

鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金可能发生

不定期份额折算的风险提示公告

根据《鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)中关于不定期份额折算的相关规定,当鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金之 B 份额的基金份额参考净值跌至 0.250 元时,鹏华证券分级份额(场内简称:券商指基,基础份额)、券商 A 级份额、券商 B 级份额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 8 月 25 日,券商 B 级的基金份额参考净值接近基金合同规定的不定期份额折算条件,因此本基金管理人敬请投资者密切关注券商 B 级份额近期的参考净值波动情况,并警惕可能出现的风险。

针对不定期折算所带来的风险,本基金管理人特别提示如下:

一、由于券商 A 级、券商 B 级折算前可能存在折溢价交易情形,不定期份额折算后,券商 A 级、券商 B 级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高溢价所带来的风险。

二、券商 B 级表现为高风险、高收益的特征,不定期份额折算后其杠杆将恢复至初始杠杆水平。

三、由于触发折算阈值当日,券商 B 级的参考净值可能已低于阈值,而折算基准日在触发阈值日后才能确定,此折算基准日券商 B 级的净值可能与折算阈值 0.250 元有一定差异。

四、券商 A 级表现为低风险、收益相对稳定的特征,但在不定期份额折算后券商 A 级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券商 A 级变为同时持有较低风险收益特征券商 A 级与较高风险收益特征券商指基的情况,因此券商 A 级持有人预期收益实现的不确定性将会增加。

本基金管理人的其他重要提示:

一、根据深圳证券交易所的相关业务规则,场内份额数将取整计算(最小单位为 1 份),舍去部分计入基金资产,持有极小数量券商指基、券商 A 级、券商 B 级的持有人存在折算后份额因为不足 1 份而被强制归入基金资产的风险。

二、为保证折算期间本基金的平稳运作，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券商 A 级份额与券商 B 级份额的上市交易和鹏华证券分级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，请参阅本基金的基金合同及《鹏华中证全指证券公司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)。

三、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。投资有风险，选择须谨慎。敬请投资者于投资前认真阅读本基金的基金合同和招募说明书（更新）等相关法律文件。

特此公告。

鹏华基金管理有限公司

2015 年 8 月 26 日