关于易方达中小板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《易方达中小板指数分级证券投资基金基金合同》(以下简称“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,易方达中小板指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)将以2015年9月18日为折算基准日,办理定期份额折算业务。

相关事项安排如下:

一、基金份额折算基准日

根据基金合同的约定,本基金定期份额折算基准日为第i个分级运作周年的最后一个工作日(i=1,2,3,4,5,6)。据此,本基金本次定期份额折算的基准日为2015年9月18日。

二、基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的易方达中小板A类份额(基金代码:150106,场内简称“中小A”)、易方达中小板份额(基金代码:161118,场内简称:“易基中小”)。

三、基金份额折算方式

易方达中小板A类份额、易方达中小板B类份额按照基金合同规定的基金份额参考净值计算规则进行基金份额参考净值计算,对易方达中小板A类份额的应得收益,每2份易方达中小板份额将按1份易方达中小板A类份额获得约定应得收益的新增折算份额。

在基金份额折算前后,易方达中小板A类份额与易方达中小板B类份额的份额配比保持1:1的比例不变。

易方达中小板A类份额持有人所持每份易方达中小板A类份额在分级运作年度末的约定应得收益,即易方达中小板A类份额每一分级运作周年最后一个工作日基金份额参考净值超出1.0000元的部分,将折算为场内易方达中小板份额并分配给易方达中小板A类份额的份额持有人。易方达中小板份额持有人所持有的每2份易方达中小板份额将按1份易方达中小板A类份额获得新增易方达中小板份额。其中,持有场外易方达中小板份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外易方达中小板份额;持有场内易方达中小板份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内易方达中小板份额。经过上述份额折算,易方达中小板A类份额的基金份额参考净值、易方达中小板份额的基金份额净值将相应调整。

每一分级运作周年进行易方达中小板A类份额上一分级运作周年应得收益的定期份额折算时,有关计算公式如下:

1. 易方达中小板A类份额(场内简称“中小A”)

[illegible],即

定期份额折算后易方达中小板A类份额的份额数 = 定期份额折算前易方达中小板A类份额的份额数

定期份额折算后易方达中小板份额的份额净值为:

[illegible]

易方达中小板A类份额持有人新增场内易方达中小板份额的份额数=

[illegible]

其中:

[illegible]

2. 易方达中小板B类份额(场内简称“中小B”)

每一分级运作周年的定期份额折算不改变易方达中小板B类份额的基金份额参考净值及其份额数。

3. 易方达中小板份额

[illegible]

易方达中小板份额持有人新增的易方达中小板份额的份额数=

[illegible]

定期份额折算后易方达中小板份额持有人持有的易方达中小板份额的份额数=

定期份额折算前易方达中小板份额的份额数+易方达中小板份额持有人新增的易方达中小板份额的份额数

即:

[illegible]

其中:

[illegible]

易方达中小板份额的场外份额经折算后的份额数保留到小数点后两位,小数点后两位以后的部分舍去,舍去部分所代表的资产归基金所有;易方达中小板份额的场内份额经折算后的份额数保留至整数位(最小单位为1份),不足1份的零碎份加总后保留至整数位(最小单位为1份),按各个场内份额持有人的零碎份从大到小的排序,依次向相应的基金份额持有人记增1份,直到所有零碎份的合计份额分配完毕。如登记结算机构业务规则有变化,以其最新规定为准。

4. 举例

假设某个定期份额折算基准日,易方达中小板份额当日折算前资产净值为1,400,000,000.00元。当天场外易方达中小板份额、场内易方达中小板份额、易方达中小板A类份额、易方达中小板B类份额的份额数分别为15亿份、5亿份、10亿份和10亿份。前一个分级运作周年末每份易方达中小板A类份额的参考份额净值为1.0200元,运作周年内进行过不定期份额折算。

(1)定期份额折算的对象为折算基准日登记在册的易方达中小板A类份额和易方达中小板份额,分别为10亿份和20亿份。

(2)易方达中小板A类份额持有人折算后持有的易方达中小板A类份额=折算前易方达中小板A类份额,即10亿份。

[illegible]

=[1,400,000,000.00-(1.0200-1.0000)×2,000,000,000/2]/2,000,000,000

=0.6900 元

易方达中小板A类份额持有人新增场内易方达中小板份额的份额数=

[illegible]

=1,000,000,000×[(1.0200-1.0000)/0.6900]

= 28,985,507份

易方达中小板A类份额新增份额折算成易方达中小板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。因此,新增场内易方达中小板份额为28,985,507份;折算完成后,基金份额持有人持有的易方达中小板A类份额仍为10亿份。

(3)场外易方达中小板份额持有人新增的场外易方达中小板份额的份额数=

[illegible]

=1,500,000,000×[(1.0200-1.0000)/(2×0.6900)]

= 21,739,131.00 份

定期份额折算后场外易方达中小板份额的份额数

= 定期份额折算前场外易方达中小板份额的份额数 + 场外新增易方达中小板份额的份额数

= 1,500,000,000 + 21,739,131.00

= 1,521,739,131.00 份

场内易方达中小板份额持有人新增的场内易方达中小板份额的份额数=

[illegible]

=500,000,000×[(1.0200-1.0000)/(2×0.6900)]

= 7,246,377份

新增份额折算成易方达中小板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。因此,新增场内易方达中小板份额为7,246,377份。

定期份额折算后场内易方达中小板份额的份额数=定期份额折算前场内易方达中小板份额的份额数 + 场内新增易方达中小板份额的份额数

= 500,000,000 + 7,246,377

= 507,246,377份

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2015年9月18日),本基金暂停办理申购(含定期定额投资,下同)、赎回、转托管(包括场外转托管、跨系统转托管,下同)、转换及份额配对转换业务;易方达中小板A类份额、易方达中小板B类份额正常交易。当日晚间,基金管理人计算当日易方达中小板份额的基金份额净值,易方达中小板A类份额与易方达中小板B类份额的基金份额参考净值,以及用于计算易方达中小板份额、易方达中小板A类份额新增份额的份额折算比例。

(二)定期份额折算基准日后的第一个工作日(即2015年9月21日),本基金暂停办理申购、赎回、转托管、转换及份额配对转换业务,易方达中小板A类份额暂停交易,易方达中小板B类份额正常交易。当日,本基金登记结算机构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2015年9月22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、转换及份额配对转换业务,易方达中小板A类份额上午10:30复牌。

五、重要提示

(一)根据深圳证券交易所《证券投资基金交易和申购赎回实施细则》,2015年9月22日即时行情显示的易方达中小板A类份额的前收盘价将调整为2015年9月21日易方达中小板A类份额的基金份额参考净值(四舍五入至0.001元)。由于易方达中小板A类份额折算前可能存在折溢价交易情形,且折算前的收盘价在扣除上一分级运作周年约定收益后,与易方达中小板A类份额折算后次日前收盘价可能有较大差异,故2015年9月22日当日可能出现交易价格大幅波动的情形。敬请投资者注意投资风险。

(二)本基金易方达中小板A类份额上一分级运作周年期末的约定应得收益将折算为场内易方达中小板份额分配给易方达中小板A类份额的持有人,而易方达中小板份额为跟踪中小板价格指数的基础份额,其份额净值将随市场涨跌而变化,因此易方达中小板A类份额持有人预期收益的实现存在一定的不确定性,其可能会承担因市场下跌而遭受损失的风险。

(三)易方达中小板A类份额和场内易方达中小板份额经折算产生的新增场内易方达中小板份额数保留至整数位(最小单位为1份),不足1份的零碎份加总后保留至整数位(最小单位为1份),按各个场内份额持有人零碎份从大到小的排序,依次向相应的基金份额持有人记增1份,直到所有零碎份的合计份额分配完毕。持有较少易方达中小板A类份额或场内易方达中小板份额的份额持有人存在无法获得新增场内易方达中小板份额的可能性。

(四)投资者欲了解本基金定期份额折算业务详情,请登陆本公司网站:www.efunds.com.cn或者拨打本公司客服电话:400 881 8088(免长途话费)。

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,但不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。投资者投资于本基金前应认真阅读本基金的基金合同、更新的招募说明书等文件。

敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

易方达基金管理有限公司
2015年9月15日

易方达基金管理有限公司关于开通易方达中证500交易型开放式指数证券投资基金场外日常申购、赎回业务的公告

易方达中证500交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)基金合同于2015年8月27日生效,根据《易方达中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)、《易方达中证500交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》(以下简称“《招募说明书》”)等有关规定以及2015年9月9日《易方达中证500交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告》,本基金管理人易方达基金管理有限公司(以下简称“本公司”)将于2015年9月16日起通过本公司直销中心办理本基金场外日常申购与赎回业务。

现将有关本基金场外日常申购、赎回业务的事项提示如下:

一、申购、赎回的开放时间

场外投资者在开放日办理基金份额的申购和赎回,交易截止时间为开放日的14:00,基金管理人可根据实际情况需要加以调整,具体办理时间以基金管理人的规定为准。但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。本基金场外申购赎回的开放时间与场内申购赎回的开放时间可能存在差异,投资者应关注基金管理人发布的有关公告并注意其提交交易申请的时间。

场外投资者在开放时间以外提交的申购、赎回等交易申请,且登记结算机构确认接受的,其基金份额申购、赎回价格为下一开放日基金份额申购、赎回的价格。

若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更、其他特殊情况或根据业务需要,基金管理人有权视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整,但应在实施前依照《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)的有关规定在指定媒介上公告。

二、申购、赎回的数额限制

投资者通过本公司直销中心每次申购的单笔最低金额为人民币贰佰万元(2,000,000),每次赎回的单笔最低份额为20万份。

投资者可将其全部或部分基金份额赎回。单笔赎回不得少于20万份(如该账户在本公司直销中心托管的基金份额余额不足20万份,则必须一次性赎回全部场外份额);若某笔赎回将导致投资者在本公司直销中心托管的基金份额余额不足20万份时,基金管理人有权将投资者在本公司直销中心的剩余场外份额一次性全部赎回。

基金管理人可以根据市场情况,在法律法规允许的情况下,调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。。

三、申购、赎回的原则

1、本基金的场外份额采用金额申购、份额赎回的方式,即申购以金额申请、赎回以份额申请;

2、本基金场外份额的申购对价、赎回对价为现金;

3、场外份额申购赎回遵循“未知价”原则,即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算;

4、场外份额赎回遵循“先进先出”原则,即按照投资人申购的先后次序进行顺序赎回;

5、条件许可情况下,本基金场外份额既可在不同场外的销售机构之间办理系统内转托管,也可跨系统转托管为场内份额。

6、当日的场外申购、赎回申请可以在当日业务办理时间结束前撤销,在当日的业务办理时间结束后不得撤销;

7、场外申购赎回应遵守本公司的相关业务规则;

8、基金管理人可根据基金运作的实际情况,在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下调整上述原则,或依据登记结算机构相关规则及其变更调整上述规则,但应在新的原则实施前依照有关规定在指定媒介上予以公告。

四、投资者的开户与申购、赎回的程序

(一)易方达ETF场外基金账户的开立

已购买过由本公司担任注册登记机构的基金的投资者,其拥有的易方达基金管理有限公司开放式基金账户不能用于申购本基金场外份额,需要重新开户,开户需提前进行。如投资者T日申购本基金场外份额,则必须于T-1日前(含T-1日)办理易方达ETF场外基金账户的开立。

投资者在办理易方达ETF场外基金账户开立当日,不能提交申购申请,申购申请的提交要以易方达ETF场外基金账户开立成功为前提。

(二)申购和赎回申请的提交

投资者通过直销中心办理申购、赎回等业务需要提交的材料及相关规定详见《易方达旗下ETF场外申赎直销业务指南》,该指南可从本公司的网站(www.efunds.com.cn)下载。账户和交易申请表可以向直销中心索取或从本公司的网站(www.efunds.com.cn)下载。

五、申购和赎回申请的确认

基金管理人在场外申购、赎回开放日截止时间前受理申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T日),在正常情况下,本基金登记结算机构在T+1日对该交易的有效性进行确认。

销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表该申请一定成功。申购、赎回的确认以基金登记结算机构的确认结果为准。T 日提交的有效申请,投资人应在T+1 日后(含该日)到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。

六、申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式,若申购资金在规定的截止时间内未全额到账则申购不成功。若申购不成功或无效,基金管理人将投资者已缴付的申购款项本金退还给投资者。

正常情况下,基金管理人将在接受投资者有效赎回申请之日起七个工作日内支付赎回款项。在发生场外巨额赎回或本基金合同载明的其他暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形时,款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。

七、申购和赎回的注册登记

正常情况下,投资者T日申购基金成功后,登记结算机构在T+1日为投资者增加权益并办理注册登记手续,投资人自T+1日起有权申请赎回该部分基金份额,或在条件许可情况下申请办理跨系统转托管;

基金份额持有人T日赎回基金成功后,正常情况下,登记结算机构在T+1日为投资者办理扣除权益的注册登记手续;

在法律法规允许的范围内,登记结算机构可以对上述注册登记办理时间进行调整,基金管理人于开始实施前在指定媒介上公告。

八、申购和赎回的投资交易

对于T日截止时间前收到的有效申购及有效赎回申请,基金管理人将根据轧差之后的净申购金额或净赎回数量,采用算法交易系统,按尽可能贴近收盘价的原则,在T日完成相应的证券交易。

九、申购、赎回的价格、费用及用途

1、申购份额的计算及余额的处理方式:申购的有效份额为净申购金额除以当日的基金份额净值,有效份额单位为份,份额计算结果均按四舍五入方法,保留到整数位,申购净击成本以人民币元为单位,四舍五入保留至小数点后两位,由此产生的收益或损失由基金财产承担。

2、赎回金额的计算及处理方式:赎回金额为赎回份额乘以当日基金份额净值减去赎回冲击成本(如有),赎回金额、赎回冲击成本的单位为人民币元,四舍五入保留到小数点两位,由此产生的收益或损失由基金财产承担。

3、投资者在申购或赎回基金份额时,基金管理人参考当时市场的交易佣金、印花税等相关交易成本水平,收取一定的申购和/或赎回冲击成本并归入基金资产,确保覆盖场外现金申赎引起的证券交易费用。当前的申购、赎回冲击成本率如下:

申购冲击成本率:0.05%

赎回冲击成本率:0.15%

本基金场外份额的申购冲击成本由申购人承担,赎回冲击成本由赎回人承担,申购冲击成本与赎回冲击成本均全部归入基金财产。

基金管理人可根据市场情况调整申购冲击成本率、赎回冲击成本率,经公告后实施。

4、申购份额、赎回金额的计算方式:

1)申购份额的计算

本基金的申购金额包括申购冲击成本和净申购金额,其通用的计算方式为:

净申购金额=申购金额÷(1+申购冲击成本率)

申购冲击成本=申购金额-净申购金额

申购份额=净申购金额÷T日基金份额净值

2)基金赎回金额的计算

赎回冲击成本=赎回份额×T日基金份额净值×赎回冲击成本率

赎回金额=赎回份额×T日基金份额净值-赎回冲击成本

5、由于场内与场外申购、赎回方式上的差异,本基金投资者依据基金份额净值所支付、取得的场外申购、赎回现金对价,与场内申购、赎回所支付、取得的对价方式不同。投资者可自行判断并选择适合自身的申购赎回场所、方式。

十、拒绝或暂停申购的情形及处理方式

在如下情况下,基金管理人可以拒绝或暂停接受投资者的申购申请(基金管理人可视情况同时暂停或拒绝场内和场外两种申购方式,也可以只拒绝或暂停其中一种方式的申购):

1、不可抗力导致基金无法正常运作或无法接受申购;

2、因特殊情况(包括但不限于上海证券交易所或深圳证券交易所依法决定临时停市或交易时间非正常停市),基金管理人无法计算当日基金资产净值或无法进行证券交易;

3、发生《基金合同》规定的暂停基金财产估值的情况;

4、因异常情况,申购赎回清单无法编制、编制错误或无法公布,或基金管理人在开市后发现基金份额参考净值计算错误;

5、基金管理人无法按时公布基金份额净值;

6、上海证券交易所、申购赎回代理券商、登记结算机构等因异常情况无法办理申购;

7、接受某笔或某些申购申请将影响或损害现有基金份额持有人利益时;

8、基金管理人可根据市场情况在申购赎回清单中设置申购份额上限,如果一笔新的场内份额申购申请被确认成功,会使本基金场内份额当日申购份额超过申购赎回清单中规定的申购份额上限时,该笔申购申请将被拒绝;

9、基金所投资的投资品种的估值出现重大转变时;

10、其他损害现有基金份额持有人利益的情形;

11、法律法规、中国证监会或上海证券交易所规定的其他情形。

发生除上述第7,8项以外的暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时,基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝,被拒绝的申购对价将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时,基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

十一、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

在如下情况下,基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项(基金管理人可同时对场内和场外两种赎回方式实施暂停或延缓支付赎回款项,也可以只针对其中一种方式):

1、不可抗力导致基金无法正常运作或无法接受赎回;

2、因特殊情况(包括但不限于上海证券交易所或深圳证券交易所依法决定临时停市或交易时间非正常停市),基金管理人无法计算当日基金资产净值或无法进行证券交易;

3、发生《基金合同》规定的暂停基金财产估值的情况;

4、因异常情况,申购赎回清单无法编制、编制错误或无法公布,或基金管理人在开市后发现基金份额参考净值计算错误;

5、基金管理人无法按时公布基金份额净值;

6、上海证券交易所、深圳证券交易所、申购赎回代理券商、登记结算机构等因异常情况无法办理申购、赎回,或者指数编制单位、上海证券交易所/深圳证券交易所等因异常情况使申购赎回清单无法编制或编制不当;

7、基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔赎回转申购;

8、发生基金所投资的投资品种的估值出现重大转变时;

9、基金资产规模过大,使基金管理人无法找到合适的投资品种,或可能对基金业绩产生负面影响,从而损害现有基金份额持有人的利益;

10)因市场剧烈波动或其它原因而出现连续巨额赎回,导致基金的现金支付出现困难;

11)法律法规、中国证监会或上海证券交易所/深圳证券交易所规定的其他情形。

基金赎回转申购业务的解释权归本基金管理人,本公司可以根据市场情况在不违背有关法律法规和基金合同规定的前提下调整上述赎回转申购的收费方式、费率水平、业务规则及有关限制,但应在调整前在至少一种中国证监会指定的媒体上予以公告。

(4)有关赎回转申购业务的未尽事项,参照上述基金的基金合同、招募说明书及其更新中关于申购、赎回的相关规定。

三、上述基金转换业务及赎回转申购业务的办理机构

直销机构:易方达基金管理有限公司

注册地址:广东省珠海市横琴新区宝中路3号4004-8室

办公地址:广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40-43楼

法定代表人:刘晓艳

电话:020-85102506

传真:400 881 8099

联系人:温海萍

网址:www.efunds.com.cn

直销中心网点信息:

1、易方达基金管理有限公司广州直销中心

地址:广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40楼

邮政编码:510620

传真:400 881 8099

电话:020-85102506

2、易方达基金管理有限公司北京直销中心

地址: 北京市西城区金融大街20号B座8层

邮政编码:100033

传真:400 881 8099

电话:010-63213377

3、易方达基金管理有限公司上海直销中心

地址:上海市世纪大道88号金茂大厦2706-2708室

邮政编码:200121

传真:400 881 8099

电话:021-50476668

四、其他需要提示的事项

1、本公告仅对易方达中证500ETF场外份额与易方达深证100ETF场外份额、易方达沪深300ETF场外份额、易方达沪深300医药ETF场外份额、易方达沪深300非银ETF场外份额、易方达创业板ETF场外份额、易方达上证中盘ETF场外份额之间的日常转换业务及对易方达中证500ETF场外份额与易方达货币市场基金的赎回转申购业务有关事项予以说明。投资者欲了解上述基金的详细情况,请仔细阅读各基金的基金合同和招募说明书。

2、投资者可通过以下途径咨询有关详情:

易方达基金管理有限公司

客户服务电话:400-881-8088

网址:www.efunds.com.cn

3、风险提示: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。投资者投资上述基金前应认真阅读上述基金的基金合同和招募说明书。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

易方达基金管理有限公司
2015年9月15日

易方达基金管理有限公司关于开通易方达中证500交易型开放式指数证券投资基金与旗下部分开放式基金场外基金份额之间转换业务及与易方达货币市场基金之间赎回转申购业务的公告

为了更好地满足广大投资者的理财需求,根据《易方达中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《易方达深证100交易型开放式指数基金基金合同》、《易方达沪深300交易型开放式指数发起式证券投资基金基金合同》、《易方达沪深300医药卫生交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《易方达沪深300非银行金融交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《易方达货币市场基金基金合同》等有关规定,基金管理人易方达基金管理有限公司(以下简称“本公司”)将自2015年9月16日起通过本公司直销中心办理易方达中证500交易型开放式指数证券投资基金(以下简称:“易方达中证500ETF”,场内申赎代码:510581)与易方达深证100交易型开放式指数基金(以下简称:“易方达深证100ETF”,场内申赎代码:159901)、易方达沪深300交易型开放式指数发起式证券投资基金(以下简称:“易方达沪深300ETF”,场内申赎代码:510311)、易方达沪深300医药卫生交易型开放式指数证券投资基金(以下简称:“易方达沪深300医药ETF”,场内申赎代码:512011)、易方达沪深300非银行金融交易型开放式指数证券投资基金(以下简称:“易方达沪深300非银ETF”,场内申赎代码:512071)、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金(以下简称:“易方达创业板ETF”,场内申赎代码:159915)、易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金 (以下简称:“易方达上证中盘ETF”,场内申赎代码:510131)的场外基金份额之间日常转换业务,少量易方达中证500ETF场外基金份额与易方达货币市场基金(A级110006;B级110016)之间的赎回转申购业务。

现将有关事项提示如下:

一、场外基金份额之间日常转换业务的有关事项:

(一)概念及适用范围

基金转换是指基金份额持有人按照《基金合同》和基金管理人届时有效公告规定的条件,申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转为基金管理人管理的、且由同一注册登记机构办理注册登记的其他基金基金份额的行为。

本次开通的日常转换业务包括:易方达深证100ETF场外基金份额、易方达沪深300ETF场外基金份额、易方达沪深300医药ETF场外基金份额、易方达沪深300非银ETF场外基金份额、易方达创业板ETF场外基金份额、易方达上证中盘ETF场外基金份额与易方达中证500ETF场外基金份额之间的转换业务。

(二)转换业务的办理时间

场外投资者在开放日办理上述基金场外份额之间的转换业务,交易截止时间为基金开放日的14:00,基金管理人可根据实际情况需要加以调整,具体办理时间以基金管理人的规定为准;但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停转换时除外。

若上海证券交易所交易或深圳证券交易所时间变更或出现其他特殊情况,基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整,但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

场外投资者需在转出基金和转入基金均可交易的当日,方可办理基金转换业务。

(三)转换的费用

上述基金场外基金份额之间互相转换时,基金转换费采用“转出基金赎回费或赎回冲击成本+转入基金申购费或申购冲击成本”算法,具体如下:

(1)基金转换的计算公式

A=[B×C×(1-D)/(1+G)]/E

H=B×C×D

J=[B×C×(1-D)/(1+G)]×G

其中,A为转入的基金份额;B为转出的基金份额;C为转换申请当日转出基金的基金份额净值;D为转出基金的对应赎回费率或赎回冲击成本率;E为转换申请当日转入基金的基金份额净值;G为对应的转入基金申购费率或申购冲击成本率;H为转出基金赎回费或赎回冲击成本;J 为转入基金申购费或申购冲击成本。

(2)基金转换费

1)基金转换费用由转出基金赎回费或赎回冲击成本及转入基金申购费用或申购冲击成本两部分构成。

2)转入基金时,如涉及的转入基金有申购费或申购冲击成本,收取转入基金的申购费用或申购冲击成本。上述基金场外份额转换产生的转入基金申购费用或申购冲击成本,全额归入转入基金基金资产。

3)转出基金时,如涉及的转出基金有赎回费用或赎回冲击成本,收取转出基金的赎回费用或赎回冲击成本。上述基金场外份额转换产生的转出基金赎回费用或赎回冲击成本,全额归入转出基金基金资产。

(3)具体转换费率举例

1)当易方达中证500ETF为转出基金,易方达沪深300ETF为转入基金时,转换对应的转出基金即易方达中证500ETF赎回冲击成本率为0.15%:转换对应的转入基金即易方达沪深300ETF的申购费率为0.05%。

2)当易方达沪深300ETF为转出基金,易方达中证500ETF为转入基金时,转换对应的转出基金即易方达沪深300ETF赎回费率为0.15%:转换对应的转入基金即易方达中证500ETF的申购冲击成本率为0.05%。

(4)基金转换份额的计算方法举例

假设某持有人持有易方达中证500ETF场外份额200万份,现欲转换为易方达沪深300ETF场外份额;假设转出基金T日的基金份额净值为1.100元,转入基金易方达沪深300ETF份额净值为1.010元,则转出基金的赎回冲击成本率为0.15%,转入基金的申购费率为0.05%。转换份额计算如下:

转换金额=转出基金申请份额×转出基金份额净值=2,000,000.00×1.100 =2,200,000.00元

转出基金赎回冲击成本=转换金额×转出基金赎回冲击成本率=2,200,000.00×0.15%=3300.00元

转入基金申购费=(转换金额-转出基金赎回冲击成本)×转入基金申购费率÷(1+转入基金申购费率)=(2,200,000.00-3300.00)×0.05%÷(1+0.05%)=1097.80元

转换费=转出基金赎回冲击成本+转入基金申购费=3300.00+1097.80=4397.80元

转入金额=转换金额-转换费=2,200,000.00-4397.80=2,195,602.2元

转入份额=转入金额÷转入基金份额净值=2,195,602.2÷1.010=2,173,864.00份

基金转换费用计算结果按四舍五入方法保留2位小数,份额计算结果按四舍五入方法保留到整数位。

(四)其他与基金转换相关的事项

(1)基金转换业务规则

1)基金转换只能在同一销售机构进行。转换的两只基金必须都是该销售机构销售的同一基金管理人管理的、在同一注册登记机构注册登记的基金。

2)基金转换以份额为单位进行申请。投资者可以发起多次基金转换业务,基金转换费用按每笔申请单独计算。转换费用以人民币元为单位,计算结果按照四舍五入方法,保留小数点后两位。

3)基金转换采取未知价法,即基金的转换价格以转换申请受理当日各转出、转入基金的份额净值为基准进行计算。

4)基金转换后,转入的基金份额的持有期将自转入的基金份额被确认之日起重新开始计算。

5)投资者办理基金转换业务时,转出方的基金必须处于可赎回状态,转入方的基金必须处于可申购状态。

6)转换业务遵循“先进先出”的业务规则,即场外份额注册日期在前的先转换出,场外份额注册日期在后的后转换出。

7)具体份额以注册登记机构的记录为准,转入份额的计算结果保留位数依照各基金更新招募说明书的规定。上述转换转入的份额计算结果均按四舍五入方法,保留到整数位,由此产生的收益或损失由基金财产承担。

(2)基金转换的办理程序

场外投资者通过直销中心办理转换业务需要提交的材料及相关规定详见《易方达旗下ETF场外申赎等直销业务指南》,该指南可从本公司的网站(www.efunds.com.cn)下载。账户和交易申请表可以向直销中心索取或从本公司的网站(www.efunds.com.cn)下载。

(3)基金转换的数额限制

易方达上证中盘ETF场外份额单笔转出申请不得少于100万份(如投资者的账户在该场外销售机构托管的基金份额余额不足100万份,则必须一次性赎回或转出该基金全部场外份额),且申请份额数需为整数份额;若某笔转换导致投资者的账户在该场外销售机构托管的该只基金份额余额不足100万份时,基金管理人有权将投资者在该销售机构托管的该基金剩余场外份额一次性全部赎回。

易方达沪深300ETF场外份额单笔转出申请不得少于100万份(如投资者的账户在该场外销售机构托管的基金份额余额不足100万份,则必须一次性赎回或转出该基金全部场外份额),且申请份额数需为整数份额;若某笔转换导致投资者的账户在该场外销售机构托管的该只基金份额余额不足100万份时,基金管理人有权将投资者在该销售机构托管的该基金剩余场外份额一次性全部赎回。

易方达沪深300医药ETF场外份额单笔转出申请不得少于50万份(如投资者的账户在该场外销售机构托管的基金份额余额不足50万份,则必须一次性赎回或转出该基金全部场外份额),且申请份额数需为整数份额;若某笔转换导致投资者的账户在该场外销售机构托管的该只基金份额余额不足50万份时,基金管理人有权将投资者在该销售机构托管的该基金剩余场外份额一次性全部赎回。

易方达沪深300非银ETF场外份额单笔转出申请不得少于50万份(如投资者的账户在该场外销售机构托管的基金份额余额不足50万份,则必须一次性赎回或转出该基金全部场外份额),且申请份额数需为整数份额;若某笔转换导致投资者的账户在该场外销售机构托管的该只基金份额余额不足50万份时,基金管理人有权将投资者在该销售机构托管的该基金剩余场外份额一次性全部赎回。

易方达创业板ETF场外份额单笔转出申请不得少于100万份(如投资者的账户在该场外销售机构托管的基金份额余额不足100万份,则必须一次性赎回或转出该基金全部场外份额),且申请份额数需为整数份额;若某笔转换导致投资者的账户在该场外销售机构托管的该只基金份额余额不足100万份时,基金管理人有权将投资者在该销售机构托管的该基金剩余场外份额一次性全部赎回。

易方达深证100ETF场外份额单笔转出申请不得少于50万份(如投资者的账户在该场外销售机构托管的基金份额余额不足50万份,则必须一次性赎回或转出该基金全部场外份额),且申请份额数需为整数份额;若某笔转换导致投资者的账户在该场外销售机构托管的该只基金份额余额不足50万份时,基金管理人有权将投资者在该销售机构托管的该基金剩余场外份额一次性全部赎回。

易方达沪深300ETF场外份额单笔转出申请不得少于50万份(如投资者的账户在该场外销售机构托管的基金份额余额不足50万份,则必须一次性赎回或转出该基金全部场外份额),且申请份额数需为整数份额;若某笔转换导致投资者的账户在该场外销售机构托管的该只基金份额余额不足50