

新华中证环保产业指数分级证券投资基金

不定期份额折算结果及恢复交易的公告

根据《新华中证环保产业指数分级证券投资基金基金合同》及深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定,新华基金管理股份有限公司(以下简称“本公司”)以2020年9月21日为份额折算基准日,对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”)实施不定期份额折算,现将相关事项公告如下:

一、份额折算结果

2020年9月21日,新华环保份额(场内简称:新华环保,基金代码:164304)的场外份额经折算后的份额数按四舍五入法保留到小数点后两位,尾差部分计入基金财产;新华环保份额的场内份额、新华环保A份额(场内简称:NCF环保A,基金代码:150190)和新华环保B份额(场内简称:NCF环保B,基金代码:150191)经折算后的份额数取整计算(最小单位为1份)。基金份额折算比例按四舍五入法精确到小数点后第9位,如下表所示:

基金份额名称	折算前份额(份)	折算后份额(份)	折算比例	折算后基金份额净值(元)	折算后基金份额累计净值(元)
新华环保场外份额	32,847,567.45	49,033,123.37	0.492747475	1.000	1.083
新华环保场内份额	4,170,054.00	11,847,971.00 (注1)	0.492747475	1.000	1.083
新华环保A份额	5,705,899.00	5,705,899.00	0.039527056	1.000	1.402
		225,537.00 (注2)			
新华环保B份额	5,705,899.00	5,705,899.00	0.945967894	1.000	0.295
		5,397,597.00 (注3)			

注1:该“折算后份额”包括新华环保A份额和新华环保B份额经折算后产生的新增新华环保场内份额。

注 2：该“折算后份额”为新华环保 A 份额经折算后产生的新增新华环保场内份额。

注 3：该“折算后份额”为新华环保 B 份额经折算后产生的新增新华环保场内份额。

投资者自公告之日起可查询经注册登记机构确认的折算后份额。

二、恢复交易

自 2020 年 9 月 23 日起,本基金恢复办理申购(含场内申购,定期定额投资)、赎回、转托管(包括系统内转托管和跨系统转托管)和配对转换业务,但仍暂停跨系统转托管(场外转场内)业务,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。

根据《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 日复牌首日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 份额的份额参考净值,分别为 1.000 元和 0.958 元,2020 年 9 月 23 日当日新华环保 A 份额和新华环保 B 份额均可能出现交易价格大幅波动的情形。敬请投资者注意投资风险。

三、重要提示

1、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。

2、本基金新华环保 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,原新华环保 A 份额持有人的风险收益特征将发生变化,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的新华环保 A 份额和较高风险收益特征的新华环保份额。由于新华环保份额为跟踪中证环保产业指数的基础份额,其份额净值将随市场涨跌而变化,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,预期收益实现的不确定性将会增加。

3、新华环保 B 份额表现为高风险、高收益的特征,但在不定期份额折算后,原新华环保 B 份额持有人的风险收益特征将发生变化,由持有单一的较高风险收益特征份额变为同时持有较高风险收益特征的新华环保 B 份额与较低

风险收益特征的新华环保份额。折算后的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，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将相应增加。

4、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，其折溢价率可能随之发生较大变化。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。

5、此次通过折算所新增的场内新华环保份额可通过办理配对转换业务分拆为新华环保 A 份额和新华环保 B 份额。

6、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。

7、本公司承诺以诚实信用、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。

特此公告。

新华基金管理股份有限公司

2020 年 9 月 23 日