

万家基金管理有限公司关于万家中证创业成长指数分级证券投资基金办理不定期份额折算业务及折算期间暂停办理申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告

根据《万家中证创业成长指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）对于基金份额折算业务的约定，分级运作期内，当万家中证创业成长指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）之基础份额（即万家创业成长份额）的基金份额净值大于或等于 2.000 元时，本基金将进行不定期份额折算。

截至 2015 年 5 月 21 日日终，万家创业成长份额的基金份额净值为 2.0362 元，达到上述办理不定期份额折算业务的条件。根据《基金合同》的约定，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 2015 年 5 月 22 日作为基金份额折算基准日，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 2015 年 5 月 22 日。

二、基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的万家创业成长 A 份额（场内简称“万家创 A”，基金代码 150090）、万家创业成长 B 份额（场内简称“万家创 B”，基金代码 150091）与万家创业成长份额（场内简称“万家中创”，基金代码 161910，包括万家中创场内份额及万家中创场外份额）。

三、基金份额折算方式

当万家创业成长份额的基金份额净值大于或等于 2.000 元后，本基金将在基金份额折算日分别对万家创业成长 A 份额、万家创业成长 B 份额和万家创业成长份额进行份额折算，份额折算后万家创业成长 A 份额和万家创业成长 B 份额的比例仍保持 1：1 不变。份额折算后万家创业成长 A 份额、万家创业成长 B 份

额的基金份额参考净值和万家创业成长份额的基金份额净值均调整为 1.000 元。基金份额折算日折算前万家创业成长 A 份额、万家创业成长 B 份额的基金份额参考净值和万家创业成长份额的基金份额净值超出 1.000 元的部分均折算为万家创业成长份额分配给基金份额持有人。

份额折算公式如下：

1) 万家创业成长 A 份额

份额折算前后万家创业成长 A 份额的份额数保持不变，即： $NUM_A^{\text{后}} = NUM_A^{\text{前}}$

万家创业成长 A 份额持有人份额折算后新增的场内万家创业成长份额数= $[NUM_A^{\text{前}} \times (NAV_A^{\text{前}} - 1.000)] / 1.000$ ，即超出 1 元以上的净值部分全部折算为场内万家创业成长份额。

其中：

$NAV_A^{\text{前}}$ ：份额折算前万家创业成长 A 份额参考净值

$NUM_A^{\text{前}}$ ：份额折算前万家创业成长 A 份额的份额数

$NUM_A^{\text{后}}$ ：份额折算后万家创业成长 A 份额的份额数

万家创业成长 A 份额折算成万家创业成长份额的场内份额采用截位方法保留到整数位（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。

2) 万家创业成长 B 份额

份额折算前后万家创业成长 B 份额份额数保持不变，即： $NUM_B^{\text{后}} = NUM_B^{\text{前}}$ ；

万家创业成长 B 份额的基金份额持有人在份额折算后新增的场内万家创业成长份额数= $[NUM_B^{\text{前}} \times (NAV_B^{\text{前}} - 1.000)] / 1.000$ ，即超出 1 元以上的净值部分全部折算为场内万家创业成长份额。

其中：

$NAV_B^{\text{前}}$ ：份额折算前万家创业成长 B 份额参考净值

$NUM_B^{\text{前}}$ ：份额折算前万家创业成长 B 份额的份额数

$NUM_B^{\text{后}}$ ：份额折算后万家创业成长 B 份额的份额数

万家创业成长 B 份额折算成万家创业成长份额的场内份额采用截位方法保

留到整数位（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。

3) 万家创业成长份额

场外万家创业成长份额持有人份额折算后获得新增场外万家创业成长份额，场内万家创业成长份额持有人份额折算后获得新增场内万家创业成长份额。

万家创业成长份额的基金份额持有人在份额折算后新增的万家创业成长份额数=
$$[NUM_{\text{创业成长}}^{\text{前}} \times (NAV_{\text{创业成长}}^{\text{前}} - 1.000)] / 1.000$$

万家创业成长份额的场外份额经折算后的份额数采用截位方法保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产；万家创业成长份额的场内份额经折算后的份额数采用截位方法保留到整数位（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。

4) 折算后万家创业成长份额的总份额数

折算后万家创业成长份额的总份额数=不定期份额折算前万家创业成长份额的份额数+万家创业成长份额持有人新增的万家创业成长份额数+万家创业成长 A 份额持有人新增的万家创业成长份额数+万家创业成长 B 份额持有人新增的万家创业成长份额数

5) 举例：

假设 T 日万家创业成长份额的基金份额净值为 2.015000000 元，万家创业成长 A 份额的基金份额参考净值为 1.025000000 元，万家创业成长 B 份额的基金份额参考净值为 3.005000000 元，投资者甲持有万家创业成长份额的场内份额 100,000 份，投资者乙持有万家创业成长 A 份额 20,000 份，投资者丙持有万家创业成长 B 份额 8,000 份，若基金管理人决定以该日为份额折算日，则执行此次不定期份额折算后：

万家创业成长份额的基金份额净值、万家创业成长 A 份额和万家创业成长 B 份额的基金份额参考净值均调整为 1.000 元

投资者甲新增的万家创业成长份额数=
$$[100,000 \times (2.015000000 - 1.000)] / 1.000 = 101,500 \text{ 份}$$

投资者乙新增的场内万家创业成长份额数=
$$[20,000 \times (1.025000000 - 1.000)] / 1.000 = 500 \text{ 份}$$

投资者丙新增的场内万家创业成长份额数=
$$[8,000 \times (3.005000000 - 1.000)] / 1.000 = 16,040 \text{ 份}$$

即：份额折算后，投资者甲共持有万家创业成长份额的场内份额 201,500 份，投资者乙共持有万家创业成长 A 份额 20,000 份及万家创业成长份额的场内份额 500 份，投资者丙共持有万家创业成长 B 份额 8,000 份及万家创业成长份额的场内份额 16,040 份。

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 2015 年 5 月 22 日），本基金暂停办理申购（含定期定额投资，下同）、赎回、转换、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；万家创业成长 B 份额、万家创业成长 A 份额正常交易；折算基准日日终，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工作日（即 2015 年 5 月 25 日），本基金将暂停办理申购、赎回、转换、转托管、配对转换业务；万家创业成长 B 份额、万家创业成长 A 份额将于该日停牌一天；登记结算机构及基金管理人将完成份额登记确认。

3、不定期份额折算日后的第二个工作日（即 2015 年 5 月 26 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；万家创业成长 B 份额、万家创业成长 A 份额将于该日上午 9:30-10:30 停牌一小时，并于上午 10:30 之后复牌；自该日起，本基金恢复办理申购、赎回、转换、转托管、配对转换业务。

4、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》，2015 年 5 月 26 日万家创业成长 B 份额、万家创业成长 A 份额即时行情显示的前收盘价为 2015 年 5 月 25 日的万家创业成长 B 类份额、万家创业成长 A 份额的基金份额参考净值（四舍五入至 0.001 元）。

5、2015 年 5 月 26 日万家创业成长 B 份额、万家创业成长 A 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、相对于万家创业成长份额，万家创业成长 A 份额为预期风险、收益相对较低的子份额。在不定期份额折算后，原万家创业成长 A 份额份额持有人将同时

持有万家创业成长 A 份额和万家创业成长份额，由持有单一的较低风险收益特征份额变为同时持有较低风险收益特征份额与较高风险收益特征份额的情况，风险收益特征将发生较大变化，实现预期收益的不确定性将会增加；此外，万家创业成长份额为跟踪中证创业成长指数的基金份额，其份额净值将随市场涨跌而变化，因此原万家创业成长 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。

2、相对于万家创业成长份额，万家创业成长 B 份额为预期风险、收益相对较高的子份额，但在不定期份额折算后，原万家创业成长 B 份额持有人将同时持有万家创业成长 B 份额与万家创业成长份额，由持有单一的高风险收益特征份额变为同时持有高风险收益特征份额与较高风险收益特征份额的情况，风险收益特征将发生较大变化，且折算后其杠杆倍数将恢复到初始杠杆水平，高于折算前的杠杆倍数，相应地，万家创业成长 B 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大幅增加。

3、由于万家创业成长 A 份额、万家创业成长 B 份额折算前可能存在折溢价交易情形。不定期份额折算后，万家创业成长 A 份额、万家创业成长 B 份额的折溢价率可能发生较大变化。提请参与二级市场交易的投资者注意与万家创业成长 A 份额、万家创业成长 B 份额的折溢价变化相关的风险。

4、原万家创业成长 A 份额和万家创业成长 B 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万家创业成长份额分拆为万家创业成长 A 份额和万家创业成长 B 份额。

5、折算后，本基金万家创业成长份额的份额数量会增加。根据深圳证券交易所的相关业务规则，场内份额数将取整计算（最小单位为 1 份），舍去部分计入基金资产，持有极小数量万家创业成长 A 份额、万家创业成长 B 份额和场内万家创业成长份额的持有人，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。

6、此次基金份额折算日不是触发折算阈值当日，折算基准日万家创业成长份额的净值可能与触发折算的阈值（2.000 元）有一定差异。

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。

万家基金管理有限公司

2015 年 5 月 22 日