

关于诺德深证 300 指数分级证券投资基金不定期份额折算结果及恢复交易的公告

根据诺德深证 300 指数分级证券投资基金（以下简称：本基金）基金合同、招募说明书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，诺德基金管理有限公司（以下简称：本公司）以 2015 年 9 月 16 日为份额折算基准日，对诺德深证 300 份额的场外份额、场内份额以及诺德深证 300A 份额、诺德深证 300B 份额实施不定期份额折算，现将相关事项公告如下：

一、份额折算结果

2015年9月16日，诺德深证300份额（交易代码：165707）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（代码：150092）、诺德深证300B份额（代码：150093）折算成诺德深证300份额的场内份额数均保留至整数位（最小单位为1份），小数点以后的部分舍去，舍去部分归基金所有。份额折算比例按截位法精确到小数点后第9位，折算结果如下表所示：

基金份额名称	折算前份额	折算前基金份额净值	折算比例	折算后份额	折算后基金份额净值
诺德深证300份额场外份额	7,143,306.73	0.660	0.659914021	4,713,972.94	1.000
诺德深证300份额场内份额	702,291.00	0.660	0.659914021	5,165,257.00 注1	1.000
诺德深证300A份额	6,535,202.00	1.020	0.300184809	1,961,768.00	1.000
			0.719458477	4,701,806.00 注2	
诺德深证300B份额	6,535,202.00	0.300	0.300184809	1,961,768.00	1.000

注 1：该“折算后份额”为折算后场内诺德深证 300 份额之和，包括原场内诺德深证 300 份额经折算后的份额以及原诺德深证 300A 份额经折算后的新增场内诺德深证 300 份额。

注 2：该“折算后份额”为诺德深证 300A 份额经份额折算后产生的新增诺德深证 300 场内份额。

投资者自公告之日起可查询经注册登记人及本公司确认的折算后份额。

二、恢复交易

自 2015 年 9 月 18 日起，本基金恢复申购（含定期定额投资）、赎回、转托管（包括场外转托管和跨系统转托管）和配对转换业务，诺德深证 300A 份额、诺德深证 300B 份额将于 2015 年 9 月 18 日上午开市至 10:30 期间停牌，并将于 2015 年 9 月 18 日上午 10:30 复牌。

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调整为前一交易日（2015 年 9 月 17 日）诺德深证 300A 份额、诺德深证 300B 份额的基金份额参考净值（四舍五入至 0.001 元），分别为 1.000 元和 0.966 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。

三、其他需要提示的事项

1、根据深圳证券交易所的相关业务规则，场内份额数将取整计算（最小单位为 1 份），舍去部分计入基金资产，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，可能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。

2、诺德深证 300A 份额具有低风险、预期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，原诺德深证 300A 份额持有人预期收益实现的不确定性将会增加；此外，诺德深证 300 份额为跟踪深 300 指数的基础份额，其份额

净值将随市场涨跌而变化，因此原诺德深证 300A 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、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。

4、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。

5、原诺德深证 300A 份额持有人可通过办理配对转换业务将此次折算获得场内诺德深证 300 份额分拆为诺德深证 300A 份额和诺德深证 300B 份额。

6、投资者若希望了解基金不定期份额折算业务详情，请参阅《诺德深证 300 指数分级证券投资基金基金合同》及《诺德深证 300 指数分级证券投资基金招募说明书》。投资者可致电本公司客户服务电话 400-888-0009，或登录本公司网站 www.nuodefund.com 了解或咨询详请。

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。本基金管理人提醒投资者知晓基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。敬请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。

特此公告。

诺德基金管理有限公司

2015 年 9 月 18 日