
华安中证银行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《华安中证银行指数分级证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”), 的相关约定, 华安中证银行指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)将以 2019 年 12 月 16 日为折算基准日办理定期份额折算业务。本基金的基金份额包括华安中证银行指数分级证券投资基金的基础份额(以下简称“华安中证银行份额”, 场内简称:“银行股基”, 交易代码: 160418)、华安中证银行指数分级证券投资基金的稳健收益类份额(以下简称“华安中证银行 A 份额”, 场内简称:“银行股 A”, 交易代码: 150299)和华安中证银行指数分级证券投资基金的积极收益类份额(以下简称“华安中证银行 B 份额”, 场内简称:“银行股 B”, 交易代码: 150300)。相关事项提示如下:

一、基金份额折算基准日

每个会计年度的 12 月 15 日(遇节假日顺延)。

本基金将以 2019 年 12 月 16 日为折算基准日办理定期份额折算业务。

二、基金份额折算对象

基金份额定期折算基准日登记在册的华安中证银行 A 份额和华安中证银行份额, 华安中证银行 B 份额不参与定期折算。

三、基金份额折算方式

华安中证银行 A 份额和华安中证银行 B 份额按照规定的净值计算规则进行基金份额参考净值计算, 对华安中证银行 A 份额的约定基准收益进行定期份额折算, 每 2 份华安中证银行份额将按 1 份华安中证银行 A 份额获得约定基准收益的新增折算份额。在基金份额定期折算前与折算后, 华安中证银行 A 份额和华安中证银行 B 份额的份额配比保持 1: 1 的比例不变。

基金份额折算基准日折算前, 华安中证银行 A 份额的基金份额参考净值超出 1.0000 元部分, 将被折算为场内华安中证银行份额分配给华安中证银行 A 份额持有人。华安中证银行份额持有人持有的每 2 份华安中证银行份额将获得按照 1 份华安中证银行 A 份额分配的新增华安中证银行份额。

持有场外华安中证银行份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外

华安中证银行份额；持有场内华安中证银行份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内华安中证银行份额。经过上述份额折算，华安中证银行 A 份额的参考净值和华安中证银行份额的基金份额净值将相应调整。

每个会计年度的 12 月 15 日（遇节假日顺延）为定期份额折算基准日，本基金将对华安中证银行 A 份额和华安中证银行份额进行定期份额折算。有关计算公式如下：

1、华安中证银行 A 份额折算

定期份额折算前后，华安中证银行 A 份额数不变，即： $NUM_A^{\text{后}} = NUM_A^{\text{前}}$

$$NAV^{\text{后}} = NAV^{\text{前}} - 0.5 \times (NAV_A^{\text{前}} - 1.000)$$

$$\begin{aligned} & \text{华安中证银行 A 份额持有人新增的场内华安中证银行份额的份额数} \\ &= \frac{NUM_A^{\text{前}} \times (NAV_A^{\text{前}} - 1.000)}{NAV^{\text{后}}} \end{aligned}$$

其中：

$NUM_A^{\text{前}}$ ：定期份额折算前华安中证银行 A 份额的基金份额数

$NUM_A^{\text{后}}$ ：定期份额折算后华安中证银行 A 份额的基金份额数

$NAV_A^{\text{前}}$ ：华安中证银行 A 份额定期份额折算基准日折算前的基金份额参考净值

$NAV^{\text{前}}$ ：定期份额折算前华安中证银行份额的基金份额净值

$NAV^{\text{后}}$ ：定期份额折算后华安中证银行份额的基金份额净值

华安中证银行 A 份额折算成华安中证银行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。

（2）华安中证银行 B 份额不参与定期份额折算，其基金份额参考净值与份额数在定期折算前后保持不变。

（3）华安中证银行份额折算

$$NAV^{\text{后}} = NAV^{\text{前}} - 0.5 \times (NAV_A^{\text{前}} - 1.000)$$

华安中证银行份额持有人新增的华安中证银行份额的份额数=

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

定期份额折算后华安中证银行份额持有人持有的份额数 = 定期份额折算前华安中证银行份额的份额数 + 华安中证银行份额持有人新增的华安中证银行份额的份额数，其中：

$NAV^{\text{后}}$ ：定期份额折算后华安中证银行份额的基金份额净值

$NAV^{\text{前}}$ ：定期份额折算前华安中证银行份额的基金份额净值

$NAV_A^{\text{前}}$ ：华安中证银行 A 份额定期份额折算基准日折算前的基金份额参考净值

$NUM^{\text{前}}$ ：定期份额折算前华安中证银行份额的份额数

华安中证银行份额的场外份额经折算后的份额数采用截位法保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产；华安中证银行份额的场内份额经折算后的份额数取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。

在实施定期份额折算时，折算日折算前华安中证银行份额的基金份额净值以及华安中证银行 A 份额的参考净值等具体见基金管理人届时发布的相关公告。

四、基金份额折算期间的基金业务办理

1、定期份额折算基准日（即 2019 年 12 月 16 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）业务、配对转换业务；华安中证银行 A 份额、华安中证银行 B 份额正常交易。当日晚间，本基金管理人计算当日基金份额（参考）净值及份额折算比例。

2、定期份额折算基准日后的第一个工作日（即 2019 年 12 月 17 日），本基金暂停办理申购、赎回、转托管、配对转换业务，华安中证银行 A 份额暂停交易，华安中证银行 B 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。

3、定期份额折算基准日后的第二个工作日（即 2019 年 12 月 18 日），本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，本基金管理人恢复办理申购、赎回、转托管、配对转换业务，华安中证银行 A 份额将于 2019 年 12 月 18 日开市复牌，华安中证银行 B 份额正常交易。

4、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》，华安中证银行 A 份额 2019 年 12 月 18 日即时行情显示的前收盘价调整为 2019 年 12 月 17 日的华安中证银行 A 份额的基金份额参考净值（四舍五入至 0.001 元）。由于华安中证银行 A 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

12月18日的前收盘价可能有较大差异,12月18日当日可能出现交易价格大幅波动的情形。

五、重要提示

(一) 由于华安中证银行 A 份额新增份额折算成华安中证银行份额的场内份额数和华安中证银行份额的场内份额经折算后的份额数取整计算(最小单位为 1 份),舍去部分计入基金财产,持有较少华安中证银行 A 份额或场内华安中证银行份额的份额持有人存在无法获得新增场内华安中证银行份额的可能性。因此,上述份额持有人可在基金份额折算基准日之前将原有份额卖出或者赎回或者增加持有份额的数量来保证自身权益不受损害。

(二) 华安中证银行 A 份额的约定应得收益将折算成场内华安中证银行份额分配给华安中证银行 A 份额的持有人,而华安中证银行份额为跟踪中证银行指数的基础份额,其份额净值将随市场涨跌而变化,因此华安中证银行 A 份额持有人预期收益的实现存在一定的不确定性,可能会承担因市场下跌而遭受损失的风险。

(三) 在二级市场可以做交易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。因此,如果投资者通过不具备基金销售资格的证券公司购买华安中证银行 A 份额,在不定期份额折算后,则折算新增的华安中证银行份额无法赎回。投资者可以选择在折算前将华安中证银行 A 份额卖出,或者在折算后将新增的华安中证银行份额转托管到具有基金销售资格的证券公司后赎回。

投资者若希望了解本基金定期份额折算业务详情,请登录本基金管理人网站(www.huaan.com.cn)或拨打客户服务电话(40088-50099)咨询详情。

本公司承诺以诚实信用、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。投资者投资于基金前应认真阅读基金的基金合同、招募说明书等文件。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

华安基金管理有限公司

2019 年 12 月 11 日