

## 关于泰达宏利中证500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《泰达宏利中证500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，泰达宏利中证500指数分级证券投资基金（简称“本基金”）将在2019年1月2日办理定期份额折算业务。相关事项提示如下：

### 一、基金份额折算基准日

根据基金合同的规定，定期份额折算基准日为每个会计年度第一个工作日。本次定期份额折算的基准日为2019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泰达500A份额（基金代码为：“150053”，场内基金简称为：“泰达500A”）、泰达中证500份额（基金代码为：“162216”，场内基金简称为：“泰达500”）。

### 三、基金份额折算方式

泰达500A份额和泰达500B份额按照《基金合同》规定的参考净值计算规则进行参考净值计算，对泰达500A份额的应得收益进行定期份额折算，每10份泰达中证500份额将按4份泰达500A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，泰达500A份额和泰达500B份额的份额配比保持4：6的比例。对于泰达500A份额期末的约定应得收益，即泰达500A份额每个会计年度12月31日份额参考净值超出1.0000元部

分，将折算为泰达中证500份额的场内份额分配给泰达500A份额持有人。泰达中证500份额持有人持有的每10份泰达中证500份额将按4份泰达500A份额获得新增泰达中证500份额的分配。持有场外泰达中证500份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外泰达中证500份额的分配；持有场内泰达中证500份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内泰达中证500份额的分配。经过上述份额折算，泰达500A份额和泰达中证500份额的基金份额净值和参考净值将相应调整。

每个会计年度第一个工作日为基金份额折算基准日，本基金将对泰达中证500份额和泰达500A份额进行应得收益的定期份额折算。

每个会计年度第一个工作日进行泰达中证 500 份额当年应得收益的定期份额折算时，有关计算公式如下：

(1) 泰达中证 500 份额

$$NAV_{500}^{\text{后}} = NAV_{500}^{\text{前}} - 0.4 \times (NAV_{500A}^{\text{前}} - 1.0000)$$

泰达中证 500 份额持有人新增的泰达中证 500 份额 =

$$0.4 \times NUM_{500}^{\text{前}} \times (NAV_{500A}^{\text{前}} - 1.0000) / NAV_{500}^{\text{后}}$$

其中：

$NAV_{500}^{\text{前}}$ ：定期份额折算前泰达中证500份额的基金份额净值，下同

$NAV_{500}^{\text{后}}$ ：定期份额折算后泰达中证500份额的基金份额净值，下同

$NAV_{500A}^{\text{前}}$ ：定期份额折算前泰达500A份额的基金份额参考净值，

下同

$NUM_{500}^{前}$ ：定期份额折算前泰达中证500份额的份额数，下同

持有泰达中证 500 份额的场外份额的持有人将按上述折算方式获得新增泰达中证 500 份额的场外份额的分配；持有泰达中证 500 份额的场内份额的持有人将按上述折算方式获得新增泰达中证 500 份额的场内份额的分配。

泰达中证 500 份额的场外份额经折算后的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；泰达中证 500 份额的场内份额经折算后的份额数取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。

## （2）泰达 500A 份额

定期份额折算后泰达 500A 份额的份额数 = 定期份额折算前泰达 500A 份额的份额数

泰达 500A 份额持有人新增的泰达中证 500 份额的份额数 =

$$[NUM_{500A}^{前} \times (NAV_{500A}^{前} - 1.0000)] / NAV_{500}^{后}$$

其中：

$NAV_{500}^{后}$ ：定期份额折算后泰达中证 500 份额净值

$NUM_{500A}^{前}$ ：定期份额折算前泰达 500A 份额的份额数

泰达 500A 份额折算成泰达中证 500 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。

### (3) 泰达500B份额

定期份额折算不改变泰达500B份额参考净值及其份额数。

### (4) 折算后泰达中证500份额的总份额数

折算后泰达中证500份额的总份额数=定期份额折算前泰达中证500份额的份额数+泰达中证500份额持有人新增的泰达中证500份额数+泰达500A份额持有人新增的泰达中证500份额数。

## 四、基金份额折算期间的基金业务办理

(一) 定期份额折算基准日(即2019年1月2日)，本基金暂停办理申购、赎回、转托管(包括场外转托管、跨系统转托管，下同)业务、配对转换业务；泰达500A、泰达500B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。

(二) 定期份额折算基准日后的第一个工作日(即2019年1月3日)，本基金暂停办理申购、赎回、转托管、配对转换业务，泰达500A暂停交易，泰达500B正常交易。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。

(三) 定期份额折算基准日后的第二个工作日(即2019年1月4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，本基金恢复办理申购、赎回、转托管、配对转换业务，泰达500A、泰达500B正常交易。

（四）根据深圳证券交易所《深圳证券交易所证券投资基金交易和申购赎回实施细则》，2019年1月4日泰达500A即时行情显示的前收盘价为2019年1月3日的泰达500A的份额净值（四舍五入至0.001元）。由于泰达500A折算前可能存在折溢价交易情形，折算前的收盘价扣除2018年约定收益后与2019年1月4日的前收盘价可能有较大差异，1月4日当日可能出现交易价格大幅波动的情形。

## 五、重要提示

由于泰达500A份额新增份额折算成泰达中证500份额的场内份额数和泰达中证500份额的场内份额经折算后的份额数取整计算（最小单位为1份），舍去部分计入基金财产，持有较少泰达500A份额数或场内泰达中证500份额数的份额持有人存在无法获得新增场内泰达中证500份额的可能性。

投资者若希望了解基金定期份额折算业务详情，请登陆本公司网站：[www.mfcteda.com](http://www.mfcteda.com)或者拨打本公司客服电话：400—698—8888。

本公司承诺以诚实信用、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。投资者投资于基金前应认真阅读基金的基金合同、招募说明书等文件。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

泰达宏利基金管理有限公司

2018年12月26日