

# 前海开源基金管理有限公司关于前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金实施转型的公告

前海开源基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”或“本公司”）于2020年10月20日至2020年11月16日17:00以通讯方式组织召开了前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）基金份额持有人大会，审议了《关于前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》（以下简称“《议案》”）。《议案》于2020年11月18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。基金管理人于2020年11月19日发布了《前海开源中证健康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》（以下简称“《决议公告》”）。根据《议案》及《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改

根据《议案》以及相关法律法规的规定，经与基金托管人国信证券股份有限公司协商一致，基金管理人已将《前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金基金合同》、《前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金托管协议》分别修订为《前海开源中证健康产业指数型证券投资基金基金合同》、《前海开源中证健康产业指数型证券投资基金托管协议》，并据此编制《前海开源中证健康产业指数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]1995号（《关于准予前海开源中证健康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，修订后的文件于2020年12月18日起生效。

## 二、关于本基金转型方案实施的安排

本次转型实施前的选择期为2020年11月19日至2020年12月16日。

选择期期间，前海开源中证健康份额（即基础份额，简称：“前海开源健康分级”，基金代码：164401，场内简称：“健康分级”，包括场外份额、场内份额）的申购赎回、转换业务，以及前海开源中证健康A份额（场内简称：“健康

A”，基金代码：150219）、前海开源中证健康 B 份额（场内简称：“健康 B”，基金代码：150220）的交易、配对转换业务照常办理。基金份额持有人在本基金正式实施转型前，可选择卖出健康 A、健康 B 或赎回、转出前海开源中证健康份额。对于在选择期内未作出选择的基金份额持有人，其持有的前海开源中证健康份额、健康 A 与健康 B 将最终转换为前海开源中证健康产业指数型证券投资基金基金份额。

在选择期期间选择赎回的，仍适用前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金的赎回费率和赎回费计入基金财产的比例。

### 三、关于健康 A 与健康 B 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《前海开源中证健康产业指数分级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健康 A 与健康 B 的终止上市。具体安排详见基金管理人 2020 年 12 月 14 日发布的《关于前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金之前海开源中证健康 A 份额和前海开源中证健康 B 份额终止上市的公告》。

### 四、关于前海开源中证健康产业指数分级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 12 月 17 日。2020 年 12 月 17 日起，本基金停止办理前海开源中证健康份额的申购（含定期定额投资）、赎回及转托管（含系统内转托管及跨系统转托管）等业务。自 2020 年 12 月 17 日起，本基金终止办理前海开源中证健康 A 份额、前海开源中证健康 B 份额与前海开源中证健康份额的基金份额配对转换业务。基金转型完毕后，前海开源中证健康产业指数型证券投资基金将于 2020 年 12 月 21 日开始办理申购（含定期定额投资）、赎回及转托管（含系统内转托管及跨系统转托管）等业务。

健康 A、健康 B 将以前海开源中证健康份额在基金份额转换基准日日终的基金份额净值为基准，按照各自的基金份额参考净值转换成前海开源中证健康产业指数型证券投资基金基金份额的场内份额，份额转换计算公式如下：

健康 A（或健康 B）的转换比例 = 基金份额转换基准日健康 A（或健康 B）的基金份额参考净值 / 基金份额转换基准日前海开源中证健康份额的基金份额净值

健康 A（或健康 B）基金份额持有人持有的转换后前海开源中证健康产业指数型证券投资基金场内份额=基金份额持有人持有的转换前健康 A（或健康 B）的份额数×健康 A（或健康 B）的转换比例

基金份额转换比例保留至小数点后第 9 位，小数点第 9 位以后的部分四舍五入。健康 A、健康 B 经转换后的份额数保留至整数位，不足 1 份的零碎份额的处理方式按照中国证券登记结算有限责任公司的相关规则处理，转换后的基金份额以登记结算机构最终确认的数据为准。由于基金份额数取整计算产生的误差，基金份额持有人将面临其所持基金资产净值减小的风险，对于持有份额数较少的健康 A、健康 B 持有人，将面临持有的基金份额转换后份额数不足一份而被计入基金资产的风险。

前海开源中证健康份额的场内份额自动转换为前海开源中证健康产业指数型证券投资基金的场内份额，前海开源中证健康份额的场外份额自动转换为前海开源中证健康产业指数型证券投资基金的场外份额。

转换后的前海开源中证健康产业指数型证券投资基金基金份额的申购费率、赎回费率具体如下：

## 1、申购费率

### （1）场外申购费率

申购金额 M（元） （含申购费）	申购费率
M < 50 万	1.20%
50 万 ≤ M < 250 万	0.80%
250 万 ≤ M < 500 万	0.40%
M ≥ 500 万	每笔 1,000 元

注：部分销售机构如实行优惠费率，请投资人参见销售机构公告。

### （2）场内申购费率

场内申购费率参照场外销售机构申购费率执行。

## 2、赎回费率

### （1）场外赎回费率

持有时间 D（天）	赎回费率
D < 7	1.50%
7 ≤ D < 365	0.50%
365 ≤ D < 1095	0.20%

D $\geq$ 1095	0
---------------	---

## 2) 场内赎回费率

持有期限 D (天)	赎回费率
D $<$ 7	1.50%
D $\geq$ 7	0.50%

赎回费中,对持续持有期少于7日的基金份额持有人收取的赎回费全额计入基金财产,对持续持有期大于等于7日的基金份额持有人收取的赎回费总额的25%应归基金财产,其余用于支付市场推广、注册登记费和其他必要的手续费。

根据有关业务规则,基金份额持有人持有的前海开源中证健康份额转换为前海开源中证健康产业指数型证券投资基金基金份额后,其原基金份额持有期计入前海开源中证健康产业指数型证券投资基金基金份额的持有期;基金份额持有人持有的健康A和健康B转换为前海开源中证健康产业指数型证券投资基金场内份额后,基金份额持有期自前海开源中证健康产业指数型证券投资基金场内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。

## 五、关于基金份额转换的特别风险揭示

### 1、健康A和健康B转换后风险收益特征发生较大变化的风险

健康A表现为低风险、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,但在份额转换后,健康A持有人原持有的较低风险收益特征的健康A将变为较高风险收益特征的前海开源中证健康产业指数型证券投资基金场内份额,基金份额风险收益特征将因转换而发生较大变化。由于前海开源中证健康产业指数型证券投资基金场内份额为跟踪中证健康产业指数的基金份额,无约定年基准收益率的相关安排,其基金份额净值将随标的指数的涨跌而变化,原健康A持有人将承担因市场下跌而遭受损失的风险。

健康B具有一定的杠杆属性,表现为高风险、预期收益相对较高的特征,但在份额转换后,健康B持有人原持有的健康B将变为较高风险收益特征的前海开源中证健康产业指数型证券投资基金场内份额,基金份额风险收益特征将因转换而发生较大变化。由于前海开源中证健康产业指数型证券投资基金场内份额为跟踪中证健康产业指数的基金份额,没有杠杆特征,其基金份额净值将随标的指数

的涨跌而变化，原健康 B 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、健康 A 和健康 B 的流动性风险

健康 A 和健康 B 转换为前海开源中证健康产业指数型证券投资基金场内份额前，健康 A 和健康 B 的持有人有两种方式退出：1) 在场内按市价卖出基金份额；2) 在场内买入等量的对应份额（即健康 A 持有人买入等量的健康 B，或者健康 B 持有人买入等量的健康 A），合并为前海开源中证健康份额，按照前海开源中证健康份额的基金份额净值申请场内赎回或转托管至场外后申请赎回。

由于健康 A 和健康 B 的持有人可能选择场内卖出或合并赎回，场内份额数量可能发生较大下降，可能出现场内流动性不足的情况，特提请投资者注意流动性风险。

## 3、转换前存在溢价交易的健康 A 和健康 B 的持有人因溢价消失而造成损失的风险

基金份额转换基准日前，健康 A 和健康 B 仍可正常交易。期间，健康 A 和健康 B 可能存在折溢价交易情形，其折溢价率可能发生较大变化。

由于基金份额转换基准日日终，以前海开源中证健康份额的基金份额净值为基准，健康 A 和健康 B 均按各自的基金份额参考净值（而不是二级市场价格）转换为前海开源中证健康产业指数型证券投资基金场内份额，如果投资者在转换前以溢价买入，转换后可能遭受较大损失。特提请参与二级市场交易的投资者注意折溢价所带来的风险。

投资者应密切关注健康 A 和健康 B 的基金份额参考净值变化情况，可通过本公司网站（[www.qhkyfund.com](http://www.qhkyfund.com)）等方式进行查询。

## 4、健康 A 和健康 B 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的风险

以前海开源中证健康份额在基金份额转换基准日日终的基金份额净值为基准，健康 A 和健康 B 均按各自的基金份额参考净值转换为前海开源中证健康产业指数型证券投资基金场内份额，并进行取整计算（最小单位为 1 份），因此健康 A 和健康 B 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。

## 5、健康 A 和健康 B 转换为前海开源中证健康产业指数型证券投资基金场内份额后部分投资者可能无法直接办理场内赎回的风险

健康A和健康B转换为前海开源中证健康产业指数型证券投资基金场内份额后，投资者可以申请场内赎回基金份额或者转托管至场外后申请赎回基金份额。部分投资者可能由于所在证券公司不具备基金销售资格或其他原因无法直接办理场内赎回，需先转托管至场外后再申请赎回或者先转托管到具有基金销售资格的证券公司后再申请赎回。

6、健康A和健康B转换为前海开源中证健康产业指数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，健康A和健康B转换为前海开源中证健康产业指数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。

7、在前海开源中证健康产业指数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；在前海开源中证健康产业指数型证券投资基金符合法律法规和深圳证券交易所规定的上市条件的情况下，基金管理人可以根据情况或者需要决定是否上市，在前海开源中证健康产业指数型证券投资基金上市交易之前，投资者将无法进行基金份额的上市交易，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12月18日起，《前海开源中证健康产业指数型证券投资基金基金合同》生效，《前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金基金合同》同日失效。前海开源中证健康产业指数型证券投资基金的基金理由梁溥森先生担任，本基金原基金经理不再担任前海开源中证健康产业指数型证券投资基金的基金经理。

投资者欲了解详细情况，请拨打前海开源基金管理有限公司客户服务电话4001-666-998或登录本公司网站（[www.qhkyfund.com](http://www.qhkyfund.com)）获取相关信息。

风险提示：基金管理人承诺以诚实信用、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。销售机构根据法规要求对投资者类别、风险承受能力和基金的风险等级进行划分，并提出适当性匹配意见。投

投资者在投资基金前应认真阅读基金合同、招募说明书（更新）和基金产品资料概要（更新）等基金法律文件，全面认识基金产品的风险收益特征，在了解产品情况及销售机构适当性意见的基础上，根据自身的风险承受能力、投资期限和投资目标，对基金投资作出独立决策，选择合适的基金产品。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

特此公告。

前海开源基金管理有限公司

2020年12月14日