

国投瑞银瑞泽中证创业成长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《国投瑞银瑞泽中证创业成长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,当国投瑞银瑞泽中证创业成长指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)之国投创业成长 B 份额的基金份额参考净值小于 0.250 元时,本基金国投创业成长份额(基础份额,场内简称:国投成长,基金代码:161223)、国投创业成长 A 份额(场内简称:成长 A 级,基金代码:150213)及国投创业成长 B 份额(场内简称:成长 B 级,基金代码:150214)将进行不定期份额折算。

由于近期 A 股市场波动较大,截至 2018 年 10 月 15 日,国投创业成长 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阈值,因此本基金管理人敬请投资者密切关注国投创业成长 B 份额近期的参考净值波动情况,并警惕可能出现的风险。

针对不定期折算所带来的风险,本基金管理人特别提示如下:

一、由于国投创业成长 A 份额、国投创业成长 B 份额折算前可能存在折溢价交易情形,不定期份额折算后,国投创业成长 A 份额、国投创业成长 B 份额的折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高溢价所带来的风险。

二、国投创业成长 B 份额表现为高风险、高收益的特征,不定期份额折算后其杠杆将恢复至初始杠杆水平。

三、由于触发折算阈值当日,国投创业成长 B 份额的基金份额参考净值可能已低于阈值,而折算基准日在触发阈值日后才能确定,因此折算基准日国投创业成长 B 份额的基金份额参考净值可能与折算阈值 0.250 元有一定差异。

四、国投创业成长 A 份额表现为低风险、收益相对稳定的特征,但在不定期份额折算后国投创业成长 A 份额持有人的风险收益特征将发生较大变化,由持有单一的较低风险收益特征国投创业成长 A 份额变为同时持有较低风险收益特征国投创业成长 A 份额与较高风险收益特征国投创业成长 B 份额的情况,因此国投创业成长 A 份额持有人预期收益实现的不确定性将会增加。

本基金管理人的其他重要提示:

一、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,持有极小数量国投创业成长 A 份额、国投创业成长 B 份额和场内国投创业成长 B 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。

二、如本基金发生上述不定期折算情形,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国投创业成长 A 份额与国投创业成长 B 份额的上市交易、与国投创业成长 B 份额的配对转换,以及国投创业成长 B 份额的申购、赎回等相关业务。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。

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《国投瑞银瑞泽中证创业成长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:400-880-6868(免长途话费)。

三、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。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。

特此公告。

2018 年 10 月 16 日