鹏华基金管理有限公司 关于以通讯方式召开鹏华创业板指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告

鹏华基金管理有限公司已于2020年9月25日在中国证监会规定媒介发布了《鹏华基金管理有限公司关于以通讯方式召开鹏华创业板指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的公告》。并于2020年9月28日在中国证监会规定媒介发布了《鹏华基金管理有限公司关于以通讯方式召开鹏华创业板指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告》。为了使本次基金份额持有人大会顺利召开，现发布关于召开本次会议的第二次提示性公告。

一、召开会议基本情况

根据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《鹏华创业板指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定，鹏华创业板指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金管理人鹏华基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，会议的具体安排如下：

1、会议召开方式：通讯方式开会。

2、会议投票表决起止时间：自2020年9月28日起，至2020年10月28日17:00止（投票表决时间以本公告列明的通讯表决票的寄送地点收到表决票时间）。

3、会议通讯表决票的寄达地点：

地址：深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心第9层

邮政编码：518048

收件人：鹏华基金管理有限公司

联系电话：400-6788-533

请在信封表面注明：“鹏华创业板指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

4、会议咨询电话：400-6788-533

二、会议审议事项

《关于鹏华创业板指数分级证券投资基金转型并修改基金合同等相关事项的议案》（见附件一）。

上述议案的内容说明详见《关于鹏华创业板指数分级证券投资基金转型并修改基金合同等相关事项的议案的说明》（见附件四）。

三、基金份额持有人大会的权益登记日

本次大会的权益登记日为2020年9月28日，即在2020年9月28日下午交易时间结束后，在登记机构登记在册的本基金全体基金份额持有人均有权参加本次基金份额持有人大会并投票表决。

四、表决票的填写和寄交方式

1、本次大会表决票见附件二。基金份额持有人可从相关报纸上剪裁、复印表决票或登录基金管理人网站(www.phfund.com.cn)下载并打印表决票。

2、基金份额持有人应当按照表决票的要求填写相关内容，其中：

（1）个人投资者自行投票的，需在表决票上签字，并提供本人身份证件正反面复印件；

（2）机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本单位公章或经授权(或认可)的业务章（以下合称“公章”），并提供加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）；合格境外机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本单位公章（如有）或由授权代表在表决票上签字（如无公章），并提供该授权代表的身份证件正反面复印件或者护照或其他身份证明文件的复印件，该合格境外机构投资者所签署的授权委托书或者证明该授权代表有权代表该合格境外机构投资者签署表决票的其他证明文件，以及该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件和取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件；

（3）基金份额持有人可根据本公告“五、授权”章节的规定授权本基金的基金管理人以及其他符合法律规定的个人或机构代其在本次基金份额持有人大会上投票。受托人接受基金份额持有人纸面方式授权代理投票的，应由受托人在表决票上签字或盖章，并提供授权委托书原件以及本公告“五、授权”中所规定的基金份额持有人以及受托人的身份证明文件或机构主体资格证明文件等相关文件的复印件；

（4）以上各项中的公章、批文、开户证明及登记证书，以基金管理人的认可为准。

3、基金份额持有人或其代理人需将填妥的表决票和所需的相关文件在2020年9月28日起，至2020年10月28日17:00止的期间内通过专人送交、快递或邮寄挂号信的方式送达至本公告列明的会议通讯表决票的寄达地点，并请在信封表面注明：“鹏华创业板指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

送达时间以本公告列明的通讯表决票的寄达地点收到表决票时间为准，即：专人送达的以实际递交时间为准；快递送达的，以基金管理人签收时间为准；以邮寄挂号信方式送达的，以挂号信回执上注明的收件日期为送达日期。

五、授权

本基金的基金份额持有人如不能亲自参与本次大会，可以授权委托基金管理人或其他符合法律规定的机构和个人等代理人参与大会并投票。

1、纸面方式授权

（1）个人投资者通过纸面方式委托他人投票的，应提供该个人投资者身份证件正反面复印件，以及填妥的授权委托书原件（参照附件三）。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件正反面复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）；

（2）机构投资者通过纸面方式委托他人投票的，应提供该机构投资者的加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等），以及填妥的授权委托书原件。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件正反面复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。合格境外机构投资者委托他人投票的，应提供该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件，以及取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件，以及填妥的授权委托书原件。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。

（3）以上各项中的公章、批文、开户证明、登记证书等，以基金管理人的认可为准。

（4）授权文件的送达

基金份额持有人授权文件的送达方式、送达时间、收件地址、联系方式等与表决票送达要求一致。

2、网络授权（仅适用于个人投资者授权给基金管理人）

为方便基金份额持有人参与大会，基金管理人提供官方微信（微信号：鹏华基金）、官方APP（APP名称：A加钱包）通道供个人投资者进行授权，上海天天基金销售有限公司及蚂蚁（杭州）基金销售有限公司提供小程序（小程序名称：鹏华分级产品转型投票大会）通道供各自个人投资者进行授权，由基金管理人根据授权人的表决意见代为行使表决权。

网络授权的起止时间自2020年9月28日起至2020年10月26日17:00止（授权时间以系统记录时间为准）。通过网络进行授权的基金份额持有人，应正确填写姓名、证件号码等信息，以核实基金份额持有人的身份，确保基金份额持有人权益。

基金份额持有人通过上述网络授权的方式仅适用于个人投资者，对机构投资者暂不开通。上述网络授权的方式仅限授权给基金管理人。

3、授权的确定原则

（1）如果基金份额持有人进行了授权委托，又存在直接投票表决，则以直接表决为有效表决，授权委托无效。

（2）如果同一基金份额持有人存在包括有效纸面方式授权和有效网络授权的，以有效的纸面授权为准。多次以有效纸面方式授权的，以基金管理人接收到的最后一次纸面授权为准。同时多次以有效纸面方式授权的，若授权表示一致，以一致的授权表示为准；若授权表示不一致，视为无效授权；

（3）如果同一基金份额持有人以有效网络授权方式进行多次授权的，以最后一次的授权为准。同时多次以网络授权方式进行授权的，若授权表示一致，以一致的授权表示为准；若授权表示不一致，视为无效授权；

（4）如委托人未在授权委托表示中明确其表决意见的，视为委托人授权受托人按照受托人的意志行使表决权；如委托人在授权委托表示中表达多种表决意见的，视为无效授权。

六、计票

1、本次通讯会议的计票方式为：由基金管理人授权的两名监督员在基金托管人（中国建设银行股份有限公司）授权代表的监督下于本次通讯会议的表决截止日期（即2020年10月28日）后2个工作日内进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

2、基金份额持有人持有的每一基金份额在其对应的份额类别内拥有平等的投票权。

3、表决票效力的认定如下：

（1）表决票填写完整清晰，所提供文件符合本会议通知规定，且在规定时间之内送达本公告列明的通讯表决票的寄送地点的，为有效表决票；有效表决票按表决意见计入相应的表决结果，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

（2）如表决票上的表决意见未填、多填、字迹模糊不清、无法辨认或意愿无法判断或相互矛盾，但其他各项符合会议通知规定的，视为弃权表决，计入有效表决票；并按“弃权”计入对应的表决结果，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

（3）如表决票上的签字或盖章部分填写不完整、不清晰的，或未能提供有效证明基金份额持有人身份或代理人经有效授权的证明文件的，或未能在规定时间之内送达本公告列明的通讯表决票的寄送地点的，均为无效表决票；无效表决票不计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

（4）基金份额持有人重复提交表决票的，如各表决票表决意见相同，则视为同一表决票；如各表决票表决意见不相同，则按如下原则处理：

①送达时间不是同一天的，以最后送达日所填写的有效的表决票为准，先送达的表决票视为被撤回；

②送达时间为同一天的，视为在同一表决票上做出了不同表决意见，计入弃权表决票；

③送达时间确定原则见“四、表决票的填写和寄交方式”中相关说明。

七、决议生效条件

1、有效表决票所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的二分之一以上（指全部有效凭证所对应的鹏华创业板份额、鹏华创业板A份额、鹏华创业板B份额分别占权益登记日各自基金总份额的二分之一以上，含二分之一）时，表明该有效表决票所代表的基金份额持有人参加了此次通讯会议，会议有效召开；在此基础上，《关于鹏华创业板指数分级证券投资基金转型并修改基金合同等相关事项的议案》应当经参加大会的鹏华创业板份额、鹏华创业板A份额、鹏华创业板B份额各自基金份额的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方为有效。

2、本次基金份额持有人大会决议通过的事项，本基金管理人自通过之日起五日内报中国证监会备案，基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。法律法规另有规定的，从其规定。

八、二次召集基金份额持有人大会及二次授权

根据《基金法》及《鹏华创业板指数分级证券投资基金基金合同》的规定，本次持有人大会需要出席大会的基金份额持有人或其代理人所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的二分之一以上（指全部有效凭证所对应的鹏华创业板份额、鹏华创业板A份额、鹏华创业板B份额分别占权益登记日各自基金总份额的二分之一以上，含二分之一）方可召开。如果本次基金份额持有人大会不符合前述要求而不能够成功召开，本基金管理人可在规定时间内就同一议案重新召集基金份额持有人大会。重新召开基金份额持有人大会时，除非授权文件另有载明，本次基金份额持有人大会授权期间基金份额持有人作出的各类授权依然有效，但如果授权方式发生变化或者基金份额持有人重新作出授权，则以最新方式或最新授权为准，详细说明见届时发布的重新召集基金份额持有人大会的通知。

九、本次大会相关机构

1、召集人：鹏华基金管理有限公司

联系人：朱海威

联系电话：400－6788－533

传真：0755－82021155

网址：www.phfund.com.cn

2、基金托管人：中国建设银行股份有限公司

3、公证机构：北京市中信公证处

联系人：王雪

联系电话：010-81136530

4、见证律师事务所：上海市通力律师事务所

十、重要提示

1、如本次基金份额持有人大会未成功召开或《关于鹏华创业板指数分级证券投资基金转型并修改基金合同等相关事项的议案》未通过的，基金管理人将根据中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会、中国证券监督管理委员会、国家外汇管理局联合发布的《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》的要求于 2020 年底完成本基金的整改，取消分级运作机制，将鹏华创业板A份额与鹏华创业板B份额按照各自的基金份额净值转换成鹏华创业板份额的场内份额。届时，基金管理人将相应变更基金名称、修改基金合同并就取消分级运作的安排进行公告。敬请投资者合理安排投资计划。

2、请基金份额持有人在提交表决票时，充分考虑邮寄在途时间，提前寄出表决票。

3、本次基金份额持有人大会有关公告可通过基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站（http://eid.csrc.gov.cn/fund）查阅，投资者如有任何疑问，可致电基金管理人客户服务电话400－6788－533（免长途话费）咨询。

4、本通知的有关内容由鹏华基金管理有限公司负责解释。

5、本基金管理人将根据深圳证券交易所的业务规则，向深圳证券交易所申请本基金在此期间的停复牌安排，即：刊登《鹏华基金管理有限公司关于以通讯方式召开鹏华创业板指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的公告》之日（2020年9月25日），鹏华创业板A份额及鹏华创业板B份额上午开市起至当日上午10点30分停牌，并将在计票日（2020年10月29日）当日上午开市起至基金份额持有人大会决议生效公告日上午10点30分停牌，如基金份额持有人大会决议生效公告发布日为非交易日，则生效公告日后首个交易日开市时复牌。

鹏华基金管理有限公司

二〇二〇年九月二十九日

附件一：《关于鹏华创业板指数分级证券投资基金转型并修改基金合同等相关事项的议案》

附件二：《鹏华创业板指数分级证券投资基金基金份额持有人大会通讯表决票》

附件三：《授权委托书》

附件四：《关于鹏华创业板指数分级证券投资基金转型并修改基金合同等相关事项的议案的说明》

附件五：《鹏华创业板指数证券投资基金（LOF）基金合同》

附件一：

《关于鹏华创业板指数分级证券投资基金转型并修改基金合同等相关事项的议案》

鹏华创业板指数分级证券投资基金基金份额持有人：

结合市场环境变化，为了更好地满足投资者的投资需求，保护基金份额持有人利益，根据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》和《鹏华创业板指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，鹏华创业板指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金管理人—鹏华基金管理有限公司经与基金托管人—中国建设银行股份有限公司协商一致，提议对鹏华创业板指数分级证券投资基金进行调整，修改基金名称、投资范围、投资策略、投资限制、收益分配方式、估值方法等相关转型事项，并根据鹏华创业板指数分级证券投资基金成立以来法律法规的变动对《基金合同》的其他内容予以调整。具体说明见附件四《关于鹏华创业板指数分级证券投资基金转型并修改基金合同等相关事项的议案的说明》。

本议案如获得基金份额持有人大会审议通过，基金管理人将根据基金份额持有人大会决议对《基金合同》进行修改。本基金的招募说明书及托管协议也将进行必要的修改或补充。

以上议案，请予审议。

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

附件二：

鹏华创业板指数分级证券投资基金基金份额持有人大会通讯表决票

基金份额持有人姓名/名称：

证件号码（身份证件号/营业执照注册号）：

开放式基金账户号/证券账户号：

审议事项	同意	反对	弃权
关于鹏华创业板指数分级证券投资基金转型并修改基金合同等相关事项的议案			

基金份额持有人/受托人（代理人）（签字或盖章）

日期：年 月 日

说明：

1、请就审议事项表示“同意”、“反对”或“弃权”，并在相应栏内画“√”，同一议案基金份额持有人只能选择一种表决意见。以上表决意见是基金份额持有人或其受托人（代理人）就基金份额持有人在该开放式基金账户/证券账户下持有的本基金全部份额做出的表决意见。如未填写，则视为对基金份额持有人全部账户下持有的本基金全部份额做出表决意见。

2、未填、多填、字迹模糊不清、无法辨认或意愿无法判断或相互矛盾的表决票均视为投票人放弃表决权利，其所持全部基金份额的表决结果均计为“弃权”。

3、本表决票可从相关网站(www.phfund.com.cn)下载、从报纸上剪裁、复印或按此格式打印。

附件三：

授权委托书

兹全权委托 先生／女士或 机构代表本人（或本机构）参加以通讯开会方式召开的鹏华创业板指数分级证券投资基金基金份额持有人大会，并代为全权行使所有议案的表决权。表决意见以受托人的表决意见为准。本授权不得转授权。若在法定时间内就同一议案重新召开鹏华创业板指数分级证券投资基金基金份额持有人大会，除本人（或本机构）重新作出授权外，本授权继续有效。

委托人（签字/盖章）：

委托人身份证件号或营业执照注册号：

开放式基金账户号/证券账户号：

受托人（代理人）（签字/盖章）：

受托人（代理人）身份证件号或营业执照注册号：

委托日期：年 月 日

附注：

1、以上授权是基金份额持有人就其在该开放式基金账户/证券账户下持有的本基金全部份额向受托人所做授权。如未填写，则视为对基金份额持有人全部账户下持有的本基金全部份额做出表决意见。

2、此授权委托书剪报、复印或按以上格式自制在填写完整并签字盖章后均为有效。

附件四：

《关于鹏华创业板指数分级证券投资基金转型并修改基金合同等相关事项的议案的说明》

一、声明

1、结合市场环境变化，为了更好地满足投资者的投资需求，保护基金份额持有人利益，根据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》和《鹏华创业板指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定，鹏华创业板指数分级证券投资基金（以下简称“鹏华创业板分级基金”）的基金管理人鹏华基金管理有限公司经与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，决定召开基金份额持有人大会，讨论并审议《关于鹏华创业板指数分级证券投资基金转型并修改基金合同等相关事项的议案》。

2、本次基金份额持有人大会需由持有有效的鹏华创业板份额、鹏华创业板A份额、鹏华创业板B份额各自基金份额的二分之一（含二分之一）的持有人出席方可召开，且《关于鹏华创业板指数分级证券投资基金转型并修改基金合同等相关事项的议案》需经参加大会的鹏华创业板份额、鹏华创业板A份额、鹏华创业板B份额各自基金份额的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方为有效，存在未能达到开会条件或无法获得相关持有人大会表决通过的可能。

3、持有人大会的决议自表决通过之日起生效。中国证监会对持有人大会表决通过的事项所作的任何决定或意见，均不表明其对本基金的价值或者投资人的收益做出实质性判断或保证。

二、调整方案要点

（一）变更基金名称

基金名称由“鹏华创业板指数分级证券投资基金”变更为“鹏华创业板指数证券投资基金（LOF）”。

（二）调整运作方式

鹏华创业板指数分级证券投资基金为契约型开放式、分级运作的基金，变更后，鹏华创业板指数证券投资基金（LOF）为上市契约型开放式基金，不再设置分级运作、配对转换和分级折算机制。

（三）调整交易、申赎机制

变更前，鹏华创业板指数分级证券投资基金的基础份额不上市交易，投资者可以在场内和场外申购赎回基础份额，鹏华创业板A份额和鹏华创业板B份额上市交易，但不可申购赎回。此外，鹏华创业板指数分级证券投资基金不同份额之间设置配对转换机制，投资者可以将持有的鹏华创业板A份额和鹏华创业板B份额合并为场内基础份额，也可以将持有的场内基础份额分拆为鹏华创业板A份额和鹏华创业板B份额。

变更后，投资者可以在场内和场外申购赎回鹏华创业板指数证券投资基金（LOF）基金份额。在鹏华创业板指数证券投资基金（LOF）基金合同生效后，基金份额可在符合法律法规和深圳证券交易所规定的上市条件的情况下上市交易。

（四）调整投资范围、投资策略、投资限制、风险收益特征等投资相关条款

对鹏华创业板指数分级证券投资基金原《基金合同》中投资范围、投资策略、投资限制、风险收益特征等内容进行了调整，主要调整如下：

	修改前	修改后
投资范围		新增“融资及转融通证券出借业务”； 本基金可依据法律法规的规定，参与融资及转融通证券出借业务。
投资策略		新增“参与融资及转融通证券出借业务策略”： 4、参与融资及转融通证券出借业务策略 本基金可在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素基础上，参与融资业务。 为更好地实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎经营原则的前提下，本基金可根据投资情况的需要参与转融通证券出借业务。本基金将在分析市场环境、投资者类型与结构、基金历史申赎情况、出借证券流动性情况等因素的基础上，合理确定出借证券的范围、期限和比例。
投资限制		新增“融资及转融通证券出借业务”的投资限制： （22）本基金参与融资的，每个交易日日终，本基金持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的50%； （23）本基金参与转融通证券出借业务，应当遵守下列要求： a.出借证券资产不得超过基金资产净值的30%，出借期限在10个交易日以上的出借证券应纳入“流动性风险管理规定”所述流动性受限证券的范围。 b.参与出借业务的单只证券不得超过本基金持有该证券总量的50%。 c. 最近6个月内日均基金资产净值不得低于2亿元； d. 证券出借的平均剩余期限不得超过30天，平均剩余期限按照市值加权平均计算；
投资限制	除上述第（2）、（11）、（20）、（21）条外，因证券/期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。	除上述第（2）、（11）、（20）、（21）、（23）条外，因证券/期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合第（23）项规定的，基金管理人不得新增出借业务，但中国证监会规定的特殊情形除外。
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。同时本基金为指数基金，通过跟踪标的指数获利，其有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。 从本基金所分拆的两类基金份额来看，鹏华创业板A份额为稳健收益类份额，具有低风险且预期收益相对较低的特征；鹏华创业板B份额为杠杆收益类份额，具有高风险且预期收益相对较高的特征。	本基金属于股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金，同时本基金为指数基金，通过跟踪标的指数获利，具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。

（五）调整收益分配方式

对鹏华创业板指数分级证券投资基金原《基金合同》中基金的收益分配内容进行了调整（详见附件五），主要调整如下：

	修改前	修改后
基金的收益与分配	在存续期内，本基金（包括鹏华创业板份额、鹏华创业板A份额、鹏华创业板B份额）不进行收益分配。 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。	一、基金利润的构成 基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额。基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。 二、基金可供分配利润 基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。 三、基金收益分配原则 1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满6个月可不进行收益分配。 2、本基金场外收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；本基金场内收益分配方式为现金分红。 3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，因基金收益分配导致基金份额净值低于面值部分的收益分配方案应不进行收益分配。 4、每份基金份额享有同等分配权； 5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。 在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人与基金托管人协商一致后可调整基金收益分配时间和支付方式，不需召开基金份额持有人大会。 四、收益分配方案 基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配频率及比例、分配方式等内容。 五、收益分配方案的确定、公告与实施 本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在2日内在规定媒介公告。 六、基金收益分配中发生的费用 基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。对于场外份额，当投资者的应收收益利息小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金管理人将将基金份额持有人的应收红利自动转为基金份额，红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。对于场内份额，遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定。

（六）调整估值方法

变更后，鹏华创业板指数证券投资基金（LOF）投资范围中新增了转融通证券出借业务，故增加转融通证券出借业务的估值方法。

（七）其他相关事项的修改

1、删除基金合同中关于基金份额发售的部分，并补充基金的历史沿革等内容。

2、考虑到自《鹏华创业板指数分级证券投资基金基金合同》生效以来，《基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其配套准则等法律法规陆续修订和发布，基金管理人需要根据法律法规的要求及转型后的鹏华创业板指数证券投资基金（LOF）的产品特征修订《鹏华创业板指数分级证券投资基金基金合同》的相关内容。修改后的基金合同详见附件五《鹏华创业板指数证券投资基金（LOF）基金合同》。

综上所述，基金管理人拟提请基金份额持有人大会授权基金管理人按照法律法规的规定及转型后的鹏华创业板指数证券投资基金（LOF）的产品特征、根据基金份额持有人大会决议修订基金合同的其他内容。

三、转型选择期及之后的相关安排

（一）转型选择期的相关安排

本次持有人大会决议生效后，鹏华创业板指数分级证券投资基金将在转型正式实施前安排不少于二十个交易日的选择期以供基金份额持有人做出选择（如赎回，场内鹏华创业板A份额、鹏华创业板B份额配对合并后赎回），具体安排详见基金管理人届时发布的相关公告。

转型选择期期间，原鹏华创业板指数分级证券投资基金赎回、基金份额转换转出、场内鹏华创业板A份额和鹏华创业板B份额配对合并、场内交易业务照常办理。对于在选择期内未作出选择的基金份额持有人，其持有的原鹏华创业板份额、鹏华创业板A份额、鹏华创业板B份额将最终转换为鹏华创业板指数证券投资基金（LOF）。

在选择期期间，投资者选择赎回的，仍适用鹏华创业板指数分级证券投资基金的赎回费率和赎回费计入基金财产的比例。

由于鹏华创业板指数分级证券投资基金在选择期期间需应对赎回等情况，基金份额持有人同意在选择期豁免鹏华创业板指数分级证券投资基金基金合同中约定的投资组合比例限制等条款，并自本次基金份额持有人大会议案被表决通过之日起可豁免进行基金份额折算业务。基金管理人提请基金份额持有人大会授权基金管理人据此落实相关事项，并授权基金管理人可根据实际情况做相应调整，以及根据实际情况可暂停申购、赎回、转换或调整赎回方式等。

（二）原基金份额转换的业务规则

转型选择期结束后，以基金份额转换基准日（具体日期详见基金管理人届时发布的相关公告）日终鹏华创业板份额的基金份额净值为基准，鹏华创业板A份额、鹏华创业板B份额按照各自的基金份额净值转换为鹏华创业板指数证券投资基金（LOF）的基金份额。

在本次基金份额持有人大会决议生效后，基金管理人将按照深圳证券交易所的业务规则申请办理鹏华创业板A份额、鹏华创业板B份额终止上市等相关业务。鹏华创业板A份额、鹏华创业板B份额终止上市日为基金份额转换基准日。

份额转换计算公式如下：

鹏华创业板A份额（或鹏华创业板B份额）的转换比例＝基金份额转换基准日鹏华创业板A份额（或鹏华创业板B份额）的基金份额净值/基金份额转换基准日鹏华创业板份额的基金份额净值

鹏华创业板A份额（或鹏华创业板B份额）基金份额持有人持有的转换后鹏华创业板指数证券投资基金（LOF）场内份额＝基金份额持有人持有的转换前鹏华创业板A份额（或鹏华创业板B份额）的份额数×鹏华创业板A份额（或鹏华创业板B份额）的转换比例

鹏华创业板A份额、鹏华创业板B份额经转换后的份额采用截位取整计算（最小单位为1份），取整后的余额计入基金资产。故基金份额转换后，由于基金份额数取整计算产生的误差，基金份额持有人存在着基金资产净值减小的风险。对于持有份额较少的鹏华创业板A份额、鹏华创业板B份额的持有人，存在着持有的基金份额转换后份额数不足一份而被计入基金资产的风险。

鹏华创业板份额的场内份额自动转换为鹏华创业板指数证券投资基金（LOF）的场内份额，鹏华创业板份额的场外份额自动转换为鹏华创业板指数证券投资基金（LOF）的场外份额。

中国证券登记结算有限公司将于转换完成后对基金份额变更登记，其中鹏华创业板份额的场外份额变更登记为鹏华创业板指数证券投资基金（LOF）的场外份额，鹏华创业板份额的场内份额、鹏华创业板A份额、鹏华创业板B份额变更登记为鹏华创业板指数证券投资基金（LOF）的场内份额。

根据有关业务规则，基金份额持有人持有的鹏华创业板份额转换为鹏华创业板指数证券投资基金（LOF）后，其原基金份额持有期计入鹏华创业板指数证券投资基金（LOF）的持有期，基金份额持有人持有的鹏华创业板A份额和鹏华创业板B份额转换为鹏华创业板指数证券投资基金（LOF）场内份额后，基金份额持有期自鹏华创业板指数证券投资基金（LOF）场内份额确认之日起计算，基金份额持有人赎回份额时适用的赎回费率将根据持有期确定，具体持有时间以登记机构系统记录为准。如果赎回份额时持有期较短，基金份额持有人将承担较高的赎回费。

涉及本基金的基金份额转换、退市等事项的实施安排将提前公告。

（三）基金转换的特别风险揭示

1、鹏华创业板A份额和鹏华创业板B份额转换后风险收益特征发生较大变化的风险

鹏华创业板A份额表现为低风险、预期收益相对较低的特征，分级运作期内按基金合同约定获得相应年基准收益率，但在份额转换后，鹏华创业板A份额持有人原持有的较低风险收益特征的鹏华创业板A份额将变为较高风险收益特征的鹏华创业板指数证券投资基金（LOF）场内份额，基金份额风险收益特征将因转换而发生较大变化。由于鹏华创业板指数证券投资基金（LOF）场内份额为跟踪创业板指数的基金份额，无约定年基准收益率的相关安排，其基金份额净值将随标的指数的涨跌而变化，原鹏华创业板A份额持有人将承担因市场下跌而遭受损失的风险。

鹏华创业板B份额具有一定的杠杆属性，表现为高风险、预期收益相对较高的特征，但在份额转换后，鹏华创业板B份额持有人原持有的鹏华创业板B份额将变为较高风险收益特征的鹏华创业板指数证券投资基金（LOF）场内份额，基金份额风险收益特征将因转换而发生较大变化。由于鹏华创业板指数证券投资基金（LOF）场内份额为跟踪创业板指数的基金份额，没有杠杆特征，其基金份额净值将随标的指数的涨跌而变化，原鹏华创业板B份额持有人将无法继续享有杠杆安排且仍需承担因市场下跌而遭受损失的风险。

2、鹏华创业板A份额和鹏华创业板B份额的流动性风险

鹏华创业板A份额和鹏华创业板B份额转换为鹏华创业板指数证券投资基金（LOF）场内份额前，鹏华创业板A份额和鹏华创业板B份额的持有人有两种方式退出：1）在场内按市价卖出基金份额；2）在场内买入等量的对应份额（即鹏华创业板A份额持有人买入等量的鹏华创业板B份额，或者鹏华创业板B份额持有人买入等量的鹏华创业板A份额），合并为鹏华创业板份额，按照鹏华创业板份额的基金份额净值申请场内赎回或转托管至场外后申请赎回。由于鹏华创业板A份额和鹏华创业板B份额的持有人可能选择场内卖出或合并赎回，场内份额数量可能发生较大下降，可能出现场内流动性不足的情况，特提请投资者注意流动性风险。

3、转换前存在溢价交易的鹏华创业板A份额和鹏华创业板B份额的持有人因溢价消失而造成损失的风险

转型选择期间，鹏华创业板A份额和鹏华创业板B份额仍可正常交易。期间，鹏华创业板A份额和鹏华创业板B份额可能存在折溢价交易情形，其折溢价率可能发生较大变化。

由于基金份额转换基准日日终，鹏华创业板A份额和鹏华创业板B份额均按各自的基金份额净值（而不是二级市场价格）转换为鹏华创业板指数证券投资基金（LOF）场内份额，如果投资者在转换前以溢价买入，转换后可能遭受较大损失。特提请参与二级市场交易的投资者注意折溢价所带来的风险。

4、鹏华创业板A份额和鹏华创业板B份额转换为鹏华创业板指数证券投资基金（LOF）场内份额后无法办理场内赎回的风险

鹏华创业板A份额和鹏华创业板B份额转换为鹏华创业板指数证券投资基金（LOF）场内份额后，投资者可以申请场内赎回基金份额或者转托管至场外后申请赎回基金份额。对于无法办理场内赎回的投资者，需先转托管至场外后再申请赎回或者先转托管到具有基金销售资格的证券公司后再申请赎回。

5、在鹏华创业板指数证券投资基金（LOF）开放赎回之前，投资者将无法办理基金赎回业务；在鹏华创业板指数证券投资基金（LOF）上市交易之前，投资者将无法进行基金份额的上市交易，存在一定的流动性风险。

四、《鹏华创业板指数证券投资基金（LOF）基金合同》的生效及后续安排

基金份额转换完成后，《鹏华创业板指数证券投资基金（LOF）基金合同》正式生效，具体生效日期本基金管理人将另行公告。自《鹏华创业板指数证券投资基金（LOF）基金合同》生效日起，《鹏华创业板指数分级证券投资基金基金合同》同时失效，鹏华创业板指数分级证券投资基金正式变更为鹏华创业板指数证券投资基金（LOF），本基金的基金合同当事人将按照《鹏华创业板指数证券投资基金（LOF）基金合同》享有权利并承担义务。

鹏华创业板指数证券投资基金（LOF）自基金合同生效之日起不超过3个月开始办理申购、赎回等业务。在符合上市条件的前提下，基金管理人将依据《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》，向深圳证券交易所申请鹏华创业板指数证券投资基金（LOF）基金份额上市交易。

五、基金投资范围、投资策略调整后的投资可行性

（一）投资方面

基金管理人已经对基金投资范围、投资策略调整后的投资运作进行了充分的分析。鹏华创业板分级基金转型后，将采用被动式指数化投资方法对创业板指数进行有效跟踪，力争实现基金份额净值增长率与同期业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度及跟踪误差达到基金合同的要求。

我司于2011年正式成立量化投资部(现更名为量化及衍生品投资部)，具备丰富的指数产品的投资管理经验。公司建立了完善的指数管理流程，标准化的指数管理平台，能够满足各类指数产品的投资管理要求。鹏华创业板分级基金转型后在投资方面具有较好的可行性。

（二）法律方面

《基金合同》约定，涉及更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、终止基金合同、本基金与其他基金合并必须以特别决议通过方为有效。

本次鹏华创业板分级基金删除分级运作机制并调整基金名称、投资范围、投资策略、投资限制、收益分配方式、估值方法等事项需召开基金份额持有人大会，且本次基金份额持有人大会决议属于特别决议，特别决议应当经参加大会的鹏华创业板份额、鹏华创业板A份额、鹏华创业板B份额各自基金份额的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过即为有效，基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

六、基金转型的主要风险及预备措施

（一）基金份额持有人大会不能成功召开的风险

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及《鹏华创业板指数分级证券投资基金基金合同》的规定，基金份额持有人大会应当由权益登记日分别代表鹏华创业板份额、鹏华创业板A份额、鹏华创业板B份额二分之一以上（含二分之一）基金份额的持有人参加，方可召开。为防范本次基金份额持有人大会不符合上述要求而不能成功召开，基金管理人将在会前尽可能与基金份额持有人进行预沟通，争取更多的持有人参加基金份额持有人大会。

（二）关于鹏