

鹏华中证800证券保险指数分级证券投资基金

可能发生不定期份额折算的提示公告

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(以下简称“本基金”)之基础份额鹏华证保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。

由于近期A股市场波动较大,截至2015年3月20日,鹏华证保份额的基金份额净值接近基金合同规定的不定期份额折算的阈值1.500元,在此提请投资者密切关注鹏华证保份额近期净值的波动情况。

根据本基金基金合同的约定,若在某一会计年度最后一个工作日发生基金合同约定的本基金不定期份额折算的情形时,基金管理人本着维护基金份额持有人利益的原则,可根据具体情况选择按照定期份额折算的规则或者不定期份额折算的规则进行份额折算。请投资者密切关注基金管理人届时发布的相关公告。

针对可能发生的不定期份额折算,本基金管理人特别提示如下:

一、本基金之证保A份额表现为低风险、预期收益相对稳定的特征。当发生合同规定的上述不定期份额折算时,证保A份额数将不发生变化,但证保A份额参考净值超过1.000元部分将会折算为鹏华证保份额,证保A份额参考净值将变为1.000元。

二、本基金之证保B份额表现为预期风险高、预期收益高的特征,当发生合同规定的不定期份额折算时,证保B份额的基金份额参考净值超过1.000元的部分将会折算为鹏华证保份额,证保B份额参考净值将变为1.000元。即原证保B份额的持有人在不定期份额折算后将持有证保B份额和鹏华证保份额。因此,持有人的风险收益特征将发生一定的变化,由持有单一的高风险收益特征份额变为同时持有高风险收益特征份额与较高风险收益特征份额的情况。不定期份额折算后证保B份额将恢复到初始2倍杠杆水平,将比折算前约1.5倍的杠杆水平有所提高。

三、证保A 份额、证保B 份额在不定期折算前可能存在折溢价交易情形。不定期份额折算后，其折溢价率可能发生变化。特提醒参与二级市场交易的投资者注意折溢价所带来的风险。

四、根据基金合同规定，折算基准日在触发阈值日后才能确定，因此折算基准日鹏华证保份额的净值可能与触发折算的阈值1.5000元有一定差异。

本基金管理人的其他重要提示：

一、若本基金发生上述不定期份额折算情形，为保证折算期间本基金的平稳运作，本基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停证保A份额与证保B 份额的上市交易和鹏华证保份额的申购及赎回等相关业务。届时本基金管理人将会对相关事项进行公告，敬请投资者予以关注。

投资者若希望了解基金不定期份额折算业务详情，请参阅基金合同及《鹏华中证800证券保险指数分级证券投资基金招募说明书》（以下简称“招募说明书”）或者拨打本公司客服电话：400-6788-999（免长途话费）或0755-82353668。

二、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。本基金管理人提醒投资者知晓基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。敬请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。

特此公告。

鹏华基金管理有限公司
二〇一五年三月二十三日