

# 华安沪深 300 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《华安沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”), 的相关约定, 华安沪深 300 指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)将以 2020 年 1 月 2 日为折算基准日办理定期份额折算业务。本基金的基金份额包括华安沪深 300 指数分级证券投资基金的基础份额(以下简称“华安沪深 300 份额”, 场内简称: 华安 300, 基金代码: 160417)、华安沪深 300 指数分级证券投资基金的稳健收益类份额(以下简称“华安沪深 300A 份额”, 场内简称: HS300A, 基金代码: 150104) 和华安沪深 300 指数分级证券投资基金的积极收益类份额(以下简称“华安沪深 300B 份额”, 场内简称: HS300B, 基金代码: 150105)。相关事项提示如下:

### 一、基金份额折算基准日

根据基金合同的约定, 定期份额折算基准日为每个会计年度的第一个工作日。本次定期份额折算的基准日为 2020 年 1 月 2 日。

### 二、基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的华安沪深 300A 份额和华安沪深 300 份额, 华安沪深 300B 份额不参与定期折算。

### 三、基金份额折算方式

华安沪深 300A 份额和华安沪深 300B 份额按照本基金招募说明书第六部分“基金份额的分级”中规定的净值计算规则进行参考净值计算, 对华安沪深 300A 份额的应得约定收益进行定期份额折算, 每 2 份华安沪深 300 份额将按 1 份华安沪深 300A 份额获得应得约定收益的新增折算份额。在基金份额定期折算前与折算后, 华安沪深 300A 份额和华安沪深 300B 份额的份额配比保持 1: 1 的比例不变。

华安沪深 300A 份额每个期末的约定应得收益, 即华安沪深 300A 份额每个会计年度最后一日份额参考净值超出 1.000 元部分, 将被折算为场内华安沪深 300 份额分配给华安沪深 300A 份额持有人。华安沪深 300 份额持有人持有的每 2 份华安沪深 300 份额将获得按照 1 份华安沪深 300A 份额分配的新增华安沪深 300 份额。

持有场外华安沪深 300 份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外华安沪深 300 份额; 持有场内华安沪深 300 份额的基金份额持有人将按前述折算

方式获得新增场内华安沪深 300 份额。经过上述份额折算，华安沪深 300A 份额的参考净值和华安沪深 300 份额的基金份额净值将相应调整。

每个会计年度的第一个工作日（除基金合同生效日所在会计年度外）为定期份额折算基准日，本基金将对华安沪深 300A 份额和华安沪深 300 份额进行上一会计年度约定应得收益的定期份额折算。有关计算公式如下：

### 1、华安沪深 300A 份额折算

定期份额折算前后，华安沪深 300A 份额数不变，即： $NUM_{300A}^{\text{后}} = NUM_{300A}^{\text{前}}$

$$NAV_{300}^{\text{后}} = NAV_{300}^{\text{前}} - 0.5 \times (NAV_{300A}^{\text{期末}} - 1.000)$$

华安沪深 300A 份额持有人新增的场内华安沪深 300 份额的份额数=

$$\frac{NUM_{300A}^{\text{前}} \times (NAV_{300A}^{\text{期末}} - 1.000)}{NAV_{300}^{\text{后}}}$$

其中：

$NUM_{300A}^{\text{前}}$ ：定期份额折算前华安沪深 300A 份额的份额数

$NUM_{300A}^{\text{后}}$ ：定期份额折算后华安沪深 300A 份额的份额数

$NAV_{300A}^{\text{期末}}$ ：华安沪深 300A 份额上一会计年度最后一日的份额参考净值

$NAV_{300}^{\text{前}}$ ：定期份额折算前华安沪深 300 份额的份额净值

$NAV_{300}^{\text{后}}$ ：定期份额折算后华安沪深 300 份额的份额净值

华安沪深 300A 份额折算成华安沪深 300 份额的场内份额取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。

2、华安沪深 300B 份额不参与定期份额折算，其基金份额参考净值与份额数在定期折算前后保持不变。

### 3、华安沪深 300 份额折算

$$NAV_{300}^{\text{后}} = NAV_{300}^{\text{前}} - 0.5 \times (NAV_{300A}^{\text{期末}} - 1.000)$$

华安沪深 300 份额持有人新增的华安沪深 300 份额的份额数=

$$\frac{NUM_{300}^{\text{前}}}{2} \times \frac{NAV_{300A}^{\text{期末}} - 1.000}{NAV_{300}^{\text{后}}}$$

定期份额折算后华安沪深 300 份额的份额数 = 定期份额折算前华安沪深 300

份额的份额数 + 华安沪深 300 份额持有人新增的华安沪深 300 份额的份额数 + 华安沪深 300A 份额持有人新增的华安沪深 300 份额数。

其中：

$NUM_{300}^{\text{前}}$ ：定期份额折算前华安沪深 300 份额的份额数

华安沪深 300 份额的场外份额经折算后的份额数采用截位法保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产；华安沪深 300 份额的场内份额经折算后的份额数取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。

在实施定期份额折算时，折算日折算前华安沪深 300 份额的基金份额净值以及华安沪深 300A 份额的参考净值等具体见基金管理人届时发布的相关公告。

#### 四、基金份额折算期间的基金业务办理

1、定期份额折算基准日（即 2020 年 1 月 2 日），华安沪深 300 份额暂停办理申购、赎回、转托管（包括场外转托管、跨系统转托管，下同）业务、配对转换业务；华安沪深 300A 份额、华安沪深 300B 份额正常交易。当日晚间，本基金管理人计算当日基金份额（参考）净值及份额折算比例。

2、定期份额折算基准日后的第一个工作日（即 2020 年 1 月 3 日），华安沪深 300 份额暂停办理申购、赎回、转托管、配对转换业务，华安沪深 300A 份额暂停交易，华安沪深 300B 份额正常交易。当日，本基金管理人为持有人办理份额登记确认。

3、定期份额折算基准日后的第二个工作日（即 2020 年 1 月 6 日），本基金管理人将公告份额折算确认结果，持有人可以查询其账户内的基金份额。当日，本基金管理人恢复办理申购、赎回、转托管、配对转换业务，华安沪深 300A 份额将于 2020 年 1 月 6 日上午开市复牌，华安沪深 300B 份额正常交易。

4、根据《深圳证券交易所证券投资基金交易和申购赎回实施细则》，华安沪深 300A 份额 2020 年 1 月 6 日即时行情显示的前收盘价将调整为 2020 年 1 月 3 日的华安沪深 300A 份额的份额参考净值（四舍五入至 0.001 元）。由于华安沪深 300A 份额可能存在折溢价交易情形，折算前的收盘价扣除 2019 年约定收益后与 2020 年 1 月 6 日的前收盘价可能有较大差异，1 月 6 日当日可能出现交易价格大幅波动的情形。

#### 五、重要提示

由于华安沪深 300A 份额新增份额折算成华安沪深 300 份额的场内份额数和华安沪深 300 份额的场内份额经折算后的份额数取整计算（最小单位为 1 份），舍去部分

计入基金财产,持有较少华安沪深 300A 份额或场内华安沪深 300 份额的份额持有人存在无法获得新增场内华安沪深 300 份额的可能性。

投资者若希望了解本基金定期份额折算业务详情,请登录本基金管理人网站([www.huaan.com.cn](http://www.huaan.com.cn))或拨打客户服务电话(40088-50099)咨询详情。

本公司承诺以诚实信用、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。投资者投资于基金前应认真阅读基金的基金合同、招募说明书等文件。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

华安基金管理有限公司

2019 年 12 月 27 日