

关于鹏华旗下上海证券交易所跨市场股票 ETF 结算模式调整并修改基金合同及招募说明书的公告

为促进沪市 ETF 的发展，上海证券交易所（以下简称“上交所”）联合中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）对沪市跨市场股票 ETF 的交易及申赎结算模式进行了调整优化。近期，上交所发布了《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则（2020 年修订）》，沪市跨市场股票 ETF 交易结算模式调整的主要内容为将其申购、赎回涉及的深市组合证券的现金替代改为采用多边净额结算，纳入中国结算担保交收，当日申购的跨市场股票 ETF 份额，同日即可卖出，当日申购未卖出的基金份额次一交易日起也可卖出。

根据上交所和中国结算对 ETF 交易结算模式的调整，鹏华基金管理有限公司（以下简称“本公司”）对旗下 4 只上海证券交易所跨市场股票 ETF 的交易结算模式进行调整，并修改基金合同及招募说明书。

一、适用基金范围

基金代码 场内简称 基金名称

512730 银行 FUND 鹏华中证银行交易型开放式指数证券投资基金

512690 酒 ETF 鹏华中证酒交易型开放式指数证券投资基金

512670 国防 ETF 鹏华中证国防交易型开放式指数证券投资基金

515633

（认购代码） 证保 ETF 鹏华中证 800 证券保险交易型开放式指数证券投资基金（募集中，仅修改招募说明书）

二、基金合同的修改

章节 修改前 修改后

全文修改 《中国证券登记结算有限责任公司关于上海证券交易所交易型开放式基金登记结算业务实施细则》

《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》

三、招募说明书的修改

章节 修改前 修改后

全文修改 《中国证券登记结算有限责任公司关于上海证券交易所交易型开放式基金登记结算业务实施细则》

《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》

重要提示

投资者申购的基金份额当日可卖出，当日未卖出的基金份额在份额交收成功之前不得卖出和赎回；即在目前结算规则下，T 日申购的基金份额当日可卖出，T 日申购当日未卖出的基金份额，T+1 日不得卖出和赎回，T+1 日交收成功后 T+2 日可卖出和赎回。因此为投资者办理申购业务的代理机构若发生交收违约，将导致投资者不能及时、足额获得申购当日未卖出的基金份额，投资者的利益可能受到影响。投资者申购的基金份额当日起可卖出，投资者赎回获得的股票当日起可卖出。

第十部分基金份额的申购与赎回

四、申购与赎回的程序

2、申购和赎回申请的确认

投资者申购的基金份额当日可卖出，当日未卖出的基金份额在份额交收成功之前不得卖出和赎回；即在目前结算规则下，T 日申购的基金份额当日可卖出，T 日申购当日未卖出的基金份额，T+1 日不得卖出和赎回，T+1 日交收成功后 T+2 日可卖出和赎回。投资者赎回获得的股票当日可卖出。 四、申购与赎回的程序

2、申购和赎回申请的确认

投资者申购的基金份额当日起可卖出，投资者赎回获得的股票当日起可卖出。

第十部分基金份额的申购与赎回

四、申购与赎回的程序

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适用《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》、《中国证券登记结算有限责任公司关于上海证券交易所交易型开放式基金登记结算业务实施细则》和参与各方相关协议的有关规定。对于本基金的申购业务采用净额结算和逐笔全额结算相结合的方式，其中上交所上市的成份股的现金替代、申购并当日卖出的基金份额涉及的深交所上市的成份股的现金替代采用净额结算，申购当日未卖出的基金份额涉及的深交所上市的成份股的现金替代采用逐笔全额结算；对于本基金的赎回业务采用净额结算和代收代付相结合的方式，其中上交所上市的成份股的现金替代采用净额结算，深交所上市的成份股的现金替代采用代收代付；本基金上述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，登记机构在 T 日收市后为投资者办理申购当日卖出基金份额与上交所上市的成份股的交收以及现金替代的清算；在 T+1 日办理申购当日未卖出基金份额与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机构、基金管理人和基金托管人。现金替代交收失败的，该笔申购当日未卖出基金份额交收失败。

投资者 T 日赎回成功后，登记机构在 T 日收市后为投资者办理基金份额的注销与上交所上市的成份股的交收以及现金替代的清算；在 T+1 日办理上交所上市的成份股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机构、基金管理人和基金托管人。基金管理人最迟于 T+3 日办理赎回的深交所上市的成份股现金替代的交付。

四、申购与赎回的程序

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适用相关业务规则和参与各方相关协议的有关规定。对于本基金的申购、赎回业务采用净额结算的方式，基金份额、上交所上市的成份股的现金替代、深交所上市的成份股的现金替代采用净额结算的方式，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，登记机构在 T 日收市后办理上交所上市的成份股交收与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，登记机构在 T 日收市后办理上交所上市的成份股交收与基金份额的注销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。

第十部分基金份额的申购与赎回

七、份额申购赎回清单的内容与格式

6、申购赎回清单的格式

七、份额申购赎回清单的内容与格式

6、申购赎回清单的格式

下列申购赎回清单仅为举例之用。基金管理人有权根据上海证券交易所的规则及业务需要对申购、赎回清单的格式进行修改，且予以公告，并在招募说明书更新时予以调整。

第十八部分风险揭示 投资者申购当日未卖出的基金份额在交收成功后方可卖出和赎回。因此为投资者办理申购业务的代理券商如发生交收违约，将导致投资者不能及时、足额获得申购当日未卖出的基金份额，投资者的利益可能受到影响。 删除

四、重要提示

1、上述 4 只 ETF 对交易结算模式的调整，自 2020 年 1 月 20 日起生效，基金合同及招募说明书对应内容相应修改。

2、2019年7月26日，中国证监会颁布了《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》”），并于2019年9月1日起正式施行。根据《信息披露办法》等法律法规规定，本公司拟同时对鹏华中证银行交易型开放式指数证券投资基金、鹏华中证酒交易型开放式指数证券投资基金及鹏华中证国防交易型开放式指数证券投资基金的《基金合同》中与信息披露相关的条款进行修订，并相应修订招募说明书等法律文件。

3、本次修订上述基金的基金合同及招募说明书事项系因法律法规的修订而作出，且对各自的基金份额持有人利益无实质性不利影响，符合相关法律法规及基金合同的规定，无需召开基金份额持有人大会。

4、本公司将在官方网站及中国证监会基金电子披露网站上公布经修改后的基金合同，并同时修订招募说明书进行相应修改。投资者可通过本公司客户服务中心或官方网站咨询有关详情。

本公司客户服务电话：400—6788—999/400—6788—533

本公司网站：www.phfund.com.cn

五、风险提示

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，但不保证上述基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现，投资者投资于上述基金时应分别认真阅读上述基金的基金合同、招募说明书等文件。敬请投资者留意投资风险。

特此公告。

鹏华基金管理有限公司

二〇二〇年一月十八日