

鹏华国证钢铁行业指数分级证券投资基金不定期份额折算结果及恢复交易的公告

根据《鹏华国证钢铁行业指数分级证券投资基金基金合同》（简称“基金合同”）及上海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定，鹏华基金管理有限公司（以下简称“本公司”）以2020年02月04日为基准日，对在该日登记在册的鹏华钢铁A份额（场内简称：钢铁A，基金代码：502024）和鹏华钢铁分级份额（基金简称：鹏华钢铁分级，场内简称：钢铁分级，基金代码：502023，包括场内份额、场外份额）（以下简称“本基金”）实施了不定期份额折算，现将相关事项公告如下：

一、份额折算结果

2020年02月04日，鹏华钢铁分级场外份额经折算后的份额数按截位法保留到小数点后两位，余额部分计入基金资产；鹏华钢铁分级场内份额、鹏华钢铁A份额、鹏华钢铁B份额经折算后的份额数取整计算（最小单位为1份），不足1份的零碎份加总后保留至整数位（最小单位为1份），按各个场内份额持有人的零碎份从大到小的排序，依次向相应的基金份额持有人记增1份，直到所有零碎份的合计份额分配完毕。

折算前后鹏华钢铁分级场外份额、鹏华钢铁分级场内份额、鹏华钢铁A份额、鹏华钢铁B份额的份额余额，份额折算比例，以及折算前后基金份额净值（或基金份额参考净值）如下表所示：

基金份额名称

折算前基金份额（单位：份）

折算前基金份额净值（或基金份额参考净值）（单位：元）

份额折算比例折算后基金份额（单位：份）

折算后基金份额净值（或基金份额参考净值）（单位：元）

鹏华钢铁分级场外份额 502,459,191.06 0.635 0.634820 318,971,143.66 1.000

鹏华钢铁分级场内份额 1,485,443.00 0.635 0.634820 942,989.00 1.000

鹏华钢铁A份额 2,144,746.00 1.019

0.250337 536,910.00

1.000

0.768965 1,649,235.00（注）

鹏华钢铁B份额 2,144,746.00 0.251 0.250337 536,910.00 1.000

注：鹏华钢铁A份额经折算后产生新增的鹏华钢铁分级场内份额。

投资者自公告之日起可查询经注册登记人及本公司确认的折算后份额。

二、恢复交易

自2020年02月06日起，本基金恢复申购、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）、配对转换业务。鹏华钢铁分级场内份额、鹏华钢铁A、鹏华钢铁B将于2020年02月06日上午开市复牌。

根据上海证券交易所的相关业务规则，2020年02月06日复牌首日鹏华钢铁分级场内份额、鹏华钢铁A份额、鹏华钢铁B份额即时行情显示的前收盘价将调整为2020年02月05日鹏华钢铁分级份额的基金份额净值以及鹏华钢铁A份额、鹏华钢铁B份额的基金份额参考净值（四舍五入至0.001元），分别为1.012元、1.000元和1.024元。2020年02月06日当日鹏华钢铁分级场内份额、鹏华钢铁A份额、鹏华钢铁B份额均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。

三、重要提示

1、特别提示：近日鹏华钢铁B份额二级市场交易价格溢价较大，不定期份额折算后，鹏华钢铁B份额的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鹏华钢铁B份额高溢价交易所带来的风险。

2、鹏华钢铁A份额表现为低风险、预期收益相对稳定的特征，但在不定期份额折算后鹏华钢铁A份额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的鹏华钢铁A份额变为同时持有较低风险收益特征的鹏华钢铁A份额与较高风险收益特征的鹏华钢铁B份额，因此原鹏华钢铁A份额持有人预期收益实现的不确定性将会增加；此外，鹏华钢铁分级份额为跟踪国证钢铁行业指数的基础份额，其份额净值将随市场涨跌而变化，因此原鹏华钢铁A份额持有人还可能会承担因市场下跌而遭受损失的风险。

3、鹏华钢铁B份额表现为高风险、高收益预期的特征，不定期份额折算后其杠杆倍数将大幅降低，将恢复到初始的2倍杠杆水平，相应地，鹏华钢铁B份额净值随市场涨跌而增长或者下降的幅度也会大幅减小。

4、原鹏华钢铁A份额持有人可通过办理配对转换业务将此次折算获得的场内鹏华钢铁分级份额分拆为鹏华钢铁A份额、鹏华钢铁B份额。

5、根据上海证券交易所的相关业务规则，鹏华钢铁分级场内份额、鹏华钢铁A份额、鹏华钢铁B份额经折算后的份额数均取整计算（最小单位为1份），不足1份的零碎份加总后保留至整数位（最小单位为1份），按各个场内份额持有人零碎份从大到小的排序，依次向相应的基金份额持有人记增1份，直到所有零碎份的合计份额分配完毕。因此持有极小数量鹏华钢铁分级份额、鹏华钢铁A份额、鹏华钢铁B份额的持有人，存在折算后份额因为不足1份而导致相应的资产被强制归入基金资产的风险。

6、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钢铁A份额，在不定期份额折算后，则折算新增的鹏华钢铁分级份额无法赎回。投资者可以选择在折算前将鹏华钢铁A份额卖出，或者在折算后将新增的鹏华钢铁分级份额转托管到具有基金销售资格的证券公司后赎回。

7、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。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及更新等相关法律文件。敬请投资者注意投资风险。

投资者若希望了解基金不定期份额折算业务详情，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

2020年02月06日