

鹏华基金管理有限公司关于鹏华新丝路指数分级证券投资基金实施 转型的提示性公告

鹏华基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）旗下鹏华新丝路指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”或“鹏华新丝路分级”）基金份额持有人大会表决投票时间自2018年3月16日起,至2018年4月1日17:00截止,会议期间审议了《关于鹏华新丝路指数分级证券投资基金转型并修改基金合同等相关事项的议案》(以下简称“本次会议议案”)。本次会议议案于2018年4月2日获表决通过,持有人大会决议自该日起生效。我司于2018年4月3日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、上海证券交易所网站(www.sse.com.cn)和基金管理人网站(www.phfund.com)发布《鹏华基金管理有限公司关于鹏华新丝路指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。根据本次持有人大会决议,现将实施转型的相关事项提示如下:

一、本基金转型选择期安排

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定,基金管理人将在本次基金份额持有人大会决议生效后、在鹏华新丝路分级正式转型前,预留至少二十个交易日的选择期供基金份额持有人做出选择(赎回或者卖出);本基金转型选择期为2018年4月3日至5月4日,选择期期间,本基金的赎回、转换转出、场内交易、场内鹏华新丝路A份额与鹏华新丝路B份额配对合并业务照常办理,不受影响。

2018年4月3日,本基金进入转型选择期,为保护基金持有人利益,本基金暂停基金申购、定期定额投资、转换转入、场内鹏华新丝路份额分拆、鹏华新丝路份额转托管(含系统内转托管与跨系统转托管)业务。对于在选择期内未作出选择的基金份额持有人,其持有的原鹏华新丝路份额、鹏华新丝路A份额、鹏华新丝路B份额将于份额转换基准日进行转换,最终将转换为鹏华沪深300指数增强型证券投资基金份额。

在选择期期间,由于鹏华新丝路分级需应对赎回、转出等情况,基金份额持有人同意在选择期豁免《鹏华新丝路指数分级证券投资基金基金合同》中约定的投资组合比例限制等条款。基金份额持有人大会授权基金管理人据此落实相关事项,并授权基金管理人可根据实际情况做相应调整,以及根据实际情况可暂停申购、赎回、转入、转出或调整赎回方式等。

二、鹏华新丝路、鹏华新丝路 A 与鹏华新丝路 B 份额终止上市交易

为实施转型，基金管理人将根据上海证券交易所、《鹏华新丝路指数分级证券投资基金基金合同》、《关于鹏华新丝路指数分级证券投资基金转型并修改基金合同等相关事项的议案》、《鹏华基金管理有限公司关于鹏华新丝路指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》的有关规定向上海证券交易所申请鹏华新丝路、鹏华新丝路 A 与鹏华新丝路 B 份额的终止上市。届时，基金管理人将发布鹏华新丝路、鹏华新丝路 A 与鹏华新丝路 B 份额终止上市公告。

三、基金份额的转换及相关安排

1、鹏华新丝路、鹏华新丝路A与鹏华新丝路B份额终止上市后，在新修改的基金合同生效前基金管理人将对鹏华新丝路分级基金进行基金份额转换，转换为鹏华沪深300指数增强型证券投资基金基金份额。基金份额的转换主要可分成以下两个步骤进行：

(1) 将鹏华新丝路A份额、鹏华新丝路B份额和鹏华新丝路份额的基金份额（参考）净值均调整为1.0000元

本次基金份额转换将分别对鹏华新丝路A份额、鹏华新丝路B份额和鹏华新丝路份额进行基金份额折算，基金份额折算后鹏华新丝路份额的基金份额净值、鹏华新丝路A份额与鹏华新丝路B份额的基金份额参考净值均调整为1.0000元，且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；

(2) 将鹏华新丝路A份额、鹏华新丝路B份额和鹏华新丝路份额转换成鹏华沪深300指数增强型证券投资基金份额

在份额转换基准日日终，在保持基金资产净值总额不变的前提下，将份额净值为1.0000元的鹏华新丝路A份额、鹏华新丝路B份额和鹏华新丝路份额统一转换为份额净值为1.0000元的鹏华沪深300指数增强型证券投资基金份额。鹏华新丝路A份额、鹏华新丝路B份额的场内份额和鹏华新丝路份额的场内份额和场外份额相应地转换成鹏华沪深300指数增强型证券投资基金的场外份额。

2、鹏华新丝路、鹏华新丝路A与鹏华新丝路B份额终止上市后，原鹏华新丝路、鹏华新丝路A与鹏华新丝路B的基金份额持有人需要对其持有的基金份额进行重新确认与登记，即确权登记。办理确权登记后，方可通过相关销售机构进行鹏华沪深300指数增强型证券投资基金份额的赎回。办理确权登记的具体时间和相关指引具体请见基金管理人届时发布的公告。

四、关于基金合同等法律文件的修订

根据《关于鹏华新丝路指数分级证券投资基金转型并修改基金合同等相关事项的议案》、《鹏华基金管理有限公司关于鹏华新丝路指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》以及相关法律法规的规定，经与基金托管人招商银行股份有限公司协商一致，基金管理人已将《鹏华新丝路指数分级证券投资基金基金合同》、《鹏华新丝路指数分级证券投资基金托管协议》分别修订为《鹏华沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》、《鹏华沪深 300 指数增强型证券投资基金托管协议》，并据此编制《鹏华沪深 300 指数增强型证券投资基金招募说明书》。鹏华新丝路指数分级证券投资基金根据中国证监会《关于准予鹏华新丝路指数分级证券投资基金变更注册的批复》（证监许可[2017]1621 号）准予变更注册。《鹏华沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》、《鹏华沪深 300 指数增强型证券投资基金托管协议》将自鹏华新丝路指数分级证券投资基金基金份额转换基准日的次一工作日起生效。

五、鹏华沪深300指数增强型证券投资基金份额的申购赎回

基金管理人将根据相关规定，在《鹏华沪深300指数增强型证券投资基金基金合同》生效后，开放鹏华沪深300指数增强型证券投资基金基金份额的日常申购、赎回，具体请见基金管理人届时发布的公告。

六、对基金份额持有人的影响及基金风险发生变化的提示

1、本基金转型前属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。同时本基金转型前为指数基金，通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。从本基金所分拆的两类基金份额来看，鹏华新丝路A份额为稳健收益类份额，具有低风险且预期收益相对较低的特征；鹏华新丝路B份额为积极收益类份额，具有高风险且预期收益相对较高的特征。转型后，鹏华沪深300指数增强型证券投资基金属于股票指数增强型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金，属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种，且不再设置风险收益特征不同的两类子份额。

2、本基金终止上市交易后，在鹏华沪深300指数增强型证券投资基金开放赎回之前，投

资人无法进行基金交易，也无法办理基金赎回，存在一定的流动性风险。

3、对于已经办理司法冻结、质押登记等限制转移措施的基金份额，有关登记机构及证券经营机构应依照有关规定办理该限制措施的转移手续。

4、本基金转型后不在交易所上市交易。

特此公告。

鹏华基金管理有限公司

2018年4月3日