

博时中证 800 证券保险指数分级证券投资基金

不定期份额折算公告

根据《博时中证 800 证券保险指数分级证券投资基金基金合同》(简称“基金合同”) 第二十二部分中关于不定期份额折算的相关规定,当博时中证 800 证券保险指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)之 B 份额的基金份额参考净值跌至 0.2500 元时,本基金将进行不定期份额折算。

截至 2015 年 8 月 25 日,本基金博时中证 800 证券保险指数分级 B 份额的基金份额参考净值为 0.2446 元,达到基金合同规定的不定期份额折算条件。根据本基金基金合同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 日为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博时中证 800 证券保险份额(场内简称“博时证保”,基金代码:160516)、博时中证 800 证券保险 A 份额(场内简称“证保 A 级”,基金代码:150225)、博时中证 800 证券保险 B 份额(场内简称“证保 B 级”,基金代码:150226)。

三、基金份额折算方式

博时中证 800 证保份额、博时中证 800 证保 A 份额、博时中证 800 证保 B 份额按照基金合同“第二十二部分 基金的份额折算”规则进行不定期份额折算。

假设不定期折算基准日折算前博时证保 A 份额参考净值为 $NAV_A^{\text{前}}$ 、博时证保 B 份额参考净值为 $NAV_B^{\text{前}}$ 、博时证保份额的份额净值为 $NAV_{\text{证保}}^{\text{前}}$ 、折算前博时证保份额的份额数为 $NUM_{\text{证保}}^{\text{前}}$ 、折算前博时证保 A 份额的份额数为 $NUM_A^{\text{前}}$ 、折算前博时证保 B 份额的份额数为 $NUM_B^{\text{前}}$ 。

当不定期折算基准日折算前博时证保 B 的份额参考净值小于等于 0.2500 元时，博时证保份额、博时证保 A 份额、博时证保 B 份额、三类份额将按照如下公式进行份额折算。

(1) 博时证保份额：

份额折算原则：

份额折算前博时证保份额的资产净值与份额折算后博时证保份额的资产净值相等。

$$NUM_{\text{证保}}^{\text{后}} = \frac{NAV_{\text{证保}}^{\text{前}} \times NUM_{\text{证保}}^{\text{前}}}{1.0000}$$

其中 $NUM_{\text{证保}}^{\text{后}}$ 为折算后原博时证保份额持有人持有的博时证保份额的份额数。

(2) 博时证保 B 份额

份额折算原则：

份额折算前博时证保 B 份额的资产净值与份额折算后博时证保 B 份额的资产净值相等。

$$NUM_B^{\text{后}} = \frac{NAV_B^{\text{前}} \times NUM_B^{\text{前}}}{1.0000}$$

其中 $NUM_B^{\text{后}}$ 为折算后原博时证保 B 份额持有人持有的博时证保 B 份额的份额数。

(3) 博时证保 A 份额

份额折算原则：

- 1) 份额折算前后博时证保 A 份额与博时证保 B 份额的份额数始终保持 1:1 配比；
- 2) 份额折算前博时证保 A 份额的资产净值与份额折算后博时证保 A 份额的资产净值及新增场内博时证保份额的资产净值之和相等；
- 3) 份额折算前博时证保 A 份额的持有人在份额折算后将持有博时证保 A 份额与新增场内博时证保份额。

$$NUM_A^{\text{后}} = NUM_B^{\text{后}}$$

$$NUM_{\text{证保}}^{\text{A类新增}} = \frac{NAV_A^{\text{前}} \times NUM_A^{\text{前}} - NUM_A^{\text{后}} \times 1.0000}{1.0000}$$

其中 $NUM_A^{\text{后}}$ 为折算后原博时证保 A 份额持有人持有的博时证保 A 份额的份额数

$NUM_{\text{证保}}^{\text{A类新增}}$ 为博时证保 A 份额持有人在份额折算后所持有的新增的场内博时证保份额的份额数。

不定期折算完成时，场外博时证保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；场内博时证保份额、博时证保A份额、博时证保B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余额计入基金财产。

四、不定期份额折算示例

假设在本基金的不定期份额折算日，博时证保份额的基金份额净值、博时证保A份额与博时证保B份额的基金份额参考净值如下表所示，折算后，博时证保份额的基金份额净值、博时证保A份额和博时证保B份额的基金份额参考净值均调整1.0000元，则各持有博时证保份额、博时证保A份额、博时证保B份额10,000份的基金份额持有人所持基金份额的变化如下。

	折算前		折算后		
	份额（参考）净值	份额数	份额（参考）净值	份额数	新增场内份额
博时证保份额	0.6170 元	10,000 份	1.0000 元	6,170	
博时证保 A 份 额	1.0280 元	10,000 份	1.0000 元	2,060	8,220
博时证保 B 份 额	0.2060 元	10,000 份	1.0000 元	2,060	

五、基金份额折算期间的基金业务办理

（一）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、转托管（包括场外转托管、跨系统转托管，下同）、配对转换业务；证保A级、证保B级将于2015年8月26日上午9:30-10:30停牌一小时，当日晚间，基金管理人计算当日基金份额（参考）净值及份额折算比例。

为了参与二级市场交易的投资者注意证保B级已经触发不定期份额折算，基金管理人将向深圳证券交易所申请临时（2015年8月26日）将证保B级场内简称变更为“*证保B级”，敬请投资者留意参与交易可能带来的风险。

(二) 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), 本基金暂停办理申购(含定期定额投资)、赎回、转托管、配对转换业务, 证保 A 级、证保 B 级将于 2015 年 8 月 27 日全天停牌。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) 不定期份额折算基准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, 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(含定期定额投资)、赎回、转托管、配对转换业务, 证保 A 级、证保 B 级将于 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。

(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 8 月 28 日证保 A 级、证保 B 级即时行情显示的前收盘价为 2015 年 8 月 27 日的证保 A 级、证保 B 级的基金份额参考净值, 2015 年 8 月 28 日当日博时证保 A 份额和博时证保 B 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。

六、重要提示

1、本基金证保 A 级、证保 B 级将于 2015 年 8 月 26 日上午 9:30-10:30 停牌一小时, 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、本基金博时证保 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博时证保 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博时证保 A 份额变为同时持有较低风险收益特征的博时证保 A 份额与较高风险收益特征的博时证保 B 份额, 因此原博时证保 A 份额持有人预期收益实现的不确定性将会增加; 此外, 博时证保 B 份额为跟踪中证 800 证券保险指数的基础份额, 其份额净值将随市场涨跌而变化, 因此原博时证保 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。

3、本基金博时证保 B 份额表现为高风险、高预期收益的特征, 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, 博时证保 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。

4、由于博时证保 A 份额、博时证保 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, 博时证保 A 份额、博时证保 B 份额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者注意折溢价所带来的风险。

5、根据深圳证券交易所的相关业务规则，博时证保 A 份额、博时证保 B 份额、博时证保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，持有极小数量博时证保 A 份额、博时证保 B 份额、博时证保份额的持有人，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、博时证保 B 份额折算基准日的基金份额参考净值与折算条件 0.2500 元可能有一定差异。

7、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。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。敬请投资者注意投资风险。

8、投资者若希望了解基金不定期份额折算业务详情，可访问本公司网站 (www.bosera.com) 或拨打全国免长途话费的客户服务电话（95105568）咨询相关情况。

特此公告。

博时基金管理有限公司

二〇一五年八月二十六日

