

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份额终止运作的特别风险提示公告》，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”，基金代码：160178（场内简称：鹏华证保A，基金代码：160178）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终，以鹏华证券保险份额（场内简称：证保A类，基金代码：160625）的基金份额净值为基准，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券保险份额。

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份额的基本份额持有人持有的基金份额数量将会在折算后发生变化。

在基金份额折算基准日终时，若去部分计分基金资产。对于持有份额数极少的鹏华证保A份额、鹏华证保B份额持有人，将面临持有的基金份额数量不足1份而被计入基金资产的风险。

2、鹏华证保A份额和鹏华证保B份额的基本份额持有人持有的基金份额数量将会在折算后发生变化。

假设份额折算基准日鹏华证券保险份额、鹏华证保A份额和鹏华证保B份额的基本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证券保险份额、鹏华证保A份额、鹏华证保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		折算后		
	基金份额净值 (元)	基金份额 (份)	份额折算比例	基金份额净值 (元)	基金份额 (份)
场内鹏华证券 保险份额	1.150	100,000 (不变)	1.150	100,000份场内鹏华 证券保险份额	100,000份场内鹏华 证券保险份额
鹏华证保A份 额	1.042	100,000 (全部赎回鹏华证 保A份额)	1.090008967 (全部赎回鹏华证 保A份额)	1.150	90,608份场内鹏华 证券保险份额
鹏华证保B份 额	1.258	100,000 (全部赎回鹏华证 保B份额)	1.150	109,393份场内鹏华 证券保险份额	100,000份场内鹏华 证券保险份额

3、鹏华证保A份额和鹏华证保B份额按照份额折算为鹏华证券保险份额后风险收益特征发生较大变化的风险

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份额持有人将有可能持有低风险的鹏华证券保险份额内份额，基金风险收益特征将因折算而发生较大变化。由于鹏华证券保险份额内份额为跟踪中证800证券保险指数的基金，其基金份额净值将随标的指数的涨跌而变化，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。

4、鹏华证保A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A份额持有人将有可能持有鹏华证券保险份额内份额，基金风险收益特征将因折算而发生较大变化。由于鹏华证券保险份额内份额为跟踪中证800证券保险指数的基金，其基金份额净值将随标的指数的涨跌而变化，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。

5、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份额折算为鹏华证券保险份额内份额后，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) 在场内卖出持有的基金份额；
- 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A-带一路份额，场内鹏华证保A份额和鹏华证保B份额将变为场外鹏华A-带一路份额内份额，投资者可以在折算前以溢价买入或转托管至场外申请赎回。

由于鹏华证保A份额和鹏华证保B份额的持有人有可能选择场内卖出或转托管回场外，可能导致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。

6、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份额将可正常交易，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，其折溢价率可能将发生较大变化。

由于基金份额折算基准日终时，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）折算为鹏华证券保险份额内份额，如果投资者在折算前以溢价买入或转托管至场外鹏华A-带一路份额内份额，折算后可能遭受较大损失。特提请投资者与二级市场的交易的投资者注意折溢价所带来的风险。

7、鹏华证保A份额和鹏华证保B份额的基本份额参考净值变化情况，可通过本公司网站（www.phfund.com.cn）方式进行查询。

8、鹏华证保A份额和鹏华证保B份额折算为鹏华证券保险份额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份额折算为鹏华证券保险份额内份额后，投资者可以申请场内赎回或转托管至场外申请赎回基金份额。部分投资者可能由于所在证券公司不具备基金销售业务资格或其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，或者选择先转托管至含有基金销售业务资格的证券公司后申请赎回。

9、鹏华证保A份额和鹏华证保B份额的持有人将无法进行基金赎回业务；在鹏华证券保险份额上市交易之前，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。

10、根据中国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则，鹏华证保A份额和鹏华证保B份额合并折算为鹏华证券保险份额后，基金份额持有人期初自鹏华证券保险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限确定，具体持有期限以登记机构系统记录为准。如赎回份额持有期限较短，基金份额持有人将承担较高的赎回费用。

11、鹏华证保A份额和鹏华证保B份额的持有人将无法进行基金赎回业务；在鹏华证券保险份额上市交易之前，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。

12、鹏华证保A份额和鹏华证保B份额的基本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。

13、鹏华证保A份额和鹏华证保B份额折算为鹏华证券保险份额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份额折算为鹏华证券保险份额内份额后，投资者可以申请场内赎回或转托管至场外申请赎回基金份额。部分投资者可能由于所在证券公司不具备基金销售业务资格或其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，或者选择先转托管至含有基金销售业务资格的证券公司后申请赎回。

14、鹏华证保A份额和鹏华证保B份额的持有人将无法进行基金赎回业务；在鹏华证券保险份额上市交易之前，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。

15、根据中国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则，鹏华证保A份额和鹏华证保B份额合并折算为鹏华证券保险份额后，基金份额持有人期初自鹏华证券保险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限确定，具体持有期限以登记机构系统记录为准。如赎回份额持有期限较短，基金份额持有人将承担较高的赎回费用。

16、鹏华证保A份额和鹏华证保B份额折算为鹏华证券保险份额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份额折算为鹏华证券保险份额内份额后，投资者可以申请场内赎回或转托管至场外申请赎回基金份额。部分投资者可能由于所在证券公司不具备基金销售业务资格或其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，或者选择先转托管至含有基金销售业务资格的证券公司后申请赎回。

17、鹏华证保A份额和鹏华证保B份额的持有人将无法进行基金赎回业务；在鹏华证券保险份额上市交易之前，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。

18、鹏华证保A份额和鹏华证保B份额的基本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。

19、鹏华证保A份额和鹏华证保B份额折算为鹏华证券保险份额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份额折算为鹏华证券保险份额内份额后，投资者可以申请场内赎回或转托管至场外申请赎回基金份额。部分投资者可能由于所在证券公司不具备基金销售业务资格或其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，或者选择先转托管至含有基金销售业务资格的证券公司后申请赎回。

20、鹏华证保A份额和鹏华证保B份额的持有人将无法进行基金赎回业务；在鹏华证券保险份额上市交易之前，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。

21、鹏华证保A份额和鹏华证保B份额的基本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。

22、鹏华证保A份额和鹏华证保B份额折算为鹏华证券保险份额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份额折算为鹏华证券保险份额内份额后，投资者可以申请场内赎回或转托管至场外申请赎回基金份额。部分投资者可能由于所在证券公司不具备基金销售业务资格或其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，或者选择先转托管至含有基金销售业务资格的证券公司后申请赎回。

23、鹏华证保A份额和鹏华证保B份额的持有人将无法进行基金赎回业务；在鹏华证券保险份额上市交易之前，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。

24、鹏华证保A份额和鹏华证保B份额的基本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。

25、鹏华证保A份额和鹏华证保B份额折算为鹏华证券保险份额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份额折算为鹏华证券保险份额内份额后，投资者可以申请场内赎回或转托管至场外申请赎回基金份额。部分投资者可能由于所在证券公司不具备基金销售业务资格或其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，或者选择先转托管至含有基金销售业务资格的证券公司后申请赎回。

26、鹏华证保A份额和鹏华证保B份额的持有人将无法进行基金赎回业务；在鹏华证券保险份额上市交易之前，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。

27、鹏华证保A份额和鹏华证保B份额的基本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。

28、鹏华证保A份额和鹏华证保B份额折算为鹏华证券保险份额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份额折算为鹏华证券保险份额内份额后，投资者可以申请场内赎回或转托管至场外申请赎回基金份额。部分投资者可能由于所在证券公司不具备基金销售业务资格或其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，或者选择先转托管至含有基金销售业务资格的证券公司后申请赎回。

29、鹏华证保A份额和鹏华证保B份额的持有人将无法进行基金赎回业务；在鹏华证券保险份额上市交易之前，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。

30、鹏华证保A份额和鹏华证保B份额的基本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。

31、鹏华证保A份额和鹏华证保B份额折算为鹏华证券保险份额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份额折算为鹏华证券保险份额内份额后，投资者可以申请场内赎回或转托管至场外申请赎回基金份额。部分投资者可能由于所在证券公司不具备基金销售业务资格或其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，或者选择先转托管至含有基金销售业务资格的证券公司后申请赎回。

32、鹏华证保A份额和鹏华证保B份额的持有人将无法进行基金赎回业务；在鹏华证券保险份额上市交易之前，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。

33、鹏华证保A份额和鹏华证保B份额的基本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。

34、鹏华证保A份额和鹏华证保B份额折算为鹏华证券保险份额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份额折算为鹏华证券保险份额内份额后，投资者可以申请场内赎回或转托管至场外申请赎回基金份额。部分投资者可能由于所在证券公司不具备基金销售业务资格或其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，或者选择先转托管至含有基金销售业务资格的证券公司后申请赎回。

35、鹏华证保A份额和鹏华证保B份额的持有人将无法进行基金赎回业务；在鹏华证券保险份额上市交易之前，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。

36、鹏华证保A份额和鹏华证保B份额的基本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。

37、鹏华证保A份额和鹏华证保B份额折算为鹏华证券保险份额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份额折算为鹏华证券保险份额内份额后，投资者可以申请场内赎回或转托管至场外申请赎回基金份额。部分投资者可能由于所在证券公司不具备基金销售业务资格或其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，或者选择先转托管至含有基金销售业务资格的证券公司后申请赎回。

38、鹏华证保A份额和鹏华证保B份额的持有人将无法进行基金赎回业务；在鹏华证券保险份额上市交易之前，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。

39、鹏华证保A份额和鹏华证保B份额的基本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。

40、鹏华证保A份额和鹏华证保B份额折算为鹏华证券保险份额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份额折算为鹏华证券保险份额内份额后，投资者可以申请场内赎回或转托管至场外申请赎回基金份额。部分投资者可能由于所在证券公司不具备基金销售业务资格或其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，或者选择先转托管至含有基金销售业务资格的证券公司后申请赎回。

41、鹏华证保A份额和鹏华证保B份额的持有人将无法进行基金赎回业务；在鹏华证券保险份额上市交易之前，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。

42、鹏华证保A份额和鹏华证保B份额的基本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。

43、鹏华证保A份额和鹏华证保B份额折算为鹏华证券保险份额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份额折算为鹏华证券保险份额内份额后，投资者可以申请场内赎回或转托管至场外申请赎回基金份额。部分投资者可能由于所在证券公司不具备基金销售业务资格或其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，或者选择先转托管至含有基金销售业务资格的证券公司后申请赎回。

44、鹏华证保A份额和鹏华证保B份额的持有人将无法进行基金赎回业务；在鹏华证券保险份额上市交易之前，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。

45、鹏华证保A份额和鹏华证保B份额的基本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。

46、鹏华证保A份额和鹏华证保B份额折算为鹏华证券保险份额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份额折算为鹏华证券保险份额内份额后，投资者可以申请场内赎回或转托管至场外申请赎回基金份额。部分投资者可能由于所在证券公司不具备基金销售业务资格或其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，或者选择先转托管至含有基金销售业务资格的证券公司后申请赎回。

47、鹏华证保A份额和鹏华证保B份额的持有人将无法进行基金赎回业务；在鹏华证券保险份额上市交易之前，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。

48、鹏华证保A份额和鹏华证保B份额的基本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。

49、鹏华证保A份额和鹏华证保B份额折算为鹏华证券保险份额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份额折算为鹏华证券保险份额内份额后，投资者可以申请场内赎回或转托管至场外申请赎回基金份额。部分投资者可能由于所在证券公司不具备基金销售业务资格或其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，或者选择先转托管至含有基金销售业务资格的证券公司后申请赎回。

50、鹏华证保A份额和鹏华证保B份额的持有人将无法进行基金赎回业务；在鹏华证券保险份额上市交易之前，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。

51、鹏华证保A份额和鹏华证保B份额的基本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。

52、鹏华证保A份额和鹏华证保B份额折算为鹏华证券保险份额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份额折算为鹏华证券保险份额内份额后，投资者可以申请场内赎回或转托管至场外申请赎回基金份额。部分投资者可能由于所在证券公司不具备基金销售业务资格或其原因无法直接办理场