

# 鹏华基金管理有限公司

## 关于修改旗下44只证券投资基金基金合同部分条款的公告

根据《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》以及各基金《基金合同》的约定,经与各基金基金托管人协商一致,并报中国证券监督管理委员会备案,鹏华基金管理有限公司(以下简称“本公司”)决定对旗下44只证券投资基金的《基金合同》进行修改。

一、此次修改的44只基金列表如下:

| 序号 | 基金全称                            |
|----|---------------------------------|
| 1  | 鹏华沪深300指数证券投资基金(LOF)            |
| 2  | 鹏华中证500指数证券投资基金(LOF)            |
| 3  | 鹏华中证A股资源产业指数型证券投资基金(LOF)        |
| 4  | 鹏华中证信息技术指数型证券投资基金(LOF)          |
| 5  | 鹏华中证800证券保险指数型证券投资基金(LOF)       |
| 6  | 鹏华中证800地产指数型证券投资基金(LOF)         |
| 7  | 鹏华中证国防指数型证券投资基金(LOF)            |
| 8  | 鹏华中证传媒指数型证券投资基金(LOF)            |
| 9  | 鹏华中证银行指数型证券投资基金(LOF)            |
| 10 | 鹏华中证酒指数型证券投资基金(LOF)             |
| 11 | 鹏华中证金证证券指数型证券投资基金(LOF)          |
| 12 | 鹏华中证一带一路主题指数型证券投资基金(LOF)        |
| 13 | 鹏华中证高铁产业指数型证券投资基金(LOF)          |
| 14 | 鹏华创业板指数型证券投资基金(LOF)             |
| 15 | 鹏华中证移动互联网指数型证券投资基金(LOF)         |
| 16 | 鹏华中证环保产业指数型证券投资基金(LOF)          |
| 17 | 鹏华国证钢铁行业指数型证券投资基金(LOF)          |
| 18 | 鹏华中证医药卫生指数证券投资基金(LOF)           |
| 19 | 鹏华港股通中证香港中小企业投资主题指数证券投资基金(LOF)  |
| 20 | 鹏华港股通中证香港银行投资指数证券投资基金(LOF)      |
| 21 | 鹏华中证空天一体军工指数证券投资基金(LOF)         |
| 22 | 鹏华沪深300指数增强型证券投资基金              |
| 23 | 鹏华中债1-3年国开行债券指数证券投资基金           |
| 24 | 鹏华中证酒交易型开放式指数证券投资基金             |
| 25 | 鹏华中证国防交易型开放式指数证券投资基金            |
| 26 | 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      |
| 27 | 鹏华中证500交易型开放式指数证券投资基金           |
| 28 | 鹏华中证银行交易型开放式指数证券投资基金            |
| 29 | 鹏华国证证券龙头交易型开放式指数证券投资基金          |
| 30 | 鹏华中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金       |
| 31 | 鹏华中证800证券保险交易型开放式指数证券投资基金       |
| 32 | 鹏华中证传媒交易型开放式指数证券投资基金            |
| 33 | 鹏华中证高股息龙头交易型开放式指数证券投资基金         |
| 34 | 鹏华国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金         |
| 35 | 鹏华中债3-5年国开行债券指数证券投资基金           |
| 36 | 鹏华中证高股息龙头交易型开放式指数证券投资基金联接基金     |
| 37 | 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    |
| 38 | 鹏华中债1-3年农发行债券指数证券投资基金           |
| 39 | 鹏华中债-市场隐含评级AAA信用债(1-3年)指数证券投资基金 |
| 40 | 鹏华中债-0-3年AA+优选信用债指数证券投资基金       |
| 41 | 鹏华中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金          |
| 42 | 鹏华中证细分化工产业主题交易型开放式指数证券投资基金      |
| 43 | 鹏华中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金          |
| 44 | 鹏华国证有色金属行业交易型开放式指数证券投资基金        |

二、《基金合同》主要修改内容

(一)“前言”章节

1.补充法律依据

增加:“《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》”)”

2.补充风险提示

(1)对于股票指数基金,增加:

“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。”

(2)对于债券指数基金,增加:

“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、成份券停牌或违约等潜在风险,详见本基金招募说明书。”

(二)“基金的基本情况”章节或“基金的投资”章节

1.修改标的指数变更程序

(1)对于股票指数基金,将“标的指数”部分修订为:

“本基金的标的指数为……

未来若出现标的指数不符合要求(因成份价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外)、指数编制机构退出等情形,基金管理人应当自该情形发生之日起十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案,如更换基金标的指数、转换运作方式,与其他基金合并,或者终止基金合同等,并在6个月内召集基金份额持有人大会进行表决,基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的,本基金合同终止。

自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定期间,基金管理人应按照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作。”

(2)对于债券指数基金,将“标的指数”部分修订为:

“本基金的标的指数为……

未来若出现标的指数不符合要求(因成份券价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外)、指数编制机构退出等情形,基金管理人应当自该情形发生之日起十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案,如更换基金标的指数、转换运作方式,与其他基金合并,或者终止基金合同等,并在6个月内召集基金份额持有人大会进行表决,基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的,本基金合同终止。

自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定期间,基金管理人应按照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作。”

(3)对于联接基金,将“目标ETF发生相关变更情形的处理方式”修订为:

“七.标的指数及目标ETF发生相关变更情形的处理方式

1.未来若出现标的指数不符合要求(因成份价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外)、指数编制机构退出等情形,除基金合同另有约定外,基金管理人应当自该情形发生之日起十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案,如更换基金标的指数、转换运作方式,与其他基金合并,或者终止基金合同等,并在6个月内召集基金份额持有人大会进行表决,基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的,本基金合同终止。

自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定期间,基金管理人应按照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作。”

2.若非标的指数不符合要求(因成份价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外)、指数编制机构退出等原因,目标ETF出现下述情形之一的,本基金将由投资于目标ETF的联接基金变更为直接投资该标的指数的指数基金,无需召开基金份额持有人大会……

发生上述相关情形时,若目标ETF变更标的指数,本基金将在履行适当程序后相应变更标

的指数且继续投资于该目标ETF。但目标ETF召开基金份额持有人大会审议变更目标ETF标的指数事项的，本基金的基金份额持有人可出席目标ETF基金份额持有人大会并进行表决，目标ETF基金份额持有人大会审议通过变更标的指数事项的，本基金可不召开基金份额持有人大会相应变更标的指数并仍为该目标ETF的联接基金。”

## 2、补充特定情况下成份股/券退市或违约时的处置方案

对于部分基金，“基金的投资”章节设有“投资决策依据及程序”部分，则在该部分补充特定情况下成份股/券退市或违约时的处置方案：

(1)对于股票指数基金，增加：

“当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照持有人利益优先的原则，综合考虑成份股的退市风险、其在指数中的权重以及对跟踪误差的影响，据此制定成份股替代策略，并对投资组合进行相应调整。”

(2)对于债券指数基金，增加：

“当标的指数成份券发生明显负面事件面临退市或违约风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照持有人利益优先的原则，综合考虑成份券的退市或违约风险、其在指数中的权重以及对跟踪误差的影响，据此制定成份券替代策略，并对投资组合进行相应调整。”

(三)“基金合同的变更、终止与基金财产的清算”章节

(1)对于股票指数基金，增加：

“出现标的指数不符合要求（因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人召集基金份额持有人大会对解决方案进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的；”

(2)对于债券指数基金，增加：

“出现标的指数不符合要求（因成份券价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人召集基金份额持有人大会对解决方案进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的；”

以上修改内容列举了本次本公司旗下44只基金《基金合同》涉及的主要修改内容，因各基金的类型及具体表述等不完全相同，《基金合同》中相应条款表述及修订位置可能存在差异，详细修改内容请见各基金修改后的《基金合同》。

三、上述修订自本公告发布之日起生效。基金管理人已履行了规定程序，符合相关法律法规的规定及各基金《基金合同》的约定。修改后的《基金合同》将与本公告同日登载于基金管理人网站（[www.phfund.com](http://www.phfund.com)）及中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）。本公司将根据相关法律法规，更新上述基金的招募说明书以及基金产品资料概要相关内容，并在规定媒介上公告。

投资者可访问鹏华基金管理有限公司网站（[www.phfund.com](http://www.phfund.com)）或拨打全国免长途费的客户服务热线（400-6788-533）咨询相关情况。

本公告的解释权归本公司所有。

本公告仅对本公司旗下44只基金修改《基金合同》的有关事项予以说明。投资者欲了解基金的详细情况，请仔细阅读各基金基金合同、招募说明书、基金产品资料概要及相关法律文件。

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财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其将来表现。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。投资有风险，敬请投资者认真阅读基金的相关法律文件，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。

特此公告。

鹏华基金管理有限公司  
二〇二一年三月二十六日