

关于鹏华创业板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相关业务规定及《鹏华创业板指数分级证券投资基金基金合同》的约定,鹏华创业板指数分级证券投资基金以2016年1月12日为基准日,对在该日交易结束后登记在册的鹏华创业板分级A份额(场内简称:创业A,基金代码:150243)、鹏华创业板分级B份额(场内简称:创业B,基金代码:150244)、鹏华创业板分级份额(场内简称:创业指基,基金代码:160637)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2016年1月14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《鹏华创业板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》,2016年1月14日复牌首日创业A、创业B即时行情显示的前收盘价将调整为2016年1月13日的创业A、创业B的基金份额参考净值(四舍五入至0.001元),分别为元1.000和0.922元。2016年1月14日当日创业A和创业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、招募说明书及更新等文件,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
2016年1月14日

鹏华创业板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《鹏华创业板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2016年1月12日为基准日,对鹏华创业板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

2016年1月14日,鹏华创业板分级份额(场内简称“创业指基”,基金代码:160637)的场外份额经折算后的份额数按截位法保留到小数点后两位,余额部分计入基金资产;鹏华创业板分级份额的场内份额、鹏华创业板分级A份额(场内简称“创业A”,基金代码:150243)、鹏华创业板分级B份额(场内简称“创业B”,基金代码:150244)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截位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 (单位:份)	折算前基金 份额净值 (单位:元)	新增份额 折算比例	折算后基金份额 (单位:份)	折算后基金 份额净值 (单位:元)
鹏华创业板分级 场外份额	73,980,982.05	0.621	0.621270541	45,962,204.74	1.000
鹏华创业板分级 场内份额	50,149,243.00	0.621	0.621270541	572,024,838.00	1.000
鹏华创业板分级A 份额	704,226,005.00	1.005	0.768032688	167,080,574.00	1.000
鹏华创业板分级B 份额	704,226,006.00	0.237	0.237254196	167,080,574.00	1.000

注:该“折算后基金份额”为鹏华创业板分级A份额经折算后产生的新增鹏华创业板分级场内份额。
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2016年1月14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,创

业A份额、创业B份额将于2016年1月14日上午开市至10:30停牌,并于2016年1月14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》,2016年1月14日创业A、创业B即时行情显示的前收盘价为2016年1月13日的创业A、创业B的基金份额参考净值,分别是1.000元和0.922元,2016年1月14日当日创业A份额和创业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:近日创业B份额二级市场交易价格溢价较大,不定期份额折算后,创业B份额的溢价率可能发生较大变化。特提请参与二级市场交易的投资者注意创业B份额高溢价交易所带来的风险。
2、创业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创业A份额持有人的风险收益特征将发生较大变化,由持有单一的较低风险收益特征的创业A份额变为同时持有较低风险收益特征的创业A份额与较高风险收益特征的鹏华创业板分级份额,因此原创业A份额持有人预期收益实现的不确定性将会增加;此外,鹏华创业板分级份额为跟踪创业板指数的基础份额,其份额净值将随市场涨跌而变化,因此原创业A份额持有人还可能会承担因市场下跌而遭受损失的风险。
3、创业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降低,将恢复到初始的2倍杠杆水平,相应地,创业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、原创业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创业板分级份额分拆为创业A份额、创业B份额。
5、根据深圳证券交易所的相关业务规则,创业A份额、创业B份额、鹏华创业板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),舍去部分计入基金财产,持有极小数量创业A份额、创业B份额、鹏华创业板分级份额的持有人,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。
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创业板分级A份额,在不定期份额折算后,则折算新增的鹏华创业板分级份额无法赎回。投资者可以选择在折算前将鹏华创业板分级A份额卖出,或者在折算后将新增的鹏华创业板分级份额转托管到具有基金销售资格的证券公司后赎回。

7、根据《鹏华创业板指数分级证券投资基金基金合同》中关于鹏华创业板分级A份额(场内简称:创业A;基金代码:150243)约定年基准收益率的相关规定:鹏华创业板分级A份额约定年基准收益率为“同期银行人民币一年期定期存款利率(税后)+3%”,同期银行人民币一年期定期存款利率以最近一次份额折算基准日次日中国人民银行公布的金融机构人民币一年期定期存款基准利率为准。鉴于2016年1月13日中国人民银行公布的金融机构人民币一年期定期存款基准利率为1.50%,因此鹏华创业板分级A份额约定年基准收益率从2016年1月13日起调整为4.50%。

8、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及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
2016年1月14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“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,2016年1月12日,国防B在二级市场的收盘价为0.558元,相对于当日0.448元的基金份额参考净值,溢价幅度达到24.55%。截止2016年1月13日,国防B二级市场的收盘价为0.502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,除了有基金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、截至本公告披露日,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阈值。不定期份额折算后,国防B的溢价率可能发生较大变化。特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。
6、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。
特此公告。

鹏华基金管理有限公司
2016年1月14日

鹏华中证国防指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告

根据《鹏华中证国防指数分级证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)中关于不定期份额折算的相关规定,当鹏华中证国防指数分级证券投资基金之B份额的基金份额参考净值跌至0.250元时,鹏华国防分级份额(场内简称:国防分级,基础份额)、鹏华国防A份额(场内简称:国防A)、鹏华国防B份额(场内简称:国防B)将进行不定期份额折算。

由于近期A股市场波动较大,截至2016年1月13日,国防B的基金份额参考净值接近基金合同规定的不定期份额折算条件,因此本基金管理人敬请投资者密切关注国防B近期的参考净值波动情况,并警惕可能出现的风险。

针对不定期折算所带来的风险,本基金管理人特别提示如下:
一、由于国防A、国防B折算前可能存在折溢价交易情形,不定期份额折算后,国防A、国防B的折溢价率可能发生较大变化。特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。
二、国防B表现为高风险、高收益的特征,不定期份额折算后其杠杆将恢复至初始杠杆水平。
三、由于触发折算阈值当日,国防B的参考净值可能已低于阈值,而折算基准日在触发阈值日后才能确定,此折算基准日国防B的净值

可能与折算阈值0.250元有一定差异。

四、国防A表现为低风险、收益相对稳定的特征,但在不定期份额折算后国防A持有人的风险收益特征将发生较大变化,由持有单一的较低风险收益特征国防A变为同时持有较低风险收益特征国防A与较高风险收益特征国防分级的情况,因此国防A持有人预期收益实现的不确定性将会增加。

本基金管理人的其他重要提示:
一、根据深圳证券交易所的相关业务规则,场内份额数将取整计算(最小单位为1份),舍去部分计入基金资产,持有极小数量鹏华国防分级份额、国防A、国防B的持有人存在折算后份额因为不足1份而被强制归入基金资产的风险。
二、为保证折算期间本基金的平稳运作,,基金管理人可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暂停国防A与国防B的上市交易和鹏华国防分级份额的申购及赎回等相关业务。届时本基金管理人将会对相关事项进行公告,敬请投资者予以关注。
投资者若希望了解基金不定期份额折算业务详情,请参阅本基金的基金合同及《鹏华中证国防指数分级证券投资基金招募说明书》(更新)(以下简称“招募说明书”)或者拨打本公司客服电话:400-6788-999(免长途话费)。
三、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资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。
本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。投资有风险,选择须谨慎。敬请投资者于投资前认真阅读本基金的基金合同和招募说明书等相关法律文件。
特此公告。

鹏华基金管理有限公司
2016年1月14日

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”估值确定。

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2016年1月13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
300349	金卡股份
002573	清新环境
002707	众信旅游

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。
投资者可登陆我公司网站(http://www.phfund.com)或拨打客户服务热线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
2016年1月14日

