

交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德德国证新能源指数 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《交银施罗德德国证新能源指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）关于不定期份额折算的相关规定，当交银施罗德德国证新能源指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）之交银新能源 B 份额（场内简称：新能源 B，基金代码：150218）的基金份额参考净值小于或等于 0.250 元时，本基金的交银新能源份额（场内简称：交银新能，基金代码：164905）、交银新能源 A 份额（场内简称：新能源 A，基金代码：150217）和交银新能源 B 份额将进行不定期份额折算。

由于近期 A 股市场波动较大，截至 2018 年 6 月 8 日，交银新能源 B 份额的基金份额参考净值接近基金合同规定的不定期份额折算的阈值 0.250 元，在此提请投资者密切关注交银新能源 B 份额近期基金份额参考净值的波动情况，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、交银新能源 A 份额、交银新能源 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，交银新能源 A 份额、交银新能源 B 份额的折溢价率可能发生较大变化。特提请参与二级市场交易的投资者注意高溢价所带来的风险。

二、交银新能源 B 份额表现为高风险、高收益的特征，不定期份额折算后其杠杆倍数将大幅降低，将恢复到初始的 2 倍杠杆水平，相应地，交银新能源 B 份额的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减小。

三、由于触发折算阈值当日，交银新能源 B 份额的份额参考净值可能已低于阈值，而折算基准日在触发阈值日后才能确定，因此折算基准日交银新能源 B 份额的份额参考净值可能与折算阈值 0.250 元有一定差异。

四、交银新能源 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交银新能源 A 份额持有人的风险收益特征将发生较大变化，由持有单一的较低风险收益特征的交银新能源 A 份额变为同时持有较低风险收益特征

的交银新能源 A 份额与较高风险收益特征的交银新能源份额的情况，因此交银新能源 A 份额持有人预期收益实现的不确定性将会增加。

重要提示：

1、若本基金发生上述不定期份额折算情形，按照基金合同规定的方法折算后本基金交银新能源份额、交银新能源 A 份额及交银新能源 B 份额的份额数量均会缩减。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，持有极小数量交银新能源份额、交银新能源 A 份额、交银新能源 B 份额的持有人存在折算后份额因为不足 1 份而被强制归入基金资产的风险。

2、为保证折算期间本基金的平稳运作，本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交银新能源 A 份额与交银新能源 B 份额的上市交易和交银新能源份额的申购、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。

3、投资者若希望了解基金不定期份额折算业务详情，请参阅本基金的基金合同及《交银施罗德德国证新能源指数分级证券投资基金招募说明书》。

4、投资者可以通过本基金管理人网站（www.fund001.com）或客户服务电话 400-700-5000（免长途话费），021-61055000 咨询有关详情。

风险提示：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财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其将来表现。分级基金不保本，可能发生亏损。本基金共有三类份额，其中交银新能源份额具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征；交银新能源 A 份额具有低预期风险、预期收益相对稳定的特征；交银新能源 B 份额具有高预期风险、高预期收益的特征。基金管理人并不承诺或保证交银新能源 A 份额的基金份额持有人的约定应得收益，在本基金资产出现极端损失情况下，交银新能源 A 份额的基金份额持有人可能会面临无法取得约定应得收益甚至损失本金的风险。投资有风险，敬请投资者认真阅读基金的相关法律文件，并选择适合自身风险承受能力的投资品种进行投资。

特此公告。

交银施罗德基金管理有限公司

二〇一八年六月九日