鹏华价值优势混合型证券投资基金（LOF）更新的招募说明书摘要

基金管理人：鹏华基金管理有限公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司
二〇一六年三月

重要提示

本基金经2006年6月5日中国证券监督管理委员会下发的《关于同意鹏华价值优势股票型证券投资基金（LOF）募集的批复》（证监基金字[2006]105号文）核准，进行募集。根据相关法律法规，本基金基金合同已于2006年7月18日生效，基金管理人于该日起正式开始对基金财产进行运作管理。

投资有风险，投资人申购基金时应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本摘要根据本基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。请投资者根据自身风险承受能力谨慎选择适合自己的基金产品。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本招募说明书更新部分已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为2016年1月17日，有关财务数据和净值表现截止日为2015年12月31日（未经审计）。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况
1、名称：鹏华基金管理有限公司
2、住所：深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心43层
3、设立日期：1998年12月22日
4、法定代表人：何如
5、办公地址：深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心43层
6、电话：（0755）82021233　传真：（0755）82021155
7、联系人：吕奇志
8、注册资本：人民币1.5亿元
9、股权结构：

出资人名称	出资额（万元）	出资比例
国信证券股份有限公司	7,500	50%
意大利欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）	7,350	49%
深圳市北融信投资发展有限公司	150	1%
总　计	15,000	100%

（二）主要人员情况
1、基金管理人董事会成员
何如先生，董事长，硕士，高级会计师，国籍：中国。历任中国电子器件公司深圳公司副总会计师兼财务处处长、总会计师、常务副总经理、总经理、党委书记，深圳发展银行行长助理、副行长、党委委员、副董事长、行长、党委副书记，现任国信证券股份有限公司董事长、党委书记，鹏华基金管理有限公司董事长。

邓召明先生，董事，经济学博士，讲师，国籍：中国。历任北京理工大学管理与经济学院讲师、中国兵器工业总公司主任科员、中国证监会处长、南方基金管理有限公司副总经理，现任鹏华基金管理有限公司总裁、党总支书记。

孙煜扬先生，董事，经济学博士，国籍：中国。历任贵州省政府经济体制改革委员会主任科员、中共深圳市委政策研究室副处长、深圳证券结算公司常务副总经理、深圳证券交易所首任行政总监、香港深业（集团）有限公司助理总经理、香港深业控股有限公司副总经理、中国高新技术产业投资管理有限公司董事长兼行政总裁、鹏华基金管理有限公司董事总裁、国信证券股份有限公司副总裁，现任国信证券股份有限公司顾问。

周中国先生，董事，会计学硕士研究生，国籍：中国。曾任深圳市华为技术有限公司定价中心经理助理；2000年7月起历任国信证券有限责任公司资金财务总部业务经理、外派财务经理、高级经理、总经理助理、副总经理、国信证券股份有限公司人力资源总部副总经理、资金财务总部副总经理；2015年6月至今任国信证券股份有限公司资金财务总部总经理。

Massimo Mazzini先生，董事，经济和商业管理博士，国籍：意大利。曾在安达信（Arthur Andersen MBA）从事风险管理和资产管理工作，历任CA AIPG SGR投资总监、CAAM AI SGR及CA AIPG SGR首席执行官和投资总监；东方汇理资产管理股份有限公司（CAAM SGR）投资副总监、农业信贷另类投资集团（Credit Agricole Alternative Investments Group）国际执行委员会委员、意大利欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）投资方案部投资总监、Epsilon资产管理股份公司（Epsilon SGR）首席执行官、欧利盛资本股份公司（Eurizon Capital S.A.）（卢森堡）首席执行官、欧利盛AI资产管理股份公司（Eurizon AI SGR）首席执行官。现任意大利欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）市场及业务发展总监、欧利盛资本股份公司（Eurizon Capital S.A.）（卢森堡）董事、VUB资产管理有限公司监事会成员。

Alessandro Varaldo先生，董事，经济学和商业管理博士，国籍：意大利。曾任米兰德意志银行集团Finanza e Futuro Fondi Sprind股份公司投资管理部债券基金和现金头寸管理高级经理、IMI Fideuram资产管理股份公司投资管理部固定收益组合和现金管理业务负责人、圣保罗银行投资公司（Banca Sanpaolo Invest S.p.A.）财务及营销策划部负责人、Capitalia股份公司（Capitalia S.p.A.）产品和销售部负责人、Capitalia投资管理股份公司（Capitalia Investment Management S.A.）董事总经理、Unicredit Holding财务风险管理部意大利企业法人风险管理业务负责人、欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）首席市场官、欧利盛资本股份公司（Eurizon Capital S.A.）（卢森堡）董事，现任意大利联合圣保罗银行股份有限公司（Intesa Sanpaolo S.p.A.）储蓄、投资和养老金产品部负责人。

史际春先生，独立董事，法学博士，国籍：中国。历任安徽大学讲师、中国人民大学副教授，现任中国人民大学法学院教授、博士生导师，国务院特殊津贴专家，兼任中国法学会经济法学研究会副会长、北京市人大常委会和法制委员会委员。

张元先生，独立董事，大学本科，国籍：中国。曾任新疆军区干事、秘书、编辑，甘肃省委研究室干事、副处长、处长、副主任，中央金融工作委员会研究室主任，中国银监会政策法规部（研究局）主任（局长）等职务；2005年6月至2007年12月，任中央国信投资集团董事；2007年12月至2010年12月，任中央国信投资集团董事长兼党委副书记；2007年12月至2010年12月，任中央国信投资集团董事长兼党委副书记。

高臻女士，独立董事，工商管理硕士，国籍：中国。曾任中国进出口银行副处长，负责贷款管理和运营、项目涉及制造业、能源、电信、跨国并购；2007年加入曼达林投资顾问有限公司，现任曼达林投资顾问有限公司执行合伙人。

2、基金管理人监事会成员
黄俞先生，监事会主席，研究生学历，国籍：中国。曾在中农信公司、正大财务公司工作，曾任鹏华基金管理有限公司董事、监事，现任深圳市北融信投资发展有限公司董事长。

Andrea Vianara先生，监事，法学学士、律师，国籍：意大利。曾在意大利多家律师事务所担任律师，先后在法国农业信贷集团（Credit Agricole Group）东方汇理资产管理股份有限公司（CAAM SGR）法务部、产品开发部，欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）治理与股权部工作，现在欧利盛资本资产管理股份公司运营部工作。

陈冰女士，监事，本科学历，国籍：中国。曾任国信证券股份有限公司资金财务部会计、上海营业部财务科副科长、资金财务部财务科副经理、资金财务部资金科经理、资金财务部主任会计师兼科经理、资金财务部总经理助理、资金财务总部副总经理等，现任国信证券资金财务总部副总经理兼资金运营部总经理、融资融券部总经理。

于丹女士，职工监事，法学硕士，国籍：中国。历任北京市金杜（深圳）律师事务所律师；2011年7月加盟鹏华基金管理有限公司，历任监察稽核部法务主管、现任监察稽核部总经理助理。

郝文高先生，职工监事，大专学历，国籍：中国。历任深圳奥尊电脑有限公司证券基金事业部副经理、招商基金管理有限公司基金事务部总监；2011年7月加盟鹏华基金管理有限公司，现任登记结算部总经理。

刘岐先生，职工监事，管理学硕士，国籍：中国。历任毕马威（中国）管理顾问公司咨询顾问，南方基金管理有限公司北京分公司副总经理；2014年10月加入鹏华基金管理有限公司，现任北京分公司总经理。

3、高级管理人员情况
何如先生，董事长，简历同前。

邓召明先生，董事，总裁，简历同前。

高阳先生，副总裁，特许金融分析师（CFA），经济学硕士，国籍：中国。历任中国国际金融有限公司经理，博时基金管理有限公司博时价值增长基金基金经理、固定收益部总经理、基金裕泽基金经理、基金裕隆基金经理、股票投资部总经理，现任鹏华基金管理有限公司副总裁。

邢彪先生，副总裁，工商管理硕士、法学硕士，国籍：中国。历任中国人民大学校办科员，中国证监会办公厅副处级秘书，全国社保基金理事会证券投资部处长、股权投资产部（实业投资部）副主任，并于2014年至2015年期间担任中国证监会第16届主板发审委专职委员，现任鹏华基金管理有限公司副总裁。

高鹏先生，副总裁，经济学硕士，国籍：中国。历任博时基金管理有限公司监察法律部监察稽核经理，鹏华基金管理有限公司监察稽核部副总经理、监察稽核部总经理、职工监事、督察长，现任鹏华基金管理有限公司副总裁。

苏波先生，副总裁，管理学博士，国籍：中国。历任深圳经济特区证券公司研究所副所长、投资部经理，南方基金管理有限公司渠道服务二部总监助理，易方达基金管理有限公司信息技术部总经理助理，鹏华基金管理有限公司公司总裁助理、机构理财部总经理、职工监事，现任鹏华基金管理有限公司副总裁。

高永杰先生，督察长，法学硕士，国籍：中国。历任中共中央办公厅秘书局干部、中国证监会办公厅新闻处干部、秘书处副处级秘书、发行监管部副处长、人事教育部副处长、处长，鹏华基金管理有限公司监察稽核部总经理，现任鹏华基金管理有限公司督察长。

4、本基金基金经理
谢书英女士，国籍中国，经济学硕士，7年证券从业经验。曾任职于高盛高华证券有限公司投资银行部；2009年4月加盟鹏华基金管理有限公司，历任研究部高级研究员、投资经理助理，从事行业研究及投资助理相关工作，2014年4月起担任鹏华金刚保本混合基金基金经理，2015年6月起兼任鹏华价值优势混合（LOF）基金基金经理。谢书英女士具备基金从业资格。

本基金历任的基金经理：
2006年7月至2007年4月?????　???????????　胡建平先生
2007年4月至2015年6月????　　程世杰先生
2015年6月至本更新招募书截止日?????　谢书英女士

本基金基金经理管理的其他基金情况：
2014年4月起担任鹏华金刚保本混合基金基金经理。

5、投资决策委员会成员情况
邓召明先生，鹏华基金管理有限公司董事、总裁、党总支书记。
高阳先生，鹏华基金管理有限公司副总裁。
初冬女士，鹏华基金管理有限公司公裁助理、固定收益投资总监、固定收益部总经理，社保基金组合投资经理及鹏华丰盛稳固收益债券、鹏华双债增利债券、鹏华双债加利债券基金基金经理。
窦洪涛先生，鹏华基金管理有限公司公裁助理、权益投资总监、权益投资一部总经理，社保基金组合投资经理，专户投资经理。
王宗合先生，鹏华基金管理有限公司权益投资二部总经理，鹏华消费优选混合、鹏华金刚保本混合、鹏华品牌传承混合、鹏华养老产业股票基金基金经理。
王咏辉先生，鹏华基金管理有限公司量化及衍生品投资部总经理，鹏华中证500指数（LOF）、鹏华地产分级、鹏华沪深300指数（LOF）、鹏华创业板分级、鹏华互联网分级基金基金经理。
梁浩先生，鹏华基金管理有限公司研究部总经理，鹏华新兴产业混合、鹏华动力增长混合（LOF）基金基金经理。
阳先伟先生，鹏华基金管理有限公司固定收益部执行总经理，鹏华丰收债券、鹏华双债保利债券、鹏华可转债债券基金基金经理。
陈鹏先生，鹏华基金管理有限公司权益投资二部副总经理，鹏华中国50混合、鹏华消费领先混合基金基金经理。
6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基本情况
名称：中国建设银行股份有限公司（简称：中国建设银行）
住所：北京市西城区金融大街25号
办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人：王洪章
成立时间：2004年09月17日
组织形式：股份有限公司
注册资本：贰仟伍拾亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整
存续期间：持续经营
基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12号
联系人：田　青
联系电话：(010)6759 5096

中国建设银行成立于1954年10月，是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行，总部设在北京。中国建设银行于2005年10月在香港联合交易所挂牌上市（股票代码939），于2007年9月在上海证券交易所挂牌上市（股票代码601939）。

2015年6月末，本集团资产总额182,192亿元，较上年末增长8.81%；客户贷款和垫款总额101,571亿元，增长7.20%；客户存款总额136,970亿元，增长6.19%。净利润1,322亿元，同比增长0.97%；营业收入3,110亿元，同比增长8.34%，其中，利息净收入同比增长6.31%，手续费及佣金净收入同比增长5.76%。成本收入比23.23%，同比下降0.94个百分点。资本充足率14.70%，处于同业领先地位。

物理与电子渠道协同发展。总行成立了渠道与运营管理部，全面推进渠道整合；营业网点“三综合”建设取得新进展，综合性网点达到1.44万个，综合营销团队达到19,934个，综合柜员占比达到84%，客户可在转型网点享受便捷舒适的“一站式”服务。加快打造电子银行的主渠道建设，有力支持物理渠道的综合化转型，电子银行和自助渠道账务性交易量占比达94.32%，较上年末提高6.29个百分点；个人网上银行客户、企业网上银行客户、手机银行客户分别增长8.19%、10.78%和11.47%；善融商务推出精品移动平台、个人商城手机客户端“建行善融商城”正式上线。

转型重点业务快速发展。2015年6月末，累计承销非金融企业债务融资工具2,374.76亿元，承销金额继续保持同业第一；证券投资基金托管只数和新发基金托管只数均列市场第一，成为首批香港基金内地销售代理人中唯一一家银行代理人；多模式现金池、票据池、银联单位结算卡等战略性产品市场份额不断扩大，现金管理品牌“离道”的市场影响力持续提升；代理中央财政授权支付业务、代理中央非税收入收缴业务客户数保持同业第一，在同业中首家按照财政部要求实现中央非税收入收缴电子化上线试点。

“善存管”证券类产品保证金第三方存管客户数3,076万户，管理资金总额7,417.41亿元，均为行业第一。

2015年上半年，本集团各方面良好表现，得到市场与业界广泛认可，先后荣获国内外知名机构授予的40多项重要奖项。在美国《银行家》杂志2015年“世界银行1000强排名”中，以一级资本总额继续位列全球第2；在美国《福布斯》杂志2015年全球上市公司2000强排名中继续位列第2；在美国《财富》杂志2015年世界500强排名第29位，较上年上升9位；荣获美国《环球金融》杂志颁发的“2015年中国最佳银行”奖项；荣获中国银行业协会授予的“年度最具社会责任金融机构奖”和“年度社会责任最佳民生金融奖”两个综合大奖。

中国建设银行总行设投资托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托投权市场处、QFII托管处、养老金托管处、清算处、核算处、监督稽核处等9个职能处室，在上海设有投资托管服务上海备份中心，共有员工210余人。自2007年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

（二）主要人员情况
赵冕甫，投资托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行郑州市分行、总行信贷部、总行信贷二部、行长行水平，相应地，鹏华传媒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。

6、原鹏华传媒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传媒分级份额分拆为鹏华传媒A份额、鹏华传媒B份额。

7、根据深圳证券交易所的相关业务规则，鹏华传媒A份额、鹏华传媒B份额、鹏华传媒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，持有极小数量鹏华传媒A份额、鹏华传媒B份额、鹏华传媒分级份额的持有人，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。

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

9、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（免长途话费）。

特此公告。

鹏华基金管理有限公司
2016年3月1日

鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告

根据中国证监会[2008]38号公告《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》的规定，鹏华基金管理有限公司（以下简称“本公司”）于2008年9月16日发布了《鹏华关于进一步规范旗下基金估值业务的公告》，说明本公司于2008年9月16日起对旗下基金持有的停牌股票等估值日无市价且对基金净值影响超过0.25%的投资品种的公允价值按照“指数收益法”估值确定。

本公司依据指导意见等法规规定，经与托管银行协商一致，决定于2016年2月29日起对本公司旗下基金（ETF基金除外）所持有的以下停牌股票采用“指数收益法”进行估值。待以下停牌股票复牌且其交易体现了活跃市场交易特征之日起，恢复采用当日收盘价进行估值，届时不再另行公告。敬请投资者予以关注。

停牌股票明细

股票代码	股票名称
300299	富春通信
600645	中源协和
002739	万达院线

本公司旗下基金将严格按照《企业会计准则》、指导意见、中国证监会相关规定和基金合同中关于估值的约定对基金所持有的投资品种进行估值，请广大投资者关注。

投资者可登陆我公司网站（http://www.phfund.com）或拨打客户服务电话400-6788-999咨询或查阅相关信息。

特此公告。

鹏华基金管理有限公司
2016年3月1日

鹏华中证传媒指数分级证券投资基金不定期份额折算公告

根据《鹏华中证传媒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，当鹏华中证传媒指数分级证券投资基金之鹏华传媒B份额的基金份额参考净值跌至0.250元时，本基金将进行不定期份额折算。

截至2016年2月29日，本基金鹏华传媒B份额的基金份额参考净值为0.225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2016年3月1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2016年3月1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传媒分级份额（场内简称“传媒分级”，基金代码：160629）、鹏华传媒A份额（场内简称“传媒A”，基金代码150203）、鹏华传媒B份额（场内简称“传媒B”，基金代码150204）。

三、基金份额折算方式
鹏华传媒分级份额、鹏华传媒A份额、鹏华传媒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传媒分级份额、鹏华传媒A份额、鹏华传媒B份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保鹏华传媒A份额与鹏华传媒B份额的比例为1:1，份额折算后鹏华传媒分级份额的基金份额净值、鹏华传媒A份额与鹏华传媒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）鹏华传媒B份额
鹏华传媒B份额折算后鹏华传媒B份额所对应的基金资产净值不变，即

$$NUM_{鹏华传媒B份额折算后} \times NAV_{鹏华传媒B份额折算后} = NUM_{鹏华传媒B份额折算前} \times NAV_{鹏华传媒B份额折算前}$$

于是，

$$NUM_{鹏华传媒B份额折算后} = \frac{NUM_{鹏华传媒B份额折算前} \times NAV_{鹏华传媒B份额折算前}}{1.000}$$

其中，$NUM_{鹏华传媒B份额折算后}$：不定期份额折算后鹏华传媒B份额的份额数；

$NAV_{鹏华传媒B份额折算后}$：不定期份额折算后鹏华传媒B份额的基金份额参考净值，为1.000元；

$NUM_{鹏华传媒B份额折算前}$：不定期份额折算前鹏华传媒B份额的份额数；

$NAV_{鹏华传媒B份额折算前}$：不定期份额折算前鹏华传媒B份额的基金份额参考净值。

2. 鹏华传媒A份额

$$NUM_{鹏华传媒A份额折算后} = NUM_{鹏华传媒A份额折算前}$$

于是，

$$NAV_{鹏华传媒A份额折算后} = 1$$

其中，$NUM_{鹏华传媒A份额折算后}$：不定期份额折算后鹏华传媒A份额的份额数；

$NAV_{鹏华传媒A份额折算后}$：不定期份额折算后鹏华传媒A份额的基金份额参考净值；

$NUM_{鹏华传媒A份额折算前}$：不定期份额折算前鹏华传媒A份额的份额数；

$NAV_{鹏华传媒A份额折算前}$：不定期份额折算前鹏华传媒A份额的基金份额参考净值。

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

鹏华传媒A份额持有人新增的场内鹏华传媒分级分级份额的份额数为

$$NUM_{鹏华传媒A份额折算后新增场内鹏华传媒分级份额份额数} = \frac{NUM_{鹏华传媒A份额折算前} \times NAV_{鹏华传媒A份额折算前} - NUM_{鹏华传媒A份额折算后} \times 1.000}{1.000}$$

其中，

$NUM_{鹏华传媒A份额折算后}$：不定期份额折算后鹏华传媒A份额的份额数；

$NAV_{鹏华传媒A份额折算后}$：不定期份额折算后鹏华传媒A份额的基金份额参考净值，为1.000元；

$NUM_{鹏华传媒A份额折算前}$：不定期份额折算前鹏华传媒A份额的份额数；

$NAV_{鹏华传媒A份额折算前}$：不定期份额折算前鹏华传媒A份额的基金份额参考净值。

③ 鹏华传媒分级份额
鹏华传媒分级份额持有人份额折算前后所持有的鹏华传媒分级份额的资产净值不变。

鹏华传媒分级份额持有人不定期份额折算后的鹏华传媒分级份额的份额数为

$$NUM_{鹏华传媒分级份额折算后} = \frac{NUM_{鹏华传媒分级份额折算前} \times NAV_{鹏华传媒分级份额折算前}}{1.000}$$

其中，

$NUM_{鹏华传媒分级份额折算后}$：不定期份额折算后鹏华传媒分级份额的份额数；

$NAV_{鹏华传媒分级份额折算后}$：不定期份额折算后鹏华传媒分级份额的基金份额参考净值，为1.000元；

$NUM_{鹏华传媒分级份额折算前}$：不定期份额折算前鹏华传媒分级份额的份额数；

$NAV_{鹏华传媒分级份额折算前}$：不定期份额折算前鹏华传媒分级份额的基金份额参考净值。

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，鹏华传媒分级份额的基金份额净值、鹏华传媒A份额与鹏华传媒B份额的基金份额参考净值如下表所示，折算后，鹏华传媒分级份额的基金份额净值、鹏华传媒A份额、鹏华传媒B份额的基金份额参考净值均调整1.000元，则各持有鹏华传媒分级份额、鹏华传媒A份额、鹏华传媒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
鹏华传媒分级份额	0.617 元	10,000 份	1.000 元	6,170 份鹏华传媒分级份额
鹏华传媒A份额	1.028 元	10,000 份	1.000 元	2,060 份鹏华传媒A份额+8,220 份鹏华传媒分级份额
鹏华传媒B份额	0.206 元	10,000 份	1.000 元	2,060 份鹏华传媒B份额

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2016年3月1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。鹏华传媒A、鹏华传媒B将于2016年3月1日上午开市至10:30停牌，并于2016年3月1日上午10:30复牌。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2016年3月2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，鹏华传媒A、鹏华传媒B暂停交易。当日，本基金注册登记人处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2016年3月3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，鹏华传媒A、鹏华传媒B将于2016年3月3日上午开市至10:30停牌，并于2016年3月3日上午10:30复牌。

（四）根据《深圳证券交易所证券投资基金交易和申赎赎回实施细则》，2016年3月3日鹏华传媒A、鹏华传媒B即时行情显示的前收盘价为2016年3月2日的鹏华传媒A、鹏华传媒B的基金份额参考净值（四舍五入至0.001元），2016年3月3日当日鹏华传媒A份额和鹏华传媒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.鹏华传媒A、鹏华传媒B将于2016年3月1日上午开市至10:30停牌，并于2016年3月1日上午10:30复牌。

鹏华传媒A、鹏华传媒B将于2016年3月2日全天停牌。鹏华传媒A、鹏华传媒B将于2016年3月3日上午开市至10:30停牌，并于2016年3月3日上午10:30复牌。

2.2016年2月29日，鹏华传媒B份额的基金份额参考净值已跌至0.250元以下，而折算基准日为2016年3月1日，因此折算基准日鹏华传媒B份额的基金份额参考净值与折算条件0.250元可能有一定差异。

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

4.鹏华传媒A份额预期为低风险、预期收益相对稳定的特征，但在不定期份额折算后鹏华传媒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传媒A份额变为同时持有较低风险收益特征的鹏华传媒A份额与较高风险收益特征的鹏华传媒分级，因此原鹏华传媒A份额持有人预期收益实现的不确定性将会增加；此外，鹏华传媒分级为跟踪中证传媒指数的基础份额，其份额净值将随市场涨跌而变化，因此原鹏华传媒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。

5.鹏华传媒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，鹏华传媒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。

6.原鹏华传媒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传媒分级份额分拆为鹏华传媒A份额、鹏华传媒B份额。

7.根据深圳证券交易所的相关业务规则，鹏华传媒A份额、鹏华传媒B份额、鹏华传媒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，持有极小数量鹏华传媒A份额、鹏华传媒B份额、鹏华传媒分级份额的持有人，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。

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

9.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（免长途话费）。

特此公告。

鹏华基金管理有限公司
2016年3月1日

鹏华中证国防指数分级证券投资基金B类份额交易价格波动提示公告

近期，鹏华基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）旗下鹏华中证国防指数分级证券投资基金之B类份额（场内简称：国防B，交易代码：150205）二级市场交易价格连续大幅下跌，2016年2月25日，国防B在二级市场的收盘价为0.486元，相对于当日0.398元的基金份额参考净值，溢价幅度达到22.11%。截至2016年2月29日，国防B二级市场的收盘价为0.437元，明显高于基金份额参考净值，投资者如果盲目投资，可能遭受重大损失。

为此，本基金管理人提示如下：

1、国防B表现为高风险、高收益的特征。由于国防B内含杠杆机制的设计，国防B基金份额参考净值的变动幅度将大于鹏华国防分级份额（场内简称：国防分级，场内代码：160630）参考净值和鹏华国防A份额（场内简称：国防A，场内代码：150205）参考净值的变动幅度，即国防B的波动性要高于其他两类份额，其承担的风险较高。国防B的持有人会因杠杆倍数的变化而承担不同程度的投资风险。

2、国防B的交易价格，除了有份额参考净值变化的风险外，还会受到市场的系统性风险、流动性风险等其他风险影响，可能使投资人面临损失。

3、截至2016年2月29日收盘，国防B的基金份额参考净值接近基金合同约定的不定期份额折算阈值。不定期份额折算后，国防B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高溢价所带来的风险。

4、截至本公告披露日，鹏华中证国防指数分级证券投资基金运作正常。本基金管理人仍将严格按照法律法规及基金合同进行投资运作。

5、截至本公告披露日，鹏华中证国防指数分级证券投资基金无其他应披露而未披露的重大信息。本基金管理人仍将严格按照有关规定和要求，及时做好信息披露工作。

6、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（更新）等相关法律文件。

敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

鹏华基金管理有限公司
2016年3月1日

关于调整鹏华中证传媒指数分级证券投资基金B类份额折算基准日证券简称的公告

2016年2月29日，鹏华中证传媒指数分级证券投资基金B类份额（证券简称：传媒B；证券编码：150204）的基金份额参考净值为0.225元，达到基金合同规定的下阀值不定期份额折算条件，根据基金合同的约定，将以2016年3月1日作为基金份额折算基准日，办理不定期份额折算业务。为加强下阀值折算基准日交易风险提示，经向深圳证券交易所申请，折算基准日3月1日鹏华中证传媒指数分级证券投资基金B类份额证券简称前将冠以“*”标识，即证券简称由“传媒B”调整为“*传媒B”，证券编码保持不变。3月2日起证券简称由“*传媒B”恢复为“传媒B”，届时将不再另行公告。

本基金管理人提请投资者警惕基金风险，切勿盲目投资。

鹏华基金管理有限公司
2016年3月1日

鹏华中证国防指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告

根据《鹏华中证国防指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）中关于不定期份额折算的相关规定，当鹏华中证国防指数分级证券投资基金之B份额的基金份额参考净值跌至0.250元时，鹏华国防分级份额（场内简称：国防分级，基础份额）、鹏华国防A份额（场内简称：国防A）、鹏华国防B份额（场内简称：国防B）将进行不定期份额折算。

由于近期A股市场波动较大，截至2016年2月29日，国防B的基金份额参考净值接近基金合同规定的不定期份额折算条件，因此本基金管理人敬请投资者密切关注鹏华国防B近期的参考净值波动情况，并警惕可能出现的风险。

针对不定期折算所带来的风险，本基金管理人特别提示如下：

一、由于国防A、国防B折算前可能存在折溢价交易情形，不定期份额折算后，国防A、国防B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高溢价所带来的风险。

二、国防B表现为高风险、高收益的特征，不定期份额折算后其杠杆将恢复至初始杠杆水平。

三、由于触发折算阈值当日，国防B的参考净值可能已低于阈值，而折算基准日在触发阈值日后才能确定，此折算基准日国防B的净值可能与折算阈值0.250元有一定差异。

四、国防A表现为低风险、收益相对稳定的特征，但在不定期份额折算后国防A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国防A份额变为同时持有较低风险收益特征国防A与较高风险收益特征国防分级的情况，因此国防A持有人预期收益实现的不确定性将会增加。

本基金管理人的其他重要提示：

一、根据深圳证券交易所的相关业务规则，场内份额数将取整计算（最小单位为1份），舍去部分计入基金资产，持有极小数量国防分级、国防A、国防B的持有人存在折算后份额因为不足1份而被强制归入基金资产的风险。

二、为保证折算期间本基金的平稳运作，基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停国防A份额与国防B份额的上市交易和鹏华国防分级份额的申购及赎回等相关业务。届时本基金管理人将会对相关事项进行公告，敬请投资者予以关注。

投资者若希望了解基金不定期份额折算业务详情，请参阅本基金的基金合同及《鹏华中证国防指数分级证券投资基金招募说明书》（更新）（以下简称“招募说明书”）或者拨打本公司客服电话：400-6788-999（免长途话费）。

三、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，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。投资有风险，选择须谨慎。敬请投资者于投资前认真阅读本基金的基金合同和招募说明书等相关法律文件。

特此公告。

鹏华基金管理有限公司
2016年3月1日

鹏华中证酒指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告

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”）中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之B份额的基金份额参考净值跌至0.250元时，鹏华酒分级份额（场内简称：酒分级，基础份额）、鹏华酒A份额（场内简称：酒A）、鹏华酒B份额（场内简称：酒B）将进行不定期份额折算。

由于近期A股市场波动较大，截至2016年2月29日，鹏华酒B的基金份额参考净值接近基金合同规定的不定期份额折算条件，因此本基金管理人敬请投资者密切关注鹏华酒B近期的参考净值波动情况，并警惕可能出现的风险。

针对不定期折算所带来的风险，本基金