

关于调整基金估值方法的公告

由我司管理、国泰君安证券股份有限公司托管的基金所投资的非公开发行且有明确锁定期的股票（含新三板采用做市转让方式的挂牌股份），经与基金托管人协商一致，于 2015 年 9 月 16 日起按下列原则进行估值：

1、如果估值日非公开发行有明确锁定期的股票的初始取得成本高于在证券交易所上市交易的同一股票的市价，采用在证券交易所上市交易的同一股票的市价作为估值日该股票的价值。

2、如果估值日非公开发行有明确锁定期的股票的初始取得成本低于在证券交易所上市交易的同一股票的市价，按以下公式确定该股票的价值：

$$FV=C+(P-C) \times (D1-Dr) / D1$$

其中：

FV 为估值日该非公开发行有明确锁定期的股票的价值；

C 为该非公开发行有明确锁定期的股票的初始取得成本（因权益业务导致市场价格除权时，应于除权日对其初始取得成本作相应调整）；

P 为估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价；

D1 为该非公开发行有明确锁定期的股票锁定期所含的交易所的交易天数；

Dr 为估值日剩余锁定期，即估值日至锁定期结束所含的交易所的交易天数（不含估值日当天）。

3、自获取确定的锁定期起始日起，即对非公开发行且有明确锁定期的股票实行以上非公开发行股票定价方法估值。

上海少数派投资管理有限公司

2015 年 9 月 16 日

