

# 关于国金上证 50 指数分级证券投资基金基金转型

## 份额转换与变更登记的公告

根据国金上证50指数分级证券投资基金（以下简称“国金上证50”或“本基金”）基金份额持有人大会决议，国金基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）决定对国金上证50进行基金份额转换与变更登记，转型为国金上证50指数增强证券投资基金（LOF）（以下简称“国金上证50指数增强（LOF）”）。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。

1、转换基准日：2019年10月14日。

2、转换对象：转换基准日登记在册的国金上证50、国金上证50A、国金上证50B基金份额。

3、基金份额的转换

(1) 转换前基金份额净值的计算

1) 转换前国金上证 50 份额的基金份额净值计算

转换前国金上证 50 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国金上证 50 份额、国金上证 50A 份额与国金上证 50B 份额的份额总额。

2) 转换前国金上证 50A 和国金上证 50B 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=自最近一次份额折算基准日的次日至转换基准日的天数； $NAV_{50}$ 为 T 日每份国金上证 50 份额的基金份额净值； $NAV_{50A}$ 为 T 日国金上证 50A 份额的基金份额参考净值； $NAV_{50B}$ 为 T 日国金上证 50B 份额的基金份额参考净值； $R$ 为国金上证 50A 份额的约定年基准收益率，则：

$$NAV_{50A} = 1 + R \times t/N$$

$$NAV_{50B} = 2 \times NAV_{50} - NAV_{50A}$$

国金上证 50 份额的基金份额净值以及国金上证 50A 份额和国金上证 50B 份

额的基金份额参考净值的计算，均保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 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) 将国金上证50A份额与国金上证50B份额转换成国金上证50份额的场内份额

在份额转换基准日日终，以国金上证 50 份额的基金份额净值为基准，国金上证 50A 份额、国金上证 50B 份额按照各自的基金份额参考净值转换成国金上证 50 份额的场内份额。国金上证 50A 份额（或国金上证 50B 份额）基金份额持有人持有的转换后国金上证 50 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。

份额转换计算公式如下：

国金上证50A份额（或国金上证50B份额）的转换比例=份额转换基准日国金上证50A份额（或国金上证50B份额）的基金份额净值/份额转换基准日国金上证50份额的基金份额净值

国金上证 50A 份额（或国金上证 50B 份额）基金份额持有人持有的转换后国金上证 50 份额的场内份额=基金份额持有人持有的转换前国金上证 50A 份额（或国金上证 50B 份额）的份额数×国金上证 50A 份额（或国金上证 50B 份额）的转换比例

2) 将国金上证50份额转换成国金上证50指数增强（LOF）份额

在国金上证 50A 份额与国金上证 50B 份额转换为国金上证 50 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，将国金上证 50 份额的场内份额和场外份额统一转换为份额净值为 1.0000 元的国金上证 50 指数增强（LOF）份额。基金份额转换后，场外的国金上证 50 指数增强（LOF）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。

份额转换的计算公式如下：

转换后国金上证50指数增强（LOF）的份额数=国金上证50份额数×份额转换  
基准日国金上证50份额的基金份额净值/1.0000

转换后国金上证 50 指数增强（LOF）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，基金管理人将在指定媒体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。

特此公告。

国金基金管理有限公司

2019年9月27日