

关于新华中证环保产业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《新华中证环保产业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，当新华中证环保产业指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）之新华环保 B 份额的基金份额参考净值低至 0.250 元或以下时，本基金将进行不定期份额折算。

截至 2015 年 9 月 15 日，新华环保份额的基金份额净值为 0.221 元，达到基金合同规定的不定期份额折算条件。根据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 2015 年 9 月 16 日为基准日办理不定期份额折算业务。相关事项公告如下：

一、基金份额折算基准日

本次不定期份额折算的基准日为 2015 年 9 月 16 日。

二、基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的新华环保 A 份额（场内简称：NCF 环保 A，基金代码：150190）、新华环保 B 份额（场内简称：NCF 环保 B，基金代码：150191）和新华环保份额。

三、基金份额折算方式

当新华环保 B 份额的基金份额参考净值低至 0.250 元或以下后，本基金将分别对新华环保 A 份额、新华环保 B 份额和新华环保份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保新华环保 A 份额和新华环保 B 份额的比例为 1:1，份额折算后新华环保份额的基金份额净值、新华环保 A 份额和新华环保 B 份额的基金份额参考净值均调整为 1.000 元。

当新华环保 B 份额的基金份额参考净值低至 0.250 元或以下，新华环保 A 份额、新华环保 B 份额、新华环保份额三类份额将按照如下公式进行份额折算：

1) 新华环保 B 份额

份额折算原则：

份额折算前新华环保 B 份额的资产净值与份额折算后新华环保 B 份额的资产净值相等。

$$NUM_{\text{新华环保B}}^{\text{后}} = \frac{NAV_{\text{新华环保B}}^{\text{前}} \times NUM_{\text{新华环保B}}^{\text{前}}}{1.000}$$

其中：

$NUM_{\text{新华环保B}}^{\text{后}}$ ：份额折算后新华环保份额的份额数

$NAV_{\text{新华环保B}}^{\text{前}}$ ：份额折算前新华环保份额的基金份额参考净值

$NUM_{\text{新华环保B}}^{\text{前}}$ ：份额折算前新华环保份额的份额数

2) 新华环保 A 份额

份额折算原则：

① 份额折算前后新华环保 A 份额与新华环保 B 份额的份额数始终保持 1: 1 配比；

② 份额折算前新华环保 A 份额的资产净值与份额折算后新华环保 A 份额的资产净值及新增场内新华环保份额的资产净值之和相等；

③ 份额折算前新华环保 A 的持有人在份额折算后将持有新华环保 A 份额与新增场内新华环保份额。

$$NUM_{\text{新华环保A}}^{\text{后}} = NUM_{\text{新华环保B}}^{\text{后}}$$

新华环保 A 份额持有人新增的场内新华环保份额的份额数=

$$\frac{NUM_{\text{新华环保A}}^{\text{前}} \times NAV_{\text{新华环保A}}^{\text{前}} - NUM_{\text{新华环保A}}^{\text{后}} \times 1.000}{1.000}$$

其中：

$NUM_{\text{新华环保A}}^{\text{后}}$ ：份额折算后新华环保 A 份额的份额数

$NUM_{\text{新华环保B}}^{\text{后}}$ ：份额折算后新华环保 B 份额的份额数

$NUM_{\text{新华环保A}}^{\text{前}}$ ：份额折算前新华环保 A 份额的份额数

$NAV_{\text{新华环保A}}^{\text{前}}$ ：份额折算前新华环保 A 份额的基金份额参考净值

3) 新华环保份额

份额折算原则：

份额折算前新华环保份额的资产净值与份额折算后新华环保份额的资产净值相等。

$$NUM_{\text{新华环保份额}}^{\text{后}} = \frac{NAV_{\text{新华环保份额}}^{\text{前}} \times NUM_{\text{新华环保份额}}^{\text{前}}}{1.000}$$

其中：

$NUM_{\text{新华环保份额}}^{\text{后}}$ ：份额折算后新华环保份额的份额数

$NAV_{\text{新华环保份额}}^{\text{前}}$ ：份额折算前新华环保份额的基金份额净值

$NUM_{\text{新华环保份额}}^{\text{前}}$ ：份额折算前新华环保份额的份额数；份额折算前新华环保 A 份额的份额数；份额折算后新华环保 A 份额的份额数；份额折算前新华环保 A 份额的基金份额参考净值；份额折算后新华环保 B 份额的份额数；份额折算后新华环保 A 份额的份额数；份额折算前新华环保 B 份额的份额数；份额折算前新华环保 B 份额的基金份额参考净值；份额折算后新华环保份额的份额数；份额折算前新华环保份额的基金份额参考净值；份额折算前新华环保份额的份额数

4) 折算后新华环保份额的总份额数

折算后新华环保份额的总份额数 = 新华环保份额持有人持有的折算后的新华环保份额数 + 环保 A 份额持有人折算新增的场内新华环保份额数。

四、折算份额数的处理方式

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，由此产生的误差计入基金资产；场内份额的份额数取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金资产。

五、不定期份额折算示例

假设在本基金的不定期份额折算基准日，新华环保份额的基金份额净值、新华环保 A 份额与新华环保 B 份额的基金份额参考净值如下表所示，折算后，新华环保份额的基金份额净值、新华环保 A 份额、新华环保 B 份额的基金份额参考净值均调整 1.000 元，则分别持有新华环保份额、新华环保 A 份额、新华环保 B 份额 10,000 份的基金份额持有人所持基金份额的变化如下表所示：

	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
新华环保份额	0.625元	10,000份	1.000元	6,250份新华环保份额
新华环保A份额	1.005元	10,000份	1.000元	2,450份新华环保A份额 +新增7,600份新华环保份额
新华环保B份额	0.245元	10,000份	1.000元	2,450份新华环保B份额

六、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 2015 年 9 月 16 日），本基金暂停办理申购（含定期定额投资，下同）、赎回、转换、转托管（包括系统内转托管、跨系统转托管，下同）、配对转换业务；新华环保 A 份额和新华环保 B 份额将于当日上午 9:30-10:30 停牌一小时，并于上午 10:30 复牌；基准日日终，基金管理人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 2015 年 9 月 17 日），本基金暂停办理申购、赎回、转托管、配对转换业务；新华环保 A 份额和新华环保 B 份额将于该日停牌一天；当日，本基金注册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 2015 年 9 月 18 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；新华环保 A 份额和新华环保 B 份额将于该日上午 9:30-10:30 停牌一小时，并于上午 10:30 之后复牌。

4、根据深圳证券交易所《深圳证券交易所证券投资基金交易和申购赎回实施细则》，2015 年 9 月 18 日新华环保 A 份额和新华环保 B 份额即时行情显示的前收盘价为 2015 年 9 月 17 日的新华环保 A 份额和新华环保 B 份额的基金份额参考净值（四舍五入至 0.001 元），2015 年 9 月 18 日当日新华环保 A 份额和新华环保 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。

七、重要提示

1、本基金新华环保 A 份额、新华环保 B 份额将于 2015 年 9 月 16 日上午

9:30-10:30 停牌一小时，并于 2015 年 9 月 16 日上午 10:30 复牌。

本基金新华环保 A 份额、新华环保 B 份额将于 2015 年 9 月 17 日全天停牌，2015 年 9 月 18 日上午 9:30-10:30 停牌一小时，并于 2015 年 9 月 18 日上午 10:30 复牌。

2、2015 年 9 月 15 日，新华环保 B 份额的基金份额参考净值已跌至 0.250 元以下，而折算基准日为 2015 年 9 月 16 日，因此折算基准日新华环保 B 份额的基金份额参考净值可能与 0.250 元有差异。

3、特别提示：近日新华环保 B 份额二级市场交易价格溢价较大，在不定期份额折算后，新华环保 B 份额的溢价率可能发生较大变化。特提请参与二级市场交易的投资者注意新华环保 B 份额高溢价交易所带来的风险。

4、新华环保 B 份额表现为较高风险、较高预期收益的特征。随着新华环保 B 份额的基金份额参考净值降低，其杠杆率升高。在不定期份额折算后，新华环保 B 份额的杠杆率将恢复至初始杠杆水平。

5、新华环保 A 份额表现为较低风险、收益相对稳定的特征。但在发生不定期份额折算后，新华环保 A 的份额持有人会获得一定比例的新华环保份额，因此其持有的部分基金份额的风险收益特征将发生较大变化，新华环保 A 份额持有人预期收益实现的不确定性将会增加。

6、根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司和基金管理人的相关业务规则，场外份额进行份额折算时计算结果保留到小数点后 2 位，小数点后 2 位以后的部分舍去，舍去部分计入基金财产。场内份额进行份额折算时计算结果保留至整数位（最小单位为 1 份），小数点以后的部分舍去，舍去部分计入基金财产。因此，在不定期份额折算过程中，由于尾差处理，可能使持有人的资产净值出现微小误差，但视为未改变基金份额持有人的资产净值。

7、在二级市场可以做交易的证券公司并不全部具备中国证监会颁发的基金销售资格，而投资者只能通过具备基金销售资格的证券公司赎回基金份额。因此，如果投资者通过不具备基金销售资格的证券公司购买新华环保 A 份额，在不定期份额折算后，则折算新增的新华环保份额无法赎回。投资者可以选择在折算前将新华环保 A 份额卖出，或者在折算后将新增的新华环保份额转托管到具有基金销售资格的证券公司后赎回。

8、投资者若希望了解本基金不定期份额折算业务详情，请参阅本基金的基金合同及《新华中证环保产业指数分级证券投资基金招募说明书》（以下简称“招募说明书”），也可访问基金管理人网站（www.ncfund.com.cn）或者拨打本公司客服电话：400-819-8866。

9、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。

本基金管理人提醒投资者知晓基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。敬请投资者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。

新华基金管理有限公司

2015年9月16日