

2020年12月23日 星期三

关于鹏华创业板指数分级证券投资基 金之鹏华创业板A份额和鹏华创业板B 份额终止运作的特别风险提示公告

根据《关于鹏华创业板指数分级证券投资基金之鹏华创业板A份额和鹏华创业板B份额终止运作、终止上市的并修改基金合同的公告》，鹏华创业板指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）之鹏华创业板A份额（场内简称：创业板A，基金代码：150243）和鹏华创业板B份额（场内简称：创业板B，基金代码：150244）的终止上市日期为2021年1月4日（最后交易日为2020年12月31日），份额折算基准日为2020年12月31日。在份额折算基准日当日终，以鹏华创业板份额（场内简称：创业板指基，基金代码：160637）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折算成场内鹏华创业板份额。

针对本基金之鹏华创业板A份额和鹏华创业板B份额终止运作、终止上市的相关安排，基金管理人特别提示如下风险事项，敬请投资者关注：

1、鹏华创业板A份额和鹏华创业板B份额的基金份额持有人持有的基金份额数量将在折算后发生较大变化。

在基金份额折算基准日当日终以鹏华创业板份额净值为基准，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折算成场内鹏华创业板份额，鹏华创业板A份额、鹏华创业板B份额持有人将各自持有的基金份额净值折算成场内鹏华创业板A份额、鹏华创业板B份额持有人，将面临持有的基金份额折算后净值不足1份而被计入基金资产的风险。

鹏华创业板A份额和鹏华创业板B份额的基金份额持有人持有的基金份额数量将在折算后发生较大变化。

由于鹏华创业板份额净值为场内鹏华创业板指数的基金份额，其基金份额净值将随标的指数的涨跌而变化，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A份额和鹏华创业板B份额的基金份额持有人持有的基金份额数量将在折算后发生较大变化。

假设份额折算基准日时点鹏华创业板A份额、鹏华创业板B份额的基金份额净值分别为1.150元、1.042元，1.258元，投资者甲、乙，丙分别持有场内鹏华创业板份额、鹏华创业板A份额、鹏华创业板B份额各100,000份，其持有的基金份额的变化如下表所示：

	折算前	折算后		
基金份额(净值)	基金份额(份)	份额折算比例	基金份额净值(元)	基金份额
场内鹏华创业板A份额	1,150	100,000	(不变)	1,150 100,000份场内鹏华创业板A份额
鹏华创业板A份额	1,042	100,000	0.906098967(全部折算为场内鹏华创业板A份额)	1,150 90,608份场内鹏华创业板A份额
鹏华创业板B份额	1,258	100,000	1.093913043(全部折算为场内鹏华创业板B份额)	1,150 109,391份场内鹏华创业板B份额

2、鹏华创业板A份额和鹏华创业板B份额折算为鹏华创业板份额后风险收益特征发生较大变化的风

险。鹏华创业板A份额表现较为低风险的特征，但在份额折算后，鹏华创业板A份额持有人将持有相对较高的鹏华创业板指数的基金份额，其基金份额净值将随标的指数的涨跌而变化，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A份额和鹏华创业板B份额折算为鹏华创业板份额后风险收益特征发生较大变化的风

险。鹏华创业板A份额持有人将持有相对较低风险的鹏华创业板指数的基金份额，其基金份额净值将随标的指数的涨跌而变化，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。

3、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份额折算为鹏华创业板份额后风险收益特征发生较大变化的风

险。鹏华创业板A份额持有人将有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。

4、折算前存在溢价交易的鹏华创业板A份额和鹏华创业板B份额持有人有因溢价消失而造成损失的风

险。鹏华创业板A份额和鹏华创业板B份额折算为鹏华创业板份额后风险收益特征发生较大变化的风

险。鹏华创业板A份额持有人将有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变化。

在份额折算基准日时点鹏华创业板A份额、鹏华创业板B份额的基金份额净值分别为1.150元、1.042元、1.258元，投资者甲、乙，丙分别持有场内鹏华创业板份额、鹏华创业板A份额、鹏华创业板B份额各100,000份，其持有的基金份额的变化如下表所示：

	折算前	折算后		
基金份额(净值)	基金份额(份)	份额折算比例	基金份额净值(元)	基金份额
场内鹏华创业板A份额	1,150	100,000	(不变)	1,150 100,000份场内鹏华创业板A份额
鹏华创业板A份额	1,042	100,000	0.906098967(全部折算为场内鹏华创业板A份额)	1,150 90,608份场内鹏华创业板A份额
鹏华创业板B份额	1,258	100,000	1.093913043(全部折算为场内鹏华创业板B份额)	1,150 109,391份场内鹏华创业板B份额

3、鹏华创业板A份额和鹏华创业板B份额折算为鹏华创业板份额后风险收益特征发生较大变化的风

险。鹏华创业板A份额表现较为低风险的特征，但在份额折算后，鹏华创业板A份额持有人将持有相对较高的鹏华创业板指数的基金份额，其基金份额净值将随标的指数的涨跌而变化，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A份额和鹏华创业板B份额折算为鹏华创业板份额后风险收益特征发生较大变化的风

险。鹏华创业板A份额持有人将有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变化。

在份额折算基准日时点鹏华创业板A份额、鹏华创业板B份额的基金份额净值分别为1.150元、1.042元、1.258元，投资者甲、乙，丙分别持有场内鹏华创业板份额、鹏华创业板A份额、鹏华创业板B份额各100,000份，其持有的基金份额的变化如下表所示：

	折算前	折算后		
基金份额(净值)	基金份额(份)	份额折算比例	基金份额净值(元)	基金份额
场内鹏华创业板A份额	1,150	100,000	(不变)	1,150 100,000份场内鹏华创业板A份额
鹏华创业板A份额	1,042	100,000	0.906098967(全部折算为场内鹏华创业板A份额)	1,150 90,608份场内鹏华创业板A份额
鹏华创业板B份额	1,258	100,000	1.093913043(全部折算为场内鹏华创业板B份额)	1,150 109,391份场内鹏华创业板B份额

4、折算前存在溢价交易的鹏华创业板A份额和鹏华创业板B份额持有人有因溢价消失而造成损失的风

险。鹏华创业板A份额和鹏华创业板B份额折算为鹏华创业板份额后风险收益特征发生较大变化的风

险。鹏华创业板A份额持有人将有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变化。

在份额折算基准日时点鹏华创业板A份额、鹏华创业板B份额的基金份额净值分别为1.150元、1.042元、1.258元，投资者甲、乙，丙分别持有场内鹏华创业板份额、鹏华创业板A份额、鹏华创业板B份额各100,000份，其持有的基金份额的变化如下表所示：

	折算前	折算后		
基金份额(净值)	基金份额(份)	份额折算比例	基金份额净值(元)	基金份额
场内鹏华创业板A份额	1,150	100,000	(不变)	1,150 100,000份场内鹏华创业板A份额
鹏华创业板A份额	1,042	100,000	0.906098967(全部折算为场内鹏华创业板A份额)	1,150 90,608份场内鹏华创业板A份额
鹏华创业板B份额	1,258	100,000	1.093913043(全部折算为场内鹏华创业板B份额)	1,150 109,391份场内鹏华创业板B份额

5、折算前存在溢价交易的鹏华创业板A份额和鹏华创业板B份额持有人有因溢价消失而造成损失的风

险。鹏华创业板A份额和鹏华创业板B份额折算为鹏华创业板份额后风险收益特征发生较大变化的风

险。鹏华创业板A份额持有人将有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变化。

在份额折算基准日时点鹏华创业板A份额、鹏华创业板B份额的基金份额净值分别为1.150元、1.042元、1.258元，投资者甲、乙，丙分别持有场内鹏华创业板份额、鹏华创业板A份额、鹏华创业板B份额各100,000份，其持有的基金份额的变化如下表所示：

	折算前	折算后		
基金份额(净值)	基金份额(份)	份额折算比例	基金份额净值(元)	基金份额
场内鹏华创业板A份额	1,150	100,000	(不变)	1,150 100,000份场内鹏华创业板A份额
鹏华创业板A份额	1,042	100,000	0.906098967(全部折算为场内鹏华创业板A份额)	1,150 90,608份场内鹏华创业板A份额
鹏华创业板B份额	1,258	100,000	1.093913043(全部折算为场内鹏华创业板B份额)	1,150 109,391份场内鹏华创业板B份额

6、折算前存在溢价交易的鹏华创业板A份额和鹏华创业板B份额持有人有因溢价消失而造成损失的风

险。鹏华创业板A份额和鹏华创业板B份额折算为鹏华创业板份额后风险收益特征发生较大变化的风

险。鹏华创业板A份额持有人将有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变化。

在份额折算基准日时点鹏华创业板A份额、鹏华创业板B份额的基金份额净值分别为1.150元、1.042元、1.258元，投资者甲、乙，丙分别持有场内鹏华创业板份额、鹏华创业板A份额、鹏华创业板B份额各100,000份，其持有的基金份额的变化如下表所示：

	折算前	折算后		
基金份额(净值)	基金份额(份)	份额折算比例	基金份额净值(元)	基金份额
场内鹏华创业板A份额	1,150	100,000	(不变)	1,150 100,000份场内鹏华创业板A份额
鹏华创业板A份额	1,042	100,000	0.906098967(全部折算为场内鹏华创业板A份额)	1,150 90,608份场内鹏华创业板A份额
鹏华创业板B份额	1,258	100,000	1.093913043(全部折算为场内鹏华创业板B份额)	1,150 109,391份场内鹏华创业板B份额

7、折算前存在溢价交易的鹏华创业板A份额和鹏华创业板B份额持有人有因溢价消失而造成损失的风

险。鹏华创业板A份额和鹏华创业板B份额折算为鹏华创业板份额后风险收益特征发生较大变化的风

险。鹏华创业板A份额持有人将有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变化。

在份额折算基准日时点鹏华创业板A份额、鹏华创业板B份额的基金份额净值分别为1.150元、1.042元、1.258元，投资者甲、乙，丙分别持有场内鹏华创业板份额、鹏华创业板A份额、鹏华创业板B份额各100,000份，其持有的基金份额的变化如下表所示：

	折算前	折算后		
基金份额(净值)	基金份额(份)	份额折算比例	基金份额净值(元)	基金份额
场内鹏华创业板A份额	1,150	100,000	(不变)	1,150 100,000份场内鹏华创业板A份额
鹏华创业板A份额	1,042	100,000	0.906098967(全部折算为场内鹏华创业板A份额)	1,150 90,608份场内鹏华创业板A份额
鹏华创业板B份额	1,258	100,000	1.093913043(全部折算为场内鹏华创业板B份额)	1,150 109,391份场内鹏华创业板B份额

8、折算前存在溢价交易的鹏华创业板A份额和鹏华创业板B份额持有人有因溢价消失而造成损失的风

险。鹏华创业板A份额和鹏华创业板B份额折算为