

鹏扬中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金

基金产品资料概要（更新）

编制日期：2024 年 7 月 25 日

送出日期：2024 年 8 月 4 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 | 基金代码 | 560500 |
| 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 | 2021-08-04 | 上市交易所及上市日期 | 上海证券交易所 2021-09-01 |
| 基金类型 | 股票型 | 交易币种 | 人民币 |
| 运作方式 | 交易型开放式 | 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 | 2021-08-04 |
| | | 证券从业日期 | 2005-03-01 |
| 场内简称 | 500 质量 | | |
| 扩位证券简称 | 500 质量成长 ETF | | |

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招募说明书》第十一部分了解详细情况。

| | |
|--------|---|
| 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。 |
| 投资范围 | 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（含中小板、创业板及其他中国证监会注册或核准上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、金融债、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、地方政府债券、可转换债券、可交换债券、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）、衍生品（包括股指期货、国债期货、股票期权）、资产支持证券、货币市场工具（含同业存单、债券回购等）、银行存款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，本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的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%；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。 |
| 主要投资策略 | 本基金主要采取完全复制法股票投资策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。在一般情况下，本基金将根据标的指数的成份股票的构成及其权重构建股票资产组合。此外，本基 |

金的投资策略还包括替代性策略、存托凭证投资策略、债券与资产支持证券投资策略、衍生品投资策略、融资与转融通证券出借业务投资策略等。

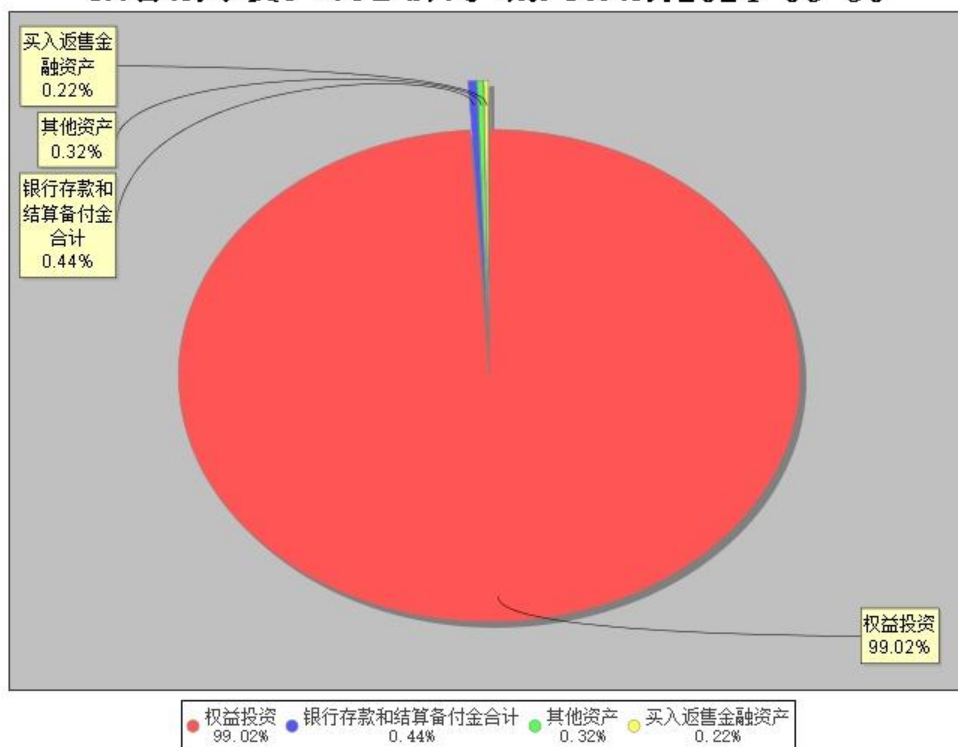
业绩比较基准 中证 500 质量成长指数收益率

本基金属于股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

风险收益特征 本基金为被动投资的交易型开放式指数基金，主要采用完全复制策略，跟踪标的指数市场表现，具有与标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

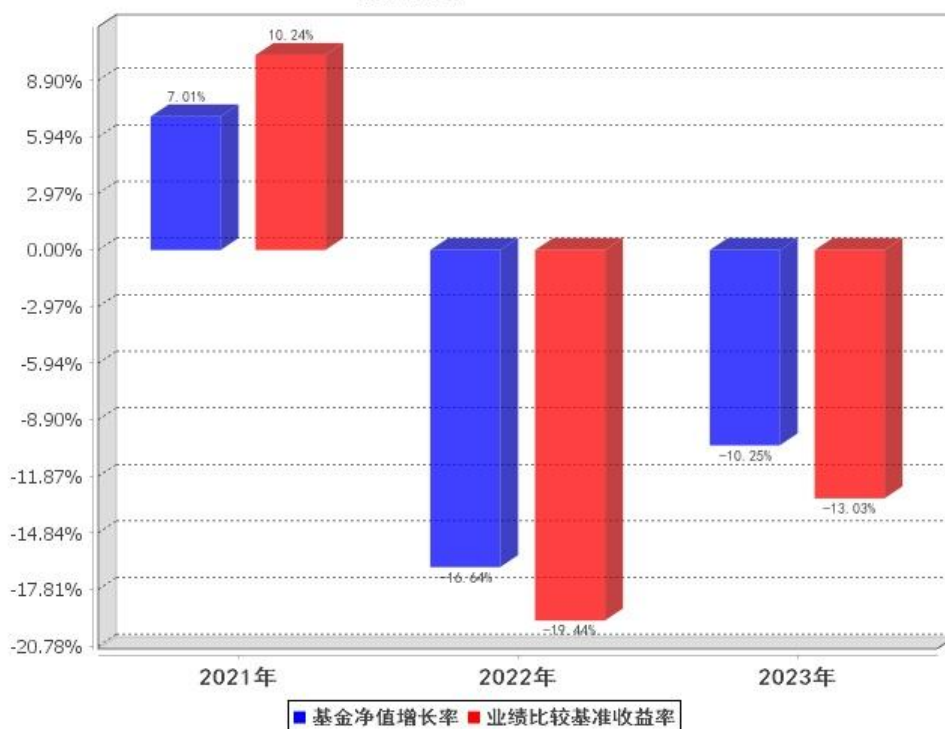
（二）投资组合资产配置图表

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

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 2021 年 8 月 4 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

注：(1)投资人在申购或赎回基金份额时，申购赎回代理券商可按照不超过 0.50% 的标准收取佣金，其中包含证券交易所、登记结算机构等收取的相关费用。

(2)场内交易费用以证券公司实际收取为准。

(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 | 0.05% | 基金托管人 |
| 审计费用 | 60,000 | 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、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。

3、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：

基金运作综合费率（年化）

0.53%

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、投资股指期货、国债期货、股票期权的风险、投资资产支持证券的风险、参与融资及转融通证券出借业务的风险以及其他风险。

本基金特有的风险：投资者可能面临标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、标的指数波动的风险、跟踪误差未达约定目标的风险、标的指数变更的风险、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、IOPV 计算错误的风险、申购赎回清单差错风险、退市风险、退补现金替代方式的风险、投资者申购失败的风险、投资者赎回失败的风险、基金份额赎回对价的变现风险、二级市场的流动性风险、指数编制机构停止服务风险、成份股停牌或违约的风险、第三方机构服务的风险等。

本基金的具体运作特点详见基金合同和招募说明书的约定，投资本基金可能面临的风险详见招募说明书的“风险揭示”部分。

（二） 重要提示

中国证监会对本基金募集的注册，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