万科：指深圳市万科房地产有限公司

40、前海管理局：指深圳市前海深港现代服务业合作区管理局

41、前海合作区：指深圳市前海深港现代服务业合作区

42、BOT 协议：指《深圳市前海开发投资控股有限公司与万科企业股份有限公司关于前海企业公馆项目之 BOT 协议》

43、目标公司：指深圳市万科前海公馆建设管理有限公司及其组织形式变更后的实体。本基金对目标公司投资前，目标公司为深圳市万科房地产有限公司全资持股的有限责任公司。本基金对目标公司投资后，目标公司将按照约定变更为股份有限公司

44、目标公司服务机构：指深圳万科

45、增资完成日：指基金合同生效后，本基金将增资入股目标公司的价款支付至目标公司银行账户之日

46、《合作框架协议》：指鹏华基金管理有限公司、深圳市万科前海公馆建设管理有限公司、万科企业股份有限公司、深圳市万科房地产有限公司、深圳市前海开发投资控股有限公司于 2015 年 2 月 13 日签署的《鹏华基金管理有限公司、深圳市万科前海公馆建设管理有限公司、万科企业股份有限公司、深圳市万科房地产有限公司、深圳市前海开发投资控股有限公司之合作框架协议》

47、《增资协议》：指鹏华基金管理有限公司、深圳市万科房地产有限公司、深圳市万科前海公馆建设管理有限公司于 2015 年 2 月 13 日签署的《鹏华基金管理有限公司、深圳市万科房地产有限公司、深圳市万科前海公馆建设管理有限公司关于深圳市万科前海公馆建设管理有限公司之增资协议》

48、《股权回购协议》：指深圳市万科房地产有限公司、鹏华基金管理有限公司、深圳市万科前海公馆建设管理有限公司于 2015 年 2 月 13 日签署的《深圳市万科房地产有限公司、鹏华基金管理有限公司、深圳市万科前海公馆建设管理有限公司关于深圳市万科前海公馆建设管理有限公司之股权回购协议》

49、项目收益：指基金管理人代表本基金通过持有目标公司股权获得利润分配及深圳万科或其指定的关联方回购目标公司股权的方式，所取得的自 2015 年 1 月 1 日起至 2023 年 7 月 24 日期间前海企业公馆项目 100%的实际或应当取得的除物业管理费之外经调整后的营业收入，详见招募说明书的约定

50、认购：指在基金募集期内，投资人申请购买基金份额的行为

51、系统内转托管：指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（交易单元）之间进行转托管的行为

52、跨系统转托管：跨系统转托管只限于在证券账户和以其为基础注册的开放式基金账户之间进行，指投资人将基金份额在证券登记结算系统内某会员单位（交易单元）与注册登记系统内的某销售机构（网点）之间进行转托管的行为

53、元：指人民币元



54、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

55、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

56、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

57、基金资产总值：指目标公司股权、各类有价证券、银行存款本息和基金应收款项以及其他资产的价值总和

58、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

59、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

60、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

61、封闭运作期：自基金合同生效之日起至 10 年后对应日止，基金采取封闭运作的期间，如该对应日为非工作日，则顺延至下一个工作日

62、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

63、基金产品资料概要：指《鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金基金产品资料概要》及其更新

64、不可抗力：指本合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

65、侧袋机制：指本基金封闭运作期届满，转为上市开放式基金（LOF）后，将基金投资组合中的特定资产从原有账户分离至一个专门账户进行处置清算，目的在于有效隔离并化解风险，确保投资者得到公平对待，属于流动性风险管理工具。侧袋机制实施期间，原有账户称为主袋账户，专门账户称为侧袋账户

66、特定资产：包括：（一）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的资产；（二）按摊余成本计量且计提资产减值准备仍导致资产价值存在重大不确定性的资产；（三）其他资产价值存在重大不确定性的资产

## 第三部分 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, 国信证券股份有限公司董事长、党委书记, 现任鹏华基金管理有限公司董事长。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。

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独立董事。

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独立董事。

蒋毅刚先生, 独立董事, 硕士, 国籍: 中国。历任深圳大学法学院讲师, 广东君诚律师事务所主任, 上海锦天城律师事务所高级合伙人, 上海市锦天城(深圳)律师事务所第一届及第四届管理委员会主任。自 2021 年 4 月开始担任鹏华基金管理有限公司独立董事。

## 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。曾任鹏华基金管理有限公司董事、深圳市北融信投资发展有限公司董事长、同方康泰产业集团有限公司主席兼执行董事、深圳市华融泰资产管理有限公司董事长、深圳华控赛格股份有限公司董事长、同方股份有限公司副董事长、总裁。现任深圳市奥融信投资发展有限公司执行董事、深圳市华融泰置业有限公司董事长、国都证券股份有限公司董事、同方康泰产业集团有限公司执行董事、行政总裁。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、资金财务总部副总经理、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.) 首席财务官。自 2016 年 2 月开始担任鹏华基金管理有限公司监事。

刘嵌先生, 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、首席市场官兼机构理财总部总经理、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。

郝文高先生, 职工监事, 大专学历, 国籍: 中国。历任深圳奥尊电脑有限公司证券基金事业部副经理、招商基金管理有限公司基金事务部总监; 2011 年 7 月加盟鹏华基金管理有限公司, 现任登记结算部总经理。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, 高级合规官, 现任监察稽核部总经理助理。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, 国信证券股份有限公司董事长、党委书记, 现任鹏华基金管理有限公司董事长。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。

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, 兼任首席信息官。

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。

王宗合先生, 副总裁, 经济学硕士, 国籍: 中国。曾任职于招商基金管理有限公司, 从事行业研究工作; 历任鹏华基金管理有限公司研究员、基金经理助理、基金管理部副总经理、董事总经理

(MD), 自 2021 年 1 月起担任鹏华基金管理有限公司副总裁, 兼任权益投资二部总经理、稳定收益投资部总经理、基金经理。

梁浩先生, 副总裁, 经济学博士, 国籍: 中国。曾任职于信息产业部电信研究院, 从事产业政策研究工作; 历任鹏华基金管理有限公司研究员、基金经理助理、研究部副总经理、董事总经理 (MD), 自 2021 年 1 月起担任鹏华基金管理有限公司副总裁, 兼任研究部总经理、资产配置与基金投资部总经理、基金经理。

#### 4、本基金基金经理

尤柏年先生, 国籍中国, 经济学博士, 17 年证券从业经验。历任澳大利亚 BConnect 公司 Apex 投资咨询团队分析师, 华宝兴业基金管理有限公司金融工程部高级数量分析师、海外投资管理部高级分析师、基金经理助理、华宝兴业成熟市场基金和华宝兴业标普油气基金基金经理等职; 2014 年 7 月加盟鹏华基金管理有限公司, 历任国际业务部副总经理, 现担任国际业务部总经理、基金经理。2014 年 08 月担任鹏华全球高收益债基金经理, 2014 年 09 月至 2020 年 01 月担任鹏华环球发现 (QDII-FOF) 基金经理, 2015 年 07 月担任鹏华前海万科 REITs 基金经理, 2016 年 12 月担任鹏华沪深港新兴成长混合基金经理, 2017 年 11 月担任鹏华港美互联股票 (LOF) 基金经理, 2017 年 11 月担任鹏华香港中小企业指数 (LOF) 基金经理, 2017 年 11 月至 2019 年 08 月担任鹏华香港银行指数 (LOF) 基金经理, 2020 年 01 月担任鹏华全球中短债债券 (QDII) 基金经理, 2021 年 05 月担任鹏华红利优选混合基金经理, 尤柏年具备基金从业资格。

本基金基金经理管理的其他基金情况:

2014 年 08 月担任鹏华全球高收益债基金经理

2014 年 09 月至 2020 年 01 月担任鹏华环球发现 (QDII-FOF) 基金经理

2016 年 12 月担任鹏华沪深港新兴成长混合基金经理

2017 年 11 月担任鹏华港美互联股票 (LOF) 基金经理

2017 年 11 月担任鹏华香港中小企业指数 (LOF) 基金经理

2017 年 11 月至 2019 年 08 月担任鹏华香港银行指数 (LOF) 基金经理

2020 年 01 月担任鹏华全球中短债债券 (QDII) 基金经理

2021 年 05 月担任鹏华红利优选混合基金经理

刘方正先生, 国籍中国, 理学硕士, 11 年证券从业经验。2010 年 6 月加盟鹏华基金管理有限公司, 从事债券研究工作, 历任固定收益部高级研究员、基金经理助理, 现任稳定收益投资部总经理助理、基金经理。2015 年 03 月至 2017 年 01 月担任鹏华弘利混合基金经理, 2015 年 03 月至 2015 年 08 月担任鹏华行业成长基金经理, 2015 年 04 月至 2017 年 01 月担任鹏华弘润混合基金经理, 2015 年 05 月担任鹏华弘华混合基金经理, 2015 年 05 月担任鹏华弘和混合基金经理, 2015 年 05 月至 2017 年 01 月担任鹏

华弘益混合基金经理, 2015年06月至2017年01月担任鹏华弘鑫混合基金经理, 2015年08月担任鹏华前海万科REITs基金经理, 2015年08月至2017年01月担任鹏华弘泰混合基金经理, 2016年03月至2018年05月担任鹏华弘锐混合基金经理, 2016年03月至2017年05月担任鹏华弘实混合基金经理, 2016年03月担任鹏华弘信混合基金经理, 2016年08月担任鹏华弘达混合基金经理, 2016年08月至2017年12月担任鹏华弘嘉混合基金经理, 2016年09月担任鹏华弘惠混合基金经理, 2016年11月至2018年01月担任鹏华兴裕定开混合基金经理, 2016年11月担任鹏华兴泰定期开放混合基金经理, 2016年12月担任鹏华兴悦定期开放混合基金经理, 2017年09月至2018年08月担任鹏华兴益定期开放混合基金经理, 2018年05月担任鹏华睿投混合基金经理, 刘方正具备基金从业资格。

本基金基金经理管理的其他基金情况:

2015年03月至2017年01月担任鹏华弘利混合基金经理

2015年03月至2015年08月担任鹏华行业成长基金经理

2015年04月至2017年01月担任鹏华弘润混合基金经理

2015年05月担任鹏华弘华混合基金经理

2015年05月担任鹏华弘和混合基金经理

2015年05月至2017年01月担任鹏华弘益混合基金经理

2015年06月至2017年01月担任鹏华弘鑫混合基金经理

2015年08月至2017年01月担任鹏华弘泰混合基金经理

2016年03月至2018年05月担任鹏华弘锐混合基金经理

2016年03月担任鹏华弘信混合基金经理

2016年03月至2017年05月担任鹏华弘实混合基金经理

2016年08月担任鹏华弘达混合基金经理

2016年08月至2017年12月担任鹏华弘嘉混合基金经理

2016年09月担任鹏华弘惠混合基金经理

2016年11月至2018年01月担任鹏华兴裕定开混合基金经理

2016年11月担任鹏华兴泰定期开放混合基金经理

2016年12月担任鹏华兴悦定期开放混合基金经理

2017年09月至2018年08月担任鹏华兴益定期开放混合基金经理

2018年05月担任鹏华睿投混合基金经理

本基金历任的基金经理：

无。

#### 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。

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。

王宗合先生，鹏华基金管理有限公司副总裁，兼任权益投资二部总经理/稳定收益投资部总经理/基金经理，鹏华优质回报两年定开混合、鹏华精选回报三年定开混合、鹏华价值共赢两年持有期混合、鹏华养老产业股票、鹏华中国 50 混合、鹏华成长价值混合、鹏华产业精选、鹏华匠心精选混合、鹏华创新未来 18 个月封闭混合、鹏华消费优选混合基金基金经理。

梁浩先生，鹏华基金管理有限公司副总裁，兼任研究部总经理/资产配置与基金投资部总经理/基金经理，鹏华新兴产业混合、鹏华研究精选混合、鹏华科技创新混合、鹏华新兴成长混合、鹏华成长智选混合、鹏华汇智优选混合基金基金经理。

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）、鹏华聚合多资产混合（FOF）、鹏华长乐稳健养老混合发起式（FOF）、鹏华养老 2035 混合（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、依法募集资金，办理基金份额的发售和登记事宜；
- 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；
- 8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；
- 9、按照规定召集基金份额持有人大会；
- 10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- 11、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；



12、中国证监会规定的其他职责。

#### 四、基金管理人的承诺

1、基金管理人承诺不从事违反《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、欺诈成份；
- (13) 以不正当手段谋求业务发展；
- (14) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
- (15) 其他法律、行政法规禁止的行为。

4、基金经理承诺

- (1) 依照有关法律法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；
- (2) 不得利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者谋取利益；

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

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

(5) 业务部门：对本部门业务范围内的业务风险负有管控和及时报告的义务；

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

#### 4、内部控制措施

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

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

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

(4) 建立并不断完善内部控制体系及内部控制制度：自成立来，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，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。

## 第四部分 基金托管人

### (一) 基金托管人概况

本基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司，基本信息如下：

名称：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：郑杨

成立时间：1992 年 10 月 19 日

经营范围：经中国人民银行和中国银行业监督管理委员会批准，公司主营业务主要包括：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱业务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外币兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；资信调查、咨询、见证业务；离岸银行业务；证券投资基金托管业务；全国社会保障基金托管业务；经中国人民银行和中国银行业监督管理委员会批准经营的其他业务。

组织形式：股份有限公司

注册资本：293.52 亿元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基金字[2003]105 号

联系人：胡波

联系电话：(021) 61618888

上海浦东发展银行自 2003 年开展资产托管业务，是较早开展银行资产托管服务的股份制商业银行之一。经过二十年来的稳健经营和业务开拓，各项业务发展一直保持较快增长，各项经营指标在股份制商业银行中处于较好水平。

上海浦东发展银行总行于 2003 年设立基金托管部，2005 年更名为资产托管部，2013 年更名为资产托管与养老金业务部，2016 年进行组织架构优化调整，并更名为资产托管部，目前下设证券托管处、客户资产托管处、内控管理处、业务保障处、总行资产托管运营中心（含合肥分中心）五个职能处室。

目前，上海浦东发展银行已拥有客户资金托管、资金信托保管、证券投资基金托管、全球资产托管、保险资金托管、基金专户理财托管、证券公司客户资产托管、期货公司客户资产托管、私募证券投资基金托管、私募股权托管、银行理财产品托管、企业年金托管等多项托管产品，形成完备的产品体系，可满足多领域客户、境内外市场的资产托管需求。

## （二）主要人员情况

郑杨，男，1966 年出生，研究生学历，博士学位，高级经济师。曾任国家经贸委经济法规司调研处副处长；中国机电设备招标中心开发处处长、第七招标业务处处长；国家外汇管理局资本项目司副司长；中国人民银行上海分行党委委员、副行长、国家外汇管理局上海市分局副局长；中国人民银行上海总部党委委员、副主任兼外汇管理部主任；上海市金融工作党委副书记、市金融办主任；上海市金融工作党委书记、市金融办主任；上海市金融工作党委书记、市地方金融监管局（市金融工作局）局长。现任上海浦东发展银行党委书记、董事长。

潘卫东，男，1966 年出生，硕士研究生，高级经济师。曾任宁波证券公司业务一部副经理；上海浦东发展银行宁波分行资财部总经理兼任北仑办事处主任、宁波分行副行长；上海浦东发展银行产品开发部总经理；上海浦东发展银行昆明分行行长、党组书记；上海市金融服务办公室挂职并任金融机构处处长；上海国际集团党委委员、总经理助理，上海国际集团党委委员、副总经理，上海国际信托有限公司党委书记、董事长；上海浦东发展银行党委委员、执行董事、副行长、财务总监。现任上海浦东发展银行党委副书记、副董事长、行长，上海国际信托有限公司董事长。

孔建，男，1968 年出生，博士研究生。历任工商银行山东省分行资金营运处副处长，上海浦东发展银行济南分行信管处总经理，上海浦东发展银行济南分行行长助理、副行长、党委书记、行长。现任上海浦东发展银行总行金融市场业务工作党委委员，资产托管部总经理。

## （三）基金托管业务经营情况

截止 2021 年 03 月 31 日，上海浦东发展银行证券投资基金托管规模为 11233.54 亿元，比去年末增加 6.47%。托管证券投资基金共二百九十八支，分别为国泰金龙行业精选基金、国泰金龙债券基金、天治财富增长基金、广发小盘成长基金、汇添富货币基金、长信金利趋势基金、嘉实优质企业基金、国联安货币基金、长信利众债券基金（LOF）、博时安丰 18 个月基金（LOF）、易方达裕丰回报基金、鹏华丰泰定期开放基金、汇添富双利增强债券基金、华富恒财定开债券基金、汇添富和聚宝货币基金、工银目标收益一年定开债券基金、北信瑞丰宜投宝货币基金、中海医药健康产业基金、华富国泰民安灵活配置混合基金、安信动态策略灵活配置基金、东方红稳健精选基金、国联安鑫享混合基

金、长安鑫利优选混合基金、工银瑞信生态环境基金、天弘新价值混合基金、嘉实机构快线货币基金、鹏华 REITs 封闭式基金、华富健康文娱基金、金鹰改革红利基金、易方达裕祥回报债券基金、中银瑞利灵活配置混合基金、华夏新活力混合基金、鑫元汇利债券型基金、南方转型驱动灵活配置基金、银华远景债券基金、富安达长盈灵活配置混合型基金、中信建投睿溢混合型证券投资基金、工银瑞信恒享纯债基金、长信利发债券基金、博时景发纯债基金、鑫元得利债券型基金、东方红战略沪港深混合基金、博时富发纯债基金、博时利发纯债基金、银河君信混合基金、兴业启元一年定开债券基金、工银瑞信瑞盈 18 个月定开债券基金、中信建投稳裕定开债券基金、招商招怡纯债债券基金、中加丰享纯债债券基金、银河君耀灵活配置混合基金、广发汇瑞 3 个月定期开放债券发起式证券投资基金、汇安嘉汇纯债债券基金、南方宣利定开债券基金、招商兴福灵活配置混合基金、博时鑫润灵活配置混合基金、兴业裕华债券基金、易方达瑞通灵活配置混合基金、招商招祥纯债债券基金、易方达瑞程混合基金、中欧骏泰货币基金、招商招华纯债债券基金、汇安丰融灵活配置混合基金、汇安嘉源纯债债券基金、国泰普益混合基金、汇添富鑫瑞债券基金、鑫元合丰纯债债券基金、博时鑫惠混合基金、国泰润利纯债基金、华富天益货币基金、汇安丰华混合基金、汇安沪深 300 指数增强型证券投资基金、汇安丰恒混合基金、景顺长城中证 500 指数基金、鹏华丰康债券基金、兴业安润货币基金、兴业瑞丰 6 个月定开债券基金、兴业裕丰债券基金、易方达瑞弘混合基金、长安鑫富领先混合基金、万家现金增利货币基金、上银慧增利货币市场基金、易方达瑞富灵活配置证券投资基金、博时富腾纯债债券型证券投资基金、安信工业 4.0 主题沪港深精选混合基金、万家天添宝货币基金、中欧瑾泰债券型证券投资基金、中银证券安弘债券基金、鑫元鑫趋势灵活配置混合基金、泰康年年红纯债一年定期开放债券基金、广发高端制造股票型发起式基金、永赢永益债券基金、南方安福混合基金、中银证券聚瑞混合基金、太平改革红利精选灵活配置混合基金、富荣富乾债券型证券投资基金、国联安安稳灵活配置混合型证券投资基金、前海开源弘泽债券型发起式证券投资基金、前海开源弘丰债券型发起式证券投资基金、中海沪港深多策略灵活配置混合型基金、中银证券祥瑞混合型证券投资基金、前海开源盛鑫灵活配置混合型证券投资基金、鑫元行业轮动灵活配置混合型证券投资基金、兴业 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、富国颐利纯债债券型证券投资基金、华安安浦债券型证券投资基金、南方泽元债券型证券投资基金、鹏扬淳利定期开放债券型证券投资基金、万家鑫悦纯债债券型基金、新疆前海联合泳祺纯债债券型证券投资基金、永赢盈益债券型证券投资基金、中加颐合纯债债券型证券投资基金、中信保诚稳达债券型证券投资基金、中银中债 3-5 年期农发行债券指数证券投资基金、东方红核心优选一年定期开放混合型证券投资基金、平安惠锦纯债债券型证券投资基金、华夏鼎通债券型证券投资基金、鑫元全利债券型发起式证券投资基金、中融恒裕纯债债券型证券投资基金、嘉实致盈债券型证券投资基金、永赢消费主题灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信瑞福纯债债券型证券投资基金、东兴品牌精选灵活配置混合型证券投资基金、广发中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、融通通捷债券型证券投资基金、华富恒盛纯债债券型证券投资基金、建信中证 1000 指数增

强型发起式证券投资基金、汇安嘉鑫纯债债券型证券投资基金、国寿安保安丰纯债债券型证券投资基金、博时中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、银河家盈纯债债券型证券投资基金、博时富永纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、南方畅利定期开放债券型发起式证券投资基金、中加瑞利纯债债券型证券投资基金、华富中证 5 年恒定久期国开债指数型证券投资基金、永赢合益债券型证券投资基金、嘉实中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、广发港股通优质增长混合型证券投资基金、长安泓沅中短债债券型证券投资基金、中海信息产业精选混合型证券投资基金、民生加银恒裕债券型证券投资基金、国寿安保尊益信用纯债债券型证券投资基金、平安惠泰纯债债券型证券投资基金、中信建投景和中短债债券型证券投资基金、工银瑞信添慧债券型证券投资基金、华富安鑫债券型证券投资基金、汇添富中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金、南方旭元债券型发起式证券投资基金、大成中债 3-5 年国开行债券指数基金、永赢众利债券型证券投资基金、华夏中债 3-5 年政策性金融债指数证券投资基金、中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金、新疆前海联合科技先锋混合型证券投资基金、银华尊尚稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、博时颐泽平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、农银养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、汇添富汇鑫浮动净值货币市场基金、泰康安欣纯债债券型证券投资基金、恒生前海港股通精选混合型证券投资基金、鹏华丰鑫债券型证券投资基金、中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金、汇添富保鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富安兴 39 个月定期开放债券型证券投资基金、中融睿享 86 个月定期开放债券型基金、南方梦元短债债券型证券投资基金、鹏扬淳开债券型证券投资基金、华宝宝惠纯债 39 个月定期开放债券型证券投资基金、建信 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金、农银汇理金益债券型证券投资基金、博时稳欣 39 个月定期开放债券型证券投资基金、同泰慧择混合型证券投资基金、招商中证红利交易型开放式指数证券投资基金、嘉实致禄 3 个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、永赢久利债券型证券投资基金、嘉实安元 39 个月定期开放纯债债券型证券投资基金、交银施罗德裕泰两年定期开放债券型证券投资基金、长城嘉鑫两年定期开放债券型证券投资基金、建信荣禧一年定期开放债券型证券投资基金、鹏扬浦利中短债债券型证券投资基金、平安惠合纯债债券型证券投资基金、工银瑞信深证 100 交易型开放式指数证券投资基金、鹏华 0-5 年利率债债券型发起式证券投资基金、景顺长城弘利 39 个月定期开放债券型证券投资基金、工银瑞信泰颐三年定期开放债券型证券投资基金、华安鑫浦 87 个月定期开放债券型证券投资基金、汇安嘉盛纯债债券型证券投资基金、东方红安鑫甄选一年持有期混合型证券投资基金、西藏东财中证通信技术主题指数型发起式证券投资基金、财通裕惠 63 个月定期开放债券型证券投资基金、南方尊利一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰中证全指家用电器交易型开放式指数证券投资基金、鹏华尊裕一年定期开放债券型发起式证券投资基金、鹏扬淳悦一年定期开放债券型发起式证券投资基金、兴业鼎泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金、安信丰泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金、国泰中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基

金、广发恒隆一年持有期混合型证券投资基金、安信中证信用主体 50 债券指数证券投资基金、国泰中证全指家用电器交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、海富通富泽混合型证券投资基金、华富中债-0-5 年中高等级信用债收益平衡指数证券投资基金、汇添富稳健增益一年持有期混合型证券投资基金、南方誉慧一年持有期混合型证券投资基金、农银汇理永乐 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、鹏扬景恒六个月持有期混合型证券投资基金、平安合兴 1 年定期开放债券型发起式证券投资基金、融通中债 1-3 年国开行债券指数基金、太平中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、天弘永裕稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、中欧真益稳健一年持有期混合型证券投资基金、南华中证杭州湾区交易型开放式指数证券投资基金联接基金、金信核心竞争力灵活配置混合型证券投资基金、华泰紫金中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金、博时价值臻选两年持有期灵活配置混合型证券投资基金、东方红益丰纯债债券型证券投资基金、东方红鑫泰 66 个月定期开放债券型证券投资基金、东方红鼎元 3 个月定期开放混合型发起式证券投资基金、富国上海金交易型开放式证券投资基金、富国上海金交易型开放式证券投资基金联接基金、工银瑞信深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、广发汇浦三年定期开放债券型证券投资基金、国联安增泰一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、海富通惠增多策略一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、华安中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金、华宝中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、景顺长城安鑫回报一年持有期混合型证券投资基金、景顺长城电子信息产业股票型证券投资基金、景顺长城中债 3-5 年政策性金融债指数证券投资基金、民生加银瑞鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金、鹏华锦润 86 个月定期开放债券型证券投资基金、鹏华创新未来 18 个月封闭运作混合型证券投资基金、鹏扬淳安 66 个月定期开放债券型证券投资基金、融通通恒 63 个月定期开放债券型证券投资基金、上银聚远盈 42 个月定期开放债券型证券投资基金、新疆前海联合淳丰纯债 87 个月定期开放债券型证券投资基金、兴业稳泰 66 个月定期开放债券型证券投资基金、兴业睿进混合型证券投资基金、易方达悦享一年持有期混合型基金、易方达创新未来 18 个月封闭运作混合型基金、银华汇益一年持有期混合型基金、永赢瑞宁 87 个月定期开放债券型证券投资基金、长信浦瑞 87 个月定期开放债券型证券投资基金、招商添盛 78 个月定期开放债券型证券投资基金、中信建投稳丰 63 个月定期开放债券型证券投资基金、中信保诚景裕中短债债券型证券投资基金、泰达宏利中证申万绩优策略指数增强型证券投资基金、泰达宏利乐盈 66 个月定期开放债券型证券投资基金、创金合信泰博 66 个月定期开放债券型证券投资基金、淳厚安裕 87 个月定期开放债券型证券投资基金、西部利得尊泰 86 个月定期开放债券型证券投资基金、西部利得聚禾灵活配置混合型基金、德邦锐泽 86 个月定期开放债券型证券投资基金、德邦惠利混合型证券投资基金、光大保德信尊合 87 个月定期开放债券型证券投资基金、蜂巢添禧 87 个月定期开放债券型证券投资基金、国金惠丰 39 个月定期开放债券型证券投资基金、九泰科新优享灵活配置混合型证券投资基金、华泰保兴久盈 63 个月定期开放债券型证券投资基金、博时恒旭一年持有期混合型证券投资基金、大成卓享一年



持有期混合型证券投资基金基金、东方红明鉴优选两年定期开放混合型证券投资基金、广发研究精选股票型证券投资基金、恒生前海恒颐五年定期开放债券型基金、华夏创新未来 18 个月封闭运作混合型证券投资基金、汇添富创新未来 18 个月封闭运作混合型证券投资基金、汇添富高质量成长精选 2 年持有期混合型证券投资基金、嘉实浦惠 6 个月持有期混合型证券投资基金、农银养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、天弘睿新三个月定期开放混合型证券投资基金、鑫元乾利债券型证券投资基金、兴业研究精选混合型证券投资基金、中加瑞合纯债债券型证券投资基金、中欧创新未来 18 个月封闭运作混合型证券投资基金、中欧价值成长混合型证券投资基金、创金合信医药消费股票型证券投资基金、新华安享惠融 88 个月定期开放债券型证券投资基金、申万菱信安泰广利 63 个月定期开放债券型证券投资基金、汇丰晋信惠安 63 个月定期开放债券型证券投资基金、中邮纯债丰利债券型证券投资基金、兴银汇泽 87 个月定期开放债券型证券投资基金、东方红启航三年持有期混合型证券投资基金、东方红启瑞三年持有期混合型证券投资基金、博时创新经济混合型证券投资基金、富国融泰三个月定期开放混合型发起式证券投资基金、国泰中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金、汇添富健康生活一年持有期混合型证券投资基金、嘉实浦盈一年持有期混合型证券投资基金、景顺长城新能源产业股票型证券投资基金、农银汇理安瑞一年持有期混合型 FOF 基金、鹏华安裕 5 个月持有期混合型证券投资基金基金、银华稳健增长一年持有期混合型证券投资基金、招商添逸 1 年定期开放债券型发起式证券投资基金、中银顺泽回报一年持有期混合型证券投资基金、创金合信竞争优势混合型证券投资基金、兴全汇吉一年持有期混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证物联网主题交易型开放式指数证券投资基金等。

#### **（四）基金托管人的内部控制制度**

1、本行内部控制目标为：确保经营活动中严格遵守国家有关法律法规、监管部门监管规则和本行规章制度，形成守法经营、规范运作的经营思想。确保经营业务的稳健运行，保证基金资产的安全和完整，确保业务活动信息的真实、准确、完整，保护基金份额持有人的合法权益。

2、本行内部控制组织架构为：总行法律合规部是全行内部控制的牵头管理部门，指导业务部门建立并维护资产托管业务的内部控制体系。总行风险监控部是全行操作风险的牵头管理部门。指导业务部门开展资产托管业务的操作风险管控工作。总行资产托管部下设内控管理处。内控管理处是全行托管业务条线的内部控制具体管理实施机构，并配备专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，独立行使监督稽核职责。

3、内部控制制度及措施：本行已建立完善的内部控制制度。内控制度贯穿资产托管业务的决策、执行、监督全过程，渗透到各业务流程和各操作环节，覆盖到从事资产托管各级组织结构、岗位及人员。内部控制以防范风险、合规经营为出发点，各项业务流程体现“内控优先”要求。

具体内控措施包括：培育员工树立内控优先、制度先行、全员化风险控制的风险管理理念，营造浓厚的内控文化氛围，使风险意识贯穿到组织架构、业务岗位、人员的各个环节。制定权责清晰的业

务授权管理制度、明确岗位职责和各项操作规程、员工职业道德规范、业务数据备份和保密等在内的各项业务管理制度；建立严格完善的资产隔离和资产保管制度，托管资产与托管人资产及不同托管资产之间实行独立运作、分别核算；对各类突发事件或故障，建立完备有效的应急方案，定期组织灾备演练，建立重大事项报告制度；在基金运作办公区域建立健全安全监控系统，利用录音、录像等技术手段实现风险控制；定期对业务情况进行自查、内部稽核等措施进行监控，通过专项/全面审计等措施实施业务监控，排查风险隐患。

#### **（五）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序**

##### **1、监督依据**

托管人严格按照有关政策法规、以及基金合同、托管协议等进行监督。监督依据具体包括：

- （1）《中华人民共和国证券法》；
- （2）《中华人民共和国证券投资基金法》；
- （3）《公开募集证券投资基金运作管理办法》；；
- （4）《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》
- （5）《基金合同》、《基金托管协议》；
- （6）法律、法规、政策的其他规定。

##### **2、监督内容**

我行根据基金合同及托管协议约定，对基金合同生效之后所托管基金的投资范围、投资比例、投资限制等进行严格监督，及时提示基金管理人违规风险。

##### **3、监督方法**

（1）资产托管部设置核算监督岗位，配备相应的业务人员，在授权范围内独立行使对基金管理人投资交易行为的监督职责，规范基金运作，维护基金投资人的合法权益，不受任何外界力量的干预；

（2）在日常运作中，凡可量化的监督指标，由核算监督岗通过托管业务的自动处理程序进行监督，实现系统的自动跟踪和预警；

（3）对非量化指标、投资指令、管理人提供的各种报表和报告等，采取人工监督的方法。

##### **4、监督结果的处理方式**

（1）基金托管人对基金管理人的投资运作监督结果，采取定期和不定期报告形式向基金管理人和中国证监会报告。定期报告包括基金监控周报等。不定期报告包括提示函、临时日报、其他临时报告等；

（2）若基金托管人发现基金管理人违法违规操作，以电话、邮件、书面提示函的方式通知基金管理人，指明违规事项，明确纠正期限。在规定期限内基金托管人再对基金管理人违规事项进行复查，如果基金管理人未予纠正，基金托管人将报告中国证监会。如果发现基金管理人投资运作有重大违规行为时，基金托管人应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正；

(3) 针对中国证监会、中国人民银行对基金投资运作监督情况的检查，应及时提供有关情况和资料。

## 第五部分 相关服务机构

### 一、基金份额销售机构

#### 1、直销机构

(1) 鹏华基金管理有限公司直销中心

办公地址：深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心 43 层

联系电话：0755-33688115

传真：0755-82021155

联系人：吕奇志

网址：www.phfund.com

(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

联系电话：010-88082426

传真：010-88082018

联系人：张圆圆

(3) 鹏华基金管理有限公司上海分公司

办公地址：上海市浦东新区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 801B 室

联系电话：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

联系电话：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、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：高天

客户服务电话：95559

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

#### 2、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](http://bank.pingan.com)

#### 3、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](http://www.spdb.com.cn)

#### 4、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](http://www.bosc.cn)

#### 5、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：缪建民

联系人：邓炯鹏

客户服务电话：95555

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

6、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)

7、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)

8、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、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：黄炎勋

联系人：陈剑虹

客户服务电话：95517 或 4008-001-001

网址：www.essence.com.cn

## 2、渤海证券股份有限公司

注册地址：天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

办公地址：天津市南开区滨水西道 8 号

法定代表人：安志勇

联系人：陈玉辉

客户服务电话：400-651-5988

网址：www.ewww.com.cn

## 3、长城证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道金田路 2026 号能源大厦南塔楼 10-19 层

办公地址：深圳市福田区福田街道金田路 2026 号能源大厦南塔楼 10-19 层

法定代表人：曹宏

联系人：梁浩

客户服务电话：95514

网址：www.cgws.com

## 4、长江证券股份有限公司

注册地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

办公地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：李新华

联系人：奚博宇

客户服务电话：95579/4008-888-999

网址：www.95579.com

## 5、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：施华

联系人：丁敏

客户服务电话：95571

网址：www.foundersc.com

## 6、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：上海市新闻路 1508 号

法定代表人：刘秋明

联系人：郁疆

客户服务电话：95525

网址：www.ebscn.com

#### 7、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：翁振杰

联系人：黄静

客户服务电话：400-818-8118

网址：www.guodu.com

#### 8、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：陈瑀琦

客户服务电话：95310

网址：www.gjq.com.cn

#### 9、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

#### 10、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：张纳沙

联系人：李颖

客户服务电话：95536

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

11、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: 李笑鸣

客户服务电话: 95553

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

12、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: 张彬

客户服务电话: 95584

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

13、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: 虞佳彦

客户服务电话: 95323

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

14、平安证券股份有限公司

注册地址: 深圳市福田区深圳市福田区福田街道益田路 5023 号平安金融中心 B 座第 22-25 层

办公地址: 深圳市福田区福田街道益田路 5023 号平安金融中心 B 座第 22-25 层

法定代表人: 何之江

联系人: 王阳

客户服务电话: 95511-8

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

15、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 (邮编:200031)

办公地址: 上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层 (邮编:200031)



法定代表人：杨玉成

联系人：陈宇

客户服务电话：95523

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

16、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：王雅薇

客户服务电话：95391/4008005000

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

17、西部证券股份有限公司

注册地址：陕西省西安市新城东大街319号8幢10000室

办公地址：陕西省西安市新城东大街319号8幢10000室

法定代表人：徐朝晖

联系人：张吉安

客户服务电话：95582

网址：[www.west95582.com](http://www.west95582.com)

18、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：高振营

联系人：江恩前

客户服务电话：95351

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

19、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：北京市西城区宣武门西大街甲127号大成大厦6层

法定代表人：肖林

联系人：王薇安

客户服务电话：95321

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

20、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](http://www.xyzq.com.cn)

21、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：北京市朝阳区建外大街甲 6 号 SK 大厦 38 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](http://www.cicc.com.cn)

22、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](http://www.chinastock.com.cn)

23、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](http://www.ciccwm.com)

24、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](http://www.zts.com.cn)

25、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](http://www.csc108.com)

26、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：杜杰

客户服务电话：95548

网址：[www.cs.ecitic.com](http://www.cs.ecitic.com)

27、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 501 房

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 5 层

法定代表人：胡伏云

联系人：陈靖

客户服务电话：95548

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

28、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](http://sd.citics.com)

(3) 期货公司销售机构

1、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](http://www.citicsf.com)

(4) 第三方销售机构

1、上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层

办公地址：上海市徐汇区宛平南路88号东方财富大厦

法定代表人：其实

联系人：高莉莉

客户服务电话：95021/400-1818-188

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

基金管理人可根据有关法律法规要求，根据实情，选择其他符合要求的机构代理销售本基金或变更上述代销机构，并在基金管理人网站公示。

二、登记结算机构

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：0755-25941405

传真：0755-25987133

负责人：丁志勇

三、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海通力律师事务所

住所：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

负责人：韩炯

办公室地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

联系电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：陈颖华

经办律师：吕红、黎明

#### 四、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、肖菊

#### 五、房地产评估机构

名称：深圳市戴德梁行土地房地产评估有限公司

住所：深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第二座第 18 层 03B、04 室

办公地址：深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场 2 座 18 楼

法定代表人：程家龙

联系电话：0755-21518000

传真：0755-82070107

联系人：夏磊

经办注册资产评估师：黄建英

## 第六部分 基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》和其他有关法律法规，以及基金合同的规定，经中国证监会 2015 年 6 月 5 日证监许可[2015]1166 号文准予募集注册。除法律、行政法规或中国证监会另有规定外，任何与基金份额发售有关的当事人不得预留或提前发售基金份额。

具体发售方案以本基金的基金份额发售公告为准，请投资者就发售和认购事宜仔细阅读本基金的基金份额发售公告。

### 一、基金的类别

契约型、混合型证券投资基金

### 二、基金的运作方式

## 契约型

基金合同生效后 10 年内（含 10 年）为基金封闭运作期，本基金在此期间内封闭运作并在深圳证券交易所上市交易。基金封闭运作期届满，本基金转为上市开放式基金（LOF）。

### 三、基金的存续期间

不定期

### 四、募集方式

本基金将通过场外和场内两种方式公开发售。场外将通过基金管理人的直销网点及其他基金销售机构的代销网点发售（具体名单详见基金份额发售公告）。场内将通过深圳证券交易所内具有相应业务资格的会员单位发售（具体名单详见基金份额发售公告或相关业务公告）。尚未取得相应业务资格，但属于深圳证券交易所会员的其他机构，可在本基金上市后，代理投资者通过深圳证券交易所交易系统参与本基金的上市交易。

在本基金封闭运作期内，登记在证券登记结算系统中的基金份额不得赎回，但在本基金上市交易后可以通过深圳证券交易所上市交易；登记在开放式基金注册登记系统中的基金份额既不能通过深圳证券交易所上市交易，也不得赎回，若需变现，可在本基金上市交易后，先通过跨系统转托管业务将登记在开放式基金注册登记系统中的基金份额转登记到证券登记结算系统中，然后通过深圳证券交易所上市交易。

### 五、募集期限

自基金份额发售之日起最长不得超过 3 个月，具体募集时间详见基金份额发售公告及销售机构相关公告。

### 六、上市交易所

深圳证券交易所

### 七、募集对象

本基金的募集对象包括：

符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者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。

### 八、募集目标

中国证监会准予本基金募集的基金份额总额为 30 亿份（不包括利息折算的基金份额），规模控制措施详见基金份额发售公告的有关规定。

### 九、基金份额的场外认购

本节内容仅适用于基金份额的场外认购，通过此种方式认购的基金份额登记在注册登记系统中。

#### 1、募集场所

本基金的场外认购通过基金管理人的直销网点和其他销售机构的代销网点（具体名单详见基金份额发售公告）进行。销售机构办理本基金场外认购业务的城市（网点）的具体情况和联系方法，请参见本基金的基金份额发售公告。

## 2、基金份额的面值、认购费用、认购价格及计算公式

（1）基金份额初始发售面值：本基金份额初始发售面值为人民币 1.00 元。

（2）认购费率：本基金场外认购费率如下表：

| 认购金额 M（元）     | 认购费率      |
|---------------|-----------|
| M<100 万       | 1.0%      |
| 100 万≤M<500 万 | 0.7%      |
| M≥500 万       | 每笔 1000 元 |

本基金的认购费用应在投资人认购基金份额时收取。基金认购费用不列入基金财产，主要用于基金的市场推广、销售、登记结算等募集期间发生的各项费用。

（3）认购份额的计算：

基金场外认购采用金额认购的方式。基金的认购金额包括认购费用和净认购金额。计算公式为：

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 + 认购利息) / 基金份额面值

场外认购份额计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有，其中利息转份额以基金登记结算机构的记录为准。利息折算的份额保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分舍去，余额计入基金资产。

例如：某投资人认购本基金 100,000 元，所对应的认购费率为 1.0%。假定该笔认购金额产生利息 52 元。则认购份额为：

净认购金额 = 认购金额 / (1 + 认购费率) = 100,000 / (1 + 1.0%) = 99,009.90 元

认购费用 = 认购金额 - 净认购金额 = 100,000 - 99,009.90 = 990.10 元

认购份额 = (净认购金额 + 认购利息) / 基金份额面值 = (99,009.90 + 52) / 1.00 = 99,061.90 份

即：投资人投资 100,000 元认购本基金份额，在基金合同生效时，投资人账户登记有本基金 99,061.90 份。

## 3、投资者对基金份额的场外认购

（1）认购时间安排

投资者可在募集期内前往本基金销售机构的网点办理基金份额认购手续，具体的业务办理时间详见本基金的基金份额发售公告或各代销机构相关业务办理规则。

(2) 投资者认购应提交的文件和办理的手续

投资者认购本基金所应提交的文件和具体办理手续详见本基金的基金份额发售公告或各代销机构相关业务办理规则。

(3) 认购的方式及确认

1) 投资者认购时，需按销售机构规定的方式全额缴款。

2) 投资者在募集期内可以多次认购基金份额，但已受理的认购申请不允许撤销。

3) 投资者在 T 日规定时间内提交的认购申请，通常应在 T+2 日到原认购网点查询认购申请的受理情况。

4) 基金销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购的确认以登记结算机构或基金管理人的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况，投资者可及时查询并妥善行使合法权利。

(4) 认购的限额

本基金其他销售机构的代销网点每个基金账户单笔最低认购金额为 100,000 元。直销中心的首次最低认购金额为 100,000 元，追加认购单笔最低认购金额为 1,000 元。本基金募集期间对单个基金份额持有人最高累计认购金额不设限制。

十、基金份额的场内认购

本节内容仅适用于基金份额的场内认购，通过此种方式认购的基金份额登记在证券登记结算系统中。

1、募集场所

本基金的场内认购通过深圳证券交易所内具有相应业务资格的会员单位（具体名单详见基金份额发售公告或相关业务公告）进行。本基金募集期结束前获得基金代销资格的证券公司也可代理场内基金份额的发售。尚未取得相应业务资格，但属于深圳证券交易所会员的其他机构，可在本基金上市后，代理投资者通过深圳证券交易所交易系统参与本基金的上市交易。

2、基金份额的面值、认购费用、认购价格及计算公式

(1) 基金份额初始发售面值：本基金份额初始发售面值为人民币 1.00 元。

(2) 认购费率：本基金场内认购费率如下表：

| 认购金额 M (元)        | 认购费率 |
|-------------------|------|
| M < 100 万         | 1.0% |
| 100 万 ≤ M < 500 万 | 0.7% |



|         |           |
|---------|-----------|
| M≥500 万 | 每笔 1000 元 |
|---------|-----------|

本基金的认购费用应在投资人认购基金份额时收取。基金认购费用不列入基金财产，主要用于基金的市场推广、销售、登记结算等募集期间发生的各项费用。

(3) 认购份额的计算：

场内认购采用“份额认购，份额确认”的方式。计算公式为：

净认购金额=挂牌价格×认购份额

认购费用=挂牌价格×认购份额×认购费率

认购金额=净认购金额+认购费用

利息折算的份额=利息/挂牌价格

场内认购份额计算结果保留到整数，小数部分舍弃，余额计入基金财产。认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有，其中利息转份额以基金登记结算机构的记录为准。利息折算的份额保留至整数位，余额计入基金财产。

例如：某投资人认购本基金 100,000 份，若会员单位设定认购费率为 1.0%，假定该笔认购产生利息 52 元。则认购金额和利息折算的份额为：

挂牌价格=1.00 元

净认购金额=挂牌价格×认购份额=1.00×100,000=100,000 元

认购费用=挂牌价格×认购份额×认购费率=1.00×100,000×1.0%=1,000 元

认购金额=净认购金额+认购费用=100,000+1,000=101,000 元

利息折算的份额=利息/挂牌价格=52/1.00=52 份（经取整）

即：投资人认购 100,000 份基金份额，需缴纳 101,000 元，若利息折算的份额为 52 份，则总共可得到 100,052 份基金份额。

### 3、投资人对基金份额的场内认购

#### (1) 认购时间安排

投资人可在募集期内前往具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位（具体名单见基金份额发售公告）办理基金份额的场内认购手续，具体的业务办理时间详见本基金的基金份额发售公告或各代销机构相关业务办理规则。

#### (2) 投资人认购应提交的文件和办理的手续

投资人认购本基金所应提交的文件和具体办理手续详见本基金的基金份额发售公告或各代销机构相关业务办理规则。

#### (3) 认购的方式及确认

1) 投资人认购时，需按办理场内认购业务相关机构规定的方式备足认购的金额。

2) 投资人在募集期内可以多次认购基金份额，但已受理的认购申请不允许撤销。

3) 投资人在 T 日规定时间内提交的认购申请，通常应在 T+2 日到原认购网点查询认购申请的受理情况。

4) 基金销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购的确认以登记结算机构或基金管理人的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况，投资人可及时查询并妥善行使合法权利。

#### (4) 认购的限额

场内认购单笔最低认购份额为 100,000 份，超过 100,000 份的须为 1,000 份的整数倍，且每笔认购最大不超过 99,999,000 份基金份额。本基金募集期间对单个基金份额持有人最高累计认购份额不设限制。

#### 十一、超过募集目标的约定

若通过场内或场外认购方式的合计认购份额超过募集上限，将对超限当日投资者的认购交易申请进行比例配售，以满足限额要求。

超限当日的认购申请确认不受前文所述最低认购数量的限制。

本基金的基石投资人前海金控以自有资金或其指定机构认购本基金份额 3 亿份（不包括利息折算的基金份额），自基金合同生效之日起 2 年内不得转让。同时，基金管理人以自有资金认购本基金 1000 万份（不包括利息折算的基金份额），自基金合同生效之日起 3 年内不得转让。基石投资人或其指定机构，以及基金管理人认购本基金基金份额（不含利息折算份额）不参与超限当日的比例配售。

#### 十二、募集资金的存放

基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

## 第七部分 基金合同的生效

鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金经中国证监会 2015 年 6 月 5 日证监许可[2015]1166 号文注册募集。募集期间有效认购份额 2,998,986,947.73 份，利息结转份额 604,609.99 份，合计 2,999,591,557.72 份，募集户数为 2,819 户。

本基金为发起式基金，基金管理人以自有资金认购本基金 1000 万份（不包括利息折算的基金份额）。基金管理人以发起资金认购的基金份额，自基金合同生效之日起 3 年内不得转让。

## 第八部分 基金份额的上市交易

在不违反法律法规及不损害基金份额持有人利益的前提下，本基金可以申请在深圳证券交易所上市交易，而无需召开基金份额持有人大会审议。在确定上市交易的时间后，基金管理人应依据法律法规规定在指定媒介上刊登基金份额上市交易公告书。

### 一、上市交易的时间

本基金基金份额于 2015 年 9 月 30 日开始在深圳证券交易所上市交易。

### 二、上市交易的规则

- 1、本基金上市首日的开盘参考价为前一交易日基金份额净值；
- 2、本基金实行价格涨跌幅限制，涨跌幅比例为 10%，自上市首日起实行；
- 3、本基金最小买入申报数量为 100 份；
- 4、本基金申报价格最小变动单位为 0.001 元人民币；
- 5、本基金上市交易的其他规则遵循《深圳证券交易所交易规则》及相关规定。

### 三、上市交易的费用

本基金上市交易的费用按照深圳证券交易所相关规则及有关规定执行。

### 四、上市交易的行情揭示

本基金在深圳交易所挂牌交易，交易行情通过行情发布系统揭示。行情发布系统同时揭示基金前一交易日的基金份额净值。

### 五、上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市

本基金的停复牌、暂停上市、恢复上市按照深圳证券交易所的相关规定执行。

### 六、其他事项

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

## 第九部分 基金封闭运作期内的投资

### 一、投资目标

本基金通过投资于目标公司股权参与前海金融创新，力争分享金融创新的红利。

### 二、投资范围

本基金封闭运作期内按照基金合同的约定投资于确定的、单一的目标公司股权。本基金的其他基金资产可以投资于固定收益类资产（具体包括：国债、金融债、企业（公司）债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、资产支持证券、债券

回购、银行存款等）、现金，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金同时可参与股票（含存托凭证）、权证等权益类资产的投资。

基金的投资组合比例为：本基金投资于确定的、单一的目标公司股权的比例不超过基金资产的50%，投资于固定收益类资产、权益类资产等的比例不低于基金资产的50%。

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

### 三、投资策略

基金合同生效后，本基金根据与目标公司及其股东所签订的增资协议等相关协议约定的程序和时间，通过增资方式持有目标公司股权至2023年7月24日，获取自2015年1月1日起至2023年7月24日期间前海企业公馆项目100%的实际或应当取得的除物业管理费收入之外的营业收入，营业收入依据相关协议约定的业绩补偿机制和激励机制进行调整。前述目标公司的概况、增资入股情况、退出安排、交易结构、业绩补偿机制和激励措施等详见本招募说明书。

本基金投资目标公司之外的基金资产可投资于依法发行或上市的股票（含存托凭证）、债券和货币市场工具等。

#### 1、对于目标公司的投资策略

本基金将审慎论证宏观经济因素（就业、利率、人口结构等）、商业地产周期（供需结构、租金和资产价格波动等）、以及其他可比投资资产项目的风险和预期收益率来判断目标公司持有商业物业当前的投资价值以及未来的发展空间。在此基础上，基金将深入调研目标公司所持商业物业的基本面（包括位置、质量、资产价格、出租率、租金价格、租户、租约、现金流等）和运营基本面（包括定位、经营策略、租赁能力、物业管理能力等），通过合适的估值方法评估其收益状况和增值潜力、预测现金流收入的规模和建立合适的估值模型。

本基金将根据投资需要参与所投资项目商业运营并代表持有人行使股东权利，并与目标公司服务机构签订相应的股权回购协议以及建立运营绩效保证机制，力争获取稳定的租金收益，具体交易结构详见本招募说明书第十部分和第十一部分。

#### 2、固定收益资产投资策略

本基金投资目标公司前的基金资产以及投资目标公司后的剩余资产、本基金获得的分红款、本基金对目标公司股权的退出款在按照《基金合同》约定进行分配或支付前，可全部投资于依法发行或上市的债券和货币市场工具等固定收益类资产。

本基金将采用持有到期策略构建投资组合，以获取相对确定的目标收益。首先对存款利率、回购利率和债券收益率进行比较，并在对封闭运作期内资金面进行判断的基础上，判断是否存在利差套利空间，以确定是否进行杠杆操作；其次对各类固定收益资产在封闭运作期内的持有期收益进行比较，

确定优先配置的资产类别，并结合各类固定收益资产的市场容量，确定配置比例。本基金将对整体固定收益组合久期做严格管理和匹配，完全配合基金合同期限内的允许范围。

投资决策委员会将定期或不定期召开会议，确定本基金固定收益资产各类属的配置比例、组合的杠杆水平等目标区间。本公司信用评估团队依托基金管理人信用分析系统评估债务人的相对违约率并确定个券的信用评级，为本基金的组合构建和调整提供标的建议。本基金将依据投资决策委员会决议和信用分析团队的建议制定具体的配置和调整计划，进行固定收益投资组合的构建和日常管理。

### 3、权益类资产投资策略

在严格控制风险、保持资产流动性的前提下，本基金将根据发行人的基本面情况，并结合对市场流动性、上市后表现的预期，适当参与股票等权益类投资，以增加基金收益。

本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。

## 四、投资限制

### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

- (1) 本基金投资目标公司股权的基金资产不高于基金合同生效日基金总资产的 50%；
- (2) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

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

### 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

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

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披

露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

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

#### 五、业绩比较基准

十年期国债收益率+1.5%

其中，十年期国债收益率是指中央国债登记结算有限责任公司在每个交易日公布的十年期银行间国债到期收益率。本基金投资于优质的商业物业，获取稳定的租金回报，“十年期国债收益率+1.5%”作为业绩比较基准可以较好地反映本基金的投资目标。如果相关法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，经基金管理人与基金托管人协商，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告，而无须召开基金份额持有人大会。

#### 六、风险收益特征

本基金在封闭运作期内投资于目标公司股权，以获取商业物业租金收益为目标，因此与股票型基金和债券型基金有不同的风险收益特征，本基金预期风险和收益高于债券型基金和货币型基金，低于股票型基金。

#### 七、基金的投资组合报告（未经审计）

基金管理人的董事会、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的法律责任。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年04月20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2021年01月01日起至2021年03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    | 152,538,914.08   | 2.81         |
|    | 其中：股票   | 152,538,914.08   | 2.81         |
| 2  | 基金投资    | -                | -            |
| 3  | 固定收益投资  | 4,386,777,257.40 | 80.71        |
|    | 其中：债券   | 4,386,777,257.40 | 80.71        |
|    | 资产支持证券  | -                | -            |
| 4  | 贵金属投资   | -                | -            |
| 5  | 金融衍生品投资 | -                | -            |

|   |                   |                  |        |
|---|-------------------|------------------|--------|
| 6 | 买入返售金融资产          | -                | -      |
|   | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -                | -      |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计      | 273,476,549.70   | 5.03   |
| 8 | 其他资产              | 622,328,692.25   | 11.45  |
| 9 | 合计                | 5,435,121,413.43 | 100.00 |

注：报告期末本基金投资的存托凭证公允价值为 7,040,888.40 元，占净值比 0.23%。本报告所指的“股票”均包含存托凭证。

## 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              | 111,008,813.42 | 3.57         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 24,036.12      | 0.00         |
| E  | 建筑业              | -              | -            |
| F  | 批发和零售业           | 20,493.82      | 0.00         |
| 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  | 6,062,768.77   | 0.20         |
| J  | 金融业              | 16,923,425.93  | 0.54         |
| K  | 房地产业             | 9,000,000.00   | 0.29         |
| L  | 租赁和商务服务业         | -              | -            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 9,465,984.00   | 0.30         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 33,392.02      | 0.00         |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -              | -            |
| P  | 教育               | -              | -            |
| Q  | 卫生和社会工作          | -              | -            |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | -              | -            |
| S  | 综合               | -              | -            |
|    | 合计               | 152,538,914.08 | 4.91         |

### (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  | 601318 | 中国平安 | 200,000 | 15,740,000.00 | 0.51         |

|    |        |      |         |               |      |
|----|--------|------|---------|---------------|------|
| 2  | 300760 | 迈瑞医疗 | 34,900  | 13,928,939.00 | 0.45 |
| 3  | 600031 | 三一重工 | 400,000 | 13,660,000.00 | 0.44 |
| 4  | 600690 | 海尔智家 | 400,000 | 12,472,000.00 | 0.40 |
| 5  | 000338 | 潍柴动力 | 600,000 | 11,544,000.00 | 0.37 |
| 6  | 300558 | 贝达药业 | 100,000 | 10,616,000.00 | 0.34 |
| 7  | 603018 | 华设集团 | 796,800 | 9,465,984.00  | 0.30 |
| 8  | 000651 | 格力电器 | 150,600 | 9,442,620.00  | 0.30 |
| 9  | 600276 | 恒瑞医药 | 99,900  | 9,199,791.00  | 0.30 |
| 10 | 000002 | 万科A  | 300,000 | 9,000,000.00  | 0.29 |

#### 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      | -                | -            |
| 2  | 央行票据      | -                | -            |
| 3  | 金融债券      | 259,875,600.00   | 8.37         |
|    | 其中：政策性金融债 | -                | -            |
| 4  | 企业债券      | 3,803,543,000.00 | 122.48       |
| 5  | 企业短期融资券   | -                | -            |
| 6  | 中期票据      | 289,085,000.00   | 9.31         |
| 7  | 可转债（可交换债） | 34,273,657.40    | 1.10         |
| 8  | 同业存单      | -                | -            |
| 9  | 其他        | -                | -            |
| 10 | 合计        | 4,386,777,257.40 | 141.27       |

#### 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  | 163769 | 20 铁工 Y7 | 2,000,000 | 201,060,000.00 | 6.47         |
| 2  | 149279 | 20 川能 Y1 | 1,900,000 | 190,551,000.00 | 6.14         |
| 3  | 175514 | 20 鲁金 Y1 | 1,500,000 | 152,685,000.00 | 4.92         |
| 4  | 163696 | 20 建二 Y1 | 1,500,000 | 148,230,000.00 | 4.77         |
| 5  | 163793 | 20 唐租 Y1 | 1,500,000 | 146,805,000.00 | 4.73         |

#### 6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：无。

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

注：无。

#### 8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：无。



## 9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### (1) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

### (2) 本基金投资股指期货的投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

## 10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### (1) 本期国债期货投资政策

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。

## 11、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

鞍山钢铁

#### 一、处罚事由

2020年6月1日，鞍山市生态环境局对鞍山钢铁集团有限公司炼铁总厂西区烧结进行现场检查发现，公司西区烧结B系列烧结机正常生产，但该烧结机机头烟气脱硫系统旁路挡板阀处于开启状态，旁路烟温检测设备故障，部分烟气从旁路直接排放。以上事实有《调查询问笔录》《现场检查（勘查）笔录》、照片等证据为凭。鞍山钢铁上述行为，违反《中华人民共和国大气污染防治法》第二十条第二款的规定。

#### 二、处罚机构及处罚结果

依据《中华人民共和国大气污染防治法》第九十九条第三项的规定，鞍山市生态环境局给予鞍山钢铁公司罚款人民币伍拾万元整（¥500,000.00元）的处罚。

对该证券的投资决策程序的说明：本基金管理人长期跟踪研究该公司，认为公司的上述违规行为对公司并不产生实质性影响。上述通告对该公司债券的投资价值不产生重大影响。该证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

### (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   | 548,603.93     |
| 2  | 应收证券清算款 | -              |
| 3  | 应收股利    | -              |
| 4  | 应收利息    | 79,361,407.35  |
| 5  | 应收申购款   | -              |
| 6  | 其他应收款   | -              |
| 7  | 待摊费用    | 186,675.97     |
| 8  | 其他      | 542,232,005.00 |
| 9  | 合计      | 622,328,692.25 |

注：其他为目标公司投资。

#### （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  | 128035 | 大族转债 | 24,206,769.80 | 0.78         |
| 2  | 128032 | 双环转债 | 6,084,960.00  | 0.20         |
| 3  | 113537 | 文灿转债 | 904,127.00    | 0.03         |
| 4  | 113527 | 维格转债 | 833,300.00    | 0.03         |
| 5  | 113014 | 林洋转债 | 557,278.80    | 0.02         |
| 6  | 110060 | 天路转债 | 207,237.00    | 0.01         |
| 7  | 113012 | 骆驼转债 | 16,984.80     | 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。

#### 八、基金的业绩（未经审计）

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。

本基金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（本报告中所述财务数据未经审计）：

|  | 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 |
|--|---------|------------|-------------|----------------|-----|-----|
|  |         |            |             |                |     |     |

|                                  |        |       |        |       |        |       |
|----------------------------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 2015年07月06日(基金合同生效日)至2015年12月31日 | 4.60%  | 0.18% | 2.32%  | 0.01% | 2.28%  | 0.17% |
| 2016年01月01日至2016年12月31日          | 5.27%  | 0.12% | 4.37%  | 0.01% | 0.90%  | 0.11% |
| 2017年01月01日至2017年12月31日          | 2.15%  | 0.08% | 5.08%  | 0.01% | -2.93% | 0.07% |
| 2018年01月01日至2018年12月31日          | 6.82%  | 0.10% | 5.13%  | 0.01% | 1.69%  | 0.09% |
| 2019年01月01日至2019年12月31日          | 7.67%  | 0.16% | 4.68%  | 0.01% | 2.99%  | 0.15% |
| 2020年01月01日至2020年12月31日          | 6.37%  | 0.23% | 4.45%  | 0.01% | 1.92%  | 0.22% |
| 2021年01月01日至2021年03月31日          | 2.29%  | 0.18% | 1.16%  | 0.02% | 1.13%  | 0.16% |
| 自基金合同生效日至2021年03月31日             | 40.76% | 0.15% | 27.19% | 0.01% | 13.57% | 0.14% |

## 第十部分 交易基础和产品结构

基金管理人与深圳万科、万科企业、目标公司、前海投控签订了《合作框架协议》及相关交易文件，针对本基金对目标公司的增资入股、股权回购、业绩补偿及激励机制和各方承诺等进行了全面、完善的约定和安排，力争有效保障基金投资人的利益。

本基金将于募集成立 6 个月之内通过增资入股的方式获得目标公司 50%的股权。本基金增资入股后将依据相关协议和目标公司章程的约定，通过持有目标公司股权、获得目标公司利润分配以及深圳万科或其指定的关联方回购目标公司股权方式，获取自 2015 年 1 月 1 日起至 2023 年 7 月 24 日期间目标公司就前海企业公馆项目实际或应当取得的除物业管理费收入之外的营业收入，营业收入将通过业绩补偿机制和激励机制进行收益调整。增资完成后 6 个月内，基金管理人、目标公司、深圳万科和万科企业将积极促成目标公司改制为股份有限公司。

注：根据本基金在 2015 年 8 月 15 日发布的公告，本基金已完成对目标公司的增资；截至 2016 年 2 月 1 日，目标公司已正式完成了由有限责任公司至股份有限公司的变更。

## 一、相关参与主体简介

### 1、目标公司

目标公司全名为深圳市万科前海公馆建设管理有限公司，于 2013 年 9 月成立，注册资本 1000 万元，组织形式为有限责任公司（法人独资）。目标公司是万科企业为了履行前海投控与万科企业签订的 BOT 协议而成立的运作实体。万科企业于 2013 年 10 月授权目标公司代表万科企业履行 BOT 协议，并以目标公司自己的名义签订前海企业公馆项目的所有业务合同、协议书，执行相关经济事项，并同意将 BOT 协议中约定的前海企业公馆项目自 2013 年 9 月 8 日至 2021 年 9 月 7 日期间的收益权转让给目标公司。

### 2、深圳万科

深圳万科正式成立于 1994 年，其前身为 1988 年成立的房地产经营管理本部。深圳万科是万科企业房地产业务的发源地，是万科企业的全资子公司和核心利润企业，并一直在集团内保持着领先地位。自 2011 年以来，深圳万科项目布局从东部滨海盐田、到罗湖福田主城区、从龙岗中心城、龙坂城市中轴、到西部南山、宝安城区，贯越深圳东西，实现了区域全覆盖、产品线全覆盖、客户生命周期全覆盖。为持续领先，深圳万科正全力实践新的盈利模式和管理方法，培养商业开发、酒店管理方面的新能力，探索度假、服务型公寓和城市综合体等新品类，开创服务新品牌。龙岗、盐田、南山三大中心城市综合体的开发，浪骑、大甲岛、双月湾等包含度假酒店、特色会所等内容在内的配套物业经营项目的启动，将最大化地实现住宅价值。

在增资完成日之前，深圳万科直接持有目标公司 100%的股权。

### 3、万科企业

万科企业成立于 1984 年，1988 年进入房地产行业，1991 年成为深圳证券交易所第二家上市公司。经过 30 年的发展，已成为国内最大的住宅开发企业，目前业务覆盖珠三角、长三角、环渤海三大城市经济圈以及中西部地区，共计 63 个大中城市。近三年来，年均住宅销售规模在 6 万套以上，2014 年公司实现销售面积 1806.4 万平方米，销售金额 2151.3 亿元。

万科企业为目标公司的实际控制人。

#### 4、前海投控

前海投控成立于 2011 年 12 月 28 日，注册资本金 1.5 亿元。前海投控是前海管理局 100%控股的全资子公司，是前海管理局旗下唯一得到法定授权的开发建设及投资主体，战略定位为集建设、投资、融资、资产运营功能于一体的“产业发展商”。根据深圳市人民政府颁布的《深圳市前海深港现代服务业合作区管理局暂行办法》及相关规定，前海投控采取企业化运作，负责前海合作区内土地一级开发、基础设施建设和重大项目投资等。前海投控已将前海企业公馆项目 2021 年 9 月 8 日至 2023 年 7 月 24 日期间的运营权及收益权确定性转让给目标公司。

##### 二、目标公司收益权的来源与合法性

依据前海投控与前海管理局签署的《深圳市前海深港现代服务业合作区土地租赁合同书》及《深圳市前海深港现代服务业合作区土地租赁补充合同书》，前海管理局将前海合作区荔湾片区第十一开发单元的用地（宗地号：T102-0243、土地面积 93192.96 平方米）租赁给前海投控使用，用于前海企业公馆项目的开发和建设，租赁期限自 2013 年 7 月 25 日起至 2023 年 7 月 24 日止。

前海投控与万科企业签署的 BOT 协议，约定合作期限为 2013 年 9 月 8 日起至 2021 年 9 月 7 日止。万科企业于 2013 年 10 月授权目标公司代表万科企业履行 BOT 协议，并以目标公司自己的名义签订前海企业公馆项目的所有业务合同、协议书，执行相关经济事项。万科企业进一步同意将前海企业公馆项目的收益权转让给目标公司。

前海投控另已同意将前海企业公馆项目 2021 年 9 月 8 日至 2023 年 7 月 24 日期间的运营权及收益权确定性转让给目标公司。

根据上述协议，目标公司合法地享有自 2015 年 1 月 1 日起至 2023 年 7 月 24 日止项目 100%的收益权。

##### 三、增资入股和转让退出的方式

在《合作框架协议》的安排下，基金管理人将根据与万科企业、目标公司签订的《增资协议》约定的程序和时间，通过增资入股的方式获得目标公司 50%的股权。

基金管理人、目标公司、深圳万科共同指定房地产评估机构深圳市戴德梁行土地房地产评估有限公司（以下简称“戴德梁行”）对前海企业公馆项目自 2015 年 1 月 1 日至 2023 年 7 月 24 日每年预计营业收入（不含物业管理费收入）产生的预计现金流及其现值进行测算评估（深圳万科所提供的作为本章第四节业绩补偿机制和激励机制的目标公司业绩比较基准应不低于戴德梁行对预计现金流的评估结果），预测营业收入如下表 10-1 所示。基金管理人参考戴德梁行的测算评估结果并结合利率水平等市场和政策情况确定了获得目标公司 50%的股权的 126,682 万元的增资价格。增资入股具体的程序和时间以基金管理人出具的公告为准。

表 10-1 目标公司预测营业收入（不含物业管理费收入）（单位：万元）

| 年度   | 预测营业收入<br>(不含物业管理费收入) |
|------|-----------------------|
| 2015 | 12,633                |
| 2016 | 17,575                |
| 2017 | 19,314                |
| 2018 | 20,980                |
| 2019 | 22,536                |
| 2020 | 23,407                |
| 2021 | 24,987                |
| 2022 | 25,437                |
| 2023 | 15,183                |

数据来源：深圳市戴德梁行土地房地产评估有限公司出具的评估报告

注：深圳万科以上述目标公司预测营业收入（不含物业管理费收入）作为目标公司各核算期的业绩比较基准，其中 2023 年分 2023 年 1-6 月以及 7 月 1 日至 7 月 24 日两个核算期，业绩比较基准分别为 13,014 万元和 2,169 万元。

按上述方式确定的增资款中，1,000 万元作为目标公司注册资本，其余作为目标公司资本公积金。本次增资完成后，目标公司注册资本为 2,000 万元，本基金持有目标公司的股权比例为 50%。

增资完成日起 6 个月内，基金管理人将积极促成目标公司改制为股份有限公司。若目标公司在增资完成日起 6 个月内未按照约定变更为股份有限公司，基金合同将自动终止，深圳万科应自行或指定关联方以本基金已向目标公司缴纳的全部增资款（含实缴出资和增资溢价款）以及增资完成日至股权转让价款全额支付日期期间的活期存款利息作为股权转让价款受让本基金所持目标公司全部股权，本基金已获得的项目收益不退还。若因目标公司、深圳万科和/或万科企业恶意拖延、重大疏忽或其他过错，导致增资完成日后 6 个月内目标公司未改制为股份有限公司的，深圳万科应以本基金向目标公司缴纳的全部增资款为基数自增资完成日起按每日 0.05%追加股权回购价款并向本基金支付直至本基金所有股权转让价款及违约金（如有）、赔偿金（如有）均获得清偿。

本基金对目标公司股权的投资将在《合作框架协议》的安排下，根据基金管理人与深圳万科、目标公司签订的《股权回购协议》，通过向深圳万科及其指定的关联方溢价转让股权的方式实现逐步退出。

本基金应分别在 2015 年 12 月 31 日前、2018 年 12 月 31 日前、2021 年 12 月 31 日前和 2023 年 10 月 31 日前向深圳万科或深圳万科指定的关联方转让 14%、18%、17.5%和 0.5%的目标公司股权，直至本基金全部股权退出。具体的股权受让方和转让对价以基金管理人出具的公告为准。

如果深圳万科或目标公司发生重大违约行为，（被）申请停业整顿、申请解散、被撤销、（被）申请破产、控股股东（实际控制人）变更或重大资产转移、停产、歇业、被注销登记、被吊销营业执照、涉及重大法律纠纷、生产经营出现严重困难或财务状况恶化、法定代表人无法正常履行职责且无人员接替，或丧失保证能力的其他情形，或者深圳万科、万科企业或目标公司发生任何涉及金额超过万科企业最近一期公告的合并资产负债表所列其有息总负债 5%的境内或境外的债权或股权类融资安排项下的违约、发生重大纠纷或财务状况严重恶化等对本基金权益实现产生严重影响或威胁的事项，提供虚假的或者隐瞒重要事实的财务报表、有关目标公司的信息或其他相关资料等情形且严重影响本基金权益实现安全的，或者非因基金管理人原因导致项目土地、建筑全部或部分被政府收回、拆除、毁损或灭失的（无论是否因不可抗力导致），基金管理人有权向深圳万科提前回购本基金所持股权。

2015 年 12 月，基金管理人与深圳万科、目标公司签订补充协议。各方同意延迟第一次股权交割，各方同意第一次最晚回购交割日延后至 2017 年 3 月 31 日，后三次最晚回购交割日保持不变。各方同意将回购义务方确定为项目公司本身，同时由深圳万科承诺督促项目公司及时履行支付回购价款、完成回购手续的义务。

#### 四、目标公司收益权的实现和保障机制

对目标公司的增资入股完成之后，本基金将主要通过目标公司逐月以对项目的营业收入（不含物业管理费收入）代深圳万科支付部分股权回购价款以及目标公司利润分配的方式实现项目收益。为保障基金持有人的利益，在《合作框架协议》的安排下，本基金对目标公司的投资将设业绩补偿机制和激励激励，具体如下：

##### 1、业绩补偿机制

深圳万科将开立保证金账户，一次性存入不低于 2000 万元的保证金并确保每年维持不低于 2000 万元的保证金。若目标公司当期营业收入扣减物业管理费收入后的余额（以下简称“实际业绩收入”）低于深圳万科提供并经基金管理人确认的目标公司当期业绩比较基准（目标公司各核算期的业绩比较基准见本章表 10-1）的，深圳万科应以保证金账户资金余额为限按目标公司当期实际业绩收入低于业绩比较基准的差额（以下简称“业绩补偿款”）向本基金进行支付。

##### 2、激励机制

若目标公司当期实际业绩收入高于目标公司业绩比较基准，对于目标公司当期实际业绩收入超过目标公司业绩比较基准的差额占目标公司业绩比较基准在 5%以内（含本数）的部分，本基金按 20%向保证金账户支付深圳万科收益分成，对于差额占目标公司业绩比较基准在 5%（不含本数）至 10%（含本数）的部分，本基金按 30%向保证金账户支付深圳万科收益分成，对于差额超过目标公司业绩比较

基准 10%（不含本数）的部分，本基金按 50%向保证金账户支付深圳万科收益分成。上述收益分成价款计入保证金账户。

业绩补偿机制和激励机制条款的执行情况以基金管理人出具的公告为准。

五、为了确保基金份额持有人利益的实现或者为了避免或最大限度减少投资损失，基金管理人在遵守基金份额持有人利益最大化原则的前提下，有权根据交易的实际情况和市场情况，代表本基金与交易相关方进行沟通、协商，对上述交易基础所涉及的相关合同、协议进行必要和适当的补充、修改，并将及时公告。

## 第十一部分 项目价值和投后管理

### 一、项目简介

#### 1、项目性质

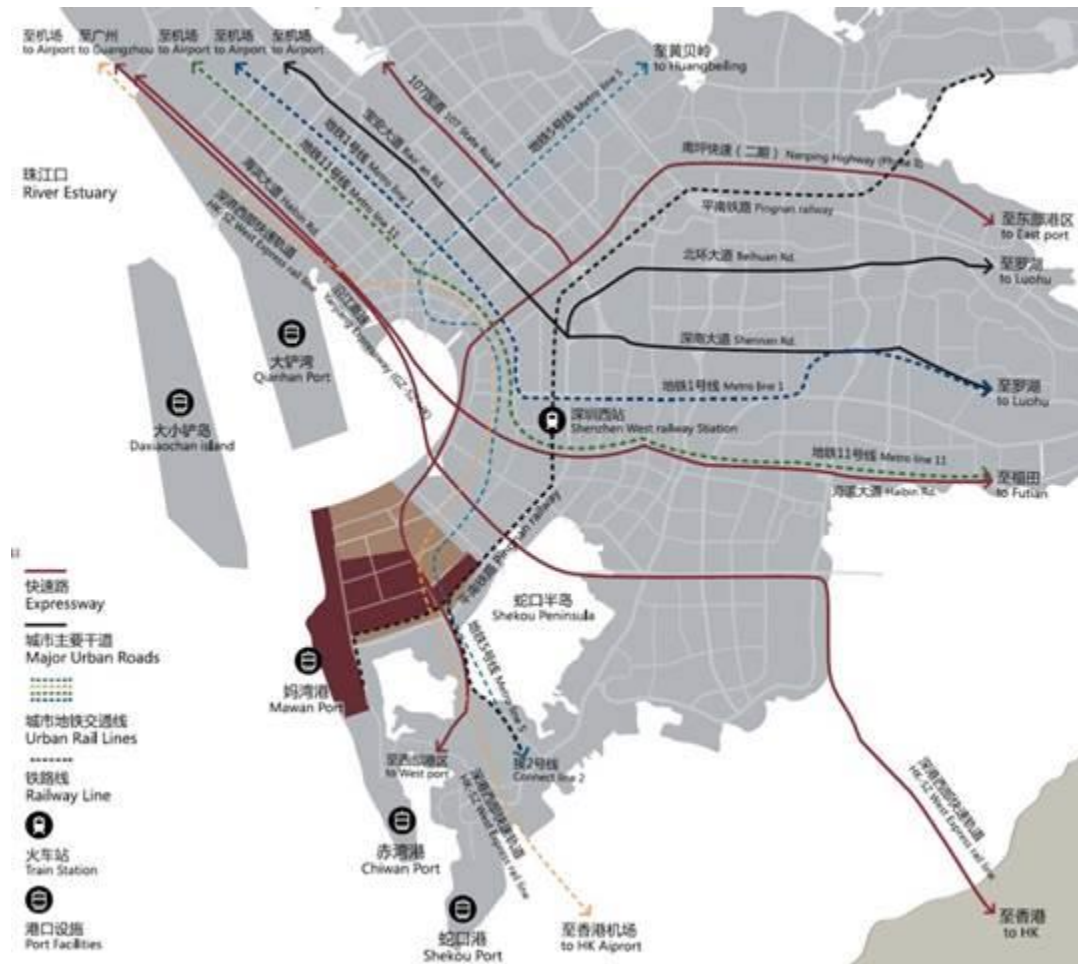
前海企业公馆项目系商业用写字楼。

#### 2、区位规划

前海企业公馆项目坐落于深圳市前海合作区荔湾片区第十一开发单元的用地（宗地号：T102-0243，总占地面积约为 93,192.96 平方米（如下图 11-1 所示），包含约 33 栋企业办公物业、1 个大型公共建筑，约 6 个小型公共建筑，拟总建筑面积约为 65,200 平方米，总投资人民币约 77,329 万元。上述各项规划、指标和总投资最终以前海管理局审定的建筑标准、设计方案和投资方案为准。

图 11-1 万科前海企业公馆项目区位规划





### 3、项目布局

前海企业公馆项目分为特区馆区和企业公馆区。特区馆区包含一座约为 12,000 平方米的特区馆，企业公馆区包含 36 栋建筑面积约 200 至 1,600 平米不等的企业公馆、一座约 3,300 平米的商务中心、约 3,000 平米的商业配套以及约 6,000 平米的半地下停车场。

项目园区设计新颖、大方。整个园区以纵横两条绿轴构成几何主轴，叠加三条南北贯穿的斜线，构建出小镇丰富而别致、自由而灵动的城市肌理。顺应总体规划中强调公共利益最大化的原则，在整体适宜步行的街区尺度里，合理地安排公共建筑、公共广场、园林景观和休闲运动设施，以达到便捷、舒适和富有趣味的空间体验。（如下图 11-2 所示）

图 11-2 万科前海企业公馆项目图



#### 4、租约及现金流情况

本基金持有的项目公司物业万科前海企业公馆在 2015 年完成总收入 12,640 万元。其中公馆租赁收入占总收入的 83%，会展中心、易想空间及其他收入合计占 17%。由于东区办公楼的竣工日为 2015 年 6 月 30 日，随着东区办公楼若干租户的免租期将在 9 月底和 12 月底结束，2016 年项目公司的总收入还将有明显增加。

#### 二、目标公司简要财务数据

北京兴华会计师事务所审计了目标公司按照中国企业会计准则编制的 2015 年度的财务报告，并出具了标准无保留意见的审计报告。

目标公司主要财务数据如下：

表 11-2 目标公司财务数据摘要（单位：元）

| 项目            | 2015. 12. 31          | 2014. 12. 31        |
|---------------|-----------------------|---------------------|
| <b>资产负债表</b>  |                       |                     |
| 货币资金          | 37,291,466.96         | 2,434,110.87        |
| 应收账款          | 8,084,757.48          | 1,235,567.83        |
| 预付款项          | 1,243,600.75          | -                   |
| 其他应收款         | 618,311,613.14        | 42,000.00           |
| 存货            | 47,303.05             | -                   |
| <b>流动资产合计</b> | <b>664,978,741.38</b> | <b>3,711,678.70</b> |
| 长期应收款         | 248,860,000.00        | -                   |
| 固定资产          | 125,607.47            | 107,775.91          |
| 无形资产          | 676,424,427.40        | 585,004,179.74      |

|                   |                  |                |
|-------------------|------------------|----------------|
| 递延所得税资产           | -                | 208,850.91     |
| <b>非流动资产合计</b>    | 925,410,034.87   | 585,320,806.56 |
| <b>资产总计</b>       | 1,590,388,776.25 | 589,032,485.26 |
| 短期借款              | 1,040,336.00     | -              |
| 应付账款              | 252,358,112.12   | 156,241,000.27 |
| 预收款项              | 471,560.19       | 484,152.77     |
| 应付职工薪酬            | 68,467.20        | -              |
| 应交税费              | 5,118,003.35     | -3,527.38      |
| 其他应付款             | 49,815,626.04    | 422,929,015.41 |
| <b>流动负债合计</b>     | 308,872,104.90   | 579,650,641.07 |
| <b>负债合计</b>       | 308,872,104.90   | 579,650,641.07 |
| 实收资本              | 20,000,000.00    | 10,000,000.00  |
| 资本公积              | 1,256,820,000.00 | -              |
| 未分配利润             | 4,696,671.35     | -618,155.81    |
| <b>所有者权益合计</b>    | 1,281,516,671.35 | 9,381,844.19   |
| <b>负债和所有者权益总计</b> | 1,590,388,776.25 | 589,032,485.26 |

#### 利润表

| 项目            | 2015 年度        | 2014 年度       |
|---------------|----------------|---------------|
| <b>一、营业收入</b> | 146,904,789.00 | 1,523,717.22  |
| 减：营业成本        | 128,644,141.11 | 648,883.36    |
| 营业税金及附加       | 7,839,172.39   | 85,328.16     |
| 销售费用          | 2,464,540.45   | 2,050,629.56  |
| 管理费用          | 1,522,616.92   | 943,021.86    |
| 财务费用          | -40,178.54     | -938,742.09   |
| 资产减值损失        | 15,684.88      |               |
| <b>二、营业利润</b> | 6,458,811.79   | -1,265,403.64 |

|               |              |             |
|---------------|--------------|-------------|
| 加：营业外收入       | 632,852.72   | 430,000.00  |
| <b>三、利润总额</b> | 7,091,664.51 | -835,403.64 |
| 减：所得税费用       | 1,776,837.35 | -208,850.91 |
| <b>四、净利润</b>  | 5,314,827.16 | -626,552.72 |

此外，根据本基金披露的定期报告，本基金持有的项目公司物业万科前海企业公馆获得的实际收入情况如下表：

| 报告期       | 收入（万元） |
|-----------|--------|
| 2015年1-7月 | 5,729  |
| 2015年8-9月 | 1,883  |
| 2015年4季度  | 5,028  |
| 2016年1季度  | 3,840  |
| 2016年2季度  | 4,305  |
| 2016年3季度  | 4,034  |
| 2016年4季度  | 4,247  |

### 三、投后管理

#### 1、目标公司的职责

本基金运作期内，目标公司负责运营前海企业公馆项目，其职责包括但不限于：对项目进行管理，并承担所有费用（包括税费）和风险、责任，管理、运营和维护项目各项设施；及时、准确地掌握所有建筑物的状况及相关信息，定期、有计划、有针对性的安排对项目土建和设施进行维护及修复；树立高度的质量意识和安全意识，防止由于管理不到位引起质量和安全方面的责任事故。

#### 2、基金管理人及投资顾问的职责

本基金运作期内，基金管理人及所聘请的基金投资顾问将勤勉尽责地履行对目标公司及项目运营的投后管理职责，维护基金份额持有人的权利和利益。投后管理职责包括：

通过目标公司股东会审议批准目标公司章程的修改，公司终止、解散、清算，注册资本及股权结构的调整，现有股东出售、转让、质押或以其他方式处分其持有的目标公司股权或其相关权益，目标公司的分立及与其他经济组织的合并，公司融资安排、资产抵押、对外担保，公司设立子公司、合资企业或其他任何形式的对外投资，公司进行单笔超过人民币 20,000,000 元的重大资产处置，或累计超过人民币 20,000,000 元的一系列重大资产处置等重大事项并享有一票否决权。

定期收集前海企业公馆项目信息及资料，了解目标公司的年度经营计划，对前海企业公馆项目进行巡查，了解目标公司的经营信息。

每季度结束后 5 个工作日内，获取目标公司该季度的财务报表（含资产负债表、利润表、现金流量表及科目余额表，下同）；每日历年度结束后 30 日内，获取目标公司未经审计的年度财务报告；每日历年度结束后 60 日内，获取目标公司经审计的年度财务报告（含资产负债表、利润表、现金流量表、财务报表附注等）。

要求目标公司在合理期限内按照其要求提供其它统计数据、其它业务和财务信息（包括但不限于财务系统内的信息），以便基金管理人适当获知目标公司信息及保护本基金权益。

在目标公司或深圳万科发生任何重大的境内或境外的债权或股权类融资安排项下的违约事件且将对本基金的权益实现产生重大影响时，对目标公司或深圳万科进行核查并要求目标公司或深圳万科向基金管理人提供详细书面说明。

如目标公司更改任何银行账户的预留印鉴或在任何机构新开立任何账户，应在该等事项发生后 10 日内书面通知基金管理人。

### 3、租金现金流的监管与保障

目标公司将确定项目营业收入（不含物业管理费收入）的唯一收款账户（以下简称“收入账户”）并将该收入账户设置为监管账户，在开户银行预留基金管理人印鉴，资金使用应受基金管理人监管，以保障基金持有人的权益。

基金管理人应在每个月前 5 个工作日内将收入账户的截至上月末的现金余额全部划付到基金托管户，基金托管户的账户信息由基金管理人另行向目标公司书面提供。（其中，增资完成后 5 个工作日内目标公司应将 2015 年 1 月 1 日至增资完成日前一月月末的全部营业收入（不含物业管理费收入）对应金额的款项划付到基金托管户。

## 第十二部分 基金的财产

### 一、基金资产总值

基金资产总值是指目标公司股权、各类有价证券、银行存款本息和基金应收款项以及其他资产的价值总和。

### 二、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### 三、基金财产的账户

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

### 四、基金财产的保管和处分

基金管理人应依法为本基金持有的目标公司股权在相关登记机构登记，以基金管理人名义持有。基金管理人应为基金利益，勤勉尽责地持有目标公司股权，并按照基金合同的约定处分目标公司股权。基金管理人应在遵守法律法规规定的前提下，安全持有目标公司股权，不得在以其名义持有的目标公司股权上设置质押或任何其他权利限制或负担。如以基金管理人名义持有的目标公司股权因基金管理人自身债务或基金管理人管理的其他财产的债务而被有权机关冻结、扣押、执行，或存在被冻结、扣押、执行风险的，基金管理人应采取一切合理措施向有权机关说明以基金管理人名义持有的目标公司股权作为基金财产的性质，并尽力避免该目标公司股权被冻结、扣押、执行。

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

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

## 第十三部分 基金资产的估值

### 一、估值日

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

### 二、估值对象

本基金所拥有的目标公司股权、股票、固定收益类资产、应收款项、其它投资等资产及负债。

### 三、估值方法

#### 1、商业物业收益的估值

通过持有目标公司股权获取商业物业收益的，基金管理人将其列为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，根据相关合同的约定和当前市场状况等因素，采用包括未来现金流折现法在内的适用的估值技术对其进行估值。包括未来现金流折现法在内的适用的估值技术在某些极端情况下难以确定公允价值的，基金管理人与基金托管人可以商定采用包括成本价在内的最能反映此类投资公允价值的估值技术进行估值。

基金管理人每年聘请符合条件的房地产评估机构对基金持有目标公司股权获取的商业物业收益进行全面评估。

#### 2、证券交易所上市的权益类证券的估值

交易所上市的权益类证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化以及证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

3、处于未上市期间的权益类证券应区分如下情况处理：

（1）送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

（2）首次公开发行未上市的股票和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

（3）首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

4、交易所市场交易的固定收益品种的估值

（1）对在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（另有规定的除外），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；

（2）对在交易所市场上市交易的可转换债券，按估值日收盘价减去可转换债券收盘价中所含债券应收利息后得到的净价进行估值；

（3）对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

5、银行间市场交易的固定收益品种，选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值。对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，按成本估值。

6、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。

7、本基金封闭运作期届满，转为上市开放式基金（LOF）后，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。

8、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

9、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。基金管理人保证本《基金合同》列明的对目标公司股权估值方法本身的科学性或绝对的合理性，投资人认购、购买本基金基金份额的行为即表明其对本基金估值方法的认可和同意。

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

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

#### 四、估值程序

1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到0.001元，小数点后第4位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或《基金合同》的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人按照《基金合同》约定的要求对外公布。

#### 五、估值错误的处理

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

本《基金合同》的当事人应按照以下约定处理：

##### 1、估值错误类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或登记机构、或销售机构、或投资人自身的过错造成估值错误，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该估值错误遭受损失当事人（“受损方”）的直接损失按下述“估值错误处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

上述估值错误的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等。

##### 2、估值错误处理原则

（1）估值错误已发生，但尚未给当事人造成损失时，估值错误责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正估值错误发生的费用由估值错误责任方承担；由于估值错误责任方未及时更正已产生的估值错误，给当事人造成损失的，由估值错误责任方对直接损失承担赔偿责任；若估值错误责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。估值错误责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保估值错误已得到更正。

（2）估值错误的责任方对有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对估值错误的有关直接当事人负责，不对第三方负责。

（3）因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但估值错误责任方仍应对估值错误负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失（“受损方”），则估值错误责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当



得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给估值错误责任方。

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

(5) 估值错误责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人过错造成基金资产损失时，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资产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。除基金管理人和托管人之外的第三方造成基金资产的损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错方追偿。

(6) 如果出现估值错误的当事人未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律、行政法规、《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估值错误。

### 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

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

### 4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

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

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

(3) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

### 六、暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

3、本基金封闭运作期届满，转为上市开放式基金（LOF）后，当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上的，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停估值；

4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

### 七、基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值和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开放日交易结束后计算当日的基金资产净值和基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值予以公布。

#### 八、特殊情形的处理

1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 8 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、由于证券交易所、登记结算公司发送的数据错误，有关会计制度变化或由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误而造成的基金资产净值计算错误，基金管理人、基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

#### 九、实施侧袋机制期间的基金资产估值

本基金实施侧袋机制的，应根据本部分的约定对主袋账户资产进行估值并披露主袋账户的基金净值信息，暂停披露侧袋账户份额净值。

## 第十四部分 基金的收益分配

### 一、基金利润的构成

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

### 二、基金可供分配利润

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

### 三、基金收益分配原则

- 1、本基金收益分配采取现金分红方式；
- 2、在满足分红条件的前提下，本基金收益每年至少分配一次；
- 3、每年基金收益分配比例不低于基金年度可供分配利润的 90%。基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日；
- 4、本基金每份基金份额享有同等分配权；
- 5、若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配；
- 6、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值，基金收益分配基准日即期末可供分配利润计算截止日；

7、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 四、收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

#### 五、收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核后确定。基金管理人依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

#### 六、基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。

#### 七、实施侧袋机制期间的收益分配

本基金实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配。

## 第十五部分 基金的费用与税收

### 一、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金的投资顾问费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼仲裁费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、因基金的证券交易或结算而产生的费用（包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金及其他类似性质的费用等）；
- 8、基金资产的资金汇划费用；
- 9、基金的开户费用、账户维护费用；
- 10、基金的上市初费和月费；
- 11、基金的资产评估费；
- 12、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

### 二、封闭运作期内基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.65% 的年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.65\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，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 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

## 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每月月末，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 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

## 3、基金投资顾问的投资顾问费

本基金的投资顾问费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。投资顾问费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金投资顾问费

E 为前一日的基金资产净值

基金投资顾问费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类中第 4—12 项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

## 三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

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

## 四、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

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

## 第十六部分 基金的会计与审计

### 一、基金会计政策

1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；

2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日；基金首次募集的会计年度按如下原则：

如果《基金合同》生效少于2个月，可以并入下一个会计年度；

3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；

4、会计制度执行国家有关会计制度；

5、本基金独立建账、独立核算；

6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；

7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

### 二、基金的年度审计

1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券、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的年度财务报表进行审计。

2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意。

3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需在2日内在指定媒介公告。

## 第十七部分 基金的信息披露

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

### 二、信息披露义务人

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人及其日常机构（如有）等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和非法人组织。

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。

三、本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

- 1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
- 2、对证券投资业绩进行预测；
- 3、违规承诺收益或者承担损失；
- 4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构；
- 5、登载任何自然人、法人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。

四、本基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证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。

## 五、公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

（一）基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议、基金产品资料概要

1、《基金合同》是界定《基金合同》当事人的各项权利、义务关系，明确基金份额持有人大会召开的规则及具体程序，说明基金产品的特性等涉及基金投资者重大利益的事项的法律文件。

2、基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金认购、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。除此之外，还应披露目标公司的相关信息，包括但不限于：目标公司基本情况及财务状况；投资协议主要内容；目标公司可能面临的特定风险等。《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。

3、基金托管协议是界定基金托管人和基金管理人在基金财产保管及基金运作监督等活动中的权利、义务关系的法律文件。

4、基金产品资料概要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。

基金募集申请经中国证监会注册后，基金管理人在基金份额发售的 3 日前，将基金招募说明书、《基金合同》摘要登载在指定媒介上；基金管理人、基金托管人应当将《基金合同》、基金托管协议登载在网站上。

#### （二）基金份额发售公告

基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于指定媒介上。

#### （三）《基金合同》生效公告

基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日在指定媒介上登载《基金合同》生效公告。

#### （四）基金净值信息

《基金合同》生效后，封闭运作期内，在本基金上市交易前，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。封闭运作期内，在本基金上市交易后，基金管理人应当在不晚于每个工作日的次日，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。

本基金封闭运作期届满，转为上市开放式基金（LOF）后，在开放期内，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。

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。

#### （五）目标公司相关信息公告

本基金应在募集之前、募集结束后以及持续运作期内详细披露与基金持有人利益密切相关的目标公司具体情况，如增资入股情况（包括增资入股的程序、时间和增资价款等）、物业出租情况、租金归集情况、目标公司财务状况、投资风险、股权退出安排等。并在定期报告中披露目标公司最近一期内运作的相关重大事项。此外还应披露第三方房地产评估机构对目标公司每年预计经营收益产生的现金流的测算评估结果。

#### （六）基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告

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。

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。

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。

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

本基金封闭运作期届满，转为上市开放式基金（LOF）后，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。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。

#### （七）基金份额上市交易公告书

基金份额获准在证券交易所上市交易的，基金管理人应当在基金份额上市交易 3 个工作日前，将基金份额上市交易公告书登载在指定媒介上。

#### （八）临时报告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，并登载在指定报刊和指定网站上。

前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件：

- 1、基金份额持有人大会的召开及决定的事项；
- 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百分之零点五；

17、基金改聘资产评估机构、房地产评估机构；

18、本基金终止上市交易；

19、估值调整公告；

20、目标公司服务机构发生变更；

21、目标公司运营或现金流偿付能力发生重大变化等可能对基金份额持有人利益产生重大影响的事项；

22、目标公司服务机构出现违法、违规或违约行为，可能对基金份额持有人造成重大影响的事项；

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。

#### （九）澄清公告

在《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、基金上市交易的证券交易所。

#### （十）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。

#### （十一）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。

#### （十二）实施侧袋机制期间的信息披露

本基金实施侧袋机制的，相关信息披露义务人应当根据法律法规、基金合同和招募说明书的规定进行信息披露，详见招募说明书“侧袋机制”部分的规定。

#### （十三）中国证监会规定的其他信息。

### 六、信息披露事务管理

基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度，指定专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和基金上市交易的证券交易所网站披露信息，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目的，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。

## 七、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各自住所和基金上市交易的证券交易所，以供社会公众查阅、复制。

## 八、暂停或延迟信息披露的情形

- 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、因不可抗力或其他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、法律法规规定、中国证监会或基金合同认定的其他情形。

九、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。

## 第十八部分 风险揭示

除以下提示到的风险外，本基金管理人提醒投资者及时关注本基金的公告信息，了解目标公司的增资入股情况、运营情况或者其他信息。

### 一、本基金特定风险

按照基金合同的约定，本基金在封闭运作期内投资于确定的、单一的目标公司股权，获取期间的商业物业收益。封闭运作期内集中持有目标公司股权，因此存在有别于股票型基金和债券型基金的特定风险。主要的特定风险包括但不限于如下几点：

#### 1、封闭运作期内集中投资风险

普通公募基金往往采用分散化投资的方式减少非系统性风险对基金投资的影响，而本基金在封闭运作期内集中持有目标公司股权，获取期间的商业物业收益。因此，相对分散化投资的普通公募基金，本基金将受到所投资目标公司个体较大的影响，具有较高的非系统性风险。

#### 2、目标公司经营风险

目标公司以项目的商业物业收入为主营业务收入来源，而国家宏观调控、房地产行业周期的影响以及前海合作区周边其他商业物业带来的市场竞争，都会给目标公司经营带来不确定性，这种不确定性可能影响未来的项目收益，造成投资人投资不达预期的风险。

#### 3、租金无法回收的风险

本基金通过持有目标公司股权获取商业物业收益，以租户的租金为主。基金管理人将采用主动催收、投资顾问协助催收、目标公司服务机构保证金补偿等一系列手段力争取得租金偿付。然而受限于租户的违约风险，租金收益存在不确定性。极端情况下租金可能将无法弥补投资本金，进而可能导致本基金投资亏损。

#### 4、续租风险

截至 2015 年 3 月，前海企业公馆项目租户已签订的租约以三年期、五年期、约七年期为主，因此存在续租时租户退租导致项目收益波动的风险。

#### 5、商业物业收益的估值风险

本基金通过持有目标公司股权获取商业物业收益。基金管理人采用估值技术对目标公司股权进行估值，估值结果将通过本基金的基金份额净值体现。由于估值技术存在诸多假设且估值需要使用的参数在获取时存在滞后性，本基金公告的基金份额净值可能不能及时、准确地体现目标公司股权当前的公允价值。

#### 6、目标公司破产风险

极端情况下，若目标公司经营不善出现资不抵债的情况将有可能破产清算，造成目标公司破产的风险。

## 7、提前终止风险

自增资完成日起 6 个月内，目标公司未按照约定变更为股份有限公司，或者发生招募说明书第十部分约定的基金管理人要求深圳万科提前回购基金所持股权的情形时，深圳万科将自行或指定关联方提前回购本基金所持股权，本基金基金合同将提前终止，基金份额持有人将无法实现正常到期情况下的全部预期收益。

## 8、增信不足风险

本基金通过深圳万科提供保证金的方式为本基金的项目投资收益提供增信，但对于实际业绩收入低于目标公司业绩比较基准的差额，深圳万科仅以保证金账户资金余额为限提供补偿，超出部分将无法通过保证金得到补偿。

## 9、净值回撤风险

当目标公司当期实际业绩收入高于目标公司当期业绩比较基准时，本基金将以已收到的投资收益就差额部分按一定比例向保证金账户支付深圳万科收益分成，因此可能在实施深圳万科收益分成时本基金净值出现一定幅度的下跌。

## 10、政策风险

政策风险包括但不限于前海开发政策风险和房地产政策风险。

前海开发政策是指深圳市政府和前海管理局针对前海开发制定颁布的重要的影响目标公司经营的举措、法规。房地产政策是指政府有关房地产市场的政策发生重大变化或是有重要的举措、法规。这些政策的出台可能引起目标公司未来租金收益的波动，从而给投资带来风险。

## 11、作为上市基金存在的风险

### （1）暂停上市或终止上市的风险

在《基金合同》生效且本基金符合上市交易条件后，本基金将在深圳证券交易所挂牌上市交易。由于上市期间可能因信息披露导致基金停牌，投资者在停牌期间不能买卖基金,产生风险；同时，可能因上市后交易对手不足导致基金流动性风险。

### （2）基金份额折溢价的风险

本基金份额在深圳证券交易所的交易价格可能不同于基金份额净值，从而产生折价或者溢价的情况，从而有可能直接或间接地对投资者造成损失。

## 12、第三方服务机构的风险

本基金的多项服务委托第三方机构办理，存在以下风险：

（1）其他销售机构因多种原因，导致认购业务受到限制、暂停或终止，由此影响投资者认购服务的风险。

（2）登记结算机构可能调整结算制度，如对投资者基金份额及资金的结算方式发生变化，制度调整可能给投资者带来理解偏差的风险。同样的风险还可能来自于证券交易所及其他代理机构。

(3) 证券交易所、登记结算机构、基金托管人及其他代理机构可能违约，导致基金或投资者利益受损的风险。

13、本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与中国存托凭证发行机制相关的风险，包括存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险；存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；因多地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；存托凭证退市的风险；已在境外上市的基础证券发行人，在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险；境内外法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。

#### 14、封闭运作期届满后转为上市开放式基金（LOF）后实施侧袋机制的相关风险

侧袋机制是一种流动性风险管理工具，是将特定资产分离至专门的侧袋账户进行处置清算，并以处置变现后的款项向基金份额持有人进行支付，目的在于有效隔离并化解风险。但基金启用侧袋机制后，侧袋账户份额将停止披露基金份额净值，并不得办理申购、赎回和转换，仅主袋账户份额正常开放赎回，因此启用侧袋机制时的基金份额持有人将在启用侧袋机制后同时拥有主袋账户份额和侧袋账户份额，侧袋账户份额不能赎回，其对应特定资产的变现时间具有不确定性，最终变现价格也具有不确定性并且有可能大幅低于启用侧袋机制时的特定资产的估值，基金份额持有人可能因此面临损失。

实施侧袋机制期间，基金管理人计算各项投资运作指标和基金业绩指标时以主袋账户资产为基准，不反映侧袋账户特定资产的真实价值及变化情况。本基金不披露侧袋账户份额净值，即便基金管理人在基金定期报告中披露报告期末特定资产可变现净值或净值参考区间的，也不作为特定资产最终变现价格的承诺，对于特定资产的公允价值和最终变现价格，基金管理人不承担任何保证和承诺的责任。

基金管理人将根据主袋账户运作情况合理确定申购政策，因此实施侧袋机制后主袋账户份额存在暂停申购的可能。

#### 15、其他风险

因地震、台风、水灾、火灾、战争、政策、法律变更及其他不能预见或其后果不能防止或不可避免的不可抗力事件，可能影响目标公司经营情况和项目租户的履约情况，造成投资人投资不达预期的风险。

#### 二、信用风险

指基金在交易过程发生交收违约，或交易对手方可能因财务状况或其他原因不能履行付款或结算的义务，从而对基金资产价值造成不利影响，导致基金资产损失。

#### 三、管理风险

在基金管理运作过程中，可能因基金管理人经济形势和证券市场等判断有误、获取的信息不全等影响基金的收益水平。基金管理人的管理水平、管理手段和管理技术等对基金收益水平存在影响。

#### 四、操作或技术风险

指相关当事人在业务各环节操作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险，例如，越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误、IT系统故障等风险。

在本基金的各种交易行为或者后台运作中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理公司、登记机构、其他销售机构、证券交易所、证券登记结算机构等等。

#### 五、合规性风险

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

#### 六、政策变更风险

因相关法律法规或监管机构政策修改等基金管理人无法控制的因素的变化，使基金或投资者利益受到影响的风险，例如，监管机构基金估值政策的修改导致基金估值方法的调整而引起基金净值波动的风险；相关法规的修改导致基金投资范围变化，基金管理人为调整投资组合而引起基金净值波动的风险等。

#### 七、本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险

本基金法律文件投资章节有关风险收益特征的表述是基于投资范围、投资比例、证券市场普遍规律等做出的概述性描述，代表了一般市场情况下本基金的长期风险收益特征。销售机构(包括基金管理人直销机构和其他销售机构)根据相关法律法规对本基金进行风险评价，不同的销售机构采用的评价方法也不同，因此销售机构的风险等级评价与基金法律文件中风险收益特征的表述可能存在不同，投资人在购买本基金时需按照销售机构的要求完成风险承受能力与产品风险之间的匹配检验。

#### 八、其他风险

1、战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致基金资产的损失。

2、金融市场危机、行业竞争、代理商违约、托管人违约等超出基金管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致基金或者基金持有人利益受损。

3、因人为因素而产生的风险，如基金经理违反职业操守的道德风险，以及因内幕交易、欺诈等行为产生的违规风险。

## 第十九部分 基金封闭运作期届满后的安排

### 一、基金封闭运作期届满后基金的存续形式

基金合同生效后 10 年基金运作期届满，在满足基金合同约定的存续条件下，本基金无需召开基金份额持有人大会，自动转换为上市开放式基金（LOF），基金名称变更为“鹏华丰锐债券型证券投资基金（LOF）”。

本基金份额转换为上市开放式基金（LOF）份额后，基金份额仍将在深圳证券交易所上市交易。

### 二、基金封闭运作期届满后基金的投资

#### 1、投资目标

本基金在有效控制风险、保持适当流动性的前提下，通过积极主动的投资管理，力争取得超越基金业绩比较基准的收益。

#### 2、投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、地方政府债、中期票据、短期融资券、可转换债券（含分离交易可转债）、资产支持证券、中小企业私募债、债券回购、银行存款等固定收益类品种以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金同时可参与股票（含存托凭证）、权证等权益类资产的投资。

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

基金的投资组合比例为：本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%，股票（含存托凭证）等权益类品种的投资比例不超过基金资产的 20%，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

#### 3、投资策略

##### （1）资产配置策略

本基金将通过跟踪考量通常的宏观经济变量（包括 GDP 增长率、CPI 走势、M2 的绝对水平和增长率、利率水平与走势等）以及各项国家政策（包括财政、货币、税收、汇率政策等）来判断经济周期目前的位置以及未来将发展的方向，在此基础上对各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估，制定股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。

##### （2）债券投资策略

本基金债券投资将采取久期策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、个券选择策略、信用策略、中小企业私募债投资策略等积极投资策略。

#### 1) 久期策略

久期管理是债券投资的重要考量因素，本基金将采用以“目标久期”为中心、自上而下的组合久期管理策略。如果预期利率下降，本基金将增加组合的久期，直至接近目标久期上限，以较多地获得债券价格上升带来的收益；反之，如果预期利率上升，本基金将缩短组合的久期，直至目标久期下限，以减小债券价格下降带来的风险。

#### 2) 收益率曲线策略

收益率曲线的形状变化是判断市场整体走向的一个重要依据，本基金将据此调整组合长、中、短期债券的搭配，即通过对收益率曲线形状变化的预测，适时采用子弹式、杠铃或梯形策略构造组合，并进行动态调整。

#### 3) 骑乘策略

本基金将采用基于收益率曲线分析对债券组合进行适时调整的骑乘策略，以达到增强组合的持有期收益的目的。该策略是指通过对收益率曲线的分析，在可选的目标久期区间买入期限位于收益率曲线较陡峭处右侧的债券。在收益率曲线不变动的情况下，随着其剩余期限的衰减，债券收益率将沿着陡峭的收益率曲线有较大幅度的下滑，从而获得较高的资本收益；即使收益率曲线上升或进一步变陡，这一策略也能够提供更多的安全边际。

#### 4) 息差策略

本基金将采用息差策略，以达到更好地利用杠杆放大债券投资的收益的目的。该策略是指在回购利率低于债券收益率的情形下，通过正回购将所获得的资金投资于债券，利用杠杆放大债券投资的收益。

#### 5) 个券选择策略

本基金将根据单个债券到期收益率相对于市场收益率曲线的偏离程度，结合信用等级、流动性、选择权条款、税赋特点等因素，确定其投资价值，选择定价合理或价值被低估的债券进行投资。

#### 6) 信用策略

本基金通过主动承担适度的信用风险来获取信用溢价。本基金主要关注信用债收益率受信用利差曲线变动趋势和信用变化两方面影响，相应地采用以下两种投资策略：

a) 信用利差曲线变化策略：首先分析经济周期和相关市场变化情况，其次分析标的债券市场容量、结构、流动性等变化趋势，最后综合分析信用利差曲线整体及分行业走势，确定本基金信用债分行业投资比例。

b) 信用变化策略：信用债信用等级发生变化后，本基金将采用最新信用级别所对应的信用利差曲线对债券进行重新定价。



本基金将根据内、外部信用评级结果，结合对类似债券信用利差的分析以及对未来信用利差走势的判断，选择信用利差被高估、未来信用利差可能下降的信用债进行投资。

### （3）股票投资策略

本基金通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘优质的上市公司，构建股票投资组合。本基金将重点关注行业增长前景、行业利润前景和行业成功要素等因素进行自上而下的行业遴选；同时结合对上市公司的竞争力分析、管理层分析等定性分析和对上市公司的关键估值方法（包括 PE、PEG、PB、PS、EV/EBITDA 等）等定量分析进行自下而上的个股精选。

本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。

## 4、投资限制

### （1）组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

1) 本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%，股票（含存托凭证）等权益类品种的投资比例不超过基金资产的 20%；

2) 保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

3) 本基金持有一家上市公司的证券（含存托凭证），其市值不超过基金资产净值的 10%；

4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家上市公司发行的证券（含存托凭证），不超过该证券的 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) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

8) 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%；

9) 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%；

10) 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%；

11) 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%；

12) 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%；

13) 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%；

14) 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;

15) 本基金持有单只中小企业私募债券, 其市值不得超过基金资产净值的 10%;

16) 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;

17) 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%;

18) 基金总资产不得超过基金净资产的 140%;

19) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的 15%。因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前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;

20) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的, 可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致;

21) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述第 2)、14)、19)、20) 项外, 因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的, 基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整, 但中国证监会规定的特殊情形除外。

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

## (2) 禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益, 基金财产不得用于下列投资或者活动:

1) 承销证券;

2) 违反规定向他人贷款或者提供担保;

3) 从事承担无限责任的投资;

4) 买卖其他基金份额, 但是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;

6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;

7) 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。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券, 或者从事其他重大关联交易的, 应当符合基金的投资目标和投资策略, 遵循持有人利益优先原则, 防范利益冲突, 建立健全内部审批机制和评估机制, 按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意, 并按法律法规予以披

露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

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

#### 5、业绩比较基准

本基金业绩比较基准为：中债总指数收益率。

中债总指数由中央国债登记结算公司编制，并在中国债券网（www.chinabond.com.cn）公开发布，具有较强的权威性和市场影响力；该指数样本券涵盖央票、国债和政策性金融债，能较好地反映债券市场的整体收益。本基金是债券型基金，主要投资于固定收益类金融工具，为此，本基金选取中债总指数作为本基金的业绩比较基准。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时，本基金管理人协商基金托管人后可以在报中国证监会备案以后变更业绩比较基准并及时公告，但不需要召集基金份额持有人大会。

#### 6、风险收益特征

封闭运作期结束后，本基金转型成为债券型基金，其预期的收益与风险低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金，为证券投资基金中具有较低风险收益特征的品种。

#### 7、侧袋机制的实施和投资运作安排

当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，根据最大限度保护基金份额持有人利益的原则，基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制。

侧袋机制实施期间，本部分约定的投资组合比例、投资策略、组合限制、业绩比较基准、风险收益特征等约定仅适用于主袋账户。

侧袋账户的实施条件、实施程序、运作安排、投资安排、特定资产的处置变现和支付等对投资者权益有重大影响的事项详见招募说明书“侧袋机制”部分的规定。

### 三、基金封闭运作期届满后基金的申购与赎回

#### 1、申购和赎回的期间

(1) 基金合同生效后 10 年之内(含 10 年)为封闭运作期，在此期间投资人不能申购、赎回基金份额，但可在本基金上市交易后通过深圳证券交易所买卖基金份额。

(2) 基金封闭期结束后或封闭期内经持有人大会通过提前转为上市开放式基金(LOF)后，投资人方可进行基金份额的申购与赎回。

#### 2、基金份额的场外申购、赎回

本节内容仅适用于本基金的场外申购、赎回业务。登记在注册登记系统中的基金份额可直接办理场外申购、赎回等基金业务；登记在证券登记结算系统中的基金份额可通过办理跨系统转托管业务将基金份额转登记到注册登记系统中，再办理场外申购、赎回等场外基金业务。

#### （1）场外申购、赎回业务办理的场所

- 1) 本基金管理人设在深圳、北京、上海和武汉的直销中心；
- 2) 浦发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、赎回的场所，并在基金管理人网站公示。

#### （2）场外申购、赎回的开放日及时间

##### 1) 开放日及开放时间

投资人在开放日办理基金份额的申购、赎回，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。开放日的具体业务办理时间在招募说明书中载明或另行公告。

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。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回业务。如果本基金接受投资人在基金合同约定之外的日期或者时间提出申购、赎回申请的，其基金份额申购、赎回价格为下一开放日基金份额申购、赎回的价格。

##### 2) 申购、赎回的开始时间

本基金转为上市开放式基金(LOF)后，投资人方可进行基金份额的申购与赎回。

在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告申购与赎回的开始时间。

3) 基金管理人如果对申购、赎回时间进行调整，应报中国证监会备案，在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在中国证监会指定媒介上公告。

#### （3）场外申购、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，即按照认购、申购的先后次序进行顺序赎回。
- 4) 当日的申购、赎回申请可以在当日开放时间结束前撤销，当日开放时间结束后不得撤销。

5) 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则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

#### (4) 场外申购、赎回的程序

##### 1) 申请方式

基金投资人必须根据基金销售机构规定的程序，在开放日的业务办理时间向基金销售机构提出申购、赎回的申请。

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

##### 2) 申购、赎回的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理申购、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，投资人应在 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。基金销售机构对申购申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购、赎回的确认以注册登记机构确认结果为准。

##### 3) 申购、赎回款项支付的方式与时间

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本金退还给投资人。

投资人 T 日赎回申请成功后，基金管理人将在 T+7 日(包括该日)内支付赎回款项。在发生巨额赎回的情形时，款项的支付办法参照《基金合同》的有关条款处理。

#### (5) 场外申购、赎回的限制

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) 投资人通过代销机构场外申购本基金，单笔最低申购金额为 1,000 元。通过基金管理人直销中心场外申购本基金，首次最低金额为 30 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）。

投资人将当期分配的基金收益再投资时，不受最低申购金额的限制。

3) 场外账户最低余额为 30 份基金份额，若某笔赎回将导致投资人在销售机构托管的单只基金份额余额不足 30 份时，该笔赎回业务应包括账户内全部基金份额，否则，剩余部分的基金份额将被强制赎回。

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

5) 基金管理人可根据市场情况, 在法律法规允许的情况下, 调整上述对申购的金额、赎回的份额的数量限制, 基金管理人必须在调整生效前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

(6) 场外申购、赎回的费用

1) 本基金场外申购费率如下:

| 申购金额 M (元)                     | 申购费率      |
|--------------------------------|-----------|
| $M < 50$ 万                     | 0.8%      |
| $50 \text{ 万} \leq M < 250$ 万  | 0.4%      |
| $250 \text{ 万} \leq M < 500$ 万 | 0.2%      |
| $M \geq 500$ 万                 | 每笔 1000 元 |

投资人在一天之内如果有多笔申购, 适用费率按单笔分别计算。

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

2) 赎回费: 本基金的场外赎回费率按持有年限逐年递减。通过场外认购、申购的投资者其份额持有期限以份额实际持有期限为准; 从场内转托管至场外的基金份额, 从场外赎回时, 其持有期限从转托管转入确认日开始计算。具体费率如下:

| 持有期限 (Y)                   | 场外赎回费率 |
|----------------------------|--------|
| $Y < 7$ 日                  | 1.50%  |
| $7 \text{ 日} \leq Y < 1$ 年 | 0.1%   |
| $1 \text{ 年} \leq Y < 2$ 年 | 0.05%  |
| $Y \geq 2$ 年               | 0      |

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担, 在基金份额持有人赎回基金份额时收取。对持续持有期少于 30 日的投资人收取的赎回费全额计入基金财产; 对持续持有期不少于 30 日但少于 3 个月的投资人收取的赎回费总额的 75% 计入基金财产; 对持续持有期不少于 3 个月但少于 6 个月的投资人收取的赎回费总额的 50% 计入基金财产; 对持续持有期不少于 6 个月的投资人, 将赎回费总额的 25% 计入基金财产 (1 年以 365 天记)。上述未纳入基金财产的赎回费用于支付登记费和其他必要的手续费。

3) 本基金的申购费率、赎回费率和收费方式由基金管理人根据《基金合同》的规定确定并在《招募说明书》中列示。基金管理人和基金托管人协商后, 可以根据《基金合同》的相关约定调整费率或收费方式, 并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

4) 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, 基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

5) 在法律法规和基金合同规定的范围内, 在不提高现有基金份额持有人适用的费率的前提下, 设立新的基金份额级别、增加新的收费方式等情况, 可由基金管理人和基金托管人协商, 并报中国证监会备案后修改基金合同并及时公告, 但不需要召开基金份额持有人大会。

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) 场外申购份额、赎回金额的计算公式

1) 基金申购份额的计算

基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。其中:

净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率)

申购费用 = 申购金额 - 净申购金额

申购份额 = 净申购金额 / 申购当日基金份额净值

例如, 某投资者投资 5,000 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 1.128 元, 则其可得到的申购份额为:

净申购金额 =  $5,000 / (1 + 0.8\%) = 4,960.32$  元

申购费用 =  $5,000 - 4,960.32 = 39.68$  元

申购份数 =  $4,960.32 / 1.128 = 4,397.45$  份

即: 某投资者投资 5,000 元申购本基金, 假设申购当日基金份额净值为 1.128 元, 则可得到 4,397.45 份基金份额。

2) 基金赎回金额的计算

本基金的净赎回金额为赎回总金额扣减赎回费用。其中,

赎回总金额 = 赎回份额 × 赎回当日基金份额净值

赎回费用 = 赎回总金额 × 赎回费率

净赎回金额 = 赎回总金额 - 赎回费用

例如: 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 1.148 元, 则可得到的净赎回金额为:

赎回总金额 =  $10,000 \times 1.148 = 11,480$  元

赎回费用 =  $11,480 \times 0.05\% = 5.74$  元

净赎回金额 =  $11,480 - 5.74 = 11,474.26$  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，假设赎回当日本基金份额净值是 1.148 元，则可得到的净赎回金额为 11,474.26 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。本基金基金份额净值的计算，保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

4) 申购份额、余额的处理方式：

申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后，以当日基金份额净值为基准计算，申购份额计算结果保留到小数点后 2 位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

5) 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以当日基金份额净值为基准并扣除相应的费用，赎回金额计算结果保留到小数点后 2 位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

(8) 场外申购、赎回的注册登记

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

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

在法律法规允许的范围内，本基金注册登记机构可对上述登记结算办理时间进行调整，本基金管理人将于开始实施前按照《信息披露管理办法》有关规定予以公告。

3、基金份额的场内申购与赎回

场内申购与赎回的内容仅适用于本基金通过深圳证券交易所会员单位办理的场内申购和赎回业务。登记在证券登记结算系统中的基金份额可直接办理场内申购、赎回业务；登记在注册登记系统中的基金份额可通过办理跨系统转托管业务将基金份额转登记到证券登记结算系统中，再办理场内申购、赎回业务。

(1) 场内申购和赎回的办理场所

具有基金代销业务资格且符合深圳证券交易所风险控制要求的深圳证券交易所会员单位（具体名单见本基金相关业务公告）。

(2) 申购与赎回的账户

投资人通过场内申购、赎回应使用中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开立的人民币普通股票账户或证券投资基金账户（账户开立的具体事项参见本基金份额发售公告认购开户相关内容）。

(3) 场内申购和赎回的开放日及开放时间

1) 开放日及开放时间



投资人在开放日办理基金份额的申购、赎回，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。开放日的具体业务办理时间在招募说明书中载明或另行公告。

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。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回业务。如果本基金接受投资人在基金合同约定之外的日期或者时间提出申购、赎回申请的，其基金份额申购、赎回价格为下一开放日基金份额申购、赎回的价格。

#### 2) 申购、赎回的开始时间

本基金转为上市开放式基金 (LOF) 后，投资人方可进行基金份额的申购与赎回。

在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告申购与赎回的开始时间。

3) 基金管理人如果对申购或赎回时间进行调整，应报中国证监会备案，在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在中国证监会指定媒介上公告。

#### (4) 场内申购和赎回的原则

1) “未知价”原则，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。申购和赎回申报单位以深圳证券交易所的规定为准。

3) 当日的申购与赎回申请可以在当日交易结束时间前撤销，在当日的交易时间结束后不得撤销。

4) 投资人通过深圳证券交易所交易系统办理本基金的场内申购、赎回时，需遵守深圳证券交易所的相关业务规则。若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对场内申购、赎回业务规则有新的规定，按新规定执行。

5) 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则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

#### (5) 场内申购和赎回的程序

##### 1) 申购和赎回的申请方式

基金投资人需遵循深圳证券交易所场内申购赎回相关业务规则，在开放日的业务办理时间内提出申购或赎回的申请。投资人在申购本基金时须按业务办理单位规定的方式备足申购资金。投资人在提交赎回申请时，其账户内必须有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回申请无效而不予成交。

##### 2) 申购和赎回申请的确认

T 日规定时间受理的申请，正常情况下，基金注册登记机构在 T+1 日内为投资人对该交易的有效性进行确认，在 T+2 日后（包括该日）投资人应向销售机构或以销售机构规定的其他方式查询申购与赎回的成交情况。

业务办理单位对申购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表业务办理单位确实接收到申购申请。申购的确认以基金注册登记机构或基金管理人的确认结果为准。

### 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，申购款项本金将退回投资人账户。

投资人 T 日赎回申请成功后，基金管理人将在 T+7 日(包括该日)内支付赎回款项。在发生巨额赎回的情形时，款项的支付办法参照《基金合同》的有关条款处理。

### (6) 场内申购和赎回的数额限制

1) 投资人通过会员单位办理场内申购本基金，单笔最低申购金额为 1,000 元，同时申购金额必须是整数金额。

2) 基金份额持有人办理场内赎回时，赎回份额必须是整数份额。

3) 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。

4) 基金管理人、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司可根据市场情况，在不违反相关法律法规规定的前提下，调整上述限制。基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

### (7) 场内申购和赎回的费用

1) 本基金场内申购费率如下：

| 申购金额 M (元)        | 申购费率      |
|-------------------|-----------|
| M < 50 万          | 0.8%      |
| 50 万 ≤ M < 250 万  | 0.4%      |
| 250 万 ≤ M < 500 万 | 0.2%      |
| M ≥ 500 万         | 每笔 1000 元 |

投资人在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。

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

2) 赎回费：本基金的场内赎回费率随投资者持有基金份额期限的增加而减少。

本基金场内赎回费率如下表:

| 持有期限 Y | 赎回费率  |
|--------|-------|
| Y<7 日  | 1.50% |
| Y≥7 日  | 0.10% |

本基金的赎回费用在投资人赎回本基金份额时收取。本基金的赎回费用由赎回申请人承担。本基金对持续持有期少于 7 日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产,对持续持有期不少于 7 日的投资者收取的赎回费总额的 25%归入基金财产,75%用于支付市场推广、注册登记费和其他手续费。

3) 本基金的申购费率、赎回费率和收费方式由基金管理人根据相关法律法规及基金合同的规定确定并在招募说明书中列示。基金管理人和基金托管人协商后,可以根据《基金合同》的相关约定调整费率或收费方式,并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

4) 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,基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

5) 在法律法规和基金合同规定的范围内,在不提高现有基金份额持有人适用的费率的前提下,设立新的基金份额级别、增加新的收费方式等情况,可由基金管理人和基金托管人协商,并报中国证监会备案后修改基金合同并及时公告,但不需要召开基金份额持有人大会。

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。

#### (8) 场内申购份额和赎回金额的计算

##### 1) 基金申购份额的计算

净申购金额=申购金额/(1+申购费率) 申购费用=申购金额-净申购金额 申购份额=净申购金额/申购当日基金份额净值 申购份额计算结果保留到整数位,整数位后小数部分的份额对应的资金返还至投资人资金账户。

例如:某投资人通过场内投资 10,000 元申购本基金,对应的申购费率为 0.8%,假设申购当日基金份额净值为 1.025 元,则其申购手续费、可得到的申购份额及返还的资金余额为:

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

$$\text{申购手续费} = 10,000 - 9,920.63 = 79.37 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 9,920.63 / 1.025 = 9,678.66 \text{ 份}$$

因场内申购份额保留至整数份,故投资人申购所得份额为 9,678 份,整数位后小数部分的申购份额对应的资金返还给投资人。具体计算公式为:

实际净申购金额=9,678×1.025=9,919.95 元

退款金额=10,000-9,919.95-79.37=0.68 元

即：投资人投资 10,000 元从场内申购本基金，假设申购当日基金份额净值为 1.025 元，则其可得到基金份额 9,678 份，退款 0.68 元。

## 2) 基金赎回金额的计算

赎回总金额=赎回份额×赎回当日基金份额净值 赎回费用=赎回总金额×赎回费率 净赎回金额=赎回总金额-赎回费用 赎回金额计算结果保留到小数点后 2 位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

例如：某投资人从场内赎回本基金 10,000 份基金份额，持有时间为 1 个月，对应的赎回费率为 0.1%，假设赎回当日基金份额净值为 1.148 元，则其可得净赎回金额为：

赎回总金额=10,000×1.148=11,480 元

赎回费用=11,480×0.1%=11.48 元

净赎回金额=11,480-11.48=11,468.52 元

即：投资人从深圳证券交易所场内赎回本基金 10,000 份基金份额，持有时间为 1 个月，假设赎回当日基金份额净值为 1.148 元，则可得到的净赎回金额为 11,468.52 元。

## (9) 场内申购与赎回的注册登记

本基金场内申购和赎回的注册与过户登记业务，按照深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关规定办理。

(10) 办理本基金份额场内申购、赎回业务应遵守深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则。若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对场内申购、赎回业务规则有新的规定，将按新规定执行。

## 4、巨额赎回的认定及处理方式

### (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延期赎回。

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

2) 部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于

上一开放日基金总份额的 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 个工作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。

## 5、拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理

（1）发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

- 1) 因不可抗力导致基金无法正常运作。
- 2) 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现有基金份额持有人利益时。
- 5) 基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人利益的情形。

6) 基金管理人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) 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购的, 基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的, 被拒绝的申购款项本金将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时, 基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

(2) 发生下列情形时, 基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项:

1) 因不可抗力导致基金无法正常运作。

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。

发生上述情形且基金管理人决定暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项时, 基金管理人应在当日报中国证监会备案, 已接受的赎回申请, 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申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人, 未支付部分可延期支付, 并以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。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。

(3) 暂停期间结束, 基金重新开放申购或赎回时, 基金管理人应按规定公告。

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

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

3) 如发生暂停的时间超过 2 周, 暂停期间, 基金管理人应每 2 周至少刊登暂停公告 1 次。当连续暂停时间超过 2 个月的, 基金管理人可以调整刊登公告的频率。暂停结束, 基金重新开放申购或赎回时, 基金管理人应在 2 日内在指定媒介

上连续刊登基金重新开放申购或赎回公告, 并公告最近 1 个开放日的基金份额净值。

## 6、基金转换

本基金转为上市开放式基金 (LOF) 后, 基金管理人可以根据相关法律法规以及基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的、且由同一注册登记机构办理注册登记的其他基金之间的转换业务, 基金转换可以收取一定的转换费, 相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及基金合同的规定制定并公告, 并提前告知基金托管人与相关机构。

## 7、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。

## 8、基金的转托管

本基金的转托管包括系统内转托管和跨系统转托管。

### (1) 系统内转托管

1) 系统内转托管是指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构 (网点) 之间或证券登记结算系统内不同会员单位 (交易单元) 之间进行转托管的行为。

2) 份额登记在注册登记系统的基金份额持有人在变更办理基金赎回业务的销售机构 (网点) 时, 销售机构 (网点) 之间不能通存通兑的, 可办理已持有基金份额的系统内转托管。

3) 份额登记在证券登记结算系统的基金份额持有人在变更办理上市交易的会员单位 (交易单元) 时, 可办理已持有基金份额的系统内转托管。

### (2) 跨系统转托管

1) 跨系统转托管只限于在证券账户和以其为基础注册的开放式基金账户之间进行, 指投资人将基金份额在证券登记结算系统内某会员单位 (交易单元) 与注册登记系统内的某销售机构 (网点) 之间进行转托管的行为。

2) 本基金跨系统转托管的具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司及深圳证券交易所的相关规定办理。

基金销售机构可以按照相关规定向基金份额持有人收取转托管费。

#### 9、定期定额投资计划

基金管理人可以为投资人办理定期定额投资计划，具体规则由基金管理人在届时发布公告或更新的招募说明书中确定。投资人在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额，每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。

#### 10、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冻结与解冻。

#### 11、实施侧袋机制期间本基金的申购与赎回

本基金实施侧袋机制的，本基金的申购和赎回安排详见招募说明书“侧袋机制”部分的规定或相关公告。

### 四、基金封闭运作期届满后基金的费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.7% 的年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.7\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，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 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每月月末，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 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 3、实施侧袋机制期间的基金费用



本基金实施侧袋机制的，与侧袋账户有关的费用可以从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支，有关费用可酌情收取或减免，但不得收取管理费，详见相关公告。

## 第二十部分 侧袋机制

### 一、侧袋机制的实施条件和程序

本基金封闭运作期届满，转为上市开放式基金（LOF）后，当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，根据最大限度保护基金份额持有人利益的原则，基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制。

基金管理人应当在启用侧袋机制后及时发布临时公告，并及时聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所进行审计并披露专项审计意见。

### 二、实施侧袋机制期间基金份额的申购与赎回

1、启用侧袋机制当日，本基金登记机构以基金份额持有人的原有账户份额为基础，确认基金份额持有人的相应侧袋账户份额；当日收到的申购申请，按照启用侧袋机制后的主袋账户份额办理；当日收到的赎回申请，仅办理主袋账户份额的赎回申请并支付赎回款项。

2、实施侧袋机制期间，基金管理人不得办理侧袋账户份额的申购、赎回和转换；同时，基金管理人按照基金合同和招募说明书约定办理主袋账户份额的赎回，并根据主袋账户运作情况确定是否暂停申购。本招募说明书“基金封闭运作期届满后基金的申购与赎回”部分的申购、赎回规定适用于主袋账户份额。

3、基金管理人应按照主袋账户的份额净值办理主袋账户份额的申购和赎回。巨额赎回按照单个开放日内主袋账户份额净赎回申请超过前一开放日主袋账户总份额的10%认定。

### 三、实施侧袋机制期间的基金投资

侧袋机制实施期间，招募说明书“基金封闭运作期届满后基金的投资”部分约定的投资组合比例、投资策略、组合限制、业绩比较基准、风险收益特征等约定仅适用于主袋账户。基金管理人计算各项投资运作指标和基金业绩指标时应当以主袋账户资产为基准。

基金管理人原则上应当在侧袋机制启动后20个交易日内完成对主袋账户投资组合的调整，因资产流动性受限等中国证监会规定的情形除外。

基金管理人不得在侧袋账户中进行除特定资产处置变现以外的其他投资操作。

### 四、侧袋账户中特定资产的处置变现和支付

特定资产以可出售、可转让、恢复交易等方式恢复流动性后，基金管理人应当按照基金份额持有人利益最大化原则，采取将特定资产予以处置变现等方式，及时向侧袋账户份额持有人支付对应款项。

终止侧袋机制后，基金管理人及时聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所进行审计并披露专项审计意见。

## 五、侧袋机制的信息披露

### 1、临时公告

在启用侧袋机制、处置特定资产、终止侧袋机制以及发生其他可能对投资者利益产生重大影响的事项后，基金管理人应及时发布临时公告。

### 2、基金净值信息

基金管理人应按照招募说明书“基金的信息披露”部分规定的基金净值信息披露方式和频率披露主袋账户份额的基金份额净值和基金份额累计净值。实施侧袋机制期间本基金暂停披露侧袋账户份额净值。

### 3、定期报告

侧袋机制实施期间，基金管理人应当在基金定期报告中披露报告期内特定资产处置进展情况，披露报告期末特定资产可变现净值或净值参考区间的，该净值或净值参考区间不代表基金管理人对该特定资产最终变现价格的承诺。

六、本部分关于侧袋机制的相关规定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，或将来法律法规或监管规则针对侧袋机制的内容有进一步规定的，基金管理人经与基金托管人协商一致并履行适当程序后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

## 第二十一部分 基金的合并、终止与清算

### 一、基金合并

本基金的存续期间，如发生下列情形之一的，在不违反法律法规、基金合同的约定以及对份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，在履行适当的程序后，本基金与基金管理人管理的其他基金合并：

- (1) 连续 60 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人；
- (2) 连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元。

基金合并的方式包括但不限于本基金吸收合并其他基金、本基金被其他基金吸收合并等方式。本基金吸收合并其他基金时，其他基金终止，本基金存续；本基金被其他基金吸收合并时，其他基金存续，本基金终止。基金合并的具体实施需符合相关法律法规的规定。

### 二、《基金合同》的变更

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

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议生效后方可执行，并自决议生效后两日内在指定媒介公告。

### 三、《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 3、本基金募集成立后 6 个月之内未按照约定完成对目标公司的增资入股；
- 4、自增资完成日起 6 个月内，目标公司未按照约定变更为股份有限公司，或发生导致本基金对目标公司投资失败或无法实现本基金对目标公司投资目标的其他情形。若发生上述情况导致基金合同终止，后续的投资退出等相关安排详见招募说明书；
- 5、《基金合同》约定的其他情形；
- 6、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### 四、基金财产的清算

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

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

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

#### 4、基金财产清算程序：

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

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

#### 五、清算费用

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

#### 六、基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

#### 七、基金财产清算的公告

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

#### 八、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

## 第二十二部分 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

#### 基金份额持有人的权利、义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的权利包括但不限于：

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

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的义务包括但不限于：

- （1）认真阅读并遵守《基金合同》、招募说明书等信息披露文件；

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

(3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；

(4) 交纳基金认购、申购、赎回款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；

(5) 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；

(6) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；

(7) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；

(8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；

(9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

### **基金管理人的权利、义务**

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的权利包括但不限于：

(1) 依法募集资金；

(2) 自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；

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

(4) 发售基金份额；

(5) 按照规定召集基金份额持有人大会；

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

(7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

(8) 选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；

(9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用，并按照《基金合同》规定对基金登记机构进行必要的监督和检查；

(10) 依据《基金合同》及有关法律规规定决定基金收益的分配方案；

(11) 以基金管理人名义持有目标公司股权，依照法律法规为基金的利益对目标公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于目标公司股权和其他证券所产生的权利；

(12) 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、融券以及将基金作为融资融券标的进行运用等相关业务；

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

(14) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商、尽职调查机构、资产评估机构、房地产评估机构或其他为基金提供服务的外部机构；

(15) 在符合有关法律、法规、《基金合同》、相关证券交易所及登记结算机构相关业务规则的前提下，制订、修改并公布有关基金认购及其他相关业务规则；

(16) 根据有关规定，选择、聘请、增补、更换、撤销基金投资顾问；

(17) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的义务包括但不限于：

(1) 依法募集资金，聘请销售机构办理基金份额的募集，办理或委托合格机构办理本基金的登记结算事宜；

(2) 办理基金备案手续；

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

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

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

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

(7) 依法接受基金托管人的监督；

(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金净值信息；

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(10) 编制季度报告、中期报告和年度报告；

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

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

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

(14) 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；

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

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

(17) 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；

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

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

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

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

(22) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；

(23) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(24) 进行目标公司的现金流测算、开展目标公司的尽职调查以及确保目标公司享有的收益权权属清晰；

(25) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

### **基金托管人的权利、义务**

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的权利包括但不限于：

(1) 自《基金合同》生效之日起，依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产；

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

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

(4) 根据相关市场规则，为基金开设证券账户、为基金办理证券交易资金清算；

(5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

(6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的义务包括但不限于：

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

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

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

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

- (5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
- (6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
- (7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；
- (8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值；
- (9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
- (10) 对基金财务会计报告、季度报告、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；
- (11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；
- (12) 建立并保存基金份额持有人名册；
- (13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- (14) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；
- (15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
- (16) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；
- (17) 参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- (18) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；
- (19) 因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- (20) 按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿；
- (21) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；
- (22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

### **基金投资顾问的权利、义务**

本基金基金投资顾问的权利包括但不限于：

基金投资顾问的权利

根据法律法规以及基金管理人与基金投资顾问签署的《投资顾问协议》，基金投资顾问的权利包括但不限于：

- (1) 引导前海金融创新发展，主导设计本基金产品；



- (2) 获取投资顾问报酬；
- (3) 作为基石投资者认购本基金份额，分享前海金融创新的红利。

本基金基金投资顾问的义务包括但不限于：

根据法律法规以及基金管理人与基金投资顾问签署的《投资顾问协议》，基金投资顾问的职责和义务包括但不限于：

(1) 作为基石投资人认购本基金基金份额，承诺在本基金募集期内以自有资金或其指定机构认购基金份额 3 亿份，且该等份额自基金合同生效之日起 2 年内不得转让；

(2) 提供聘请律师事务所、会计师事务所、资产评估机构、房地产评估机构等外部机构的建议；

(3) 协助基金管理人设计本基金产品；

(4) 配合基金管理人进行目标公司的现金流测算、开展目标公司的尽职调查，确保目标公司享有的收益权权属清晰；

(5) 为维护基金份额持有人的权利和利益，监督目标公司服务机构、目标公司收入归集账户以及其他交易方履行相关协议的约定；

(6) 承担印鉴证照监管、账户及资金支出监管、租赁收入及其他收入监管、合同监管、重大事项监管的义务；

(7) 在基金合同存续期间，根据基金管理人定期报告的频率及时间安排，督促目标公司提供运营情况、现金流情况、租户履约情况、经营风险等信息；

(8) 目标公司出现经营及偿付异常的，应通知基金管理人，并主导资产处置，组织实施清算和追偿；

(9) 目标公司服务机构出现违法、违规或违约行为，应及时通知基金管理人；

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

## **(二) 基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则**

**基金份额持有人大会由基金份额持有人组成。基金份额持有人持有的每一基金份额具有同等的投票权。**

### **召开事由**

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

- (1) 终止《基金合同》（法律法规、中国证监会或基金合同另有约定的除外）；
- (2) 更换基金管理人；
- (3) 更换基金托管人；
- (4) 转换基金运作方式（法律法规、中国证监会或基金合同另有约定的除外）；
- (5) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；

- (6) 变更基金类别；
- (7) 本基金与其他基金的合并（法律法规、中国证监会或基金合同另有约定的除外）；
- (8) 变更基金投资目标、范围或策略（法律法规、中国证监会或基金合同另有约定的除外）；
- (9) 变更基金份额持有人大会程序；
- (10) 提前终止基金上市；
- (11) 扩大基金规模；
- (12) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- (13) 单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；
- (14) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
- (15) 法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

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

- (1) 基金管理人或基金托管人主动调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；
- (2) 法律法规要求增加的基金费用的收取；
- (3) 因相应的法律法规、监管机关的监管规则、相关证券交易所或登记结算机构业务规则等发生变动而应当对《基金合同》进行修改；
- (4) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生重大变化；
- (5) 基金管理人、相关证券交易所和登记结算机构在法律法规、《基金合同》规定的范围内调整有关基金认购、交易、非交易过户等业务的规则；
- (6) 监管机关或证券交易所要求本基金终止上市的；
- (7) 因增资完成日起 6 个月内，目标公司未按照约定变更为股份有限公司而终止《基金合同》，或发生导致本基金对目标公司投资失败或无法实现本基金对目标公司投资目标的其他情形；
- (8) 按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

### **召集人和召集方式**

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

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

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

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

#### **召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式**

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

(1) 会议召开的时间、地点和会议形式；

(2) 会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；

(3) 有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；

(4) 授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；

(5) 会务常设联系人姓名及联系电话；

(6) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；

(7) 召集人需要通知的其他事项。

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

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

#### **基金份额持有人出席会议的方式**

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规和监管机关允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

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

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

(2) 经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）。若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一（含三分之一）。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

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

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

(4) 上述第（3）项中直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证

及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金登记机构记录相符。

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

### **议事内容与程序**

#### **1、议事内容及提案权**

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

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

#### **2、议事程序**

##### **(1) 现场开会**

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

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

##### **(2) 通讯开会**

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

### **决议形成的条件、表决方式、程序**

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1、一般决议，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过方为有效；除下列第 2 项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。除基金合同另有约定的，转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、与其他基金合并以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

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

## 计票

### 1、现场开会

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

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

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

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

### 2、通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

## 生效公告

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

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

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

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

#### **实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定**

若本基金实施侧袋机制，则相关基金份额或表决权的比例指主袋份额持有人和侧袋份额持有人分别持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例，但若相关基金份额持有人大会召集和审议事项不涉及侧袋账户的，则仅指主袋份额持有人持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例：

1、基金份额持有人行使提议权、召集权、提名权所需单独或合计代表相关基金份额 10%以上（含 10%）；

2、现场开会的到会者在权益登记日代表的基金份额不少于本基金在权益登记日相关基金份额的二分之一（含二分之一）；

3、通讯开会的直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日相关基金份额的二分之一（含二分之一）；

4、在参与基金份额持有人大会投票的基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日相关基金份额的二分之一、召集人在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内就原定审议事项重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）相关基金份额的持有人参与或授权他人参与基金份额持有人大会投票；

5、现场开会由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人；

6、一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过；

7、特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过。

同一主侧袋账户内的每份基金份额具有平等的表决权。

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

#### **基金合同的合并、变更和终止的事由、程序**

## 1. 基金合并

本基金的存续期间，如发生下列情形之一的，在不违反法律法规、基金合同的约定以及对份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，在履行适当的程序后，本基金与基金管理人管理的其他基金合并，无需召开基金份额持有人大会：

- (1) 连续 60 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人；
- (2) 连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元。

基金合并的方式包括但不限于本基金吸收合并其他基金、本基金被其他基金吸收合并等方式。本基金吸收合并其他基金时，其他基金终止，本基金存续；本基金被其他基金吸收合并时，其他基金存续，本基金终止。基金合并的具体实施需符合相关法律法规的规定。

## 2. 《基金合同》的变更

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

(2) 关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自完成备案手续后方可执行，自决议生效后两日内在指定媒介公告。

## 3. 《基金合同》的终止

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

- (1) 基金份额持有人大会决定终止的；
- (2) 基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- (3) 自增资完成日起 6 个月内，目标公司未按照约定变更为股份有限公司，或发生导致本基金对目标公司投资失败或无法实现本基金对目标公司投资目标的其他情形；
- (4) 《基金合同》约定的其他情形；
- (5) 相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### (四) 争议解决方式

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交华南国际经济贸易仲裁委员会，按照华南国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为深圳市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力。

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

《基金合同》受中国法律管辖。

### (五) 基金合同存放地和投资人取得基金合同的方式



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

## 第二十三部分 基金托管协议的内容摘要

### （一）基金托管协议当事人

#### 1. 基金管理人

名称：鹏华基金管理有限公司

住所：深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心 43 层

办公地址：深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心 43 层

法定代表人：何如

成立时间：1998 年 12 月 22 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证券监督管理委员会 [1998] 31 号文

经营范围：基金管理业务、发起设立基金及中国证券监督管理委员会批准的其他业务。

注册资本：1.5 亿元

组织形式：有限责任公司

存续期间：持续经营

#### 2. 基金托管人

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：高国富

成立日期：1992 年 10 月 19 日

基金托管业务资格批准机关：中国证监会

基金托管业务资格文号：证监基金字[2003]105 号

组织形式：股份有限公司（上市）

注册资本：216.18 亿元人民币

经营期限：永久存续

### （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》和本协议的约定，对基金的投资范围、投资对象进行监督。

本基金合同生效后 10 年内（含 10 年）为基金封闭运作期，本基金在此期间内封闭运作并在深圳证券交易所上市交易。基金封闭运作期届满，本基金转为上市开放式基金（LOF）。

本基金封闭运作期内将投资于以下金融工具：

本基金封闭运作期内按照本《基金合同》的约定投资于确定的、单一的目标公司股权。本基金的其他基金资产可以投资于固定收益类资产（具体包括：国债、金融债、企业（公司）债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、资产支持证券、债券回购、银行存款等）、现金，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金同时可参与股票（含存托凭证）、权证等权益类资产的投资。

基金的投资组合比例为：本基金投资于确定的、单一的目标公司股权的比例不超过基金资产的 50%，投资于固定收益类资产、权益类资产等的比例不低于基金资产的 50%。

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

基金封闭运作期届满，本基金转为上市开放式基金（LOF）后，将投资于以下金融工具：

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、地方政府债、中期票据、短期融资券、可转换债券（含分离交易可转债）、资产支持证券、中小企业私募债、债券回购、银行存款等固定收益类品种以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金同时可参与股票（含存托凭证）、权证等权益类资产的投资。

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

《基金合同》已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，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。

本基金不得投资于相关法律、法规、部门规章及《基金合同》禁止投资的投资工具。

**2、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》和本协议的约定，对基金投资、融资比例进行监督。**

（1）按法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金封闭运作期内的投资资产配置比例为：本基金投资目标公司股权的初始成本不高于基金合同生效日基金资产的 50%；

基金封闭运作期届满，本基金转为上市开放式基金（LOF）后，本基金的投资资产配置比例为：本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%，股票（含存托凭证）等权益类品种的投资比例不超过基金资产的 20%，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

因基金规模或市场变化等因素导致投资组合不符合上述规定的，基金管理人应在合理的期限内调整基金的投资组合，以符合上述比例限定。法律法规另有规定时，从其规定。

如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。

(2) 根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金封闭运作期内投资组合遵循以下投资限制：

- 1) 本基金投资目标公司股权的初始成本不高于基金合同生效日基金资产的 50%；
- 2) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

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

基金封闭运作期届满，本基金转为上市开放式基金（LOF）后，本基金投资组合遵循以下投资限制：

1) 本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%，股票（含存托凭证）等权益类品种的投资比例不超过基金资产的 20%；

2) 保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

3) 本基金持有一家上市公司的股票（含存托凭证），其市值不超过基金资产净值的 10%；

4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家上市公司发行的证券（含存托凭证），不超过该证券的 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) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

8) 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%；

9) 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%；

10) 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%；

11) 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%；

12) 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%；

13) 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%；

14) 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;

15) 本基金持有单只中小企业私募债券, 其市值不得超过基金资产净值的 10%;

16) 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;

17) 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%;

18) 基金总资产不得超过基金净资产的 140%;

19) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的 15%。因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前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;

20) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的, 可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致;

21) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

托管人对上述指标的监督义务, 仅限于监督由基金管理人管理且由托管人托管的全部公募基金及基金专户产品是否符合上述比例限制。《基金法》及其他有关法律法规或监管部门取消上述限制的, 履行适当程序后, 基金不受上述限制。

除投资资产配置外, 基金托管人对基金投资的监督和检查自本托管协议生效之日起开始。

(3) 法律法规允许的基金投资比例调整期限

除上述第 2)、14)、19)、20) 项外, 由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例, 不在限制之内, 但基金管理人应在 10 个工作日内进行调整, 以达到规定的投资比例限制要求。法律法规另有规定的从其规定。

基金管理人应在出现可预见资产规模大幅变动的情况下, 至少提前 2 个工作日正式向基金托管人发函说明基金可能的变动规模和公司应对措施, 便于基金托管人实施交易监督。

(4) 本基金可以按照国家的有关规定进行融资融券。

(5) 相关法律、法规或部门规章规定的其他比例限制。

基金托管人对基金投资的监督和检查自本托管协议生效之日起开始。

**3、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同和本协议的约定, 对基金投资禁止行为进行监督。基金财产不得用于下列投资或者活动。**

根据法律法规的规定及《基金合同》的约定, 本基金禁止从事下列行为:

(1) 承销证券;

(2) 违反规定向他人贷款或者提供担保;

(3) 从事承担无限责任的投资;

- (4) 买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- (6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

#### **4、基金托管人依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定对于基金关联投资限制进行监督。**

运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当遵循基金份额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，符合国务院证券监督管理机构的规定，并履行信息披露义务。

如法律法规或《基金合同》有关于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相互提供与本机构有控股关系的股东或与本机构有其他重大利害关系的公司名单及其更新，并加盖业务章并书面提交，确保关联交易名单真实、完整、全面。基金管理人有责任保管关联交易名单，名单变更后基金管理人应及时发送基金托管人。如果基金托管人在运作中严格遵循了监督流程，基金管理人仍违规进行关联交易，并造成基金资产损失的，由基金管理人承担责任。

#### **5、基金托管人依据有关法律法规的规定和《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。**

(1) 基金托管人按以下方式对基金管理人参与银行间市场交易的交易对手的资信风险控制措施进行监督。

基金管理人向基金托管人提供其银行间债券市场交易的交易对手库，交易对手库由银行间交易会员中财务状况较好、实力雄厚、信用等级高的交易对手组成。基金管理人可以根据实际情况的变化，及时对交易对手库予以更新和调整，并及时书面通知基金托管人。基金托管人据以对基金银行间债券市场交易的交易对手是否符合上述名单进行监督。

(2) 基金托管人对银行间交易市场的交易方式的控制按如下约定进行监督。

基金管理人应按照审慎的风险控制原则，对银行间交易对手的资信状况进行评估，控制交易对手的资信风险，确定与各类交易对手所适用的交易结算方式，在具体的交易中，应尽力争取对基金有利的交易方式。由于交易对手资信风险引起的损失，基金托管人不承担赔偿责任。

#### **6、基金托管人对基金管理人选择存款银行进行监督。**

基金如投资银行存款，基金管理人应根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，事先确定符合条件的所有存款银行的名单，并及时提供给基金托管人，基金管理人可以根据实际情况的变化，及时

对存款银行的名单予以更新和调整，并通知基金托管人。基金托管人据此对基金投资银行存款的交易对手是否符合上述名单进行监督。

基金管理人负责对存款银行的资信控制，并对投资银行存款的信用风险（包括但不限于存款银行的信用等级、存款银行的支付能力等）进行评估。对于基金投资的银行存款，由于存款银行发生信用风险事件而造成损失时，先由基金管理人负责赔偿，之后有权要求相关责任人进行赔偿。

#### **7、基金托管人对基金投资流通受限证券的监督。**

基金管理人投资流通受限证券，应事先根据中国证监会相关规定，明确基金投资流通受限证券的比例，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。

(1) 本基金投资的流通受限证券与上文所述的流通受限证券并不完全一致，须为经中国证监会批准的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。本基金不投资有锁定期但锁定期不明确的证券。

(2) 基金管理人投资非公开发行股票，应制订流动性风险处置预案并经其董事会批准。风险处置预案应包括但不限于因投资受限证券需要解决的基金投资比例限制失调、基金流动性困难以及相关损失等问题的应对解决措施，以及有关异常情况的处置。基金管理人应在首次投资流通受限证券前向基金托管人提供基金投资非公开发行股票的相关流动性风险处置预案。

基金管理人对本基金投资受限证券的流动性风险负责，确保对相关风险采取积极有效的措施，在合理的时间内有效解决基金运作的流动性问题。如因基金巨额赎回或市场发生剧烈变动等原因而导致基金现金周转出现困难时，基金管理人应保证提供足额现金确保基金的支付结算，并承担所有损失。对本基金因投资受限证券导致的流动性风险，基金托管人不承担任何责任。如因基金管理人原因导致本基金出现损失的，基金托管人不承担任何责任。

(3) 本基金投资非公开发行股票，基金管理人应至少于执行投资指令之前两个工作日将有关资料书面提交基金托管人，并保证向基金托管人提供的有关资料真实、准确、完整。有关资料如有调整，基金管理人应及时提供调整后的资料。上述书面资料包括但不限于：

- 1) 中国证监会批准发行非公开发行股票的批准文件。
- 2) 有关非公开发行股票的发行数量、发行价格、锁定期等发行资料。
- 3) 基金拟认购的数量、价格、总成本、账面价值。

4) 基金托管人应按照《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》规定，对基金管理人是否遵守法律法规进行监督，并审核基金管理人提供的有关书面信息。基金托管人认为上述资料可能导致基金出现风险的，有权要求基金管理人在投资流通受限证券前就该风险的消除或防范

措施进行补充书面说明，并保留查看基金管理人风险管理部门就基金投资流通受限证券出具的风险评估报告等资料的权利。否则，基金托管人有权拒绝执行有关指令。因拒绝执行该指令造成基金财产损失的，基金托管人不承担任何责任，并有权报告中国证监会。

如基金管理人和基金托管人无法就上述问题达成一致，应及时上报中国证监会请求解决。基金托管人履行了本协议规定的监督职责后，不承担任何责任。

8. 基金托管人对基金投资中小企业私募债券、中期票据的监督责任仅限于依据本协议第二条第（一）款第 2 项对投资比例和投资限制进行事后监督；除此外，无其它监督责任。如发现异常情况，应及时以书面形式通知基金管理人。基金管理人应积极配合和协助基金托管人进行监督和核查。基金因投资中小企业私募债券、中期票据导致的信用风险、流动性风险，基金托管人不承担任何责任。如因基金管理人原因导致基金出现损失的，基金托管人不承担任何责任。

基金管理人管理的基金在投资中小企业私募债、中期票据前，基金管理人须根据法律、法规、监管部门的规定，制定严格的关于投资中小企业私募债、中期票据的风险控制制度和流动性风险处置预案，管理人在此承诺将严格执行该风险控制制度和流动性风险处置预案。

（二）基金托管人应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。

（三）基金托管人发现基金管理人的投资运作及其他运作违反《基金法》、《基金合同》、基金托管协议等有关规定时，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应在下一个工作日及时核对，并以书面形式向基金托管人发出回函，进行解释或举证。

在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人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。

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的监督和核查，对基金托管人发出的书面提示，必须在规定时间内答复基金托管人并改正，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，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

若基金托管人发现基金管理人发出但未执行的投资指令或依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反《基金合同》约定的，应当立即通知基金管理人，并报告中国证监会。基金管理人的上述违规失信行为给基金财产或基金份额持有人造成的损失，由基金管理人承担。

对于必须于估值完成后方可获知的监控指标或依据交易程序已经成交的投资指令，基金托管人发现该投资指令违反法律法规或者违反《基金合同》约定的，应当立即通知基金管理人，并报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人有关重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠基金托管人根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍基金托管人进行有效监督，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）基金管理人有关基金托管人的业务核查**

基金管理人有关基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括但不限于基金托管人是否安全保管基金财产、是否分别开设基金财产的资金账户和证券账户、是否复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、是否根据管理人指令办理清算交收、进行相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

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、无故未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、《基金合同》、本托管协议及其他有关规定时，基金管理人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向基金管理人发出回函。在限期内，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。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应报告中国证监会。基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应立即报告中国证监会和银行业监督管理机构，同时通知基金托管人限期纠正。

基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复基金管理人并改正。

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

### **（四）基金财产的保管**

#### **（一）基金财产保管的原则**

1. 基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。
2. 基金托管人应按本协议规定安全保管托管财产。未经基金管理人的指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何财产（托管人主动扣收的汇划费除外）。托管人不对处于自身实际控制之外的账户及财产承担责任。
3. 基金托管人按照规定为托管的基金财产开设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，与基金托管人的其他业务和其他基金的托管业务实行严格的分账管理，确保基金财产的完整与独立。



5. 对于因基金认（申）购、基金投资过程中产生的应收财产，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托管人处的，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责任。

## （二）募集资金的验证

募集期内销售机构按销售与服务代理协议的约定，将认购资金划入基金管理人以法人名义在中国证券登记结算有限公司开立的备付金账户。该账户由基金管理人开立并管理。基金募集期满，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，由基金管理人聘请具有从事证券业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的 2 名以上（含 2 名）中国注册会计师签字方为有效。验资完成，基金管理人应将募集的属于本基金财产的全部资金划入基金托管人为基金开立的资产托管专户中，并确保划入的资金与验资金额相一致。基金托管人收到有效认购资金当日以书面形式确认资金到账情况，并及时将资金到账凭证传真给基金管理人，双方进行账务处理。

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事宜。

## （三）基金资产托管专户的开立和管理

基金托管人以基金托管人的名义或以基金的名义在其营业机构开设资产托管专户，并根据基金管理人合法合规的有效指令办理资金收付。基金管理人应根据法律法规及托管行的相关要求，提供开户所需的资料并提供其他必要协助。本基金的资产托管专户的预留印鉴的印章由基金托管人保管和使用。

本基金的一切货币收支活动，均需通过基金托管人或基金的资产托管专户进行。基金的资产托管专户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。除因本基金业务需要，基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立其他任何银行账户；亦不得使用以基金名义开立的银行账户进行本基金业务以外的活动。

资产托管专户的管理应符合《人民币银行结算账户管理办法》、《现金管理暂行条例》、《人民币利率管理规定》、《利率管理暂行规定》、《支付结算办法》以及银行业监督管理机构的其他有关规定。

## （四）基金证券账户与证券交易资金账户的开设和管理

基金托管人以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限公司上海分公司/深圳分公司开立专门的证券账户。

基金证券账户的开立和使用，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出借和未经对方同意擅自转让本基金的任何证券账户；亦不得使用本基金的任何证券账户进行本基金业务以外的活动。

基金证券账户的开立由基金托管人负责，管理和运用由基金管理人负责。

基金托管人保管证券账户卡原件。

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上海分公司/深圳分公司开立结算备付金账户，基金托管人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和基金托管人为履行结算参与人的义务所制定的业务规则执行。

#### （五）银行间市场债券托管和资金结算专户的开立和管理及市场准入备案

《基金合同》生效后，在符合监管机构要求的情况下，基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表基金进行交易；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、银行间市场清算所股份有限公司的有关规定，以本基金的名义分别在中央国债登记结算有限责任公司、银行间市场清算所股份有限公司开立债券托管账户和资金结算账户，并代表基金进行银行间市场债券交易的结算。基金管理人和基金托管人应共同负责完成银行间债券市场准入备案。

#### （六）其他账户的开设和管理

1、因业务发展而需要开立的其它账户，可以根据《基金合同》或有关法律法规的规定，经基金管理人和基金托管人协商一致后，由基金托管人负责为基金开立。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。

#### （七）基金投资银行存款账户的开立和管理

基金投资银行定期存款，基金管理人与基金托管人应比照证监会《关于货币市场基金投资银行存款有关问题的通知》的规定，就本基金投资银行存款业务签订书面协议。

基金投资银行定期存款应由基金管理人与存款银行总行或其授权分行签订总体合作协议，并将资金存放于存款银行总行或其授权分行指定的分支机构。

存款账户必须以基金名义开立，账户名称为基金名称，存款账户开户文件上加盖预留印鉴及基金管理人公章。

本基金投资银行存款时，基金管理人应当与存款银行签订具体存款协议，明确存款的类型、期限、利率、金额、账号、对账方式、支取方式、账户管理等细则。

为防范特殊情况下的流动性风险，定期存款协议中应当约定提前支取条款。

基金所投资定期存款存续期间，基金管理人、基金托管人应当与存款银行建立定期对账机制，确保基金银行存款业务账目及核对的真实、准确。

#### （八）基金财产投资的有关实物证券、银行定期存款存单等有价凭证的保管

基金财产投资的有关实物证券由基金托管人存放于基金托管人的保管库；其中实物证券也可存入中央国债登记结算有限责任公司或中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司或票据营业

中心的代保管库。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。属于基金托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、灭失，由此产生的责任应由基金托管人承担。基金托管人对基金托管人以外机构实际有效控制或保管的实物证券、银行定期存款存单对应的财产不承担保管责任。

#### **（九）与基金财产有关的重大合同的保管**

由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同的原件分别应由基金托管人、基金管理人保管。除本协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时应当保证基金一方持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人在合同签署后 5 个工作日内通过专人送达、挂号邮寄等安全方式将合同原件送达基金托管人处。合同原件应存放于基金管理人和基金托管人各自文件保管部门 15 年以上。

#### **（五）基金资产净值的计算和会计核算**

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

基金份额净值是指基金资产净值除以基金份额总数后得到的基金份额的资产净值。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，由此产生的误差计入基金财产。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。

基金管理人每工作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，由基金管理人依据基金合同和相关法律法规的规定对外公布。

#### **（六）基金份额持有人名册的保管**

基金管理人妥善保管的基金份额持有人名册，包括《基金合同》生效日、《基金合同》终止日、基金份额持有人大会权利登记日、每年 6 月 30 日、12 月 31 日的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容必须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的基金注册登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，基金管理人应按照目前相关规则保管基金份额持有人名册。保管方式可以采用电子或文档的形式。保管期限为 15 年。

#### **（七）争议解决方式**

（一）本协议适用中华人民共和国法律（为本协议之目的，在此不包括香港、澳门特别行政区和台湾地区法律），并从其解释。

（二）相关各方当事人同意，因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议，除经友好协商可以解决的，应提交华南国际经济贸易仲裁委员会，根据该会届时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在深圳，仲裁裁决是终局性的并对相关各方均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，相关各方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责，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。

## 第二十四部分 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，已开通基金网上交易系统，投资者可登陆本基金管理人的网站（[www.phfund.com](http://www.phfund.com)），更加方便、快捷地办理基金交易及信息查询等已开通的各项基金网上交易业务。同时，投资者可关注鹏华基金官方微信账号（微信号：[penghuajijin](https://www.penghuajijin.com)），快速实现净值查询功能，绑定个人账户之后，还可实现账户查询功能和交易功能。鹏华直销 APP（即鹏华 A 加钱包 APP）及鹏华基金微信号目前也支持鹏华基金客户进行非直销基金资产的查询服务。基金管理人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](http://www.phfund.com)）、短信平台、呼叫中心（400-6788-533；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，基金管理人将通过手机短信、E-MAIL 等方式为客户发送所定制的信息。手机短信可定制的信息包括：月度短信账单、鹏华早讯、持有基金周末净值等；邮件定制的信息包括：鹏友会周刊、电子对账单等信息。基金管理人将根据业务发展需要和实际情况，适时调整发送的定制信息内容。

### 三、在线咨询服务

投资者可通过在线客服、短信接收平台、鹏华基金官方微信（微信号：[penghuajijin](https://www.penghuajijin.com)）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（400-6788-533、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。

## 第二十五部分 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         |
|---|----------------------|------------|
| 鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金更新的招募说明书摘要        | 《上海证券报》              | 2020年7月15日 |
| 鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2020 年第 2 季度报告提示性公告          | 《证券时报》               | 2020年7月17日 |
| 鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2020 年第 2 季度报告提示性公告          | 《上海证券报》              | 2020年7月21日 |
| 鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2020 年第 2 季度报告提示性公告          | 《中国证券报》              | 2020年7月21日 |
| 鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2020 年第 2 季度报告提示性公告          | 《证券日报》               | 2020年7月21日 |
| 鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2020 年第 2 季度报告提示性公告          | 《证券时报》               | 2020年7月21日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与阳光人寿保险股份有限公司认\申购费率优惠活动的公告 | 《上海证券报》              | 2020年7月22日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与阳光人寿保险股份有限公司认\申购费率优惠活动的公告 | 《中国证券报》              | 2020年7月22日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与阳光人寿保险股份有限公司认\申购费率优惠活动的公告 | 《证券日报》               | 2020年7月22日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与阳光人寿保险股份有限公司认\申购费率优惠活动的公告 | 《证券时报》               | 2020年7月22日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中信银行股份有限公司认\申购费率优惠活动的公告   | 《上海证券报》              | 2020年8月3日  |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中信银行股份有限公司认\申购费率优惠活动的公告   | 《中国证券报》              | 2020年8月3日  |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中信银行股份有限公司认\申购费率优惠活动的公告   | 《证券日报》               | 2020年8月3日  |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中信银行股份有限公司认\申购费率优惠活动的公告   | 《证券时报》               | 2020年8月3日  |
| 鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2020 年中期报告提示性公告              | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券 | 2020年8月31日 |

|  |                 |             |
|--|-----------------|-------------|
|  | 报》、《证券日报》       |             |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告                   | 《上海证券报》         | 2020年9月17日  |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金在青岛意才基金销售有限公司调整认\申购费率优惠活动的公告 | 《上海证券报》         | 2020年9月18日  |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金在青岛意才基金销售有限公司调整认\申购费率优惠活动的公告 | 《中国证券报》         | 2020年9月18日  |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告                   | 《中国证券报》、《上海证券报》 | 2020年9月18日  |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金在青岛意才基金销售有限公司调整认\申购费率优惠活动的公告 | 《证券日报》          | 2020年9月18日  |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金在青岛意才基金销售有限公司调整认\申购费率优惠活动的公告 | 《证券时报》          | 2020年9月18日  |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告                   | 《证券时报》          | 2020年9月18日  |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下基金在直销柜台开展费率优惠活动的公告               | 《上海证券报》         | 2020年9月22日  |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下基金在直销柜台开展费率优惠活动的公告               | 《中国证券报》         | 2020年9月22日  |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下基金在直销柜台开展费率优惠活动的公告               | 《证券日报》          | 2020年9月22日  |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下基金在直销柜台开展费率优惠活动的公告               | 《证券时报》          | 2020年9月22日  |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下基金在成都华羿恒信基金销售有限公司暂停办理相关销售业务的公告   | 《上海证券报》         | 2020年9月29日  |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告                   | 《上海证券报》         | 2020年9月29日  |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下基金在成都华羿恒信基金销售有限公司暂停办理相关销售业务的公告   | 《中国证券报》         | 2020年9月29日  |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下基金在成都华羿恒信基金销售有限公司暂停办理相关销售业务的公告   | 《证券日报》          | 2020年9月29日  |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下基金在成都华羿恒信基金销售有限公司暂停办理相关销售业务的公告   | 《证券时报》          | 2020年9月29日  |
| 鹏华基金管理有限公司关于调整旗下部分基金投资范围并相应修改法律文件的公告           | 《上海证券报》         | 2020年10月14日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于调整旗下部分基金投资范围并相应修改法律文件的公告           | 《中国证券报》         | 2020年10月14日 |

|   |                |             |
|---|----------------|-------------|
| 鹏华基金管理有限公司关于调整旗下部分基金投资范围并相应修改法律文件的公告                      | 《证券日报》         | 2020年10月14日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于调整旗下部分基金投资范围并相应修改法律文件的公告                      | 《证券时报》         | 2020年10月14日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告                              | 《上海证券报》        | 2020年10月19日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告                              | 《证券时报》         | 2020年10月19日 |
| 鹏华基金管理有限公司旗下基金2020年第3季度报告提示性公告                            | 《上海证券报》        | 2020年10月28日 |
| 鹏华基金管理有限公司旗下基金2020年第3季度报告提示性公告                            | 《中国证券报》        | 2020年10月28日 |
| 鹏华基金管理有限公司旗下基金2020年第3季度报告提示性公告                            | 《证券日报》         | 2020年10月28日 |
| 鹏华基金管理有限公司旗下基金2020年第3季度报告提示性公告                            | 《证券时报》         | 2020年10月28日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告                              | 《证券时报》、《上海证券报》 | 2020年10月30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)有限公司申购(含定期定额申购)、赎回费率优惠活动的公告 | 《上海证券报》        | 2020年11月16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)有限公司申购(含定期定额申购)、赎回费率优惠活动的公告 | 《中国证券报》        | 2020年11月16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)有限公司申购(含定期定额申购)、赎回费率优惠活动的公告 | 《证券日报》         | 2020年11月16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)有限公司申购(含定期定额申购)、赎回费率优惠活动的公告 | 《证券时报》         | 2020年11月16日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与信达证券股份有限公司申购(含定期定额申购)费率优惠活动的公告        | 《上海证券报》        | 2020年12月15日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与信达证券股份有限公司申购(含定期定额申购)费率优惠活动的公告        | 《中国证券报》        | 2020年12月15日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与信达证券股份有限公司申购(含定期定额申购)费率优惠活动的公告        | 《证券日报》         | 2020年12月15日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与信达证券股份有限公司申购(含定期定额申购)费率优惠活动的公告        | 《证券时报》         | 2020年12月15日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于终止成都华羿恒信基金销售有限公司办理相关销售业务并为投资者办理转托管业务的提示性公告    | 《上海证券报》        | 2020年12月23日 |

|   |                               |             |
|---|-------------------------------|-------------|
| 鹏华基金管理有限公司关于终止成都华羿恒信基金销售有限公司办理相关销售业务并为投资者办理转托管业务的提示性公告    | 《中国证券报》                       | 2020年12月23日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于终止成都华羿恒信基金销售有限公司办理相关销售业务并为投资者办理转托管业务的提示性公告    | 《证券日报》                        | 2020年12月23日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于终止成都华羿恒信基金销售有限公司办理相关销售业务并为投资者办理转托管业务的提示性公告    | 《证券时报》                        | 2020年12月23日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下证券投资基金持有的股票估值方法变更的提示性公告                     | 《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》 | 2020年12月29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》                       | 2020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》                       | 2020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       | 《证券日报》                        | 2020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》                        | 2020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东莞农村商业银行股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告    | 《上海证券报》                       | 2021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银行股份有限公司定期定额申购和网上银行、手机银行申购费率优惠活动的公告 | 《上海证券报》                       | 2021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东莞农村商业银行股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告    | 《中国证券报》                       | 2021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银行股份有限公司定期定额申购和网上银行、手机银行申购费率优惠活动的公告 | 《中国证券报》                       | 2021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东莞农村商业银行股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告    | 《证券日报》                        | 2021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银行股份有限公司定期定额申购和网上银行、手机银行申购费率优惠活动的公告 | 《证券日报》                        | 2021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东莞农村商业银行股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告    | 《证券时报》                        | 2021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银行股份有限公司定期定额申购和网上银行、手机银行申购费率优惠活动的公告 | 《证券时报》                 | 2021年1月4日  |
| 鹏华基金管理有限公司关于鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金 2021 年第 1 次分红公告  | 《上海证券报》                | 2021年1月15日 |
| 鹏华基金管理有限公司高级管理人员变更公告                                      | 《中国证券报》                | 2021年1月16日 |
| 鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2020 年第 4 季度报告提示性公告                      | 《证券时报》                 | 2021年1月18日 |
| 鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2020 年第 4 季度报告提示性公告                      | 《上海证券报》                | 2021年1月21日 |
| 鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2020 年第 4 季度报告提示性公告                      | 《证券时报》                 | 2021年1月21日 |
| 鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2020 年第 4 季度报告提示性公告                      | 《中国证券报》                | 2021年1月22日 |
| 鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2020 年第 4 季度报告提示性公告                      | 《证券日报》                 | 2021年1月22日 |
| 鹏华基金管理有限公司高级管理人员变更公告                                      | 《证券时报》                 | 2021年1月28日 |
| 鹏华基金管理有限公司高级管理人员变更公告                                      | 《证券时报》                 | 2021年1月28日 |
| 鹏华基金管理有限公司澄清公告  | 《上海证券报》                | 2021年2月6日  |
| 鹏华基金管理有限公司关于对旗下基金中基金资产管理计划通过直销渠道申购、赎回、转换旗下公募基金免除相关费用的公告   | 《上海证券报》                | 2021年3月9日  |
| 鹏华基金管理有限公司关于对旗下基金中基金资产管理计划通过直销渠道申购、赎回、转换旗下公募基金免除相关费用的公告   | 《中国证券报》                | 2021年3月9日  |
| 鹏华基金管理有限公司关于对旗下基金中基金资产管理计划通过直销渠道申购、赎回、转换旗下公募基金免除相关费用的公告   | 《证券日报》                 | 2021年3月9日  |
| 鹏华基金管理有限公司关于对旗下基金中基金资产管理计划通过直销渠道申购、赎回、转换旗下公募基金免除相关费用的公告   | 《证券时报》                 | 2021年3月9日  |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告                              | 《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》 | 2021年3月13日 |
| 关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购贝泰妮首次公开发行 A 股的公告                      | 《中国证券报》                | 2021年3月19日 |
| 关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购贝泰妮首次公开发行 A 股的公告                      | 《证券时报》                 | 2021年3月19日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于直销渠道相关业务费率优惠活动的公告                             | 《上海证券报》                | 2021年3月22日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于直销渠道相关业务费率优惠活动的公告                             | 《中国证券报》                | 2021年3月22日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于直销渠道相关业务费率优惠活动的公告                             | 《证券时报》、《证券日报》          | 2021年3月22日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加珠                                     | 《中国证券报》                | 2021年3月30日 |

|   |                               |                 |
|---|-------------------------------|-----------------|
| 海盈米基金销售有限公司基金转换业务申购补差费率优惠活动的公告                                      |                               |                 |
| 鹏华基金管理有限公司旗下基金 2020 年年度报告提示性公告                                      | 《中国证券报》                       | 2021 年 3 月 30 日 |
| 鹏华基金管理有限公司旗下基金 2020 年年度报告提示性公告                                      | 《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》         | 2021 年 3 月 30 日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加珠海盈米基金销售有限公司基金转换业务申购补差费率优惠活动的公告                 | 《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》         | 2021 年 3 月 30 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和网上银行、手机银行申购费率优惠活动的公告           | 《上海证券报》                       | 2021 年 4 月 1 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和网上银行、手机银行申购费率优惠活动的公告           | 《中国证券报》                       | 2021 年 4 月 1 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和网上银行、手机银行申购费率优惠活动的公告           | 《证券日报》                        | 2021 年 4 月 1 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和网上银行、手机银行申购费率优惠活动的公告           | 《证券时报》                        | 2021 年 4 月 1 日  |
| 鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金收到关于深圳市万科前海公馆建设管理股份有限公司 2020 年度业绩补偿款的公告 | 《上海证券报》                       | 2021 年 4 月 10 日 |
| 鹏华基金管理有限公司澄清公告  | 《上海证券报》                       | 2021 年 4 月 10 日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中泰证券股份有限公司申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告                  | 《证券日报》                        | 2021 年 4 月 13 日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中泰证券股份有限公司申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告                  | 《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》        | 2021 年 4 月 13 日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与天风证券股份有限公司申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告                  | 《上海证券报》                       | 2021 年 4 月 16 日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与天风证券股份有限公司申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告                  | 《中国证券报》                       | 2021 年 4 月 16 日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与天风证券股份有限公司申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告                  | 《证券时报》                        | 2021 年 4 月 16 日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与北京展恒基金销售股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告              | 《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》 | 2021 年 4 月 19 日 |
| 鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2021 年第 1 季度报告提示性公告                                | 《上海证券报》                       | 2021 年 4 月 21 日 |

|   |                |                 |
|---|----------------|-----------------|
| 鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2021 年第 1 季度报告提示性公告        | 《中国证券报》        | 2021 年 4 月 21 日 |
| 鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2021 年第 1 季度报告提示性公告        | 《证券日报》         | 2021 年 4 月 21 日 |
| 鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2021 年第 1 季度报告提示性公告        | 《证券时报》         | 2021 年 4 月 21 日 |
| 关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购瑞华泰首次公开发行 A 股的公告        | 《上海证券报》、《证券日报》 | 2021 年 4 月 23 日 |
| 关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购志特新材首次公开发行 A 股的公告       | 《上海证券报》、《证券日报》 | 2021 年 4 月 23 日 |
| 关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购瑞华泰首次公开发行 A 股的公告        | 《中国证券报》        | 2021 年 4 月 23 日 |
| 关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购志特新材首次公开发行 A 股的公告       | 《中国证券报》        | 2021 年 4 月 23 日 |
| 关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购瑞华泰首次公开发行 A 股的公告        | 《证券时报》         | 2021 年 4 月 23 日 |
| 关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购志特新材首次公开发行 A 股的公告       | 《证券时报》         | 2021 年 4 月 23 日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告                | 《上海证券报》        | 2021 年 4 月 29 日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与珠海盈米基金销售有限公司相关费率优惠活动的公告 | 《上海证券报》        | 2021 年 5 月 14 日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与珠海盈米基金销售有限公司相关费率优惠活动的公告 | 《中国证券报》、《证券日报》 | 2021 年 5 月 14 日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与珠海盈米基金销售有限公司相关费率优惠活动的公告 | 《证券时报》         | 2021 年 5 月 14 日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于修订旗下部分公募基金基金合同和托管协议的公告          | 《上海证券报》        | 2021 年 5 月 25 日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于修订旗下部分公募基金基金合同和托管协议的公告          | 《中国证券报》        | 2021 年 5 月 25 日 |
| 鹏华基金管理有限公司关于修订旗下部分公募基金基金合同和托管协议的公告          | 《证券时报》         | 2021 年 5 月 25 日 |

上述披露事项的披露期间自 2020 年 06 月 16 日至 2021 年 06 月 15 日。

## 第二十六部分 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、基金销售机构等的办公场所，投资人可在办公时间免费查阅；也可在支付工本费后在合理时间内获取本招募说明书复制件或复印件，但应以招募说明书正本为准。投资人也可以直接登录基金管理人的网站进行查阅。

基金管理人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

## 第二十七部分 备查文件

一、备查文件包括：

- 1、中国证监会注册的鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金募集的文件
- 2、《鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金基金合同》
- 3、《鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金托管协议》
- 4、法律意见书
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、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人查阅方式：

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

2、查阅方式：投资人可在营业时间免费到存放地点查阅，也可按工本费购买复印。

鹏华基金管理有限公司

2021年07月