汇添富基金管理股份有限公司关于上证上海改革发展主题交易型开放式指数发起式证券投资基金办理基金份额转换业务的公告

根据《上证上海改革发展主题交易型开放式指数发起式证券投资基金基金合同》（简称“基金合同”）和 2019 年 7 月 9 日的《汇添富基金管理股份有限公司关于上证上海改革发展主题交易型开放式指数发起式证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》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，上证上海改革发展主题交易型开放式指数发起式证券投资基金（简称“本基金”或“上海改革发展 ETF”）将以 2019 年 8 月 19 日为基准日办理份额转换业务。相关事项公告如下：

一、基金份额转换基准日

2019 年 8 月 19 日

二、基金份额转换对象

基金份额转换基准日登记在册的上证上海改革发展主题交易型开放式指数发起式证券投资基金基金份额（场内简称：上海改革，基金代码：510820）

三、基金份额转换期间

自 2019 年 8 月 19 日起，预计份额转换将进行 7 个工作日。

四、基金份额折算方式

基金管理人将以 2019 年 8 月 19 日为基金份额转换基准日，将上海改革发展 ETF 的基金份额转换成中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“上海国企 ETF”）的基金份额。假设上海改革发展 ETF 和上海国企 ETF 的基金份额在份额转换基准日的基金份额净值为 A 元和 B 元（仅为折算之目的，精确到小数点后第 8 位，小数点后第 9 位四舍五入），具体计算过程如下：

上海改革发展ETF折算成上海国企ETF的基金份额数 = 上海改革发展ETF的基金份额数×份额转换基准日上海改革发展 ETF 的基金份额净值 A / 份额转换基准日上海国企 ETF 的基金份额净值 B

折算后的份额数采用截位法保留到整数，再按照份额转换基准日上海改革发展 ETF 的持有人名册，将折算后的上海国企 ETF 份额按各投资者持有份额占比分配给上海改革发展 ETF 持有人。由于在将折算后上海国企 ETF 份额按比例分配给上海改革发展 ETF 持有人后的份额数时，每位持有人获配的基金份额数需取整计算（最小单位为 1 份），不足 1 份的零碎份额，基金管理人将所有零碎份额归集起来，按各个零碎份额从大到小的排序，依次向相应的基金份额持有人记增 1 份，直到所有零碎份额的合计份额分配完毕。转换完成。

例：份额转换基准日上海改革发展 ETF 共计 1,000,000,000 份基金份额，转换基准日上海改革发展 ETF 的基金份额净值为 0.97382345 元，上海国企 ETF 的基金份额净值 1.02665678，份额转换后：

折算后的上海国企 ETF 基金份额数＝

1,000,000,000×0.97382345/1.02665678=948,538,468.72 份（四舍五入保留到小数点后 2 位）=948,538,468（保留至整数位）

五、重要提示

1、基金份额转换过程中，上海改革发展 ETF 和上海国企 ETF 暂停申赎、交易、估值的风险

由于在实施合并方案的过程中，基金管理人会根据相关法律法规和实际情况暂停申购、赎回或场内交易业务，以及暂停基金估值，投资者会在一定期间内无法赎回持有的上海改革发展 ETF 和上海国企 ETF 的基金份额。

2、在上海改革发展 ETF 基金份额转换过程中，上海改革发展 ETF 和上海国企 ETF 的投资者无法查询基金份额和基金份额净值的风险

由于在份额转换过程中，上海改革发展 ETF 会同时办理基金的摘牌退市和基金份额的退登记工作，将导致上海改革发展 ETF 和上海国企 ETF 的投资者从份额折算基准日当天晚上至份额折算全部完成的时间内，可能无法查询原有基金份额和基金份额净值。在完成份额折算后，基金管理人将及时公告折算结果，并按照《中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的约定披露基金份额净值。

3、因份额折算导致持有人持有基金份额数变化的风险

由于在份额转换基准日当天，两只基金的基金份额净值存在差异，可能存在折算后的上海国企ETF基金份额数少于原上海改革发展ETF持有的基金份额数，甚至有可能小于上海国企 ETF 的最小申购赎回单位，那么投资者面临持有的基金份额只能在场内卖出，不能赎回的风险。

根据上海证券交易所的相关业务规则，在份额转换的计算过程中，折算份额均取整计算（最小单位为 1 份），不足 1 份的零碎份额，按各个零碎份额从大到小的排序，依次向相应基金额持有人记增 1 份，直到所有零碎份额的合计份额分配完毕，因此，存在部分持有人可能因为份额取整导致的微小损失。

4、上海改革发展 ETF 和上海国企 ETF 作为融资融券担保物，在基金合并过程中名义价值暂时显著降低从而间接导致该等投资者经济损失的风险

上海改革发展 ETF 或上海国企 ETF 若被作为融资融券担保物的，在本次基金合并操作过程中，发生上海改革发展 ETF 和上海国企 ETF 暂停交易、暂停估值等情形的，将导致其作为担保物的名义价值显著降低，造成担保物价值与其融资融券债务之间的比例低于维持担保比例，融资融券客户将可能被证券公司要求追加担保物，如无法按照融资融券业务约定的时间、数量追加担保物时，将可能面临担保物被证券公司强制平仓的风险，进而可能会给该等投资者造成经济损失。

5、上海国企 ETF 作为约定购回式证券交易的标的证券，在基金合并过程中短期内无估值价格可能导致投资者面临被动提前购回的风险

由于上海国企 ETF 在合并期间，存在短暂几天无法估值的问题，因此，可能导致将上海国企 ETF 作为约定购回式证券交易的标的证券的投资者，面临被动提前购回的风险。

6、上海国企 ETF 作为股票质押回购交易业务的补充质押的标的证券，在基金合并过程中短期内无估值可能导致投资者面临补充质押无法成交以及突破证券公司关于质押率要求的风险

由于上海国企 ETF 在合并期间，存在短暂几天无法估值的问题，因此，可能导致将上海国企 ETF 作为股票质押回购交易业务的补充质押标的证券的投资者，面临补充质押无法成交的风险，以及由于上海国企 ETF 作为质押物的名义

价值可能降低，导致融入方客户的质押率突破证券公司关于质押率要求的风险。

投资者可登陆本公司网站（www.99fund.com）查询相关信息或拨打客户服务电话（400-888-9918）咨询相关事宜。

汇添富基金高度重视投资者服务和投资者教育，特此提醒投资者需正确认知基金投资的风险和长期受益，做理性的基金投资人，做明白的基金投资人，享受长期投资的快乐！

特此公告。

汇添富基金管理股份有限公司

2019年8月15日