鹏华基金管理有限公司关于以通讯方式二次召开鹏华中证传媒指数型证券投资基金（LOF）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》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《鹏华中证传媒指数型证券投资基金(LOF)基金合同》(以下简称“《基金合同》”)的有关规定,鹏华中证传媒指数型证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”)的基金管理人鹏华基金管理有限公司(以下简称“本基金管理人”)已以通讯方式组织召开了投票期间为2024年4月26日至2024年5月27日17:00止的基金份额持有人大会(以下简称“第一次基金份额持有人大会”),审议《关于鹏华中证传媒指数型证券投资基金(LOF)终止上市并变更为鹏华中证传媒交易型开放式指数证券投资基金联接基金的议案》。由于本人直接出具有效表决意见或授权他人代表出具有效表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额少于权益登记日本基金基金份额总数的二分之一,未达到法律法规规定和《基金合同》约定的基金份额持有人大会召开条件,故第一次基金份额持有人大会未能成功召开。详情请查阅本基金管理人于2024年5月30日发布的《鹏华基金管理有限公司关于鹏华中证传媒指数型证券投资基金(LOF)基金份额持有人大会会议情况的公告》。

根据《基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《基金合同》的有关约定,本基金管理人与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致,决定以通讯方式二次召开本基金的基金份额持有人大会,审议同一议案,即《关于鹏华中证传媒指数型证券投资基金(LOF)终止上市并变更为鹏华中证传媒交易型开放式指数证券投资基金联接基金的议案》。会议的具体安排如下:

1、会议召开方式:通讯方式开会。

2、会议投票表决起止时间:自2024年11月28日起,至2025年1月3日17:00止(投票表决时间以本公告列明的通讯表决票的寄送地点收到表决票的时间为准)。

3、会议通讯表决票的寄达地点:

基金管理人:鹏华基金管理有限公司
地址:深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心9层
邮政编码:518048
联系人:朱海威
联系电话:0755-82825931

请在信封表面注明:“鹏华中证传媒指数型证券投资基金(LOF)基金份额持有人大会(二次召开)表决专用”。

4、会议咨询电话:400-6788-533

二、会议审议事项

《关于鹏华中证传媒指数型证券投资基金(LOF)终止上市并变更为鹏华中证传媒交易型开放式指数证券投资基金联接基金的议案》(见附件一)。

上述议案的内容说明详见《关于鹏华中证传媒指数型证券投资基金(LOF)终止上市并变更为鹏华中证传媒交易型开放式指数证券投资基金联接基金的议案的说明》(见附件二)。

三、基金份额持有人大会的权益登记日

本次大会的权益登记日为2024年11月27日,即在2024年11月27日下午交易时间结束后,在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加本次基金份额持有人大会并投票表决。

四、表决票的填写和寄交方式

1、本次会议表决票见附件三。基金份额持有人可从相关报纸上剪裁、复印表决票或登录本基金管理人网站(www.phfund.com.cn)、中国证监会基金电子披露网站(http://eid.csrc.gov.cn/fund)下载并打印表决票。

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,并提供本人身份证件正反面复印件;

(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经授权或认可的业务章(以下合称“公章”),并提供加盖公章的企业法人营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等);合格境外投资者自行投票的,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件正反面复印件或者护照或其他身份证明文件的复印件,该合格境外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投资者签署表决票的其他证明文件,以及该合格境外投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件和取得合格境外投资者资格的证明文件的复印件;

(3)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,并提供该个人投资者身份证件正反面复印件,以及填妥的授权委托书原件(参照附件四)。如代理人为个人,还需提供代理人的身份证件正反面复印件;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复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等);

(4)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,并提供该机构投资者的加盖公章的企业法人营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、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。如代理人为个人,还需提供代理人的身份证件正反面复印件;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复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等)。合格境外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,以及取得合格境外投资者资格的证明文件的复印件,以及填妥的授权委托书原件。如代理人为个人,还需提供代理人的身份证件正反面复印件;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复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等);

(5)以上各项中的公章、批文、开户证明及登记证书,以基金管理人的认可为准。

(6)根据第一次持有人大会的相关公告,除非授权文件另有载明,第一次召集的基金份额持有人大会授权期间基金份额持有人作出的各类授权在本次大会时依然有效,但如果基金份额持有人重新作出授权的,则以最新授权为准。

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在2024年11月28日起,至2025年1月3日17:00止的期间内通过专人送交、快递或邮寄挂号信的方式送达至本公告列明的通讯表决票的寄送地点,并请在信封表面注明:“鹏华中证传媒指数型证券投资基金(LOF)基金份额持有人大会(二次召开)表决专用”。

送达时间以本公告列明的通讯表决票的寄送地点收到表决票的时间为准,即:专人送达的以实际递交时间为准;快递送达的,以基金管理人签收时间为准;以邮寄挂号信方式送达的,以挂号信回执上注明的收件日期为送达日期。

五、计票

1、本次通讯会议的计票方式为:由基金管理人授权的两名监督员在基金托管人(中国建设银行股份有限公司)授权代表的监督下于本次通讯会议的表决截止日期(即2025年1月3日)后第2个工作日(即2025年1月7日)进行计票,并由公证机关对其计票过程予以公证。

2、基金份额持有人所持每份基金份额享有一票表决权。

3、表决票效力的认定如下:

(1)表决票填写完整清晰,所提供文件符合本会议通知规定,且在规定时间之内送达本公告列明的通讯表决票的寄送地点的,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)如表决票上的表决意见未填、多填、字迹模糊不清、无法辨认或意愿无法判断或相互矛盾,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。

(3)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内送达本公告列明的通讯表决票的寄送地点的,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。

(4)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,以最后送达日所填写的有效的表决票为准,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送达时间确定原则见“四、表决票的填写和寄交方式”中相关说明。

六、决议生效条件

1、有效表决票所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的三分之一以上(含三分之一)时,表明该有效表决票所代表的基金份额持有人参加了此次通讯会议,会议有效召开;在此基础上,《关于鹏华中证传媒指数型证券投资基金(LOF)终止上市并变更为鹏华中证传媒交易型开放式指数证券投资基金联接基金的议案》应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上(含二分之一)通过方为有效。

2、本次基金份额持有人大会决议通过的事项,本基金管理人自通过之日起五日内报中国证监会备案,基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效。法律法规另有规定的,从其规定。

七、本次大会相关机构

1、召集人:鹏华基金管理有限公司
联系人:朱海威
联系电话:0755-82825931
网址:www.phfund.com.cn
2、基金托管人:中国建设银行股份有限公司
3、公证机构:北京市中信公证处
联系人:甄真
联系电话:010-81139007
4、见证律师事务所:上海市通力律师事务所

八、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,提前寄出表决票。

2、本次基金份额持有人大会有关公告可通过基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站(http://eid.csrc.gov.cn/fund)查阅,投资者如有任何疑问,可致电基金管理人客户服务电话400-6788-533(免长途话费)咨询。

3、为保护基金份额持有人利益,本基金管理人将根据深圳证券交易所的业务规则,向深圳证券交易所申请本基金A类基金份额(基金代码:160629)在此期间的停复牌安排。本基金A类基金份额首次停牌时间为本公告发布之日(2024年11月27日)上午开市起至当日上午10:30止,10:30起复牌。本基金A类基金份额第二次停牌时间为基金份额持有人大会计票日(2025年1月7日)上午开市起至基金份额持有人大会决议生效公告日上午10:30止,10:30起复牌。敬请基金份额持有人关注本基金A类基金份额停牌期间的流动性风险。

如议案获得通过,基金管理人将根据深圳证券交易所的相关业务规定申请办理本基金A类基金份额的终止上市、基金变更等相关事项,具体安排详见基金管理人届时发布的相关公告。并且基金管理人将根据议案及《关于鹏华中证传媒指数型证券投资基金(LOF)终止上市并变更为鹏华中证传媒交易型开放式指数证券投资基金联接基金的议案的说明》对《鹏华中证传媒指数型证券投资基金(LOF)基金合同》进行修改,并按规定披露变更后的《鹏华中证传媒交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》、《鹏华中证传媒交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》、《鹏华中证传媒交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》及基金产品资料概要等文件。

如议案未获通过,具体安排详见基金管理人届时发布的相关公告。

4、本公告的有关内容由鹏华基金管理有限公司负责解释。

鹏华基金管理有限公司
2024年11月27日

附件一:《关于鹏华中证传媒指数型证券投资基金(LOF)终止上市并变更为鹏华中证传媒交易型开放式指数证券投资基金联接基金的议案》

附件二:《关于鹏华中证传媒指数型证券投资基金(LOF)终止上市并变更为鹏华中证传媒交易型开放式指数证券投资基金联接基金的议案的说明》

附件三:《鹏华中证传媒指数型证券投资基金(LOF)基金份额持有人大会(二次召开)通讯表决票》

附件四:《授权委托书》

附件五:《鹏华中证传媒交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同(草案)》

附件一:《关于鹏华中证传媒指数型证券投资基金(LOF)终止上市并变更为鹏华中证传媒交易型开放式指数证券投资基金联接基金的议案》

鹏华中证传媒指数型证券投资基金(LOF)基金份额持有人:

为了适应市场形势的发展,更好地满足投资者的投资需求,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《鹏华中证传媒指数型证券投资基金(LOF)基金合同》(以下简称“《基金合同》”)的有关规定,鹏华中证传媒指数型证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”)的基金管理人鹏华基金管理有限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,提议对本基金实施变更,内容包括将基金类别变更为ETF联接基金,并相应将基金名称变更为“鹏华中证传媒交易型开放式指数证券投资基金联接基金”;终止A类基金份额上市,保留A类基金份额场内申购、赎回业务;调整基金费用的种类、基金费用计提方法和计提标准;降低A类基金份额的赎回费率等,并根据上述调整需要、法律法规要求和基金实际运作需求修改基金合同其他相关条款。具体说明见附件二《关于鹏华中证传媒指数型证券投资基金(LOF)终止上市并变更为鹏华中证传媒交易型开放式指数证券投资基金联接基金的议案的说明》。

为实施本基金上述变更方案,提议授权基金管理人办理本基金变更及向深圳证券交易所申请办理终止A类基金份额上市的具体事宜,包括但不限于根据市场情况确定变更的具体时间和方式,根据现时有效的法律法规的要求和《关于鹏华中证传媒指数型证券投资基金(LOF)终止上市并变更为鹏华中证传媒交易型开放式指数证券投资基金联接基金的议案的说明》相关内容对本基金实施变更。

以上议案,请予审议。

基金管理人:鹏华基金管理有限公司

附件二:《关于鹏华中证传媒指数型证券投资基金(LOF)终止上市并变更为鹏华中证传媒交易型开放式指数证券投资基金联接基金的议案的说明》

一、声明

1、为了适应市场形势的发展,更好地满足投资者的投资需求,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《鹏华中证传媒指数型证券投资基金(LOF)基金合同》(以下简称“《基金合同》”或“基金合同”)的有关规定,鹏华中证传媒指数型证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”)的基金管理人鹏华基金管理有限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,决定二次召开基金份额持有人大会,审议《关于鹏华中证传媒指数型证券投资基金(LOF)终止上市并变更为鹏华中证传媒交易型开放式指数证券投资基金联接基金的议案》。

2、本次基金份额持有人大会需要出具书面意见的基金份额持有人或其代理人所代表的基金份额不少于权益登记日基金总份额的三分之一(含三分之一)方可召开,且《关于鹏华中证传媒指数型证券投资基金(LOF)终止上市并变更为鹏华中证传媒交易型开放式指数证券投资基金联接基金的议案》应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上(含二分之一)通过方为有效,存在未能达到开会条件或无法获得相关持有人大会表决通过的可能。

3、基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。中国证监会对持有人大会表决通过的事项的备案、所作的任何决定或意见,均不表明其对本基金的价值或者投资人的收益做出实质性判断或保证。

二、调整方案要点

(一)变更基金名称和类别

1、基金名称由“鹏华中证传媒指数型证券投资基金(LOF)”变更为“鹏华中证传媒交易型开放式指数证券投资基金联接基金”。

2、基金类别由“股票型证券投资基金”变更为“ETF联接基金”。

(二)终止A类基金份额上市,保留A类基金份额场内申购、赎回业务

鹏华中证传媒指数型证券投资基金(LOF)的A类基金份额已自2021年1月18日起在深圳证券交易所上市。本基金变更后,本基金A类基金份额将终止在深圳证券交易所上市交易。基金合同中将删除“基金份额的上市与交易”章节,并在释义、基金的基本情况、基金份额的申购与赎回、基金份额持有人大会、基金费用与税收、基金的信息披露等章节删除与基金份额上市交易有关的表述。

鹏华中证传媒指数型证券投资基金(LOF)的A类基金份额可通过场内或场外两种方式办理申购与赎回,C类基金份额仅可通过场外方式办理申购与赎回。变更后,鹏华中证传媒交易型开放式指数证券投资基金联接基金A类基金份额仍可通过场内或场外两种方式办理申购与赎回,C类基金份额仅可通过场外方式办理申购与赎回。

(三)调整基金费用的种类、基金费用计提方法和计提标准

1、基金管理人的管理费:年费率由1.00%降为0.50%,且投资于目标ETF的部分不收取管理费;

2、基金托管人的托管费:年费率由0.20%降为0.10%,且投资于目标ETF的部分不收取托管费;

3、C类基金份额的销售服务费:年费率由0.30%降为0.20%;

4、标的指数许可使用费:在鹏华中证传媒指数型证券投资基金(LOF)变更为鹏华中证传媒交易型开放式指数证券投资基金联接基金后,不再从基金财产中计提标的指数许可使用费。

(四)降低A类基金份额的赎回费率

将A类基金份额的场外赎回费率调整为:

持有期限(Y)	赎回费率
Y<7日	1.50%
7日≤Y<30日	0.50%
Y≥30日	0

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担,在基金份额持有人赎回基金份额时收取,赎回费全额计入基金财产。A类基金份额的场内赎回费率参照场外赎回费率执行。

(五)变更基金的投资目标、投资范围、投资策略、投资限制和风险收益特征等

1、投资目标:补充“本基金主要投资于目标ETF”。

2、投资范围:补充目标ETF、存托凭证、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、资产支持证券、融资和转融通证券出借业务等,并删除权证。

3、投资策略:根据投资范围的调整补充目标ETF投资策略、存托凭证投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略、资产支持证券投资策略,删除权证相关表述,并根据变更后的特点调整相关投资策略。

4、投资限制和风险收益特征:根据上述调整,相应进行修改。

5、补充标的指数及目标ETF发生相关变更情形的处理方式。

(六)调整估值对象、估值方法条款

1、在估值对象中补充目标ETF基金份额、存托凭证、资产支持证券、股指期货合约,并删除权证。

2、在估值方法中补充目标ETF估值方法、存托凭证估值方法、融资及转融通证券出借业务估值方法,删除权证的估值方法,并调整固定收益品种相关估值方法条款等。

(七)在基金的基本情况、基金份额的申购与赎回、基金合同当事人及权利义务、基金份额持有人大会、基金资产估值、基金的信息披露等章节补充ETF联接基金相关内容

1、基金的基本情况章节:补充本基金与目标ETF的联系与区别。

2、基金份额的申购与赎回章节:在拒绝或暂停申购的情形、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形中,补充目标ETF暂停估值、暂停申赎、暂停上市或目标ETF停牌等。

3、基金合同当事人及权利义务章节:在基金份额持有人的权利中补充出席或者委派代表出席目标ETF的基金份额持有人大会,对目标ETF的基金份额持有人大会审议事项行使表决权。

4、基金份额持有人大会章节:补充本基金基金份额持有人参加目标ETF基金份额持有人大会并表决的相关条款,在持有人大会的召开事由中相应补充目标ETF相关条款。

5、基金资产估值:在暂停估值的情形中补充基金所投资的目标ETF发生暂停估值、暂停公告基金份额净值的情形。

6、基金的信息披露章节:补充投资目标ETF、投资资产支持证券、参与融资及转融通证券出借业务的相关信息披露。

(八)补充侧袋机制

根据《公开募集证券投资基金侧袋机制指引(试行)》相关要求补充了侧袋机制相关内容。

(九)其他必要修改

根据上述主要内容作出的必要修改,根据法律法规及中国证监会要求和基金实际运作需求对《基金合同》进行的其他修改,详见《鹏华中证传媒交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同(草案)》。

三、终止A类基金份额上市的安排及《鹏华中证传媒交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》的生效

如《关于鹏华中证传媒指数型证券投资基金(LOF)终止上市并变更为鹏华中证传媒交易型开放式指数证券投资基金联接基金的议案》(以下简称“议案”)获得通过,基金管理人将根据深圳证券交易所的相关业务规则申请办理本基金A类基金份额的终止上市、基金变更等相关事项。基金管理人提请基金份额持有人大会授权基金管理人落实上述事项,并授权基金管理人可根据业务规则和实际情况做相应调整。具体业务办理和时间安排详见基金管理人届时发布的相关公告。

修订后的《鹏华中证传媒交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》自基金管理人公告的生效之日起生效,原《鹏华中证传媒指数型证券投资基金(LOF)基金合同》自同日起失效。修订后的《鹏华中证传媒交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》将在基金管理人网站(www.phfund.com.cn)、中国证监会基金电子披露网站(http://eid.csrc.gov.cn/fund)进行披露,提请投资者关注。

四、本基金变更及A类基金份额终止上市的主要风险及预备措施

在提议本基金变更及A类基金份额终止上市并设计具体方案之前,基金管理人与基金份额持有人进行沟通,认真听取相关意见,拟定议案前综合考虑基金份额持有人的要求。议案公告后,基金管理人还将再次征询基金份额持有人的意见。如有必要,基金管理人将根据基金份额持有人意见,对本基金变更及A类基金份额终止上市的方案进行适当的修订,并重新公告。

附件三:鹏华中证传媒指数型证券投资基金(LOF)基金份额持有人大会(二次召开)通讯表决票

基金份额持有人姓名/名称:

证件号码(身份证件号/营业执照注册号):

开放式基金账户号/证券账户号:

审议事项	同意	反对	弃权
关于鹏华中证传媒指数型证券投资基金(LOF)终止上市并变更为鹏华中证传媒交易型开放式指数证券投资基金联接基金的议案			

基金份额持有人/受托人(代理人)(签字或盖章)

日期:　　年　月　日

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“√”,同一议案基金份额持有人只能选择一种表决意见。以上表决意见是基金份额持有人或其受托人(代理人)就基金份额持有人在该开放式基金账户/证券账户下持有的本基金全部份额做出的表决意见。如未填写,则视为对基金份额持有人全部账户下持有的本基金全部份额做出表决意见。

2、未填、多填、字迹模糊不清、无法辨认或意愿无法判断或相互矛盾,但其他各项符合会议通知规定的表决票均视为投票人放弃表决权利,其所持全部基金份额的表决结果均计为“弃权”。

3、本表决票可从基金管理人网站(www.phfund.com.cn)、中国证监会基金电子披露网站(http://eid.csrc.gov.cn/fund)下载、从报纸上剪裁、复印或按此格式打印。

附件四:授权委托书

兹全权委托　　先生/女士或　　　　机构代表本人(或本机构)参加以通讯方式二次召开的鹏华中证传媒指数型证券投资基金(LOF)基金份额持有人大会,并代为全权行使议案的表决权。表决意见以受托人的表决意见为准。本授权不得转授权。

委托人(签字/盖章):
委托人身份证件号或营业执照注册号:
开放式基金账户号/证券账户号:
受托人(代理人)(签字/盖章):
受托人(代理人)身份证件号或营业执照注册号:

委托日期:　　年　月　日

附注:

1、以上授权是基金份额持有人就其在该开放式基金账户/证券账户下持有的本基金全部份额向受托人所做授权。如未填写,则视为对基金份额持有人全部账户下持有的本基金全部份额做出表决意见。

2、此授权委托书从基金管理人网站(www.phfund.com.cn)、中国证监会基金电子披露网站(http://eid.csrc.gov.cn/fund)下载、剪报、复印或按以上格式自制在填写完整并签字盖章后均为有效。

附件五:《鹏华中证传媒交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同(草案)》

附件五:《鹏华中证传媒交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同(草案)》

第一部分　前言

一、订立本基金合同的目的、依据和原则

1、订立本基金合同的目的是保护投资人合法权益,明确基金合同当事人的权利义务,规范基金运作。

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》(以下简称“《指数基金指引》”)和其他有关法律法规。

3、订立本基金合同的原则是平等自愿、诚实信用、充分保护投资人合法权益。

二、基金合同是规定基金合同当事人之间权利义务关系的基本法律文件,其他与基金相关的涉及基金合同当事人之间权利义务关系的任何文件或表述,如与基金合同有冲突,均以基金合同为准。基金合同当事人按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。

基金合同的当事人包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人。基金投资人自依本基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受。

三、鹏华中证传媒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”)由鹏华中证传媒指数型证券投资基金(LOF)转型而来,鹏华中证传媒指数型证券投资基金(LOF)由鹏华中证传媒指数分级证券投资基金终止分级运作变更而来,鹏华中证传媒指数分级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。

中国证监会对鹏华中证传媒指数分级证券投资基金终止分级运作并变更为鹏华中证传媒指数型证券投资基金(LOF)的备案,以及鹏华中证传媒指数型证券投资基金(LOF)变更为本基金的注册,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。投资者应当认真阅读基金招募说明书、基金合同、基金产品资料概要等信息披露文件,自主判断基金的投资价值,自主做出投资决策,自行承担投资风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证投资于本基金一定盈利,也不保证最低收益。

本基金为指数基金,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、成份股停牌等潜在风险,详见本基金招募说明书。

四、基金管理人、基金托管人在本基金合同之外披露涉及本基金的信息,其内容涉及界定基金合同当事人之间权利义务关系的,如与基金合同有冲突,以基金合同为准。

五、本基金按照中国法律法规成立并运作,若基金合同的内容与届时有效的法律法规的强制性规定不一致,应当以届时有效的法律法规的规定为准。

六、本基金的投资范围包括存托凭证,除与其他仅投资于股票的基金所面临的共同风险外,若本基金投资存托凭证的,还将面临存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险,以及与存托凭证发行机制相关的风险。

第二部分　释义

在本基金合同中,除非文意另有所指,下列词语或简称具有如下含义:

1、基金或本基金:指鹏华中证传媒交易型开放式指数证券投资基金联接基金,由鹏华中证传媒指数型证券投资基金(LOF)转型而来

2、基金管理人:指鹏华基金管理有限公司

3、基金托管人:指中国建设银行股份有限公司

4、基金合同或本基金合同:指《鹏华中证传媒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

5、托管协议:指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《鹏华中证传媒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

6、招募说明书:指《鹏华中证传媒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

7、法律法规:指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等

8、《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〈中华人民共和国港口法〉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

9、《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

10、《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

11、《运作办法》:指中国证监会2014年7月7日颁布、同年8月8日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

12、《流动性风险管理规定》:指中国证监会2017年8月31日颁布、同年10月1日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订

13、《指数基金指引》:指中国证监会2021年1月18日颁布、同年2月1日实施的《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》及颁布机关对其不时做出的修订

14、中国证监会:指中国证券监督管理委员会

15、银行业监督管理机构:指中国人民银行和/或国家金融监督管理总局

16、基金合同当事人:指受基金合同约束,根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体,包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人

17、个人投资者:指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

18、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

19、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(包括其不时修订),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

20、投资人、投资者: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

21、基金份额持有人:指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

22、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

23、销售机构:指鹏华基金管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件,取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务协议,办理基金销售业务的机构,以及可通过深圳证券交易所办理基金销售业务的会员单位。其中,可通过深圳证券交易所办理本基金销售业务的机构必须是具有基金销售业务资格、并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的、可通过深圳证券交易所交易系统办理本基金销售业务的深圳证券交易所会员单位

24、场外:指通过深圳证券交易所交易系统外的销售机构利用其自身柜台或其他交易系统办理本基金基金份额的申购和赎回等业务的场所。通过该等场所办理基金份额的申购和赎回也称为场外申购和场外赎回

25、场内:指通过具有相应业务资格的深圳证券交易所会员单位利用深圳证券交易所交易系统办理本基金基金份额的申购、赎回的场所。通过该等场所办理基金份额的申购、赎回也称为场内申购、场内赎回

26、登记业务:指基金登记、存管、过户、清算和结算业务,具体内容包括投资人开放式基金账户和/或深圳证券账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等

27、登记机构:指办理登记业务的机构。基金的登记机构为鹏华基金管理有限公司或接受鹏华基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构,本基金的登记机构为中国证券登记结算有限责任公司

28、登记结算系统:指中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统,登记在该系统的基金份额也称为场外份额

29、证券登记系统:指中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记系统,登记在该系统的基金份额也称为场内份额

30、开放式基金账户:指投资人通过场外销售机构在中国证券登记结算有限责任公司注册的开放式基金账户,用于记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况

31、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申购、赎回、转换及转托管等业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户

32、深圳证券账户:指在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开设的深圳证券交易所人民币普通股票账户(即A股账户)或证券投资基金账户

33、标的指数:指中证传媒指数

34、基金合同生效日:指《鹏华中证传媒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,《鹏华中证传媒指数型证券投资基金(LOF)基金合同》自同一日失效

35、基金合同终止日:指基金合同规定的基金合同终止事由出现后,基金财产清算完毕,清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期

36、存续期:指基金合同生效至终止之间的不定期期限

37、工作日:指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

38、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

39、T+n日:指自T日起第n个工作日(不包含T日)

40、开放日:指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

41、开放时间:指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

42、申购:指基金合同生效后,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

43、赎回:指基金合同生效后,基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为

44、巨额赎回:指本基金单个开放日,基金净赎回申请(赎回申请总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过上一开放日基金总份额的10%

45、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

46、转托管:指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的操作,包括系统内转托管和跨系统转托管

47、系统内转托管:指投资者将持有的基金份额在登记结算系统内不同销售机构(网点)之间或证券登记系统内不同会员单位(交易单元)之间进行转托管的行为

48、跨系统转托管:指投资者将持有的基金份额在登记结算系统和证券登记系统之间进行转托管的行为

49、定期定额投资计划:指投资人通过有关销售机构提出申请,约定每期申购日、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

50、元:指人民币元

51、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、出借期限在10个交易日以上的出借证券、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

52、摆动定价机制:指当开放式基金遭遇大额申购赎回时,通过调整基金份额净值的方式,将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者,从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响,确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待

53、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

54、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

55、基金资产净值:指基金资产总值减去基金负债后的价值

56、基金份额净值:指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

57、基金资产估值:指计算评估基金资产和负债的价值,以确定基金资产净值和基金份额净值的过程

58、销售服务费:指本基金用于持续销售和服务基金份额持有人的费用,该笔费用从C类基金份额基金资产中计提,属于基金的营运费用

59、基金份额分类:本基金根据申购费、赎回费及销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人申购时收取申购费用,并不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;在投资人申购时不收取申购费用,而从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,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。A类基金份额通过场外和场内两种方式申购和赎回,C类基金份额通过场外方式申购和赎回

60、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

61、基金产品资料概要:指《鹏华中证传媒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

62、交易型开放式指数证券投资基金:指《深圳证券交易所证券投资基金交易和申购赎回实施细则》定义的“交易型开放式基金”,简称“ETF”

63、目标ETF:指鹏华中证传媒交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“鹏华中证传媒ETF”)

64、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最小化,采用开放式运作方式的基金,简称“联接基金”

65、转融通证券出借: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

66、侧袋机制:指将基金投资组合中的特定资产从原有账户分离至一个专门账户进行处置清算,目的在于有效隔离并化解风险,确保投资者得到公平对待,属于流动性风险管理工具。侧袋机制实施期间,原有账户称为主袋账户,专门账户称为侧袋账户

67、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

68、不可抗力:指本合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

第三部分　基金的基本情况

一、基金名称

鹏华中证传媒交易型开放式指数证券投资基金联接基金

二、基金的类别

ETF联接基金

三、基金的运作方式

契约型开放式

四、基金的投资目标

本基金通过主要投资于目标ETF,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化,力争将日均跟踪偏离度控制在0.35%以内,年化跟踪误差控制在4%以内。

五、目标ETF及标的指数

目标ETF为鹏华中证传媒交易型开放式指数证券投资基金,标的指数为中证传媒指数。

六、基金存续期限

不定期

七、基金份额类别

本基金根据申购费、赎回费及销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人申购时收取申购费用,并不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;在投资人申购时不收取申购费用,而从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为C类基金份额。相关费率的设置及费率水平在招募说明书或相关公告中列示。

本基金A类和C类基金份额分别设置代码。A类基金份额通过场外和场内两种方式申购和赎回,A类基金份额持有人可进行跨系统转托管;C类基金份额通过场外方式申购和赎回。除经基金管理人另行公告,C类基金份额持有人不能进行跨系统转托管。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。

投资者可自行选择申购的基金份额类别。

在不违反法律法规规定、基金合同的约定以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下,基金管理人经与基金托管人协商一致,可以增加、减少或调整基金份额类别设置、对基金份额分类办法及规则进行调整并依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告,无需召开基金份额持有人大会审议。

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,二者既有联系也有区别。

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。

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主要采取完全复制法,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。

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。

第四部分　基金的历史沿革

本基金由鹏华中证传媒指数型证券投资基金(LOF)转型而来,鹏华中证传媒指数型证券投资基金(LOF)由鹏华中证传媒指数分级证券投资基金终止分级运作并变更而来。

一、鹏华中证传媒指数分级证券投资基金

鹏华中证传媒指数分级证券投资基金经中国证监会2014年9月17日证监许可[2014]968号文注册,进行募集。鹏华中证传媒指数分级证券投资基金的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,《鹏华中证传媒指数分级证券投资基金基金合同》于2014年12月11日生效。

二、转型为鹏华中证传媒指数型证券投资基金(LOF)

根据《鹏华中证传媒指数分级证券投资基金基金合同》约定,鹏华中证传媒指数分级证券投资基金应根据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》等法律法规规定终止鹏华传媒A份额与鹏华传媒B份额的运作,无需召开基金份额持有人大会。据此,基金管理人已于2020年12月2日在规定媒介发布《关于鹏华中证传媒指数分级证券投资基金之鹏华传媒A份额和鹏华传媒B份额终止运作并修改基金合同的公告》,向深圳证券交易所申请鹏华中证传媒指数分级证券投资基金的两级子份额终止上市,并于2020年12月31日(份额折算基准日)进行基金份额折算,《鹏华中证传媒指数型证券投资基金(LOF)基金合同》于2021年1月1日正式生效,《鹏华中证传媒指数分级证券投资基金基金合同》自同一日失效。

三、转型为鹏华中证传媒交易型开放式指数证券投资基金联接基金

鹏华中证传媒指数型证券投资基金(LOF)转型为本基金经中国证监会《关于准予鹏华中证传媒指数型证券投资基金(LOF)变更注册的批复》(证监许可[20XX]XX号文)变更注册。20XX年×月×日至20XX年×月×日,鹏华中证传媒指数型证券投资基金(LOF)的基金份额持有人大会以通讯方式召开,大会审议通过了《关于鹏华中证传媒指数型证券投资基金(LOF)终止上市并变更为鹏华中证传媒交易型开放式指数证券投资基金联接基金的议案》,内容包括将基金类别变更为ETF联接基金,并相应将基金名称变更为“鹏华中证传媒交易型开放式指数证券投资基金联接基金”;终止A类基金份额上市,保留A类基金份额场内申购、赎回业务;调整基金费用的种类、基金费用计提方法和计提标准;降低A类基金份额的赎回费率等,并根据上述调整需要、法律法规要求和基金实际运作需求修改基金合同其他相关条款。上述基金份额持有人大会决议事项自表决通过之日起生效。自20XX年×月×日起,原《鹏华中证传媒指数型证券投资基金(LOF)基金合同》失效,《鹏华中证传媒交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》生效。

第五部分　基金的存续

一、基金份额的变更登记

基金合同生效后,本基金登记机构将进行本基金基金份额的更名以及必要信息的变更。

二、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

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进行表决。

法律法规或中国证监会另有规定时,从其规定。

第六部分　基金份额的申购与赎回

A类基金份额投资者可通过场内或场外两种方式对基金份额进行申购与赎回。C类基金份额投资者可通过场外方式对基金份额进行申购与赎回。场外申购的基金份额登记在登记结算系统基金份额持有人深圳开放式基金账户下;场内申购的基金份额登记在证券登记系统基金份额持有人深圳证券账户下。

一、申购和赎回场所

投资者办理本基金场外申购、赎回业务的场所为基金管理人的直销网点和基金管理人委托的代销机构的代销网点;投资者办理本基金场内申购、赎回业务的场所为具有基金销售业务资格且符合深圳证券交易所有关风险控制要求的深圳证券交易所会员单位。

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。基金投资者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的其他方式办理基金份额的申购与赎回。

二、申购和赎回的开放日及时间

1、开放日及开放时间

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。

基金合同生效后,若出现新的证券/期货交易市场、证券/期货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》的有关规定在规定媒介上公告。

2、申购、赎回开始日及业务办理时间

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》的有关规定在规定媒介上公告申购与赎回的开始时间。

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或者赎回或者转换。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。

三、申购与赎回的原则

1、“未知价”原则,即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的各类基金份额净值为基准进行计算;

2、“金额申购、份额赎回”原则,即申购以金额申请,赎回以份额申请;

3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销;

4、场外赎回遵循“先进先出”原则,即按照基金份额登记的先后次序进行顺序赎回;

5、场内申购与赎回业务遵循深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定。若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对场内申购、赎回业务等规则有新的规定,按新规定执行。

6、投资者通过场外申购、赎回应使用中国证券登记结算有限责任公司开立的开放式基金账户,通过场内申购、赎回应使用中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开立的深圳证券账户(人民币普通股票账户和证券投资基金账户)。

7、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。

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》的有关规定在规定媒介上公告。

四、申购与赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式

投资人必须根据销售机构规定的程序,在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

2、申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时,必须全额交付申购款项,投资人交付申购款项,申购成立;基金份额登记机构确认基金份额时,申购生效。若资金在规定时间内未全额到账则申购不成立,申购款项将退回投资人账户,基金管理人不承担由此产生的利息损失。

基金份额持有人递交赎回申请,赎回成立;基金份额登记机构确认赎回时,赎回生效。投资人赎回申请生效后,基金管理人将在T+7日(包括该日)内支付赎回款项。在发生巨额赎回、本基金合同载明的暂停赎回或其他延缓支付赎回款项的情形时,款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。

遇交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其他非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程,则赎回款顺延至上述情形消除后的下一个工作日划出。

3、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T日),在正常情况下,本基金登记机构在T+1日内对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请,投资人可在T+2日后(包括该日)到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功,则申购款项退还给投资人。

基金销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功,而仅代表销售机构确实接收到申请。申购、赎回申请的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况,投资人应及时查询并妥善行使合法权利。

基金管理人在不违反法律法规的前提下,可对上述程序规则进行调整。基金管理人应依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

五、申购和赎回的数量限制

1、基金管理人可以规定投资人首次申购和每次申购的最低金额、最高金额以及每次赎回的最低份额,具体规定请参见招募说明书或相关公告。

2、基金管理人可以规定投资人每个基金交易账户的最低基金份额余额,具体规定请参见招募说明书或相关公告。

3、基金管理人可以规定单个投资人累计持有的基金份额上限,具体规定请参见招募说明书或相关公告。

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。具体见基金管理人相关公告。

5、对于场内申购、赎回及持有场内份额的数量限制等,深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则有规定的,从其规定办理。

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。基金管理人必须依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

六、申购和赎回的价格、费用及其用途

1、本基金各类基金份额净值的计算,均保留到小数点后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。

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。本基金C类基金份额不收取申购费。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。其中,场外申购份额计算结果保留到小数点后两位,小数点后两位以后的部分四舍五入,由此产生的收益或损失由基金财产承担;场内申购份额计算结果保留到整数位,小数部分舍弃,对应的资金返还至投资者资金账户(返还资金的计算公式及方法请参见招募说明书)。

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》,赎回金额单位为元。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。本基金对持续持有期少于7日的投资者收取不低于1.5%的赎回费,并将上述赎回费全额计入基金财产。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。

4、本基金A类基金份额收取申购费用,C类基金份额不收取申购费用。A类基金份额的申购费用由投资人承担,不列入基金财产。

5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担,在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用纳入基金财产的比例详见招募说明书,未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。

6、本基金的A类基金份额的申购费率、A类基金份额和C类基金份额申购份额具体的计算方法、赎回费率、赎回金额具体的计算方法和收费方式由基金管理人根据基金合同的规定确定,并在招募说明书中列示。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》的有关规定在规定媒介上公告。

7、当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。

8、办理基金份额的场内申购、赎回业务应遵守深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则。若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对场内申购、赎回业务规则有新的规定,基金合同相应予以修改,并按照新规定执行,且此项修改无须召开基金份额持有人大会。

9、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情况下且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下,根据市场情况制定基金促销计划,针对投资者开展基金促销活动。在基金促销活动期间,基金管理人可以根据法律法规要求对基金申购费率、赎回费率和销售服务费率等进行适当费率优惠。

七、拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时,基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请:

1、因不可抗力导致基金无法正常运作。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时,基金管理人可暂停接收投资人的申购申请。

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。

4、基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。

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。

6、当一笔新的申购申请被确认成功,使本基金总规模超过基金管理人规定的本基金总规模上限时;或使本基金单日申购金额或净申购比例超过基金管理人规定的当日申购金额或净申购比例上限时;或该投资人累计持有的份额超过单个投资人累计持有的份额上限时;或该投资人当日申购金额超过单个投资人单日或单笔申购金额上限时。

7、当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现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时,经与基金托管人协商确认后,基金管理人应当暂停接受基金申购申请。

8、基金管理人、基金托管人、登记机构、销售机构、支付结算机构等因异常情况导致基金销售系统、基金销售支付结算系统、基金登记系统、基金会计系统等无法正常运行。

9、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。

10、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。

11、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第4、6项以外暂停申购情形且基金管理人决定暂停接受投资人申购申请的,基金管理人应当根据有关规定在规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

发生下列情形时,基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项:

1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时,基金管理人可暂停接收投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。

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。

4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

5、当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现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时,经与基金托管人协商确认后,基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请。

6、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,基金管理人可暂停接受基金份额持有人的赎回申请。

7、基金管理人、基金托管人、登记机构、销售机构、支付结算机构等因异常情况导致基金销售系统、基金销售支付结算系统、基金登记系统、基金会计系统等无法正常运行。

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。

10、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

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的,基金管理人应在当日报中国证监会备案,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,对于场外赎回申请,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。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。暂停赎回或延缓支付款项的场内处理,按照深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关规定办理。

九、巨额赎回的情形及处理方式

1、巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过上一开放日基金总份额的10%,即认为是发生了巨额赎回。

2、巨额赎回的场外处理方式

当基金出现巨额赎回时,基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。

(1)全额赎回:当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时,按正常赎回程序执行。

(2)部分延期赎回:当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时,基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的10%的前提下,可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请,应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例,确定当日受理的赎回份额;对于未能赎回部分,投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的,将自动转入下一个开放日继续赎回,直到全部赎回为止;选择取消赎回的,当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理,无优先权并以下一开放日的该类基金份额净值为基础计算赎回金额,以此类推,直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择,投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

(3)暂停赎回:连续2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,并应当在规定媒介上进行公告。

(4)若基金发生巨额赎回,在当日存在单个基金份额持有人超过上一开放日基金总份额10%以上的赎回申请(“大额赎回申请人”)的情形下,基金管理人可以延期办理大额赎回申请人的赎回申请。对其他赎回申请人(“小额赎回申请人”)和大额赎回申请人10%以内的赎回申请在当日根据前述“(1)全额赎回”或“(2)部分延期赎回”的约定方式办理,在仍可接受赎回申请的范围内对大额赎回申请人超过10%的赎回申请按比例确认。对当日未予确认的赎回申请进行延期办理。对于未能赎回部分,基金份额持有人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择取消赎回的,当日未获受理的部分赎回申请将被撤销;选择延期赎回的,当日未获受理的赎回申请将与下一开放日赎回申请一并处理,无优先权并以下一开放日的该类基金份额净值为基础计算赎回金额,以此类推。如基金份额持有人在提交赎回申请时未作明确选择,基金份额持有人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

(5)当出现巨额赎回时,场内赎回申请按照深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相应规则进行处理,基金转换中转出份额的申请的处理方式遵照相关的业务规则及届时开展转换业务的公告。

3、巨额赎回的公告

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个交易日内通知基金份额持有人,说明有关处理方法,并在2日内在规定媒介上刊登公告。

十、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

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在规定媒介上刊登暂停公告。

2、上述暂停申购或赎回情况消除的,基金管理人应于重新开放日公布最近1个开放日的各类基金份额净值。

3、基金管理人可以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,最迟于重新开放日在规定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告;也可以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。

十一、基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换业务,基金转换可以收取一定的转换费,相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及本基金合同的规定制定并公告,并提前告知基金托管人与相关机构。

十二、基金的非交易过户

基金的非交易过户是指基金登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。无论在上述何种情况下,接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资人。

继承是指基金份额持有人死亡,其持有的基金份额由其合法的继承人继承;捐赠指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体;司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供基金登记机构要求提供的相关资料,对于符合条件的非交易过户申请按基金登记机构的规定办理,并按基金登记机构规定的标准收费。

十三、基金的转托管

基金份额持有人可办理已持有基金份额在不同销售机构之间的转托管,基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。本基金的转托管包括系统内转托管和跨系统转托管。

1、系统内转托管

(1)系统内转托管是指基金份额持有人将持有的基金份额在登记结算系统内不同销售机构(网点)之间或证券登记系统内不同会员单位(交易单元)之间进行转托管的行为。

(2)基金份额登记在登记结算系统的基金份额持有人在变更办理基金份额赎回业务的销售机构(网点)时,须办理已持有基金份额的系统内转托管。

(3)基金份额登记在证券登记系统的基金份额持有人在变更办理基金份额场内赎回的会员单位(交易单元)时,须办理已持有基金份额的系统内转托管。

(下转B62版)