

# 易方达生物科技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《易方达生物科技指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）关于基金不定期份额折算的相关约定，当易方达生物科技指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）之基础份额——易方达生物科技分级份额（场内简称：生物分级；场内代码：161122）的基金份额净值大于 1.5000 元时，本基金将进行不定期份额折算。

截至 2020 年 7 月 22 日收盘，易方达生物科技份额的基金份额净值接近基金合同约定的不定期份额折算阈值，提请投资者密切关注易方达生物科技份额近期基金份额净值的波动情况。

针对不定期份额折算可能带来的风险，基金管理人特别提示如下：

1、相对于易方达生物科技份额，本基金易方达生物科技 A 类份额（场内简称：生物 A；场内代码：150257）为预期风险、收益相对较低的子份额。在因易方达生物科技份额的基金份额净值大于 1.5000 元而触发基金合同约定的不定期份额折算情形时，基金份额折算基准日折算前易方达生物科技 A 类份额超出 1.0000 元的部分将折算为易方达生物科技份额，即不定期份额折算前的易方达生物科技 A 类份额持有人在不定期份额折算后将持有易方达生物科技 A 类份额和易方达生物科技份额。因此，原易方达生物科技 A 类份额的基金份额持有人所持有基金份额的风险收益特征将发生一定的变化，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份额与较高风险收益特征份额的情况。

2、相对于易方达生物科技份额，本基金易方达生物科技 B 类份额（场内简称：生物 B；场内代码：150258）为预期风险、收益相对较高的子份额。在因易方达生物科技份额的基金份额净值大于 1.5000 元而触发基金合同约定的不定期份额折算情形时，基金份额折算基准日折算前易方达生物科技 B 类份额超出 1.0000 元的部分将折算为易方达生物科技份额，即份额折算前的易方达生物科技 B 类份额持有人在份额折算后将持有易方达生物科技 B 类份额与易方达生物科技份额。因此，原易方达生物科技 B 类份额的基金份额持有人的风险收益特征将发生一定的变化，由持有单一的高风险收益特征份额变为同时持有高风险收益特征份额与较高风险收益特征份额的情况。经过折算，易方达生物科技 B 类份额的杠杆将恢复至初始杠杆水平，高于折算前的杠杆倍数。

3、由于易方达生物科技 A 类份额、易方达生物科技 B 类份额折算前可能存在折溢价交

易情形。不定期份额折算后，易方达生物科技 A 类份额、易方达生物科技 B 类份额的折溢价率可能发生较大变化。提请参与二级市场交易的投资者注意与易方达生物科技 A 类份额、易方达生物科技 B 类份额的折溢价变化相关的风险。

4、根据基金合同规定，折算基准日在触发阈值日后才能确定，因此折算基准日易方达生物科技份额的净值可能与触发折算的阈值（1.5000 元）有一定差异。

此外，如本基金发生上述不定期份额折算情形，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、登记结算机构的相关业务规则，暂停 A 类份额与 B 类份额的上市交易、基础份额与 A 类份额/B 类份额之间的份额配对转换和基础份额的申购、赎回、转换、定期定额投资及跨系统转托管等相关业务。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。

5、本基金管理人已于2019年3月8日发布公告，自2019年3月8日起暂停易方达生物科技份额的跨系统转托管（场外转场内）业务。恢复时间将另行公告。

6、根据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》（以下简称《资管新规》）要求，公募产品不得进行份额分级，应在《资管新规》规定的过渡期结束前（即 2020 年 12 月 31 日前）进行整改规范，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。

投资者若希望了解基金不定期份额折算业务详情，请参阅本基金基金合同及《易方达生物科技指数分级证券投资基金管理人的招募说明书》或者拨打本公司客服电话 400 881 8088（免长途话费）。

**风险提示** 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。销售机构根据法规要求对投资者类别、风险承受能力和基金的风险等级进行划分，并提出适当性匹配意见。投资者在投资基金前应认真阅读基金合同和招募说明书（更新）等基金法律文件，全面认识基金产品的风险收益特征，在了解产品情况及听取销售机构适当性意见的基础上，根据自身的风险承受能力、投资期限和投资目标，对基金投资作出独立决策，选择合适的基金产品。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

特此公告。

易方达基金管理有限公司

2020 年 7 月 23 日