

关于交银施罗德德国证新能源指数分级证券投资基金实施转型的公告

交银施罗德基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）于2020年10月16日起至2020年10月27日止以通讯方式组织召开了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”）的基金份额持有人大会，审议了《关于交银施罗德德国证新能源指数分级证券投资基金转型及修改基金合同有关事项的议案》（以下简称“《议案》”）。《议案》于2020年10月28日获得表决通过，自该日起基金份额持有人大会决议生效，并已报中国证券监督管理委员会备案。本基金管理人已于2020年10月29日发布《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持有人大会表决结果暨决议生效的公告》（以下简称“《决议公告》”）。根据《决议公告》，现就转型相关事项公告如下：

一、关于基金合同等法律文件的修订情况

根据《关于交银施罗德德国证新能源指数分级证券投资基金转型及修改基金合同有关事项议案的说明》，经与基金托管人协商一致，基金管理人已将《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》、《交银施罗德德国证新能源指数分级证券投资基金托管协议》分别修订为《交银施罗德德国证新能源指数证券投资基金（LOF）基金合同》、《交银施罗德德国证新能源指数证券投资基金（LOF）托管协议》，并据此拟定了《交银施罗德德国证新能源指数证券投资基金（LOF）招募说明书》、《交银施罗德德国证新能源指数证券投资基金（LOF）产品资料概要》。

上述文件已经中国证监会证监许可[2020]1998号（《关于准予交银施罗德德国证新能源指数分级证券投资基金变更注册的批复》）准予变更注册。《交银施罗德德国证新能源指数证券投资基金（LOF）基金合同》及《交银施罗德德国证新能源指数证券投资基金（LOF）托管协议》将自2020年11月30日起生效。

二、转型方案实施的安排

本次基金份额持有人大会决议生效后，本基金的转型选择期为2020年10月29日至2020年11月25日，以供基金份额持有人做出赎回、卖出等选择。

选择期期间，交银施罗德国证新能源指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”；本基金基础份额：交银新能源份额，基金代码：164905；稳健收益类份额：交银新能源 A 份额，基金代码：150217，场内简称“新能源 A”；积极收益类份额：交银新能源 B 份额，基金代码：150218，场内简称“新能源 B”）之交银新能源份额的申购赎回业务，以及交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额的交易、合并业务照常办理。基金份额持有人在交银施罗德国证新能源指数分级证券投资基金正式转型前，可以选择卖出交银新能源 A 份额、交银新能源 B 份额或者赎回交银新能源份额。对于在选择期内未作出选择的基金份额持有人，其持有的交银新能源 A 份额、交银新能源 B 份额和交银新能源份额将最终转换为交银施罗德国证新能源指数证券投资基金（LOF）基金份额。

在选择期期间，基金份额持有人选择赎回的，仍适用交银施罗德国证新能源指数分级证券投资基金的赎回费率和赎回费计入基金财产的比例。

在选择期期间，交银施罗德国证新能源指数分级证券投资基金豁免基金合同中约定的投资组合比例限制等条款。

三、交银新能源 A 份额与交银新能源 B 份额的终止上市

基金管理人按照深圳证券交易所的业务规则和《交银施罗德国证新能源指数分级证券投资基金基金合同》等的有关规定向深圳证券交易所申请交银新能源 A 份额与交银新能源 B 份额的终止上市。具体安排详见基金管理人 2020 年 11 月 20 日发布的《交银施罗德国证新能源指数分级证券投资基金之交银新能源 A 份额与交银新能源 B 份额终止上市公告》。

四、交银施罗德国证新能源指数分级证券投资基金基金份额的转换

1、份额转换基准日

选择期结束后，基金管理人将以 2020 年 11 月 26 日为基金份额转换基准日。

自 2020 年 11 月 26 日起，交银施罗德国证新能源指数分级证券投资基金暂停办理申购、赎回、转托管（包括系统内转托管、跨系统转托管，下同）、配对转换等业务。基金转型完毕后，交银施罗德国证新能源指数证券投资基金（LOF）于 2020 年 11 月 30 日起开始办理申购、赎回、转托管等业务。

2、份额转换方式

（1）交银新能源 A 份额及交银新能源 B 份额：

在份额转换基准日日终，以交银新能源份额的基金份额净值为基准，交银新能源 A 份额、交银新能源 B 份额按照各自的基金份额参考净值转换成交银新能源份额的场内份额。交银新能源 A 份额（或交银新能源 B 份额）基金份额持有人持有的转换后交银新能源份额的场内份额取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。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持有基金份额的资产净值减小的风险。对于持有份额数较少的交银新能源 A 份额、交银新能源 B 份额，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。

份额转换计算公式如下：

交银新能源 A 份额（或交银新能源 B 份额）的转换比例 = 份额转换基准日交银新能源 A 份额（或交银新能源 B 份额）的基金份额参考净值 / 份额转换基准日交银新能源份额的基金份额净值

交银新能源 A 份额（或交银新能源 B 份额）基金份额持有人持有的转换后交银新能源份额的场内份额 = 基金份额持有人持有的转换前交银新能源 A 份额（或交银新能源 B 份额）的份额数 × 交银新能源 A 份额（或交银新能源 B 份额）的转换比例

（2）交银新能源份额：

交银新能源份额的场内份额自动转为交银新能源指数（LOF）场内份额，交银新能源份额的场外份额自动转为交银新能源指数（LOF）场外份额。

3、份额转换后的持有期计算

根据有关业务规则，基金份额持有人持有的交银新能源份额转换为交银新能源指数（LOF）份额后，其原基金份额持有期计入交银新能源指数（LOF）份额的持有期；基金份额持有人持有的交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额转换为交银新能源指数（LOF）的场内份额后，基金份额持有期自交银新能源指数（LOF）的场内份额确认之日起计算，基金份额持有人赎回份额时适用的赎回费率将根据持有期确定，具体持有时间以登记结算机构系统记录为准。如果赎回份额时持有期较短，基金份额持有人将承担较高的赎回费。

4、份额转换结果

基金管理人将于 2020 年 11 月 30 日公告份额转换确认结果，基金份额持有

人可以查询其账户内转换后的交银施罗德德国证新能源指数证券投资基金（LOF）基金份额。

五、基金转换的特别风险揭示

1、交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额转换后风险收益特征发生较大变化的风险

份额转换完成后，交银新能源 A 份额持有人原持有的交银新能源 A 份额将变为交银新能源指数（LOF）场内份额，基金份额风险收益特征将因转换而发生较大变化。份额转换完成后，交银新能源 B 份额持有人原持有的交银新能源 B 份额将变为交银新能源指数（LOF）场内份额，基金份额风险收益特征将因转换而发生较大变化。

2、交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额的流动性风险

交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额转换为交银新能源指数（LOF）场内份额前，交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额的持有人可选择以下方式退出：1）在场内买入等量的对应份额（即交银新能源 A 份额持有人买入等量的交银新能源 B 份额，或者交银新能源 B 份额持有人买入等量的交银新能源 A 份额），合并为交银新能源份额的场内份额，按照交银新能源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。由于交银新能源 A 份额和交银新能源 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；2）在场内进行交易。

3、转换前若存在溢价交易的交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额的持有人因溢价消失而造成损失的风险

基金份额转换基准日前，交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额仍可正常交易。期间，交银新能源 A 份额和交银新能源 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。

由于基金份额转换完成后，交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额均按各自的基金份额参考净值（而不是二级市场价格）转换为交银新能源指数（LOF）的场内份额，如果投资者在转换前以溢价买入，转换后可能遭受较大损失。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。

投资者应密切关注交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额的基金份额参考净值变化情况,可通过本基金管理人网站(www.fund001.com)等方式进行查询。

4、交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额的基金份额持有人持有的基金份额数量将会在转换后发生变化的风险

基金份额转换完成后,交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额均按各自的基金份额参考净值(而不是二级市场价格)转换为交银新能源指数(LOF)的场内份额。因此交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额的基金份额持有人持有的基金份额数量将会在转换后发生变化。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 A 份额、交银新能源 B 份额的持有人,存在转换后份额因为不足 1 份而导致相应的资产被强制归入基金资产的风险。

5、交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额转换为交银新能源指数(LOF)的场内份额后无法办理场内赎回的风险

交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额转换为交银新能源指数(LOF)的场内份额后,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。可以在二级市场办理基金买卖的证券公司并不全部具备中国证监会颁发的基金销售资格,而投资者只能通过具备基金销售资格的证券公司赎回基金份额。如果投资者通过不具备基金销售资格的证券公司在二级市场买入交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额,转换为交银新能源指数(LOF)场内份额后可能无法办理场内赎回。对于无法办理场内赎回的投资者,需先转托管至场外后再申请赎回或者先转托管到具有基金销售资格的证券公司后再申请赎回。

6、交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额转换为交银施罗德德国证新能源指数证券投资基金(LOF)的场内份额后自确认之日起计算及收取赎回费的风险

根据有关业务规则,基金份额持有人持有的交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额转换为交银施罗德德国证新能源指数证券投资基金(LOF)的场内份额后,基金份额持有期自交银施罗德德国证新能源指数证券投资基金(LOF)的场内份额确认之日起计算,基金份额持有人赎回份额时适用的赎回费率将根据持有期确定,具体持有时间以登记结算机构系统记录为准。如果赎回份额时持有期较短,基金份额持有人将承担较高的赎回费。

7、在交银新能源指数（LOF）基金合同生效及开放赎回之前，投资者将无法办理基金赎回业务，存在一定的流动性风险。

六、本基金转型后新基金合同的生效

自 2020 年 11 月 30 日起，交银施罗德国证新能源指数分级证券投资基金正式变更为交银施罗德国证新能源指数证券投资基金（LOF），《交银施罗德国证新能源指数证券投资基金（LOF）基金合同》生效，《交银施罗德国证新能源指数分级证券投资基金基金合同》同日失效。

投资者可通过本基金管理人网站（www.fund001.com）查阅相关公告，如有任何疑问，可致电本基金管理人客户服务电话 400-700-5000（免长途话费），（021）61055000 咨询。

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。投资有风险，敬请投资者认真阅读基金的相关法律文件以及关注本基金的特定风险，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

二〇二〇年十一月二十三日