

# 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 分级证券投资基金办理不定期份额折算业务的公告

根据《交银施罗德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”）“第二十一部分 基金份额折算”的相关规定，当交银施罗德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”的基金份额净值大于或等于 1.500 元时，本基金将进行不定期份额折算。

截至 2020 年 11 月 5 日，交银新能源份额的基金份额净值为 1.530 元，达到基金合同规定的不定期份额折算条件。根据本基金基金合同以及深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定，本基金将以 2020 年 11 月 6 日为不定期折算基准日办理不定期份额折算业务。相关事项公告如下：

## 一、基金份额不定期折算基准日

本次不定期份额折算的基准日为 2020 年 11 月 6 日。

## 二、基金份额不定期折算的对象

基金份额不定期折算基准日登记在册的本基金之基础份额（基金代码：164905，场内简称“交银新能”）、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”）。

## 三、基金份额折算方式

当交银新能源份额的基金份额净值大于或等于 1.500 元，本基金将分别对上述折算对象进行份额折算。折算后，上述折算对象的基金份额参考净值或基金份额净值均调整为 1.000 元；交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额的份额比例仍为 1:1。具体折算方式如下：

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。

#### 四、基金份额折算公式

##### 1、交银新能源 A 份额

$$NAV_A^{\text{后}} = 1.000$$

$$NUM_A^{\text{前}} = NUM_A^{\text{后}}$$

折算后交银新能源 A 份额持有人持有的新增交银新能源份额的份额数为：

$$NUM_A^{\text{前}} \times (NAV_A^{\text{前}} - 1.000)$$

其中：

$NUM_A^{\text{前}}$ ：份额折算基准日折算前交银新能源 A 份额的份额数；

$NUM_A^{\text{后}}$ ：份额折算基准日折算后交银新能源 A 份额的份额数；

$NAV_A^{\text{前}}$ ：份额折算基准日折算前交银新能源 A 份额的基金份额参考净值；

$NAV_A^{\text{后}}$ ：份额折算基准日折算后交银新能源 A 份额的基金份额参考净值；

##### 2、交银新能源 B 份额

$$NAV_B^{\text{后}} = 1.000$$

$$NUM_B^{\text{前}} = NUM_B^{\text{后}}$$

折算后交银新能源 B 份额持有人持有的新增交银新能源份额的份额数为：

$$NUM_{B}^{前} \times (NAV_{B}^{前} - 1.000)$$

其中：

$NUM_{B}^{前}$ ：份额折算基准日折算前交银新能源 B 份额的份额数；

$NUM_{B}^{后}$ ：份额折算基准日折算后交银新能源 B 份额的份额数；

$NAV_{B}^{前}$ ：份额折算基准日折算前交银新能源 B 份额的基金份额参考净值；

$NAV_{B}^{后}$ ：份额折算基准日折算后交银新能源 B 份额的基金份额参考净值；

3、交银新能源份额

$$NAV^{后} = 1.000$$

折算后交银新能源份额持有人持有的新增交银新能源份额的份额数为：

$$NUM^{前} \times (NAV^{前} - 1.000)$$

折算后交银新能源份额的总份额数=折算前交银新能源份额的份额数+交银新能源份额持有人新增的交银新能源份额数+交银新能源 A 份额持有人新增的场内交银新能源份额数+交银新能源 B 份额持有人新增的场内银新能源份额数

其中：

$NUM^{前}$ ：份额折算基准日折算前交银新能源份额的份额数；

$NAV^{前}$ ：份额折算基准日折算前交银新能源份额的基金份额净值；

$NAV^{后}$ ：份额折算基准日折算后交银新能源份额的基金份额净值。

4、折算份额数的处理方式

上述不定期折算后，场外份额的份额数采用四舍五入的方式保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分舍去，舍去部分所代表的资产计入基金财产；场内份额的份额数取整计算（最小单位为 1 份），小数点以后的部分舍去，舍去部分所代表的资产计入基金财产。

5、举例

某投资者持有交银新能源份额、交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额分别为 100,000 份，100,000 份和 100,000 份。在本基金的不定期份额折算基准日，假设三类份额的基金份额（参考）净值如下表所示（为便于投资者理解，此处采用假设的净值进行计算），折算后，交银新能源份额、交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额的基金份额（参考）净值均调整为 1.000 元。

|  | 折算前 | 折算后 |
|--|-----|-----|
|--|-----|-----|

|            | 基金份额净值（假设值） | 基金份额      | 基金份额净值  | 基金份额                                   |
|------------|-------------|-----------|---------|----------------------------------------|
| 交银新能源份额    | 1.510 元     | 100,000 份 | 1.000 元 | 151,000 份交银新能源份额                       |
| 交银新能源 A 份额 | 1.028 元     | 100,000 份 | 1.000 元 | 100,000 份交银新能源 A 份额+新增 2,800 份交银新能源份额  |
| 交银新能源 B 份额 | 1.992 元     | 100,000 份 | 1.000 元 | 100,000 份交银新能源 B 份额+新增 99,200 份交银新能源份额 |

#### 五、基金份额折算期间的基金业务办理

1、不定期份额折算基准日（即 2020 年 11 月 6 日），本基金暂停办理申购、赎回、转托管（包括系统内转托管、跨系统转托管，下同）、份额配对转换业务；交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额正常交易；基准日日终，基金管理人将计算当日基金份额净值及份额折算比例。

2、不定期份额折算基准日后的第一个工作日（即 2020 年 11 月 9 日），本基金暂停办理申购、赎回、转托管、份额配对转换业务；交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额将于该日停牌一天；当日，本基金登记机构及基金管理人将完成份额登记确认及份额折算。

3、不定期份额折算基准日后的第二个工作日（即 2020 年 11 月 10 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的基金份额；交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额将于该日上午开市起复牌；自该日起，本基金恢复办理申购、赎回、转托管、份额配对转换业务。

4、根据《深圳证券交易所证券投资基金交易和申购赎回实施细则》，2020 年 11 月 10 日交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额即时行情显示的前收盘价为 2020 年 11 月 9 日的交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额的基金份额参考净值（四舍五入至 0.001 元）。

5、2020 年 11 月 10 日交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额均可能出现

交易价格大幅波动的情形。敬请投资者注意投资风险。

## 六、重要提示

### 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。

4、折算后，本基金交银新能源份额的份额数量会发生变化。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，持有极小数量交银新能源 A 份额、交银新能源 B 份额和场内交银新能源份额的持有人，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。

5、交银新能源 A 份额、交银新能源 B 份额将于 2020 年 11 月 9 日全天暂停交易，11 月 10 日上午开市起复牌，敬请投资者妥善作好交易安排。

6、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），具体内容详见基金管理人于 2020 年 10 月 29 日发布的《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》。

7、投资者可以通过本基金管理人网站（[www.fund001.com](http://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

二〇二〇年十一月六日