鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金
定期份额折算的公告

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》”）以及深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则，鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）将于 2019 年 11 月 01 日办理基金份额定期折算业务。相关事项公告如下：

一、折算基准日

根据《基金合同》的约定，基金份额定期折算基准日为每个会计年度 10 月 31 日，基金份额定期折算日为每个会计年度 11 月第一个工作日。本次定期折算日为 2019 年 11 月 01 日。

二、折算对象

基金份额折算基准日登记在册的鹏华证券 A 份额（场内简称：券商 A 级，基金代码：150235）、鹏华证券分级份额（基金简称：鹏华证券分级，场内简称：券商指基，基金代码：160633）。

三、折算频率

每年折算一次。

四、折算方式

鹏华证券 A 份额与鹏华证券 B 份额按照《基金合同》的约定进行基金份额参考净值计算，对鹏华证券 A 份额的约定应得收益进行定期份额折算。

在基金份额折算前与折算后，鹏华证券 A 份额与鹏华证券 B 份额的份额配比保持 1：1 的比例。对于鹏华证券 A 份额的约定应得收益，即鹏华证券 A 份额每个定期折算基准日基金份额参考净值超出 1.000 元部分，将折算为场内鹏华证券分级份额分配给鹏华证券 A 份额持有人。鹏华证券分级份额持有人持有的每 2 份鹏华证券分级份额将按 1 份鹏华证券 A 份额获得新增鹏华证券分级份额的分配。持有场外鹏华证券分级份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外鹏华证券分级份额的分配；持有场内鹏华证券分级份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内鹏华证券分级份额的分配。经过上述份额折算，鹏华证券 A 份额的基金份额参考净值调整为 1.000 元，鹏华证券分级份额的基金份额净值将相应调整。

每个会计年度 11 月第一个工作日为基金份额折算日，本基金将对鹏华证券 A 份额和鹏华证券分级份额进行定期份额折算。有关计算公式如下：

（1）鹏华证券 A 份额

定期份额折算不改变鹏华证券 A 份额的份额数，即

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

$$NUM^{\text{定期后}}_{\text{鹏华证券 A 份额}} = NUM^{\text{定期前}}_{\text{鹏华证券 A 份额}}$$

其中，

$\mathrm{NUM}^{\text{定期前}}_{\text{鹏华证券 A 份额}}$：定期份额折算前鹏华证券 A 份额的份额数，

$\mathrm{NUM}^{\text{定期后}}_{\text{鹏华证券 A 份额}}$：定期份额折算后鹏华证券 A 份额的份额数。

因持有鹏华证券 A 份额而新增的场内鹏华证券分级份额的份额数为

$$NUM^{\text{定期新增，鹏华证券 A 份额}}_{\text{鹏华证券份额}} = \frac{NUM^{\text{定期前}}_{\text{鹏华证券 A 份额}} \times \left(NAV^{\text{参考，定期前}}_{\text{鹏华证券 A 份额}} - 1.000\right)}{NAV^{\text{定期后}}_{\text{鹏华证券份额}}}$$

其中，

$\mathrm{NUM}^{\text{定期前}}_{\text{鹏华证券 A 份额}}$：定期份额折算前鹏华证券 A 份额的份额数，

$\mathrm{NAV}^{\text{参考，定期前}}_{\text{鹏华证券 A 份额}}$：定期份额折算前鹏华证券 A 份额的基金份额参考净值，

$\mathrm{NUM}^{\text{定期前}}_{\text{鹏华证券份额}}$：定期份额折算前鹏华证券分级份额的份额数，

$\mathrm{NAV}^{\text{定期后}}_{\text{鹏华证券份额}}$：定期份额折算后鹏华证券分级份额的基金份额净值，计算公式为

$$NAV^{\text{定期后}}_{\text{鹏华证券份额}} = \frac{\text{定期折算前全部鹏华证券份额的基金资产净值} - 0.5 \times \left(NAV^{\text{参考，定期前}}_{\text{鹏华证券 A 份额}} - 1.000\right) \times NUM^{\text{定期前}}_{\text{鹏华证券份额}}}{NUM^{\text{定期前}}_{\text{鹏华证券份额}}}$$

定期份额折算后的鹏华证券分级份额的基金份额净值，保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

（2）鹏华证券 B 份额

定期份额折算不改变鹏华证券 B 份额的基金份额参考净值及其份额数，即

$$NAV^{\text{参考，定期后}}_{\text{鹏华证券 B 份额}} = NAV^{\text{参考，定期前}}_{\text{鹏华证券 B 份额}}$$

$$NUM^{\text{定期后}}_{\text{鹏华证券 B 份额}} = NUM^{\text{定期前}}_{\text{鹏华证券 B 份额}}$$

（3）鹏华证券分级份额

定期份额折算后鹏华证券分级份额的份额数等于定期折算前鹏华证券分级份额的份额数与新增的鹏华证券分级份额的份额数之和，即

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

$$NUM^{\text{定期后}}_{\text{鹏华证券份额}} = NUM^{\text{定期前}}_{\text{鹏华证券份额}} + NUM^{\text{定期新增}}_{\text{鹏华证券份额}}$$

鹏华证券分级份额持有人新增的鹏华证券分级份额数为

$$NUM^{\text{定期新增}}_{\text{鹏华证券份额}} = \frac{0.5 \times (NAV^{\text{参考，定期前}}_{\text{鹏华证券 A 份额}} - 1.000) \times NUM^{\text{定期前}}_{\text{鹏华证券份额}}}{NAV^{\text{定期后}}_{\text{鹏华证券份额}}}$$

其中，

$NAV^{\text{参考，定期前}}_{\text{鹏华证券 A 份额}}$：定期份额折算前鹏华证券 A 份额的基金份额参考净值，

$NUM^{\text{定期前}}_{\text{鹏华证券份额}}$：定期份额折算前鹏华证券分级份额的份额数，

$NAV^{\text{定期后}}_{\text{鹏华证券份额}}$：定期份额折算后鹏华证券分级份额的基金份额净值，计算公式同上。

份额折算后场外基金份额的份额数计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分舍弃，余额计入基金财产；场内基金份额的份额数计算结果保留到整数位，余额的处理方法按照深圳证券交易所或基金份额登记机构的相关规则及有关规定执行。

五、定期份额折算示例

假设本基金成立后第 2 个会计年度 11 月第一个工作日为定期份额折算日，鹏华证券分级份额当天折算前资产净值为 8,661,250,000 元。当天场外鹏华证券分级份额、场内鹏华证券分级份额、鹏华证券 A 份额、鹏华证券 B 份额的份额分别为 55 亿份、10 亿份、20 亿份、20 亿份。本次定期份额折算前每份鹏华证券 A 份额参考净值为 1.065 元，且未进行不定期份额折算。

定期份额折算的对象为基准日登记在册的鹏华证券 A 份额和鹏华证券分级份额，即 20 亿份和 65 亿份。

（1）鹏华证券 A 份额持有人

定期折算后持有的鹏华证券 A 份额为

$$NUM^{\text{定期后}}_{\text{鹏华证券 A 份额}} = NUM^{\text{定期前}}_{\text{鹏华证券 A 份额}} = 20 \text{ 亿份}$$

定期份额折算后鹏华证券分级份额的份额净值为

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

$$NAV^{\text{定期后}}_{\text{鹏华证券份额}}$$

$$= \frac{\text{定期折算前全部鹏华证券份额的基金资产净值} - 0.5 \times \left(NAV^{\text{参考，定期前}}_{\text{鹏华证券 A 份额}} - 1.000\right) \times NUM^{\text{定期前}}_{\text{鹏华证券份额}}}{NUM^{\text{定期前}}_{\text{鹏华证券份额}}}$$

$$= \frac{8{,}661{,}250{,}000 - 0.5 \times (1.065 - 1.000) \times 6{,}500{,}000{,}000}{6{,}500{,}000{,}000},$$

$$= 1.300 \text{ 元}$$

因持有鹏华证券 A 份额而新增的场内鹏华证券分级份额的份额数为

$$NUM^{\text{定期新增，鹏华证券 A 份额}}_{\text{鹏华证券份额}}$$

$$= \frac{NUM^{\text{定期前}}_{\text{鹏华证券 A 份额}} \times \left(NAV^{\text{参考，定期前}}_{\text{鹏华证券 A 份额}} - 1.000\right)}{NAV^{\text{定期后}}_{\text{鹏华证券份额}}}$$

$$= \frac{2{,}000{,}000{,}000 \times (1.065 - 1.000)}{1.300},$$

$$= 100{,}000{,}000 \text{ 份}$$

鹏华证券 A 份额持有人在定期折算后总共持有 20 亿份鹏华证券 A 份额，基金份额净值为 1.000 元；新增持有 100,000,000 份鹏华证券分级份额，基金份额净值为 1.300 元。

（2）鹏华证券分级份额持有人

鹏华证券分级份额持有人新增的鹏华证券分级份额数为

$$NUM^{\text{定期新增}}_{\text{鹏华证券份额}}$$

$$= \frac{0.5 \times (NAV^{\text{参考，定期前}}_{\text{鹏华证券 A 份额}} - 1.000) \times NUM^{\text{定期前}}_{\text{鹏华证券份额}}}{NAV^{\text{定期后}}_{\text{鹏华证券份额}}}$$

$$= \frac{0.5 \times (1.065 - 1.000) \times 6{,}500{,}000{,}000}{1.300},$$

$$= 162{,}500{,}000 \text{ 份}$$

鹏华证券分级份额持有人在定期折算后持有的鹏华证券分级份额为

$$NUM^{\text{定期后}}_{\text{鹏华证券份额}} = NUM^{\text{定期前}}_{\text{鹏华证券份额}} + NUM^{\text{定期新增}}_{\text{鹏华证券份额}}$$

$$= 6{,}500{,}000{,}000 + 162{,}500{,}000,$$

$$= 6{,}662{,}500{,}000 \text{ 份}$$

鹏华证券分级份额持有人在定期折算后总共持有 6,662,500,000 份鹏华证券分级份额，基金份额净值为 1.300 元。

六、基金份额折算期间的基金业务办理

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

（一）2019 年 10 月 31 日，本基金暂停办理申购、赎回、转换、定期定额投资、转托管（包括系统内转托管、跨系统转托管，下同）、配对转换业务。鹏华证券 A 份额和鹏华证券 B 份额正常交易。

（二）2019 年 11 月 01 日，本基金暂停办理申购、赎回、转换、定期定额投资、转托管、配对转换业务。鹏华证券 A 份额暂停交易，鹏华证券 B 份额正常交易。当日晚间，基金管理人计算当日基金份额净值及份额折算比例并进行份额折算。

（三）2019 年 11 月 04 日，本基金暂停办理申购、赎回、转换、定期定额投资、转托管、配对转换业务。鹏华证券 A 份额暂停交易，鹏华证券 B 份额正常交易。当日，本基金基金份额登记人及基金管理人为持有人办理份额登记确认。

（四）2019 年 11 月 05 日，基金管理人将公告份额折算确认结果，持有人可以查询其账户内的基金份额。当日，本基金恢复办理申购、赎回、转换、定期定额投资、转托管、配对转换业务。鹏华证券 A 份额于该日开市起复牌，鹏华证券 B 份额正常交易。

七、重要提示

（一）根据《深圳证券交易所证券投资基金交易和申购赎回实施细则》，2019 年 11 月 05 日鹏华证券 A 份额即时行情显示的前收盘价为 2019 年 11 月 04 日的鹏华证券 A 份额净值（四舍五入至 0.001 元）。由于鹏华证券 A 份额折算前可能存在折溢价交易情形，折算前的收盘价扣除约定收益后与 2019 年 11 月 05 日的前收盘价可能有较大差异，2019 年 11 月 05 日当日可能出现交易价格大幅波动的情形。敬请投资者注意投资风险。

（二）鹏华证券 A 份额的约定应得收益将折算成鹏华证券分级场内份额分配给鹏华证券 A 份额的持有人，而鹏华证券分级份额为跟踪中证全指证券公司指数的基础份额，其份额净值将随市场涨跌而变化，因此鹏华证券 A 份额持有人预期收益的实现存在一定的不确定性，可能会承担因市场下跌而遭受损失的风险。

（三）由于鹏华证券 A 份额新增份额折算成鹏华证券分级份额的场内份额数和鹏华证券分级份额的场内份额经折算后的份额数取整计算（最小单位为 1 份），舍去部分计入基金财产，持有较少鹏华证券 A 份额数或场内鹏华证券分级份额数的份额持有人存在无法获得新增场内鹏华证券分级份额的可能性。因此，上述份额持有人可在基金份额折算基准日之前将原有份额卖出或者赎回或者增加持有份额的数量来保证自身权益不受损害。

（四）在二级市场可以做交易的证券公司并不全部具备中国证监会颁发的基金销售资格，而投资者只能通过具备基金销售资格的证券公司赎回基金份额。因此，如果投资者通过不具备基金销售资格的证券公司购买鹏华证券 A 份额，在定期份额折算后，则折算新增的鹏华证券分级份额无法赎回。投资者可以选择在折算前将鹏华证券 A 份额卖出，或者在折算后将新增的鹏华证券分级份额转托管到具有基金销售资格的证券公司后赎回。

（五）本公司承诺以诚实信用、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。投资者投资于本基金前应认真阅读本基金的基金合同、招募说明书及更新等文件。敬请投资者注意投资风险。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

投资者若希望了解基金份额折算业务详情，请登陆本公司网站：www.phfund.com 或者拨打本公司客服电话：400-6788-999 或 400-6788-533（免长途话费）。

特此公告。

鹏华基金管理有限公司

2019 年 10 月 29 日

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn