

关于广发中证医疗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《广发中证医疗指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）关于基金不定期份额折算的相关约定，当广发中证医疗指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）之 B 类份额的基金份额参考净值达到或跌破 0.2500 元时，广发医疗指数分级份额（场内简称：医疗分级；场内代码 502056）、广发医疗指数分级 A 类份额（场内简称：医疗 A；场内代码 502057）、广发医疗指数分级 B 类份额（场内简称：医疗 B；场内代码 502058）将进行不定期份额折算。

截至 2016 年 1 月 28 日，广发医疗指数分级 B 类份额的基金份额的参考净值为 0.2348 元，达到上述办理不定期折算业务的条件。根据基金合同的约定，以及上海证券交易所、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 2016 年 1 月 29 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 2016 年 1 月 29 日。

二、基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的广发医疗 A 份额、广发医疗 B 份额、广发医疗份额。

三、基金份额折算方式

1、当广发医疗 B 份额的基金份额参考净值达到或跌破 0.2500 元后，本基金将分别对广发医疗 A 份额、广发医疗 B 份额和广发医疗份额进行份额折算。

2、份额折算后本基金将确保广发医疗 A 份额和广发医疗 B 份额的比例为 1：1，份额折算后广发医疗份额的基金份额净值、广发医疗 A 份额和广发医疗 B 份额的基金份额参考净值均调整为 1 元。

3、广发医疗 A 份额、广发医疗 B 份额、广发医疗份额三类份额将按照如下公式进行份额折算。

（1）广发医疗 A 份额

①份额折算前后广发医疗 A 份额与广发医疗 B 份额的份额数始终保持 1：1 配比；

②份额折算前广发医疗 A 份额的资产净值与份额折算后广发医疗 A 份额的资产净值及广发医疗 A 份额新增场内广发医疗份额的资产净值之和相等；

③份额折算前广发医疗 A 份额的持有人在份额折算后将持有广发医疗 A 份额与新增场内广发医疗份额。

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

$$NUM_{\text{基础}}^{\text{场内}} = \frac{NUM_A^{\text{前}} \times NAV_A^{\text{前}} - NUM_A^{\text{后}} \times 1.0000}{1.0000}$$

其中：

$NUM_A^{\text{后}}$ ：份额折算后广发医疗 A 份额的份额数

$NUM_B^{\text{后}}$ ：份额折算后广发医疗 B 份额的份额数

$NUM_{\text{基础}}^{\text{场内}}$ ：份额折算前广发医疗 A 份额持有人在份额折算后所持有的新增的场内广发医疗份额的份数

$NUM_A^{\text{前}}$ ：份额折算前广发医疗 A 份额的份额数

$NAV_A^{\text{前}}$ ：份额折算前广发医疗 A 份额参考净值，即折算基准日广发医疗 A 份额的基金份额参考净值

(2) 广发医疗 B 份额

份额折算前广发医疗 B 份额的资产净值与份额折算后广发医疗 B 份额的资产净值相等。

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

其中：

$NUM_B^{\text{后}}$ ：份额折算后广发医疗 B 份额的份额数

$NUM_B^{\text{前}}$ ：份额折算前广发医疗 B 份额的份额数

$NAV_B^{\text{前}}$ ：份额折算前广发医疗 B 份额参考净值，即折算基准日广发医疗 B 份额的基金份额参考净值

(3) 广发医疗份额

份额折算前广发医疗份额的资产净值与份额折算后广发医疗份额的资产净值相等。

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

其中：

$NUM_{\text{基础}}^{\text{后}}$ ：份额折算后广发医疗份额的份额数

$NUM_{\text{基础}}^{\text{前}}$ ：份额折算前广发医疗份额的份额数

$NAV_{\text{基础}}^{\text{前}}$ ：份额折算前广发医疗份额净值，即折算基准日广发医疗份额的基金份额净值

四、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 2016 年 1 月 29 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; 广发医疗 B 份额将于 2016 年 1 月 29 日上午 9: 30-10: 30 停牌一小时, 并于 2016 年 1 月 29 日上午 10: 30 复牌。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 2 月 1 日), 本基金暂停办理申购、赎回、转托管、配对转换业务, 广发医疗份额、广发医疗 A 份额和广发医疗 B 份额暂停交易。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 2 月 2 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、转托管、配对转换业务, 广发医疗份额、广发医疗 A 份额和广发医疗 B 份额于该日开市起复牌。

(四) 根据上海证券交易所的相关规定, 2016 年 2 月 2 日广发医疗份额、广发医疗 A 份额和广发医疗 B 份额复牌首日即时行情显示的前收盘价为 2016 年 2 月 1 日的广发医疗份额、广发医疗 A 份额、广发医疗 B 份额的份额参考净值(四舍五入至 0.001 元)。

(五) 2016 年 2 月 2 日, 广发医疗份额、广发医疗 A 份额和广发医疗 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。

五、重要提示

(一) 由于广发医疗 A 份额新增份额折算成广发医疗份额的场内份额数和广发医疗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, 持有较少广发医疗 A 份额数或场内广发医疗份额数的份额持有人存在无法获得新增场内广发医疗份额的可能性。因此, 上述份额持有人可在基金份额折算基准日之前将原有份额卖出或者增加持有份额的数量来保证自身权益不受损害。

(二) 由于广发医疗 A 份额、广发医疗 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, 广发医疗 A 份额、广发医疗 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。

(三) 广发医疗 B 份额具有高风险、高收益的特征, 不定期份额折算后其杠杆将恢复至初始杠杆水平。

(四) 由于触发折算阈值当日, 广发医疗 B 份额的参考净值可能已低于阈值, 而折算基准日在触发阈值日后才能确定, 因此折算基准日广发医疗 B 类份额的参考净值可能与折算阈值 0.2500 元有一定差异。

(五) 广发医疗 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广发医疗 A 类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广发医疗 A 份额变为同时持有较低风险收益特征广发医疗 A 份额与较高风险收益特征广发医疗份额的情况, 因此广发医疗 A 份额持有人预期收益实现的不确定性将会增加。

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。本基金管理人提醒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，知晓基金投资的“买者自负”原则，充分认识投资风险。投资者若希望了解基金不定期份额折算业务详情，请登陆本公司网站：www.gffunds.com.cn 或者拨打本公司客服电话：95105828(免长途话费)。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

广发基金管理有限公司

2016年1月29日