

关于南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金 不定期份额折算结果及恢复交易的公告

根据《南方中证国有企业改革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,南方基金管理有限公司(以下简称“本公司”)以2015年7月9日为基准日,对南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)之南方国企改革份额(场内简称“改革基金”,基金代码:160136,包含场内份额和场外份额)、国企改革A份额(场内简称“改革A”,基金代码150295)、国企改革B份额(场内简称“改革B”,基金代码150296)实施不定期份额折算,现将相关事项公告如下:

一、份额折算结果

2015年7月9日,南方国企改革份额的场外份额经折算后的份额数计算结果保留到小数点后两位,小数点后两位以后的部分舍弃,余额计入基金财产;南方国企改革份额的场内份额、国企改革A份额、国企改革B份额经折算后的份额数取整计算(最小单位为1份),余额部分计入基金资产。如下表所示:

	折算前		折算后	
	折算前基金份额数(份)	折算前基金份额净值/参考净值(元)	折算后基金份额数	折算后基金份额净值/参考净值(元)
南方国企改革场外份额	223,439,313.30	0.668162775	149,293,831.62	1.0000
南方国企改革场内份额	355,920,410.00	0.668162775	237,812,768.00	1.0000
国企改革A份额	1,081,445,620.00	1.005828767	357,414,298.00 730,334,816.00*	1.0000
国企改革B份额	1,081,445,621.00	0.330496783	357,414,298.00	1.0000

*注:该“折算后基金份额数”为国企改革A份额经折算后产生新增南方国企改革场内份额数
投资人自公告之日起可查询经登记机构及本公司确认的折算后份额。

二、恢复交易

自2015年7月13日起,本基金恢复申购(含定投)、赎回、配对转换和转托管业务(包

括场外转托管、跨系统转托管)。改革 A 和改革 B 于 2015 年 7 月 13 日上午 10:30 恢复交易。

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 7 月 13 日改革 A、改革 B 即时行情显示的前收盘价为 2015 年 7 月 10 日的改革 A、改革 B 的基金份额参考净值，分别是 1.000 元和 1.133 元。2015 年 7 月 13 日当日改革 A、改革 B 均可能出现交易价格较大幅波动的情形。敬请投资人注意投资风险。

三、其他需要提示的事项

1、本基金国企改革 A 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国企改革 A 份额持有人的风险收益特征将发生较大变化，由持有单一的较低风险收益特征的国企改革 A 份额变为同时持有较低风险收益特征的国企改革 A 份额与较高风险收益特征的南方国企改革份额，因此原国企改革 A 份额持有人预期收益实现的不确定性将会增加；此外，南方国企改革份额为跟踪中证国有企业改革指数的基础份额，其份额净值将随市场涨跌而变化，因此原国企改革 A 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、本基金国企改革 B 份额表现为高风险、高收益的特征，不定期份额折算后其杠杆倍数将大幅降低，将恢复到初始杠杆水平，相应地，国企改革 B 份额净值随市场涨跌而增长或者下降的幅度也会大幅减小。

3、由于改革 A、改革 B 份额折算前可能存在折溢价交易情形，不定期份额折算后，改革 A、改革 B 的折溢价率可能发生较大变化。特提请参与二级市场交易的投资人注意折溢价所带来的风险。

4、原国企改革 A 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南方国企改革份额分拆为国企改革 A 份额、国企改革 B 份额。

5、根据深圳证券交易所的相关业务规则，国企改革 A 份额、国企改革 B 份额、南方国企改革份额的场内份额经折算后的份额数均取整计算（最小单位为 1 份），舍去部分计入基金财产，持有极小数量国企改革 A 份额、国企改革 B 份额、南方国企改革份额的持有人，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、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。投资人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。敬请投资人注意投资风险。

7、投资人可访问本公司网站(www.nffund.com)或拨打全国免长途话费的客户服务电话(400—889—8899)咨询相关情况。

特此公告。

南方基金管理有限公司

2015 年 7 月 13 日