

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份额发售公告

重要提示

1、鹏扬中证数字经济主题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2021年10月28日证监许可[2021]2242号文准予注册。

2、本基金是交易型开放式、股票型指数证券投资基金。

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),基金托管人为招商银行股份有限公司,本基金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、合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者。

5、本基金自2021年12月6日至2021年12月17日发售。本基金的投资者可选择网上现金认购、网下现金认购两种方式。网上现金认购的日期为2021年12月16日至2021年12月17日;网下现金认购的日期为2021年12月6日至2021年12月17日。如上海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。

6、本基金网上现金发售通过具有基金销售业务资格及上海证券交易所会员资格的证券公司办理。

7、本基金的网下现金认购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“八、本次募集有关当事人或中介机构(三)基金份额发售机构”。

8、投资人认购本基金时需具有上海证券账户,即在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司开立的上海证券A股账户或上海证券投资基金账户。上海证券投资基金账户只能进行基金份额的网上现金认购、网下现金认购及二级市场交易,如投资人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基金的场内申购赎回的,则应开立并使用上海证券账户。

9、本基金认购费用或认购佣金不高于0.80%。

10、募集规模上限

本基金网上现金认购和网下现金认购合计首次募集规模上限为50亿元人民币(不包括募集期间利息和认购费用,下同)。

本基金募集过程中,网上现金认购和网下现金认购合计首次募集规模接近,达到或超过50亿元人民币的,基金提前结束募集,下一个工作日之后不再接受新的网上现金认购,网下现金认购。

在募集期间内任何一天(含第一天)当募集截止时间后网上现金认购和网下现金认购合计累计有效认购申请份额总额超过50亿份(折合为金额50亿元人民币),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。未确认部分的认购款项将在募集期结束后退还给投资者。

网上现金认购和网下现金认购合计末日认购申请确认比例的计算方法如下:

网上现金认购和网下现金认购合计末日认购申请确认比例=(50亿份-末日之前网上现金认购和网下现金认购合计有效认购申请份额总额)/末日网上现金认购和网下现金认购合计有效认购申请份额总额。

末日投资者网上现金认购或网下现金认购申请确认份额=末日提交的有效网上现金认购或网下现金认购申请份额×网上现金认购和网下现金认购合计末日认购申请确认比例。

“末日之前网上现金认购和网下现金认购合计有效认购申请份额总额”和“末日网上现金认购和网下现金认购合计有效认购申请份额总额”都不包括募集期间利息和认购费用。

当发生部分确认时,本基金登记结算机构按照末日认购申请确认比例对末日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,最终确认的基本金网上现金和网下现金累计有效认购份额(不包括募集期间利息和认购费用)可能会略微超过50亿份。末日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。

11、投资者在认购本基金时,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,投资人可以在当日接受认购申报的时段内撤销认购申请,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。

12、销售机构对认购申请的受理不表示对该申请的成功确认,而仅代表销售机构确实收到了认购申请。认购的确认以登记机构的确认为准。投资人可以在基金合同生效后到各销售机构查询最终确认情况和有效认购份额。基金管理人及销售机构不承担对确认结果的通知义务,投资人本人主动查询认购申请的确认结果。

13、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上海证券交易所上市交易。上市交易的有关事项将另行公告。

14、本公司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,请详细阅读刊登在本公司官网(www.pyamc.com)和中国证监会基金电子披露网站(<http://eid.cscc.gov.cn/fund>)上《鹏扬中证数字经济主题交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》。

15、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。

16、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。

17、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。

18、本公司会综合各种情况对本基金的发售安排做适当调整,并可根据基金销售情况适当延长、缩短或调整基金发售时间,并及时公告。

19、本基金募集结束后,基金管理人确定本基金的申购赎回代理券商名单,报上海证券交易所,经上海证券交易所相关部门认可后,在基金管理人网站公示。基金上市后,指定交易未在申购赎回代理券商的投资人只能进行本基金的二级市场买卖,如投资人需进行本基金申购赎回交易,须指定交易或转指定交易到申购赎回代理券商。

20、风险提示

(1)本基金标的指数为中证数字经济主题指数,其从沪深市场中选取涉及数字经济基础设施和数字化程度较高的应用领域上市公司证券作为指数样本,以反映沪深市场数字经济主题上市公司证券的整体表现。

1)样本选取方法

A、样本空间

同中证全指指数的样本空间

B、选择方法

(a)对样本空间内证券按照过去一年的日均成交金额由高到低排名,剔除排名后20%的证券;

(b)在剩余证券中,选取涉及以下数字经济相关业务的上市公司证券作为待选样本:基础设施领域:通信设备、电子设备、电脑与外围设备、半导体等;

主要应用领域:线上购物、快递物流、影视娱乐、网络游戏、视频直播、在线教育、远程医疗、车联网等;

(c)在上述待选样本中,根据基础设施领域和主要应用领域证券的过去一年日均总市占比分布样本数量。分别在基础设施领域和主要应用领域内,按照过去一年日均总市占比分布样本数量,合计选取50只证券作为指数样本。

2)指数计算

指数计算公式为:

报告期指数=报告期样本的调整市值÷除数×1000

其中,调整市值=(∑证券价格×调整股本数×权重因子)。调整股本数的计算方法,除数修正方法参见计算与维护细则。权重因子介于0和1之间,以使单个样本权重不超过10%。

投资人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:<http://www.csindex.com.cn/z-CN/indicies/index-detail/931582>

(2)本基金投资于中证数字经济主题指数成份股及备选成份股的资产不低于基金资产净值的90%,且不低于非现金基金资产的80%,其投资目标是紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场价格波动等因素产生波动,投资人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。

本基金投资风险包括:市场风险、信用风险、管理风险、流动性风险、操作和技术风险、合规性风险、ETF特有的风险、投资股指期货、国债期货、股票期权的风险、投资资产支持证券的风险、参与融资及转融通证券出借业务的风险以及其他风险。本基金的特有风险包括:标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、标的指数波动的风险、跟踪误差未达约定目标的风险、标的指数变更的风险、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、IOPV计算错误的风险、申购赎回清单差错风险、退市风险、退补现金替代方式的风险、投资人申购失败的风险、投资人赎回失败的风险、基金份额赎回对价的变现风险、基金在二级市场的流动性风险、指数编制机构停止服务风险、成分股停牌或违约的风险、第三方机构服务的风险等等,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。

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。

本基金可投资股指期货和国债期货,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,相关行情稍微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,可能给投资人带来重大损失。

本基金可根据投资策略需要或不同配置地的市场环境的变化,选择将部分基金资产投资于内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(以下简称港股通标的股票)或选择不将基金资产投资于港股通标的股票,基金资产并非必投资港股通标的股票。投资港股通标的股票可能使本基金面临港股通交易机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险,包括但不限于:港股市场股价波动较大的风险(港股市场实行T+0日买卖交易,且对个股不设涨跌幅限

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

二〇二一年十一月

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:10210002153

3)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:91101535900000022

大额支付号:3101000000010

(5)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,而需使用上海A股账户卡或上海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:2021年12月6日-2021年12月17日(周六、周日和节假日不受理),具体业务办理时间由发售代理机构确定。

(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;投资人可多次认购,累计认购份额不设上限。

(3)认购手续:投资者直接通过发售代理机构办理认购。

1)开立上海A股账户或上海证券交易所证券投资基金账户。

2)在认购前向基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。

四、过户登记

(一)本基金募集期间募集的资金应当存入专门账户,在基金募集行为结束前,任何人不得动用。

(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。

基金募集届满基金备案条件的,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。

如基金募集届满未达到基金合同的生效条件,则基金募集失败。基金管理人应以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用;在基金募集届满后30日内返还投资者已缴纳的认购款项,并加计银行同期存款利息。

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:北京西城区复兴门外大街A2号中化大厦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:招商银行股份有限公司

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

基金托管业务批准文号:证监基金字[2002]83号

注册资本:252.20亿元

存续期间:持续经营

电话:0755-83199084

资产托管部信息披露负责人:张燕

(三)基金份额发售机构

1、发售代理人

华泰证券股份有限公司

2、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:申屠涓涓

传真:010-81922890

3、网下现金发售代理机构

网上现金发售通过具有基金销售业务资格的上海证券交易所会员单位办理,具体名单可在上海证券交易所网站查询。

4、网下现金发售代理机构

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

5、基金管理人可根据有关法律法规,选择其他符合要求的机构代理发售本基金,并及时公告。

(4)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1