

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（C 份额）

基金产品资料概要（更新）

编制日期：2024 年 7 月 22 日

送出日期：2024 年 7 月 30 日

本概要提供本基金的重要信息，是招募说明书的一部分。

作出投资决定前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。

一、产品概况

基金简称	鹏扬中证 500 质量成长 ETF 联接	基金代码	007593
下属基金简称	鹏扬中证 500 质量成长 ETF 联接 C	下属基金代码	007594
基金管理人	鹏扬基金管理有限公司	基金托管人	兴业银行股份有限公司
基金合同生效日	2022-11-09	上市交易所及上市日期	不适用
基金类型	股票型	交易币种	人民币
运作方式	开放式(普通开放式)	开放频率	每个开放日
基金经理	施红俊	开始担任本基金基金经理的日期	2022-11-09
		证券从业日期	2005-03-01
其他	本基金由鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金于 2022 年 11 月 9 日 转型而来。《基金合同》生效后，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 个工作日出现前述情形的，基金合同终止，不需召开基金份额持有人大会。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的情形除外)、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，但基金合同中“目标 ETF 发生相关变更情形时的处理”另有约定的除外。		

二、基金投资与净值表现

（一）投资目标与投资策略

阅读本公司《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招募说明书》第八部分了解详细情况。

投资目标	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。力争日均跟踪偏离度绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%。
投资范围	本基金的标的指数为中证 500 质量成长指数。

本基金主要投资于目标 ETF、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(包括主板、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)、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许投资的香港联合交易所上市的股票(以下简称港股通标的股票)、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、可转债、可交换债、可分离交易可转债的纯债部分及其他经中国证监会允许投资的债券)、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、信用衍生品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。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%；投资于港股通标的股票的比例不得超过本基金所投资股票资产的 50%；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。

如果法律法规或中国证监会变更基金投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

主要投资策略

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。本基金产品投资策略主要包括目标 ETF 投资策略、股票投资策略、债券投资策略、衍生品投资策略及其他投资策略。

业绩比较基准

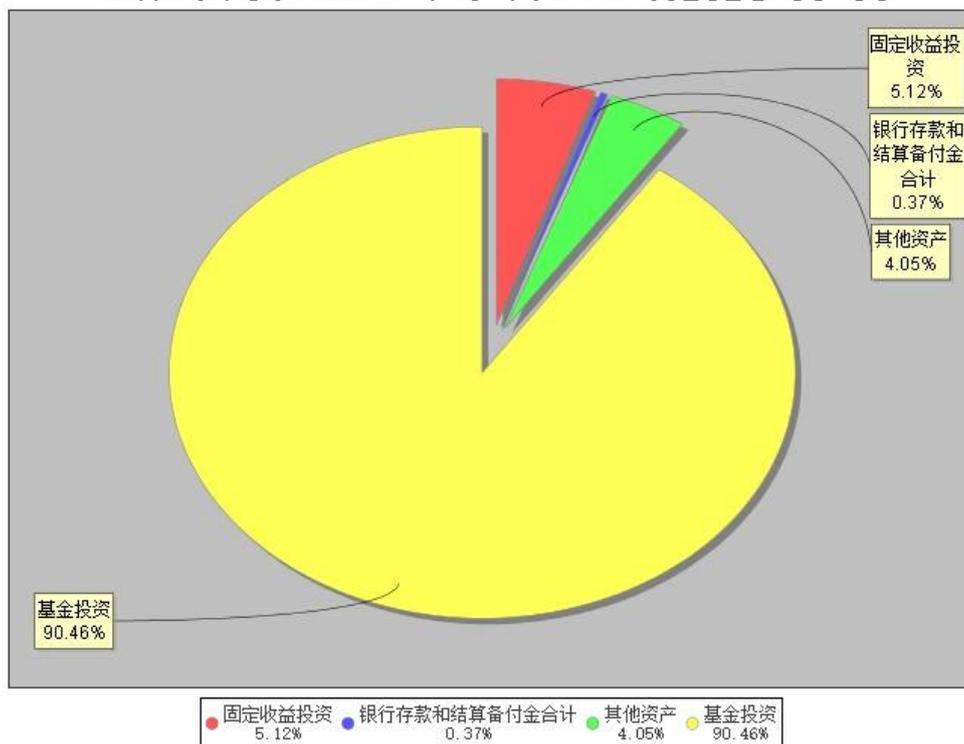
中证 500 质量成长指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%

风险收益特征

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。

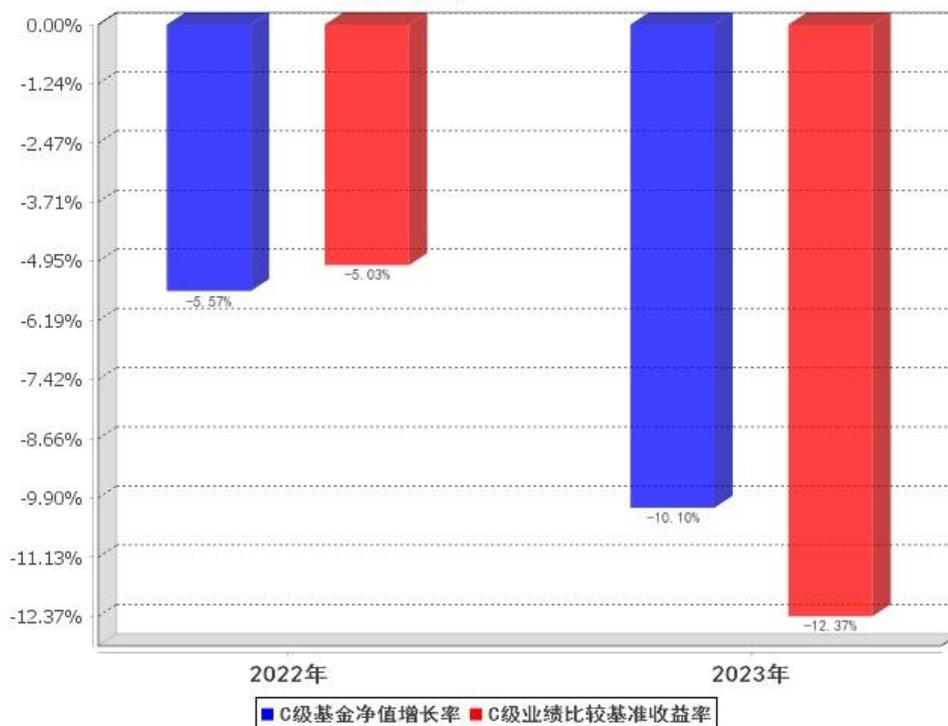
（二）投资组合资产配置图表

报告期末资产组合情况-截止日期:2024-06-30



(三) 自基金合同生效以来/最近十年（孰短）基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

C级自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图
截止日期:2023-12-31



- 注：（1）本基金基金合同生效日为2022年11月9日。
 （2）合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。
 （3）业绩表现截止日期2023年12月31日。基金过往业绩不代表未来表现。

三、投资本基金涉及的费用

（一）基金销售相关费用

以下费用在赎回基金过程中收取：

费用类型	份额（S）或金额（M）/持有期限（N）	收费方式/费率	备注
赎回费	N<7 天	1.50%	-
	N≥7 天	0.00%	-

（二）基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除：

费用类别	收费方式/年费率或金额	收取方
管理费	0.45%	基金管理人、销售机构
托管费	0.10%	基金托管人
销售服务费	0.40%	销售机构
审计费用	75,000	会计师事务所
信息披露费	120,000	规定披露报刊

注：1、本基金交易证券、基金等产生的费用和税负，按实际发生额从基金资产扣除。

2、本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费、托管费。

3、审计费用、信息披露费为基金整体承担费用，非单个份额类别费用，且年金额为预估值，最终实际金额以基金定期报告披露为准。

4、基金合同生效后与本基金相关的律师费、诉讼费、仲裁费、基金份额持有人大会费用等可以在基金财产中列支的其他费用按照国家有关规定和基金合同约定在基金财产中列支。费用类别详见本基金基金合同及招募说明书或其更新。

（三）基金运作综合费用测算

若投资者认购/申购本基金份额，在持有期间，投资者需支出的运作费率如下表：

鹏扬中证 500 质量成长 ETF 联接 C

基金运作综合费率（年化）
0.98%

注：基金管理费率、托管费率、销售服务费率（若有）为基金现行费率，其他运作费用以最近一次基金年报披露的相关数据为基准测算。

四、风险揭示与重要提示

（一）风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。投资有风险，投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。

本基金的风险主要包括：市场风险、管理风险、流动性风险、操作和技术风险、合规性风险、基金管理人职责终止风险、本基金特有的风险及其他风险等。

本基金特有的风险：(1) 联接基金的特殊风险，包括可能具有与目标 ETF 不同的风险收益特征及净值增长率的风险、目标 ETF 面临的风险可能直接或间接成为本基金的风险、由目标 ETF 的联接基金变更为直接投资目标 ETF 标的指数成份股的指数基金的风险。(2) 指数投资相关的风险，包括指数化投资相关的风险、标的指数的风险、基金跟踪偏离与跟踪误差风险、指数编制机构停止服务的风险、成份股停牌或违约的风险。(3) 本基金可根据投资策略需要或不同配置地的市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称港股通标的股票）或选择不将基金资产投资于港股通标的股票，基金资产并非必然投资港股通标的股票。投资港股通标的股票可能使本基金面临港股通交易机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来

的特有风险。(4)本基金可投资存托凭证，如果投资，基金净值可能受到存托凭证的境外基础证券价格波动影响，存托凭证的境外基础证券的相关风险、存托凭证发行机制和交易机制等相关风险可能直接或间接成为本基金的风险。(5)本基金可投资股指期货和国债期货，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。(6)本基金可投资股票期权，可能存在流动性风险、价格风险、操作风险等。(7)本基金为对冲信用风险可投资于信用衍生品，信用衍生品的投资可能面临流动性风险、偿付风险以及价格波动风险等。(8)本基金可投资资产支持证券，资产支持证券可能面临的信用风险、利率风险、流动性风险、提前偿付风险、操作风险和法律风险等风险，由此可能增加本基金净值的波动性。(9)本基金可根据法律法规的规定和基金合同的约定进行融资业务交易，如参与，可能存在杠杆投资风险、提前了结融资交易风险、担保物追加及强制平仓风险、对手方交易风险等融资业务特有风险。(10)本基金可参与转融通证券出借业务，可能因此面临的风险包括但不限于流动性风险、信用风险、市场风险及其他风险。(11)基金自动清盘风险。

（二）重要提示

中国证监会对鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金转型为本基金的变更注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金投资者作出投资决定前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人。

基金合同生效后，基金产品资料概要的信息发生重大变更的，基金管理人将在三个工作日内更新，其他信息发生变更的，基金管理人每年更新一次。因此，本文件内容相比基金的实际情况可能存在一定的滞后，如需及时、准确获取基金的相关信息，敬请同时关注基金管理人发布的相关临时公告等。

与本基金/基金合同相关的争议解决方式为仲裁。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，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市，具体内容详见《基金合同》。

五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站 www.pyamc.com 或拨打客服电话 400-968-6688

- 1、基金合同、托管协议、招募说明书
- 2、定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告
- 3、基金份额净值
- 4、基金销售机构及联系方式
- 5、其他重要资料

六、其他情况说明

无