

鹏华基金管理有限公司

关于修订鹏华基金旗下11只基金 基金合同部分条款的公告

为更好地满足投资者需求,鹏华基金管理有限公司(以下简称“本公司”或“鹏华基金”)决定根据《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》、《公开募集证券投资基金参与转融通证券出借业务指引(试行)》、《基金参与融资融券及转融通证券出借业务指引》的规定,及鹏华基金旗下11只基金(详见下表)基金合同(以下合称“《基金合同》”)的约定,拟对该等基金《基金合同》的部分条款进行修订,具体包括:在释义、投资范围、投资策略、投资限制、估值方法及信息披露等章节中调整或增加融资及转融通证券出借业务相关内容,同时对上述基金托管协议(以下合称“《托管协议》”)涉及的上述相关内容进行了相应修订。

此次拟进行修订的基金共11只,列表如下:

序号	基金全称	托管人
1	鹏华国证钢铁行业指数型证券投资基金(LOF)	招商银行股份有限公司
2	鹏华中证空天一体军工指数证券投资基金(LOF)	中国工商银行股份有限公司
3	鹏华中证高铁产业指数型证券投资基金(LOF)	招商银行股份有限公司
4	鹏华中证一带一路主题指数型证券投资基金(LOF)	招商银行股份有限公司
5	鹏华创业板指数型证券投资基金(LOF)	中国建设银行股份有限公司
6	鹏华中证移动互联网指数型证券投资基金(LOF)	中国建设银行股份有限公司
7	鹏华中证医药卫生指数型证券投资基金(LOF)	中国建设银行股份有限公司
8	鹏华中证环保产业指数型证券投资基金(LOF)	中国建设银行股份有限公司
9	鹏华中证金指证券公司指数型证券投资基金(LOF)	中国建设银行股份有限公司
10	鹏华中证酒指数型证券投资基金(LOF)	中国建设银行股份有限公司
11	鹏华中证银行指数型证券投资基金(LOF)	中国建设银行股份有限公司

经与各基金托管人协商一致,本公司对《基金合同》、《托管协议》中有关内容进行相应修订,修订内容主要为:

1.在《基金合同》释义部分增加如下内容:

转融通证券出借业务:指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金融股份有限公司(以下简称证券金融公司)出借证券,证券金融公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务

2.在《基金合同》投资范围部分增加或将相关内容修改为如下内容:

本基金可依据法律法规的规定,参与融资及转融通证券出借业务。

3.在《基金合同》投资策略部分补充相关投资策略,内容如下:

参与融资及转融通证券出借业务策略

本基金可在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素基础上,参与融资业务。

为更好地实现投资目标,在加强风险防范并遵守审慎经营原则的前提下,本基金可根据投资管理的需要参与转融通证券出借业务。本基金将在分析市场环境、投资者类型与结构、基金历史申赎情况、出借证券流动性情况等因素的基础上,合理确定出借证券的范围、期限和比例。

4.在《基金合同》投资限制中增加或将相关内容修改为如下内容(以《鹏华中证移动互联网指数型证券投资基金(LOF)基金合同》为例):

(22)本基金参与融资的,每个交易日日终,本基金持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的95%;

(23)本基金参与转融通证券出借业务,应当遵守下列要求:

a.参与转融通证券出借业务的资产不得超过基金资产净值的30%,其中出借期限在10个交易日以上的出借证券纳入《流动性风险管理规定》所述流动性受限证券的范围;

b.参与出借业务的单只证券不得超过本基金持有该证券总量的50%;

c.最近6个月内日均基金资产净值不得低于2亿元;

d.证券出借的平均剩余期限不得超过30天,平均剩余期限按照市值加权平均计算。

除上述第(2)、(11)、(20)、(21)、(23)条外,因证券/期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的,基金管理人应当在10个交易日内进行调整;因前述因素致使基金投资比例不符合上述第(23)条规定的,基金管理人不得新增出借业务;但中国证监会规定的

特殊情形除外。

5.在《基金合同》删除如下内容:

本基金可以根据届时有效的有关法律法规和政策的规定进行融资融券及转融通。

6.在《基金合同》估值方法中增加如下内容:

本基金参与融资及转融通证券出借业务的,按照相关法律法规和行业协会的相关规定进行估值。

7.在《基金合同》公开披露的基金信息中增加如下内容:

若本基金参与融资及转融通证券出借业务,应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露参与融资及转融通证券出借业务的情况,包括投资策略、业务开展情况、损益情况、风险及其管理情况等,并就报告期内本基金参与转融通证券出借业务发生的重大关联交易事项做详细说明。

8.根据上述第2、4、6点相应修改《托管协议》中涉及的相关内容。

详细修订内容请见修改后的《基金合同》和《托管协议》。

本基金管理人将按照相关规定相应更新上述11只基金的招募说明书及产品资料概要。

根据《公开募集证券投资基金参与转融通证券出借业务指引(试行)》等相关法律法规的规定及《基金合同》的约定,上述修改无需召开基金份额持有人大会。上述基金《基金合同》和《托管协议》的修改自2021年10月11日起生效。

投资者可访问鹏华基金管理有限公司网站(www.phfund.com)或拨打全国免费长途服务的客户服务热线(400-6788-533)咨询相关情况。

风险提示:基金的过往业绩并不预示其未来表现,基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成本基金表现的保证。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,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。销售机构根据法规要求对投资者类别、风险承受能力和基金的风险等级进行划分,并提出适当性匹配意见。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则,在投资人作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资人自行承担。投资人在投资基金前应认真阅读基金合同、招募说明书(更新)和基金产品资料概要(更新)等基金法律文件,全面认识基金的风险收益特征,在了解基金情况及听取销售机构适当性意见的基础上,根据自身的风险承受能力、投资期限和投资目标,对基金投资作出独立决策,选择合适的基金产品。

本公告的解释权归本公司所有。

特此公告。

鹏华基金管理有限公司
2021年10月11日