

# 易方达基金管理有限公司关于易方达证券公司指数分级证券投资基金修改基金合同的公告

经国务院同意，中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会、中国证券监督管理委员会、国家外汇管理局联合发布的《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》明确规定，公募产品不得进行份额分级。为落实上述规定要求，并根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》及相关法律法规的规定，经与基金托管人协商一致，易方达基金管理有限公司（以下简称“本公司”或“基金管理人”）对易方达证券公司指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”，易方达证券公司份额（基础份额）场内简称：证券分级，基金代码：502010；易方达证券公司分级 A 类份额场内简称：证券 A，基金代码：502011；易方达证券公司分级 B 类份额场内简称：证券 B，基金代码：502012）的基金合同进行了修改，并已报监管部门备案。本次法律文件的修改系根据相关法律法规及监管要求而进行，符合相关法律法规的规定以及基金合同的约定。本次基金合同修改涉及根据监管规定取消分级机制，并据此就易方达证券公司分级 A 类份额与易方达证券公司分级 B 类份额的终止运作，包括终止上市与份额折算等后续具体操作做了安排，具体修改内容详见附件。

## 重要提示：

1、本次基金合同修改自 2020 年 11 月 19 日起生效。

2、易方达证券公司分级 A 类份额和易方达证券公司分级 B 类份额的终止运作的时间安排，将由基金管理人提前至少 20 个交易日另行公告。

3、本公司将在公司网站（www.efunds.com.cn）公布修改后的基金合同，招募说明书届时将在最新一期的版本中予以更新。

### 风险提示：

1、本基金修改基金合同后，各类份额持有人的影响列示如下表：

公告前 <sup>1</sup>				公告后、折算前				折算后			
持有份额类别	折溢价	净值杠杆	有无上市交易	持有份额类别	折溢价	净值杠杆	有无上市交易	持有份额类别	折溢价	净值杠杆	有无上市交易
A 类份额	D <sub>A</sub>	无	有	不变 <sup>2</sup>	D <sub>A</sub> 可能收窄	不变 <sup>2</sup>	不变 <sup>2</sup>	场内基础份额	D <sub>c</sub>	无	有
B 类份额	D <sub>B</sub>	L <sub>B</sub>	有	不变 <sup>2</sup>	D <sub>B</sub> 可能收窄	L <sub>B</sub> 正常变化	不变 <sup>2</sup>	场内基础份额	D <sub>c</sub>	无	有
场内基础份额	D <sub>c</sub>	无	有	不变 <sup>2</sup>	D <sub>c</sub> 可能收窄	不变 <sup>2</sup>	不变 <sup>2</sup>	场内基础份额	D <sub>c</sub>	无	有
场外基础份额	无	无	无	不变 <sup>2</sup>	不变 <sup>2</sup>	不变 <sup>2</sup>	不变 <sup>2</sup>	场外基础份额	无	无	无

备注 1：“公告前”指的是本次公告之前。

备注 2：“不变”指的是与本次公告之前相比没有变化。

备注 3： $D_A = A$  类份额价格/ $A$  类份额参考净值-1； $D_B = B$  类份额价格/ $B$  类份额参考净值-1； $D_c =$ 基础份额价格/ $B$  类份额参考净值-1； $L_B =$ 基础份额净值/（ $B$  类份额参考净值× $B$  类份额数/ $(A$  类份额数+ $B$  类份额数)）；

$L_B$  随基础份额净值的变化而变化，而基础份额净值根据标的指数的涨跌而涨跌。

（1）由于场内易方达证券公司份额、易方达证券公司分级 A 类份额与易方达证券公司分级 B 类份额可能存在折溢价交易情形，本次基金合同修改后，其折溢价率可能发生较大变化，如果投资者以溢价买入，折算后可能遭受较大损失（具体折算方式及示例详见风险提示

第4条及修改后的基金合同条款)。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) 易方达证券公司分级A类份额具有低预期风险、预期收益相对稳定的特征,但在份额折算后,易方达证券公司分级A类份额的持有人将持有具有较高预期风险、较高预期收益特征的易方达证券公司份额,由于易方达证券公司份额为跟踪中证全指证券公司指数的基础份额,其份额净值将随标的指数的涨跌而变化,原易方达证券公司分级A类份额持有人将承担因市场下跌而遭受损失的风险。

易方达证券公司分级B类份额具有一定的杠杆属性,具有高预期风险、预期收益相对较高的特征,但在份额折算后,易方达证券公司分级B类份额的持有人将持有具有较高预期风险、较高预期收益特征的易方达证券公司份额,由于易方达证券公司份额为跟踪中证全指证券公司指数的基础份额,没有杠杆特征,其基金份额净值将随标的指数的涨跌而变化,不会形成杠杆性收益或损失,但原易方达证券公司分级B类份额持有人仍需承担因市场下跌而遭受损失的风险。

2、易方达证券公司分级A类份额和易方达证券公司分级B类份额折算为易方达证券公司份额前,易方达证券公司分级A类份额和易方达证券公司分级B类份额的持有人有两种方式退出:

(1) 在场内按市价卖出基金份额;

(2) 在场内买入等量的对应份额(即易方达证券公司分级A类份额持有人买入等量的易方达证券公司分级B类份额,或者易方达证券公司分级B类份额持有人买入等量的易方达证券公司分级A类份

额), 合并为易方达证券公司份额, 场内卖出易方达证券公司份额或者按照易方达证券公司份额的基金份额净值申请场内赎回。

3、本次基金合同修改后, 由于易方达证券公司分级 A 类份额和易方达证券公司分级 B 类份额的持有人可能选择场内卖出或合并赎回等方式退出, 场内份额数量可能发生较大下降, 可能出现场内流动性不足的情况, 特提请投资者注意流动性风险。

4、以份额折算基准日日终易方达证券公司份额的基金份额净值为基准, 易方达证券公司分级 A 类份额、易方达证券公司分级 B 类份额按照各自的基金份额参考净值(而不是二级市场价格)折算成场内易方达证券公司份额。易方达证券公司分级 A 类份额和易方达证券公司分级 B 类份额基金份额持有人持有的折算后场内易方达证券公司份额取整计算(最小单位为 1 份)。

折算前存在溢价交易的基金份额的持有人将会因为溢价的消失而造成损失。

易方达证券公司分级 A 类份额和易方达证券公司分级 B 类份额的基金份额持有人持有的基金份额数量将会在折算后发生变化, 示例如下:

假设份额折算基准日易方达证券公司份额、易方达证券公司分级 A 类份额和易方达证券公司分级 B 类份额的基金份额(参考)净值的分别为: 0.9000 元、1.0100 元、0.7900 元, 投资者甲、乙、丙分别持有场内易方达证券公司份额、易方达证券公司分级 A 类份额、易方达证券公司分级 B 类份额各 100,000 份, 其所持基金份额的变化如下

表所示：

基金份额	折算前		份额折算比例	折算后	
	基金份额（参考）净值（元）	基金份额（份）		基金份额净值（元）	基金份额
场内易方达证券公司份额	0.9000	100,000	（无变化）	0.9000	100,000 份场内易方达证券公司份额
易方达证券公司分级 A 类份额	1.0100	100,000	1.122222 （全部折算为易方达证券公司份额）	0.9000	112,222 份场内易方达证券公司份额
易方达证券公司分级 B 类份额	0.7900	100,000	0.877778 （全部折算为易方达证券公司份额）	0.9000	87,777 份场内易方达证券公司份额

注：具体折算结果以登记结算机构为准

5、易方达证券公司分级 A 类份额和易方达证券公司分级 B 类份额折算为易方达证券公司份额后，投资者可以申请场内赎回基金份额或者转托管至场外后申请赎回基金份额。部分投资者可能由于所在证券公司不具备基金销售资格或其他原因无法直接办理场内赎回，需先转托管至场外后再申请赎回或者先转托管到具有基金销售资格的证券公司后再申请赎回。

6、根据中国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则，易方达证券公司分级 A 类份额和易方达证券公司分级 B 类份额合并或折算为易方达证券公司份额后，基金份额持有期自易方达证券公司份额确认之日起计算。如果赎回份额时持有期较短，基金份额持有人将承担较高的赎回费。

根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及本基金招募说明书的约定，本基金的赎回费率如下：

### (1) 场外赎回费率

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费率随基金份额持有时间增加而递减，具体如下：

持有期限（天）	赎回费率
0-6	1.50%
7-364	0.50%
365-729	0.25%
730 及以上	0.00%

（注：赎回份额持有时间的计算，以该份额在登记结算机构的登记日开始计算。）

### (2) 场内赎回费率

本基金场内基础份额的赎回费率与场外基础份额的赎回费率相同，具体如下：

持有期限（天）	赎回费率
0-6	1.50%
7-364	0.50%
365-729	0.25%
730 及以上	0.00%

本基金赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。对持续持有期少于7日的投资者收取的赎回费，将全额计入基金财产；对持续持有期长于7日的投资者

收取的赎回费，将不低于赎回费总额的 25% 归入基金财产，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。

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。销售机构根据法规要求对投资者类别、风险承受能力和基金的风险等级进行划分，并提出适当性匹配意见。投资者在投资基金前应认真阅读基金合同、招募说明书（更新）和基金产品资料概要（更新）等基金法律文件，全面认识基金产品的风险收益特征，在了解产品情况及销售机构适当性意见的基础上，根据自身的风险承受能力、投资期限和投资目标，对基金投资作出独立决策，选择合适的基金产品。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

投资者欲了解详情，请登录基金管理人网站：[www.efunds.com.cn](http://www.efunds.com.cn) 或拨打本公司客服电话：400 881 8088 进行咨询。

特此公告。

附件：易方达证券公司指数分级证券投资基金基金合同修改对照表

易方达基金管理有限公司

2020 年 11 月 18 日

附件：易方达证券公司指数分级证券投资基金基金合同修改对照表

章节	修改前	修改后
第十一部分 基金份额持 有人大会	无	<p>一、召开事由</p> <p>2、出现以下情况之一的，可由基金管理人和基金托管人协商后修改《基金合同》，不需召开基金份额持有人大会： .....</p> <p><u>(12) 根据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》等法律法规规定取消分级运作机制并终止 A 类份额与 B 类份额的上市；</u></p>
新增加	无	<p><u>第二十一部分 A 类份额与 B 类份额的终止运作</u></p> <p><u>一、本基金应根据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》等法律法规规定终止 A 类份额与 B 类份额的运作，无需召开基金份额持有人大会。为此，基金管理人将向上海证券交易所申请 A 类份额与 B 类份额终止上市，并办理 A 类份额与 B 类份额的份额折算。具体终止运作的时间安排见基金管理人届时发布的公告。基金管理人应将基金合同根据前述法律法规做相应修改并公告。</u></p> <p><u>二、A 类份额与 B 类份额的份额折算</u></p> <p><u>1、基金份额折算基准日</u> <u>基金份额折算基准日具体日期见基金管理人届时发布的公告。</u></p> <p><u>2、份额折算方式</u> <u>以基金份额折算基准日日终基础份额的基金份额净值为基准，A 类份额与 B 类份额按照各自的基金份额参考净值折算成场内基础份额。A 类份额（或 B 类份额）基金份额持有人持有的折算后场内基础份额份数保留到整数位（最小单位为 1 份），零碎份额部分按照登记结算机构的相关规则及有关规定处理。</u> <u>份额折算计算公式：</u> <u>A 类份额（或 B 类份额）的折算比例=基金份额折算基准日 A 类份额（或 B 类份额）的基金份额参考净值/基金份额折算基准日基础份额的基金份额净值</u> <u>A 类份额（或 B 类份额）基金份额持有人持有的折算后场内基础份额=基金份额持有人持有的折算前 A 类份额（或 B 类份额）的份数×A 类份额（或 B 类份额）的折算比例</u></p> <p><u>3、份额折算后的基金运作</u> <u>A 类份额与 B 类份额全部折算为场内基础份额后，本基金接受场外与场内申购和赎回，开始申购、赎回的时间及具体操作以基金管理人的公告为准。</u></p> <p><u>4、份额折算的公告</u> <u>A 类份额与 B 类份额的份额折算结束后，基金管理人应按照《信息披露办法》在规定媒介上公告。</u></p> <p><u>三、基金份额折算期间的基金业务办理</u> <u>为保证基金份额折算期间本基金的平稳运作，基金管理人可暂停相关份额的交易和申购或赎回等相关业务，具体见基金管理人届时发布的相关公告。</u></p>