

# 鹏扬中债-30年期国债交易型开放式指数证券投资基金 证券投资基金基金份额发售公告

基金管理人：鹏扬基金管理有限公司  
基金托管人：招商银行股份有限公司  
二〇二三年二月

## 重要提示

1.鹏扬中债-30年期国债交易型开放式指数证券投资基金(以下简称本基金)已经中国证监会2022年1月10日证监许可[2022]92号文准予注册,并于2022年8月19日获得中国证监会延期募集备案的回函(机构部函[2022]1442号)。

2.本基金是交易型开放式指数证券投资基金。

3.本基金的基金管理人和登记机构为鹏扬基金管理有限公司(以下简称本公司),基金托管人为招商银行股份有限公司,本基金的登记结算机构为中国证券登记结算有限责任公司。

4.本基金的募集对象为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、合格境外投资者以及法律法规和中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。

5.本基金自2023年2月17日至2023年5月16日通过各基金份额发售机构公开发售,本基金的投资者可选择网上现金认购、网下现金认购和网下债券认购3种方式。网上现金认购的日期为2023年5月12日至2023年5月16日;网下现金认购和网下债券认购的日期为2023年2月17日至2023年5月16日。如上海证券交易所对网上现金认购时间作出调整,本公司将作出相应调整并及时公告。本公司可根据认购的情况适当调整募集时间,但最长不超过法定募集期限,并予以公告。

6.本基金的网上现金发售通过具有基金销售业务资格及上海证券交易所会员资格的证券公司办理;本基金的网下现金发售和网下债券发售通过基金管理人及基金管理人指定的发售代理机构进行。具体详见“六(三)基金份额发售机构”。各发售代理机构办理认购业务的办理网点、办理日期和费用以办理认购申请的发售代理机构为准。

7.投资人认购本基金时需具有上海证券交易所A股账户或上海证券交易所证券投资基金账户。上海证券交易所证券投资基金账户只能进行基金份额的现金认购和二级市场交易,如投资人需要使用标的指数成份券或备选成份券中的上海证券交易所托管的债券参与网下债券认购或基金的申购、赎回,则应开立上海证券交易所A股账户。

8.本基金认购费用或认购佣金不高于0.40%。

9.本基金首次募集规模上限为50亿元人民币(不含募集期利息和认购费用,下同)。本次认购采取“全比例确认”的方式对上述规模限制进行控制。具体处理方式如下:

(1)募集结束后,若本基金募集期内的有效认购申请不超过人民币50亿元,则投资者在募集期内提交的有效认购申请全部予以确认。

(2)募集结束后,若本基金募集期内的有效认购申请超过人民币50亿元,将对募集期内的有效认购申请采用“全比例确认”的原则给予部分确认,未确认部分将在募集期结束后退还给投资者。当发生比例确认时,基金管理人将及时公告比例确认情况和结果。

(3)认购申请确认比例的计算方法如下:  
募集期有效认购申请确认比例=50亿份有效认购申请份数/募集期有效认购申请份数  
投资者有效认购申请确认份数=投资者在募集期内提交的有效认购份数×募集期有效认购申请确认比例

(4)当发生部分确认时,本基金登记结算机构按照募集期有效认购申请确认比例对募集期每笔有效认购申请进行部分确认处理,因对每笔认购申请处理的精度等原因,最终确认的本基金累计有效认购份数可能略低于募集期总有效认购申请份数,投资者应在基金合同生效后到其认购申请的发售代理机构查询最终确认情况和有效认购份数。基金管理人及基金份额发售机构不承诺对认购结果的通知义务,投资者本人应主动查询认购申请的确认结果。

10.投资者在认购本基金时,需按基金管理人及发售代理机构的规定,备足认购资金,办理认购手续。网上现金认购申请提交后,投资人可以在当日接受认购申请的时段内撤销认购申请,申请一经确认,认购资金即被冻结。通过基金管理人的网下现金认购申请提交后不得撤销,通过其他发售代理机构提交的网下现金认购申请能否撤销以各销售机构的规定为准。

11.基金份额发售机构销售网点受理认购申请并不表示对该申请的成功确认,而仅代表销售网点确实收到了认购申请。申请是否成功应以登记机构的确认为准。投资者应在基金合同生效后到其认购申请的发售机构网站查询最终确认情况和有效认购份数。基金管理人及基金份额发售机构不承诺对认购结果的通知义务,投资者本人应主动查询认购申请的确认结果。

12.本基金(基金合同)生效后,符合基金上市交易条件的,本基金基金份额可上市在上海证券交易所上市交易。上市交易的有关事项将另行公告。

13.本公告仅对本基金发售的有关事项和规定予以说明。投资者欲了解本基金的详细情况,请详细阅读《鹏扬中债-30年期国债交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》。本基金的招募说明书及本公告同时刊登在本公司网站。投资者如有疑问,可拨打本公司客户服务电话(400-968-6688)及各发售代理机构客户服务热线。

14.本公司在募集期内可能新增或变更销售机构,投资者可留意本公司及各发售代理机构的公告或网站公示,或拨打本公司客户服务热线(400-968-6688)及各发售代理机构的客户服务热线进行咨询。

15.本基金募集期结束后,基金管理人确定本基金的申购赎回代理券商名单,报上海证券交易所,经上海证券交易所有关部门认可后,予以公告。基金上市后,指定交易未在申购赎回代理券商处投资人只能进行本基金的二级市场买卖,如投资人需进行本基金申购赎回交易,须指定交易或转指定交易到申购赎回代理券商。

16.风险提示  
本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资者根据所持有的基金份额享受基金收益,同时承担相应的投资风险。

本基金的投资风险包括市场风险、信用风险、管理风险、流动性风险、操作和技术风险、合规性风险、ETF特有的风险、投资跟踪偏离度风险以及其他风险。

本基金属于被动投资的交易型开放式指数基金,风险收益高于货币市场基金,低于混合型基金与股票型基金。本基金为被动投资的交易型开放式指数基金,主要采用抽样复制策略,跟踪标的指数市场表现,具有与标的指数所表征的市场组合相似的风险收益特征。

本基金可投资国债期货,如果投资,期货采用保证金交易制度,由于保证金交易具有杠杆性,当出现不利行情时,相关行情微小的变动就可能会使投资人权益遭受较大损失。期货采用每日无负债结算制度,如果没有在规定的时间内补足保证金,按规定将被强制平仓,可能给投资带来重大损失。

本基金投资目标为紧密跟踪标的指数“中债-30年期国债指数”,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

本基金为指数基金,投资者投资于本基金面临跟踪误差控制未达约定目标、指数编制机构停止服务、成份券停牌或退市等风险。

本基金为被动投资的交易型开放式指数基金,主要采用抽样复制策略,跟踪标的指数市场表现,具有与标的指数所表征的市场相似的风险收益特征。但由于基金费用、交易成本、组合持仓与标的指数的成份券之间存在差异,基金净值方法与指数成份券取价规则之间存在差异等因素,可能导致本基金净值与指数收益存在偏差。

投资风险,投资者在投资本基金之前,请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同,全面了解本基金的风险收益特征和产品特性,并充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,谨慎做出投资决策。

17.本公司可综合各种情况对发售安排做适当调整。本公司拥有对本基金份额发售公告的最终解释权。

## 一、本次发售基本情况

(一)基金的基本信息  
基金名称:鹏扬中债-30年期国债交易型开放式指数证券投资基金  
基金简称:鹏扬中债-30年期国债ETF  
场内简称:30年国债  
扩位简称:30年国债ETF  
基金证券代码:511090  
基金认购代码:511093

(二)基金类别  
债券型证券投资基金

(三)运作方式  
交易型开放式

(四)存续期限  
不定期

(五)基金份额发售面值  
基金份额初始面值为人民币1.00元,认购价格为人民币1.00元

(六)发售对象  
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、合格境外投资者以及法律法规和中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。

(七)发售目标  
本基金募集份额总额不少于2亿份,基金募集金额不少于人民币2亿元。本基金募集规模上限为50亿元。

(八)基金份额发售机构  
本基金的发售机构名单详见本基金发售公告“六(三)基金份额发售机构”部分的相关内容。

本公司在募集期内可能新增或变更销售机构,投资者可留意本公司及各发售代理机构的公告或网站公示,或拨打本公司客户服务热线(400-968-6688)及各发售代理机构的客户服务热线进行咨询。

(九)发售时间安排  
本基金募集期限不超过3个月,自基金份额开始发售之日起计算。  
本基金自2023年2月17日至2023年5月16日进行发售。如果在此发售期间未达到本基金招募说明书规定的基金备案条件,基金可在募集期限内继续销售,直到达到基金备案条件。本基金管理人可根据认购的情况在募集期内适当延长或缩短募集时间,并及时公告。另外,如遇突发事件,以上基金募集期的安排也可以适当调整。

(十)募集期资金利息与募集债券权益的处理方式  
通过基金管理人进行网下现金认购的有效认购资金在募集期间产生的利息,将折算为基金份额归投资人所有,其中利息转份额以登记结算机构的记录为准;网上现金认购及通过发售代理机构进行网下现金认购的有效认购资金在登记结算机构清算交收后产生的利息,计入基金财产,不折为基金份额;网下债券认购的冻结期间,产生的权益根据中国证券登记结算有限责任公司的业务规则进行处理。

(十一)认购方式  
投资者可选择网上现金认购、网下现金认购、网下债券认购三种方式认购本基金。

网上现金认购是指投资者通过基金管理人指定的发售代理机构通过上海证券交易所网上系统以现金进行的认购;网下现金认购是指投资者通过基金管理人及其指定的发售代理机构以现金进行的认购;网下债券认购是指投资者通过基金管理人及其指定的发售代理机构以债券进行的认购。

(十二)认购费用  
认购费用由投资者承担,用于本基金的市场推广、销售、注册登记等募集期间发生的费用,不列入基金财产。

本基金通过对直销柜台认购的养老金客户与除此之外的非养老金客户实施差别的认购费率。养老金客户是指全国社会保障基金、依法设立的基本养老保险基金,可以投资基金的地方社会保障基金、企业年金单一计划以及集合计划,企业年金理事会委托的特定客户资产管理计划、企业年金养老产品、职业年金计划、养老保障管理产品以及可以投资基金的其他养老金

客户。如将来出现经可以投资基金的住房公积金、享受税收优惠的个人养老账户等经过养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，基金管理人可将其纳入养老基金客户范围。

认购费率表如下表所示：

认购份额(M)	非养老金客户认购费率	养老金客户认购费率 (通过直销柜台)
M<50万份	0.40%	0.04%
50万份≤M<100万份	0.20%	0.02%
M≥100万份	每笔1000元	每笔1000元

基金管理人办理网下现金认购时可参考上述表格所示费率收取认购费用。投资者申请多次现金认购的，须按每笔认购申请所对应的费率档次分别计费。

发售代理机构办理网上现金认购、网下现金认购、网下债券认购时可参照上述费率结构收取一定的佣金。

通过发售代理机构进行网下债券认购的投资者，在发售代理机构允许的条件下，可选择以现金或基金份额的方式支付认购费用(或佣金)。

(十二)网上现金认购

1.认购原则与认购限额：

网上现金认购以基金份额申请。单一账户每笔认购份额须为1000份或其整数倍。

投资者在认购本基金时，需按发售代理机构的规定，备齐认购资金，办理认购手续。网上

现金认购申请提交后，投资者可以在当日接受认购申请的时段内撤销认购申请，申请一经确认，

认购资金即被冻结。

2.认购金额的计算：

认购金额=认购价格×认购份额×(1+佣金比率)

(或若适用固定费用的，认购金额=认购价格×认购份额+固定费用)

认购佣金=认购价格×认购份额×佣金比率

(或若适用固定费用的，认购佣金=固定费用)

认购佣金由发售代理机构在投资者认购确认时收取，投资者需以现金方式交纳认购佣金。

例：某投资者通过网上现金认购1000份本基金，假设发售代理机构确认的佣金比率为

0.40%，则需准备的认购资金金额计算如下：

认购金额=1.00×1,000×(1+0.40%)=1,004元

认购佣金=1.00×1,000×0.40%=4元

即投资者需准备1,004元资金，方可认购到1,000份本基金基金份额。

通过发售代理机构进行网上现金认购的有效认购资金在登记结算机构清算交收后至划入

基金托管专户前产生的利息，计入基金财产，不折算为投资者基金份额。

3.清算交收：T日通过发售代理机构提交的网上现金认购申请，由该发售代理机构冻结相应

的认购资金，登记结算机构进行清算交收，并将有效认购数据发送给发售协调人，发售协调人

将实际到位的认购资金划往预先开设的基金募集专户。

4.认购确认：在基金合同生效后，投资者应通过其办理认购的销售网点或由其提供的其他

方式查询认购确认情况。

(十三)网下现金认购

1.通过基金管理人进行网下现金认购的认购金额的计算

通过基金管理人进行网下现金认购的投资者，认购以基金份额申请，认购费用、认购金额

的计算公式为：

认购费用=认购价格×认购份额×认购费率

(或若适用固定费用的，认购费用=固定费用)

认购金额=认购价格×认购份额×(1+认购费率)

(或若适用固定费用的，认购金额=认购价格×认购份额+固定费用)

利息折算的份额=利息/认购价格

认购总份额=认购份额+利息折算的份额

认购费用由基金管理人收取，投资者需以现金方式交纳认购费用。通过基金管理人进行

网下现金认购款项在基金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。

例：某投资者通过基金管理人采用网下现金认购的方式认购本基金800,000份，认购费率

为0.20%，假定认购金额产生的利息为100元，则该投资者的认购金额为：

认购费用=1.00×800,000×0.20%=1,600元

认购金额=1.00×800,000×(1+0.20%)=801,600元

利息折算的份额=100/1.00=100份

认购总份额=800,000+100=800,100份

即：某投资者通过基金管理人采用网下现金认购的方式认购本基金800,000份，认购费率

为0.20%，假定认购金额产生的利息为100元，则该投资者的认购金额为801,600元，可得到

800,100份基金份额。

2.通过发售代理机构进行网下现金认购的认购金额的计算：同通过发售代理机构进行网

上现金认购的认购金额的计算。通过发售代理机构进行网下现金认购的有效认购资金在登记

结算机构清算交收后至划入基金托管专户前产生的利息，计入基金财产，不折算为投资者基

金份额。

3.认购限额：网下现金认购以基金份额申请。投资者通过发售代理机构办理网下现金认

购的，每笔认购份额须为1,000份或其整数倍；投资者通过基金管理人办理网下现金认购的，每

笔认购份额须在5万份以上(含5万份)。投资者可多次认购，累计认购份额不设上限。

4.认购手续：投资者在认购本基金时，需按销售机构的规定，到销售网点办理相关认购手

续，并备齐认购资金。通过基金管理人的网下现金认购申请提交后不得撤销，通过其他发售代

理机构提交的网下现金认购申请能否撤销以各销售机构的规定为准。

5.清算交收：T日通过基金管理人提交的网下现金认购申请，由基金管理人进行有效认购

款项的清算交收。募集期结束后，基金管理人将于第3个工作日将汇总的认购款项及其利息

划往基金募集专户。其中，认购款项利息将折算为基金份额归投资者所有。

T日通过发售代理机构提交的网下现金认购申请，由该发售代理机构冻结相应的认购资

金。在网下现金认购的最后一个工作日，各发售代理机构将每一个投资者账户提交的网下现

金认购申请汇总后，通过上海证券交易所网上定价发行系统代该投资者提交网上现金认购申

请。之后，登记结算机构进行清算交收，并将有效认购数据发送给发售协调人，发售协调人将

实际到位的认购资金划往基金募集专户。

6.认购确认：基金合同生效后，投资者可通过其办理认购的销售网点或由其提供的其他方

式查询认购确认情况。

(十四)网下债券认购

1.认购原则与认购限额：

投资者在认购本基金时，需按销售机构的规定到销售机构网点办理认购手续，并备足认购

债券。通过基金管理人的网下债券认购申请提交后不得撤销，通过其他发售代理机构提交的

网下债券认购申请能否撤销以各销售机构的规定为准。

网下债券认购以单只债券手数申报，同一认购的债券必须是标的指数成份券或已公告的

备选成份券(详见基金份额发售公告)。单只债券最低认购申报股数为1手，超过1手的部分须

为1手的整数倍。投资者可以多次提交认购申请，累计申报股数不设上限。

2.特殊情形

(1)公告的将被调出标的指数的成份券不得用于认购本基金。

(2)限购个人认购规模：基金管理人可根据市场情况、价格波动及其他异常情况，决定

是否对个券认购规模进行限制，并在网下债券认购开始日前公告限购认购规模的个股名单。

(3)临时拒绝个券认购：对于在网下债券认购期间价格波动异常、认购申报数量异常的个

券，基金管理人可不经公告，全部或部分拒绝该债券的认购申报。

3.认购份额的计算方式

网下债券认购以单只债券手数申请，在销售机构允许的条件下，投资者可以以现金或基金

份额的方式支付认购佣金。认购份额的计算方式为：

认购份额=

$$\sum_{i=1}^n (\text{第 } i \text{ 只债券的价值} \times \text{有效认购数量}) / 1.00$$

其中：

(1) $n$ 代表投资者提交认购申请的只数； $i$ 债券。如投资者仅提交了1只债券的申请，则 $i=1$ 。

(2) $\text{第 } i \text{ 只债券的价值} = \text{第 } i \text{ 只债券在 } T \text{ 日的估值价(注：如无特别所指，则为估值净价)} +$

$(D-1) \times \text{日应计利息}$ 。其中， $T$ 日为网下债券认购期最后一日， $D$ 日为债券付息日。

若某一债券在 $T$ 日至登记结算机构债券过户日的冻结期间发生利息兑付等权益变动情

况，则由于投资者获得了相应的权益，基金管理人将相应调整应计利息的计算。

(3) $\text{“有效认购数量”}$ 是由基金管理人确认的并据以进行清算交收的债券数量。其中，

1)若基金管理人在网下债券认购日前公告了限购认购规模的个股名单，则对于经公告限

制认购规模的个股，基金管理人可确认的认购数量上限的确认方法在相应公告中列示。

2)若某一债券在网下债券认购日至登记结算机构进行债券过户日( $D$ 日)的冻结期间发

生司法执行，则基金管理人将根据登记结算机构发送的解冻数据对投资者的有效认购数量进

行相应调整。

4.清算交收

通过发售代理机构进行网下债券认购的，每日日终，发售代理机构将当日的债券认购数据

按投资者证券账户汇总发送给基金管理人，在网下债券认购最后一日，基金管理人初步确认各

成份债券的有效认购数量。登记结算机构根据基金管理人提供的确认数据将投资者账户内相

应的债券进行冻结。基金募集期结束后，基金管理人根据发售代理机构提供的数据计算投资

人应以基金份额方式支付的认购佣金，并从投资者的认购份额中扣除，然后将扣除的认购金

以基金份额的形式返还给发售代理机构。

登记结算机构根据基金管理人提供的投资者净认购份额明细数据进行投资者认购份额的初

始登记，并根据基金管理人报上海证券交易所以确认的有效认购申请债券数据，将投资者申请

认购的债券过户到基金的证券账户。

5.认购确认

基金合同生效后，投资者可通过其办理网下债券认购的销售网点或由其提供的其他方

式查询认购确认情况。

6.在发售代理机构允许的条件下，投资者可选择以现金或基金份额的方式支付认购佣金。

(1)若投资者选择以现金方式支付认购佣金，则其可得到的净认购份额和需支付的认购佣

金如下：

认购佣金=认购价格×认购份额×佣金比率

净认购份额=认购份额

(2)若投资者选择以基金份额的方式支付认购佣金，则其可得到的净认购份额和需支付的

认购佣金如下：

认购佣金=认购价格×认购份额/(1+佣金比率)×佣金比率

净认购份额=认购份额-认购佣金/1.00

认购份额、净认购份额和以基金份额的方式支付认购佣金的计算保留到整数位,小数点后部分舍去。

## 二、投资者的开户

投资人认购本基金时需具有上海证券交易所A股账户或上海证券交易所证券投资基金账户(以下合称“上海证券账户”)。

1.如投资人需新开立上海证券账户,则应注意:

(1)上海证券交易所证券投资基金账户只能进行基金份额的现金认购和二级市场交易,如投资人需要使用标的指数成份券或备选成份券中的上海证券交易所托管的债券参与网下债券认购或基金的申购、赎回,则应开立上海证券交易所A股账户。

(2)开户当日无法办理指定交易,建议投资人在进行认购前至少提前2个工作日办理开户手续。

2.如投资人已开立上海证券账户,则应注意:

(1)如投资人未办理指定交易或指定交易在不办理本基金发售业务的发售代理机构,需要指定交易或转指定交易在可办理本基金发售业务的发售代理机构。

(2)当日办理指定交易或转指定交易的投资者当日无法进行认购,建议投资人在进行认购前至少提前1个工作日办理指定交易或转指定交易手续。

3.使用专用交易单元的机构投资者则无需办理指定交易。

## 三、本基金的认购程序

(一)网上现金认购的程序

1.认购时间:基金发售日的上午9:30—11:30和下午1:00—3:00(周六、周日及法定节假日不受理)。如上海证券交易所对网上现金认购时间作出调整,我司将作出相应调整并及时公告。

2.认购手续:

1)开立上海证券交易所A股账户或证券投资基金账户,办理指定交易在发售代理机构。利用上海证券交易所网上系统以现金进行认购。

2)在认购前向资金账户中存入足够的认购资金。

3)投资人可通过填写认购委托单、电话委托、磁卡委托、网上委托等方式申报认购委托,可多次申报,申报一经确认,认购资金即被冻结。

具体时间和认购手续以上海证券交易所和发售代理机构的相关规则为准。

(二)网下现金认购的程序

1.直销柜台

(1)认购时间:基金发售日的9:30至17:00(周六、周日和节假日不受理)。

(2)认购手续:

个人投资人到基金管理人直销网点提供下列资料办理基金的认购手续:

1)个人投资者提供身份证件原件及复印件(如为第二代身份证需正反面复印件);

2)上海A股账户卡或上海证券交易所证券投资基金账户(原件和复印件);

3)风险承受能力调查问卷;

4)加盖银行受理章的汇款凭证回单原件及复印件;

5)填妥的《ETF基金网下认购业务申请表》;

6)ETF基金风险揭示书;

7)基金管理人要求提供的其他有关材料。

机构投资者到基金管理人直销网点提供下列资料办理基金的认购手续:

1)营业执照或注册登记证书正(副)本、组织机构代码证及税务登记证原件或加盖单位公章的复印件;开展金融相关业务资格证明原件或加盖单位公章的复印件(金融机构提供);

2)法人或负责人身份证件原件或加盖单位公章的复印件;

3)基金业务授权委托书(本公司标准文本,须加盖单位公章和法定代表人或授权人章);

4)被授权人(即业务经办人)身份证件原件或加盖单位公章的复印件;

5)上海A股账户卡或上海证券交易所证券投资基金账户(原件和复印件);

6)机构投资者签署《开放式基金客户风险承受能力测试问卷》(机构版);

7)加盖银行受理章的汇款凭证回单原件及复印件;

8)填妥并加盖印鉴章的《ETF基金网下认购业务申请表》;

9)ETF基金风险揭示书;

10)基金管理人要求提供的其他有关材料。

(3)本公司直销资金划转账户

投资者认购本基金,需在募集期内,将足额认购资金汇入下列本公司任一直销资金专户:

1)建设银行账户:

账户名称:鹏扬基金管理有限公司

开户银行:中国建设银行北京复兴支行

银行账号:1105013751000001225

大额支付号:105100008038

2)交通银行账户:

账户名称:鹏扬基金管理有限公司

开户银行:交通银行北京海淀支行

银行账号:110060576018800024256

大额支付号:301100000099

3)工商银行账户:

账户名称:鹏扬基金管理有限公司

开户银行:中国工商银行股份有限公司北京复内支行

银行账号:0200215319200037984

大额支付号:102100021535

4)浦发银行账户:

账户名称:鹏扬基金管理有限公司

开户银行:上海浦东发展银行北京分行营业部

银行账号:91010153890000022

大额支付号:310100000010

5)兴业银行账户:

账户名称:鹏扬基金管理有限公司

开户银行:兴业银行股份有限公司上海分行

银行账号:216200100101822906

大额支付号:309290000107

(4)注意事项

1)通过本公司直销柜台办理业务的,若投资者的认购资金在认购申请当日17:00之前未到达本公司指定的直销资金专户,则当日提交的认购申请作废,投资者需重新提交认购申请并确保资金在认购申请当日17:00之前到达本公司指定的直销资金专户。在本基金发行截止日的截止时间之前,若投资者的认购资金未到达本公司指定账户,则投资者提交的认购申请将被认定为无效认购。

2)已开立本公司基金账户的投资者在认购时不能使用本公司基金账户,而需使用上海A股账户卡或上海证券交易所证券投资基金账户卡。

3)具体业务办理规则和程序以本公司直销机构的规定为准,投资者填写的资料需真实、准确,否则由此引发的错误和损失,由投资者自行承担。

4)投资者应在转账附言/用途摘要/备注栏正确填写上海证券账户信息,并预留有效的联系方式,便于发生资金异常时及时通知;转账时应提示银行柜台人员准确完整地传递上述转账信息。

2.发售代理机构

(1)认购时间:基金发售日的具体业务办理时间由发售代理机构确定。

(2)认购手续:投资者直接通过发售代理机构办理认购。

1)开立上海证券交易所A股账户或上海证券交易所证券投资基金账户,办理指定交易或转指定交易。

2)在认购前向资金账户中存入足够的认购资金。

3)投资者填写认购委托单,同时填写委托该发售代理机构代为办理网上现金认购的委托申请书。申请一经确认,认购资金即被冻结。

具体时间和认购手续以基金管理人或各发售代理机构的规定为准。

(三)网下债券认购的程序

1.直销柜台

(1)认购时间:基金发售日的9:30至17:00(周六、周日和节假日不受理)。

(2)认购手续:

个人投资人到基金管理人直销网点提供下列资料办理基金的认购手续:

1)个人投资者提供身份证件原件及复印件(如为第二代身份证需正反面复印件);

2)上海A股账户卡或上海证券交易所证券投资基金账户(原件和复印件);

3)风险承受能力调查问卷;

4)加盖银行受理章的汇款凭证回单原件及复印件;

5)填妥的《ETF基金网下认购业务申请表》;

6)ETF基金风险揭示书;

7)在A股账户中备足符合要求的认购债券;

8)基金管理人要求提供的其他有关材料。

机构投资者到基金管理人直销网点提供下列资料办理基金的认购手续:

- 1) 营业执照或注册登记证书正(副)本、组织机构代码证及税务登记证原件或加盖单位公章的复印件;开展金融相关业务资格证明原件或加盖单位公章的复印件(金融机构提供);
- 2) 法人或负责人身份证件原件或加盖单位公章的复印件;
- 3) 基金业务授权委托书(本公司标准文本,须加盖单位公章和法定代表人或授权人章);
- 4) 被授权人(即业务经办人)身份证件原件或加盖单位公章的复印件;
- 5) 上海 A 股账户卡或上海证券交易所证券投资基金账户(原件和复印件);
- 6) 机构投资者签署《开放式基金客户风险承受能力测试问卷》(机构版);
- 7) 加盖银行受理章的汇款凭证回单原件及复印件;
- 8) 盖章并加盖印鉴章的《ETF 基金网下认购业务申请表》;
- 9) ETF 基金风险提示书;
- 10) 在 A 股账户中各足符合要求的认购债券;
- 11) 基金管理人要求提供的其他有关材料。

- (3) 注意事项
  - 1) 开立上海证券交易所 A 股账户。
  - 2) 登记机构办理债券冻结业务时,投资者 A 股账户中债券余额不足,则基金管理人有权将投资者的该笔债券认购申请部分或全部确认失败。

2. 发售代理机构
  - (1) 认购时间:基金发售日的具体业务办理时间由发售代理机构确定。
  - (2) 认购手续:投资者直接通过发售代理机构办理认购。
    - 1) 开立上海证券交易所 A 股账户,办理指定交易或转指定交易。
    - 2) 在 A 股账户中各足符合要求的认购债券。
    - 3) 投资者填写认购委托单。申请一经确认,认购债券即被冻结。具体时间和认购手续以基金管理人或各发售代理机构的规定为准。

#### 四、过户登记

(一) 本基金募集期间募集的资金应当存入专门账户,在基金募集行为结束前,任何人不得动用。网下债券认购募集的债券将按照交易所和登记结算机构的规则办理冻结和过户,任何人不得动用。

- (二) 本基金权益登记由登记机构在发售结束后完成过户登记。
- (三) 本基金募集期间的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用,不得从基金财产中列支。

#### 五、基金的验资与基金合同生效

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(含网下债券认购所募集的债券市值)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,基金募集期届满或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。

如基金募集期届满,未达到基金合同的生效条件,则基金募集失败。基金管理人应以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用;在基金募集期限届满后 30 日内退还投资者已缴纳的认购款项,并加计银行同期活期存款利息。

#### 六、本次发售当事人或中介机构

- (一) 基金管理人
 

名称:鹏扬基金管理有限公司  
住所:中国(上海)自由贸易试验区栖霞路 120 号 3 层 302 室  
办公地址:北京市西城区复兴门内大街 A2 号西城金茂中心 16 层  
法定代表人:杨爱斌  
全国统一客户服务电话:400-968-6688  
电话:010-68105888  
传真:010-68105932  
联系人:吉瑞

- (二) 基金托管人
 

名称:招商银行股份有限公司  
住所:深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦  
办公地址:深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦  
法定代表人:缪建民  
成立时间:1987 年 4 月 8 日  
基金托管业务批准文号:证监基金字[2002]83 号  
注册资本:252.20 亿元  
存续期间:持续经营  
电话:0755-83199084  
联系人:张燕

- (三) 基金份额发售机构
  1. 发售协调人  
华泰证券股份有限公司
  2. 直销机构
    - (1) 鹏扬基金管理有限公司直销柜台  
办公地址:北京市石景山区绿地环球文化金融城 9 号院 5 号楼 1401-1405  
法定代表人:杨爱斌  
全国统一客户服务电话:400-968-6688  
联系人:申屠清泉  
传真:010-81922890

3. 网上现金发售代理机构  
网上现金发售通过具有基金销售业务资格的上海证券交易所会员单位办理,具体名单可在上海证券交易所网站查询。

4. 网下现金发售代理机构和网下债券发售代理机构  
暂无。基金管理人可根据实际情况变更网下现金发售代理机构和网下债券发售代理机构,并在基金管理人网站公示。

5. 本公司可以根据情况变化增加或者减少基金份额网下发售机构,并在基金管理人网站公示。基金份额发售机构可以根据情况增加或者减少其销售城市、网点。

- (四) 登记机构
 

名称:中国证券登记结算有限责任公司  
注册地址:北京市西城区太平桥大街 17 号  
办公地址:北京市西城区太平桥大街 17 号  
法定代表人:于文强  
电话:010-50938931  
传真:010-50938907  
联系人:徐一文

- (五) 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  
办公地址:上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼  
负责人:韩炯  
电话:021-31358666  
传真:021-31358600  
经办律师:陈颖华  
联系人:蔡明、陈颖华
- (六) 会计师事务所
 

本基金的法定验资机构为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)。  
名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)  
住所:上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼  
办公地址:上海市湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼  
执行事务合伙人:李丹  
经办注册会计师:周伟、耿亚男  
联系电话:021-23238888  
传真:021-23238800  
联系人:周伟

#### 七、网下债券认购清单

本基金募集期间,网下债券认购名单如下表所示。将被调出标的指数或即将到期的成份券不得用于认购本基金。基金管理人可根据网下债券认购日前 3 个月券的交易量、价格波动及其他异常情况,决定是否对个券认购规模进行限制,并在网下债券认购日前公告限制认购规模的个券名单。对于在网下债券认购期间价格波动异常或认购申报数量异常或网下债券认购截止日估值不合理的个券,基金管理人可不经公告,全部或部分拒绝该债券的认购申报。为保护投资者利益,基金管理人可根据实际认购情况,全部或部分拒绝成份券的认购申报。

网下债券认购名单如下:

序号	沪市代码	证券名称	序号	沪市代码	证券名称
1	019689	22 国债 24	5	019642	20 国债 12
2	019673	22 国债 08	6	019630	20 国债 04
3	019662	21 国债 14	7	019536	16 国债 08
4	019653	21 国债 05	8	019547	16 国债 19