

鹏华基金管理有限公司关于鹏华中证A500指数证券投资基金转型为鹏华中证A500交易型开放式指数证券投资基金联接基金并修订相关法律文件的公告

鹏华基金管理有限公司（以下简称“本公司”）管理的鹏华中证A500指数证券投资基金（以下简称“本基金”）于2024年11月14日经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可〔2024〕1592号文准予注册，进行募集。基金管理人获得中国证监会书面确认后，《鹏华中证A500指数证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）于2024年12月30日生效。

为了更好地满足投资者的投资需求，保护基金份额持有人利益，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》等法律法规的规定和《基金合同》的相关约定，本公司经与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，决定自2025年1月8日起，将本基金转型为鹏华中证A500交易型开放式指数证券投资基金联接基金，并对《基金合同》、《鹏华中证A500指数证券投资基金托管协议》（以下简称“《托管协议》”）及相关法律文件进行相应修订。现将具体事宜公告如下：

一、转型为鹏华中证A500交易型开放式指数证券投资基金联接基金

根据《基金合同》约定“若本基金管理人注册并成立跟踪同一标的指数的交易型开放式指数基金（ETF），在不改变本基金投资目标的前提下，本基金经履行适当程序后可变更为该ETF的联接基金。联接基金是指其绝大部分基金资产投资于跟踪同一标的指数的ETF，以紧密跟踪标的指数表现的基金产品。此项变更需经基金管理人和基金托管人协商一致后修改基金合同，不需召开基金份额持有人大会。”

本公司管理的鹏华中证A500交易型开放式指数证券投资基金已于2024年11月21日正式成立，并自2024年12月2日起在上海证券交易所上市交易，与本基金跟踪同一标的指数。根据《基金合同》的约定，本公司决定自2025年1月8日起，将本基金转型为鹏华中证A500交易型开放式指数证券投资基金的联接基金，基金全称由“鹏华中证A500指数证券投资基金”变更为“鹏华中证A500交易型开放式指数证券投资基金联接基金”，本基金A类基金份额简称“鹏华中证A500指数A”变更

为“鹏华中证A500ETF联接A”，C类基金份额简称“鹏华中证A500指数C”变更为“鹏华中证A500ETF联接C”，各类基金份额代码不变。

本基金基金份额登记机构将对基金份额进行变更登记，转型后“鹏华中证A500指数证券投资基金A类基金份额”将变更登记为“鹏华中证A500交易型开放式指数证券投资基金联接基金A类基金份额”，“鹏华中证A500指数证券投资基金C类基金份额”将变更登记为“鹏华中证A500交易型开放式指数证券投资基金联接基金C类基金份额”。

上述基金转型不影响各类基金份额净值的计算，转型后各类基金份额的申购费率、赎回费率及销售服务费率保持不变。

二、修订《基金合同》、《托管协议》的相关说明

为确保本基金转型为鹏华中证A500交易型开放式指数证券投资基金联接基金符合法律法规的规定和《基金合同》的约定，基金管理人经与基金托管人协商一致，对《基金合同》的相关内容进行了修订，具体修订内容详见附件。

根据基金合同约定，本次转型无须召开基金份额持有人大会。自2025年1月8日起，本基金正式转型为鹏华中证A500交易型开放式指数证券投资基金联接基金，《基金合同》失效，《鹏华中证A500交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》生效。基金管理人经与基金托管人协商一致，已相应修改《托管协议》，并将按照法律法规的规定更新《鹏华中证A500指数证券投资基金招募说明书》及基金产品资料概要。

本公司于本公告发布当日（2025年1月7日）在中国证监会规定网站同时发布修订后的基金合同、托管协议以及更新后的招募说明书及基金产品资料概要。

投资者可访问鹏华基金管理有限公司网站（www.phfund.com.cn）或拨打全国免长途费的客户服务电话（400—6788—533）咨询相关情况。

本公告仅对本基金转型为鹏华中证A500交易型开放式指数证券投资基金联接基金并修订相关法律文件的有关事项予以说明。投资者欲了解基金的详细情况，请仔细阅读基金合同、招募说明书（更新）、基金产品资料概要（更新）及相关法律文件。

风险提示：基金过往业绩并不预示其未来表现，基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对基金表现的保证。基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管

理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。销售机构根据法规要求对投资者类别、风险承受能力和基金的风险等级进行划分，并提出适当性匹配意见。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行承担。投资者在投资基金前应认真阅读基金合同、招募说明书（更新）和基金产品资料概要（更新）等基金法律文件，全面认识基金的风险收益特征，在了解基金情况及听取销售机构适当性意见的基础上，根据自身的风险承受能力、投资期限和投资目标，对基金投资作出独立决策，选择合适的基金产品。

特此公告。

鹏华基金管理有限公司

2025年1月7日

附件：鹏华中证 A500 指数证券投资基金转型为鹏华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同及托管协议修订对照表

| 基金合同 | | |
|------------|---|---|
| 章节 | 原文条款 内容 | 修改后条款 内容 |
| 第一部分 前言 | 一、订立本基金合同的目的、依据和原则 2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国民法典》、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）、《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》（以下简称“《指数基金指引》”）和其他有关法律、法规。 | 一、订立本基金合同的目的、依据和原则 2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国民法典》、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）、 《公开募集证券投资基金运作指引第2号——基金中基金指引》 、《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 |

| | | |
|---------------------------|--|---|
| | <p>三、鹏华中证A500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投资价值和市场前景做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。</p> | <p>简称“《指数基金指引》”）和其他有关法律法规。</p> <p>三、鹏华中证A500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”）由鹏华中证A500指数证券投资基金转型而来。鹏华中证A500指数证券投资基金由基金管理人依照《基金法》、《鹏华中证A500指数证券投资基金基金合同》及其他有关规定募集，并经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）注册。</p> <p>中国证监会对鹏华中证A500指数证券投资基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值和市场前景做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。</p> |
| <p>第二部分 释义</p> | <p>1、基金或本基金：指鹏华中证A500指数证券投资基金</p> <p>4、基金合同、《基金合同》或本基金合同：指《鹏华中证A500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《鹏华中证A500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、招募说明书或《招募说明书》：指《鹏华中证A500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《鹏华中证A500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《鹏华中证A500指数证券投资基金基金份额发售公告》</p> <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>29、基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理认购、申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户</p> <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>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> <p>40、认购：指在基金募集期内，投资人申请购买基金份额的行为</p> <p>48、基金收益：指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已</p> | <p>1、基金或本基金：指鹏华中证A500交易型开放式指数证券投资基金联接基金，由鹏华中证A500指数证券投资基金转型而来</p> <p>4、基金合同、《基金合同》或本基金合同：指《鹏华中证A500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《鹏华中证A500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、招募说明书或《招募说明书》：指《鹏华中证A500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《鹏华中证A500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>8、交易型开放式指数证券投资基金：指《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》定义的“交易型开放式指数基金”，简称“ETF”</p> <p>9、标的指数：指中证A500指数</p> <p>10、目标ETF：指鹏华中证A500交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“鹏华中证A500ETF”）</p> <p>11、ETF联接基金：指将其绝大部分基金财产投资于跟踪同一标的指数的ETF（以下简称“目标ETF”），紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，采用开放式运作方式的基金，简称“联接基金”</p> <p>27、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> <p>32、基金交易账户：指销售机构为投资人开</p> |

| | | |
|--------------------|--|--|
| | <p>实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约</p> <p>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、基金应收申购款及其他资产的价值总和</p> <p>55、基金份额分类：本基金根据销售服务费及认购/申购费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购基金时收取认购/申购费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为A类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费，并不收取认购/申购费用的基金份额，称为C类基金份额。两类基金份额分设不同的基金代码，并分别公布基金份额净值</p> | <p>立的、记录投资人通过该销售机构办理申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户</p> <p>33、基金合同生效日：指《鹏华中证A500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《鹏华中证A500指数证券投资基金基金合同》自同一日失效</p> <p>49、基金收益：指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、投资目标ETF份额所得收益、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约</p> <p>50、基金资产总值：指基金拥有的目标ETF基金份额、各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和</p> <p>56、基金份额分类：本基金根据销售服务费及申购费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人申购基金时收取申购费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为A类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费，并不收取申购费用的基金份额，称为C类基金份额。两类基金份额分设不同的基金代码，并分别公布基金份额净值</p> |
| <p>第三部分基金的基本情况</p> | <p>一、基金名称 鹏华中证A500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>四、基金的投资目标 紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。在正常市场情况下，力争将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控制在0.35%以内，年化跟踪误差控制在4%以内。</p> <p>五、基金的标的指数 本基金的标的指数为中证A500指数。</p> <p>六、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>七、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。本基金A类基金份额的具体认购费率按招募说明书及基金产品资料概要的规定执行。本基金C类基金份额不收取认购费。</p> <p>九、基金份额类别 本基金根据销售服务费及认购/申购费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购基金时收取认购/申购费</p> | <p>一、基金名称 鹏华中证A500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> <p>四、基金的投资目标 本基金主要通过投资于目标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。本基金力争将日均跟踪偏离度绝对值控制在0.35%以内，年化跟踪误差控制在4%以内。</p> <p>五、目标ETF及其标的指数 目标ETF为鹏华中证A500交易型开放式指数证券投资基金，其标的指数为中证A500指数。</p> <p>七、基金份额类别 本基金根据销售服务费及申购费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人申购基金时收取申购费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为A类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费，并不收取申购费用的基金份额，称为C类基金份额。 本基金A类基金份额和C类基金份额分别设置</p> |

| | | |
|--------------------|---|--|
| | <p>用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为A类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费，并不收取认购/申购费用的基金份额，称为C类基金份额。</p> <p>本基金A类基金份额和C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算并公告基金份额净值。</p> <p>投资者可自行选择认购/申购的基金份额类别。</p> <p>在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，根据基金实际运作情况，基金管理人经与基金托管人协商一致，可以增加本基金新的基金份额类别、调整现有基金份额类别的费率水平或者停止现有基金份额类别的销售等，此项调整无需召开基金份额持有人大会。</p> <p>十、条件许可情况下的基金模式变更</p> <p>若本基金管理人注册并成立跟踪同一标的指数的交易型开放式指数基金（ETF），在不改变本基金投资目标的前提下，本基金经履行适当程序后可变更为该ETF的联接基金。联接基金是指其绝大部分基金资产投资于跟踪同一标的指数的ETF，以紧密跟踪标的指数表现的基金产品。此项变更需经基金管理人和基金托管人协商一致后修改基金合同，不需召开基金份额持有人大会。</p> | <p>代码。由于基金费用的不同，本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算并公告基金份额净值。</p> <p>投资者可自行选择申购的基金份额类别。</p> <p>在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，根据基金实际运作情况，基金管理人经与基金托管人协商一致，可以增加本基金新的基金份额类别、调整现有基金份额类别的费率水平或者停止现有基金份额类别的销售等，此项调整无需召开基金份额持有人大会。</p> <p>八、本基金与目标ETF的联系与区别</p> <p>本基金为目标ETF的联接基金，二者既有联系也有区别。</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标的指数。（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）在基金的投资方法方面，目标ETF主要采取完全复制策略，直接投资于标的指数的成份股、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，实现对标的指数的紧密跟踪。（2）在交易方式方面，投资者既可以像买卖股票一样在交易所买卖目标ETF的基金份额，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，投资者可以通过基金管理人及其他销售机构按未知价法进行基金的申购与赎回。</p> <p>本基金与目标ETF业绩表现仍可能出现差异。可能引发差异的因素主要包括：（1）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，仍需将不低于基金资产净值5%的资产投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券。（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资产净值产生一定影响。</p> |
| <p>第四部分基金的历史沿革</p> | <p>第四部分 基金份额的发售</p> <p>一、基金份额的发售时间、发售方式、发售对象</p> <p>1、发售时间</p> <p>自基金份额发售之日起最长不得超过3个月，一</p> | <p>第四部分 基金的历史沿革</p> <p>本基金由鹏华中证A500指数证券投资基金转型而来。鹏华中证A500指数证券投资基金经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）2024年11月14日证监许可</p> |

| | |
|--|---|
| <p>具体发售时间见基金份额发售公告。</p> <p>2、发售方式 通过各销售机构的基金销售网点公开发售，各销售机构的具体名单见基金份额发售公告以及基金管理人网站披露的基金销售机构名录。</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、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。</p> <p>二、基金份额的认购</p> <p>1、认购费用 本基金A类基金份额的认购费率由基金管理人决定，并在招募说明书及基金产品资料概要中列示；本基金C类基金份额不收取认购费。本基金A类基金份额的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相应类别的基金份额归基金份额持有人所有，其中利息转份额以登记机构的记录为准。</p> <p>3、基金认购份额的计算 基金认购份额具体的计算方法在招募说明书中列示。</p> <p>4、认购份额余额的处理方式 认购份额的计算保留到小数点后2位，小数点2位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。</p> <p>5、认购申请的确认 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。认购的确认以登记机构或基金管理人的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况，投资人可及时查询并妥善行使合法权利。</p> <p>三、基金份额认购数量的限制</p> <p>1、投资人认购时，需按销售机构规定的方式全额缴款。</p> <p>2、基金管理人可以对每个基金交易账户的单笔最低认购金额进行限制，具体限制请参看招募说明书或相关公告。</p> <p>3、基金管理人可以对募集期间的单个投资人的累计认购金额进行限制，具体限制和处理方法请参看招募说明书或相关公告。</p> <p>4、投资人在募集期内可以多次认购基金份额，但已受理的认购申请不允许撤销。</p> <p>5、如果募集期限届满，单一投资者认购基金份额比例达到或者超过50%，基金管理人有权</p> | <p>[2024]1592号文准予注册，进行募集。基金管理人为鹏华基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。基金管理人获得中国证监会书面确认后，《鹏华中证A500指数证券投资基金基金合同》于2024年12月30日生效。</p> <p>2024年11月21日，基金管理人管理的鹏华中证A500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《鹏华中证A500指数证券投资基金基金合同》的约定，经与基金托管人协商一致，决定将鹏华中证A500指数证券投资基金转型为鹏华中证A500交易型开放式指数证券投资基金联接基金，并据此修订《鹏华中证A500指数证券投资基金基金合同》。自2025年1月8日起，鹏华中证A500指数证券投资基金正式转型为本基金，原《鹏华中证A500指数证券投资基金基金合同》失效，《鹏华中证A500交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》生效。</p> |
|--|---|

| | | |
|----------------------------|--|---|
| | <p>全部或部分拒绝该投资者的认购申请，以确保其持有基金份额比例低于50%，并于10个工作日内返还相应款项。</p> | |
| <p>第五部分 基金的 存续</p> | <p style="text-align: center;">第五部分 基金备案</p> <p>一、基金备案的条件</p> <p>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。</p> <p>基金募集达到基金备案条件的，自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起，《基金合同》生效；否则《基金合同》不生效。基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对《基金合同》生效事宜予以公告。基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。</p> <p>二、基金合同不能生效时募集资金的处理方式</p> <p>如果募集期限届满，未满足基金备案条件，基金管理人应当承担下列责任：—</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；— 2、在基金募集期限届满后30日内退还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息；— 3、如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。— <p>三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模</p> <p>《基金合同》生效后，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60个工作日出现前述情形的，基金管理人应当在10个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并在6个月内召集基金份额持有人大会。</p> <p>法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。</p> | <p style="text-align: center;">第五部分 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60个工作日出现前述情形的，基金管理人应当在10个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并在6个月内召集基金份额持有人大会。</p> <p>法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。</p> |

| | | |
|------------------------------|---|--|
| <p>第六部分 基金份额的申购与赎回</p> | <p>七、拒绝或暂停申购的情形 9、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者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。 发生除上述第4、8、9项以外暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人申购申请时，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。 八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> | <p>七、拒绝或暂停申购的情形 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。 9、目标ETF暂停申购、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。 发生除上述第4、10项以外暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人申购申请时，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。 八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 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。 8、目标ETF暂停赎回、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>第七部分 基金合同当事人及权利义务</p> | <p>一、基金管理人 (二) 基金管理人的权利与义务 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： (1) 依法募集资金； (16) 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、转托管、定期定额投资和非交易过户等业务规则； 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： (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办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜； (5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资； (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； (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</p> | <p>一、基金管理人 (二) 基金管理人的权利与义务 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： (15) 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、转托管、定期定额投资和非交易过户等业务规则； (16) 代表基金份额持有人的利益行使因基金财产投资于目标ETF所产生的权利，基金合同另有约定的除外； 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： (1) 办理或者委托经中国证监会认定的其他机构办理基金份额的申购、赎回和登记事宜； (5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行基金、证券投资； (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； 三、基金份额持有人 1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有</p> |

| | | |
|---------------------------|--|---|
| | <p>内退还基金认购人；</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>（5）出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；</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）交纳基金认购、申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；</p> | <p>关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：</p> <p>（5）出席或者委派代表出席本基金或目标ETF的基金份额持有人大会，对本基金或目标ETF的基金份额持有人大会审议事项行使表决权；</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>第八部分 基金份额持有人大会</p> | <p>一、召开事由</p> <p>1、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，法律法规、中国证监会另有规定或基金合同另有约定的除外：</p> <p>（8）变更基金投资目标、范围或策略；</p> <p>2、在法律法规规定和《基金合同》约定的范围内且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：</p> <p>（4）基金管理人、登记机构、基金销售机构调整有关认购、申购、赎回、转换、定期定额投资、非交易过户、转托管等业务规则；</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为：在目标ETF基金份额持有人大会的权益登记日，本基金持有目标ETF基金份额的总数乘以该持有人所持有的本基金份额占本基金总份额的比例，计算结果按照四舍五入的方法，保留到整数位。本基金份额折算为目标ETF后的每一参会份额和目标ETF的每一参会份额拥有平等的投票权。若本基金启用侧袋机制且特定资产不包括目标ETF，则本基金的主袋账户份额持有人可以凭持有的主袋账户份额直接参加或者委派代表参加目标ETF基金份额持有人大会并表决。</p> <p>本基金的基金管理人不应以本基金的名义代表本基金的全体基金份额持有人以目标ETF的基金份额持有人的身份行使表决权，但可接受本基金的特定基金份额持有人的委托以本基金的基金份额持有人代理人的身份出席目标ETF的基金份额持有人大会并参与表决。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>一、召开事由</p> <p>1、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，法律法规、中国</p> |

| | | |
|-------------|---|--|
| | | <p>证监会另有规定或基金合同另有约定的除外：</p> <p>（8）变更基金投资目标、范围或策略，但由于目标ETF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、范围或策略的情况除外；</p> <p>（9）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>2、在法律法规规定和《基金合同》约定的范围内且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：</p> <p>（4）基金管理人、登记机构、基金销售机构调整有关申购、赎回、转换、定期定额投资、非交易过户、转托管等业务规则；</p> <p>（8）由于目标ETF交易方式变更、终止上市、基金合同终止、与其他基金进行合并而变更基金投资目标、范围或策略；</p> <p>（9）本基金采取特殊申购或其他方式参与目标ETF的申购赎回；</p> <p>（10）按照本基金合同约定，由目标ETF的联接基金变更为直接投资目标ETF标的指数的指数基金；</p> |
| 第十二部分 基金的投资 | <p>一、投资目标</p> <p>紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。在正常市场情况下，力争将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控制在0.35%以内，年化跟踪误差控制在4%以内。</p> <p>二、投资范围</p> <p>本基金主要投资于标的指数成份股（含存托凭证）、备选成份股（含存托凭证）。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于依法发行或上市的其他股票（包括主板、创业板以及其他中国证监会允许基金投资的股票）、存托凭证、债券（含国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券、政府支持机构债及其他中国证监会允许基金投资的债券）、债券回购、资产支持证券、银行存款（包括协议存款、定期存款等）、同业存单、货币市场工具、股指期货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（但须符合中国证监会相关规定）。基金的投资组合比例为：本基金投资于股票资产及存托凭证的比例不低于基金资产的90%，</p> | <p>一、投资目标</p> <p>本基金主要通过投资于目标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。本基金力争将日均跟踪偏离度绝对值控制在0.35%以内，年化跟踪误差控制在4%以内。</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，本基金可少量投资于依法发行或上市的其他股票（包括主板、创业板以及其他中国证监会允许基金投资的股票）、存托凭证、债券（含国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券、政府支持机构债及其他中国证监会允许基金投资的债券）、债券回购、资产支持证券、银行存款（包括协议存款、定期存款等）、同业存单、货币市场工具、股指期货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（但须符合中国证监会相关规定）。基金的投资组合比例为：本基金投资于目标</p> |

投资目标的指数成份股及其备选成份股（均含存托凭证）的比例不低于非现金基金资产的80%；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，保持不低于基金资产净值5%的现金或者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。

四、投资策略

本基金主要采取完全复制策略，即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化对股票投资组合进行相应调整。

当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，或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，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，以更好地实现本基金的投资目标。

在正常市场情况下，本基金力争将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控制在0.35%以内，年化跟踪误差控制在4%以内。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和跟踪误差进一步扩大。

1、股票投资策略

本基金将主要按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化而进行相应调整。

（1）定期调整

根据标的指数的调整规则和备选股票的预期，对股票投资组合及时进行调整。

（2）不定期调整

1) 当成份股发生配送股、增发、分红、临时调入及调出等情况而影响其在指数中权重的行为时，本基金将根据各成份股的权重变化进行相应调整；

2) 根据本基金的申购和赎回情况，对股票投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数；

3) 特殊情况下，基金管理人可以根据市场情况，综合考虑跟踪偏离度、跟踪误差最小化和持有人利益，采用合理方法寻求替代。以上特殊情况包括但不限于：①法律法规的限制；②标的指数成份股流动性严重不足，或因股票停牌等其他市场因素，使基金管理人无法依指数权重投资某成份股时；③成份股上市公司存在

ETF的比例不低于基金资产净值的90%；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，保持不低于基金资产净值5%的现金或者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。

四、投资策略

本基金为鹏华中证A500ETF的联接基金，主要通过投资于鹏华中证A500ETF实现对标的指数的紧密跟踪，力争将日均跟踪偏离度绝对值控制在0.35%以内，年化跟踪误差控制在4%以内。如因标的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和跟踪误差进一步扩大。

1、目标ETF投资策略

本基金投资目标ETF的方式如下：

（1）申购、赎回：按照目标ETF法律文件约定的方式申购目标ETF。

（2）二级市场方式：在二级市场进行目标ETF基金份额的交易。

当目标ETF申购、赎回或交易模式进行了变更或调整，本基金也将作相应的变更或调整，无须召开基金份额持有人大会。

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。

2、股票投资策略

本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，在条件允许的情况下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。因此对可投资于标的指数成份股、备选成份股的资金头寸，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股时，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，以降低跟踪偏离度和跟踪误差，优化投资组合的配置结构。

五、投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%；

（12）若本基金参与股指期货交易，应当遵

| | |
|---|---|
| <p>重大违规行为、面临重大的不利处罚或司法诉讼时；④有充分而合理的理由认为成份股市场 价格被操纵时；⑤其他原因导致无法有效复制 和跟踪标的指数时。</p> <p>五、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）本基金投资于股票资产及存托凭证的比例不低于基金资产的90%，投资于标的指数成份股及其备选成份股（均含存托凭证）的比例不低于非现金基金资产的80%；</p> <p>（12）若本基金参与股指期货交易，应当遵守下列要求：</p> <p>b. 本基金在任何交易日日终，持有的买入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；</p> <p>c. 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%；</p> <p>除上述第（2）、（7）、（9）、（10）、（14）项情形之外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。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比例不符合第（14）项规定的，基金管理人不得新增出借业务，但中国证监会规定的特殊情形除外。</p> <p>2、禁止行为</p> <p>为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：</p> <p>（4）买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；</p> <p>七、风险收益特征</p> <p>本基金属于股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。本基金为指数型基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。</p> | <p>守下列要求：</p> <p>b. 本基金在任何交易日日终，持有的买入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，有价证券指目标ETF、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；</p> <p>c. 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及目标ETF总市值的20%；</p> <p>除上述第（1）、（2）、（7）、（9）、（10）、（14）项情形之外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制、目标ETF暂停申购、赎回或二级市场交易停牌等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制、目标ETF暂停申购、赎回或二级市场交易停牌等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合第（1）项投资比例的，基金管理人应当在20个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。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比例不符合第（14）项规定的，基金管理人不得新增出借业务，但中国证监会规定的特殊情形除外。</p> <p>2、禁止行为</p> <p>为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：</p> <p>（4）买卖除目标ETF以外的其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；</p> <p>七、风险收益特征</p> <p>本基金为ETF联接基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、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。因此，本基金的业绩表现与标的指数的表现密切相关。</p> <p>八、标的指数及目标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，在履行适当程序后，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审议；若届时本</p> |
|---|---|

| | | |
|------------------|---|---|
| | | <p>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> <p>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；</p> <p>2、目标ETF终止上市；</p> <p>3、目标ETF基金合同终止；</p> <p>4、目标ETF与其他基金进行合并；</p> <p>5、目标ETF的基金管理人发生变更（但变更后的本基金与目标ETF的基金管理人相同的除外）；</p> <p>6、中国证监会规定的其他情形。</p> |
| 第十三部分 基金的财产 | <p>一、基金资产总值</p> <p>基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和。</p> | <p>一、基金资产总值</p> <p>基金资产总值是指基金拥有的目标ETF基金份额、各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和。</p> |
| 第十四部分 基金资产估值 | <p>二、估值对象</p> <p>基金所拥有的股票、存托凭证、债券、资产支持证券、股指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>四、估值方法</p> <p>七、暂停估值的情形</p> <p>十、特殊情形的处理</p> <p>1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第8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>二、估值对象</p> <p>基金所拥有的目标ETF基金份额、股票、存托凭证、债券、资产支持证券、股指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>四、估值方法</p> <p>1、目标ETF估值方法</p> <p>对持有的目标ETF基金，按估值日目标ETF基金份额净值估值。</p> <p>七、暂停估值的情形</p> <p>4、基金所投资的目标ETF发生暂停估值、暂停公告基金份额净值的情形；</p> <p>十、特殊情形的处理</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> |
| 第十五部分 基金费用与税收 | <p>一、基金费用的种类</p> <p>二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式</p> <p>1、基金管理人的管理费</p> <p>本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.15%年费率计提。管理费的计算方法如下： $H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$ 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</p> | <p>一、基金费用的种类</p> <p>10、基金投资目标ETF的相关费用（包括但不限于目标ETF的交易费用、申赎费用等）；</p> <p>二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式</p> <p>1、基金管理人的管理费</p> <p>本基金的管理费按前一日基金资产净值扣除前一日所持有目标ETF基金份额所对应基金资产净值后的余额（若为负数，则取0）的0.15%年费率计提。管理费的计算方法如下： $H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$ H为每日应计提的基金管理费</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0.05%年费率计提。托管费的计算方法如下： $H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$ 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</p> <p>上述“一、基金费用的种类”中第4-10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>三、不列入基金费用的项目</p> <p>3、《基金合同》生效前的相关费用；</p> <p>4、标的指数许可使用费。标的指数许可使用费由基金管理人承担，不得从基金财产中列支。</p> | <p>E为前一日的基金资产净值扣除前一日所持有目标ETF基金份额所对应基金资产净值后的余额（若为负数，则取0）</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扣除前一日所持有目标ETF基金份额所对应基金资产净值后的余额（若为负数，则取0）的0.05%年费率计提。托管费的计算方法如下： $H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$ 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基金份额所对应基金资产净值后的余额（若为负数，则取0）</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>三、不列入基金费用的项目</p> <p>3、《基金合同》生效前的相关费用根据《鹏华中证A500指数证券投资基金基金合同》执行；</p> |
| <p>第十八部分 基金的信息披露</p> | <p>五、公开披露的基金信息 公开披露的基金信息包括： （一）基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议、基金产品资料概要</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，说明基金认购、— 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>基金募集申请经中国证监会注册后，基金管理人应当在基金份额发售的三日前，将基金份额发售公告、基金招募说明书提示性公告、《基金合同》提示性公告登载在规定报刊上，将基金份额发售公告、基金招募说明书、基金产品资料概要、《基金合同》和托管协议登载在规定网站上，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规定网站上。</p> <p>（二）基金份额发售公告 基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编</p> | <p>五、公开披露的基金信息 公开披露的基金信息包括： （一）基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议、基金产品资料概要</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>基金转型后，基金管理人应将基金招募说明书、基金产品资料概要、《基金合同》和基金托管协议登载在规定网站上，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规定网站上。</p> |

| | | |
|-------------------------|---|--|
| | <p>制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于规定媒介上。</p> <p>（三）《基金合同》生效公告 基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日在规定媒介上登载《基金合同》生效公告。</p> <p>（七）临时报告</p> <p>8、基金募集期延长或提前结束募集；</p> | <p>（五）临时报告</p> <p>24、目标ETF变更；</p> <p>（十）投资目标ETF的信息披露</p> <p>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）等文件中披露所持目标ETF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）交易及持有目标ETF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）本基金持有的目标ETF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。</p> |
| 第十九部分基金合同的变更、终止与基金财产的清算 | <p>三、基金财产的清算</p> <p>5、基金财产清算的期限为6个月，但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的，清算期限相应顺延。</p> | <p>三、基金财产的清算</p> <p>5、基金财产清算的期限为6个月，但因本基金所持基金、证券的流动性受到限制而不能及时变现的，清算期限相应顺延。</p> |
| 第二十二部分基金合同的效力 | <p>1、《基金合同》经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签章并在募集结束后经基金管理人向中国证监会办理基金备案手续，并经中国证监会书面确认后生效。</p> | <p>1、《基金合同》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章。自2025年1月8日起，鹏华中证A500指数证券投资基金正式转型为本基金，《基金合同》生效，原《鹏华中证A500指数证券投资基金基金合同》自同一起失效。</p> |

| 托管协议 | | |
|------|---|---|
| 章节 | 原文条款 | 修改后条款 |
| | 内容 | 内容 |
| | <p>鉴于鹏华基金管理有限公司系一家依照中国法律合法成立并有效存续的有限责任公司，按照相关法律法规的规定具备担任基金管理人的资格和能力，拟募集发行鹏华中证A500指数证券投资基金； 鉴于鹏华基金管理有限公司拟担任鹏华中证</p> | <p>鉴于鹏华基金管理有限公司系一家依照中国法律合法成立并有效存续的有限责任公司，按照相关法律法规的规定具备担任基金管理人的资格和能力； 鉴于鹏华基金管理有限公司拟担任鹏华中证A500交易型开放式指数证券投资基金联接基</p> |

| | | |
|-------------------------------------|--|---|
| | <p>A500指数证券投资基金的基金管理人，中国建设银行股份有限公司拟担任鹏华中证A500指数证券投资基金的基金托管人；为明确鹏华中证A500指数证券投资基金的基金管理人和基金托管人之间的权利义务关系，特制订本托管协议；除非另有约定，《鹏华中证A500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》”)中定义的术语在用于本托管协议时应具有相同的含义；若有抵触应以《基金合同》为准，并依其条款解释。</p> | <p>金的基金管理人，中国建设银行股份有限公司拟担任鹏华中证A500交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金托管人；为明确鹏华中证A500交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金管理人和基金托管人之间的权利义务关系，特制订本托管协议；除非另有约定，《鹏华中证A500交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》(以下简称“基金合同”或“《基金合同》”)中定义的术语在用于本托管协议时应具有相同的含义；若有抵触应以《基金合同》为准，并依其条款解释。</p> |
| <p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p> | <p>(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。《基金合同》明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应按照基金托管人要求的格式，将拟投资的标的证券库中各投资品种的具体范围提供给基金托管人，基金管理人可以根据实际情况的变化，对各标的投资品种的具体范围予以更新和调整并及时通知基金托管人。基金托管人根据上述投资范围对基金实际投资是否符合《基金合同》关于证券选择标准的约定进行监督。</p> <p>本基金主要投资于标的指数成份股（含存托凭证）、备选成份股（含存托凭证）。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于依法发行或上市的其他股票（包括主板、创业板以及其他中国证监会允许基金投资的股票）、存托凭证、债券（含国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券、政府支持机构债及其他中国证监会允许基金投资的债券）、债券回购、资产支持证券、银行存款（包括协议存款、定期存款等）、同业存单、货币市场工具、股指期货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（但须符合中国证监会相关规定）。</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金投资于股票资产及存托凭证的比例不低于基金资产的90%，投资于标的指数成份股及其备选成份股（均含存托凭证）的比例不低于非现金基金资产的80%；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，保持不低于基金资产净值5%的现金或者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。</p> <p>(二) 基金托管人根据有关法律法规的规定及</p> | <p>(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。《基金合同》明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应按照基金托管人要求的格式，将拟投资的标的证券库中各投资品种的具体范围提供给基金托管人，基金管理人可以根据实际情况的变化，对各标的投资品种的具体范围予以更新和调整并及时通知基金托管人。基金托管人根据上述投资范围对基金实际投资是否符合《基金合同》关于证券选择标准的约定进行监督。</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，本基金可少量投资于依法发行或上市的其他股票（包括主板、创业板以及其他中国证监会允许基金投资的股票）、存托凭证、债券（含国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券、政府支持机构债及其他中国证监会允许基金投资的债券）、债券回购、资产支持证券、银行存款（包括协议存款、定期存款等）、同业存单、货币市场工具、股指期货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（但须符合中国证监会相关规定）。</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%；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，保持不低于基金资产净值5%的现金或者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。</p> <p>(二) 基金托管人根据有关法律法规的规定</p> |

| | | |
|------------------|---|---|
| | <p>《基金合同》的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督：</p> <p>(1) 本基金投资于股票资产及存托凭证的比例不低于基金资产的90%，投资于标的指数成份股及其备选成份股（均含存托凭证）的比例不低于非现金基金资产的80%；</p> <p>(11) 若本基金参与股指期货交易，应当遵守下列要求：</p> <p>b. 本基金在任何交易日日终，持有的买入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；</p> <p>c. 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%；</p> <p>除上述第（2）、（7）、（9）、（13）项情形之外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。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比例不符合第（13）项规定的，基金管理人不得新增出借业务，但中国证监会规定的特殊情形除外。</p> | <p>及《基金合同》的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督：</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>(11) 若本基金参与股指期货交易，应当遵守下列要求：</p> <p>b. 本基金在任何交易日日终，持有的买入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，有价证券指目标ETF、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；</p> <p>c. 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及目标ETF总市值的20%；</p> <p>除上述第（1）、（2）、（7）、（9）、（13）项情形之外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制、目标ETF暂停申购、赎回或二级市场交易停牌等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制、目标ETF暂停申购、赎回或二级市场交易停牌等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合第（1）项投资比例的，基金管理人应当在20个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。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比例不符合第（13）项规定的，基金管理人不得新增出借业务，但中国证监会规定的特殊情形除外。</p> |
| <p>五、基金财产的保管</p> | <p>(二) 基金募集期间及募集资金的验资</p> <p>1. 基金募集期间募集的资金应存于基金管理人在基金托管人的营业机构开立的“基金募集专户”。该账户由基金管理人开立并管理。</p> <p>2. 基金募集期满或基金停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关规定后，基金管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人开立的基金托管资金账户，同时在规定时间</p> | |

| | | |
|------------------------|--|---|
| | <p>内，聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所进行验资，出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的2名或2名以上中国注册会计师签字方为有效。</p> <p>3. 若基金募集期限届满，未能达到《基金合同》生效的条件，由基金管理人按规定办理退款等事宜，基金托管人应予以必要的协助与配合。</p> | |
| <p>八、基金资产净值计算和会计核算</p> | <p>(二) 基金资产估值方法和特殊情形的处理</p> <p>1. 估值对象 基金所拥有的股票、存托凭证、债券、资产支持证券、股指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>2. 估值方法 本基金所持有的投资品种，按如下原则进行估值：</p> <p>3. 特殊情形的处理</p> <p>(1) 基金管理人或基金托管人按估值方法的第(8)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>(四) 暂停估值与公告基金份额净值的情形</p> | <p>(二) 基金资产估值方法和特殊情形的处理</p> <p>1. 估值对象 基金所拥有的目标ETF基金份额、股票、存托凭证、债券、资产支持证券、股指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>2. 估值方法 本基金所持有的投资品种，按如下原则进行估值：</p> <p>(1) 目标ETF估值方法 对持有的目标ETF基金，按估值日目标ETF基金份额净值估值。</p> <p>3. 特殊情形的处理</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>(四) 暂停估值与公告基金份额净值的情形</p> <p>4、基金所投资的目标ETF发生暂停估值、暂停公告基金份额净值的情形；</p> |
| <p>十、基金信息披露</p> | <p>(二) 信息披露的内容</p> <p>基金的信息披露内容主要包括基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议、基金产品资料概要、基金份额发售公告、《基金合同》生效公告、基金净值信息、基金份额申购、赎回价格、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）、临时报告、澄清公告、基金份额持有人大会决议、清算报告、实施侧袋机制期间的信息披露和中国证监会规定的其他信息（基金投资股指期货、基金参与融资及转融通证券出借业务、基金投资资产支持证券的信息披露）。基金年度报告需经符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计后，方可披露。</p> | <p>(二) 信息披露的内容</p> <p>基金的信息披露内容主要包括基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议、基金产品资料概要、基金净值信息、基金份额申购、赎回价格、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）、临时报告、澄清公告、基金份额持有人大会决议、清算报告、实施侧袋机制期间的信息披露、投资目标ETF的信息披露和中国证监会规定的其他信息（基金投资股指期货、基金参与融资及转融通证券出借业务、基金投资资产支持证券的信息披露）。基金年度报告需经符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计后，方可披露。</p> |
| <p>十一、基金费用</p> | <p>(一) 基金管理费的计提比例和计提方法</p> <p>本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.15%年费率计提。管理费的计算方法如下： $H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$ 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</p> | <p>(一) 基金管理费的计提比例和计提方法</p> <p>本基金的管理费按前一日基金资产净值扣除前一日所持有目标ETF基金份额所对应基金资产净值后的余额（若为负数，则取0）的0.15%年费率计提。管理费的计算方法如下： $H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$ H为每日应计提的基金管理费</p> |

| | | |
|---------|--|--|
| | <p>(二) 基金托管费的计提比例和计提方法 本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.05%年费率计提。托管费的计算方法如下： $H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$ 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</p> <p>(四) 基金相关账户的开户费用及维护费用、证券/期货等交易、结算费用、基金的银行汇划费用、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用、基金份额持有人大会费用、《基金合同》生效后与基金有关的会计师费、律师费、仲裁费、诉讼费、公证费和认证费等根据国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的费用，列入当期基金费用。</p> <p>(五) 不列入基金费用的项目 《基金合同》生效前的相关费用不得从基金财产中列支；基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，处理与基金运作无关的事项发生的费用，标的指数许可使用费以及其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目等不列入基金费用。</p> | <p>E为前一日的基金资产净值扣除前一日所持有目标ETF基金份额所对应基金资产净值后的余额（若为负数，则取0）</p> <p>(二) 基金托管费的计提比例和计提方法 本基金的托管费按前一日基金资产净值扣除前一日所持有目标ETF基金份额所对应基金资产净值后的余额（若为负数，则取0）的0.05%年费率计提。托管费的计算方法如下： $H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$ 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基金份额所对应基金资产净值后的余额（若为负数，则取0）</p> <p>(四) 基金相关账户的开户费用及维护费用、证券/期货等交易、结算费用、基金投资目标ETF的相关费用（包括但不限于目标ETF的交易费用、申赎费用等）、基金的银行汇划费用、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用、基金份额持有人大会费用、《基金合同》生效后与基金有关的会计师费、律师费、仲裁费、诉讼费、公证费和认证费等根据国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的费用，列入当期基金费用。</p> <p>(五) 不列入基金费用的项目 《基金合同》生效前的相关费用根据《鹏华中证A500指数证券投资基金基金合同》执行，不得从基金财产中列支；基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，处理与基金运作无关的事项发生的费用，以及其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目等不列入基金费用。</p> |
| 十五、禁止行为 | <p>(九) 基金财产用于下列投资或者活动：1. 承销证券；2. 违反规定向他人贷款或者提供担保；3. 从事承担无限责任的投资；4. 买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；5. 向其基金管理人、基金托管人出资；6. 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；7. 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。法律法规或监管部门取消或调整上述禁止性规定，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按调整后的规定执行。</p> | <p>(九) 基金财产用于下列投资或者活动：1. 承销证券；2. 违反规定向他人贷款或者提供担保；3. 从事承担无限责任的投资；4. 买卖除目标ETF以外的其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；5. 向其基金管理人、基金托管人出资；6. 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；7. 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。法律法规或监管部门取消或调整上述禁止性规定，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按调整后的规定执行。</p> |
| 十六、托管协议 | <p>(三) 基金财产的清算 5. 基金财产清算的期限为6个月，但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现</p> | <p>(三) 基金财产的清算 5. 基金财产清算的期限为6个月，但因本基金所持基金、证券的流动性受到限制而不能及</p> |

| | | |
|-----------------------|---|---|
| <p>的变更、终止与基金财产的清算</p> | <p>的，清算期限相应顺延。</p> | <p>时变现的，清算期限相应顺延。</p> |
| <p>十九、托管协议的效力</p> | <p>（一）基金管理人在向中国证监会申请发售基金份额时提交的托管协议草案，应经托管协议当事人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字（或盖章），协议当事人双方根据中国证监会的意见修改托管协议草案。托管协议以中国证监会注册的文本为正式文本。</p> | <p>（一）基金托管协议当事人双方根据中国证监会的意见修改托管协议草案。托管协议以中国证监会注册的文本为正式文本。</p> |