

# 关于新华中证环保产业指数分级证券投资基金之新华环保 A 份额、新华环保 B 份额终止运作的特别风险提示公告

根据《新华基金管理股份有限公司关于新华中证环保产业指数分级证券投资基金实施转型的公告》及《新华基金管理股份有限公司关于新华中证环保产业指数分级证券投资基金之新华环保 A 份额、新华环保 B 份额终止上市的公告》，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)的终止上市日为 2020 年 12 月 1 日(最后交易日为 2020 年 11 月 30 日)，份额转换基准日为 2020 年 12 月 1 日。在份额转换基准日日终，以新华环保份额的基金份额净值为基准，新华环保 A 份额、新华环保 B 份额按照各自的基金份额参考净值折算成场内新华环保份额。

针对本基金之新华环保 A 份额、新华环保 B 份额终止运作的相关安排，基金管理人特别提示如下风险事项，敬请投资者关注：

1、转换基准日前(不含转换基准日)，新华环保 A 份额和新华环保 B 份额仍可正常交易，期间敬请投资者高度关注以下风险：

(1) 由于新华环保 A 份额和新华环保 B 份额可能存在折溢价交易情形，其折溢价率可能发生较大变化，如果投资者以溢价买入，折算后可能遭受较大损失(具体折算方式及示例详见本公告第 4 条)。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。

投资者应密切关注新华环保 A 份额和新华环保 B 份额的基金份额参考净值变化情况(可通过本公司网站查询)。

(2) 新华环保 A 份额具有低预期风险、预期收益相对稳定的特征，但在份额折算后，新华环保 A 份额的持有人将持有具有较高预期风险、较高预期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，其份额净值将随标的指数的涨跌而变化，原新华环保 A 份额持有人将承担因市场下跌而遭受损失的风险。

新华环保 B 份额具有一定的杠杆属性，具有高预期风险、预期收益相对较高的特征，但在份额折算后，新华环保 B 份额的持有人将持有具有较高预期风险、较高预期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，没有杠杆特征，其基金份额净值将随标的指数的涨跌而变化，不会形成杠杆性收益或损失，但新华环保 B 份额持有人仍需承担因市场下跌而遭受损失的风险。

2、新华环保 A 份额和新华环保 B 份额折算为新华环保份额前，新华环保 A 份额和新华环保 B 份额的持有人有两种方式退出：

(1) 在场内按市价卖出基金份额；

(2) 在场内买入等量的对应份额(即新华环保 A 份额持有人买入等量的新华环保 B 份额，或者新华环保 B 份额持有人买入等量的新华环保 A 份额)，合并为新华环保份额，按照新华环保份额的基金份额净值申请场内赎回或转托管至场外后申请赎回。

3、由于新华环保 A 份额和新华环保 B 份额的持有人可能选择场内卖出或合并赎回，场内份额数量可能发生较大下降，可能出现场内流动性不足的情况，特提请投资者注意流动性风险。

4、在份额转换基准日日终，以新华环保份额的基金份额净值为基准，新华环保 A 份额、新华环保 B 份额按照各自的基金份额参考净值(而不是二级市场价格)折算成场内新华环保份额。新华环保 A 份额和新华环保 B 份额基金份额持有人持有的折算后场内新华环保份额取整计算(最小单位为 1 份)，余额计入基金资产。

折算前存在溢价交易的基金份额的持有人将会因为溢价的消失而造成损失。

新华环保 A 份额和新华环保 B 份额的基金份额持有人持有的基金份额数量将会在折算后发生变化，示例如

下：

假设份额转换基准日新华环保份额、新华环保 A 份额和新华环保 B 份额的基金份额（参考）净值的分别为：0.900 元、1.010 元、0.790 元，投资者甲、乙、丙分别持有场内新华环保份额、新华环保 A 份额、新华环保 B 份额各 100,000 份，其所持基金份额的变化如下表所示：

折算前

份额折算比例

折算后

基金份额

（参考）净值

（元）

基金份额

（份）

基金份

额（参

考）净值

（元）

基金份额（份）

新华环保份额 0.900 100,000 无变化 0.900

100,000 份

场内新华环保份额

新华环保 A 份额 1.010 100,000

1.122222222

（全部折算为新华环保份额）

0.900

112,222 份

场内新华环保份额

新华环保 B 份额 0.790 100,000

0.877777778

（全部折算为新华环保份额）

0.900

87,777 份

场内新华环保份额

在份额转换基准日日终，在新华环保 A 份额与新华环保 B 份额转换为新华环保份额的场内份额后，在保持基金资产净值总变的前提下，将新华环保份额的场内份额和场外份额分别转换为份额净值为 1.000 元的新华中证环保产业指数份额场内份额和场外份额。基金份额转换后，场外的新华中证环保产业指数份额数，保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位截位，由此产生的计算误差归入基金资产，场内的新华中证环保产业指数的份额数按截位法取整计算（最小单位为 1 份），取整后的余额计入基金资产。

由于基金份额数取整计算产生的误差，基金份额持有人存在着基金资产净值减小的风险。

对于持有份额数较少的新华中证环保份额的场内份额持有人，存在着持有的基金份额转换后份额数不足一份而被计入基金资产的风险。

份额转换的计算公式如下：

由新华环保份额的场内份额或新华环保份额的场外份额转换的新华中证环保产业指数的份额数=新华环保份额的场内份额或新华环保份额的场外份额数×份额转换基准日新华环保

份额的基金份额净值 $\div$ 1.000

由新华环保 A 份额转换的新华中证环保产业指数的份额数=新华环保 A 份额的场内份额数 $\times$ 份额转换基准日新华环保 A 份额的参考资产净值 $\div$ 1.000

由新华环保 B 份额转换的新华中证环保产业指数的份额数=新华环保 B 份额的场内份额数 $\times$ 份额转换基准日新华环保 B 份额的参考资产净值 $\div$ 1.000

转换后新华中证环保产业指数的份额净值为 1.000 元。

5、新华环保 A 份额和新华环保 B 份额折算为新华环保份额后，投资者可以申请场内赎回基金份额或者转托管至场外后申请赎回基金份额。对于无法办理场内赎回的投资者，需先转托管至场外后方可申请赎回。

6、根据中国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则，新华环保 A 份额和新华环保 B 份额合并或折算为新华环保份额后，基金份额持有期自新华环保份额确认之日起重新计算。

本基金转型后的赎回费率如下：

(1) 场外赎回费率

赎回费率随基金份额持有时间增加而递减，具体如下：

持有期（记为 T） 场外赎回费率

T < 7 日 1.50%

7 日 $\leq$  T < 1 年 0.5%

1 年 $\leq$  T < 2 年 0.2%

T  $\geq$  2 年 0

注：对上述场外份额持有期而言，1 年按 365 日计算。

(2) 场内赎回费率

持有期（记为 T） 场内赎回费率

T < 7 日 1.50%

T  $\geq$  7 日 0.50%

投资者可将其持有的全部或部分基金份额赎回。本基金的赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。其中，对持续持有期少于 7 日的投资者收取不少于 1.5% 的赎回费并全额计入基金财产。对持有期不少于 7 日的投资者收取的赎回费不低于赎回费总额的 25% 归基金财产，其余用于支付登记费和其他必要的手续费。

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。投资有风险，敬请投资者认真阅读相关公告，了解本基金目前的风险收益特征变化和相關安排，并根据自身投资目的、投资期限、投资经验、资产状况谨慎作出投资决策。

如有疑问，请拨打客户服务电话 400-819-8866 或登录本公司网站 [www.ncfund.com.cn](http://www.ncfund.com.cn) 获取相关信息。

特此公告。

新华基金管理股份有限公司

2020 年 11 月 27 日