

# 金鹰中证 500 指数分级证券投资基金可能发生 不定期份额折算的风险提示公告

根据《金鹰中证 500 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，当金鹰中证 500 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小于 0.2500 元（不含 0.2500 元）时，金鹰中证 500 份额（场内简称：金鹰 500，场内代码：162107）、金鹰中证 500A 份额（场内简称：金鹰 500A，场内代码：150088）、金鹰中证 500B 份额（场内简称：金鹰 500B，场内代码：150089）将进行不定期份额折算。

由于近期 A 股市场波动较大，截至 2015 年 9 月 7 日收盘，金鹰中证 500B 份额的基金份额参考净值接近基金合同约定的不定期份额折算阈值，提请投资者密切关注金鹰中证 500B 份额近期基金份额参考净值的波动情况。

针对不定期份额折算可能带来的风险，基金管理人特别提示如下：

- 1、由于金鹰中证 500A 份额、金鹰中证 500B 份额折算前可能存在折溢价交易情形，不定期份额折算后，金鹰中证 500A 份额、金鹰中证 500B 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高溢价所带来的风险。

- 2、金鹰中证 500B 份额表现为高风险、高收益的特征，不定期

份额折算后其杠杆将恢复至初始杠杆水平。

3、由于触发折算阈值当日，金鹰中证 500B 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，此折算基准日金鹰中证 500B 份额的净值可能与折算阈值 0.2500 元有一定差异。

4、金鹰中证 500A 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金鹰中证 500A 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金鹰中证 500A 份额变为同时持有较低风险收益特征金鹰中证 500A 份额与较高风险收益特征金鹰中证 500 份额的情况，因此金鹰中证 500A 份额持有人预期收益实现的不确定性将会增加。

本基金管理人的其他重要提示：

1、根据深圳证券交易所的相关业务规则，场内金鹰中证 500 份额、金鹰中证 500A 份额、金鹰中证 500B 份额采用截位法保留到整数位，由上述截位法计算过程产生的误差计入基金财产，持有极小数量金鹰中证 500 份额、金鹰中证 500A 份额、金鹰中证 500B 份额的持有人存在折算后份额因为不足 1 份而被强制归入基金资产的风险。

2、如本基金发生上述不定期份额折算情形，为保证折算期间本基金的平稳运作，本基金管理人可根据深圳证券交易所、登记结算机构的相关业务规则，暂停金鹰中证 500A 份额与金鹰中证 500B 份额的上市交易、配对转换，以及金鹰中证 500 份额的申购、赎回、

转托管等相关业务。届时本基金管理人将会对相关事项进行公告，敬请投资者予以关注。

投资者若希望了解基金不定期份额折算业务详情，请参阅本基金基金合同及《金鹰中证 500 指数分级证券投资基金招募说明书》或者拨打本公司客服电话 400-6135-888（免长途话费）。

3、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。

金鹰基金管理有限公司

2015 年 9 月 8 日