

国寿安保基金管理有限公司关于国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金实施转型的提示性公告

国寿安保基金管理有限公司（以下简称“本公司”）旗下管理的国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”或“国寿养老基金”)于 2019 年 1 月 17 日起至 2019 年 2 月 15 日以通讯方式召开基金份额持有人大会,审议《关于国寿安保中证养老产业指数分级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“本次会议议案”)。本次会议议案于 2019 年 2 月 18 日获表决通过,持有人大会决议自该日起生效。本公司于 2019 年 2 月 19 日在指定媒介上发布了《国寿安保基金管理有限公司关于国寿安保中证养老产业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》。

根据本次持有人大会决议,现将实施转型的相关事项提示如下:

一、本基金转型选择期开始日:2019 年 2 月 19 日,本基金转型选择期终止日:终止上市日前一交易日。

本次转型实施前的选择期自 2019 年 2 月 19 日起,至终止上市日前一交易日止,期间不少于二十个交易日。选择期期间,国寿养老份额的赎回、转出业务,国寿养老 A 份额与国寿养老 B 份额的交易、配对转换业务照常办理,不受影响;国寿养老份额的申购、转入业务暂停办理。基金份额持有人在正式转型前,可选择卖出国寿养老 A 份额、国寿养老 B 份额或赎回、转出国寿养老份额等方式退出。对于在选择期内未作出选择的基金份额持有人,其持有的国寿养老份额、国寿养老 A 份额与国寿养老 B 份额将最终转换为国寿安保中证养老产业指数增强型证券投资基金的基金份额。在选择期期间,由于本基金需应对赎回、转出等情况,基金份额持有人同意在选择期豁免本基金基金合同中约定的投资组合比例限制等条款。基金管理人提请基金份额持有人大会授权基金管理人据此落实相关事项,并授权基金管理人可根据实际情况做相应调整,以及根据实际情况可暂停申购、赎回、转入、转出、配对转换或调整申购、赎回、转入、转出的方式等。

二、国寿养老 A 份额、国寿养老 B 份额终止上市交易

为实施转型,本公司将按照深圳证券交易所的业务规则向深圳证券交易所申请国寿养老 A 份额、国寿养老 B 份额的终止上市。届时,本公司将按照深圳证券

交易所的业务规则及时发布本基金的终止上市公告。

三、基金份额的转换净值折算和变更登记

本公司将于选择期届满后对投资者未赎回的国寿养老份额以及持有的国寿养老 A 份额和国寿养老 B 份额进行基金份额净值折算和份额变更登记，将国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金的各类基金份额转换为国寿安保中证养老产业指数增强型证券投资基金的基金份额。

1、基金份额净值折算

(1) 将国寿养老 A 份额与国寿养老 B 份额折算成国寿养老份额的场内份额在份额折算基准日日终，以国寿养老份额的基金份额净值为基准，按照国寿养老 A 份额与国寿养老 B 份额各自的基金份额净值折算成国寿养老份额的场内份额。国寿养老 A 份额（或国寿养老 B 份额）基金份额持有人持有的折算后国寿养老份额的场内份额取整计算（最小单位为 1 份），取整后的余额计入基金财产。

份额折算计算公式：

国寿养老 A 份额（或国寿养老 B 份额）的折算比例 = 份额折算基准日国寿养老 A 份额（或国寿养老 B 份额）的基金份额参考净值 / 份额折算基准日国寿养老份额的基金份额净值

国寿养老 A 份额（或国寿养老 B 份额）持有人折算后新增国寿养老份额的场内份额数 = 基金份额持有人持有的折算前国寿养老 A 份额（或国寿养老 B 份额）的份额数 × 国寿养老 A 份额（或国寿养老 B 份额）的折算比例

(2) 将国寿养老份额的场内份额、场外份额的份额净值调整为 1.0000 元（基金份额持有人持有的份额数量相应增减）

份额折算计算公式：

国寿养老份额的场内份额（或场外份额）的折算比例 = 份额折算基准日国寿养老份额的场内份额（或场外份额）基金份额净值 / 1.0000

折算后国寿养老份额的场内份额（或场外份额）的份额数 = 基金份额持有人持有的折算前国寿养老份额的场内份额（或场外份额）的份额数 × 国寿养老份额的场内份额（或场外份额）的折算比例

基金份额折算比例保留至小数点后第 8 位，小数点第 8 位以后的部分四舍五入。国寿养老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，国寿养老份额的场内份额经折算后的份额数保留至整数位，由此产生的误差计入基金财产。

除保留位数因素影响外，基金份额的折算对基金份额持有人的权益无实质性影响。

2、基金份额变更登记

（1）基金份额变更登记时间

中国证券登记结算有限公司将于基金份额净值折算完成的当天，即基金份额变更登记日对基金份额变更登记。在基金份额变更登记日日终，国寿养老份额的场内份额、场外份额变更登记为国寿安保中证养老产业指数增强型证券投资基金的基金份额，原场外份额结转后的基金份额数，保留到小数点后2位，小数点后第3位四舍五入，原场内份额结转而来的基金份额数保留至整数位，由此产生的计算误差归入基金资产。

（2）基金份额变更登记流程

1) 基金管理人向中国证券登记结算有限责任公司申请基金更名。原“国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金”将变更登记为“国寿安保中证养老产业指数增强型证券投资基金”。

2) 份额折算基准日后基金管理人向中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司申请场内份额退出登记。

3) 中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司办理场内份额退出登记，并向基金管理人提供退出登记前的持有人名册。

4) 基金管理人根据中登深圳分公司提供的退出登记前持有人名册将原场内持有人的份额统一登记到基金管理人在中登开立的场外基金账户下。

5) 经原国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金场内份额持有人向基金管理人提出确权申请，基金管理人把原归属于投资者的份额转到其开立的中登场外基金账户。

基金变更登记成功后，国寿安保中证养老产业指数增强型证券投资基金的登记机构仍为中国证券登记结算有限责任公司。

四、基金份额的确权

基金份额变更登记完成后，原国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金

场内份额持有人需要赎回基金份额时，基金份额持有人需要对原持有的基金份额进行确认和重新登记，投资者完成确权业务后方可办理赎回等业务，具体确权业务规则由基金管理人根据上述规则制定相应的细则并公告。

基金转型完成后，国寿安保中证养老产业指数增强型证券投资基金的登记机构仍为中国证券登记结算有限责任公司。在转型完成并开放赎回业务后，基金份额持有人可通过直销机构或代销机构办理基金份额的赎回。基金份额登记在证券登记结算系统的原国寿养老份额、国寿养老 A 份额、国寿养老 B 份额的持有人需先办理确权（由于国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金将终止上市，且终止场内申购赎回，登记在证券登记结算系统的基金份额，将统一登记在基金管理人开立的中登场外基金账户，持有人需要对其持有的原场内份额进行重新确认与登记，基金管理人把原归属于投资者的份额转到其开立的中登场外基金账户。此过程称之为“确权”），待确权成功并经转型后新基金恢复赎回业务后，方可办理赎回或其他业务。

经过确权后持有人持有的原登记在场内证券登记结算系统的份额，持有期限自重新确认与登记之日起计算；基金份额持有人原登记在场外登记系统的份额，持有期限自其认购/申购国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金基金份额确认之日起计算。

五、关于基金合同等法律文件的修订

根据《关于国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金转型及基金合同修改有关事项的议案》以及相关法律法规的规定，经与基金托管人招商证券股份有限公司协商一致，基金管理人已将《国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金基金合同》、《国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金托管协议》分别修订为《国寿安保中证养老产业指数增强型证券投资基金基金合同》、《国寿安保中证养老产业指数增强型证券投资基金托管协议》，并据此编制《国寿安保中证养老产业指数增强型证券投资基金招募说明书》。国寿安保中证养老产业指数增强型证券投资基金已经中国证监会证监许可[2018]2221号（《关于准予国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金变更注册的批复》）准予变更注册。自本基金基金份额转换完成之日起，《国寿安保中证养老产业指数增强型证券投资基金基金合同》生效，《国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金基金合同》同时失效，国寿安

保中证养老产业指数分级证券投资基金正式变更为国寿安保中证养老产业指数增强型证券投资基金。

六、本基金转型主要风险及预备措施

（一）基金转型后风险收益特征发生变化的风险

本基金由指数分级股票型基金变更为指数增强股票型基金，与原基金的投资目标、投资范围和投资策略等方面存在区别，风险收益特征也将发生变化，提示投资者关注。

（二）基金转型后遭遇大规模赎回的流动性风险

为应对基金转型可能引发的大规模赎回，本基金将尽可能提前做好流动性安排，保持投资组合的流动性以应对可能的赎回，降低净值波动率。

（三）基金转型过程中的操作及市场风险

为维护基金份额持有人利益，对于基金转型过程中可能发生的较大规模的申购赎回或市场风险对基金净值造成大幅波动，基金管理人将根据申购赎回情况及时对可能存在的市场投资风险进行有效评估，保持相对合理的仓位水平，科学有效地控制基金的市场风险。

（四）折算后原场内份额后续安排

为充分维护投资者利益，特对折算后场内基金份额后续安排进行如下提示：

自《国寿安保中证养老产业指数增强型证券投资基金基金合同》生效并开放跨系统转托管后，原场内份额持有人，可自行进行场外开户和跨系统转托管至场外。待关闭场内份额的跨系统转托管业务后，原登记在中国证券登记结算有限责任公司深圳证券登记结算系统的场内基金份额，将统一转登记至本基金管理人开立的中登场外基金账户上，届时仍持有场内份额余额的投资者，需根据基金管理人届时发布的相关公告，对其持有的基金份额进行重新确认与登记，此过程即为“确权”，确权完成后，基金份额持有人方可在场外对相关基金份额进行赎回及其他业务。

特此公告。

国寿安保基金管理有限公司

2019年2月19日