

关于华夏磐泰定期开放混合型证券投资基金（LOF）

可能触发转型条款的提示性公告

华夏磐泰定期开放混合型证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”，基金代码：160323）的基金合同自 2016 年 12 月 26 日起生效，本基金采取在封闭期内封闭运作、封闭期与封闭期之间定期开放的模式，封闭期长度为 18 个月，封闭期内不办理申购与赎回业务。根据华夏基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）于 2018 年 6 月 21 日发布的《华夏磐泰定期开放混合型证券投资基金（LOF）开放日常申购、赎回业务的公告》，本基金自 2018 年 6 月 26 日至 2018 年 7 月 16 日（含）进入首个申赎开放期。

本基金基金合同规定，“基金合同生效后的存续期内，当某次开放期结束后，本基金规模不足 5 亿元时，基金管理人可与基金托管人协商一致后，将本基金转为“华夏磐泰混合型证券投资基金（LOF）”，不再以定期开放的方式运作。由上述情形导致本基金运作方式转换的，无需召开基金份额持有人大会”。根据本基金截至目前的申赎情况、资产规模状况以及近期市场情况，本基金有可能触发上述基金转型条款。为保护投资者利益，本基金管理人特将相关情况提示如下：

一、若截至 2018 年 7 月 16 日（首个开放期最后一个开放日）日终，本基金的基金资产净值低于 5 亿元，本基金管理人将在与基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致后，根据本基金基金合同“第二十部分 基金的转型”（详见附件）的相关约定，自 2018 年 7 月 17 日（转型日）起将本基金转为每个开放日可办理申购、赎回业务的普通上市型开放式基金，转型后基金名称为“华夏磐泰混合型证券投资基金（LOF）”，基金简称为“华夏磐泰混合（LOF）”，基金场内简称为“华夏磐泰”，基金代码为“160323”。

二、若本基金转型，转型后的华夏磐泰混合型证券投资基金（LOF）将自 2018 年 7 月 17 日起开放日常申购、赎回及定期定额申购业务，本基金管理人届时将发布开放相关业务的公告。本次转型不影响基金的申赎数额限制、申赎费率等，投资者如欲提前了解相关情况，可查阅本基金管理人于 2018 年 6 月 21 日发布的《华夏磐泰定期开放混合型证券投资基金（LOF）开放日常申购、赎回业务的公告》。

三、本基金管理人将根据本基金开放期末日实际规模情况确定、安排转型事

宜，并将及时告知投资者有关情况，敬请投资者关注。

四、重要提示：

（一）基金份额在深圳证券交易所上市交易的相关事宜不因基金转换运作方式而发生调整。

（二）若基金转型，本基金将转为普通上市型开放式基金，不再以定期开放的方式运作，基金名称、基金的投资、基金的申赎开放时间、巨额赎回情形及处理、基金收益分配等内容将相应调整，敬请投资者仔细阅读本基金的转型条款（详见附件），充分考虑自身的投资需求，做好投资安排。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉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。投资有风险，投资者在投资基金之前，请仔细阅读基金的招募说明书和基金合同，全面认识基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策。

特此公告

华夏基金管理有限公司

二〇一八年七月十二日

附件：华夏磐泰定期开放混合型证券投资基金（LOF）基金合同“第二十部分 基金的转型”

“第二十部分 基金的转型”

一、基金转型的条件

基金合同生效后的存续期内，当某次开放期结束后，本基金规模不足 5 亿元时，基金管理人可与基金托管人协商一致后，将本基金转为“华夏磐泰混合型证券投资基金（LOF）”，不再以定期开放的方式运作。

由上述情形导致本基金运作方式转换的，无需召开基金份额持有人大会。

二、基金转型后的名称

本基金转为普通上市型开放式基金（LOF）后，基金名称变更为“华夏磐泰混合型证券投资基金（LOF）”，同时，基金的投资范围、投资限制、开放申购与赎回以及基金收益分配等相关内容也将根据《基金合同》的相关约定做相应修改，上述变更无需经基金份额持有人大会决议。

三、基金转型后份额的上市交易

本基金转为普通上市型开放式基金（LOF）后，本基金基金份额在深圳证券交易所上市交易的相关事宜不因基金转换运作方式而发生调整。

四、基金转型后的投资

（一）基金的投资范围

本基金转为普通上市型开放式基金（LOF）后，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、中小企业私募债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、衍生品（包括权证、股指期货、国债期货、股票期权等）、货币市场工具（含同业存单）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 0-30%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券。

（二）基金的投资限制

（1）本基金股票投资占基金资产的比例为 0%-30%。

(2) 每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后, 保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券。其中, 现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

(3) 本基金持有一家公司发行的证券, 其市值不超过基金资产净值的 10%。

(4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券, 不超过该证券的 10%。

(5) 本基金持有的全部权证, 其市值不得超过基金资产净值的 3%。

(6) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证, 不得超过该权证的 10%。

(7) 本基金在任何交易日买入权证的总金额, 不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%。

(8) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例, 不得超过基金资产净值的 10%。

(9) 本基金持有的全部资产支持证券, 其市值不得超过基金资产净值的 20%。

(10) 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例, 不得超过该资产支持证券规模的 10%。

(11) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券, 不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%。

(12) 本基金应投资于信用级别评级为 **BBB** 以上(含 **BBB**) 的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间, 如果其信用等级下降、不再符合投资标准, 应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出。

(13) 基金财产参与股票发行申购, 本基金所申报的金额不超过本基金的总资产, 本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量。

(14) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%, 债券回购最长期限为 1 年, 债券回购到期后不得展期。

(15) 本基金持有单只中小企业私募债券, 其市值不得超过该基金资产净值的 10%。

(16) 本基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%。

(17) 基金在任何交易日日终, 持有的买入股指期货合约价值, 不得超过基金资产净值的 10%; 基金在任何交易日日终, 持有的卖出股指期货合约价值不得

超过基金持有的股票总市值的 20%；基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%。

（18）基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的 15%；基金在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%；基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 30%。

（19）基金因未平仓的期权合约支付和收取的权利金总额不得超过基金资产净值的 10%；开仓卖出认购期权的，应持有足额标的证券；开仓卖出认沽期权的，应持有合约行权所需的全额现金或交易所规则认可的可冲抵期权保证金的现金等价物；未平仓的期权合约面值不得超过基金资产净值的 20%。其中，合约面值按照行权价乘以合约乘数计算。

（20）基金参与股指期货、国债期货交易，应当遵守下列要求：本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%。其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等，如基金未参与股指期货、国债期货交易，则不受上述投资限制。

（21）本基金投资流通受限证券，基金管理人应制定严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险。

（22）基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定。基金所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定。

（23）本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%。

（24）本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%。

（25）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的 15%。因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前述所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动

性受限资产的投资。

(26) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致。

(27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除第(2)、(12)、(25)、(26)项另有约定外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

基金管理人应当自转型为普通上市型开放式基金（LOF）之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。期间，基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制，或遵循变更后的规定。

五、基金转型后的收益分配

本基金转型后，收益分配遵循下列原则：

本基金场外份额收益分配方式为分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；本基金场内份额的收益分配方式仅能为现金分红，具体权益分派程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定。

六、基金转型后的申购和赎回开放时间

本基金转为普通上市型开放式基金（LOF）后，投资人在开放日内可办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，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。

七、基金转型后的巨额赎回的认定和处理方式

1、巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金

转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过前一开放日的基金总份额的 10%，即认为是发生了巨额赎回。

2、巨额赎回的处理方式

当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。

(1) 全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

(2) 部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的 10% 的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

(3) 暂停赎回：连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒介上进行公告。

(4) 如果基金发生巨额赎回，在单个基金份额持有人超过基金总份额 20% 以上的大额赎回申请情形下，如果基金管理人认为支付全部投资人的赎回申请有困难或认为因支付全部投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人可以延期办理赎回申请。具体分为两种情况：

①如果基金管理人认为有能力支付其他投资人的全部赎回申请，为了保护其他赎回投资人的利益，对于其他投资人的赎回申请按正常程序进行。对于单个投资人超过基金总份额 20% 以上的大额赎回申请，基金管理人在剩余支付能力范围内对其按比例确认当日受理的赎回份额，未确认的赎回部分作自动延期处理。延

期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理,无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额,以此类推,直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时选择取消赎回的,则当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。

②如果基金管理人认为仅支付其他投资人的赎回申请也有困难时,则所有投资人的赎回申请(包括单个投资人超过基金总份额 20%以上的大额赎回申请和其他投资人的赎回申请)都按照上述“(2) 部分延期赎回”的约定一并办理。

3、巨额赎回的公告

当发生上述延期赎回并延期办理时,基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个交易日内通知基金份额持有人,说明有关处理方法,同时在指定媒介上刊登公告。

场内巨额赎回按照深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关规定处理。”