

关于金鹰中证500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《金鹰中证500指数分级证券投资基金基金合同》(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,金鹰中证500指数分级证券投资基金(简称“本基金”)将在2013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第一个工作日。本次定期份额折算的基准日为2013年1月4日。

二、基金份额折算对象

定期折算日登记在册的金鹰中证500基金份额和金鹰中证500A基金份额。

三、基金份额折算方式

根据净资产不变的原则,将金鹰中证500A份额2012年12月31日的份额参考净值超过1元的部分转换成金鹰中证500场内份额;金鹰中证500份额持有人所持有的每两份(场内和场外)金鹰中证500份额按照一份金鹰中证500A份额获得新增金鹰中证500份额的分配,按上述份额折算后,金鹰中证500的份额净值(无论场内还是场外)作相应的调整,金鹰中证500B份额不进行折算。

(1) 金鹰中证500份额之折算

1) 定期折算后的金鹰中证500份额净值

$$NAV_{500}^{\text{后}} = NAV_{500}^{\text{前}} - \frac{1}{2}(NAV_a^{\text{期末}} - 1)$$

其中, $NAV_{500}^{\text{前}}$ 为折算日折算前金鹰中证500份额的单位份额净值, $NAV_{500}^{\text{后}}$ 为折算日折算后金鹰中证500份额的单位净值。 $NAV_a^{\text{期末}}$ 为最近一个会计年度12月31日金鹰中证500A份额的单位参考净值。

2) 定期折算后的金鹰中证500份额数

根据净资产不变的原则,1份折算前的金鹰中证500份额折算后的金鹰中证500份额为:

$$\text{每1份金鹰中证500份额定期折算后的份额数} = \frac{NAV_{500}^{\text{前}}}{NAV_{500}^{\text{后}}}$$

(2)、金鹰中证500A份额之折算

折算完成时，1份折算前参考净值为 $NAV_a^{\text{前}}$ （大于1）的金鹰中证500A份额折算后份额保持不变，再加上新增的份额净值为 $NAV_{500}^{\text{后}}$ 的折算后的金鹰中证500份额（场内）；由净资产不变的原则，有：

$$\text{每1份金鹰优先份额定期折算后新增的金鹰中证500份额} = \frac{NAV_a^{\text{期末}} - 1}{NAV_{500}^{\text{后}}}$$

定期折算完成时，场外金鹰中证500份额采用截位法保留到小数点后第2位，小数点第3位及第3位以后的部分舍去；场内金鹰中证500份额采用截位法保留到整数位；由上述截位法计算过程产生的误差计入基金财产。

(3) 举例

本基金成立后第一个会计年度第一个工作日为定期折算基准日，假设在该日折算前金鹰中证500份额的单位份额净值为0.8805元，前一个会计年度末金鹰中证500A份额的单位份额参考净值为1.0365元。折算前，投资者甲持有10000份金鹰中证500A份额，投资者乙持有10000份金鹰中证500场内份额，8000份金鹰中证500场外份额，则有：

$$\text{折算后金鹰中证500份额单位份额净值} = 0.8805 - (1.0365 - 1) / 2 = 0.8623 \text{元}$$

投资者甲折算后持有的金鹰中证500A份额数等于其折算前持有的金鹰中证500A份额数，皆为10000份。

投资者甲新增的金鹰中证500场内份额数 = $10000 \times (1.0365 - 1) / 0.8623 = 423$ 份（场内金鹰中证500份额采用截位法保留到整数位，由此产生的误差计入基金财产）

投资者乙折算后持有的金鹰中证500场内份额 = $10000 \times 0.8805 / 0.8623 = 10211$ 份（场内金鹰中证500份额采用截位法保留到整数位，由此产生的误差计入基金财产）

投资者乙折算后持有的金鹰中证500场外份额 = $8000 \times 0.8805 / 0.8623 = 8168.85$ 份（场外金鹰中证500份额采用截位法保留到小数点后第2位，由此产生的误差计入基金财产）

四、基金份额折算期间的基金业务办理

(一) 定期份额折算基准日(即2013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; 金鹰中证500A、金鹰中证500B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。

(二) 定期份额折算基准日后的第一个工作日(即2013年1月7日), 本基金暂停办理申购、赎回、转托管、配对转换业务, 金鹰中证500A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。

(三) 定期份额折算基准日后的第二个工作日(即2013年1月8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, 金鹰中证500A自10:30分恢复交易。

(四) 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》, 2013年1月8日金鹰中证500A复牌首日即时行情显示的前收盘价为2013年1月7日的金鹰中证500A的份额净值(四舍五入至0.001元)。由于金鹰中证500A折算前可能存在折溢价交易情形, 折算前的收盘价扣除2012年约定收益后与2013年1月8日的前收盘价可能有较大差异, 1月8日当日可能出现交易价格大幅波动的情形。

五、重要提示

由于金鹰中证500A份额新增份额折算成金鹰中证500份额的场内份额数和金鹰中证500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, 持有较少金鹰中证500A份额数或场内金鹰中证500份额数的份额持有人存在无法获得新增场内金鹰中证500份额的可能性。因此, 上述份额持有人可在基金份额折算基准日之前将原有份额卖出或者增加持有份额的数量来保证自身权益不受损害。

投资者欲了解本基金定期份额折算业务详情, 请登陆本公司网站:
www.gefund.com.cn或者拨打本公司客服电话: 400-6135-888。

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。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。敬请投资人注意投资风险。

特此公告。

金鹰基金管理有限公司

2012年12月27日