

关于鹏扬中债-30年期国债交易型开放式指数证券投资基金 春节后首个交易日预估现金部分与现金差额之间的差异放大风险的提示性公告

根据鹏扬中债-30年期国债交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”,场内简称:30年国债,扩位简称:30年国债ETF,基金代码:511090)招募说明书的相关约定,本基金2月24日预估现金部分将使用2月13日最小申赎单位的基金资产净值、2月24日成份证券参考价格(成份证券2月13日估值价格与2月24日应计利息之和)进行计算;而现金差额将使用2月24日最小申赎单位的基金资产净值、2月24日成份证券估值全价进行计算。

由于春节假期的存在,2026年2月14日至2026年2月23日(连续10个自然日)皆为上海证券交易所非交易日。春节假期时间跨度长、成份证券的应计利息增加较多,在不考虑2月24日成份证券市场净价变动的前提下,成份证券在春节期间应计利息的增加,会使得本基金在2月24日的最小申赎单位的基金资产净值大于2月13日的最小申赎单位的基金资产净值,这将明显放大本基金2月24日的预估现金部分与2月24日的实际现金差额之间的差异。

如广大投资者于2026年2月24日参与本基金,建议选择场内直接买卖的方式参与,避免受到当日预估现金部分与现金差额之间差异的影响。

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。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。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。投资者投资本公司管理的基金时,应认真阅读基金合同、招募说明书(更新)、产品资料概要(更新)等法律文件,全面认识基金的风险收益特征和产品特性,在了解产品情况、听取销售机构适当性匹配意见的基础上,充分考虑自身的风险承受能力、投资期限和投资目标,理性判断市场,谨慎做出投资决策。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则,在做出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行承担。请投资者严格遵守反洗钱相关法律法规的规定,切实履行反洗钱义务。

特此公告。

鹏扬基金管理有限公司
2026年2月24日