

# 新华中证环保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

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”）中关于不定期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”）之基础份额——新华环保份额（场内简称：新华环保，基金代码：164304）的基金份额净值大于 1.500 元时，本基金将进行不定期份额折算。

截至 2020 年 9 月 16 日，新华环保份额的基金份额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新华环保份额近期的基金份额净值波动情况，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）新华环保 A 份额（场内简称：NCF 环保 A，基金代码：150190）为低预期风险且预期收益相对稳定的基金份额，但在不定期份额折算后，原新华环保 A 份额持有人将持有新华环保 A 份额和新华环保份额，由持有单一的较低风险收益特征份额变为同时持有较低风险收益特征份额与较高风险收益特征份额，风险收益特征将发生较大变化，预期收益实现的不确定性将会增加。

（二）新华环保 B 份额（场内简称：NCF 环保 B，基金代码：150191）为高预期风险且预期收益相对较高的基金份额，原新华环保 B 份额持有人将同时持有较高风险收益特征新华环保 B 份额与较低风险收益特征新华环保份额，风险收益特征将发生较大变化，且折算后其杠杆倍数将大幅提升，由目前的杠杆恢复到初始的 2 倍杠杆水平。

（三）由于新华环保 A 份额和新华环保 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，其折溢价率可能发生变化。特提请参与二级市场交易的投资者注意投资风险。

（四）根据基金合同规定，折算基准日在触发阈值后才能确定，因此折算基准日的新华环保份额净值与折算阈值 1.500 元可能有一定差异。

（五）为保证折算期间本基金的平稳运作，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新华环保 A 份额与新

华环保 B 份额的上市交易和新华环保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。

(六) 本基金管理人已于 2019 年 2 月 27 日发布了《关于新华中证环保产业指数分级证券投资基金暂停大额申购、转换转入及定期定额投资业务的公告》；2019 年 5 月 15 日发布了《关于新华中证环保产业指数分级证券投资基金恢复场外大额申购、转换转入及定期定额投资业务并暂停跨系统转托管（场外转场内）业务的公告》；2020 年 3 月 23 日发布了《关于新华中证环保产业指数分级证券投资基金暂停场内申购业务的公告》。相关限制如有调整，以本基金管理人届时最新公告为准。

**根据中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会、中国证券监督管理委员会、国家外汇管理局联合发布的《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》，本基金将在 2020 年底前完成规范整改，请投资者关注相关风险以及基金管理人届时发布的相关公告。**

投资者若希望了解基金不定期份额折算业务详情，请登录本公司网站（[www.ncfund.com.cn](http://www.ncfund.com.cn)）查询或阅读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”）或者拨打本公司客服电话：400-819-8866。

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。本基金管理人充分重视投资者教育工作，以保障投资者利益为己任，特此提醒广大投资者正确认识投资基金所存在的风险，慎重考虑、谨慎决策，选择与自身风险承受能力相匹配的产品，做理性的基金投资者，享受长期投资理财的快乐！

特此公告。

新华基金管理股份有限公司

2020年9月17日