

# 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分 ETF 调整替代金额处理程序的公告

为了更好地满足投资者的需求，根据相关法律法规及下述各基金的基金合同等有关规定，鹏华基金管理有限公司（以下简称“本公司”）经履行适当程序，决定自 2024 年 11 月 11 日起对旗下部分 ETF 的替代金额处理程序进行调整，并相应修改招募说明书相关条款。具体事项公告如下：

## 一、适用基金范围

基金代码	基金名称	场内简称
159972	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	5 年地债 ETF
159816	鹏华中证 0-4 年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金	0-4 地债 ETF

## 二、替代金额处理程序调整方案

项目	调整前	调整后
替代金额的处理程序	<p>T 日，基金管理人在申购赎回清单中公布现金替代保证金率，并据此收取替代金额。</p> <p>在 T 日后被替代的成份证券有正常交易的 2 个交易日（简称为 T+2 日）内，基金管理人将以收到的替代金额买入被替代的部分证券。T+2 日日终，若已购入全部被替代的证券，则以替代金额与被替代证券的实际购入成本（包括买入价格与交易费用）的差额，确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项；若未能购入全部被替代的证券，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本加上按照 T+2 日估值</p>	<p>T 日，基金管理人在申购赎回清单中公布现金替代保证金率，并据此收取替代金额。</p> <p>在 T 日后被替代的成份证券有正常交易的 1 个交易日（简称为 T+1 日）内，基金管理人将以收到的替代金额买入被替代的部分证券。基金管理人有权在 T+1 日内任意时刻以收到的替代金额代投资者买入小于等于被替代证券数量的任意数量的被替代证券，实际买入被替代证券的价格可能处于 T+1 日内较高的位置或处于最高价格，基金管理人对此不承担责任。基金管理人有权根据基金投资的需要自主决定不买入部分</p>

	<p>全价（即 T+2 日的估值价与 T+2 日应收利息之和）计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项。</p> <p>特例情况：若自 T 日起，深圳证券交易所正常交易日已达到 3 日而该证券正常交易日低于 2 日，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本加上按照最近一次估值价及估值日每张债券所含应收利息之和计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项。</p> <p>T+2 日后第 1 个工作日（若在特例情况下，则为 T 日起第 4 个交易日），基金管理人将应退款和补款的明细数据发送给登记机构，登记机构办理现金替代多退少补资金的清算：T+2 日后 2 个工作日（若在特例情况下，则为 T 日起第 5 个交易日），登记机构办理现金替代多退少补资金的交收。</p>	<p>被替代证券，或者不进行任何买入证券的操作，基金管理人可能不买入被替代证券的情形包括但不限于市场流动性不足、技术系统无法实现以及基金管理人认为不应买入的其他情形。T+1 日日终，若已购入全部被替代的证券，则以替代金额与被替代证券的实际购入成本（包括买入价格与交易费用）的差额，确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项；若未能购入全部被替代的证券，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本加上按照 T+1 日估值全价（即 T+1 日的估值价与 T+1 日应收利息之和）计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项。</p> <p>特例情况：若自 T 日起，深圳证券交易所正常交易日已达到 2 日而该证券正常交易日低于 1 日，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本加上按照最近一次估值价及估值日每张债券所含应收利息之和计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项。</p> <p>T+1 日后第 1 个工作日（若在特例情况下，则为 T 日起第 3 个交易日），基金管理人将应退款和补款的明细数据发送给登记机构，相关款项的清算交收将于此后 3 个工作日内完成。</p>
--	--	---

### 三、重要提示

1、本次调整符合有关法律法规规定和基金合同的约定，对基金份额持有人利益无实质性不利影响，无需召开基金份额持有人大会。

2、本公司将对上述基金招募说明书中的相关内容进行相应调整。

3、投资者可通过本公司客户服务电话 400-6788-533 或本公司网站（[www.phfund.com.cn](http://www.phfund.com.cn)）咨询相关情况。

风险提示：本公司承诺以诚实信用、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。投资者投资基金时应认真阅读基金合同、招募说明书（更新）、基金产品资料概要（更新）。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

2024年11月8日