

# 关于国金上证 50 指数分级证券投资基金

## 办理不定期份额折算业务的公告

根据《国金上证 50 指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）第二十一部分“基金份额折算”的相关规定，当国金上证 50 指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）的基础份额（基金代码：502020，以下简称“国金上证 50 份额”，场内简称“国金 50”）的基金份额净值大于或等于 1.500 元时，本基金将进行不定期份额折算。

截至 2017 年 11 月 9 日，国金上证 50 份额的基金份额净值为 1.501 元，达到本基金基金合同规定的不定期份额折算条件。根据本基金基金合同以及上海证券交易所、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 2017 年 11 月 10 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 2017 年 11 月 10 日。

### 二、基金份额折算对象

基金不定期份额折算基准日登记在册的本基金的稳健收益类份额（基金代码：502021，以下简称“国金上证 50A 份额”，场内简称“国金 50A”）、积极收益类份额（基金代码：502022，以下简称“国金上证 50B 份额”，场内简称“国金 50B”）和国金上证 50 份额。

### 三、不定期份额折算方式

当国金上证 50 份额的基金份额净值大于或等于 1.500 元时，本基金在根据市场情况确定份额折算基准日后将分别对国金上证 50A 份额、国金上证 50B 份额和国金上证 50 份额进行不定期份额折算，份额折算后本基金将确保国金上证 50A 份额和国金上证 50B 份额的比例为 1：1，份额折算后国金上证 50A 份额、国金上证 50B 份额和国金上证 50 份额的基金份额净值均调整为 1.000 元。

国金上证 50A 份额、国金上证 50B 份额、国金上证 50 份额三类份额按照如下公式进行份额折算：

#### 1、国金上证 50A 份额

份额折算原则：

(1) 份额折算前国金上证 50A 份额的份额数与份额折算后国金上证 50A 份额的份额数相等；

(2) 份额折算前国金上证 50A 份额的资产净值与份额折算后国金上证 50A 份额的资产净值及其新增场内国金上证 50 份额的资产净值之和相等；

(3) 份额折算前国金上证 50A 份额的持有人在份额折算后将持有国金上证 50A 份额与新增场内国金上证 50 份额，国金上证 50A 份额持有人份额折算后获得新增的场内国金上证 50 份额数，即在份额折算基准日国金上证 50A 份额参考净值超出 1.000 元的部分全部折算为场内国金上证 50 份额；

$$NUM_{50A}^{\text{后}} = NUM_{50A}^{\text{前}}$$

国金上证 50A 份额持有人新增的场内国金上证 50 份额的份额数=

$$\frac{NUM_{50A}^{\text{前}} \times (NAV_{50A}^{\text{前}} - 1.000)}{1.000}$$

其中：

$NAV_{50A}^{\text{前}}$ ：不定期份额折算前国金上证 50A 份额参考净值

$NUM_{50A}^{\text{前}}$ ：不定期份额折算前国金上证 50A 份额的份额数

$NUM_{50A}^{\text{后}}$ ：不定期份额折算后国金上证 50A 份额的份额数

## 2、国金上证 50B 份额

份额折算原则：

(1) 份额折算前国金上证 50B 份额的份额数与份额折算后国金上证 50B 份额的份额数相等；

(2) 份额折算前国金上证 50B 份额的资产净值与份额折算后国金上证 50B 份额的资产净值及其新增场内国金上证 50 份额的资产净值之和相等；

(3) 份额折算前国金上证 50B 份额的持有人在份额折算后将持有国金上证 50B 份额与新增场内国金上证 50 份额，国金上证 50B 份额持有人份额折算后获得新增的场内国金上证 50 份额数，即在份额折算基准日国金上证 50B 份额参考

净值超出 1.000 元的部分全部折算为场内国金上证 50 份额；

$$NUM_{50B}^{\text{后}} = NUM_{50B}^{\text{前}}$$

国金上证 50B 份额持有人新增的场内国金上证 50 份额的份额数=

$$\frac{NUM_{50B}^{\text{前}} \times (NAV_{50B}^{\text{前}} - 1.000)}{1.000}$$

其中：

$NAV_{50B}^{\text{前}}$ ：不定期份额折算前国金上证 50B 份额参考净值

$NUM_{50B}^{\text{前}}$ ：不定期份额折算前国金上证 50B 份额的份额数

$NUM_{50B}^{\text{后}}$ ：不定期份额折算后国金上证 50B 份额的份额数

### 3、国金上证 50 份额

份额折算原则：

场外国金上证 50 份额持有人在份额折算后获得新增场外国金上证 50 份额，场内国金上证 50 份额持有人在份额折算后获得新增场内国金上证 50 份额。

$$NUM_{50}^{\text{后}} = \frac{NAV_{50}^{\text{前}} \times NUM_{50}^{\text{前}}}{1.000}$$

其中：

$NAV_{50}^{\text{前}}$ ：不定期份额折算前国金上证 50 份额的份额净值

$NUM_{50}^{\text{前}}$ ：不定期份额折算前国金上证 50 份额的份额数

$NUM_{50}^{\text{后}}$ ：不定期份额折算后国金上证 50 份额的份额数

场外份额经折算后的份额数采用截位法保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产；场内份额折算过程中产生的不足 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，由中国证券登记结算有限责

任公司上海分公司证券登记系统随机排列。中国证券登记结算有限责任公司上海分公司证券登记系统按照排列顺序，依次登记为 1 份，直至完成全部折算。

**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。**

在实施不定期份额折算时，折算基准日折算前国金上证 50 份额的基金份额净值以及国金上证 50A 份额和国金上证 50B 份额参考净值等具体见基金管理人届时发布的相关公告。

#### 四、基金份额折算期间的基金业务办理

1、不定期份额折算基准日（即 2017 年 11 月 10 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、跨系统转托管，下同）、配对转换业务；国金上证 50 份额、国金上证 50A 份额及国金上证 50B 份额正常交易；基准日日终，基金管理人将计算基金份额净值及份额折算比例。

2、不定期份额折算基准日后的第一个交易日（即 2017 年 11 月 13 日），本基金将暂停办理申购、赎回、转托管、配对转换业务；国金上证 50 份额、国金上证 50A 份额和国金上证 50B 份额将于该日停牌一天；本基金注册登记机构及基金管理人将完成份额折算。

3、不定期份额折算基准日后的第二个交易日（即 2017 年 11 月 14 日），基金管理人将公告份额折算确认结果，基金份额持有人可以查询其账户内的基金份额；国金上证 50 份额、国金上证 50A 份额和国金上证 50B 份额将于该日上午开市起复牌；自该日起，本基金恢复办理申购、赎回、转托管、配对转换业务。

4、2017 年 11 月 14 日国金上证 50 份额、国金上证 50A 份额和国金上证 50B 份额即时行情显示的前收盘价为 2017 年 11 月 13 日的国金上证 50A 份额和国金上证 50B 份额的基金份额参考净值。**2017 年 11 月 14 日当日国金上证 50 份额、国金上证 50A 份额、国金上证 50B 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。**

#### 五、重要提示

1、本基金国金上证 50A 份额具有低预期风险、预期收益相对稳定的特征，但在不定期份额折算后，原国金上证 50A 份额持有人将持有国金上证 50A 份额和国金上证 50 份额，由持有单一的具有低预期风险、预期收益相对稳定的

份额变为同时持有具有低预期风险、预期收益相对稳定的份额及具有与标的指数及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征的国金上证 50 份额，风险收益特征将发生变化，预期收益实现的不确定性将会增加；此外，国金上证 50 份额净值将随市场涨跌而变化，因此原国金上证 50A 份额持有人还可能会承担因市场下跌而遭受损失的风险。

2、国金上证 50B 份额具有高预期风险、高预期收益的特征，但在不定期份额折算后，原国金上证 50B 份额持有人将同时持有高预期风险、高预期收益的特征的国金上证 50B 份额及具有与标的指数及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征的基金份额国金上证 50 份额，风险收益特征将发生变化，且折算后其杠杆倍数将大幅提升，由目前的杠杆恢复到初始的 2 倍杠杆水平。相应地，国金上证 50B 份额的基金份额参考净值随市场涨跌而增长或者下降的幅度也会增加。

3、由于国金上证 50 份额、国金上证 50A 份额和国金上证 50B 份额折算前可能存在折溢价交易情形，不定期份额折算后，国金上证 50 份额、国金上证 50A 份额和国金上证 50B 份额折溢价水平可能发生变化。特提请参与二级市场交易的投资者注意投资风险。

4、原国金上证 50A 份额和国金上证 50B 份额持有人可通过办理配对转换业务将此次折算获得的场内国金上证 50 份额分拆为国金上证 50A 份额和国金上证 50B 份额。

5、此次基金份额折算基准日不是触发折算阈值当日，折算基准日的国金上证 50 份额净值与不定期折算阈值 1.500 元可能有一定差异。

6、根据上海证券交易所的相关业务规则，场内的国金上证 50 份额、国金上证 50A 份额、国金上证 50B 份额折算后的份额数取整计算（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，依次登记为 1 份，直至完成全部折算。

7、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知晓基金投资的“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。敬请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。

特此公告。

国金基金管理有限公司

2017年11月10日