

泰达宏利基金管理有限公司

关于泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金实施转型的公告

泰达宏利基金管理有限公司（以下简称“我公司”）于2019年9月27日以现场方式召开泰达宏利中证500指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金份额持有人大会，审议《关于泰达宏利中证500指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》（以下简称“大会议案”）。大会议案于2019年9月27日获得表决通过，自该日起持有人大会决议生效，并已报中国证券监督管理委员会备案。我公司已于2019年9月28日发布了《泰达宏利中证500指数分级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》（以下简称“《决议公告》”）。根据《决议公告》，现就转型相关的信息公告如下：

一、关于《基金合同》等法律文件的修订

根据大会议案以及相关法律法规的规定，经与基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，基金管理人已将《泰达宏利中证500指数分级证券投资基金基金合同》、《泰达宏利中证500指数分级证券投资基金托管协议》分别修订为《泰达宏利中证500指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》、《泰达宏利中证500指数增强型证券投资基金（LOF）托管协议》，并据此编制《泰达宏利中证500指数增强型证券投资基金（LOF）招募说明书》。

上述文件已经中国证券监督管理委员会证监许可[2019]1209号（《关于准予泰达宏利中证500指数分级证券投资基金变更注册的批复》）准予变更注册。《泰达宏利中证500指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》、《泰达宏利中证500指数增强型证券投资基金（LOF）托管协议》将自2019年11月6日起生效，原《泰达宏利中证500指数分级证券投资基金基金合同》、《泰达宏利中证500指数分级证券投资基金托管协议》将自同一起失效。

二、关于选择期的安排

本次转型实施前的选择期为自2019年9月30日起，至2019年11月1日止。选择期期间，泰达中证500份额的申购赎回业务，泰达500A份额与泰达500B份额的交易、配对转换业务照常办理，不受影响。基金份额持有人在泰达宏利中证500

分级正式实施转型前，可选择卖出泰达500A份额、泰达500B份额或赎回泰达中证500份额。对于在选择期内未作出选择的基金份额持有人，其持有的泰达中证500份额、泰达500A份额与泰达500B份额将在份额转换基准日进行转换，最终转换为泰达宏利中证500指数增强型证券投资基金（LOF）基金份额。

在选择期期间选择赎回的，适用泰达宏利中证500分级的赎回费率和赎回费计入基金财产的比例。

在选择期期间，本基金仍按照《基金合同》约定的运作方式进行运作。由于本基金需应对赎回等情况，基金份额持有人同意在选择期豁免本基金《基金合同》中约定的投资组合比例限制等条款。基金管理人提请基金份额持有人大会授权基金管理人据此落实相关事项，并授权基金管理人可根据实际情况做相应调整，以及根据实际情况可暂停申购、赎回或调整赎回方式等。具体安排详见基金管理人届时发布的相关公告。

三、关于本基金的终止上市交易和基金份额的转换

基金管理人将按照《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》、《泰达宏利中证500指数分级证券投资基金基金合同》等的有关规定向深圳证券交易所申请泰达500A份额与泰达500B份额的终止上市。基金管理人已向深圳证券交易所申请终止本基金的上市交易，并获得深圳证券交易所同意（《终止上市通知书》深证上[2019]677号），泰达500A份额、泰达500B份额于2019年11月4日终止上市。具体安排详见基金管理人届时发布的泰达宏利中证500指数分级证券投资基金之泰达500A份额、泰达500B份额终止上市的公告。

本基金的基金份额转换基准日为2019年11月4日。2019年11月4日以及2019年11月5日暂停办理泰达中证500份额的申购、赎回、定期定额投资和转托管等业务，自2019年11月4日起，将终止办理基金份额的拆分及合并业务。基金转型完毕后，泰达宏利中证500指数增强型证券投资基金（LOF）将于2019年11月6日恢复申购、赎回、定期定额投资、转托管的业务。

基金管理人在份额转换基准日将本基金各类基金份额转换成泰达宏利中证500指数增强型证券投资基金（LOF）基金份额。

在份额转换基准日，在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司登记在册的泰达中证500份额、泰达500A份额与泰达500B份额将转换为泰达宏利中证500

指数增强型证券投资基金 (LOF) 的场内份额，在中国证券登记结算有限责任公司登记在册的泰达中证500份额将转换为泰达宏利中证500指数增强型证券投资基金 (LOF) 的场外份额。本次基金份额的转换主要可分成以下两个步骤进行：1、将泰达500A份额与泰达500B份额转换成泰达中证500份额的场内份额；2、将泰达中证500份额的场内份额和场外份额分别转换成泰达宏利中证500指数增强型证券投资基金 (LOF) 的场内份额和场外份额。

转换后，泰达宏利中证500指数增强型证券投资基金 (LOF) 的基金份额数=泰达中证500份额数。

泰达500A份额转换成泰达中证500份额的份额数=

$$\frac{NUM_{500A}^{\text{前}} \times NAV_{500A}^{\text{前}}}{NAV_{500}^{\text{前}}}$$

泰达500B份额转换成泰达中证500份额的份额数=

$$\frac{NUM_{500B}^{\text{前}} \times NAV_{500B}^{\text{前}}}{NAV_{500}^{\text{前}}}$$

其中：

$NUM_{500A}^{\text{前}}$ ：泰达 500A 份额转换前份额数；

$NUM_{500B}^{\text{前}}$ ：泰达 500B 份额转换前份额数；

$NAV_{500A}^{\text{前}}$ ：泰达 500A 份额转换前单位资产净值；

$NAV_{500B}^{\text{前}}$ ：泰达 500B 份额转换前单位资产净值；

$NAV_{500}^{\text{前}}$ ：泰达中证 500 份额转换前单位资产净值。

泰达中证500份额、泰达500A份额与泰达500B份额的场内份额经转换后的份额数采用取整计算（最小单位为 1 份），取整后的余额计入基金资产。故基金份额转换后，由于基金份额数取整计算产生的误差，基金份额持有人存在着基金资产净值减小的风险。对于持有份额数较少的泰达中证500份额、泰达500A份额与泰达500B份额场内份额的持有人，存在着持有的基金份额转换后份额数不足一份而被计入基金资产的风险。

在泰达宏利中证500指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金份额上市交易前，泰达宏利中证500指数增强型证券投资基金 (LOF) 场内份额的持有人只能通过赎回基金份额的方式退出投资。在泰达宏利中证500指数增强型证券投资基金

(LOF) 基金份额上市交易后，基金份额持有人可通过赎回或卖出基金份额的方式退出投资。

四、对基金份额持有人的影响及基金风险发生变化的提示

本基金转型前为股票型指数分级基金，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。从本基金所分离的两类基金份额来看，泰达500A份额具有低风险、收益相对稳定的特征；泰达500B份额具有高风险、高预期收益的特征。

本基金转型后为股票型指数增强型基金，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。变更后采用指数增强型投资策略，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

转型后，原泰达500A份额持有人持有的基金份额由原来的低风险变成中高预期风险。原泰达500B份额持有人持有的基金份额由原来的高风险变成中高预期风险。本基金由被动跟踪指数的分级基金转型为股票型指数增强型基金，对于原泰达中证500份额持有人来说，基金的风险收益特征发生了一定的变化。

投资者可登录本基金管理人网站 (www.mfcteda.com) 或拨打本基金管理人的客服电话 (400-698-8888) 获取相关信息。

本公告的解释权归本基金管理人所有。

风险提示：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。投资者投资于本公司旗下基金前应认真阅读各基金的基金合同和招募说明书。基金的过往业绩并不代表其将来表现。投资有风险，敬请投资者认真阅读基金的相关法律文件，并选择适合自身风险承受能力的投资品种进行投资。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

泰达宏利基金管理有限公司

2019年10月29日