（上接B067版）

	基金份额的配对转换	删除。
基金合同当事人及权利义务	（13）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、融券及转融通； （15）选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；	（13）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及转融通； （15）选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券/期货经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；
基金合同当事人及权利义务	（16）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、转换和非交易过户等业务的业务规则；	（16）在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金申购、赎回、转换和非交易过户等业务规则；
基金合同当事人及权利义务	（1）依法募集资金，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；	（1）依法募集资金，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申购、赎回和登记事宜；
基金合同当事人及权利义务	（8）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，按有关规定计算并公告基金资产净值、基金份额净值、基金份额参考净值，确定鹏华新丝路份额申购、赎回的价格；	（8）采取适当合理的措施使计算基金份额申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回的价格；
基金合同当事人及权利义务	（24）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存款利息在基金募集期结束后30日内退还基金认购人；	删除。
基金合同当事人及权利义务	（二）基金托管人的权利与义务 1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于： （4）根据相关市场规则，为基金开设资金账户、证券账户，为基金办理证券交易资金清算； 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于： （6）按规定开设基金财产的资金账户、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； （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、基金份额参考净值、鹏华新丝路份额申购、赎回价格； （12）建立并保存基金份额持有人名册； （21）执行生效的基金份额持有人大会的决议；	（二）基金托管人的权利与义务 1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于： （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、期货交易资金清算； 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于： （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； （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、基金份额参考净值、鹏华新丝路份额申购、赎回价格； （12）保存基金份额持有人名册； （21）执行生效的基金份额持有人大会的决定；
基金合同当事人及权利义务	三、基金份额持有人 基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对基金合同的承认和接受，基金投资者自依据基金合同取得基金份额，即成为本基金份额持有人和基金合同的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。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或签字为必要条件。 （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； （7）执行生效的基金份额持有人大会的决议；	三、基金份额持有人 基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受，基金投资者自依据《基金合同》取得的基金份额，即成为本基金份额持有人和《基金合同》的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章或签字为必要条件。 （4）交纳基金申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用； （7）执行生效的基金份额持有人大会的决定；
基金合同当事人及权利义务	基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人大会的审议事项应分别由鹏华新丝路份额、鹏华新丝路A份额、鹏华新丝路B份额的基金份额持有人独立进行表决。基金份额持有人持有的每一基金份额在其对应的份额类别内拥有平等的投票权。 本基金份额持有人大会不设日常机构。	基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人大会的审议事项应分别由鹏华新丝路份额、鹏华新丝路A份额、鹏华新丝路B份额的基金份额持有人独立进行表决。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。 本基金暂不设置日常机构，日常机构的设置和相关规则按照法律法规的有关规定进行。
基金份额持有人大会	一、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、中国证监会另有规定的除外）； （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、中国证监会另有规定的除外）； （5）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准； （7）本基金与其他基金的合并（法律法规、中国证监会另有规定的除外）； （8）变更基金投资目标、范围或策略（法律法规、中国证监会另有规定的除外）； （9）变更基金份额持有人大会程序； （10）基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会； （11）单独或合计持有鹏华新丝路份额、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； （12）终止鹏华新丝路份额、鹏华新丝路A份额或鹏华新丝路B份额上市，但因其基金不再具备上市条件而被上海证券交易所终止上市的除外； （13）对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项； （14）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）调低除基金管理费、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）在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式； （4）在法律法规和基金合同规定的范围内，在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，增加、减少、调整基金份额类别设置； （5）在法律法规和基金合同规定的范围内，在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金管理人、登记机构、基金销售机构调整有关申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务规则； （6）在法律法规和基金合同规定的范围内，在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金推出新业务或服务； （7）因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改； （8）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； （9）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。	一、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，法律法规、中国证监会或基金合同另有约定的除外： （1）终止《基金合同》； （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； （5）调整基金管理人、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； （8） 变更基金投资目标、范围或策略； （9）变更基金份额持有人大会程序； （10）基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会； （11）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； （12）对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项； （13）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）调低除基金管理费、基金托管费外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）在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式； （4）在法律法规和基金合同规定的范围内，在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，增加、减少、调整基金份额类别设置； （5）在法律法规和基金合同规定的范围内，在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金管理人、登记机构、基金销售机构调整有关申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务规则； （6）在法律法规和基金合同规定的范围内，在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金推出新业务或服务； （7）因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改； （8）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； （9）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。
基金份额持有人大会	二、会议召集人及召集方式 4、单独或合计持有鹏华新丝路份额、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，单独或合计持有鹏华新丝路份额、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。基金托管人应当收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知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、单独或合计持有鹏华新丝路份额、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，单独或合计持有鹏华新丝路A份额、鹏华新丝路B份额各自基金份额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。	二、会议召集人及召集方式 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。
基金份额持有人大会	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表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。	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。
基金份额持有人大会	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，基金管理人、基金托管人须为基金份额持有人行使投票权提供便利。会议的召开方式由会议召集人确定。	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，基金管理人、基金托管人须为基金份额持有人行使投票权提供便利。会议的召开方式由会议召集人确定。
基金份额持有人大会	1.现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票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，基金管理人或基金托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会时同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程： （2）经核对，汇总到会者出示的有权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的鹏华新丝路份额、鹏华新丝路A份额、鹏华新丝路B份额的基金份额持有人代表所持有的基金份额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（含二分之一）时，可以进行基金份额持有人大会议程； （3）经核对，汇总到会者出示的有权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的鹏华新丝路份额、鹏华新丝路A份额、鹏华新丝路B份额各自基金总份额的二分之一（含二分之一）时，大会召开的时间为：自大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就拟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）以上基金份额持有人代表出具书面意见或授权他人代表出具书面意见。	1.现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票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，基金管理人或基金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： （2）经核对，汇总到会者出示的有权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的鹏华新丝路份额、鹏华新丝路A份额、鹏华新丝路B份额的基金份额持有人代表所持有的基金份额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以上（含二分之一）时，可以进行基金份额持有人大会议程。
基金份额持有人大会	（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小于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（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份额各自基金份额小于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，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，就拟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）以上基金份额持有人代表出具书面意见或授权他人代表出具书面意见。	（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的鹏华新丝路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，就拟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）以上基金份额持有人代表出具书面意见或授权他人代表出具书面意见。
基金份额持有人大会	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。	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。
基金份额持有人大会	六、表决 基金份额持有人所持每份鹏华新丝路份额、鹏华新丝路A份额、鹏华新丝路B份额在其对应的份额类别内有一票表决权。 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的三分之二以上（含三分之二）通过方可生效，除本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。	六、表决 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）通过方可有效。除本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。
基金管理人、基金托管人的更换条件和程序	（一）基金管理人的更换程序 1、提名：新任基金管理人由基金托管人或由单独或合计持有10%以上（含10%）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提名； 2、决议：基金份额持有人大会在基金管理人职责终止后6个月内对被提名的基金管理人形成决议，该决议需经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）表决通过；	（一）基金管理人的更换程序 1、提名：新任基金管理人由基金托管人或由单独或合计持有10%以上（含10%）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提名； 2、决议：基金份额持有人大会在基金托管人职责终止后6个月内对被提名的基金管理人形成决议，该决议需经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）表决通过；
基金管理人、基金托管人的更换条件和程序	（三）基金管理人与基金托管人同时更换的条件和程序。 1、提名：如果基金管理人和基金托管人同时更换，由单独或合计持有鹏华新丝路份额、鹏华新丝路A份额、鹏华新丝路B份额各自基金份额10%以上（含10%）的基金份额持有人提名新的基金管理人和基金托管人；	（三）基金管理人与基金托管人同时更换的条件和程序 1、提名：如果基金管理人和基金托管人同时更换，由单独或合计持有基金总份额10%以上（含10%）的基金份额持有人提名新的基金管理人和基金托管人；
基金管理人、基金托管人的更换条件和程序	（四）新基金管理人接收基金管理业务或新基金托管人接收基金财产和基金托管业务前，原基金管理人或原基金托管人应继续履行相关职责，并保证不做出对基金份额持有人的利益造成损害的行为。	三、本部分关于基金管理人、基金托管人更换条件和程序的约定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人与基金托管人协商一致并提前公告后，可直接对相应内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。
基金的托管	基金托管人和基金管理人按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定订立托管协议。	基金托管人和基金管理人按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定订立托管协议，基金托管事宜以托管协议约定为准。
基金份额的登记	二、基金登记业务办理机构 本基金的登记业务由基金管理人或基金管理人委托的其他符合条件的机构办理。	二、基金登记业务办理机构 本基金的登记业务由基金管理人或基金管理人委托的其他符合条件的机构办理，但基金管理人依法应当承担的责任不因委托而免除。
基金的投资	一、投资目标 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。	一、投资目标 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。
基金的投资	二、投资范围 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。	二、投资范围 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（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，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。
基金的投资	三、标的指数 新丝路指数 在出现以下两种情况时，基金管理人将通过适当程序更换标的指数： 1、如果标的指数可能存在的不合理性导致其不能很好地反映沪深A股市场新丝路主题相关上市公司股票的整体走势，或随着中国证券市场的进一步发展和完善，未来出现了更合理、更具代表性的反映该类股票走势的指数时； 2、当标的指数出现下列问题时： （1）上海证券交易所或深圳证券交易所停止向标的指数供应商提供标的指数所需的数据、限制其从交易所取得数据或处理数据的权利； （2）标的指数被上海证券交易所及深圳证券交易所停止发布； （3）标的指数其他指数替代； （4）标的指数供应商停止编辑、计算和公布标的指数点位或停止对基金管理人的标的指数使用授权； （5）标的指数由于指数编制方法等重大变更导致该指数不宜继续作为本基金的标的指数； （6）存在针对标的指数或标的指数供应商的商业纠纷或法律诉讼，且此类纠纷或诉讼可能对标的指数或基金管理人使用标的指数的能力产生重大不利影响；	三、标的指数 新丝路指数 在出现以下两种情况时，基金管理人将通过适当程序更换标的指数： 1、如果标的指数可能存在的不合理性导致其不能很好地反映沪深A股市场新丝路主题相关上市公司股票的整体走势，或随着中国证券市场的进一步发展和完善，未来出现了更合理、更具代表性的反映该类股票走势的指数时； 2、当标的指数出现下列问题时： （1）上海证券交易所或深圳证券交易所停止向标的指数供应商提供标的指数所需的数据、限制其从交易所取得数据或处理数据的权利； （2）标的指数被上海证券交易所及深圳证券交易所停止发布； （3）标的指数其他指数替代； （4）标的指数供应商停止编辑、计算和公布标的指数点位或停止对基金管理人的标的指数使用授权； （5）标的指数由于指数编制方法等重大变更导致该指数不宜继续作为本基金的标的指数； （6）存在针对标的指数或标的指数供应商的商业纠纷或法律诉讼，且此类纠纷或诉讼可能对标的指数或基金管理人使用标的指数的能力产生重大不利影响；
基金的投资	基金管理人可以依据审慎原则，在充分考虑基金份额持有人利益及履行适当程序的前提下，更换本基金的标的指数、业绩比较基准和投资对象，并依据市场代表性、流动性、与原标的指数的相关性等诸多因素选择确定新的标的指数，而无需召开基金份额持有人大会，基金管理人应与基金托管人协商一致后，报中国证监会备案并及时公告。 标的指数更换后，基金管理人可根据需要替换或删除基金名称中与原标的指数相关的商号或字样。	基金管理人可以依据审慎原则，在充分考虑基金份额持有人利益及履行适当程序的前提下，更换本基金的标的指数、业绩比较基准和投资对象，并依据市场代表性、流动性、与原标的指数的相关性等诸多因素选择确定新的标的指数，而无需召开基金份额持有人大会，基金管理人应与基金托管人协商一致后，报中国证监会备案并及时公告。 标的指数更换后，基金管理人可根据需要替换或删除基金名称中与原标的指数相关的商号或字样。
基金的投资	四、投资策略 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的成份股即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 本基金所构建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、申购赎回交动情况，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。由于受到各项持股比例限制，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，选取剩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 本基金可以投资股指期货、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以及水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权衡调整投资策略，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。	四、投资策略 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的成份股即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 本基金所构建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、申购赎回交动情况，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。由于受到各项持股比例限制，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。
基金的投资	五、投资限制 1、组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制： （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）本基金非指数化投资部分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； （12）基金财产投资与股票发行申购，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%； （16）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100%，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； （17）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200%； （18）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； （19）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%； （20）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。	五、绩效比较基准 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具有较强成长性、同时也为市场提供