

关于西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金基金转型之份额转换与变更登记的公告

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金基金合同》、《西部利得基金管理有限公司关于以通讯方式召开西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的公告》等规定，西部利得基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”或“我司”）旗下管理的西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金（以下简称“500 等权重”或“本基金”）于 2019 年 12 月 12 日至 2020 年 1 月 6 日以通讯方式召开基金份额持有人大会，审议《关于修改西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金基金合同有关事项的议案》（以下简称“本次会议议案”）。本次会议议案于 2020 年 1 月 7 日获表决通过，持有人大会决议自该日起生效。我司于 2020 年 1 月 8 日发布了《关于西部利得中证 500 等权重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公告》、《关于西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金实施转型的提示性公告》，于 2020 年 1 月 17 日发布了《西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金将于转型选择期结束后进行份额折算的风险提示公告》，并于 2020 年 2 月 6 日、2020 年 2 月 11 日分别发布了份额折算的第二次、第三次风险提示公告。上述具体安排详见基金管理人发布的相关公告。

本次转型实施前的选择期自 2020 年 1 月 8 日起，至 2020 年 2 月 12 日止。选择期期间，投资者可通过场内交易与赎回 500 等权重份额（基金代码：502000，场内简称：500 等权）、场外赎回 500 等权重份额、场内交易 500 等权重 A 份额（基金代码：502001，场内简称：500 等权 A）及 500 等权重 B 份额（基金代码：502002，场内简称：500 等权 B）、场内合并 500 等权重 A 份额与 500 等权重 B 份额等方式进行份额退出。选择期内 500 等权重份额的申购、转托管（包含系统内转托管及跨系统转托管）及分拆业务暂停办理，500 等权重 A 份额及 500 等权重 B 份额的场内合并业务照常办理，不受影响。具体详见基金管理人发布的相关公告。

对于在选择期内未作出选择的基金份额持有人，其持有的 500 等权重份额（基金代码：502000，场内简称：500 等权）、500 等权重 A 份额（基金代码：502001，场内简称：500 等权 A）与 500 等权重 B 份额（基金代码：502002，场内简称：500 等权 B）将于 2020 年 2

月 17 日（即份额折算基准日、份额转换基准日）进行折算和转换，最终将转换为西部利得中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）（以下简称“500 增强”）份额。基金份额转换由基金管理人办理，并由注册登记机构进行基金份额的变更登记。

基金份额转换的具体安排如下：

1、转换基准日：2020 年 2 月 17 日

2、转换对象：转换基准日登记在册的 500 等权重份额、500 等权重 A 份额、500 等权重 B 份额。

3、基金份额的转换

（1）转换前基金份额净值的计算

1) 转换前 500 等权重份额的基金份额净值计算

转换前 500 等权重份额的基金份额净值=转换基准日的基金资产净值 / 转换基准日本基金基金份额的总数。

其中，基金资产净值为基金资产总值减去负债后的价值，转换前本基金基金份额数量为转换前 500 等权重份额、500 等权重 A 份额与 500 等权重 B 份额的份额总额。

2) 转换前 500 等权重 A 份额、500 等权重 B 份额的基金份额净值计算

设转换基准日为基金份额净值计算日，N 为当年的实际天数；t 为自最近一次份额折算基准日的次日至转换基准日的天数； $NAV_{\text{西部利得中证 500 等权重}}$ 为 T 日每份 500 等权重份额的基金份额净值； $NAV_{\text{西部利得中证 500 等权重 A}}$ 为 T 日 500 等权重 A 份额的基金份额参考净值； $NAV_{\text{西部利得中证 500 等权重 B}}$ 为 T 日 500 等权重 B 份额的基金份额参考净值；R 为 500 等权重 A 份额的约定年基准收益率，则：

$$\begin{aligned} NAV_{\text{西部利得中证 500 等权重 A}} &= (1 + R)^{\frac{t}{N}} \\ NAV_{\text{西部利得中证 500 等权重 B}} &= \frac{NAV_{\text{西部利得中证 500 等权重}} - 0.5 \times NAV_{\text{西部利得中证 500 等权重 A}}}{0.5} \end{aligned}$$

500 等权重份额的基金份额净值以及 500 等权重 A 份额和 500 等权重 B 份额的基金份额参考净值的计算，均保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

（2）基金份额转换公式

1）将 500 等权重 A 份额与 500 等权重 B 份额转换成 500 等权重份额的场内份额

在份额转换基准日日终，以 500 等权重份额净值为基准，500 等权重 A 份额、500 等权重 B 份额按照各自的基金份额参考净值转换成 500 等权重份额的场内份额。500 等权重 A 份额（或 500 等权重 B 份额）基金份额持有人持有的转换后 500 等权重份额的场内份额在折算过程中产生的不足 1 份的零碎份额，按照所有投资者零碎份额数量大小顺序排列，零碎份额数量相同的，由中国证券登记结算有限责任公司上海分公司证券登记系统随机排列，中国证券登记结算有限责任公司上海分公司证券登记系统按照排列顺序，依次登记 1 份，直至折算过程中产生场内零碎份额分配完毕。

份额转换计算公式如下：

500 等权重 A 份额（或 500 等权重 B 份额）的转换比例 = 份额转换基准日 500 等权重 A 份额（或 500 等权重 B 份额）的基金份额净值 / 份额转换基准日 500 等权重份额的基金份额净值

500 等权重 A 份额（或 500 等权重 B 份额）基金份额持有人持有的转换后 500 等权重份额的场内份额 = 基金份额持有人持有的转换前 500 等权重 A 份额（或 500 等权重 B 份额）的份额数 × 500 等权重 A 份额（或 500 等权重 B 份额）的转换比例

2）将 500 等权重份额转换成 500 增强份额

在 500 等权重 A 份额与 500 等权重 B 份额转换为 500 等权重份额的场内份额后，在保持基金资产净值总额不变的前提下，将 500 等权重份额的场内份额和场外份额统一转换为份额净值为 1.0000 元的 500 增强份额。基金份额转换后，场外的 500 增强的份额数，保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位截位，由此产生的计算误差归入基金资产，场内份额折算过程中产生的不足 1 份的零碎份额，按照所有投资者零碎份额数量大小顺序排列，零碎份额数量相同的，由中国证券登记结算有限责任公司上海分公司证券登记系统随机排列，中国证券登记结算有限责任公司上海分公司证券登记系统按照排列顺序，依次登记 1 份，直至折算过程中产生场内零碎份额分配完毕。

份额转换的计算公式如下：

转换后 500 增强的份额数 = 500 等权重份额数 × 份额转换基准日 500 等权重份额的基金份额净值 / 1.0000

转换后 500 增强的份额净值为 1.0000 元。

（3）基金份额转换结果的公告

本基金此次份额转换结果及注册登记机构变更登记完成后,基金管理人将对份额转换结果予以公告。

如果基金份额转换过程中发生不可抗力,基金管理人可延迟办理基金份额转换与变更登记。

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财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其将来表现。投资有风险,敬请投资人认真阅读基金的相关法律文件,并选择适合自身风险承受能力的投资品种进行投资。

4、咨询方式:

1) 西部利得基金管理有限公司客服热线:400-700-7818。

2) 西部利得基金管理有限公司: www.westleadfund.com。

3) 西部利得基金管理有限公司直销网点及本基金各代销机构的相关网点(详见本公司官网)。

5、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。投资者投资于本基金前应认真阅读本基金的基金合同和招募说明书等相关法律文件。

特此公告。

西部利得基金管理有限公司

2020年2月14日