

# 国金通用基金管理有限公司

## 国金通用沪深 300 指数分级证券投资基金办理不定期份额折算业务的公告

根据《国金通用沪深 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，国金通用沪深 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通用沪深 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”，场内简称“国金 300”，基金代码：167601）、国金通用沪深 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”，场内简称“国金 300A”，基金代码：150140）和国金通用沪深 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”，场内简称“国金 300B”，基金代码：150141）。

根据基金合同的规定，当国金沪深 300 份额的基金份额净值大于或等于 1.500 元时，本基金将进行不定期份额折算。本基金的国金沪深 300 份额的基金份额净值于 2014 年 12 月 31 日达到 1.521 元，将在 2015 年 1 月 5 日办理不定期份额折算业务，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，本次不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国金沪深 300 份额、国金沪深 300A 份额和国金沪深 300 份额。

### 三、基金份额折算方式

在折算基准日，本基金将分别对国金沪深 300A 份额、国金沪深 300B 份额和国金沪深 300 份额进行不定期份额折算，份额折算后本基金将确保国金沪深 300A 份额和国金沪深 300B 份额的比例为 1：1，份额折算后国金沪深 300A 份额、国金沪深 300B 份额和国金沪深 300 份额的基金份额净值均调整为 1.000 元。

国金沪深 300A 份额、国金沪深 300B 份额、国金沪深 300 份额三类份额按照如下公式进行份额折算：

## 1、国金沪深 300A 份额

份额折算原则：

A、份额折算前国金沪深 300A 份额的份额数与份额折算后国金沪深 300A 份额的份额数相等；

B、份额折算前国金沪深 300A 份额的资产净值与份额折算后国金沪深 300A 份额的资产净值及其新增场内国金沪深 300 份额的资产净值之和相等；

C、份额折算前国金沪深 300A 份额的持有人在份额折算后将持有国金沪深 300A 份额与新增场内国金沪深 300 份额，国金沪深 300A 份额持有人份额折算后获得新增的份额数，即在份额折算基准日国金沪深 300A 份额参考净值超出 1.000 元的部分全部折算为场内国金沪深 300 份额；

$$NUM_{300A}^{\text{后}} = NUM_{300A}^{\text{前}}$$

国金沪深 300A 份额持有新增的场内国金沪深 300 份额的份额数=

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

其中：

$NAV_{300A}^{\text{前}}$ ：不定期份额折算前国金沪深 300A 份额参考净值

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

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

## 2、国金沪深 300B 份额

份额折算原则：

A、份额折算前国金沪深 300B 份额的份额数与份额折算后国金沪深 300B 份额的份额数相等；

B、份额折算前国金沪深 300B 份额的资产净值与份额折算后国金沪深 300B 份额的资产净值及其新增场内国金沪深 300 份额的资产净值之和相等；

C、份额折算前国金沪深 300B 份额的持有人在份额折算后将持有国金沪深 300B 份额与新增场内国金沪深 300 份额，国金沪深 300B 份额持有人份额折算后获得新增的份额数，即在份额折算基准日国金沪深 300B 份额参考净值超出 1.000

元的部分全部折算为场内国金沪深 300 份额；

$$NUM_{300B}^{\text{后}} = NUM_{300B}^{\text{前}}$$

国金沪深 300B 份额持有人新增的场内国金沪深 300 份额的份额数=

$$\frac{NUM_{300B}^{\text{前}} \times (NAV_{300B}^{\text{前}} - 1.000)}{1.000}$$

其中：

$NAV_{300B}^{\text{前}}$ ：不定期份额折算前国金沪深 300B 份额参考净值

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

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

### 3、国金沪深 300 份额

份额折算原则：

场外国金沪深 300 份额持有人份额折算后获得新增场外国金沪深 300 份额，场内国金沪深 300 份额持有人份额折算后获得新增场内国金沪深 300 份额。

$$NUM_{300}^{\text{后}} = \frac{NAV_{300}^{\text{前}} \times NUM_{300}^{\text{前}}}{1.000}$$

其中：

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

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

$NUM_{300}^{\text{后}}$ ：不定期份额折算后国金沪深 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。

在实施不定期份额折算时，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 份额和国金沪深 300B 份额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、不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、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、不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、转托管、配对转换业务，国金沪深 300A 份额、国金沪深 300B 份额暂停交易。当日，本基金管理人为持有人办理份额登记确认。

3、不定期份额折算基准日后的第二个工作日（即 2015 年 1 月 7 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、国金沪深 300B 份额将于上午 9:30-10:30 停牌一小时，并于上午 10:30 之后复牌。

4、根据深圳证券交易所《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 日国金沪深 300A 份额、国金沪深 300B 份额复牌即时行情显示的前收盘价分别为 2015 年 1 月 6 日的国金沪深 300A 份额、国金沪深 300B 份额的份额净值（四舍五入至 0.001 元），2015 年 1 月 7 日当日国金沪深 300A 份额、国金沪深 300B 份额均可能出现交易价格大幅波动的情形。敬请投资者注意投资风险。

## 五、重要提示

1、本基金国金沪深 300A 份额表现为低风险、收益相对稳定的特征,但在不定期份额折算后,原国金沪深 300A 份额持有人将持有国金沪深 300A 份额和国金沪深 300 份额,由持有单一的较低风险收益特征份额变为同时持有较低风险收益特征份额与较高风险收益特征份额,风险收益特征将发生变化,预期收益实现的不确定性将会增加;此外,国金沪深 300 份额为跟踪沪深 300 指数的基础份额,其份额净值将随市场涨跌而变化,因此原国金沪深 300A 份额持有人还可能会承担因市场下跌而遭受损失的风险。

2、国金沪深 300B 份额表现为高风险、高收益的特征,但在不定期份额折算后,原国金沪深 300B 份额持有人将同时持有较高风险收益特征国金沪深 300B 份额与较低风险收益特征国金沪深 300 份额,风险收益特征将发生变化,且折算后其杠杆倍数将大幅提升,由目前的杠杆恢复到初始的 2 倍杠杆水平。此外,国金沪深 300B 份额的基金份额参考净值随市场涨跌而增长或者下降的幅度也会增

加。

3、由于国金沪深 300A 份额和国金沪深 300B 份额折算前可能存在折溢价交易情形，不定期份额折算后，国金沪深 300A 份额和国金沪深 300B 份额均可能出现交易大幅波动的情形。特提请参与二级市场交易的投资者注意投资风险。

4、原国金沪深 300A 份额和国金沪深 300B 份额持有人可通过办理配对转换业务将此次折算获得的场内国金沪深 300 份额分拆为国金沪深 300A 份额和国金沪深 300B 份额。

5、折算后，本基金国金沪深 300 份额的份额数量会增加。根据深圳证券交易所的相关业务规则，场内份额数将取整计算（最小单位为 1 份），舍去部分计入基金资产，持有极小数量国金沪深 300A 份额、国金沪深 300B 份额和场内国金沪深 300 份额的持有人，存在折算后份额因为不足 1 份而导致相应的资产被强制归入基金资产的风险。

6、此次基金份额折算基准日不是触发折算阈值当日，折算基准日的国金沪深 300 份额净值与折算阈值 1.500 元可能有一定差异。

7、根据基金合同的规定，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）为本基金的定期份额折算基准日，因此 2015 年 1 月 5 日也是本基金的定期份额折算基准日；根据基金合同的规定，若在定期份额折算日发生基金合同约定的本基金不定期折算的情形时，将按照不定期份额折算的规则进行份额折算。因此，本次本基金将按照不定期份额折算的规则进行份额折算，不再进行定期份额折算。

投资者若希望了解本基金不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。

国金通用基金管理有限公司

2015年1月5日