鹏扬中债-30年期国债交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书

基金管理人:鹏扬基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
登记机构:中国证券登记结算有限责任公司

上市地点:上海证券交易所
上市时间:2023年6月13日
公告日期:2023年6月8日

一、重要声明与提示

《鹏扬中债-30年期国债交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书》(以下简称本公告)依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称《基金法》)、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号〈上市交易公告书的内容与格式〉》和《上海证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制,鹏扬中债-30年期国债交易型开放式指数证券投资基金(以下简称本基金)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)的董事会及董事保证本公告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本基金托管人招商银行股份有限公司保证本公告中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性,承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、上海证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见,均不表明对本基金的任何保证。凡本公告未涉及的有关内容,请投资者详细查阅2023年2月14日刊登在鹏扬基金管理有限公司网站(www.pyamc.com)、上海证券交易所网站(www.sse.com.cn)及中国证监会基金电子披露网站(http://eid.csrc.gov.cn/fund)上的《鹏扬中债-30年期国债交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》。

二、基金概览

1、基金名称:鹏扬中债-30年期国债交易型开放式指数证券投资基金
2、基金场内简称:30年国债
3、基金交易代码:511090
4、2023年6月6日基金份额总额:2,918,146.00份
5、2023年6月6日基金份额净值:100.0857元
6、本次上市交易份额:2,918,146.00份
7、上市交易的证券交易所:上海证券交易所
8、上市交易日期:2023年6月13日
9、基金管理人:鹏扬基金管理有限公司
10、基金托管人:招商银行股份有限公司
11、上市推荐人:湘财证券股份有限公司
12、申购赎回代理券商:安信证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、申万宏源西部证券有限公司、申万宏源证券有限公司、中国银河证券股份有限公司、中泰证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中信证券华南股份有限公司、中信证券(山东)有限责任公司。

本公司可根据情况变更申购赎回代理券商。

三、基金的募集与上市交易

(一)本基金上市前基金募集情况

1、基金募集申请的注册机构和注册文号:经中国证监会2022年1月10日证监许可[2022]92 文准予注册,并于2022年8月19日获得中国证监会延期募集备案的回函(机构部函[2022]1442号)。
2、基金运作方式:交易型开放式。
3、基金合同期限:不定期。
4、发售日期:本基金自2023年2月17日至2023年5月16日(周六、周日和节假日不受理)进行发售。其中,网上现金认购的日期为2023年5月12日至2023年5月16日;网下现金认购和网下债券认购的日期为2023年2月17日至2023年5月16日。
5、发售价格:人民币1.00元。
6、发售方式:网上现金认购、网下现金认购和网下债券认购3种方式。
7、发售机构:
(1)网下现金认购及网下债券认购的直销机构:鹏扬基金管理有限公司。
(2)网上现金认购的发售代理机构:具有基金销售业务资格的上海证券交易所会员资格的证券公司办理网上现金认购业务。具体名单可在上海证券交易所网站查询。
(3)网下现金认购的发售代理机构:华泰证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、中泰证券股份有限公司、中国中金财富证券有限公司、中信证券股份有限公司、中信证券(山东)有限责任公司、中信证券华南股份有限公司。
(4)无网下债券发售代理机构。
8、验资机构名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
9、募集资金总额及入账情况

此次募集扣除认购费后的有效净认购金额(不含募集期利息)为291,812,000.00元人民币,认购款项在本基金验资确认日之前产生的银行利息共计37,953.45元人民币(含计入基金资产的网上现金认购的有效资金产生的利息35,290.44元,归入基金资产;含网下现金认购的有效认购资金产生的利息2,663.01元,其中利息折份额部分共计人民币2,663.00元,小数部分0.01元,归入基金资产)。

上述有效净认购资金已于2023年5月19日全部划至本基金托管人招商银行股份有限公司的基金托管账户。上述网下现金认购的有效认购资金产生的利息(含利息折份额部分及归入基金资产小数部分)已于2023年5月19日全部划至本基金托管人招商银行股份有限公司的基金托管账户;网上现金认购的有效认购资金在募集期间产生的利息将于下一银行结息日后全部划入本基金托管专户。

本次募集有效认购户数为2,110户,按照每份基金份额面值1.00元人民币计算,本次募集资金及其产生的利息结转的基金份额共计291,814,663.00份,已全部计入各基金份额持有人的基金账户。

10、基金备案情况

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》以及《鹏扬中债-30年期国债交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《鹏扬中债-30年期国债交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金募集符合有关条件,本基金管理人已向中国证监会办理基金备案手续,并于2023年5月19日获书面确认,基金合同自该日起正式生效。自基金合同生效之日起,基金管理人开始正式管理本基金。

11、基金合同生效日:2023年5月19日。
12、基金合同生效日的基金份额总额:291,814,663.00份。
13、根据《鹏扬中债-30年期国债交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《鹏扬中债-30年期国债交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定,鹏扬基金管理有限公司决定对本基金进行基金份额折算与变更登记,本次基金份额折算日2023年5月29日。本次基金份额折算前基金份额总额为291,814,663.00份,折算前基金份额净值为1.0005元;根据本基金的基金份额折算方法,折算后基金份额总额为2,918,146.00份,折算后基金份额净值为100.0453元。本基金的登记机构中国证券登记结算有限责任公司于2023年5月29日进行了变更登记。折算后的基金份额保留至整数位,小数部分舍去,由此产生的误差计入基金财产。

(二)基金上市交易的主要内容

1、基金上市交易的核准机构和核准文号:上海证券交易所自律监管决定书[2023]126号
2、上市交易日期:2023年6月13日
3、上市交易的证券交易所:上海证券交易所
4、基金场内简称:30年国债
5、基金交易代码:511090
6、本次上市交易份额:2,918,146.00份
7、未上市交易份额的流通规定:本基金上市交易后,所有的基金份额均可进行交易,不存在未上市交易的基金份额。
8、基金资产净值的披露:在开始办理基金份额申购或者赎回或基金上市交易后,基金管理人应当在不晚于每个开放日/交易日的次日,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/交易日的基金份额净值和基金份额累计净值,并在上海证券交易所行情发布系统揭示基金份额净值。

根据相关机构规定,基金管理人应在上市前一交易日16:00之前提供ETF基金份额参考净值,作为上市首日的开盘参考价。本基金上市首日开盘参考价由基金管理人根据中债日间估值行情估算,与日终基金净值可能存在差异,敬请知悉。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

(一)持有人户数

截至2023年6月6日,本基金基金份额持有人户数为2,110户,平均每户持有的基金份额为1,383.01份。

(二)持有人结构

截至2023年6月6日,本基金份额持有人结构如下:机构投资者持有的基金份额为2,218,066.00份,占基金总份额的76.01%;个人投资者持有的基金份额700,080.00份,占基金总份额的23.99%。

(三)截至2023年6月6日,前十名基金份额持有人的情况

序号	基金份额持有人名称	持有份额	占基金总份额的比例
1	武汉科前生物股份有限公司	300,000.00	10.28%
2	中国银河证券股份有限公司	300,000.00	10.28%
3	申万宏源证券有限公司	300,000.00	10.28%
4	中信证券股份有限公司	300,000.00	10.28%
5	方正中期期货有限公司	200,016.00	6.85%
6	上海东证期货有限公司	200,000.00	6.85%
7	华泰期货有限公司	200,000.00	6.85%
8	国泰君安期货有限公司	200,000.00	6.85%
9	中信建投期货有限公司	200,000.00	6.85%
10	宋连香	30,000.00	1.03%
11	张丽华	30,000.00	1.03%

五、基金主要当事人简介

(一)基金管理人

1、基金管理人概况
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
邮政编码:100045
法定代表人:杨爱斌
成立日期:2016年7月6日
批准设立机关及批准设立文号:中国证监会证监许可[2016]1453号
组织形式:有限责任公司
注册资本:1.18亿元人民币
存续期限:持续经营
统一社会信用代码:91310115MA1K3E3W2K
经营范围:公开募集证券投资基金管理、基金销售、特定客户资产管理和中国证监会许可的其他业务。
信息披露联系人:吉瑞
联系电话:400-968-6688

2、股权结构

鹏扬基金管理有限公司作为专业人士控股的公募基金公司,治理结构先进、清晰、市场化,具备一般同业公司难以企及的优越性,高度契合资产管理公司"以人为本"的发展理念。公司总经理杨爱斌先生作为专业人士,持股45.15%,持股比例最高,核心团队持股超过14%。公司通过建立并不断完善合伙人文化与机制,帮助公司引入关键人才,确保公司长期持续发展。

股东名称	出资金额(人民币:万元)	出资方式	持股比例
杨爱斌	5,327.70	货币	45.15%
上海华石投资有限公司	3,322.36	货币	28.16%
宏实资本管理有限公司	1,180.00	货币	10.00%
上海璞识企业管理中心(有限合伙)	588.82	货币	4.99%
上海润京企业管理中心(有限合伙)	588.82	货币	4.99%
上海济通企业管理中心(有限合伙)	515.00	货币	4.36%
上海弘至企业管理中心(有限合伙)	277.30	货币	2.35%
合计	11,800.00		100%

3、内部组织结构及职能

自成立以来,公司严格按照法律法规和中国证监会的各项规定及要求,建立组织机构健全、职责划分清晰、制衡监督有效、激励约束合理的治理结构,保持公司规范运作,维护基金份额持有人的利益,并且根据业务发展变化,公司设置并适时调整内部组织架构。

目前,公司内部组织架构主要分为投研体系、市场体系、中后台支持体系。

其中,投资体系包括固收投研体系、权益投研体系、数量投研体系、多资产投研体系,各业务体系下设相应职能部门,负责按各自专业分工开展投资研究、投资管理、投资交易等工作。市场体系包括市场营销部、券商业务部、机构业务部、零售直销部、互联网金融部、产品开发部、客户服务部以及下设的分公司及机构区域业务中心,各业务板块下设相应职能部门,负责按各自所服务的客户群体开展营销推广和客户服务等工作。中后台支持体系包括交易管理、风险管理、合规体系、后台体系,各业务板块下设相应职能部门。其中,后台体系包括基金运营部、信息技术部、财务部、人力资源及行政管理部,合规体系包括监察稽核部、法务部。交易管理部负责组织、制定和执行交易计划;风险管理部负责对基金投资及公司运营过程中产生的或潜在的风险进行有效管理和控制;合规体系负责公司的合规管理、以及法务相关工作;后台体系负责会计与清算、注册登记、公司IT系统的建立和管理维护、公司财务、人力资源、行政管理等工作。

4、人员情况

公司根据业务发展需要进行合理的人员配置,重视人才队伍建设和人才发展,截至2023年3月31日,公司现有员工246人,其中72%员工具有硕士及以上学历,形成了一支高素质、专业化的人才队伍。

5、基金管理业务介绍

鹏扬基金管理有限公司成立于2016年7月6日,注册资金1.18亿元,注册地为上海,是中国证监会批准设立的全国性公募基金管理公司,也是国内首家"私转公"基金管理公司,目前在北京、上海、深圳设有分公司。

公司遵循"专业稳健,回报信任"的经营宗旨,坚持"稳健投资、长期投资"的投资理念,建立完备的投研体系,构建完善的产品线,协同发展主动债券、主动股票、多资产、主动量化、被动指数五大核心策略,致力于打造在资本市场上有影响力的、持续为客户创造价值的资产管理公司。

6、本基金基金经理

施红俊先生:数量投资部总经理兼指数投资总监,同济大学管理学博士。曾任大公国际资信评估有限公司上海分公司中小企业评级部部门经理,中证指数有限公司研究员、固定收益主管、研究开发部副总监。鹏扬中证500质量成长指数证券投资基金基金经理(2019年8月29日至2022年11月8日期间)、鹏扬中证科创创业50指数证券投资基金基金经理(2021年7月16日至2022年11月30日期间)、鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金基金经理(2020年6月9日起任职)、鹏扬沪深300质量成长低波动指数证券投资基金基金经理(2021年5月25日起任职)、鹏扬中证500质量成长交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2021年8月4日起任职)、鹏扬中证数字经济主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2021年12月22日起任职)、鹏扬中债3-5年国开行债券指数证券投资基金基金经理(2022年4月27日起任职)、鹏扬中证数字经济主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(2022年9月26日起任职)、鹏扬中证科创创业50交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2022年10月26日起任职)、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经理(2022年11月9日起任职)、鹏扬中证科创创业50交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(2022年12月1日起任职)、鹏扬北证50成份指数证券投资基金基金经理(2023年4月25日起任职)、鹏扬中债-30年期国债交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2023年5月19日起任职)。

(二)基金托管人

1、基本情况
名称:招商银行股份有限公司(以下简称"招商银行")
住所:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
法定代表人:缪建民
成立日期:1987年4月8日
基金托管资格批文及文号:证监基金字[2002]83号
注册资本:252.20亿元
存续期间:持续经营
基金托管部门负责人:孙乐
资产托管部信息披露负责人:张姗
联系电话:0755-83077987
传真:0755-83195201

2、发展概况

招商银行成立于1987年4月8日,是我国第一家完全由企业法人持股的股份制商业银行,总行设在深圳。自成立以来,招商银行先后进行了三次增资扩股,并于2002年3月成功地发行了15亿A股,4月9日在上交所挂牌(股票代码:600036),是国内第一家采用国际会计标准上市的公司。2006年9月又成功发行了22亿H股,9月22日在香港联交所挂牌交易(股票代码:3968),10月5日行使H股超额配售,共发行了24.2亿H股。截至2023年3月31日,本集团总资产105,087.52亿元人民币,高级法下资本充足率17.39%,权重法下资本充足率14.41%。

2002年8月,招商银行成立基金托管部;2005年8月,经报中国证监会同意,更名为资产托管部,现下设基金券商团队、银保信托团队、养老金团队、业务管理团队、产品研发团队、风险管理团队、系统与数据团队、项目支持团队、运营管理团队、基金外包业务团队10个职能团队,现有员工192人。2002年11月,经中国人民银行和中国证监会批准获得证券投资基金托管业务资格,成为国内第一家获得该项业务资格上市银行;2003年4月,正式办理基金托管业务。招商银行作为托管业务资质最全的商业银行,拥有证券投资基金托管、受托投资管理托管、合格境外机构投资者托管(QFII)、合格境内机构投资者托管(QDII)、全国社会保障基金托管、保险资金托管、企业年金基金托管、存托凭证试点存托人等业务资格。

招商银行确立"因势而变、先您所想"的托管理念和"财富所托、信守承诺"的托管核心价值,独创"6S托管银行"品牌体系,以"保护您的业务、保护您的财富"为历史使命,不断创新托管系统、服务和产品:在业内率先推出"网上托管银行系统"、托管业务综合系统和"6心"托管服务标准,首家发布私募基金绩效分析报告,开办国内首个托管银行网站,推出国内首个托管大数据平台,成功托管国内第一只券商集合资产管理计划、第一只FOF、第一只信托资金计划、第一只股权私募基金、第一家实现货币市场基金赎回资金T+1到账、第一只境外银行QDII基金、第一只红利ETF基金、第一只"1+N"基金专户理财、第一家大小非解禁资产、第一单TOT保管,实现从单一托管服务商向全面投资服务机构的转变,得到了同业认可。

招商银行资产托管业务持续稳健发展,社会影响力不断提升,四度蝉联获《财资》"中国最佳托管专业银行"。2016年6月招商银行荣膺《财资》"中国最佳托管银行奖",成为国内唯一获得该奖项的托管银行;"托管通"获得国内《银行家》2016中国金融创新"十佳金融产品创新奖";7月荣膺2016年中国资产管理"金贝奖""最佳资产托管银行"。2017年6月招商银行再度荣膺《财资》"中国最佳托管银行奖";"全功能网上托管银行2.0"荣获《银行家》2017中国金融创新"十佳金融产品创新奖";8月荣膺国际财经权威媒体《亚洲银行家》"中国年度托管银行奖"。2018年1月招商银行荣膺中央国债登记结算有限责任公司"2017年度优秀资产托管机构"奖项;同月,招商银行托管大数据平台风险管理系统荣获2016-2017年度银监会系统"金点子"方案一等奖,以及中央金融团工委、全国金融青联第五届"双提升"金点子方案二等奖;3月荣膺公募基金20年"最佳基金托管银行"奖;5月荣膺国际财经权威媒体《亚洲银行家》"中国年度托管银行奖";12月荣膺2018东方财富风云榜"2018年度最佳托管银行"、"20年最值得信赖托管银行"奖。2019年3月招商银行荣获《中国基金报》"2018年度最佳基金托管银行"奖;6月荣获《财资》"中国最佳托管机构""中国最佳养老金托管机构""中国最佳零售基金行政外包"三项大奖;12月荣获2019东方财富风云榜"2019年度最佳托管银行"奖。2020年1月,荣膺中央国债登记结算有限责任公司"2019年度优秀资产托管机构"奖项;6月荣获《财资》"中国最佳托管机构""最佳公募基金托管机构""最佳公募基金行政外包机构"三项大奖;10月荣获《中国基金报》"2019年度最佳基金托管银行"奖。2021年1月,荣膺中央国债登记结算有限责任公司"2020年度优秀资产托管机构"奖项;1月荣获2020东方财富风云榜"2020年度最受欢迎托管银行"奖项;2021年10月,荣获国新投资有限公司"2021年度优秀托管银行奖"和《证券时报》"2021年度杰出资产托管银行天玑奖";2021年12月,荣获《中国基金报》第三届中国公募基金英华奖"2020年度最佳基金托管银行";2022年1月荣获中央国债登记结算有限责任公司"2021年度优秀资产托管机构、估值业务杰出机构";9月荣获《财资》"中国最佳托管银行""最佳公募基金托管银行""最佳理财托管银行"三项大奖。

3、基金托管业务经营情况

截至2023年3月31日,招商银行股份有限公司累计托管1223只证券投资基金。

(三)上市推荐人
名称:湘财证券股份有限公司
注册地址:湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼
办公地址:湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼
法定代表人:高振营
联系人:江恩前
电话:021-50295432
客服电话:95351
传真:021-68865680
网址:www.xcsc.com

(四)基金验资机构
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:周祎、耿亚男
联系电话:021-23238888
传真:021-23238800
联系人:周祎

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件。

七、基金财务状况

(一)基金募集期间费用

本次基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用不从基金资产中支付。

(二)基金上市前重要财务事项

本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

(三)基金资产负债表

本基金2023年6月6日资产负债表如下:
(除特别注明外,金额单位为人民币元)

资 产	本期末 2023年6月6日
资 产:	
银行存款	241,489,371.27
结算备付金	115,555.60
存出保证金	708.22
交易性金融资产	52,518,857.53
其中:股票投资	-
基金投资	-
债券投资	52,518,857.53
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	-
应收利息	-
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	35,290.44
资产总计	294,159,783.06
负债和所有者权益	本期末 2023年6月6日
负 债:	
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-
应付证券清算款	-
应付赎回款	-
应付管理人报酬	7,199.86
应付托管费	2,399.95
应付销售服务费	-
应付交易费用	-
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	2,085,494.80
负债合计	2,095,094.61
所有者权益:	
实收基金	291,814,663.00
未分配利润	250,025.45
所有者权益合计	292,064,688.45
负债和所有者权益总计	294,159,783.06

八、基金投资组合

本基金目前处于建仓期,在上市首日前,基金管理人将使本基金的投资组合比例符合有关法律法规、部门规章、规范性文件的规定和基金合同的有关约定。

截至2023年6月6日,本基金的投资组合情况如下:

1 基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	52,518,857.53	17.85
	其中:债券	52,518,857.53	17.85
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	241,604,926.87	82.13
8	其他资产	35,998.66	0.01
9	合计	294,159,783.06	100.00

2 按行业分类的股票投资组合
截至2023年6月6日,本基金未持有股票。

3 按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细
截至2023年6月6日,本基金未持有股票。

4 按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	52,518,857.53	17.98
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	52,518,857.53	17.98

5 按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	019702	23国债09	400,000	41,117,282.19	14.08
2	019547	16国债19	110,000	11,401,575.34	3.90
-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-

6 按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细
截至2023年6月6日,本基金未持有资产支持证券。

7 按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
截至2023年6月6日,本基金未持有贵金属。

8 按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
截至2023年6月6日,本基金未持有权证。

9 本基金投资的股指期货交易情况说明
截至2023年6月6日,本基金未持有股指期货。

10 本基金投资的国债期货交易情况说明
截至2023年6月6日,本基金未持有国债期货。

11 投资组合报告附注

11.1 本基金未发现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查,未发现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

11.2 2根据基金合同规定,本基金的投资范围不包括股票。

11.3 其他资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	708.22
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	35,290.44
7	其他	-
8	合计	35,998.66

11.4 基金持有的处于转股期的可转换债券明细
截至2023年6月6日,本基金未持有处于转股期的可转换债券。

11.5 前十名股票中存在流通受限情况的说明
截至2023年6月6日,本基金未持有股票。

11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分
由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

九、重大事件揭示

(一)2023年5月20日发布鹏扬中债-30年期国债交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效公告。

十、基金管理人承诺

本基金管理人就本基金上市交易之后履行管理人职责做出承诺:

(一)严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

(二)真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件,披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息,并接受中国证监会、证券交易所的监督管理。

(三)在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后,将及时予以公开澄清。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺:

在上海证券交易所的大力支持下,由鹏扬基金管理有限公司管理,并由招商银行股份有限公司托管的鹏扬中债-30年期国债交易型开放式指数证券投资基金已于2023年5月19日成立运作。

在本基金上市后,托管人承诺严格遵照《基金法》等相关法规以及《鹏扬中债-30年期国债交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《鹏扬中债-30年期国债交易型开放式指数证券投资基金托管协议》的约定履行相应职责。

十二、基金上市推荐人意见

本基金上市推荐人就基金上市交易事宜出具意见如下:

(一)本基金上市符合《基金法》、《上海证券交易所证券投资基金上市规则》规定的相关条件;

(二)基金上市文件真实、准确、完整,符合相关规定要求,文件内所载的资料均经过核实。

十三、备查文件目录

以下备查文件存放于基金管理人和基金托管人的公司住所和上海证券交易所,投资者可在办公时间免费查阅。

(一)中国证监会准予本基金募集注册的文件
(二)《鹏扬中债-30年期国债交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
(三)《鹏扬中债-30年期国债交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》
(四)《鹏扬中债-30年期国债交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
(五)法律意见书
(六)基金管理人业务资格批件、营业执照
(七)基金托管人业务资格批件、营业执照

鹏扬基金管理有限公司
二〇二三年六月八日

附件:基金合同内容摘要

一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

(一)基金份额持有人的权利与义务

基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受,基金投资者自依据《基金合同》取得基金份额,即成为本基金份额持有人和《基金合同》的当事人,直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章或签字为必要条件。

每份基金份额具有同等的合法权益。

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:
(1)分享基金财产收益;
(2)参与分配清算后的剩余基金财产;
(3)依法转让或者申请赎回其持有的基金份额;
(4)按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会;
(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;
(6)查阅或者复制公开披露的基金信息资料;
(7)监督基金管理人的投资运作;
(8)对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁;
(9)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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:
(1)认真阅读并遵守《基金合同》、招募说明书等信息披露文件;
(2)了解所投资基金产品,了解自身风险承受能力,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;
(3)关注基金信息披露,及时行使权利和履行义务;
(4)交纳基金认购款项或认购债券、申购对价及法律法规和《基金合同》所规定的费用;
(5)在其持有的基金份额范围内,承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任;
(6)不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动;
(7)执行生效的基金份额持有人大会的决议;
(8)返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利;
(9)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(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;
(2)自《基金合同》生效之日起,根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产;
(3)依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用;
(4)销售基金份额;
(5)按照规定召集基金份额持有人大会;
(6)依据《基金合同》及有关法律规定监督基金托管人,如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定,应呈报中国证监会和其他监管部门,并采取必要措施保护基金投资者的利益;
(7)在基金托管人更换时,提名新的基金托管人;
(8)选择、更换基金销售机构,对基金销售机构的相关行为进行监督和处理;
(9)担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记结算机构办理基金登记结算业务并获得《基金合同》规定的费用;
(10)依据《基金合同》及有关法律规定决定基金收益的分配方案;
(11)在《基金合同》约定的范围内,拒绝或暂停受理申购与赎回申请;
(12)依照法律法规为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利;
(13)在法律法规允许的前提下,为基金的利益依法为基金参与融资或转融通证券出借业务;
(14)以基金管理人的名义,代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;
(15)选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券期货经纪商或其他为基金提供服务的外部机构;
(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、赎回等业务规则;
(17)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜;
(2)办理基金备案手续;
(3)自《基金合同》生效之日起,以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产;
(4)配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策,以专业化的经营方式管理和运作基金财产;
(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;
(6)除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外,不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人运作基金财产;
(7)依法接受基金托管人的监督;
(8)采取适当合理的措施使计算基金份额认购价格、申购对价、赎回对价的方法符合《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、赎回对价,编制申购赎回清单;
(9)进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;
(10)编制季度报告、中期报告和年度报告;
(11)严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定,履行信息披露及报告义务;
(12)保守基金商业秘密,不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前应予保密,不向他人泄露,但向审计、法律等外部专业顾问提供的除外;
(13)按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配基金收益;
(14)按规定受理申购与赎回申请,及时、足额支付赎回对价;
(15)依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会;
(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;
(17)确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出,并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式,随时查阅到与基金有关的公开资料,并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件;
(18)组织并参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;
(19)面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时,及时报告中国证监会并通知基金托管人;
(20)因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时,应当承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;
(21)监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务,基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时,基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿;
(22)当基金管理人将其义务委托第三方处理时,应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任;但因第三方责任导致基金财产或基金份额持有人利益受到损失,而基金管理人首先承担了责任的情况下,基金管理人有权向第三方追偿;
(23)以基金管理人名义,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为;
(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存款利息在基金募集期结束后30日内退还基金认购人;
(25)执行生效的基金份额持有人大会的决议;
(26)建立并保存基金份额持有人名册;
(27)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(三) 基金托管人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金托管人的权利包括但不限于:
(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;
(2)依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用;
(3)监督基金管理人对本基金的投资运作,如发现基金管理人有违反《基金合同》及国家法律法规行为,对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形,应呈报中国证监会,并采取必要措施保护基金投资者的利益;
(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;
(5)提议召开或召集基金份额持有人大会;
(6)在基金管理人更换时,提名新的基金管理人;
(7)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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:
(1)以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产;
(2)设立专门的基金托管部门,具有符合要求的营业场所,配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员,负责基金财产托管事宜;
(3)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,确保基金财产的安全,保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立;对所托管的不同的基金分别设置账户,独立核算,分账管理,保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立;
(4)除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外,不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人托管基金财产;
(5)保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证;
(6)按规定开设基金财产的资金账户和证券账户等投资所需账户,按照《基金合同》的约定,根据基金管理人的投资指令,及时办理清算、交割事宜;
(7)保守基金商业秘密,除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前予以保密,不得向他人泄露;
(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、赎回对价;
(9)办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项;
(10)对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告出具意见,说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行;如果基金管理人有未执行《基金合同》规定的行为,还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施;
(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不低于法律法规规定的最低期限;
(12)保存基金份额持有人名册;
(13)按规定制作相关账册并与基金管理人核对;
(14)依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回对价;
(15)依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定,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;
(16)按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作;
(17)参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;
(18)面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时,及时报告中国证监会和银行监管机构,并通知基金管理人;
(19)因违反《基金合同》导致基金财产损失时,应承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;
(20)按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务,基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时,应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿;
(21)执行生效的基金份额持有人大会的决议;
(22)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成,基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

若以本基金为目标基金,且基金管理人与本基金基金管理人一致的联接基金的基金合同生效,鉴于本基金和联接基金的相关性,联接基金的基金份额持有人可以凭所持有的联接基金的基金份额直接出席本基金的基金份额持有人大会或者委派代表出席本基金的基金份额持有人大会并参与表决。在计算参会份额和票数时,联接基金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:在本基金基金份额持有人大会的权益登记日,联接基金持有本基金份额的总数乘以该基金份额持有人所持有的联接基金份额占联接基金总份额的比例,计算结果按照四舍五入的方法,保留到整数位。联接基金折算为本基金的每一参会份额后和本基金的每一参会份额拥有平等的投票权。

联接基金的基金管理人不应以联接基金的名义代表联接基金的全体基金份额持有人以本基金的基金份额持有人的身份行使表决权,但可接受联接基金的特定基金份额持有人的委托以联接基金的基金份额持有人代理人的身份出席本基金的基金份额持有人大会并参与表决。

联接基金的基金管理人代表联接基金的基金份额持有人提议召开或召集本基金份额持有人大会的,须先遵照联接基金基金合同的约定召开联接基金的基金份额持有人大会,联接基金的基金份额持有人大会决定提议召开或召集本基金份额持有人大会的,由联接基金的基金管理人代表联接基金的基金份额持有人提议召开或召集本基金份额持有人大会。

本基金份额持有人大会不设日常机构。

(一)召开事由

1、除法律法规、监管机构或基金合同另有规定的,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:
(1)终止《基金合同》;

(下转B75版)

鹏扬中债-30年期国债交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书提示性公告

本公司董事会及董事保证基金上市交易公告书所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

鹏扬中债-30年期国债交易型开放式指数证券投资基金将于2023年6月13日在上海证券交易所上市,上市交易公告书全文于2023年6月8日在本公司网站(http://www.pyamc.com) 、上海证券交易所网站(http://www.sse.com.cn/)和中国证监会基金电子披露网站(http://eid.csrc.gov.cn/fund)披露,供投资者查阅。如有疑问可拨打本公司客服电话(400-968-6688)咨询。

本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,但不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。请充分了解本基金的风险收益特征,审慎做出投资决定。

特此公告。

鹏扬基金管理有限公司
2023年6月8日

鹏扬国证财富管理交易型开放式指数证券投资基金增加网下股票发售代理机构的公告

根据鹏扬基金管理有限公司(以下简称"本公司")与6家证券公司签署的销售协议,本公司自2023年6月8日起增加以下证券公司为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",认购代码:159503,场内简称:财富管理ETF)的网下股票发售代理机构。

特别提示:本基金网下股票认购的日期为2023年6月8日至2023年6月21日,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。

投资者可通过以下途径咨询有关情:

1.华泰证券股份有限公司
客户服务电话:95597
网址:www.htsc.com.cn

2. 湘财证券股份有限公司
客服电话:95351
网址:www.xcsc.com

3.中信建投证券股份有限公司
客服电话:95587/4008-888-108
网址:www.csc108.com

4.中信证券股份有限公司
客服电话:95548
网址:www.cs.ecitic.com

5.中信证券(山东)有限责任公司
客服电话:95548
网址:sd.citics.com

6.中信证券华南股份有限公司
客服电话:95548
网址:www.gzs.com.cn

7.鹏扬基金管理有限公司
客户服务电话:400-968-6688
网址:www.pyamc.com

风险提示: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。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,全面认识基金产品的风险收益特征,在了解产品情况及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。基金管理人提醒投资者基金投资的"买者自负"原则,在投资者作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行负责。

特此公告。

鹏扬基金管理有限公司
2023年6月8日

鹏扬中债-30年期国债交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务公告

1. 公告基本信息

基金名称	鹏扬中债-30年期国债交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	鹏扬中债-30年期国债ETF
基金主代码	511090
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023年5月19日
基金管理人名称	鹏扬基金管理有限公司
基金托管人名称	招商银行股份有限公司
基金注册登记机构名称	中国证券登记结算有限责任公司
公告依据	《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》等相关法律、法规的规定以及《鹏扬中债-30年期国债交易型开放式指数证券投资基金基金合同》(以下简称"基金合同")、《鹏扬中债-30年期国债交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》(以下简称"招募说明书")等。
申购起始日	2023年6月13日
赎回起始日	2023年6月13日

注:场内简称:30年国债(扩位简称:30年国债ETF)

2. 日常申购、赎回业务的办理时间

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,若出现新的证券交易市场、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》的有关规定在规定媒介上公告。

3. 日常申购业务

3.1 申购金额限制

投资者申购的基金份额需为最小申购赎回单位的整数倍。本基金最小申购赎回单位为1万份。基金管理人可根据基金运作情况、市场情况、投资人需求等因素对基金的最小申购赎回单位进行调整并提前公告。

基金管理人可设定本基金当日申购份额上限,并在申购赎回清单中公告。该项调整只需在当日基金申购赎回清单上公布,而不必另行在规定媒介上公告。

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份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。

基金管理人可在法律法规允许的情况下,调整上述申购的数量限制。基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

3.2 申购费率

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

4. 日常赎回业务

4.1 赎回份额限制

投资者赎回的基金份额需为最小申购赎回单位的整数倍。本基金最小申购赎回单位为1万份。基金管理人可根据基金运作情况、市场情况、投资人需求等因素对基金的最小申购赎回单位进行调整并提前公告。

基金管理人可设定本基金当日赎回份额上限,并在申购赎回清单中公告。该项调整只需在当日基金申购赎回清单上公布,而不必另行在规定媒介上公告。

基金管理人可在法律法规允许的情况下,调整上述赎回的数量限制。基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

4.2 赎回费率

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

5. 基金销售机构

本基金的申购赎回代理券商(一级交易商)名单如下:安信证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、申万宏源西部证券有限公司、申万宏源证券有限公司、中国银河证券股份有限公司、中泰证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中信证券华南股份有限公司、中信证券(山东)有限责任公司。

基金管理人可根据情况变更或增减申购赎回代理券商,并予以公告。

投资者办理本基金申购、赎回业务的具体流程、规则等以及各销售机构的业务办理状况,请参照各申购赎回代理证券公司的规定执行。

6. 基金份额净值公告的披露安排

《基金合同》生效后,在基金上市交易前且未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规定网站披露一次基金份额净值和基金份额累计净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回或基金上市交易后,基金管理人应当在不晚于每个开放日/交易日的次日,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/交易日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日,在规定网站披露半年度和年度最后一日的基金份额净值和基金份额累计净值。

7. 其他需要提示的事项

(1)申购与赎回的原则
1)采用"份额申购"和"份额赎回"的方式,即申购和赎回均以份额申请;
2)本基金的申购对价、赎回对价包括组合证券、现金替代、现金差额和/或其他对价;
3)申购、赎回申请提交后不得撤销;
4)申购、赎回应遵守《业务规则》的规定;
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。

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,或依据上海证券交易所、登记结算机构相关规则及其变更调整上述原则。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。

(2)申购与赎回的程序

1)申购和赎回的申请方式

投资人必须根据申购赎回代理券商规定的程序,在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

投资人在提交申购申请时,须根据申购赎回清单备足申购对价,基金份额持有人提交赎回申请时,必须持有足够的基金份额余额和现金,否则所提交的申购、赎回申请无效。投资人办理申购、赎回等业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守基金合同和招募说明书规定的前提下,以各申购赎回代理机构的具体规定为准。

2)申购和赎回申请的确认

投资人申购、赎回申请在受理当日进行确认。如投资人未能提供符合要求的申购对价,则申购申请失败。如投资人持有的符合要求的基金份额不足或未能根据要求准备足额的现金,或本基金投资组合内不具备足额的符合要求的赎回对价,或投资人提交的赎回申请超过基金管理人设定的当日净赎回份额上限、当日累计赎回份额上限、单个账户当日净赎回份额上限或单个账户当日累计赎回份额上限,则赎回申请失败。

申购赎回代理券商受理申购、赎回申请并不代表该申购、赎回申请一定成功。申购、赎回的确认以登记结算机构的确认结果为准。投资人应及时查询有关申请的确认情况,否则,如因申请未得到登记结算机构的确认而造成的损失,由投资人自行承担。

3)申购和赎回的清算交收与登记

本基金申购赎回过程中涉及的基金份额、组合证券、现金替代、现金差额及其他对价的清算交收与登记规则适用上海证券交易所、登记结算机构的相关规定和参与各方相关协议及其不时修订的有关规定。

本基金的申购、赎回业务采用净额结算方式,即基金份额、上海证券交易所上市成份券的现金替代采用净额结算,申购赎回业务涉及的现金差额和现金替代退补款采用代收代付。

投资者T日申购成功后,登记结算机构在T日收市后为投资者办理上海证券交易所上市的成份券的交收、基金份额的交收登记以及现金替代的清算;在T+1日办理现金替代的交收以及现金差额的清算;在T+2日办理现金差额的交收,并将结果发送给申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。

投资者T日赎回成功后,登记结算机构在T日收市后为投资者办理基金份额的注销、上海证券交易所上市的成份券的交收以及现金替代的清算;在T+1日办理现金替代的交收以及现金差额的清算;在T+2日办理现金差额的交收,并将结果发送给申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。

如果登记结算机构和基金管理人在清算交收时发现相关参与方不能正常履约的情形,则依据《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》等业务规则和参与各方相关协议的有关规定进行处理。

投资人应按照基金合同的约定和申购赎回代理券商的规定按时足额支付应付的现金差额和现金替代退补款。因投资人原因导致现金差额或现金替代退补款未能按时足额交收的,基金管理人有权为基金的利益向该投资人追偿并要求其承担由此导致的其他基金份额持有人或基金资产的损失。

4)如上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司修改或更新上述规则并适用于本基金的,则基金管理人按照新的规则执行,并在招募说明书中进行更新。

5)在不违反法律法规、证券交易所及登记结算机构规定且对基金份额持有人权益无实质不利影响的情况下,基金管理人可对上述申购与赎回的程序、办理时间及方式、处理规则等进行调整,并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。

(3)申购和赎回的对价

1)T日的基金份额净值在当天收市后计算,并在 T+1 日公告,计算公式为计算日基金资产净值除以计算日发售在外的基金份额总数。如遇特殊情况,经履行适当程序,可以适当延迟计算或公告。

2)申购对价、赎回对价根据申购赎回清单和投资人申购、赎回的基金份额数额确定。申购对价是指投资人申购基金份额时应交付的组合证券、现金替代、现金差额和/或其他对价。赎回对价是指基金份额持有人赎回基金份额时,基金管理人应交付的组合证券、现金替代、现金差额和/或其他对价。

申购赎回清单由基金管理人编制。T日的申购赎回清单在当日上海证券交易所开市前公告。申购赎回清单的内容与格式见招募说明书。

(4)本公告仅对本基金开放申购、赎回事项予以说明。投资者欲了解本基金的详细情况,请通过本公司网站(www.pyamc.com)查阅本基金的基金合同和招募说明书等法律文件。

(5)对未开设销售网点地区的投资者及希望了解本公司旗下管理基金其他有关信息的投资者,可拨打本公司的客户服务电话(400-968-6688)垂询相关事宜。

(6)本基金将自2023年6月13日起在上海证券交易所上市交易,投资者可通过本公司网站查询本公司于2023年6月8日发布的《鹏扬中债-30年期国债交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书》了解相关信息。

(7)风险提示: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财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。敬请投资人注意投资风险。投资人投资于本基金前应认真 阅读本基金的《基金合同》、《招募说明书》等法律文件。

特此公告。

鹏扬基金管理有限公司
2023年6月8日