

# 关于浙商沪深 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《浙商沪深 300 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，浙商沪深 300 指数分级证券投资基金（简称“本基金”）将在 2015 年 1 月 5 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 2015 年 1 月 5 日。

### 二、 基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的浙商稳健份额（简称：浙商稳健；代码：150076）、浙商沪深 300 份额（场内简称：浙商 300；代码：166802）。浙商进取份额（简称：浙商进取；代码：150077）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

浙商稳健份额和浙商进取份额按照基金合同中规定的净值计算规则进行净值计算，对浙商稳健份额的约定应得收益进行定期份额折算，每 2 份浙商沪深 300 份额将按 1 份浙商稳健份额获得约定应得收益的新增折算份额。

在基金份额折算前与折算后，浙商稳健份额和浙商进取份额的份额配比保持 1:1 的比例。

对于浙商稳健份额期末的约定收益，即浙商稳健份额每个会计年度 12 月 31 日份额参考净值超出 1.000 元部分，将折算为场内浙商沪深 300 份额分配给浙商稳健份额持有人。浙商沪深 300 份额持有人持有的每 2 份浙商沪深 300 份额将按 1 份浙商稳健份额获得新增浙商沪深 300 份额的分配。持有场外浙商沪深 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浙商沪深 300 份额的分配；持有场内浙商沪深 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浙商沪深 300 份额的分配。

经过上述份额折算, 浙商稳健份额的基金份额参考净值和浙商沪深 300 份额的基金份额净值将相应调整。

每个会计年度第一个工作日为基金份额折算日, 本基金将对浙商稳健份额和浙商沪深 300 份额进行已实现的约定收益的定期份额折算。

每个会计年度第一个工作日进行浙商稳健份额上一年度应得收益的定期份额折算时, 有关计算公式如下:

#### 1、浙商沪深 300 份额折算

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

浙商沪深 300 份额持有人新增的浙商沪深 300 份额数 =

$$0.5 \times NUM_{\text{沪深300}}^{\text{前}} \times (NAV_{\text{稳健}}^{\text{前}} - 1.000) / NAV_{\text{沪深300}}^{\text{后}}$$

定期份额折算后浙商沪深 300 份额的份额数 = 定期份额折算前浙商沪深 300 份额的份额数 + 浙商沪深 300 份额持有人新增的浙商沪深 300 份额的份额数

其中:

$NAV_{\text{沪深300}}^{\text{前}}$ : 折算前浙商沪深 300 份额的基金份额净值, 下同

$NAV_{\text{沪深300}}^{\text{后}}$ : 折算后浙商沪深 300 份额的基金份额净值, 下同

$NAV_{\text{稳健}}^{\text{前}}$ : 折算前浙商稳健份额的基金份额参考净值, 下同

$NUM_{\text{沪深300}}^{\text{前}}$ : 折算前浙商沪深 300 份额的份额数, 下同

持有浙商沪深 300 份额的场外份额的持有人将按上述折算方式获得新增浙商沪深 300 份额的场外份额的分配; 持有浙商沪深 300 份额的场内份额的持有人将按上述折算方式获得新增浙商沪深 300 份额的场内份额的分配。

浙商沪深 300 份额的场外份额经折算后的份额数采用四舍五入的方式保留到小数点后两位, 由此产生的误差计入基金财产; 浙商沪深 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。

#### 2、浙商稳健份额折算

定期份额折算后浙商稳健份额的基金份额参考净值 = 1.000 元

定期份额折算后浙商稳健份额的份额数 = 定期份额折算前浙商稳健份额的份额数

浙商稳健份额持有人新增的浙商沪深 300 份额数 =

$$\left[ NUM_{\text{稳健}}^{\text{前}} \times (NAV_{\text{稳健}}^{\text{前}} - 1.000) \right] / NAV_{\text{沪深300}}^{\text{后}}$$

其中：

$NUM_{\text{稳健}}^{\text{前}}$ ：折算前浙商稳健份额的份额数，下同

浙商稳健份额折算成浙商沪深 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。

### 3、浙商进取份额折算

浙商进取份额不进行份额折算，其基金份额参考净值和份额数保持不变。

### 4、折算后浙商沪深 300 份额的总份额数

折算后浙商沪深 300 份额的总份额数 = 定期份额折算前浙商沪深 300 份额的份额数 + 浙商沪深 300 份额持有人新增的浙商沪深 300 份额数 + 浙商稳健份额持有人新增的浙商沪深 300 份额数。

### 5、举例

假设基金份额折算日折算前浙商沪深 300 份额的基金份额净值为 1.356 元，上会计年度末浙商稳健份额的基金份额参考净值为 1.058 元，浙商进取份额的基金份额参考净值为 1.654 元，投资人甲持有浙商沪深 300 份额的场内份额 100,000 份，投资人乙持有浙商稳健份额 60,000 份，投资人丙持有浙商进取份额 80,000 份，则：

份额折算后浙商沪深 300 份额的基金份额净值 =  $1.356 - 0.5 \times (1.058 - 1.000)$   
= 1.327 元，浙商稳健份额的基金份额参考净值 = 1.000 元

投资人甲新增的浙商沪深 300 份额数 =  $[0.5 \times 100,000 \times (1.058 - 1.000)] / 1.327 = 2185$  份（场内份额取整计算，最小单位为 1 份，余额计入基金财产）

投资人乙新增的浙商沪深 300 份额数 =  $[60,000 \times (1.058 - 1.000)] / 1.327 = 2,622$  份（场内份额取整计算，最小单位为 1 份，余额计入基金财产）

即：份额折算后，投资人甲共持有浙商沪深 300 份额的场内份额 102,185 份，投资人乙共持有浙商稳健份额 60,000 份及浙商沪深 300 份额的场内份额 2,622 份，投资人丙仍持有浙商进取份额 80,000 份。

## 四、 基金份额折算期间的业务办理

(一) 定期份额折算基准日(即 2015 年 1 月 5 日), 本基金暂停办理申购、赎回、系统内转托管和跨系统转登记、份额配对转换业务, 浙商稳健份额、浙商进取份额正常交易。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 2015 年 1 月 6 日), 本基金暂停办理申购、赎回、系统内转托管和跨系统转登记、份额配对转换业务, 浙商稳健份额暂停交易, 浙商进取份额正常交易。当日, 基金注册登记机构及基金管理人为份额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 2015 年 1 月 7 日), 基金管理人将公告份额折算确认结果, 份额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、系统内转托管和跨系统转登记、份额配对转换业务, 浙商稳健份额于该日 10:30 恢复交易, 浙商进取份额正常交易。

(四) 根据深圳证券交易所《证券投资基金交易和申购赎回实施细则》, 2015 年 1 月 7 日浙商稳健复牌首日即时行情显示的前收盘价为 2015 年 1 月 6 日的浙商稳健份额的份额净值(四舍五入至 0.001 元)。由于浙商稳健份额折算前可能存在折溢价交易情形, 折算前的收盘价扣除 2014 年约定收益后与 2015 年 1 月 7 日的前收盘价可能有较大差异, 2015 年 1 月 7 日当日可能出现交易价格大幅波动的情形。

## 五、 重要提示

由于浙商稳健份额新增份额折算成浙商沪深 300 份额的场内份额数和浙商沪深 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, 持有较少浙商稳健份额数或场内浙商沪深 300 份额数的份额持有人存在无法获得新增场内浙商沪深 300 份额的可能性。

投资人若希望了解基金定期份额折算业务详情, 请登陆本公司网站:  
<http://www.zsfund.com> 或拨打本公司客服电话: 400-067-9908(免长途话费), 021-60359000。

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。投资者投资于基金前应认真阅读基金的基金合同、招募说明书等文件。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

浙商基金管理有限公司

2014年12月29日