

金鹰中证 500 指数分级证券投资基金

不定期份额折算公告

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”）关于不定期份额折算的相关规定，当金鹰中证 500 指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）之金鹰 500B 份额的基金份额参考净值小于 0.2500 元时（不含 0.2500），本基金将进行不定期份额折算。

截至 2015 年 9 月 15 日，本基金金鹰中证 500B 份额的基金份额参考净值为 0.2062 元，达到基金合同规定的不定期份额折算条件。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金鹰中证 500 份额（场内简称“金鹰 500”，基金代码：162107）、金鹰中证 500A 份额（场内简称“金鹰 500A”，基金代码 150088）、金鹰中证 500B 份额（场内简称“金鹰 500B”，基金代码 150089）。

三、基金份额折算方式

金鹰中证 500 份额、金鹰中证 500A 份额、金鹰中证 500B 份额按照《基金合同》“第五部分、基金份额的折算”规则进行不定期份额折算。

当达到不定期折算条件时，本基金将分别对金鹰中证 500 份额、金鹰中证 500A 份额、金鹰中证 500B 份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保金鹰中证 500A 份额与金鹰中证 500B 份额的比例为 1: 1，份额折算后金鹰中证 500 份额的基金份额净值、金鹰中证 500A 份额与金鹰中证 500B 份额的基金份额参考净值均调整为 1.0000 元。具体折算原则及公式如下。具体折算原则及公式如下：

1) 金鹰中证 500B 份额

份额折算前后金鹰中证 500B 份额所对应的基金资产净值不变，即

$$NUM_{\text{金鹰中证500B份额}}^{\square\square\square\square} = \left(NUM_{\text{金鹰中证500B份额}}^{\text{不定期前}} \times NAV_{\text{金鹰中证500B份额}}^{\text{参考, 不定期前}} \right) / 1.0000$$

其中，

$NUM_{\text{金鹰中证500B份额}}^{\text{不定期前}}$ ：不定期份额折算前金鹰中证 500B 份额的份额数，

$NAV_{\text{金鹰中证500B份额}}^{\text{参考, 不定期前}}$ ：不定期份额折算前金鹰中证 500B 份额的基金份额参考净值，

$NUM_{\text{金鹰中证500B份额}}^{\square\square\square\square}$ ：不定期份额折算后金鹰 500B 份额的份额数。

2) 金鹰中证 500A 份额

① 份额折算后金鹰 500A 份额与金鹰 500B 份额的份额数保持 1: 1 配比，即

$$NUM_{\text{金鹰中证500A份额}}^{\text{不定期后}} = NUM_{\text{金鹰中证500B份额}}^{\text{不定期后}}$$

其中，

$NUM_{\text{金鹰中证500A份额}}^{\text{不定期后}}$ ：不定期份额折算后金鹰 500A 份额的份额数，

$NUM_{\text{金鹰中证500B份额}}^{\text{不定期后}}$ ：不定期份额折算后金鹰 500B 份额的份额数。

② 份额折算前金鹰中证 500A 的持有人在份额折算后将持有金鹰中证 500A 份额与新增场内金鹰中证 500 份额，且所对应的基金资产净值不变。

金鹰中证 500A 份额持有人新增的场内金鹰中证 500 份额的份额数为

$$NUM_{\text{金鹰中证500份额}}^{\text{不定期新增}} = \left(NUM_{\text{金鹰中证500A份额}}^{\text{不定期前}} \times NAV_{\text{金鹰中证500A份额}}^{\text{参考, 不定期前}} - NUM_{\text{金鹰中证500A份额}}^{\text{不定期后}} \times 1.0000 \right) / 1.0000$$

其中，

$NUM_{\text{金鹰中证500A份额}}^{\text{不定期前}}$ ：不定期份额折算前金鹰中证 500A 份额的份额数，

$NAV_{\text{金鹰中证500A份额}}^{\text{参考, 不定期前}}$ ：不定期份额折算前金鹰中证 500A 份额的基金份额参考净值，

$NUM_{\text{金鹰中证500A份额}}^{\text{不定期后}}$ ：不定期份额折算后金鹰 500A 份额的份额数。

3) 金鹰中证 500 份额

金鹰中证 500 份额持有人份额折算前后所持有的金鹰中证 500 份额的资产净值不变。

金鹰中证 500 份额持有人不定期份额折算后的金鹰中证 500 份额的份额数为

$$NUM_{\text{金鹰中证500份额}}^{\square\square\square\square} = \left(NUM_{\text{金鹰中证500份额}}^{\text{不定期前}} \times NAV_{\text{金鹰中证500份额}}^{\text{参考, 不定期前}} \right) / 1.0000$$

其中，

$NUM_{\text{金鹰中证500份额}}^{\text{不定期前}}$ ：不定期份额折算前金鹰中证 500 份额的份额数，

$NAV_{\text{金鹰中证500份额}}^{\text{参考, 不定期前}}$ ：不定期份额折算前金鹰中证 500 份额的基金份额净值，

$NUM_{\text{金鹰中证500份额}}^{\square\square\square\square}$ ：不定期份额折算后金鹰中证 500 份额的份额数。

份额折算后场外基金份额的份额数计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分舍弃，余额计入基金财产；场内基金份额的份额数计算结果保留到整数位，余额的处理方法按照深圳证券交易所或基金注册登记机构的相关规则及有关规定执行。

四、不定期份额折算示例

设在本基金的不定期份额折算日，金鹰中证 500 份额的基金份额净值、金鹰中证 500A 份额与金鹰中证 500B 份额的基金份额参考净值如下表所示，折算后，金鹰中证 500 份额的基金份额净值、金鹰中证 500A 份额、金鹰中证 500B 份额的基金份额参考净值均调整为 1.0000 元，则各持有金鹰中证 500 份额、金鹰中证 500A 份额、金鹰中证 500B 份额 10,000 份的基金份额持有人所持基金份额的变化如下表所示：

	折算前		折算后	
	份额净值/ 份额参考净 值	份额数	份额净值/ 份额参考净值	份额数
金鹰中证 500 份额	0.6170 元	10,000 份	1.0000 元	6,170 份金鹰中证 500 份额
金鹰中证 500A 份额	1.0280 元	10,000 份	1.0000 元	2,060 份金鹰中证 500A 份额+ 8,220 份场内金鹰中证 500 份 额
金鹰中证 500B 份额	0.2060 元	10,000 份	1.0000 元	2,060 份金鹰中证 500B 份额

五、基金份额折算期间的基金业务办理

1、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、赎回、转换、定期定额投资、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。金鹰中证 500A、金鹰中证 500B 将于 2015 年 9 月 16 日上午开市至 10:30 停牌，并于 2015 年 9 月 16 日上午 10:30 复牌。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、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、转换、定期定额投资、转托管、配对转换业务，金鹰中证 500A、金鹰中证 500B 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。

3、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、转换、定期定额投资、转托管、配对转换业务，金鹰中证 500A、金鹰中证 500B 将于 2015 年 9 月 18 日上午开市至 10:30 停牌，并于 2015 年 9 月 18 日上午 10:30 复牌。

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》，2015 年 9 月 18 日金鹰中证 500A、金鹰中证 500B 即时行情显示的前收盘价为 2015 年 9 月 17 日的金鹰中证 500A、金鹰中证 500B 的基金份额参考净值(四舍五入至 0.001 元)，2015 年 9 月 18 日当日金鹰中证 500A 份额和金鹰中证 500B 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。

六、重要提示

1、金鹰中证 500A、金鹰中证 500B 将于 2015 年 9 月 16 日上午开市至 10:30 停牌，并于 2015 年 9 月 16 日上午 10:30 复牌。

金鹰中证 500A、金鹰中证 500B 将于 2015 年 9 月 17 日全天停牌。金鹰中证 500A、金鹰中证 500B 将于 2015 年 9 月 18 日上午开市至 10:30 停牌，并于 2015 年 9 月 18 日上午 10:30 复牌。

2、2015 年 9 月 15 日，金鹰中证 500B 份额的基金份额参考净值已跌至 0.250 元以下，而折算基准日为 2015 年 9 月 16 日，因此折算基准日金鹰中证 500B 份额的基金份额参考净值与折算条件 0.250 元可能有一定差异。

3、特别提示：近日金鹰中证 500B 份额二级市场交易价格溢价较大，不定期份额折算

后，金鹰中证 500B 份额的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金鹰中证 500B 份额高溢价交易所带来的风险。

4、金鹰中证 500A 份额表现为低风险、预期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的金鹰中证 500A 份额变为同时持有较低风险收益特征的金鹰中证 500A 份额与较高风险收益特征的金鹰中证 500 份额，因此原金鹰中证 500A 份额持有人预期收益实现的不确定性将会增加；此外，金鹰中证 500 份额为跟踪中证 500 指数的基础份额，其份额净值将随市场涨跌而变化，因此原金鹰中证 500A 份额持有人还可能会承担因市场下跌而遭受损失的风险。

5、金鹰中证 500B 份额表现为高风险、高收益预期的特征，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，金鹰中证 500B 份额净值随市场涨跌而增长或者下降的幅度也会大幅减小。

6、原金鹰中证 500A 份额持有人可通过办理配对转换业务将此次折算获得的场内金鹰中证 500 份额分拆为金鹰中证 500A 份额、金鹰中证 500B 份额。

7、根据深圳证券交易所的相关业务规则，金鹰中证 500A 份额、金鹰中证 500B 份额、金鹰中证 500 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，持有极小数量金鹰中证 500A 份额、金鹰中证 500B 份额、金鹰中证 500 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。

8、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金鹰中证 500A 份额，在不定期份额折算后，则折算新增的金鹰中证 500 份额无法赎回。投资者可以选择在折算前将金鹰中证 500A 份额卖出，或者在折算后将新增的金鹰中证 500 份额转托管到具有基金销售资格的证券公司后赎回。

9、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（更新）等相关法律文件。敬请投资者注意投资风险。

投资者若希望了解基金不定期份额折算业务详情，请登陆本公司网站：www.gefund.com 或者拨打本公司客服电话：400-6135-888（免长途话费）。

特此公告。

金鹰基金管理有限公司

2015 年 9 月 16 日