

万家基金管理有限公司

关于万家中证创业成长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《万家中证创业成长指数分级证券投资基金基金合同》（简称“基金合同”）、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，万家中证创业成长指数分级证券投资基金（简称“本基金”）将在 2016 年 1 月 4 日办理定期份额折算业务。相关事项提示如下：

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 2016 年 1 月 4 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中证创业成长指数分级证券投资基金之稳健收益类份额（场内简称“成长 A”，交易代码：150090）、万家中证创业成长指数分级证券投资基金之基础份额（以下简称“万家中创”，其中场内简称“成长分级”，交易代码：161910）。

三、基金份额折算方式

成长 A 份额和万家中创份额按照《基金合同》“三、基金份额的分类与净值计算规则”进行净值计算，对成长 A 份额的应得收益进行定期份额折算，每 2 份万家中创份额将按 1 份成长 A 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，成长 A 份额和成长 B 份额的份额配比保持 1：1 的比例。

对于成长 A 份额期末的约定应得收益，即成长 A 份额每个会计年度 12 月 31 日份额净值超出 1.000 元部分，将折算为场内万家中创份额分配给成长 A 份额持有人。万家中创份额持有人持有的每 2 份万家中创份额将按 1 份成长 A 份额获得新增万家中创份额的分配。持有场外万家中创份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外万家中创份额的分配；持有场内万家中创份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内万家中创份额的分配。经过上述份额折算，成长 A 份额和万家中创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基准日，本基金将对成长 A 份额和万家中创份额进行应得收益的定期份额折算。

有关计算公式如下：

（一）成长 A 份额

定期份额折算后成长 A 份额的份额数= 定期份额折算前成长 A 份额的份额数

$$NAV_{\text{创业成长}}^{\text{后}} = \frac{\text{折算前万家中创份额资产净值} - \text{NUM}_{\text{创业成长}}^{\text{前}} \times (\text{每份成长 A 份额期末资产净值} - 1.000) / 2}{\text{NUM}_{\text{创业成长}}^{\text{前}}}$$

成长 A 份额持有人新增的场内万家中创份额的份额数=

$$\frac{\text{NUM}_A^{\text{前}} \times (\text{每份成长 A 份额期末资产净值} - 1.000)}{NAV_{\text{创业成长}}^{\text{后}}}$$

其中：

$NAV_{\text{创业成长}}^{\text{后}}$ ：定期份额折算后万家中创份额净值

$NUM_{\text{创业成长}}^{\text{前}}$ ：定期份额折算前万家中创份额的份额数

$NUM_A^{\text{前}}$ ：定期份额折算前成长 A 份额的份额数

成长 A 份额新增份额折算成万家中创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。

（二）成长 B 份额

每个会计年度的定期份额折算不改变成长 B 份额净值及其份额数。

（三）万家中创份额

万家中创份额持有人新增的万家中创份额的份额数=

$$\frac{NUM_{\text{创业成长}}^{\text{前}}}{2} \times \frac{(\text{每份成长 A 份额期末资产净值} - 1.000)}{NAV_{\text{创业成长}}^{\text{后}}}$$

万家中创份额的场外份额经折算后的份额数采用截位方法保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产；万家中创份额的场内份额经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。

（四）折算后万家中创份额的总份额数

定期份额折算后万家中创份额的总份额数= 定期份额折算前万家中创份额的份额数+ 万家中创份额持有人新增的万家中创份额的份额数+成长 A 份额持有人新增的万家中创份额的份额数

在实施基金份额折算时，份额折算日折算前万家中创份额的基金份额净值、成长 A 份额参考净值等具体见基金管理人届时发布的相关公告。

（五）举例

2016 年 1 月 4 日为本基金的定期份额折算日，假设万家中创份额当日折算前资产净值为 4,658,000,000 元。当日场外万家中创份额、场内万家中创份额分别为 30 亿份、5 亿份。前一个会计年度末每份成长 A 份额资产净值为 1.065000000 元，且未进行不定期份额折算。投资者甲持有万家中创份额场内份额 100,000 份，投资者乙持有成长 A 份额 20,000 份，投资者丙持有成长 B 份额 8,000 份，则执行定期份额折算后：

万家中创份额的基金份额净值

$$=[4,658,000,000 - 3,500,000,000 \times (1.065000000 - 1.000) / 2] / 3,500,000,000 = 1.298 \text{ 元}$$

投资者甲新增场内万家中创份额数

$$=[100,000 / 2 \times (1.065000000 - 1.000)] / 1.298 = 2,503 \text{ 份}$$

投资者乙新增场内万家中创份额数=[20,000 × (1.065000000 - 1.000)] / 1.298 = 1,001 份

即：份额折算后，投资者甲共持有万家中创份额的场内份额 102,503 份，投资者乙共持有成长 A 份额 20,000 份及万家中创份额的场内份额 1,001 份，投资者丙仍持有成长 B 份额 8,000 份。

四、基金份额折算期间的基金业务办理

(一)定期份额折算基准日(即2016年1月4日),本基金暂停办理申购、赎回、转换、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;成长A、成长B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2016年1月5日),本基金暂停办理申购、赎回、转换、转托管、配对转换业务,成长A暂停交易,成长B正常交易。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)定期份额折算基准日后的第二个工作日(即2016年1月6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、赎回、转换、转托管、配对转换业务,成长A将于2016年1月6日上午10:30恢复交易,成长B正常交易。

(四)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》,2016年1月6日成长A复牌首日即时行情显示的前收盘价为2016年1月5日的成长A的份额净值(四舍五入至0.001元)。由于成长A折算前可能存在折溢价交易情形,折算前的收盘价扣除2015年约定收益后与2016年1月6日的前收盘价可能有较大差异,1月6日当日可能出现交易价格大幅波动的情形。

五、重要提示

由于成长A份额新增份额折算成万家中创份额的场内份额数和万家中创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,持有较少成长A份额数或场内万家中创份额数的份额持有人存在无法获得新增场内万家中创份额的可能性。

投资者若希望了解基金份额折算业务详情,请登陆本公司网站:

www.wjasset.com 或者拨打本公司客服电话:400-888-0800(免长途话费)。

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。

万家基金管理有限公司

2015年12月29日