

(上接C005版)

基金管理人并不承诺或保证封闭期满时估值优先持有人的约定应得收益,即在封闭期末本基金资产出现极端损失情况下,估值优先可能低于无法取得约定应得收益乃至投资本金受损的风险。

在封闭期内本基金不对估值优先和估值进取基金份额进行收益分配,对投资者认购或上市交易购买并持有到期的同一份估值优先和估值进取基金份额,在本基金封闭期届满后,按照《基金合同》所约定的资产收益分配原则分别计算估值优先和估值进取份额,并以各自份额净值为基础,按照本基金的基金份额净值(NAV)为同一上市开放式基金(LOF)的份额,以在基金转换运作方式的同时实现基金份额持有人的资产收益分配。

(三)本基金基金份额的计算

本基金在封闭期及封闭期满转为上市开放式(LOF)基金后,均依据以下公式计算T日基金份额净值:

T日基金份额净值= T日闭市后的基金资产净值/T日基金份额的余额数

封闭期内,本基金份额的余额数为估值优先和估值进取份额的份额总额;封闭期满转为上市开放式(LOF)基金后,T日基金份额的余额数为T日LOF基金份额总额。基金份额净值的计算,保留到小数点后位,小数点后4位四舍五入,由此产生的误差计入基金份额。

T日的基金份额净值在当天收市后计算,并在T+1日内公告。如遇特殊情况,经中国证监会同意,可适当延迟计算或公告。

(四)估值优先和估值进取在封闭期的基金份额净值计算

按照上述基金资产及收益分配规则,在封闭期对估值优先和估值进取单独进行基金份额净值计算,并按各自的基金份额净值进行资产分配及份额转换。

假设NAV为本基金在封闭期截止当日基金份额净值,NAV0为封闭期截止当日T估值优先基金份额净值,NAV1为封闭期截止当日T估值优先基金份额净值。

5.7%。封闭期截止当日T的估值优先和估值进取基金份额净值计算公式如下:

(1)当NAV<0.86时,则估值优先和估值进取截至封闭期末当日T基金份额净值:

NAV0+NAV0*0.5;

(2)当0.86≤NAV≤1.60时,则估值优先和估值进取截至封闭期末当日T基金份额净值:

NAV0+1.3*RA*0.5;

(3)当NAV>1.60时,则估值优先和估值进取截至封闭期末当日T基金份额净值:

NAV0+1.3*RA+0.5*(NAV-1.60)*0.5;

NAVb=(NAV-1.60)*0.5;

在封闭期计算估值优先和估值进取份额净值时,各自保留小数点后8位,小数点后第9位四舍五入,由此产生的误差计入基金份额,并由基金管理人通过基金份额净值公告对账单向客户对账进行调整。

(五)估值优先和估值进取在封闭期的基金份额净值的计算

基金管理人在基金份额净值计算的基础上,采用“虚拟清算”原则计算并公告估值优先和估值进取基金份额参考净值。封闭期内的基金份额参考净值是对两类基金份额价值的一个估算,并不代表基金份额持有人可以获得的实际价值。

估值优先和估值进取基金份额参考净值在当天收市后计算,并在T+1日内与本基金基金份额净值计算一致。

如遇特殊情况,经中国证监会同意,可以适当延迟计算或公告。

第30日为基金份额参考净值日,NAV为本基金在封闭期内第T日基金份额净值;NAV0为封闭期内第T日估值优先基金份额参考净值;NAV1为封闭期截止当日T估值优先基金份额参考净值;估值优先和估值进取在封闭期内每天天数设定为T=y1*1.3+T1+T2+T3天(T的值等于365+365+365=1095+365+365=1090)。

在封闭期内,基金管理人可根据基金运作的实际运作情况对估值优先和估值进取基金份额参考净值进行调整,如调整,届时将见更新的基金份额净值公告。

基金管理人公告的基金份额净值计算方法如下:

(1)当NAV<0.5*(1+3*x1*T1)时,则估值优先和估值进取在封闭期内第T日(0<T≤T1)基金份额参考净值:

NAV0+NAV0*0.5;

(2)当0.5*(1+3*x1*T1)≤NAV≤1.60时,则估值优先和估值进取在封闭期内第T日(0<T≤T1)基金份额参考净值:

NAV0+1.3*x1*T1+0.5*(NAV-1.60)*0.5;

NAVb=(NAV-1.60)*0.5;

估值优先和估值进取基金份额参考净值的计算,保留到小数点后3位,小数点后第4位四舍五入。

(六)估值优先和估值进取基金份额净值的转换

本基金封闭期满,本基金所持有的类基金份额将按约定的收益的分配规则进行净值计算,并以各自的份额净值为基础,按照本基金的基金份额净值(NAV)转换为同一上市开放式基金(LOF)的份额,并办理基金的申购、赎回业务。

(七)上市交易的基金份额

《基金合同》生效后,在本基金符合法律法规和深圳证券交易所规定的上市条件的情况下,本基金在封闭期内,基金份额的估值优先和估值进取两类基金份额同时申请上市交易。

在本基金封闭期满,估值优先和估值进取份额分别按照《基金合同》约定及深圳证券交易所规则转换为上市开放式基金(LOF)基金份额,转换后的基金份额继续在深圳证券交易所上市交易。

(八)上市交易的地点

本基金上市交易的地点为深圳证券交易所。

本基金所披露的估值优先和估值进取上市后,登记在证券登记结算系统中的基金份额将通过办理跨系统转托管业务将基金份额登记在证券登记结算系统中,并同时上市交易。

(九)上市交易的时间

在确定上市日期后,基金管理人应依附法律法规规定在指定媒体上刊登基金份额上市交易公告书。

(十)上市交易的规则

本基金在深圳证券交易所的上市交易遵循《上市规则》、《深圳证券交易所交易规则》等有关规定,包括但不限于:

1、本基金在封闭期内所分离的估值优先和估值进取两类基金份额上市首日的开盘参考价为前一交易日类基金份额的参考净值;

2、本基金封闭期满,估值优先和估值进取份额转换为上市开放式基金(LOF)基金份额后,本基金在上市首日的开盘参考价为前一交易日的基金份额净值;

3、本基金实行价格涨跌幅限制,涨跌幅比例为10%,自上市首日实行;

4、本基金买卖申报单数为100份及其整数倍;

5、本基金申报价格最小变动单位为0.01元人民币;

6、本基金上市交易遵循《深圳证券交易所交易规则》及相关规定。

(十一)上市交易的费用

本基金上市交易的费用按照深圳证券交易所有关规定办理。

(十二)上市交易的暂停揭示

基金管理人公告的基金份额净值

本基金在封闭期内首分离的估值优先和估值进取类基金份额的净值,基金管理人将通过基金份额净值公告和基金份额净值公告,并同时上市交易。

本基金在封闭期内首分离的估值优先