

# 关于汇添富恒生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《汇添富恒生指数分级证券投资基金基金合同》（简称“基金合同”），及深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定，汇添富恒生指数分级证券投资基金（简称“本基金”）将以 2020 年 1 月 2 日为基准日办理定期份额折算业务。相关事项公告如下：

### 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 1 月份的第一个工作日。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添富恒生份额（基金代码：164705，场内简称：添富恒生）、恒生 A 份额（基金代码：150169，场内简称：恒生 A）。

### 三、基金份额折算频率

每年折算一次（可进行不定期折算的除外）。

### 四、基金份额折算方式

恒生 A 份额和恒生 B 份额按照《基金合同》“第四部分：基金份额的分类和净值计算规则”进行净值计算，对恒生 A 份额的应得收益进行定期份额折算，每 2 份添富恒生份额将按 1 份恒生 A 份额获得约定应得收益的新增折算份额。

在基金份额折算前与折算后，恒生 A 份额和恒生 B 份额的份额配比保持 1:1 的比例。

折算前的恒生 A 份额持有人，以恒生 A 份额在基金份额折算基准日的基金份额参考净值超出本金 1.000 元部分，获得新增添富恒生份额的份额分配。折算不改变恒生 A 份额持有人的资产净值，其持有的恒生 A 份额的基金份额净值折算调整为 1.000 元、份额数量不变，相应折算增加场内添富恒生份额。

折算前的添富恒生份额的基金份额持有人，以每 2 份添富恒生份额，按 1 份恒生 A 份额的份额分配，获得新增添富恒生份额。持有场外添富恒生份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外添富恒生份额的分配；持有场内添富恒生份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内添富恒生份额的分配。折算不改变添富恒生份额持有人的资产净值。

经过上述份额折算，恒生 A 份额和添富恒生份额的基金份额参考净值将相应调整。

每个会计年度 1 月份的第一个工作日为基金份额折算基准日，本基金将对恒生 A 份额和添富恒生份额进行应得收益的定期份额折算，有关计算公式如下：

(1) 恒生 A 份额

$$NUM_{恒生A}^{后} = NUM_{恒生A}^{前}$$

定期份额折算后恒生 A 份额的份额数 = 定期份额折算前恒生 A 份额的份额数

定期份额折算后添富恒生份额的份额净值为：

$$NAV_{添富恒生}^{后} = \frac{NAV_{添富恒生}^{前} \times NUM_{添富恒生}^{前} - \frac{1}{2} \times (NAV_{恒生A}^{前} - 1.000) \times NUM_{添富恒生}^{前}}{NUM_{添富恒生}^{前}}$$

恒生 A 份额持有人新增的场内添富恒生份额的份额数

$$= \frac{NUM_{恒生A}^{前} \times (NAV_{恒生A}^{前} - 1.000)}{NAV_{添富恒生}^{后}}$$

其中：

$NUM_{恒生A}^{前}$ ：定期份额折算前恒生 A 份额的份额数

$NUM_{恒生A}^{后}$ ：定期份额折算后恒生 A 份额的份额数

$NAV_{添富恒生}^{前}$ ：定期份额折算前添富恒生份额的份额净值

$NAV_{添富恒生}^{后}$ ：定期份额折算后添富恒生份额的份额净值

$NAV_{恒生A}^{前}$ ：定期份额折算前恒生 A 份额的份额参考净值

$NUM_{添富恒生}^{前}$ ：定期份额折算前添富恒生份额的份额数

(2) 恒生 B 份额

每个会计年度的定期份额折算不改变恒生 B 份额的参考净值及其份额数。

(3) 添富恒生份额

$$NAV_{添富恒生}^{后} = \frac{NAV_{添富恒生}^{前} \times NUM_{添富恒生}^{前} - \frac{1}{2} \times (NAV_{恒生A}^{前} - 1.000) \times NUM_{添富恒生}^{前}}{NUM_{添富恒生}^{前}}$$

定期份额折算后添富恒生份额持有人新增的添富恒生份额的份额数

$$= \frac{\text{NUM}_{\text{添富恒生}}^{\text{前}}}{2} \times \frac{\text{NAV}_{\text{恒生A}}^{\text{前}} - 1.000}{\text{NAV}_{\text{添富恒生}}^{\text{后}}}$$

其中：

$\text{NAV}_{\text{添富恒生}}^{\text{前}}$ ：定期份额折算前添富恒生份额的份额净值

$\text{NAV}_{\text{添富恒生}}^{\text{后}}$ ：定期份额折算后添富恒生份额的份额净值

$\text{NAV}_{\text{恒生A}}^{\text{前}}$ ：定期份额折算前恒生 A 份额的份额参考净值

$\text{NUM}_{\text{添富恒生}}^{\text{前}}$ ：定期份额折算前添富恒生份额的份额数

#### (4) 定期份额折算后添富恒生份额总份额数

定期份额折算后添富恒生份额的总份额数 = 定期份额折算前添富恒生份额的份额数+添富恒生份额持有人新增的添富恒生份额的份额数+恒生 A 份额持有人新增的场内添富恒生份额的份额数

即：

$$\begin{aligned} \text{NUM}_{\text{添富恒生}}^{\text{后}} = & \text{NUM}_{\text{添富恒生}}^{\text{前}} + \frac{\text{NUM}_{\text{添富恒生}}^{\text{前}}}{2} \times \frac{\text{NAV}_{\text{恒生A}}^{\text{前}} - 1.000}{\text{NAV}_{\text{添富恒生}}^{\text{后}}} \\ & + \frac{\text{NUM}_{\text{恒生A}}^{\text{前}} \times (\text{NAV}_{\text{恒生A}}^{\text{前}} - 1.000)}{\text{NAV}_{\text{添富恒生}}^{\text{后}}} \end{aligned}$$

其中：

$\text{NAV}_{\text{添富恒生}}^{\text{后}}$ ：定期份额折算后添富恒生份额净值

$\text{NAV}_{\text{恒生A}}^{\text{前}}$ ：定期份额折算前恒生 A 份额的份额参考净值

$\text{NUM}_{\text{添富恒生}}^{\text{前}}$ ：定期份额折算前添富恒生份额的份额数

$\text{NUM}_{\text{添富恒生}}^{\text{后}}$ ：定期份额折算后添富恒生份额的份额数

$\text{NUM}_{\text{恒生A}}^{\text{前}}$ ：定期份额折算前恒生 A 份额的份额数

$\text{NUM}_{\text{添富恒生}}^{\text{后}}$ ：定期份额折算后添富恒生份额的份额数

#### 五、定期份额折算示例

假设在本基金成立后第 2 个分级运作周年的第一个工作日(定期份额折算基准日)，添富恒生份额(场外与场内合计)当天折算前资产净值为 8,050,000,000 元。

当天场外添富恒生份额、场内添富恒生份额、恒生 A 份额、恒生 B 份额的份额数分别为 50 亿份、20 亿份、30 亿份、30 亿份。定期份额折算前添富恒生 A 份额净值为 1.070 元；定期份额折算当日未发生不定期份额折算。

(1) 恒生 A 份额

定期份额折算后添富恒生份额的份额净值为：

$$\begin{aligned} NAV_{\text{添富恒生}}^{\text{后}} &= \frac{NAV_{\text{添富恒生}}^{\text{前}} \times NUM_{\text{添富恒生}}^{\text{前}} - \frac{1}{2} \times (NAV_{\text{恒生A}}^{\text{前}} - 1.000) \times NUM_{\text{添富恒生}}^{\text{前}}}{NUM_{\text{添富恒生}}^{\text{前}}} \\ &= NAV_{\text{添富恒生}}^{\text{前}} - \frac{1}{2} \times (NAV_{\text{恒生A}}^{\text{前}} - 1.000) \\ &= \frac{8,050,000,000}{5,000,000,000 + 2,000,000,000} - \frac{1.070 - 1.000}{2} \\ &= 1.115(\text{元}) \end{aligned}$$

恒生 A 份额持有人新增的场内添富恒生份额的份额数

$$\begin{aligned} &= \frac{NUM_{\text{恒生A}}^{\text{前}} \times (NAV_{\text{恒生A}}^{\text{前}} - 1.000)}{NAV_{\text{添富恒生}}^{\text{后}}} \\ &= \frac{3,000,000,000 \times (1.070 - 1.000)}{1.115} \\ &= 188,340,807(\text{份}) \end{aligned}$$

恒生 A 份额新增份额折算成添富恒生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。因此，恒生 A 份额持有人新增场内添富恒生份额合计为 188,340,807 份；折算完后恒生 A 份额仍为 30 亿份。

(2) 恒生 B 份额

每个会计年度的定期份额折算不改变恒生 B 份额的参考净值及其份额数，即恒生 B 份额仍为 30 亿份。

(3) 添富恒生份额

定期份额折算后场外添富恒生份额持有人新增的场外添富恒生份额的份额数

$$= \frac{NUM_{\text{添富恒生}}^{\text{前}}}{2} \times \frac{NAV_{\text{恒生A}}^{\text{前}} - 1.000}{NAV_{\text{添富恒生}}^{\text{后}}}$$

$$= \frac{5,000,000,000.00}{2} \times \frac{1.070-1.000}{1.115}$$

$$=156,950,672.64 \text{ (份)}$$

定期份额折算后场外添富恒生份额持有人的份额数

$$= \text{定期份额折算前场外添富恒生份额的份额数} + \text{场外添富恒生份额持有人新增的场外添富恒生份额的份额数}$$

$$=5,000,000,000.00+156,950,672.64$$

$$=5,156,950,672.64 \text{ (份)}$$

定期份额折算后场内添富恒生份额持有人新增的场内添富恒生份额的份额数

$$= \frac{\text{NUM}_{\text{添富恒生}}^{\text{前}}}{2} \times \frac{\text{NAV}_{\text{恒生A}}^{\text{前}} - 1.000}{\text{NAV}_{\text{添富恒生}}^{\text{后}}}$$

$$= \frac{2,000,000,000.00}{2} \times \frac{1.070-1.000}{1.115}$$

$$= 62,780,270 \text{ (份)}$$

定期份额折算后场内添富恒生份额持有人的份额数

$$= \text{定期份额折算前场内添富恒生份额的份额数} + \text{场内添富恒生份额持有人新增的场内添富恒生份额的份额数}$$

$$=2,000,000,000.00+62,780,270$$

$$=2,062,780,270 \text{ (份)}$$

(4) 定期份额折算后添富恒生份额总份额数

定期份额折算后添富恒生份额的总份额数

$$= \text{定期份额折算前添富恒生份额的份额数} + \text{添富恒生份额持有人新增的添富恒生份额的份额数} + \text{恒生 A 份额持有人新增的场内添富恒生份额的份额数}$$

$$=5,000,000,000.00+2,000,000,000.00+156,950,672.64+62,780,270+188,340,807$$

$$=7,408,071,749.64 \text{ (份)}$$

六、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），本基金添富恒生份额暂停办理申购（含定期定额投资，下同）、赎回、转托管及配对转换业务；添富恒生份额、恒生 A 份额、恒生 B 份额正常交易。当日晚间，基金管理人计算当日基金份额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），本基金添富恒生份额暂停办理申购、赎回、转托管及配对转换业务，添富恒生份额、恒生 A 份额暂停交易。恒生 B 份额在整个定期折算期间交易正常进行。当日，本基金注册登记人及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），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，本基金添富恒生份额恢复办理申购（仅限场外份额）、赎回、转托管（仅限场内份额转托管至场外业务）及配对转换业务，添富恒生份额、恒生 A 份额恢复正常交易。

## 七、重要提示

1、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》，2020 年 1 月 6 日添富恒生份额即时行情显示的前收盘价为 2020 年 1 月 3 日的添富恒生份额的份额净值（四舍五入至 0.001 元），2020 年 1 月 6 日恒生 A 份额即时行情显示的前收盘价为 2020 年 1 月 3 日的恒生 A 的份额净值（四舍五入至 0.001 元）。由于添富恒生份额、恒生 A 份额折算前可能存在折溢价交易情形，折算前的收盘价扣除本次定期折算的折算期间（2019 年 1 月 3 日至 2020 年 1 月 2 日）的约定收益后与 2020 年 1 月 6 日的前收盘价可能有较大差异，2020 年 1 月 6 日当日可能出现交易价格大幅波动的情形。敬请投资者注意投资风险。

2、本基金恒生 A 份额期末的约定应得收益将折算为场内添富恒生份额分配给恒生 A 份额的持有人，而添富恒生份额为跟踪恒生指数的基础份额，其份额净值将随市场涨跌而变化，因此添富恒生 A 份额持有人预期收益的实现存在一定的不确定性，其可能会承担因市场下跌而遭受损失的风险。

3、由于恒生 A 份额经折算产生的新增场内添富恒生份额数和场内添富恒生份额经折算后的份额数将取整计算（最小单位为 1 份），舍去部分计入基金财产，持有极小数量恒生 A 份额或场内添富恒生份额的持有人存在无法获得新增场内

添富恒生份额的可能性。

4、本公司自 2019 年 4 月 16 日起已暂停受理场内份额的申购业务，以及场外份额转托管至场内业务(详情请见基金管理人于 2019 年 4 月 16 日发布的《关于汇添富恒生指数分级证券投资基金恢复大额申购业务并暂停场内申购及场外份额跨系统转托管的公告》)。自 2020 年 1 月 6 日起，本基金恢复办理场内份额的赎回、场内份额转托管至场外业务，场外份额的申购、赎回、定期定额投资业务，但继续暂停场内申购及场外份额跨系统转托管业务。

投资者可登陆本公司网站（[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受益，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

2019年12月27日