

关于鹏扬国证财富管理交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金转型为鹏扬国证财富管理指数型发起式证券投资基金并修改相关法律文件的公告

鹏扬基金管理有限公司（以下简称本公司）旗下的鹏扬国证财富管理交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（以下简称本基金）于2023年12月27日经中国证监会证监许可【2023】2911号文准予募集注册，并于2024年1月30日募集成立。

本基金的目标ETF，即鹏扬国证财富管理交易型开放式指数证券投资基金，截止2024年7月11日日终，已出现连续50个工作日低于5000万元的情形，触发其基金合同约定的终止情形。

《鹏扬国证财富管理交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》（以下简称《基金合同》）约定：如目标ETF终止上市或目标ETF基金合同终止，本基金将由投资于目标ETF的联接基金变更为直接投资该标的指数的指数基金，无需召开基金份额持有人大会。基金的投资目标、投资范围、投资策略等相关内容也将作相应修改。

根据有关法律法规的规定及《基金合同》上述约定，本公司经与基金托管人华泰证券股份有限公司协商一致，决定于2024年7月15日起将本基金转型为鹏扬国证财富管理指数型发起式证券投资基金，并对《基金合同》、《鹏扬国证财富管理交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金托管协议》（以下简称《托管协议》）及相关法律文件做相应修改。现将具体事宜公告如下：

一、转型变更为指数基金

本基金转型变更为鹏扬国证财富管理指数型发起式证券投资基金后，本基金的登记机构将进行基金份额变更登记，即将“鹏扬国证财富管理交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金A类基金份额”变更为“鹏扬国证财富管理指数型发起式证券投资基金A类基金份额”，将“鹏扬国证财富管理交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金C类基金份额”变更为“鹏扬国证财富管理指数型发起式证券投资基金C类基金份额”。本基金A类基金简称由“鹏扬国证财富管理ETF发起式联接A”变更为“鹏扬国证财富管理指数型发起式A”，本基金C类基金简称由“鹏扬国证财富管理ETF发起式联接C”变更为“鹏扬国证财富管理指数型发起式C”，基金代码保持不变。

前述变更不影响各类基金份额净值的计算，各类基金份额的申购费率、赎回费率及销售服务费率保持不变。

二、修订《基金合同》、《托管协议》的相关说明

1、为确保本基金转型为鹏扬国证财富管理指数型发起式证券投资基金符合法律、法规的规定和《基金合同》的约定，本基金管理人根据与基金托管人协商一致的结果，对《基金合同》的相关内容进行了修订，具体内容见附件。

2、本次《基金合同》修订的内容对原有基金份额持有人的利益无实质性不利影响，不需召开基金份额持有人大会。本基金管理人已就修订内容履行了规定的程序，符合法律法规及《基金合同》的相关规定。修订后的《鹏扬国证财富管理指数型发起式证券投资基金基金合同》自2024年7月15日起生效，《基金合同》同日起失效。本基金管理人已与基金托管人协商一致，已相应修改《托管协议》。

三、重要提示

1、本公司于本公告日在本公司网站上同时公布经修改后的《基金合同》及《托管协议》，本公司将根据本公告更新本基金的招募说明书、基金产品资料概要相关内容。

2、本公告仅对本次基金转型的有关事项予以说明。欲了解本基金的详细情况，投资者可访问本公司网站 www.pyamc.com 或拨打客服电话 400-968-6688（免长途话费）的方式进行咨询。

四、风险提示

本公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。投资者投资本公司管理的基金时，应认真阅读基金合同、招募说明书等法律文件，并选择适合自身风险承受能力的投资品种进行投资。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

鹏扬基金管理有限公司

2024年7月12日

附件：《鹏扬国证财富管理交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》修改前后对照表

章节	原文条款 内容	修改后条款 内容
第一部分 前言	<p>一、订立本基金合同的目的、依据和原则</p> <p>2、订立基金合同的依据是《中华人民共和国民法典》（以下简称《民法典》）、《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》）、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》（以下简称《销售办法》）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称《流动性风险管理规定》）、《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》（以下简称《指数基金指引》）、《公开募集证券投资基金运作指引第2号——基金中基金指引》（以下简称《基金中基金指引》）和其他有关法律法规。</p>	<p>一、订立本基金合同的目的、依据和原则</p> <p>2、订立基金合同的依据是《中华人民共和国民法典》（以下简称《民法典》）、《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》）、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》（以下简称《销售办法》）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称《流动性风险管理规定》）、《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》（以下简称《指数基金指引》）和其他有关法律法规。</p>
第一部分 前言	<p>三、鹏扬国证财富管理交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（以下简称本基金）由基金管理人依照《基金法》、基金合同及其他有关规定募集，并经中国证券监督管理委员会（以下简称中国证监会）注册。</p> <p>中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值和市场前景做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。</p>	<p>三、鹏扬国证财富管理指数型发起式证券投资基金（以下简称本基金）由鹏扬国证财富管理交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金转型而来，鹏扬国证财富管理交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同及其他有关规定募集，并经中国证券监督管理委员会（以下简称中国证监会）注册。</p> <p>中国证监会对鹏扬国证财富管理交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值和市场前景做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有</p>

		风险。
第一部分 前言	七、本基金主要投资于目标 ETF、标的指数成份股及备选成份股，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、成份股停牌或退市等潜在风险。具体风险详见招募说明书。	七、本基金为指数基金，投资者投资于本基金面临标的指数回报与相应市场平均回报偏离的风险、标的指数波动、跟踪误差控制未达约定目标、标的指数变更、指数编制机构停止服务、成份股停牌或退市等潜在风险。具体风险详见招募说明书。
第二部分 释义	1、基金或本基金：指鹏扬国证财富管理交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	1、基金或本基金：指鹏扬国证财富管理指数型发起式证券投资基金
第二部分 释义	4、基金合同或本基金合同：指《鹏扬国证财富管理交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充 5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《鹏扬国证财富管理交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充 6、招募说明书：指《鹏扬国证财富管理交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金招募说明书》及其更新 7、基金产品资料概要：指《鹏扬国证财富管理交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金产品资料概要》及其更新	4、基金合同或本基金合同：指《鹏扬国证财富管理指数型发起式证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充 5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《鹏扬国证财富管理指数型发起式证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充 6、招募说明书：指《鹏扬国证财富管理指数型发起式证券投资基金招募说明书》及其更新 7、基金产品资料概要：指《鹏扬国证财富管理指数型发起式证券投资基金基金产品资料概要》及其更新
第二部分 释义	18、发起资金：指用于认购发起式基金且来源于基金管理人股东的资金、基金管理人固有资金、基金管理人高级管理人员或基金经理等人员的资金。发起资金认购本基金的金额不低于 1000 万元人民币，且发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年 19、发起资金提供方：指以发起资金认购本基金且承诺以发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年的基金管理人股东、基金管理人、基金管理人高级管理人员或基金经理等人员 20、交易型开放式指数证券投资基金：指《中国证券登记结算有限责任公司关于交易所交易型开放式证券投资基金登记结算业	18、发起资金：指用于认购鹏扬国证财富管理交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金且来源于基金管理人股东的资金、基金管理人固有资金、基金管理人高级管理人员或基金经理等人员的资金。发起资金认购本基金的金额不低于 1000 万元人民币，且发起资金认购的基金份额持有期限自《鹏扬国证财富管理交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》生效之日起不少于 3 年 19、发起资金提供方：指以发起资金认购鹏扬国证财富管理交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金且承诺以发起资金

	务实施细则》(以下简称《登记结算业务实施细则》)定义的“交易型开放式证券投资基金”,简称ETF 21、ETF 联接基金:指将绝大部分基金财产投资于跟踪同一标的指数的ETF(以下简称目标ETF),紧密跟踪标的指数表现,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化,采用开放式运作方式的基金,简称联接基金	认购的基金份额持有期限自《鹏扬国证财富管理交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》生效之日起不少于3年的基金管理人股东、基金管理人、基金管理人高级管理人员或基金经理等人员
第二部分 释义	34、基金合同生效日:指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件,基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕,并获得中国证监会书面确认的日期	32、基金合同生效日:指《鹏扬国证财富管理指数型发起式证券投资基金基金合同》生效日,原《鹏扬国证财富管理交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》自同一日起失效
第二部分 释义	36、基金募集期:指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间,最长不得超过3个月	
第二部分 释义	54、基金资产总值:指基金拥有的各类有价证券、目标ETF份额、银行存款本息、基金应收款项及其他资产的价值总和	51、基金资产总值:指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收款项及其他资产的价值总和
第三部分 基金的基本情况	一、基金名称 鹏扬国证财富管理交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	一、基金名称 鹏扬国证财富管理指数型发起式证券投资基金
第三部分 基金的基本情况	二、基金的类别 ETF 联接基金	二、基金的类别 股票型证券投资基金
第三部分 基金的基本情况	四、基金的投资目标 本基金通过投资于目标ETF,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。	四、基金的投资目标 本基金进行被动式指数化投资,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
第三部分 基金的基本情况	五、基金标的指数及目标ETF 本基金标的指数为深圳证券信息有限公司编制并发布的国证财富管理指数及其未来可能发生的变更。 目标ETF为鹏扬国证财富管理交易型开放式指数证券投资基金。	
第三部分 基金	六、基金的最低募集金额	

的基本情况	<p>本基金为发起式基金，发起资金提供方使用发起资金认购本基金的总金额不少于 1000 万元人民币，且持有认购基金份额的期限自基金合同生效日起不少于 3 年（基金合同生效不满 3 年提前终止的情况除外），期间份额不能赎回。法律法规、监管机构和基金合同另有规定的除外。</p>	
第三部分 基金的基本情况	<p>七、基金份额发售面值和认购费用 本基金基金份额发售面值为人民币 1.00 元。 本基金认购费率按招募说明书及基金产品资料概要的约定执行。</p>	
第三部分 基金的基本情况	<p>十、本基金与目标 ETF 的联系与区别 本基金为目标 ETF 的联接基金，二者既有联系也有区别。 本基金与目标 ETF 之间的联系：（1）两只基金的投资目标均为紧密跟踪业绩比较基准；（2）两只基金具有相似的风险收益特征；（3）目标 ETF 是本基金的主要投资对象。 本基金与目标 ETF 之间的区别：（1）在投资方法上，目标 ETF 主要采取完全复制法，直接投资于标的指数成份股、备选成份股；而本基金则采取间接的方法，通过将绝大部分基金财产投资于目标 ETF，实现对业绩比较基准的紧密跟踪。（2）在交易方式上，投资者既可以像买卖股票一样在交易所市场买卖目标 ETF，也可以按照最小申购、赎回单位和申购赎回清单的要求，申赎目标 ETF；而本基金则像普通的开放式基金一样，通过基金管理人及销售机构按“未知价”原则进行基金的申购与赎回。 本基金与目标 ETF 业绩表现可能出现差异。可能引发差异的因素主要包括：（1）法律法规对投资比例的要求。目标 ETF 作为一种特殊的基金品种，可将全部或接近全部的基金资产，用于跟踪标的指数的表现；而本基金作为普通的开放式基金，本基金每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货和股票期权合约需缴纳的交易</p>	

	<p>易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或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、存出保证金和应收申购款等。（2）申购赎回的影响。目标 ETF 采取按照最小申购、赎回单位和申购赎回清单要求进行申赎的方式，申购赎回对基金净值影响较小；而本基金采取按照未知价法进行申赎的方式，大额申赎可能会对基金净值产生一定冲击。</p>	
<p>第四部分 基金份额的历史沿革</p>	<p>第四部分 基金份额的发售</p> <p>一、基金份额的发售时间、发售方式、发售对象</p> <p>1、发售时间</p> <p>自基金份额发售之日起最长不得超过 3 个月，具体发售时间见基金份额发售公告。</p> <p>2、发售方式</p> <p>通过各销售机构的基金销售网点公开发售，各销售机构的具体名单见基金份额发售公告以及基金管理人网站。</p> <p>3、发售对象</p> <p>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、发起资金提供方以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者。</p> <p>基金管理人有权对发售对象的范围予以进一步限定，具体发售对象见基金份额发售公告以及基金管理人届时发布的相关公告。</p> <p>二、基金份额的认购</p> <p>1、认购费用</p> <p>本基金的认购费率由基金管理人决定，并在招募说明书及基金产品资料概要中列示。基金认购费用不列入基金财产。</p> <p>2、募集期利息的处理方式</p> <p>有效认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金</p>	<p>第四部分 基金份额的历史沿革</p> <p>鹏扬国证财富管理指数型发起式证券投资基金由鹏扬国证财富管理交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金转型而来。鹏扬国证财富管理交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金经 2023 年 12 月 27 日中国证券监督管理委员会证监许可【2023】2911 号文准予募集注册，自 2024 年 1 月 22 日起至 2024 年 1 月 26 日期间向全社会公开募集。募集有效认购总户数为 110 户，募集资金及其产生的利息共计 10,272,839.04 元，折合基金份额 10,272,839.04 份。鹏扬基金管理有限公司向中国证监会办理完毕基金备案手续后，于 2024 年 1 月 30 日获书面确认，《鹏扬国证财富管理交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》自该日起正式生效。</p> <p>2024 年 7 月 11 日，鹏扬国证财富管理交易型开放式指数证券投资基金触发基金合同终止条款。根据《鹏扬国证财富管理交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》的约定，如目标 ETF 终止上市或目标 ETF 基金合同终止，本基金将由投资于目标 ETF 的联接基金变更为直接投资该标的指数的指数基金，无需召开基金份额持有人大会。基金的投资目标、投资范围、投资策略等相关内容也将作相应修改。基金管理人据此决定将鹏扬国证财富管理交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金转</p>

	<p>份额持有人所有，其中利息转份额以登记机构的记录为准。</p> <p>3、基金认购份额的计算 基金认购份额具体的计算方法在招募说明书中列示。</p> <p>4、认购份额余额的处理方式 认购份额余额的处理方式在招募说明书中列示。</p> <p>5、认购申请的确认 基金销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购成功的确认以登记机构的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况，投资人应及时查询。</p> <p>三、基金份额认购金额的限制</p> <p>1、投资人认购时，需按销售机构规定的方式全额缴款。</p> <p>2、基金管理人可以对每个基金交易账户的单笔最低认购金额进行限制，具体限制请参看招募说明书或相关公告。</p> <p>3、基金管理人可以对募集期间的单个投资人的累计认购金额进行限制，具体限制和处理方法请参看招募说明书或相关公告。</p> <p>4、投资人在募集期内可以多次认购基金份额，认购一经受理不得撤销。认购费按每笔认购申请单独计算。</p> <p>四、发起资金的认购 发起资金提供方使用发起资金认购本基金的总金额不少于 1000 万元人民币，且持有认购基金份额的期限自基金合同生效日起不少于 3 年（基金合同生效不满 3 年提前终止的情况除外），期间份额不能赎回。法律法规、监管机构和基金合同另有规定的除外。本基金发起资金的认购情况详见基金管理人届时发布的公告。</p>	<p>型为鹏扬国证财富管理指数型发起式证券投资基金，并相应修订《鹏扬国证财富管理交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》。</p> <p>自 2024 年 7 月 15 日，鹏扬国证财富管理交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金正式转型为鹏扬国证财富管理指数型发起式证券投资基金，《鹏扬国证财富管理指数型发起式证券投资基金基金合同》自该日起生效。</p>
<p>第五部分 基金的存续</p>	<p>第五部分 基金备案</p> <p>一、基金备案的条件</p>	<p>第五部分 基金的存续</p> <p>《鹏扬国证财富管理交易型开放式指数证券投资基金发起式联</p>

	<p>本基金自基金份额发售之日起 3 个月内，在发起资金认购本基金的总金额不少于 1000 万元且发起资金提供方承诺持有期限不少于 3 年的条件下，基金募集期届满或者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，验资报告需对发起资金提供方及其持有的基金份额进行专门说明。基金管理人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。</p> <p>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。基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。</p> <p>二、基金合同不能生效时募集资金的处理方式</p> <p>如果募集期限届满，未满足基金备案条件，基金管理人应当承担下列责任：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用。 2、在基金募集期限届满后 30 日内退还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。 3、如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。 <p>三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模</p> <p>基金合同生效之日起 3 年后的年度对应日，若基金资产净值低于</p>	<p>接基金基金合同》生效之日起三年后的年度对应日，若基金资产净值低于 2 亿元的，基金合同自动终止，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。若届时的法律法规或中国证监会有关发起式基金的规定发生变化，上述终止规定被取消、更改或补充时，则本基金可以参照届时有效的法律法规或中国证监会规定执行。</p> <p>《鹏扬国证财富管理交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》生效满三年后本基金继续存续的，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 50 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元的，本基金根据基金合同的约定进入清算程序并终止，不需召开基金份额持有人大会。</p> <p>法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。</p>
--	---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

	<p>2 亿元的，基金合同自动终止，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。若届时的法律法规或中国证监会有关发起式基金的规定发生变化，上述终止规定被取消、更改或补充时，则本基金可以参照届时有效的法律法规或中国证监会规定执行。</p> <p>基金合同生效满 3 年后继续存续的，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 50 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元的，本基金根据基金合同的约定进入清算程序并终止，不需召开基金份额持有人大会。</p> <p>法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。</p>	
第六部分 基金份额的申购与赎回	<p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>1、本基金基金份额净值的计算，均保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。为避免基金份额持有人利益因基金份额净值小数点保留精度受到不利影响，基金管理人可临时提高基金份额净值的精度，无需就基金份额净值精度调整事项进行公告。出现巨额赎回时，基金份额净值按照巨额赎回的条款执行。本基金不同类别基金份额分别设置基金代码，分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值。T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告。</p>	<p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>1、本基金基金份额净值的计算，均保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。为避免基金份额持有人利益因基金份额净值小数点保留精度受到不利影响，基金管理人可临时提高基金份额净值的精度。出现巨额赎回时，基金份额净值按照巨额赎回的条款执行。本基金不同类别基金份额分别设置基金代码，分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值。T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告。</p>
第六部分 基金份额的申购与赎回	<p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：</p> <p>8、基金所投资的品种的估值出现重大转变时。</p> <p>9、目标 ETF 暂停估值，导致基金管理人无法计算当日基金资产</p>	<p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：</p> <p>5、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者（基金管理人、基金管理人高级管理人员或基金经理等人员作</p>

	<p>净值。</p> <p>10、目标 ETF 暂停申赎、暂停上市或目标 ETF 停牌，基金管理人认为有必要暂停本基金申购的。</p> <p>发生上述第 1-3、6-12 项情形之一且基金管理人决定拒绝或暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在规定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的，被拒绝的申购款项本金将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。</p>	<p>为发起资金提供方的除外）持有基金份额的比例达到或者超过 50%，或者变相规避 50%集中度的情形。</p> <p>发生上述第 1-3、7-10 项情形之一且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在规定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的，被拒绝的申购款项本金将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。</p>
第六部分 基金份额的申购与赎回	<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：</p> <p>8、目标 ETF 暂停估值，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</p> <p>9、目标 ETF 暂停申赎、暂停上市或目标 ETF 停牌，基金管理人认为有必要暂停本基金赎回的。</p>	<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：</p>
第七部分 基金合同当事人及权利义务	<p>二、基金托管人</p> <p>（一）基金托管人简况</p> <p>注册资本：907466.3335 万人民币</p>	<p>二、基金托管人</p> <p>（一）基金托管人简况</p> <p>注册资本：902938.484 万人民币</p>
第七部分 基金合同当事人及权利义务	<p>三、基金份额持有人</p> <p>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：</p> <p>（9）发起资金提供方持有认购的基金份额不少于 3 年，法律法规或监管机构另有规定的除外；</p>	<p>三、基金份额持有人</p> <p>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：</p> <p>（9）发起资金提供方持有认购的基金份额期限自《鹏扬国证财富管理交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》生效之日起不少于 3 年，法律法规或监管机构另有规定的除外；</p>
第八部分 基金	<p>鉴于本基金是目标 ETF 的联接基金，本基金的基金份额持有人可</p>	

<p>份额持有人大会</p>	<p>以凭所持有的本基金份额直接参加或者委派代表参加目标 ETF 基金份额持有人大会并表决。在计算参会份额和票数时，本基金的基金份额持有人持有的享有表决权的参会份额数和表决票数为：在目标 ETF 基金份额持有人大会的权益登记日，本基金持有目标 ETF 基金份额的总数乘以该持有人所持有的本基金份额占本基金总份额的比例，计算结果按照四舍五入的方法，保留到整数位。本基金份额折算为目标 ETF 后的每一参会份额和目标 ETF 的每一参会份额拥有平等的投票权。若本基金启用侧袋机制且特定资产不包括目标 ETF，则本基金的主袋账户份额持有人可以凭持有的主袋账户份额直接参加或者委派代表参加目标 ETF 基金份额持有人大会并表决。</p> <p>本基金的基金管理人不应以本基金的名义代表本基金的全体基金份额持有人以目标 ETF 的基金份额持有人的身份行使表决权，但可接受本基金的特定基金份额持有人的委托以本基金的基金份额持有人代理人的身份出席目标 ETF 的基金份额持有人大会并参与表决。</p> <p>本基金的基金管理人代表本基金的基金份额持有人提议召开或召集目标 ETF 基金份额持有人大会的，须先遵照本基金《基金合同》的约定召开本基金的基金份额持有人大会，本基金的基金份额持有人大会决定提议召开或召集目标 ETF 基金份额持有人大会的，由本基金基金管理人代表本基金的基金份额持有人提议召开或召集目标 ETF 基金份额持有人大会。</p>	
<p>第八部分 基金份额持有人大会</p>	<p>一、召开事由</p> <p>1、除法律法规和中国证监会另有规定或基金合同另有约定外，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：</p>	<p>一、召开事由</p> <p>1、除法律法规和中国证监会另有规定或基金合同另有约定外，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：</p>

	<p>(11)基金管理人代表本基金的基金份额持有人提议召开或召集目标 ETF 份额持有人大会;</p> <p>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:</p> <p>(8)由于目标 ETF 基金交易方式变更、终止上市、基金合同终止、与其他基金进行合并而变更基金投资目标、范围或策略;</p> <p>(9)由于目标 ETF 终止上市或基金合同终止而变更为直接投资该标的指数的指数基金并修改基金合同相应内容包括基金投资目标、范围或策略等;</p> <p>(10)本基金采取特殊申购或其他方式参与目标 ETF 的申购赎回;</p>	<p>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:</p>
第八部分 基金份额持有人大会	<p>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</p> <p>1、召开基金份额持有人大会,召集人应于会议召开前 30 日,在规定媒介公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容:</p>	<p>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</p> <p>1、召开基金份额持有人大会,召集人应至少于会议召开前 30 日,在规定媒介公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容:</p>
第九部分 基金管理人、基金托管人的更换条件和程序	<p>三、新任基金管理人或临时基金管理人接收基金管理业务,或新任基金托管人或临时基金托管人接收基金财产和基金托管业务前,原任基金管理人或原任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。原任基金管理人或原任基金托管人在继续履行相关职责期间,仍有权按照基金合同的规定收取基金管理费或基金托管费。</p>	<p>三、新任基金管理人或临时基金管理人接收基金管理业务前,或新任基金托管人或临时基金托管人接收基金财产和基金托管业务前,原任基金管理人或原任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。原任基金管理人或原任基金托管人在继续履行相关职责期间,仍有权按照基金合同的规定收取基金管理费或基金托管费。</p>
第十二部分 基金的投资	<p>一、投资目标</p> <p>本基金通过投资于目标 ETF,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。</p>	<p>一、投资目标</p> <p>本基金进行被动式指数化投资,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。</p>
第十二部分 基	<p>二、投资范围</p>	<p>二、投资范围</p>

<p>金的投资</p>	<p>股本基金主要投资于目标 ETF、标的指数成份股（含存托凭证）及备选成份股（含存托凭证）。为更好地实现投资目标，本基金还可少量投资于非成份股（包括创业板及其他中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持债券、政府支持机构债券、可转债、可交换债、可分离交易可转债及其他经中国证监会允许投资的债券）、衍生品（包括股指期货、国债期货、股票期权）、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、资产支持证券、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。本基金可以根据有关法律法规的规定参与融资和转融通证券出借业务。</p> <p>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。</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%；本基金每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或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、存出保证金及应收申购款等。</p> <p>如法律法规或监管机构变更投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资比例。</p>	<p>本基金主要投资于标的指数成份股（含存托凭证）、备选成份股（含存托凭证）。为更好地实现投资目标，本基金还可少量投资于非成份股（包括创业板及其他中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持债券、政府支持机构债券、可转债、可交换债、可分离交易可转债及其他经中国证监会允许投资的债券）、衍生品（包括股指期货、国债期货、股票期权）、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、资产支持证券、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。本基金可以根据有关法律法规的规定参与融资和转融通证券出借业务。</p> <p>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。</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；本基金每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或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、存出保证金及应收申购款等。</p> <p>如法律法规或监管机构变更投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资比例。</p>
<p>第十二部分 基金的投资</p>	<p>三、投资策略</p> <p>本基金为目标 ETF 的联接基金，通过投资于目标 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪，力争日均跟踪偏离度绝对值不超过 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</p>	<p>三、投资策略</p> <p>本基金采用被动式指数化投资方法，按照国证财富管理指数中的成份股构成及其权重构建股票投资组合，以跟踪国证财富管理指数的收益表现，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应</p>

	<p>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。</p> <p>(一) 目标 ETF 投资策略</p> <p>本基金投资目标 ETF 的方式如下：</p> <p>(1) 申购、赎回：按照目标 ETF 法律文件约定的方式申赎目标 ETF。</p> <p>(2) 二级市场方式：在二级市场进行目标 ETF 基金份额的交易。当目标 ETF 申购、赎回或交易模式进行了变更或调整，本基金也将作相应的变更或调整，无须召开基金份额持有人大会。</p> <p>本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，决定采用申购、赎回的方式或二级市场方式进行目标 ETF 的投资。</p> <p>(二) 股票投资策略</p> <p>1、股票投资策略</p> <p>基金可投资于标的指数成份股、备选成份股，以更好的跟踪标的指数。同时，还可通过买入标的指数成份股、备选成份股来构建组合以申购目标 ETF。因此对标的指数成份股、备选成份股的投资，主要采取完全复制法，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金投资组合，并根据标的指数组成及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致无法获得足够数量的个券时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代，包括通过投资其他股票进行替代，以降低跟踪误差，优化投资组合的配置结构。</p> <p>2、存托凭证投资策略</p> <p>本基金在把握风险的基础上，对境内外宏观因素、行业发展前景、企业盈利能力、投资时机等进行判断，筛选出具备竞争优势、估</p>	<p>调整。</p> <p>(一) 资产配置策略</p> <p>本基金管理人主要按照标的指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据指数成份股及其权重的变动进行相应调整。基金管理人将综合考虑股票市场情况、基金资产的流动性要求和法律法规限制等因素确定各类资产的具体配置比例。</p> <p>本基金将对基金组合与指数表现的跟踪偏离度和跟踪误差保持动态监控，每月定期分析基金组合与标的指数表现的累积偏离度、跟踪误差变化情况及其原因，并优化跟踪误差管理方案，实现对跟踪偏离度和跟踪误差的有效控制。本基金对标的指数的跟踪目标是：在正常情况下，力争相对于业绩比较基准的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%。</p> <p>(二) 股票投资策略</p> <p>1、标的指数介绍。本基金股票资产跟踪的标的指数为国证财富管理指数。国证财富管理指数是国证指数有限公司从沪深两市选取 40 只财富管理领域相关上市公司作为指数样本股，并采用派氏加权方法的指数。</p> <p>2、股票投资组合构建。本基金采用完全复制法构建股票投资组合，并通过事先设置目标跟踪误差、事中监控、事后调整等手段，严格将跟踪误差控制在规定范围内，控制与标的指数主动偏离的风险。</p> <p>3、股票投资组合调整。本基金所构建的股票投资组合原则上根据标的指数成份股组成及其权重的变动进行相应调整。同时，当出现特殊情形导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以采用包括替代、抽样等技术手段在内的优化复制法来构造股票投资组合，以更好地实现投资目标。其中，替代是指通</p>
--	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

	<p>值合理的存托凭证，以把握存托凭证带来的投资机会。本基金重点从以下 4 个方面来考察存托凭证的投资价值：（1）境外基础证券发行人的基本面情况；（2）存托凭证的估值情况；（3）境外基础证券发行人的股权结构、公司治理、运行规范程度等情况；（4）存托凭证与境外基础证券的投票权差异、协议控制架构或类似特殊安排等存托凭证的特有情况。</p> <p>（三）债券投资策略</p> <p>出于对流动性、跟踪误差、有效利用基金资产的考量，本基金适时对债券进行投资。本基金对债券进行配置的原则是：安全性与流动性优先，且兼顾收益性。通过研究国内外宏观经济、货币和财政政策、市场结构变化、资金流动情况，采取自上而下的策略判断未来利率变化和收益率曲线变动的方向及幅度，确定组合久期，进而根据各类资产的预期收益率确定债券资产配置。</p> <p>（四）衍生品投资策略</p> <p>1、股指期货投资策略</p> <p>本基金进行股指期货投资时，将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，适当参与股指期货的投资。通过利用股指期货，调整投资组合的风险暴露，改善组合的风险收益特性，从而实现套期保值；同时，还可利用股指期货流动性好，交易成本低等特点，对投资组合的仓位进行及时调整，提高投资组合的运作效率，从而实现有效管理。</p> <p>2、国债期货投资策略</p> <p>本基金进行国债期货投资时，将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，并积极采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对国债市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，通过多头或空头套期保值等策略进行套</p>	<p>过投资其他成份股、非成份股或金融衍生品等金融工具来构建对应的风险敞口。为了减小跟踪误差，本基金将按照主营业务相近、市值相近、相关性较高及 β 值相近等原则来选择替代股票。抽样复制法是根据预先设定的标准剔除部分成分股，并对选取的成分股在组合中的相对权重进行再配置，从而使组合的跟踪成本和跟踪误差控制在可以接受的范围之内。基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使得本基金的股票投资组合比例符合《基金合同》的约定。</p> <p>（1）定期调整。根据标的指数的调整规则，对股票投资组合及时进行调整。指数样本每半年调整一次。本基金将按照标的指数对成份股及其权重的调整方案，对股票投资组合进行相应调整。</p> <p>（2）不定期调整。在特殊情况下，基金管理人可以根据市场情况，采取合理措施，对投资组合进行适当性变更和调整，从而更加有效地跟踪标的指数、降低跟踪误差。这些特殊情况包括但不限于以下情形：①法律法规的限制；②标的指数成份股流动性严重不足，或因受股票停牌的限制等其他市场因素，使基金管理人无法依指数权重购买某成份股时；③成份股上市公司存在重大虚假陈述等违规行为、以及面临重大的不利行政处罚或司法诉讼时；④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；⑤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；⑥其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时。</p> <p>4、存托凭证投资策略</p> <p>本基金在把握风险的基础上，对境内外宏观因素、行业发展前景、企业盈利能力、投资时机等进行判断，筛选出具备竞争优势、估值合理的存托凭证，以把握存托凭证带来的投资机会。本基金重</p>
--	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

	<p>期保值操作。充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。</p> <p>3、股票期权投资策略</p> <p>本基金进行股票期权投资时，将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，充分评估股票期权的流动性、风险收益特征等，同时结合对证券市场的判断，优选出估值合理的期权合约，从而有效地实现基金资产的增值及对下跌风险的控制。</p> <p>（五）其他投资策略</p> <p>1、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金资产支持证券投资将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析，评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。</p> <p>2、融资业务策略</p> <p>本基金参与融资业务，将在综合考虑风险、收益、流动性等因素的基础上，通过对市场行情、组合风险收益、信用资质等条件的详细分析，选择合适的交易对手方、确定明确的投资时机及合理的融资比例。若相关业务法律法规发生变化，本基金将从其最新规定，以符合法律法规和监管要求的变化。</p> <p>3、参与转融通证券出借业务</p> <p>本基金将在充分考虑风险和收益特征的基础上，审慎参与转融通证券出借业务。本基金将基于对市场行情和组合风险收益的分析，确定投资时机、标的证券、期限以及投资比例。若相关转融通证券出借业务法律法规发生变化，本基金将从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。</p>	<p>点从以下 4 个方面来考察存托凭证的投资价值：（1）境外基础证券发行人的基本面情况；（2）存托凭证的估值情况；（3）境外基础证券发行人的股权结构、公司治理、运行规范程度等情况；（4）存托凭证与境外基础证券的投票权差异、协议控制架构或类似特殊安排等存托凭证的特有情况。</p> <p>（三）债券投资策略</p> <p>基于对流动性、跟踪误差、有效利用基金资产的考量，本基金适时对债券进行投资。本基金对债券进行配置的原则是：安全性与流动性优先，且兼顾收益性。通过研究国内外宏观经济、货币和财政政策、市场结构变化、资金流动情况，采取自上而下的策略判断未来利率变化和收益率曲线变动的方向及幅度，确定组合久期，进而根据各类资产的预期收益率确定债券资产配置。</p> <p>（四）衍生品投资策略</p> <p>1、本基金进行股指期货投资时，将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，适当参与股指期货的投资。通过利用股指期货，调整投资组合的风险暴露，改善组合的风险收益特性，从而实现套期保值；同时，还可利用股指期货流动性好，交易成本低等特点，对投资组合的仓位进行及时调整，提高投资组合的运作效率，从而实现有效管理。</p> <p>2、本基金进行国债期货投资时，将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，并积极采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对国债市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。</p>
--	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

	<p>未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，本基金可在履行适当程序后相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书中更新。</p>	<p>3、本基金进行股票期权投资时，将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，充分评估股票期权的流动性、风险收益特征等，同时结合对证券市场的判断，优选出估值合理的期权合约，从而有效地实现基金资产的增值及对下跌风险的控制。</p> <p>（五）其他投资策略</p> <p>1、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金资产支持证券投资将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析，评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。</p> <p>2、融资投资策略</p> <p>本基金参与融资业务，将在综合考虑风险、收益、流动性等因素的基础上，通过对市场行情、组合风险收益、信用资质等条件的详细分析，选择合适的交易对手方、确定明确的投资时机及合理的融资比例。若相关业务法律法规发生变化，本基金将从其最新规定，以符合法律法规和监管要求的变化。</p> <p>3、参与转融通证券出借业务</p> <p>本基金将在充分考虑风险和收益特征的基础上，审慎参与转融通证券出借业务。本基金将基于对市场行情和组合风险收益的分析，确定投资时机、标的证券、期限以及投资比例。若相关转融通证券出借业务法律法规发生变化，本基金将从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。</p> <p>未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，本基金可相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书中更新。</p>
<p>第十二部分 基金的投资</p>	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p>	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p>

	<p>基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>（1）本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%。除上述（2）、（3）⑤、（10）、（11）、（12）项情形之外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制、目标 ETF 申购、赎回、交易被暂停或交收延迟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，第（1）项基金管理人应当在 20 个交易日内进行调整，其他项基金管理人应当在 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。</p> <p>2、禁止行为</p> <p>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：</p>	<p>基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>（1）本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。除上述（2）、（3）⑤、（10）、（11）、（12）项情形之外，因证券/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。法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。</p> <p>2、禁止行为</p> <p>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：</p> <p>（4）买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；</p>
<p>第十二部分 基金的投资</p>	<p>五、业绩比较基准</p> <p>未来若出现标的指数不符合要求（因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求及法律法规、监管机构另有规定的除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人应当自该情形发生之日起十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如更换基金标的指数、转换运作方式、与其他基金合并、或者终止基金合同等，并按照监管部门要求履行适当程序。若基金管理人根据监管部门的要求，需要召开基金份额持有人大会，而基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的，基金合同终止，但下文“目标 ETF 发生相关变更情形的处理方式”另有约定的除外。若标的指数及业绩比较基准变更对基金投资无实质性不利影响（包括但不限于编制机构名称变更、指数更名等），则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人可在履</p>	<p>五、业绩比较基准</p> <p>未来若出现标的指数不符合要求（因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求及法律法规、监管机构另有规定的除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人应当自该情形发生之日起十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如更换基金标的指数、转换运作方式、与其他基金合并、或者终止基金合同等，并按照监管部门要求履行适当程序。若基金管理人根据监管部门的要求，需要召开基金份额持有人大会，而基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的，基金合同终止。若标的指数及业绩比较基准变更对基金投资无实质性不利影响（包括但不限于编制机构名称变更、指数更名等），则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人可在履行适当程序后变更标的指数和业绩比较基准，并及时公告。</p>

	行适当程序后变更标的指数和业绩比较基准，并及时公告。	
第十二部分 基金的投资	<p>六、风险收益特征</p> <p>本基金为 ETF 联接基金，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要通过投资于目标 ETF 实现对标的指数的紧密跟踪，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。</p>	<p>六、风险收益特征</p> <p>本基金为股票型基金，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数基金，主要采用指数复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。</p>
第十二部分 基金的投资	<p>八、目标 ETF 发生相关变更情形的处理方式</p> <p>目标 ETF 出现下述情形之一的，本基金将由投资于目标 ETF 的联接基金变更为直接投资该标的指数的指数基金，无需召开基金份额持有人大会；若届时本基金管理人已有跟踪该标的指数的指数基金，则本基金将本着维护投资者合法权益的原则，履行适当的程序后选取其他合适的指数作为标的指数。相应地，本基金基金合同中将删除关于目标 ETF 的表述部分，或变更标的指数，届时将由基金管理人另行公告。</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、目标 ETF 交易方式发生重大变更致使本基金的投资策略难以实现； 2、目标 ETF 终止上市； 3、目标 ETF 基金合同终止； 4、目标 ETF 与其他基金进行合并； 5、目标 ETF 的基金管理人发生变更（但变更后的本基金与目标 ETF 的基金管理人相同的除外）； 6、中国证监会规定的其他情形。 <p>若目标 ETF 变更标的指数，本基金将在履行适当程序后相应变更标的指数且继续投资于该目标 ETF。</p>	
第十三部分 基金的财产	<p>一、基金资产总值</p> <p>基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券、目标 ETF 基金份额</p>	<p>一、基金资产总值</p> <p>基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息和基</p>

	额、票据价值、银行存款本息和基金应收款项以及其他资产的价值总和。	金应收款项以及其他资产的价值总和。
第十四部分 基金资产估值	<p>二、估值对象</p> <p>基金所拥有的目标 ETF、股票、债券、国债期货合约、股指期货合约、股票期权合约、资产支持证券、银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。</p>	<p>二、估值对象</p> <p>基金所拥有的股票、债券、国债期货合约、股指期货合约、股票期权合约、资产支持证券、银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。</p>
第十四部分 基金资产估值	<p>四、估值方法</p> <p>10、目标 ETF 估值方法</p> <p>本基金投资的目标 ETF 份额按照估值日目标 ETF 的基金份额净值估值。如果基金管理人认为按上述价格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协商后，按最能反映其公允价值的价格估值。</p>	四、估值方法
第十四部分 基金资产估值	<p>七、暂停估值的情形</p> <p>4、基金所投资的目标 ETF 发生暂停估值、暂停公告基金份额净值的情形。</p>	七、暂停估值的情形
第十四部分 基金资产估值	<p>十、特殊情况的处理</p> <p>1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 15 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。</p> <p>2、由于不可抗力原因，或由于证券期货交易所、登记结算公司、指数编制机构、期货公司及存款银行等第三方机构发送的数据错误、遗漏等原因，或国家会计政策变更、市场规则变更等非基金管理人或基金托管人过错，基金管理人或基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人或基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。</p>	<p>十、特殊情况的处理</p> <p>1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 14 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。</p> <p>2、由于不可抗力原因，或由于证券/期货交易所、登记结算公司、指数编制机构、期货公司及存款银行等第三方机构发送的数据错误、遗漏等原因，或国家会计政策变更、市场规则变更等非基金管理人或基金托管人过错，基金管理人或基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的或未能避免错误发生的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人或基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。</p>

<p>第十五部分 基金费用与税收</p>	<p>二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式</p> <p>1、基金管理人的管理费</p> <p>本基金对基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费。本基金的管理费按前一日基金资产净值扣除所持有的目标 ETF 基金份额所对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取 0）的 0.50% 年费率计提。</p> <p>管理费的计算方法如下： $H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$ 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扣除所持有的目标 ETF 基金份额部分的基金资产净值，若为负数，则取 0 基金管理费每日计提，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 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、公休日等，支付日期顺延。</p> <p>2、基金托管人的托管费</p> <p>本基金对基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费。本基金的托管费按前一日基金资产净值扣除所持有的目标 ETF 基金份额所对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取 0）的 0.10% 年费率计提。</p> <p>托管费的计算方法如下： $H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$ 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扣除所持有的目标 ETF 基金份额部分的基金资产净值，若为负数，则取 0 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</p>	<p>二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式</p> <p>1、基金管理人的管理费</p> <p>本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下： $H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$ 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 基金管理费每日计提，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 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、公休日等，支付日期顺延。</p> <p>2、基金托管人的托管费</p> <p>本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 年费率计提。托管费的计算方法如下： $H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$ 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 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。</p>
-----------------------------	--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

	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 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。	
第十五部分 基金费用与税收	<p>三、不列入基金费用的项目</p> <p>下列费用不列入基金费用：</p> <p>3、《基金合同》生效前的相关费用；</p>	<p>三、不列入基金费用的项目</p> <p>下列费用不列入基金费用：</p> <p>3、《基金合同》生效前的相关费用根据《鹏扬国证财富管理交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》的约定执行；</p>
第十八部分 基金的信息披露	<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>公开披露的基金信息包括：</p> <p>（一）基金招募说明书、基金产品资料概要、《基金合同》、基金托管协议、基金份额发售公告</p> <p>基金募集申请经中国证监会注册后，基金管理人应当在基金份额发售的三日前，将基金份额发售公告、基金招募说明书提示性公告、基金合同提示性公告登载在规定报刊上；将基金份额发售公告、基金招募说明书、基金产品资料概要、《基金合同》和基金托管协议登载在规定网站上，其中基金产品资料概要还应当登载在基金销售机构网站或营业网点；基金托管人应当同时将《基金合同》、基金托管协议登载在规定网站上。</p> <p>（二）《基金合同》生效公告</p> <p>基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日在规定报刊和规定网站上登载《基金合同》生效公告。</p> <p>基金管理人应当在基金合同生效公告中披露基金管理人、基金管理人高级管理人员、基金经理等投资管理人员以及基金管理人股东持有本基金的份额及其承诺的持有期限。</p> <p>（五）基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金</p>	<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>公开披露的基金信息包括：</p> <p>（一）基金招募说明书、基金产品资料概要、《基金合同》、基金托管协议、基金份额发售公告</p> <p>（四）基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告</p> <p>（五）临时报告</p> <p>27、本基金在《鹏扬国证财富管理交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》生效满 3 年后，连续 30、40、45 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的；</p>

	<p>季度报告</p> <p>《基金合同》生效不足两个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。</p> <p>(六) 临时报告</p> <p>26、目标 ETF 变更；</p> <p>28、本基金在《基金合同》生效满 3 年后，连续 30、40、45 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的；</p>	
第十八部分 基金的信息披露	<p>八、当出现下述情况时，基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金相关信息：</p> <p>4、基金所投资的目标 ETF 发生暂停估值、暂停公告基金份额净值的情形；</p>	<p>八、当出现下述情况时，基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金相关信息：</p>
第二十部分 违约责任	<p>三、由于基金管理人、基金托管人不可控制的因素导致业务出现差错，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现错误的，由此造成基金财产或投资人损失，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但是基金管理人和基金托管人应积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。</p>	<p>三、由于基金管理人、基金托管人不可控制的因素导致业务出现差错，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现错误的或未能避免错误发生的，由此造成基金财产或投资人损失，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但是基金管理人和基金托管人应积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。</p>
第二十二部分 基金合同的效力	<p>1、《基金合同》经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字或签章并在募集结束后经基金管理人向中国证监会办理基金备案手续，并经中国证监会书面确认后生效。</p>	<p>1、《基金合同》由《鹏扬国证财富管理交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》修订而来。自 2024 年 7 月 15 日起，本基金合同生效，《鹏扬国证财富管理交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》自同一日起失效。</p>