

# 国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金

## 不定期份额折算公告

根据《国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）关于不定期份额折算的相关规定，当国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金之国寿养老B份额的基金份额参考净值跌至0.250元或以下时，本基金将进行不定期份额折算。

截至2018年08月17日，本基金国寿养老B份额的基金份额参考净值为0.242元，达到基金合同规定的不定期份额折算条件。根据《基金合同》以及深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定，本基金将以2018年08月20日为基准日办理不定期份额折算业务。相关事项公告如下：

### 一、基金份额折算基准日

本次不定期份额折算的基准日为2018年08月20日。

### 二、基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的国寿养老份额（基金简称“国寿养老”，基金代码：168001）、国寿养老A份额（场内简称“养老A”，基金代码150305）、国寿养老B份额（场内简称“养老B”，基金代码150306）。

### 三、基金份额折算方式

国寿养老份额、国寿养老A份额、国寿养老B份额按照《基金合同》“第二十二部分、基金份额的折算”规则进行不定期份额折算。

当达到不定期折算条件时，本基金将分别对国寿养老A份额、国寿养老B份额和国寿养老份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保国寿养老A份额和国寿养老B份额的比例为1：1，份额折算后国寿养老份额的基金份额净值、国寿养老A份额和国寿养老B份额的基金份额参考净值均调整为1.000元。国寿养老份额、国寿养老A份额和国寿养老B份额的份额数将相应缩减。

#### 1、国寿养老B份额

$$NUM_B^{\text{后}} = \frac{NAV_B^{\text{前}} \times NUM_B^{\text{前}}}{1.000}$$

$NUM_B^{\text{前}}$ ：不定期份额折算前国寿养老B份额的份额数，

$NUM_B^{\text{后}}$ ：不定期份额折算后国寿养老 B 份额的份额数，

$NAV_B^{\text{前}}$ ：不定期份额折算前国寿养老 B 份额的基金份额参考净值。

## 2、国寿养老 A 份额

不定期份额折算后国寿养老 A 份额与国寿养老 B 份额的份额配比保持 1：1 不变，即：

$$NUM_A^{\text{后}} = NUM_B^{\text{后}}$$

国寿养老 A 份额持有人新增的场内国寿养老份额的份额数为：

$$NUM_{\text{基础}}^{\text{a, 新增}} = \frac{NUM_A^{\text{前}} \times NAV_A^{\text{前}} - NUM_A^{\text{后}} \times 1.000}{1.000}$$

$NUM_a^{\text{前}}$ ：不定期份额折算前国寿养老 A 份额的份额数，

$NUM_a^{\text{后}}$ ：不定期份额折算后国寿养老 A 份额的份额数，

$NAV_A^{\text{前}}$ ：不定期份额折算前国寿养老 A 份额的基金份额参考净值。

## 3、国寿养老份额

$$NUM_{\text{基础}}^{\text{后}} = \frac{NAV_{\text{基础}}^{\text{前}} \times NUM_{\text{基础}}^{\text{前}}}{1.000}$$

$NUM_{\text{基础}}^{\text{前}}$ ：国寿养老份额持有人持有的不定期份额折算前的国寿养老份额的份额数，

$NUM_{\text{基础}}^{\text{后}}$ ：国寿养老份额持有人持有的不定期份额折算后的国寿养老份额的份额数，

$NAV_{\text{基础}}^{\text{前}}$ ：不定期份额折算前国寿养老份额的基金份额净值。

## 4、不定期份额折算后国寿养老份额的总份额数

不定期份额折算后国寿养老份额的总份额数=国寿养老份额持有人持有的不定期份额折算后的国寿养老份额的份额数+国寿养老A份额持有人新增的场内国寿养老份额数

## 四、折算份额数的处理方式

不定期份额折算后，场外国寿养老份额的份额数采用四舍五入的方式保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金资产；场内国寿养老份额的份额数取整计算（最小单位为1份），余额计入基金资产。

按照上述折算和计算方法，可能会给基金份额持有人的资产净值造成微小误差，视为未改变基金份额持有人的资产净值。

## 五、不定期份额折算示例

设在本基金的不定期份额折算日，国寿养老份额的基金份额净值、国寿养老A份额与国寿养老B份额的基金份额参考净值如下表所示，折算后，国寿养老份额的基金份额净值、国寿养老A份额、国寿养老B份额的基金份额参考净值均调整为1.000元，则各持有国寿养老份额、国寿养老A份额、国寿养老B份额10,000份的基金份额持有人所持基金份额的变化如下表所示：

	折算前		折算后	
	份额净值/ 份额参考净值	份额数	份额净值/ 份额参考净值	份额数
国寿养老份额	0.617 元	10,000 份	1.000 元	6,170 份国寿养老份额
国寿养老 A 份额	1.028 元	10,000 份	1.000 元	2,060 份国寿养老 A 份额+8,220 份国寿养老份额
国寿养老 B 份额	0.206 元	10,000 份	1.000 元	2,060 份国寿养老 B 份额

#### 六、基金份额折算期间的基金业务办理

(一) 不定期份额折算基准日(即2018年08月20日)，本基金暂停办理申购、赎回、转换、定期定额投资、转托管(包括系统内转托管、跨系统转托管，下同)、配对转换业务。养老A、养老B将于2018年08月20日上午开市至10:30停牌，并于2018年08月20日上午10:30复牌。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) 不定期份额折算基准日后的第一个工作日(即2018年08月21日)，本基金暂停办理申购、赎回、转换、定期定额投资、转托管、配对转换业务，养老A、养老B暂停交易。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) 不定期份额折算基准日后的第二个工作日(即2018年08月22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、定期定额投资、转托管、配对转换业务。养老A份额、养老B份额将于2018年08月22日上午开市复牌。

(四) 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》，2018年08月22日养老A、养老B即时行情显示的前收盘价为2018年08月21日的养老A、养老B的基金份额参考净值(四舍五入至0.001元)，2018年08月22日当日养老A份额和养老B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。

#### 七、重要提示

1、养老A、养老B将于2018年08月20日上午开市至10:30停牌，并于2018年

08月20日上午10:30复牌。养老A、养老B将于2018年08月21日全天停牌，并于2018年08月22日上午开市复牌。

2、2018年08月17日，养老B份额的基金份额参考净值已跌至0.250元以下，而折算基准日为2018年08月20日，因此折算基准日养老B份额的基金份额参考净值与折算条件0.250元可能有一定差异。

3、特别提示：近日养老B份额二级市场交易价格溢价较大，不定期份额折算后，养老B份额的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养老B份额高溢价交易所带来的风险。

4、养老A份额表现为低风险、预期收益相对稳定的特征，但在不定期份额折算后养老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养老A份额变为同时持有较低风险收益特征的养老A份额与较高风险收益特征的国寿养老份额，因此原养老A份额持有人预期收益实现的不确定性将会增加；此外，国寿养老份额为跟踪中证养老产业指数的基础份额，其份额净值将随市场涨跌而变化，因此原养老A份额持有人还可能会承担因市场下跌而遭受损失的风险。

5、养老B份额表现为高风险、高收益预期的特征，不定期份额折算后其杠杆倍数将大幅降低，将恢复到初始的2倍杠杆水平，相应地，养老B份额净值随市场涨跌而增长或者下降的幅度也会大幅减小。

6、原养老A份额持有人可通过办理配对转换业务将此次折算获得的国寿养老场内份额分拆为养老A份额、养老B份额。

7、根据深圳证券交易所的相关业务规则，养老A份额、养老B份额、国寿养老份额的场内份额经折算后的份额数均取整计算（最小单位为1份），舍去部分计入基金财产，持有极小数量养老A份额、养老B份额、国寿养老份额的持有人，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。

8、在二级市场可以做交易的证券公司并不全部具备中国证监会颁发的基金销售资格，而投资者只能通过具备基金销售资格的证券公司赎回基金份额。因此，如果投资者通过不具备基金销售资格的证券公司购买养老A份额，在不定期份额折算后，则折算新增的国寿养老份额无法赎回。投资者可以选择在折算前将养老A份额卖出，或者在折算后将新增的国寿养老份额转托管到具有基金销售资格的证券公司后赎回。

9、投资者若希望了解基金不定期份额折算业务详情，请参阅本基金基金合同及《国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金招募说明书》或者拨打本公司客服电话（4009-258-258）。

10、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。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。

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，选择须谨慎。敬请投资者于投资前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和临时公告。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

国寿安保基金管理有限公司

2018年8月20日