

# 关于嘉实多利分级债券型证券投资基金 办理基金份额到期折算业务的提示性公告

根据《嘉实多利分级债券型证券投资基金基金合同》（简称“基金合同”）以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，嘉实多利分级债券型证券投资基金（简称“本基金”）将在2012年3月23日办理基金份额到期折算业务。相关事项提示如下：

## 一、基金份额到期折算日

根据基金合同的规定，基金合同生效后第 12 个自然月的对应日（若该对应日不是工作日，则顺延至下一个工作日），是第一个到期折算日。自第一个到期折算日起，每个到期折算日后第 12 个自然月的对应日（若该对应日不是工作日，则顺延至下一个工作日），是后续的到期折算日。

本次到期折算日为2012年3月23日。

## 二、基金份额折算对象

到期折算日登记在册的本基金所有份额。

## 三、基金份额折算方式

1、到期折算日折算前嘉实多利进取份额的份额净值大于 1.0000 元

如果到期折算日折算前嘉实多利进取份额的份额净值大于 1.0000 元，则：

- 1) 折算前的嘉实多利基金份额持有人，以每 10 份嘉实多利基金份额，按 8 份嘉实多利优先份额的约定收益及 2 份嘉实多利进取份额的约定收益，获得新增嘉实多利基金份额的份额分配：折算不改变嘉实多利基金份额持有人的资产净值，其持有的嘉实多利基金份额份额净值折算调整为 1.0000 元、份额数量相应折算增加；
- 2) 折算前的嘉实多利优先份额持有人，以嘉实多利优先份额的约定收益，获得新增嘉实多利基金份额的份额分配：折算不改变嘉实多利优先份额持有人的资产净值，其持有的嘉实多利优先份额份额净值折算调整为 1.0000 元、份额数量不变，相应折算增加嘉实多利基金份额场内份额；
- 3) 折算前的嘉实多利进取份额持有人，以嘉实多利进取份额的约定收益，获得新增嘉实多利基金份额的份额分配：折算不改变嘉实多利进取份额持有人的资产净值，其持有的嘉实多利进取份额份额净值折算调整为 1.0000 元、份额数量不变，相

应折算增加嘉实多利基金份额场内份额。

按照基金合同第二十一章第（三）条第 1 款第（1）项、第（2）项所述的折算方法，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。

（1）嘉实多利基金份额的折算方法

如果到期折算日折算前嘉实多利进取份额的份额净值大于 1.0000 元，本基金先计算“嘉实多利基金份额的折算比例”，再计算“到期折算日折算后嘉实多利基金份额的份额数”，将到期折算日折算后嘉实多利基金份额的份额净值调整为 1.0000 元，计算公式如下：

$$\begin{aligned} \text{嘉实多利基金份额的折算比例} &= \frac{\text{到期折算日折算前基金资产净值} / \text{到期折算日基金份额数量}}{1.0000} \\ \text{到期折算日折算后嘉实多利基金份额的份额数} &= \text{到期折算日折算前嘉实多利基金份额的份额数} \\ &\quad \times \text{嘉实多利基金份额的折算比例} \\ \text{到期折算日折算后嘉实多利基金份额的份额净值} &= 1.0000 \text{元} \end{aligned}$$

到期折算日基金份额数量：是指到期折算日折算前嘉实多利基金份额、嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额数量之和

“嘉实多利基金份额的折算比例”的计算结果，保留到小数点后 9 位。场外“到期折算日折算后嘉实多利基金份额的份额数”的计算结果，保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。场内“到期折算日折算后嘉实多利基金份额的份额数”的计算结果中，不足 1 份的零碎份，按各个零碎份从大到小的排序，依次向相应的基金份额持有人记增 1 份，直到所有零碎份的合计份额分配完毕。

到期折算日折算前的场外嘉实多利基金份额持有人，将按前述折算方式，获得新增场外嘉实多利基金份额的分配。到期折算日折算前的场内嘉实多利基金份额持有人，将按前述折算方式，获得新增场内嘉实多利基金份额的分配。

（2）嘉实多利优先份额、嘉实多利进取份额的折算方法

如果到期折算日折算前嘉实多利进取份额的份额净值大于 1.0000元，本基金先计算“嘉实多利优先份额（或嘉实多利进取份额）的折算比例”，再计算“嘉实多利优先份额（或嘉实多利进取份额）的约定收益折算为新增嘉实多利基金份额的场内份额数”，将到期折算日折算后嘉实多利优先份额（或嘉实多利进取份额）的份额净值调整为 1.0000 元，计算公式如下：

$$\text{嘉实多利优先份额（或嘉实多利进取份额）的折算比例} = \frac{\text{到期折算日折算前嘉实多利优先份额（或嘉实多利进取份额）的份额净值}}{1.0000}$$

$$\begin{aligned} \text{嘉实多利优先份额（或嘉实多利进取份额）的约定收益折算为新增嘉实多利基金份额的场内份额数} = \\ \text{到期折算日折算前嘉实多利优先份额（或嘉实多利进取份额）的份额数} \\ \times (\text{嘉实多利优先份额（或嘉实多利进取份额）的折算比例} - 1) \end{aligned}$$

$$\text{到期折算日折算后嘉实多利优先份额（或嘉实多利进取份额）的份额净值} = 1.0000 \text{元}$$

$$\begin{aligned} \text{到期折算日折算后嘉实多利优先份额(或嘉实多利进取份额)的份额数} = \\ \text{到期折算日折算前嘉实多利优先份额(或嘉实多利进取份额)的份额数} \end{aligned}$$

“嘉实多利优先份额（或嘉实多利进取份额）的折算比例”的计算结果，保留到小数点后 4 位。“嘉实多利优先份额（或嘉实多利进取份额）的约定收益折算为新增嘉实多利基金份额的场内份额数”的计算结果中，不足 1 份的零碎份，按各个零碎份从大到小的排序，依次向相应的基金份额持有人记增 1 份，直到所有零碎份的合计份额分配完毕。

2、到期折算日折算前嘉实多利进取份额的份额净值小于或等于 1.0000 元

如果到期折算日折算前嘉实多利进取份额的份额净值小于或等于 1.0000 元，则：

- 1) 折算前的嘉实多利基金份额持有人，以每 10 份嘉实多利基金份额，按 8 份嘉实多利优先份额的约定收益，获得新增嘉实多利基金份额的分配：折算不改变嘉实多利基金份额持有人的资产净值，其持有的嘉实多利基金份额份额净值折算减少、份额数量相应折算增加；
- 2) 折算前的嘉实多利优先份额持有人，以嘉实多利优先份额的约定收益，获得新增嘉实多利基金份额的份额分配：折算不改变嘉实多利优先份额持有人的资产净值，其持有的嘉实多利优先份额份额净值折算调整为 1.0000 元、份额数量不变，相应折算增加嘉实多利基金份额场内份额；
- 3) 折算不改变嘉实多利进取份额持有人的资产净值，其持有的嘉实多利进取份额的份额净值、及份额数量不变。

按照基金合同第二十一章第（三）条第 2 款第（1）项、第（2）项所述的折算方法，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。

#### （1）嘉实多利基金份额的折算方法

如果到期折算日折算前嘉实多利进取份额的份额净值小于或等于 1.0000 元，本基金先计算“到期折算日折算后嘉实多利基金份额的份额净值”，再计算“嘉实多利基金份额持有人新增的嘉实多利基金份额数”，计算公式如下：

$$\text{到期折算日折算后嘉实多利基金份额的份额净值} = \frac{\text{到期折算日折算前嘉实多利基金份额的资产净值}}{\text{到期折算日折算前嘉实多利基金份额的份额数}} - \frac{\frac{8}{10} \times \text{到期折算日折算前嘉实多利基金份额的份额数} \times (\text{到期折算日折算前嘉实多利优先份额的份额净值} - 1.0000)}{\text{到期折算日折算前嘉实多利基金份额的份额数}}$$

嘉实多利基金份额持有人新增的嘉实多利基金份额数 =

$$\frac{8}{10} \times \text{到期折算日折算前嘉实多利基金份额的份额数} \times \frac{(\text{到期折算日折算前嘉实多利优先份额的份额净值} - 1.0000)}{\text{到期折算日折算后嘉实多利基金份额的份额净值}}$$

“到期折算日折算后嘉实多利基金份额的份额净值”的计算结果，保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入。场外“嘉实多利基金份额持有人新增的嘉实多利基金份额数”的计算结果，保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。场内“嘉实多利基金份额持有人新增的嘉实多利基金份额数”的计算结果中，不足 1 份的零碎份，按各个零碎份从大到小的排序，依次向相应的基金份额持有人记增 1 份，直到所有零碎份的合计份额分配完毕。

到期折算日折算前的场外嘉实多利基金份额持有人，将按前述折算方式，获得新增场外嘉实多利基金份额的分配。到期折算日折算前的场内嘉实多利基金份额持有人，将按前述折算方式，获得新增场内嘉实多利基金份额的分配。

## (2) 嘉实多利优先份额的折算方法

如果到期折算日折算前嘉实多利进取份额的份额净值小于或等于 1.0000 元，本基金先计算“到期折算日折算后嘉实多利基金份额的份额净值”，再计算“嘉实多利优先份额的约定收益折算为新增嘉实多利基金份额的场内份额数”，将到期折算日折算后嘉实多利优先份额的份额净值调整为 1.0000 元、份额数量不变，计算公式如下：

$$\text{到期折算日折算后嘉实多利基金份额的份额净值} = \frac{\text{到期折算日折算前嘉实多利基金份额的资产净值}}{\text{到期折算日折算前嘉实多利基金份额的份额数}} - \frac{\frac{8}{10} \times \text{到期折算日折算前嘉实多利基金份额的份额数} \times (\text{到期折算日折算前嘉实多利优先份额的份额净值} - 1.0000)}{\text{到期折算日折算前嘉实多利基金份额的份额数}}$$

嘉实多利优先份额的约定收益折算为新增嘉实多利基金份额的场内份额数 =

$$\frac{\text{到期折算日折算前嘉实多利优先份额的份额数} \times (\text{到期折算日折算前嘉实多利优先份额的份额净值} - 1)}{\text{到期折算日折算后嘉实多利基金份额的份额净值}}$$

到期折算日折算后嘉实多利优先份额的份额净值 = 1.0000元

到期折算日折算后嘉实多利优先份额的份额数 = 到期折算日折算前嘉实多利优先份额的份额数

“到期折算日折算后嘉实多利基金份额的份额净值”的计算结果，保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入。“嘉实多利优先份额的约定收益折算为新增嘉实多利基金份额的场内份额数”的计算结果中，不足 1 份的零碎份，按各个零碎份从大到小的排序，依次

向相应的基金份额持有人记增 1 份，直到所有零碎份的合计份额分配完毕。

### (3) 嘉实多利进取份额的折算方法

如果到期折算日折算前嘉实多利进取份额的份额净值小于或等于 1.0000 元，则到期折算不改变嘉实多利进取份额的份额数量和份额净值。

### 3、到期折算后嘉实多利基金份额的总份额数

到期折算日折算后嘉实多利基金份额的总份额数 =

$$\begin{aligned} & \text{嘉实多利基金份额到期折算后的份额数(含到期折算日折算前份额数及折算后新增份额数)} \\ & + \text{嘉实多利优先份额的约定收益折算为新增嘉实多利基金份额的场内份额数} \\ & + \text{嘉实多利进取份额的约定收益折算为新增嘉实多利基金份额的场内份额数 (如有)} \end{aligned}$$

## 四、基金份额折算期间的基金业务办理

1、基金份额到期折算日（即2012年3月23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；多利优先、多利进取交易正常。当日晚间，基金管理人计算当日基金份额净值及份额折算比例。

2、基金份额到期折算日后的第一个工作日（即2012年3月26日），本基金暂停办理申购、赎回、转托管、配对转换业务，多利优先、多利进取暂停交易。当日，本基金注册登记人及基金管理人为持有人办理份额登记确认。

3、基金份额到期折算日后的第二个工作日（即2012年3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、赎回、转托管、配对转换业务，多利优先、多利进取恢复交易。

4、根据深圳证券交易所《关于分级基金份额折算后复牌首日前收盘价调整的通知》，2012年3月27日多利优先、多利进取复牌首日即时行情显示的前收盘价分别为2012年3月26日的多利优先、多利进取的份额净值（四舍五入至0.0001元）。由于多利优先、多利进取在折算前可能存在折溢价交易情形，折算前的收盘价与2012年3月27日的前收盘价可能有较大差异，3月27日当日可能出现交易价格大幅波动的情形。

## 五、重要提示

投资者若希望了解基金份额到期折算业务详情，请登陆本公司网站：[www.jsfund.cn](http://www.jsfund.cn)或者拨打本公司客服电话：400—600—8800。

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。敬请投资者留意投资风险。

嘉实基金管理有限公司

2012年3月13日