鹏华基金管理有限公司关于鹏华沪深300交易型开放式指数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“本公司”）旗下鹏华沪深300交易型开放式指数证券投资基金于2017年12月7日至2018年1月7日期间以通讯方式召开了基金份额持有人大会，大会表决时间于2018年1月7日17:00截止，会议期间审议了《关于鹏华沪深300交易型开放式指数证券投资基金转型并修改基金合同等相关事项的议案》。本次基金份额持有人大会于2018年1月8日表决通过了《关于鹏华沪深300交易型开放式指数证券投资基金转型并修改基金合同等相关事项的议案》，本次大会决议自该日起生效。我司于2018年1月9日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、深圳证券交易所网站（www.szse.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沪深300交易型开放式指数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，基金管理人鹏华基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）将在本次基金份额持有人大会决议生效后、鹏华沪深300交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”或“鹏华沪深300ETF”）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（如赎回或者卖出）；本基金转型选择期为2018年1月9日至2月6日，选择期期间，本基金的申购、赎回、交易和转托管等业务照常办理，不受影响。为实施转型，2018年2月7日起，本基金将暂停申购、赎回和转托管等业务。对于在选择期内未作出选择的基金份额持有人，其持有的鹏华沪深300ETF份额将于转换基准日进行转换，最终将转换为鹏华量化先锋混合型证券投资基金（以下简称“鹏华量化先锋混合基金”）份额。

二、鹏华沪深300ETF份额终止上市交易

为实施转型，基金管理人将根据深圳证券交易所、《鹏华沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《关于鹏华沪深300交易型开放式指数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沪深300交易型开放式指数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》的有关规定向深圳证券交易所申请鹏华沪深300ETF份额的终止上市。届时，基金管理人将发布鹏华沪深300交易型开放式指

数证券投资基金终止上市公告。

三、基金份额的转换

1、鹏华沪深300ETF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沪深300ETF进行基金份额转换，转换为鹏华量化先锋混合基金基金份额。

2、原鹏华沪深300ETF份额由中国证券登记结算有限责任公司深圳证券登记结算系统统一变更登记至鹏华基金管理有限公司登记系统。

3、鹏华沪深300ETF终止上市后，基金管理人将向中国证券登记结算有限责任公司申请办理基金份额的变更登记。基金管理人在取得终止上市权益登记日的基金份额持有人名册之后，将根据中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司提供的明细数据进行投资人持有基金份额的初始登记，并进行基金份额更名以及必要的信息变更。

4、鹏华沪深300ETF终止上市后，原鹏华沪深300ETF基金份额持有人需要对其持有的鹏华沪深300ETF份额进行重新确认与登记，即确权登记。办理确权登记后，原鹏华沪深300ETF基金份额持有人方可通过相关销售机构进行鹏华量化先锋混合基金份额的赎回。办理鹏华沪深300ETF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《关于鹏华沪深 300 交易型开放式指数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沪深 300 交易型开放式指数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，经与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，基金管理人已将《鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》分别修订为《鹏华量化先锋混合型证券投资基金基金合同》、《鹏华量化先锋混合型证券投资基金托管协议》，并据此编制《鹏华量化先锋混合型证券投资基金招募说明书》。鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金根据中国证监会《关于准予鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金变更注册的批复》（证监许可[2017]1052 号）准予变更注册。《鹏华量化先锋混合型证券投资基金基金合同》、《鹏华量化先锋混合型证券投资基金托管协议》将自鹏华沪深 300 交易型开放式指数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、鹏华量化先锋混合基金份额的申购赎回

鹏华沪深300ETF终止上市后，基金管理人将根据相关规定，在《鹏华量化先锋混合型证券投资基金基金合同》生效后，开放鹏华量化先锋混合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，其风险与预期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。同时本基金为交易型开放式指数基金，采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的证券市场相似的风险收益特征。转型后，鹏华量化先锋混合基金属于混合型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。

2、鹏华沪深300ETF终止上市交易后，鹏华量化先锋混合基金开放赎回之前，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 1 月 9 日