

国金基金管理有限公司

国金通用上证 50 指数分级证券投资基金办理不定期份额折算业务的公告

根据《国金通用上证 50 指数分级证券投资基金基金合同》（简称“基金合同”）关于基金份额不定期折算的相关规定，当国金通用上证 50 指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）之国金上证 50B 份额的基金份额参考净值跌至不定期折算阈值 0.250 元以下（含 0.250 元，下同）时，本基金将进行不定期份额折算。

截至 2015 年 8 月 24 日，本基金国金上证 50B 份额的基金份额参考净值为 0.211 元，达到基金合同规定的不定期份额折算条件。根据基金合同以及上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定，本基金将以 2015 年 8 月 25 日为基金份额折算基准日办理不定期份额折算业务。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，本次不定期份额折算的基准日为 2015 年 8 月 25 日。

二、基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的国金上证 50 份额、国金上证 50A 份额和国金上证 50B 份额。

三、基金份额折算方式

在折算基准日，将分别对国金上证 50A 份额、国金上证 50B 份额和国金上证 50 份额进行折算，折算后本基金将确保国金上证 50A 份额和国金上证 50B 份额的比例为 1:1；折算后国金上证 50 份额的净值以及国金上证 50A 份额、国金上证 50B 份额的参考净值均调整为 1.000 元。具体折算原则及公式如下：

（1）国金上证 50B 份额

份额折算前国金上证 50B 份额的资产净值与份额折算后国金上证 50B 份额的资产净值相等。

$$NUM_{50B}^{\text{后}} = \frac{NUM_{50B}^{\text{前}} \times NAV_{50B}^{\text{前}}}{1.000}$$

其中：

$NAV_{50B}^{\text{前}}$ ：不定期份额折算前国金上证 50B 份额的参考净值

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

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

(2) 国金上证 50A 份额

份额折算原则：

A、份额折算前后国金上证 50A 份额与国金上证 50B 份额始终保持 1：1 配比；

B、份额折算前国金上证 50A 份额的资产与份额折算后国金上证 50A 份额的资产净值及其新增场内国金上证 50 份额的资产净值之和相等；

C、份额折算前国金上证 50A 份额的持有人在份额折算后将持有国金上证 50A 份额与新增场内国金上证 50 份额。

$$NUM_{50A}^{\text{后}} = NUM_{50B}^{\text{后}}$$

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=

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

其中：

$NAV_{50A}^{\text{前}}$ ：不定期份额折算前国金上证 50A 份额的参考净值

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

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

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

(3) 国金上证 50 份额

份额折算原则：

份额折算前国金上证 50 份额的资产净值与份额折算后国金上证 50 份额的资产净值相等。

$$NUM_{50}^{\text{后}} = \frac{NAV_{50}^{\text{前}} \times NUM_{50}^{\text{前}}}{1.000}$$

其中：

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

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

$NUM_{50}^{后}$ ：不定期份额折算后国金上证 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。

四、基金份额折算期间的基金业务办理

（一）不定期份额折算基准日（即 2015 年 8 月 25 日），本基金暂停办理申购（含定期定额投资）、赎回、转托管（包括场外转托管、跨系统转托管，下同）、配对转换业务；国金上证 50B 份额于该日 9：30-10：30 停牌 1 小时。该日终，基金管理人将计算基金份额净值及份额折算比例。

（二）不定期份额折算基准日后的第一个工作日（即 2015 年 8 月 26 日），本基金暂停办理申购（含定期定额投资）、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、国金上证 50B 份额在该日停牌一个交易日。当日，本基金注册登记机构及基金管理人为持有人办理份额登记确认。

（三）不定期份额折算基准日后的第二个工作日（即 2015 年 8 月 27 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（含定期定额投资）、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、国金上证 50B 份额将于该日开市起复牌。

（四）2015 年 8 月 27 日国金上证 50 份额、国金上证 50A 份额、国金上证 50B 份额即时行情显示的前收盘价为 2015 年 8 月 26 日的国金上证 50 份额的份额净值以及国金上证 50A 份额、国金上证 50B 份额的份额参考净值，2015 年 8 月 27 日当日国金上证 50 份额、国金上证 50A 份额和国金上证 50B 份额均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。

五、重要提示

1、本基金国金上证 50B 份额将于 2015 年 8 月 25 日 9:30-10:30 停牌 1 小时,于 2015 年 8 月 26 日停牌 1 个交易日,并于 2015 年 8 月 27 日开市起复牌。

2、不定期份额折算后,国金上证 50B 份额杠杆倍数将恢复到初始杠杆水平,国金上证 50B 份额的溢价率可能大幅降低。投资者如果在折算基准日(2015 年 8 月 25 日)当天买入,可能遭受重大损失,敬请投资者注意投资风险。

3、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,但在不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。

4、本基金国金上证 50B 份额表现为高风险、高收益的特征,不定期份额折算后其杠杆倍数将大幅降低,将恢复到初始杠杆水平,相应地,国金上证 50B 份额净值随市场涨跌而增长或者下降的幅度也会大幅减小。

5、由于国金上证 50 份额、国金上证 50A 份额、国金上证 50B 份额折算前可能存在折溢价交易情形,不定期份额折算后,国金上证 50 份额、国金上证 50A 份额、国金上证 50B 份额的折溢价率可能发生较大变化。特提请参与二级市场交易的投资者注意折溢价所带来的风险。

6、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、国金上证 50B 份额折算后的份额数取整计算(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。

7、此次基金份额折算基准日不是触发折算阈值当日,国金上证 50B 份额折算基准日的份额参考净值与折算阈值 0.250 元可能有一定差异。

8、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《国金通用上证 50 指数分级证券投资基金招募说明书》(以下简称“招募说明书”)等相关法律文件。敬请投资者注意投资风险。

9、投资者若希望了解基金不定期份额折算业务详情，请参阅本基金的基金合同及招募说明书或者通过本基金管理人网站（www.gfund.com）或客户服务电话（4000-2000-18）咨询。

风险提示：本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。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

国金基金管理有限公司
2015年8月25日