

# 嘉实基金管理有限公司关于嘉实多利分级债券型证券投资基金 实施转型的公告

嘉实基金管理有限公司（以下简称“本公司”）于2020年9月25日至2020年10月26日以通讯方式组织召开了嘉实多利分级债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金份额持有人大会，审议了《关于嘉实多利分级债券型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28日获得表决通过，自该日起基金份额持有人大会决议生效，并已报中国证券监督管理委员会备案。本公司已于2020年10月29日发布了《关于嘉实多利分级债券型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》，现就转型相关事项公告如下：

## 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，经与基金托管人招商银行股份有限公司协商一致，本公司已将《嘉实多利分级债券型证券投资基金基金合同》、《嘉实多利分级债券型证券投资基金托管协议》修订为《嘉实多利收益债券型证券投资基金基金合同》、《嘉实多利收益债券型证券投资基金托管协议》，并据此拟定了《嘉实多利收益债券型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]421号（《关于准予嘉实多利分级债券型证券投资基金变更注册的批复》）准予变更注册，修订后的文件于2020年11月27日起生效。

## 二、关于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29日至2020年11月25日。

选择期期间，嘉实多利基金份额的申购赎回业务，以及嘉实多利优先份额、嘉实多利进取份额的交易、配对转换业务照常办理。基金份额持有人在嘉实多利分级债券型证券投资基金正式转型前，可选择以卖出嘉实多利优先份额、嘉实多利进取份额或赎回嘉实多利基金份额等方式退出。对于在选择期内未作出上述选择的基金份额持有人，其持有的嘉实多利基金份额、嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额将最终转换为嘉实多利收益债券型证券投资基金的基金份额。在选择期期间选择赎回的，仍适用嘉实多利分级债券型证券投资基金的赎回费率和赎回费计入基金财产的比例。在选择期期间，嘉实多利分级债券型证券投资基金豁免《基金合同》中约定的投资组合比例限制等条款。

### 三、关于嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额的终止上市

基金管理人已按照深圳证券交易所的业务规则和《嘉实多利分级债券型证券投资基金基金合同》等的有关规定向深圳证券交易所申请嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额的终止上市。具体安排详见基金管理人2020年11月23日发布的《关于嘉实多利分级债券型证券投资基金之嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额终止上市公告》。

### 四、关于嘉实多利分级债券型证券投资基金基金份额的转换

本基金的基金份额转换基准日为2020年11月26日。自2020年11月26日起停止办理嘉实多利基金份额的申购、赎回和转托管（包括场外转托管和跨系统转托管）等业务，并自2020年11月26日起停止办理嘉实多利优先份额、嘉实多利进取份额与嘉实多利基金份额的基金份额配对转换业务。基金转型完毕后，嘉实多利收益债券型证券投资基金份额于2020年11月30日起开始办理申购、赎回、定期定额投资、转托管（包括场外转托管和场内转场外跨系统转托管）等业务。

在基金份额转换基准日日终，嘉实多利基金份额、嘉实多利优先份额、嘉实多利进取份额将最终转换为嘉实多利收益债券型证券投资基金的基金份额。

在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记系统登记在册的嘉实多利基金份额、嘉实多利优先份额、嘉实多利进取份额将转换为嘉实多利收益债券型证券投资基金场内份额，在中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统登记在册的嘉实多利基金份额将转换为嘉实多利收益债券型证券投资基金场外份额。

嘉实多利优先份额或嘉实多利进取份额转换为嘉实多利收益债券型证券投资基金的场内基金份额数截位取整计算（最小单位为1份），舍去部分计入基金财产。由于基金份额数取整计算存在误差，基金份额持有人将面临资产净值减小的风险；对于持有份额较少的嘉实多利优先份额或嘉实多利进取份额的基金份额持有人，将面临因持有的基金份额转换后不足1份被计入基金财产的风险。

基金份额折算转换公式如下：

将嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额折算成嘉实多利基金份额的场内份额

份额转换基准日，嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额按届时各自份额净值与嘉实多利基金份额净值之比折算为嘉实多利基金份额的场内份额。

嘉实多利优先份额折算的嘉实多利基金份额数=（折算前嘉实多利优先份额数×NAVA）  
÷ NAVt

嘉实多利进取份额折算的嘉实多利基金份额数=（折算前嘉实多利进取份额数×NAVB）

÷ NAV<sub>t</sub>

折算前嘉实多利优先份额数：指份额转换基准日闭市后嘉实多利优先份额数

折算前嘉实多利进取份额数：指份额转换基准日闭市后嘉实多利进取份额数

NAV<sub>t</sub>：份额转换基准日嘉实多利基金份额的份额净值

NAVA：份额转换基准日嘉实多利优先份额的份额净值

NAVB：份额转换基准日嘉实多利进取份额的份额净值

嘉实多利优先份额、嘉实多利进取份额折算成的嘉实多利基金份额数，场内份额数保留至整数位（最小单位为1份），余额计入基金资产。嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额的份额折算最终结果以登记机构的确认为准。

在保持基金资产净值总额和基金份额净值不变的前提下，将嘉实多利基金份额统一转换为嘉实多利收益债券型证券投资基金的基金份额。嘉实多利基金份额的场内份额和场外份额相应地转换成嘉实多利收益债券型证券投资基金的场内份额和场外份额。

## 五、关于基金份额转换的特别风险揭示

### 1、嘉实多利优先份额和嘉实多利进取份额折算后风险收益特征发生较大变化的风险

嘉实多利优先份额表现为较低风险、预期收益相对稳定的特征，分级运作期内按基金合同约定获得相应年基准收益率，但在份额折算后，嘉实多利优先份额持有人原持有的较低风险收益特征的嘉实多利优先份额将变为嘉实多利收益债券型证券投资基金场内份额，基金份额风险收益特征将因折算而发生变化。由于嘉实多利收益债券型证券投资基金场内份额无约定年基准收益率的相关安排，其基金份额净值将随投资运作变化，原嘉实多利优先份额持有人将承担因市场下跌而遭受损失的风险。

嘉实多利进取份额具有一定的杠杆属性，表现为较高风险、预期收益相对较高的特征，但在份额折算后，嘉实多利进取份额持有人原持有的嘉实多利进取份额将变为嘉实多利收益债券型证券投资基金场内份额，基金份额风险收益特征将因折算而发生较大变化。由于嘉实多利收益债券型证券投资基金场内份额没有杠杆特征，其基金份额净值将随投资运作而变化，原嘉实多利进取份额持有人将无法继续享有杠杆安排且仍需承担因市场下跌而遭受损失的风险。

### 2、基金转型过程中的流动性风险

基金转型过程中可能发生较大规模的申购赎回，以及由于市场原因等对基金净值造成大幅波动的风险。

### 3、嘉实多利优先份额和嘉实多利进取份额持有人持有的基金份额数量将会在转换后发生变

化的风险

以嘉实多利基金份额在基金份额转换基准日日终的基金份额净值为基准，嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额均按各自的基金份额参考净值最终转换为嘉实多利收益债券型证券投资基金的场内基金份额，并进行截位取整计算（最小单位为1份），因此嘉实多利优先份额和嘉实多利进取份额的基金份额持有人持有的基金份额数量将会在转换后发生变化。

4、嘉实多利优先份额和嘉实多利进取份额转换为嘉实多利收益债券型证券投资基金场内份额后自确认之日起计算及收取赎回费的风险

根据有关业务规则，嘉实多利优先份额和嘉实多利进取份额转换为嘉实多利收益债券型证券投资基金场内份额后，基金份额持有期自份额确认之日起计算，基金份额持有人赎回份额时适用的赎回费率将根据持有期确定，具体持有时间以登记结算机构系统记录为准。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。

5、在嘉实多利收益债券型证券投资基金开放赎回之前，投资者将无法办理基金赎回业务，存在一定的流动性风险。

## 六、关于本基金转型后新基金合同的生效

自2020年11月27日起，嘉实多利分级债券型证券投资基金正式变更为嘉实多利收益债券型证券投资基金。《嘉实多利收益债券型证券投资基金基金合同》生效，《嘉实多利分级债券型证券投资基金基金合同》同日失效。

嘉实基金管理有限公司

2020年11月23日