# 鹏华丰润债券型证券投资基金上市交易公告书

**基金管理人：鹏华基金管理有限公司**
**基金托管人：中国建设银行股份有限公司**
**注册登记人：中国证券登记结算有限责任公司**
**上市地点：深圳证券交易所**
**上市时间：2010年12月16日**
**公告日期：2010年12月13日**

## 一、重要声明与提示

鹏华丰润债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）上市交易公告书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号<上市交易公告书的内容与格式>》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，本基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本基金托管人保证本报告书中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。

本公告书第七节“基金财务状况”未经审计。

凡本上市交易公告书未涉及的有关内容，请投资者详细查阅2010年10月29日刊登于《中国证券报》和鹏华基金管理有限公司网站（http://www.phfund.com.cn）的本基金招募说明书。

## 二、基金概览

1、基金简称：鹏华丰润债券封闭
场内简称：鹏华丰润
2、交易代码：160617
3、基金份额总额：1,335,591,800.74份（截止：2010年12月9日）
4、基金份额净值：1.001元（截止：2010年12月9日）
5、本次上市交易份额：595,646,018.00份
6、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所
7、上市交易日期：2010年12月16日
8、基金管理人：鹏华基金管理有限公司
9、基金托管人：中国建设银行股份有限公司

## 三、基金的募集与上市交易

（一）本基金上市前基金募集情况：

1、基金募集申请的核准机构和核准文号：中国证券监督管理委员会证监许可【2010】1378号

2、基金运作方式：基金合同生效后三年内（含三年）封闭运作，封闭期间投资者不能申购、赎回本基金份额，但可在深圳证券交易所上市交易；封闭期结束后转为上市开放式基金（LOF）

3、基金合同期限：不定期
4、发售日期：自2010年11月3日至2010年11月25日
5、发售价格：1.00元人民币
6、发售期限：23天
7、发售方式：场外、场内认购
8、发售机构：

（1）深圳证券交易所（场内）发售机构：

本基金场内发售的机构为具有基金代销业务资格并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的深圳证券交易所会员单位，具体名单详见深圳证券交易所网站（www.szse.cn）。

（2）柜台（场外）发售机构：

1）直销机构：鹏华基金管理有限公司

2）代销银行：中国建设银行、中国工商银行、中国农业银行、交通银行、中国银行、招商银行、深圳发展银行、平安银行、中信银行、北京银行、杭州银行、宁波银行、东莞银行、华夏银行、浦发银行等。

3）其他代销机构：国泰君安证券股份有限公司、中信建投证券有限责任公司、国信证券股份有限公司、华泰联合证券有限责任公司、招商证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、湘财证券有限责任公司、渤海证券有限责任公司、华泰证券有限责任公司、长城证券有限责任公司、东北证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、齐鲁证券有限责任公司、光大证券股份有限公司、东莞证券有限责任公司、宏源证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、财富证券有限责任公司、财通证券有限责任公司、华林证券有限责任公司、广州证券有限责任公司、国联证券股份有限公司、江海证券有限公司、方正证券有限责任公司、信达证券股份有限公司、华龙证券有限责任公司、广发华福证券有限责任公司、东兴证券股份有限公司等。

9、验资机构名称：普华永道中天会计师事务所有限公司

10、募集资金总额及入账情况：本次募集净认购额（不含利息）为1,335,072,301.75元人民币，按照每一基金份额面值人民币1.00元计算，折算成基金份额计1,335,072,301.75份，有效认购户数为5,226户。认购资金在本基金验资确认日之前产生的银行利息共计520,545.27元，按照本基金基金合同的约定，其中519,498.99元折算为基金份额分别计入各基金份额持有人基金账户，归基金份额持有人所有；其余的1,046.28元为利息折份额计算尾差归入基金财产。上述募集资金及其利息折算的合计基金总份额为1,335,591,800.74份基金份额。

募集资金及利息已于2010年12月1日全额划入本基金在基金托管人中国建设银行股份有限公司开立的基金托管专户。

11、本基金募集备案情况：根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等相关法律、法规的规定以及《鹏华丰润债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）的有关约定，本基金募集结果符合备案条件，鹏华基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）已向中国证监会办理完毕基金备案手续，并于2010年12月2日获中国证监会书面确认，本基金合同自该日起正式生效。基金合同生效之日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

12、基金合同生效日：2010年12月2日。
13、基金合同生效日的基金份额总额：1,335,591,800.74份。

（二）本基金上市交易的主要内容：

1、基金上市交易的核准机构和核准文号：深圳证券交易所深证上【2010】407号
2、上市交易日期：2010年12月16日
3、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所。投资者在深圳证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金交易。
4、基金简称：鹏华丰润债券封闭
场内简称：鹏华丰润
5、交易代码：160617
6、本次上市交易份额：595,646,018.00份
7、基金资产净值的披露：开放式基金每日收市后对基金资产净值进行的估值

基金管理人每个开放日对基金资产估值。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，基金托管人复核。基金管理人于每个工作日交易结束后将经过基金托管人复核的基金净值传给深交所，深交所于次日通过行情系统“市盈率Ⅰ”揭示。根据《基金法》，开放式基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此基金管理人对公布的基金净值负责。

8、未上市交易份额的流通规定：未上市交易的份额托管在场外，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，将其跨系统转托管至深圳证券交易所场内后即可上市流通。

## 四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

截至2010年12月9日的场内基金份额持有情况：
场内基金份额持有人户数：2,560户
平均每户持有的场内基金份额：232,674.23份
场内机构投资者持有的基金份额及占场内基金总份额比例：机构持有451,501,845.00份，占75.80%
场内个人投资者持有的基金份额及占场内基金总份额比例：个人持有144,144,173.00份，占24.20%
场内基金前十名持有人情况：

| 序号 | 持有人名称（全称） | 持有基金份额（份） | 占场内总份额比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 海通证券股份有限公司 | 100,005,000.00 | 16.79% |
| 2 | 兴业证券股份有限公司 | 50,002,500.00 | 8.39% |
| 2 | 招商证券股份有限公司 | 50,002,500.00 | 8.39% |
| 3 | 中山市玛丽艳娜美容品有限公司 | 40,010,780.00 | 6.72% |
| 4 | 远光软件股份有限公司 | 40,009,200.00 | 6.72% |
| 5 | 扬州完美日用品有限公司 | 25,006,750.00 | 4.20% |
| 6 | 渤海证券股份有限公司 | 20,002,799.00 | 3.36% |
| 7 | 国元农业保险股份有限公司-自有资金 | 20,001,600.00 | 3.36% |
| 8 | 申银万国证券股份有限公司 | 20,000,990.00 | 3.36% |
| 9 | 光大永明人寿保险有限公司 | 15,003,150.00 | 2.52% |
| 10 | 华泰证券股份有限公司 | 15,000,900.00 | 2.52% |
| 合计 |  | 395,046,169.00 | 66.32% |

注：由于四舍五入的原因，占场内总份额比例分项之和与合计可能有尾差。

## 五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人
1、名称：鹏华基金管理有限公司
2、法定代表人：何如
3、总经理：邓召明
4、注册资本：1.5亿元人民币
5、注册地址：深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心43层
6、设立批准文号：中国证监会证监基字［1998］31号
7、工商登记注册的法人营业执照文号：4403011013037
8、经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务。
9、存续期间：持续经营

10、股东及其出资比例：公司股东由国信证券有限公司、意大利欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）、深圳市北融信投资发展有限公司组成，三家股东的出资比例分别为50%、49%、1%。

11、内部组织结构及职能：

基金管理部
负责公司公募基金的投资管理工作。
机构投资部
负责社保基金和其它委托理财业务的投资管理工作。
研究部
在公司既定的投资理念和研究理念的基础上，以系统性的研究方法和高质量的研究成果为公司投资部门提供持续有效的支持。
机构理财部
负责开展专户理财、社保、企业年金等除投资以外的业务。
集中交易室
负责执行公司既定的各基金的投资指令并及时反馈市场信息。
市场发展部
负责公司渠道管理以及客户服务工作。
营销策划部
负责公司营销策划和品牌宣传工作。
电子商务部
负责公司电子商务平台的搭建，业务推广以及公司网站的建设、更新、内容维护等工作。
登记结算部
负责公司旗下基金的注册登记、清算和会计工作。
监察稽核部
负责对公司管理和基金运作合法合规性进行全方位的严格监控，及时防范风险事件的发生。
总裁办公室
负责公司财务管理、人事劳资管理、日常行政事务管理及对外信息披露。
信息技术部
负责公司的计算机设备维护、系统开发及网络运行和维护。
产品规划部
负责制定公司产品规划与发展策略以及产品设计、产品管理和产品研究工作，完善公司产品线，丰富公司产品储备。
国际业务部
负责QDII等海外投资研究等相关业务。开展QDII基金投资组合管理；进行产品研究分析，构建投资组合。
固定收益部
负责公司固定收益证券的研究、投资工作。
北京分公司
主要负责北方地区的基金销售业务。
上海分公司
主要负责华东区域的基金销售业务。
武汉分公司
主要负责华中区域的基金销售业务。
广州分公司
主要负责华南区域的基金销售业务。

12、人员情况：截至2010年11月30日，公司共有员工206人，其中10人具有博士学位，占员工总数4.85%、117人具有硕士学历，占员工总数的56.80%，拥有本科学历的员工共65人，占员工总数的31.55%、大专及以下学历14人，占员工总数6.80%

13、信息披露负责人及咨询电话：程国洪，0755-82021186

14、基金管理业务情况：

截至目前，鹏华基金管理有限公司旗下共管理18只开放式基金和2只封闭式基金及六只社保投资组合，管理的总资产超过1000亿元。旗下管理的开放式基金有鹏华货币市场证券投资基金、鹏华普天收益证券投资基金、鹏华普天债券投资基金（普天债券A、普天债券B）、鹏华行业成长证券投资基金、鹏华中国50开放式证券投资基金、鹏华价值优势股票型证券投资基金（LOF）、鹏华动力增长混合型证券投资基金（LOF）、鹏华优质治理股票型证券投资基金（LOF）、鹏华丰收债券型证券投资基金、鹏华盛世创新股票型证券投资基金（LOF）、鹏华沪深300指数证券投资基金（LOF）、鹏华精选成长股票型证券投资基金、鹏华中证500指数证券投资基金（LOF）、鹏华信用增利债券型证券投资基金（鹏华信用增利A、鹏华信用增利B）、上证民营企业50交易型开放式指数证券投资基金、鹏华上证民营企业50交易型开放式指数证券投资基金联接基金、鹏华环球发现证券投资基金、鹏华丰润债券型证券投资基金。封闭式基金有基金普惠、普丰；以及全国社会保障基金六个委托投资组合。

15、本基金基金经理：

阳先伟先生，经济学硕士，8年证券从业经验，先后在民生证券、国海证券等机构从事债券研究及投资组合管理工作，历任研究员、高级经理等职务。2004年9月加盟鹏华基金管理有限公司，从事债券及宏观研究工作，曾任普天债券开放式证券投资基金基金经理助理，2006年12月起至今担任普天债券基金基金经理，2008年5月起至今担任鹏华丰收债券基金基金经理。阳先伟先生具备基金从业资格。

（二）基金托管人情况
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：郭树清
成立时间：2004年09月17日
组织形式：股份有限公司
注册资本：贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元人民币
存续期间：持续经营
基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字［1998］12号
联系人：尹东
联系电话：（010）6759 5003

中国建设银行股份有限公司拥有悠久的经营历史，其前身“中国人民建设银行”于1954年成立，1996年易名为“中国建设银行”。中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于2004年9月分立而成立，承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行（股票代码：939）于2005年10月27日在香港联合交易所主板上市，是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006年9月11日，中国建设银行又作为第一家H股公司晋身恒生指数。2007年9月25日中国建设银行A股在上海证券交易所上市并开始交易。A股发行后中国建设银行的已发行股份总数为：233,689,084,000股（包括224,689,084,000股H股及9,000,000,000股A股）。

截至2010年06月30日，中国建设银行实现净利润707.79亿元，较上年同期增长26.75%。手续费及佣金净收入336.42亿元，较上年同期增长43.63%，在营业收入中的占比提高至21.94%。年化平均资产回报率为1.43%，年化加权平均净资产收益率为24.00%，分别较上年同期提高0.09个百分点和1.46个百分点；净利息收益率为2.41%，呈现企稳回升态势。信贷资产质量继续稳定向好，不良贷款较上年末实现“双降”，拨备覆盖率大幅提高至204.72%。

中国建设银行在中国内地设有1.3万余个分支机构，并在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京、首尔、纽约及胡志明市设有分行，在悉尼设有代表处，设立了安徽繁昌建信村镇银行、浙江青田建信华侨村镇银行、浙江武义建信村镇银行、陕西安塞建信村镇银行4家村镇银行，拥有建行亚洲、建银国际、建行伦敦、建信基金、建信金融租赁、建信信托等多家子公司。全行已安装运行自动柜员机（ATM）37,487台，拥有员工约30万人，为客户提供全面的金融服务。

中国建设银行得到市场和业界的支持和广泛认可，2010年上半年共获得50多个国内外奖项。本集团在英国《银行家》杂志公布的“全球商业银行品牌十强”列第2位，为中资银行之首；在美国《福布斯》杂志公布的“2010中国品牌价值50强”列第3位；荣获英国《金融时报》颁发的“中国最佳渠道银行”；被《亚洲金融》杂志评为2010年度“中国最佳银行”；连续三年被香港《资本》杂志评为“中国杰出零售银行”；被中国红十字会总会授予“中国红十字杰出奉献奖章”。

中国建设银行总行设投资托管服务部，下设综合制度处、基金市场处、资产托管处、QFII托管处、基金核算处、基金清算处、监督稽核处和投资托管团队、涉外资产核算团队、养老金托管服务团队、养老金托管市场团队、上海备份中心等12个职能处室，现有员工130余人。2008年，中国建设银行一次性通过了根据美国注册会计师协会（AICPA）颁布的审计准则公告第70号（SAS70）进行的内部控制审计，安永会计师事务所为此提交了“业内最干净的无保留意见的报告”，中国建设银行成为取得国际同业普遍认同并接受的SAS70国际专项认证的托管银行。

（三）基金验资机构

名称：普华永道中天会计师事务所有限公司@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）61238888@经办注册会计师：薛竞、陈熹

## 六、基金合同摘要

（一）基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

1.基金份额持有人的权利、义务

（1）基金份额持有人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的权利为：
1）分享基金财产收益；
2）参与分配清算后的剩余基金财产；
3）依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；
4）按照规定要求召开基金份额持有人大会；
5）出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
6）查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
7）监督基金管理人的投资运作；
8）对基金管理人、基金托管人、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
9）法律法规和基金合同规定的其他权利。
每份基金份额具有同等的合法权益。

（2）基金份额持有人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的义务为：
1）遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；
2）交纳基金认购、申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用；
3）在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；
4）不从事任何有损基金及其他基金份额持有人合法权益的活动；
5）执行生效的基金份额持有人大会决议；
6）返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人及基金管理人的代理人、基金托管人、代销机构、其他基金份额持有人处获得的不当得利；
7）法律法规和基金合同规定的其他义务。

2.基金管理人的权利、义务

（1）基金管理人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的权利为：
1）自本基金合同生效之日起，依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用基金财产；
2）依照基金合同获得基金管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；
3）发售基金份额；
4）依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
5）在符合有关法律法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则，在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金的除调高托管费率和管理费率之外的相关费率结构和收费方式；
6）根据本基金合同及有关规定监督基金托管人，对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；
7）在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回申请；
8）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、融券；
9）自行担任或选择、更换注册登记机构，获取基金份额持有人名册，并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查；
10）选择、更换代销机构，并依据基金销售服务代理协议和有关法律法规，对其行为进行必要的监督和检查；
11）选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；
12）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
13）依法召集基金份额持有人大会；
14）法律法规和基金合同规定的其他权利。

（2）基金管理人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的义务为：
1）依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
2）办理基金备案手续；
3）自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；
4）配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；
5）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；
6）除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；
7）依法接受基金托管人的监督；
8）计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；
9）采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；
10）按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
11）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
12）编制季度、中期和年度基金报告；
13）严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
14）保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；
15）按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；
16）依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
17）保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
18）以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
19）组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
20）因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
21）基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；
22）按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；
23）面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；
24）执行生效的基金份额持有人大会决议；
25）不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；
26）依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利，不谋求对上市公司的控股和直接管理；
27）法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

3.基金托管人的权利、义务

（1）基金托管人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的权利为：
1）依基金合同约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；
2）监督基金管理人对本基金的投资运作；
3）自本基金合同生效之日起，依法保管基金资产；
4）在基金管理人更换时，提名新任基金管理人；
5）根据本基金合同及有关规定监督基金管理人，对于基金管理人违反本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；
6）依法召集基金份额持有人大会；
7）按规定取得基金份额持有人名册资料；
8）法律法规和基金合同规定的其他权利。

（2）基金托管人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的义务为：
1）安全保管基金财产；
2）设立专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；
3）对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立；
4）除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；
5）保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
6）按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；
7）保守基金商业秘密，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；
8）对基金财务会计报告、中期和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人有未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；
9）保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
10）按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
11）办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
12）复核、审查基金管理人计算的基金资产净值和基金份额申购、赎回价格；
13）按照规定监督基金管理人的投资运作；
14）按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
15）依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；
16）按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；
17）因违反基金合同导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
18）基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿；
19）参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
20）面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行业监督管理机构，并通知基金管理人；
21）执行生效的基金份额持有人大会决议；
22）不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；
23）建立并保存基金份额持有人名册；
24）法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

（二）基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

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

2.召开事由

（1）当出现或需要决定下列事由之一的，经基金管理人、基金托管人或持有基金份额10%以上（含10%，下同）的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）提议时，应当召开基金份额持有人大会：
1）终止基金合同；
2）转换基金运作方式，本基金依据本基金合同的约定直接转换运作方式的除外；
3）变更基金类别；
4）变更基金投资目标、投资范围或投资策略（法律法规、中国证监会和基金合同另有规定的除外）；
5）变更基金份额持有人大会程序；
6）更换基金管理人、基金托管人；
7）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但法律法规要求提高该等报酬标准的除外；
8）本基金与其他基金的合并；
9）封闭期内基金扩募；
10）终止基金上市，但因本基金不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的除外；
11）对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；
12）法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

（2）出现以下情形之一的，可由基金管理人和基金托管人协商后修改基金合同，不需召开基金份额持有人大会：
1）调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；
2）在法律法规和本基金合同规定的范围内变更基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；
3）因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；
4）对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生重大变化；
5）基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；
6）按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

（3）基金合同生效后，当出现下述情形之一时，基金管理人应当召集召开基金份额持有人大会审议基金合同终止或与其他基金合并事项：
1）连续90个工作日基金份额持有人少于200人；
2）连续90个工作日基金资产规模少于3000万人民币；
3）连续90个工作日本基金前十大基金份额持有人持有本基金90%以上的基金份额。

发生上述情形之一时，基金份额持有人大会应按照本基金合同的规定程序召开，并就因上述情形的发生是否终止本基金合同的事项或与其他基金合并的事项以特别决议方式进行表决。

3.召集人和召集方式

（1）除法律法规或本基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。基金管理人未按规定召集或者不能召集时，由基金托管人召集。

（2）基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当自行召集。

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

（4）代表基金份额10%以上的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，代表基金份额10%以上的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会，但应当至少提前30日向中国证监会备案。

（5）基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

4.召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1）基金份额持有人大会的召集人（以下简称“召集人”）负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。召开基金份额持有人大会，召集人必须于会议召开日前30日在指定媒体公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容：
a）会议召开的时间、地点和出席方式；
b）会议拟审议的主要事项；
c）会议形式；
d）议事程序；
e）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人权益登记日；
f）代理投票的授权委托书的内容要求（包括但不限于代理人身份、代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；
g）表决方式；
h）会务常设联系人姓名、电话；
i）出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
j）召集人需要通知的其他事项。

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

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

5.基金份额持有人出席会议的方式

（1）会议方式

1）基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。
2）现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席，如基金管理人或基金托管人拒不派代表出席的，不影响表决效力。
3）通讯方式开会指按照本基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。
4）会议的召开方式由召集人确定。

（2）召开基金份额持有人大会的条件

1）现场开会方式

在同时符合以下条件时，现场会议方可举行：

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

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

2）通讯开会方式

在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

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

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

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

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

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

6.议事内容与程序

（1）议事内容及提案权

1）议事内容为本基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容。

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

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

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

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

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

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

（2）议事程序

1）现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照规定程序宣布会议议事程序及注意事项，确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，经合法执业的律师见证后形成大会决议。

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

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

2）通讯方式开会

在通讯表决开会的方式下，首先由召集人提前30日公布提案，在所通知的表决截止日期后第2个工作日在公证机关及监督人的监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。如监督人经通知但拒绝到场监督，则在公证机关监督下形成的决议有效。

（3）基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

7.决议形成的条件、表决方式、程序

（1）基金份额持有人所持每一基金份额享有平等的表决权。

（2）基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1）一般决议

一般决议须经出席会议的基金份额持有人（或其代理人）所持表决权的50%以上通过方为有效，除下列2）所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过；

2）特别决议

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

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

（4）采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

（5）基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

8.计票

（1）现场开会

1）如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，则基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与基金管理人、基金托管人授权的一名监督员共同担任监票人；但如果基金管理人和基金托管人的授权代表未出席，则大会主持人可自行选举三名基金份额持有人代表担任监票人。

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

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

（2）通讯方式开会

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

9.基金份额持有人大会决议报中国证监会核准或备案后的公告时间、方式

（1）基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。关于本章第（二）条所规定的第（1）-（8）项召开事由的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准生效后方可执行，关于本章第（二）条所规定的第（9）、（10）项召开事由的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准或出具无异议意见后方可执行。

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

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

10.法律法规或监管部门对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

（三）基金收益分配原则、执行方式

1.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。

2.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。

3.收益分配原则

（1）本基金在封闭期内，收益分配应遵循下列原则：
1）基金收益分配方式为现金方式；
2）每一基金份额享有同等分配权；
3）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；
4）在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至少1次；
5）在符合上述收益分配条件的前提下，年度收益分配比例不得低于基金年度已实现收益的90%。基金合同生效不满3个月的，收益可不分配；
6）基金红利发放日距离收益分配基准日的时间不得超过15个工作日；
7）法律、法规或监管机构另有规定的，从其规定。

（2）本基金封闭期满并转换为上市开放式基金（LOF）后，或者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，本基金收益分配应遵循下列原则：

1）在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为12次，每次收益分配比例不得低于期末（即收益分配基准日）可供分配利润的60%；

2）本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，登记在注册登记系统的基金份额，投资人可选择现金红利或将现金红利按除权日的单位净值自动转为基金份额进行再投资；选择红利再投资方式的投资人其红利所转换的基金份额免收申购费用；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。

登记在证券登记结算系统中的基金份额只能采取现金红利的分配方式，投资人不能选择其他的分红方式，具体收益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

3）基金红利发放日距离收益分配基准日（即期末可供分配利润计算截至日）的时间不得超过15个工作日；
4）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；
5）每一基金份额享有同等分配权；
6）法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

4.收益分配方案

基金收益分配方案中应载明收益分配基准日以及该日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式、支付方式等内容。

5.收益分配的时间和程序

（1）基金收益分配方案由基金管理人拟订，由基金托管人复核，依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告并报中国证监会备案；

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

6.收益分配中发生的费用

收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担；当投资人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记机构可将投资人的现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额。

（四）与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

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

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的0.6%年费率计提。计算方法如下：

$H=E\times\text{年管理费率}\div\text{当年天数}$

H为每日应计提的基金管理费
E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起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、休息日，支付日期顺延。

2.基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.2%年费率计提。计算方法如下：

$H=E\times\text{年托管费率}\div\text{当年天数}$

H为每日应计提的基金托管费
E为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，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托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

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

（五）基金财产的投资方向和投资限制

1.投资目标

在严格控制投资风险的基础上，通过积极的投资策略，力争为基金持有人创造较高的当期收益。

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，主要投资于固定收益类品种，包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、短期融资券、可转债、分离交易可转债、资产支持证券、债券回购等金融工具以及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具。

本基金也可投资于股票、权证以及法律法规或监管部门允许基金投资的其他权益类金融工具。本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类金融工具，但可以参与一级市场股票首次公开发行或股票增发，并可持有因所持可转换公司债券转股形成的股票、因持有股票被派发的权证、因投资于分离交易可转债而产生的权证。

如法律法规或中国证监会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：本基金对债券等固定收益类品种的投资比例不低于基金资产的80%；股票等权益类品种的投资比例不超过基金资产的20%；基金转为上市开放式基金（LOF）后，本基金将保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。

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.投资限制

（1）组合限制

本基金在投资策略上兼顾投资原则以及本基金的固有特点，通过分散投资降低基金财产的非系统性风险。基金的投资组合将遵循以下限制：

1）本基金对债券等固定收益类品种的投资比例不低于基金资产的80%；股票等权益类品种的投资比例不超过基金资产的20%；基金转为上市开放式基金（LOF）后，本基金将保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。
2）本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的10%；
3）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%；
4）在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的0.5%；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%；本基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的10%。法律法规或中国证监会另有规定的，遵从其规定；
5）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净资产的40%；本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为1年，债券回购到期后不得展期；
6）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；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%；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%；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%；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；
7）本基金参与股票发行申购的，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的股票发售总量；
8）本基金持有的所有流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的20%；本基金持有的同一流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的10%；
9）法律法规及中国证监会规定的其它比例限制。

基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。在符合相关法律法规规定的前提下，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等非本基金管理人的因素致使基金的投资组合不符合上述规定的投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整。

如果法律法规及监管政策等对本基金的基金合同所约定的投资组合比例限制进行变更，本基金在履行适当程序后可相应调整禁止行为和投资比例限制规定。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，本基金在履行相关程序后不再受相关限制。

（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）向他人贷款或者提供担保；
3）从事承担无限责任的投资；
4）买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
5）向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
6）买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
7）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
8）依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动；
9）法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，本基金在履行适当程序后不再受相关限制。

（六）基金资产净值的计算方法和公告方式

1.基金资产净值的计算方法

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

2.基金资产净值的公告方式

（1）本基金的基金合同生效后，基金上市交易前，基金管理人将至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值；

（2）基金上市交易后，基金管理人将在每个交易日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露基金份额净值和基金份额累计净值；

（3）在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人将在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值；

（4）基金管理人将公告半年度和年度最后一个市场交易日（或自然日）基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在上述市场交易日（或自然日）的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定报刊和网站上。

（七）基金合同变更和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

1.基金合同的变更

（1）基金合同变更内容对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的，应召开基金份额持有人大会，基金合同变更的内容应经基金份额持有人大会决议同意。
1）转换基金运作方式，本基金依据本基金合同的约定直接转换运作方式的除外；
2）变更基金类别；
3）变更基金投资目标、投资范围或投资策略（法律法规、中国证监会和基金合同另有规定的除外）；
4）变更基金份额持有人大会程序；
5）更换基金管理人、基金托管人；
6）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但根据适用的相关规定提高该等报酬标准的除外；
7）本基金与其他基金的合并；
8）封闭期内基金扩募；
9）终止基金上市，但因本基金不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的除外；
10）对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；
11）法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

基金合同生效后，当出现下述情形之一时，基金管理人应当召集召开基金份额持有人大会审议基金合同终止或与其他基金合并事项：
1）连续90个工作日基金份额持有人少于200人；
2）连续90个工作日基金资产规模少于3000万人民币；
3）连续90个工作日本基金前十大基金份额持有人持有本基金90%以上的基金份额。

发生上述情形之一时，基金份额持有人大会应按照本基金合同的规定程序召开，并就因上述情形的发生是否终止本基金合同的事项或与其他基金合并的事项以特别决议方式进行表决。

但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人和基金托管人同意变更后公布，并报中国证监会备案：
1）调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；
2）在法律法规和本基金合同规定的范围内变更基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；
3）因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；
4）对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生重大变化；
5）基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；
6）按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

（2）关于变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案，并于中国证监会核准或出具无异议意见后生效执行，并自生效之日起2日内在至少一种指定媒体公告。

2.本基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同将终止：
（1）基金份额持有人大会决定终止的；
（2）基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在6个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务；
（3）基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在6个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务；
（4）中国证监会规定的其他情况。

3.基金财产的清算

（1）基金财产清算组

1）基金合同终止时，成立基金财产清算组，基金财产清算组在中国证监会的监督下进行基金清算。
2）基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。
3）基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算组可以依法进行必要的民事活动。

（2）基金财产清算程序

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

（3）清算费用

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

（4）基金财产按下列顺序清偿：
1）支付清算费用；
2）交纳所欠税款；
3）清偿基金债务；
4）按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。
基金财产未按前款1）-3）项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

（5）基金财产清算的公告

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

（6）基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

（八）争议解决方式

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

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

本基金合同受中国法律管辖。

（九）基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

本基金合同可印制成册，供投资人在基金管理人、基金托管人、代销机构和注册登记机构办公场所查阅，但其效力应以基金合同正本为准。

## 七、基金财务状况（未经审计）

深圳证券交易所在鹏华丰润债券型证券投资基金募集期间未收取任何费用，其他各基金销售机构根据本基金招募说明书设定的费率收取认购费。

本基金募集结束后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

鹏华丰润债券型证券投资基金2010年12月9日资产负债表如下：

单位：人民币元

| 项 目 | 行次 | 2010年12月9日 |
|---|---|---|
| 资产： |  |  |
| 银行存款 | 1 | 39,689,148.75 |
| 结算备付金 | 2 | - |
| 存出保证金 | 3 | - |
| 交易性金融资产 | 4 | 192,047,500.60 |
| 其中：股票投资 | 5 | - |
| 债券投资 | 6 | 192,047,500.60 |
| 资产支持证券投资 | 7 | - |
| 衍生金融资产 | 8 | - |
| 买入返售金融资产 | 9 | 1,110,000,000.00 |
| 应收证券清算款 | 10 | - |
| 应收利息 | 11 | 2,011,017.33 |
| 应收股利 | 12 | - |
| 应收申购款 | 13 | - |
| 其他资产 | 14 | 1,046.28 |
| 资产总计： | 15 | 1,343,748,712.96 |
| 负债： |  |  |
| 短期借款 | 16 | - |
| 交易性金融负债 | 17 | - |
| 衍生金融负债 | 18 | - |
| 卖出回购金融资产款 | 19 | - |
| 应付证券清算款 | 20 | 6,959,484.16 |
| 应付赎回款 | 21 | - |
| 应付管理人报酬 | 22 | 153,702.89 |
| 应付托管费 | 23 | 51,234.30 |
| 应付销售服务费 | 24 | - |
| 应付交易费用 | 25 | -1,996.34 |
| 应交税费 | 26 | - |
| 应付利息 | 27 | - |
| 应付利润 | 28 | - |
| 其他负债 | 29 | 18,799.92 |
| 负债合计 | 30 | 7,181,224.93 |
| 所有者权益： |  |  |
| 实收基金 | 31 | 1,335,591,800.74 |
| 未分配利润 | 32 | 975,687.29 |
| 所有者权益合计 | 33 | 1,336,567,488.03 |
| 负债和所有者权益总计 | 34 | 1,343,748,712.96 |

## 八、基金投资组合

截止到2010年12月9日，鹏华丰润债券型证券投资基金的投资组合如下：

（一）期末基金资产组合情况

单位：人民币元

| 序号 | 资产品种 | 金额（元） | 金额占基金总资产比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 股票 | - | - |
| 2 | 债券 | 192,047,500.60 | 14.29 |
| 3 | 权证 | - | - |
| 4 | 银行存款及清算备付金 | 39,689,148.75 | 2.95 |
| 5 | 其他资产 | 1,112,012,063.61 | 82.75 |
|  | 合计 | 1,343,748,712.96 | 100.00 |

（二）期末按行业分类的股票投资组合

本基金截至2010年12月9日止未持有股票。

（三）期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

本基金截至2010年12月9日止未持有股票。

（四）期末按券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 | 27,980,126.40 | 2.09 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
|  | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | 153,118,374.20 | 11.46 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 可转债 | 10,949,000.00 | 0.82 |
| 7 | 其他 | - | - |
| 8 | 合计 | 192,047,500.60 | 14.37 |

（五）期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券名细

| 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 | 122033 | 09富力债 | 1,000,000 | 104,100,000.00 | 7.79 |
| 2 | 010213 | 02国债⒀ | 301,640 | 27,980,126.40 | 2.09 |
| 3 | 122020 | 09复地债 | 149,800 | 15,758,960.00 | 1.18 |
| 4 | 125709 | 唐钢转债 | 100,000 | 10,949,000.00 | 0.82 |
| 5 | 122013 | 08北辰债 | 100,000 | 10,650,000.00 | 0.80 |

（六）投资组合报告附注

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

2、截至2010年12月9日，本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

3、其他资产构成

| 其他资产明细 | 金额（元） |
|---|---|
| 交易保证金 | - |
| 应收证券清算款 | - |
| 应收利息 | 2,011,017.33 |
| 应收股利 | - |
| 应收申购款 | - |
| 其他应收款 | 1,046.28 |
| 待摊费用 | - |
| 其他 | 1,110,000,000.00 |
| 合计 | 1,112,012,063.61 |

4、期末本基金持有的处于转股期的可转换债券明细及资产支持证券、分离交易可转债

（1）期末本基金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 | 125709 | 唐钢转债 | 10,949,000.00 | 0.82 |

（2）期末本基金持有的分离交易可转债明细

| 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 | 126013 | 08青啤债 | 7,892,295.60 | 0.59 |
| 2 | 126017 | 08葛洲债 | 3,917,917.50 | 0.29 |
| 3 | 126018 | 08江铜债 | 3,075,200.00 | 0.23 |

（3）截止到2010年12月9日，本报告期间本基金没有投资及持有资产支持证券。

5、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。

## 九、重大事件揭示

本基金自合同生效至上市交易期间未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

## 十、基金管理人承诺

本基金管理人就本基金上市交易之后履行管理人职责做出如下承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

（二）真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、证券交易所的监督管理。

（三）在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后，将及时予以公开澄清。

## 十一、基金托管人承诺

基金托管人就本基金上市交易后履行托管人职责做出如下承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，设立专门的基金托管部，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。

（二）根据《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付等行为进行监督和核查。

（三）基金托管人发现基金管理人的行为违反《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，并在限期内，随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。

（四）基金托管人发现基金管理人有重大违规行为，将立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

## 十二、基金上市推荐人意见

本基金无上市推荐人。

## 十三、备查文件目录

本基金备查文件包括下列文件：
（一）中国证监会核准基金募集的文件；
（二）鹏华丰润债券型证券投资基金基金合同；
（三）鹏华丰润债券型证券投资基金托管协议；
（四）鹏华丰润债券型证券投资基金招募说明书；
（五）法律意见书；
（六）基金管理人业务资格批件、营业执照；
（七）基金托管人业务资格批件和营业执照。
存放地点：基金管理人和基金托管人的住所
查阅方式：基金投资者可在营业时间免费查阅，或通过指定的信息披露媒体、本基金管理人网站（www.phfund.com.cn）查阅。

**鹏华基金管理有限公司**
2010年12月13日

---

# 鹏华基金管理有限公司关于增加广发银行为旗下部分基金代销机构的公告

根据鹏华基金管理有限公司（以下简称“本公司”）与广东发展银行股份有限公司（以下简称“广发银行”）签署的销售代理协议，自2010年12月13日起，

广发银行将增加代理本公司旗下鹏华消费优选股票型证券投资基金（基金代码206007）和鹏华信用增利债券型证券投资基金（A类基金代码：206003，B类基金代码：206004）的销售业务。

投资者可在广发银行设在北京、上海、广州、天津、杭州、宁波、温州、南京、无锡、大连、沈阳、大庆、郑州、昆明、武汉、长沙、深圳、珠海、汕头、东莞、佛山、江门、中山、惠州、肇庆、梅州、湛江、茂名、清远、河源等35个城市的529家营业网点为投资者办理开户、认购、申购、赎回等相关业务。

投资者可通过以下途径咨询有关详情：

一、广东发展银行股份有限公司
注册地址：广州市农林下路83号
客服电话：95508
网址：www.gdb.com.cn

二、鹏华基金管理有限公司
客户服务中心电话：400-6788-999或0755-82353668
网址：www.phfund.com.cn

风险提示：本公司承诺以诚实信用、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，也不保证最低收益。投资者投资于本公司基金时应认真阅读相关基金合同、招募说明书等文件，并根据自身风险承受能力选择适合自己的基金产品。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

**鹏华基金管理有限公司**
2010年12月13日