鹏华量化策略灵活配置混合型证券投资基金招募说明书

国证券监督管理委员会下发的《关于准予鹏

华量化策略灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》注册，进行募集。

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。

本基金属于混合型基金， 其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债

券型基金，低于股票型基金，属于证券投资基金中中高风险、中高预期收益的

品种。 投资人在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身

的风险承受能力，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括但

不限于：系统性风险、非系统性风险、管理风险、流动性风险、本基金特定风险

及其他风险等。 基金的过往业绩并不预示其未来表现，基金管理人管理的其

他基金的业绩并不构成对本基金表现的保证。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金

财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。 基金管理人提醒投资人基

金投资的“买者自负” 原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金

净值变化引致的投资风险，由投资人自行承担。 投资有风险，投资人在投资本

基金前应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同。

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》）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）、《证券投资

基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）等有关法律法规的规

定，以及《鹏华量化策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》（以下简称

基金合同）的约定编写。

本招募说明书阐述了鹏华量化策略灵活配置混合型证券投资基金（以下

简称“本基金” 或“基金” ）的投资目标、策略、风险、费率等与投资人投资决

策有关的必要事项，投资人在做出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

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。 基金投资人自依基金合

同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人，其持有基金

份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、基金

合同及其他有关规定享有权利、承担义务。 基金投资人欲了解基金份额持有

人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

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：指鹏华量化策略灵活配置混合型证券投资基金

2、基金管理人：指鹏华基金管理有限公司

3、基金托管人：指中国建设银行股份有限公司

4、 基金合同： 指《鹏华量化策略灵活配置混合型证券投资基金基金合

同》及对基金合同的任何有效修订和补充

5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《鹏华量化策

略灵活配置混合型证券投资基金托管协议》 及对该托管协议的任何有效修

订和补充

6、招募说明书或本招募说明书：指《鹏华量化策略灵活配置混合型证券

投资基金招募说明书》及其定期的更新

7、基金份额发售公告：指《鹏华量化策略灵活配置混合型证券投资基金

基金份额发售公告》

8、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文

件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、

通知等

9、《基金法》：指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会

第五次会议通过，并经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，并经2015年4@ 月24日第十二届

全国人民代表大会常务委员会第十四次会议修改的《中华人民共和国证券投

资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订

10、《销售办法》：指中国证监会2013年3月15日颁布、同年6月1日实施的

《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

11、《信息披露办法》：指中国证监会2004年6月8日颁布、同年7月1日实施

的《证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

12、《运作办法》： 指中国证监会2014年7月7日颁布、 同年8月8日实施的

《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

13、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

14、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

15、基金合同当事人：指受基金合同约束，根据基金合同享有权利并承担

义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人

16、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

17、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

18、合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管

理办法》及相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基

金的中国境外的机构投资者

19、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

20、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

21、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，发售基金份

额，办理基金份额的申购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等

业务

22、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

23、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

24、登记机构：指办理登记业务的机构。 基金的登记机构为鹏华基金管理

有限公司 或接受鹏华基金管理有限公司委托代为办理登记业务的

机构

25、基金账户：指登记机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人

所管理的基金份额余额及其变动情况的账户

26、基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售

机构办理认购、申购、赎回、转换及转托管等业务而引起的基金份额变动及结

余情况的账户

27、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

28、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

29、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

30、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

31、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

32、T日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请

的开放日

33、T+n日：指自T日起第n个工作日（不包含T日）

34、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

35、开放时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

36、《业务规则》：指《鹏华基金管理有限公司开放式基金业务规则》，是

规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金登记方面的业务规则，由基金

管理人和投资人共同遵守37、认购：指在基金募集期内，投资人申请购买基金

份额的行为

38、申购：指基金合同生效后，投资人根据基金合同和招募说明书的规定

申请购买基金份额的行为

39、赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同和招募说明书

规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为

40、基金转换：指基金份额持有人按照基金合同和基金管理人届时有效

公告规定的条件，申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转

换为基金管理人管理的其他基金基金份额的行为

41、转托管：指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变

更所持基金份额销售机构的操作

42、定期定额投资计划：指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期

申购日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定

银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式

43、巨额赎回：指本基金单个开放日，基金净赎回申请（赎回申请份额总

数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换

中转入申请份额总数后的余额）超过上一开放日基金总份额的10%

44、元：指人民币元

45、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

46、基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应

收申购款及其他资产的价值总和

47、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

48、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

49、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

50、指定媒介：指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网

站及其他媒介

51、不可抗力：指基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观

事件

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，现任国信证券股份有限公司董事长、党委书记，鹏华基金管理有限公司

董事长。

邓召明先生，董事，经济学博士，讲师，国籍：中国。 历任北京理工大学管

理与经济学院讲师、中国兵器工业总公司主任科员、中国证监会处长、南方基

金管理有限公司副总经理、中国证监会第六、七届发审委委员，现任鹏华基金

管理有限公司总裁、党总支书记。

孙煜扬先生，董事，经济学博士，国籍：中国。 历任贵州省政府经济体制改

革委员会主任科员、中共深圳市委政策研究室副处长、深圳证券结算公司常

务副总经理、深圳证券交易所首任行政总监、香港深业（集团）有限公司助理

总经理、香港深业控股有限公司副总经理、中国高新技术产业投资管理有限

公司董事长兼行政总裁、鹏华基金管理有限公司董事总裁、国信证券股份有

限公司副总裁、国信证券股份有限公司公司顾问。

周中国先生，董事，会计学硕士研究生，国籍：中国。 曾任深圳市华为技术

有限公司定价中心经理助理；2000年7月起历任国信证券有限责任公司资金

财务总部业务经理、外派财务经理、高级经理、总经理助理、副总经理、国信证

券股份有限公司人力资源总部副总经理、资金财务总部副总经理；2015年6月

至今任国信证券股份有限公司资金财务总部总经理。

Massimo Mazzini先生，董事，经济和商学学士。国籍：意大利。曾在安达信

（Arthur@ Andersen@ MBA） 从事风险管理和资产管理工作， 历任CA@ AIPG@

SGR投资总监、CAAM@ AI@ SGR及CA@ AIPG@ SGR首席执行官和投资总监、东

方汇理资产管理股份有限公司（CAAM@ SGR）投资副总监、农业信贷另类投

资集团（Credit@ Agricole@ Alternative@ Investments@ Group） 国际执行委员会委

员、意大利欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon@ Capital@ SGR@ S.p.A.）投资

方案部投资总监、Epsilon@ 资产管理股份公司（Epsilon@ SGR）首席执行官，欧

利盛资本股份公司（Eurizon@ Capital@ S.A.）（卢森堡）首席执行官和总经理。

现任意大利欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon@ Capital@ SGR@ S.p.A.）市

场及业务发展总监。

Andrea@Vismara先生，董事，法学学士，律师，国籍：意大利。 曾在意大利多

家律师事务所担任律师，先后在法国农业信贷集团（Credit@ Agricole@ Group）

东方汇理资产管理股份有限公司（CAAM@ SGR）法务部、产品开发部，欧利

盛资本资产管理股份公司（Eurizon@ Capital@ SGR@ S.p.A.）治理与股权部工作，

现在担任意大利欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon@ Capital@ SGR@ S.p.

A） 董事会秘书兼任企业事务部总经理， 欧利盛资本股份公司（Eurizon@

Capital@ S.A.）（卢森堡）企业服务部总经理。

史际春先生，独立董事，法学博士，国籍：中国。 历任安徽大学讲师、中国

人民大学副教授，现任中国人民大学法学院教授、博士生导师，国务院特殊津

贴专家，兼任中国法学会经济法学研究会副会长、北京市人大常委会和法制

委员会委员。

张元先生，独立董事，大学本科，国籍：中国。 曾任新疆军区干事、秘书、编

辑，甘肃省委研究室干事、副处长、处长、副主任，中央金融工作委员会研究室

主任，中国银监会政策法规部（研究局）主任（局长）等职务；2005年6月至

2007年12月，任中央国债登记结算有限责任公司董事长兼党委书记；2007年12

月至2010年12月，任中央国债登记结算有限责任公司监事长兼党委副书记。

高臻女士，独立董事，工商管理硕士，国籍：中国。 曾任中国进出口银行副

处长，负责贷款管理和运营，项目涉及制造业、能源、电信、跨国并购；2007年

加入曼达林投资顾问有限公司，现任曼达林投资顾问有限公司执行合伙人。

2、基金管理人监事会成员

黄俞先生，监事会主席，研究生学历，国籍：中国。 曾在中农信公司、正大

财务公司工作，曾任鹏华基金管理有限公司董事、监事，现任深圳市北融信投

资发展有限公司董事长。

陈冰女士，监事，本科学历，国籍：中国。 曾任国信证券股份有限公司资金

财务部会计、上海营业部财务科副科长、资金财务部财务科副经理、资金财务

部资金科经理、资金财务部主任会计师兼科经理、资金财务部总经理助理、资

金财务总部副总经理等，现任国信证券资金财务总部副总经理兼资金运营部

总经理、融资融券部总经理。

SANDRO@VESPRINI先生，监事，工商管理学士，国籍：意大利。先后在米

兰军医院出纳部、税务师事务所、菲亚特汽车发动机和变速器平台管控管理

团队工作、圣保罗IMI资产管理SGR企业经管部、圣保罗财富管理企业管控部

工作、曾任欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon@ Capital@ SGR@ S.p.A.）财务

管理和投资经理，现任欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon@ Capital@ SGR@

S.p.A.）财务负责人。

于丹女士，职工监事，法学硕士，国籍：中国。 历任北京市金杜（深圳）律

师事务所律师；2011年7月加盟鹏华基金管理有限公司，历任监察稽核部法务

主管，现任监察稽核部总经理助理。

郝文高先生，职工监事，大专学历，国籍：中国。 历任深圳奥尊电脑有限公

司证券基金事业部副经理、招商基金管理有限公司基金事务部总监；2011年7

月加盟鹏华基金管理有限公司，现任登记结算部总经理。

刘嵚先生，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，现任首席市场官兼市场发展部、北京分公司

总经理。

3、高级管理人员情况

何如先生，董事长，简历同前。

邓召明先生，董事，总裁，简历同前。

高阳先生，副总裁，特许金融分析师（CFA），经济学硕士，国籍：中国。 历

任中国国际金融有限公司经理，博时基金管理有限公司博时价值增长基金基

金经理、固定收益部总经理、基金裕泽基金经理、基金裕隆基金经理、股票投

资部总经理，现任鹏华基金管理有限公司副总裁。

邢彪先生，副总裁，工商管理硕士、法学硕士，国籍：中国。 历任中国人民

大学校办科员，中国证监会办公厅副处级秘书，全国社保基金理事会证券投

资部处长、股权资产部（实业投资部）副主任，并于2014年至2015年期间担任

中国证监会第16届主板发审委专职委员， 现任鹏华基金管理有限公司副总

裁。

高鹏先生，副总裁，经济学硕士，国籍：中国。 历任博时基金管理有限公司

监察法律部监察稽核经理， 鹏华基金管理有限公司监察稽核部副总经理、监

察稽核部总经理、职工监事、督察长，现任鹏华基金管理有限公司副总裁、电

子商务部总经理。

苏波先生，副总裁，管理学博士，国籍：中国。 历任深圳经济特区证券公司

研究所副所长、投资部经理，南方基金管理有限公司渠道服务二部总监助理，

易方达基金管理有限公司信息技术部总经理助理，鹏华基金管理有限公司总

裁助理、机构理财部总经理、职工监事，现任鹏华基金管理有限公司副总裁。

高永杰先生，督察长，法学硕士，国籍：中国。 历任中共中央办公厅秘书局

干部，中国证监会办公厅新闻处干部、秘书处副处级秘书、发行监管部副处

长、人事教育部副处长、处长，现任鹏华基金管理有限公司督察长。

韩亚庆先生，副总裁，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，现任鹏华基金管理有限公司副总

裁。

4、本基金拟任基金经理

余斌先生，国籍中国，经济学硕士，9年证券从业经验。 曾任职于招商证券

股份有限公司， 担任风险控制部市场风险分析师；2009年10月加盟鹏华基金

管理有限公司，历任机构理财部大客户经理、量化投资部量化研究员，先后从

事特定客户资产管理业务产品设计、量化研究等工作；2014年5月起担任鹏华

信息分级基金基金经理，2014年5月起兼任鹏华证券保险分级基金基金经理，

2014年11月起兼任鹏华国防分级基金基金经理，2015年4月起兼任鹏华酒分级

基金基金经理，2015年5月起兼任鹏华证券分级基金基金经理，2015年6月起兼

任鹏华环保分级基金基金经理。

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董事、总裁、党总支书记。

高阳先生，鹏华基金管理有限公司副总裁。

邢彪先生，鹏华基金管理有限公司副总裁。

高鹏先生，鹏华基金管理有限公司副总裁。

韩亚庆先生，鹏华基金管理有限公司副总裁。

梁浩先生，鹏华基金管理有限公司研究部总经理，鹏华新兴产业混合、鹏

华医药科技混合基金基金经理。

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。

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；

（上接B21版）

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

6、编制季度、半年度和年度基金报告；

7、计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；

8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；

9、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，保护投资人利益和公司合法权益；

（2）管理层牢固树立了内控优先的风险管理理念，并着力培养全体员工

的风险防范意识，营造浓厚的风险管理文化氛围，保证全体员工及时了解国

家法律法规和公司规章制度，使风险意识贯穿到公司各个部门、各个岗位和

各个环节；

（3）公司依据自身经营特点建立了包括岗位自控、相关部门和岗位之间

相互监督制衡、督察长和监察稽核部监督的、权责统一、严密有效的三道内控

防线；

（4）建立并不断完善内部控制体系及内部控制制度：自成立来，公司不

断完善内控组织架构、控制程序、控制措施以及控制职责，建立健全内部控制

体系。 通过不断地对内部控制制度进行修订和更新，公司的内部控制制度不

断走向完善；

（5） 建立健全各项管理制度和业务规章： 公司建立了包括投资管理制

度、基金会计制度、信息披露制度、监察稽核制度、信息技术管理制度、公司财

务制度等基本管理制度以及包括岗位设置、岗位职责、操作流程手册在内的

业务流程、规章等，从基本管理制度和业务流程上进行风险控制；

（6）建立了岗位分离、相互制衡的内控机制：公司在岗位设置上采取了

严格的分离制度，实现了基金投资与交易、交易与清算、公司会计与基金会计

等业务岗位的分离制度，形成了不同岗位之间的相互制衡机制，从岗位设置

上减少和防范操作及操守风险；

（7）建立健全了岗位责任制：公司通过健全岗位责任制使每位员工都能

明确自己的岗位职责和风险管理责任；

（8）构建风险管理系统：公司通过建立风险评估、预警、报告、控制以及

监督程序，并经过适当的控制流程，定期或实时对风险进行评估、预警、监督，

从而识别、评估和预警与公司管理及基金运作有关的风险，通过明晰的报告

渠道，对风险问题进行层层监督、管理、控制，使部门和管理层即时把握风险

状况并及时、快速作出风险控制决策；

（9）建立自动化监督控制系统：公司启用了恒生交易系统以及自行开发

的投资指标监控系统等计算机辅助控制系统，对投资比例限制、“禁止买入股

票名单” 、交叉交易等方面进行电子化控制，有效地防止了运作风险和操守风

险；

（10）不断强化投资纪律，严格实施股票库制度：公司不断强化投资纪

律，加强集体决策机制，各基金的行业配置比例、基金经理个股授权、基准仓

位等由投资决策委员会决定。 同时，公司建立了严格的股票库制度、禁止和限

制投资股票制度，并由研究小组负责维护，所有股票投资必须完全从股票库

中选择。 公司还建立了契约风险评估制度，定期对各基金遵守基金合同的情

况进行评估，防范契约风险。

5、基金管理人关于内部合规控制书的声明

（1）基金管理人确知建立、实施和维持内部控制制度是本公司董事会及

管理层的责任；

（2）本基金管理人承诺以上关于内部控制的披露真实、准确；

（3） 本基金管理人承诺根据市场变化和公司发展不断完善内部控制体

系和内部控制制度。

第四部分 基金托管人

一、基本情况

1、基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司（简称：中国建设银行）

住所：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

法定代表人：王洪章

成立时间：2004年09月17日

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12号

联系人：田青

联系电话：(010)/ 6759/ 5096

中国建设银行成立于1954年10月，是一家国内领先、国际知名的大型股

份制商业银行，总部设在北京。 中国建设银行于2005年10月在香港联合交易

所挂牌上市(股票代码939)，于2007年9月在上海证券交易所挂牌上市(股票代

码601939)。

2015/年末，本集团资产总额18.35/万亿元，较上年增长9.59%；客户贷款

和垫款总额10.49/万亿元，增长10.67%；客户存款总额13.67/万亿元，增长

5.96%。 净利润2,289/亿元，增长0.28%；营业收入6,052/亿元，增长6.09%，其中，

利息净收入增长4.65%，手续费及佣金净收入增长4.62%。 平均资产回报率

1.30%，加权平均净资产收益率17.27%，成本收入比26.98%，资本充足率

15.39%，主要财务指标领先同业。

物理与电子渠道协同发展。 营业网点“三综合” 建设取得新进展，综合

性网点数量达1.45/万个，综合营销团队2.15/万个，综合柜员占比达到88%。

启动深圳等8/家分行物理渠道全面转型创新试点，智慧网点、旗舰型、综合型

和轻型网点建设有序推进。 电子银行主渠道作用进一步凸显，电子银行和自

助渠道账务性交易量占比达95.58%，较上年提升7.55/个百分点；同时推广账

号支付、手机支付、跨行付、龙卡云支付、快捷付等五种在线支付方式，成功实

现绝大多数主要快捷支付业务的全行集中处理。

转型业务快速增长。 信用卡累计发卡量8,074/万张，消费交易额2.22/万

亿元，多项核心指标继续保持同业领先。 金融资产1,000/万以上的私人银行

客户数量增长23.08%，客户金融资产总量增长32.94%。 非金融企业债务融资

工具累计承销5,316/亿元，承销额市场领先。 资产托管业务规模7.17/万亿元，

增长67.36%；托管证券投资基金数量和新增只数均为市场第一。 人民币国际

清算网络建设再获突破，继伦敦之后，再获任瑞士、智利人民币清算行资格；

上海自贸区、新疆霍尔果斯特殊经济区主要业务指标居同业首位。

2015/年，本集团先后获得国内外各类荣誉总计122/项，并独家荣获美国

《环球金融》杂志“中国最佳银行” 、香港《财资》杂志“中国最佳银行” 及香

港《企业财资》杂志“中国最佳银行” 等大奖。 本集团在英国《银行家》杂志

2015/年“世界银行品牌1000/强” 中，以一级资本总额位列全球第二；在美国

《福布斯》杂志2015/年度全球企业2000/强中位列第二。

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保

险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII7托管处、养老金托管处、清算处、

核算处、跨境托管运营处、监督稽核处等10/个职能处室，在上海设有投资托

管服务上海备份中心，共有员工220/余人。 自2007/年起，托管部连续聘请外

部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工

作手段。

2、主要人员情况

赵观甫，投资托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行郑州市分行、总

行信贷部、总行信贷二部、行长办公室工作，并在中国建设银行河北省分行营

业部、总行个人银行业务部、总行审计部担任领导职务，长期从事信贷业务、

个人银行业务和内部审计等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行青岛分行、中

国建设银行总行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室，长期从事零售业

务和个人存款业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张力铮，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行建筑经

济部、信贷二部、信贷部、信贷管理部、信贷经营部、公司业务部，并在总行集

团客户部和中国建设银行北京市分行担任领导职务，长期从事信贷业务和集

团客户业务等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行会计部，

长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

3、基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一

直秉持“以客户为中心” 的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履

行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供

高质量的托管服务。 经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩

大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、

基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内

托管业务品种最齐全的商业银行之一。 截至2016/年一季度末，中国建设银

行已托管584只证券投资基金。 中国建设银行专业高效的托管服务能力和业

务水平，赢得了业内的高度认同。 中国建设银行自2009年至今连续五年被国

际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行” 。

二、基金托管人的内部控制制度

1、内部控制目标

作为基金托管人，中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法

规、行业监管规章和本行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确

保业务的稳健运行，保证基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、

完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

2、内部控制组织结构

中国建设银行设有风险与内控管理委员会，负责全行风险管理与内部控

制工作，对托管业务风险控制工作进行检查指导。 投资托管业务部专门设置

了监督稽核处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，具

有独立行使监督稽核工作职权和能力。

3、内部控制制度及措施

投资托管业务部具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制

制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；

业务人员具备从业资格；业务管理严格实行复核、审核、检查制度，授权工作

实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机

制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专

职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，

技术系统完整、独立。

三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

1、监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投

资运作。 利用自行开发的“托管业务综合系统——基金监督子系统” ，严格

按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、

投资范围、投资组合等情况进行监督，并定期编写基金投资运作监督报告，报

送中国证监会。 在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节

中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支

情况进行检查监督。

2、监督流程

（1）每工作日按时通过基金监督子系统，对各基金投资运作比例控制指

标进行例行监控，发现投资比例超标等异常情况，向基金管理人发出书面通

知，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，并及时报告中国证监会。

（2）收到基金管理人的划款指令后，对涉及各基金的投资范围、投资对

象及交易对手等内容进行合法合规性监督。

（3）根据基金投资运作监督情况，定期编写基金投资运作监督报告，对

各基金投资运作的合法合规性、投资独立性和风格显著性等方面进行评价，

报送中国证监会。

（4）通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求基

金管理人进行解释或举证，并及时报告中国证监会。

第五部分 相关服务机构

一、基金份额发售机构

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：0755-82021233

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：李筠

（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1001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

具体名单详见本基金份额发售公告。

基金管理人可根据有关法律法规要求，根据实情，选择其他符合要求的

机构销售本基金或变更上述销售机构，并及时公告。

二、登记机构

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

法定代表人：何如

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）82021106

传真：（0755）82021165

联系人：吴群莉

三、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

负责人：俞卫锋

办公地址：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：黎明

经办律师：黎明、丁媛

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

办公地址：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼

法定代表人：杨绍信

联系电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

联系人：陈熹

经办会计师：单峰、陈熹

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2016年10月14日证监许可[2016]2346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，请投资人就发售和认

购事宜仔细阅读本基金的基金份额发售公告。

一、基金运作方式和类型

契约型开放式，混合型基金

二、基金的存续期间

不定期

三、募集方式及场所

通过各销售机构的基金销售网点（包括基金管理人的直销中心及其他销

售机构的销售网点，具体名单见基金份额发售公告）公开发售。基金管理人可

以根据情况变更、增减销售机构，并另行公告。

四、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。

五、募集对象

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。

六、募集上限

本基金首次募集不设目标上限。

七、基金份额的面值、认购费用、认购价格及计算公式

1、基金份额面值：本基金份额发售面值为人民币1.00元。

2、认购费率

本基金对通过直销中心认购的养老金客户与除此之外的其他投资人实

施差别的认购费率。

养老金客户指基本养老基金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投

资运营收益形成的补充养老基金等，包括但不限于全国社会保障基金、可以

投资基金的地方社会保险基金、企业年金单一计划以及集合计划、商业养老

保险组合。 如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，基金

管理人可在招募说明书更新时或发布临时公告将其纳入养老金客户范围，并

按规定向中国证监会备案。 非养老金客户指除养老金客户外的其他投资人。

通过基金管理人的直销中心认购本基金的养老金客户适用下表特定认

购费率，其他投资人认购本基金份额的适用下表一般认购费率：

认购金额M（元） 一般认购费率 特定认购费率

M<100万 1.00% 0.40%

100万≤M<500万 0.50% 0.15%

M≥500万 每笔1000元 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、登记等募集期间发生的各项费

用。 投资人在一天之内如果有多笔认购，适用费率按单笔分别计算。

3、认购份额的计算

本基金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 =7认购金额/（1＋认购费率）；

认购费用 =7认购金额－净认购金额；

认购份额 =7（净认购金额＋认购利息）/基金份额面值。

认购份额的计算保留到小数点后2位， 小数点2位以后的部分四舍五入，

由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

利息折算的份额保留到小数点后两位， 小数点后两位以后部分舍去，由

此产生的误差计入基金财产。

例：某投资者（非养老金客户）认购本基金基金份额100,000元，所对应的

认购费率为1.00％。 假定该笔认购金额产生利息20元。 则认购份额为：

净认购金额＝100,000／（1＋1.00％）＝99,009.90元

认购费用＝100,000－99,009.90＝990.10元

认购份额＝99,009.90／1.00＝99,009.90份

利息折算份额＝20／1.00＝20.00份

认购份额总额＝99,009.90＋20.00=99,029.90份

即，若该投资者认购本基金基金份额100,000元，假定该笔认购金额产生

利息20元， 在基金合同生效时， 投资者账户登记有本基金基金份额99,029.90

份。

4、募集期利息的处理方式

有效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，其中利息转份额以登记机构的记录为准。

八、投资人对基金份额的认购

1、认购时间安排

投资人可在募集期内前往本基金销售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销售机构相关业务办

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

份额发售公告或各销售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，需按销售机构规定的方式全额缴款。

（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）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，投资人应及时查询并妥善行

使合法权利。 否则，由此产生的投资人任何损失由投资人自行承担。

4、认购的限额

（1）本基金销售机构每个基金账户单笔最低认购金额为10元，各销售机

构对本基金最低认购金额及交易级差有其他规定的，以各销售机构的业务规

定为准。

（2）直销中心的首次最低认购金额为50万元，追加认购单笔最低认购金

额为1万元，不设级差限制（通过本基金管理人基金网上交易系统等特定交易

方式认购本基金暂不受此限制）， 本基金直销中心单笔认购最低金额与认购

级差限制可由基金管理人酌情调整。

（3）本基金募集期间对单个投资人的累计认购金额不设限制。

九、募集资金的存放

基金合同生效前，投资人的认购款项只能存入专门账户，不得动用。

第七部分 基金合同的生效

一、基金备案的条件

本基金自基金份额发售之日起3个月内，在基金募集份额总额不少于2亿

份， 基金募集金额不少于2亿元人民币且基金认购人数不少于200人的条件

下，基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售，并在10

日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起10日内，向中国证监会

办理基金备案手续。

基金募集达到基金备案条件的，自基金管理人办理完毕基金备案手续并

取得中国证监会书面确认之日起，《基金合同》生效；否则《基金合同》不生

效。 基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对《基金合同》生效事宜

予以公告。 基金管理人应将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。

二、基金合同不能生效时募集资金的处理方式

如果募集期限届满，未满足基金备案条件，基金管理人应当承担下列责

任：

1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；

2、在基金募集期限届满后30日内返还投资者已交纳的款项，并加计银行

同期活期存款利息；

3、如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。

基金管理人、基金托管人和销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各

自承担。

三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

基金合同生效后， 连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人

或者基金资产净值低于5000万元的， 基金管理人应当在定期报告中予以披

露；连续60个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并

提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召

开基金份额持有人大会进行表决。

法律法规另有规定时，从其规定。

第八部分 基金份额的申购与赎回

一、申购和赎回场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。 具体的销售网点将由基金管

理人在招募说明书或其他相关公告中列明。 基金管理人可根据情况变更或增

减销售机构，并予以公告。 基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的

营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。

若基金管理人或其指定的销售机构开通电话、 传真或网上等交易方式，

投资人可以通过上述方式进行申购与赎回，具体办法由基金管理人或其指定

的销售机构另行公告。

二、申购和赎回的开放日及时间

1、开放日及开放时间

投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券

交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律

法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

基金合同生效后，若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更

或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的

调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

2、申购、赎回开始日及业务办理时间

基金管理人自基金合同生效之日起不超过3个月开始办理申购， 具体业

务办理时间在相关公告中规定。

基金管理人自基金合同生效之日起不超过3个月开始办理赎回， 具体业

务办理时间在相关公告中规定。

在确定申购开始与赎回开始时间后， 基金管理人应依照《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。

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

申购或者赎回或者转换。 投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申

购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的，其基金份额申购、赎回价格为下

一开放日基金份额申购、赎回的价格。

三、申购与赎回的原则

1、“未知价” 原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额

净值为基准进行计算；

2、“金额申购、份额赎回” 原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

4、赎回遵循“先进先出” 原则，即按照投资人认购、申购的先后次序进行

顺序赎回。

基金管理人可在法律法规允许的情况下，对上述原则进行调整。 基金管

理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介

上公告。

四、申购与赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式

投资人必须根据销售机构规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内

提出申购或赎回的申请。

2、申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时，必须全额交付申购款项，投资人交付申购款项，

申购成立；基金份额登记机构确认基金份额时，申购生效。 若资金在规定时间

内未全额到账则申购不成立，申购款项将退回投资人账户，基金管理人不承

担由此产生的利息损失。

基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；基金份额登记机构确认赎回

时，赎回生效。

投资人赎回生效后，基金管理人将在T＋7日（包括该日）内支付赎回款

项。 在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。

3、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为

申购或赎回申请日（T日），在正常情况下，本基金登记机构在T+1日内对该

交易的有效性进行确认。 T日提交的有效申请，投资人可在T+2日后（包括该

日）到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。 若

申购不成功，则申购款项退还给投资人。

基金销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代

表销售机构确实接收到申请。 申购、赎回申请的确认以登记机构的确认结果

为准。 对于申请的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利。

五、申购和赎回的限制

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、投资人通过销售机构申购本基金，单笔最低申购金额为10元，各销售

机构对本基金最低申购金额及交易级差有其他规定的，以各销售机构的业务

规定为准。 通过基金管理人直销中心申购本基金，首次最低申购金额为50万

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等

特定交易方式申购本基金暂不受此限制）。 本基金直销中心单笔申购最低金

额与申购级差限制可由基金管理人酌情调整。

3、投资人赎回本基金份额时，可申请将其持有的部分或全部基金份额赎

回；账户最低余额为5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5份时，该笔赎回业务应包括账户内全部基金份额，

否则，剩余部分的基金份额将被强制赎回。

4、基金管理人可以根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整上述

规定申购金额和赎回份额的数量限制。 基金管理人必须依照《信息披露办

法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。

六、申购和赎回的价格、费用及其用途

1、本基金份额净值的计算，保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五

入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。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。

2、申购费率

本基金对通过直销中心申购的养老金客户与除此之外的其他投资人实

施差别的申购费率。

养老金客户指基本养老基金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投

资运营收益形成的补充养老基金等，包括但不限于全国社会保障基金、可以

投资基金的地方社会保险基金、企业年金单一计划以及集合计划、商业养老

保险组合。 如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，基金

管理人可在招募说明书更新时或发布临时公告将其纳入养老金客户范围，并

按规定向中国证监会备案。 非养老金客户指除养老金客户外的其他投资人。

通过基金管理人的直销中心申购本基金的养老金客户适用下表特定申

购费率，其他投资人申购本基金份额的适用下表一般申购费率：

申购金额M（元） 一般申购费率 特定申购费率

M<100万 1.20% 0.48%

100万≤ M <500万 0.60% 0.18%

M≥ 500万 每笔1000元 每笔1000元

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取。 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。

申购费用由投资人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、

销售、登记等各项费用。

3、申购份额的计算及余额的处理方式

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

申购的有效份额单位为份，上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小

数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

例：某投资人（非养老金客户）投资50,000元申购本基金基金份额，对应

费率为1.20%，假设申购当日基金份额净值为1.0368元，则可得到的申购份额

为：

净申购金额＝50,000/（1＋1.20%）＝49,407.11元

申购费用＝50,000－49,407.11＝592.89元

申购份额＝49,407.11／1.0368＝47,653.46份

即：投资人（非养老金客户）投资50,000元申购本基金基金份额，假设申

购当日基金份额净值为1.0368元，则其可得到47,653.46份基金份额。

4、赎回费率

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎

回基金份额时收取。

本基金的赎回费率如下表所示：

持有年限（Y） 赎回费率

Y＜7日 1.50%

7日≤Y<30日 0.75%

30日≤Y＜6个月 0.50%

Y≥6个月 0

注：1个月为30日

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。 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。

5、赎回金额的计算及处理方式

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

赎回金额单位为元，计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后两位，

由此产生的收益或损失由基金财产承担。

例：某投资人赎回本基金10,000份基金份额，持有时间为3个月，对应的赎

回费率为0.50%，假设赎回当日基金份额净值是1.0685元，则其可得到的赎回

金额为：

赎回金额=10,000×1.0685=10,685.00元

赎回费用=10,685.00×0.5%=53.437元

净赎回金额=10,685.00-53.43=10,631.577元

即：投资人赎回本基金10,000份基金份额，持有期限为3个月，假设赎回当

日本基金基金份额净值是1.0685元，则其可得到的净赎回金额为10,631.57元。

6、基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并依

照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

7、 基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根

据市场情况制定基金促销计划，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。

七、拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

1、因不可抗力导致基金无法正常运作。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接

收投资人的申购申请。

3、证券/期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当

日基金资产净值。

4、 接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利

益时。

5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他

可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人利益的情形。

6、基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术故障等异常情

况导致基金销售系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。

7、 基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有

基金份额的比例达到或者超过50%，或者变相规避50%集中度的情形时。

8、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第1、2、3、5、6、8项暂停申购情形时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

资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。 在暂停申购的

情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付

赎回款项：

1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接

收投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。

3、证券/期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当

日基金资产净值。

4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

5、继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时，可暂停

接受投资人的赎回申请。

6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形时且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项的，基

金管理人应在当日报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足

额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总

量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。 若出现上述第4项所述

情形，按基金合同的相关条款处理。 基金份额持有人在申请赎回时可事先选

择将当日可能未获受理部分予以撤销。 在暂停赎回的情况消除时，基金管理

人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

九、巨额赎回的情形及处理方式

1、巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请（赎回申请份额总数加上

基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入

申请份额总数后的余额）超过前一开放日的基金总份额的10%，即认为是发

生了巨额赎回。

2、巨额赎回的处理方式

当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况

决定全额赎回或部分延期赎回。

（1） 全额赎回： 当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请

时，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。

3、巨额赎回的公告

当发生上述延期赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或

者招募说明书规定的其他方式在3个交易日内通知基金份额持有人， 说明有

关处理方法，同时在指定媒介上刊登公告。

十、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1、发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人当日应立即向中国证监

会备案，并在规定期限内在指定媒介上刊登暂停公告。

2、如发生暂停的时间为1日，基金管理人应于重新开放日，在指定媒介上

刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近1个开放日的基金份额净值。

3、如发生暂停的时间超过1日但少于2周（含2周），暂停结束，基金重新

开放申购或赎回时，基金管理人依照有关法律法规的规定在指定媒介上刊登

基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近1个开放日的基金份额净值。

4、如发生暂停的时间超过2周，暂停期间，基金管理人应每2周至少刊登

暂停公告1次。 当连续暂停时间超过2个月的，基金管理人可以调整刊登公告

的频率。 暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人依照有关法律法

规的规定在指定媒介上连续刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近

1个开放日的基金份额净值。

十一、基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及基金合同的规定决定开办本基

金与基金管理人管理的其他基金之间的转换业务，基金转换可以收取一定的

转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及基金合同的规定制

定并公告，并提前告知基金托管人与相关机构。

十二、基金的非交易过户

基金的非交易过户是指基金登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等

情形而产生的非交易过户以及登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过

户。 无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基

金份额的投资人。

继承是指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继

承；捐赠指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金

会或社会团体；司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持

有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。 办理非交易

过户必须提供基金登记机构要求提供的相关资料，对于符合条件的非交易过

户申请按基金登记机构的规定办理，并按基金登记机构规定的标准收费。

十三、基金的转托管

基金份额持有人可办理已持有基金份额在不同销售机构之间的转托管，

基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。

十四、定期定额投资计划

基金管理人可以为投资人办理定期定额投资计划，具体规则由基金管理

人另行规定。 投资人在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额，

每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所

规定的定期定额投资计划最低申购金额。

十五、基金份额的冻结和解冻

基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，

以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。

十六、基金份额的转让

在法律法规允许且条件具备的情况下，基金管理人可受理基金份额持有

人通过中国证监会认可的交易场所或者交易方式进行份额转让的申请并由

登记机构办理基金份额的过户登记。 基金管理人拟受理基金份额转让业务

的，将提前公告，基金份额持有人应根据基金管理人公告的业务规则办理基

金份额转让业务。

十七、其他业务

在不违反法律法规及中国证监会规定的前提下，基金管理人可在对基金

份额持有人利益无实质性不利影响的情形下办理基金份额的质押业务或其

他基金业务，基金管理人可制定相应的业务规则，并依照《信息披露办法》的

有关规定进行公告。

第九部分 基金的投资

一、投资目标

本基金通过灵活运用多种量化投资策略，在充分控制基金财产风险和保

证基金资产流动性的基础上，力争实现基金资产长期稳健的保值增值。

二、投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上

市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券

（含国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、次级债、

可转换债券、可交换债券等）、货币市场工具（含同业存单等）、权证、资产支

持证券、股指期货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相关规定）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行

适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为0%－95%；每个

交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金以

及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的

5%。

如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的

投资范围会做相应调整。

三、投资策略

1、资产配置策略

本基金依据宏观和行业经济变量、资本市场金融时间序列数据等构建量

化模型和工具对市场的投资者行为、市场情绪、风险偏好等进行系统分析和

评估。 通过基本面分析框架与量化模型相结合的方式综合评估不同大类资产

在不同时期的投资价值及其风险收益特征，在股票、债券和货币等资产间进

行大类资产的灵活配置。 在基金合同要求内，合理使用金融工具动态调整组

合的风险暴露，以期达到控制组合下行风险实现稳健增值的目标。

2、股票投资策略

本基金以量化方法构建股票组合，并结合基本面研究成果对股票组合进

行评估，剔除投资风险较大的个股，以期获得相对市场表现的长期稳定的超

额回报。 量化选股体系包括量化选股模型、风险评估模型以及组合优化模型

等。

（1）量化选股模型

本基金将以多因子量化选股模型构建股票组合。 多因子模型针对个股构

建价值（value）、质量（quality）、动量（momentum）、成长（growth）、一致预期

（consensus7 expectation）等因子，通过量化方法处理因子与个股超额回报之间

的特征关系，挑选出具有基本面逻辑支撑和统计意义有效的因子组合，进而

得出具有稳定超额回报的股票组合。由于宏观经济环境和市场环境总是变化

的，本基金将在充分评估的基础上对因子组合进行动态调整。

（2）风险评估模型

本基金将对股票组合的风险暴露进行分解，构建风险因子。 在分析个股

的风险因子暴露程度后， 通过量化方法对投资组合的风险进行综合评估，最

终将投资组合风险控制在目标范围内。

（3）组合优化模型

本基金将综合考虑量化选股模型、风险评估模型、交易和冲击成本、投资

品种和比例限制，最终得出优化目标下的个股及权重，形成组合优化模型。

3、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、信用策略等积极投资策略，灵活地调整组合的券种搭配，

精选安全边际较高的个券，力争实现组合的保值增值。

4、权证投资策略

本基金通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型及价值

挖掘策略、价差策略、双向权证策略等寻求权证的合理估值水平，追求稳定的

当期收益。

5、资产支持证券的投资策略

本基金将综合运用战略资产配置和战术资产配置进行资产支持证券的

投资组合管理，并根据信用风险、利率风险和流动性风险变化积极调整投资

策略，严格遵守法律法规和基金合同的约定，在保证本金安全和基金资产流

动性的基础上获得稳定收益。

6、股指期货投资策略

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目标，选择流动性好、交易

活跃的股指期货合约，充分考虑股指期货的风险收益特征，通过多头或空头

的套期保值策略，以改善投资组合的投资效果，实现股票组合的超额收益。

四、投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金股票资产占基金资产的比例为0%－95%；

（2）每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持

不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；

（3） 本基金持有一家公司发行的证券， 其市值不超过基金资产净值的

10%；

（4）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该

证券的10%；

（5）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的3%；

（6）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的

10%；

（7）本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金

资产净值的0.5%；

（8）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超

过基金资产净值的10%；

（9）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的

20%，中国证监会规定的特殊品种除外；

（10）本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得

超过该资产支持证券规模的10%；

（11）本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产

支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%；

（12）本基金应投资于信用级别评级为BBB以上（含BBB）的资产支持证

券。 基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，

应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出；

（13）基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金

的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的

总量；

（14）本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超

过基金资产净值的40%； 在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为17

年，债券回购到期后不展期；

（15）本基金总资产不得超过基金净资产的140%；

（16）本基金仅在投资股指期货时遵守下列要求：

1）本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过

基金资产净值的10%；

2）本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值

之和，不得超过基金资产净值的95%。 其中，有价证券指股票、债券（不含到期

日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含

质押式回购）等；

3）本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持

有的股票总市值的20%；

4）本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧

差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；

5）本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金

额不得超过上一交易日基金资产净值的20%；

（17）本基金投资流通受限证券，基金管理人应根据中国证监会相关规

定进行投资。 基金管理人应制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范

流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险；

（18）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（12）项外，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等

基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金

管理人应当在10个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例

符合基金合同的有关约定。 期间，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金

合同的约定。 基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起

开始。

法律法规或监管部门取消上述限制，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

沪深3007指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%

沪深3007 指数选样科学客观，行业代表性好，流动性高，抗操纵性强，是

目前市场上较有影响力的股票投资业绩比较基准。 而中证全债指数能够较好

的反映债券市场变动的全貌，适合作为本基金债券投资的比较基准。 基于本

基金的投资范围和投资比例限制，选用上述业绩比较基准能够忠实反映本基

金的风险收益特征。

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比较基准

时，本基金管理人与基金托管人协商一致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，但不需要召开基金份额持有人大会。

六、风险收益特征

本基金属于混合型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券

基金，低于股票型基金，属于证券投资基金中中高风险、中高预期收益的品

种。

第十部分 基金的财产

一、基金资产总值

基金资产总值是指购买的各类证券及票据价值、银行存款本息和基金应

收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和。

二、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

三、基金财产的账户

基金托管人根据相关法律法规、 规范性文件为本基金开立资金账户、证

券账户以及投资所需的其他专用账户。 开立的基金专用账户与基金管理人、

基金托管人、基金销售机构和基金登记机构自有的财产账户以及其他基金财

产账户相独立。

四、基金财产的保管和处分

本基金财产独立于基金管理人、 基金托管人和基金销售机构的财产，并

由基金托管人保管。 基金管理人、基金托管人、基金登记机构和基金销售机构

以其自有的财产承担其自身的法律责任，其债权人不得对本基金财产行使请

求冻结、扣押或其他权利。 除依法律法规和《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。

第十一部分 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

基金所拥有的股票、权证、债券、股指期货、银行存款本息、应收款项、其

它投资等资产及负债。

三、估值方法

1、交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易

所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未

发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交

易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证

券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市

价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

2、交易所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（税后）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；

（4）对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的固定收益品种，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、银行间市场交易的固定收益品种的估值

（1）银行间市场交易的固定收益品种（除同业存单外），选取第三方估

值机构提供的相应品种当日的估值数据进行估值；

（2）同业存单按估值日第三方估值机构提供的估值净价估值；选定的第

三方估值机构未提供估值价格的，按成本估值；

（3）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固定收

益品种，按成本估值。

4、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

（1）送股、转增股、配股和公开增发的新股，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。

5、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别

估值。

6、股指期货合约，以估值日结算价估值；估值日无结算价的，且最近交易

日后经济环境未发生重大变化的，以最近交易日的结算价估值。

7、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，

基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价

格估值。

8、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。 如有新增事项，

按国家最新规定估值。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方

法、 程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，

应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管

理人承担。 本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有

关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的

意见，按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。

四、估值程序

1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金

份额的余额数量计算，精确到0.0001元，小数点后第5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4位以内（含第4位）发生估

值错误时，视为基金份额净值错误。

基金合同的当事人应按照以下约定处理：

1、估值错误类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或登记机构、或

销售机构、或投资人自身的过错造成估值错误，导致其他当事人遭受损失的，

过错的责任人应当对由于该估值错误遭受损失当事人（“受损方” ）的直接

损失按下述“估值错误处理原则” 给予赔偿，承担赔偿责任。

上述估值错误的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、

数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等。

2、估值错误处理原则

（1）估值错误已发生，但尚未给当事人造成损失时，估值错误责任方应

及时协调各方，及时进行更正，因更正估值错误发生的费用由估值错误责任

方承担；由于估值错误责任方未及时更正已产生的估值错误，给当事人造成

损失的，由估值错误责任方对直接损失承担赔偿责任；若估值错误责任方已

经积极协调， 并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则

其应当承担相应赔偿责任。 估值错误责任方应对更正的情况向有关当事人进

行确认，确保估值错误已得到更正。

（2）估值错误的责任方对有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负

责，并且仅对估值错误的有关直接当事人负责，不对第三方负责。

（3） 因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义

务。 但估值错误责任方仍应对估值错误负责。 如果由于获得不当得利的当事

人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失（“受损方” ），

则估值错误责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对

获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的

当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的

赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支

付给估值错误责任方。

（4） 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的

方式。

（5）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/期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂

停营业时；

2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值

时；

3、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7项进行估值时，所造成的

误差不作为基金资产估值错误处理。

上接B23版）

（一）基金管理人对基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项

包括基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户等

投资所需账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、根据

基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

（二）基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实

行分账管理、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投

资信息等违反《基金法》、《基金合同》、本协议及其他有关规定时，应及时以

书面形式通知基金托管人限期纠正。基金托管人收到通知后应及时核对并以

书面形式给基金管理人发出回函，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定

期限内及时改正。 在上述规定期限内，基金管理人有权随时对通知事项进行

复查，督促基金托管人改正。 基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，

包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实

性，在规定时间内答复基金管理人并改正。

（三）基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应及时报告中国证

监会，同时通知基金托管人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。 基金托

管人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、

欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经基金管理人提出警告仍不

改正的，基金管理人应报告中国证监会。

四、基金财产的保管

（一）基金财产保管的原则

1、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。

2、基金托管人应安全保管基金财产。

3、 基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户等投资所

需账户。

4、基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的

完整与独立。

5、基金托管人按照《基金合同》和本协议的约定保管基金财产，如有特

殊情况双方可另行协商解决。 基金托管人未经基金管理人的指令，不得自行

运用、处分、分配本基金的任何资产（不包含基金托管人依据中国证券登记结

算有限责任公司结算数据完成场内交易交收、开户银行或登记结算机构扣收

结算费和账户维护费等费用）。

6、对于因为基金投资产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事

人确定到账日期并通知基金托管人， 到账日基金财产没有到达基金账户的，

基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金财产造成

损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金财产的损失，基金托管人

对此不承担任何责任。

7、除依据法律法规和《基金合同》的规定外，基金托管人不得委托第三

人托管基金财产。

（二）基金募集期间及募集资金的验资

1、 基金募集期间募集的资金应存于基金管理人在基金托管人的营业机

构开立的“基金募集专户” 。 该账户由基金管理人开立并管理。

2、基金募集期满或基金停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金

额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，基金管

理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人开立的基金银行账户，同

时在规定时间内， 聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验

资，出具验资报告。 出具的验资报告由参加验资的2名或2名以上中国注册会

计师签字方为有效。

3、若基金募集期限届满，未能达到《基金合同》生效的条件，由基金管理

人按规定办理退款等事宜。

（三）基金银行账户的开立和管理

1、基金托管人可以基金的名义在其营业机构开立基金的银行账户，并根

据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金

托管人保管和使用。

2、基金银行账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。 基金

托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立任何其他银行账户；亦不得

使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

3、基金银行账户的开立和管理应符合银行业监督管理机构的有关规定。

4、在符合法律法规规定的条件下，基金托管人可以通过基金托管人专用

账户办理基金资产的支付。

（四）基金证券账户和结算备付金账户的开立和管理

1、 基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司为基金开立基金托管

人与基金联名的证券账户。

2、基金证券账户的开立和使用，仅限于满足开展本基金业务的需要。 基

金托管人和基金管理人不得出借或未经对方同意擅自转让基金的任何证券

账户，亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

3、基金证券账户的开立和证券账户卡的保管由基金托管人负责，账户资

产的管理和运用由基金管理人负责。

证券账户开户费由基金管理人先行垫付,待托管产品启始运营后,基金管

理人可向基金托管人发送划款指令,将代垫开户费从本基金托管资金账户中

扣还基金管理人。

4、 基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司

开立结算备付金账户，并代表所托管的基金完成与中国证券登记结算有限责

任公司的一级法人清算工作，基金管理人应予以积极协助。 结算备付金、结算

保证金、交收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以及

基金管理人与基金托管人签署的《托管银行证券资金结算协议》执行。

5、 若中国证监会或其他监管机构在本托管协议订立日之后允许基金从

事其他投资品种的投资业务，涉及相关账户的开立、使用的，若无相关规定，

则基金托管人比照上述关于账户开立、使用的规定执行。

（五）债券托管专户的开设和管理

《基金合同》生效后，基金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、银行间市场登记结算机构的有关规定，在银行间市场登记结

算机构开立债券托管账户，持有人账户和资金结算账户，并代表基金进行银

行间市场债券的结算。基金管理人和基金托管人共同代表基金签订全国银行

间债券市场债券回购主协议。

（六）其他账户的开立和管理

1、 在本托管协议订立日之后， 本基金被允许从事符合法律法规规定和

《基金合同》约定的其他投资品种的投资业务时，如果涉及相关账户的开设

和使用，由基金管理人协助托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》

的约定，开立有关账户。 该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）基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券、银行存款开户证实书等有价凭证由基金

托管人存放于基金托管人的保管库，也可存入中央国债登记结算有限责任公

司、中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司/北京分公司或

票据营业中心的代保管库，保管凭证由基金托管人持有。 实物证券、银行定期

存款证实书等有价凭证的购买和转让，按基金管理人和基金托管人双方约定

办理。基金托管人对由基金托管人以外机构实际有效控制或保管的资产不承

担保管责任。

（八）与基金财产有关的重大合同的保管

与基金财产有关的重大合同的签署，由基金管理人负责。 由基金管理人

代表基金签署的、 与基金财产有关的重大合同的原件分别由基金管理人、基

金托管人保管。 除本协议另有规定外，基金管理人代表基金签署的与基金财

产有关的重大合同包括但不限于基金年度审计合同、基金信息披露协议及基

金投资业务中产生的重大合同，基金管理人应保证基金管理人和基金托管人

至少各持有一份正本的原件。基金管理人应在重大合同签署后及时以加密方

式将重大合同传真给基金托管人，并在三十个工作日内将正本送达基金托管

人处。 重大合同的保管期限为《基金合同》终止后15年。

五、基金资产净值计算和会计核算

（一）基金资产净值的计算、复核与完成的时间及程序

1、基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的金额。 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0.0001元，小数点后第五位四舍五入。 国家另有规定的，从其规定。

每个交易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，

由基金管理人按照规定对外公布。

（二）基金资产估值方法和特殊情形的处理

1、估值对象

基金所拥有的股票、权证、债券、股指期货和银行存款本息、应收款项、其

它投资等资产及负债。

2、估值方法

本基金所持有的投资品种，按如下原则进行估值 ：

（1）交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交

易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境

未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近

交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或

证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行

市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

（2）交易所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（税后）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；

4）对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的固定收益品种，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）银行间市场交易的固定收益品种的估值

1）银行间市场交易的固定收益品种（除同业存单外），选取第三方估值

机构提供的相应品种当日的估值数据进行估值。

2）同业存单按估值日第三方估值机构提供的估值净价估值；选定的第三

方估值机构未提供估值价格的，按成本估值。

3）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固定收益

品种，按成本估值。

（4）处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

1）送股、转增股、配股和公开增发的新股，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。

（5）同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分

别估值。

（6）股指期货合约，以估值日结算价估值；估值日无结算价的，且最近交

易日后经济环境未发生重大变化的，以最近交易日的结算价估值。

（7） 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值

的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值

的价格估值。

（8）相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。 如有新增事

项，按国家最新规定估值。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方

法、 程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，

应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管

理人承担。 本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有

关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的

意见，按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。

3、特殊情形的处理

基金管理人或基金托管人按估值方法的第（7）项进行估值时，所造成的

误差不作为基金资产估值错误处理。

（三）基金份额净值错误的处理方式

1、当基金份额净值小数点后4位以内(含第4位)发生差错时，视为基金份

额净值错误；基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报

基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；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；当发生净值计算

错误时，由基金管理人负责处理，由此给基金份额持有人和基金造成损失的，

应由基金管理人先行赔付，基金管理人按差错情形，有权向其他当事人追偿。

2、 当基金份额净值计算差错给基金和基金份额持有人造成损失需要进

行赔偿时， 基金管理人和基金托管人应根据实际情况界定双方承担的责任，

经确认后按以下条款进行赔偿：

(1)本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，与本基金有关的会计问

题，如经双方在平等基础上充分讨论后，尚不能达成一致时，按基金管理人的

建议执行，由此给基金份额持有人和基金财产造成的损失，由基金管理人负

责赔付。

(2)若基金管理人计算的基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告，

而且基金托管人未对计算过程提出疑义或要求基金管理人书面说明，基金份

额净值出错且造成基金份额持有人损失的，应根据法律法规的规定对投资者

或基金支付赔偿金，就实际向投资者或基金支付的赔偿金额，基金管理人与

基金托管人按照管理费和托管费的比例各自承担相应的责任。

(3)如基金管理人和基金托管人对基金份额净值的计算结果，虽然多次重

新计算和核对，尚不能达成一致时，为避免不能按时公布基金份额净值的情

形，以基金管理人的计算结果对外公布，由此给基金份额持有人和基金造成

的损失，由基金管理人负责赔付。

(4)由于基金管理人提供的信息错误（包括但不限于基金申购或赎回金

额等）， 进而导致基金份额净值计算错误而引起的基金份额持有人和基金财

产的损失，由基金管理人负责赔付。

3、由于证券交易所及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份额净值计算

错误，基金管理人、基金托管人免除赔偿责任。 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。

4、 基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算

尾差，以基金管理人计算结果为准。

5、前述内容如法律法规或者监管部门另有规定的，从其规定。 如果行业

另有通行做法，双方当事人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进

行协商。

（四）暂停估值与公告基金份额净值的情形

1、基金投资所涉及的证券/期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂

停营业时；

2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值

时；

3、中国证监会和《基金合同》认定的其他情形。

（五）基金会计制度

按国家有关部门规定的会计制度执行。

（六）基金账册的建立

基金管理人进行基金会计核算并编制基金财务会计报告。 基金管理人独

立地设置、记录和保管本基金的全套账册。 若基金管理人和基金托管人对会

计处理方法存在分歧，应以基金管理人的处理方法为准。 若当日核对不符，暂

时无法查找到错账的原因而影响到基金资产净值的计算和公告的，以基金管

理人的账册为准。

（七）基金财务报表与报告的编制和复核

1、财务报表的编制

基金财务报表由基金管理人编制，基金托管人复核。

2、报表复核

基金托管人在收到基金管理人编制的基金财务报表后， 进行独立的复

核。 核对不符时，应及时通知基金管理人共同查出原因，进行调整，直至双方

数据完全一致。

3、财务报表的编制与复核时间安排

(1)报表的编制

基金管理人应当在每月结束后5个工作日内完成月度报表的编制； 在每

个季度结束之日起15个工作日内完成基金季度报告的编制；在上半年结束之

日起60日内完成基金半年度报告的编制；在每年结束之日起90日内完成基金

年度报告的编制。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。《基金合同》

生效不足两个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者

年度报告。

(2)报表的复核

基金管理人应及时完成报表编制， 将有关报表提供基金托管人复核；基

金托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，基金管理人和基金托

管人应共同查明原因，进行调整，调整以国家有关规定为准。

基金管理人应留足充分的时间，便于基金托管人复核相关报表及报告。

（八）基金管理人应在编制季度报告、半年度报告或者年度报告之前及

时向基金托管人提供基金业绩比较基准的基础数据和编制结果。

六、基金份额持有人名册的保管

基金份额持有人名册至少应包括基金份额持有人的名称和持有的基金

份额。 基金份额持有人名册由基金注册登记机构根据基金管理人的指令编制

和保管，基金管理人和基金托管人应分别保管基金份额持有人名册，保存期

不少于15年。 如不能妥善保管，则按相关法规承担责任。

在基金托管人要求或编制半年报和年报前，基金管理人应将有关资料送

交基金托管人，不得无故拒绝或延误提供，并保证其真实性、准确性和完整

性。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外

的其他用途，并应遵守保密义务。

七、争议解决方式

因本协议产生或与之相关的争议，双方当事人应通过协商、调解解决，协

商、调解不能解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委

员会，仲裁地点为北京市，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲

裁规则进行仲裁。 仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力，仲裁费用由败诉

方承担。

争议处理期间，双方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责，各自

继续忠实、勤勉、尽责地履行《基金合同》和本托管协议规定的义务，维护基

金份额持有人的合法权益。

本协议受中国法律管辖。

八、托管协议的变更与终止

（一）托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行修改。 修改后的新协议，

其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突。 基金托管协议的变更报中国

证监会备案。

（二）托管协议终止的情形

1、《基金合同》终止；

2、基金托管人解散、依法被撤销、破产或由其他基金托管人接管基金资

产；

3、基金管理人解散、依法被撤销、破产或由其他基金管理人接管基金管

理权；

4、发生法律法规或《基金合同》规定的终止事项。

（三）基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起30个工作日

内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督

下进行基金清算。

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金

托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指

定的人员组成。 基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

3、基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清

理、估价、变现和分配。 基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

4、基金财产清算程序：

(1)《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；

(2)对基金财产和债权债务进行清理和确认；

(3)对基金财产进行估值和变现；

(4)制作清算报告；

(5)聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算

报告出具法律意见书；

(6)将清算结果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。

6、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。

7、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。

8、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。

9、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人提供，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

为丰富投资人的交易方式和渠道，基金管理人为投资人提供多种形式的

交易服务。

在营销渠道创新方面，本基金管理人大力发展基金电子商务，并已开通

基金网上交易系统，投资人可登陆本基金管理人的网站（www.phfund.com），

更加方便、快捷地办理基金交易及信息查询等已开通的各项基金网上交易业

务。 基金管理人也将不断努力完善现有技术系统和销售渠道，为投资人提供

更加多样化的交易方式和手段。

二、交易资料的寄送服务

基金管理人将向发生交易且基金管理人持有其真实、准确、完整联系方

式的基金份额持有人以书面或电子文件形式定期或不定期寄送新开户欢迎

信、交易对账单、《鹏友会》等资料。

三、信息定制服务

投资人可以通过基金管理人网站（www.phfund.com）、短信平台、呼叫中

心（400-6788-999；0755-82353668）等渠道提交信息定制申请，在申请获基金

管理人确认后，基金管理人将通过手机短信、E-MAIL等方式为客户发送所定

制的信息。 通过手机短信可定制的信息包括：月度短信账单、公司最新公告、

持有基金周末净值等；通过邮件定制的信息包括：鹏友会周刊、财经资讯、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。

四、在线咨询服务

投资人可通过登录本基金管理人网站进行信息查询，通过输入基金账户

号（或证件号码）和查询密码进入查询账户，享有交易查询、信息定制、资料

修改、对账单打印、理财刊物查阅等服务。

投资人可通过在线客服、 短信接收平台等网络通讯工具进行业务咨询，

基金管理人在工作时间内有专人在线提供咨询服务。

五、客户服务中心（CALL-CENTER）电话服务

呼叫中心（400-6788-999、0755-82353668）自动语音系统提供每周7×24

小时基金账户余额、交易情况、基金产品信息与服务等信息查询。

呼叫中心人工坐席提供工作日8：30－21：00的座席服务（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。

六、客户投诉受理服务

投资人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。

七、客户专家团

为持续改进客户服务工作，基金管理人建立“客户专家团” 机制，邀请客

户对客户服务工作提出意见和建议。

第二十一部分 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的内容与格式进行披露，并至

少在一种指定媒介上公告。

第二十二部分 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。

第二十三部分 备查文件

一、备查文件包括：

1、 中国证监会注册鹏华量化策略灵活配置混合型证券投资基金募集的

文件

2、《鹏华量化策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

3、《鹏华量化策略灵活配置混合型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

购买复印件。