

# 国金基金管理有限公司

## 国金沪深 300 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《国金沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）及深圳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，国金沪深 300 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沪深 300 指数分级证券投资基金的基础份额（以下简称“国金沪深 300 份额”）、国金沪深 300 指数分级证券投资基金的稳健收益类份额（以下简称“国金沪深 300A 份额”）和国金沪深 300 指数分级证券投资基金的积极收益类份额（以下简称“国金沪深 300B 份额”）。本基金将在 2016 年 1 月 4 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的第一个工作日。本次定期份额折算的基准日为 2016 年 1 月 4 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沪深 300A 份额和国金沪深 300 份额。国金沪深 300B 份额不参与定期折算，除非定期折算时同时满足不定期折算的条件。

### 三、基金份额折算方式

国金沪深 300A 份额和国金沪深 300B 份额按照招募说明书第六部分“基金份额的分级运作及净值计算规则”中规定的净值计算规则进行参考净值计算，对国金沪深 300A 份额的应得约定收益进行定期份额折算，国金沪深 300 份额持有人持有的每 2 份国金沪深 300 份额将按 1 份国金沪深 300A 份额获得应得约定收益的新增折算份额。在基金份额定期折算前与折算后，国金沪深 300A 份额和国金沪深 300B 份额的份额配比保持 1：1 的比例不变。

国金沪深 300A 份额每个期末的约定应得收益，即国金沪深 300A 份额每个会计年度最后一日份额参考净值超出 1.000 元部分，将被折算为场内国金沪深 300 份额分配给国金沪深 300A 份额持有人。国金沪深 300 份额持有人持有的每 2 份国金沪深 300 份额将获得按照 1 份国金沪深 300A 份额应得约定收益分配的新增国金沪深 300 份额。

持有场外国金沪深 300 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沪深 300 份额；持有场内国金沪深 300 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沪深 300 份额。经过上述份额折算，国金沪深 300A 份额的参考净值和国金沪深 300 份额的基金份额净值将相应调整。

每个会计年度的第一个工作日（除基金合同生效日所在会计年度外）为定期份额折算基准日，本基金将对国金沪深 300A 份额和国金沪深 300 份额进行上一会计年度约定应得收益的定期份额折算。有关计算公式如下：

#### 1、国金沪深 300A 份额折算

定期份额折算前后，国金沪深 300A 份额数不变，即： $NUM_{300A}^{后}=NUM_{300A}^{前}$

$$NAV_{300}^{后}=NAV_{300}^{前}-0.5\times(NAV_{300A}^{期末}-1.000)$$

国金沪深 300A 份额持有人新增的场内国金沪深 300 份额的份额数=

$$\frac{NUM_{300A}^{前}\times(NAV_{300A}^{期末}-1.000)}{NAV_{300}^{后}}$$

其中，

$NUM_{300A}^{前}$ ：定期份额折算前国金沪深 300A 份额的份额数

$NUM_{300A}^{后}$ ：定期份额折算后国金沪深 300A 份额的份额数

$NAV_{300A}^{期末}$ ：国金沪深 300A 份额上一会计年度最后一日的份额参考净值

$NAV_{300}^{前}$ ：定期份额折算前国金沪深 300 份额的份额净值

$NAV_{300}^{后}$ ：定期份额折算后国金沪深 300 份额的份额净值

国金沪深 300A 份额应得约定收益折算成国金沪深 300 份额的场内份额取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。

2、国金沪深 300B 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、国金沪深 300 份额折算

$$NAV_{300}^{\text{后}} = NAV_{300}^{\text{前}} - 0.5 \times (NAV_{300A}^{\text{期末}} - 1.000)$$

国金沪深 300 份额持有人新增的国金沪深 300 份额的份额数=

$$\frac{NUM_{300}^{\text{前}}}{2} \times \frac{NAV_{300A}^{\text{期末}} - 1.000}{NAV_{300}^{\text{后}}}$$

定期份额折算后国金沪深 300 份额的份额数=定期份额折算前国金沪深 300 份额的份额数+国金沪深 300 份额持有人新增的国金沪深 300 份额的份额数+国金沪深 300A 份额持有人新增的国金沪深 300 份额数。

其中， $NUM_{300}^{\text{前}}$ ：定期份额折算前国金沪深 300 份额的份额数

国金沪深 300 份额的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；国金沪深 300 份额的场内份额经折算后的份额数取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。

在实施定期份额折算时，折算日折算前国金沪深 300 份额的基金份额净值以及国金沪深 300A 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 2016 年 1 月 4 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；国金沪深 300A 份额、国金沪深 300B 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 2016 年 1 月 5 日），本基金暂停办理申购、赎回、转托管、配对转换业务，国金沪深 300A 份额暂停交易，国金沪深 300B 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 2016 年 1 月 6 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，国金沪深 300A 份额 9:30 至 10:30 暂停交易一小时、并于上午 10:30 后恢复交易，国金沪深 300B 份额正常交易。

4、根据深圳证券交易所 2012 年 7 月 26 日发布的《关于分级基金份额折算后次日前收盘价调整的通知》，2016 年 1 月 6 日国金沪深 300A 份额复牌首日即

时行情显示的前收盘价为 2016 年 1 月 5 日的国金沪深 300A 份额的份额净值(四舍五入至 0.001 元)。由于国金沪深 300A 份额可能存在折溢价交易情形,折算前的收盘价扣除 2015 年约定收益后与 2016 年 1 月 6 日的前收盘价可能有较大差异,1 月 6 日当日可能出现交易价格大幅波动的情形。

### 五、重要提示

由于国金沪深 300A 份额新增份额折算成国金沪深 300 份额的场内份额数和国金沪深 300 份额的场内份额经折算后的份额数取整计算(最小单位为 1 份),舍去部分计入基金财产,持有较少国金沪深 300A 份额或场内国金沪深 300 份额的份额持有人存在无法获得新增场内国金沪深 300 份额的可能性。

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](http://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 29 日