

华宝标普美国品质消费股票指数证券投资基金(LOF)

场内溢价风险的提示性公告

华宝基金管理有限公司(以下简称“本基金管理人”)旗下华宝标普美国品质消费股票指数证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”),包括人民币份额(基金代码:162415,场内简称“美国消费”)和美元份额(基金代码:002423),其中人民币份额(以下简称“美国消费”)在深圳证券交易所上市交易。近期美国消费二级市场交易价格相对基金份额净值,持续出现场内高溢价。

2020年4月1日晚公布的美国消费3月31日基金净值为1.323元,标的指数(指数名称:标普美国品质消费股票指数,指数代码:IXY)于4月1日美国交易时间的表现(单日下跌4.41%)尚未计入3月31日基金净值,而将影响4月2日晚公布的4月1日基金净值。美国消费4月2日场内收盘价格为1.488元,相对于4月1日基金净值,场内溢价可能超过10%。4月3日,投资者在交易美国消费时,还需要考虑4月2日美国交易时间标的指数的表现估算溢价。**特此提示投资者关注二级市场溢价风险。若投资者以高溢价买入美国消费,将承担额外的溢价成本以及未来溢价波动带来的价格风险,可能造成重大损失。**

有关本基金的场内溢价风险,本基金管理人提示如下:

1、本基金二级市场的交易价格,除了受基金份额净值变化的影响外,还会受到市场的系统性风险、流动性风险等其他风险影响,可能使投资者面临损失。

2、本基金为QDII基金,二级市场交易价格的溢价水平亦受外汇投资额度管理与申购限制等因素影响,请投资者务必关注风险,谨慎投资。受外汇投资额度限制,本基金已于2020年2月12日发布公告,自2020年2月14日起暂停全部申购(含定期定额投资)业务。

3、由于前述本基金暂停申购的情形,以及场内价格受跌停板规则限制可能无法及时反映基金净值的大幅波动,当前本基金场内交易价格大幅高于基金份额净值。该溢价水平可能大幅波动,给投资者带来基金净值波动风险以外的溢价风险,投资者应避免高溢价买入。

4、截至本公告披露日,本基金运作正常。本基金管理人始终严格按照法律法规及基金合同的相关规定进行投资运作。

5、截至本公告披露日,本基金无其他应披露而未披露的重大信息。本基金管理人仍将严格按照有关规定和要求,及时做好信息披露工作。

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。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。

华宝基金管理有限公司

2020年4月3日