

建信央视财经 50 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《建信央视财经 50 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，建信央视财经 50 指数分级发起式证券投资基金（简称“本基金”）将在 2018 年 1 月 2 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第一个工作日。本次定期份额折算的基准日为 2018 年 1 月 2 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央视 50A 份额（场内简称：建信 50A；代码：150123）、建信央视 50 基金份额（场内简称：建信 50；代码：165312）。

三、基金份额折算方式

建信央视 50A 份额（场内简称：建信 50A；代码：150123）和建信央视 50B 份额（场内简称：建信 50B；代码：150124）按照《基金合同》规定的净值计算规则进行净值计算，对建信央视 50A 份额的应得收益进行定期份额折算，每 2 份建信央视 50 基金份额将按 1 份建信央视 50A 份额获得约定应得收益的新增折算份额。

对于建信央视 50A 份额期末的约定应得收益，即建信央视 50A 份额每个会计年度 12 月 31 日份额净值超出本金 1.0000 元部分，将折算为场内建信央视 50 份额分配给建信央视 50A 份额持有人。建信央视 50 份额持有人持有的每 2 份建信央视 50 份额将按 1 份建信央视 50A 份额获得新增建信央视财经 50 份额的分配。持有场外建信央视 50 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央视 50 份额的分配；持有场内建信央视 50 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央视 50 份额的分配。经过上述份额折算，建信央

视 50A 份额的参考净值和建信央视 50 份额的基金份额净值将相应调整。

每个会计年度第一个工作日为基金份额折算基准日，本基金将对建信央视 50A 份额和建信央视 50 份额进行应得收益的定期份额折算。

每个会计年度第一个工作日进行建信央视 50A 份额上一年度应得收益的定期份额折算时，有关计算公式如下：

(1) 建信央视 50A 份额

定期份额折算后建信央视 50A 份额的份额数 = 定期份额折算前建信央视 50A 份额的份额数

$$NAV_{\text{央视50}}^{\text{后}} = \frac{\text{折算前建信央视50的资产净值} - (\text{每份建信央视50A份额期末资产参考净值} - 1.0000) \times \text{NUM}_{\text{央视50}}^{\text{前}}}{\text{NUM}_{\text{央视50}}^{\text{前}}}$$

建信央视 50A 份额持有人新增的场内建信央视 50 份额的份额数=

$$\frac{\text{NUM}_{\text{央视50A}}^{\text{前}} \times (\text{每份建信央视50A份额期末资产参考净值} - 1.0000)}{NAV_{\text{央视50}}^{\text{后}}}$$

其中：

$NAV_{\text{央视50}}^{\text{后}}$ ：定期份额折算后建信央视 50 份额净值

$NUM_{\text{央视50}}^{\text{前}}$ ：定期份额折算前建信央视 50 份额的份额数

$NUM_{\text{央视50A}}^{\text{前}}$ ：定期份额折算前建信央视 50A 份额的份额数

(2) 建信央视 50B 份额

每个会计年度的定期份额折算不改变建信央视 50B 份额参考净值及其份额数。

(3) 建信央视 50 份额

$$NAV_{\text{央视50}}^{\text{后}} = \frac{\text{折算前建信央视50份额的资产净值} - (\text{每份建信央视50A份额期末资产参考净值} - 1.0000) \times \text{NUM}_{\text{央视50}}^{\text{前}}}{\text{NUM}_{\text{央视50}}^{\text{前}}}$$

建信央视 50 份额持有人新增的建信央视 50 份额=

$$\frac{NUM_{\text{央视50}}^{\text{前}}}{2} \times \frac{\text{每份建信央视50A份额期末资产参考净值}-1.0000}{NAV_{\text{央视50}}^{\text{后}}}$$

建信央视 50 份额持有人定期份额折算后持有的建信央视 50 份额的份额数 = 定期份额折算前建信央视 50 份额的份额数 + 建信央视 50 份额持有人新增的建信央视 50 份额的份额数

其中：

$NAV_{\text{央视50}}^{\text{后}}$ ：定期份额折算后建信央视 50 份额净值

$NUM_{\text{央视50}}^{\text{前}}$ ：定期份额折算前建信央视 50 份额的份额数

建信央视 50 份额的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；建信央视 50 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。

在实施基金份额折算时，折算日折算前建信央视 50 份额的基金份额净值、建信央视 50A 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）举例：

假设本基金成立后第 5 个会计年度第一个工作日为定期份额折算基准日，建信央视 50 份额当天折算前资产净值为 12,690,000,000 元。当天场外建信央视 50 份额、场内建信央视 50 份额、建信央视 50A 份额、建信央视 50B 份额的份额数分别为 100 亿份、10 亿份、30 亿份、30 亿份。前一个会计年度末每份建信央视 50A 份额资产净值为 1.0775 元，且未进行不定期份额折算。

1) 定期份额折算的对象为基准日登记在册的建信央视 50A 份额和建信央视 50 份额，即 30 亿份和 110 亿份。

2) 建信央视 50A 份额持有人

折算后持有建信央视 50A 份额=折算前建信央视 50A 份额=30 亿份

$$NAV_{\text{央视50}}^{\text{后}} = \frac{\text{折算前建信央视50份额的资产净值} - (\text{每份建信央视50A份额期末资产参考净值}-1.0000) \times NUM_{\text{央视50}}^{\text{前}}}{NUM_{\text{央视50}}^{\text{前}}}$$

$$=[12,690,000,000-(1.0775-1.0000)/2 \times 11,000,000,000]/11,000,000,000$$

$$=1.1149 \text{ 元}$$

新增的场内建信央视 50 份额的份额数=

$$\frac{\text{NUM}_{\text{央视50A}}^{\text{前}} \times (\text{每份建信央视50A份额期末资产参考净值}-1.0000)}{\text{NAV}_{\text{央视50}}^{\text{后}}}$$

$$=3,000,000,000 \times (1.0775-1.0000) / 1.1149=208,538,882.41 \text{ 份}$$

建信央视 50A 份额新增份额折算成建信央视 50 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，因此新增建信央视 50 份额为 208,538,882 份；持有的建信央视 50A 份额为 30 亿份。

3) 建信央视 50 份额持有人

场外建信央视 50 份额持有人新增的建信央视 50 份额

$$= \frac{\text{NUM}_{\text{央视50}}^{\text{前}}}{2} \times \frac{\text{每份建信央视50A份额期末资产参考净值}-1.0000}{\text{NAV}_{\text{央视50}}^{\text{后}}}$$

$$=10,000,000,000/2 \times (1.0775-1.0000)/1.1149=347,564,804.02 \text{ 份}$$

场外建信央视 50 份额持有人定期份额折算后持有的建信央视 50 份额的份额数=定期份额折算前场外建信央视 50 份额的份额数+场外建信央视 50 份额持有人新增的建信央视 50 份额的份额数

$$=10,000,000,000+347,564,804.02=10,347,564,804.02 \text{ 份}$$

场内建信央视 50 份额持有人新增的建信央视 50 份额

$$= \frac{\text{NUM}_{\text{央视50}}^{\text{前}}}{2} \times \frac{\text{每份建信央视50A份额期末资产参考净值}-1.0000}{\text{NAV}_{\text{央视50}}^{\text{后}}}$$

$$=1,000,000,000/2 \times (1.0775-1.0000)/1.1149=34,756,480.40 \text{ , 取整后为 } 34,756,480 \text{ 份}$$

场内建信央视 50 份额持有人定期份额折算后持有的建信央视 50 份额的份额数=定期份额折算前场内建信央视 50 份额的份额数+场内建信央视 50 份额持有人新增的建信央视 50 份额的份额数=1,000,000,000+34,756,480=1,034,756,480 份

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 2018 年 1 月 2 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，建信央视 50A、建信央视 50B 正常交易。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 2018 年 1 月 3 日），本基金暂停办理申购、赎回、转托管、配对转换业务，且建信央视 50A 暂停交易，建信央视 50B 正常交易。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）定期份额折算基准日后的第二个工作日（即 2018 年 1 月 4 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，建信央视 50A 开市起恢复交易，建信央视 50B 正常交易。

（四）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》，2018 年 1 月 4 日建信央视 50A 即时行情显示的前收盘价调整为基金管理人 2018 年 1 月 3 日向深圳证券交易所提供的基金份额净值或者参考净值（四舍五入至 0.001 元）。由于建信央视 50A 折算前可能存在折溢价交易情形，且建信央视 50A 份额折算后恢复交易首日的收盘价以基金管理人最近公布并向深圳证券交易所提供的基金份额净值或者参考净值为准，因此，建信央视 50A 份额折算后恢复交易首日的收盘价与份额折算前的收盘价格可能发生较大变化。

五、重要提示

由于建信央视 50A 份额新增份额折算成建信央视 50 基金份额的场内份额数和建信央视 50 基金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，持有较少建信央视 50A 份额数或场内建信央视 50 基金份额数的份额持有人存在无法获得新增场内建信央视 50 基金份额的可能性。

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）。

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

2017 年 12 月 27 日