

## 关于银华中证国防安全主题指数分级证券投资基金 办理定期份额折算业务的公告

根据《银华中证国防安全主题指数分级证券投资基金基金合同》（简称“基金合同”），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，银华中证国防安全主题指数分级证券投资基金（简称“本基金”）将以 2015 年 12 月 1 日为基准日办理定期份额折算业务。相关事项公告如下：

### 一、基金份额折算基准日

根据基金合同的规定，定期份额折算基准日为每个会计年度 12 月第一个工作日。本次定期份额折算的基准日为 2015 年 12 月 1 日。

### 二、基金份额折算对象

基金份额折算基准日交易结束后登记在册的银华国安份额（基础份额，场内简称：国安分级，代码：161832）、国安 A 份额（稳健收益类份额，场内简称：国安 A，代码：150351）。

### 三、基金份额折算方式

国安 A 份额和国安 B 份额按照基金合同“四、基金份额的分类与净值计算规则”进行净值计算，对国安 A 份额的应得收益进行定期份额折算，每 2 份银华国安份额将按 1 份国安 A 份额获得约定应得收益的新增折算份额。

在基金份额折算前与折算后，国安 A 份额和国安 B 份额的份额配比保持 1:1 的比例。

对于国安 A 份额期末的约定应得收益，即国安 A 份额每个定期折算期间期末即 11 月 30 日份额净值超出 1.000 元部分，将折算为场内银华国安份额分配给国安 A 份额持有人。银华国安份额持有人持有的每 2 份银华国安份额将按 1 份国安 A 份额获得新增银华国安份额的分配。持有场外银华国安份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外银华国安份额的分配；持有场内银华国安份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内银华国安份额的分配。经过上述份额折算，国安 A 份额和银华国安份额的基金份额净值将相应调整。

每个会计年度 12 月第一个工作日为基金份额折算基准日，本基金将对国安

A 份额和银华国安份额进行应得收益的定期份额折算，在份额折算期间的份额净值计算保留小数位数以份额折算相关公告为准。

每个会计年度 12 月第一个工作日进行国安 A 份额上一定期折算期间应得收益的定期份额折算时，以下公式中每份国安 A 份额期末资产净值等于当期定期折算期末即 11 月 30 日的国安 A 份额资产净值。

有关计算公式如下：

(1) 国安 A 份额

定期份额折算后国安 A 份额的份额数 = 定期份额折算前国安 A 份额的份额数

$$NAV_{\text{银华国安份额}}^{\text{后}} = \frac{\text{折算前银华国安份额的资产净值} \times \left( \frac{\text{每份国安A份额期末资产净值} - 1.000}{NAV_{\text{银华国安份额}}^{\text{前}}} \right) \times 0.5 \times NUM_{\text{银华国安份额}}^{\text{前}}}{NUM_{\text{银华国安份额}}^{\text{前}}}$$

国安 A 份额持有人新增的场内银华国安份额的份额数 =

$$NUM_{\text{国安A份额}}^{\text{前}} \times \frac{(\text{每份国安A份额期末资产净值} - 1.000)}{NAV_{\text{银华国安份额}}^{\text{后}}}$$

【国安 A 份额持有人新增的场内银华国安份额的折算比例=

$$\frac{(\text{每份国安A份额期末资产净值} - 1.000)}{NAV_{\text{银华国安份额}}^{\text{后}}}]$$

其中：

$NAV_{\text{银华国安份额}}^{\text{后}}$ ：定期份额折算后银华国安份额净值

$NUM_{\text{银华国安份额}}^{\text{前}}$ ：定期份额折算前银华国安份额的份额数

$NUM_{\text{国安A份额}}^{\text{前}}$ ：定期份额折算前国安 A 份额的份额数

(2) 国安 B 份额

每个会计年度的定期份额折算不改变国安 B 份额净值及其份额数。

(3) 银华国安份额

定期份额折算后银华国安份额持有人持有的银华国安份额的份额数 = 定期份额折算前银华国安份额的份额数 + 银华国安份额持有人新增的银华国安份额的份额数

$$NAV_{\text{银华国安份额}}^{\text{后}} = \frac{\text{折算前银华国安份额的资产净值} \times \left( \frac{\text{每份国安A份额期末资产净值} - 1.000}{NAV_{\text{银华国安份额}}^{\text{前}}} \right) \times 0.5 \times NUM_{\text{银华国安份额}}^{\text{前}}}{NUM_{\text{银华国安份额}}^{\text{前}}}$$

银华国安份额持有人新增的银华国安份额=

$$NUM_{\text{银华国安份额}}^{\text{前}} \times \frac{(\text{每份国安A份额期末资产净值}-1.000)}{NAV_{\text{银华国安份额}}^{\text{后}}} \times 0.5$$

【银华国安份额持有人新增的银华国安份额的折算比例 =

$$\frac{(\text{每份国安A份额期末资产净值}-1.000)}{NAV_{\text{银华国安份额}}^{\text{后}}} \times 0.5 \quad \text{】}$$

其中：

$NAV_{\text{银华国安份额}}^{\text{后}}$ ：定期份额折算后银华国安份额净值

$NUM_{\text{银华国安份额}}^{\text{前}}$ ：定期份额折算前银华国安份额的份额数

场外银华国安份额经折算后的份额数按截位法保留到小数点后两位，舍去部分计入基金财产；国安 A 份额、场内银华国安份额经折算后的份额数取整计算（最小单位为 1 份），舍去部分计入基金财产。份额折算比例按截位法精确到小数点后第 9 位。

#### 4、举例

假设本基金成立后某个会计年度 12 月第一个工作日为定期份额折算基准日，国安 A 份额、国安 B 份额、银华国安场外份额及银华国安场内份额的规模依次为 5 亿份、5 亿份、10 亿份和 10 亿份，国安 A 份额期末份额净值为 1.060 元，定期份额折算后银华国安份额净值为 0.993 元，则，

折算后：

国安 A 份额持有人新增的场内银华国安份额的折算比例= (1.060-1) / 0.993=0.060422960；

银华国安份额持有人新增的银华国安份额的折算比例=0.5\* (1.060-1) / 0.993=0.030211480。

本基金折算后，国安 A 份额 5 亿份，同时，新增的场内银华国安份额数=500,000,000×0.060422960=30,211,480 份；

国安 B 份额 5 亿份；

银华国安场外份额数

=1,000,000,000+1,000,000,000×0.030211480=1,030,211,480.00 份；

银华国安场内份额数

$=1,000,000,000+1,000,000,000\times 0.030211480=1,030,211,480$  份。

#### 四、基金份额折算期间的基金业务办理

(一) 定期份额折算基准日(即 2015 年 12 月 1 日), 本基金暂停办理申购(含定期定额投资, 下同)、赎回及配对转换业务。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。

(二) 定期份额折算基准日后的第一个工作日(即 2015 年 12 月 2 日), 本基金暂停办理申购、赎回及配对转换业务。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) 定期份额折算基准日后的第二个工作日(即 2015 年 12 月 3 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、赎回及配对转换业务。

#### 五、重要提示

(一) 本基金国安 A 份额期末的约定应得收益将折算为场内银华国安份额分配给国安 A 份额的持有人, 而银华国安份额为跟踪中证国防安全主题指数的基础份额, 其份额净值将随市场涨跌而变化, 因此国安 A 份额持有人预期收益的实现存在一定的不确定性, 其可能会承担因市场下跌而遭受损失的风险。

(二) 由于国安 A 份额经折算产生的新增场内银华国安份额和场内银华国安份额经折算后的份额数将取整计算(最小单位为 1 份), 舍去部分计入基金财产, 持有极小数量国安 A 份额或场内银华国安份额的持有人存在无法获得新增场内银华国安份额的可能性。

(三) 投资者若希望了解基金定期份额折算业务详情, 请登陆本公司网站: [www.yhfund.com.cn](http://www.yhfund.com.cn) 或者拨打本公司客服电话: 400-678-3333(免长途话费)。

风险提示: 本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。投资有风险, 决策须谨慎。

特此公告。

银华基金管理有限公司

2015年11月26日