

交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德国证新能源指数 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《交银施罗德国证新能源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，当交银施罗德国证新能源指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）之基础份额“交银新能源份额”（基金代码：164905，场内简称“交银新能”）的基金份额净值大于或等于 1.500 元时，本基金的交银新能源份额、交银新能源 A 份额（基金代码：150217，场内简称“新能源 A”）和交银新能源 B 份额（基金代码：150218，场内简称“新能源 B”）将进行不定期份额折算。

由于近期 A 股市场波动较大，截至本公告日前一交易日，交银新能源份额的基金份额净值接近基金合同规定的不定期份额折算的阈值 1.500 元，在此提请投资者密切关注交银新能源份额近期净值的波动情况。

一、该情形下的不定期份额折算方式

1、折算前的交银新能源份额持有人，获得新增交银新能源份额的份额分配。交银新能源份额持有人持有的交银新能源份额的基金份额净值折算调整为 1.000 元，份额数量相应折算增加；

2、折算前的交银新能源 A 份额持有人，以交银新能源 A 份额在基金份额折算基准日折算前的基金份额参考净值超出 1.000 元部分，获得新增场内交银新能源份额的份额分配。交银新能源 A 份额持有人持有的交银新能源 A 份额净值折算调整为 1.000 元、份额数量不变，相应折算增加场内交银新能源份额；

3、折算前的交银新能源 B 份额持有人，以交银新能源 B 份额在基金份额折算基准日折算前的基金份额参考净值超出 1.000 元部分，获得新增场内交银新能源份额的份额分配。交银新能源 B 份额持有人持有的交银新能源 B 份额净值折算调整为 1.000 元、份额数量不变，相应折算增加场内交银新能源份额。

按照上述折算方法，由于计算过程尾差处理的原因，可能会给基金份额持有人的资产净值造成微小误差，该误差归入基金财产，视为未改变基金份额持有人的资产净值。

二、该情形下的不定期份额折算的相关风险

1、基金份额风险收益特征变化风险

本基金是一只股票型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，属于承担较高预期风险、预期收益较高的证券投资基金品种。本基金采取了基金份额分级的结构设计，不同的基金份额具有不同的风险收益特征。本基金共有三类份额，其中交银新能源份额具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征；交银新能源 A 份额具有低预期风险、预期收益相对稳定的特征；交银新能源 B 份额具有高预期风险、高预期收益的特征。

实施上述不定期份额折算后，交银新能源 A 份额持有人或交银新能源 B 份额持有人将会获得一定比例的交银新能源份额的场内份额，因此其所持有的基金份额将面临风险收益特征出现变化的风险。

2、交银新能源 A 份额、交银新能源 B 份额在折算前可能存在折溢价交易情形。不定期份额折算后，其折溢价率可能随之发生较大变化。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。

3、根据基金合同规定，折算基准日在触发阈值日后才能确定，因此折算基准日交银新能源份额的净值可能与触发折算的阈值 1.500 元有一定差异。

重要提示：

1、若本基金发生上述不定期份额折算情形，为保证折算期间本基金的平稳运作，本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交银新能源 A 份额与交银新能源 B 份额的上市交易和交银新能源份额的申购及赎回及场内份额配对转换等相关业务。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。

2、投资者若希望了解基金不定期份额折算的机制设计，请参阅本基金的基金合同及《交银施罗德德国证新能源指数分级证券投资基金招募说明书》。

3、本基金已于 2020 年 10 月 28 日召开基金份额持有人大会，表决通过了《关于交银施罗德德国证新能源指数分级证券投资基金转型及修改基金合同有关事项的议案》，本基金的转型选择期为 2020 年 10 月 29 日至 2020 年 11 月 25 日，自

2020 年 11 月 30 日起，交银施罗德德国证新能源指数分级证券投资基金将正式变更为交银施罗德德国证新能源指数证券投资基金（LOF），有关详情请见基金管理人发布的《交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德德国证新能源指数分级证券投资基金持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

4、投资者可以通过本基金管理人网站（www.fund001.com）或客户服务电话 400-700-5000（免长途话费），021-61055000 咨询有关详情。

风险提示：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财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其将来表现。分级基金不保本，可能发生亏损。本基金共有三类份额，其中交银新能源份额具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征；交银新能源 A 份额具有低预期风险、预期收益相对稳定的特征；交银新能源 B 份额具有高预期风险、高预期收益的特征。基金管理人并不承诺或保证交银新能源 A 份额的基金份额持有人的约定应得收益，在本基金资产出现极端损失情况下，交银新能源 A 份额的基金份额持有人可能会面临无法取得约定应得收益甚至损失本金的风险。投资有风险，敬请投资者认真阅读基金的相关法律文件，并选择适合自身风险承受能力的投资品种进行投资。

特此公告。

交银施罗德基金管理有限公司

二〇二〇年十一月二日