

# 鹏华新丝路指数分级证券投资基金基金份额折算和变更登记的提示性公告

鹏华基金管理有限公司于 2018 年 4 月 3 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、上海证券交易所网站（www.sse.com.cn）和基金管理人网站（www.phfund.com）发布《鹏华基金管理有限公司关于鹏华新丝路指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》与《鹏华基金管理有限公司关于鹏华新丝路指数分级证券投资基金实施转型的提示性公告》。根据持有人大会决议，基金管理人将对鹏华新丝路指数分级证券投资基金进行基金份额折算和变更登记，鹏华新丝路指数分级证券投资基金转型为鹏华沪深 300 指数增强型证券投资基金（以下简称“鹏华鹏华沪深 300 指数增强基金”或“本基金”），基金份额折算和变更登记由基金管理人办理，本基金实施折算和变更登记事项如下：

## 一、基金份额净值折算和变更登记

### 1、基金份额折算基准日

基金份额折算基准日为 2018 年 5 月 24 日。

### 2、折算对象

基金份额折算基准日鹏华新丝路指数分级证券投资基金的全部份额，包括鹏华新丝路份额(502026)，鹏华新丝路 A 份额(502027)，鹏华新丝路 B 份额(502028)。

### 3、基金份额净值折算

在基金份额净值折算基准日日终，鹏华新丝路份额（502026），鹏华新丝路 A 份额（502027），鹏华新丝路 B 份额（502028）的基金份额净值均折算为 1.000 元。

折算方式如下：

鹏华新丝路份额的基金份额折算公式如下：

鹏华新丝路份额的折算比例 = 基金份额净值折算基准日折算前鹏华新丝路份额的基金份额净值 / 1.000

鹏华新丝路份额折算后增减的份额数 = 折算前鹏华新丝路份额的份额数 ×

(鹏华新丝路份额的折算比例-1)

鹏华新丝路 A 份额的基金份额折算公式如下:

鹏华新丝路 A 份额的折算比例 = 基金份额净值折算基准日折算前鹏华新丝路 A 份额的基金份额参考净值 / 1.000

鹏华新丝路 A 份额折算后增减的鹏华新丝路份额的份额数 = 折算前鹏华新丝路 A 份额的份额数 × (鹏华新丝路 A 份额的折算比例 - 1)

鹏华新丝路 B 份额的基金份额折算公式如下:

鹏华新丝路 B 份额的折算比例 = 基金份额净值折算基准日折算前鹏华新丝路 B 份额的基金份额参考净值 / 1.000

鹏华新丝路 B 份额折算后增减的鹏华新丝路份额的份额数 = 折算前鹏华新丝路 B 份额的份额数 × (鹏华新丝路 B 份额的折算比例 - 1)

基金份额折算比例保留至小数点后第 8 位, 小数点第 8 位以后的部分四舍五入。份额折算后新增鹏华新丝路分级的份额数采用四舍五入的方式保留到小数点后两位, 由此产生的误差计入基金财产。

在实施基金份额折算时, 基金份额净值折算基准日折算前鹏华新丝路、鹏华新丝路 A、鹏华新丝路 B 份额的基金份额(参考)净值与鹏华新丝路、鹏华新丝路 A、鹏华新丝路 B 份额的折算比例的具体计算结果见基金管理人届时发布的相关公告。

## 2、基金份额变更登记

基金管理人将于基金份额净值折算基准日后完成基金份额变更登记。在基金份额变更登记日日终, 基金管理人将对投资者持有的鹏华新丝路份额、鹏华新丝路 A 份额、鹏华新丝路 B 份额变更登记为鹏华沪深 300 指数增强型证券投资基金基金份额。基金变更登记成功后鹏华沪深 300 指数增强型证券投资基金的登记机构为中国证券登记结算有限责任公司。

## 二、关于基金合同等法律文件的修订

根据《关于鹏华新丝路指数分级证券投资基金转型并修改基金合同等相关事项的议案》、《鹏华基金管理有限公司关于鹏华新丝路指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》以及相关法律法规的规定, 经与基金托管人招商银行股份有限公司协商一致, 基金管理人已将《鹏华新丝路指数分

级证券投资基金基金合同》、《鹏华新丝路指数分级证券投资基金托管协议》分别修订为《鹏华沪深300指数增强型证券投资基金基金合同》、《鹏华沪深300指数增强型证券投资基金托管协议》，并据此编制《鹏华沪深300指数增强型证券投资基金招募说明书》。鹏华新丝路指数分级证券投资基金根据中国证监会《关于准予鹏华新丝路指数分级证券投资基金变更注册的批复》（证监许可[2017]1621号）准予变更注册。《鹏华沪深300指数增强型证券投资基金基金合同》、《鹏华沪深300指数增强型证券投资基金托管协议》将自鹏华新丝路指数分级证券投资基金基金份额转换基准日的次一工作日起，即2018年5月25日起生效，同日，鹏华新丝路指数分级证券投资基金正式更名为“鹏华沪深300指数增强型证券投资基金”。

### 三、鹏华沪深 300 指数增强型证券投资基金的申购赎回

基金管理人自《鹏华沪深300指数增强型证券投资基金基金合同》生效之日，即2018年5月25日起不超过3个月开始办理鹏华沪深300指数增强型证券投资基金的申购、赎回业务，具体业务办理时间在相关公告中约定。在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人将依照《证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定在指定媒介上公告申购与赎回的开始时间。

### 四、对基金份额持有人的影响及基金风险发生变化的提示

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。敬请投资人注意投资风险。投资者投资于本基金前应认真阅读《鹏华沪深300指数增强型证券投资基金基金合同》、最新的《鹏华沪深300指数增强型证券投资基金招募说明书》等法律文件以及《鹏华基金管理有限公司关于以通讯方式召开鹏华新丝路指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的公告》、《关于鹏华新丝路指数分级证券投资基金转型的议案》、《鹏华基金管理有限公司关于鹏华新丝路指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》的相关规定，了解拟投资基金的风险收益特征变化和转型安排，并根据自身投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资者的风险承受能力相匹配。

特此公告。

鹏华基金管理有限公司

2018年5月22日