鹏华基金管理有限公司关于以通讯方式召开鹏华新丝路指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的公告

一、召开会议基本情况

根据《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》和《鹏华新丝路指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定，鹏华新丝路指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金管理人鹏华基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）决定以通讯开会方式召开本基金的基金份额持有人大会，会议的具体安排如下：

1、会议召开方式：通讯方式开会。

2、会议投票表决起止时间：自2018年3月16日起，至2018年4月1日17:00止（投票表决时间以本基金管理人委托的公证机关收到表决票时间为准）。

3、会议通讯表决票的寄达地点：

公证机构：北京市长安公证处

地址：北京市东城区朝阳门北大街6 号首创大厦七层

邮政编码：100027

联系人：向开罗

联系电话：010-65543888 转8823

请在信封表面注明：“鹏华新丝路指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

4、会议咨询电话：400－6788－999

二、会议审议事项

《关于鹏华新丝路指数分级证券投资基金转型并修改基金合同等相关事项的议案》（见附件一）。

上述议案的内容说明详见《关于鹏华新丝路指数分级证券投资基金转型并修改基金合同等相关事项的议案的说明》（见附件四）。

三、基金份额持有人大会的权益登记日

本次大会的权益登记日为2018年3月15日，即在2018年3月15日下午交易时间结束后，在登记机构登记在册的本基金全体基金份额持有人均有权参加本次基金份额持有人大会并投票表决。

四、表决票的填写和寄交方式

1、本次会议表决票见附件二。基金份额持有人可从相关报纸上剪裁、复印表决票或登陆本基金管理人网站(www.phfund.com)下载并打印表决票。

2、基金份额持有人应当按照表决票的要求填写相关内容，其中：

（1）个人投资者自行投票的，需在表决票上签字，并提供本人身份证件正反面复印件；

（2）机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本单位公章或经授权或认可的业务章（以下合称“公章”），并提供加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）；合格境外机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本单位公章（如有）或由授权代表在表决票上签字（如无公章），并提供该授权代表的身份证件正反面复印件或者护照或其他身份证明文件的复印件，该合格境外机构投资者所签署的授权委托书或者证明该授权代表有权代表该合格境外机构投资者签署表决票的其他证明文件，以及该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件和取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件；

（3）个人投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供该个人投资者身份证件正反面复印件，以及填妥的授权委托书原件（参照附件三）。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件正反面复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）；

（4）机构投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供该机构投资者的加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等），以及填妥的授权委托书原件。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件正反面复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。合格境外机构投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件和取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件；

（5）个人投资者委托他人投票的寄达地点：

公证机构：北京市长安公证处

地址：北京市东城区朝阳门北大街6 号首创大厦七层

邮政编码：100027

联系人：向开罗

联系电话：010-65543888 转8823

4、见证律师：上海市通力律师事务所

九、重要提示

1、请基金份额持有人在提交表决票时，充分考虑邮寄在途时间，提前寄出表决票。

2、本次基金份额持有人大会有关公告可通过基金管理人网站查阅，投资者如有任何疑问，可致电基金管理人客户服务电话400－6788－999（免长途话费）咨询。

3、本通知的有关内容由鹏华基金管理有限公司负责解释。

鹏华基金管理有限公司

二〇一八年三月一日

附件一：《关于鹏华新丝路指数分级证券投资基金转型并修改基金合同等相关事项的议案》

附件二：《鹏华新丝路指数分级证券投资基金基金份额持有人大会通讯表决票》

附件三：《授权委托书》

附件四：《关于鹏华新丝路指数分级证券投资基金转型并修改基金合同等相关事项的议案的说明》

附件一：《关于鹏华新丝路指数分级证券投资基金转型并修改基金合同等相关事项的议案》

鹏华新丝路指数分级证券投资基金基金份额持有人：

为了更好地满足投资者的投资需求，保护基金持有人利益，根据《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》和《鹏华新丝路指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，鹏华新丝路指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金管理人——鹏华基金管理有限公司经与基金托管人——招商银行股份有限公司协商一致，提议对鹏华新丝路指数分级证券投资基金进行调整，修改基金名称、投资目标、投资范围、投资策略和限制、申购赎回规则、基金费用、收益分配方式、估值方法等相关转型事项，并根据鹏华新丝路指数分级证券投资基金成立以来法律法规的变动对《基金合同》的其他内容予以调整。具体说明见附件四《关于鹏华新丝路指数分级证券投资基金转型并修改基金合同等相关事项的说明》。

本议案如获得基金份额持有人大会审议通过，基金管理人将根据基金份额持有人大会决议对《基金合同》进行修改。本基金的招募说明书及托管协议也将进行必要的修改或补充。

以上议案，请予审议。

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

附件二：鹏华新丝路指数分级证券投资基金基金份额持有人大会通讯表决票

基金份额持有人姓名/名称：

证件号码（身份证件号/营业执照注册号）：

基金账户号：

审议事项	同意	反对	弃权
关于鹏华新丝路指数分级证券投资基金转型并修改基金合同等相关事项的议案			

基金份额持有人/受托人（代理人）（签字或盖章）

日期：年 月 日

说明：

1、请就审议事项表示“同意”、“反对”或“弃权”，并在相应栏内画“√”，同一议案基金份额持有人只能选择一种表决意见。以上表决意见是基金份额持有人或其受托人（代理人）就基金份额持有人持有的本基金全部份额做出的表决意见。

2、未填、多填、字迹模糊不清、无法辨认或意愿无法判断的表决票均视为投票人放弃表决权利，其所持全部基金份额的表决结果均计为“弃权”。

3、本表决票可从相关网站(www.phfund.com)下载、从报纸上剪裁、复印或按此格式打印。

附件三：授权委托书

兹全权委托 先生／女士或 机构代表本人（或本机构）参加以通讯开会方式召开的鹏华新丝路指数分级证券投资基金基金份额持有人大会，并代为全权行使所有议案的表决权。表决意见以受托人的表决意见为准。本授权不得转授权。若在法定时间内就同一议案重新召开鹏华新丝路指数分级证券投资基金基金份额持有人大会，除本人（或本机构）重新作出授权外，本授权继续有效。

委托人（签字/盖章）：

委托人身份证件号或营业执照注册号：

基金账户号：

受托人（代理人）（签字/盖章）：

受托人（代理人）身份证件号或营业执照注册号：

委托日期：年 月 日

附注：

1、以上授权是基金份额持有人就其持有的本基金全部份额向受托人所做授权。

2、此授权委托书剪报、复印或按以上格式自制在填写完整并签字盖章后均为有效。

附件四：《关于鹏华新丝路指数分级证券投资基金转型并修改基金合同等相关事项的议案的说明》

一、声明

1、为提高基金资产的运作效率，保护基金持有人利益，根据《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》”）和《鹏华新丝路指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，鹏华新丝路指数分级证券投资基金（以下简称“鹏华新丝路分级基金”）的基金管理人鹏华基金管理有限公司经与基金托管人招商银行股份有限公司协商一致，决定召开基金份额持有人大会，讨论并审议《关于鹏华新丝路指数分级证券投资基金转型并修改基金合同等相关事项的议案》。

2、本次基金份额持有人大会需由持有有效的鹏华新丝路份额、鹏华新丝路A份额、鹏华新丝路B份额各自基金份额不少于本基金在权益登记日鹏华新丝路份额、鹏华新丝路A份额、鹏华新丝路B份额各自基金总份额的二分之一的持有人出席方可召开，且《关于鹏华新丝路指数分级证券投资基金转型并修改基金合同等相关事项的议案》需经参加大会的鹏华新丝路份额、鹏华新丝路A份额、鹏华新丝路B份额各自基金份额的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，存在未能达到开会条件或无法获得相关持有人大会表决通过的可能。

3、持有人大会的决议自表决通过之日起生效。中国证监会对持有人大会表决通过的事项所作的任何决定或意见，均不表明其对本基金的价值或者投资人的收益做出实质性判断或保证。

二、调整方案要点

（一）变更基金名称

基金名称由“鹏华新丝路指数分级证券投资基金”变更为“鹏华沪深300指数增强型证券投资基金”（以下简称“本基金”）。

（二）调整基金类型、标的指数

基金类型由股票指数分级证券投资基金变更为股票指数增强型证券投资基金，并删除与原分级运作方式相关的章节，包括“第四部分 基金份额的分级”、“第五部分 基金份额的净值计算”、“第十一部分 基金份额的配对转换”以及“第十二部分 基金份额的折算”。基金标的指数由新丝路指数变更为沪深300指数。

（三）终止上市交易

鹏华新丝路分级基金转型后将在上海证券交易所终止上市交易，并删除“第八部分 基金份额的上市与交易”。

（四）调整申购赎回规则

申购赎回方式由场内、场外申购和赎回调整为场外申购和赎回，并相应修改申购和赎回场所、申购与赎回的原则等相关条款。

（五）调整投资目标、投资范围、投资策略、投资限制、业绩比较基准、风险收益特征

调整了基金的投资目标、投资范围、投资策略、投资限制、业绩比较基准和风险收益特征，对基金合同的相应内容修改如下：

原文：

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，力争将日均跟踪偏离度控制在0.35％以内，年跟踪误差控制在4％以内。

拟修改为：

本基金为股票指数增强型基金，在力求对沪深300指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越标的指数的业绩表现，谋求基金资产的长期增值。

原文：

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及其备选成份股（含中小板、创业板股票及其他中国证监会核准上市的股票）、债券、股指期货、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

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：投资于股票部分的比例不低于基金资产的80％，其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的80％；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，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。

拟修改为：

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（包括中小板、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、超短期融资券、公开发行的次级债、可转换债券、可交换债券等）、货币市场工具（含回业存单等）、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）。

本基金可以根据国家的有关规定进行融资及转融通。

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：投资于股票资产的比例不低于基金资产的80％，其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的80％；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％，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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。

原文：

本基金采用被动式指数化投资方法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。

当预期成份股发生调整或成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。

本基金力争鹏华新丝路份额净值增长率与同期业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过0.35％，年跟踪误差不超过4％。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

1、股票投资策略

（1）股票投资组合的构建

本基金在建仓期内，将按照标的指数各成份股的基准权重对其逐步买入，在力求跟踪误差最小化的前提下，本基金可采取适当方法，以降低买入成本。当遇到成份股停牌、流动性不足等其他市场因素而无法依指数权重购买某成份股及预期标的指数成份股因将调整或其他影响指数复制的因素时，本基金可以根据市场情况，结合研究分析，对基金财产进行适当调整，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。

（2）股票投资组合的调整

本基金所根据的股票投资组合将根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况，对其进行适时调整，以保证鹏华新丝路份额净值增长率与标的指数收益率间的高度正相关和跟踪误差最小化。基金管理人将对成份股的流动性进行分析，如发现流动性欠佳的个股将可能采用合理方法寻求替代。由于受到各项投资比例限制，基金可能不能按照成份股权重持有成份股，基金将会采用合理方法寻求替代。

1）定期调整

根据标的指数的调整规则和备选股票的预期，对股票投资组合及时进行调整。

2）不定期调整

根据指数编制规则，当标的指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重新调整时，本基金将根据各成份股的权重变化进行相应调整；

根据本基金的申购和赎回情况，对股票投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数；

根据法律、法规规定，成份股在标的指数中的权重因其它特殊原因发生相应变化的，本基金可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。

2、债券投资策略

本基金可以根据流动性管理需要，选取到期日在一年以内的政府债券进行配置。本基金债券投资组合将采用自上而下的投资策略，根据宏观经济分析、资金面动向分析等判断未来利率变化，并利用债券定价技术，进行个券选择。

3、衍生品投资策略

本基金可投资股指期货、权证和其他经中国证监会允许的金融衍生产品。

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低申购赎回时现金资产对投资组合的影响及投资组合仓位调整的交易成本，达到稳定投资组合资产净值的目的。

基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项，同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。

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。

4、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。

拟修改为：

1、股票投资策略

本基金为指数增强型基金，以沪深300 指数为标的指数，基金股票投资方面将主要采用指数增强量化投资策略，在严格控制跟踪误差的基础上，力求获得超越标的指数的超额收益。

指数增强量化投资策略主要借鉴国内外成熟的组合投资策略，在对标的指数成份股及其他股票基本面的深入研究的基础上，运用多因子量化选股模型构建投资组合，同时优化组合交易并严格控制组合风险，力求实现超额收益。

（1）多因子量化选股模型

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、质量、动量、成长、一致预期等因子，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。本基金对因子的有效性进行持续的跟踪，分析其变化规律，基金经理根据市场状况结合因子变化趋势，对模型使用的因子结构进行动态调整。

（2）风险控制与调整

本基金为指数增强型基金。在追求超额收益的同时，需要控制跟踪偏离过大的风险。基金将根据投资组合相对标的指数的暴露度等因素的分析，对组合跟踪效果进行预估，及时调整投资组合，力求将跟踪误差控制在目标范围内。

本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5％，年跟踪误差不超过7.75％。

（3）投资组合优化模型

本基金将综合考虑预期回报、风险及交易成本进行投资组合优化。选股范围以标的指数成份股为主，也包括非成份股中与成份股相关性强，流动性好，基本面信息充足的股票。

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、信用策略等积极投资策略，自上而下地管理组合的久期，灵活地调整组合的券种搭配，同时精选个券，以增强组合的持有期收益。

3、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。

4、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。

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。

原文：

（1）投资于股票部分的比例不低于基金资产的80％，其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的80％；

（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，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

（3）本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的10％，但除非法律法规另有规定，本基金指数化投资部分不受此限制；

（4）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％；

（5）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％；

（6）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％；

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

（8）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20％，中国证监会规定的特殊品种除外；

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

（10）本基金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％；

（11）本基金投资处于信用级别评级为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；

（12）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；

（13）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的债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不得展期；

（14）基金总资产不得超过基金净资产的140％；

（15）本基金与股指期货交易，应当遵守下列要求：

a.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％；

b.本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约的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；

c.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％；

d.本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；

e.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％；

（19）本基金参与融资的，每个交易日日终，本基金持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的95％；

（20）本基金参与转融通证券出借业务的，在任何交易日日终，参与转融通证券出借交易的资产不得超过基金资产净值的50％，证券出借的平均剩余期限不得超过30天，平均剩余期限按照市值加权平均计算；

（21）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；

（22）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；

（23）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）、（21）、（22）条外，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制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

原文：

六、业绩比较基准

新丝路指数收益率×95％＋商业银行活期存款利率（税后）×5％

新丝路指数以沪深A股市场注册地为陕西、甘肃、宁夏、青海与新疆5省的上市公司为样本空间，根据市值和成交金额的综合表现进行排名，选出前100只股票作为指数样本股。新丝路指数反映丝绸之路经济带区域内相关上市公司的整体表现，同时也为市场提供相关的主题投资标的。

拟修改为：

五、业绩比较基准

本基金业绩比较基准＝沪深300 指数收益率×95％＋1.5％（指年收益率，评价时按期间折算）。

沪深300 指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国A 股市场指数，它的样本选自沪深两个证券市场，覆盖了大部分流通市值，其成份股票为中国A 股市场中代表性强、流动性高的股票，能够反映A 股市场总体发展趋势。

原文：

七、风险收益特征

本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。同时本基金为指数基金，通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。

从本基金所分拆的两类基金份额来看，鹏华新丝路A份额为稳健收益类分额，具有低风险且预期收益相对较低的特征；鹏华新丝路B份额为积极收益类分额，具有高风险且预期收益相对较高的特征。

拟修改为：

七、风险收益特征

本基金属于股票指数增强型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金，属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种。

（六）调整基金的费率

原费率结构：

管理费：1.00％

托管费：0.22％

标的指数许可使用费：0.02％

场外申购费：

申购金额M（元）	申购费率
M＜100万	1.20％
100万≤M＜500万	0.60％
M≥500万	每笔100元

场外赎回费：

本基金将于2018年3月6日起对持续持有期少于7日的投资者收取1.5％的场外赎回费；对持续持有期不少于7日的投资者，赎回费率如下表所示：

持有期限Y	赎回费率
7天≤Y＜1年	0.50％
1年≤Y＜2年	0.25％
Y≥2年	0.00％

场内申购费：由上海证券交易所会员单位按照场外申购费率设定。

申购金额M（元）	申购费率
M＜500万	0
M≥500 万	每笔1000元

场内赎回费：本基金将于2018年3月6日起对持续持有期少于7日的投资者收取1.5％的场内赎回费；对持续持有期不少于7日的投资者，场内赎回费率为固定费率0.50％，不按持有期限设置分段赎回费率。

拟修改为：

管理费：1.00％

托管费：0.15％

标的指数许可使用费：0.0112％

申购费：

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

赎回费：

持有期限（Y）	赎回费率
Y＜7天	1.50％
7天≤Y＜1年	0.50％
1年≤Y（2年	0.25％
Y≥2年	0.00％

（七）调整收益分配方式

调整了基金的收益分配方式，对基金合同的相应内容修改如下：

原文：

在存续期内，本基金（包括鹏华新丝路份额、鹏华新丝路A份额、鹏华新丝路B份额）不进行收益分配。

法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

拟修改为：

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、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；

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，经与基金托管人协商一致，基金管理人可调整基金收益分配原则和支付方式，不需召开基金份额持有人大会。

（八）调整估值方法

原文：

1、证券交易所上市的有价证券的估值

（1）交易所上市的有价证券（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）交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价减第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价减第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整并确定公允价格。

（3）交易所上市未实行净价交易的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；

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

（5）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；

（6）对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价估值或推荐估值净价。对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待债期所对应的价格进行估值。

（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、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。

（九）本基金新修改的基金合同的生效

基金份额持有人大会决议生效日后，新修改的基金合同正式生效，具体生效日期本基金管理人将另行公告。自新修改的基金合同生效日起，《鹏华新丝路指数分级证券投资基金合同》同时失效，鹏华新丝路指数分级证券投资基金正式变更为鹏华沪深300指数增强型证券投资基金，本基金的基金合同当事人将按照《鹏华沪深300指数增强型证券投资基金基金合同》享有权利并承担义务。

三、转型选择期的相关安排

本次持有人大会决议生效后，鹏华新丝路指数分级证券投资基金将在转型正式实施前安排不少于二十个交易日的选择期以供基金份额持有人做出选择（如赎回、卖出、场内鹏华新丝路A份额、鹏华新丝路B份额配对合并后赎回或卖出），具体时间安排详见基金管理人届时发布的相关公告。

转型选择期期间，原鹏华新丝路指数分级证券投资基金赎回、场内鹏华新丝路A份额、鹏华新丝路B份额配对合并、场内交易业务照常办理。为保障本基金原持有人利益，本基金暂停基金申购、定投、基金份额转换、场内鹏华新丝路份额分拆、鹏华新丝路份额转托管（含系统内转托管与跨系统转托管）业务。对于在选择期内未作出选择的鹏华新丝路份额持有人，其持有的原鹏华新丝路份额、鹏华新丝路A份额、鹏华新丝路B份额将于份额转换基准日进行转换，最终将转换为鹏华沪深300指数增强型证券投资基金基金份额。

由于鹏华新丝路指数分级证券投资基金在选择期期间需应对赎回等情况，基金份额持有人同意在选择期临免鹏华新丝路指数分级证券投资基金基金合同中约定的投资组合比例限制等条款。基金管理人提请基金份额持有人大会授权基金管理人据此落实相关事项，并授权基金管理人可根据实际情况做相应调整，以及根据实际情况可暂停申购、赎回、转入、转出或调整赎回方式等。

四、基金份额转换等相关说明

鹏华基金管理有限公司将在基金份额持有人大会决定的事项生效日后，在新修改的基金合同生效前对鹏华新丝路指数分级证券投资基金申请退市并进行基金份额转换，转换为鹏华沪深300指数增强型证券投资基金基金份额，基金登记机构仍为中国证券登记结算有限责任公司。

本次转型涉及到基金份额的转换，主要分成以下两个步骤进行：

1、将鹏华新丝路A份额、鹏华新丝路B份额和鹏华新丝路份额的基金份额（参考）净值均调整为1.0000元

本次基金份额转换将分别对鹏华新丝路A份额、鹏华新丝路B份额和鹏华新丝路份额进行基金份额折算，基金份额折算后鹏华新丝路份额的基金份额净值、鹏华新丝路A份额与鹏华新丝路B份额的基金份额参考净值均调整为1.0000元，且基金份额的份额数计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分舍弃，余额计入基金财产；

2、将鹏华新丝路A份额、鹏华新丝路B份额和鹏华新丝路份额转换成鹏华沪深300指数增强型证券投资基金份额

在份额转换基准日日终，在保持基金资产净值总额不变的前提下，将份额净值为1.0000元的鹏华新丝路A份额、鹏华新丝路B份额和鹏华新丝路份额统一转换为份额净值为1.0000元的鹏华沪深300指数增强型证券投资基金份额。鹏华新丝路A份额、鹏华新丝路B份额的场内份额和鹏华新丝路份额的场内份额和场外份额份额相应地转换成鹏华沪深300指数增强型证券投资基金的场外份额。

鹏华沪深300指数增强型证券投资基金自基金合同生效之日起不超过3个月开始办理申购、赎回等业务。因鹏华新丝路指数分级证券投资基金由可上市交易的开放式指数证券投资基金转换为纯场外指数型证券投资基金，在转型选择期结束后仍旧持有鹏华新丝路指数分级证券投资基金场内基金份额的持有人需对其持有的鹏华沪深300指数增强型证券投资基金基金份额进行重新确认与登记，此过程即为“确权”，确权完成后，基金份额持有人方可在场外对相关基金份额进行赎回及其他交易。

投资者在未确权前，若鹏华沪深300指数增强型证券投资基金进行收益分配，未确权投资者的收益分配方式为红利再投资方式。

本基金的基金份额转换、退市及确权等事项的实施安排将提前公告。

五、基金投资范围、投资策略调整后的投资可行性

（一）投资方面

基金管理人已经对基金投资范围、投资策略调整后的投资运作进行了充分的分析。鹏华新丝路分级基金转型后，将在力求对沪深300指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越标的指数的业绩表现，谋求基金资产的长期增值。

我司于2011年正式成立量化投资部(现已更名为量化及衍生品投资部)，宽基指数管理经验丰富，目前拥有完备的数据库及量化指数增强策略，并且已有的产品鹏华沪深300指数基金、鹏华中证500指数基金近2年来有较为明显的超额收益，鹏华新丝路分级基金转型后在投资方面具有较好的可行性。

（二）法律方面

《基金合同》约定，基金调整基金名称、投资目标、投资范围、投资策略和限制、申购赎回规则、基金费用、收益分配方式、估值方法等事项需召开基金份额持有人大会，本次基金份额持有人大会决议属于特别决议，特别决议应当经参加大会的鹏华新丝路份额、鹏华新丝路A份额、鹏华新丝路B份额各自基金份额的基金份额持有人或其代理人所持表决权权重的三分之二以上（含三分之二）通过即为有效，基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

六、关于鹏华新丝路指数分级证券投资基金转型并修改基金合同等相关事项的议案的主要风险及预备措施

关于鹏华新丝路指数分级证券投资基金转型并修改基金合同等相关事项的议案存在被基金份额持有人大会否决的风险。

在鹏华新丝路指数分级证券投资基金转型并修改基金合同等调整方案之前，我司已对持有人进行了走访，认真听取了持有人意见，拟定议案综合考虑了持有人的要求。议案公告后，我们还将再次征询意见。如有必要，基金管理人将根据持有人意见，对调整方案进行适当的修订并重新公告。基金管理人可在必要情况下，预留出足够的时间，以做二次召开或推迟基金份额持有人大会的召开的充分准备。

如果本方案未获得基金份额持有人大会批准，基金管理人计划在30日内，按照有关规定重新向基金份额持有人大会提交鹏华新丝路分级基金转型并修改基金合同等方案议案。

附表：《鹏华新丝路指数分级证券投资基金变更注册为鹏华沪深300指数增强型证券投资基金的基金合同修订对照表》

	变更注册前	变更注册后
全文