

建信中证申万有色金属指数分级发起式证券投资基金办理定期 份额折算业务的公告

根据《建信中证申万有色金属指数分级发起式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，建信中证申万有色金属指数分级发起式证券投资基金（简称“本基金”）将在 2015 年 12 月 1 日办理定期份额折算业务。相关事项提示如下：

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登记在册的建信有色 A 份额、建信有色份额（场内简称：建信金属；代码：165316）。

三、基金份额折算方式

建信有色 A 份额(场内简称:金属 A；代码：150333)与建信有色 B 份额(场内简称:金属 B；代码：150334)按照本基金合同第五部分“基金份额的净值计算”进行基金份额参考净值计算，对建信有色 A 份额的约定应得收益进行定期份额折算。

在基金份额折算前与折算后，建信有色 A 份额与建信有色 B 份额的份额配比保持 1：1 的比例。对于建信有色 A 份额的约定应得收益，即建信有色 A 份额每个会计年度 11 月 30 日基金份额参考净值超出 1.000 元部分，将折算为场内建信有色份额分配给建信有色 A 份额持有人。建信有色份额持有人持有的每 2 份建信有色份额将按 1 份建信有色 A 份额获得新增建信有色份额的分配。持有场外建信有色份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外建信有

色份额的分配；持有场内建信有色份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内建信有色份额的分配。经过上述份额折算，建信有色 A 份额的基金份额参考净值调整为 1.000 元，建信有色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（可不进行定期折算的除外），本基金将对建信有色 A 份额和建信有色份额进行定期份额折算。有关计算公式如下：

(1) 建信有色 A 份额

定期份额折算不改变建信有色 A 份额的份额数，即

$$NUM_{\text{建信有色 A 份额}}^{\text{定期后}} = NUM_{\text{建信有色 A 份额}}^{\text{定期前}}$$

其中，

$NUM_{\text{建信有色 A 份额}}^{\text{定期前}}$ ：定期份额折算前建信有色 A 份额的份额数，

$NUM_{\text{建信有色 A 份额}}^{\text{定期后}}$ ：定期份额折算后建信有色 A 份额的份额数。

因持有建信有色 A 份额而新增的场内建信有色份额的份额数为

$$NUM_{\text{建信有色份额}}^{\text{定期新增, 建信有色 A 份额}} = \frac{NUM_{\text{建信有色 A 份额}}^{\text{定期前}} \times (NAV_{\text{建信有色 A 份额}}^{\text{参考, 定期前}} - 1.000)}{NAV_{\text{建信有色份额}}^{\text{定期后}}}$$

其中，

$NUM_{\text{建信有色 A 份额}}^{\text{定期前}}$ ：定期份额折算前建信有色 A 份额的份额数，

$NAV_{\text{建信有色 A 份额}}^{\text{参考, 定期前}}$ ：定期份额折算前建信有色 A 份额的基金份额参考净值，

$NUM_{\text{建信有色份额}}^{\text{定期前}}$ ：定期份额折算前建信有色份额的份额数，

$NAV_{\text{建信有色份额}}^{\text{定期后}}$ ：定期份额折算后建信有色份额的基金份额净值，计算公式为

式为

$$NAV_{\text{建信有色份额}}^{\text{定期后}}$$

$$= \frac{\text{定期折算前全部建信有色份额的基金资产净值} - 0.5 \times (NAV_{\text{建信有色 A 份额}}^{\text{参考, 定期前}} - 1.000) \times NUM_{\text{建信有色 A 份额}}^{\text{定期前}}}{NUM_{\text{建信有色份额}}^{\text{定期前}}}$$

定期份额折算后的建信有色份额的基金份额净值，保留到小数点后 4 位，

小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

(2) 建信有色 B 份额

定期份额折算不改变建信有色 B 份额的基金份额参考净值及其份额数，即

$$NAV_{\text{建信有色 B 份额}}^{\text{参考, 定期后}} = NAV_{\text{建信有色 B 份额}}^{\text{参考, 定期前}}$$

$$NUM_{\text{建信有色 B 份额}}^{\text{定期后}} = NUM_{\text{建信有色 B 份额}}^{\text{定期前}}$$

(3) 建信有色份额

定期份额折算后建信有色份额的份额数等于定期折算前建信有色份额的份额数与新增的建信有色份额的份额数之和，即

$$NUM_{\text{建信有色份额}}^{\text{定期后}} = NUM_{\text{建信有色份额}}^{\text{定期前}} + NUM_{\text{建信有色份额}}^{\text{定期新增}}$$

建信有色份额持有人新增的建信有色份额数为

$$NUM_{\text{建信有色份额}}^{\text{定期新增}} = \frac{0.5 \times (NAV_{\text{建信有色 A 份额}}^{\text{参考, 定期前}} - 1.000) \times NUM_{\text{建信有色份额}}^{\text{定期前}}}{NAV_{\text{建信有色份额}}^{\text{定期后}}}$$

其中，

$NAV_{\text{建信有色 A 份额}}^{\text{参考, 定期前}}$ ：定期份额折算前建信有色 A 份额的基金份额参考净值，

$NUM_{\text{建信有色份额}}^{\text{定期前}}$ ：定期份额折算前建信有色份额的份额数，

$NUM_{\text{建信有色份额}}^{\text{定期后}}$ ：定期份额折算后建信有色份额的基金份额净值，计算公式同上。

在实施基金份额折算时，折算日折算前建信有色份额的基金份额净值、建信有色 A 份额参考净值等具体见基金管理人届时发布的相关公告。

(4) 定期份额折算示例

假设本基金成立后第 2 年 12 月第一个工作日为定期份额折算基准日，建信有色份额当天折算前资产净值为 8,659,000,000 元。当天场外建信有色份额、场内建信有色份额、建信有色 A 份额、建信有色 B 份额的份额数分别为 55 亿份、10 亿份、20 亿份、20 亿份。11 月 30 日每份建信有色 A 份额资产净值为 1.065 元，且未进行不定期份额折算。

定期份额折算的对象为基准日登记在册的建信有色 A 份额和建信有色份额，即 20 亿份和 65 亿份。

(1) 建信有色 A 份额持有人

定期折算后持有的建信有色 A 份额为

$$NUM_{\text{建信有色A份额}}^{\text{定期后}} = NUM_{\text{建信有色A份额}}^{\text{定期前}} = 20\text{亿份}$$

定期份额折算后建信有色份额的份额净值为

$$\begin{aligned} NAV_{\text{建信有色份额}}^{\text{定期后}} &= \frac{\text{定期折算前全部建信有色份额的基金资产净值} - 0.5 \times (NAV_{\text{建信有色A份额}}^{\text{参考, 定期前}} - 1.000) \times NUM_{\text{建信有色份额}}^{\text{定期前}}}{NUM_{\text{建信有色份额}}^{\text{定期前}}} \\ &= \frac{8,690,000,000 - 0.5 \times (1.065 - 1.000) \times 6,500,000,000}{6,500,000,000} = 1.300\text{元} \end{aligned}$$

因持有建信有色 A 份额而新增的场内建信有色份额的份额数为

$$\begin{aligned} NUM_{\text{建信有色份额}}^{\text{定期新增, 建信有色A份额}} &= \frac{NUM_{\text{建信有色A份额}}^{\text{定期前}} \times (NAV_{\text{建信有色A份额}}^{\text{参考, 定期前}} - 1.000)}{NAV_{\text{建信网金份额}}^{\text{定期后}}} \\ &= \frac{2,000,000,000 \times (1.065 - 1.000)}{1.300} = 100,000,000\text{份} \end{aligned}$$

建信有色 A 份额持有人在定期折算后总共持有 20 亿份建信有色 A 份额，基金份额净值为 1.0000 元；新增持有 100,000,000 份建信有色份额，基金份额净值为 1.300 元。

(2) 建信有色份额持有人

建信有色份额持有人新增的建信有色份额数为

$$\begin{aligned} NUM_{\text{建信有色份额}}^{\text{定期新增}} &= \frac{0.5 \times (NAV_{\text{建信有色A份额}}^{\text{参考, 定期前}} - 1.000) \times NUM_{\text{建信有色份额}}^{\text{定期前}}}{NAV_{\text{建信有色份额}}^{\text{定期后}}} \\ &= \frac{0.5 \times (1.065 - 1.000) \times 6,500,000,000}{1.300} = 162,500,000\text{份} \end{aligned}$$

建信有色份额持有人在定期折算后持有的建信有色份额为

$$\begin{aligned} NUM_{\text{建信有色份额}}^{\text{定期后}} &= NUM_{\text{建信有色份额}}^{\text{定期前}} + NUM_{\text{建信有色份额}}^{\text{定期新增}} \\ &= 6,500,000,000 + 162,500,000 = 6,662,500,000\text{份} \end{aligned}$$

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、赎回、转托管（包括场外转托管、跨系统转托管，下同）业务及配对转换业务。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、转托管、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、转托管、配对转换业务。

五、重要提示

由于金属 A 份额新增份额折算成建信有色份额的场内份额数和建信有色份额的场内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，持有较少金属 A 份额数或场内建信有色份额数的份额持有人存在无法获得新增场内建信有色份额的可能性。

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.ccbfund.cn 或者拨打本公司客服电话：400-81-95533（免长途通话费）、010-66228000。

本公司承诺以诚实信用、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。投资者投资于基金前应认真阅读基金的基金合同、招募说明书等文件。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

建信基金管理有限责任公司

二〇一五年十一月二十六日