

华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金

不定期份额折算公告

根据《华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金合同》（简称“基金合同”）第二十一部分中关于不定期份额折算的相关规定，当华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）之华安中证证券份额的基金份额净值大于或等于1.5000元时，本基金将对华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金之基础份额（以下简称“华安中证证券份额”，场内简称：“证券股基”，交易代码：160419）、华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金B份额（以下简称“华安中证证券B份额”，场内简称：“证券股B”，交易代码：150302）办理不定期份额折算业务。

截至2019年2月25日，本基金华安中证证券份额的基金份额净值为1.6291元，达到基金合同规定的不定期份额折算条件。根据本基金基金合同以及深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定，本基金将以2019年2月26日为基准日办理不定期份额折算业务。相关事项公告如下：

一、基金份额折算基准日

本次不定期份额折算的基准日为2019年2月26日。

二、基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的华安中证证券份额、华安中证证券B份额。

三、基金份额折算方式

华安中证证券份额、华安中证证券B份额按照基金合同“第二十一部分 基金的份额折算”规则进行不定期份额折算。

当华安中证证券份额的基金份额净值大于或等于1.5000元时，本基金在根据市场情况确定份额折算基准日后将分别对华安中证证券B份额和华安中证证券份额进行不定期份额折算。此类不定期折算不改变华安中证证券A份额的基金份额参考净值及其基金份额数；份额折算后本基金将确保华安中证证券A份额和华安

中证证券B份额的比例为1: 1；华安中证证券B份额的基金份额参考净值超过华安中证证券A份额的基金份额参考净值的部分，折算成场内的华安中证证券份额；份额折算后，华安中证证券份额的基金份额净值、华安中证证券B份额的基金份额参考净值与折算基准日华安中证证券A份额的基金份额参考净值三者相等；份额折算前华安中证证券B份额的基金份额持有人在份额折算后将持有华安中证证券B份额与新增的场内华安中证证券份额；场外华安中证证券份额持有人份额折算后获得新增场外华安中证证券份额，场内华安中证证券份额持有人份额折算后获得新增场内华安中证证券份额。华安中证证券B份额、华安中证证券份额两类份额按照如下公式进行份额折算。

具体折算如下：

1、华安中证证券A份额

此类不定期折算不改变华安中证证券A份额的基金份额参考净值及其基金份额数。

2、华安中证证券 B 份额

份额折算原则：

A. 份额折算后华安中证证券 B 份额与华安中证证券 A 份额的份额配比数保持 1:1 的配比；

B. 华安中证证券 B 份额的基金份额参考净值超过华安中证证券 A 份额的基金份额参考净值的部分，折算成场内的华安中证证券份额；

C. 份额折算后，华安中证证券份额的基金份额净值、华安中证证券 B 份额的基金份额参考净值与折算基准日华安中证证券 A 份额的基金份额参考净值三者相等；

D. 份额折算前华安中证证券 B 份额的基金份额持有人在份额折算后将持有华安中证证券 B 份额与新增的场内华安中证证券份额。

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

$$NAV_B^{\text{后}} = NAV_A^{\text{前}}$$

$$NAV^{\text{后}} = NAV_A^{\text{前}}$$

华安中证证券 B 份额持有人新增的场内华安中证证券份额的份额数=

$$\frac{NUM_B^{\text{前}} \times (NAV_B^{\text{前}} - NAV_A^{\text{前}})}{NAV^{\text{后}}}$$

其中：

$NUM_B^{\text{前}}$ ：不定期份额折算前华安中证证券 B 份额的基金份额数

$NUM_B^{\text{后}}$ ：不定期份额折算后华安中证证券 B 份额的基金份额数

$NAV_A^{\text{前}}$ ：不定期份额折算前华安中证证券 A 份额的基金份额参考净值

$NAV_B^{\text{前}}$ ：不定期份额折算前华安中证证券 B 份额的基金份额参考净值

$NAV_B^{\text{后}}$ ：不定期份额折算后华安中证证券 B 份额的基金份额参考净值

$NAV^{\text{后}}$ ：不定期份额折算后华安中证证券份额的基金份额净值

3、华安中证证券份额

份额折算原则：

场外华安中证证券份额持有人份额折算后获得新增场外华安中证证券份额，场内华安中证证券份额持有人份额折算后获得新增场内华安中证证券份额。

$$NAV^{\text{后}} = NAV_A^{\text{前}}$$

$$NUM^{\text{后}} = \frac{NAV^{\text{前}} \times NUM^{\text{前}}}{NAV^{\text{后}}}$$

其中：

$NAV^{\text{前}}$ ：不定期份额折算前华安中证证券份额的基金份额净值

$NUM^{\text{前}}$ ：不定期份额折算前华安中证证券份额的基金份额数

$NUM^{\text{后}}$ ：不定期份额折算后华安中证证券份额的基金份额数

四、不定期份额折算示例

假设在本基金的不定期份额折算日，华安中证证券份额的基金份额净值、华安中证证券A份额与华安中证证券B份额的基金份额参考净值如下表所示，折算后，华安中证证券份额的基金份额净值、华安中证证券B份额的基金份额参考净值均调整华安中证证券A份额的基金份额参考净值，则各持有华安中证证券份额、华安中证证券A份额、华安中证证券B份额10,000份的基金份额持有人所持基金份额的变化如下表所示：

	折算前		折算后		
	份额（参考）净值	基金份额数	份额（参考）净值	份额数	新增场内母份额
华安中证证券份额	1.5000 元	100,000 份	1.0200 元	100,000 份	47,058 份
华安中证证券 A 份额	1.0200 元	100,000 份	1.0200 元	100,000 份	
华安中证证券 B 份额	1.9800 元	100,000 份	1.0200 元	100,000 份	94,117 份

五、基金份额折算期间的基金业务办理

（一）不定期份额折算基准日（即2019年2月26日），本基金暂停办理申购、赎回、转托管（包括场外转托管、跨系统转托管，下同）、配对转换业务；华安中证证券A份额、华安中证证券B份额正常交易。当日晚间，基金管理人计算当日基金份额（参考）净值及份额折算比例。

（二）不定期份额折算基准日后的第一个工作日（即2019年2月27日），本基金暂停办理申购、赎回、转托管、配对转换业务，华安中证证券B份额暂停交易，华安中证证券A份额正常交易。当日，本基金管理人为持有人办理份额登记确认。

（三）不定期份额折算基准日后的第二个工作日（即2019年2月28日），基金管理人将公告份额折算确认结果，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、配对转换业务，华安中证证券B份额将于2019年2月28日开市复牌，华安中证证券A份额正常上市交易。

（四）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》，华安中证证券B份额2019年2月28日即时行情显示的前收盘价将调整为2019年2月27日的华安中证证券B份额的基金份额参考净值（四舍五入至0.001元）。由于华安中证证券B份额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

2019年2月28日的前收盘价可能有较大差异，2月28日当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。

六、重要提示

1、本基金证券股B将于2019年2月27日全天停牌，并于2019年2月28日开市复牌；证券股A正常交易。

2、本基金华安中证证券A份额表现为低风险、收益相对稳定的特征，本次不定期份额折算将不改变本基金华安中证证券A份额的基金份额参考净值及其份额数。

3、华安中证证券B份额表现为高风险、高收益的特征，但在不定期份额折算后，原华安中证证券B份额的持有人将同时持有高风险收益特征华安中证证券B份额与较高风险收益特征华安中证证券A份额，风险收益特征将发生变化，且折算后其杠杆倍数将大幅提升，由目前的杠杆水平恢复到约2倍杠杆水平。此外，华安中证证券B份额的基金份额参考净值随市场涨跌而增长或者下降的幅度也会增加。

4、由于华安中证证券A份额、华安中证证券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，华安中证证券A份额、华安中证证券B份额的折溢价率可能发生变化。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。

5、此类不定期份额折算后，本基金场外华安中证证券份额将获得场外华安中证证券份额，场内华安中证证券份额、华安中证证券B份额将获得新增的场内华安中证证券份额。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，持有极小数量华安中证证券B份额和场内华安中证证券份额的持有人，存在折算后份额因为不足1份而导致相应的资产被强制归入基金资产的风险。

6、华安中证证券份额折算基准日的基金份额净值与折算条件1.5000元可能有一定差异。

7、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。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。敬请投资者注意投资风险。

8、投资者若希望了解基金不定期份额折算业务详情，可访问本公司网站（www.huaan.com.cn）或拨打全国免长途话费的客户服务电话（40088-50099）咨询相关情况。

特此公告。

华安基金管理有限公司
二〇一九年二月二十六日