

# 华宝标普石油天然气上游股票指数证券投资基金（LOF）

## 基金净值与场内价格波动风险、场内溢价风险

### 的提示性公告

华宝基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）旗下华宝标普石油天然气上游股票指数证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”），包括A类人民币份额（基金代码：162411，场内简称“华宝油气”）、C类人民币份额（基金代码：007844）和A类美元份额（基金代码：001481），其中A类人民币份额（以下简称“华宝油气”）在深圳证券交易所上市交易。近期本基金净值以及二级市场价格大幅波动，并持续出现场内溢价。**特此提示投资者关注二级市场价格波动风险及二级市场溢价风险。若投资者以高溢价买入华宝油气，将承担额外的溢价成本以及未来溢价波动带来的价格风险，可能造成重大损失。**

有关本基金的基金净值及场内价格波动风险、场内溢价风险，本基金管理人提示如下：

1. 本基金为QDII指数基金，通过完全复制法投资于指数成分股或备选成分股，被动跟踪标普石油天然气上游股票指数（指数代码：SPSIOP，以下简称“标的指数”）。近期标的指数价格剧烈波动，本基金净值波动风险显著加大。请投资者仔细阅读本基金信息披露文件和公告，审慎了解产品设计和风险收益特征，根据自身风险承受能力理性做出投资决策，避免遭受超过预期的损失。
2. 本基金以跟踪标的指数为目标，该指数历史上与原油价格长期趋势存在较高相关性，但本基金并不直接于投资原油期货或原油ETF，也不以跟踪原油价格为投资目标。标的指数以及基金净值表现与原油价格走势存在差异，在某些市场环境下可能差异巨大。
3. 受外汇投资额度限制，本基金已于2020年2月12日发布公告，自2020年2月14日起暂停全部申购（含定期定额投资）业务。
4. 根据本基金招募说明书，如投资者于T日申请赎回本基金，赎回申请将根据“未知价原则”，于T+2日按本基金T日净值确认。投资者可在T+3日后（包括该日）于销售机构查询申请的确认情况。投资者T日提出的赎回申请被确认有效后，基金管理人将通过登记结算机构及其相关销售机构在T+10日（包括该日）内将赎回款项划往基金份额持有人账户。由于本基金标的指数为美国股票指数，本基金T日净值将反

映标的指数在 T 日美国交易时间（国内 T 日晚间）的行情变化，并将由本基金管理人于 T+1 日晚上公布。

5. 由于前述本基金暂停申购的情形，以及场内价格受跌停板规则限制可能无法及时反映基金净值的大幅波动，华宝油气可能存在溢价，即场内交易价格持续高于基金份额净值的情况。该溢价水平可能大幅波动，给投资者带来基金净值波动风险以外的溢价波动风险，投资者应避免高溢价买入。
6. 截至本公告披露日，本基金运作正常。本基金管理人始终严格按照法律法规及基金合同的相关规定进行投资运作。
7. 截至本公告披露日，本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。

风险提示：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。投资人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等相关法律文件。

特此公告。

华宝基金管理有限公司

2020 年 4 月 23 日