

鹏华基金管理有限公司关于以通讯方式召开鹏华中证500指数证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会的第二次提示性公告

鹏华基金管理有限公司已于2023年7月31日在中国证监会规定媒介发布了《鹏华基金管理有限公司关于以通讯方式召开鹏华中证500指数证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会的公告》,并于2023年8月1日在中国证监会规定媒介发布了《鹏华基金管理有限公司关于以通讯方式召开鹏华中证500指数证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会的第一次提示性公告》。为了本次基金份额持有人大会顺利召开,现发布关于召开本次基金份额持有人大会的第二次提示性公告。

一、召开基金份额持有人大会的基本情况
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500指数证券投资基金（LOF）基金合同》的有关规定,鹏华中证500指数证券投资基金（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“基金管理人”）与中国工商银行股份有限公司（以下简称“基金托管人”）一致,决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会,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2023年8月4日起至2023年9月10日17:00止（投票表决时间以本公告列明的通讯表决的送达地点收到表决票的时间为准）。
- 3.会议通讯表决的送达地点: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:宋海威
联系电话:0755-82825931
请在信封背面注明:“鹏华中证500指数证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会”字样。
- 4.会议咨询电话:400-6788-533
- 5.会议审议事项
《关于鹏华中证500指数证券投资基金（LOF）修改基金合同等相关事项的议案》（见附件一）。

上述议案的内容说明详见《关于鹏华中证500指数证券投资基金（LOF）修改基金合同等相关事项的议案的说明》（见附件二）。

三、基金份额持有人大会的授权登记日
本次大会的授权登记日为2023年8月3日,即在2023年8月3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基金公章或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公章的复印件）,开户证明或授权登记证书复印件等;合格机构投资者投资者可自行投票的,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有效身份证件复印件,该合格机构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机构投资者签署表决票的其他证明文件,以及该合格机构投资者投资者的营业执照、商业登记证或者者其他有效注册证明文件并取得该合格机构投资者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,以及填写的授权委托书原件（参照附件四）。如代理人个人,还需提供代理人个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公章的复印件）,开户证明或授权登记证书复印件等;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投资者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公章的复印件）,开户证明或授权登记证书复印件等;合格境外机构投资者投资者使用授权委托书的,应由代理人在表决票上加盖合格境外机构投资者投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册证明文件,以及取得合格境外机构投资者投资者的资格证明文件的复印件,以及填写的授权委托书原件。如代理人个人,还需提供代理人个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公章的复印件）,开户证明或授权登记证书复印件等;

(4)基金份额持有人或其代理人需将填写的表决票和所需的相关文件在2023年8月4日,至2023年9月10日17:00止的期间内投入专人送达、快递或邮寄号信筒的方式送达至本公告列明的通讯表决票的送达地点,并请在信封背面注明:“鹏华中证500指数证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会表决方式”。

上述时间以本公告列明的通讯表决票的送达地点收到表决票的时间为准,即:专人送达的以实际送达时间为准;快递送达的,以基金管理人签收时间为准;以邮寄号信筒方式送达的,以挂号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（中国工商银行股份有限公司）授权的监督下于本次通讯会议表决截止日（即2023年9月10日）后2个工作日内进行计票,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,所提供文件符合本次会议通知规定,且在规定时间内送达本公告列明的通讯表决票的送达地点的,为有效表决票;有效表决票按表决意见计入相应人的表决结果,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、无法辨认或意见无效判断或相互矛盾,但其各项有效表决意见通知规定的,视为弃权表决,计入有效表决票;并“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)如基金份额持有人的签字或盖章部分不完整、不清的,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,或未能在规定时间内送达本公告列明的通讯表决票的送达地点的,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,则按照下列原则处理:
①送达时间不是同一天的,以最后送达日所填写的有效表决票为准,先送达的表决票视为撤回;
②送达时间同一天的,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“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50%以上（含50%）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500指数证券投资基金（LOF）修改基金合同等相关事项的议案》应当由出具表决意见的基金份额持有人或其代理人所持表决权的50%以上（含50%）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议自表决通过之日起生效。法律法规另有规定的,从其规定。
七、二次召集基金份额持有人大会及二次决议
根据《基金法》及《鹏华中证500指数证券投资基金（LOF）基金合同》的规定,本次基金份额持有人大会需要出具表决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50%（含50%）方可召开。根据《基金法》的规定,若出具表决意见的基金份额持有人或其代理人在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的50%,召集人可以在规定时间内就原审议事项重新召集基金份额持有人大会。若二次召集基金份额持有人大会,除非授权文件另有授权,本次基金份额持有人大会授权期届满基金份额持有人作出的各类授权依然有效,但如果授权方式发生变化或者基金份额持有人重新作出授权,则以前最新方式或最新授权为准,详细说明见届时发布的重新召集基金份额持有人大会的通知。
八、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:宋海威
联系电话:0755-82825931
网址:www.phfund.com.cn
2.基金托管人:中国工商银行股份有限公司
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
九、重要提示
1.请基金份额持有人提交表决票时,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）查询,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（免长途费）咨询。
3.为保护基金份额持有人利益,本基金将对基金份额持有人大会会议（2023年9月11日）上午9时起至持有人大会决议生效公告日上午10:30停牌,10:30后复牌。敬请基金份额持有人关注本基金停牌期间的流动性风险。
4.本公告的有关内容均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
2023年8月2日

附件一:《关于鹏华中证500指数证券投资基金（LOF）修改基金合同等相关事项的议案》

附件二:《关于鹏华中证500指数证券投资基金（LOF）修改基金合同等相关事项的议案的说明》

附件三:《鹏华中证500指数证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会通讯表决票》

附件四:《授权委托书》

附件五:变更注册后《鹏华中证500指数证券投资基金（LOF）基金合同》（草案）

附件一:《关于鹏华中证500指数证券投资基金（LOF）修改基金合同等相关事项的议案》

鹏华中证500指数证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会二次决议
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500指数证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称“基金合同”）的有关规定,鹏华中证500指数证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）的基金管理人鹏华基金管理有限公司与中国工商银行股份有限公司协商一致,提议修改本基金《基金合同》相关内容,内容包括调整投资范围、投资策略、投资限制、业绩比较基准、估值方法、基金费用的计提方法和支付方式、基金存续条款、收益分配条款等相关事项,并据此对上述调整需要及法律法规要求和基金实际运作需要,对《基金合同》进行修改。具体说明如下:关于《鹏华中证500指数证券投资基金（LOF）修改基金合同等相关事项的议案的说明》

本议案如修改基金份额持有人大会审议通过,基金管理人将根据基金份额持有人大会决议对《基金合同》进行修改。本基金的招募说明书及托管协议也将进行必要的修改或补充。
以上议案,准予审议。
基金管理人:鹏华基金管理有限公司

附件二:《关于鹏华中证500指数证券投资基金（LOF）修改基金合同等相关事项的议案的说明》

一、说明
1.为了适应市场形势的发展,更好地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》和《鹏华中证500指数证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称“基金合同”）的有关规定,鹏华中证500指数证券投资基金（LOF）基金管理人鹏华基金管理有限公司、基金托管人中国工商银行股份有限公司一致,决定召开基金份额持有人大会,审议如下议案:变更注册后《鹏华中证500指数证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称“基金合同”）,并授权其对本基金的投资价值和市场价格做出实质性判断或保证,但不表明其对本基金没有投资风险。基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,但不保证投资本基金一定盈利,也不保证最低收益。
投资者应当认真阅读招募说明书、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。

二、调整资产配置方式
1.调整投资范围及投资比例并相应修改和补充投资策略
变更前注册后:
“本基金投资于具有良好流动性的金融工具,主要投资于中证500指数的成份股及其备选成份股（含存托凭证）,投资比例不低于基金资产净值的90%。现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外,为更好的实现投资目标,本基金可少量投资于中证500成份股（含存托凭证）新股（含存托凭证,首次发行或增发等）以及法律法规及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。”
变更后注册后:
“本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括标的指数成份股及其备选成份股（均含存托凭证）,为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于部分非成份股（包含主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、存托凭证、债券（含国债、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、可交换债券等）、债券回购、银行存款、货币市场工具、资产支持证券、股指期货以及法律法规和中国证监会允许的基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。”
如法律法规或监管机构以后允许本基金投资的其他品种,基金管理人可在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:投资于标的指数成份股及备选成份股（均含存托凭证）的比例不低于基金资产净值的90%且不低于非现金基金资产的90%,每个交易日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或监管部门以后允许变更的,本基金在履行适当程序后可以变更后的比例为准,本基金的投资比例可不做相应调整。”

2.调整业绩比较基准
变更前注册后:
“中证500指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%”
变更后注册后:
“中证500指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%”

3.调整基金费用的计提方法和支付方式
变更前注册后:
管理费:基金管理费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人支付,经基金管理人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休等,支付日期顺延。
托管费:基金托管费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人支付,经基金管理人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、公休等,支付日期顺延。

管理费:基金管理费每日计提,按月支付,由基金管理人向基金托管人支付,经基金管理人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休等,支付日期顺延。
托管费:基金托管费每日计提,按月支付,由基金管理人向基金托管人支付,经基金管理人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休等,支付日期顺延。

三、《基金合同》生效后,基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5,000万元的,基金管理人应当向中国证监会报告;连续20个工作日出现前述情形的,基金管理人应当向中国证监会说明原因并报送法律法规。”
变更后注册后:
“《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,如持续停牌、转换运作方式、与其他基金合并或终止基金合同等,并在6个月内召集基金份额持有人大会。”

5.调整收益分配方式
变更前注册后:
“1.在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为6次,每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的20%,若《基金合同》生效不满3个月不进行收益分配;”
变更后注册后:
“1.在符合有关基金分红条件的前提下,本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配,具体分配方案以公告为准,若《基金合同》生效不满3个月不进行收益分配;”
除上述内容的调整以外,考虑到自《基金合同》生效后与相关法律法规持续兼容和实际情况,基金管理人拟根据有效的法律法规要求,变更后鹏华中证500指数证券投资基金（LOF）的产品特征和实际操作需求,以及基金管理人、基金托管人的信息更新,相应修改《基金合同》的相关内容。具体修改内容及详见附件五。

三、《关于鹏华中证500指数证券投资基金（LOF）修改基金合同等相关事项的议案》的主要风险及预防措施
（一）修改基金合同的风险
《关于鹏华中证500指数证券投资基金（LOF）修改基金合同等相关事项的议案》存在被基金份额持有人大会否决的风险。
在修改基金合同的公告之前,本基金管理人已对持有人进行了走访,认真听取了持有人意见,拟定议案充分考虑了持有人的意见。议案公告后,我们将再次仔细征求意见。如有必要,基金管理人将根据持有人的意见,对修改基金合同的方案进行修订并重新公告。基金管理人可在必要情况下,预留出足够的时间,以做二次召集或推迟基金份额持有人大会召开的充分准备。
如修改基金合同的方案未获得基金份额持有人大会批准,基金管理人计划按照有关规定向基金份额持有人大会提交《基金修改基金合同等方案》的议案。
（二）基金修改基金合同前后可能遭遇大规模赎回的风险
为应对修改基金合同前后可能遭遇大规模赎回的风险,本基金在修改基金合同期间将尽可能保证投资组合的流动性,降低净值波动率。

鹏华中证500指数证券投资基金（LOF）
基金份额持有人大会通讯表决票

基金份额持有人姓名/名称:
证件号码（身份证/营业执照注册号）:
开放式基金账户号/券商账户号:

关于鹏华中证500指数证券投资基金（LOF）修改基金合同等相关事项的议案
我/我们同意/不同意/弃权
基金份额持有人/受托人（代理人）（签字或盖章）
日期:2023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/券商账户下持有的本基金全部份额做出表决意见。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、无法辨认或意见无效判断或相互矛盾,但其他各项有效表决意见对应的表决票均视为基金份额持有人放弃表决权,其所持基金份额的各项结果均计为“弃权”。
3.本次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
被委托人姓名/女士或/机构代表本人（或本人）参加以通讯方式召开的鹏华中证500指数证券投资基金（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。若在上述时间就同一议案重新召开鹏华中证500指数证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会,除本人（或本人机构）重新作出授权外,本授权继续有效。
委托人（签字/盖章）:
受托人身份证件号或营业执照注册号:
开放式基金账户号/券商账户号:
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:2023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/券商账户下持有的本基金全部份额的受托人授权权。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.此授权委托书书在基金管理人网站（www.phfund.com.cn）、中国证监会基金电子披露网站（http://eid.csrc.gov.cn/fund）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:变更注册后《鹏华中证500指数证券投资基金（LOF）基金合同》（草案）

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,其与基金合同的相关涉及基金合同当事人之间权利义务关系的任何文件及表述,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。基金投资人自愿认/申购取得基金份额,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500指数证券投资基金（LOF）由基金管理人依照《基金法》、基金合同及其他有关规定募集,并经中国证监会备案（以下简称“中国证监会”）核准。
中国证监会对基金募集的核准及后续变更注册,并不表明其对本基金的投资价值和市场价格做出实质性判断或保证,也不表明其对本基金没有投资风险。
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,但不保证投资本基金一定盈利,也不保证最低收益。
投资者应当认真阅读招募说明书、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。

一、基金名称
鹏华中证500指数证券投资基金（LOF）

二、基金类别
股票型证券投资基金

三、基金运作方式
上市型开放式（LOF）

四、上市交易所
深圳证券交易所

五、标的指数
中证500指数

六、基金的投资目标
本基金采用指数化投资方式,追求基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间的跟踪误差最小化,力争将日均跟踪偏离度控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内,以实现对中国中证500指数的有效跟踪。

七、基金存续期限
不定期

八、基金份额类别

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及强制性规定不一致,应当以届时有效的法律法规及规范性文件为准。
六、本基金的投资范围包括存托凭证,除与其他投资于股票的基金所面临的共同风险外,还本基金投资于存托凭证的,本基金还将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险,以及与中国存托凭证发行机制相关的风险。
七、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。

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. 本基金基金:指鹏华中证500指数证券投资基金（LOF）

2. 基金管理人:指鹏华基金管理有限公司

3. 基金托管人:指中国工商银行股份有限公司

4. 基金合同:指本基金合同及《鹏华中证500指数证券投资基金（LOF）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500指数证券投资基金（LOF）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500指数证券投资基金（LOF）招募说明书》及其更新

7. 基金产品资料概要:指《鹏华中证500指数证券投资基金（LOF）基金产品资料概要》及其更新

8. 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

9. 《基金法》:指2003年10月29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次会议修订,并于2013年6月1日起实施,并经2015年11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〈中华人民共和国民法》等七部法律的决定》修订的《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

10. 《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

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

14. 《指数基金指引》:指《指数基金指引》于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

15. 中国证监会:指中国证监会

16. 银行业监督管理机构:指中国人民银行和/或中国银行保险监督管理委员会

17. 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

18. 个人投资者:指根据有关法律法规规定投资于证券投资基金的自然人

19. 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受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

20. 合格境外投资者:指符合合格境外机构投资者人民币合格境外机构投资者境内证券期货投资管理办法》及相关法规规定,使用来自境外的外汇进行境内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

21. 投资人、投资者:指个人投资者、机构投资者、合格境外投资者以及法律法规和中国证监会允许投资证券投资基金的合格投资者的合称

22. 基金份额持有人:指依据基金合同和招募说明书约定取得基金份额的投资人

23. 基金销售机构:指基金管理人、销售机构及基金销售代理机构
24. 基金销售费用:指基金管理人及销售机构向投资人推介、销售基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务

24. 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,可以办理基金销售业务的其他机构,以及通过深圳证券交易所办理基金业务的会员单位。其中,通过深圳证券交易所办理基金销售业务的其他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

25. 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

26. 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、赎回和上市交易等业务的场所。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

27. 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验证、基金份额持有人信息的确认、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

28. 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

29. 基金认购:指投资者认购证券投资基金基金份额的行为

30. 基金申购赎回:指投资者通过深圳证券交易所交易系统或基金管理人直销渠道申购、赎回基金份额的行为

31. 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,清算结果经中国证监会备案并予以公告的日期

32. 存续期:指基金合同生效至终止之间的不定期期限

33. 工作日:指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

34. 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

41. T+n日:指自T日起第n个工作日（不包含T日）

42. 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

43. 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

44. 上市交易:指基金份额在深圳证券交易所交易所以集中竞价的方式买卖基金份额的行为

45. 《业务规则》:指本基金管理人、深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司及销售机构的相关业务规则及其不时做出的修订

46. 申购:指基金份额持有人按照基金合同和招募说明书规定的条件要求将基金份额转换为基金份额的行为

47. 赎回:指基金份额持有人按照基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件,申请将其持有基金份额管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金份额的行为

48. 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

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

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

52. 定期定额投资计划:指投资者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扣款及受理基金申购申请的一种投资方式

53. 巨额赎回:指本基金单个开放日,基金净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换转出申请份额总数后扣除申购份额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%

54. 元:指人民币元

55. 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、已实现的其他合法收入及运用基金资产带来的成本和费用的节约

56. 基金资产总值:指基金拥有的各类有价证券、银行存款、基金应收申购款及其他资产的价值总和

57. 基金资产净值:指基金资产总值减去基金负债后的价值

58. 基金份额净值:指基金份额净值除以计算日基金份额总额

59. 基金产品估值: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

60. 规定规模: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. 销售服务费:指从基金财产中计提的,用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务费用,该笔费用从A类基金份额基金资产中计提

62. 基金份额类别:指本基金根据申购费用、销售服务费用收取方式等不同,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,但不从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为A类基金份额;在投资人申购时不收取申购费用,但从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为A类基金份额。本基金A类基金份额持有人可以通过上市交易、场外申购赎回、场内申购赎回三种方式,实现基金份额的日常交易;C类基金份额通过场内上市交易,不开设场内申购、赎回的方式,投资者可以通过场外方式申购/赎回A类基金份额

63. 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、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

64. 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

65. 转融通证券出借业务:指本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投资基金业协会（以下简称“证券业公司”）出借证券,证券业公司到期归还出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,确保投资者按照约定净值进行交易,并避免因特定资产估值不确定性而对基金净值产生波动,从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响,最大限度降低赎回投资者等投资者遭受的损失

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) 摊余成本法且公允价值减值准备导致资产价值存在重大不确定性的资产;(3) 其他资产公允价值存在重大不确定性的资产

68. 不可抗力:指本基金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500指数证券投资基金（LOF）

二、基金类别
股票型证券投资基金

三、基金运作方式
上市型开放式（LOF）

四、上市交易所
深圳证券交易所

五、标的指数
中证500指数

六、基金的投资目标
本基金采用指数化投资方式,追求基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间的跟踪误差最小化,力争将日均跟踪偏离度控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内,以实现对中国中证500指数的有效跟踪。

七、基金存续期限
不定期

八、基金份额类别