

大成中证互联网金融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《大成中证互联网金融指数分级证券投资基金基金合同》（简称“基金合同”）及上海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，大成中证互联网金融指数分级证券投资基金（简称“本基金”）将在 2015 年 12 月 15 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

根据本基金基金合同的规定，本基金基金份额定期折算基准日为每个会计年度的 12 月 15 日（若该日非交易日，则顺延至最近一个交易日），故本基金定期折算基准日为 2015 年 12 月 15 日。

二、基金份额折算对象

基金份额折算对象为基金份额折算基准日登记在册的互联网金融份额（包括场外份额和场内份额；场内简称“互联金融”；场内代码“502036”）、互联网金融 A 份额（场内简称“网金 A”；场内代码“502037”）。

三、基金份额折算方式

互联网金融 A 份额和互联网金融 B 份额（场内简称“网金 B”，场内代码“502038”）按照本基金基金合同第四部分“一、基金份额的分类和净值计算规则”进行净值计算，对互联网金融 A 份额的应得收益进行定期份额折算，每 2 份互联网金融份额将按 1 份互联网金融 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，互联网金融 A 份额和互联网金融 B 份额的份额配比保持 1:1 的比例。

折算前的互联网金融 A 份额持有人，以互联网金融 A 份额在基金份额折算基准日的基金份额参考净值超出本金 1.0000 元部分，获得新增互联网金融份额的份额分配。折算不改变互联网金融 A 份额持有人的资产净值，其持有的互联网金融 A 份额的基金份额参考净值折算调整为 1.0000 元、份额数量不变，相应折算增加场内互联网金融份额。

折算前的互联网金融份额的基金份额持有人，以每 2 份互联网金融份额，按 1 份互联网金融 A 份额的份额分配，获得新增互联网金融份额。持有场外互

互联网金融份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外互联网金融份额的分配；持有场内互联网金融份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内互联网金融份额的分配。折算不改变互联网金融份额持有人的资产净值。

经过上述份额折算，互联网金融 A 份额的基金份额参考净值和互联网金融份额的基金份额净值将相应调整。

每个会计年度 12 月 15 日（若该日非交易日，则顺延至最近一个交易日）为基金份额折算基准日，本基金将对互联网金融 A 份额和互联网金融份额进行应得收益的定期份额折算，有关计算公式如下：

（1）互联网金融 A 份额

$$NUM_{互联网金融A}^{后} = NUM_{互联网金融A}^{前}$$

定期份额折算后互联网金融 A 份额的份额数 = 定期份额折算前互联网金融 A 份额的份额数

定期份额折算后互联网金融份额的份额净值为：

$$NAV_{互联网金融}^{后} = \frac{NAV_{互联网金融}^{前} \times NUM_{互联网金融}^{前} - \frac{1}{2} \times (NAV_{互联网金融A}^{前} - 1.0000) \times NUM_{互联网金融}^{前}}{NUM_{互联网金融}^{前}}$$

互联网金融 A 份额持有人新增的场内互联网金融份额的份额数

$$= \frac{NUM_{互联网金融A}^{前} \times (NAV_{互联网金融A}^{前} - 1.0000)}{NAV_{互联网金融}^{后}}$$

其中：

$NUM_{互联网金融A}^{前}$ ：定期份额折算前互联网金融 A 份额的份额数

$NUM_{互联网金融A}^{后}$ ：定期份额折算后互联网金融 A 份额的份额数

$NAV_{互联网金融}^{前}$ ：定期份额折算前互联网金融份额的份额净值

$NAV_{互联网金融}^{后}$ ：定期份额折算后互联网金融份额的份额净值

$NAV_{互联网金融A}^{前}$ ：定期份额折算前互联网金融 A 份额的份额参考净值

$NUM_{互联网金融}^{前}$ ：定期份额折算前互联网金融份额的份额数

（2）互联网金融 B 份额

每个会计年度的定期份额折算不改变互联网金融 B 份额的参考净值及其份

额数。

(3) 互联网金融份额

$$NAV_{\text{互联网金融}}^{\text{后}} = \frac{NAV_{\text{互联网金融}}^{\text{前}} \times NUM_{\text{互联网金融}}^{\text{前}} - \frac{1}{2} \times (NAV_{\text{互联网金融A}}^{\text{前}} - 1.0000) \times NUM_{\text{互联网金融}}^{\text{前}}}{NUM_{\text{互联网金融}}^{\text{前}}}$$

定期份额折算后互联网金融份额持有人新增的互联网金融份额的份额数

$$= \frac{\frac{1}{2} \times NUM_{\text{互联网金融}}^{\text{前}} \times (NAV_{\text{互联网金融A}}^{\text{前}} - 1.0000)}{NAV_{\text{互联网金融}}^{\text{后}}}$$

定期份额折算后互联网金融份额的份额数 = 定期份额折算前互联网金融份额的份额数 + 互联网金融份额持有人新增的互联网金融份额的份额数 + 互联网金融 A 份额持有人新增的互联网金融份额的份额数

即：

$$NUM_{\text{互联网金融}}^{\text{后}} = NUM_{\text{互联网金融}}^{\text{前}} + \frac{\frac{1}{2} \times NUM_{\text{互联网金融}}^{\text{前}} \times (NAV_{\text{互联网金融A}}^{\text{前}} - 1.0000)}{NAV_{\text{互联网金融}}^{\text{后}}} + \frac{NUM_{\text{互联网金融A}}^{\text{前}} \times (NAV_{\text{互联网金融A}}^{\text{前}} - 1.0000)}{NAV_{\text{互联网金融}}^{\text{后}}}$$

其中：

$NAV_{\text{互联网金融}}^{\text{后}}$ ：定期份额折算后互联网金融份额净值

$NAV_{\text{互联网金融A}}^{\text{前}}$ ：定期份额折算前互联网金融 A 份额的份额参考净值

$NUM_{\text{互联网金融}}^{\text{前}}$ ：定期份额折算前互联网金融份额的份额数

$NUM_{\text{互联网金融}}^{\text{后}}$ ：定期份额折算后互联网金融份额的份额数

$NUM_{\text{互联网金融A}}^{\text{前}}$ ：定期份额折算前互联网金融 A 份额的份额数

场外互联网金融份额经折算后的份额数采用截位法保留到小数点后 2 位，由此误差产生的收益或损失计入基金财产；场内互联网金融份额、互联网金融 A 份额折算成的新增场内互联网金融份额数取整计算（最小单位为 1 份），不足 1 份的零碎份额，按照投资者零碎份额数量大小顺序排列，零碎份额数量相同的，则随机排列。按照排列顺序，依次均登记为 1 份，直至完成全部折算。如登记结算机构业务规则有变化，以其最新规定为准。

四、基金份额折算期间的基金业务办理

1、定期份额折算基准日（即 2015 年 12 月 15 日），本基金暂停办理互联网金融份额的申购（含定期定额投资，下同）、赎回、转换、转托管（包括场外转托管、跨系统转托管，下同）及配对转换业务；互联网金融份额、互联网金融 A 份额和互联网金融 B 份额正常交易。当日晚间，基金管理人计算当日互联网金融份额的基金份额净值和互联网金融 A 份额、互联网金融 B 份额的基金份额参考净值并进行份额折算。

2、定期份额折算基准日后的第一个工作日（即 2015 年 12 月 16 日），本基金互联网金融份额暂停办理申购、赎回、转换、转托管、配对转换业务，互联网金融份额和互联网金融 A 份额暂停交易，互联网金融 B 份额正常交易。当日，本基金注册登记机构及基金管理人为持有人办理份额登记确认。

3、定期份额折算基准日后的第二个工作日（即 2015 年 12 月 17 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、转托管、配对转换业务，互联网金融份额和互联网金融 A 份额于该日开市起复牌，互联网金融 B 份额正常交易。

五、重要提示

1、根据上海证券交易所相关规定，2015 年 12 月 17 日互联网金融 A 份额复牌首日即时行情显示的前收盘价为 2015 年 12 月 16 日互联网金融 A 份额的基金份额参考净值（四舍五入至 0.001 元）。由于互联网金融 A 份额折算前可能存在折溢价交易情形，互联网金融 A 份额折算前（2015 年 12 月 15 日）的收盘价扣除约定应得收益后与 2015 年 12 月 17 日的前收盘价可能有较大差异。互联网金融 A 份额 2015 年 12 月 17 日当日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。

2、根据上海证券交易所相关规定，2015 年 12 月 17 日互联网金融份额复牌首日即时行情显示的前收盘价为 2015 年 12 月 16 日互联网金融份额的基金份额净值（四舍五入至 0.001 元）。由于互联网金融份额折算前可能存在折溢价交易情形，互联网金融份额折算前（2015 年 12 月 15 日）的收盘价与 2015 年 12 月 17 日的前收盘价可能有较大差异。互联网金融份额 2015 年 12 月 17 日当日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。

3、由于场内的互联网金融份额、互联网金融 A 份额折算成的新增互联网金融份额数取整计算（最小单位为 1 份），不足 1 份的零碎份额，按照投资者零碎份额数量大小顺序排列，零碎份额数量相同的，则随机排列。按照排列顺序，依次均登记为 1 份，直至完成全部折算。因此，折算前持有较少场内互联网金融份额或互联网金融 A 份额的持有人存在无法获得新增互联网金融份额的可能性。

4、由于互联网金融 A 份额定期折算基准日参考净值超出 1.0000 元的部分将折算为场内互联网金融份额，折算后其份额持有人的风险收益特征将发生一定变化：由持有单一的低风险、收益相对稳定的互联网金融 A 份额变为同时持有低风险、收益相对稳定的互联网金融 A 份额与较高风险、较高收益的互联网金融份额，敬请互联网金融 A 份额持有人注意。

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.dcfund.com.cn 或者拨打本公司客服电话：400—888—5558。

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

大成基金管理有限公司

2015 年 12 月 10 日