

工银瑞信中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提示公告

根据《工银瑞信中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,当工银瑞信中证新能源指数分级证券投资基金(场内简称“新能母基”,交易代码:164821,以下简称“本基金”)之工银新能源B级份额(场内简称“新能B级”,交易代码:150328)的基金份额的基金份额参考净值达到0.2500元时,本基金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10月15日,新能B级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阀值0.2500元,在此提请投资者密切关注新能B级近期参考净值的波动情况。

针对可能发生的不定期份额折算,本基金管理人特别提示如下:

一、由于新能A级、新能B级折算前可能存在折溢价交易情形,不定期份额折算后,新能A级、新能B级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、新能B级表现为高风险、高收益的特征,不定期份额折算后其杠杆将恢复至初始杠杆水平。

三、由于触发折算阀值当日,新能B级的参考净值可能已低于阀值,而折算基准日在触发阀值日后才能确定,此折算基准日新能B级的净值可能与折算阀值0.2500元有一定差异。

四、新能A级表现为低风险、收益相对稳定的特征,但在不定期份额折算后新能A级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新能A级份额变为同时持有较低风险收益特征新能A级份额与较高风险收益特征新能母基的情况,因此新能A级份额持有人预期收益实现的不确定性将会增加。

本基金管理人的其他重要提示:

一、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,持有极小数量新能源母基份额、新能源A级份额、新能B级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。

二、为保证折算期间本基金的平稳运作,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新能A级与新能B级的上市交易和新能源母基的申购及赎回等相关业务。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。

投资者若希望了解基金不定期份额折算业务详情,请参阅《工银瑞信中证新能源指数分级证券投资基金基金合同》、《工银瑞信中证新能源指数分级证券投资基金招募说明书》及其更新或者拨打本公司客服电话:400-811-9999。

三、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。本基金管理人提醒投资者知晓基金投资的“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。敬请投资者投资于本基金前应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。

工银瑞信基金管理有限公司

2018年10月16日