

鹏华基金管理有限公司 关于旗下基金持有的股票停牌后 估值方法变更的提示性公告

根据中国证监会[2008]38号公告《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》的规定,鹏华基金管理有限公司(以下简称“本公司”)于2008年9月16日发布了《鹏华关于进一步规范旗下基金估值业务的公告》,说明本公司于2008年9月16日起对旗下基金持有的停牌股票等估值日无市价且对基金净值影响超过0.25%的投资品种的公允价值按照“指数收益法”确定。

本公司依据指导意见等法规规定,经与托管银行协商一致,决定于2015年8月26日起对本公司旗下基金(ETF基金除外)所持有的以下停牌股票采用“指数收益法”进行估值。待以下停牌股票复牌且其交易体现了活跃市场交易特征之日起,恢复采用当日收盘价进行估值,届时不再另行公告。敬请投资者予以关注。

停牌股票明细

股票代码	股票名称
002368	太极股份
000211	招商广产
900839	凯迪电力

本公司旗下基金将严格按照《企业会计准则》、指导意见、中国证监会相关规定和基金合同中关于估值的约定对基金所持有的投资品种进行估值,请广大投资者关注。

投资者可登陆本公司网站(<http://www.phfund.com>)或拨打客户服务电话400-6788-999咨询或查阅相关信息。

特此公告。

鹏华基金管理有限公司

2015年8月27日

关于调整鹏华中证传媒指数分级证券投资 基金B类份额折算基准日证券简称的公告

2015年8月26日,鹏华中证传媒指数分级证券投资基金B类份额(证券编码:150204)的基金份额参考净值为0.238元,达到基金合同规定的下阀值不定期份额折算条件,根据基金合同的约定,将以2015年8月27日为基金份额折算基准日,办理不定期份额折算业务。为加强下阀值折算基准日交易风险提示,经向深圳证券交易所申请,折算基准日8月27日鹏华中证传媒指数分级证券投资基金B类份额证券简称前将冠以“一”标识,即证券简称由“传媒B”调整为“一传媒B”,证券编码保持不变。

本基金管理人提请投资者警惕基金风险,切勿盲目投资。

鹏华基金管理有限公司

2015年8月27日

关于恢复旗下鹏华中证信息技术指数分级 证券投资基金B类份额证券简称的公告

经向深圳证券交易所申请,鹏华中证信息技术指数分级证券投资基金B类份额(证券编码:150180)自8月27日起证券简称由“信息B”恢复为“信息B”,特此公告。

鹏华基金管理有限公司

2015年8月27日

关于恢复旗下鹏华中证移动互联网指数 分级证券投资基金B类份额证券简称的公告

经向深圳证券交易所申请,鹏华中证移动互联网指数分级证券投资基金B类份额(证券编码:150246)自8月27日起证券简称由“一互联B”恢复为“互联B”,特此公告。

鹏华基金管理有限公司

2015年8月27日

鹏华中证800证券保险指数分级证券投资基金 不定期份额折算结果及恢复交易的公告

根据《鹏华中证800证券保险指数分级证券投资基金基金合同》(简称“基金合同”)及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定,鹏华基金管理有限公司(以下简称“本公司”)以2015年8月26日为基准日,对鹏华中证800证券保险指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)实施不定期份额折算,现将相关事项公告如下:

一、份额折算结果

2015年8月27日,鹏华证券保险份额(场内简称:证保分级,基金代码:160625)的场外份额经折算后的份额数按位数法保留到小数点后两位,余额部分计入基金资产;鹏华证券保险份额的场内份额、鹏华证保A份额(场内简称:证保A,基金代码:150177)、鹏华证保B份额(场内简称:证保B,基金代码:150178)经折算后的份额数取整计算(最小单位为1份),余额部分计入基金资产。基金份额折算比例按位数法精确到小数点后第9位,如下表所示:

基金份额名称	折算前基金份额净值 (单位:份)	折算前基金份额净值 (单位:元)	份额折算比例	折算后基金份额 (单位:份)	折算后基金份额 (单位:元)
鹏华证券保险场外份额	1,835,356.0346	0.556	0.556064579	1,020,576,480.72	1.000
鹏华证券保险场内份额	398,419,066.00	0.556	0.556064579	2,442,878,340.00	1.000
鹏华证保A份额	2,372,225,590.00	1.024	0.087868886	208,444,819.00	1.000
鹏华证保B份额	2,372,225,590.00	0.088	0.087868886	208,444,819.00	1.000

注:该“折算后基金份额”为鹏华证保A份额经折算后产生的新增鹏华证券保险场内份额。

投资者自公告之日起可查询经注册登记人及本公司确认的折算后份额。

二、恢复交易

自2015年8月27日起,本基金恢复申购、赎回、转换、定期定额投资、转托管(包括系统内转托管、跨系统转托管)、配对转换业务,鹏华证保A份额、鹏华证保B份额将于2015年8月27日上午十开市至10:30停牌,并于2015年8月27日上午10:30复牌。

根据深圳证券交易所《证券投资基金交易和申购赎回实施细则》,2015年8月27日鹏华证保A、鹏华证保B即时行情显示的前收盘价为2015年8月26日的鹏华证保A、鹏华证保B的基金份额参考净值,分别为1.000元和0.986元,2015年8月27日当日鹏华证保A份额和鹏华证保B份额均可能出现交易价格大幅波动的情形。敬请投资者注意投资风险。

三、重要提示

1、特别提示:近日鹏华证保B份额二级市场交易价格溢价较大,不定期份额折算后,鹏华证保B份额的溢价率可能发生重大变化。提请参与二级市场交易的投资者注意鹏华证保B份额高溢价交易所带来的风险。

2、鹏华证保A份额表现为低风险、预期收益相对稳定的特征,但在不定期份额折算后鹏华证保A份额持有人的风险收益特征将发生重大变化,由持有单一的较低风险收益特征的鹏华证保A份额变为同时持有较低风险收益特征的鹏华证保A份额与较高风险收益特征的鹏华证券保险份额,因此原鹏华证保A份额持有人预期收益实现的不确定性将增加,此外,鹏华证券保险份额为跟踪中证800证券保险指数的基础份额,其份额净值将随市场涨跌而变化,因此原鹏华证保A份额持有人还可能承担因市场下跌而遭受损失的风险。

3、鹏华证保B份额表现为高风险、高收益预期的特征,不定期份额折算后其杠杆倍数将大幅下降,将恢复到初始的2倍杠杆水平,相应地,鹏华证保B份额净值随市场涨跌而增长或者下降的幅度也会大幅减小。

4、原鹏华证保A份额持有人可通过办理配对转换业务将此次折算获得的场内鹏华证保B份额作为鹏华证保A份额、鹏华证保B份额。

5、根据深圳证券交易所相关业务规则,鹏华证保A份额、鹏华证保B份额、鹏华证券保险份额的场内份额经折算后的份额数均取整计算(最小单位为1份),舍去部分计入基金资产,持有极小数量鹏华证保A份额、鹏华证保B份额、鹏华证券保险份额的持有人,存在折算后份额因为不足1份而导致相应的资产被强制归入基金资产的风险。

6、在二级市场可以做交易的证券公司并不全部具备中国证监会颁发的基金销售资格,而投资者只能通过具备基金销售资格的证券公司赎回基金份额。因此,如果投资者通过不具备基金销售资格的证券公司购买鹏华证保A份额,在不定期份额折算后,则折算新增的鹏华证保A份额将无法赎回,投资者可以选择在折算前将鹏华证保A份额卖出,或者在折算后将新增的鹏华证保份额转托管到具有基金销售资格的证券公司后赎回。

7、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。投资者投资于本基金前应认真阅读本基金的基金合同和招募说明书(更新)等相关法律文件。敬请投资者注意投资风险。

投资者若希望了解基金不定期份额折算业务详情,请登陆本公司网站: www.phfund.com或者拨打本公司客服电话:400-6788-999(免长途话费)。

特此公告。

鹏华基金管理有限公司

2015年8月27日

关于鹏华中证800证券保险指数分级证券 投资基金不定期份额折算前收盘价调整的公告

根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定及《鹏华中证800证券保险指数分级证券投资基金基金合同》的约定,鹏华中证800证券保险指数分级证券投资基金以2015年8月26日为基准日,对在该日交易结束后登记在册的鹏华证保A 份额(场内简称:证保A,基金代码:150177)、鹏华证保B 份额(场内简称:证保B,基金代码:150178)、鹏华证券保险份额(场内简称:证保分级,基金代码:160625)办理了不定期份额折算业务。对于不定期份额折算的结果,详见2015年8月27日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及鹏华基金管理有限公司网站上的《鹏华中证800证券保险指数

分级证券投资基金不定期份额折算结果及恢复交易的公告》。

根据《深圳证券交易所证券投资基金交易和申购赎回实施细则》,2015年8月27日复牌首日证保A、证保B即时行情显示的前收盘价将调整为2015年8月26日的证保A、证保B的基金份额参考净值(四舍五入至0.001元),分别为1.000元和0.986元。2015年8月27日当日证保A和证保B均可能出现交易价格大幅波动的情形。敬请投资者注意投资风险。

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财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。投资者投资于本公司基金时应认真阅读相关基金合同、招募说明书(更新)等文件,并根据自身风险承受能力选择适合自己的基金产品进行投资。敬请投资者注意投资风险。特此公告。

鹏华基金管理有限公司

2015年8月27日

鹏华中证传媒指数分级证券投资基金B类 份额不定期份额折算的风险提示公告

根据《鹏华中证传媒指数分级证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)关于基金不定期份额折算的相关约定,当鹏华中证传媒指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)之B类份额的基金份额参考净值小于0.2500元时,鹏华传媒分级份额(场内简称:传媒分级,场内代码:160629)、鹏华传媒A类份额(场内简称:传媒A,场内代码:150203)、鹏华传媒B类份额(场内简称:“传媒B”,场内代码:150204)将进行不定期份额折算。

截至2015年8月26日,鹏华传媒B的基金份额参考净值为0.238元,达到基金合同规定的不定期份额折算条件。根据基金合同约定,本基金将于2015年8月27日为基准日办理不定期份额折算业务。截至2015年8月26日,传媒收盘价约为0.560元,溢价率高达135.29%。不定期份额折算后,传媒B杠杆倍数将大幅降低,恢复到初始杠杆水平,传媒B的溢价率可能大幅降低,投资者如果在折算基准日(2015年8月27日)当天盲目投资,可能遭受重大损失,敬请投资者注意投资风险。

鹏华基金管理有限公司

2015年8月27日

鹏华中证传媒指数分级证券投资基金 不定期份额折算公告

根据《鹏华中证传媒指数分级证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)关于不定期份额折算的相关规定,当鹏华中证传媒指数分级证券投资基金之鹏华传媒B份额的基金份额参考净值跌至0.250元时,本基金将进行不定期份额折算。

截至2015年8月26日,本基金鹏华传媒B份额的基金份额参考净值为0.238元,达到基金合同规定的不定期份额折算条件。根据本基金基金合同以及深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定,本基金将以2015年8月27日为基准日办理不定期份额折算业务。相关事项公告如下:

一、基金份额折算基准日

本次不定期份额折算的基准日为2015年8月27日。

二、基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的鹏华传媒分级份额(场内简称:“传媒分级”,基金代码:160629)、鹏华传媒A份额(场内简称:“传媒A”,基金代码150203)、鹏华传媒B份额(场内简称:“传媒B”,基金代码150204)。

三、基金份额折算方式

鹏华传媒分级份额、鹏华传媒A份额、鹏华传媒B份额按照《基金合同》“第二十二部分、基金份额的折算”规则进行不定期份额折算。

当达到不定期折算条件时,本基金将分别对鹏华传媒分级份额、鹏华传媒A份额、鹏华传媒B份额进行份额折算,份额折算后本基金将确保鹏华传媒A份额与鹏华传媒B份额的比例为1:1,份额折算后鹏华传媒分级份额的基金份额净值、鹏华传媒A份额与鹏华传媒B份额的基金份额参考净值均调整为1.000元。具体折算原则及公式如下:

<p>1、场内份额折算公式:</p> $\text{折算后场内份额} = \frac{\text{折算前场内份额} \times \text{折算前基金份额净值}}{\text{折算基准日基金份额参考净值}}$ <p>2、场外份额折算公式:</p> $\text{折算后场外份额} = \frac{\text{折算前场外份额} \times \text{折算前基金份额净值}}{\text{折算基准日基金份额参考净值}}$ <p>3、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>4、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>5、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>6、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>7、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>8、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>9、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>10、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>11、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>12、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>13、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>14、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>15、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>16、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>17、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>18、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>19、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>20、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>21、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>22、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>23、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>24、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>25、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>26、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>27、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>28、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>29、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>30、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>31、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>32、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>33、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>34、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>35、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>36、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>37、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>38、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>39、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>40、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>41、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>42、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>43、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>44、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>45、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>46、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>47、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>48、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>49、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>50、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>51、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>52、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>53、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>54、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>55、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>56、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>57、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>58、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>59、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>60、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>61、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>62、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>63、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>64、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>65、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>66、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>67、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>68、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>69、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>70、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>71、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>72、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>73、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>74、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>75、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>76、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>77、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>78、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>79、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>80、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>81、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>82、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>83、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>84、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>85、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>86、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>87、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>88、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>89、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>90、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>91、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>92、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>93、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>94、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>95、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>96、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>97、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>98、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>99、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p> <p>100、基金份额折算基准日:</p> <p>2015年8月27日</p>	<p>折算前</p> <p>份额数</p> <p>份额净值/</p> <p>份额参考净值</p> <p>折算后</p> <p>份额数</p> <p>鹏华传媒分级份额</p> <p>6,617份鹏华传媒分级份额</p> <p>鹏华传媒A份额</p> <p>2,060份鹏华传媒A份额+8,259份鹏华传媒分级份额</p> <p>鹏华传媒B份额</p> <p>2,060份鹏华传媒B份额</p>
---	---

份额折算后场外基金份额的份额数计算结果保留到小数点后两位,小数点后两位以后的部分舍去,余额计入基金资产;场内基金份额的份额数计算结果保留到整数位,余额的处理方法按照深圳证券交易所基金注册登记机构的相关规则及有关规定执行。

四、不定期份额折算示例

设在本金的不定期份额折算日,鹏华传媒分级份额的基金份额净值、鹏华传媒A份额与鹏华传媒B份额的基金份额参考净值如下表所示,折算后,鹏华传媒分级份额的基金份额净值、鹏华传媒A份额、鹏华传媒B份额的基金份额参考净值均调整1.000元,则各持有鹏华传媒分级份额、鹏华传媒A份额、鹏华传媒B份额10,000份的基金份额持有人所持基金份额的变化如下表所示:

	折算前		折算后	
	份额净值/ 份额参考净值	份额数	份额净值/ 份额参考净值	份额数
鹏华传媒分级份额	0.617元	10,000份	1.000元	6,170份鹏华传媒分级份额
鹏华传媒A份额	1.028元	10,000份	1.000元	2,060份鹏华传媒A份额+8,259份鹏华传媒分级份额
鹏华传媒B份额	0.26元	10,000份	1.000元	2,060份鹏华传媒B份额

五、基金份额折算期间的基金业务办理

(一)不定期份额折算基准日(即2015年8月27日),本基金暂停办理申购、赎回、转换、定期定额投资、转托管(包括系统内转托管、跨系统转托管,下同)、配对转换业务。鹏华传媒A、鹏华传媒B将于2015年8月27日上午十开市至10:30:复牌,并于2015年8月27日上午10:30复牌。

(二)不定期份额折算基准日后的第一个工作日(即2015年8月28日),本基金暂停办理申购、赎回、转换、定期定额投资、转托管、配对转换业务,鹏华传媒A、鹏华传媒B暂停交易。

(三)当本基金注册登记人及基金管理人将持有人办理份额登记确认。

(四)不定期份额折算基准日后的第二个工作日(即2015年8月31日),基金管理人将公告份额折算确认结果,持有人可以查询其账户内的基金份额。当日,本基金恢复办理申购、赎回、转换、定期定额投资、转托管、配对转换业务,鹏华传媒A、鹏华传媒B将于2015年8月31日上午十开市至10:30停牌,并于2015年8月31日上午10:30复牌。

(五)根据深圳证券交易所《证券投资基金交易和申购赎回实施细则》,2015年8月31日鹏华传媒A、鹏华传媒B即时行情显示的前收盘价为2015年8月28日的鹏华传媒A、鹏华传媒B的基金份额参考净值(四舍五入至0.001元),2015年8月31日当日鹏华传媒A份额和鹏华传媒B份额均可能出现交易价格大幅波动的情形。敬请投资者注意投资风险。

六、重要提示

1、鹏华传媒A、鹏华传媒B将于2015年8月27日上午十开市至10:30停牌,并于2015年8月27日上午10:30复牌。

2、鹏华传媒A、鹏华传媒B将于2015年8月28日全天停牌。鹏华传媒A、鹏华传媒B将于2015年8月31日上午十开市至10:30停牌,并于2015年8月31日上午10:30复牌。

3、2015年8月26日,鹏华传媒B份额的基金份额参考净值已跌至0.250元以下,而折算基准日为2015年8月27日,因此折算基准日鹏华传媒B份额的基金份额参考净值与折算条件0.250元可能存在一定差异。

4、鹏华传媒A份额表现为低风险、预期收益相对稳定的特征,但在不定期份额折算后鹏华传媒A份额持有人的风险收益特征将发生重大变化,由持有单一的较低风险收益特征的鹏华传媒A份额变为同时持有较低风险收益特征的鹏华传媒A份额与较高风险收益特征的鹏华传媒B份额,因此原鹏华传媒A份额持有人预期收益实现的不确定性将增加,此外,鹏华传媒B份额为跟踪中证传媒指数的基础份额,其份额净值将随市场涨跌而变化,因此原鹏华传媒A份额持有人还可能承担因市场下跌而遭受损失的风险。

5、鹏华传媒B份额表现为高风险、高收益预期的特征,不定期份额折算后其杠杆倍数将大幅下降,将恢复到初始的2倍杠杆水平,相应地,鹏华传媒B份额净值随市场涨跌而增长或者下降的幅度也会大幅减小。

6、原鹏华传媒A份额持有人可通过办理配对转换业务将此次折算获得的场内鹏华传媒B份额分拆为鹏华传媒A份额、鹏华传媒B份额。

7、根据深圳证券交易所相关业务规则,鹏华传媒A份额、鹏华传媒B份额、鹏华传媒分级份额的场内份额经折算后的份额数均取整计算(最小单位为1份),舍去部分计入基金资产,持有极小数量鹏华传媒A份额、鹏华传媒B份额、鹏华传媒分级份额的持有人,存在折算后份额因为不足1份而导致相应的资产被强制归入基金资产的风险。

8、在二级市场可以做交易的证券公司并不全部具备中国证监会颁发的基金销售资格,而投资者只能通过具备基金销售资格的证券公司赎回基金份额。因此,如果投资者通过不具备基金销售资格的证券公司购买鹏华传媒A份额,在不定期份额折算后,则折算新增的鹏华传媒分级份额无法赎回,投资者可以选择在折算前将鹏华传媒A份额卖出,或者在折算后将新增的鹏华传媒分级份额转托管到具有基金销售资格的证券公司后赎回。

9、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。投资者投资于本基金前应认真阅读本基金的基金合同和招募说明书(更新)等相关法律文件。敬请投资者注意投资风险。

投资者若希望了解基金不定期份额折算业务详情,请登陆本公司网站: www.phfund.com或者拨打本公司客服电话:400-6788-999(免长途话费)。

特此公告。

鹏华基金管理有限公司

2015年8月27日

鹏华中证国防指数分级证券投资基金 B类份额交易价格波动提示公告

近期,鹏华基金管理有限公司(以下简称“本基金管理人”)旗下鹏华中证国防指数分级证券投资基金之B类份额(场内简称:国防B;交易代码:150206)二级市场交易价格连续大幅下跌,2015年8月26日,国防B在二级市场的收盘价为0.745元,相对于当日0.438元的基金份额参考净值,溢价幅度达到70.09%。截止2015年8月26日,国防B二级市场的收盘价为0.671元,明显高于基金份额参考净值,投资者如果盲目投资,可能遭受重大损失。

为此,本基金管理人提示如下:

1、国防B表现为高风险、高收益的特征。由于国防B内含杠杆机制的设计,国防B基金份额参考净值的变动幅度将大于鹏华国防分级份额(场内简称:国防分级,场内代码:160630)净值和鹏华国防A份额(场内简称:国防A,场内代码:150205)参考净值的变动幅度,即国防B的波动性要高于其他两类份额,其承担的风险也较高。国防B的持有人会因杠杆倍数的变化而承担不同程度的投资风险。

2、国防B的交易价格,除了有份额参考净值变化的风险外,还会受到市场的系统性风险、流动性风险等其他风险影响,可能使投资人面临损失。

3、截至2015年8月26日收盘,国防B的基金份额参考净值接近基金合同约定的不定期份额折算阀值。不定期份额折算后,国防B的溢价率可能发生重大变化。提请参与二级市场交易的投资者注意高溢价所带来的风险。

4、截至本公告披露日,鹏华中证国防指数分级证券投资基金运作正常。本基金管理人仍将严格按照法律法规及基金合同进行投资运作。

5、截至本公告披露日,鹏华中证国防指数分级证券投资基金无其他应披露而未披露的重大信息。本基金管理人仍将严格按照有关规定和要求,及时做好信息披露工作。