

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份额基金份额折算的公告

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《鹏华国证钢铁行业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份额终止运作涉及的折算相关内容公告如下:

一、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。

二、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),不足1份的零碎份额的处理方式按照中国证券登记结算有限责任公司的相关规则处理,折算后的基金份额以登记机构最终确认的数据为准。

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

三、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自该日起暂停办理赎回、转换转出业务,停止办理场内合并业务;鹏华钢铁份额、鹏华钢铁A份额、鹏华钢铁B份额正常交易。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。

根据相关业务公告,本基金鹏华钢铁份额已暂停办理申购(含定期定额投资)、转换转入、转托管(包括系统内转托管及跨系统转托管,下同)、场内分拆业务。

(二)折算基准日后的第一个工作日(即2021年1月4日),鹏华钢铁份额、鹏华钢铁A份额、鹏华钢铁B份额暂停交易,鹏华钢铁A份额与鹏华钢铁B份额摘牌。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),鹏华钢铁A份额和鹏华钢铁B份额终止上市交易。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“鹏华国证钢铁行业指数型证券投资基金(LOF)”的基金份额。当日,鹏华国证钢铁行业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,并于该日开市起复牌。根据上海证券交易所的相关业务规则,2021年1月5日即时行情显示的场内鹏华钢铁份额的前收盘价将调整为2021年1月4日鹏华钢铁份额的基金份额净值(四舍五入至0.001元)。

四、《鹏华国证钢铁行业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,经与基金托管人招商银行股份有限公司协商一致,并报中国证监会备案,鹏华钢铁A份额和鹏华钢铁B份额终止运作后,《鹏华国证钢铁行业指数分级证券投资基金基金合同》将修订为《鹏华国证钢铁行业指数型证券投资基金(LOF)基金合同》,《鹏华国证钢铁行业指数分级证券投资基金托管协议》将修订为《鹏华国证钢铁行业指数型证券投资基金(LOF)托管协议》,修订后的基金合同、托管协议全文已于2020年12月2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>)。

鹏华国证钢铁行业指数分级证券投资基金折算基准日次日(2021年1月1日)《鹏华国证钢铁行业指数型证券投资基金(LOF)基金合同》生效,《鹏华国证钢铁行业指数分级证券投资基金基金合同》同时失效。

五、提示

1、在基金份额折算过程中,根据上海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),不足1份的零碎份额的处理方式按照中国证券登记结算有限责任公司的相关规则处理。持有极小数量鹏华钢铁A份额、鹏华钢铁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钢铁A份额和鹏华钢铁B份额折算为场内鹏华钢铁份额后,基金份额持有期自场内鹏华钢铁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,鹏华国证钢铁行业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,敬请投资者注意投资风险。

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29日