

关于鹏华中证传媒指数分级证券投资基金修改基金份额净值和基金份额参考净值计算公式并修改基金合同的公告

为保障鹏华中证传媒指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）的正常运作，我司拟完善本基金的鹏华传媒 A 份额和鹏华传媒 B 份额的基金份额净值及基金份额参考净值的计算公式，同时对本基金的基金合同进行修改，并更新招募说明书及其摘要。

一、基金合同的修改

（一）基金份额净值计算公式的修改

修改前：

2、鹏华传媒 A 份额与鹏华传媒 B 份额的基金份额净值计算

设 T 日为鹏华传媒 A 份额与鹏华传媒 B 份额的基金份额净值计算日，则鹏华传媒 A 份额和鹏华传媒 B 份额的基金份额净值为：

$$NAV_{\text{鹏华传媒 A 份额}} = 1 + R \times \frac{t}{N}$$

$$NAV_{\text{鹏华传媒 B 份额}} = 2 \times NAV_{\text{鹏华传媒份额}} - NAV_{\text{鹏华传媒 A 份额}}$$

修改后：

2、鹏华传媒 A 份额与鹏华传媒 B 份额的基金份额净值计算

设 T 日为鹏华传媒 A 份额与鹏华传媒 B 份额的基金份额净值计算日，则鹏华传媒 A 份额和鹏华传媒 B 份额的基金份额净值为：

$$NAV_{\text{鹏华传媒 A 份额}} = \text{Min}(2 \times NAV_{\text{鹏华传媒份额}}, 1 + R \times \frac{t}{N})$$

$$NAV_{\text{鹏华传媒 B 份额}} = \text{Max}(0, 2 \times NAV_{\text{鹏华传媒份额}} - NAV_{\text{鹏华传媒 A 份额}})$$

（二）基金份额参考净值计算公式的修改

修改前：

设 T 日为鹏华传媒 A 份额与鹏华传媒 B 份额的基金份额参考净值计算日，

则鹏华传媒 A 份额与鹏华传媒 B 份额的基金份额参考净值为：

$$NAV_{\text{鹏华传媒 A 份额}}^{\text{参考}} = 1 + R \times \frac{t}{N}$$
$$NAV_{\text{鹏华传媒 B 份额}}^{\text{参考}} = 2 \times NAV_{\text{鹏华传媒份额}} - NAV_{\text{鹏华传媒 A 份额}}^{\text{参考}}$$

修改后：

设 T 日为鹏华传媒 A 份额与鹏华传媒 B 份额的基金份额参考净值计算日，
则鹏华传媒 A 份额与鹏华传媒 B 份额的基金份额参考净值为：

$$NAV_{\text{鹏华传媒 A 份额}}^{\text{参考}} = \text{Min}(2 \times NAV_{\text{鹏华传媒份额}}, 1 + R \times \frac{t}{N})$$
$$NAV_{\text{鹏华传媒 B 份额}}^{\text{参考}} = \text{Max}(0, 2 \times NAV_{\text{鹏华传媒份额}} - NAV_{\text{鹏华传媒 A 份额}}^{\text{参考}})$$

二、重要提示

1、对鹏华传媒 A 份额与鹏华传媒 B 份额的基金份额净值和基金份额参考净值计算公式的修改，自 2020 年 7 月 6 日起生效，基金合同及招募说明书对应内容相应修改。

2、本次修订已与本基金的基金托管人协商一致，且未对基金份额持有人利益形成实质性不利影响，符合相关法律法规及基金合同的规定，无需召开基金份额持有人大会。

3、本公司将在官方网站及中国证监会基金电子披露网站上公布经修改后的基金合同，并同时为招募说明书进行相应修改。投资者可通过本公司客户服务中心或官方网站咨询有关详情。

本公司客户服务电话：400—6788—999/400—6788—533

本公司网站：www.phfund.com.cn

三、风险提示

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，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现，投资者投资于本基金时应分别认真阅读本基金的基金合同、

招募说明书等文件。敬请投资者留意投资风险。

特此公告。

鹏华基金管理有限公司

二〇二〇年七月四日