

鹏扬国证财富管理交易型开放式指数 证券投资基金基金份额发售公告

基金管理人：鹏扬基金管理有限公司

基金托管人：华泰证券股份有限公司

二〇二三年六月

目录

重要提示.....	3
一、本次发售基本情况.....	7
二、投资者的开户.....	13
三、本基金的认购程序.....	14
四、清算与交割.....	18
五、基金的验资与基金合同生效.....	19
六、本次发售当事人或中介机构.....	19
七、网下股票认购清单.....	22

重要提示

1、鹏扬国证财富管理交易型开放式指数证券投资基金（以下简称本基金）已经中国证监会 2023 年 4 月 11 日证监许可[2023]775 号文准予注册。

2、本基金是交易型开放式、股票型证券投资基金。

3、本基金的基金管理人为鹏扬基金管理有限公司（以下简称本公司），基金托管人为华泰证券股份有限公司，本基金的登记结算机构为中国证券登记结算有限责任公司。

4、本基金的募集对象为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。

5、本基金自 2023 年 6 月 8 日至 2023 年 6 月 21 日通过基金份额发售机构公开发售。本基金的投资者可选择网上现金认购、网下现金认购、网下股票认购 3 种方式。网上现金认购的日期为 2023 年 6 月 8 日至 2023 年 6 月 21 日；网下现金认购的日期为 2023 年 6 月 8 日至 2023 年 6 月 21 日；网下股票认购的日期为 2023 年 6 月 8 日至 2023 年 6 月 21 日。如深圳证券交易所对网上现金认购时间作出调整，本公司将作出相应调整并及时公告。本公司可根据认购的情况适当调整募集时间，但最长不超过法定募集期限，并予以公告。本基金的募集期限不超过 3 个月，自基金份额开始发售之日起计算。

6、本基金网上现金发售通过具有基金销售业务资格及深圳证券交易所会员资格的证券公司办理。本基金的网下现金发售和网下股票发售通过基金管理人及基金管理人指定的发售代理机构进行。具体详见“六（三）基金份额发售机构”。各发售代理机构办理认购业务的办理网点、办理日期和时间等事项参照各发售代理机构的具体规定。

7、投资人认购本基金时需具有深圳证券交易所 A 股账户或深圳证券交易所证券投资基金账户。如投资者需要参与网下现金或网上现金认购，应使用深圳 A 股账户或深圳证券交易所证券投资基金账户；深圳证券交易所证券投资基金账户只能进行本基金的现金认购和二级市场交易。如投资者需要参与基金份额的申购、赎回，则应开立深圳 A 股账户。如投资者以深圳证券交易所上市交易的本基金标的指数成份股或备选成份股进行网下股票认购的，应开立并使用深圳 A 股账户。

如投资者以上海证券交易所上市交易的本基金标的指数成份股或备选成份股进行网下股票认购的，除了持有深圳 A 股账户或深圳证券交易所证券投资基金账户外，还应持有上海证券交易所 A 股账户，且该两个账户的证件号码及名称属于同一投资人所有，并注意投资人认购基金份

额的托管证券公司和上海 A 股账户指定交易证券公司应为同一发售代理机构。

8、本基金认购费用或认购佣金不高于 0.80%。

9、本基金首次募集规模上限为 30 亿元人民币（不含募集期利息和认购费用，下同）。若募集期投资者的认购规模超过募集规模上限，基金管理人采取末日比例配售的方式对募集规模进行控制。

在募集期内任何一天（含募集期首日），当日募集截止时间后有效认购申请累计金额超过 30 亿元，基金管理人将采取末日比例确认的方式实现规模的有效控制。当发生末日比例确认时，基金管理人将及时公告比例确认情况与结果。

当发生部分确认时，本基金登记结算机构按照募集期有效认购申请确认比例对募集期每笔有效认购申请份额进行部分确认处理，因对每笔认购明细处理的精度等原因，最终确认的本基金累计有效认购份额（不包括募集期利息和认购费用）可能会略微超过 30 亿份。最终投资者认购申请确认份额不受认购最低限额的限制。最终认购申请确认结果以本基金登记结算机构的计算并确认的结果为准。

敬请投资者注意，如采用“末日比例确认”的认购确认方式，将导致投资者认购申请确认份额低于认购申请份额，可能会出现认购确认份额对应的费率高于认购申请份额对应的费率的情形，实际的认购费用以办理认购申请的发售代理机构为准。

10、投资人在认购本基金时，需按基金管理人及发售代理机构的规定，备足认购资金，办理认购手续。网上现金认购申请提交后，不得撤销，申请一经确认，认购资金即被冻结。通过基金管理人的网下现金认购申请提交后不得撤销，通过其他发售代理机构提交的网下现金认购申请能否撤销以各销售机构的规定为准。通过基金管理人的网下股票认购申请提交后不得撤销，通过其他发售代理机构提交的网下股票认购申请能否撤销以各销售机构的规定为准。

11、基金份额发售机构销售网点受理认购申请并不表示对该申请的成功确认，而仅代表销售网点确实收到了认购申请。申请是否成功应以登记机构的确认为准。投资者应在基金合同生效后到其办理认购业务的销售网点查询最终确认情况和有效认购份额。基金管理人及基金份额发售机构不承担对确认结果的通知义务，投资者本人应主动查询认购申请的确认结果。

12、本基金《基金合同》生效后，符合基金上市交易条件的，本基金基金份额可申请在深圳证券交易所上市交易。上市交易的有关事项将另行公告。

13、本公告仅对本基金发售的有关事项和规定予以说明。投资者欲了解本基金的详细情

况，请仔细阅读《鹏扬国证财富管理交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》。本基金的招募说明书及本公告将同时刊登在本公司网站。投资者如有疑问，可拨打本公司客户服务电话（400-968-6688）及各发售代理机构客户服务电话。

14、本公司在募集期内可能新增或变更销售机构，投资者可留意本公司及各发售代理机构的公告或网站公示，或拨打本公司客户服务电话（400-968-6688）及各发售代理机构的客户服务热线进行咨询。

15、基金募集期结束后，基金管理人确定本基金的申购赎回代理券商名单，在基金管理人网站公示。本基金上市后，未登记在申购赎回代理券商的基金份额只能进行二级市场买卖，如投资者需进行上述份额的赎回交易，须转托管到本基金的申购赎回代理券商。

16、风险提示

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者根据所持有的基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。

本基金投资中的风险包括：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。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。

本基金为指数基金，投资者投资于本基金面临标的指数波动、标的指数回报与股票市场平均回报偏离、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、成份股停牌或违约等潜在风险。

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。

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，如果投资，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。

本基金可参与转融通证券出借业务，可能面临由此带来的流动性风险、信用风险、市场风险等。

本基金标的指数为国证财富管理指数。

(1) 选样空间

满足下列条件的沪深 A 股和红筹企业发行的存托凭证：

- ①非 ST、*ST 股票；
- ②主板、创业板证券上市时间超过 6 个月，科创板证券上市时间超过 1 年；
- ③公司最近一年无重大违规、财务报告无重大问题；
- ④公司最近一年经营无异常、无重大亏损；
- ⑤考察期内证券价格无异常波动；
- ⑥公司业务领域涉及证券或银行。

(2) 选样方法

根据上市公司的业务开展情况，将选样空间内证券分为券商财富管理样本池和银行财富管理样本池，然后按照如下方法分别计算各池内证券的选样指标和初始权重：

①券商财富管理样本池

首先，根据资产管理规模和代销收入两个指标，计算池内证券的资管规模得分和代销收入得分，按从高到低的顺序，分别将证券划为 4 组，对应赋予组内证券 4、2、1、0 的指标得分后，加权计算池内证券的综合得分。

其次，对综合得分进行离差标准化，计算池内证券的综合得分调整因子，按从高到低排序后，剔除综合得分调整因子为 0 的证券，选取排名前 40 只证券构成券商财富管理样本池；若样本池数量小于 40 只，则按实际数量纳入。

然后，根据综合得分调整因子*自由流通市值，计算入围的 40 只券商证券的初始权重。

②银行财富管理样本池

首先，计算池内证券的非利息收入占比和手续费及佣金收入占比两个指标，分别按照从高到低的顺序排列，根据排名赋予各组内证券 1、2、3、……、n 的指标得分后，加权计算综合得分。

其次，选取综合得分排名靠前的 10 只证券构成银行财富管理样本池；若样本池数量小于 10 只，则按实际数量纳入。

然后，对入围的 10 只银行证券按综合得分升序排列，分别赋予 10、9、8、……、1 的调整因子用以计算其初始权重。

③财富管理指数样本

将券商财富管理样本池（40 只）与银行财富管理样本池（10 只）合并，选取 50 只证券

构成财富管理指数样本，样本数量不足时则按实际数量纳入。

（3）指数计算

指数采用派氏加权法，依据下列公式逐日连锁实时计算：

$$\text{实时指数} = \text{上一交易日收市指数} \times \frac{\sum (\text{样本股实时成交价} \times \text{样本权数} \times \text{权重调整因子})}{\sum (\text{样本上一交易日收市价} \times \text{样本权数} \times \text{权重调整因子})}$$

其中，样本权数调整方法参见指数计算与维护细则。权重调整因子的设置，在指数计算中，设置权重调整因子，根据券商财富管理样本池、银行财富管理样本池的初始权重乘以一定系数确定财富管理指数样本的初始权重，使合并后券商财富管理样本池的权重占比为 80%，合并后银行财富管理样本池的权重占比为 20%，同时，使单只样本在每次定期调整时的权重不超过 15%，前五大样本权重合计不超过 60%；权重调整因子每年调整 2 次，于样本定期调整时实施。在下一个定期调整日之前，权重调整因子一般固定不变。当出现样本临时调整时，新进样本继承被剔除证券在调整前最后一个交易日的权重，据此计算新进证券的权重调整因子。

（4）指数信息查阅方式

投资者可通过指数公司的网站查询标的指数的编制方案。查询链接如下：

www.cnindex.com.cn。

投资有风险，投资者在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策。

17、本公司可综合各种情况对发售安排做适当调整。本公司拥有对本基金份额发售公告的最终解释权。

一、本次发售基本情况

（一）基金的基本信息

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

基金简称：鹏扬国证财富管理 ETF

场内简称：财富管理 ETF

基金代码：159503

（二）基金类别

股票型证券投资基金

（三）运作方式

交易型开放式

（四）存续期限

不定期

（五）基金份额发售面值

基金份额初始面值为人民币 1.00 元，认购价格为人民币 1.00 元

（六）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、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者。

（七）发售目标

本基金基金募集份额总额不少于 2 亿份，基金募集金额不少于人民币 2 亿元。本基金募集规模上限为 30 亿元。

（八）基金份额发售机构

本基金的销售机构名单详见本基金发售公告“六（三）基金份额发售机构”部分的相关内容。

本公司在募集期内可能新增或变更销售机构，投资者可留意本公司及各发售代理机构的公告或网站公示，或拨打本公司客户服务热线（400-968-6688）及各发售代理机构的客户服务热线进行咨询。

（九）发售时间安排

本基金募集期限不超过 3 个月，自基金份额开始发售之日起计算。

本基金自 2023 年 6 月 8 日至 2023 年 6 月 21 日进行发售。如果在此发售期间未达到本基金招募说明书规定的基金备案条件，基金可在募集期限内继续销售，直到达到基金备案条件。本基金管理人可根据认购的情况在募集期内适当延长或缩短募集时间，并及时公告。另外，如遇突发事件，以上基金募集期的安排也可以适当调整。

（十）认购方式

投资者可选择网上现金认购、网下现金认购、网下股票认购三种方式认购本基金。

网上现金认购是指投资者通过基金管理人指定的发售代理机构通过深圳证券交易所网上系统以现金进行的认购；网下现金认购是指投资者通过基金管理人及其指定的发售代理机构以现金进行的认购；网下股票认购是指投资人通过基金管理人及其指定的发售代理机构以股票进行的认购。

（十一）认购费用

本基金在认购时收取认购费用，认购费率最高不超过 0.80%。认购费用由投资者承担，用于本基金的市场推广、销售、注册登记等募集期间发生的费用，不列入基金财产。

本基金通过对直销柜台认购的养老金客户与除此之外的非养老金客户实施差别的认购费率。养老金客户是指全国社会保障基金、依法设立的基本养老保险基金、可以投资基金的地方社会保障基金、企业年金单一计划以及集合计划，企业年金理事会委托的特定客户资产管理计划、企业年金养老金产品、职业年金计划、养老保障管理产品以及可以投资基金的其他养老金客户。如将来出现经可以投资基金的住房公积金、享受税收优惠的个人养老账户等经过养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，基金管理人可将其纳入养老金客户范围。

本基金认购费率如下表所示：

认购份额 (M)	非养老金客户认购费率	养老金客户认购费率 (通过直销柜台)
M < 50万份	0.80%	0.08%
50万份 ≤ M < 100万份	0.50%	0.05%
M ≥ 100万份	每笔1000元	每笔1000元

基金管理人办理网下现金认购时可参考上述表格所示费率收取认购费用。投资者申请多次现金认购的，须按每笔认购申请所对应的费率档次分别计费。

发售代理机构办理网上现金认购、网下现金认购、网下股票认购时可参照上述费率结构收取一定的佣金。

通过发售代理机构进行网下股票认购的投资者，在发售代理机构允许的条件下，可以选择以现金或基金份额的方式支付认购费用（或佣金）。

（十二）网上现金认购

1、认购原则与认购限额：

网上现金认购以基金份额申请。单一账户每笔认购份额须为 1000 份或其整数倍。

投资人在认购本基金时，需按发售代理机构的规定，备足认购资金，办理认购手续。网上现金认购申请提交后，不得撤销，申请一经确认，认购资金即被冻结。

2、认购金额的计算：

认购金额 = 认购价格 × 认购份额 × (1 + 佣金比率)

(或若适用固定费用的，认购金额 = 认购价格 × 认购份额 + 固定费用)

认购佣金 = 认购价格 × 认购份额 × 佣金比率

(或若适用固定费用的，认购佣金 = 固定费用)

利息折算的份额=利息/认购价格

认购佣金由发售代理机构在投资者认购确认时收取，投资者需以现金方式交纳认购佣金。

网上现金认购款项在基金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。网上现金认购款项的利息和具体份额以登记机构的记录为准。利息折算的基金份额保留至整数位，小数部分舍去，舍去部分计入基金财产。

举例：某投资者通过网上现金认购 1,000 份本基金，假设发售代理机构确认的佣金比率为 0.80%，则需准备的认购资金金额计算如下：

认购金额 = $1.00 \times 1,000 \times (1 + 0.80\%) = 1,008$ 元

认购佣金 = $1.00 \times 1,000 \times 0.80\% = 8$ 元

即投资者需准备 1,008 元资金，方可认购到 1,000 份本基金基金份额。假设该笔认购金额产生利息 10 元，则投资者可得到 1,010 份本基金份额。

3、清算交收：投资者提交的认购委托，由登记机构进行有效认购款项的清算交收。

4、认购确认：在基金合同生效后，投资者应通过其办理认购的销售网点或以其提供的其他方式查询认购确认情况。

（十三）网下现金认购

1、认购金额的计算：

（1）通过基金管理人进行网下现金认购的认购金额的计算

通过基金管理人进行网下现金认购的投资人，认购以基金份额申请，认购费用、认购金额的计算公式为：

认购费用 = 认购价格 × 认购份额 × 认购费率

（或若适用固定费用的，认购费用 = 固定费用）

认购金额 = 认购价格 × 认购份额 × (1 + 认购费率)

（或若适用固定费用的，认购金额 = 认购价格 × 认购份额 + 固定费用）

利息折算的份额 = 利息 / 认购价格

认购总份额 = 认购份额 + 利息折算的份额

认购费用由基金管理人收取，投资人需以现金方式交纳认购费用。

网下现金认购款项在基金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，网下现金认购款项的利息和具体份额以基金管理人或登记机构的记录为准。利息折算的基金份额保留至整数位，小数部分舍去，舍去部分计入基金财产。

举例：某投资人（非养老金客户）通过基金管理人采用网下现金认购的方式认购本基金

800,000 份，认购费率为 0.50%，假定认购金额产生的利息为 100 元，则该投资人的认购金额为：

认购费用 = $1.00 \times 800,000 \times 0.50\% = 4,000$ 元

认购金额 = $1.00 \times 800,000 \times (1 + 0.50\%) = 804,000$ 元

利息折算的份额 = $100 / 1.00 = 100$ 份

认购总份额 = $800,000 + 100 = 800,100$ 份

即，某投资人（非养老金客户）通过基金管理人采用网下现金认购的方式认购本基金 800,000 份，认购费率为 0.50%，假定认购金额产生的利息为 100 元，则该投资人的认购金额为 804,000 元，可得到 800,100 份基金份额。

（2）通过发售代理机构进行网下现金认购的认购金额的计算：同通过发售代理机构进行网上现金认购的认购金额的计算。

2、认购限额：网下现金认购以基金份额申请。投资人通过发售代理机构办理网下现金认购的，每笔认购份额须为 1,000 份或其整数倍；投资人通过基金管理人办理网下现金认购的，每笔认购份额须在 5 万份以上（含 5 万份）。投资人可多次认购，累计认购份额不设上限。

3、认购手续：投资人在认购本基金时，需按销售机构的规定，到销售网点办理相关认购手续，并备足认购资金。通过基金管理人的网下现金认购申请提交后不得撤销，通过其他发售代理机构提交的网下现金认购申请能否撤销以各销售机构的规定为准。

4、清算交收：通过基金管理人提交的网下现金认购申请，由基金管理人进行有效认购款项的清算交收。通过发售代理机构提交的网下现金认购申请，由登记机构进行有效认购款项的清算交收。

5、认购确认：基金合同生效后，投资人可通过其办理认购的销售网点或以其提供其他方式查询认购确认情况。

（十四）网下股票认购

1、认购原则与认购限额：

投资者在认购本基金时，需按销售机构的规定到销售机构网点办理认购手续，并备足认购股票。通过基金管理人的网下股票认购申请提交后不得撤销，通过其他发售代理机构提交的网下股票认购申请能否撤销以各销售机构的规定为准。

网下股票认购以单只股票股数申报，用以认购的股票必须是标的指数成份股和已公告的备选成份股（详见基金份额发售公告）。单只股票最低认购申报股数为 1,000 股，超过 1,000

股的部分须为 100 股的整数倍。投资者可以多次提交认购申请，累计申报股数不设上限。

2、特殊情形

(1) 已公告的将被调出标的指数的成份股不得用于认购本基金。

(2) 限制个股认购规模：基金管理人可根据个股市场情况、价格波动及其他异常情况，决定是否对个股认购规模进行限制，并在网下股票认购开始日前公告限制认购规模的个股名单。

(3) 临时拒绝个股认购：对于在网下股票认购期间价格波动异常、认购申报数量异常或长期停牌的个股，基金管理人可不经公告，全部或部分拒绝该股票的认购申报。

(4) 根据法律法规本基金不得持有的标的指数成份股，将不能用于认购本基金。

3、认购份额的计算方式

网下股票认购以单只股票股数申请，在销售机构允许的条件下，投资人可以以现金或基金份额的方式支付认购佣金。认购份额的计算方式为：

$$\text{认购份额} = \sum_{i=1}^n (\text{第 } i \text{ 只股票在网下股票认购期最后一日的均价} \times \text{有效认购数量}) / 1.00$$

其中：

(1) i 代表投资人提交认购申请的第 i 只股票。如投资者仅提交了 1 只股票的申请，则 $i=1$ 。

(2) “第 i 只股票在网下股票认购期最后一日的均价”由基金管理人根据证券交易所的当日行情数据，以该股票的总成交金额除以总成交股数计算，以四舍五入的方法保留小数点后两位。若该股票在当日停牌或无成交，则以同样方法计算最近一个交易日的均价作为计算价格。

若某一股票在网下股票认购期最后一日至登记机构进行股票过户日的冻结期间发生除息、送股(转增)、配股等权益变动，则由于投资者获得了相应的权益，基金管理人将按如下方式对该股票在网下股票认购期最后一日的均价进行调整：

1) 除息：调整后价格 = 网下股票认购期最后一日均价 - 每股现金股利或股息

2) 送股：调整后价格 = 网下股票认购期最后一日均价 / (1 + 每股送股比例)

3) 配股：调整后价格 = (网下股票认购期最后一日均价 + 配股价 × 配股比例) / (1 + 每股配股比例)

4) 送股且配股：调整后价格 = (网下股票认购期最后一日均价 + 配股价 × 配股比例) / (1 + 每股送股比例 + 每股配股比例)

5) 除息、送股且配股: 调整后价格 = (网下股票认购期最后一日均价 + 配股价 × 配股比例 - 每股现金股利或股息) / (1 + 每股送股比例 + 每股配股比例)

(3) “有效认购数量”是由基金管理人确认的并据以进行清算交收的股票股数。

1) 对于经公告限制认购规模的个股, 基金管理人可确认的认购数量上限的计算方式详见届时相关公告。如果投资人申报的个股认购数量总额大于基金管理人可确认的认购数量上限, 则按照各投资人的认购申报数量同比例收取。

2) 若某一股票在网下股票认购期最后一日至登记机构进行股票过户日的冻结期间发生司法执行, 基金管理人将根据登记机构确认的实际过户数据对投资人的有效认购数量进行相应调整。

4、清算交收

通过发售代理机构进行网下股票认购的, 发售代理机构将股票认购数据按投资人证券账户汇总发送给基金管理人。发售期最后一日日终, 基金管理人初步确认各成份股的有效认购数量。基金发售期结束后, 登记机构根据基金管理人提供的确认数据, 将投资者上海市场网下认购股票进行冻结, 并将投资者深圳市场网下认购股票过户至本基金组合证券认购专户。以基金份额方式支付佣金的, 基金管理人为投资者计算认购份额, 并根据发售代理机构提供的数据计算投资者应以基金份额方式支付的佣金, 从投资者的认购份额中扣除, 同时为发售代理机构增加相应的基金份额。登记机构根据基金管理人确认的认购申请股票数据, 按照交易所和登记机构的规则和流程, 最终将投资者申请认购的股票过户到本基金的证券账户。

5、认购确认

基金合同生效后, 投资者可通过其办理网下股票认购的销售网点或其他方式查询认购确认情况。

6、特别提示

投资者应根据法律法规及证券交易所相关规定进行股票认购, 并及时履行因股票认购导致的股份减持所涉及的信息披露等义务。

二、投资者的开户

投资人认购本基金时需具有深圳证券交易所 A 股账户 (以下简称“深圳 A 股账户”) 或深圳证券交易所证券投资基金账户 (以下简称“深圳证券交易所证券投资基金账户”)。

已有深圳 A 股账户或深圳证券交易所证券投资基金账户的投资者不必再办理开户手续。

尚无深圳 A 股账户或深圳证券投资基金账户的投资者，需在认购前持本人身份证到中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司的开户代理机构办理深圳 A 股账户或深圳证券投资基金账户的开户手续。有关开设深圳 A 股账户和深圳证券投资基金账户的具体程序和办法，请到各开户网点详细咨询有关规定。

账户使用注意事项：

(1) 如投资者需要参与网下现金或网上现金认购，应使用深圳 A 股账户或深圳证券投资基金账户；深圳证券投资基金账户只能进行本基金的现金认购和二级市场交易。如投资者需要参与基金份额的申购、赎回，则应开立深圳 A 股账户。

(2) 如投资者以深圳证券交易所上市交易的本基金标的指数成份股或备选成份股进行网下股票认购的，应开立并使用深圳 A 股账户。

(3) 如投资者以上海证券交易所上市交易的本基金标的指数成份股或备选成份股进行网下股票认购的，除了持有深圳 A 股账户或深圳证券投资基金账户外，还应持有上海证券交易所 A 股账户（以下简称“上海 A 股账户”），且该两个账户的证件号码及名称属于同一投资人所有，并注意投资人认购基金份额的托管证券公司和上海 A 股账户指定交易证券公司应为同一发售代理机构。

三、本基金的认购程序

(一) 网上现金认购的程序

1、认购时间：

基金发售日的上午 9:30—11:30 和下午 1:00—3:00(周六、周日及法定节假日不受理)。如深圳证券交易所对网上现金认购时间作出调整，我司将作出相应调整并及时公告。

2、认购手续：

1) 开立深圳证券交易所 A 股账户或证券投资基金账户。

2) 在认购前向资金账户中存入足够的认购资金。

3) 投资者网上现金认购流程、需提交的文件等应遵循发售代理机构及深圳证券交易所的有关规定。

具体时间和认购手续以深圳证券交易所和发售代理机构的相关规则为准。

(二) 网下现金认购的程序

1、直销机构

(1) 认购时间：基金发售日的 9:30 至 17:00 (周六、周日和节假日不受理)。

(2) 认购手续

个人投资人到基金管理人直销网点提供下列资料办理基金的认购手续：

- 1) 个人投资者提供身份证件原件及复印件 (如为第二代身份证需正反面复印件)；
- 2) 深圳 A 股账户卡或深圳证券交易所证券投资基金账户 (原件和复印件)；
- 3) 风险承受能力调查问卷；
- 4) 加盖银行受理章的汇款凭证回单原件及复印件；
- 5) 填妥的《ETF 基金网下认购业务申请表》；
- 6) ETF 基金风险揭示书；
- 7) 基金管理人要求提供的其他有关材料。

机构投资者到基金管理人直销网点提供下列资料办理基金的认购手续：

- 1) 营业执照或注册登记证正 (副) 本、组织机构代码证及税务登记证原件或加盖单位公章的复印件；开展金融相关业务资格证明原件或加盖单位公章的复印件 (金融机构提供)；
- 2) 法人或负责人身份证件原件或加盖单位公章的复印件；
- 3) 基金业务授权委托书 (本公司标准文本, 须加盖单位公章和法定代表人或授权人章)；
- 4) 被授权人 (即业务经办人) 身份证件原件或加盖单位公章的复印件；
- 5) 深圳 A 股账户卡或深圳证券交易所证券投资基金账户 (原件和复印件)；
- 6) 机构投资者签署《开放式基金客户风险承受能力测试问卷》(机构版)；
- 7) 加盖银行受理章的汇款凭证回单原件及复印件；
- 8) 填妥的《ETF 基金网下认购业务申请表》；
- 9) ETF 基金风险揭示书；
- 10) 基金管理人要求提供的其他有关材料。

(3) 本公司直销资金划转账户

投资者认购本基金, 需在募集期内, 将足额认购资金汇入下列本公司任一直销资金专户：

1) 建设银行账户：

账户名称：鹏扬基金管理有限公司

开户银行：中国建设银行北京复兴支行

银行账号：11050137510000001225

大额支付号：105100008038

2) 交通银行账户:

账户名称: 鹏扬基金管理有限公司

开户银行: 交通银行北京海淀支行

银行账号: 110060576018800024256

大额支付号: 301100000099

3) 工商银行账户:

账户名称: 鹏扬基金管理有限公司

开户银行: 中国工商银行股份有限公司北京复内支行

银行账号: 0200215319200037984

大额支付号: 102100021535

4) 浦发银行账户:

账户名称: 鹏扬基金管理有限公司

开户银行: 上海浦东发展银行北京分行营业部

银行账号: 91010153890000022

大额支付号: 310100000010

5) 兴业银行账户:

账户名称: 鹏扬基金管理有限公司

开户银行: 兴业银行股份有限公司上海分行

银行账号: 216200100101822906

大额支付号: 309290000107

(4) 注意事项

1) 通过本公司直销柜台办理业务的,若投资者的认购资金在认购申请当日 17:00 之前未到达本公司指定的直销资金专户,则当日提交的认购申请作废,投资者需重新提交认购申请并确保资金在认购申请当日 17:00 之前到达本公司指定的直销资金专户。在本基金发行截止日的截止时间之前,若投资者的认购资金未到达本公司指定账户,则投资者提交的认购申请将可被认定为无效认购。

2) 已开立本公司基金账户的投资者在认购时不能使用本公司基金账户,而需使用深圳 A 股账户卡或深圳证券交易所证券投资基金账户卡。

3) 具体业务办理规则和程序以本公司直销机构的规定为准,投资者填写的资料需真实、准确,否则由此引发的错误和损失,由投资者自行承担。

2、发售代理机构

(1) 认购时间：基金发售日的具体业务办理时间由发售代理机构确定。

(2) 认购手续：投资者直接通过发售代理机构办理认购。

1) 开立深圳 A 股账户或深圳证券交易所证券投资基金账户。

2) 在认购前向资金账户中存入足够的认购资金。

3) 投资者填写认购委托单，同时填写委托该发售代理机构代为办理网上现金认购的委托申请书。申请一经确认，认购资金即被冻结。

具体时间和认购手续以基金管理人或各发售代理机构的规定为准。

(三) 网下股票认购的程序

1、直销机构

(1) 认购时间：基金发售日的 9:30 至 17:00 (周六、周日和节假日不受理)。

(2) 认购手续：

个人投资人到基金管理人直销网点提供下列资料办理基金的认购手续：

1) 个人投资者提供身份证件原件及复印件 (如为第二代身份证需正反面复印件)；

2) 深圳证券交易所 A 股账户卡复印件或上海证券交易所 A 股账户卡复印件；

3) 风险承受能力调查问卷；

4) 汇款使用的银行借记卡或存折原件及复印件 (该指定银行账户为资金进出的唯一账号)；

5) 填妥的《ETF 基金网下认购业务申请表》；

6) ETF 基金风险揭示书；

7) 基金管理人要求提供的其他有关材料。

机构投资人到基金管理人直销网点提供下列资料办理基金的认购手续：

1) 营业执照或注册登记证书正 (副) 本、组织机构代码证及税务登记证原件或加盖单位公章的复印件；开展金融相关业务资格证明原件或加盖单位公章的复印件 (金融机构提供)；

2) 法人或负责人身份证件原件或加盖单位公章的复印件；

3) 基金业务授权委托书 (本公司标准文本，须加盖单位公章和法定代表人或授权人章)；

4) 被授权人 (即业务经办人) 身份证件原件或加盖单位公章的复印件；

5) 深圳证券交易所 A 股账户卡复印件或上海证券交易所 A 股账户卡复印件；

6) 机构投资者签署《开放式基金客户风险承受能力测试问卷》(机构版)；

7) 提供加盖单位公章的由指定银行出具的银行账户证明复印件或银行账户的相关证明文件（该指定银行账户为资金进出的唯一账号）；

8) 填妥并加盖印鉴章的《ETF 基金网下认购业务申请表》；

9) ETF 基金风险揭示书；

10) 提供加盖单位公章的股票份额承诺书；

11) 基金管理人要求提供的其他有关材料。

(3) 注意事项

1) 开立深圳证券交易所 A 股账户、上海证券交易所 A 股账户。

2) 在 A 股账户中具备足够的符合要求的标的指数成份股或备选成份股。

3) 投资者准备相关资料并填写认购委托单。登记机构将在募集结束后办理用以认购的股票冻结业务，届时如投资者用以认购的股票的可数量不足，则投资者的该笔股票认购申请无效。

具体认购程序以本公司直销机构的规定为准。

特别提示，投资者应根据法律法规及证券交易所相关规定进行股票认购，并及时履行因股票认购导致的股份减持所涉及的信息披露等义务。

2、发售代理机构

(1) 认购时间：基金发售日的具体业务办理时间由发售代理机构确定。

(2) 认购手续：投资者直接通过发售代理机构办理认购。

1) 开立深圳证券交易所 A 股账户、上海证券交易所 A 股账户。

2) 在 A 股账户中具备足够的符合要求的标的指数成份股或备选成份股。

3) 投资者填写认购委托单。申请一经确认，认购股票即被冻结。

具体认购程序以发售代理机构的规定为准。

四、清算与交割

(一) 本基金募集期间的认购资金存入专用账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。募集期间的认购股票按照交易所和登记机构的规则和流程办理冻结与过户，最终将投资人申请认购确认的股票过户至基金证券账户。

网下现金认购及网上现金认购的有效认购资金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，利息折算的份额以基金管理人及登记机构的记录为准。投资者的

认购股票在股票认购日至登记机构进行股票过户日的冻结期间的权益归属依据相关规则办理。

(二) 本基金权益登记由登记机构在发售结束后完成过户登记。

(三) 基金募集期间的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，不得从基金财产中列支。

五、基金的验资与基金合同生效

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（含网下股票认购所募集的股票市值）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。

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：

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。对于基金募集期间网下股票认购所募集的股票，登记机构应予以解冻，基金管理人不承担相关股票冻结期间交易价格波动的责任；登记机构及发售代理机构将协助基金管理人完成相关资金和证券的退还工作。

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。

六、本次发售当事人或中介机构

(一) 基金管理人

名称：鹏扬基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区栖霞路120号3层302室

办公地址：北京市西城区复兴门外大街A2号西城金茂中心16层

法定代表人：杨爱斌

全国统一客户服务电话：4009686688

电话：010-68105888

传真：010-68105932

联系人：吉瑞

（二）基金托管人

名称：华泰证券股份有限公司

住所：南京市江东中路 228 号

办公地址：南京市江东中路 228 号

法定代表人：张伟

成立日期：1991 年 4 月 9 日

基金托管资格批文及文号：《关于核准华泰证券股份有限公司证券投资基金托管资格的批复》（中国证监会证监许可[2014]1007 号）

注册资本：907558.9027 万人民币

存续期间：持续经营

电话：025--83388463

联系人：李欣然

（三）基金份额发售机构

1、网下现金认购和网下股票认购的直销机构

鹏扬基金管理有限公司直销柜台

办公地址：北京市石景山区绿地环球文化金融城 9 号院 5 号楼 1401-1405

法定代表人：杨爱斌

全国统一客户服务电话：4009686688

联系人：申屠清泉

传真：010-81922890

2、网上现金认购的发售代理机构

网上现金发售通过具有基金销售业务资格的深圳证券交易所会员单位办理，具体名单如下：爱建证券、安信证券、渤海证券、财达证券、财通证券、财信证券、长城证券、长江证券、川财证券、大通证券、大同证券、德邦证券、第一创业、东北证券、东方财富、东方证券、东海证券、东莞证券、东吴证券、东兴证券、高华证券、方正证券、光大证券、广发证

券、国都证券、国海证券、国金证券、国开证券、国联证券、国融证券、国盛证券、国泰君安、国信证券、国元证券、海通证券、恒泰证券、红塔证券、宏信证券、华安证券、华宝证券、华创证券、华福证券、华金证券、华林证券、华龙证券、华融证券、华泰证券、华西证券、华鑫证券、江海证券、金元证券、九州证券、开源证券、联储证券、民生证券、南京证券、平安证券、瑞银证券、山西证券、上海证券、申万宏源证券、申万宏源西部证券、世纪证券、首创证券、太平洋证券、天风证券、万和证券、万联证券、网信证券、五矿证券、西部证券、西南证券、长城国瑞、湘财证券、新时代证券、信达证券、兴业证券、银河证券、银泰证券、英大证券、甬兴证券、粤开证券、招商证券、浙商证券、中航证券、中金财富、中金公司、中山证券、中泰证券、中天证券、中信建投、中信山东、中信证券、中信证券华南、中银证券、中邮证券、中原证券（排名不分先后）。

如果会员单位有所增加或减少，请以深圳证券交易所的具体规定为准，本基金管理人将不就此事项进行公告。

3、网下现金认购的发售代理机构

暂无。基金管理人可根据实际情况变更网下现金认购的发售代理机构，并在基金管理人网站公示。

4、网下股票认购的发售代理机构

暂无。基金管理人可根据实际情况变更网下股票认购的发售代理机构，并在基金管理人网站公示。

5、本公司可以根据情况变化增加或者减少基金份额网下发售机构，并在基金管理人网站公示。基金份额发售机构可以根据情况增加或者减少其销售城市、网点。

（四）登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

注册地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：于文强

电话：010-50938931

传真：010-50938907

联系人：徐一文

（五）律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：韩炯

电话：021-31358666

传真：021-31358600

经办律师：陈颖华

联系人：黎明、陈颖华

（六）会计师事务所

本基金的法定验资机构为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

办公地址：上海市湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人：李丹

经办注册会计师：薛竞、周祎

联系电话：021-23238888

传真：021-23238800

联系人：周祎

七、网下股票认购清单

本基金募集期间，网下股票认购名单如下表所示。将被调出标的指数或即将到期的成份券不得用于认购本基金。基金管理人可根据网下股票认购日前 3 个月个股的交易量、价格波动及其他异常情况，决定是否对个股认购规模进行限制，并在网下股票认购日前公告限制认购规模的个股名单。对于在网下股票认购期间价格波动异常、认购申报数量异常或长期停牌的个股，基金管理人可不经公告，全部或部分拒绝该股票的认购申报。为保护投资人利益，基金管理人可根据实际认购情况，全部或部分拒绝成份券的认购申报。

网下股票认购名单如下：

证券代码	证券简称	证券代码	证券简称	证券代码	证券简称
000001.SZ	平安银行	600030.SH	中信证券	601198.SH	东兴证券
000166.SZ	申万宏源	600036.SH	招商银行	601211.SH	国泰君安

000686.SZ	东北证券	600109.SH	国金证券	601236.SH	红塔证券
000750.SZ	国海证券	600155.SH	华创阳安	601328.SH	交通银行
000776.SZ	广发证券	600369.SH	西南证券	601377.SH	兴业证券
000783.SZ	长江证券	600621.SH	华鑫股份	601456.SH	国联证券
002142.SZ	宁波银行	600837.SH	海通证券	601688.SH	华泰证券
002500.SZ	山西证券	600918.SH	中泰证券	601696.SH	中银证券
002736.SZ	国信证券	600926.SH	杭州银行	601788.SH	光大证券
002797.SZ	第一创业	600958.SH	东方证券	601878.SH	浙商证券
002926.SZ	华西证券	600999.SH	招商证券	601881.SH	中国银河
002939.SZ	长城证券	601009.SH	南京银行	601901.SH	方正证券
002948.SZ	青岛银行	601066.SH	中信建投	601990.SH	南京证券
300059.SZ	东方财富	601108.SH	财通证券	601995.SH	中金公司
600000.SH	浦发银行	601162.SH	天风证券	601998.SH	中信银行
601166.SH	兴业银行	002673.SZ	西部证券	600909.SH	华安证券
601555.SH	东吴证券				

鹏扬基金管理有限公司

二〇二三年六月一日