

# 关于中海中证高铁产业指数分级证券投资基金不定期份额折算 结果及恢复交易的公告

根据《中海中证高铁产业指数分级证券投资基金基金合同》及上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定，中海基金管理有限公司（以下简称“本公司”）以2018年10月19日为份额折算基准日，对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”）之基础份额（即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，包括场外份额、场内份额）、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）和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）实施了不定期份额折算。现将相关事项公告如下：

## 一、份额折算结果

2018年10月19日，场外中海中证高铁产业分级份额经折算后的份额数按截位法保留到小数点后两位，舍去部分计入基金财产；场内中海中证高铁产业分级份额、中海中证高铁产业分级A类份额、中海中证高铁产业分级B类份额经折算后的份额数取整计算（最小单位为1份），不足1份的零碎份加总后保留至整数位（最小单位为1份），按各个场内份额持有人的零碎份从大到小的排序，依次向相应的基金份额持有人记增1份，直到所有零碎份的合计份额分配完毕。

折算前后场外中海中证高铁产业分级份额、场内中海中证高铁产业分级份额、中海中证高铁产业分级A类份额、中海中证高铁产业分级B类份额的份额余额，以及折算前后基金份额净值（或基金份额参考净值）如下表所示：

基金代码	份额名称	折算前基金份额净值（或基金份额参考净值）	折算前份额数量（份）	份额折算比例	折算后份额数量（份）	折算后基金份额净值（或基金份额参考净值）
------	------	----------------------	------------	--------	------------	----------------------

		(元)				(元)
502030	场 外 高 铁 分 级	0.637	24,046,948.47	0.636532	15,306,643.96	1.000
502030	场 内 高 铁 分 级	0.637	373,124	0.636532	237,506.00	1.000
502031	高 铁 A	1.011	2,933,898	0.262241	769,389.00	1.000
				0.748581	2,196,261.00 (注)	
502032	高 铁 B	0.263	2,933,898	0.262241	769,389.00	1.000

注：中海中证高铁产业分级 A 类份额经折算后产生新增的场内中海中证高铁产业分级份额。

## 二、恢复交易

自 2018 年 10 月 23 日起，本基金恢复赎回、转换、转托管（包括系统内转托管、跨系统转托管）、配对转换业务，中海中证高铁产业分级 A 类份额、中海中证高铁产业分级 B 类份额将于 2018 年 10 月 23 日开市后复牌。

2018 年 10 月 23 日复牌首日中海中证高铁产业分级 A 类份额、中海中证高铁产业分级 B 类份额的即时行情的前收盘价为 2018 年 10 月 22 日的中海中证高铁产业分级 A 类份额、中海中证高铁产业分级 B 类份额的基金份额参考净值（结果四舍五入至 0.001 元），分别为 1.000 元和 1.070 元。2018 年 10 月 23 日，

中海中证高铁产业分级 A 类份额、中海中证高铁产业分级 B 类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。

### 三、重要提示

1、由于中海中证高铁产业分级 A 类份额、中海中证高铁产业分级 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，中海中证高铁产业分级 A 类份额、中海中证高铁产业分级 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。

2、中海中证高铁产业分级 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。

3、中海中证高铁产业分级 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产业分级 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产业分级 A 类份额变为同时持有较低风险收益特征中海中证高铁产业分级 A 类份额与较高风险收益特征中海中证高铁产业分级 B 类份额的情况，因此中海中证高铁产业分级 A 类份额持有人预期收益实现的不确定性将会增加。

4、中海中证高铁产业分级 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产业分级 A 类份额分拆为中海中证高铁产业分级 A 类份额和中海中证高铁产业分级 B 类份额。

5、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产业分级 B 类份额、中海中证高铁产业分级 A 类份额、中海中证高铁产业分级 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。

6、投资者若希望了解基金不定期份额折算业务详情, 请参阅本基金基金合同及《中海中证高铁产业指数分级证券投资基金招募说明书》或者拨打本公司客服电话 4008889788（免长途话费）。

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。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23日