

## 关于银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金 办理不定期份额折算业务的公告

根据《银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）第二十章中关于不定期份额折算的相关规定，当银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金（以下简称“本基金”）之“中证 800B 份额”（代码：150139）的基金份额参考净值达到 0.250 元及以下，本基金银华 800 份额（基础份额，场内简称：800 分级，代码：161825）、中证 800A 份额（代码：150138）及中证 800B 份额将进行不定期份额折算。

截至 2015 年 8 月 25 日，本基金中证 800B 份额的基金份额参考净值为 0.233 元，达到基金合同规定的不定期份额折算阈值 0.250 元以下。根据本基金基金合同以及深圳证券交易所、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 2015 年 8 月 26 日为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 2015 年 8 月 26 日。

### 二、基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的中证 800A 份额、中证 800B 份额、银华 800 份额。

### 三、基金份额折算方式

中证 800A 份额、中证 800B 份额和银华 800 份额按照《基金合同》“二十、基金份额折算”规则进行不定期份额折算。

当中证 800B 份额的基金份额净值达到 0.250 元后，本基金将分别对中证 800A 份额、中证 800B 份额和银华 800 份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保中证 800A 份额和中证 800B 份额的比例为 1:1，份额折算后银华 800 份额、中证 800A 份额和中证 800B 份额的基金份额净值均调整为 1 元。

当中证 800B 份额净值达到 0.250 元后，中证 800A 份额、中证 800B 份额、银华 800 份额三类份额将按照如下公式进行份额折算。

#### （1）中证 800B 份额

份额折算原则：

份额折算前中证 800B 份额的资产净值与份额折算后中证 800B 份额的资产净值相等。

$$NUM_{\text{中证800B份额}}^{\text{后前}} = NUM_{\text{中证800B份额}} \times \frac{NAV_{\text{中证800B份额}}^{\text{前}}}{1.000}$$

【中证 800B 份额持有人持有的中证 800B 份额的折算比例 =  $\frac{NAV_{\text{中证800B份额}}^{\text{前}}}{1.000}$ 】

其中：

$NUM_{\text{中证800B份额}}^{\text{后}}$ ：份额折算后中证 800B 份额的份额数

$NUM_{\text{中证800B份额}}^{\text{前}}$ ：份额折算前中证 800B 份额的份额数

$NAV_{\text{中证800B份额}}^{\text{前}}$ ：份额折算前中证 800B 份额净值

## (2) 中证 800A 份额

份额折算原则：

① 份额折算前后中证 800A 份额与中证 800B 份额的份额数始终保持 1:1 配比；

② 份额折算前中证 800A 份额的资产净值与份额折算后中证 800A 份额的资产净值及新增场内银华 800 份额的资产净值之和相等；

③ 份额折算前中证 800A 份额的持有人在份额折算后将持有银华 800A 份额与新增场内银华 800 份额。

$$NUM_{\text{中证800A份额}}^{\text{后后}} : NUM_{\text{中证800B份额}} = 1 : 1$$

$$NUM_{\text{银华800份额}}^{\text{场内新增份额}} = \frac{NUM_{\text{中证800A份额}}^{\text{前前后}} \times NAV_{\text{中证800A份额}} - NUM_{\text{中证800A份额}} \times 1.000}{1.000}$$

【中证 800A 份额持有人持有的中证 800A 份额的折算比例 =  $\frac{NAV_{\text{中证800B份额}}^{\text{前}}}{1.000}$ 】

【中证 800A 份额持有人新增的场内银华 800 份额的折算比例 =

$$\left( \frac{NAV_{\text{中证800A份额}}^{\text{前前}} - NAV_{\text{中证800B份额}}}{1.000} \right) \text{】}$$

其中：

$NUM_{\text{中证800A份额}}^{\text{后}}$ ：份额折算后中证 800A 份额的份额数

$NUM_{\text{中证800B份额}}^{\text{后}}$ ：份额折算后中证 800B 份额的份额数

$NAV_{\text{中证800B份额}}^{\text{前}}$ ：份额折算前中证 800B 份额净值

$NUM_{\text{银华800份额}}^{\text{场内新增份额}}$ ：份额折算前中证 800A 份额持有人在份额折算后所持有的新增的场内银华 800 份额的份额数

$NUM_{\text{中证800A份额}}^{\text{前}}$ ：份额折算前中证 800A 份额的份额数

$NAV_{\text{中证800A份额}}^{\text{前}}$ ：份额折算前中证 800A 份额净值

(3) 银华 800 份额：

份额折算原则：

份额折算前银华 800 份额的资产净值与份额折算后银华 800 份额的资产净值相等。

$$NUM_{\text{银华800份额}}^{\text{后前}} = NUM_{\text{银华800份额}}^{\text{前}} \times \frac{NAV_{\text{银华800份额}}^{\text{前}}}{1.000}$$

$$\text{【银华 800 份额持有人持有的银华 800 份额的折算比例} = \frac{NAV_{\text{银华800份额}}^{\text{前}}}{1.000} \text{】}$$

其中：

$NUM_{\text{银华800份额}}^{\text{后}}$ ：份额折算后银华 800 份额的份额数

$NUM_{\text{银华800份额}}^{\text{前}}$ ：份额折算前银华 800 份额的份额数

$NAV_{\text{银华800份额}}^{\text{前}}$ ：份额折算前银华 800 份额净值

例、某三位投资人分别持有银华800份额、中证800A份额、中证800B份额各 10,000 份，在本基金的不定期份额折算日，三类份额的折算比例如下表所示，折算后，银华800份额、中证800A份额、中证800B份额三类基金份额净值均调整为1.000元。

	折算比例	折算前基金份额	折算后基金份额
银华 800 份额	0.633000000	10,000 份	6330 份银华 800 份额

中证 800A 份额	持有中证 800A 份额的折算比例 0.234000000 新增银华 800 份额的折算比例 0.798000000	10,000 份	2340 份中证 800A 份额 +7980 份银华 800 份额
中证 800B 份额	0.234000000	10,000 份	2340 份中证 800B 份额

#### 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 2015 年 8 月 26 日), 本基金暂停办理申购(含定期定额投资, 下同)、赎回、转托管、配对转换业务; 中证 800A 份额、中证 800B 份额于 2015 年 8 月 26 日上午 9:30-10:30 停牌一小时, 并将于 2015 年 8 月 26 日 10:30 之后恢复交易。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) 不定期份额折算基准日后的第一个工作日(即 2015 年 8 月 27 日), 本基金暂停办理申购、赎回、转托管、配对转换业务, 中证 800A 份额、中证 800B 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) 不定期份额折算基准日后的第二个工作日(即 2015 年 8 月 28 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, 中证 800A 份额、中证 800B 份额于 2015 年 8 月 28 日上午 9:30-10:30 停牌一小时, 并将于 2015 年 8 月 28 日 10:30 之后恢复交易。

(四) 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》, 2015 年 8 月 28 日中证 800A 份额、中证 800B 份额即时行情显示的前收盘价为 2015 年 8 月 27 日的中证 800A 份额、中证 800B 份额的份额参考净值(四舍五入至 0.001 元)。由于中证 800A 份额、中证 800B 份额在折算前存在折溢价交易情形, 2015 年 8 月 28 日当日中证 800A 份额和中证 800B 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

1、本基金中证 800A 份额、中证 800B 份额将于 2015 年 8 月 26 日上午 9:30-10:30 停牌一小时, 并于 2015 年 8 月 26 日上午 10:30 之后复牌。

2、本基金中证 800A 份额表现为低风险、收益相对稳定的特征, 但在不定

期份额折算后中证 800A 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的中证 800A 份额变为同时持有较低风险收益特征的中证 800A 份额与较高风险收益特征的银华 800 份额，因此原中证 800A 份额持有人预期收益实现的不确定性将会增加；此外，银华 800 份额为跟踪中证 800 等权重指数的基础份额，其份额净值将随市场涨跌而变化，因此原中证 800A 份额持有人还可能会承担因市场下跌而遭受损失的风险。

3、本基金中证 800B 份额表现为高风险、高收益的特征，不定期份额折算后其杠杆倍数将大幅降低，将恢复到初始的 2 倍杠杆水平，相应地，中证 800B 份额参考净值随市场涨跌而增长或者下降的幅度也会大幅减小。

4、由于中证 800A 份额、中证 800B 份额折算前可能存在折溢价交易情形，不定期份额折算后，中证 800A 份额、中证 800B 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变化所带来的风险。

5、根据深圳证券交易所的相关业务规则，中证 800A 份额、中证 800B 份额、银华 800 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，因此持有极小数量中证 800A 份额、中证 800B 份额和场内银华 800 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。

6、中证 800B 份额折算基准日的份额参考净值与折算阈值 0.250 元可能有一定差异。

7、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。投资者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。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

银华基金管理有限公司

2015年8月26日