鹏华中证酒指数分级证券投资基金

不定期份额折算公告

根据《鹏华中证酒指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）关于不定期份额折算的相关规定，当鹏华中证酒指数分级证券投资基金的基础份额（以下简称“鹏华酒分级份额”）的基金份额净值达到 1.500 元时，本基金将进行不定期份额折算。

截至 2020 年 06 月 30 日，本基金鹏华中证酒指数分级证券投资基金份额的基金份额净值为 1.507 元，达到基金合同规定的不定期份额折算条件。根据本基金基金合同以及深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定，本基金将以 2020 年 07 月 01 日为基准日办理不定期份额折算业务。相关事项公告如下：

一、基金份额折算基准日

本次不定期份额折算的基准日为 2020 年 07 月 01 日。

二、基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的鹏华酒分级份额（场内简称“酒分级”，基金代码：160632）、鹏华酒 A 份额（场内简称“酒 A”，基金代码 150229）、鹏华酒 B 份额（场内简称“酒 B”，基金代码 150230）。

三、基金份额折算方式

鹏华酒分级份额、鹏华酒 A 份额、鹏华酒 B 份额按照《基金合同》“第二十二部分、基金份额的折算”规则进行不定期份额折算。

当达到不定期折算条件时，本基金将分别对鹏华酒分级份额、鹏华酒 A 份额、鹏华酒 B 份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保鹏华酒 A 份额与鹏华酒 B 份额的比例为 1：1，份额折算后鹏华酒分级份额的基金份额净值、鹏华酒 A 份额与鹏华酒 B 份额的基金份额参考净值均调整为 1.000 元。具体折算原则及公式如下：

1）鹏华酒 A 份额

① 份额折算前鹏华酒 A 份额的份额数与份额折算后鹏华酒 A 份额的份额数相等，即

$$NUM_{\text{鹏华酒 A 份额}}^{\text{不定期后}} = NUM_{\text{鹏华酒 A 份额}}^{\text{不定期前}}$$

其中，

$NUM_{\text{鹏华酒 A 份额}}^{\text{不定期前}}$：不定期份额折算前鹏华酒 A 份额的份额数，

$NUM_{\text{鹏华酒A份额}}^{\text{不定期后}}$：不定期份额折算后鹏华酒 A 份额的份额数。

② 份额折算前鹏华酒 A 份额持有人在份额折算后将持有鹏华酒 A 份额与新增场内鹏华酒分级份额，且所对应的基金资产净值不变。

鹏华酒 A 份额持有人新增的场内鹏华酒分级份额的份额数为

$$NUM_{\text{鹏华酒份额}}^{\text{不定期新增，鹏华酒A份额}} = \frac{NUM_{\text{鹏华酒A份额}}^{\text{不定期前}} \times \left(NAV_{\text{鹏华酒A份额}}^{\text{参考，不定期前}} - 1.000\right)}{1.000}$$

其中，

$NUM_{\text{鹏华酒A份额}}^{\text{不定期前}}$：不定期份额折算前鹏华酒 A 份额的份额数，

$NAV_{\text{鹏华酒A份额}}^{\text{参考，不定期前}}$：不定期份额折算前鹏华酒 A 份额的基金份额参考净值。

2）鹏华酒 B 份额

① 份额折算前鹏华酒 B 份额的份额数与份额折算后鹏华酒 B 份额的份额数相等

$$NUM_{\text{鹏华酒B份额}}^{\text{不定期后}} = NUM_{\text{鹏华酒B份额}}^{\text{不定期前}}$$

其中，

$NUM_{\text{鹏华酒B份额}}^{\text{不定期前}}$：不定期份额折算前鹏华酒 B 份额的份额数，

$NUM_{\text{鹏华酒B份额}}^{\text{不定期后}}$：不定期份额折算后鹏华酒 B 份额的份额数。

② 份额折算前鹏华酒 B 份额持有人在份额折算后将持有鹏华酒 B 份额与新增场内鹏华酒分级份额，且所对应的基金资产净值不变。

鹏华酒 B 份额持有人新增的场内鹏华酒分级份额的份额数为

$$NUM_{\text{鹏华酒份额}}^{\text{不定期新增，鹏华酒B份额}} = \frac{NUM_{\text{鹏华酒B份额}}^{\text{不定期前}} \times \left(NAV_{\text{鹏华酒B份额}}^{\text{参考，不定期前}} - 1.000\right)}{1.000}$$

其中，

$NUM_{\text{鹏华酒B份额}}^{\text{不定期前}}$：不定期份额折算前鹏华酒 B 份额的份额数，

$NAV^{参考，不定期前}_{鹏华酒\ B\ 份额}$：不定期份额折算前鹏华酒 B 份额的基金份额参考净值。

3）鹏华酒分级份额

鹏华酒分级份额持有人份额折算前后所持有的鹏华酒分级份额的资产净值不变。场外鹏华酒分级份额持有人份额折算后获得新增场外鹏华酒分级份额，场内鹏华酒分级份额持有人份额折算后获得新增场内鹏华酒分级份额。

鹏华酒分级份额持有人不定期份额折算后的鹏华酒分级份额的份额数为

$$NUM^{不定期后}_{鹏华酒份额} = \frac{NUM^{不定期前}_{鹏华酒份额} \times NAV^{不定期前}_{鹏华酒份额}}{1.000}$$

其中，

$NUM^{不定期前}_{鹏华酒份额}$：不定期份额折算前鹏华酒分级份额的份额数，

$NAV^{不定期前}_{鹏华酒份额}$：不定期份额折算前鹏华酒分级份额的基金份额净值，

$NUM^{不定期后}_{鹏华酒份额}$：不定期份额折算后鹏华酒分级份额的份额数。

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注册登记机构的相关规则及有关规定执行。

四、不定期份额折算示例

设在本基金的不定期份额折算日，鹏华酒分级份额的基金份额净值、鹏华酒 A 份额与鹏华酒 B 份额的基金份额参考净值如下表所示，折算后，鹏华酒分级份额的基金份额净值、鹏华酒 A 份额、鹏华酒 B 份额的基金份额参考净值均调整 1.000 元，则各持有鹏华酒分级份额、鹏华酒 A 份额、鹏华酒 B 份额 10,000 份的基金份额持有人所持基金份额的变化如下表所示：

	折算前		折算后	
	份额净值/份额参考净值	份额数	份额净值/份额参考净值	份额数
鹏华酒分级份额	1.536 元	10,000 份	1.000 元	15,360 份鹏华酒分级份额
鹏华酒 A 份额	1.028 元	10,000 份	1.000 元	10,000 份鹏华酒 A 份额+280 份鹏华酒分级份额

鹏华酒 B 份额	2.044 元	10,000 份	1.000 元	10,000 份鹏华酒 B 份额+10,440 份鹏华酒分级

五、基金份额折算期间的基金业务办理

（一）不定期份额折算基准日（即 2020 年 07 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（包括系统内转托管、跨系统转托管，下同）、配对转换业务。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。

（二）不定期份额折算基准日后的第一个工作日（即 2020 年 07 月 02 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,鹏华酒 A、鹏华酒 B 暂停交易。当日，本基金注册登记人及基金管理人为持有人办理份额登记确认。

（三）不定期份额折算基准日后的第二个工作日（即 2020 年 07 月 03 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。鹏华酒 A 份额、鹏华酒 B 份额将于 2020 年 07 月 03 日上午开市复牌交易。

根据相关公告，鹏华酒分级仍暂停跨系统转托管（场外转场内）业务；单日单个基金账户累计的场内申购、定期定额投资本基金的金额不应超过 1000 元。上述安排如有调整，基金管理人将另行发布公告。

（四）根据深圳证券交易所的相关业务规则，2020 年 07 月 03 日鹏华酒 A、鹏华酒 B 即时行情显示的前收盘价为 2020 年 07 月 02 日的鹏华酒 A、鹏华酒 B 的基金份额参考净值(四舍五入至 0.001 元)，2020 年 07 月 03 日当日鹏华酒 A 份额和鹏华酒 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。

六、重要提示

1、本基金鹏华酒 A、鹏华酒 B 将于 2020 年 07 月 02 日暂停交易，并于 2020 年 07 月 03 日上午开市复牌交易。

2、本基金鹏华酒 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酒 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酒 A 份额变为同时持有较低风险收益特征的鹏华酒 A 份额与较高风险收益特征的鹏华酒分级份额，因此原鹏华酒 A 份额持有人预期收益实现的不确定性将会增加；此外，鹏华酒分级份额为跟踪中证酒指数的基础份额，其份额净值将随市场涨跌而变化，因此原鹏华酒 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、本基金鹏华酒 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提升，将恢复到初始的 2 倍杠杆水平，相应地，鹏华酒 B 份额净值随市场涨跌而增长或者下降的幅度

也会大幅增加。

4、由于鹏华酒 A 份额、鹏华酒 B 份额折算前可能存在折溢价交易情形，不定期份额折算后，鹏华酒 A、鹏华酒 B 份额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。

5、原鹏华酒 A 份额、鹏华酒 B 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酒分级份额分拆为鹏华酒 A 份额、鹏华酒 B 份额。

6、根据深圳证券交易所的相关业务规则，鹏华酒 A 份额、鹏华酒 B 份额、鹏华酒分级份额的场内份额经折算后的份额数均取整计算（最小单位为 1 份），舍去部分计入基金财产，持有极小数量鹏华酒 A 份额、鹏华酒 B 份额、鹏华酒分级份额的持有人，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。

7、鹏华酒分级份额折算基准日的份额净值与折算条件 1.500 元可能有一定差异。

8、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。

9、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 07 月 01 日