

# 关于国金沪深300指数分级证券投资基金 基金转型份额转换与变更登记的公告

根据国金沪深300指数分级证券投资基金（以下简称“国金沪深300”或“本基金”）基金份额持有人大会决议，国金基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）决定对国金沪深300进行基金份额转换与变更登记，转型为国金沪深300指数增强证券投资基金（以下简称“国金沪深300指数增强”）。基金份额转换由基金管理人办理，并由注册登记机构进行基金份额的变更登记。

1、转换基准日：2017年8月31日。

2、转换对象：转换基准日登记在册的国金沪深300、国金沪深300A、国金沪深300B基金份额。

3、基金份额的转换

(1) 转换前基金份额净值的计算

1) 转换前国金沪深 300 份额的基金份额净值计算

转换前国金沪深 300 份额的基金份额净值= 转换基准日的基金资产净值 / 转换基准日本基金基金份额的总数。

其中，基金资产净值为基金资产总值减去负债后的价值，转换前本基金基金份额数量为转换前国金沪深 300 份额、国金沪深 300A 份额与国金沪深 300B 份额的份额总额。

2) 转换前国金沪深 300A 和国金沪深 300B 份额的基金份额净值计算

设转换基准日为基金份额净值计算日， $N$  为当年的实际天数； $t = \min\{\text{自年初至转换基准日的天数, 自会计年度内最近一次不定期份额转换日至转换基准日的天数}\}$ ； $NAV_{300}$  为  $T$  日每份国金沪深 300 份额的基金份额净值； $NAV_{300A}$  为  $T$  日国金沪深 300A 份额的基金份额净值； $NAV_{300B}$  为  $T$  日国金沪深 300B 份额的基金份额净值； $R$  为国金沪深 300A 份额的约定年基准收益率，则：

$$NAV_{300A} = 1 + R \times t / N$$

$$NAV_{300B} = 2 \times NAV_{300} - NAV_{300A}$$

国金沪深 300 份额的基金份额净值以及国金沪深 300A 份额和国金沪深 300B 份额的基金份额净值的计算,均保留到小数点后 4 位,小数点后第 5 位四舍五入,由此产生的误差计入基金财产。

## (2) 基金份额转换公式

1) 将国金沪深300A份额与国金沪深300B份额转换成国金沪深300份额的场内份额

在份额转换基准日日终,以国金沪深300份额的基金份额净值为基准,国金沪深300A份额、国金沪深300B份额按照各自的基金份额参考净值转换成国金沪深300份额的场内份额。国金沪深300A 份额(或国金沪深300B份额)基金份额持有人持有的转换后国金沪深300份额的场内份额取整计算(最小单位为1份),取整后的余额计入基金财产。由于基金份额数取整计算产生的误差,基金份额持有人存在着基金资产净值减小的风险。对于持有份额数较少的国金沪深300A份额、国金沪深300B份额,存在着持有的基金份额转换后份额数不足一份而被计入基金资产的风险。

份额转换计算公式如下:

国金沪深300A(或国金沪深300B)的转换比例=份额转换基准日国金沪深300A(或国金沪深300B)的基金份额净值/份额转换基准日国金沪深300份额的基金份额净值

国金沪深 300A(或国金沪深 300B)基金份额持有人持有的转换后国金沪深 300 份额的场内份额=基金份额持有人持有的转换前国金沪深 300A(或国金沪深 300B)的份额数×国金沪深 300A(或国金沪深 300B)的转换比例

2) 将国金沪深300份额转换成国金沪深300指数增强份额

在国金沪深 300A 份额与国金沪深 300B 份额转换为国金沪深 300 份额的场内份额后,在保持基金资产净值总额不变的前提下,将国金沪深 300 份额的场内份额和场外份额统一转换为份额净值为 1.0000 元的国金沪深 300 指数增强份额。基金份额转换后,场外的国金沪深 300 指数增强的份额数,保留到小数点后 2 位,小数点后第 3 位截位,由此产生的计算误差归入基金资产,场内的国金沪深 300 指数增强的份额数采用取整计算(最小单位为 1 份),取整后的余额计入基金资产。由于基金份额数取整计算产生的误差,基金份额持有人存在着基金资产

净值减小的风险。对于持有份额数较少的国金沪深 300 份额的场内份额，存在着持有的基金份额转换后份额数不足一份而被计入基金资产的风险。

份额转换的计算公式如下：

转换后国金沪深300指数增强的份额数=国金沪深300份额数×份额转换基准日国金沪深300份额的基金份额净值/1.0000

转换后国金沪深 300 指数增强的份额净值为 1.0000 元。

### （3）基金份额转换结果的公告

本基金此次份额转换结果及注册登记机构变更登记完成后，基金管理人将在指定媒体对份额转换结果予以公告。

如果基金份额转换过程中发生不可抗力，基金管理人可延迟办理基金份额转换与变更登记。

风险提示：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财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其将来表现。投资有风险，敬请投资人认真阅读基金的相关法律文件，并选择适合自身风险承受能力的投资品种进行投资。

特此公告。

国金基金管理有限公司

2017年8月28日