

关于诺德深证300指数分级证券投资基金办理不定期份额折算业务的公告

根据《诺德深证 300 指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）第二十四部分中关于不定期份额折算的相关规定，当诺德深证 300 指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）之诺德深证 300B 份额（场内简称：诺德 300B，交易代码：150093）的基金份额参考净值达到 0.250 元，诺德深证 300 份额（基础份额，场内简称：诺德 S300，交易代码：165707）、诺德深证 300A 份额（场内简称：诺德 300A，交易代码：150092）和诺德深证 300B 份额将进行不定期份额折算。截至 2015 年 9 月 15 日，诺德深证 300B 份额的基金份额参考净值为 0.215 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 9 月 16 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9月16日。

二、基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的诺德深证300A份额、诺德深证300B份额和诺德深证300份额。三、基金份额折算方式

当诺德深证 300B 份额的基金份额参考净值达到 0.250 元后，本基金将分别对诺德深证 300A 份额、诺德深证 300B 份额和诺德深证 300 份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保诺德深证 300A 份额和诺德深证 300B 份额的份额数比例为 1: 1，份额折算后诺德深证 300A 份额参考净值、诺德深证 300B 份额参考净值、诺德深证 300 份额净值均调整为 1.000 元。

当诺德深证 300B 份额的基金份额参考净值达到 0.250 元后，诺德深证 300A 份额、诺德深证 300B 份额和诺德深证 300 份额三类份额按照如下公式进行份额折算：

I) 诺德深证 300B 份额的折算：

份额折算原则：

- 份额折算前诺德深证 300B 份额的资产净值与份额折算后诺德深证 300B 份额的资产净值相等；

$$NUM_B^{\text{后}} = \frac{NAV_B^{\text{前}} \times NUM_B^{\text{前}}}{1.000}$$

其中：

$NUM_B^{\text{后}}$ ：份额折算后诺德深证 300B 份额的份额数

$NAV_B^{\text{前}}$ ：份额折算前诺德深证 300B 份额参考净值

$NUM_B^{\text{前}}$ ：份额折算前诺德深证 300B 份额的份额数

II) 诺德深证 300A 份额的折算：

份额折算原则：

- 份额折算前后诺德深证 300A 份额与诺德深证 300B 份额的份额数始终保持 1:1 配比；
- 份额折算前诺德深证 300A 份额的资产净值与份额折算后诺德深证 300A 份额的资产净值及新增场内诺德深证 300 份额的资产净值之和相等
- 份额折算前诺德深证 300A 份额的持有人在份额折算后将持有诺德深证 300A 份额与新增场内诺德深证 300 份额；

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

诺德深证 300A 份额持有人新增的场内诺德深证 300 份额的份额数=

$$\frac{NUM_A^{\text{前}} \times NAV_A^{\text{前}} - NUM_A^{\text{后}} \times 1.000}{1.000}$$

其中：

$NUM_A^{\text{后}}$ ：份额折算后诺德深证 300A 份额的份额数

$NUM_B^{\text{后}}$ ：份额折算后诺德深证 300B 份额的份额数

$NUM_A^{\text{前}}$ ：份额折算前诺德深证 300A 份额的份额数

$NAV_A^{\text{前}}$ ：份额折算前诺德深证300A份额参考净值

III) 诺德深证 300 份额的折算：

份额折算原则：

- 份额折算前诺德深证 300 份额的资产净值与份额折算后诺德深证 300 份额的资产净值相等；

$$NUM_{300}^{\text{后}} = \frac{NAV_{300}^{\text{前}} \times NUM_{300}^{\text{前}}}{1.000}$$

其中：

$NUM_{300}^{\text{后}}$ ：份额折算后诺德深证 300 份额的份额数

$NAV_{300}^{\text{前}}$ ：份额折算前诺德深证 300 份额净值

$NUM_{300}^{\text{前}}$ ：份额折算前诺德深证 300 份额的份额数

诺德深证 300 份额的场外份额经折算后的份额数采用截位法保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产；诺德深证 300 份额的场内份额经折算后的份额数，以及诺德深证 300A 份额、诺德深证 300B 份额折算成诺德深证 300 份额的场内份额数均保留至整数位，小数点以后的部分舍去，舍去部分归基金所有。

IV) 举例：

某投资者持有诺德深证 300 份额、诺德深证 300A 份额、诺德深证 300B 份额各 10,000 份，在本基金的不定期份额折算日，三类份额的基金份额净值或参考净值如下表所示，折算后，诺德深证 300 份额、诺德深证 300A 份额参考净值、诺德深证 300B 份额参考净值均调整为 1.000 元。

	折算前		折算后	
	基金份额净值 或参考净值	基金份额	基金份额净值 或参考净值	基金份额
诺德深证 300 份额	0.614 元	10,000 份	1.000 元	6,140 份诺德深证 300 份额
诺德深证 300A 份额	1.030 元	10,000 份	1.000 元	1,980 份诺德深证 300A 份额 +新增 8,320 份诺德深证 300 份额的场内份额
诺德深证 300B 份额	0.198 元	10,000 份	1.000 元	1,980 份诺德深证 300B 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 9 月 16 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；诺德深证 300A 份额、诺德深证 300B 份额于 2015 年 9 月 16 日上午 9:30-10:30 停牌一小时，并将于 2015 年 9 月 16 日 10:30 之后恢复交易。该日终，基金管理人将计算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 9 月 17 日），本基金暂停办理申购、赎回、转托管、配对转换业务，诺德深证 300A 份额、诺德深证 300B 份额全天暂停交易。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 9 月 18 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，诺德 300A、诺德 300B 于 2015 年 9 月 18 日上午 9:30-10:30 停牌一小时，并将于 2015 年 9 月 18 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 9 月 18 日诺德深证 300A 份额、诺德深证 300B 份额即时行情显示的前收盘价为 2015 年 9 月 17 日的诺德深证 300A 份额、诺德深证 300B 份额的份额参考净值（四舍五入至 0.001 元），2015 年 9 月 18 日当日诺德深证 300A 份额和诺德深证 300B 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、诺德深证300A份额、诺德深证300B份额将于2015年9月16日上午9:30-10:30停牌一小时，并于2015年9月16日上午10:30复牌。

诺德深证300A份额、诺德深证300B份额将于2015年9月17日全天停牌，2015年9月18日上午9:30-10:30停牌一小时，并于2015年9月18日上午10:30复牌。

2、由于诺德深证 300A 份额、诺德深证 300B 份额折算前可能存在折溢价交易情形，不定期份额折算后，诺德深证 300A 份额、诺德深证 300B 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所带来的风险。

3、诺德深证300B份额具有高风险、高预期收益的特征。不定期份额折算后其杠杆将恢复至初始杠杆水平，相应地，诺德深证300B份额参考净值随市场涨跌而增长或者下降的幅度也也会大幅减小。

4、诺德深证 300A 份额具有低风险、收益相对稳定的特征。但在不定期份额折算后诺德深证 300 A 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诺德深证 300A 份额变为同时持有较低风险收益特征的诺德深证 300A 份额与较高风险收益特征的诺德深证 300 份额的情况，因此，诺德深证 300A 份额持有人预期收益实现的不确定性将会增加。

5、根据合同规定，折算基准日在触发阈值日后才能确定，因此折算基准日诺德深证 300B 份额的净值可能与触发折算的阈值 0.250 元有一定差异。

6、根据深圳证券交易所的相关业务规则，诺德深证300份额、诺德深证300A份额、诺德深证300B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，因此持有极小数量诺德深证300份额、诺德深证300A份额、诺德深证300B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。

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。

诺德基金管理有限公司

2015年9月16日