（上接B073版）

基金经理制定具体的操作计划并通过交易系统或书面指令形式向中央交易室发出交易指令。中央交易室依据投资指令具体执行买卖操作，并将指令的执行情况反馈给基金经理。

（4）组合监控与调整

基金经理负责向投资决策委员会汇报基金投资执行情况。监察部对基金投资进行日常监督。绩效与风险评估小组定期对基金投资进行绩效评估和风险分析，并通过监察部呈报给合规审查与风险控制委员会及督察长办公室、投资决策委员会、基金经理及相关人员。在监察部和绩效与风险评估小组提供的绩效评估和风险分析报告的基础上，基金经理定期对证券市场变化和基金投资阶段成果和经验进行反思，对基金投资组合不断进行调整和优化。

(八)投资限制

1、组合限制

基金的投资组合将遵循以下限制：

（1）本基金债券的投资比例不低于基金资产的80%，投资于非固定收益类资产的比例不高于基金资产的20%；可转债投资比例不高于基金资产净值的30%；但在每个受限开放期的前10个工作日和后10个工作日、自由开放期的前3个月和后3个月以及开放期期间不受前述投资组合比例的限制；

（2）本基金在封闭期内持有现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不受限制，但在开放期保持不低于基金资产净值5％的现金或者到期日在一年以内的政府债券；

（3）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10％；

（4）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的10％；

（5）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20％；

（6）本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10％；

（7）本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10％；

（8）本基金应投资于信用级别评级为BBB以上(含BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出；

（9）本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%；债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不得展期；

（10）本基金可转债投资比例不高于基金资产净值的30%；

（11）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

因证券市场波动、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。法律法规或监管部门另有规定的从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

如果法律法规对基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制，但须提前公告，不需要经基金份额持有人大会审议。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

（1）承销证券；

（2）向他人贷款或者提供担保；

（3）从事承担无限责任的投资；

（4）买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；

（5）向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；

（6）买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；

（7）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

（8）依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

法律法规或监管部门调整上述限制的，本基金投资按照调整后的规定执行。

（九）基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使相应权利，保护基金份额持有人的利益；

2、有利于基金财产的安全与增值；

3、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

(十)基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关规定进行融资、融券。

(十一)基金投资组合报告（截止2014年12月31日）

本投资组合报告已经基金托管人复核，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。本报告中所列财务数据未经审计。

1.报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	–	–
	其中：股票	–	–
2	固定收益投资	261,457,136.60	93.77
	其中：债券	261,457,136.60	93.77
	资产支持证券	–	–
3	贵金属投资	–	–
4	金融衍生品投资	–	–
5	买入返售金融资产	–	–
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	–	–
6	银行存款和结算备付金合计	11,867,623.48	4.26
7	其他资产	5,512,537.28	1.98
8	合计	278,837,297.36	100.00

2.报告期末按行业分类的股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票类资产。

3.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有股票类资产。

4.报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	–	–
2	央行票据	–	–
3	金融债券	–	–
	其中：政策性金融债	–	–
4	企业债券	210,111,971.30	148.66
5	企业短期融资券	10,076,000.00	7.13
6	中期票据	–	–
7	可转债	41,269,165.30	29.20
8	其他	–	–
9	合计	261,457,136.60	184.98

5.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	124543	14临港控	200,020	21,782,178.00	15.41
2	124429	13亭公投	120,010	13,028,285.60	9.22
3	124435	13邯城投	121,000	13,007,500.00	9.20
4	122965	09潍投债	116,020	12,298,120.00	8.70
5	124761	14深业团	102,900	10,855,950.00	7.68

6.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

9.报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

9.1本期国债期货投资政策

注：国债期货不在本基金投资范围之内，报告期间本基金没有参与国债期货投资，也没有持有相关头寸。

9.2报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：国债期货不在本基金投资范围之内，报告期间本基金没有参与国债期货投资，也没有持有相关头寸。

9.3本期国债期货投资评价

注：国债期货不在本基金投资范围之内，报告期间本基金没有参与国债期货投资，也没有持有相关头寸。

10.投资组合报告附注

10.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

10.2

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

10.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	121,563.53
2	应收证券清算款	68,425.20
3	应收股利	–
4	应收利息	5,322,548.55
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	5,512,537.28

10.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113005	平安转债	9,652,470.00	6.83
2	110023	民生转债	5,530,800.00	3.91
3	110020	南山转债	4,538,721.10	3.21
4	110015	石化转债	4,047,600.00	2.86
5	113002	工行转债	2,983,800.00	2.11
6	127002	徐工转债	1,788,060.00	1.27
7	113001	中行转债	1,565,900.00	1.11
8	110018	国电转债	1,030,750.00	0.73

10.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

（十二）基金的业绩（数据截止2014年12月31日）

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉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。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资人申购基金时应认真阅读本招募说明书。有关业绩数据经托管人复核，但未经审计。

银河回报债券A

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2013.08.09-2013.12.31	1.20%	0.12%	2.28%	0.02%	-1.08%	0.10%
2014.01.01-2014.12.31	32.81%	0.44%	5.72%	0.02%	27.09%	0.42%
自基金合同生效起至今	34.40%	0.38%	8.01%	0.02%	26.39%	0.36%

银河回报债券C

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2013.08.09-2013.12.31	1.00%	0.11%	2.28%	0.02%	-1.28%	0.09%
2014.01.01-2014.12.31	32.28%	0.43%	5.72%	0.02%	26.56%	0.41%
自基金合同生效起至今	33.60%	0.38%	8.01%	0.02%	25.59%	0.36%

注：本基金的业绩比较基准为：每个封闭期起始日的三年期银行定期存款税后收益率+1.5%。

七、基金的费用

(一)基金费用的种类

1、基金管理人的管理费；

2、基金托管人的托管费；

3、销售服务费：本基金从C 类基金份额的基金资产中计提销售服务费；

4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；

5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；

6、基金份额持有人大会费用；

7、基金的证券交易费用；

8、基金的银行汇划费用；

9、证券账户开户费用、银行账户维护费用；

10、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

(二)上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

(三)基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.7%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×0.7 %÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费自基金合同生效之日起每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起5个工作日内或不可抗力情形消除之日起5个工作日内支付。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.2%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费自基金合同生效之日起每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起5个工作日内或不可抗力情形消除之日起5个工作日内支付。

3、销售服务费

本基金A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为0.4%。销售服务费主要用于本基金持续销售以及基金份额持有人服务等各项费用。

C类基金份额的销售服务费计提的计算公式如下：

H＝E×0.4%÷当年天数

H为每日应计提的C类基金份额销售服务费

E为前一日的C类基金份额的基金资产净值

销售服务费自基金合同生效之日起每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前5 个工作日内从基金财产中划出，由基金管理人按照相关合同规定支付给基金销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至支付法定节假日、休息日结束之日起5个工作日内或不可抗力情形消除之日起5个工作日内支付。

上述“一、基金费用的种类中第4-10项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

(四)不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、《基金合同》生效前的相关费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（五）费用调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情降低基金管理费、基金托管费或销售服务费，此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率实施日前在指定媒体和基金管理人网站上刊登公告。

八、对招募说明书更新部分的说明

银河岁岁回报定期开放债券型证券投资基金本次更新招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》等有关法规及《银河岁岁回报定期开放债券型证券投资基金基金合同》进行更新编写，更新的内容主要包括以下几部分：

1、在“三、基金管理人”部分，公司注册资本由1.5亿元增加至2亿元，各持股单位出资额也进行了变更，但占总股本比例不变；董事、监事、高级管理人员及基金经理信息根据实际情况进行了更新。

2、在“四、基金托管人”部分，对“基金托管人概况”根据实际情况进行了更新。

3、在“五、相关服务机构”部分，根据实际情况对直销及代销机构的相关信息进行了更新。

4、在“十、基金的投资”之“（十一）基金投资组合报告”更新为数据截止日为2014年12月31日的报告，该部分内容均按有关规定编制，并经基金托管人复核，但未经审计。“(十二)基金的业绩”中对基金成立以来至2014年12月31日的基金业绩表现进行了披露。该部分内容均按有关规定编制，并经基金托管人复核，但未经审计。

5、“二十三、其他应披露事项”中列示了本报告期内本基金及本基金管理公司在指定报纸上进行的信息披露。

银河基金管理有限公司
二〇一五年三月二十四日

关于旗下基金所持有股票“海伦钢琴”因长期停牌变更估值方法的提示性公告

根据中国证券监督管理委员会公告[2008] 38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》等有关规定，银河基金管理有限公司（以下简称“本公司”）与基金托管人协商一致，自2015年3月23日起，对本公司旗下证券投资基金持有的“海伦钢琴（代码：300329）”采用“指数收益法”予以估值。

待该股票其交易体现了活跃市场交易特征后，将恢复采用当日收盘价格进行估值，届时不再另行公告。

特此公告。

银河基金管理有限公司
2015年3月24日

关于旗下基金所持有股票“华宇软件”因长期停牌变更估值方法的提示性公告

根据中国证券监督管理委员会公告[2008] 38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》等有关规定，银河基金管理有限公司（以下简称“本公司”）与基金托管人协商一致，自2015年3月23日起，对本公司旗下证券投资基金持有的“华宇软件（代码：300271）”采用“指数收益法”予以估值。

待该股票其交易体现了活跃市场交易特征后，将恢复采用当日收盘价格进行估值，届时不再另行公告。

特此公告。

银河基金管理有限公司
2015年3月24日

关于旗下基金所持有股票“锐奇股份”因长期停牌变更估值方法的提示性公告

根据中国证券监督管理委员会公告[2008] 38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》等有关规定，银河基金管理有限公司（以下简称“本公司”）与基金托管人协商一致，自2015年3月23日起，对本公司旗下证券投资基金持有的“锐奇股份（代码：300126）”采用“指数收益法”予以估值。

待该股票其交易体现了活跃市场交易特征后，将恢复采用当日收盘价格进行估值，届时不再另行公告。

特此公告。

银河基金管理有限公司
2015年3月24日

鹏华基金关于新增南京银行股份有限公司为旗下部分基金代销机构的公告

根据鹏华基金管理有限公司（以下简称“本公司”）与南京银行股份有限公司（以下简称“南京银行”）签署的协议，自2015年3月24日起，本公司新增南京银行代理旗下鹏华品牌传承灵活配置混合型证券投资基金（000431）、鹏华弘利灵活配置混合型证券投资基金A类（001122）、鹏华弘利灵活配置混合型证券投资基金C类（001123）、鹏华行业成长证券投资基金（206001）的销售业务。

投资者可通过南京银行各营业网点办理上述基金的开户、认购/申购、赎回、转换和定期定额投资等业务。具体业务规则、费率及相关重要事项等详见本公司发布的上述基金基金合同、招募说明书（更新）以及相关业务公告。上述基金在南京银行办理定期定额投资业务的最低申购金额不低于人民币300元，具体执行标准按照南京银行业务规则等要求执行。投资者在办理上述基金定期定额投资业务的同时，仍然可以进行日常申购、赎回业务。

投资者可通过以下途径咨询有关详情：

1、南京银行股份有限公司

客户服务电话：40088-96400

公司网址：www.njcb.com.cn

2、鹏华基金管理有限公司

客户服务电话：400-6788-999（免长途话费）或0755-82353668

网址：www.phfund.com

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。投资者应充分了解基金定期定额投资和零存整取等储蓄方式的区别。定期定额投资是引导投资者进行长期投资、平均投资成本的一种简单易行的投资方式。但是定期定额投资并不能规避基金投资所固有的风险，不能保证投资者获得收益，也不是替代储蓄的等效理财方式。投资者投资于本公司基金时应认真阅读相关基金基金合同、招募说明书等文件，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3月24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元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。

2015年2月25日，本公司旗下基金持有的股票“顺荣三七”（股票代码002555）停牌，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3月23日起对本公司旗下基金（ETF基金除外）所持有的该股票采用“指数收益法”进行估值。待“顺荣三七” 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。

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3月24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元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。

2015年3月16日，本公司旗下基金持有的股票“中国国旅”（股票代码601888）停牌，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3月23日起对本公司旗下基金（ETF基金除外）所持有的该股票采用“指数收益法”进行估值。待“中国国旅” 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。

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3月24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》（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800证券保险指数分级证券投资基金的基础份额（以下简称“鹏华证券保险份额”）的基金份额净值达到1.500元时，本基金将进行不定期份额折算。

截至2015年3月23日，本基金鹏华证券保险份额的基金份额净值为1.513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3月24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3月24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证券保险份额（场内简称“鹏华证保”，基金代码：160625）、鹏华证券保险A份额（场内简称“证保A”，基金代码150177）、鹏华证券保险B份额（场内简称“证保B”，基金代码150178）。

三、基金份额折算方式

鹏华证券保险份额、鹏华证券保险A份额、鹏华证券保险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证券保险份额、鹏华证券保险A份额、鹏华证券保险B份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保鹏华证券保险A份额与鹏华证券保险B份额的比例为1:1，份额折算后鹏华证券保险份额的基金份额净值、鹏华证券保险A份额与鹏华证券保险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：

1）鹏华证券保险A份额

① 份额折算前鹏华证券保险A份额的份额数与份额折算后鹏华证券保险A份额的份额数相等，即

$$NUM_{鹏华证券保险A份额}^{折算前} = NUM_{鹏华证券保险A份额}^{折算后}$$

其中，

$NUM_{鹏华证券保险A份额}^{折算前}$：不定期份额折算前鹏华证券保险A份额的份额数；

$NUM_{鹏华证券保险A份额}^{折算后}$：不定期份额折算后鹏华证券保险A份额的份额数。

② 份额折算前鹏华证券保险A份额持有人在证券保险账户持有的鹏华证券保险A份额与场内鹏华证券保险A份额合并计算，且份额对应的基金资产净值不变。

鹏华证券保险A份额持有人折算前场内鹏华证券保险A份额的份额数为

$$NUM_{鹏华证券保险A份额}^{场内折算前} \times (NAV_{鹏华证券保险A份额}^{折算前} - 1.000) / 1.000$$

其中，

$NAV_{鹏华证券保险A份额}^{折算前}$：不定期份额折算前鹏华证券保险A份额的基金份额参考净值。

③ 份额折算后鹏华证券保险A份额持有人在证券保险账户持有的鹏华证券保险A份额与场内鹏华证券保险A份额合并计算，且份额对应的基金资产净值不变。

鹏华证券保险A份额持有人不定期份额折算后场内鹏华证券保险A份额的份额数为

$$NUM_{鹏华证券保险A份额}^{场内折算后} = NUM_{鹏华证券保险A份额}^{场内折算前} \times NAV_{鹏华证券保险A份额}^{折算前} / 1.000$$

其中，

$NUM_{鹏华证券保险A份额}^{场内折算后}$：不定期份额折算后鹏华证券保险A份额的份额数。

② 份额折算前鹏华证券保险B份额的份额数与份额折算后鹏华证券保险B份额的份额数相等

$$NUM_{鹏华证券保险B份额}^{折算前} = NUM_{鹏华证券保险B份额}^{折算后}$$

其中，

$NUM_{鹏华证券保险B份额}^{折算前}$：不定期份额折算前鹏华证券保险B份额的份额数；

$NUM_{鹏华证券保险B份额}^{折算后}$：不定期份额折算后鹏华证券保险B份额的份额数。

③ 份额折算前鹏华证券保险B份额持有人在证券保险账户持有的鹏华证券保险B份额与场内鹏华证券保险B份额合并计算，且份额对应的基金资产净值不变。

鹏华证券保险B份额持有人折算前场内鹏华证券保险B份额的份额数为

$$NUM_{鹏华证券保险B份额}^{场内折算前} - NUM_{鹏华证券保险B份额}^{场内折算后} \times (NAV_{鹏华证券保险B份额}^{折算前} - 1.000) / 1.000$$

其中，

$NAV_{鹏华证券保险B份额}^{折算前}$：不定期份额折算前鹏华证券保险B份额的基金份额参考净值。

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弃，余额计入基金财产；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或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

设在本基金的不定期份额折算日，鹏华证券保险份额的基金份额净值、鹏华证券保险A份额与鹏华证券保险B份额的基金份额参考净值如下表所示，折算后，鹏华证券保险份额的基金份额净值、鹏华证券保险A份额、鹏华证券保险B份额的基金份额参考净值均调整1.000元，则各持有鹏华证券保险份额、鹏华证券保险A份额、鹏华证券保险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
鹏华证券保险份额	1.536元	10,000份	1.000元	15,360份鹏华证券保险份额
鹏华证券保险A份额	1.028元	10,000份	1.000元	10,000份鹏华证券保险A份额+280份鹏华证券保险份额
鹏华证券保险B份额	2.044元	10,000份	1.000元	10,000份鹏华证券保险B份额+10,440份鹏华证券保险份额

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3月24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。当日晚间，基金管理人计算当日基金份额净值及份额折算比例。

（二）不定期份额折算基准日后的第一个工作日（即2015年3月25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，鹏华证券保险A、鹏华证券保险B暂停交易。当日，本基金注册登记人及基金管理人为持有人办理份额登记确认。

（三）不定期份额折算基准日后的第二个工作日（即2015年3月26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，鹏华证券保险A、鹏华证券保险B将于2015年3月26日上午开市至10:30停牌，并于2015年3月26日上午10:30复牌。

（四）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3月26日鹏华证券保险A、鹏华证券保险B即时行情显示的前收盘价为2015年3月25日的鹏华证券保险A、鹏华证券保险B的基金份额参考净值(四舍五入至0.001元)，2015年3月26日当日鹏华证券保险A份额和鹏华证券保险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。

五、重要提示

1、本基金鹏华证券保险A、鹏华证券保险B将于2015年3月26日上午开市至10:30停牌，并于2015年3月26日上午10:30复牌。

2、本基金鹏华证券保险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券保险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鹏华证券保险A份额变为同时持有较低风险收益特征的鹏华证券保险A份额与较高风险收益特征的鹏华证券保险份额，因此原鹏华证券保险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，因此原鹏华证券保险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、本基金鹏华证券保险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提升，将恢复到初始的2倍杠杆水平，相应地，鹏华证券保险B份额净值随市场涨跌而增长或者下降的幅度也会大幅增加。

4、由于鹏华证券保险A份额、鹏华证券保险B份额折算前可能存在折溢价交易情形，不定期份额折算后，鹏华证券保险A、鹏华证券保险B份额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折溢价所带来的风险。

5、原鹏华证券保险A份额、鹏华证券保险B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券保险份额分拆为鹏华证券保险A份额、鹏华证券保险B份额。

6、根据深圳证券交易所的相关业务规则，鹏华证券保险A份额、鹏华证券保险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），舍去部分计入基金财产，持有极小数量鹏华证券保险A份额、鹏华证券保险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。

7、鹏华证券保险份额折算基准日的份额净值与折算条件1.500元可能有一定差异。

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等相关法律文件。敬请投资者注意投资风险。

9、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3月24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的基础份额（以下简称“鹏华传媒份额”）的基金份额净值达到1.500元时，本基金将进行不定期份额折算。

截至2015年3月23日，本基金鹏华传媒份额的基金份额净值为1.534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3月24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3月24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份额（场内简称“鹏华传媒”，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：

1）鹏华传媒A份额

① 份额折算前鹏华传媒A份额的份额数与份额折算后鹏华传媒A份额的份额数相等，即

$$NUM_{鹏华传媒A份额}^{折算前} = NUM_{鹏华传媒A份额}^{折算后}$$

其中，

$NUM_{鹏华传媒A份额}^{折算前}$：不定期份额折算前鹏华传媒A份额的份额数；

$NUM_{鹏华传媒A份额}^{折算后}$：不定期份额折算后鹏华传媒A份额的份额数。

② 份额折算前鹏华传媒A份额持有人在证券账户持有的鹏华传媒A份额与场内鹏华传媒A份额合并计算，且份额对应的基金资产净值不变。

鹏华传媒A份额持有人折算前场内鹏华传媒A份额的份额数为

$$NUM_{鹏华传媒A份额}^{场内折算前} - NUM_{鹏华传媒A份额}^{场内折算后} \times (NAV_{鹏华传媒A份额}^{折算前} - 1.000) / 1.000$$

其中，

$NAV_{鹏华传媒A份额}^{折算前}$：不定期份额折算前鹏华传媒A份额的基金份额参考净值。

2）鹏华传媒B份额

① 份额折算前鹏华传媒B份额的份额数与份额折算后鹏华传媒B份额的份额数相等

$$NUM_{鹏华传媒B份额}^{折算前} = NUM_{鹏华传媒B份额}^{折算后}$$

其中，

$NUM_{鹏华传媒B份额}^{折算前}$：不定期份额折算前鹏华传媒B份额的份额数；

$NUM_{鹏华传媒B份额}^{折算后}$：不定期份额折算后鹏华传媒B份额的份额数。

② 份额折算前鹏华传媒B份额持有人在证券账户持有的鹏华传媒B份额与场内鹏华传媒B份额合并计算，且份额对应的基金资产净值不变。

鹏华传媒B份额持有人折算前场内鹏华传媒B份额的份额数为

$$NUM_{鹏华传媒B份额}^{场内折算前} - NUM_{鹏华传媒B份额}^{场内折算后} \times (NAV_{鹏华传媒B份额}^{折算前} - 1.000) / 1.000$$

其中，

$NAV_{鹏华传媒B份额}^{折算前}$：不定期份额折算前鹏华传媒B份额的基金份额参考净值。

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弃，余额计入基金财产；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或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

设在本基金的不定期份额折算日，鹏华传媒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
鹏华传媒份额	1.536元	10,000份	1.000元	15,360份鹏华传媒份额
鹏华传媒A份额	1.028元	10,000份	1.000元	10,000份鹏华传媒A份额+280份鹏华传媒份额
鹏华传媒B份额	2.044元	10,000份	1.000元	10,000份鹏华传媒B份额+10,440份鹏华传媒份额

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3月24日），本基金暂停办理申购、赎