

# 国联安基金管理有限公司关于国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金办理到期份额折算业务的公告

根据《国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金基金合同》(以下简称“《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,国联安双禧中证 100 指数 分级证券投资基金(以下简称“本基金”)将以 2019 年 4 月 15 日为折算日办理基金份额的到期折 算业务。相关事项提示如下:一、基金份额到期折算日 根据《基金合同》的规定,自上一基金份额折算日次日或基金合同生效日始至满三年的最 后工作日止,如果期间每个工作日国联安双禧中证 100 指数 分级证券投资基金之 B 份额(以下简 称“中证 100B 份额”)的份额净值都大于 0.150 元,则最后工作日为基金份额折算日。自本基金《基金合同》生效以来,中证 100B 的份额净值均大于 0.150 元,本基金成立于 2010 年 4 月 16 日,上一次基金份额折算日为 2016 年 4 月 15 日,因此 2019 年 4 月 15 日为本次基金份额折算 日。折算后基金运 作方式及国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金之 A 份额(以下 简称“中 证 100A 份额”)与中证 100B 份额配比保持不变。二、基 金份额到期折算对象 基金份额折算日登记在册的本基金所有份额,即 国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金 之基础份额(场内简称“双 禧 100”,交易代码 162509)、国联安双禧中证 100 指数分级证券投 资

基金之 A 份额 (场内简称“中证 100A”, 交易代码 150012) 以及国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金之 B 份额 (场内简称“中证 100B”, 交易代码 150013)。

三、基金份额到期折算方法 (一) 双禧 100 份额折算

基金份额折算日折算后, 双禧 100 份额的基金份额净值折算调整为 1.000 元。折算后, 双禧 100 份额持有人持有的双禧 100 份额的份额数按照双禧 100 份额折算比例相应增加或缩减。若折算前, 双禧 100 份额净值大于 1.000 元, 则折算后双禧 100 份额持有人持有的双禧 100 份额增加; 若折算前, 双禧 100 份额净值小于或等于 1.000 元, 则折算后双禧 100 份额持有人持有的双禧 100 份额缩减。

双禧 100 份额的折算比例 = 折算日折算前双禧 100 份额的基金份额净值 / 1

双禧 100 份额经折算后的份额数 = 折算前双禧 100 份额的份额数 × 双禧 100 份额的折算比例

双禧 100 份额的场外份额经折算后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财产; 双禧 100 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), 余额计入基金财产。

(二) 中证 100A、中证 100B 份额折算

基金份额折算日折算后, 中证 100A、中证 100B 份额的基金份额净值折算调整为 1.000 元。根据中证 100B 折算日折算前的份额净值, 按照以下两种情况进行基金份额的折算:

- 1、折算日折算前中证 100B 的份额净值大于 1 元

如果中证 100B 份额折算日折算前份额净值大于 1.000 元, 则持有人持有的中证 100A 份额及中

证 100B 份额的数量在折算前后均保持不变，因折算新增的份额将全部折算成双禧 100 份额的场内 份额。 中证 100A 份额 ( 或中证 100B 份 额 ) 的折算比例 = 折算日折算前中证 100A 份额 ( 或中证 100B 份 额 ) 的基金份额净值 / 1 中证 100A 份额 ( 或中证 100B 份 额 ) 新增份额折 算成双禧 100 份额的场内份额 = 折算前中证 100A 份额 ( 或中证 100B 份 额 ) 的份额数 × [ 中证 100A 份额 ( 或中证 100B 份 额 ) 的折算比例 - 1 ] 折算后中证 100A 份 额 ( 或中证 100B 份 额 ) 的份额数 = 中证 100A 份 额 ( 或中证 100B 份 额 ) 折 算前的份额数 中证 100A 份 额 ( 或 中证 100B 份 额 ) 折算成双禧 100 份额的场内份额取整计算 ( 最小单位 为 1 份 ) , 余额计入基金财产。

2、折算日折算前中证 100B 的份额净 值小于或等于 1 元 如果中证 100B 份 额折算日折算前的基金份额净值 小于或等于 1.000 元 , 则中证 100B 份 额持有 人持有的中证 100B 份 额数按照中证 100B 份 额的折算比例相应缩减。为保持中证 100A 和中 证 100B 份 额数比率 4 :6 不变 , 中证 100A 份 额的折算比例与中证 100B 份 额的折算比例相同 , 中证 100A 份 额持有 人持有的中证 100A 份 额 数同比例相应缩减 , 超出份额数将全部折算成双禧 100 份 额的场内 份 额。 中证 100B 份 额的折算比例 = 折算日折算前中证 100B 份 额的基 金份额净值 / 1 中证 100B 份 额经折算后的份额数 = 折算前中证 100B 份 额的份额数 × 中证 100B 份 额的折算比 例 中证 100A 份 额的折算比 例 = 折算日折算前中证 100B 份 额的基金份额净值 / 1 中证 100A 份 额经 折算后的份额数 = 折算前中证 100A 份 额的份额数 × 中证 100A 份 额的 折算比 例 中证 100A 份 额超出份额折算成双禧 100 份 额的场内份 额 =

折算前中证 100A 份额的份额数 $\times$ （折算日折算前中证 100A 份额的基金份额净值—折算日折算前中证 100B 份额的基金份额净值） 中证 100A 和中证 100B 份额经折算后的份额数取整计算(最小单位为 1 份) , 余额计入基金财产。中证 100A 份额折算成双禧 100 份额的场内份额取整计算(最小单位为 1 份), 余额计入基金财产。 (三) 折算后双禧 100 份额的总份额数 折算后双禧 100 份额的总份额数 = 双禧 100 份额经折算后的份额数 + 中证 100A 份额折算成双禧 100 份额的场内份额 + 中证 100B 份额折算成双禧 100 份额的场内份额

四、基金份额折算期间的基金业务办理 (一) 基金份额到期折算日(即 2019 年 4 月 15 日), 本基金暂停办理申购(含定期定额投资, 下同)、赎回、转托管(包括系统内转托管和跨系统转托管, 下同)及份额配对转换业务; 中证 100A 与中证 100B 份额正常交易。2019 年 4 月 15 日晚间, 本基金管理人计算当日基金份额净值及份额折算比例。(二) 基金份额到期折算日后的第一个工作日(即 2019 年 4 月 16 日), 本基金暂停办理申购、赎回、转托管及份额配对转换业务, 中证 100A 与中证 100B 份额暂停交易。当日, 本基金注册登记人及本基金管理人为持有人办理份额登记确认。(三) 基金份额到期折算日后的第二个工作日(即 2019 年 4 月 17 日), 本基金管理人将公告

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、转托管及份额配对转换业务。中证 100A 与中证 100B 份额于当天恢复交易。

五、重要提示（一）根据深圳证券交易所《深圳证券交易所证券投资基金交易和申购赎回实施细则》，2019 年 4 月 17 日中证 100A 和中证 100B 份额即时行情显示的前收盘价为 2019 年 4 月 16 日的中证 100A 和中证 100B 份额的份额净值（四舍五入至 0.001 元）。由于中证 100A 或中证 100B 份额折算前存在折溢价交易情形，折算前中证 100A 份额的收盘价扣除约定收益后与 2019 年 4 月 17 日中证 100A 份额的前收盘价可能有较大差异，折算前中证 100B 份额扣除份额净值相对面值的已实现收益或加计份额净值相对面值的损失后与 2019 年 4 月 17 日中证 100B 份额的前收盘价可能有较大差异，2019 年 4 月 17 日当日中证 100A 与中证 100B 份额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。（二）本基金中证 100A 份额期末的约定应得收益将折算为场内双禧 100 份额分配给中证 100A 份额的持有人，而双禧 100 份额为跟踪中证 100 指数的基础份额，其份额净值将随市场涨跌而变化，因此中证 100A 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。（三）由于中证 100A 份额经折算产生的新增场内双禧 100 份额数、中证 100B 份额经折算产生的新增场内双禧 100 份额数（若折算日折算前中证 100B 的份额净值大于 1 元）和场内双禧 100 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，持有极小数量中证 100A 份额、中证 100B 份额或场内

双禧 100 份额的持有人存在无法获得新增场内双禧 100 份额的可能性。

(四) 投资者若希望了解本基金份额到期折算业务详情, 请登陆本基金管理人网站: [www.cpicfunds.com](http://www.cpicfunds.com) 或者拨打本基金管理人客户服务热线: 400-7000-365 (免长途话费) 021-38784766。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财产, 但不保证基金一定盈利, 也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险, 敬请投资人认真阅读基金的相关法律文件, 并选择适合自身风险承受能力的投资品种进行投资。特此公告。国联安基金管理有限公司 二〇一九年四月十日

