

# 关于南方新兴消费增长分级股票型证券投资基金 办理到期份额折算业务的公告

根据《南方新兴消费增长分级股票型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”），及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，南方新兴消费增长分级股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）将于 2015 年 3 月 13 日办理基金份额折算业务。相关事项公告如下：

## 一、份额折算周期到期日

本基金的基金合同生效日为 2012 年 3 月 13 日，上一折算周期到期日为 2014 年 3 月 13 日。根据基金合同约定，本次份额折算周期到期日为 2015 年 3 月 13 日。

## 二、份额折算对象

折算周期到期日（即 2015 年 3 月 13 日）登记在册的南方消费基础份额（以下简称“南方消费”，基金代码“160127”，包含场内和场外份额）、南方消费收益份额（以下简称“消费收益”，基金代码“150049”）、南方消费进取份额（以下简称“消费进取”，基金代码“150050”）。

## 三、份额折算方式

### 1、南方消费的折算

折算周期到期日收市后，将基金份额持有人持有的南方消费的份额净值调整为 1.000 元，同时相应调整基金份额持有人持有的份额数量。

折算前南方消费的份额净值为  $NAV_p$

折算后南方消费的份额净值=1.000

南方消费的份额折算比例= $NAV_p/1.000$

折算后南方消费的份额数=折算前南方消费的份额数 $\times$ 南方消费的份额折算比例。

折算后场外的南方消费的份额数采用四舍五入的方式保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产；折算后场内的南方消费的份额数取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。

例 1：假设 2015 年 3 月 13 日折算前南方消费的份额净值为 1.084 元，投资者 A、B 分别持有 10002 份场外和场内的南方消费份额，则，

南方消费的份额折算比例= $1.084 / 1.000=1.084$

折算后，

A 持有的场外的南方消费的份额数=10002×1.084=10842.17 份

B 持有的场内的南方消费的份额数=10002×1.084=10842 份

## 2、消费收益、消费进取的折算

基金份额折算日折算后，消费收益、消费进取的份额净值折算调整为 1.000 元。根据消费进取折算日折算前的份额净值，按照以下两种情况进行基金份额的折算：

(1) 折算日折算前消费进取的份额净值大于 1 元

如果消费进取折算日折算前份额净值大于 1.000 元，则持有人持有的消费收益及消费进取的份额数在折算前后均保持不变，份额净值超出部分将全部折算成场内的南方消费。

消费收益（或消费进取）的份额折算比例=折算日折算前消费收益（或消费进取）的份额净值 / 1.000

消费收益（或消费进取）净值超出部分折算成场内的南方消费的份额数=折算前消费收益（或消费进取）的份额数×[消费收益（或消费进取）的份额折算比例-1]

折算后消费收益（或消费进取）的份额数=消费收益（或消费进取）折算前的份额数  
消费收益（或消费进取）折算成场内的南方消费的份额数取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。

例 2：假设 2015 年 3 月 13 日，折算前南方消费、消费进取、消费收益的份额净值分别为 1.084 元、1.106 元、1.062 元，投资者 A、B 分别持有 10002 份消费进取、消费收益，则，

消费进取的份额折算比例=1.106 / 1.000=1.106

消费收益的份额折算比例=1.062 / 1.000=1.062

折算后，

A 持有的消费进取的份额数=折算前持有的消费进取的份额数=10002 份

A 持有的消费进取净值超出部分折算成场内的南方消费的份额数=10002×(1.106-1)  
=1060 份

B 持有的消费收益的份额数=折算前持有的消费收益的份额数=10002 份

B 持有的消费收益净值超出部分折算成场内的南方消费的份额数=10002×(1.062-1)  
=620 份

2015 年 3 月 13 日日终折算后，本基金所有份额净值均调整为 1.000 元

投资者 A 持有消费进取的份额数不变，仍为 10002 份，新增持有场内的南方消费的份额数取整计算，为 1060 份；

投资者 B 持有的消费收益的份额数不变，仍为 10002 份，新增持有场内的南方消费的份额数取整计算，为 620 份。

场内的南方消费、消费进取、消费收益的份额数均取整数计算，余额计入基金财产。

折算前后，按基金份额净值计算，投资者持有的基金份额价值，除保留位数因素影响外，无实质变化。

投资者可在份额折算日后第二个工作日查询经基金登记机构及基金管理人确认的折算后份额。

(2) 折算日折算前消费进取的份额净值小于或等于 1 元

如果消费进取折算日折算前的份额净值小于或等于 1.000 元，则消费进取持有人持有的消费进取的份额数按照消费进取的份额折算比例相应缩减。为保持消费收益和消费进取的份额数比率 1: 1 不变，消费收益的份额折算比例与消费进取的份额折算比例相同，消费收益持有人持有的消费收益的份额数同比例相应缩减，消费收益份额净值超出消费进取份额净值部分将全部折算成场内的南方消费。

消费进取的份额折算比例 = 折算日折算前消费进取的份额净值 / 1.000

消费进取经折算后的份额数 = 折算前消费进取的份额数 × 消费进取的份额折算比例

消费收益的份额折算比例 = 消费进取的份额折算比例

消费收益经折算后的份额数 = 折算前消费收益的份额数 × 消费收益的份额折算比例

消费收益净值超出消费进取净值部分折算成场内的南方消费的份额数 = 折算前消费收益的份额数 × (折算日折算前消费收益的份额净值 - 折算日折算前消费进取的份额净值)

消费收益和消费进取经折算后的的份额数取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。消费收益折算成场内的南方消费的份额数取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。

例 3：假设 2015 年 3 月 13 日，折算前消费进取、消费收益的份额净值分别为 0.949 元、1.062 元，投资者 A、B 分别持有 10002 份消费进取、消费收益，则，

消费进取的份额折算比例 =  $0.949 / 1.000 = 0.949$

消费收益的份额折算比例 = 消费进取的份额折算比例 = 0.949

折算后，

A 持有的消费进取的份额数 =  $10002 \times 0.949 = 9491$  份

B 持有的消费收益的份额数 =  $10002 \times 0.949 = 9491$  份

B 持有的消费收益净值超出消费进取净值部分折算成场内的南方消费的份额数 =  $10002 \times (1.062 - 0.949) = 1130$  份

2015 年 3 月 13 日日终折算后，本基金所有份额净值均调整为 1.000 元。

投资者 A 持有的消费进取的份额数取整计算，为 9491 份。

投资者 B 持有的消费收益的份额数取整计算，为 9491 份；新增持有场内的南方消费的份额数取整计算，为 1130 份。

场内的南方消费、消费进取、消费收益的份额数均取整数计算，余额计入基金财产。折算前后，按基金份额净值计算，投资者持有的基金份额价值，除保留位数因素影响外，

无实质变化。

投资者可在份额折算日后第二个工作日查询经基金登记机构及基金管理人确认的折算后份额。

### 3、折算后南方消费份额的总数量

折算后南方消费份额的总数量=南方消费经折算后的份额数+消费收益折算成南方消费的份额数+消费进取折算成南方消费的份额数

按照上述折算方法，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。

## 四、份额折算期间的业务办理

1、份额折算基准日（即3月13日），本基金暂停办理申购（含定投，下同）、赎回、配对转换及转托管业务（包括场外转托管、跨系统转托管，下同），但消费收益、消费进取份额的交易正常进行。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。

2、份额折算基准日后的第一个工作日（即3月16日），本基金继续暂停办理申购、赎回、配对转换及转托管业务，消费收益、消费进取份额暂停交易。当日，基金登记机构及基金管理人为持有人办理份额登记确认。

3、份额折算基准日后的第二个工作日（即3月17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。当日，本基金恢复办理申购、赎回、配对转换及转托管业务，消费收益、消费进取份额于当日上午10:30恢复交易。

4、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》，本基金折算完成后次一交易日即时行情显示的前收盘价调整为前一交易日的基金份额净值，即3月17日消费收益即时行情显示的前收盘价为消费收益3月16日的份额净值，3月17日消费进取即时行情显示的前收盘价为消费进取3月16日的份额净值。由于消费收益、消费进取折算前可能存在折溢价交易情形，故3月17日可能出现交易价格大幅波动的情形。

## 五、重要提示

投资者可访问本公司网站([www.nffund.com](http://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。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，不保证投资本基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的最低收益。敬请投资人注意投资风险。

特此公告

南方基金管理有限公司

2015年3月10日