

# 汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富恒生指数分级证券投资基金实施转型的公告

汇添富基金管理股份有限公司（以下简称“基金管理人”）于2020年10月29日以现场方式组织召开了汇添富恒生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，审议通过《关于汇添富恒生指数分级证券投资基金转型的议案》（以下简称“议案”），自该日起基金份额持有人大会决议生效（详见本公司于2020年10月30日发布《汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富恒生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》）。现将本基金转型相关事项提示如下：

## 一、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，经与基金托管人协商一致，基金管理人已将《汇添富恒生指数分级证券投资基金基金合同》、《汇添富恒生指数分级证券投资基金托管协议》修订为《汇添富恒生指数型证券投资基金(QDII-LOF)基金合同》、《汇添富恒生指数型证券投资基金(QDII-LOF)托管协议》，并据此拟定了《汇添富恒生指数型证券投资基金(QDII-LOF)招募说明书》及各类基金份额的基金产品资料概要。上述文件已经中国证监会准予变更注册。

此外，经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案，《汇添富恒生指数型证券投资基金(QDII-LOF)基金合同》和《汇添富恒生指数型证券投资基金(QDII-LOF)托管协议》还根据《存托凭证发行与交易管理办法（试行）》就参与存托凭证投资事宜进行了修订，包括增加存托凭证的投资风险、明确投资范围包含存托凭证、增加存托凭证的投资策略、投资比例限制、估值方法等。

自2020年12月1日起，《汇添富恒生指数型证券投资基金(QDII-LOF)基金合同》生效，原《汇添富恒生指数分级证券投资基金基金合同》自同一日起失效。

## 二、本基金转型方案实施的安排

本基金转型实施前的选择期为2020年10月30日至2020年11月29日。

在选择期内，添富恒生份额正常办理场外和场内赎回业务，其场内申购业务继续暂停办理，其场外大额申购（含定投）业务的限制金额保持1万元不变。恒

生 A 份额与恒生 B 份额的交易、配对转换中场内合并业务照常办理，配对转换中场内分拆业务暂停办理。恒生 A 份额与恒生 B 份额基金份额持有人可以选择卖出恒生 A 份额与恒生 B 份额，或者先将所持有的恒生 A 份额与恒生 B 份额场内合并为添富恒生份额再赎回添富恒生份额；添富恒生份额基金份额持有人可以选择赎回添富恒生份额。

### 三、恒生 A 份额、恒生 B 份额的终止上市

基金管理人已按照深圳证券交易所的业务规则和本基金的基金合同等的有关规定向深圳证券交易所申请恒生指数分级证券投资基金的恒生 A 份额和恒生 B 份额的终止上市。具体安排详见基金管理人后续相关公告。

### 四、本基金基金份额的转换

根据转型安排，本基金以 2020 年 11 月 30 日为基金份额转换基准日，将该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添富恒生份额、恒生 A 份额与恒生 B 份额将转换为汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）的 A 类基金份额的场内份额，在中国证券登记结算有限责任公司登记在册的添富恒生份额将转换为汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）的 A 类基金份额的场外份额。本次基金份额的转换分为两个步骤：1、将恒生 A 份额与恒生 B 份额转换成添富恒生份额的场内份额；2、将添富恒生份额的场内份额和场外份额分别转换成汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）的 A 类基金份额的场内份额和场外份额。转换计算具体如下：

步骤 1：

$$\text{恒生 A 份额转换成添富恒生份额的场内份额的份额数} = \frac{NUM_{恒生A}^{前} \times NAV_{恒生A}^{前}}{NAV_{添富恒生}^{前}}$$

$$\text{恒生 B 份额转换成添富恒生份额的场内份额的份额数} = \frac{NUM_{恒生B}^{前} \times NAV_{恒生B}^{前}}{NAV_{添富恒生}^{前}}$$

其中：

$NUM_{恒生A}^{前}$ ：恒生 A 份额转换前的份额数

$NUM_{恒生B}^{前}$ ：恒生 B 份额转换前的份额数

$NAV_{恒生A}^{前}$ ：恒生 A 份额转换前的份额参考净值

$NAV_{恒生B}^{前}$  : 恒生B 份额转换前的份额参考净值

$NAV_{添富恒生}^{前}$  : 添富恒生份额转换前的基金份额净值

步骤 2:

汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）的 A 类基金份额场内份额的份额数=恒生添富份额场内份额的份额数

汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）的 A 类基金份额场外份额的份额数=恒生添富份额场外份额的份额数

添富恒生份额的场内份额、恒生 A 份额与恒生 B 份额经转换后的份额数采用截位取整计算（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添富恒生份额的场内份额、恒生 A 份额与恒生 B 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。

## 五、本基金转型后的风险收益特征提示

本基金转型前为股票型指数分级基金，但由于采取了基金份额分级的结构设计，不同的基金份额具有不同的风险收益特征。从本基金所自动分离或分拆的两类基金份额来看，稳健收益类的恒生 A 份额具有低风险、收益稳定的特征，积极收益类的恒生 B 份额则具有高风险、高收益的特征。

本基金转型后为跟踪指数的股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。

此外，本基金转型后仍然主要投资于境外证券市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还将面临汇率风险、境外证券市场风险等特殊投资风险。

## 六、其他重要提示

鉴于选择期最后两日（11 月 28 日和 11 月 29 日）为非交易日，敬请投资者在选择期的工作日合理安排办理申购、赎回等业务的时间，以确保业务申请判定成功。

投资者可登录本公司网站（[www.99fund.com](http://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收益，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

2020年11月24日