

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 分级证券投资基金办理定期份额折算业务的公告

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”）的相关规定，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”）将以 2020 年 1 月 2 日为基金份额定期折算基准日办理定期份额折算业务。相关事项公告如下：

一、基金份额定期折算基准日

根据基金合同的规定，本基金基金份额定期折算基准日为每个会计年度（除基金合同生效日所在会计年度外）的第一个工作日。本次基金份额定期折算基准日为 2020 年 1 月 2 日。

二、基金份额定期折算的对象

基金份额定期折算基准日登记在册的交银新能源 A 份额（基金代码：150217，场内简称“新能源 A”）、交银新能源份额（交银新能源份额的场外份额和场内份额，基金代码：164905，场内简称“交银新能”）。

三、基金份额定期折算方式

1、在本次基金份额定期折算基准日，本基金将对当日登记在册的交银新能源 A 份额进行应得收益的定期份额折算，交银新能源份额的基金份额净值也相应的进行调整。在基金份额折算前与折算后，交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额（基金代码：150218，场内简称：新能源 B）的份额配比保持 1：1 的比例；

2、折算前的交银新能源 A 份额持有人，以交银新能源 A 份额在基金份额折算基准日折算前的基金份额参考净值超出 1.000 元部分，获得新增场内交银新能源份额的份额分配。交银新能源 A 份额持有人持有的交银新能源 A 份额的基金份额参考净值折算调整为 1.000 元、份额数量不变，相应折算增加场内交银新能源份额；

3、折算前的交银新能源份额持有人，以每 2 份交银新能源份额配比 1 份交

银新能源 A 份额进行份额分配，获得新增交银新能源份额。持有场外交银新能源份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外交银新能源份额的分配；持有场内交银新能源份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内交银新能源份额的分配；

4、折算不改变交银新能源 B 份额持有人的资产净值，其持有的交银新能源 B 份额的基金份额参考净值及份额数量不变。

按照上述折算方法，由于计算过程尾差处理的原因，可能会给基金份额持有人的资产净值造成微小误差，该误差归入基金财产，视为未改变基金份额持有人的资产净值。

四、基金份额定期折算公式

1、交银新能源 A 份额

$$NUM_A^{\text{前}} = NUM_A^{\text{后}}$$

$$NAV_A^{\text{后}} = 1.000$$

$$NAV^{\text{后}} = NAV^{\text{前}} - \frac{NAV_A^{\text{前}} - 1.000}{2}$$

交银新能源 A 份额持有人持有的新增场内交银新能源份额的份额数为：

$$\frac{NUM_A^{\text{前}} \times (NAV_A^{\text{前}} - 1.000)}{NAV^{\text{后}}}$$

其中：

$NUM_A^{\text{前}}$ ：份额折算基准日折算前交银新能源 A 份额的份额数；

$NUM_A^{\text{后}}$ ：份额折算基准日折算后交银新能源 A 份额的份额数；

$NAV_A^{\text{前}}$ ：份额折算基准日折算前交银新能源 A 份额的基金份额参考净值；

$NAV_A^{\text{后}}$ ：份额折算基准日折算后交银新能源 A 份额的基金份额参考净值；

$NAV^{\text{前}}$ ：份额折算基准日折算前交银新能源份额的基金份额净值；

$NAV^{\text{后}}$ ：份额折算基准日折算后交银新能源份额的基金份额净值。

2、交银新能源 B 份额

定期份额折算不改变交银新能源 B 份额的基金份额参考净值及其份额数。

3、交银新能源份额

$$NAV^{\text{后}} = NAV^{\text{前}} - \frac{NAV_A^{\text{前}} - 1.000}{2}$$

折算后交银新能源份额持有人持有的新增交银新能源份额的份额数为：

$$\frac{(NAV^{\text{前}} - NAV^{\text{后}}) \times NUM^{\text{前}}}{NAV^{\text{后}}}$$

定期份额折算后交银新能源份额的总份额数 = 定期份额折算前交银新能源的份额数 + 交银新能源份额持有人新增的交银新能源份额的份额数 + 交银新能源 A 份额持有人新增的交银新能源份额的份额数

其中：

NUM^前：份额折算基准日折算前交银新能源份额的份额数；

NAV^前：份额折算基准日折算前交银新能源份额的基金份额净值；

NAV^后：份额折算基准日折算后交银新能源份额的基金份额净值。

4、折算份额数的处理方式

上述定期折算后，场外份额的份额数采用四舍五入的方式保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分舍去，舍去部分所代表的资产计入基金财产；场内份额的份额数取整计算（最小单位为 1 份），小数点以后的部分舍去，舍去部分所代表的资产计入基金财产。

五、基金份额定期折算期间的基金业务办理

1、基金份额定期折算基准日（即 2020 年 1 月 2 日），本基金暂停办理申购、赎回、转托管（包括系统内转托管、跨系统转托管，下同）及份额配对转换业务；新能源 A 正常交易。基准日日终，基金管理人将计算当日基金份额净值及份额折算比例。新能源 B 在整个定期折算期间交易正常进行。

2、基金份额定期折算基准日后的第一个工作日（即 2020 年 1 月 3 日），本基金暂停办理申购、赎回、转托管及份额配对转换业务，新能源 A 暂停交易。当日，本基金登记机构及基金管理人将完成份额登记确认及份额折算。

3、基金份额定期折算基准日后的第二个工作日（即 2020 年 1 月 6 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；当日，本基金恢复办理申购、赎回、转托管及份额配对转换业务（但仍需遵循基金管理人于 2019 年 2 月 21 日发布的《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暂停大额申购业务的公告》及 2019 年 2 月 28 日发布的《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调整大额申购业务限额的公告》中的相关限制，相关限制如有调整，以基金管理人届时最新公告为准）。新能源 A 将于 2020 年 1 月 6 日上午开市起恢复交易。

六、重要提示

1、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 1 月 6 日新能源 A 即时行情显示的前收盘价为 2020 年 1 月 3 日的交银新能源 A 份额的基金份额参考净值（四舍五入至 0.001 元）。由于交银新能源 A 份额在折算前可能存在折溢价交易情形，折算前的收盘价扣除约定收益后与 2020 年 1 月 6 日的前收盘价可能有较大差异，因此 2020 年 1 月 6 日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。

2、本基金交银新能源 A 份额期末的约定应得收益将折算为场内交银新能源份额分配给交银新能源 A 份额的持有人，而交银新能源份额为跟踪国证新能源指数的基础份额，其份额净值将随市场涨跌而变化，因此交银新能源 A 份额持有人预期收益的实现存在一定的不确定性，其可能会承担因市场下跌而遭受损失的风险。

3、由于交银新能源 A 份额经折算产生的新增场内交银新能源份额数和场内交银新能源份额经折算后的份额数将取整计算（最小单位为 1 份），舍去部分计入基金财产，持有极小数量交银新能源 A 份额或场内交银新能源份额的持有人存在无法获得新增场内交银新能源份额的可能性。

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

二〇一九年十二月二十七日