

# 关于新华中证环保产业指数分级证券投资基金

## 办理不定期份额折算业务的公告

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”）“第二十一部分、基金份额折算”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）的基金份额净值大于或等于 1.500 元时，本基金将进行不定期份额折算。

截至 2020 年 9 月 18 日，新华环保份额的基金份额净值为 1.501 元，达到基金合同规定的不定期份额折算条件。根据基金合同以及深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定，本基金将以 2020 年 9 月 21 日为基准日办理不定期份额折算业务。相关事项公告如下：

### 一、基金份额折算基准日

本次不定期份额折算的基准日为 2020 年 9 月 21 日。

### 二、基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的新华环保 A 份额（场内简称：NCF 环保 A，基金代码：150190）、新华环保 B 份额（场内简称：NCF 环保 B，基金代码：150191）和新华环保份额（场内简称：新华环保，基金代码：164304）。

### 三、基金份额折算方式

当新华环保份额的基金份额净值高至 1.500 元或以上后，本基金将分别对新华环保 A 份额、新华环保 B 份额和新华环保份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保新华环保 A 份额和新华环保 B 份额的比例为 1:1，份额折算后新华环保 A 份额的基金份额参考净值、新华环保 B 份额的基金份额参考净值和新华环保份额的基金份额净值均调整为 1.000 元。

当新华环保份额的份额净值高至 1.500 元或以上后，新华环保 A 份额、新华环保 B 份额、新华环保份额三类份额将按照如下公式进行份额折算：

#### 1) 新华环保 A 份额

份额折算原则：

① 份额折算前新华环保 A 份额的份额数与份额折算后新华环保 A 份额的

份额数相等；

② 新华环保 A 份额持有人份额折算后获得新增的份额数，即超出 1.000 元以上的净值部分全部折算为场内新华环保份额。

$$NUM_{\text{新华环保 A}}^{\text{后}} = NUM_{\text{新华环保 A}}^{\text{前}}$$

新华环保 A 份额持有人新增的场内新华环保份额的份额数=

$$\frac{NUM_{\text{新华环保 A}}^{\text{前}} \times (NAV_{\text{新华环保 A}}^{\text{前}} - 1.000)}{1.000}$$

其中：

$NUM_{\text{新华环保 A}}^{\text{前}}$ ：份额折算前新华环保 A 份额的份额数

$NUM_{\text{新华环保 A}}^{\text{后}}$ ：份额折算后新华环保 A 份额的份额数

$NAV_{\text{新华环保 A}}^{\text{前}}$ ：份额折算前新华环保 A 份额的基金份额参考净值

## 2) 新华环保 B 份额

份额折算原则：

- ① 份额折算后新华环保 B 份额与新华环保 A 份额的份额数保持 1:1 配比；
- ② 份额折算前新华环保 B 份额的资产净值与份额折算后新华环保 B 份额的资产净值及新增场内新华环保份额的资产净值之和相等；

③ 份额折算前新华环保 B 的持有人在份额折算后将持有新华环保 B 份额与新增场内新华环保份额。

$$NUM_{\text{新华环保 B}}^{\text{后}} = NUM_{\text{新华环保 A}}^{\text{后}}$$

新华环保 B 份额持有人新增的场内新华环保份额的份额数=

$$\frac{NUM_{\text{新华环保 B}}^{\text{前}} \times (NAV_{\text{新华环保 B}}^{\text{前}} - 1.000)}{1.000}$$

其中：

$NUM_{\text{新华环保 B}}^{\text{后}}$ ：份额折算后新华环保 B 份额的份额数

$NUM_{\text{新华环保 A}}^{\text{后}}$ ：份额折算后新华环保 A 份额的份额数

$NUM_{\text{新华环保 B}}^{\text{前}}$ ：份额折算前新华环保 B 份额的份额数

$NAV_{\text{新华环保 B}}^{\text{前}}$ ：份额折算前新华环保 B 份额的基金份额参考净值

### 3) 新华环保份额

份额折算原则：

场外新华环保份额持有人份额折算后获得新增场外新华环保份额，场内新华环保份额持有人份额折算后获得新增场内新华环保份额。

$$NUM_{\text{新华环保份额}}^{\text{后}} = \frac{NAV_{\text{新华环保份额}}^{\text{前}} \times NUM_{\text{新华环保份额}}^{\text{前}}}{1.000}$$

其中：

$NUM_{\text{新华环保份额}}^{\text{后}}$ ：份额折算后新华环保份额的份额数

$NAV_{\text{新华环保份额}}^{\text{前}}$ ：份额折算前新华环保份额的基金份额参考净值

$NUM_{\text{新华环保份额}}^{\text{前}}$ ：份额折算前新华环保份额的份额数

### 4) 折算后新华环保份额的总份额数

折算后新华环保份额的总份额数=折算前新华环保份额的份额数+新华环保份额持有人新增的新华环保份额数+环保 A 份额持有人折算新增的场内新华环保份额数+环保 B 份额持有人折算新增的场内新华环保份额数。

## 四、基金份额折算期间的基金业务办理

1、不定期份额折算基准日（即 2020 年 9 月 21 日），本基金暂停办理申购（已于 2020 年 3 月 23 日暂停场内申购业务。含定期定额投资，下同）、赎回、转换、转托管（包括系统内转托管、跨系统转托管（已于 2019 年 5 月 15 日暂停跨系统转托管（场外转场内）业务），下同）、配对转换业务；新华环保 A 份额和新华环保 B 份额正常交易；基准日日终，基金管理人将计算基金份额净值及份额折算比例。

2、不定期份额折算基准日后的第一个工作日（即 2020 年 9 月 22 日），本基金将暂停办理申购、赎回、转换、转托管、配对转换业务；新华环保 A 份额和新华环保 B 份额将于该日停牌一天；本基金注册登记人及基金管理人将完成份额登记确认及份额折算。

3、不定期份额折算基准日后的第二个工作日（即 2020 年 9 月 23 日），基

金管理人将公告份额折算确认结果，基金份额持有人可以查询其账户内的基金份额；自该日起，本基金恢复办理申购（包括场内申购）、赎回、转换、转托管、配对转换业务，但仍暂停跨系统转托管（场外转场内）业务（详见 2019 年 5 月 15 日《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》），相关限制如有调整，以基金管理人届时最新公告为准；新华环保 A 份额和新华环保 B 份额将于当日开市起恢复正常交易。

4、根据深圳证券交易所《深圳证券交易所证券投资基金交易和申购赎回实施细则》，2020 年 9 月 23 日新华环保 A 份额和新华环保 B 份额即时行情显示的前收盘价为 2020 年 9 月 22 日的新华环保 A 份额和新华环保 B 份额的基金份额参考净值（四舍五入至 0.001 元）。

#### 五、重要提示

1、新华环保 A 份额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 B 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；此外，新华环保 B 份额为基础份额，其份额净值将随市场涨跌而变化，因此原新华环保 A 份额持有人还可能会承担因市场下跌而遭受损失的风险。

2、新华环保 B 份额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 A 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。此外，新华环保 B 份额的基金份额参考净值随市场涨跌而增长或者下降的幅度也会大幅增加。

3、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。

4、原新华环保 A 份额和新华环保 B 份额持有人可通过办理配对转换业务将此次折算获得的场内新华环保 B 份额分拆为新华环保 A 份额和新华环保 B 份额。

5、折算后，本基金新华环保份额的份额数量会增加。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，持有极小数量新华环保 A 份额、新华环保 B 份额和场内新华环保份额的持有人，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。

6、此次基金份额折算基准日不是触发折算阈值当日，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。

**7、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。**

8、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。

新华基金管理股份有限公司

2020 年 9 月 21 日