

南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金定期份额折算公告

根据《南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金基金合同》（简称“基金合同”）中关于定期份额折算的相关规定，南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）将以 2019 年 12 月 2 日为基准日办理基金份额定期折算业务。相关事项公告如下：

一、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年 12 月 1 日（若该日为非工作日，则顺延至下一个工作日）。本次定期折算基准日为 2019 年 12 月 2 日。

二、折算对象

基金份额折算基准日登记在册的南方国企改革份额（场内简称“改革基金”，基金代码：160136，包含场内份额和场外份额）、国企改革 A 份额（场内简称“改革 A”，基金代码 150295）。

三、折算频率

每年折算一次。

四、折算方式

定期份额折算后国企改革 A 份额的基金份额参考净值调整为 1.0000 元，基金份额折算基准日折算前国企改革 A 份额的基金份额参考净值超出 1.0000 元的部分将折算为场内南方国企改革份额分配给国企改革 A 份额持有人。南方国企改革份额持有人持有的每两份南方国企改革份额将按一份国企改革 A 份额获得新增南方国企改革份额的分配，经过上述份额折算后，南方国企改革份额的基金份额净值将相应调整。在基金份额折算前与折算后，国企改革 A 份额和国企改革 B 份额的份额配比保持 1: 1 的比例。

有关计算公式如下：

（1）南方国企改革份额

$$NAV_P^{\text{后}} = \frac{\text{折算前南方国企改革份额的资产净值} - 0.5 \times (NAV_A^{\text{前}} - 1.0000) \times NUM_P^{\text{前}}}{NUM_P^{\text{前}}}$$

$$\text{南方国企改革份额持有人新增的南方国企改革份额} = \frac{NUM_P^{\text{前}}}{2} \times \frac{NAV_A^{\text{前}} - 1.0000}{NAV_P^{\text{后}}}$$

其中：

$NAV_P^{\text{后}}$ ：折算后南方国企改革份额的基金份额净值，下同；

$NAV_A^{\text{前}}$ ：折算前国企改革 A 份额的基金份额参考净值，即折算基准日国企改革 A 份额的基金份额参考净值，下同；

$NUM_P^{\text{前}}$ ：折算前南方国企改革份额的份额数，下同。

持有场外南方国企改革份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外南方国企改革份额的分配；持有场内南方国企改革份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内南方国企改革份额的分配。

（2）国企改革 A 份额

定期份额折算后国企改革 A 份额的基金份额参考净值=1.0000 元

定期份额折算后国企改革 A 份额的份额数=定期份额折算前国企改革 A 份额的份额数，即

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

国企改革 A 份额持有人新增的场内南方国企改革份额的份额数=

$$\frac{NUM_A^{\text{前}} \times (NAV_A^{\text{前}} - 1.0000)}{NAV_P^{\text{后}}}$$

其中：

$NUM_A^{\text{前}}$ ：折算前国企改革 A 份额的基金份额数，下同；

$NUM_A^{\text{后}}$ ：折算后国企改革 A 份额的基金份额数，下同；

（3）国企改革 B 份额

国企改革 B 份额不参与定期份额折算，每次定期份额折算不改变国企改革 B 份额的基金份额参考净值及其份额数。

（4）折算后的南方国企改革份额总数

折算后的南方国企改革份额的总份额数=折算前南方国企改革份额的份额数+南方国企改革份额持有人新增的南方国企改革份额的份额数+国企改革 A 份额持有人新增的场内南方国企改革份额的份额数

5、按照上述折算和计算方法，可能会给基金份额持有人的资产净值造成微小误差，视为未改变基金份额持有人的资产净值。

五、基金份额折算期间的基金业务办理

1、定期份额折算基准日（即 2019 年 12 月 2 日），本基金暂停办理申购、赎回、定投、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。国企改革 A 份额和国企改革 B 份额正常交易。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并进

行份额折算。

2、定期份额折算基准日后的第一个工作日（即 2019 年 12 月 3 日），本基金暂停办理申购、赎回、定投、转托管、配对转换业务。国企改革 A 份额暂停交易，国企改革 B 份额正常交易。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。

3、定期份额折算基准日后的第二个工作日（即 2019 年 12 月 4 日），基金管理人将公告份额折算结果，持有人可以查询其账户内的基金份额。由于各销售机构系统及业务安排等原因，折算后份额可查询时间可能有所不同，具体以各销售机构为准。当日，本基金恢复办理申购、赎回、定投、转托管、配对转换业务。国企改革 A 份额于 2019 年 12 月 4 日复牌，国企改革 B 份额正常交易。

六、重要提示

1、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》，2019 年 12 月 4 日改革 A 即时行情显示的前收盘价为 2019 年 12 月 3 日的改革 A 的基金份额参考净值，2019 年 12 月 4 日当日改革 A 可能出现交易价格大幅波动的情形。敬请投资人注意投资风险。

2、本基金国企改革 A 份额的约定应得收益将折算成南方国企改革分级场内份额分配给国企改革 A 份额的持有人，而南方国企改革分级份额为跟踪中证国企改革指数的基础份额，其份额净值将随市场涨跌而变化，因此国企改革 A 份额持有人预期收益的实现存在一定的不确定性，可能会承担因市场下跌而遭受损失的风险。

3、根据深圳证券交易所的相关业务规则，国企改革 A 份额、南方国企改革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，持有极小数量国企改革 A 份额、南方国企改革份额的持有人，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。

4、由于改革 A 份额折算前可能存在折溢价交易情形，定期份额折算后，改革 A 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人注意折溢价所带来的风险。

5、在二级市场可以做交易的证券公司并不全部具备中国证监会颁发的基金销售资格，而投资者只能通过具备基金销售资格的证券公司赎回基金份额。因此，如果投资者通过不具备基金销售资格的证券公司购买国企改革 A 份额，在定期份额折算后，则折算新增的南方国企改革份额无法赎回。投资者可以选择在折算前将国企改革 A 份额卖出，或者在折算后将新增的南方国企改革份额转托管到具有基金销售资格的证券公司后赎回。

6、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。投资人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。敬请投资人注意投资风险。

7、投资人若希望了解基金定期份额折算业务详情，可访问本公司网站(www.nffund.com)或拨打全国免长途费的客户服务电话（400—889—8899）咨询相关情况。

特此公告

南方基金管理股份有限公司

2019年11月27日