

关于中海中证高铁产业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《中海中证高铁产业指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）关于基金定期份额折算的相关约定，在存续期内的每个运作周年的结束日，基金份额定期折算基准日登记在册的中海中证高铁份额（基金代码：502030）、中海中证高铁 A 份额（场内简称：高铁 A；场内代码：502031）将进行定期份额折算。

本基金于 2015 年 7 月 31 日成立，根据合同约定，若某运作周年结束日为非工作日，则该运作周年的结束日顺延至之后的第一个工作日，故第一个运作周期的结束日为 2016 年 8 月 1 日，同样也是基金份额折算基准日。

相关事项公告如下：

（1）基金份额折算基准日

本次定期份额折算的基准日为 2016 年 8 月 1 日。

（2）基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的中海中证高铁 A 份额、中海中证高铁份额。

（3）基金份额折算方式

中海中证高铁 A 份额和中海中证高铁 B 份额按照基金合同中规定的基金份额参考净值计算规则进行基金份额参考净值计算，对中海中证高铁 A 份额的约定应得收益进行定期份额折算，每 2 份中海中证高铁份额将按 1 份中海中证高铁 A 份额获得约定应得收益的新增折算份额。在基金份额折算前与折算后，中海中证高铁 A 份额和中海中证高铁 B 份额的份额配比保持 1：1 的比例。

中海中证高铁 A 份额、中海中证高铁 B 份额与中海中证高铁份额三类份额的折算公式如下：

（1）中海中证高铁 A 份额

定期份额折算后中海中证高铁 A 份额的份额数=定期份额折算前中海中证高铁 A 份额的份额数

$$NAV_{\text{基础}}^{\text{后}} = \frac{NAV_{\text{基础}}^{\text{前}} \times NUM_{\text{基础}}^{\text{前}} - (NAV_A^{\text{前}} - 1.000) / 2 \times NUM_{\text{基础}}^{\text{前}}}{NUM_{\text{基础}}^{\text{前}}}$$

中海中证高铁 A 份额持有人新增的场内中海中证高铁份额数量 =

$$\frac{NUM_A^{\text{前}} \times (NAV_A^{\text{前}} - 1.000)}{NAV_{\text{基础}}^{\text{后}}}$$

其中：

$NAV_A^{\text{前}}$ 为折算前中海中证高铁 A 份额的基金份额参考净值

$NUM_A^{\text{前}}$ 为折算前中海中证高铁 A 份额的份额数

$NAV_{\text{基础}}^{\text{后}}$ 为折算后中海中证高铁份额的基金份额净值

$NUM_{\text{基础}}^{\text{前}}$ 为折算前中海中证高铁份额的份额数

(2) 中海中证高铁 B 份额

每个运作周年的定期份额折算不改变中海中证高铁 B 份额的基金份额参考净值及其份额数。

(3) 中海中证高铁份额

$$NAV_{\text{基础}}^{\text{后}} = \frac{NAV_{\text{基础}}^{\text{前}} \times NUM_{\text{基础}}^{\text{前}} - (NAV_A^{\text{前}} - 1.000) / 2 \times NUM_{\text{基础}}^{\text{前}}}{NUM_{\text{基础}}^{\text{前}}}$$

中海中证高铁份额持有人新增的中海中证高铁份额 =

$$\frac{NUM_{\text{基础}}^{\text{前}}}{2} \times \frac{(NAV_A^{\text{前}} - 1.000)}{NAV_{\text{基础}}^{\text{后}}}$$

定期份额折算后中海中证高铁份额持有人持有的中海中证高铁份额的份额数 = 定期份额折算前中海中证高铁份额的份额数 + 中海中证高铁份额持有人新增的中海中证高铁份额的份额数

其中：

$NAV_A^{\text{前}}$ 为折算前中海中证高铁 A 份额的基金份额参考净值

$NAV_{\text{基础}}^{\text{后}}$ 为折算后中海中证高铁份额的基金份额净值

$NUM_{\text{基础}}^{\text{前}}$ 为折算前中海中证高铁份额的份额数

(4) 折算期间份额的处理方式

中海中证高铁份额的场外份额经折算后的份额数采用截尾法保留到小数点后两位；中海中证高铁份额的场内份额经折算后的份额数，以及中海中证高铁 A 份额折算成中海中证高铁份额的场内份额数均取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。

按照上述折算和计算方法，可能会给基金份额持有人的资产净值造成微小误差，视为未改变基金份额持有人的资产净值。

四、基金份额折算期间的基金业务办理：

1、定期折算基准日（即 2016 年 8 月 1 日），本基金暂停办理申购（含定期定额投资）、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；中海中证高铁 A 份额，中海中证高铁 B 份额正常交易。 当日晚间，基金管理人计算当日基金份额净值的中海中证高铁基金份额净值、中海中证高铁 A 份额与中海中证高铁 B 份额的基金份额参考净值，以及计算基础份额、中海中证高铁 A 类份额新增份额的份额折算比例。

2、定期折算基准日后的第一个工作日（即 2016 年 8 月 2 日），本基金暂停办理申购（含定期定额投资）、赎回、转托管、配对转换业务，中海中证高铁 A 份额全天暂停交易。当日，本基金登记机构及基金管理人为基金份额持有人办理份额登记确认。中海中证高铁 B 份额在整个定期折算期间交易正常进行。

3、定期折算基准日后的第二个工作日（即 2016 年 8 月 3 日），基金管理人将公告份额折算确认结果，基金份额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（含定期定额投资）、赎回、转托管、配对转换、二级市场交易业务。 上述安排如有调整，基金管理人将另行发布公告，具体详见基金管理人届时发布的相关公告。

4、2016 年 8 月 3 日场内中海中证高铁 A 份额即时行情显示的前收盘价为 2016 年 8 月 2 日的中海中证高铁 A 份额的基金份额参考净值（四舍五入至 0.001 元）。

上述安排如有调整，基金管理人将另行发布公告，具体详见基金管理人届时发布的相关公告。

五、重要提示

1、根据上海证券交易所的相关业务规则，2016年8月3日中海中证高铁产业分级A类份额当日即时行情显示的前收盘价为中海中证高铁产业分级A类份额的基金份额参考净值（四舍五入至0.001元）。由于中海中证高铁产业分级A类份额折算前可能存在折溢价交易情形，且折算前的收盘价在扣除上一运作周年约定收益后，与其份额折算后次日前收盘价可能有较大差异，故2016年8月3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。

2、本基金中海中证高铁A份额期末的约定应得收益将折算为场内中海中证高铁份额分配给中海中证高铁A份额的持有人，而中海中证高铁份额为跟踪中证高铁指数的基础份额，其份额净值将随市场涨跌而变化，因此中海中证高铁A份额持有人预期收益的实现存在一定的不确定性，其可能会承担因市场下跌而遭受损失的风险。

3、由于中海中证高铁A份额经折算产生的新增场内中海中证高铁份额数和场内中海中证高铁份额经折算后的份额数将取整计算（最小单位为1份），舍去部分计入基金财产，持有极小数量中海中证高铁A份额或场内中海中证高铁份额的持有人存在无法获得新增场内中海中证高铁份额的可能性。

4、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。

中海基金管理有限公司

2016年7月27日