

华宝基金管理有限公司

关于华宝中证 1000 指数分级证券投资基金实施转型的公告

华宝基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”或“我司”）于 2020 年 10 月 9 日至 2020 年 10 月 18 日以通讯方式召开了华宝中证 1000 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《关于华宝中证 1000 指数分级证券投资基金转型及基金合同修改有关事项的议案》（以下简称“议案”）。议案于 2020 年 10 月 19 日获得表决通过，自该日起持有人大会决议生效，并报中国证券监督管理委员会备案。本基金管理人已于 2020 年 10 月 20 日发布了《关于华宝中证 1000 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》，现将实施转型的相关事项提示如下：

一、关于转型方案实施的安排

本基金的转型选择期为 2020 年 10 月 21 日至 2020 年 11 月 17 日，以供基金份额持有人做出赎回、卖出等选择。

选择期期间，华宝中证 1000 份额的申购赎回业务，以及华宝中证 1000A 份额、华宝中证 1000B 份额的交易、配对转换业务照常办理。原基金份额持有人可以选择卖出华宝中证 1000A 份额、华宝中证 1000B 份额或者赎回华宝中证 1000 份额。对于在选择期内未作出选择的基金份额持有人，其持有的华宝中证 1000 份额、华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额将在份额转换基准日进行转换，最终转换为华宝中证 1000 指数证券投资基金的基金份额。

在选择期期间选择赎回的，仍适用华宝中证 1000 指数分级证券投资基金的赎回费率和赎回费计入基金财产的比例。

基金管理人可根据实际情况暂停申购、赎回或调整赎回方式。具体安排详见基金管理人届时发布的相关公告。

二、关于本基金的终止上市交易和基金份额的转换

为实施转型，基金管理人将按照深圳证券交易所、《华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同》等的有关规定向深圳交易所申请华宝中证 1000A 份额与华宝中证 1000B 份额的终止上市。

转型选择期届满后，基金管理人将以 2020 年 11 月 18 日作为份额转换基准日。基金管理人在份额转换基准日在保持基金资产净值总额不变的前提下，将华宝中证 1000 指数分级证券投资基金的各类基金份额转换成华宝中证 1000 指数证券投资基金（以下简称“华宝中证 1000 指数基金”）基金份额。

在份额转换基准日，华宝中证 1000 份额的场外份额将转换为华宝中证 1000 指数基金的场外份额，华宝中证 1000 份额的场内份额转换为华宝中证 1000 指数基金的场内份额。华宝中证 1000A 份额、华宝中证 1000B 份额将在终止分级运作后以份额折算基准日华宝中证 1000 份额的基金份额净值为基准按照各自的基金份额参考净值折算成华宝中证 1000 指数基金的场内份额。

华宝中证 1000A 份额（或华宝中证 1000B 份额）的折算比率 = 份额折算基准日华宝中证 1000A 份额（或华宝中证 1000B 份额）的基金份额参考净值 / 份额折算基准日华宝中证 1000 份额的基金份额净值

华宝中证 1000A 份额（或华宝中证 1000B 份额）基金份额持有人持有的折算后华宝中证 1000 指数基金的场内份额数 = 基金份额持有人持有的折算前华宝中证 1000A 份额（或华宝中证 1000B 份额）的份额数 × 华宝中证 1000A 份额（或华宝中证 1000B 份额）的折算比率

华宝中证 1000 份额的场外份额经转换后的基金份额数采用四舍五入的方式保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产。华宝中证 1000 份额、华宝中证 1000A 份额与华宝中证 1000B 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），余额的处理方法按照深圳交易所或登记机构的相关规则及有关规定执行。

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华宝中证 1000 份额、华宝中证 1000A 份额与华宝中证 1000B 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。

上述具体安排详见本基金管理人届时发布的相关公告。

三、关于基金合同等法律文件的修订情况

根据议案以及相关法律法规的规定，经与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，我司已将《华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同》、《华宝中证 1000 指数分级证券投资基金托管协议》修订为《华宝中证 1000 指数证券投资基金基金合同》、《华宝中证 1000 指数证券投资基金托管协议》，并据此拟定了《华宝中证 1000 指数证券投资基金招募说明书》。上述文件已经中国证券监督管理委员会证监许可[2020]1798 号（《关于准予华宝中证 1000 指数分级证券投资基金变更注册的批复》）准予变更注册。本基金基金份额转换完成后，自 2020 年 11 月 19 日起《华宝中证 1000 指数证券投资基金基金合同》生效，《华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同》同时失效，华宝中证 1000 指数分级证券投资基金正式变更为华宝中证 1000 指数证券投资基金。上述具体安排详见基金管理人届时发布的相关公告。

四、关于折算后场内基金份额后续安排

基金管理人将于基金份额转换完成后对基金份额转换结果进行公告。自《华宝中证 1000 指数证券投资基金基金合同》生效后，基金管理人将根据相关规定办理华宝中证 1000 指数基金基金份额的申购赎回等业务。详见后续公告。

五、风险提示

1、份额转换基准日前，华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额仍可正常交易。期间，华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额可能存在折溢价交易情形，其折溢价率可能发生较大变化。基金份额转换基准日日终，华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额均按各自的基金份额参考净值（而不是二级市场价格）转换为华宝中证 1000 指数基金的场内份额，如果投资者在转型前以溢价持有或买入，折算后可能遭受较大损失。特提请二级市场交易的投资者注意折溢价所带来的风险。投资者应密切关注华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额的基金份额参考净值变化情况，可通过本公司官方

网站（www.fsfund.com）等方式进行查询。

2、由于基金转型后运作方式等发生较大变化，影响基金的风险收益特征。转型前华宝中证 1000A 份额具有较低风险、收益相对稳定的特征，华宝中证 1000B 份额由于利用杠杆投资，则具有较高风险、较高预期收益的特征。转型后华宝中证 1000 指数基金为股票型指数基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金，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。对于原基金份额持有人来说，基金的风险收益特征发生了一定的变化。

同时，不同的销售机构采用的评价方法不同，销售机构的风险等级评价与基金法律文件中风险收益特征的表述可能存在不同，提示投资者关注。

投资者如有任何疑问，可以通过本基金管理人的网站（www.fsfund.com）或本基金管理人客户服务电话（400-700-5588、400-820-5050、021-38924558）获取相关信息。

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。投资者投资于本基金时应认真阅读基金的《基金合同》、《招募说明书》和《产品资料概要》。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

华宝基金管理有限公司

2020 年 11 月 12 日