

中海基金管理有限公司关于中海中证高铁产业指数分级证券投资基金办理不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”）关于基金不定期份额折算的相关约定，当中海中证高铁产业指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）之 B 类份额的基金份额参考净值小于 0.2500 元时，中海中证高铁产业分级份额（场内简称：高铁分级；场内代码 502030）、中海中证高铁产业分级 A 类份额（场内简称：高铁 A；场内代码 502031）、中海中证高铁产业分级 B 类份额（场内简称：高铁 B；场内代码 502032）将进行不定期份额折算。

截至 2018 年 10 月 18 日，中海中证高铁产业分级 B 类份额的基金份额参考净值为 0.245 元，达到基金合同规定的不定期份额折算条件。根据基金合同约定，以及上海证券交易所、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 2018 年 10 月 19 日为基准日办理不定期份额折算业务。

相关事项公告如下：

（1）基金份额折算基准日

本次不定期份额折算的基准日为 2018 年 10 月 19 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 B 份额与中海中证高铁份额（含场内份额、场外份额）。

（3）基金份额折算方式

份额折算前后本基金将确保中海中证高铁 A 份额和中海中证高铁 B 份额的比例为 1:1，份额折算后中海中证高铁份额的基金份额净值、中海中证高铁 A 份额和中海中证高铁 B 份额的基金份额参考净值均调整为 1.000 元。

中海中证高铁 B 份额、中海中证高铁 A 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 B 份额

份额折算原则：

份额折算前中海中证高铁 B 份额的资产净值与份额折算后中海中证高铁 B 份额的资产净值相等。

$$NUM_B^{\text{后}} = \frac{NAV_B^{\text{前}} \times NUM_B^{\text{前}}}{1.000}$$

其中：

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

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

$NUM_B^{\text{后}}$ 为折算后中海中证高铁 B 份额的份额数

2) 中海中证高铁 A 份额

份额折算原则：

① 份额折算前后中海中证高铁 A 份额与中海中证高铁 B 份额的份额数始终保持 1: 1 配比；

② 份额折算前中海中证高铁 A 份额的资产净值与份额折算后中海中证高铁 A 份额的资产净值及新增场内中海中证高铁份额的资产净值之和相等；

③ 份额折算前中海中证高铁 A 份额的持有人在份额折算后将持有中海中证高铁 A 份额与新增场内中海中证高铁份额。

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

$$NUM_{\text{基础}}^{\text{场内新增}} = \frac{NAV_A^{\text{前}} \times NUM_A^{\text{前}} - NUM_A^{\text{后}} \times 1.000}{1.000}$$

其中：

$NUM_A^{\text{后}}$ 为折算后中海中证高铁 A 份额的份额数

$NUM_B^{\text{后}}$ 为折算后中海中证高铁 B 份额的份额数

$NUM_{\text{基础}}^{\text{场内新增}}$ 为份额折算前中海中证高铁 A 份额持有人在份额折算后所持有的新增的场内中海中证高铁份额的份额数

$NAV_A^{\text{前}}$ 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

3) 中海中证高铁份额:

份额折算原则:

份额折算前中海中证高铁份额的资产净值与份额折算后中海中证高铁份额的资产净值相等。

$$NUM_{\text{基础}}^{\text{后}} = \frac{NAV_{\text{基础}}^{\text{前前}} \times NUM}{1.000}$$

其中:

$NAV_{\text{基础}}^{\text{前}}$ 为折算前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

$NUM_{\text{基础}}^{\text{后}}$ 为折算后原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

(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、中海中证高铁 B 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、不定期折算基准日(即 2018 年 10 月 19 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; 高铁 A 份额与 B 份额将于当日上午 9:30-10:30 停牌一小时, 并于上午 10:30 复牌。当日晚间, 基金管理人计算当日基金份额净值及份额折算比例。

2、不定期折算基准日后的第一个工作日(即 2018 年 10 月 22 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, 高铁 A、高铁 B 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。

3、不定期折算基准日后的第二个工作日(即 2018 年 10 月 23 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、2018年10月23日场内中海中证高铁A份额、中海中证高铁B份额即时行情显示的前收盘价为2018年10月22日的中海中证高铁A份额、中海中证高铁B份额的基金份额参考净值（四舍五入至0.001元）。

5、2018年10月23日中海中证高铁A份额、中海中证高铁B份额均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。

五、重要提示

1、本基金中海中证高铁A类份额与B类份额将于2018年10月19日上午9:30-10:30停牌一小时，并于2018年10月19日上午10:30复牌。

本基金场内中海中证高铁A类份额、中海中证高铁B类份额将于2018年10月22日停牌1个交易日，并于2018年10月23日开市起复牌。

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。

2、由于场内中海中证高铁A类份额、中海中证高铁B类份额折算前可能存在折溢价交易情形，不定期份额折算后，场内中海中证高铁A类份额、中海中证高铁B类份额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折溢价所带来的风险。

3、中海中证高铁B类份额表现为高风险、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。

4、由于触发折算阈值当日，中海中证高铁B类份额的参考净值可能已低于阈值，而折算基准日在触发阈值日后才能确定，此折算基准日中海中证高铁B类份额的参考净值可能与折算阈值0.2500元有一定差异。

5、中海中证高铁A类份额表现为低风险、收益相对稳定的特征，但在不定期份额折算后中海中证高铁A类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中海中证高铁A类份额变为同时持有较低风险收益特征中海中证高铁A类份额与较高风险收益特征中海中证高铁份额的情况，因

此中海中证高铁 A 类份额持有人预期收益实现的不确定性将会增加。

6、中海中证高铁 A 类份额持有人可通过办理配对转换业务将此次折算获得的场内中海中证高铁份额分拆为中海中证高铁 A 类份额和中海中证高铁 B 类份额。

7、根据上海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，持有极小数量中海中证高铁份额、中海中证高铁 A 类份额、中海中证高铁 B 类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。

8、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中海中证高铁 A 类份额，在不定期份额折算后，则折算新增的中海中证高铁份额无法赎回。投资者可以选择在折算前将中海中证高铁 A 类份额卖出，或者在折算后将新增的中海中证高铁份额转托管到具有基金销售资格的证券公司后赎回。

9、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

2018 年 10 月 19 日