

鹏扬中债-30年期国债交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书

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
登记机构:中国证券登记结算有限责任公司
上市地点:上海证券交易所
上市时间:2023年6月13日
公告日期:2023年6月8日

一、重要声明与提示

《鹏扬中债-30年期国债交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书》(以下简称本公告)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管理办法》(以下简称《信息披露办法》)和《上海证券交易所证券投资基金上市规则》(以下简称《上市规则》)制定。本公告旨在向投资者提供有关鹏扬中债-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)基金管理人鹏扬基金管理有限公司(以下简称基金管理人)的董事会及高级管理人员所披露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。本基金托管人招商银行股份有限公司保证本公告中基金财务会计资料内容的真实性、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、上海证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见,均不构成对本基金的任何保证。凡本公告未涉及的有关内容,请投资者详细阅读2023年2月14日刊登在鹏扬基金管理有限公司网站(www.pyfunds.com)、上海证券交易所网站(www.sse.com.cn)及中国证监会基金电子披露网站(http://fund.csrc.gov.cn/html)的《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》。

二、基金概况

- 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
- 基金场内简称:30年国债
- 基金交易代码:511090
- 2023年6月6日基金份额总额:2,918,146.00份
- 2023年6月6日基金份额净值:100.0857元
- 本次上市交易份额:2,918,146.00份
- 上市交易的证券交易所:上海证券交易所
- 上市交易日期:2023年6月13日
- 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
- 上市推荐人:湘财证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、申万宏源证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、中国银河证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中信证券华南股份有限公司、中信证券(山东)有限责任公司

本公司可根据情况变更申购赎回代理机构。

三、基金的募集与上市交易

- 本基金上市前基金募集情况
- 基金募集申请的注册机构和注册文号:经中国证监会2022年1月10日证监许可[2022]92号文准予注册,2022年8月19日取得中国证监会公募基金募集备案的回函(机构函部[2022]1442号)
- 基金运作方式:交易型开放式
- 基金合同期限:不定期
- 发售日期:自2023年2月17日至2023年5月16日(周六、周日和节假日不受影响)进行发售。其中,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。
- 发售价格:人民币1.00元
- 发售方式:网上现金认购、网下现金认购和网下债券认购3种方式。
- 发售机构:

- (1)网下现金认购及网下债券认购的直销机构:鹏扬基金管理有限公司。
- (2)网上现金认购的发售代理机构:具有基金销售业务资格的上海证券交易所会员资格的证券公司办理网上现金认购业务,具体名单在《招募说明书》中列示。
- (3)网下现金认购的发售代理机构:华泰证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中信证券华南股份有限公司、中信证券(山东)有限责任公司、中信证券华南股份有限公司。
- (4)网下债券发售代理机构:

8. 验资机构名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

9. 募集资金总额及人账情况

此次募集资金认购的持有有效认购金额(不含募集利息)为291,812,000.00元人民币,认购款项在本基金认购日之前产生的利息共计7,953.45元人民币(含募集利息)计入募集资产,认购款项扣除认购费用产生的利息3,290.44元,计入募集资产;各网下现金认购的有效认购资金产生的利息2,663.01元,其中利息折除前部分计入认购资产,折除后部分0.01元计入基金资产。

上述有效认购资金已于2023年5月19日全部划入本基金托管人招商银行股份有限公司的基金托管账户。上述网下现金认购的有效认购资金产生的利息(含利息折除部分)及计入基金资产部分已于2023年5月19日全部划入基金托管人招商银行股份有限公司的基金托管账户。网上现金认购的有效认购资金在募集期间产生的利息将于下一银行利息日后全部划入本基金托管专户。

本次募集有效认购金额为2,110户,按照每份基金份额净值1.00元人民币计算,本次募集资金及其产生的利息和费用共计291,814,663.00元,已全额计入本次基金资产。

10. 基金备案情况

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》以及《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合同》、《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》的有关规定,本基金募集符合有关法律、基金管理人已向中国证监会办理基金备案手续,并于2023年5月19日获书面确认,基金合同自该日起正式生效,自基金合同生效之日起,基金管理人开始正式管理本基金。

11. 基金合同生效日:2023年5月19日

12. 基金合同生效日基金余额(含利息)为291,814,663.00元

13. 根据《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合同》、《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》的有关规定,鹏扬基金管理有限公司决定自本基金进行基金份额折算并变更登记,本次基金份额折算日为2023年5月29日,本次基金份额折算前基金份额总额为2,918,146.00份,折算前基金份额净值为1.0000元,根据本基金的基金份额折算方法,折算后基金份额总额为2,918,146.00份,折算前基金份额净值为100.0857元。本基金基金份额持有人(即基金份额持有人)于2023年5月29日进行了变更登记,折算后的基金份额保留至整数位,小数部分舍去,由此产生的误差计入基金财产。

(二)基金上市交易的主要内容

- 基金上市交易的核准机构和核准文号:上海证券交易所自律监管决定书[2023]126号
- 上市交易日期:2023年6月13日
- 上市交易的证券交易所:上海证券交易所
- 基金场内简称:30年国债
- 基金交易代码:511090
- 本次上市交易份额:2,918,146.00份
- 未上市交易份额的流通规定:本基金上市后,所有的基金份额均可进行交易,不存在未上市交易的基金份额。

8. 基金资产净值的披露:在开始办理基金份额申购或者赎回或基金上市交易后,基金管理人应当在每个开放日交易日的次日,通过规定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日交易日的基金份额净值和基金份额累计净值,并在上海证券交易所网站公布基金份额净值。

根据相关机构规定,基金管理人应在上市前一交易日16:00之前提供ETF基金份额参考净值,作为上市首日的开盘参考价,本基金上市首日开盘参考价由基金管理人根据中债网估值行情估算,与日终基金净值可能存在差异,敬请知悉。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

(一)持有人户数

截至2023年6月6日,本基金基金份额持有人户数为2,110户,平均每户持有的基金份额为1,383.01份。

(二)持有人结构

截至2023年6月6日,本基金份额持有人结构如下:机构投资者持有的基金份额为2,218,066.00份,占基金总份额的76.01%;个人投资者持有的基金份额700,080.00份,占基金总份额的23.99%。

(三)截至2023年6月6日,前十名基金份额持有人情况

序号	基金份额持有人名称	持有份额	占基金总份额的比例
1	武汉科创生物股份有限公司	300,000.00	10.28%
2	中国银河证券股份有限公司	300,000.00	10.28%
3	申万宏源证券有限公司	300,000.00	10.28%
4	中信证券股份有限公司	300,000.00	10.28%
5	方正中期期货有限公司	200,016.00	6.85%
6	上海东证期货有限公司	200,000.00	6.85%
7	华泰期货有限公司	200,000.00	6.85%
8	国泰君安期货有限公司	200,000.00	6.85%
9	中信建投期货有限公司	200,000.00	6.85%
10	奕莲号	30,000.00	1.03%
11	张丽华	30,000.00	1.03%

五、基金主要当事人简介

(一)基金管理人

1. 基金管理人概况

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

邮政编码:100045

法定代表人:杨成波

成立日期:2016年7月6日

批准设立机关及批准设立文号:中国证监会证监许可[2016]453号

组织形式:有限责任公司

注册资本:1.18亿元人民币

存续期间:持续经营

统一社会信用代码:91310115MA1K3E3W2K

经营范围:公开募集证券投资基金管理、基金销售、特定客户资产管理和中国证监会许可的其他业务。

信息披露联系人:张倩

联系电话:400-968-6688

2. 股权结构

鹏扬基金管理有限公司作为专业人土控股的公募基金,治理结构先进、清晰,市场化,具备一般同行业公司难以及的优越性,高度契合资产管理公司“以人为本”的发展理念。公司总经理杨成波先生作为专业人士,持股45.15%,持股比例最高,核心岗位任职超过14%。公司通过建立并不断完善合伙人文化与机制,帮助公司引进关键人才,确保公司长期持续发展。

股东名称	出资额(人民币万元)	出资方式	持股比例
杨成波	5,327.70	货币	45.15%
上海华石投资有限公司	5,322.36	货币	28.16%
宏实资本管理有限公司	1,180.00	货币	10.00%
上海理业企业管理中心(有限合伙)	588.82	货币	4.99%
上海理业企业管理中心(有限合伙)	588.82	货币	4.99%
上海理业企业管理中心(有限合伙)	515.00	货币	4.26%
上海理业企业管理中心(有限合伙)	277.30	货币	2.35%
合计	11,800.00		100%

3. 内部组织结构及职能

自成立以来,公司严格按照法律法规和中国证监会的各项规定及要求,建立组织架构健全、职责划分清晰、决策有效、激励约束合理的治理体系,确保公司规范运作,基金份额持有人利益得到充分保障,并具备风险防范体系,公司设置并适时调整内部组织架构。

目前,公司与国际接轨,设有研究体系、市场体系、中后台支持体系。

其中,投资体系包括:研究体系、权益投资体系、数量投资体系、多资产投资体系,各业务体系下设相应职能部门,负责各自专业分工开展研究、投资管理、投资交易等工作。市场体系包括市场营销部、渠道业务部、机构业务部、零售业务部、互联网金融部、产品开发部,各事业部及以下的分公司及区域业务中心,各业务板块下设相应职能部门,负责各自服务的客户群体开展营销推广和客户服务工作。中后台支持体系包括:风险管理、合规体系、后台体系,各业务板块下设相应职能部门。其中,后台支持体系包括:基金运营、信息技术、财务、人力资源及行政等部门,负责提供后台支持保障。此外,基金管理人还负责制定和执行交易计划,风险管理部负责基金投资及公司运营过程中产生的潜在的风险进行有效管理和控制,合规体系负责公司的合规管理,以及法律相关工作;后台体系负责会计核算、注册

登记、公司IT系统的建立和管理维护、公司财务、人力资源、行政管理等工作。

4. 人员情况

公司根据业务发展需要进行合理的人员配置,重视人才队伍建设和人才发展,截至2023年3月31日,公司现有员工246人,其中72%员工具有硕士及以上学历,形成了一支高素质、专业化的人才队伍。

5. 基金管理人业务介绍

鹏扬基金管理有限公司成立于2016年7月6日,注册资本1.18亿元,注册地为上海,是中国证监会批准设立的全国性公募基金管理人,也是国内首家“私转公”基金管理公司,目前在北京、上海、深圳设有分公司。

公司遵循“专业稳健,回报信任”的经营宗旨,坚持“稳健投资、长期投资”的投资理念,建立完备的投研体系,构建完善的产品线,协同发展主动债券、主动股票、多资产、主动量化、被动指数五大核心策略,致力于打造在资本市场上有影响力的、持续为客户创造价值的资产管理公司。

6. 本基金基金经理

施红俊先生:数量投资部总经理兼指数投资总监,同济大学管理学博士。曾任大公国际资信评估有限公司上海分公司中小企业评级部副经理,中证指数有限公司研究员、固定收益主管、研究开发部副总监。鹏扬中证500质量成长指数证券投资基金基金经理(2019年8月29日至2022年11月8日期间)、鹏扬中证科创创业50指数证券投资基金基金经理(2021年7月16日至2022年11月30日期间)、鹏扬中证量化核心大盘选股股票证券投资基金基金经理(2020年6月9日起任职)、鹏扬沪深300质量成长低波动指数证券投资基金基金经理(2021年5月25日起任职)、鹏扬中证500质量成长交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2021年8月4日起任职)、鹏扬中证数字经济主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2021年12月22日起任职)、鹏扬中债3-5年国开债债券指数证券投资基金基金经理(2022年4月27日起任职)、鹏扬中证数字经济主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2022年9月26日起任职)、鹏扬中证科创创业50交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2022年10月26日起任职)、鹏扬中证500质量成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(2022年11月9日起任职)、鹏扬中证科创创业50交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(2022年12月1日起任职)、鹏扬中证50成份指数证券投资基金基金经理(2023年4月25日起任职)、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经理(2023年5月19日起任职)。

(二) 基金托管人

1. 基本情况

名称:招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)
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
成立日期:1987年4月8日
基金托管资格批文及文号:证监基金字[2002]83号
注册资本:252.20亿元
存续期间:持续经营
基金托管部门负责人:孙乐
资产托管部信息披露负责人:张娜
联系电话:0755-83077987
传真:0755-83195201

2. 发展概况

招商银行成立于1987年4月8日,是我国第一家完全由企业法人持股的股份制商业银行,总行设在深圳。自成立以来,招商银行先后进行了三次增资扩股,并于2002年3月成功地发行了15亿A股,4月9日在上交所挂牌(股票代码:600036),是国内第一家采用国际会计标准上市的公司。2006年9月又成功发行了22.2亿H股,9月22日在香港联交所挂牌交易(股票代码:3968),10月5日行使H股超额配售,共发行了24.2亿H股。截至2023年3月31日,本集团总资产105,087.52亿元人民币,高级法下资本充足率17.39%,权重法下资本充足率14.41%。

2002年8月,招商银行成立基金托管部;2005年8月,经中国证监会同意,更名为资产托管部,现下设基金券商团队、银行信託团队、养老金团队、业务管理团队、产品研发团队、风险管理团队、系统与数据团队、项目支持团队、运营管理团队、基金外包业务团队10个职能团队,现有员工192人。2002年11月,经中国人民银行和中国证监会批准获得证券投资基金托管业务资格,成为国内第一家获得该项业务资格上市银行;2003年4月,正式办理基金托管业务。招商银行资产托管业务资格齐全,招商银行拥有证券投资基金托管、受托投资管理托管、合格境外机构投资者托管(QFII)、合格境内机构投资者托管(QDII)、全国社会保障基金托管、保险资金托管、企业年金基金托管、存托凭证试点存托人等业务资格。

招商银行确立“因势而变、先您所想”的托管理念,恪守诚信,信守承诺的托管核心价值观,独创“6S”托管银行品牌体系,以“保护您的财富、保护您的财富”为历史使命,不断创新托管系统、服务和产品;在业内率先推出“网上托管银行系统”、托管业务综合系统和“6.C”托管服务标准,曾发布公募基金绩效分析报告,并办国内首个托管银行网站,推出国内首个托管大数据平台,成功托管国内第一只券商集合资产管理计划、第一只FOF、第一只信托资金计划、第一只股权私募基金、第一家实现货币市场基金赎回资金T+1到账、第一只境外银行QDII基金、第一只红利ETF基金、第一只“1+N”基金专户理财、第一家大小非解禁资产、第一单TOT保管,实现从单一托管服务商向全面投资者服务机构的转变,得到了同业认可。

招商银行资产托管业务持续稳健发展,社会影响力不断提升,四度蝉联获《财资》“中国最佳托管专业银行”。2016年6月招商银行荣膺《财资》“中国最佳托管银行奖”,成为国内唯一获得该奖项的托管银行;“托管通”获得国内《银行家》2016中国金融创新“十佳金融产品创新奖”;7月荣膺2016年中国资产管理“金贝奖”“最佳托管银行奖”。2017年6月招商银行再度荣膺《财资》“中国最佳托管银行奖”;“多功能网上托管银行2.0”荣获《银行家》2017中国金融创新“十佳金融产品创新奖”;8月荣膺国际财经权威媒体《亚洲银行家》“中国年度最佳托管银行奖”。2018年1月招商银行荣膺《中国基金报》“2017年度优秀托管机构”奖项;同月,招商银行托管大数据平台风险管理系统荣获2016-2017年度银监会系统“金点子”方案一等奖,以及中央金融团工委、全国金融第五届“双提升”金点子方案二等奖;3月荣膺公募基金20年“最佳基金托管银行”奖;5月荣膺国际财经权威媒体《亚洲银行家》“中国年度托管银行奖”;12月荣膺2018东方财富风云榜“2018年度最佳托管银行”、“20年最值得信赖托管银行”奖。2019年3月招商银行荣获《中国基金报》“2018年度最佳基金托管银行”奖;6月荣获《财资》“中国最佳托管机构”“中国最佳养老金托管机构”“中国最佳零售基金行政外包”三项大奖;12月荣获2019东方财富风云榜“2019年度最佳托管银行”奖。2020年1月,荣膺中央国债登记结算有限责任公司“2019年度优秀资产托管机构”奖项;6月荣获《财资》“中国最佳托管机构”“最佳公募基金托管机构”“最佳公募基金行政外包机构”三项大奖;10月荣获《中国基金报》“2019年度最佳基金托管银行”奖。2021年1月,荣膺中央国债登记结算有限责任公司“2020年度优秀资产托管机构”奖项;4月荣获2020东方财富风云榜“2020年度最受欢迎托管银行”奖项;2021年10月,荣获国际清算银行“2021年度优秀托管银行”和《证券时报》“2021年度杰出资产托管银行天玑奖”,2021年12月,荣获《中国基金报》第三届中国公募基金英华奖“2020年度最佳基金托管银行”,2022年1月荣获中央国债登记结算有限责任公司“2021年度优秀资产托管机构、估值业务杰出机构”;9月荣获《财资》“中国最佳托管银行”“最佳公募基金托管银行”“最佳理财托管银行”三项大奖。

3. 基金托管业务经营情况

截至2023年3月31日,招商银行股份有限公司累计托管1223只证券投资基金。

(三) 上市推荐人

名称:湘财证券股份有限公司
注册地址:湖南省长沙市天心区湘府中路198号新城商务中心A栋11楼
办公地址:湖南省长沙市天心区湘府中路198号新城商务中心A栋11楼
法定代表人:高振晋
联系人:江思前
电话:021-50295432
客服电话:9535
传真:021-68865680
网址:www.xcsc.com

(四) 基金验资机构

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

六. 基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件。

七. 基金财务状况

(一) 基金募集期间费用

本次基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用不从基金资产中支付。

(二) 基金上市前重要财务事项

本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

(三) 基金资产负债表

本基金2023年6月6日资产负债表如下:

(除特别注明外,金额单位为人民币元)

资产	本期末 2023年6月6日
资产:	
银行存款	241,489,371.27
结算备付金	115,555.60
存出保证金	708.22
交易性金融资产	52,518,857.53
其中:股票投资	-
基金投资	-
债券投资	52,518,857.53
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	-
应收利息	-
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	35,290.44
资产总计	294,159,783.06
负债和所有者权益	本期末 2023年6月6日
负债:	
短期借款	-
交易性金融负债	-

衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-
应付证券清算款	-
应付赎回款	-
应付管理人报酬	7,199.86
应付托管费	2,399.95
应付销售服务费	-
应付交易费用	-
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	2,085,494.80
负债合计	2,095,094.61
所有者权益：	
实收基金	291,814,663.00
未分配利润	250,025.45
所有者权益合计	292,064,688.45
负债和所有者权益总计	294,159,783.06

八、基金投资组合

本基金目前处于建仓期,在上市首日前,基金管理人将使本基金的投资组合比例符合有关法律法规、部门规章、规范性文件的规定和基金合同的有关约定。

截至2023年6月6日,本基金的投资组合情况如下:

1 基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	52,518,857.53	17.85
	其中:债券	52,518,857.53	17.85
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	241,604,926.87	82.13
8	其他资产	35,998.66	0.01
9	合计	294,159,783.06	100.00

2 按行业分类的股票投资组合

截至2023年6月6日,本基金未持有股票。

3 按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

截至2023年6月6日,本基金未持有股票。

4 按债券品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	52,518,857.53	17.98
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	52,518,857.53	17.98

5 按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	019702	23国债09	400,000	41,117,282.19	14.08
2	019547	16国债19	110,000	11,401,575.34	3.90
-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-

6 按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

截至2023年6月6日,本基金未持有资产支持证券。

7 按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

截至2023年6月6日,本基金未持有贵金属。

8 按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

截至2023年6月6日,本基金未持有权证。

9 本基金投资的股指期货交易情况说明

截至2023年6月6日,本基金未持有股指期货。

10 本基金投资的国债期货交易情况说明

截至2023年6月6日,本基金未持有国债期货。

11 投资组合报告附注

11.1 本基金未发现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查,未发现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

11.2 2根据基金合同规定,本基金的投资范围不包括股票。

11.3 其他资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	708.22
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	35,290.44
7	其他	-
8	合计	35,998.66

11.4 基金持有的处于转股期的可转换债券明细

截至2023年6月6日,本基金未持有处于转股期的可转换债券。

11.5 前十名股票中存在流通受限情况的说明

截至2023年6月6日,本基金未持有股票。

11.6 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,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

九、重大事件揭示

(一)2023年5月20日发布鹏扬中债-30年期国债交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效公告。

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)在获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

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺:

在上海证券交易所的大力支持下,由鹏扬基金管理有限公司管理,并由招商银行股份有限公司托管的鹏扬中债-30年期国债交易型开放式指数证券投资基金已于2023年5月19日成立运作。

在本基金上市后,托管人承诺严格遵守《基金法》等相关法规以及《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合同》、《鹏扬中债-30年期国债交易型开放式指数证券投资基金托管协议》的约定履行相应职责。

十二、基金上市推荐人意见

本基金上市推荐人就基金上市交易事宜出具意见如下:

(一)本基金上市符合《基金法》、《上海证券交易所证券投资基金上市规则》规定的相关条件;

(二)本基金上市文件真实、准确、完整,符合相关规定要求,文件内所载的资料均经过核实。

十三、备查文件目录

以下备查文件存放于基金管理人和基金托管人的公司住所和上海证券交易所,投资者可在办公时间免费查阅。

(一)中国证监会准予本基金募集注册的文件

(二)《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合同》

(三)《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》

(四)《鹏扬中债-30年期国债交易型开放式指数证券投资基金托管协议》

(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、营业执照

附件：基金合同内容摘要

一、基金份额持有人的权利与义务

(一)基金份额持有人的权利与义务

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，且其持有基金份额的行为本身即表明其承认并接受《基金合同》的约束。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。

基金份额持有人享有同等的合法权益。

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) 依法转让或质押其持有的基金份额；
 - (4) 按照规定要求召集基金份额持有人大会或者召集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、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；
 - (9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。
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) 认真阅读并遵守《基金合同》、招募说明书等信息披露文件；
 - (2) 了解并自行承担投资风险，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；
 - (3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；
 - (4) 交纳基金认购/申购款项、申购对价及法律法规和《基金合同》所规定的费用；
 - (5) 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；
 - (6) 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；
 - (7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
 - (8) 返还其在基金交易过程中因任何原因获得的、不当得利；
 - (9) 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) 按照规定召集基金份额持有人大会；
 - (6) 依据《基金合同》及有关法律法规监督基金托管人，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、更换基金销售机构，对基金销售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登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；
 - (10) 依据《基金合同》及有关法律法规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) 依照法律法规为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
 - (13) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金参与融资融券出借证券出借业务；
 - (14) 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；
 - (15) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券期货投资咨询或其他为基金提供服务的中介机构；
 - (16) 在符合法律法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回等业务规则；
 - (17) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。
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、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) 依法接受基金托管人的监督；
 - (8) 严格执行估值程序，计算基金份额认购价格、申购对价、赎回对价的方法符合《基金合同》等法律法规的规定，按有关规定计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回对价，编制申购赎回清单；
 - (9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
 - (10) 编制季度报告、中期报告和年度报告；
 - (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，但向审计、法律等外部专业顾问提供的除外；
 - (13) 按规定向基金份额持有人披露基金资产净值、基金份额申购、赎回对价及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、足额支付赎回对价；
 - (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，保存期限不低于法律法规规定的最低期限；
 - (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交出，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情况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) 当基金管理人将基金财产交由第三方处理时，应当对第三方处理有关基金财产的行为承担责任，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) 募集基金，除法律法规和《基金合同》另有规定外，基金管理人不得收取任何形式的手续费，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议；
 - (26) 建立并保存基金份额持有人名册；
 - (27) 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，依法法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产；
 - (2) 根据《基金合同》、《基金合同》及法律法规的规定，监督基金管理人的投资运作；
 - (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) 根据相关市场规则，为基金开设资金账户、证券账户等投资所需账户，为基金办理证券期货交易资金清算；
 - (5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；
 - (6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；
 - (7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。
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，保证其所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，保证基金财产的完整、独立，不得与基金托管人自有财产及不同的基金财产相混同；
 - (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等投资所需账户，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、基金份额净值、基金份额申购、赎回对价；
 - (9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事宜；
 - (10) 对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告出具意见，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不低于法律法规规定的最低期限；
 - (12) 保存基金份额持有人名册；
 - (13) 按规定制作相关账册并向基金管理人核对；
 - (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对价；
 - (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管理人、基金份额持有人依法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，应为基金份额持有人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议；
 - (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。

二、基金份额持有人的权利与义务

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基金份额的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席大会并行使表决权。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。若以本基金为目标基金，且基金管理人、基金托管人与本基金基金管理人一致的联接基金的基金合同生效，鉴于本基金和联接基金的相关性，联接基金的基金份额持有人可以凭其持有的联接基金的基金份额直接出席本基金基金份额持有人大会或者委派代表出席本基金的基金份额持有人大会并参与表决。在计算参会份额和票数时，联接基金基金份额持有人持有的有效表决权的参会份额数按法律法规为在本基金基金份额持有人大会的权益登记日，联接基金持有本基金份额的总票数乘以该基金份额持有人所持有的联接基金份额占联接基金总份额的比例，计算结果按照四舍五入的方法，保留到整数位。联接基金计算为本基金的每一参会份额后和本基金的每一参会份额享有平等的投票权。
2. 联接基金基金管理人不应以联接基金的名义代表联接基金的全基金份额持有人以本基金的基金份额持有人的身份行使表决权，但可接受联接基金的特定基金份额持有人的委托以联接基金的基金份额持有人代理人的身份出席本基金的基金份额持有人大会并参与表决。
3. 联接基金基金管理人代表联接基金的基金份额持有人提议召开或召集本基金份额持有人大会的，须先遵照联接基金基金合同的约定召开联接基金的基金份额持有人大会，联接基金的基金份额持有人大会决定提议召开或召集本基金份额持有人大会的，由联接基金的基金管理人代表联接基金的基金份额持有人提议召开或召集本基金份额持有人大会。

本基金份额持有人大会不设日常机构。

(一)召开事由

1. 除法律法规、监管机构或基金合同另有规定的，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) 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) 对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
 - (13) 终止基金上市,但因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；
 - (14) 法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其它应当召开基金份额持有人大会的事项。
2. 在法律法规规定和《基金合同》约定的范围内且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下,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) 法律法规要求增加的基金费用的收取；
 - (2) 调整本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；
 - (3) 因相应的法律法规、上海证券交易所或登记结算机构的相关业务规则发生变动而应当对《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) 基金管理人、证券交易所或登记结算机构调整有关基金认购、申购、赎回、交易、非交易过户等业务的规则；
 - (6) 新增、调整基金的申购赎回方式,调整申购赎回清单的内容,调整申购赎回清单计算、公告时间或频率；
 - (7) 基金推出新业务或服务；
 - (8) 调整基金份额类别设置；
 - (9) 根据中债金融估值中心有限公司的要求及其相关协议约定,变更IOPV计算发布费用的计算方法；
 - (10) 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,并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。
 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,但至少提前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日,在指定媒介公告。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、地点和会议形式；
 - (2) 会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；
 - (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) 授权委托证明的内容要求(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；
 - (6) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
 - (7) 召集人需要通知的其他事项。
 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、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。

(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、通讯开会方式或法律法规、监管机构允许的其他方式召开,会议的召开方式由会议召集人确定。
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会议:
 - (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证明符合法律法规、《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益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二分之一(含二分之一)。若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金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,就原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到会者在权益登记日代表的有效的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一(含三分之一)。
 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或基金合同约定的其他方式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式或基金合同约定的其他方式进行表决。

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》约定公布会议通知后,在2个工作日内连续公布相关提示性公告；
 - (2) 召集人按基金合同约定通知基金托管人(如果基金托管人为召集人,则为基金管理人)到指定地点对表决意见的计票进行监督。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表决意见;基金托管人或基金管理人经通知

不参加收取表决意见的,不影响表决效力;

(3)本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的,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);若本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见基金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,就原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以上(含三分之一)基金份额的持有人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见;

(4)上述第(3)项中直接出具表决意见的基金份额持有人或受托代表他人出具表决意见的代理人,同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具表决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证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定,并与基金登记结算机构记录相符。

3.在法律法规或监管机构允许的情况下,经基金份额持有人大会会议通知载明,基金份额持有人也可以选择网络、电话或其他方式进行表决,或者采用网络、电话或其他方式授权他人代为出席会议并表决。为此,基金份额持有人需在会议通知载明的期限内,以会议通知载明的方式向会议召集人提交相应有效的表决票或授权委托书。

(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前及时公告。

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。

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和代理人所持表决权的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拒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)、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名(或单位名称)和联系方式等事项。

(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,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)通过方可做出。除法律法规另有规定或基金合同另有约定外,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》、本基金与其他基金合并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,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,表面符合会议通知规定的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,但应当计入出具表决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和代理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或代理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日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。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。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。

(九)本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定,凡是直接引用法律法规、监管规则的部分,如将来法律法规、监管规则修改导致相关内容被取消或变更的,基金管理人应与基金托管人协商一致并提前公告后,可直接对本部分内容进行修改、调整或补充,无需召开基金份额持有人大会审议。

三、基金收益分配原则、执行方式

(一)基金收益分配原则

1.本基金在符合有关基金分红条件的前提下可进行收益分配,每次收益分配方案见基金管理人届时发布的相关公告;

2.基于本基金的性质和特点,本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提,收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值,即基金收益分配基准日的基金份额净值减去收益分配金额后可能低于面值;

3.《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配;

4.本基金收益分配采取现金分红的方式;

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。

在不违反法律法规的规定且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下,基金管理人在与基金托管人协商一致并按照规定要求履行适当程序后,可对上述基金收益分配原则进行调整并提前公告。

(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对象、分配时间、分配数额及比例、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,依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

(四)基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。

四、与基金财产管理、运用有关的其他费用的提取、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》生效后与基金相关的信息披露费用,但法律、中国证监会另有规定的除外;
- 4.《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费;
- 5.基金份额持有人大会费用;
- 6.基金的证券期货等交易、结算费用;
- 7.基金的银行汇划费用;
- 8.基金上市初费及年费;
- 9.IOPV计算与发布费用;
- 10.登记结算费用;
- 11.基金相关账户的开户及维护费用;
- 12.基金收益分配中发生的费用;
- 13.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。

(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0.15%年费率计提。管理费的计算方法如下:

$$H=E \times 0.15\% \times \text{当年天数}$$

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,逐日累计至每月月末,按月支付,经基金管理人与基金托管人双方核对无误后,基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前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、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0.05%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

$$H=E \times 0.05\% \times \text{当年天数}$$

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,逐日累计至每月月末,按月支付,经基金管理人与基金托管人双方核对无误后,基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5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—13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;
- 4.标的指数许可使用费。标的指数许可使用费由基金管理人承担,不得从基金财产中列支;
- 5.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)基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。基金财产投资的相关税收,由基金份额持有人承担,基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

五、基金财产的投资方向和投资限制

(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。

(二)投资范围

本基金主要投资于标的成份券和备选成份券。为更好地实现投资目标,本基金还可少量投资于债券(包括非标的成份券和备选成份券的其他国债、央行票据、金融债、地方政府债及其他经中国证监会允许投资的债券)、国债期货、货币市场工具、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、债券回购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。

本基金将根据法律法规的规定参与债券借贷业务。

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,可以相应调整本基金的投资范围的规定。

在建仓完成后,本基金投资于债券的比例不低于基金资产净值的80%,其中,投资于标的指数成份券和备选成份券的比例不低于非现金基金资产的80%;其他金融工具的投资比例依据法律法规和监管机构的规定执行。

如法律法规或监管机构以后允许变更投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以相应调整本基金的投资比例的规定。

(三)投资限制

1.组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制:

(1)本基金投资于债券的比例不低于基金资产净值的80%,其中,投资于标的指数成份券和备选成份券的比例不低于非现金基金资产的80%;

(2)本基金参与国债期货交易时,需遵守下列投资比例限制:

①本基金在任何交易日日终,持有的买入国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的15%;本基金在任何交易日日终,持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的30%;本基金在任何交易日日终,持有的买入和卖出国债期货合约成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的30%;

②本基金所持有的债券(不含到期日在一年以内的政府债券)市值和买入、卖出国债期货合约价值,合计(轧差计算)应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定;

③本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;

(3)基金资产总值不超过基金资产净值的140%;

(4)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;

(5)本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%;因证券市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合该比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;

(6)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;

(7)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(5)、(6)情形及上述条款中另有约定之外,因证券市场波动、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份券调整、标的指数成份券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。法律法规或监管机构另有规定的,从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内,本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消上述限制或变更上述限制,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准,但须提前公告,不需要经基金份额持有人大会审议。

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)违反规定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,但是中国证监会另有规定的除外;
- (5)向其基金管理人、基金托管人出资;
- (6)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;
- (7)法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有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,或者从事其他重大关联交易的,应当符合基金的投资目标和投资策略,遵循基金份额持有人利益优先原则,防范利益冲突,建立健全内部审批机制和评估机制,按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意,并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议,并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

如法律、行政法规或监管部门取消或变更上述禁止性规定,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制,或以变更后的规定为准。

六、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) 基金净值信息

《基金合同》生效后,在基金上市交易前且未开始办理基金份额申购或者赎回,基金管理人应当至少每周在规定网站披露一次基金资产净值和基金份额累计净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回或基金上市交易后,基金管理人应当在不晚于每个开放日/交易日的次日,通过规定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日/交易日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日,在规定网站披露半年度和年度最后一日的基金份额净值和基金份额累计净值。

七、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. 变更基金合同涉及法律法规规定或本基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的,应召开基金份额持有人大会决议通过。对于法律法规规定和基金合同约定可不经基金份额持有人大会决议通过的事项,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。

2. 关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自生效后依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

(二) 《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的,经履行相关程序后,《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、符合《中华人民共和国证券法》规定的注册会计师、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》终止情形出现时,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)对基金剩余财产进行分配。

5. 基金财产清算的期限为6个月,但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的,清算期限相应顺延。

(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符合《中华人民共和国证券法》规定的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财产清算报告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,保存期限不低于法律法规规定的最低期限。

八、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,仲裁地点为北京市,仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力。除非仲裁裁决另有规定,仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间,基金管理人、基金托管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。

《基金合同》受中国法律(为基金合同之目的,不含港澳台地区法律)管辖并从其解释。

九、基金合同的存放地和投资者取得基金合同的方式

《基金合同》可印制或册,供投资者在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅。