

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”或“鹏华创业板A份额”/场内简称:创业A、基金代码:150243)和鹏华创业板B份额(场内简称:创业B、基金代码:150244)的终止上市日为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,以鹏华创业板份额(场内简称:创业指基,基金代码:160637)的基金份额净值为准,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会在折算后发生变化的风险

在基金份额折算基准日当日以鹏华创业板份额基金份额净值为基准,鹏华创业板A份额、鹏华创业板B份额均按各自的基金份额净值折算为鹏华创业板场内份额,并进行取整计算(最小单位为1份),舍去部分计入基金资产。对于持有份额数较少的鹏华创业板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份额数不足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会在折算后发生变化。示例如下:

假设份额折算基准日鹏华创业板份额、鹏华创业板A份额和鹏华创业板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,其所持基金份额的变化如下表所示:

	折算前		份额折算比例	折算后	
	基金份额净值(元)	基金份额(份)		基金份额净值(元)	基金份额
场内鹏华创业板份额	1.150	100,000	(无变化)	1.150	100,000份场内鹏华创业板份额
鹏华创业板A份额	1.042	100,000	0.900890672 (全部折算为场内鹏华创业板份额)	1.150	90,008份场内鹏华创业板份额
鹏华创业板B份额	1.258	100,000	1.093131043 (全部折算为场内鹏华创业板份额)	1.150	109,381份场内鹏华创业板份额

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变化较大风险

鹏华创业板A份额表现为低风险的特征,但在份额折算后,鹏华创业板A份额持有人原持有低风险的鹏华创业板A份额将变为较高风险的鹏华创业板份额场内份额,基金份额风险收益特征将因折算而发生较大变化。由于鹏华创业板份额场内份额为跟踪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,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,表现为高风险的特征,但在份额折算后,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的鹏华创业板份额场内份额,基金份额风险收益特征将因折算而发生较大变化。由于鹏华创业板份额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。

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重大下降,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份额的持有人因溢价消失而造成损失的风险

在份额折算基准日前(含折算基准日),鹏华创业板A份额和鹏华创业板B份额仍可正常交易,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重大变化。

由于基金份额折算基准日当日终,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)折算为鹏华创业板份额场内份额,如果投资者在折算前以溢价买入或持有鹏华创业板A份额和鹏华创业板B份额,折算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。

投资者应密切关注鹏华创业板A份额和鹏华创业板B份额的基金份额参考净值变化情况,可通过本公司网站(www.phfund.com.cn)等方式进行查询。

5.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场内份额后无法直接办理场内赎回的风险

鹏华创业板A份额和鹏华创业板B份额折算为鹏华创业板份额场内份额后,投资者可以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。部分投资者可能由于不在证券公司不具备基金销售业务资格或其他原因无法直接办理场内赎回,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业务资格的证券公司后再申请赎回。

6.份额折算后,在鹏华创业板份额开放赎回之前,投资者将无法进行基金份额赎回业务;在鹏华创业板份额上市交易之前,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。

7.根据中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则,鹏华创业板A份额和鹏华创业板B份额合并或折算为鹏华创业板份额后,基金份额持有人自鹏华创业板份额确认之日起计算,基金份额净值适用的赎回费率将根据持有期限确定,具体持有期限应以登记机构系统记录为准。如赎回份额时持有期限较短,基金份额持有人将承担较高的赎回费用。本基金场外基础份额的赎回费率具体如下(1年为365日):

持有期限(Y)	赎回费率
Y<=7日	1.50%
7日<Y<=1月	0.50%
1月<Y<=2年	0.25%
Y>=2年	0.00%

本基金场内基础份额的赎回费率具体如下:

持有期限(Y)	赎回费率
Y<=7日	1.50%
Y>=7日	0.50%

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担,在基金份额持有人赎回基金份额时收取。本基金对持续持有期少于7日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产,对持续持有期不少于7日的投资者收取的赎回费总额的25%应归入基金财产,其余用于支付市场推广、注册登记费和其他必要的手续费。

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财产,但不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现,投资者投资于本基金时应分别认真阅读本基金的基金合同、招募说明书、基金产品资料概要及其更新等信息披露文件。

投资者欲了解详情,请登录基金管理人网站:www.phfund.com.cn或拨打本公司客服电话:400-6788-533进行咨询。

鹏华基金管理有限公司
2020年12月3日

鹏华创业板指数分级证券投资基金 定期份额折算前收盘价调整的公告

根据《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2020年12月01日为基金份额折算基准日,在对该日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)和鹏华创业板分级B份额(基金简称:鹏华创业板分级、场内简称:创业指基,基金代码:160637)办理了定期份额折算业务。对于定期份额折算的结果及相关事宜,详见2020年12月03日刊登在中国证券监督管理委员会规定媒介上的《鹏华创业板指数分级证券投资基金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的业务规则,2020年12月03日鹏华创业板分级A份额行情显示的前收盘价作为2020年12月02日的鹏华创业板分级A的基金份额参考净值,即1.000元。由于鹏华创业板分级A折算前存在折价交易情形,2020年12月01日的收盘价为0.998元,扣除约定收益后为0.978元,与2020年12月03日的前收盘价存在较大差异。2020年12月03日当日鹏华创业板分级A份额可能出现交易价格波动的情形。敬请投资者注意投资风险。

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》,本基金将在2020年底前完成规范整改,请投资者关注相关风险以及本基金管理人届时发布的公告。

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。

鹏华基金管理有限公司
2020年12月03日

鹏华创业板指数分级证券投资基金 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》(以下简称“基金合同”)及中国证券登记结算有限责任公司的相关业务约定,鹏华基金管理有限公司(以下简称“本公司”)以2020年12月01日为基金份额折算基准日,在对该日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)和鹏华创业板分级B份额(基金简称:鹏华创业板分级、场内简称:创业指基,基金代码:160637)(以下简称“本基金”)办理了定期份额折算业务,现将折算结果及恢复交易相关事项公告如下:

一、份额折算日期

2020年12月01日,鹏华创业板分级份额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份额经折算后份额数取整计算(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取整后份额数精确到小数点后第9位,如下表所示:

基金份额名称	折算前基金份额(单位:份)	折算后份额折算比例	折算前基金份额(单位:份)	折算后基金份额(单位:份)
鹏华创业板分级场外份额	107,229,167.25	0.009847522	108,189,701.54	1,166
鹏华创业板分级场内份额	14,310,353.00	0.009847522	24,223,066.00	1,166
鹏华创业板分级A份额	29,338,440.00	0.019785944	58,200,000.00	1,000

注:鹏华创业板分级A份额经折算后,产生新增的鹏华创业板分级场内份额。

投资者自公告之日起可查询经基金份额登记人及本公司确认的折算后份额。

二、恢复交易

自2020年12月03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。鹏华创业板分级A份额将于2020年12月03日上午开始复牌。

根据相关公告,鹏华创业板分级仍暂停系统转托管(指场外场内)业务;单日单个基金账户累计的场内申购、定期定额投资本基金的金額不应超过1000元。上述安排如有调整,基金管理人将另行发布公告。

三、重要提示

1、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》,本基金将在2020年底前完成规范整改,请投资者关注相关风险以及本基金管理人届时发布的公告。

2、根据深圳证券交易所的业务规则,2020年12月03日鹏华创业板分级A份额行情显示的前收盘价作为2020年12月02日的鹏华创业板分级A的基金份额参考净值,即1.000元。由于鹏华创业板分级A折算前存在折价交易情形,2020年12月01日的收盘价为0.998元,扣除约定收益后为0.978元,与2020年12月03日的前收盘价存在较大差异。2020年12月03日当日鹏华创业板分级A份额可能出现交易价格波动的情形。敬请投资者注意投资风险。

3、鹏华创业板分级A份额的约定应得收益将折算成鹏华创业板分级场内份额分配给鹏华创业板分级A份额的持有人,而鹏华创业板分级份额为跟踪创业板指数的基金份额,其基金份额净值将随市场涨跌而变化,因此鹏华创业板分级A份额持有人预期收益的实现存在一定的不确定性,可能会承担因市场下跌而遭受损失的风险。

4、根据深圳证券交易所的相关业务规则,鹏华创业板分级A份额新增份额折算成鹏华创业板分级份额的场内份额数按照鹏华创业板分级份额的场内份额经折算后的份额数取整计算(最小单位为1份),舍去部分计入基金财产,持有极少量鹏华创业板分级A份额、鹏华创业板分级份额的持有人,存在折算后份额为不足1份而导致相应的资产被强制归入基金资产的风险。

5、根据《鹏华创业板指数分级证券投资基金基金合同》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约定:鹏华创业板分级A份额约定年基准收益率为“同期银行间人民币一年定期存款利率(税后)+3%”,同期银行间人民币一年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定期存款基准利率为准。鉴于2020年12月02日中国人民银行公布的金融机构人民币一年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为2020年12月02日起调整为4.50%。

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业务资格,而投资者只能通过具备基金销售业务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业务资格的证券公司购买鹏华创业板分级A份额,在定期份额折算后,则新增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业务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。

投资者希望了解基金销售业务详情,请登陆本公司网站:www.phfund.com.cn或者拨打本公司客服电话:400-6788-533(免长途话费)。

鹏华基金管理有限公司
2020年12月03日

关于鹏华中证800证券保险交易型 开放式指数证券投资基金增加中国 银河证券股份有限公司为申购赎回 代理券商的公告

经上海证券交易所有确认,根据鹏华基金管理有限公司(以下简称“本公司”)与中国银河证券股份有限公司(以下简称“银河证券”)签署的协议,本公司决定自2020年12月03日起增加银河证券为鹏华中证800证券保险交易型开放式指数证券投资基金(二级市场简称:证保ETF,二级市场交易代码:515630,申购赎回简称:证保ETF,申购赎回代码:515631)的申购赎回代理券商。

投资人可通过以下途径了解或咨询相关情况:

1、中国银河证券股份有限公司(网址及客户服务电话:www.chinastock.com.cn、4008-888-888或95551)

2、鹏华基金管理有限公司(网址及客户服务电话:www.phfund.com、400-6788-533(免长途电话费))

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。投资人应认真阅读投资本基金之基金合同、《招募说明书》(更新)、基金产品资料概要(更新)等相关法律文件,了解所投资基金的风险收益特征,并根据自身情况购买与本人风险承受能力相匹配的产品。

鹏华基金管理有限公司
2020年12月03日

关于鹏华中证800证券保险指数分级 证券投资基金之鹏华证保A份额和鹏华 证保B份额终止运作的特别风险提示公告

根据《关于鹏华中证800证券保险指数分级证券投资基金之鹏华证保A份额和鹏华证保B份额终止运作、终止上市并修改基金合同的公告》,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”或“鹏华证保A份额”/场内简称:证保A、基金代码:150177)和鹏华证保B份额(场内简称:证保B、基金代码:150178)的终止上市日为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,以鹏华证券保险份额(场内简称:证保指基,基金代码:160625)的基金份额净值为准,鹏华证保A份额、鹏华证保B份额按照各自的基金份额净值折算成场内鹏华证保A份额和鹏华证保B份额。

针对本基金之鹏华证保A份额和鹏华证保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.鹏华证保A份额和鹏华证保B份额的基金份额持有人持有的基金份额数量将会在折算后发生变化的风险

在基金份额折算基准日当日终以鹏华证保A份额基金份额净值为基准,鹏华证保A份额、鹏华证保B份额均按各自的基金份额净值折算为鹏华证保A份额场内份额,并进行取整计算(最小单位为1份),舍去部分计入基金资产。对于持有份额数较少的鹏华证保A份额、鹏华证保B份额持有人,将面临持有的基金份额折算后份额数不足1份而被计入基金资产的风险。

鹏华证保A份额和鹏华证保B份额的基金份额持有人持有的基金份额数量将会在折算后发生变化。示例如下:

	折算前		份额折算比例	折算后	
	基金份额净值(元)	基金份额(份)		基金份额净值(元)	基金份额
场内鹏华证保A份额	1.150	100,000	(无变化)	1.150	100,000份场内鹏华证保A份额
鹏华证保A份额	1.042	100,000	0.900890672 (全部折算为场内鹏华证保A份额)	1.150	90,008份场内鹏华证保A份额
鹏华证保B份额	1.258	100,000	1.093131043 (全部折算为场内鹏华证保A份额)	1.150	109,381份场内鹏华证保A份额

2.鹏华证保A份额和鹏华证保B份额折算为鹏华证保A份额场内份额后风险收益特征发生变化较大风险

鹏华证保A份额表现为低风险的特征,但在份额折算后,鹏华证保A份额持有人原持有低风险的鹏华证保A份额将变为较高风险的鹏华证保A份额场内份额,基金份额风险收益特征将因折算而发生较大变化。由于鹏华证保A份额场内份额为跟踪中证800证券保险指数的基金份额,其基金份额净值将随标的指数的涨跌而变化,原鹏华证保A份额持有人将承担因市场下跌而遭受损失的风险。

鹏华证保B份额具有一定的杠杆属性,表现为高风险的特征,但在份额折算后,鹏华证保B份额持有人原持有的鹏华证保B份额将变为较高风险的鹏华证保A份额场内份额,基金份额风险收益特征将因折算而发生较大变化。由于鹏华证保B份额场内份额为跟踪中证800证券保险指数的基金份额,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,原鹏华证保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.鹏华证保A份额和鹏华证保B份额的流动性风险

鹏华证保A份额和鹏华证保B份额折算为鹏华证保A份额场内份额前,鹏华证保A份额和鹏华证保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(即鹏华证保A份额持有人买入等量的鹏华证保B份额,或者鹏华证保B份额持有人买入等量的鹏华证保A份额),合并为鹏华证保A份额,按照鹏华证保A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。

由于鹏华证保A份额和鹏华证保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重大下降,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证保A份额和鹏华证保B份额的持有人因溢价消失而造成损失的风险

在份额折算基准日前(含折算基准日),鹏华证保A份额和鹏华证保B份额仍可正常交易,鹏华证保A份额和鹏华证保B份额可能存在折溢价交易情形,其折溢价率可能发生重大变化。

由于基金份额折算基准日当日终,鹏华证保A份额和鹏华证保B份额均按各自的基金份额净值(而不是二级市场价格)折算为鹏华证保A份额场内份额,如果投资者在折算前以溢价买入或持有鹏华证保A份额和鹏华证保B份额,折算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。

投资者应密切关注鹏华证保A份额和鹏华证保B份额的基金份额参考净值变化情况,可通过本公司网站(www.phfund.com.cn)等方式进行查询。

5、鹏华证保A份额和鹏华证保B份额折算为鹏华证保A份额场内份额后无法直接办理场内赎回的风险

鹏华证保A份额和鹏华证保B份额折算为鹏华证保A份额场内份额后,投资者可以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。部分投资者可能由于不在证券公司不具备基金销售业务资格或其他原因无法直接办理场内赎回,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业务资格的证券公司后再申请赎回。

6、份额折算后,在鹏华证保A份额开放赎回之前,投资者将无法进行基金份额赎回业务;在鹏华证保A份额上市交易之前,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。

7.根据中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则,鹏华证保A份额和鹏华证保B份额合并或折算为鹏华证保A份额场内份额后,基金份额持有人自鹏华证保A份额确认之日起计算,基金份额净值适用的赎回费率将根据持有期限确定,具体持有期限应以登记机构系统记录为准。如赎回份额时持有期限较短,基金份额持有人将承担较高的赎回费用。本基金场外基础份额的赎回费率具体如下(1年为365日):

以登记机构系统记录为准。如赎回份额时持有期限较短,基金份额持有人将承担较高的赎回费用。

根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及本基金招募说明书(更新)的约定,本基金场外基础份额的赎回费率具体如下(1年为365日):

持有期限(Y)	赎回费率
Y<=7日	1.50%
7日<Y<=1月	0.50%
1月<Y<=2年	0.25%
Y>=2年	0.00%

本基金场内基础份额的赎回费率具体如下:

持有期限(Y)	赎回费率
Y<=7日	1.50%
Y>=7日	0.50%

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担,在基金份额持有人赎回基金份额时收取。本基金对持续持有期少于7日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产,对持续持有期不少于7日的投资者收取的赎回费总额的25%应归入基金财产,其余用于支付市场推广、注册登记费和其他必要的手续费。

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,但不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现,投资者投资于本基金时应分别认真阅读本基金的基金合同、招募说明书、基金产品资料概要及其更新等信息披露文件。

投资者欲了解详情,请登录基金管理人网站:www.phfund.com.cn或拨打本公司客服电话:400-6788-533进行咨询。

鹏华基金管理有限公司
2020年12月3日

关于鹏华中证800地产指数分级证券 投资基金之鹏华地产A份额和鹏华地 产B份额终止运作的特别风险提示公告

根据《关于鹏华中证800地产指数分级证券投资基金之鹏华地产A份额和鹏华地产B份额终止运作、终止上市并修改基金合同的公告》,鹏华中证800地产指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”或“鹏华地产A份额”/场内简称:地产A、基金代码:150192)和鹏华地产B份额(场内简称:地产B、基金代码:150193)的终止上市日为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,以鹏华地产A份额(场内简称:房地A、基金代码:160628)的基金份额净值为准,鹏华地产A份额、鹏华地产B份额按照各自的基金份额净值折算成场内鹏华地产A份额。

针对本基金之鹏华地产A份额和鹏华地产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.鹏华地产A份额和鹏华地产B份额的基金份额持有人持有的基金份额数量将会在折算后发生变化的风险

在基金份额折算基准日当日终以鹏华地产A份额基金份额净值为基准,鹏华地产A份额、鹏华地产B份额均按各自的基金份额净值折算为鹏华地产A份额场内份额,并进行取整计算(最小单位为1份),舍去部分计入基金资产。对于持有份额数较少的鹏华地产A份额、鹏华地产B份额持有人,将面临持有的基金份额折算后份额数不足1份而被计入基金资产的风险。

鹏华地产A份额和鹏华地产B份额的基金份额持有人持有的基金份额数量将会在折算后发生变化。示例如下:

	折算前		份额折算比例	折算后	
	基金份额净值(元)	基金份额(份)		基金份额净值(元)	基金份额
场内鹏华地产A份额	1.150	100,000	(无变化)	1.150	100,000份场内鹏华地产A份额
鹏华地产A份额	1.042	100,000	0.900890672 (全部折算为场内鹏华地产A份额)	1.150	90,008份场内鹏华地产A份额
鹏华地产B份额	1.258	100,000	1.093131043 (全部折算为场内鹏华地产A份额)	1.150	109,381份场内鹏华地产A份额

2.鹏华地产A份额和鹏华地产B份额折算为鹏华地产A份额场内份额后风险收益特征发生变化较大风险

鹏华地产A份额表现为低风险的特征,但在份额折算后,鹏华地产A份额持有人原持有低风险的鹏华地产A份额将变为较高风险的鹏华地产A份额场内份额,基金份额风险收益特征将因折算而发生较大变化。由于鹏华地产A份额场内份额为跟踪中证800地产指数的基金份额,其基金份额净值将随标的指数的涨跌而变化,原鹏华地产A份额持有人将承担因市场下跌而遭受损失的风险。

鹏华地产B份额具有一定的杠杆属性,表现为高风险的特征,但在份额折算后,鹏华地产B份额持有人原持有的鹏华地产B份额将变为较高风险的鹏华地产A份额场内份额,基金份额风险收益特征将因折算而发生较大变化。由于鹏华地产A份额场内份额为跟踪中证800地产指数的基金份额,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,原鹏华地产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.鹏华地产A份额和鹏华地产B份额的流动性风险

鹏华地产A份额和鹏华地产B份额折算为鹏华地产A份额场内份额前,鹏华地产A份额和鹏华地产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(即鹏华地产A份额持有人买入等量的鹏华地产B份额,或者鹏华地产B份额持有人买入等量的鹏华地产A份额),合并为鹏华地产A份额,按照鹏华地产A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。

由于鹏华地产A份额和鹏华地产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重大下降,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地产A份额和鹏华地产B份额的持有人因溢价消失而造成损失的风险

在份额折算基准日前(含折算基准日),鹏华地产A份额和鹏华地产B份额仍可正常交易,鹏华地产A份额和鹏华地产B份额可能存在折溢价交易情形,其折溢价率可能发生重大变化。

由于基金份额折算基准日当日终,鹏华地产A份额和鹏华地产B份额均按各自的基金份额净值(而不是二级市场价格)折算为鹏华地产A份额场内份额,如果投资者在折算前以溢价买入或持有鹏华地产A份额和鹏华地产B份额,折算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。

投资者应密切关注鹏华地产A份额和鹏华地产B份额的基金份额参考净值变化情况,可通过本公司网站(www.phfund.com.cn)等方式进行查询。