

鹏华中证 5 年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要（更新）

编制日期：2024 年 06 月 26 日

送出日期：2024 年 06 月 28 日

本概要提供本基金的重要信息，是招募说明书的一部分。
作出投资决定前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。

一、产品概况

基金简称	5 年地债	基金代码	159972
基金管理人	鹏华基金管理有限公司	基金托管人	招商银行股份有限公司
基金合同生效日	2019 年 08 月 23 日	上市交易所及上市日期（若有）	深圳证券交易所 / 2019 年 11 月 08 日
基金类型	债券型	交易币种	人民币
运作方式	普通开放式	开放频率	每个开放日
基金经理	叶朝明	开始担任本基金基金经理的日期	2022 年 01 月 28 日
		证券从业日期	2007 年 07 月 23 日
	张羊城	开始担任本基金基金经理的日期	2023 年 11 月 17 日
		证券从业日期	2017 年 06 月 30 日
场内简称	5 年地债 ETF		
其他（若有）	《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，则自动终止基金合同并进入基金财产的清算程序，无须召开基金份额持有人大会审议。		

注：无。

二、基金投资与净值表现

（一）投资目标与投资策略

本部分请阅读《鹏华中证 5 年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》“基金的投资”了解详细情况。

投资目标	本基金将紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.25%，年化跟踪误差不超过 3%。
------	---

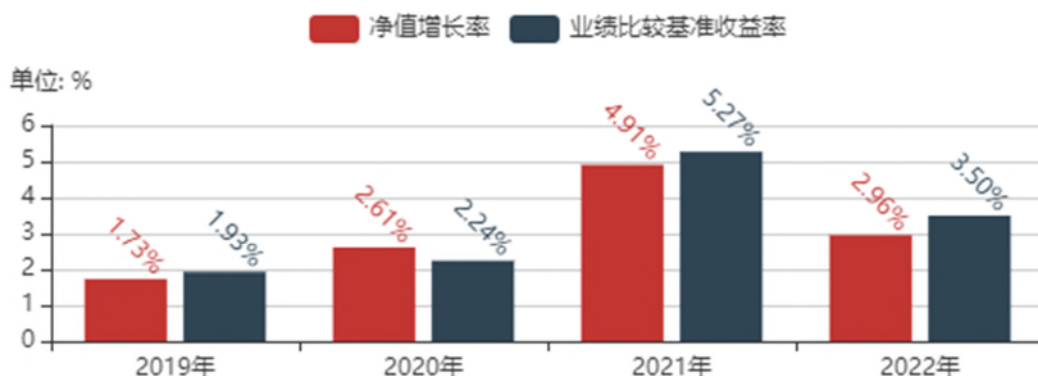
<p>投资范围</p>	<p>本基金标的指数为：中证5年期地方政府债指数。</p> <p>本基金主要投资于标的指数成份债券和备选成份债券。为更好地实现基金的投资目标，本基金还可以投资于国内依法发行上市的其他债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、央行票据、中期票据、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</p> <p>基金的投资组合比例为：在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份债券和备选成份债券的资产比例不低于基金资产净值的80%，且不低于非现金基金资产的80%。</p> <p>如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资比例会做相应调整。</p>
<p>主要投资策略</p>	<p>（一）分层抽样策略；（二）替代性策略；（三）债券投资策略；（四）资产支持证券投资策略。</p>
<p>业绩比较基准</p>	<p>中证5年期地方政府债指数收益率</p>
<p>风险收益特征</p>	<p>本基金属于债券型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。</p> <p>本基金属于指数基金，采用分层抽样复制策略，跟踪中证5年期地方政府债指数，其风险收益特征与标的指数所表征的债券市场组合的风险收益特征相似。</p>

（二）投资组合资产配置图表/区域配置图表



上述披露数据截止时间为2023年03月31日。

(三) 自基金合同生效以来/最近十年(孰短)基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图



合同生效当年按照实际存续期计算, 上述披露数据截止时间为2022年12月31日, 基金的过往业绩不代表未来表现。

三、投资本基金涉及的费用

(一) 基金销售相关费用

注: 投资者在申购或赎回基金份额时, 申购赎回代理机构可按照不超过 0.5% 的标准收取佣金。场内交易费用以证券公司实际收取为准。

(二) 基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除:

费用类别	收费方式/年费率或金额	收取方
管理费	0.15%	基金管理人和销售机构
托管费	0.05%	基金托管人
销售服务费	-	销售机构
审计费用	95000 元	会计师事务所
信息披露费	120000 元	规定披露报刊
指数许可使用费 (若有)	年费率为 0.02%, 标的指数许可使用费每日计算, 逐日累计至每季季末, 按季支付 (当季不足 25,000 元的, 按 25,000 元计算), 计费期间不足一季度的, 根据实际天数按比例计算。	指数编制公司
其他费用	按照国家有关规定和《基金合同》约定, 可以在基金财产中列支的其他费用	相关服务机构

注: 1、本基金交易证券等产生的费用和税负, 按实际发生额从基金资产扣除。

2、审计费用、信息披露费和指数许可使用费 (若有) 为基金整体承担费用, 非单个份额类别费用, 且年金额为预估值, 最终实际金额以基金定期报告披露为准。

(三) 基金运作综合费用测算

若投资者申购本基金份额, 在持有期间, 投资者需支出的运作费率如下表:

基金运作综合费率（年化）
0.23%

注：基金运作综合费率测算中的基金管理费率、托管费率、销售服务费率（若有）为基金现行合同费率，不含费率优惠，其他运作费用以最近一次基金年报披露的相关数据为基准测算。

四、风险揭示与重要提示

（一）风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。

投资有风险，投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。

1、本基金特定风险

（1）标的指数回报与债券市场平均回报偏离的风险

标的指数并不能完全代表整个债券市场。标的指数成份债券的平均回报率与整个债券市场的平均回报率可能存在偏离。

（2）标的指数波动的风险

标的指数成份债券的价格可能受到政治因素、经济因素、上市公司经营状况、投资人心理和交易制度等各种因素的影响而波动，导致指数波动，从而使基金收益水平发生变化，产生风险。

（3）基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

（4）标的指数变更的风险

尽管可能性很小，但根据基金合同规定，如出现变更标的指数的情形，本基金将变更标的指数。基于原标的指数的投资政策将会改变，投资组合将随之调整，基金的收益风险特征将与新的标的指数保持一致，投资人须承担此项调整带来的风险与成本。

（5）基金份额二级市场交易价格折溢价的风险

基金份额在证券交易所的交易价格受诸多因素影响，可能存在不同于基金份额净值的情形，即存在价格折溢价的风险。

（6）参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险

基金上市交易后，基金管理人将根据基金的运作情况决定是否进行本基金基金份额参考净值的计算与公告，并将提前公告。IOPV 与实时的基金份额净值可能存在差异，IOPV 计算可能出现错误，投资者若参考 IOPV 进行投资决策可能导致损失。

（7）退市风险

因本基金不再符合证券交易所上市条件被终止上市，或被基金份额持有人大会决议提前终止上市，导致基金份额不能继续进行二级市场交易的风险。

（8）跟踪误差控制未达约定目标的风险

（9）指数编制机构停止服务的风险

(10) 成份券停牌或违约的风险

(11) 投资人申购赎回失败的风险

本基金的申购、赎回清单中，可能仅允许对部分成份债券使用现金替代，且设置现金替代比例上限，因此，投资人在进行申购时，可能存在无法买入申购所需的足够的成份债券，导致申购失败的风险。

投资人在提出赎回申请时，如基金组合中不具备足额的符合条件的赎回对价，可能导致赎回失败的情形。

基金管理人可能根据成份债券市值规模变化等因素调整最小申购、赎回单位，由此可能导致投资人按原最小申购、赎回单位申购并持有的基金份额，可能无法按照新的最小申购、赎回单位全部赎回，而只能在二级市场卖出全部或部分基金份额。

基金还可能在申购赎回清单中设定申购份额上限（或赎回份额上限），如果投资者的申购（或赎回）申请接受后将使当日申购（或赎回）总份额超过申购份额上限（或赎回份额上限），则投资者的申购（或赎回）申请可能失败。

(12) 基金份额赎回对价的变现风险

本基金赎回对价主要为组合证券，在组合证券变现过程中，由于市场变化、部分成份债券流动性差等因素，导致投资人变现后的价值与赎回时赎回对价的价值有差异，存在变现风险。

(13) 资产支持证券风险

本基金投资品种包含资产支持证券品种，由于资产支持证券一般都针对特定机构投资者发行，且仅在特定机构投资者范围内流通转让，该品种的流动性较差，且抵押资产的流动性较差，因此，持有资产支持证券可能给组合资产净值带来一定的风险。另外，资产支持证券还面临提前偿还和延期支付的风险。

(14) 自动终止风险

若连续 60 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，本基金将自动终止，存在自动终止的风险。

2、普通债券型证券投资基金共有的风险，如系统性风险、非系统性风险、管理风险、流动性风险及其他风险等。

3、本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险。

(二) 重要提示

中国证监会对本基金的注册或核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

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，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人。

基金产品资料概要信息发生重大变更的，基金管理人将在三个工作日内更新，其他信息发生变更的，基金管理人每年更新一次。因此，本文件内容相比基金的实际情况可能存在一定的滞后，如需及时、准确获取基金的相关信息，敬请同时关注基金管理人发布的相关临时公告等。

因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，任何一方均有权将争议提交深圳国际仲裁院（深圳仲裁委员会），按照深圳国际仲裁院（深圳仲裁委员会）届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为深圳市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

五、其他资料查询方式

以下资料详见鹏华基金官方网站[www.phfund.com.cn][客服电话：400-6788-533]

- （1）基金合同、托管协议、招募说明书
- （2）定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告
- （3）基金份额净值
- （4）基金销售机构及联系方式
- （5）其他重要资料

六、其他情况说明

无。