

关于万家中证创业成长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《万家中证创业成长指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）对于基金份额折算业务的约定，分级运作期内，当万家中证创业成长指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）之万家创业成长 B 份额的基金份额参考净值跌至 0.250 元或以下时，本基金将进行不定期份额折算。

截至 2015 年 8 月 25 日，万家创业成长 B 份额的基金份额净值为 0.1835 元，达到上述办理不定期份额折算业务的条件。根据《基金合同》的约定，以及深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定，本基金将以 2015 年 8 月 26 日作为基金份额折算基准日，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

本次不定期份额折算的基准日为 2015 年 8 月 26 日。

二、基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的万家创业成长 A 份额（场内简称“成长 A”，基金代码 150090）、万家创业成长 B 份额（场内简称“成长 B”，基金代码 150091）与万家创业成长份额（场内简称“成长分级”，基金代码 161910，包括万家中创场内份额及万家中创场外份额）。

三、基金份额折算方式

当万家创业成长 B 份额的基金份额参考净值小于或等于 0.250 元后，本基金将分别对万家创业成长 A 份额、万家创业成长 B 份额和万家创业成长份额进行份额折算，份额折算后万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额的比例仍保持 1:1 不变。份额折算后万家创业成长份额的基金份额净值、万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额的基金份额参考净值均调整为 1.000 元，万家创业成长份额、万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额的份额数将得到相应的调

整。

份额折算公式如下：

1) 万家创业成长 B 份额

份额折算后万家创业成长 B 份额的份额数： $NUM_B^{\text{后}} = (NUM_B^{\text{前}} \times NAV_B^{\text{前}}) / 1.000$

万家创业成长 B 份额经份额折算后的份额数采用截位方法保留到整数位(最小单位为 1 份)，余额计入基金财产。

2) 万家创业成长 A 份额

份额折算前后万家创业成长 A 份额与万家创业成长 B 份额的份额数始终保持 1: 1 不变，即： $NUM_A^{\text{后}} = NUM_B^{\text{后}}$ ；

万家创业成长 A 份额的持有人在份额折算后新增场内万家创业成长份额数 = $(NUM_A^{\text{前}} \times NAV_A^{\text{前}} - NUM_A^{\text{后}} \times 1.000) / 1.000$

万家创业成长 A 份额经份额折算后的份额数采用截位方法保留到整数位(最小单位为 1 份)，余额计入基金财产。万家创业成长 A 份额经份额折算成万家创业成长份额的场内份额采用截位方法保留到整数位(最小单位为 1 份)，余额计入基金财产。

3) 万家创业成长份额：

万家创业成长份额的持有人在份额折算后持有的万家创业成长份额数 = $(NUM_{\text{创业成长}}^{\text{前}} \times NAV_{\text{创业成长}}^{\text{前}}) / 1.000$

万家创业成长份额的场外份额经份额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；万家创业成长份额的场内份额经份额折算后的份额数采用截位方法保留到整数位(最小单位为 1 份)，余额计入基金财产。

4) 折算后万家创业成长份额的总份额数

折算后万家创业成长份额的总份额数 = 万家创业成长份额的持有人在不定期份额折算后持有的万家创业成长份额数 + 万家创业成长 A 份额持有人新增的万家创业成长份额数。

5) 举例：

假设 T 日万家创业成长份额的基金份额净值为 0.585000000 元，万家创业成长 A 份额的基金份额参考净值为 1.025000000 元，万家创业成长 B 份额的基金份额参考净值为 0.145000000 元，投资者甲持有万家创业成长份额的场内份额 100,000 份，投资者乙持有万家创业成长 A 份额 20,000 份，投资者丙持有万家创

业成长 B 份额 8,000 份，若基金管理人决定以该日为份额折算日，则执行此次不定期份额折算后：

万家创业成长份额的基金份额净值、万家创业成长 A 份额和万家创业成长 B 份额的基金份额参考净值均调整为 1.000 元

投资者甲折算后持有万家创业成长份额数 = $(100,000 \times 0.585000000) / 1.000 = 58,500$ 份

投资者乙折算后持有万家创业成长 A 份额数 = $(20,000 \times 0.145000000) / 1.000 = 2,900$ 份

投资者乙新增的场内万家创业成长份额数 = $[20,000 \times 1.025000000 - 2,900 \times 1.000] / 1.000 = 17,600$ 份

投资者丙折算后持有万家创业成长 B 份额数 = $(8,000 \times 0.145000000) / 1.000 = 1,160$ 份

即：份额折算后，投资者甲持有万家创业成长份额的场内份额 58,500 份，投资者乙共持有万家创业成长 A 份额 2,900 份及万家创业成长份额的场内份额 17,600 份，投资者丙持有万家创业成长 B 份额 1,160 份。

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 8 月 26 日），本基金暂停办理申购（含定期定额投资）、赎回、转换、转托管（包括系统内转托管、跨系统转托管，下同）、配对转换业务；万家创业成长 B 份额、万家创业成长 A 份额将于当日上午 9:30-10:30 停牌一小时，并于上午 10:30 复牌。当日晚间，基金管理人将计算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 8 月 27 日），本基金将暂停办理申购、赎回、转换、转托管、配对转换业务；万家创业成长 B 份额、万家创业成长 A 份额将于该日停牌一天；当日，登记结算机构及基金管理人将完成份额登记确认。

3、不定期份额折算日后的第二个工作日（即 2015 年 8 月 28 日），基金管理人将公告份额折算确认结果，基金份额持有人可以查询其账户内的基金份额；万家创业成长 B 份额、万家创业成长 A 份额将于该日上午 9:30-10:30 停牌一小时，并于上午 10:30 之后复牌；当日，本基金恢复办理申购、赎回、转换、转托管、

配对转换业务。

4、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8月28日万家创业成长B份额、万家创业成长A份额即时行情显示的前收盘价为2015年8月27日的万家创业成长B类份额、万家创业成长A份额的基金份额参考净值（四舍五入至0.001元）。

5、2015年8月28日万家创业成长B份额、万家创业成长A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、本基金万家中证创业成长指数分级证券投资基金A份额、万家中证创业成长指数分级证券投资基金B份额将于2015年8月26日上午9:30-10:30停牌一小时，并于2015年8月26日上午10:30复牌。

本基金万家中证创业成长指数分级证券投资基金A份额、万家中证创业成长指数分级证券投资基金B份额将于2015年8月27日全天停牌，2015年8月28日上午9:30-10:30停牌一小时，并于2015年8月28日上午10:30复牌。

2、2015年8月25日，万家中证创业成长指数分级证券投资基金B份额的基金参考净值已跌至0.250以下，而折算基准日为2015年8月26日，因此折算基准日万家中证创业成长指数分级证券投资基金B份额的基金参考净值可能与0.250元有差异。

3、特别提示：近日，万家创业成长B份额二级市场交易价格溢价交较大，在不定期份额折算后，万家创业成长B份额的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者注意万家创业成长B份额高溢价交易带来的风险。

4、万家创业成长B份额表现为较高风险、较高预期收益的特征。随着万家创业成长B份额的基金参考净值降低，其杠杆率升高。在不定期份额折算后，万家创业成长B份额的杠杆率将恢复至初始杠杆水平。

5、万家创业成长A份额表现为较低风险、收益相对稳定的特征。但在发生不定期折算后，万家创业成长A的份额持有人会获得一定比例的万家创业成长B份额，因此其持有的部分基金份额的风险收益特征将发生较大变化，万家创业成长A份额持有人预期收益实现的不确定性将会增加。

6、根据深圳证券交易所的相关业务规则，场外份额进行份额折算时计算结果保留到小数点后 2 位，小数点后 2 位的部分舍去，舍去部分计入基金财产。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，持有极小数量万家创业成长 A 份额、万家创业成长 B 份额和场内万家创业成长份额的持有人，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。

7、折算后，本基金万家创业成长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，持有极小数量万家创业成长 A 份额、万家创业成长 B 份额和场内万家创业成长份额的持有人，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。

8、基金管理人承诺以诚实信用、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。本基金管理人提醒投资者知晓基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。敬请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等相关法律文件。

特此公告。

万家基金管理有限公司

2015 年 8 月 26 日