

鹏华国证钢铁行业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《鹏华国证钢铁行业指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）关于基金不定期份额折算的相关约定，当鹏华国证钢铁行业指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）之 B 类份额的基金份额参考净值跌至 0.250 元时，鹏华钢铁分级份额（场内简称：钢铁分级，场内代码：502023）、鹏华钢铁 A 份额（场内简称：钢铁 A，场内代码：502024）、鹏华钢铁 B 份额（场内简称：钢铁 B，场内代码：502025）将进行不定期份额折算。

由于近期 A 股市场波动较大，截至 2019 年 09 月 30 日，钢铁 B 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钢铁 B 近期的参考净值波动情况，并警惕可能出现的风险。

针对不定期份额折算可能带来的风险，本基金管理人特别提示如下：

- 1、由于钢铁 A、钢铁 B 折算前可能存在折溢价交易情形，不定期份额折算后，钢铁 A、钢铁 B 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折溢价所带来的风险。
- 2、钢铁 B 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，溢价率可能发生较大变化。投资者如果盲目投资，可能遭受重大损失，敬请投资者注意投资风险。
- 3、由于触发折算阈值当日，钢铁 B 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，此折算基准日钢铁 B 的净值可能与折算阈值 0.250 元有一定差异。
- 4、钢铁 A 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钢铁 A 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钢铁 A 变为同时持有较低风险收益特征钢铁 A 与较高风险收益特征鹏华钢铁分级份额的情况，因此钢铁 A 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：

- 1、根据上海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，持有极小数量鹏华钢铁分级份额、钢铁 A、钢铁 B 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。
- 2、如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上海证券交易所、登记机构的相关业务规则，暂停鹏华钢铁分级、钢铁 A 与钢铁 B 的上市交易、配对转换，以及鹏华钢铁分级份额的申购、赎回、转托管等相关业务。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基金合同及《鹏华国证钢铁行业指数分级证券投资基金招募说明书》（更新）（以下简称“招募说明书”）或者拨打本公司客服电话：400-6788-999 或 400-6788-533（免长途话费）。
- 3、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等相关法律文件。

特此公告。

鹏华基金管理有限公司

2019年10月08日