

易方达证券公司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《易方达证券公司指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）关于基金不定期份额折算的相关约定，当易方达证券公司指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）之基础份额——易方达证券公司份额（场内简称：证券分级；场内代码 502010）的基金份额净值大于 1.5000 元时，本基金将进行不定期份额折算。

截至 2020 年 12 月 1 日收盘，易方达证券公司份额的基金份额净值接近基金合同约定的不定期份额折算阈值，提请投资者密切关注易方达证券公司份额近期基金份额净值的波动情况。

针对不定期份额折算可能带来的风险，基金管理人特别提示如下：

1、根据《易方达基金管理有限公司关于易方达证券公司指数分级证券投资基金之易方达证券公司分级 A 类份额和易方达证券公司分级 B 类份额终止运作、终止上市并修改基金合同的公告》，易方达证券公司分级 A 类份额（场内简称：证券 A，基金代码：502011）和易方达证券公司分级 B 类份额（场内简称：证券 B，基金代码：502012）的摘牌日为 2021 年 1 月 4 日，终止上市日为 2021 年 1 月 5 日（最后交易日为 2020 年 12 月 31 日），基金份额折算基准日为 2020 年 12 月 31 日。以基金份额折算基准日日终易方达证券公司份额的基金份额净值为基准，易方达证券公司分级 A 类份额、易方达证券公司分级 B 类份额按照各自的基金份额参考净值（而不是二级市场价格）折算成场内易方达证券公司份额。敬请投资者关注相关风险以及基金管理人发布的相关公告，合理安排投资计划。

2、相对于易方达证券公司份额，本基金易方达证券公司分级 A 类份额为预期风险、收益相对较低的子份额。在因易方达证券公司份额的基金份额净值大于 1.5000 元而触发基金合同约定的不定期份额折算情形时，基金份额折算基准日折算前易方达证券公司分级 A 类份额超出 1.0000 元的部分将折算为易方达证券公司份额，即不定期份额折算前的易方达证券公司分级 A 类份额持有人在不定期份额折算后将持有易方达证券公司分级 A 类份额和易方达证券公司份额。因此，原易方达证券公司分级 A 类份额的基金份额持有人所持有基金份额的风险收益特征将发生一定的变化，由持有单一的较低风险收益特征份额变为同时持有较低风险收益特征份额与较高风险收益特征份额的情况。

3、相对于易方达证券公司份额，本基金易方达证券公司分级 B 类份额为预期风险、收

益相对较高的子份额。在因易方达证券公司份额的基金份额净值大于 1.5000 元而触发基金合同约定的不定期份额折算情形时，基金份额折算基准日折算前易方达证券公司分级 B 类份额超出 1.0000 元的部分将折算为易方达证券公司份额，即份额折算前的易方达证券公司分级 B 类份额持有人在份额折算后将持有易方达证券公司分级 B 类份额与易方达证券公司份额。因此，原易方达证券公司分级 B 类份额的基金份额持有人的风险收益特征将发生一定的变化，由持有单一的高风险收益特征份额变为同时持有高风险收益特征份额与较高风险收益特征份额的情况。经过折算，易方达证券公司分级 B 类份额的杠杆将恢复至初始杠杆水平，高于折算前的杠杆倍数。

4、由于易方达证券公司份额、易方达证券公司分级 A 类份额、易方达证券公司分级 B 类份额折算前可能存在折溢价交易情形。不定期份额折算后，易方达证券公司份额、易方达证券公司分级 A 类份额、易方达证券公司分级 B 类份额的折溢价率可能发生较大变化。提请参与二级市场交易的投资者注意与易方达证券公司份额、易方达证券公司分级 A 类份额、易方达证券公司分级 B 类份额的折溢价变化相关的风险。

5、根据基金合同规定，折算基准日在触发阈值日后才能确定，因此折算基准日易方达证券公司份额的净值可能与触发折算的阈值（1.5000 元）有一定差异。

此外，如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上海证券交易所、登记结算机构的相关业务规则，暂停基础份额、A 类份额与 B 类份额的上市交易、场内合并和基础份额的赎回、转换转出等相关业务。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。

6、根据相关公告，本基金已暂停申购、转换转入、定期定额投资、转托管及场内分拆业务。

投资者若希望了解基金不定期份额折算业务详情，请参阅本基金基金合同及《易方达证券公司指数分级证券投资基金更新的招募说明书》或者拨打本公司客服电话：400 881 8088。

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。销售机构根据法规要求对投资者类别、风险承受能力和基金的风险等级进行划分，并提出适当性匹配意见。投资者在投资基金前应认真阅读基金合同、招募说明书（更新）和基金产品资料概要（更新）等基金法律文件，全面认识基金产品的风险收益特征，在了解产品情况及销售机构适当性意见的基础上，根据自身的风险承受能力、投资期限和投资目标，对基金投资作出独立决策，选择合适的基金产品。基金管理人

提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

特此公告。

易方达基金管理有限公司

2020年12月2日