

国金基金管理有限公司

国金上证 50 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《国金上证 50 指数分级证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及上海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,国金上证 50 指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)的基金份额包括国金上证 50 指数分级证券投资基金的基础份额(以下简称“国金上证 50 份额”)、国金上证 50 指数分级证券投资基金的稳健收益类份额(以下简称“国金上证 50A 份额”)和国金上证 50 指数分级证券投资基金的积极收益类份额(以下简称“国金上证 50B 份额”)。本基金将在 2015 年 12 月 15 日办理定期份额折算业务,相关事项公告如下:

一、基金份额折算基准日

根据基金合同的规定,定期份额折算基准日为每个会计年度(基金合同生效不足六个月的年份除外)的 12 月 15 日(遇节假日顺延)。本次定期份额折算的基准日为 2015 年 12 月 15 日。

二、基金份额折算对象

本次定期份额折算的对象是基金定期份额折算基准日登记在册的国金上证 50A 份额和国金上证 50 份额,国金上证 50B 份额不参与本次定期份额折算。

三、基金份额折算方式

国金上证 50A 份额和国金上证 50B 份额按照招募说明书中规定的净值计算规则进行参考净值计算,对国金上证 50A 份额的应得约定收益进行定期份额折算。在基金份额定期折算前与折算后,国金上证 50A 份额和国金上证 50B 份额的份额配比保持 1:1 的比例不变。

折算基准日折算前的国金上证 50A 份额的参考净值超出 1.000 元部分,将被折算为场内国金上证 50 份额分配给国金上证 50A 份额持有人。国金上证 50 份

额持有人持有的每 2 份国金上证 50 份额将获得按照 1 份国金上证 50A 份额应得约定收益分配的新增国金上证 50 份额。

持有场外国金上证 50 份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外国金上证 50 份额；持有场内国金上证 50 份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内国金上证 50 份额。经过上述份额折算，国金上证 50A 份额的参考净值和国金上证 50 份额的基金份额净值将相应调整。

有关计算公式如下：

(1) 国金上证 50A 份额折算

定期份额折算前后，国金上证 50A 份额数不变，即： $NUM_{50A}^{后} = NUM_{50A}^{前}$

$$NAV_{50}^{后} = NAV_{50}^{前} - 0.5 \times (NAV_{50A}^{期末} - 1.000)$$

国金上证 50A 份额持有人新增的场内国金上证 50 份额的份额数=

$$\frac{NUM_{50A}^{前} \times (NAV_{50A}^{期末} - 1.000)}{NAV_{50}^{后}}$$

其中，

$NUM_{50A}^{前}$ ：定期份额折算前国金上证 50A 份额的份额数

$NUM_{50A}^{后}$ ：定期份额折算后国金上证 50A 份额的份额数

$NAV_{50A}^{期末}$ ：国金上证 50A 份额在折算基准日折算前的份额参考净值

$NAV_{50}^{前}$ ：定期份额折算前国金上证 50 份额的份额净值

$NAV_{50}^{后}$ ：定期份额折算后国金上证 50 份额的份额净值

折算过程中产生的不足 1 份的零碎份额，按照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，依次均登记为 1 份，直至完成全部折算。

(2) 国金上证 50B 份额不参与定期份额折算，其基金份额参考净值与份额数在定期折算前后保持不变。

(3) 国金上证 50 份额折算

$$NAV_{50}^{后} = NAV_{50}^{前} - 0.5 \times (NAV_{50A}^{期末} - 1.000)$$

国金上证 50 份额持有人新增的国金上证 50 份额的份额数=

$$\frac{\text{NUM}_{50}^{\text{前}}}{2} \times \frac{\text{NAV}_{50}^{\text{期末}} - 1.000}{\text{NAV}_{50}^{\text{后}}}$$

定期份额折算后国金上证 50 份额的份额数=定期份额折算前国金上证 50 份额的份额数+国金上证 50 份额持有人新增的国金上证 50 份额的份额数+国金上证 50A 份额持有人新增的国金上证 50 份额数。

其中， $\text{NUM}_{50}^{\text{前}}$ ：定期份额折算前国金上证 50 份额的份额数

场外份额经折算后的份额数采用截位法保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产；场内份额折算过程中产生的不足 1 份的零碎份额，按照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，依次均登记为 1 份，直至完成全部折算。

按照上述折算和计算方法，可能会给基金份额持有人的资产净值造成微小误差，视为未改变基金份额持有人的资产净值。

在实施定期份额折算时，折算基准日折算前国金上证 50 份额的基金份额净值以及国金上证 50A 份额的参考净值等具体见基金管理人届时发布的相关公告。

四、基金份额折算期间的基金业务办理

1、定期份额折算基准日（即 2015 年 12 月 15 日），本基金暂停办理申购、赎回、转托管（包括场外转托管、跨系统转托管，下同）业务、配对转换业务；国金上证 50 份额、国金上证 50A 份额、国金上证 50B 份额正常交易。当日晚间，本基金管理人计算当日基金份额净值及份额折算比例。

2、定期份额折算基准日后的第一个工作日（即 2015 年 12 月 16 日），本基金暂停办理申购、赎回、转托管、配对转换业务，国金上证 50 份额、国金上证 50A 份额暂停交易，国金上证 50B 份额正常交易。当日，本基金管理人为持有人办理份额登记确认。

3、定期份额折算基准日后的第二个工作日（即 2015 年 12 月 17 日），本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，本基金管理人恢复办理申购、赎回、转托管、配对转换业务，国金上证 50 份额、国金上证 50A 份额恢复交易，国金上证 50B 份额正常交易。

五、重要提示

1、根据上海证券交易所相关规定，2015年12月17日国金上证50A份额复牌首日即时行情显示的前收盘价为2015年12月16日国金上证50A份额的基金份额参考净值（四舍五入至0.001元）。由于国金上证50A份额折算前可能存在折溢价交易情形，国金上证50A份额折算前（2015年12月15日）的收盘价扣除约定应得收益后与2015年12月17日的前收盘价可能有较大差异。国金上证50A份额2015年12月17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。

2、根据上海证券交易所相关规定，2015年12月17日国金上证50份额复牌首日即时行情显示的前收盘价为2015年12月16日国金上证50份额的基金份额净值（四舍五入至0.001元）。由于国金上证50份额折算前可能存在折溢价交易情形，国金上证50份额折算前（2015年12月15日）的收盘价扣除约定应得收益后与2015年12月17日的前收盘价可能有较大差异。国金上证50份额2015年12月17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。

3、根据上海证券交易所的相关业务规则，场内的国金上证50份额、国金上证50A份额折算后新增的国金上证50份额数取整计算（最小单位为1份），不足1份的零碎份额，按照投资者零碎份额数量大小顺序排列，零碎份额数量相同的，则随机排列。按照排列顺序，依次均登记为1份，直至完成全部折算。

4、本基金国金上证50A份额表现为低风险、收益相对稳定的特征，但在定期份额折算后国金上证50A份额持有人的风险收益特征将发生较大变化，由持有单一的较低风险收益特征的国金上证50A份额变为同时持有较低风险收益特征的国金上证50A份额与较高风险收益特征的国金上证50份额，因此原国金上证50A份额持有人预期收益实现的不确定性将会增加；此外，国金上证50份额为跟踪上证50指数的基础份额，其份额净值将随市场涨跌而变化，因此原国金上证50A份额持有人还可能会承担因市场下跌而遭受损失的风险。

投资者若希望了解本基金定期份额折算业务详情，请登录本基金管理人网站（www.gfund.com）或拨打本公司客户服务电话4000-2000-18（免长途话费）咨询详情。

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。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。投资者投资基金前应认真阅读基金合同、招募说明书等法律文件，投资与自身风险承受能力相适应的基金。

特此公告。

国金基金管理有限公司

2015年12月10日