

中海中证高铁产业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

返回 >时间: 2018-09-19

根据《中海中证高铁产业指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）中关于不定期份额折算的相关规定，当中海中证高铁 B 份额的基金份额参考净值小于或等于 0.250 元时，中海中证高铁份额（场内简称：高铁分级，基金代码：502030）、中海中证高铁 A 份额（场内简称：高铁 A，代码：502031）、中海中证高铁 B 份额（场内简称：高铁 B，基金代码：502032）将进行份额折算。

由于近期 A 股市场波动较大，截至 2018 年 9 月 18 日，中海中证高铁 B 份额的基金份额参考净值接近基金合同规定的不定期份额折算条件，因此本基金管理人敬请投资者密切关注中海中证高铁 B 份额近期的基金份额参考净值波动情况，并警惕可能出现的风险。

针对前述情形下的不定期折算所带来的风险，本基金管理人特别提示如下：

1、触发不定期折算当日，中海中证高铁 B 份额的基金份额参考净值已跌至 0.250 元或以下，而折算基准日在触发日后才能确定，因此折算基准日中海中证高铁 B 份额的基金份额参考净值可能与 0.250 元有差异。

2、特别提示：如果发生不定期份额折算，中海中证高铁 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中海中证高铁 B 份额高溢价交易所带来的风险。

3、中海中证高铁 B 份额表现为高风险、高预期收益的特征。随着中海中证高铁 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，中海中证高铁 B 份额的杠杆率将恢复至初始杠杆水平。

4、中海中证高铁 A 份额表现为低风险、收益相对稳定的特征。但在发生不定期份额折算后，中海中证高铁 A 份额的份额持有人会获得一定比例的中海中证高铁份额，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，中海中证高铁 A 份额持有人预期收益实现的不确定性将会增加。

5、根据上海证券交易所、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，场外份额经折算后的份额数采用截尾法保留到小数点后两位。场内份额经折算后的份额数取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。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。

6、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中海中证高铁 A 份额，在不定期份额折算后，则折算新增的中海中证高铁份额无法赎回。投资者可以选择在折算前将中海中证高铁 A 份额卖出，或者在折算后将新增的中海中证高铁份额转托管到具有基金销售资格的证券公司后赎回。

本基金管理人的其他重要提示：

1、为保证折算期间本基金的平稳运作，基金管理人可根据上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停中海中证高铁 A 份额与中

海中证高铁 B 份额的上市交易和海中证高铁份额的申购、赎回、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业务详情，请参阅本基金的基金合同及《海中证高铁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”)或者拨打本公司客服电话：400-888-9788（免长途话费）、021-38789788。

3、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。投资有风险，选择须谨慎。敬请投资者于投资前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和临时公告。

特此公告。

中海基金管理有限公司
2018年9月19日