

# 鹏华优质治理股票型证券投资基金（LOF）

## 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：中国工商银行股份有限公司

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：2007年 7 月 18 日

公告日期：2007年 7 月 13 日

### 一、重要声明与提示

鹏华优质治理股票型证券投资基金（LOF）（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2007年4月27日刊登于《中国证券报》和鹏华基金管理有限公司网站(www.phfund.com.cn)的本基金招募说明书。

### 二、基金概览

1、基金简称：鹏华治理

2、交易代码：160611

3、基金份额总额：16,985,599,084.90 份(截止：2007年7月11日)

4、基金份额净值：1.071 元(截止：2007年7月11日)

- 5、本次上市交易份额：2,512,802,220.00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：2007年7月18日
- 8、基金管理人：鹏华基金管理有限公司
- 9、基金托管人：中国工商银行股份有限公司

### 三、基金的募集与上市交易

#### (一)本基金上市前基金集中申购情况：

1、基金发售申请的核准机构和核准文号：依据中国证监会2007年4月10日证监基金字[2007]100号文核准的普润证券投资基金基金份额持有人大会决议及中国证监会2007年4月10日证监基金字[2007]101号文核准的普华证券投资基金基金份额持有人大会决议，普润证券投资基金及普华证券投资基金由封闭式基金转为开放式基金、调整存续期限、终止上市、调整投资目标、范围和策略、修订基金合同，并更名为“鹏华优质治理股票型证券投资基金（LOF）”。

2、基金运作方式：上市契约型开放式

3、基金合同期限：不定期

4、发售日期：自2007年5月8日至2007年5月28日开放集中申购，期间不开放赎回，称为“集中申购期”。

5、发售价格：1.00元人民币

6、发售期限：21天

7、发售方式：场外集中申购

8、发售机构：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：中国工商银行、中国建设银行、交通银行、招商银行、深圳市商业银行、深圳发展银行。

3)其他代销机构：国信证券、国泰君安证券、银河证券、广发证券、招商证券、中信证券、中信建投证券、华泰证券、联合证券、平安证券、湘财证券、东莞证券、齐鲁证券、东海证券、兴业证券、长城证券、中信万通证券、中信金通证券、上海证券、光大证券、宏源证券、东吴证券、财通证券、海通证券、东北证券、金元证券、申银万国证券、西部证券、江南证券。

9、验资机构名称：安永华明会计师事务所有限公司

10、集中申购资金总额及入账情况：本次集中申购额为9,382,669,143.08元人民币，折算成9,382,669,143.08份基金份额；集中申购款在基金验资确认日之前产生的利息共计为1,571,880.73元人民币，其中1,571,608.08元折算成基金份额分别计入各基金份额持有人基金帐户，归基金份额持有人所有；其余的272.65元为利息折份额计算尾差归入基金财产。募集资金及利息已于2007年5月15日全额划入本基金在基金托管人中国工商银行开立的基金托管专户。

11、本基金集中申购备案情况：本基金于2007年5月15日验资完毕，当日向中国证监会提交了验资报告，办理基金集中申购的备案手续。

12、基金合同生效日：2007年4月25日。

13、基金资产合并日的基金份额总额：11,883,924,351.16份。

14、原基金份额转换日：2007年5月14日

15、原有基金普华、普润份额的转换情况

基金管理人已于2007年5月14日对投资者持有的原普华证券投资基金、普润证券投资基金（以下简称“基金普华”、“基金普润”）进行了基金份额转换操作。经本基金托管人中国工商银行股份有限公司确认，转换基准日（5月14日）基金普华基金份额净值为2.4083元，精确到小数点后第7位为2.4083268元（第7位以后舍去）；基金普润基金份额净值为2.5910元，精确到小数点后第7位为2.5910404元（第7位以后舍去），本基金管理人按照1:2.4083268的转换比例将基金普华的基金财产进行了转换，按照1:2.5910404的转换比例将基金普润的基金财产进行了转换。转换后，原基金普华、基金普润基金份额净值变为1.000元，相应地，原基金普华每1份基金份额转换为2.4083268份，原基金普润每1份基金份额转换为2.5910404份，基金份额计算结果保留到整数位，所产生的误差归入基金财产。原基金普华的基金总份额由500,000,000份转换为1,204,163,400份，基金普润的基金总份额由500,000,000份转换为1,295,520,200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【2007】109号

2、上市交易日期：2007年7月18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：鹏华治理

5、交易代码：160611

6、本次上市交易份额：2,512,802,220.00份

7、基金资产净值的披露：包括开放式基金每日收市后对基金资产净值进行的估值和基金上市交易时间的净值揭示两部分。

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。

考虑到鹏华优质治理股票型证券投资基金(LOF)作为上市开放式基金在交易所交易的特性,仅揭示每日收市后的净值不能满足交易需求,基金管理人同深圳证券交易所协商一致,决定增加鹏华优质治理股票型证券投资基金(LOF)的基金份额参考净值揭示频率,每交易日内定时揭示四次。交易时间内基金管理人将实时计算的基金份额参考净值传给深交所,深交所通过行情系统“市盈率II”实时揭示。基金份额参考净值的揭示仅为投资者的交易提供参考,基金管理人、基金托管人并不对其准确性负责,亦不对其交易作出任何保证或担保。

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2007年7月11日的场内基金份额持有情况:

场内基金份额持有人户数:22302户

平均每户持有的场内基金份额:112,671.61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1,623,975,614.00份,占64.63%

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888,826,606.00份(包括未确权份额),占35.37%

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	中国人寿保险(集团)公司	223,740,952.00	8.90

2	中国人寿保险股份有限公司	217,897,978.00	8.67
3	鹏华基金管理有限公司	110,800,920.00	4.41
4	海通—汇丰— MERRILLLYNCHINTERNATIONAL	95,044,817.00	3.78
5	招商证券—招行—招商证券基金宝 集合资产管理计划	84,291,438.00	3.35
6	新华人寿保险股份有限公司	83,411,286.00	3.32
7	中国太平洋保险（集团）股份有限公司	70,519,951.00	2.81
8	太平人寿保险有限公司	64,591,056.00	2.57
9	生命人寿保险股份有限公司—传统 —普通保险产品	63,980,692.00	2.55
10	中国太平洋人寿保险股份有限公司	61,703,977.00	2.46

## 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：孙枫
- 3、总经理：孙煜扬
- 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与益田路交汇处深圳国际商会中心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：发起设立基金、基金管理业务及中国证监会批准的其它业务。
- 9、存续期间：持续经营
- 10、股东及其出资比例：国信证券有限公司（50%）、深圳市北融信投资发展有限公司（16.68%）、方正证券有限责任公司（16.66%）、安徽国元信托投资有限责任公司（16.66%）

11、内部组织结构及职能：本基金管理人下设三个总部和两个直属部门，分别是：投资总部、营运总部、营销总部、监察稽核部及总裁办公室。

投资总部负责基金的投资、研究及交易。运营总部负责公司基金产品设计、基金的注册登记、清算和会计工作，并负责公司的计算机设备维护、系统开发及网络运行和维护。营销总部从事基金市场开发、销售、项目管理、客户服务等工作。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监察稽核。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。

12、人员情况：

截至到2007年2月28日，公司共有员工123人，其中64人具有硕士以上学历，占员工总数的52%，拥有本科学历的员工共46人，占员工总数的37.4%。

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8只开放式基金和2只封闭式基金，管理的总资产800多亿元。旗下管理的开放式基金有鹏华货币市场证券投资基金、鹏华普天系列开放式证券投资基金（普天债券A、普天债券B、普天收益）、鹏华行业成长开放式证券投资基金、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）。封闭式基金有基金普惠、普丰；以及全国社会保障基金四个委托投资组合。

15、本基金基金经理：

程世杰，男，1968年11月出生，经济学硕士，8年金融证券从业经历。2001年5月加盟鹏华基金管理有限公司，历任行业研究员、鹏华中国50基金经理助理、普华证券投资基金基金经理。2007年4月以来一直担任本基金基金经理。

杨靖，男，1968年1月出生，管理学硕士，6年证券从业经验。曾在长城证券公司从事证券研究工作，先后任研究员、行业研究小组组长；2001年6月加盟鹏华基金管理有限公司从事行业研究工作，2005年开始先后任鹏华中国50基金、鹏华行业成长基金和普润基金经理助理。2006年9月开始担任普润证券投资基金基金经理。2007年4月以来一直担任本基金基金经理。

本基金历任基金经理情况：程世杰先生、杨靖先生从本基金基金合同生效至今一直担任本基金基金经理。

(二)基金托管人

名称：中国工商银行股份有限公司

法定代表人：姜建清

注册资本：人民币 334,018,850,026 元

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

托管部负责人：周月秋

信息披露负责人：蒋松云

电话：（010）66106912

#### 1、主要人员情况

截至 2007 年 6 月末，中国工商银行资产托管部共有员工 82 人，平均年龄 30 岁，90%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有硕士以上学位或高级职称。

#### 2、基金托管业务经营情况

作为中国首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国工商银行始终坚持“诚实信用、勤勉尽责”的原则，严格履行着资产托管人的责任和义务，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的业务管理模式、健全的托管业务系统、强大的市场营销能力，为广大基金份额持有人和众多资产管理机构提供安全、高效、专业的托管服务，取得了优异业绩。截至2007年6月，托管证券投资基金80只，其中封闭式16只，开放式64只。托管资产规模年均递增超过70%。至今已形成包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社保基金、企业年金、产业基金、履约类产品、QFII资产、QDII资产等产品在内的托管业务体系。继先后获得《亚洲货币》和《全球托管人》评选的“2004年度中国最佳托管银行”称号、《财资》和《全球托管人》评选的“2005年度中国最佳托管银行”称号后，中国工商银行又分别摘取《环球金融》、《财资》杂志“2006年度中国最佳托管银行”桂冠。

#### （三）基金验资机构

名称：安永华明会计师事务所

法定代表人：葛明

注册地址及办公地址：北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼16层

经办注册会计师：谢枫、罗智

电话：010-58153000

### 六、基金合同摘要

#### 基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

## **(一) 基金份额持有人的权利、义务**

基金投资者购买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本基金份额,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。

每份基金份额具有同等的合法权益。

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金份额持有人的权利包括但不限于:

- (1) 分享基金财产收益;
- (2) 参与分配清算后的剩余基金财产;
- (3) 依法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、基金销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。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金份额持有人的义务包括但不限于:

- (1) 遵守基金合同;
- (2) 缴纳基金认购、申购、赎回款项及法律法规和基金合同所规定的费用;
- (3) 在其持有的基金份额范围内,承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任;
- (4) 不从事任何有损基金及其他基金合同当事人合法权益的活动;
- (5) 返还在基金交易过程中因任何原因,自基金管理人、基金托管人及代销机构处获得的不当得利;
- (6) 执行生效的基金份额持有人大会的决定;
- (7) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

## **(二) 基金管理人的权利与义务**

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金管理人的权利包括但不限于:

- (1) 依法募集基金;
- (2) 自基金合同生效之日起,根据法律法规和基金合同独立运用并管理基金财产;

- (3) 依照基金合同收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用;
- (4) 销售基金份额;
- (5) 召集基金份额持有人大会;
- (6) 依据基金合同及有关法律的规定监督基金托管人,如认为基金托管人违反了基金合同及国家有关法律的规定,应呈报中国证监会和其他监管部门,并采取必要措施保护基金投资者的利益;
- (7) 在基金托管人更换时,提名新的基金托管人;
- (8) 选择、委托、更换基金代销机构,对基金代销机构的相关行为进行监督和处理;
- (9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金注册登记机构办理基金注册登记业务并获得基金合同规定的费用;
- (10) 依据基金合同及有关法律的规定决定基金收益的分配方案;
- (11) 在基金合同约定的范围内,拒绝或暂停受理申购与赎回申请;
- (12) 在符合有关法律法规和基金合同的前提下,制订和调整《业务规则》,决定和调整除调高管理费和托管费率之外的基金相关费率结构和收费方式;
- (13) 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;
- (14) 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;
- (15) 以基金管理人的名义,代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;
- (16) 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;
- (17) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金管理人的义务包括但不限于:

- (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;如认为基金代销机构违反基金合同、基金销售与服务代理协议及国家有关法律的规定,应呈报中国证监会和其他监管部门,并采取必要措施保护基金投资者的利益;
- (2) 办理基金备案手续;
- (3) 自基金合同生效之日起,以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产;
- (4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策,以专业化的经营方式管理

和运作基金财产；

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

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

(7) 接受基金托管人依法进行的监督；

(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，确定基金份额申购、赎回的价格；

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(10) 编制半年度和年度基金报告；

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

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

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

(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

(15) 依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

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

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

(18) 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；

(19) 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；

(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时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

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

(22) 当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；但因第三方责任导致基金财产或基金份额持有人利益受到损失，而基金管理人首先承担了责任的情况下，基金管理人有权向第三方追偿；

(23) 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实施其他法律行为；

(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；

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；

(26) 按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；

(27) 不从事任何有损基金财产及本基金其他当事人利益的活动；

(28) 公平对待所管理的不同基金，防止在不同基金间进行有损本基金份额持有人利益的活动或资源分配；

(29) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

### **(三) 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：

(1) 自基金合同生效之日起，依法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产；

(2) 依基金合同约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；

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

(4) 以基金托管人和基金联名的方式在中国证券登记结算有限公司上海分公司和深圳分公司开设证券账户；

(5) 以基金托管人名义开立证券交易资金账户，用于证券交易资金清算；

(6) 以基金的名义在中央国债登记结算有限公司开设银行间债券托管账户，负责基金投资债券的后台匹配及资金的清算；

(7) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

(8) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(9) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

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：

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

- (2) 设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；
- (3) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；
- (4) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；
- (5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
- (6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户，按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
- (7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；
- (8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回价格；
- (9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
- (10) 对基金财务会计报告、季度、半年度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；如果基金管理人未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；
- (11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料15年以上；
- (12) 建立并保存基金份额持有人名册；
- (13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- (14) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；
- (15) 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；
- (16) 按照法律法规和基金合同的规定监督基金管理人的投资运作；
- (17) 参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- (18) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；
- (19) 因违反基金合同导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(20) 按规定监督基金管理人按法律法规和基金合同规定履行自己的义务，基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金利益向基金管理人追偿；

(21) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；

(22) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

### **基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则**

基金份额持有人大会由基金份额持有人或基金份额持有人的合法授权代表共同组成。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

#### **(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；

(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) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；

(6) 变更基金类别；

(7) 本基金与其他基金的合并；

(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) 调低基金管理费、基金托管费、基金销售服务费；

(2) 在法律法规和基金合同规定的范围内调低本基金的申购费率、赎回费率或变更收费方式；

(3) 因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改；

(4) 对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及基金合同当

事人权利义务关系发生变化；

(5) 除按照法律法规和基金合同规定应当召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

## **(二) 会议召集人及召集方式**

1、除法律法规规定或基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集；

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集；

3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。

基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集。

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

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

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

## **(三) 召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式**

1、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前30天，在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

(1) 会议召开的时间、地点、方式和会议形式；

(2) 会议拟审议的事项、议事程序和表决形式；

(3) 有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；

(4) 授权委托书的内容要求（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；

(5) 会务常设联系人姓名及联系电话。

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定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，不影响表决意见的计票结果。

#### **(四) 基金份额持有人出席会议的方式**

基金份额持有人大会可通过现场开会方式或通讯开会方式召开。

会议的召开方式由会议召集人确定，但更换基金管理人和基金托管人必须以现场开会方式召开。

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

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

(2) 经核对，汇总到会者出示的在权利登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的50%（含50%）。

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

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

(1) 会议召集人按基金合同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；

(2) 会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力；

(3) 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的50%（含50%）；

(4) 上述第(3)项中直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与基金登记注册机构记录相符，并且委托人出具的代理投票授权委托书符合法律法规、基金合同和会议通知的规定；

(5) 会议通知公布前报中国证监会备案。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者；表面符合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。

## **（五）议事内容与程序**

### **1、议事内容及提案权**

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如基金合同的重大修改、决定终止基金合同、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及基金合同规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日基金总份额10%（含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；也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案，临时提案应当在大会召开日至少35天前提交召集人并由召集人公告。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开日30天前公告。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

召集人对于基金管理人、基金托管人和基金份额持有人提交的临时提案进行审核，符合条件的应当在大会召开日30天前公告。大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

(1) 关联性。大会召集人对于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解释和说明。

(2) 程序性。大会召集人可以对提案涉及的程序性问题做出决定。如将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。

单独或合并持有权利登记日基金总份额10%（含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，或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。法律法规另有规定除外。

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，应当最迟在基金份额持有人大会召开前30日公告。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下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人所持表决权的50%以上（含50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

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

### (2) 通讯开会

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

## (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50%以

上(含50%)通过方为有效;除下列第2项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

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

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

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

## **(七) 计票**

### **1、现场开会**

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

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

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

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

### **2、通讯开会**

在通讯开会的情况下,计票方式为:由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表(若由基金托管人召集,则为基金管理人授权代表)的监督下进行计票,并由公证机关

对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

#### **（八）生效与公告**

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

基金份额持有人大会的决议自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起2个工作日内在至少一家指定媒体及基金管理人网站上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

基金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的决议。

### **基金收益分配原则、执行方式**

#### **（一）基金收益分配原则**

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，全年分配比例不得低于年度可供分配收益的50%；

2、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年至少分配一次，若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配；

3、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按除权日的基金份额净值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；场内认购、申购和上市交易的基金份额的分红方式为现金红利，投资者不能选择其他的分红方式，具体权益分配程序等有关事项遵循深交所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

4、基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；

5、基金当年收益应先弥补上一年度亏损后，才可进行当年收益分配；

6、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；

7、每一基金份额享有同等分配权；

8、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### **（二）收益分配方案**

基金收益分配方案中应载明基金收益分配原则、基金收益分配对象、分配时间、分配数额、分配方式等内容。

### （三）收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在2日内在至少一家指定媒体公告并报中国证监会备案。

### 与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

#### （一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金合同生效后的信息披露费用；
- 4、基金合同生效后的会计师费和律师费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、按照国家有关规定和基金合同约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

#### （二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

##### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

##### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的2.5‰的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 2.5\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支取。若

遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

上述一、基金费用的种类中第3—7项费用,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

### **(三) 不列入基金费用的项目**

下列费用不列入基金费用:

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;
- 3、基金合同生效前的相关费用,包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用;
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

### **(四) 费用调整**

基金管理人和基金托管人协商一致后,可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率等费率,须召开基金份额持有人大会审议;调低基金管理费率、基金托管费率等费率,无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前2日在至少一种指定媒体和基金管理人网站上公告。

## **基金财产的投资方向和投资限制**

### **(一) 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,包括国内依法发行的各类股票、债券、权证、资产证券化产品以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如有投资需要可参与有价值的新股配售和增发。其中股票的主要投资方向为具有相对完善的公司治理结构和良好成长性的优质上市公司的股票,该部分股票的投资比例不低于基金股票资产的80%。

本基金股票资产占基金资产的比例为60%~95%,债券资产占基金资产的比例为0~35%,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%,现金或到期日在1年期以内政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。

法律法规或中国证监会以后允许基金投资的其他金融工具或品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。如法律法规或中国证监会变更投资品种的比例限制的,基金管理人可相应调整本基金的投资比例上限规定,不需经基金份额持有人大会审议。

### **(二) 投资限制**

#### A 禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

- 1、承销证券；
- 2、向他人贷款或提供担保；
- 3、从事承担无限责任的投资；
- 4、买卖其他基金份额，但国务院另有规定的除外；
- 5、向基金管理人、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债券；
- 6、买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、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、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动；
- 8、当时有效的法律法规、中国证监会及基金合同规定禁止从事的其他行为。

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

#### B 投资组合限制

本基金的投资组合将遵循以下限制：

- 1、本基金持有一家上市公司的股票，其市值不得超过基金资产净值的10%；
- 2、本基金与由基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券，不得超过该证券的10%；
- 3、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%；
- 4、本基金持有的现金和到期日在一年以内的政府债券为基金资产净值5%以上（含5%）；
- 5、本基金不得违反基金合同关于投资范围、投资策略和投资比例的约定；
- 6、本基金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%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%，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，从其规定；
- 7、基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；
- 8、相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制；

如法律法规或监管部门取消上述限制性规定，履行适当程序后，本基金不受上述规定的限制。基金管理人应当在基金合同生效之日起六个月内使本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导

致的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内，但基金管理人应在10个交易日内进行调整，以达到标准。法律法规另有规定的从其规定。

### **基金资产净值的计算方法和公告方式**

#### **（一）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。

#### **（二）基金资产净值的公告方式**

基金合同生效后，在基金集中申购期开始前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。

自基金集中申购期开始日起，基金管理人应当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。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，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媒体和基金管理人网站上。

### **基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式**

#### **（一）基金合同的变更**

1、以下变更基金合同的事项应经基金份额持有人大会决议通过：

- （1）更换基金管理人；
- （2）更换基金托管人；
- （3）转换基金运作方式；
- （4）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；
- （5）变更基金类别；
- （6）变更基金投资目标、策略或投资范围（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；
- （7）本基金与其他基金的合并；
- （8）变更基金份额持有人大会召开程序；
- （9）终止基金合同；
- （10）其他可能对基金当事人权利和义务产生重大影响的事项。

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后变更并公告，并报中国证监会备案：

- （1）调低基金管理费、基金托管费、基金销售服务费；
- （2）在法律法规和基金合同规定的范围内调低本基金的申购费率、赎回费率或变更收费方

式；

(3) 因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改；

(4) 对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化；

(5) 除按照法律法规和基金合同规定应当召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

2、关于基金合同变更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，自变更生效之日起在至少一家指定媒体公告。

## **(二) 基金合同的终止**

有下列情形之一的，基金合同应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止的；

2、基金管理人、基金托管人职责终止，在6个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；

3、基金合同约定的其他情形；

4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

## **(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) 基金合同终止后，由基金财产清算小组统一接管基金；

(2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；

(3) 对基金财产进行估值和变现；

(4) 制作清算报告；

(5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

(6) 将清算报告报中国证监会备案并公告。

(7) 对基金财产进行分配；

5、基金财产清算的期限为6个月。依据相关法律法规和中国证监会的规定或依据基金财产清算的实际情况需要延长或缩短清算期限的，清算小组将提前予以公告。

#### **（四）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。

#### **（五）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。

#### **（六）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小组进行公告。

#### **（七）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。

### **争议解决方式**

各方当事人同意，因基金合同而产生的或与基金合同有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，仲裁费由败诉方承担。基金合同受中国法律管辖。

### **基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式**

基金合同可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、代销机构的办公场所和营业场所查阅；投资者也可按工本费购买基金合同复制件或复印件，但内容应以基金合同正本为准。

### **七、基金财务状况（未经审计）**

深圳证券交易所鹏华优质治理股票型证券投资基金（LOF）集中申购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或佣金比率收取集中申购费。

本基金集中申购结束后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

鹏华优质治理股票型证券投资基金（LOF）2007年7月11日资产负债表如下：

项目	行次	2007年7月11日
资 产：		

银行存款	1	3,809,444,095.76
结算备付金	2	73,792,914.32
存出保证金	3	6,307,606.02
交易性金融资产	4	14,320,545,787.51
其中：股票投资	5	14,219,195,025.51
债券投资	6	101,350,762.00
资产支持证券投资	7	0.00
基金投资	8	0.00
衍生金融资产	9	41,594,500.00
买入返售金融资产	10	0.00
应收证券清算款	11	3,417,588.14
应收利息	12	3,889,465.46
应收股利	13	566,096.15
应收申购款	14	37,175,159.23
其他资产	15	0.00
资产合计：	16	18,296,733,212.59
负债：		
短期借款	17	0.00
交易性金融负债	18	0.00
衍生金融负债	19	0.00
卖出回购金融资产款	20	0.00
应付证券清算款	21	80,305,355.91
应付赎回款	22	0.00
应付管理人报酬	23	8,053,445.57
应付托管费	24	1,342,240.93
应付销售服务费	25	0.00
应付交易费用	26	13,279,639.04
应付税费	27	0.00
应付利息	28	0.00
应付利润	29	0.00
其他负债	30	544,354.78
负债合计	31	103,525,036.23
所有者权益：		
实收基金	32	16,985,599,084.90
未分配利润	33	1,207,609,091.46
所有者权益合计	34	18,193,208,176.36
负债与持有人权益总计：	35	18,296,733,212.59

## 八、基金投资组合

截止到2007年7月11日，鹏华优质治理股票型证券投资基金（LOF）的投资组合如下：

### （一）期末基金资产组合情况

序号	资产品种	金额(元)	金额占基金总资产比例(%)
1	股票	14,219,195,025.51	77.72
2	债券	101,350,762.00	0.55
3	权证	41,594,500.00	0.23
4	银行存款及清算备付金	3,883,237,010.08	21.22
5	其他资产	51,355,915.00	0.28
	合计	18,296,733,212.59	100.00

(二) 期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例(%)
1	A 农、林、牧、渔业	138,960,778.69	0.76
2	B 采掘业	1,210,878,507.22	6.66
3	C 制造业	5,424,659,008.29	29.82
其中:	C0 食品、饮料	695,807,299.98	3.82
	C1 纺织、服装、皮毛	0.00	0.00
	C2 木材、家具	0.00	0.00
	C3 造纸、印刷	0.00	0.00
	C4 石油、化学、塑胶、塑料	592,253,966.72	3.26
	C5 电子	76,922,407.15	0.42
	C6 金属、非金属	2,029,407,123.33	11.15
	C7 机械、设备、仪表	1,483,943,052.16	8.16
	C8 医药、生物制品	546,325,158.95	3.01
	C99 其他制造业	0.00	0.00
4	D 电力、煤气及水的生产和供应业	318,867,643.62	1.75
5	E 建筑业	103,423,950.41	0.57
6	F 交通运输、仓储业	325,929,008.84	1.79
7	G 信息技术业	751,654,089.09	4.13
8	H 批发和零售贸易	446,293,636.99	2.45
9	I 金融、保险业	3,710,475,740.79	20.39
10	J 房地产业	1,311,323,899.69	7.21
11	K 社会服务业	241,060,020.13	1.33
12	L 传播与文化产业	235,668,741.75	1.30
13	M 综合类	0.00	0.00
	合计	14,219,195,025.51	78.16

(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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例(%)
1	600036	招商银行	39,035,634	1,072,699,222.32	5.90
2	600016	民生银行	75,820,836	903,784,365.12	4.97
3	000063	中兴通讯	9,039,942	483,636,897.00	2.66
4	000933	神火股份	13,700,047	432,647,484.26	2.38
5	600569	安阳钢铁	52,637,104	427,939,655.52	2.35
6	601166	兴业银行	10,461,203	383,716,926.04	2.11
7	600000	浦发银行	9,884,661	360,295,893.45	1.98
8	000002	万科A	16,015,556	339,529,787.20	1.87
9	600028	中国石化	26,479,960	336,560,291.60	1.85
10	600030	中信证券	5,800,000	323,640,000.00	1.78

(四) 期末按券种分类的债券投资组合

序号	债券品种	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例(%)
1	国债	77,232,350.40	0.43
2	金融债	0.00	0.00
3	企业债	0.00	0.00
4	可转换债券	24,118,411.60	0.13
	合计	101,350,762.00	0.56

(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明细

序号	债券名称	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例(%)
1	中海转债	24,118,411.60	0.13
2	20 国债(10)	23,760,587.50	0.13
3	02 国债(10)	21,802,330.00	0.12

4	99 国债(8)	17,458,000.00	0.10
5	02 国债(14)	11,960,607.40	0.07

#### (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、处罚的股票。

2、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）
存出保证金	6,307,606.02
应收证券清算款	3,417,588.14
应收利息	3,889,465.46
应收股利	566,096.15
应收申购款	37,175,159.23
其他应收款	0.00
合计	51,355,915.00

4、期末本基金投资及持有的处于转股期的可转换债券明细及资产支持证券  
期末本基金没有投资及持有处于转股期的可转换债券及资产支持证券。

#### 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)鹏华优质治理股票型证券投资基金（LOF）基金合同；
- (三)鹏华优质治理股票型证券投资基金（LOF）托管协议；
- (四)鹏华优质治理股票型证券投资基金（LOF）招募说明书；
- (五)原普华证券投资基金转换基金运作方式及召开基金份额持有人大会的相关文件
- (六)原普润证券投资基金转换基金运作方式及召开基金份额持有人大会的相关文件
- (七)法律意见书；
- (八)基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (九)基金托管人业务资格批件和营业执照；
- (十)中国证监会要求的其他文件。

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](http://www.phfund.com.cn))查阅。

鹏华基金管理有限公司

2007年7月13日