

# 国金基金管理有限公司

## 关于国金沪深300指数分级证券投资基金实施转型的提示性公告

国金基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”或“我司”）旗下管理的国金沪深300指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”或“国金沪深300基金”）于2017年7月12日至2017年8月11日以通讯方式召开基金份额持有人大会，审议《关于国金沪深300指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》（以下简称“本次会议议案”）。本次会议议案于2017年8月14日获表决通过，持有人大会决议自该日起生效。我司于2017年8月15日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、深圳证券交易所网站([www.szse.cn](http://www.szse.cn))和基金管理人网站([www.gfund.com](http://www.gfund.com))发布了《关于国金沪深300指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

根据本次持有人大会决议，现将实施转型的相关事项提示如下：

**一、本基金转型选择期开始日：2017年8月15日，本基金转型选择期终止日：终止上市日前一交易日。**

本次转型实施前的选择期自2017年8月15日起，至终止上市日前一交易日止。选择期间，国金沪深300份额的申购赎回、转入转出业务，国金沪深300A份额与国金沪深300B份额的交易、配对转换业务照常办理，不受影响。基金份额持有人在国金沪深300基金正式实施转型前，可选择卖出国金沪深300A份额、国金沪深300B份额或赎回国金沪深300份额；对于在选择期内未作出选择的基金份额持有人，其持有的国金沪深300份额、国金沪深300A份额或国金沪深300B份额将于份额转换基准日转换为国金沪深300指数增强证券投资基金（以下简称“国金沪深300指数增强基金”）份额。在选择期期间，由于国金沪深300份额需应对赎回、转出等情况，基金份额持有人同意在选择期豁免《国金沪深300指数分级证券投资基金基金合同》中约定的投资组合比例限制等条款。基金份额持有人大会授权基金管理人据此落实相关事项，并授权基金管理人可根据实际情况

做相应调整，以及根据实际情况可暂停申购、赎回、转入、转出或调整赎回方式等。

## 二、国金沪深300A份额、国金沪深300B份额终止上市交易

为实施转型，基金管理人将按照深圳证券交易所、《国金沪深300指数分级证券投资基金基金合同》等的有关规定向深圳证券交易所申请国金沪深300A份额与国金沪深300B份额的终止上市。届时，基金管理人将发布国金沪深300基金终止上市公告。

## 三、基金份额的折算

转型选择期届满后，基金管理人将确定份额转换基准日，并在该日将国金沪深300基金各类基金份额转换成国金沪深300指数增强基金份额。

本次基金份额的转换主要可分成以下两个步骤进行：

1、将国金沪深300A份额与国金沪深300B份额转换成国金沪深300份额的场内份额

在份额转换基准日日终，以国金沪深300份额的基金份额净值为基准，国金沪深300A份额、国金沪深300B份额按照各自的基金份额参考净值转换成国金沪深300份额的场内份额。国金沪深300A份额或国金沪深300B份额的基金份额持有人持有的转换后国金沪深300份额的场内份额取整计算（最小单位为1份），取整后的余额计入基金财产。由于基金份额数取整计算产生的误差，基金份额持有人存在着基金资产净值减小的风险。对于持有份额数较少的国金沪深300A份额、国金沪深300B份额的份额持有人，存在着持有的基金份额转换后份额数不足一份而被计入基金资产的风险。

份额转换计算公式如下：

国金沪深300A（或国金沪深300B）的转换比例 = 份额转换基准日国金沪深300A（或国金沪深300B）的基金份额净值 / 份额转换基准日国金沪深300份额的基金份额净值

国金沪深300A（或国金沪深300B）基金份额持有人持有的转换后国金沪深300份额的场内份额 = 基金份额持有人持有的转换前国金沪深300A（或国金沪深300B）的份额数 × 国金沪深300A（或国金沪深300B）的转换比例

2、将国金沪深300份额转换成国金沪深300指数增强基金份额

在国金沪深 300A 份额与国金沪深 300B 份额转换为国金沪深 300 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，将国金沪深 300 份额的场内份额和场外份额统一转换为份额净值为 1.0000 元的国金沪深 300 指数增强基金份额。基金份额转换后，场外的国金沪深 300 指数增强基金的份额数，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，场内的国金沪深 300 指数增强基金的份额数采用取整计算（最小单位为 1 份），取整后的余额计入基金资产。由于基金份额数取整计算产生的误差，基金份额持有人存在着基金资产净值减小的风险。对于持有份额数较少的国金沪深 300 场内份额的份额持有人，存在着持有的基金份额转换后份额数不足一份而被计入基金资产的风险。

份额转换的计算公式如下：

转换后国金沪深300指数增强基金的份额数=国金沪深300份额数×份额转换  
基准日国金沪深300份额的基金份额净值/1.0000

转换后国金沪深 300 指数增强基金的份额净值为 1.0000 元。

#### **四、关于基金合同等法律文件的修订**

根据《关于国金沪深300指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》以及相关法律法规的规定，经与基金托管中国光大银行股份有限公司协商一致，基金管理人已将《国金沪深300指数分级证券投资基金基金合同》、《国金沪深300指数分级证券投资基金托管协议》分别修订为《国金沪深300指数增强证券投资基金基金合同》、《国金沪深300指数增强证券投资基金托管协议》，并据此编制《国金沪深300指数增强证券投资基金招募说明书》。国金沪深300指数分级已经中国证监会证监许可[2017]646号（《关于准予国金沪深300指数分级证券投资基金变更注册的批复》）准予变更注册。《国金沪深300指数增强证券投资基金基金合同》、《国金沪深300指数增强证券投资基金托管协议》将自国金沪深300指数增强证券投资基金基金份额转换基准日的次一工作日起生效，原《国金沪深300指数增强证券投资基金基金合同》、《国金沪深300指数增强证券投资基金托管协议》将自同一日起失效。

#### **五、关于折算后场内基金份额后续安排**

基金管理人将于基金份额转换完成后两个工作日内对基金份额转换结果进

行公告。

自《国金沪深 300 指数增强证券投资基金基金合同》生效之日起三个月内，持有国金沪深 300 指数增强基金场内份额的基金份额持有人可自行进行场外开户和跨系统转托管，将国金沪深 300 指数增强基金场内份额转换为国金沪深 300 指数增强基金场外份额。国金沪深 300 指数增强基金将于《国金沪深 300 指数增强证券投资基金基金合同》生效三个月后关闭场内份额的跨系统转托管业务，届时仍持有国金沪深 300 指数增强基金场内份额的基金份额持有人将不能自行进行跨系统转托管，原登记在中国证券登记结算有限责任公司深圳证券登记结算系统的场内基金份额，将统一转登记至本基金管理人开立的中登场外基金账户上，届时仍持有国金沪深 300 指数增强基金场内份额余额的投资人，需根据基金管理人届时发布的公告，对其持有的基金份额进行重新确认与登记，此过程即为“确权”，确权完成后，基金份额持有人方可在场外对相关基金份额进行赎回及其他交易。

#### **六、对基金份额持有人的影响及基金风险发生变化的提示**

本基金转型前为被动跟踪指数的指数型证券投资基金，属于证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。一般情形下，其风险和预期收益高于混合型、债券型、货币型基金。

就国金沪深300基金场内份额分拆成的两类基金份额而言，国金沪深300A份额具有低风险、预期收益相对稳定的特征；国金沪深300B份额具有高风险、高预期收益的特征。

本基金转型后为股票型基金，属于证券投资基金中较高预期收益、较高预期风险的品种，其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

本基金由股票指数分级基金转型为普通股票指数型基金，对原国金沪深300基金份额持有人来说，基金的风险收益特征发生了一定的变化。原国金沪深300A份额持有人持有的基金份额由原来的低风险变成较高预期风险。

特此公告。

国金基金管理有限公司

2017年8月15日