

关于南方恒生生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）

调整申购赎回现金替代处理规则的公告

为更好地服务投资者，南方基金管理股份有限公司（以下简称“本公司”）旗下南方恒生生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）（以下简称“本基金”；场内简称：恒生生物科技 ETF；交易代码：159615），根据深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则，以及本基金基金合同、招募说明书等有关规定，拟自 2025 年 7 月 28 日起调整本基金申购赎回中现金替代的处理规则，具体如下：

一、申购赎回现金替代处理规则调整

本基金拟对申购赎回中现金替代的处理规则等进行调整。

（一）调整前：

“4、现金替代相关内容

.....

3）替代金额的处理程序

T 日，基金管理人在申购赎回清单中公布现金替代溢价比例和现金替代折价比例，并据此收取申购替代金额和支付赎回替代金额。

正常情况下，对于确认成功的 T 日申购申请，基金管理人根据实际单位购入成本（包括买入价格与相关费用，折算为人民币）或被替代证券的 T+1 日收盘价（按照汇率折算为人民币，被替代证券当日在证券交易所无交易的，取最近交易日的收盘价）计算被替代证券的单位结算成本，在此基础上根据替代证券数量和申购替代金额确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项。若发生特殊情况，基金管理人可以对交收日期进行相应调整。上述汇率目前采用汇率公允价。汇率公允价包括但不限于港股通结算汇兑比率、中国外汇交易中心最新收盘价、中国外汇交易中心参考汇率或交易汇率、中国人民银行或其授权机构最新公布的人民币汇率中间价、与基金托管人商定的其他公允价格等。

正常情况下，对于确认成功的 T 日赎回申请，基金管理人根据实际单位卖出金额（扣除相关费用，折算为人民币）或被替代证券的 T+1 日收盘价（按照汇率折算为人民币，被替代证券当日在证券交易所无交易的，取最近交易日的收盘价）计算被替代证券的单位结算金额，在此基础上根据替代证券数量确定赎回替代金额。若发生特殊情况，基金管理人可以对交收日期进行相应调整。上述汇率目前采用汇率公允价。汇率公允价包括但不限于港股通结算汇

兑比率、中国外汇交易中心最新收盘价、中国外汇交易中心参考汇率或交易汇率、中国人民银行或其授权机构最新公布的人民币汇率中间价、与基金托管人商定的其他公允价格等。

正常情况下，T 日后的第 5 个开放日内，基金管理人将应退款或补款与相关申购赎回代理机构办理交收；T 日后的第 8 个开放日内，基金管理人将应支付的赎回替代金额与相关申购赎回代理券商办理交收。当 T+1 日为半日港股通交易日或因为风球等因素引发临时停市时，计算并确定被替代组合证券的单位结算成本的时间将顺延，款项交收的日期也顺延。若发生特殊情况，基金管理人可以对以上交收日期进行相应调整。

.....

5、预估现金差额相关内容

预估现金差额是指由基金管理人估计并在 T 日申购赎回清单中公布的当日现金差额的估计值，预估现金差额由申购赎回代理券商预先冻结。

预估现金差额的计算公式为：

$$T \text{ 日预估现金差额} = T-1 \text{ 日最小申购赎回单位的基金资产净值} - (\text{申购赎回清单中必须用现金替代的固定替代金额之和} + \text{申购赎回清单中可以用现金替代成份证券的数量} \times \text{该证券调整后 T 日开盘参考价与最新估值汇率（如需）乘积之和})$$

其中，若 T 日为基金分红除息日，则计算公式中的“T-1 日最小申购、赎回单位的基金资产净值”需扣减相应的收益分配数额。如果 T-1 日至 T 日期间有香港交易所交易日且非申赎开放日，或发生其他特殊情况，则基金管理人可对 T-1 日最小申购赎回单位的基金资产净值等进行调整，下同。预估现金差额的数值可能为正、为负或为零。”

（二）调整后：

“4、现金替代相关内容

.....

3) 替代金额的处理程序

T 日，基金管理人在申购赎回清单中公布现金替代溢价比例和现金替代折价比例，并据此收取申购替代金额和支付赎回替代金额。

正常情况下，对于确认成功的 T 日（T 日为开放日）申购申请，基金管理人根据 T 日内所购入的被替代证券的实际单位购入成本（包括买入价格与相关费用，按照汇率折算为人民币）和未购入的被替代证券的 T 日收盘价（按照汇率折算为人民币，被替代证券当日在证券交易所无交易的，取最近交易日的收盘价；交易日无收盘价的，取最后成交价）计算被替代证券的单位结算成本，在此基础上根据替代证券数量和申购替代金额确定基金应退还投资者

或投资者应补交的款项，若 T 日发生除息、收益分配等重要权益变动，则进行相应调整。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被替代证券，或者不进行任何买入被替代证券的操作。

正常情况下，对于确认成功的 T 日（T 日为开放日）赎回申请，基金管理人根据 T 日内所卖出的被替代证券的实际单位卖出金额（扣除相关费用，按照汇率折算为人民币）和未卖出的被替代证券的 T 日收盘价（按照汇率折算为人民币，被替代证券当日在证券交易所无交易的，取最近交易日的收盘价；交易日无收盘价的，取最后成交价）计算被替代证券的单位结算金额，在此基础上根据替代证券数量确定赎回替代金额，若 T 日发生除息、收益分配等重要权益变动，则进行相应调整。基金管理人有权根据基金投资的需要自主决定不卖出部分被替代证券，或者不进行任何卖出被替代证券的操作。

上述汇率目前采用汇率公允价。汇率公允价包括但不限于港股通结算汇兑比率、中国外汇交易中心最新收盘价、中国外汇交易中心参考汇率或交易汇率、中国人民银行或其授权机构最新公布的人民币汇率中间价、与基金托管人商定的其他公允价格等。

正常情况下，T 日后的第 5 个开放日内，基金管理人将应退款或补款与相关申购赎回代理机构办理交收；T 日后的第 8 个开放日内，基金管理人将应支付的赎回替代金额与相关申购赎回代理券商办理交收。当 T 日为半日港股通交易日或因为风球等因素引发临时停市时，计算并确定被替代组合证券的单位结算成本的时间将顺延，款项交收的日期也顺延。若发生特殊情况，基金管理人可以对以上交收日期进行相应调整。

.....

5、预估现金差额相关内容

预估现金差额是指由基金管理人估计并在 T 日申购赎回清单中公布的当日现金差额的估计值，预估现金差额由申购赎回代理券商预先冻结。

预估现金差额的计算公式为：

$$T \text{ 日预估现金差额} = T-1 \text{ 日最小申购赎回单位的基金资产净值} - (\text{申购赎回清单中必须用现金替代的固定替代金额之和} + \text{申购赎回清单中可以用现金替代成份证券的数量、该证券调整后 T 日开盘参考价与最新估值汇率（如需）乘积之和})$$

其中，若 T 日为基金分红除息日，则计算公式中的“T-1 日最小申购、赎回单位的基金资产净值”需扣减相应的收益分配数额。如果 T-1 日至 T 日期间有香港交易所交易日且非申赎开放日，或发生其他特殊情况，则基金管理人可对 T-1 日最小申购赎回单位的基金资产净值等进行调整，下同。若 T 日为基金最小申购赎回单位调整生效日，则计算公式中的“T-1

日最小申购赎回单位的基金资产净值”需根据调整前后最小申购赎回单位按比例计算。预估现金差额的数值可能为正、为负或为零。”

本次调整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。调整后的申购赎回现金替代处理规则等详见本基金招募说明书更新。

二、重要提示：

1、基金份额持有人于 2025 年 7 月 25 日 15:00 前提出的申购赎回申请按照原申购赎回现金替代处理规则办理，基金份额持有人于 2025 年 7 月 25 日 15:00 后提出的申购赎回申请适用于新的申购赎回现金替代处理规则。

2、本次调整符合相关法律法规及基金合同的规定，本公告仅对申购赎回现金替代处理规则调整的有关事项进行说明，本基金的招募说明书中涉及的调整内容将进行相应更新。

3、投资人在销售机构办理上述业务时，需同时遵循该销售机构的相关规定。

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。敬请投资人注意投资风险。投资人投资于上述基金前应认真阅读基金的基金合同、招募说明书和基金产品资料概要及其更新等法律文件。

投资人可以登录本公司网站（www.nffund.com）或拨打客户服务电话（400-889-8899）咨询相关信息。

特此公告。

南方基金管理股份有限公司

2025 年 7 月 26 日