

# 鹏扬基金管理有限公司关于以通讯方式召开鹏扬中证 500 质量成长 指数证券投资基金基金份额持有人大会的公告

## 一、召开会议基本情况

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》和《鹏扬中证500质量成长指数证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，并经与基金托管人兴业银行股份有限公司（以下简称“本基金托管人”或“基金托管人”）协商一致，鹏扬中证500质量成长指数证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金管理人鹏扬基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”或“基金管理人”）决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，会议的具体安排如下：

1、会议召开方式：通讯方式。

2、会议投票表决起止时间：自2022年8月12日至2022年11月7日17:00止（以收到表决票的时间为准）。

3、会议通讯表决票的送达地点：

收件人：鹏扬基金管理有限公司客户服务部

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

联系人：张妍

联系电话：400-968-6688

邮政编码：100043

请在信封表面注明：“鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

## 二、会议审议事项

《关于鹏扬中证500质量成长指数证券投资基金转型为鹏扬中证500质量成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金并修订基金合同等有关事项的议案》（见附件一）。

上述议案的内容说明见《关于鹏扬中证500质量成长指数证券投资基金转型为鹏扬中证500质量成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金并修订基金合同等有关事项的方案说明书》（见附件四）。

## 三、权益登记日

本次基金份额持有人大会的权益登记日为2022年8月11日，该日在本基金登记机构登记

在册的本基金全体基金份额持有人均有权参与本次基金份额持有人大会的表决。

#### 四、表决票的填写和寄交方式

##### （一）纸质表决票的填写和寄交方式

1、本次会议表决票见附件二。基金份额持有人可通过剪报、复印获取表决票或登录本基金管理人网站（[www.pyamc.com](http://www.pyamc.com)）下载等方式获取表决票。

2、基金份额持有人应当按照表决票的要求填写相关内容，其中：

（1）个人投资者自行投票的，需在表决票上签字，并提供个人身份证明文件（包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）正反面复印件。

（2）机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本单位公章或基金管理人认可的其他印章（以下合称“公章”），并提供加盖公章的企业法人营业执照副本复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。

（3）合格境外机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本单位公章（如有）或由授权代表在表决票上签字（如无公章），并提供该授权代表的身份证明文件（包括使用的身份证或护照或其他能够表明其身份的有效证件或证明）正反面复印件、该合格境外机构投资者所签署的授权委托书或者证明该授权代表有权代表该合格境外机构投资者签署表决票的其他证明文件、该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件，以及取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件。

（4）个人投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供个人投资者身份证明文件（包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）正反面复印件，以及填妥的授权委托书原件（见附件三）。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证明文件（包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）正反面复印件；如代理人为机构，还需提供代理人加盖公章的企业法人营业执照副本复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。

（5）机构投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供机构投资者加盖公章的企业法人营业执照副本复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等），以及填妥的授权委托书原件（见附件三）。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证明文件（包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）正反面复印件；如代理人为机构，

还需提供代理人加盖公章的企业法人营业执照副本复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。

（6）直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面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书符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金登记注册机构记录相符。

（7）以上各项中的签字、公章、批文、开户证明及登记证书等文件，以本基金管理人的认可为准。

3、基金份额持有人或其代理人需将填妥的表决票和所需的相关文件于 2022 年 8 月 12 日至 2022 年 11 月 7 日 17:00 期间（以收到表决票的时间为准），通过专人送交、快递或邮寄的方式送达至本公告列明的送达地点，请在信封表面注明：“鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

#### （二）网络投票（仅适用于个人投资者）

为方便基金份额持有人参与大会投票，基金管理人提供或指定网络投票通道供个人投资者进行投票。网络投票的起止时间自 2022 年 8 月 12 日起至 2022 年 11 月 7 日 17:00 止（投票时间以系统记录时间为准）。通过网络进行投票的基金份额持有人，应正确填写姓名、证件号码等信息，以核实基金份额持有人的身份，确保基金份额持有人权益。

基金份额持有人通过上述网络投票的方式仅适用于个人投资者，对机构投资者暂不开通。

### 五、授权

为便于基金份额持有人参与本次基金份额持有人大会，除直接投票外，基金份额持有人还可以授权委托他人代其参与基金份额持有人大会并投票。根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，基金份额持有人授权委托他人在基金份额持有人大会上表决的，需符合以下规则：

#### （一）委托人

本基金的基金份额持有人可授权委托他人代理行使本次基金份额持有人大会的表决权。基金份额持有人授权委托他人行使表决权的票数按该基金份额持有人在权益登记日所持有的全部基金份额数计算，一份基金份额代表一票表决权。投资者在权益登记日未持有本基金基金份额的，授权无效。

投资者在权益登记日是否持有本基金基金份额以及所持有基金份额的数额，以本基金登记机构的登记为准。

## （二）受托人

基金份额持有人可以授权委托本基金的基金管理人或其他符合法律规定的机构或个人，代其行使表决权。

## （三）授权方式

### 1、纸面方式授权

（1）个人基金份额持有人委托他人投票的，受托人应提供由委托人填妥并签署的授权委托书原件（见附件三），并提供基金份额持有人的个人身份证明文件（包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）正反面复印件。如受托人为个人，还需提供受托人的身份证明文件（包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）正反面复印件；如受托人为机构，还需提供该受托人加盖公章的企业法人营业执照副本复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。

（2）机构投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供机构投资者加盖公章的企业法人营业执照副本复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等），以及机构投资者填妥并签署的授权委托书原件（见附件三）。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证明文件（包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）正反面复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的加盖公章的企业法人营业执照副本复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。

（3）合格境外机构投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件，以及取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件，以及合格境外机构投资者填妥的授权委托书原件（见附件三）。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证明文件（包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）正反面复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的加盖公章的企业法人营业执照副本复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。

（4）代理人将在取得基金份额持有人签署的授权委托书后统一办理委托投票手续（包括提供代理人有关证明文件）。

（5）以上各项及本公告正文全文中的签字、公章、批文、开户证明及登记证书，以基

基金管理人的认可为准。

(6) 纸面授权文件的送达方式、送达时间、收件地址、联系方式等与表决票送达要求一致。

#### 2、电话授权（仅适用于个人投资者）

为方便基金份额持有人参与本次基金份额持有人大会，基金份额持有人可拨打本基金管理人客户服务电话(400-968-6688转人工，免收长途话费)，并按提示确认身份后授权基金管理人投票。

本基金管理人也可主动与基金份额持有人取得联系，在通话过程中以回答提问方式核实基金份额持有人身份后，由人工坐席根据基金份额持有人意愿进行授权记录并完成基金份额持有人对基金管理人授权。为保护基金份额持有人利益，整个通话过程将被录音。

#### 3、短信授权（仅适用于个人投资者）

为方便基金份额持有人参与本次基金份额持有人大会，本基金管理人可以通过短信平台向预留有效手机号码的基金份额持有人发送授权征集短信，基金份额持有人可回复短信表明授权意见。

### （四）授权效力确定规则

1、如果同一基金份额持有人进行了授权委托，又直接投票表决，则以直接表决为有效表决，授权委托无效。

2、如果同一基金份额持有人通过纸面及其他多种方式进行了有效授权，不论授权时间先后，均以有效的纸面授权为准。

3、如果同一基金份额持有人在不同时间多次通过纸面方式进行有效授权，无论授权意向是否相同，均以最后一次授权为准。

4、如果最后时间收到的纸面授权有多次，不能确定最后一次授权的，按以下原则处理：若多次授权的授权表示一致的，按照该相同的授权表示为准；若多次授权同一代理人但授权表示不一致的，视为委托人授权代理人选择其中一种授权表示行使表决权；若授权不同代理人且授权表示不一致的，视为授权无效，不计入有效票。

5、如果委托人在授权委托书中明确其表决意见的，以委托人的表决意见为准；如果授权委托书中未明确委托人的表决意见的，即视为授权代理人按照代理人的意志全权行使表决权；如委托人在授权委托书中表达多种表决意见的，视为委托人授权代理人选择其中一种表决意见行使表决权。

### （五）授权时间的确定

如基金份额持有人通过纸面方式进行授权，授权时间以本基金管理人收到授权委托书的时间为准。如基金份额持有人通过非纸面方式进行授权，授权时间以系统记录时间为准。

## 六、计票

1、本次通讯会议的计票方式为：由本基金管理人授权的两名监督员在本基金托管人授权代表的监督下于本公告所通知的表决截止日期后2个工作日内进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。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。

2、基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

3、表决票效力的认定如下：

(1) 表决票填写完整清晰，所提供文件符合公告规定，且在规定时间之前送达指定收件人的，为有效表决票；有效表决票按表决意见计入相应的表决结果，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

(2) 基金份额持有人送达了有效表决票，又存在有效纸面授权或有效非纸面授权的，以其送达的有效表决票为准。

(3) 如表决票上的表决意见未选、多选或无法辨认、表决意见空白、字迹模糊不清、相互矛盾或意愿无法判断，但其他各项符合本公告规定的，视为弃权表决，计入有效表决票；并按“弃权”计入对应的表决结果，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

(4) 如表决票上的签字或盖章部分填写不完整、不清晰的，或未能提供有效证明基金份额持有人身份或代理人经有效授权的证明文件的，或未能在规定时间之前送达指定收件人的，均为无效表决票；无效表决票不计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

(5) 基金份额持有人重复提交表决票的，如各表决票表决意见相同，则视为同一表决票；如各表决票表决意见不相同，则按如下原则处理：

① 送达时间不是同一天的，以最后送达的填写有效的表决票为准，先送达的表决票视为被撤回；

② 送达时间为同一天的，视为在同一表决票上做出了不同表决意见，计入弃权表决票；

③ 送达时间按如下原则确定：专人送达的以实际递交给指定收件人的时间为准，邮寄的以指定收件人收到的时间为准。

## 七、决议生效条件

1、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）；

2、本次议案经参加基金份额持有人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）同意，则视为表决通过，形成的基金份额持有人大会决议有效；

3、本次基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效，本基金管理人在通过之日起5日内报中国证监会备案，并自基金份额持有人大会决议生效之日起2日内在规定媒介上公告。

#### **八、二次召集基金份额持有人大会**

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及《基金合同》的规定，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）时，基金份额持有人大会方可举行。如果本次基金份额持有人大会不符合前述要求而不能成功召开，本基金管理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，但权益登记日仍为2022年8月11日。

重新召集基金份额持有人大会时，对于投票而言，基金份额持有人在本次基金份额持有人大会所投的有效表决票依然有效，但如果基金份额持有人重新进行投票的，则以最新的有效表决票为准。重新召开基金份额持有人大会时，除非授权文件另有载明，本次基金份额持有人大会授权期间基金份额持有人做出的各类授权依然有效，但如果授权方式发生变化或者基金份额持有人重新做出授权，则以最新方式或最新授权为准，详细说明见届时发布的重新召集基金份额持有人大会的通知。

#### **九、本次大会相关机构**

1、召集人：鹏扬基金管理有限公司

2、基金托管人：兴业银行股份有限公司

3、公证机关：北京市方圆公证处

地址：北京市东城区朝阳门内大街东水井胡同5号北京INN大厦3层

联系人：赵蓉

联系电话：010-85197506

邮政编码：100010

4、见证律师：上海市通力律师事务所

#### **十、重要提示**

1、请基金份额持有人在提交表决票时，充分考虑邮寄在途时间，确保表决票于表决截止时间前送达。

2、投资者可登录本基金管理人网站（[www.pyamc.com](http://www.pyamc.com)）或拨打本基金管理人客户服务电话（400-968-6688）了解本次基金份额持有人大会相关事宜。

3、基金管理人将在发布本公告后，在2个工作日内连续公布相关提示性公告，就基金份额持有人大会相关情况做必要说明，请予以留意。

4、本公告的有关内容由鹏扬基金管理有限公司负责解释。

特此公告

鹏扬基金管理有限公司

二〇二二年八月八日

附件一：《关于鹏扬中证500质量成长指数证券投资基金转型为鹏扬中证500质量成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金并修订基金合同等有关事项的议案》

附件二：《鹏扬中证500质量成长指数证券投资基金基金份额持有人大会通讯表决票》

附件三：《授权委托书》

附件四：《关于鹏扬中证500质量成长指数证券投资基金转型为鹏扬中证500质量成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金并修订基金合同等有关事项的方案说明书》



附件一：

**关于鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金转型为鹏扬中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金并修订基金合同等有关事项的议案**

鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金基金份额持有人：

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》《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》和《鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）等有关规定，经与基金托管人兴业银行股份有限公司协商一致，鹏扬基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）决定以通讯方式召开鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金份额持有人大会，审议本基金转型为鹏扬中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金并修订基金合同等有关事项。《关于鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金转型为鹏扬中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金并修订基金合同等有关事项的方案说明书》见附件四。为实施本次会议议案，提议授权基金管理人办理有关具体事宜，包括但不限于确定本基金转型为鹏扬中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金的具体时间，根据本次审议事项对基金合同等法律文件进行修订，并根据现时有效的法律法规、基金托管人信息更新及基金实际投资运作情况对基金合同等法律文件进行其他必要的修订和补充。

以上议案，请予审议。

鹏扬基金管理有限公司

二〇二二年八月八日

附件二：

## 鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金基金份额持有人大会通讯

### 表决票

基金份额持有人姓名/名称：			
基金份额持有人证件号码（身份证件号/营业执照号）：			
基金份额持有人基金账户号：			
受托人（代理人）姓名/名称：			
受托人（代理人）证件号码（身份证件号/营业执照号）：			
审议事项	同意	反对	弃权
《关于鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金转型为鹏扬中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金并修订基金合同等有关事项的议案》			
基金份额持有人/受托人（代理人）签名或盖章			
日期：____年____月____日			
<p>说明：1、请就审议事项表示“同意”、“反对”或“弃权”，并在相应栏内画“√”，同一议案只能表示一项意见。2、“基金账户号”，仅指持有本基金基金份额的基金账户号，同一基金份额持有人拥有多个此类账户且需要按照不同账户持有基金份额分别行使表决权的，应当分别填写基金账户号；其他情况可不必填写。此处空白、多填、错填、无法识别等情况的，将被默认为代表此基金份额持有人所持有的本基金所有基金份额。3、如表决票上的表决意见未选、多选、无法辨认、表决意见空白、字迹模糊不清、相互矛盾或意愿无法判断，但其他各项符合会议通知规定的，视为弃权表决，计入有效表决票；并按“弃权”计入对应的表决结果，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。4、如表决票上的签字或盖章部分填写不完整、不清晰的，或未能提供有效证明基金份额持有人身份或代理人经有效授权的证明文件的，或未能在规定时间内送达基金管理人的，均为无效表决票；无效表决票不计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。5、本表决票可从基金管理人网站（<a href="http://www.pyamc.com">www.pyamc.com</a>）或中国证监会基金电子披露网站（<a href="http://eid.csrc.gov.cn/fund">http://eid.csrc.gov.cn/fund</a>）下载、从报纸上剪裁、复印或按此格式打印。</p>			

附件三：

## 授权委托书

兹委托            先生/女士/公司代表本人（或本机构）参加投票截止日为 2022 年 11 月 7 日的以通讯方式召开的鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金基金份额持有人大会，并代为全权行使对议案的表决权。表决意见以代理人的表决意见为准。

若鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金重新召集审议相同议案的持有人大会的，本授权继续有效。

委托人（签字/盖章）：

委托人证件号码：

委托人基金账号：

代理人（签字/盖章）：

代理人身份证号或营业执照号：

委托日期：     年   月   日

附注：

1、本授权委托书中“委托人证件号码”，指基金份额持有人在开立持有本基金基金份额的基金账户时所使用的证件号码或该证件号码的更新。

2、“基金账号”指持有本基金基金份额的基金账户号码。同一基金份额持有人拥有多个基金账户且需要按照不同账户持有的基金份额分别行使授权的，应当填写基金账号；其他情况可不必填写。此处空白、多填、错填、无法识别等情况，将被默认为代表此基金份额持有人所持有的本基金所有基金份额。

3、此授权委托书可剪报、复印、打印或按以上格式自制，填写完整并签字盖章后均为有效。

附件四：

**关于鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金转型为鹏扬中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金并修订基金合同等有关事项的方案说明书**

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》《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》和《鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”或“《基金合同》”）等有关规定，经与基金托管人兴业银行股份有限公司协商一致，鹏扬基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）决定以通讯方式召开鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金（以下简称“本基金”）基金份额持有人大会，审议本基金转型为鹏扬中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金并修订基金合同等事宜。涉及的主要修订情况如下（具体修订详见附表）：

**一、基金类别变更**

基金类别由股票指数基金变更为 ETF 联接基金。

**二、基金投资目标、投资范围及投资比例等变更**

**1、本基金投资目标**

由“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。力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的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%。”

变更为：“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%。”

**2、本基金投资范围**

由“本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，以中证 500 质量成长指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于其他股票（非标的指数成份股及其备选成份股，含中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册的上市股票、存托凭证）、银行存款、债券、债券回购、权证、股指期货、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

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。”

变更为：

“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。”

### **3、基金的投资组合比例**

由“本基金投资于中证 500 质量成长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%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货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。”

变更为：“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。”

### **4、根据修改后的投资范围调整业绩比较基准、投资策略、投资限制及风险收益特征。**

### **三、估值对象、估值方法、暂停估值的情形等变更**

根据修改后的投资范围调整估值对象、估值方法等，并增加估值原则。

#### 四、增加自动终止条款

由“《基金合同》生效后，连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续六十个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。

法律法规另有规定时，从其规定。”

变更为：

“《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。

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。”

#### 五、修改基金费用

##### (1) 修改基金管理费、基金托管费计提标准

由“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 0.45% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.45\% \div \text{当年天数}$$

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，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初 3 个工作日内按照指定的账户路径及日期进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。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 0.10% 的年费率计提。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

基金托管费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，

自动在次月初3个工作日内按照指定的账户路径及日期进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。”

变更为:

#### “1、基金管理人的管理费

本基金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目标ETF基金份额部分的基金资产净值后的余额(若为负数,则取0)的0.45%年费率计提。管理费的计算方法如下:

$$H=E \times 0.45\% \div \text{当年天数}$$

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前一日所持有目标ETF基金份额部分的基金资产净值,若为负数,则E取0

基金管理费每日计提,按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在次月初3个工作日内按照指定的账户路径及日期进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令。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目标ETF基金份额部分的基金资产净值后的余额(若为负数,则取0)的0.10%的年费率计提。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扣除前一日所持有目标ETF基金份额部分的基金资产净值后的余额,若为负数,则取0

基金托管费每日计提,按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在次月初3个工作日内按照指定的账户路径及日期进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。”

(2) 标的指数许可使用费由基金管理人承担,不再从基金财产中列支。

## 六、变更基金赎回费率

原赎回费率为:

A类基金份额		C类基金份额
持有期限 (Y)	赎回费率	赎回费率
Y < 7 日	1.50%	1.50%
7 日 ≤ Y < 30 日	0.75%	0.50%
30 日 ≤ Y < 180 日	0.50%	0%
Y ≥ 180 日	0%	

变更为:

A类基金份额		C类基金份额
持有期限 (Y)	赎回费率	赎回费率
Y < 7 日	1.50%	1.50%
Y ≥ 7 日	0%	0%

## 七、其他修订

根据基金转型后的特点、现时有效的法律法规、基金托管人信息更新及基金实际投资运作情况对基金合同等法律文件进行的其他必要修订和补充。

如本次基金份额持有人大会议案获得通过,基金管理人将在基金份额持有人大会决议生效公告中公告上述修订事项的生效日期,即鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金转型为鹏扬中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金的起始日期,请投资者关注。基金管理人将于修订生效当日发布本基金更新后的基金合同、托管协议、招募说明书及基金产品资料概要,届时投资者可登录本公司网站 (www.pyamc.com) 查阅。

### 附表: 基金合同修订对照表

章节	原文条款	修改后条款
	内容	内容
前言	2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》(以下简称“《合同法》”)、《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	2、订立本基金合同的依据是《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



	<p>下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(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>	<p>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>
前言	<p>(三)鹏扬中证500质量成长指数证券投资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价值和收益做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。</p>	<p>(三)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(以下简称本基金)由鹏扬中证500质量成长指数证券投资基金转型而来。鹏扬中证500质量成长指数证券投资基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同及其他有关规定变更注册,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>
前言	<p>(六)本基金为指数基金,投资者可能面临基金跟踪误差控制未达约定目标、指数编制机构停止服务、成份股停牌或违约等潜在风险,具体风险详见招募说明书。</p>	<p>(六)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,详见本基金招募说明书。</p>
前言		<p>(八)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,包括但不限于:港股市场股价波动较大的风险(港股市场实行T+0回转交易,且对个股不设涨跌幅</p>

		<p>限制，港股股价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动)、汇率风险 (汇率波动可能对基金的投资收益造成损失)、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险 (在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险) 等。</p> <p>(九) 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。</p> <p>(十) 本基金可投资股指期货和国债期货，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。本基金可投资股票期权，可能面临的风险包括但不限于流动性风险、价格风险、操作风险等，可能给投资带来重大损失。具体详见招募说明书“风险揭示”章节。</p> <p>(十一) 为对冲信用风险，本基金可能投资于信用衍生品，如果投资，信用衍生品投资可能面临流动性风险、偿付风险以及价格波动风险等。</p>
--	--	--

<p><b>释义</b></p>	<p>1、基金或本基金：指鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金</p> <p>4、基金合同或本基金合同：指《鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充</p> <p>5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《鹏扬中证 500 质量成长指数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</p> <p>6、招募说明书：指《鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金招募说明书》及其更新</p> <p>7、基金产品资料概要：指《鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金基金产品资料概要》及其更新</p> <p>8、基金份额发售公告：指《鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金基金份额发售公告》</p>	<p>1、基金或本基金：指鹏扬中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金</p> <p>4、基金合同或本基金合同：指《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合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充</p> <p>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托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充</p> <p>6、招募说明书：指《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》及其更新</p> <p>7、基金产品资料概要：指《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产品资料概要》及其更新</p>
<p><b>释义</b></p>	<p>10、《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，经 2012 年 12 月 28 日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自 2013 年 6 月 1 日起实施，并经 2015 年 4 月 24 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改&lt;中华人民共和国港口法&gt;等七部法律的决定》修改的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订</p> <p>11、《销售办法》：指中国证监会 2013 年 3 月 15 日颁布、同年 6 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订</p> <p>12、《信息披露办法》：指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订</p>	<p>9、《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，经 2012 年 12 月 28 日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自 2013 年 6 月 1 日起实施，并经 2015 年 4 月 24 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改&lt;中华人民共和国港口法&gt;等七部法律的决定》修正的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订</p> <p>10、《销售办法》：指中国证监会 2020 年 8 月 28 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订</p> <p>11、《信息披露办法》：指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日实施的，并经 2020 年 3 月 20 日中国证监会《关于修改部分证券期货规章的决定》修正的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订</p>

释义		<p>17、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</p> <p>18、ETF 联接基金：指将绝大部分基金财产投资于跟踪同一标的的指数的 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</p>
释义	<p>20、机构投资者：指依法可以投资开放式证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织</p> <p>21、合格境外机构投资者：指符合相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者</p> <p>22、投资人：指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者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人的合称</p>	<p>21、机构投资者：指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织</p> <p>22、合格境外投资者：指符合《合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者境内证券期货投资管理办法》及相关法律法规规定使用来自境外的资金进行境内证券期货投资的境外机构投资者，包括合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者</p> <p>23、投资人：指个人投资者、机构投资者和合格境外投资者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人的合称</p>
释义	<p>24、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务</p>	<p>25、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务</p>
释义	<p>30、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</p>	<p>31、基金合同生效日：指《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合同》生效日，原《鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金基金合同》自同日起终止</p>
释义	<p>32、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</p>	
释义	<p>35、T 日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的工作日</p>	<p>35、T 日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日</p>
释义	<p>37、开放日：指为投资人办理基金份额</p>	<p>37、开放日：指为投资人办理基金份额</p>

	申购、赎回或其他业务的工作日	申购、赎回或其他业务的工作日（若本基金参与港股通交易且该工作日为非港股通交易日时，则本基金可以不开放申购和赎回等业务，具体以届时公告为准）
释义	40、认购：指在基金募集期内，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为	
释义	43、基金转换：指基金份额持有人按照本基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的、且由同一登记机构办理登记的其他基金基金份额的行为	42、基金转换：指基金份额持有人按照本基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金基金份额的行为
释义	45、定期定额投资计划：指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期扣款日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式	44、定期定额投资计划：指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期扣款日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及受理基金申购申请的一种投资方式
释义	49、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	48、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
释义	53、指定媒介：指中国证监会指定的用以进行信息披露的全国性报刊及指定互联网网站（包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介	52、规定媒介：指符合中国证监会规定条件的用以进行信息披露的全国性报刊及《信息披露办法》规定的互联网网站（包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介
释义	55、流动性受限资产：指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等	54、流动性受限资产：指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等
释义		59、港股通：指内地投资人委托内地证券公司，经由内地证券交易所设立的证券交易服务公司，向香港联合交易所进行申报，买卖规定范围内的香港联合交易所上市股票

		<p>60、信用衍生品：指符合证券交易所或银行间市场相关业务规则，专门用于管理信用风险的信用衍生工具</p> <p>61、信用保护买方：亦称信用保护购买方，指接受信用风险保护的一方</p> <p>62、信用保护卖方：亦称信用保护提供方，指提供信用风险保护的一方</p> <p>63、名义本金：亦称交易名义本金，指为信用衍生品交易提供信用风险保护的金额，各项支付和结算以此金额为计算基准</p> <p>64、转融通证券出借业务：指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司（以下简称证券金融公司）出借证券，证券金融公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务</p>
释义	<p>62、特定资产：包括：（1）无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性的资产；（2）按摊余成本计量且计提资产减值准备仍导致资产价值存在重大不确定性的资产；（3）其他资产价值存在重大不确定性的资产。</p>	<p>66、特定资产：包括：（1）无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性的资产；（2）按摊余成本计量且计提资产减值准备仍导致资产价值存在重大不确定性的资产；（3）其他资产价值存在重大不确定性的资产</p>
基金的基本情况	<p>一、基金名称 鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金</p> <p>二、基金的类别 股票型证券投资基金</p>	<p>一、基金名称 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</p> <p>二、基金的类别 ETF 联接基金</p>
基金的基本情况	<p>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。力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的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%。</p> <p>五、基金的最低募集份额总额 本基金的最低募集份额总额为 2 亿份。</p> <p>六、基金份额面值和认购费用 本基金基金份额发售面值为人民币 1.00 元。</p> <p>本基金 A 类基金份额的具体认购费率按招募说明书的规定执行，C 类基金份额不收取认购费。</p>	<p>四、基金的投资目标 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%。</p> <p>五、目标 ETF 鹏扬中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金（以下简称鹏扬中证 500 质量成长 ETF）。</p> <p>六、基金份额类别设置 ……投资人可自行选择申购的基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间不得相互转换。……</p> <p>八、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</p>

	<p>七、基金份额类别设置</p> <p>……投资人可自行选择认购或申购的基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间不得相互转换。……</p>	<p>有联系也有区别。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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：</p> <p>（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股指期货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>第四部分 基金的历史沿革与存续</p> <p>一、基金的历史沿革</p> <p>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由鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金转型而来。鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金经中国证监会《关于准予鹏</p>

<p>2、发售方式 本基金将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详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 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、机构投资者和合格境外机构投资者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人。</p> <p>（二）基金份额的认购</p> <p>1、认购费用 本基金 A 类基金份额在认购时收取认购费用；C 类基金份额不收取认购费用。本基金的 A 类基金份额的认购费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。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 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份额持有人所有，其中利息转份额的具体数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、投资人认购前，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</p>	<p>扬中证 500 质量成长指数证券投资基金注册的批复》（证监许可[2019]376号）准予募集注册，基金管理人为鹏扬基金管理有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金自 2019 年 7 月 25 日至 2019 年 8 月 26 日进行公开募集，募集结束后基金管理人向中国证监会办理备案手续。经中国证监会书面确认，《鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金基金合同》于 2019 年 8 月 29 日生效。2021 年 8 月 4 日，基金管理人管理的鹏扬中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金正式成立。基金管理人根据持有人大会会议决议，决定将鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金转换为鹏扬中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金的联接基金，即本基金。</p> <p>自 202X 年 XX 月 XX 日起，鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金正式转型为鹏扬中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金。</p> <p>二、基金的存续</p> <p>《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。</p> <p>法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。</p>
--	--



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。

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。A类基金份额的认购费按每笔A类基金份额认购申请单独计算。

## 第五部分 基金备案

### 一、基金备案的条件

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,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。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。

### 二、基金合同不能生效时募集资金的处理方式

如果募集期限届满,未满足募集生效条件,基金管理人应当承担下列责任:

- 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日内退还投资人已缴纳的款项,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。

### 三、基金存续期内的基金份额持有人数

	<p>量和资产规模</p> <p>《基金合同》生效后,连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形,基金管理人应当在定期报告中予以披露;连续六十个工作日出现前述情形的,基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案,如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等,并召开基金份额持有人大会进行表决。法律法规另有规定时,从其规定。</p>	
<p><b>基金份额的申购与赎回</b></p>	<p>一、申购和赎回场所</p> <p>本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售机构将由基金管理人在招募说明书或基金管理人网站列明。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构,并在管理人网站公示。基金投资人应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供其他方式办理基金份额的申购与赎回。</p>	<p>一、申购和赎回场所</p> <p>本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售机构将由基金管理人在招募说明书或基金管理人网站列明。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构,并在基金管理人网站公示。基金投资人应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供其他方式办理基金份额的申购与赎回。</p>
<p><b>基金份额的申购与赎回</b></p>	<p>二、申购和赎回的开放日及时间</p> <p>1、开放日及开放时间</p> <p>投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回,具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间,但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。</p> <p>基金合同生效后,若出现新的证券市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况,基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整,但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。</p> <p>2、申购、赎回开始日及业务办理时间</p> <p>在确定申购开始与赎回开始时间后,基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告申购与赎回的开始时间。</p> <p>基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转</p>	<p>二、申购和赎回的开放日及时间</p> <p>1、开放日及开放时间</p> <p>投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回,具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间(若该交易日为非港股通交易日,则本基金有权不开放申购、赎回等业务,并按规定进行公告),但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。</p> <p>基金合同生效后,若出现新的证券市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况,基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整,但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。</p> <p>2、申购、赎回开始日及业务办理时间</p> <p>在确定申购开始与赎回开始时间后,基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告申购与赎回的开始时间。</p> <p>基金管理人不得在基金合同约定之外</p>

	换申请且登记机构确认接受的,其基金份额申购、赎回价格为下一开放日基金份额申购、赎回的价格。	的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的,其基金份额申购、赎回价格为下一开放日该类基金份额申购、赎回的价格。
<b>基金份额的申购与赎回</b>	<p>三、申购与赎回的原则</p> <p>5、遵循“基金份额持有人利益优先”原则,基金管理人在办理基金份额申购、赎回业务时,如果发生申购、赎回损害持有人利益的情形时,应当及时暂停申购、赎回业务;</p> <p>基金管理人可在法律法规允许的情况下,对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。</p>	<p>三、申购与赎回的原则</p> <p>5、办理申购、赎回业务时,应当遵循基金份额持有人利益优先原则,确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待;</p> <p>基金管理人可在法律法规允许的情况下,对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。</p>
<b>基金份额的申购与赎回</b>	<p>四、申购与赎回的程序</p> <p>3、申购和赎回申请的确认</p> <p>基金管理人可以在法律法规和基金合同允许的范围内,对上述业务办理时间进行调整,并在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。</p> <p>4、申购与赎回的登记</p> <p>投资人申购基金成功后,登记机构在T+1日为投资人登记权益并办理登记手续,投资人自T+2日(含该日)后有权赎回该部分基金份额。</p> <p>投资人赎回基金成功后,登记机构在T+1日为投资人办理扣除权益的登记手续。</p> <p>基金管理人可以在法律法规允许的范围内,对上述登记办理时间进行调整,但不得实质影响投资人的合法权益,并最迟于开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。</p>	<p>四、申购与赎回的程序</p> <p>3、申购和赎回申请的确认</p> <p>基金管理人可以在法律法规和基金合同允许的范围内,对上述业务办理时间进行调整,并在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。</p>
<b>基金份额的申购与赎回</b>	<p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>4、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时,基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施,切实保护存量基金份额持有人的合</p>	<p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>4、基金管理人有权规定本基金的总规模限额、单日申购金额上限、净申购比例上限,具体规定请参见招募说明书或相关公告。</p> <p>5、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时,基</p>

	<p>法权益，具体规定请参见相关公告。</p> <p>5、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。</p>	<p>金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体规定请参见相关公告。</p> <p>6、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。</p>
<p><b>基金份额的申购与赎回</b></p>	<p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>1、本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码，分别计算和公告各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。本基金各类基金份额净值的计算，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。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，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。</p> <p>2、申购份额的计算及余额的处理方式：本基金申购份额的计算详见《招募说明书》。本基金 A 类基金份额的申购费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。申购的有效份额为净申购金额除以当日的该类基金份额净值，有效份额单位为份，上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。</p> <p>3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见《招募说明书》。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。</p>	<p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>1、本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码，分别计算和公告各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。本基金各类基金份额净值的计算，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。T 日的各类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>2、申购份额的计算及余额的处理方式：本基金申购份额的计算详见《招募说明书》。本基金 A 类基金份额的申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。申购的有效份额为净申购金额除以当日的该类基金份额净值，有效份额单位为份，上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。</p> <p>3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见《招募说明书》。本基金的赎回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。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。</p>

<p><b>基金份额的申购与赎回</b></p>	<p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>7、基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式,并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。</p>	<p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>7、基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式,并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。</p> <p>8、当本基金发生大额申购或赎回情形时,基金管理人可以采用摆动定价机制,以确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。</p>
<p><b>基金份额的申购与赎回</b></p>	<p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>3、证券、期货交易所交易时间非正常停市,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</p> <p>5、基金资产规模过大,使基金管理人无法找到合适的投资品种,或其他可能对基金业绩产生负面影响,从而损害现有基金份额持有人利益的情形。</p> <p>6、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或登记机构的异常情况导致基金销售系统、基金登记结算系统、基金会计系统或证券登记结算系统无法正常运行。</p> <p>7、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人持有基金份额的比例达到或者超过 50%,或者变相规避 50%集中度的情形时。</p>	<p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>3、证券、期货交易所或外汇市场交易时间非正常停市,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</p> <p>5、基金资产规模过大,使基金管理人无法找到合适的投资品种,或其他可能对基金业绩产生负面影响,或发生其他损害现有基金份额持有人利益的情形。</p> <p>6、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或登记机构的异常情况导致基金销售系统、基金登记系统、基金会计系统无法正常运行。</p> <p>7、基金所投资的品种的估值出现重大转变时。</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申购的。</p> <p>12、基金参与港股通交易且港股通交易每日额度不足。</p>
<p><b>基金份额的申购与赎回</b></p>	<p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>发生上述第 1、2、3、5、6、9、10 项暂停申购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指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝,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>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>发生上述第 1、2、3、5、6、7、8、9、11、12、13 项暂停申购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指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><b>基金份额的申购与</b></p>	<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p>	<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p>

<p><b>赎回</b></p>	<p>3、证券、期货交易所交易时间非正常停市,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</p> <p>5、接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时。</p> <p>发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项时,基金管理人应按规定报中国证监会备案,已确认的赎回申请,基金管理人应足额支付;如暂时不能足额支付,应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人,未支付部分可延期支付,并以受理赎回申请当日的该类基金份额净值为依据计算赎回金额。若出现上述第 4 项所述情形,按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时,基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。</p>	<p>3、证券、期货交易所或外汇市场交易时间非正常停市,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</p> <p>5、发生继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时。</p> <p>6、基金所投资的投资品种的估值出现重大转变时。</p> <p>7、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>8、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>发生上述情形之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时,基金管理人应按规定报中国证监会备案,已确认的赎回申请,基金管理人应足额支付;如暂时不能足额支付,应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人,未支付部分可延期支付,并以受理赎回申请当日的该类基金份额净值为依据计算赎回金额。若出现上述第 4 项所述情形,按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时,基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。</p>
<p><b>基金份额的申购与赎回</b></p>	<p>九、巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>(b) 赎回申请日,若已披露的基金份额净值会影响基金份额持有人相对利益的,遵循“基金份额持有人利益优先”原则,基金管理人有权采用更高精度的基金份额净值(小数点后保留至第 8 位,小数点后第 9 位四舍五入)计算当日的赎回金额和申购、定期定额申购份额。在这种情况下,基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个交易日内通知基金份额持有人,说明有关处理方法,同时在指定媒介上刊登公告。</p> <p>(2) 部分延期赎回:……若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额</p>	<p>九、巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>(b) 赎回申请日,若已披露的基金份额净值会影响基金份额持有人相对利益的,遵循“基金份额持有人利益优先”原则,基金管理人有权采用更高精度的基金份额净值(小数点后保留至第 8 位,小数点后第 9 位四舍五入)计算当日的赎回金额和申购、定期定额申购份额。在这种情况下,基金管理人应当按照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。</p> <p>(2) 部分延期赎回:……若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额的 10%,基金管理人有权对该单个基金份额持有人超出 10%的赎回申请实施</p>

	<p>的 10%，基金管理人应当先行对该单个基金份额持有人超出 10% 的赎回申请实施延期办理，而对该单个基金份额持有人 10% 以内（含 10%）的赎回申请与其他投资者的赎回申请一并按上述“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”约定的方式进行一并处理，具体见招募说明书或相关公告。</p> <p>（3）暂停赎回：连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒介上进行公告。</p> <p>3、巨额赎回的公告</p> <p>当发生上述巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个工作日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在 2 日内在指定媒介上刊登公告。</p> <p>十、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告</p> <p>1、发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人应在规定期限内指定媒介上刊登暂停公告。</p> <p>3、基金管理人可根据暂停申购或赎回的时间，依照《信息披露办法》的有关规定，最迟应于重新开放日，在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告；也可根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间，届时不再另行发布重新开放的公告。</p>	<p>延期办理，而对该单个基金份额持有人 10% 以内（含 10%）的赎回申请与其他投资者的赎回申请一并按上述“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”约定的方式进行一并处理，具体见招募说明书或相关公告。</p> <p>（3）暂停赎回：连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒介上进行公告。</p> <p>3、巨额赎回的公告</p> <p>当发生上述巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个工作日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在 2 日内在指定媒介上刊登公告。</p> <p>十、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告</p> <p>1、发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人应在规定期限内指定媒介上刊登暂停公告。</p> <p>3、基金管理人可根据暂停申购或赎回的时间，依照《信息披露办法》的有关规定，最迟应于重新开放日，在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告；也可根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间，届时不再另行发布重新开放的公告。</p>
<p>基金份额的申购与赎回</p>		<p>十六、基金份额折算</p> <p>在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人经与基金托管人协商一致，可对基金份额进行折算，不需召开基金份额持有人大会审议。</p> <p>十九、当技术条件成熟，本基金管理人在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，经与基金托管人协商一致，可根据具体情况对上述申购和赎回的安排进行补充和</p>

		调整,或者安排本基金的一类或多类基金份额在证券交易所上市交易、申购和赎回,或者办理基金份额的转让、过户、质押等业务,届时无须召开基金份额持有人大会审议,但应根据相关法规规定进行信息披露。
<b>基金合同当事人及权利义务</b>	<p>一、基金管理人</p> <p>(二) 基金管理人的权利与义务</p> <p>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:</p> <p>(1) 依法募集基金;</p> <p>(15)在符合有关法律、法规的前提下,制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、定期定额投资和非交易过户等业务规则;</p> <p>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:</p> <p>(1) 依法募集基金, 办理或者委托经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;</p> <p>(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定,按有关规定计算并公告基金净值信息,确定基金份额申购、赎回的价格;</p> <p>(10)编制季度、中期和年度基金报告;</p> <p>(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 15 年以上;</p> <p>(24)基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件,《基金合同》不能生效,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活期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人;</p> <p>(25)执行生效的基金份额持有人大会的决定;</p>	<p>一、基金管理人</p> <p>(二) 基金管理人的权利与义务</p> <p>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:</p> <p>(1) 依法募集资金;</p> <p>(13)在法律法规允许的前提下,为基金的利益依法为基金进行融资;</p> <p>(16)在符合有关法律、法规的前提下,制订和调整有关基金申购、赎回、转换、定期定额投资和非交易过户等业务规则;</p> <p>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:</p> <p>(1) 依法募集资金, 办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的申购、赎回和登记事宜;</p> <p>(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定,按有关规定计算并公告基金净值信息,确定基金份额申购、赎回的价格;</p> <p>(10)编制季度报告、中期报告和年度基金报告;</p> <p>(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年限;</p> <p>(24)执行生效的基金份额持有人大会的决议;</p>
<b>基金合同当事人及权利义务</b>	<p>二、基金托管人</p> <p>(一) 基金托管人简况</p> <p>法定代表人: 陶以平</p> <p>(二) 基金托管人的权利与义务</p>	<p>二、基金托管人</p> <p>(一) 基金托管人简况</p> <p>法定代表人: 吕家进</p> <p>(二) 基金托管人的权利与义务</p>



	<p>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:</p> <p>(1) 自《基金合同》生效之日起,依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产;</p> <p>(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,为基金办理证券交易资金清算;</p> <p>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:</p> <p>(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、赎回价格;</p> <p>(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 15 年以上;</p> <p>(15) 按照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自行召集基金份额持有人大会;</p> <p>(21) 执行生效的基金份额持有人大会的决定;</p>	<p>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:</p> <p>(1) 自《基金合同》生效之日起,依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金费用;</p> <p>(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;</p> <p>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:</p> <p>(8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、各类基金份额净值、基金份额申购、赎回价格;</p> <p>(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,保存期限不低于法律法规规定的最低年限;</p> <p>(15) 按照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;</p> <p>(21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议;</p>
<p><b>基金合同当事人及权利义务</b></p>	<p>三、基金份额持有人</p> <p>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:</p> <p>(3) 依法申请赎回或转让其持有的基金份额;</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>(4) 缴纳基金认购、申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用;</p> <p>(7) 执行生效的基金份额持有人大会的决定;</p>	<p>三、基金份额持有人</p> <p>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:</p> <p>(3) 依法转让或者申请赎回其持有的基金份额;</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>(4) 交纳基金申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用;</p> <p>(7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议;</p>
<p><b>基金份额持有人大会</b></p>	<p>本基金份额持有人大会不设日常机构。</p>	<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:在目标 ETF 基金份额持有人大会的权益登记</p>

		<p>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>本基金份额持有人大会不设日常机构。若将来法律法规对基金份额持有人大会另有规定的,以届时有效的法律法规为准。</p>
<b>基金份额持有人大会</b>	<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>(12)对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项;</p> <p>2、在法律法规和基金合同规定的范围内,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</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 基金份额持有人大会;</p> <p>(13)对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项;</p>

	<p>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>(3) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内,对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下,调整本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式;</p> <p>(6) 在不违反法律法规、基金合同以及不对基金份额持有人权益产生实质性不利影响的情况下,根据基金实际运作情况,在履行适当程序后,基金管理人可根据实际情况,经与基金托管人协商,调整本基金份额类别的设置;</p> <p>(7) 在不违反法律法规、基金合同以及在不损害已有基金份额持有人权益的前提下,基金管理人、登记机构、基金销售机构在法律法规规定或中国证监会许可的范围内调整有关认购、申购、赎回、转换、基金交易、非交易过户、转托管等业务规则;</p> <p>(8) 在不违反法律法规、基金合同以及在不损害已有基金份额持有人权益的前提下,基金推出新业务或服务;</p>	<p>2、在法律法规和基金合同规定的范围内,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>(3) 调整本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式;</p> <p>(6) 根据基金实际运作情况,在履行适当程序后,基金管理人可根据实际情况,经与基金托管人协商,调整本基金份额类别的设置;</p> <p>(7) 基金管理人、登记机构、基金销售机构在法律法规规定或中国证监会许可的范围内调整有关申购、赎回、转换、基金交易、非交易过户、转托管、转让、质押等业务规则;</p> <p>(8) 基金推出新业务或服务;</p> <p>(9) 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>(10) 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>(11) 调整基金份额净值的计算和公告时间或频率;</p> <p>(12) 本基金采取其他方式参与目标 ETF 的申购赎回;</p>
<p><b>基金份额持有人大会</b></p>	<p>二、会议召集人及召集方式</p> <p>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;</p> <p>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;</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:</p> <p>(4) 授权委托书的内容要求(包括但不限于代理人身份,代理权限和代理有效期限等)、授权方式、送达时间和地</p>	<p>二、会议召集人及召集方式</p> <p>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。</p> <p>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。</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>(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)、授权方式、送达时间和</p>

	<p>点；</p> <p>四、基金份额持有人出席会议的方式</p> <p>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书委派代表出席，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议程：</p> <p>（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书符合法律法规、《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；</p> <p>2、通讯开会。……</p> <p>（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书符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金登记注册机构记录相符。</p>	<p>地点；</p> <p>四、基金份额持有人出席会议的方式</p> <p>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议程：</p> <p>（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；</p> <p>2、通讯开会。……</p> <p>（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，并与基金登记机构记录相符。</p>
<p><b>基金份额持有人大会</b></p>	<p>八、生效与公告</p> <p>基金份额持有人大会决议自生效之日起2日内在指定媒介上公告。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。</p>	<p>八、生效与公告</p> <p>基金份额持有人大会决议自生效之日起2日内在规定媒介上公告。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。</p>
<p><b>基金管理人、基金托管人的更换条件和程序</b></p>	<p>二、基金管理人和基金托管人的更换程序</p> <p>（一）基金管理人的更换程序</p> <p>2、决议：基金份额持有人大会在基金管理人职责终止后6个月内对被提名的基金管理人形成决议，该决议需经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）表决通过，并自表决通过之日起生效；</p> <p>5、公告：基金管理人更换后，由基金托管人在更换基金管理人的基金份额</p>	<p>二、基金管理人和基金托管人的更换程序</p> <p>（一）基金管理人的更换程序</p> <p>2、决议：基金份额持有人大会在基金管理人职责终止后6个月内对被提名的基金管理人形成决议，该决议需经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）表决通过，决议自表决通过之日起生效；</p> <p>5、公告：基金管理人更换后，由基金托管人在更换基金管理人的基金份额</p>

	<p>持有人大会决议生效后 2 日内在指定媒介公告；</p> <p>(二) 基金托管人的更换程序</p> <p>2、决议：基金份额持有人大会在基金托管人职责终止后 6 个月内对被提名的基金托管人形成决议，该决议需经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）表决通过，并自表决通过之日起生效；</p> <p>5、公告：基金托管人更换后，由基金管理人在更换基金托管人的基金份额持有人大会决议生效后 2 日内在指定媒介公告；</p> <p>(三) 基金管理人与基金托管人同时更换的条件和程序</p> <p>3、公告：新任基金管理人和新任基金托管人应在更换基金管理人和基金托管人的基金份额持有人大会决议生效后 2 日内在指定媒介上联合公告。</p>	<p>持有人大会决议生效后 2 日内在规定媒介公告；</p> <p>(二) 基金托管人的更换程序</p> <p>2、决议：基金份额持有人大会在基金托管人职责终止后 6 个月内对被提名的基金托管人形成决议，该决议需经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）表决通过，决议自表决通过之日起生效；</p> <p>5、公告：基金托管人更换后，由基金管理人在更换基金托管人的基金份额持有人大会决议生效后 2 日内在规定媒介公告；</p> <p>(三) 基金管理人与基金托管人同时更换的条件和程序</p> <p>3、公告：新任基金管理人和新任基金托管人应在更换基金管理人和基金托管人的基金份额持有人大会决议生效后 2 日内在规定媒介上联合公告。</p>
<p><b>基金份额的登记</b></p>	<p>三、基金登记机构的权利</p> <p>4、在法律法规允许的范围内，对登记业务的办理时间进行调整，并依照有关规定于开始实施前在指定媒介上公告；</p>	<p>三、基金登记机构的权利</p> <p>4、在法律法规允许的范围内，对登记业务的办理时间进行调整，并依照有关规定于开始实施前在规定媒介上公告；</p>
<p><b>基金的投资</b></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。力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的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%。</p> <p>二、投资范围</p> <p>本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，以中证 500 质量成长指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于其他股票（非标的指数成份股及其备选成份股，含中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册的上市股票、存托凭证）、银行存款、债券、债券回购、权证、股指期货、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金</p>	<p>一、投资目标</p> <p>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%。</p> <p>二、投资范围</p> <p>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、</p>

	<p>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:本基金投资于中证 500 质量成长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%;本基金每个交易日日终在扣除股指期货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>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。</p> <p>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%;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。</p>
<p><b>基金的投资</b></p>	<p>三、投资策略</p> <p>本基金采用被动式指数化投资方法,按照中证 500 质量成长指数中的成份股构成及其权重构建股票投资组合,以跟踪中证 500 质量成长指数的收益表现,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</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。</p> <p>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>

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%。

## （二）股票投资策略

1、标的指数介绍。本基金股票资产跟踪的标的指数为中证 500 质量成长指数。中证 500 质量成长指数是中证指数有限公司从中证 500 样本股中选取 100 只盈利能力较高、盈利可持续、现金流量较为充沛且兼具成长性的股票作为指数样本股，并采用非市值加权方法的 Smart Beta 指数。

2、股票投资组合构建。本基金原则上将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。

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。

（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。中证指数有限公司原则上每半年审核一次标的指数的成份股。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。

## （二）股票投资策略

### 1、股票投资策略

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。

### 2、港股通标的股票投资策略

本基金将通过国内和香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场。本基金管理人基于对于香港市场长期投资研究经验及两地市场一体化过程中可能出现的投资机会，采取“自下而上”的优选个股策略，重点投资于受惠于中国经济转型，且估值合理的具备核心竞争力股票。本基金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。

## （四）衍生品投资策略

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。

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

<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>(四) 衍生品投资策略</p> <p>1、股指期货投资策略</p> <p>本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等,主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。根据期货合约的交易方向不同,套期保值分为两类:买入套期保值和卖出套期保值。买入套期保值(又称多头套期保值)是在期货市场买入期货合约,用期货市场多头对冲现货市场上行风险,主要用于降低基金建仓期股票价格大幅上涨的风险;卖出套期保值(又称空头套期保值)是在期货市场中卖出期货合约,用期货市场空头对冲现货市场的下行风险,以规避基金运作期间股票价格下跌的风险。本基金将通过最优套期保值比例来确定期货头寸,以当前投资组合和目标投资组合的差与期货标的指数之间的<math>\beta</math>系数作为最优套期保值比例。本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差,达到有效跟踪标的指数的目的。</p> <p>2、权证投资策略</p>	<p>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>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>4、信用衍生品投资策略</p> <p>本基金投资信用衍生品,将按照风险管理的原则,以风险对冲为目的。根据投资组合所持标的债券等固定收益品种</p>
---	--



	<p>本基金权证投资将以价值分析为基础，在采用数量化模型分析其合理定价的基础上，把握市场的短期波动，进行积极操作，追求在风险可控的前提下实现稳健的超额收益。</p> <p>(五) 其他</p> <p>未来随着市场的发展和基金管理运作的需要，基金管理人可以在不改变投资目标的前提下，遵循法律法规的规定，履行适当程序后，相应调整或更新投资策略，并在招募说明书更新中公告。</p>	<p>的投资策略，以及潜在信用风险等情况，审慎开展信用衍生品投资，合理确定信用衍生品的投资金额、期限等，从而实现有效地信用风险管理。同时，本基金还将对信用衍生品交易对手方、创设机构加强风险管理，合理分散相应集中度，且对其进行必要的尽职调查与严格的准入管理。</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公告。</p>
<p><b>基金的投资</b></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) 本基金投资于中证 500 质量成长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%；</p> <p>(2) 本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保证现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，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>(3) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；</p> <p>(4) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；</p> <p>(5) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；</p> <p>(6) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；</p> <p>(7) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；</p> <p>(8) 本基金的基金总资产不得超过基金净资产的 140%；</p> <p>(9) 本基金投资于股指期货，还应遵</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%。</p> <p>(2) 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，应当保证现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，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>(3) 本基金投资于资产支持证券时，需遵守下列投资限制：</p> <p>① 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；</p> <p>② 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；</p> <p>③ 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；</p> <p>④ 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；</p> <p>⑤ 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出。</p>

循如下投资组合限制：

1) 在任何交易日日终，本基金持有的买入股指期货合约价值不超过基金资产净值的 10%，卖出股指期货合约价值不超过基金持有的股票总市值的 20%；

2) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当不低于基金资产的 80%；

3) 本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%。其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

4) 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；

(10) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的 15%。因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使本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；

(11) 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；

(12) 本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行，与境内上市交易的股票合并计算；

(13) 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。

除上述第（2）、（10）、（11）项外，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。法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

(4) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量。

(5) 本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行，与境内上市交易的股票合并计算。

(6) 本基金参与国债期货、股指期货交易时，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内交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 30%；

② 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；本基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；

③ 本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货和股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

④ 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；

⑤ 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定。

(7) 本基金参与股票期权交易时，需遵守下列投资比例限制：

① 因未平仓的期权合约支付和收取的

<p>法律法规或监管部门取消或变更上述限制,则本基金投资可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。</p> <p>2、禁止行为</p> <p>(4) 买卖其他基金份额,但是法律法规或中国证监会另有规定的除外;</p>	<p>权利金总额不得超过基金资产净值的<b>10%</b>;</p> <p>②开仓卖出认购期权的,应持有足额标的证券;开仓卖出认沽期权的,应持有合约行权所需的全额现金或交易所规则认可的可冲抵期权保证金的现金等价物;</p> <p>③未平仓的期权合约面值不得超过基金资产净值的<b>20%</b>。其中,合约面值按照行权价乘以合约乘数计算;</p> <p>④基金的投资符合基金合同约定的比例限制(如股票仓位、个股占比等)、投资目标和风险收益特征。</p> <p>(8) 本基金参与信用衍生品交易,需遵守下列投资比例限制:</p> <p>①本基金不持有具有信用保护卖方属性的信用衍生品,不持有合约类信用衍生品;</p> <p>②本基金持有的信用衍生品名义本金不得超过本基金中所对应受保护债券面值的<b>100%</b>;</p> <p>③本基金投资于同一信用保护卖方的各类信用衍生品,名义本金合计不得超过基金资产净值的<b>10%</b>;因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前述比例限制的,基金管理人应在<b>3个月</b>之内进行调整。除外。</p> <p>(9) 本基金资产总值不得超过基金资产净值的<b>140%</b>。</p> <p>(10) 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<b>1年</b>,债券回购到期后不得展期。</p> <p>(11) 本基金参与融资业务时,在任何交易日日终持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的<b>95%</b>。</p> <p>(12) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的<b>15%</b>;因证券市场波动、上市公司股票停牌、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。</p>
---	--

		<p>(13)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。</p> <p>(14)本基金参与转融通证券出借业务应当符合以下要求:</p> <p>①参与转融通证券出借业务的资产不得超过基金资产净值的30%,出借期限在10个交易日以上的出借证券应纳入《流动性风险管理规定》所述流动性受限证券的范围;</p> <p>②参与转融通证券出借业务的单只证券不得超过基金持有该证券总量的50%;</p> <p>③最近6个月内日均基金资产净值不得低于2亿元;</p> <p>④本基金参与证券出借的平均剩余期限不得超过30天,平均剩余期限按照市值加权平均计算;</p> <p>⑤因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合本条规定的,基金管理人不得新增出借业务。</p> <p>(15)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%。</p> <p>(16)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。</p> <p>除上述第(2)、(3)⑤、(8)、(12)、(13)、(14)项外,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>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</p>
--	--	--

		<p>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。</p>
基金的投资	<p>五、业绩比较基准</p> <p>中证 500 质量成长指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%</p>	<p>五、业绩比较基准</p> <p>本基金的业绩比较基准为中证 500 质量成长指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%</p> <p>……但下文“目标 ETF 发生相关变更情形时的处理”另有约定的除外。但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,报中国证监会备案并及时公告。</p>
基金的投资	<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。</p> <p>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>	<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>
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"> <li>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;</li> <li>2、目标 ETF 终止上市;</li> <li>3、目标 ETF 基金合同终止;</li> <li>4、目标 ETF 与其他基金进行合并;</li> <li>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</li> </ol>

		<p>理人相同的除外)；</p> <p>6、中国证监会规定的其他情形。</p> <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>
<b>基金的财产</b>	<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、银行存款本息和基金应收款项以及其他资产的价值总和。</p> <p>四、基金财产的保管和处分</p> <p>基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。基金管理人管理运作基金财产所产生的债权，不得与其固有资产产生的债务相互抵销；基金管理人管理运作不同基金的基金财产所产生的债权债务不得相互抵销。</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、目标 ETF 基金份额、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。</p> <p>四、基金财产的保管和处分</p> <p>基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。基金管理人管理运作基金财产所产生的债权，不得与其固有资产产生的债务相互抵销；基金管理人管理运作不同基金的基金财产所产生的债权债务不得相互抵销。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。</p>
<b>基金资产估值</b>	<p>二、估值对象</p> <p>基金所拥有的证券、期货合约和银行存款本息、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、信用衍生品、银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。</p>
<b>基金资产估值</b>		<p>三、估值原则</p> <p>基金管理人在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，应符合《企业会计准则》、监管部门有关规定。</p> <p>(一)对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，应将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。</p> <p>与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因</p>

		<p>素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等,如果该限制是针对资产持有者的,那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外,基金管理人不应考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。</p> <p>(二)对不存在活跃市场的投资品种,应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时,应优先使用可观察输入值,只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下,才可以使用不可观察输入值。</p> <p>(三)如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件,使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25%以上的,应对估值进行调整并确定公允价值。</p>
<p><b>基金资产估值</b></p>	<p>三、估值方法</p> <p>1、证券交易所上市的有价证券的估值</p> <p>(1)交易所上市的有价证券(包括股票、权证等),以其估值日在证券交易所挂牌的市价(收盘价)估值;估值日无交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,以最近交易日的市价(收盘价)估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格;</p> <p>2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理:</p> <p>(3)首次公开发行有明确锁定期的股票,同一股票在交易所上市后,按交易所上市的同一股票的估值方法估值;非公开发行有明确锁定期的股票,按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p> <p>3、全国银行间债券市场交易的债券等固定收益品种,以第三方估值机构提供的价格数据估值;对银行间市场未上</p>	<p>四、估值方法</p> <p>1、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> <p>2、证券交易所上市的有价证券的估值</p> <p>(1)交易所上市的有价证券(包括股票等),以其估值日在证券交易所挂牌的市价(收盘价)估值;估值日无交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,以最近交易日的市价(收盘价)估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格;</p> <p>3、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理:</p> <p>(3)首次公开发行有明确锁定期的股票,同一股票在交易所上市后,按交易</p>

	<p>市,且第三方估值机构未提供估值价格的债券,按成本估值;</p> <p>4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的,按债券所处的市场分别估值。</p> <p>5、股指期货合约,一般以估值当日结算价进行估值,估值当日无结算价的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化的,采用最近交易日结算价估值。根据有关法律法规,基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任,因此,就与本基金有关的会计问题,如经相关各方在平等基础上充分讨论后,仍无法达成一致的意见,按照基金管理人对基金净值的计算结果对外予以公布。</p>	<p>所上市的同一股票的估值方法估值;非公开发行有明确锁定期的股票,按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值;</p> <p>4、全国银行间债券市场交易的债券等固定收益品种,以第三方估值机构提供的价格数据估值;对银行间市场未上市,且第三方估值机构未提供估值价格的债券,按成本估值。</p> <p>5、同一证券同时在两个或两个以上市场交易的,按证券所处的市场分别估值。</p> <p>6、股指期货合约和国债期货合约,一般以估值当日结算价进行估值,估值当日无结算价的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化的,采用最近交易日结算价估值。</p> <p>7、本基金投资股票期权,按照相关法律法规和监管部门的规定估值。</p> <p>8、本基金投资港股通标的股票,港股通投资上市流通的股票按估值日在港交所的收盘价估值;估值日无交易的,以最近交易日的收盘价估值。港股通投资持有外币证券资产估值涉及到港币、美元、英镑、欧元、日元等主要货币对人民币汇率的,应当以基金估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价为准。</p> <p>9、信用衍生品按第三方估值机构提供的当日估值价格进行估值,但基金管理人依法应当承担的估值责任不应委托而免除;选定的第三方估值机构未提供估值价格的,依照有关法律法规及《企业会计准则》要求采用合理估值技术确定公允价值。</p> <p>12、本基金参与融资业务的,按照相关法律法规、监管部门和行业协会的相关规定进行估值。</p> <p>13、本基金参与转融通证券出借业务的,按照相关法律法规和行业协会的相关规定进行估值。</p> <p>根据有关法律法规,基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金</p>
--	---	---



		<p>管理人担任,因此,就与本基金有关的会计问题,如经相关各方在平等基础上充分讨论后,仍无法达成一致的意见,按照基金管理人对于基金净值信息的计算结果对外予以公布。</p>
<p><b>基金资产估值</b></p>	<p>四、估值程序</p> <p>1、各类基金份额净值是按照每个工作日闭市后,基金资产净值除以当日该类基金份额的余额数量计算,精确到0.0001元,小数点后第5位四舍五入。国家另有规定的,从其规定。</p> <p>五、估值错误的处理</p> <p>4、基金份额净值估值错误处理的方法如下:</p> <p>(2) 错误偏差达到该类基金份额净值的0.25%时,基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案;错误偏差达到该类基金份额净值的0.5%时,基金管理人应当公告。</p> <p>(3) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的,从其规定处理。如果行业另有通行做法,双方当事人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。</p> <p>六、暂停估值的情形</p> <p>1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;</p> <p>2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时;</p> <p>八、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9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、期货交易所及登记结算公司发送的数据错误,或国家会计政策变更、市场规则变更等,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,基金管理人和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</p>	<p>五、估值程序</p> <p>1、各类基金份额净值是按照每个工作日闭市后,某类基金资产净值除以当日该类基金份额的余额数量计算,精确到0.0001元,小数点后第5位四舍五入,由此产生的误差计入基金财产。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的,从其规定。</p> <p>六、估值错误的处理</p> <p>2、估值错误处理原则</p> <p>(5) 按法律法规规定的其他原则处理估值错误。</p> <p>4、基金份额净值估值错误处理的方法如下:</p> <p>(2) 错误偏差达到该类基金份额净值的0.25%时,基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案;错误偏差达到该类基金份额净值的0.5%时,基金管理人应当公告,并报中国证监会备案。</p> <p>(3) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的,从其规定处理。如果行业另有通行做法,基金管理人和基金托管人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。</p> <p>七、暂停估值的情形</p> <p>1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场或外汇市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;</p> <p>2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时;</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>九、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、</p>

	<p>施消除或减轻由此造成的影响。</p> <p>九、实施侧袋机制期间的基金资产估值 本基金实施侧袋机制的,应根据本部分的约定对主袋账户资产进行估值并披露主袋账户的基金份额净值,暂停披露侧袋账户基金份额净值。</p>	<p>期货交易所及登记机构发送的数据错误,或国家会计政策变更、市场规则变更等,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,基金管理人和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、实施侧袋机制期间的基金资产估值 本基金实施侧袋机制的,应根据本部分的约定对主袋账户资产进行估值并披露主袋账户的基金净值信息,暂停披露侧袋账户基金净值信息。</p>
<b>基金费用与税收</b>	<p>一、基金费用的种类</p> <p>4、基金合同生效后的标的指数许可使用费;</p> <p>8、基金的证券、期货交易费用;</p>	<p>一、基金费用的种类</p> <p>7、基金的证券、期货等交易费用;</p> <p>10、因投资港股通标的股票而产生的合理费用;</p>
<b>基金费用与税收</b>	<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 本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.45% 年费率计提。管理费的计算方法如下: <math>E</math> 为前一日的基金资产净值</p> <p>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 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下: <math>E</math> 为前一日的基金资产净值</p> <p>4、标的指数许可使用费 本基金按照基金管理人与标的指数许</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 本基金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目标 ETF 基金份额部分的基金资产净值后的余额(若为负数,则取 0)的 0.45% 年费率计提。管理费的计算方法如下: <math>E</math> 为前一日的基金资产净值扣除前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产净值,若为负数,则 <math>E</math> 取 0</p> <p>2、基金托管人的托管费 本基金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目标 ETF 基金份额部分的基金资产净值后的余额(若为负数,则取 0)的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下: <math>E</math> 为前一日的基金资产净值扣除前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产净值后的余额,若为负数,则取 0</p>

	<p>可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数许可使用费计提方法支付指数许可使用费。</p> <p>指数许可使用费的费率、收取下限、具体计算方法及支付方式请参见招募说明书。</p> <p>如果指数使用许可协议约定的指数许可使用费的计算方法、费率和支付方式等发生调整,本基金将采用调整后的方法或费率计算指数使用费。基金管理人应在招募说明书及其更新中披露基金最新适用的方法。此项变更无需召开基金份额持有人大会审议,但基金管理人应按照基金合同的约定在指定媒介予以公告。</p> <p>上述“一、基金费用的种类”中第5—11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。</p>	<p>上述“一、基金费用的种类”中第4—11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。</p>
<p><b>基金的收益与分配</b></p>	<p>三、基金收益分配原则</p> <p>2、基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值;即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值;</p> <p>五、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》的有关规定在指定媒介公告。</p> <p>基金红利发放日距离收益分配基准日(即可供分配利润计算截止日)的时间不得超过15个工作日。</p> <p>六、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人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额,不足以支付银行转账或其他手续费用时,基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为相应类别的基金份额。红利再投资的计算方法,依照《业务规则》执行。</p>	<p>五、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》的有关规定在指定媒介公告。</p> <p>六、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人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额,不足以支付银行转账或其他手续费用时,基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为相应类别的基金份额。红利再投资的计算方法,依照《业务规则》执行。</p>
<p><b>基金的会计与审计</b></p>	<p>一、基金会计政策</p> <p>2、基金的会计年度为公历年度的1月</p>	<p>一、基金会计政策</p> <p>2、基金的会计年度为公历年度的1月</p>

	<p>1 日至 12 月 31 日；基金首次募集的会计年度按如下原则：如果《基金合同》生效少于 2 个月，可以并入下一个会计年度；</p> <p>二、基金的年度审计</p> <p>1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。</p> <p>3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。</p>	<p>1 日至 12 月 31 日；</p> <p>二、基金的年度审计</p> <p>1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。</p> <p>3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。</p>
基金的信息披露	<p>一、本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《基金合同》及其他有关规定。相关法律法规关于信息披露的规定发生变化时，本基金从其最新规定。</p>	<p>一、本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《流动性风险管理规定》、《基金合同》及其他有关规定。相关法律法规关于信息披露的规定发生变化时，本基金从其最新规定。</p>
基金的信息披露	<p>二、信息披露义务人</p> <p>本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的全国性报刊（以下简称“指定报刊”）及指定互联网网站（以下简称“指定网站”，包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介披露，并保证投资人能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。</p>	<p>二、信息披露义务人</p> <p>本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过符合中国证监会规定条件的全国性报刊（以下简称规定报刊）及《信息披露办法》规定的互联网网站（以下简称规定网站）等媒介披露，并保证投资人能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。</p>
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>2、基金招募说明书应当最大限度地披露影响投资人决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资；拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估；巨额赎回情形下的流动性风险管理措施；实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响；基金产品特性、风险揭示、信息披</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</p> <p>2、基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。《基金合同》生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在规定网站上；基金招募说明书其他信息发</p>

<p>露及基金份额持有人服务等内容。</p> <p>基金合同生效后,基金招募说明书的信息发生重大变更的,基金管理人应当在三个工作日内,更新基金招募说明书并登载在指定网站上;基金招募说明书其他信息发生变更的,基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的,基金管理人不再更新基金招募说明书。</p> <p>基金产品资料概要是基金招募说明书的摘要文件,用于向投资者提供简明的基金概要信息。基金管理人应当依照法律法规和中国证监会的规定编制、披露与更新基金产品资料概要。</p> <p>《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,基金管理人应当在三个工作日内,更新基金招募说明书和基金产品资料概要,并登载在指定网站及基金销售机构网站或营业网点;基金产品资料概要其他信息发生变更的,基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的,基金管理人不再更新基金产品资料概要。</p> <p>4、基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告。</p> <p>基金募集申请经中国证监会注册后,基金管理人在基金份额发售的3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指定报刊上;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指定网站上,并将基金产品资料概要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指定网站上。</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指定报刊和指定网站上登载《基金合同》生效公告。</p> <p>(三)基金净值信息</p> <p>《基金合同》生效后,在开始办理基金份额申购或者赎回前,基金管理人应当至少每周在指定网站披露一次各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。</p>	<p>生变更的,基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的,基金管理人不再更新基金招募说明书。</p> <p>4、基金产品资料概要是基金招募说明书的摘要文件,用于向投资者提供简明的基金概要信息。《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,基金管理人应当在三个工作日内,更新基金产品资料概要,并登载在指定网站及基金销售机构网站或营业网点;基金产品资料概要其他信息发生变更的,基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的,基金管理人不再更新基金产品资料概要。</p> <p>5、基金转型经基金份额持有人大会审议通过后,基金管理人将基金招募说明书提示性公告、基金合同提示性公告登载在指定报刊上;将基金招募说明书、基金产品资料概要、《基金合同》和基金托管协议登载在指定网站上,并将基金产品资料概要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指定网站上。</p> <p>(二)基金净值信息</p> <p>《基金合同》生效后,在开始办理基金份额申购或者赎回前,基金管理人应当至少每周在指定网站披露一次各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。在开始办理基金份额申购或者赎回后,基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日,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的各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。</p> <p>基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日,在指定网站披露半年度和年度最后一日的各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。</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(含资产组合季度报告)</p> <p>基金管理人应当在每年结束之日起三个月内,编制完成基金年度报告,将年</p>
--	--

<p>在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过指定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日的各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。</p> <p>基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在指定网站披露半年度和年度最后一日的各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。</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季度报告（含资产组合季度报告）</p> <p>基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载在指定网站上，并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计。</p> <p>基金管理人应当在上半年结束之日起两个月内，编制完成基金中期报告，将中期报告登载在指定网站上，并将中期报告提示性公告登载在指定报刊上。</p> <p>基金管理人应当在季度结束之日起十五个工作日内，编制完成基金季度报告，将季度报告登载在指定网站上，并将季度报告提示性公告登载在指定报刊上。</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>本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，并登载在指定报刊和指定网站上。</p> <p>前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件：</p> <p><b>8、基金募集期延长或提前结束募集；</b></p> <p>（七）澄清公告</p> <p>在《基金合同》存续期限内，任何公共媒介中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影</p>	<p>度报告登载在规定网站上，并将年度报告提示性公告登载在规定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计。</p> <p>基金管理人应当在上半年结束之日起两个月内，编制完成基金中期报告，将中期报告登载在规定网站上，并将中期报告提示性公告登载在规定报刊上。</p> <p>基金管理人应当在季度结束之日起十五个工作日内，编制完成基金季度报告，将季度报告登载在规定网站上，并将季度报告提示性公告登载在规定报刊上。</p> <p>（五）临时报告</p> <p>本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，并登载在指定报刊和规定网站上。</p> <p>前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件：</p> <p><b>24、目标 ETF 变更；</b></p> <p><b>27、本基金连续 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；</b></p> <p>（六）澄清公告</p> <p>在《基金合同》存续期限内，任何公共媒介中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动，以及可能损害基金份额持有人权益的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清。</p> <p>（八）清算报告</p> <p>基金合同终止的，基金管理人应当依法组织基金财产清算小组对基金财产进行清算并作出清算报告。基金财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。</p> <p>（九）投资资产支持证券的信息披露</p> <p>基金管理人应在基金年度报告及中期报告中披露其持有的资产支持证券总</p>
---	--

	<p>响或者引起较大波动,以及可能损害基金份额持有人权益的,相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清,并将有关情况立即报告中国证监会。</p> <p>(九) 清算报告 基金合同终止的,基金管理人应当依法组织基金财产清算小组对基金财产进行清算并作出清算报告。基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上,并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。</p> <p>(十) 投资股指期货的信息披露 本基金将在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露股指期货交易情况,包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等,并充分揭示股指期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标。</p>	<p>额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。基金管理人应在基金季度报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期末按市值占基金净资产比例大小排序的前 10 名资产支持证券明细。</p> <p>(十) 投资股指期货和国债期货的信息披露 本基金将在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露股指期货和国债期货交易情况,包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等,并充分揭示股指期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标。</p> <p>(十一) 投资港股通标的股票的信息披露 基金管理人应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露港股通标的股票的投资情况,并充分揭示投资港股通标的股票的相关风险。法律法规或中国证监会另有规定的,从其规定。</p> <p>(十二) 投资信用衍生品的信息披露 基金管理人应在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露信用衍生品的投资情况,包括投资策略、持仓情况等,并充分揭示投资信用衍生品对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资目标及策略。</p> <p>(十三) 投资股票期权的信息披露 基金管理人应在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露参与股票期权交易的有关情况,包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标、估值方法等,并充分揭示股票期权交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标等。</p> <p>(十四) 参与融资及转融通证券出借业务的信息披露 基金管理人应在季度报告、中期报告、</p>
--	--	---

		<p>年度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露参与融资及转融通证券出借业务的有关情况,包括投资策略、业务开展情况、损益情况、风险及其管理情况等,并就报告期内本基金参与转融通证券出借业务发生的重大关联交易事项做详细说明。</p> <p>(十五) 投资基金份额的信息披露 基金管理人应在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露所持基金的以下相关情况,包括:(1) 投资政策、持仓情况、损益情况、净值披露时间等。(2) 交易及持有基金产生的费用,招募说明书中应当列明计算方法并举例说明。(3) 本基金持有的基金发生的重大影响事件,如转换运作方式、与其他基金合并、终止基金合同以及召开基金份额持有人大会等。(4) 本基金投资于基金管理人以及基金管理人关联方所管理基金的情况。</p>
基金的信息披露	<p>六、信息披露事务管理 基金管理人、基金托管人应当在指定报刊中选择一家报刊披露本基金信息。基金管理人、基金托管人除依法在指定媒介上披露信息外,还可以根据需要在其他公共媒介披露信息,但是其他公共媒介不得早于指定媒介披露信息,并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。</p>	<p>六、信息披露事务管理 基金管理人、基金托管人应当在指定报刊中选择一家报刊披露本基金信息。基金管理人、基金托管人除依法在指定媒介上披露信息外,还可以根据需要在其他公共媒介披露信息,但是其他公共媒介不得早于规定媒介披露信息,并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。</p>
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: 1、基金投资所涉及的证券、期货交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;</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: 1、基金投资所涉及的证券、期货交易所或外汇市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时; 3、当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上的,经与基金托管人协商一致,基金管理人暂停估值的; 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>
基金合同的变更、终止与基	<p>一、《基金合同》的变更 2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议须报中国证监会备案,</p>	<p>一、《基金合同》的变更 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执行,自</p>



<p><b>金财产的清算</b></p>	<p>自表决通过之日起生效,自决议生效后2日内在指定媒介公告。</p> <p>二、《基金合同》的终止</p> <p>有下列情形之一的,《基金合同》应当终止:</p> <p>3、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,基金管理人召集基金份额持有人大会对解决方案进行表决,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;</p> <p>三、基金财产的清算</p> <p>3、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或临时基金管理人、基金托管人、具有证券、期货相关业务资格的注册会计师、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。</p> <p>六、基金财产清算的公告</p> <p>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具有证券、期货相关业务资格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。</p> <p>七、基金财产清算账册及文件的保存</p> <p>基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。</p>	<p>决议生效后两日内在规定媒介公告。</p> <p>二、《基金合同》的终止事由</p> <p>有下列情形之一的,经履行相关程序后,《基金合同》应当终止:</p> <p>三、基金财产的清算</p> <p>3、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或临时基金管理人、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。</p> <p>六、基金财产清算的公告</p> <p>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。</p> <p>七、基金财产清算账册及文件的保存</p> <p>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年限。</p>
<p><b>基金合同的效力</b></p>	<p>《基金合同》是约定基金当事人之间、基金与基金当事人之间权利义务关系的法律文件。</p> <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>《基金合同》是约定基金合同当事人之间权利义务关系的法律文件。</p> <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。经202X年X月X日鹏扬中证500质量成长指数证券投资基金基金份额持有人大会决议通过,并报中国证监会备案。自202X年X月X日起,《基金合同》生效,原《鹏扬中证500质量成长指数证券投资基金基金合同》同日起失效。</p>