

诺德深证 300 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《诺德深证 300 指数分级证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)关于不定期份额折算的相关约定,当诺德深证 300B 份额的基金份额参考净值达到 0.250 元,诺德深证 300 份额(基础份额,场内简称:诺德 S300,交易代码:165707)、诺德深证 300A 份额(场内简称:诺德 300A,交易代码:150092)和诺德深证 300B 份额(场内简称:诺德 300B,交易代码:150093)将进行不定期份额折算。

由于近期 A 股市场波动较大,截至 2019 年 1 月 28 日,诺德深证 300B 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诺德深证 300B 份额近期净值的波动情况,并警惕可能出现的风险。

针对可能发生的不定期份额折算,本基金管理人特别提示如下:

- 一、由于诺德深证 300A 份额、诺德深证 300B 份额折算前可能存在折溢价交易情形,不定期份额折算后,诺德深证 300A 份额、诺德深证 300B 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折溢价所带来的风险。
- 二、诺德深证 300B 份额具有高风险、高预期收益的特征。不定期份额折算后其杠杆将恢复至初始杠杆水平。
- 三、诺德深证 300A 份额具有低风险、收益相对稳定的特征。但在不定期份额折算后诺德深证 300A 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的诺德深证 300A 份额变为同时持有较低风险收益特征的诺德深证 300A 份额与较高风险收益特征的诺德深证 300 份额的情况,因此,诺德深证 300A 份额持有人预期收益实现的不确定性将会增加。
- 四、根据合同规定,折算基准日在触发阈值日后才能确定,因此折算基准日诺德深证 300B 份额的净值可能与触发折算的阈值 0.250 元有一定差异。

本基金管理人的其他重要提示:

- 一、根据深圳证券交易所相关业务规则,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,持有极小数量诺德深证 300 份额、诺德深证 300A 份额、诺德深证 300B 份额的持有人存在折算后份额因为不足 1 份而被强制归入基金资产的风险。
- 二、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诺德深证 300A 份额与诺德深证 300B 份额的上市交易和诺德深证 300 份额的申购及赎回等相关业务。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《诺德深证 300 指数分级证券投资基金基金合同》及《诺德深证 300 指数分级证券投资基金招募说明书》。投资者可致电本公司客户服务电话 400-888-0009,或登录本公司网站 www.nuodfund.com 了解或咨询详情。
- 三、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。

诺德基金管理有限公司

2019 年 1 月 29 日