关于鹏华中证国防指数分级证券投资基金之鹏华国防A份额和鹏华国防B份额终止运作、终止上市并修改基金合同的公告

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》和《鹏华中证国防指数分级证券投资基金基金合同》等的有关规定，鹏华中证国防指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金管理人鹏华基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）制定了本基金的分级份额终止运作的实施方案。现将鹏华国防A份额和鹏华国防B份额终止运作相关内容公告如下：

一、终止运作分级份额的基本信息

1、基金名称：鹏华中证国防指数分级证券投资基金之鹏华国防A份额

场内简称：国防A

基金代码：150205

2、基金名称：鹏华中证国防指数分级证券投资基金之鹏华国防B份额

场内简称：国防B

基金代码：150206

3、终止上市日：2021年1月4日（最后交易日为2020年12月31日）

二、分级份额终止运作的主要内容

根据《鹏华中证国防指数分级证券投资基金基金合同》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》等相关规定，基金管理人向深圳证券交易所申请鹏华国防A份额和鹏华国防B份额终止上市，现已获得深圳证券交易所同意（《终止上市通知书》深证上[2020]1109号）。鹏华国防A份额和鹏华国防B份额的终止上市日为2021年1月4日。

鹏华国防A份额和鹏华国防B份额将折算为场内鹏华国防份额，折算完成后投资者可以申请场内赎回鹏华国防份额或将场内鹏华国防份额转托管至场外后进行赎回。

三、基金份额的折算

1、份额折算基准日

本次份额折算基准日为2020年12月31日。

2、基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的鹏华国防A份额和鹏华国防B份额。

3、基金份额折算方式

在份额折算基准日日终，以鹏华国防份额的基金份额净值为基准，鹏华国防A份额、鹏华国防B份额按照各自的基金份额净值折算成鹏华国防份额的场内份额。鹏华国防A份额（或鹏华国防B份额）基金份额持有人持有的折算后场内鹏华国防份额取整计算（最小单位为1份），余额计入基金资产。

份额折算计算公式：

鹏华国防A份额（或鹏华国防B份额）的折算比例＝份额折算基准日鹏华国防A份额（或鹏华国防B份额）的基金份额净值／份额折算基准日鹏华国防份额的基金份额净值

鹏华国防A份额（或鹏华国防B份额）基金份额持有人持有的折算后场内鹏华国防份额＝基金份额持有人持有的折算前鹏华国防A份额（或鹏华国防B份额）的份额数×鹏华国防A份额（或鹏华国防B份额）的折算比例

四、基金份额折算期间的基金业务办理

（一）折算基准日（即2020年12月31日），本基金鹏华国防份额暂停办理申购（含定期定额投资）、赎回、转换、转托管（包括系统内转托管、跨系统转托管，下同）业务，停止办理配对转换业务；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）折算基准日后的第一个工作日（即2021年1月4日），本基金鹏华国防份额暂停办理申购（含定期定额投资）、赎回、转换、转托管业务，鹏华国防A份额、鹏华国防B份额终止上市。当日，本基金登记机构及基金管理人为基金份额持有人办理份额登记确认。

（三）折算基准日后的第二个工作日（即2021年1月5日），基金管理人将公告份额折算确认结果，基金份额持有人可以查询其账户内“鹏华中证国防指数型证券投资基金（LOF）”的基金份额。当日，鹏华中证国防指数型证券投资基金（LOF）恢复办理申购（含定期定额投资）、赎回、转换、转托管业务。

五、《鹏华中证国防指数型证券投资基金（LOF）基金合同》的生效

根据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》等相关规定，经与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，鹏华国防A份额和鹏华国防B份额终止运作后，《鹏华中证国防指数分级证券投资基金基金合同》将修订为《鹏华中证国防指数型证券投资基金（LOF）基金合同》，《鹏华中证国防指数分级证券投资基金托管协议》将修订为《鹏华中证国防指数型证券投资基金（LOF）托管协议》，修订后的基金合同、托管协议全文将与本公告同日登载于本公司网站（www.phfund.com.cn）及中国证监会基金电子披露网站（http://eid.csrc.gov.cn/fund）。

鹏华中证国防指数分级证券投资基金折算基准日次日（2021年1月1日）《鹏华中证国防指数型证券投资基金（LOF）基金合同》生效，《鹏华中证国防指数分级证券投资基金基金合同》同时失效。上述变更事项，本基金管理人将根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的规定对招募说明书和基金产品资料概要相应更新。

《鹏华中证国防指数型证券投资基金（LOF）基金合同》生效后，在符合法律法规和深圳证券交易所规定的上市条件的情况下，基金管理人可根据有关规定，申请鹏华中证国防指数型证券投资基金（LOF）的基金份额上市交易。

六、提示

1、在基金份额折算过程中，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，持有极小数量鹏华国防A份额、鹏华国防B份额的份额持有人，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。

2、根据相关业务规则，基金份额持有人持有的鹏华国防A份额和鹏华国防B份额折算为场内鹏华国防份额后，基金份额持有期自场内鹏华国防份额确认之日起计算。基金份额持有人赎回份额时适用的赎回费率将根据持有期确定，具体持有期时间以登记机构系统记录为准。如果赎回份额时持有期较短，基金份额持有人将承担较高的赎回费。

3、折算完成后，鹏华中证国防指数型证券投资基金（LOF）为股票型基金，具有较高预期风险的特征。

4、投资者可登录基金管理人网站（www.phfund.com.cn）或拨打客服电话400-6788-533咨询相关信息。

鹏华基金管理有限公司
2020年12月2日

关于鹏华中证传媒指数分级证券投资基金之鹏华传媒A份额和鹏华传媒B份额终止运作、终止上市并修改基金合同的公告

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》和《鹏华中证传媒指数分级证券投资基金基金合同》等的有关规定，鹏华中证传媒指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金管理人鹏华基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）制定了本基金的分级份额终止运作的实施方案。现将鹏华传媒A份额和鹏华传媒B份额终止运作相关内容公告如下：

一、终止运作分级份额的基本信息

1、基金名称：鹏华中证传媒指数分级证券投资基金之鹏华传媒A份额

场内简称：传媒A

基金代码：150203

2、基金名称：鹏华中证传媒指数分级证券投资基金之鹏华传媒B份额

场内简称：传媒B

基金代码：150204

3、终止上市日：2021年1月4日（最后交易日为2020年12月31日）

二、分级份额终止运作的主要内容

根据《鹏华中证传媒指数分级证券投资基金基金合同》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》等相关规定，基金管理人向深圳证券交易所申请鹏华传媒A份额和鹏华传媒B份额终止上市，现已获得深圳证券交易所同意（《终止上市通知书》深证上[2020]1113号）。鹏华传媒A份额和鹏华传媒B份额的终止上市日为2021年1月4日。

鹏华传媒A份额和鹏华传媒B份额将折算为场内鹏华传媒份额，折算完成后投资者可以申请场内赎回鹏华传媒份额或将场内鹏华传媒份额转托管至场外后进行赎回。

三、基金份额的折算

1、份额折算基准日

本次份额折算基准日为2020年12月31日。

2、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A份额和鹏华传媒B份额。

3、基金份额折算方式

在份额折算基准日日终，以鹏华传媒份额的基金份额净值为基准，鹏华传媒A份额、鹏华传媒B份额按照各自的基金份额净值折算成鹏华传媒份额的场内份额。鹏华传媒A份额（或鹏华传媒B份额）基金份额持有人持有的折算后场内鹏华传媒份额取整计算（最小单位为1份），余额计入基金资产。

份额折算计算公式：

鹏华传媒A份额（或鹏华传媒B份额）的折算比例＝份额折算基准日鹏华传媒A份额（或鹏华传媒B份额）的基金份额净值／份额折算基准日鹏华传媒份额的基金份额净值

鹏华传媒A份额（或鹏华传媒B份额）基金份额持有人持有的折算后场内鹏华传媒份额＝基金份额持有人持有的折算前鹏华传媒A份额（或鹏华传媒B份额）的份额数×鹏华传媒A份额（或鹏华传媒B份额）的折算比例

四、基金份额折算期间的基金业务办理

（一）折算基准日（即2020年12月31日），本基金鹏华传媒份额暂停办理申购（含定期定额投资）、赎回、转换、转托管（包括系统内转托管、跨系统转托管，下同）业务，停止办理配对转换业务；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）折算基准日后的第一个工作日（即2021年1月4日），本基金鹏华传媒份额暂停办理申购（含定期定额投资）、赎回、转换、转托管业务，鹏华传媒A份额、鹏华传媒B份额终止上市。当日，本基金登记机构及基金管理人为基金份额持有人办理份额登记确认。

（三）折算基准日后的第二个工作日（即2021年1月5日），基金管理人将公告份额折算确认结果，基金份额持有人可以查询其账户内“鹏华中证传媒指数型证券投资基金（LOF）”的基金份额。当日，鹏华中证传媒指数型证券投资基金（LOF）恢复办理申购（含定期定额投资）、赎回、转换、转托管业务。

五、《鹏华中证传媒指数型证券投资基金（LOF）基金合同》的生效

根据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》等相关规定，经与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，鹏华传媒A份额和鹏华传媒B份额终止运作后，《鹏华中证传媒指数分级证券投资基金基金合同》将修订为《鹏华中证传媒指数型证券投资基金（LOF）基金合同》，《鹏华中证传媒指数分级证券投资基金托管协议》将修订为《鹏华中证传媒指数型证券投资基金（LOF）托管协议》，修订后的基金合同、托管协议全文将与本公告同日登载于本公司网站（www.phfund.com.cn）及中国证监会基金电子披露网站（http://eid.csrc.gov.cn/fund）。

鹏华中证传媒指数分级证券投资基金折算基准日次日（2021年1月1日）《鹏华中证传媒指数型证券投资基金（LOF）基金合同》生效，《鹏华中证传媒指数分级证券投资基金基金合同》同时失效。上述变更事项，本基金管理人将根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的规定对招募说明书和基金产品资料概要相应更新。

《鹏华中证传媒指数型证券投资基金（LOF）基金合同》生效后，在符合法律法规和深圳证券交易所规定的上市条件的情况下，基金管理人可根据有关规定，申请鹏华中证传媒指数型证券投资基金（LOF）的基金份额上市交易。

六、提示

1、在基金份额折算过程中，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，持有极小数量鹏华传媒A份额、鹏华传媒B份额的份额持有人，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。

2、根据相关业务规则，基金份额持有人持有的鹏华传媒A份额和鹏华传媒B份额折算为场内鹏华传媒份额后，基金份额持有期自场内鹏华传媒份额确认之日起计算。基金份额持有人赎回份额时适用的赎回费率将根据持有期确定，具体持有期时间以登记机构系统记录为准。如果赎回份额时持有期较短，基金份额持有人将承担较高的赎回费。

3、折算完成后，鹏华中证传媒指数型证券投资基金（LOF）为股票型基金，具有较高预期风险的特征。

4、投资者可登录基金管理人网站（www.phfund.com.cn）或拨打客服电话400-6788-533咨询相关信息。

鹏华基金管理有限公司
2020年12月2日

关于鹏华国证钢铁行业指数分级证券投资基金之鹏华钢铁A份额和鹏华钢铁B份额终止运作、终止上市并修改基金合同的公告

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》和《鹏华中证国防指数分级证券投资基金基金合同》等的有关规定，鹏华中证国防指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金管理人鹏华基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）制定了本基金的分级份额终止运作的实施方案。现将鹏华国证钢铁行业指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金管理人鹏华基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）制定了本基金的分级份额终止运作的实施方案。现将鹏华钢铁A份额和鹏华钢铁B份额终止运作相关内容公告如下：

一、终止运作分级份额的基本信息

1、基金名称：鹏华中证国防指数分级证券投资基金之鹏华国防A份额

场内简称：国防A

基金代码：150205

2、基金名称：鹏华中证国防指数分级证券投资基金之鹏华国防B份额

场内简称：国防B

基金代码：150206

3、终止上市日：2021年1月4日（最后交易日为2020年12月31日）

二、分级份额终止运作的主要内容

根据《鹏华中证国防指数分级证券投资基金基金合同》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》等相关规定，基金管理人向深圳证券交易所申请鹏华国防A份额和鹏华国防B份额终止上市，现已获得深圳证券交易所同意（《终止上市通知书》深证上[2020]1109号）。鹏华国防A份额和鹏华国防B份额的终止上市日为2021年1月4日。

鹏华国防A份额和鹏华国防B份额将折算为场内鹏华国防份额，折算完成后投资者可以申请场内赎回鹏华国防份额或将场内鹏华国防份额转托管至场外后进行赎回。

三、基金份额的折算

1、份额折算基准日

本次份额折算基准日为2020年12月31日。

2、基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的鹏华国防A份额和鹏华国防B份额。

3、基金份额折算方式

在份额折算基准日日终，以鹏华国防份额的基金份额净值为基准，鹏华国防A份额、鹏华国防B份额按照各自的基金份额净值折算成鹏华国防份额的场内份额。鹏华国防A份额（或鹏华国防B份额）基金份额持有人持有的折算后场内鹏华国防份额取整计算（最小单位为1份），余额计入基金资产。

份额折算计算公式：

鹏华国防A份额（或鹏华国防B份额）的折算比例＝份额折算基准日鹏华国防A份额（或鹏华国防B份额）的基金份额净值／份额折算基准日鹏华国防份额的基金份额净值

鹏华国防A份额（或鹏华国防B份额）基金份额持有人持有的折算后场内鹏华国防份额＝基金份额持有人持有的折算前鹏华国防A份额（或鹏华国防B份额）的份额数×鹏华国防A份额（或鹏华国防B份额）的折算比例

四、基金份额折算期间的基金业务办理

（一）折算基准日（即2020年12月31日），本基金鹏华国防份额暂停办理申购（含定期定额投资）、赎回、转换、转托管（包括系统内转托管、跨系统转托管，下同）业务，停止办理配对转换业务；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）折算基准日后的第一个工作日（即2021年1月4日），本基金鹏华国防份额暂停办理申购（含定期定额投资）、赎回、转换、转托管业务，鹏华国防A份额、鹏华国防B份额终止上市。当日，本基金登记机构及基金管理人为基金份额持有人办理份额登记确认。

（三）折算基准日后的第二个工作日（即2021年1月5日），基金管理人将公告份额折算确认结果，基金份额持有人可以查询其账户内“鹏华中证国防指数型证券投资基金（LOF）”的基金份额。当日，鹏华中证国防指数型证券投资基金（LOF）恢复办理申购（含定期定额投资）、赎回、转换、转托管业务。

五、《鹏华中证国防指数型证券投资基金（LOF）基金合同》的生效

根据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》等相关规定，经与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，鹏华国防A份额和鹏华国防B份额终止运作后，《鹏华中证国防指数分级证券投资基金基金合同》将修订为《鹏华中证国防指数型证券投资基金（LOF）基金合同》，《鹏华中证国防指数分级证券投资基金托管协议》将修订为《鹏华中证国防指数型证券投资基金（LOF）托管协议》，修订后的基金合同、托管协议全文将与本公告同日登载于本公司网站（www.phfund.com.cn）及中国证监会基金电子披露网站（http://eid.csrc.gov.cn/fund）。

鹏华中证国防指数分级证券投资基金折算基准日次日（2021年1月1日）《鹏华中证国防指数型证券投资基金（LOF）基金合同》生效，《鹏华中证国防指数分级证券投资基金基金合同》同时失效。上述变更事项，本基金管理人将根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的规定对招募说明书和基金产品资料概要相应更新。

《鹏华中证国防指数型证券投资基金（LOF）基金合同》生效后，在符合法律法规和深圳证券交易所规定的上市条件的情况下，基金管理人可根据有关规定，申请鹏华中证国防指数型证券投资基金（LOF）的基金份额上市交易。

六、提示

1、在基金份额折算过程中，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，持有极小数量鹏华国防A份额、鹏华国防B份额的份额持有人，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。

2、根据相关业务规则，基金份额持有人持有的鹏华国防A份额和鹏华国防B份额折算为场内鹏华国防份额后，基金份额持有期自场内鹏华国防份额确认之日起计算。基金份额持有人赎回份额时适用的赎回费率将根据持有期确定，具体持有期时间以登记机构系统记录为准。如果赎回份额时持有期较短，基金份额持有人将承担较高的赎回费。

3、折算完成后，鹏华中证国防指数型证券投资基金（LOF）为股票型基金，具有较高预期风险的特征。

4、投资者可登录基金管理人网站（www.phfund.com.cn）或拨打客服电话400-6788-533咨询相关信息。

鹏华基金管理有限公司
2020年12月2日

关于鹏华中证传媒指数分级证券投资基金之鹏华传媒A份额和鹏华传媒B份额终止运作的特别风险提示公告

根据《关于鹏华中证传媒指数分级证券投资基金之鹏华传媒A份额和鹏华传媒B份额终止运作、终止上市并修改基金合同的公告》，鹏华中证传媒指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）之鹏华传媒A份额（场内简称：传媒A，基金代码：150203）和鹏华传媒B份额（场内简称：传媒B，基金代码：150204）的终止上市日为2021年1月4日（最后交易日为2020年12月31日），份额折算基准日为2020年12月31日。在份额折算基准日日终，以鹏华传媒份额（场内简称：传媒分级，基金代码：160629）的基金份额净值为基准，鹏华传媒A份额、鹏华传媒B份额按照各自的基金份额净值折算成场内鹏华传媒份额。

针对本基金之鹏华传媒A份额和鹏华传媒B份额终止运作、终止上市的相关安排，基金管理人特别提示如下风险事项，敬请投资者关注：

1、鹏华传媒A份额和鹏华传媒B份额的基金份额持有人持有的基金份额数量将会在折算后发生变化的风险

在基金份额折算基准日日终以鹏华传媒份额基金份额净值为基准，鹏华传媒A份额、鹏华传媒B份额均按各自的基金份额净值折算为鹏华传媒份额场内份额，并进行取整计算（最小单位为1份），舍去部分计入基金资产。对于持有份额数极少的鹏华传媒A份额、鹏华传媒B份额持有人，将面临持有的基金份额折算后份额数不足1份而被计入基金资产的风险。

鹏华传媒A份额和鹏华传媒B份额的基金份额持有人持有的基金份额数量将会在折算后发生变化。示例如下：

假设份额折算基准日鹏华传媒份额、鹏华传媒A份额和鹏华传媒B份额的基金份额净值的分别为：1.150元、1.042元、1.258元，投资者甲、乙、丙分别持有场内鹏华传媒份额、鹏华传媒A份额、鹏华传媒B份额各100,000份，其所持基金份额的变化如下表所示：

	折算前		折算比例	折算后	
	基金份额净值（元）	基金份额（份）		基金份额净值（元）	基金份额
场内鹏华传媒份额	1.150	100,000	（无变化）	1.150	100,000份场内鹏华传媒份额
鹏华传媒A份额	1.042	100,000	0.906087（全部折算为场内鹏华传媒份额）	1.150	90,608份场内鹏华传媒份额
鹏华传媒B份额	1.258	100,000	1.093913（全部折算为场内鹏华传媒份额）	1.150	109,391份场内鹏华传媒份额

注：具体折算结果以登记结算机构为准

5、鹏华传媒A份额和鹏华传媒B份额折算为场内鹏华传媒份额后，投资者可以申请场内赎回基金份额或者转托管至场外后申请赎回基金份额。部分投资者可能由于所在证券公司不具备基金销售业务资格或其他原因无法直接办理场内赎回，需先转托管至场外后再申请赎回或者先转托管到具有基金销售业务资格的证券公司后再申请赎回。

6、根据中国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则，鹏华传媒A份额和鹏华传媒B份额合并或折算为鹏华传媒份额后，基金份额持有期自鹏华传媒份额确认之日起计算。基金份额持有人赎回份额时适用的赎回费率将根据持有期限确定，具体持有期限以登记机构系统记录为准。如赎回份额时持有期限较短，基金份额持有人将承担较高的赎回费。

根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及本基金招募说明书（更新）的约定，本基金场外基础份额的赎回费率具体如下（1年为365日）：

持有期限（Y）	赎回费率
Y<7日	1.50%
7日≤Y<1年	0.50%
1年≤Y<2年	0.25%
Y≥2年	0.00%

（注：赎回份额持有期限的计算，以该份额在登记结算机构的登记日开始计算。）

2、场内赎回费率

本基金场内基础份额的赎回费率具体如下：

持有期限（Y）	赎回费率
Y<7日	1.50%
Y≥7日	0.50%

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。本基金对持续持有期少于7日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产，对持续持有期不少于7日的投资者收取的赎回费总额的25%应归入基金财产，其余用于支付市场推广、注册登记费和其他必要的手续费。

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、基金产品资料概要及其更新等信息披露文件。

投资者欲了解详情，请登录基金管理人网站：www.phfund.com.cn或拨打本公司客服电话：400—6788—533进行咨询。

特此公告。

鹏华基金管理有限公司
2020年12月2日

关于鹏华国证钢铁行业指数分级证券投资基金之鹏华钢铁A份额和鹏华钢铁B份额终止运作、终止上市并修改基金合同的公告

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》和《鹏华中证国防指数分级证券投资基金基金合同》等的有关规定，鹏华国证钢铁行业指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金管理人鹏华基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）制定了本基金的分级份额终止运作的实施方案。现将鹏华钢铁A份额和鹏华钢铁B份额终止运作相关内容公告如下：

一、终止运作分级份额的基本信息

1、基金名称：鹏华国证钢铁行业指数分级证券投资基金之鹏华钢铁A份额

场内简称：钢铁A

基金代码：502024

2、基金名称：鹏华国证钢铁行业指数分级证券投资基金之鹏华钢铁B份额

场内简称：钢铁B

基金代码：502025

3、摘牌日：2021年1月4日，终止上市日：2021年1月5日（最后交易日为2020年12月31日）

二、分级份额终止运作的主要内容

根据《鹏华国证钢铁行业指数分级证券投资基金基金合同》和《上海证券交易所证券投资基金上市规则》等相关规定，基金管理人向上海证券交易所申请鹏华钢铁A份额和鹏华钢铁B份额终止上市，现已获得上海证券交易所同意（上海证券交易所自律监管决定书[2020]387号）。鹏华钢铁A份额和鹏华钢铁B份额的摘牌日为2021年1月4日，终止上市日为2021年1月5日。

鹏华钢铁A份额和鹏华钢铁B份额将折算为场内鹏华钢铁份额，折算完成后投资者可以申请场内卖出或赎回鹏华钢铁份额或将场内鹏华钢铁份额转托管至场外后进行赎回。

三、基金份额的折算

1、份额折算基准日

本次份额折算基准日为2020年12月31日。

2、基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的鹏华钢铁A份额和鹏华钢铁B份额。

3、基金份额折算方式

在份额折算基准日日终，以鹏华钢铁份额的基金份额净值为基准，鹏华钢铁A份额、鹏华钢铁B份额按照各自的基金份额净值折算成鹏华钢铁份额的场内份额。鹏华钢铁A份额（或鹏华钢铁B份额）基金份额持有人持有的折算后场内鹏华钢铁份额取整计算（最小单位为1份），余额计入基金资产。

份额折算计算公式：

鹏华钢铁A份额（或鹏华钢铁B份额）的折算比例＝份额折算基准日鹏华钢铁A份额（或鹏华钢铁B份额）的基金份额净值／份额折算基准日鹏华钢铁份额的基金份额净值

鹏华钢铁A份额（或鹏华钢铁B份额）基金份额持有人持有的折算后场内鹏华钢铁份额＝基金份额持有人持有的折算前鹏华钢铁A份额（或鹏华钢铁B份额）的份额数×鹏华钢铁A份额（或鹏华钢铁B份额）的折算比例

四、基金份额折算期间的基金业务办理

（一）折算基准日（即2020年12月31日），本基金鹏华钢铁份额暂停办理申购（含定期定额投资）、赎回、转换、转托管（包括系统内转托管、跨系统转托管，下同）业务，停止办理配对转换业务；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）折算基准日后的第一个工作日（即2021年1月4日），本基金鹏华钢铁份额暂停办理申购（含定期定额投资）、赎回、转换、转托管业务，鹏华钢铁A份额、鹏华钢铁B份额终止上市。当日，本基金登记机构及基金管理人为基金份额持有人办理份额登记确认。

（三）折算基准日后的第二个工作日（即2021年1月5日），基金管理人将公告份额折算确认结果，基金份额持有人可以查询其账户内“鹏华中证国防指数型证券投资基金（LOF）”的基金份额。当日，鹏华中证国防指数型证券投资基金（LOF）恢复办理申购（含定期定额投资）、赎回、转换、转托管业务。

五、《鹏华中证国防指数型证券投资基金（LOF）基金合同》的生效

根据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》等相关规定，经与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，鹏华国防A份额和鹏华国防B份额终止运作后，《鹏华中证国防指数分级证券投资基金基金合同》将修订为《鹏华中证国防指数型证券投资基金（LOF）基金合同》，《鹏华中证国防指数分级证券投资基金托管协议》将修订为《鹏华中证国防指数型证券投资基金（LOF）托管协议》，修订后的基金合同、托管协议全文将与本公告同日登载于本公司网站（www.phfund.com.cn）及中国证监会基金电子披露网站（http://eid.csrc.gov.cn/fund）。

鹏华中证国防指数分级证券投资基金折算基准日次日（2021年1月1日）《鹏华中证国防指数型证券投资基金（LOF）基金合同》生效，《鹏华中证国防指数分级证券投资基金基金合同》同时失效。上述变更事项，本基金管理人将根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的规定对招募说明书和基金产品资料概要相应更新。

《鹏华中证国防指数型证券投资基金（LOF）基金合同》生效后，在符合法律法规和深圳证券交易所规定的上市条件的情况下，基金管理人可根据有关规定，申请鹏华中证国防指数型证券投资基金（LOF）的基金份额上市交易。

六、提示

1、在基金份额折算过程中，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，持有极小数量鹏华国防A份额、鹏华国防B份额的份额持有人，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。

2、根据相关业务规则，基金份额持有人持有的鹏华国防A份额和鹏华国防B份额折算为场内鹏华国防份额后，基金份额持有期自场内鹏华国防份额确认之日起计算。基金份额持有人赎回份额时适用的赎回费率将根据持有期确定，具体持有期时间以登记机构系统记录为准。如果赎回份额时持有期较短，基金份额持有人将承担较高的赎回费。

3、折算完成后，鹏华中证国防指数型证券投资基金（LOF）为股票型基金，具有较高预期风险的特征。

4、投资者可登录基金管理人网站（www.phfund.com.cn）或拨打客服电话400-6788-533咨询相关信息。

鹏华基金管理有限公司
2020年12月2日

关于鹏华中证传媒指数分级证券投资基金之鹏华传媒A份额和鹏华传媒B份额终止运作的特别风险提示公告

根据《关于鹏华中证传媒指数分级证券投资基金之鹏华传媒A份额和鹏华传媒B份额终止运作、终止上市并修改基金合同的公告》，鹏华中证传媒指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）之鹏华传媒A份额（场内简称：传媒A，基金代码：150203）和鹏华传媒B份额（场内简称：传媒B，基金代码：150204）的终止上市日为2021年1月4日（最后交易日为2020年12月31日），份额折算基准日为2020年12月31日。在份额折算基准日日终，以鹏华传媒份额（场内简称：传媒分级，基金代码：160629）的基金份额净值为基准，鹏华传媒A份额、鹏华传媒B份额按照各自的基金份额净值折算成场内鹏华传媒份额。

针对本基金之鹏华传媒A份额和鹏华传媒B份额终止运作、终止上市的相关安排，基金管理人特别提示如下风险事项，敬请投资者关注：

1、鹏华传媒A份额和鹏华传媒B份额的基金份额持有人持有的基金份额数量将会在折算后发生变化的风险

在基金份额折算基准日日终以鹏华传媒份额基金份额净值为基准，鹏华传媒A份额、鹏华传媒B份额均按各自的基金份额净值折算为鹏华传媒份额场内份额，并进行取整计算（最小单位为1份），舍去部分计入基金资产。对于持有份额数极少的鹏华传媒A份额、鹏华传媒B份额持有人，将面临持有的基金份额折算后份额数不足1份而被计入基金资产的风险。

鹏华传媒A份额和鹏华传媒B份额的基金份额持有人持有的基金份额数量将会在折算后发生变化。示例如下：

假设份额折算基准日鹏华传媒份额、鹏华传媒A份额和鹏华传媒B份额的基金份额净值的分别为：1.150元、1.042元、1.258元，投资者甲、乙、丙分别持有场内鹏华传媒份额、鹏华传媒A份额、鹏华传媒B份额各100,000份，其所持基金份额的变化如下表所示：

	折算前		份额折算比例	折算后	
	基金份额净值（元）	基金份额（份）		基金份额净值（元）	基金份额
场内鹏华传媒份额	1.150	100,000	（无变化）	1.150	100,000份场内鹏华传媒份额
鹏华传媒A份额	1.042	100,000	0.906086957（全部折算为场内鹏华传媒份额）	1.150	90,608份场内鹏华传媒份额
鹏华传媒B份额	1.258	100,000	1.093913043（全部折算为场内鹏华传媒份额）	1.150	109,391份场内鹏华传媒份额

2、鹏华传媒A份额和鹏华传媒B份额折算为鹏华传媒份额后风险收益特征发生较大变化的风险

鹏华传媒A份额表现为低风险的特征，但在份额折算后，鹏华传媒A份额持有人原持有低风险的鹏华传媒A份额将变为较高风险的鹏华传媒份额场内份额，基金份额风险收益特征将因折算而发生较大变化。由于鹏华传媒份额场内份额为跟踪中证传媒指数的基金份额，其基金份额净值将随标的指数的涨跌而变化，原鹏华传媒A份额持有人将承担因市场下跌而遭受损失的风险。

鹏华传媒B份额具有一定的杠杆属性，表现为高风险的特征，但在份额折算后，鹏华传媒B份额持有人原持有的鹏华传媒B份额将变为较高风险的鹏华传媒份额场内份额，基金份额风险收益特征将因折算而发生较大变化。由于鹏华传媒份额场内份额为跟踪中证传媒指数的基金份额，没有杠杆特征，其基金份额净值将随标的指数的涨跌而变化，原鹏华传媒B份额持有人将无法继续享有杠杆安排且仍需承担因市场下跌而遭受损失的风险。

3、鹏华传媒A份额和鹏华传媒B份额的流动性风险

鹏华传媒A份额和鹏华传媒B份额折算为鹏华传媒份额场内份额后，鹏华传媒A份额和鹏华传媒B份额的持有人有两种方式退出：

1）在场内按市价卖出基金份额；

2）在场内买入等量的对应份额（即鹏华传媒A份额持有人买入等量的鹏华传媒B份额，或者鹏华传媒B份额持有人买入等量的鹏华传媒A份额），合并为鹏华传媒份额，按照鹏华传媒份额的基金份额净值申请场内赎回或转托管至场外后申请赎回。

由于鹏华传媒A份额和鹏华传媒B份额的持有人可能选择场内卖出或合并赎回，场内份额数量可能发生较大下降，可能出现场内流动性不足的情况，特提请投资者注意流动性风险。

4、折算前存在溢价交易的鹏华传媒A份额和鹏华传媒B份额的持有人因溢价消失而造成损失的风险

在份额折算基准日前（含折算基准日），鹏华传媒A份额和鹏华传媒B份额仍可正常交易，鹏华传媒A份额和鹏华传媒B份额可能存在折溢价交易情形，其折溢价率可能发生较大变化。

由于基金份额折算基准日日终，鹏华传媒A份额和鹏华传媒B份额均按各自的基金份额净值（而不是二级市场价格）折算为鹏华传媒份额场内份额，如果投资者在折算前以溢价买入或持有鹏华传媒A份额和鹏华传媒B份额，折算后可能遭受较大损失。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。

投资者应密切关注鹏华传媒A份额和鹏华传媒B份额的基金份额参考净值变化情况，可通过本公司网站（www.phfund.com.cn）等方式进行查询。

5、鹏华传媒A份额和鹏华传媒B份额折算为鹏华传媒份额场内份额后无法直接办理场内赎回的风险

鹏华传媒A份额和鹏华传媒B份额折算为鹏华传媒份额后，投资者可以申请场内赎回基金份额或者转托管至场外后申请赎回基金份额。部分投资者可能由于所在证券公司不具备基金销售业务资格或其他原因无法直接办理场内赎回，需先转托管至场外后再申请赎回或者先转托管到具有基金销售业务资格的证券公司后再申请赎回。

6、份额折算后，在鹏华传媒份额开放赎回之前，投资者将无法办理基金赎回业务；在鹏华传媒份额上市交易之前，投资者将无法进行基金份额的上市交易，存在一定的流动性风险。

7、根据中国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则，鹏华传媒A份额和鹏华传媒B份额合并或折算为鹏华传媒份额后，基金份额持有期自鹏华传媒份额确认之日起计算。基金份额持有人赎回份额时适用的赎回费率将根据持有期限确定，具体持有期限以登记机构系统记录为准。如赎回份额时持有期限较短，基金份额持有人将承担较高的赎回费。

根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及本基金招募说明书（更新）的约定，本基金场外基础份额的赎回费率具体如下（1年为365日）：

持有期限（Y）	赎回费率
Y<7日	1.50%
7日≤Y<1年	0.50%
1年≤Y<2年	0.25%
Y≥2年	0.00%

本基金场内基础份额的赎回费率具体如下：

持有期限（Y）	赎回费率
Y<7日	1.50%
Y≥7日	0.50%

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。本基金对持续持有期少于7日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产，对持续持有期不少于7日的投资者收取的赎回费总额的25%应归入基金财产，其余用于支付市场推广、注册登记费和其他必要的手续费。

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、基金产品资料概要及其更新等信息披露文件。

投资者