

# 关于嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

## 实施基金份额折算的提示性公告

嘉实基金管理有限公司已于 2019 年 1 月 4 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及深圳证券交易所网站（www.szse.cn）发布了《关于嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金实施基金份额折算的公告》。为了保障嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金份额持有人的权益，现发布关于嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金实施基金份额折算的提示性公告。

为了满足广大投资者的需求，提高嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”，场内简称：300ETF，场外简称：嘉实沪深 300ETF，基金代码：159919）的交易便利性，经与基金托管人中国银行股份有限公司、深圳证券交易所协商一致，本基金管理人决定对本基金实施基金份额折算。折算日折算后的基金份额净值和当日标的指数收盘值的千分之一基本一致。

### 一、基金份额的折算

（一）权益登记日、除权日、份额折算日

2019 年 1 月 11 日。

（二）折算对象

权益登记日登记在册的本基金所有基金份额。

（三）折算比例

1. 2019 年 1 月 3 日收市后，基金管理人计算当日的基金资产净值 X，基金份额总额 Y，并与基金托管人核对一致。

2. 令上述日期沪深 300 指数（指数代码：399300）收盘点位为 I，则折算比例 =  $(X/Y) \div (I/1000)$ ，结果以四舍五入的方法保留到小数点后 9 位。

根据上述公式，本基金本次基金份额折算比例为 1.110680861。

（四）折算方式

1. 权益登记日日终，中国证券登记结算有限责任公司（以下简称中国结算）根据基金管理人的委托，按照上述折算比例，对各基金份额持有人持有的基金份额进行折算。为保护基金份额持有人利益，中国结算将对基金份额持有人持有的折算产生的小数点后基金份额按照“上进位”的原则进行取整，即将小数点后基金份额均进位为 1 份。如果某基金份额持有人拥有多个账户，或同一账户存在不同托管单元，或某一托管单元存在冻结份额和未冻结份额，则对该基金份额持有人的这几部分小数点后基金份额的进位将以中国结算的实际处理结果为准。进位处理所需资金由基金管理人弥补，并于权益登记日下一工作日划入基金托管账户。

2. 除权日（折算日）基金份额净值 = 除权日（折算日）基金资产净值 ÷ 折算后的基金份额数量，结果四舍五入保留到小数点后四位。

基金份额折算后，基金资产净值（包括已实现收益、未实现收益和实收基金的金额）没有变化，本基金未来的分红能力也不受影响，仅基金份额总额与持有人持有的基金份额数相应调整，对基金份额持有人所代表的表决权和收益分配权等权益无实质性影响。

3. 本基金本次份额折算后，基金份额累计净值 = [（基金份额净值 + 基金份额本次折算后的份额分红金额）× 基金份额本次折算比例 + 基金份额上次折算至本次折算期间份额分红金额] × 基金份额上次折算比例。

4.本基金本次份额折算后，在确定基金收益分配数额时，基金净值增长率为收益评价日基金份额净值与基金份额本次折算日基金份额净值之比减去1乘以100%；标的指数同期增长率为收益评价日标的指数收盘值与基金份额本次折算日标的指数收盘值之比减去1乘以100%。

（五）折算结果的公告和查询

权益登记日下一工作日前（含权益登记日下一工作日），基金管理人将公告基金份额折算结果。自权益登记日后的第一个工作日（2019年1月14日）起，基金份额持有人可以通过申购赎回代办证券公司或二级市场交易代办证券公司查询其所持有基金份额的折算结果。

（六）最小申购赎回单位调整

本次基金份额折算不调整最小申购赎回单位。

（七）特别提示

为保证基金份额折算的顺利实施，以下事项提示投资者、证券公司及其他市场参与者加以关注，并做好相应准备：

1. 本基金于权益登记日（2019年1月11日）停牌，权益登记日后的第一个工作日（2019年1月14日）复牌。
2. 本基金于权益登记日（2019年1月11日）暂停申购（含RTGS部分）、赎回业务，权益登记日后的第一个工作日（2019年1月14日）恢复申购（含RTGS部分）和赎回业务。投资人申购、赎回的基金份额需为最小申购赎回单位的整数倍。
3. 权益登记日（2019年1月11日）当日，因本基金停牌，投资者将无法申报以本基金为标的的融资融券交易。权益登记日后的第一个工作日（2019年1月14日）起，以上交易申报恢复正常。
4. 权益登记日（2019年1月11日），证券公司应暂停以本基金为标的证券的约定购回式证券交易及其相关业务的交易申报，权益登记日后的第一个工作日（2019年1月14日）起可恢复正常办理。
5. 根据相关业务规则，证券公司在权益登记日（2019年1月11日）前一交易日完成融资融券业务相关数据申报后，应按照折算比例对投资者借入本基金的数量进行相应调整，故投资者权益登记日当日可查询到的借入本基金的数量可能为基金份额折算后的数量。中国结算在基金份额折算前对融资融券业务中的非交易业务进行处理，若投资者在权益登记日按基金份额折算后的数量提交本基金还券划转业务申请，可能存在还券数量不准确等问题。
6. 权益登记日（2019年1月11日，同时为本基金的除权日）当日，深圳证券交易所行情系统发布的本基金的前收盘价为除权后的价格，而中国结算在权益登记日日终才对本基金份额进行折算处理。由于基金价格除权与份额折算的时间点不完全一致，对于融资融券、约定购回式证券交易、股票质押式回购交易等需要计算投资者维持担保比例或履约保障比例的业务，权益登记日当日对以本基金作为担保品的投资者维持担保比例或履约保障比例计算可能不准确，证券公司在盯市、接受该部分投资者融资融券担保品提取等申请时，需要进行复核或相应限制。该部分投资者在申请融资融券担保品提取或股票质押式回购交易部分解除质押时，也应当关注维持担保比例或履约保障比例计算不准确的可能影响。
7. 本基金新增份额在折算处理日后的第一个工作日（2019年1月14日）上市流通并可赎回。
8. 本基金折算处理日（2019年1月11日）的基金份额净值和基金份额累计净值，将于2019年1月14日通过网站以及指定信息披露媒介进行披露。
9. 在本基金折算前已冻结或质押的基金份额，折算后的相应份额将一并被冻结或质押。
10. 基金份额折算导致基金份额净值变化，不会改变基金的风险收益特征，也不会降低基金投资风险或提高基金投资收益；基金份额折算后基金投资仍有可能出现亏损，基金份额

净值仍有可能低于面值。

## 二、基金份额销售机构

### （一）申购赎回代理券商

国泰君安证券、中信建投证券、国信证券、招商证券、广发证券、中信证券、中国银河证券、海通证券、申万宏源证券、安信证券、华泰证券、中信证券（山东）、中投证券、兴业证券、东方证券、方正证券、长城证券、光大证券、东北证券、中泰证券、华福证券、中国国际金融有限公司、宏信证券、长江证券、湘财证券、渤海证券、新时代证券、平安证券、华鑫证券。

### （二）二级市场交易代办券商

投资者在深圳证券交易所各会员单位证券营业部均可参与本基金二级市场交易。

如本基金增加其他销售机构，基金管理人将及时公告。

## 三、其他事项

1. 本公告仅对本基金份额折算的有关事项予以说明。投资者欲了解本基金详细情况，请阅读本基金基金合同及更新的招募说明书。

2. 投资者可访问本公司网站 [www.jsfund.cn](http://www.jsfund.cn) 或拨打客户服务电话（400-600-8800）咨询相关事宜。

特此公告

嘉实基金管理有限公司

2019年1月11日