

(上接D263版)

84 瑞福证券有限责任公司
 注册地址:福州市五四路157号新天地大厦7、8层
 办公地址:福州市五四路157号新天地大厦7-10层
 法定代表人:黄金琳
 电话:0591-87383623
 传真:0591-87383610
 客户服务热线:96326 福建省外请先拨0591)
 网址:www.hqf.com.cn

85 天相投资顾问有限公司
 注册地址:北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701
 办公地址:北京市西城区金融街5号新盛大厦A座6层
 法定代表人:林义相
 联系人:林爽
 联系电话:010-66045608
 客户服务热线:010-66045678
 传真:010-66045600
 天相投顾网址: http://www.txsc.com
 天相基金网网址: http://jijin.txsc.com

86 信达证券股份有限公司
 注册地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
 办公地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
 法定代表人:高红卫
 联系人:唐静
 联系电话:010-63081000
 联系传真:010-63080787
 客服热线:400-800-8899
 网址:www.cindasc.com

87 财通证券股份有限公司
 注册地址:甘肃省兰州市静宁路308号
 办公地址:兰州城关区东岗西路638号财富大厦
 法定代表人:李俊安
 联系人:周颖
 联系电话:0931-4890208
 联系传真:0931-4890268
 客服电话:0931-4890208,4890100,4890619,4890618
 网址:www.cftz.com.cn

88 红塔证券股份有限公司
 注册 办公地址:云南省昆明市北京路151号红塔大厦A座
 法定代表人:况雨林
 电话:(0871)8790100
 传真:(0871)3578827
 联系人:刘晓明
 客户服务热线: 0871-3577888
 网址:www.hongtasecurities.com

89 国信证券股份有限公司
 注册地址:西安市东大街232号陕西信托大厦16-17层
 办公地址:西安市东大街232号陕西信托大厦16-17层
 法定代表人:何江
 联系电话:029-87406688
 传真:(029-87406387
 联系人:冯菁
 客户服务热线:95582
 网址:www.guoxin.com.cn

90 浙商证券有限责任公司
 注册 办公地址:浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A67
 法定代表人:吴承恩
 电话:(0571)87901000
 传真:(0571)87901913
 客户服务热线:(0571)967777
 网址:www.stocke.com.cn

91 天风证券股份有限公司
 注册 办公地址:湖北省武汉市东湖新技术开发区东园路2号光谷大厦四楼
 法定代表人:余磊
 联系人:王蕾
 联系电话:027-8718882
 客户服务热线:86714410027-8761882
 网址:www.tfzq.com

92 西藏同信证券股份有限公司
 注册地址:西藏自治区拉萨市北京中路101号
 办公地址:上海市东山路118号24号楼
 法定代表人:贾绍君
 联系人:王莉
 联系电话:021-36533017
 传真:021-36533019
 客户服务热线:400-881-1177
 网址:www.xtzq.com.cn

93 西南证券股份有限公司
 注册地址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦41-42层
 办公地址:深圳市福田区金田路中华国际交易广场8楼
 法定代表人:杨宇光
 全国免费业务咨询电话:95511-8
 网址: http://www.swsc.com.cn

94 华龙证券有限责任公司
 注册 办公地址:兰州市城关区金田路中华国际交易广场8楼
 法定代表人:杨宇光
 全国免费业务咨询电话:95511-8
 网址: http://www.hqjw.com.cn

95 锦泰证券有限责任公司
 注册地址:北京市西城区金融大街30号A座1层
 办公地址:北京市西城区金融大街30号A座1层
 法定代表人:丁颖
 联系人:高珊
 电话:010-58580040
 传真:010-58580042
 客户服务热线:010-58581118
 网址:www.jintasecurities.com

96 太平洋证券股份有限公司
 注册 办公地址:深圳市福田区深南中路2068号华能大厦30、31层
 法定代表人:赵文安
 电话:0755-83007069
 传真:0755-83007069
 客户服务热线:4008-698-698
 网址:www.pysc.com.cn

97 世纪证券有限责任公司
 注册 办公地址:深圳市福田区梅林南路18号
 法定代表人:孔佑杰
 联系人:冯杰
 电话:010-83991743
 传真:010-60412527

(上接 D261 版)

基金管理人每日计提,按月支付,经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

(2) 基金托管人的基金托管费
 基金托管人的基金托管费按基金财产净值的 0.24% 费率计提。计算方法如下:

$$H = E \times 0.24\% \div \text{当年天数}$$
 H 为每日应计提的基金托管费
 E 为前一日的基金财产净值
 基金托管费每日计提,按月支付,经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

(3) 基金合同生效后的指数跟踪费用
 在通常情况下,基金标的指数的跟踪费用可使用基金财产前一日基金资产净值的 0.26% 费率计提,计算方法如下:

$$H = E \times 0.26\% \div \text{当年天数}$$
 H 为每日应计提的基金跟踪费
 E 为前一日的基金资产净值
 自基金合同生效之日起,基金标的指数的跟踪费用每日计提,按季支付,基金设立当年,不足 3 个月的,按照 3 个月收费,根据基金管理人于标的跟踪费用合同签订的跟踪费协议约定的规定,标的指数可使用基金财产收取不超过每季自自然月内人民币 50,000 元,当季标的指数的跟踪费用可使用基金财产不超过 50,000 元的,按照 50,000 元支付,基金管理人有权根据标的指数的跟踪费用使用比例进行调节,经基金托管人复核并于每年 1 月 4 日、7 月、10 月的每个月个工作日内将上季度标的指数的跟踪费用从基金财产中一次性支付,若遇法定节假日,则顺延,支付日期顺延。

(4) 基金财产管理费
 本基金财产管理费(即第 3 条第(9)项费用)由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定,列入当期基金费用。

(5) 不列入基金费用的项目
 本基金第 3 款约定以外的其他费用,以及基金管理人和基金托管人因履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失等不列入基金费用。

(6) 基金管理费调整
 基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费,无需召开基金份额持有人大会。

5. 税收
 本基金运作过程中涉及的各种纳税义务,依照国家法律法规的规定进行纳税义务。

(七) 基金投资方向及投资限制
 1. 基金投资范围及比例
 本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括中证 500 指数的成份股及其备选成份股、首发和增发新股、债券、权证及经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具,法律法规及监管机构以后允许基金投资的品种。本基金投资于股票资产占基金资产净值的比例范围为 90%-95%,其中标的指数成份股、备选成份股占基金资产净值的比例不低于 90%;现金、债券资产及中国证监会允许的其它证券品种占基金资产净值的比例范围为 5%-10%,其中现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值 5%;权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规及监管机构的规定。

2. 投资禁止行为及限制
 (1) 禁止用本基金财产从事以下行为
 1) 承销证券;
 2) 向他人贷款或者提供担保;
 3) 从事承担无限责任的投资;
 4) 买卖其他基金份额,但是国务院另有规定的除外;
 5) 向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券;
 6) 买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券;
 7) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;
 8) 依照法律、行政法规有关禁止性规定,由国务院证券监督管理机构规定的其他活动。
 3. 基金合同投资组合限制
 (1) 本基金持有的股票资产占基金资产净值比例范围为 90%-95%,持有的债券、现金等其它金融工具占基金资产净值的比例范围为 5%-10%;
 (2) 本基金投资于指数成份股、备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%;
 (3) 本基金持有一家上市公司的股票,其市值不超过基金资产净值的 10%,但标的指数的成份股不受此限制;
 (4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家上市公司发行的证券,不超过该证券的 10%,但标的指数的成份股不受此限制;
 (5) 本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的 3%;
 (6) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证,不得超过该权证的 10%;本基金在任何交易日买入权证的总金额,不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%;
 (7) 本基金在全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%;
 (8) 本基金参与股指期货交易,本基金所申报的金额不超过基金总资产,本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;
 (9) 如果法律法规或监管机构以后允许基金投资股指期货及其它金融衍生工具时,投资比例须符合法律法规及监管机构的规定;
 (10) 法律法规及中国证监会规定的其它限制;

4. 若将法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更,致使前款约定的投资禁止行为和限制组合比例限制失效或取消,基金管理人可在依据履行相应程序后,本基金可相应调整禁止行为和受限限制。

5. 基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定,因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合基金合同约定的投资比例限制的,基金管理人应当在十个交易日内进行调整,法律法规或监管机构另有规定的,从其规定。

(八) 基金资产净值的计算方法和公告方式
 基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

1. 基金份额上市交易公告
 本基金工银 500 A 份额和工银 500B 份额获准在证券交易所上市交易,基金管理人应当在基金份额上市交易后的 3 个工作日内,将基金份额上市交易公告书登载在指定报刊网站上。

2. 基金资产净值、基金份额净值公告
 本基金合同生效后,在开始办理基金份额申购或者赎回前,基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和工银 500A 份额、工银 500B 份额与工银 500 份额的基金份额净值。
 在工银 500A 份额、工银 500B 份额上市交易或开始办理申购后,基金管理人应当在每个开放日的次日,通过网站、基金销售网点以及其他媒介,披露开放日工银 500A 份额、工银 500B 份额各自的基金份额净值和基金份额累计净值。
 基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和工银 500 份额、工银 500A 份额与工银 500B 份额的基金份额净值,基金管理人应当在前述最后一个市场交易日的次日,将基金资产净值,以及工银 500 份额、工银 500A 份额与工银 500B 份额各自的基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定报刊和网站上。

(九) 基金份额的折算
 本基金将在基金份额存续期内每个会计年度(除基金合同另有约定在会计年度外)将工银 500 份额和工银 500A 份额进行一次基金的定期份额折算,另外,在每个会计年度内如果工银 500 份额的基金份额参考净值达到 0.2500 元时也将进行基金份额不定期折算。

1. 定期份额折算
 本基金在存续期内的每个会计年度(除基金合同生效日所在会计年度外)第一个工作日进行基金的定期份额折算,本基金在存续期内的每个会计年度(除基金合同生效日所在会计年度外)第一个交易日本市,基金管理人根据基金资产净值计算工银 500 份额净值,然后根据基金份额净值折算确定工银 500A 份额和工银 500B 份额的期末参考净值。然后对工银 500A 份额的应得收益进行定期份额折算,每 10 份工银 500

客户服务热线:010-83991728
 网址: http://www.ruzq.com.cn
 C 注册代理机构名称: 瑞福证券有限责任公司
 注册地址: 广东省深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 19 层
 法定代表人: 王立新(代)
 电话: 010-81630000
 联系人: 宋萍萍
 电话: 0755-22163307
 传真: 0755-22163380
 联系人: 宋萍萍
 电话: 0755-22163307
 传真: 0755-22163380
 (四) 会计师事务所和经办注册会计师
 名称: 安永华明会计师事务所
 办公地址: 北京市东城区东长安街 1 号东方广场东塔楼安永大楼 19 层(即长安街 1 号) 4 层
 电话: 010-58153322, 010-58152145
 联系人: 李娜
 电话: 010-8188298
 签字注册会计师: 李慧民、王珊珊
 联系人: 王珊珊

四、基金名称
 本基金名称: 银华-道琼斯 88 精选证券投资基金
五、基金的类型
 本基金类型: 契约型开放式。
六、基金投资目标
 本基金将运用增强型指数化投资方法,通过严格的投资流程和数量风险管理,在对标的指数有效跟踪的基础上力求取得高于指数的投资收益率,实现基金资产的长期增值。

七、标的指数
 本基金以道琼斯中国 88 指数(简称道中 88 指数)为标的指数。
 道中 88 指数是一个由全球指数编制机构道琼斯公司为中国大陆股票市场编制的指数,由道琼斯中国指数中按照自由流通股市值和交易流动性综合排名的前 88 家上市公司构成,为了准确代表投资者可实际交易的股票数量,道中 88 指数为挑选成份股时并计算自由流通股股本时,排除了持股超过整个市值 5% 的公司,其它公司以及政府持有的股份,道中 88 指数每季度进行一次成份股的调整,同时道中 88 指数成份股按市值的建立并适当保留道中 88 指数中具有较好流动性的成份股。
 道中 88 指数以人民币元计算,基期为 1993 年 12 月 31 日,基数定为 100。

八、业绩基准
 本基金业绩基准与标的指数的定义相同。

九、投资策略及资产配置
 本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具,包括道琼斯中国 88 指数的成份股及其备选成份股、新股发行或增发、公司债券、金融债、企业债、可转债等债券资产以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具,各类资产投资比例符合《证券投资基金法》的规定。

十、投资风格
 本基金的跟踪风格定位于增强型指数基金,并选择了以市值代表性强、流动性高为特色的道琼斯中国 88 指数为基金投资跟踪的跟踪标的,因此,本基金的投资组合具有大盘蓝筹指数的风格和特点,通过买入并持有的长期投资策略,力争获取中国经济长期高速增长带来的资本市场收益。

十一、投资组合策略和投资组合构建
 本基金为增强型指数基金,以道中 88 指数为基金投资组合跟踪的标的指数,股票投资组合主要投资于与标的指数的成份股,增强部分主要选择基本面好、具有核心竞争力、价值型企业的股票,在控制与标的指数偏离风险的前提下,力求取得超越标的指数的投资收益率。

1. 资产配置策略
 本基金以道琼斯中国 88 指数的稳定收益为宗旨,采用自上而下的两层资产配置策略:第一层,资产类别配置,确定基金资产在不同资产类别之间的配置比例;第二层,股票和债券的个券选择与组合管理,在不同类别资产配置的基础上进一步确定各资产类别中不同证券的配置比例,在降低跟踪误差和控制流动性风险的双重约束下构建跟踪标的指数的投资组合。
 在资产配置原则上,本基金股票资产投资比例上限为 95%,且保持不低于基金资产 9% 的现金或到期日在一年以内的政府债券。

2. 股票资产配置策略
 在股票资产的配置上,本基金采用增强型指数化投资方法,以成份股在标的指数中的权重为基础构建指数化跟踪投资组合,并选择基本面好、具有核心竞争力的价值型企业的股票对指数进行适度增强。

3. 增强型投资策略
 本基金在增强部分的投资,是指基于价值选股原则对企业基本面情况进行深入分析的基础上,在控制跟踪误差的前提下投资于核心竞争力增强、投资价值上升的股票。
 本基金将充分利用投资团队在投资和研究方面的经验和实力,对宏观经济走向、产业发展演变及上市公司的基本面进行深入的分析和判断,对上市公司未来业绩进行跟踪,并在此基础上,通过一定的价值评判标准对上市公司的投资价值进行评估。

4. 债券资产配置策略
 本基金债券投资为在跟踪误差与流动性风险约束下的投资,本基金将以降低基金的跟踪误差为目的,在考虑流动性风险的前提下,构建债券投资组合。

5. 衍生品投资策略
 本基金所构建的投资投资组合的调整原则包括:根据标的指数成份股及其权重变动而进行相应调整;根据基金资产净值的变化降低对基本恶化企业的投资比重,提高核心竞争力的股票资产的投资比例;还将根据法律法规和标的指数编制机构,申赎跟踪变动情况,新增增发因素等变化,对基金投资组合进行及时调整,以保证基金净值增长率与标的指数的变动正相关和跟踪误差最小化。
 本基金的投资组合将遵循法律法规对基金投资组合进行流动性风险管理,并参照跟踪标的指数的成份股和权重进行动态调整,同时,本基金还将根据法律法规对投资组合比例限制,申赎跟踪变动情况等变化,对基金投资组合进行及时调整,以保证基金净值增长率与标的指数的变动正相关和跟踪误差最小化。

6. 衍生品投资策略
 本基金的投资组合将遵循法律法规对基金投资组合进行流动性风险管理,并参照跟踪标的指数的成份股和权重进行动态调整,同时,本基金还将根据法律法规对投资组合比例限制,申赎跟踪变动情况等变化,对基金投资组合进行及时调整,以保证基金净值增长率与标的指数的变动正相关和跟踪误差最小化。

十二、投资组合比例
 本基金资产的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。
 基金资产在中国证券登记结算公司集中登记,复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证报告内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
 本投资组合所披露的投资组合截至 2011 年 12 月 31 日,本报告相关数据未经审计。

1. 报告期末基金资产净值情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	6,125,473,292.62	79.67
	其中:股票	6,125,473,292.62	79.67
2	固定收益投资	387,020,000.00	5.03
	其中:债券	387,020,000.00	5.03
3	基金投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
5	货币资金、拆出资金、应收利息、应收股利、其他应收款	1,163,838,211.38	15.14
6	预付款项	11,773,039.40	0.15
7	合计	7,688,104,543.40	100.00

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合
 2.1 报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

份额将 4 份工银 500A 份额获得约定应得收益的新增折算份额,定期份额折算后工银 500A 份额的基金份额参考净值调整为 1.0000 元,基金份额折算后工银 500A 份额的基金份额参考净值超出 1.0000 元部分折算为工银 500B 份额的场内份额并给付给工银 500A 份额持有人。

每个会计年度第一个工作日为基金份额折算基准日,本基金将对工银 500A 份额和工银 500B 份额进行应得收益的相关计算如下:

$$\text{折算后工银 500A 份额持有人的新增场内工银 500B 份额} = \frac{\text{折算前工银 500A 份额持有人的基金份额} \times (\text{折算前工银 500A 份额的基金份额参考净值} - 1.0000)}{10 \times \text{折算前工银 500B 份额的基金份额参考净值}}$$

$$\text{折算后工银 500B 份额持有人的新增场内工银 500A 份额} = \frac{\text{折算前工银 500B 份额持有人的基金份额} \times (\text{折算前工银 500B 份额的基金份额参考净值} - 1.0000)}{10 \times \text{折算前工银 500A 份额的基金份额参考净值}}$$

$$\text{折算后工银 500A 份额持有人的新增场内工银 500B 份额} = \frac{\text{折算前工银 500A 份额持有人的基金份额} \times (\text{折算前工银 500A 份额的基金份额参考净值} - 1.0000)}{10 \times \text{折算前工银 500B 份额的基金份额参考净值}}$$

$$\text{折算后工银 500B 份额持有人的新增场内工银 500A 份额} = \frac{\text{折算前工银 500B 份额持有人的基金份额} \times (\text{折算前工银 500B 份额的基金份额参考净值} - 1.0000)}{10 \times \text{折算前工银 500A 份额的基金份额参考净值}}$$

$$\text{折算后工银 500A 份额持有人的新增场内工银 500B 份额} = \frac{\text{折算前工银 500A 份额持有人的基金份额} \times (\text{折算前工银 500A 份额的基金份额参考净值} - 1.0000)}{10 \times \text{折算前工银 500B 份额的基金份额参考净值}}$$

$$\text{折算后工银 500B 份额持有人的新增场内工银 500A 份额} = \frac{\text{折算前工银 500B 份额持有人的基金份额} \times (\text{折算前工银 500B 份额的基金份额参考净值} - 1.0000)}{10 \times \text{折算前工银 500A 份额的基金份额参考净值}}$$

$$\text{折算后工银 500A 份额持有人的新增场内工银 500B 份额} = \frac{\text{折算前工银 500A 份额持有人的基金份额} \times (\text{折算前工银 500A 份额的基金份额参考净值} - 1.0000)}{10 \times \text{折算前工银 500B 份额的基金份额参考净值}}$$

$$\text{折算后工银 500B 份额持有人的新增场内工银 500A 份额} = \frac{\text{折算前工银 500B 份额持有人的基金份额} \times (\text{折算前工银 500B 份额的基金份额参考净值} - 1.0000)}{10 \times \text{折算前工银 500A 份额的基金份额参考净值}}$$

$$\text{折算后工银 500A 份额持有人的新增场内工银 500B 份额} = \frac{\text{折算前工银 500A 份额持有人的基金份额} \times (\text{折算前工银 500A 份额的基金份额参考净值} - 1.0000)}{10 \times \text{折算前工银 500B 份额的基金份额参考净值}}$$

$$\text{折算后工银 500B 份额持有人的新增场内工银 500A 份额} = \frac{\text{折算前工银 500B 份额持有人的基金份额} \times (\text{折算前工银 500B 份额的基金份额参考净值} - 1.0000)}{10 \times \text{折算前工银 500A 份额的基金份额参考净值}}$$

$$\text{折算后工银 500A 份额持有人的新增场内工银 500B 份额} = \frac{\text{折算前工银 500A 份额持有人的基金份额} \times (\text{折算前工银 500A 份额的基金份额参考净值} - 1.0000)}{10 \times \text{折算前工银 500B 份额的基金份额参考净值}}$$

$$\text{折算后工银 500B 份额持有人的新增场内工银 500A 份额} = \frac{\text{折算前工银 500B 份额持有人的基金份额} \times (\text{折算前工银 500B 份额的基金份额参考净值} - 1.0000)}{10 \times \text{折算前工银 500A 份额的基金份额参考净值}}$$

$$\text{折算后工银 500A 份额持有人的新增场内工银 500B 份额} = \frac{\text{折算前工银 500A 份额持有人的基金份额} \times (\text{折算前工银 500A 份额的基金份额参考净值} - 1.0000)}{10 \times \text{折算前工银 500B 份额的基金份额参考净值}}$$

$$\text{折算后工银 500B 份额持有人的新增场内工银 500A 份额} = \frac{\text{折算前工银 500B 份额持有人的基金份额} \times (\text{折算前工银 500B 份额的基金份额参考净值} - 1.0000)}{10 \times \text{折算前工银 500A 份额的基金份额参考净值}}$$

$$\text{折算后工银 500A 份额持有人的新增场内工银 500B 份额} = \frac{\text{折算前工银 500A 份额持有人的基金份额} \times (\text{折算前工银 500A 份额的基金份额参考净值} - 1.0000)}{10 \times \text{折算前工银 500B 份额的基金份额参考净值}}$$

$$\text{折算后工银 500B 份额持有人的新增场内工银 500A 份额} = \frac{\text{折算前工银 500B 份额持有人的基金份额} \times (\text{折算前工银 500B 份额的基金份额参考净值} - 1.0000)}{10 \times \text{折算前工银 500A 份额的基金份额参考净值}}$$

$$\text{折算后工银 500A 份额持有人的新增场内工银 500B 份额} = \frac{\text{折算前工银 500A 份额持有人的基金份额} \times (\text{折算前工银 500A 份额的基金份额参考净值} - 1.0000)}{10 \times \text{折算前工银 500B 份额的基金份额参考净值}}$$

$$\text{折算后工银 500B 份额持有人的新增场内工银 500A 份额} = \frac{\text{折算前工银 500B 份额持有人的基金份额} \times (\text{折算前工银 500B 份额的基金份额参考净值} - 1.0000)}{10 \times \text{折算前工银 500A 份额的基金份额参考净值}}$$

$$\text{折算后工银 500A 份额持有人的新增场内工银 500B 份额} = \frac{\text{折算前工银 500A 份额持有人的基金份额} \times (\text{折算前工银 500A 份额的基金份额参考净值} - 1.0000)}{10 \times \text{折算前工银 500B 份额的基金份额参考净值}}$$

$$\text{折算后工银 500B 份额持有人的新增场内工银 500A 份额} = \frac{\text{折算前工银 500B 份额持有人的基金份额} \times (\text{折算前工银 500B 份额的基金份额参考净值} - 1.0000)}{10 \times \text{折算前工银 500A 份额的基金份额参考净值}}$$

$$\text{折算后工银 500A 份额持有人的新增场内工银 500B 份额} = \frac{\text{折算前工银 500A 份额持有人的基金份额} \times (\text{折算前工银 500A 份额的基金份额参考净值} - 1.0000)}{10 \times \text{折算前工银 500B 份额的基金份额参考净值}}$$

$$\text{折算后工银 500B 份额持有人的新增场内工银 500A 份额} = \frac{\text{折算前工银 500B 份额持有人的基金份额} \times (\text{折算前工银 500B 份额的基金份额参考净值} - 1.0000)}{10 \times \text{折算前工银 500A 份额的基金份额参考净值}}$$

$$\text{折算后工银 500A 份额持有人的新增场内工银 500B 份额} = \frac{\text{折算前工银 500A 份额持有人的基金份额} \times (\text{折算前工银 500A 份额的基金份额参考净值} - 1.0000)}{10 \times \text{折算前工银 500B 份额的基金份额参考净值}}$$

$$\text{折算后工银 500B 份额持有人的新增场内工银 500A 份额} = \frac{\text{折算前工银 500B 份额持有人的基金份额} \times (\text{折算前工银 500B 份额的基金份额参考净值} - 1.0000)}{10 \times \text{折算前工银 500A 份额的基金份额参考净值}}$$

$$\text{折算后工银 500A 份额持有人的新增场内工银 500B 份额} = \frac{\text{折算前工银 500A 份额持有人的基金份额} \times (\text{折算前工银 500A 份额的基金份额参考净值} - 1.0000)}{10 \times \text{折算前工银 500B 份额的基金份额参考净值}}$$

$$\text{折算后工银 500B 份额持有人的新增场内工银 500A 份额} = \frac{\text{折算前工银 500B 份额持有人的基金份额} \times (\text{折算前工银 500B 份额的基金份额参考净值} - 1.0000)}{10 \times \text{折算前工银 500A 份额的基金份额参考净值}}$$

$$\text{折算后工银 500A 份额持有人的新增场内工银 500B 份额} = \frac{\text{折算前工银 500A 份额持有人的基金份额} \times (\text{折算前工银 500A 份额的基金份额参考净值} - 1.0000)}{10 \times \text{折算前工银 500B 份额的基金份额参考净值}}$$

$$\text{折算后工银 500B 份额持有人的新增场内工银 500A 份额} = \frac{\text{折算前工银 500B 份额持有人的基金份额} \times (\text{折算前工银 500B 份额的基金份额参考净值} - 1.0000)}{10 \times \text{折算前工银 500A 份额的基金份额参考净值}}$$

$$\text{折算后工银 500A 份额持有人的新增场内工银 500B 份额} = \frac{\text{折算前工银 500A 份额持有人的基金份额} \times (\text{折算前工银 500A 份额的基金份额参考净值} - 1.0000)}{10 \times \text{折算前工银 500B 份额的基金份额参考净值}}$$

$$\text{折算后工银 500B 份额持有人的新增场内工银 500A 份额} = \frac{\text{折算前工银 500B 份额持有人的基金份额} \times (\text{折算前工银 500B 份额的基金份额参考净值} - 1.0000)}{10 \times \text{折算前工银 500A 份额的基金份额参考净值}}$$

$$\text{折算后工银 500A 份额持有人的新增场内工银 500B 份额} = \frac{\text{折算前工银 500A 份额持有人的基金份额} \times (\text{折算前工银 500A 份额的基金份额参考净值} - 1.0000)}{10 \times \text{折算前工银 500B 份额的基金份额参考净值}}$$

$$\text{折算后工银 500B 份额持有人的新增场内工银 500A 份额} = \frac{\text{折算前工银 500B 份额持有人的基金份额} \times (\text{折算前工银 500B 份额的基金份额参考净值} - 1.0000)}{10 \times \text{折算前工银 500A 份额的基金份额参考净值}}$$

$$\text{折算后工银 500A 份额持有人的新增场内工银 500B 份额} = \frac{\text{折算前工银 500A 份额持有人的基金份额} \times (\text{折算前工银 500A 份额的基金份额参考净值} - 1.0000)}{10 \times \text{折算前工银 500B 份额的基金份额参考净值}}$$

$$\text{折算后工银 500B 份额持有人的新增场内工银 500A 份额} = \frac{\text{折算前工银 500B 份额持有人的基金份额} \times (\text{折算前工银 500B 份额的基金份额参考净值} - 1.0000)}{10 \times \text{折算前工银 500A 份额的基金份额参考净值}}$$

$$\text{折算后工银 500A 份额持有人的新增场内工银 500B 份额} = \frac{\text{折算前工银 500A 份额持有人的基金份额} \times (\text{折算前工银 500A 份额的基金份额参考净值} - 1.0000)}{10 \times \text{折算前工银 500B 份额的基金份额参考净值}}$$

$$\text{折算后工银 500B 份额持有人的新增场内工银 500A 份额} = \frac{\text{折算前工银 500B 份额持有人的基金份额} \times (\text{折算前工银 500B 份额的基金份额参考净值} - 1.0000)}{10 \times \text{折算前工银 500A 份额的基金份额参考净值}}$$

$$\text{折算后工银 500A 份额持有人的新增场内工银 500B 份额} = \frac{\text{折算前工银 500A 份额持有人的基金份额} \times (\text{折算前工银 500A 份额的基金份额参考净值} - 1.0000)}{10 \times \text{折算前工银 500B 份额的基金份额参考净值}}$$

$$\text{折算后工银 500B 份额持有人的新增场内工银 500A 份额} = \frac{\text{折算前工银 500B 份额持有人的基金份额} \times (\text{折算前工银 500B 份额的基金份额参考净值} - 1.0000)}{10 \times \text{折算前工银 500A 份额的基金份额参考净值}}$$

$$\text{折算后工银 500A 份额持有人的新增场内工银 500B 份额} = \frac{\text{折算前工银 500A 份额持有人的基金份额} \times (\text{折算前工银 500A 份额的基金份额参考净值} - 1.0000)}{10 \times \text{折算前工银 500B 份额的基金份额参考净值}}$$

$$\text{折算后工银 500B 份额持有人的新增场内工银 500A 份额} = \frac{\text{折算前工银 500B 份额持有人的基金份额} \times (\text{折算前工银 500B 份额的基金份额参考净值} - 1.0000)}{10 \times \text{折算前工银 500A 份额的基金份额参考净值}}$$

$$\text{折算后工银 500A 份额持有人的新增场内工银 500B 份额} = \frac{\text{折算前工银 500A 份额持有人的基金份额} \times (\text{折算前工银 500A 份额的基金份额参考净值} - 1.0000)}{10 \times \text{折算前工银 500B 份额的基金份额参考净值}}$$

$$\text{折算后工银 500B 份额持有人的新增场内工银 500A 份额} = \frac{\text{折算前工银 500B 份额持有人的基金份额} \times (\text{折算前工银 500B 份额的基金份额参考净值} - 1.0000)}{10 \times \text{折算前工银 500A 份额的基金份额参考净值}}$$

$$\text{折算后工银 500A 份额持有人的新增场内工银 500B 份额} = \frac{\text{折算前工银 500A 份额持有人的基金份额} \times (\text{折算前工银 500A 份额的基金份额参考净值} - 1.0000)}{10 \times \text{折算前工银 500B 份额的基金份额参考净值}}$$

$$\text{折算后工银 500B 份额持有人的新增场内工银 500A 份额} = \frac{\text{折算前工银 500B 份额持有人的基金份额} \times (\text{折算前工银 500B 份额的基金份额参考净值} - 1.0000)}{10 \times \text{折算前工银 500A 份额的基金份额参考净值}}$$

$$\text{折算后工银 500A 份额持有人的新增场内工银 500B 份额} = \frac{\text{折算前工银 500A 份额持有人的基金份额} \times (\text{折算前工银 500A 份额的基金份额参考净值} - 1.0000)}{10 \times \text{折算前工银 500B 份额的基金份额参考净值}}$$

$$\text{折算后工银 500B 份额持有人的新增场内工银 500A 份额} = \frac{\text{折算前工银 500B 份额持有人的基金份额} \times (\text{折算前工银 500B 份额的基金份额参考净值} - 1.0000)}{10 \times \text{折算前工银 500A 份额的基金份额参考净值}}$$

$$\text{折算后工银 500A 份额持有人的新增场内工银 500B 份额} = \frac{\text{折算前工银 500A 份额持有人的基金份额} \times (\text{折算前工银 500A 份额的基金份额参考净值} - 1.0000)}{10 \times \text{折算前工银 500B 份额的基金份额参考净值}}$$

$$\text{折算后工银 500B 份额持有人的新增场内工银 500A 份额} = \frac{\text{折算前工银 500B 份额持有人的基金份额} \times (\text{折算前工银 500B 份额的基金份额参考净值} - 1.0000)}{10 \times \text{折算前工银 500A 份额的基金份额参考净值}}$$

$$\text{折算后工银 500A 份额持有人的新增场内工银 500B 份额} = \frac{\text{折算前工银 500A 份额持有人的基金份额} \times (\text{折算前工银 500A 份额的基金份额参考净值} - 1.0000)}{10 \times \text{折算前工银 500B 份额的基金份额参考净值}}$$

$$\text{折算后工银 500B 份额持有人的新增场内工银 500A 份额} = \frac{\text{折算前工银 500B 份额持有人的基金份额} \times (\text{折算前工银 500B 份额的基金份额参考净值} - 1.0000)}{10 \times \text{折算前工银 500A 份额的基金份额参考净值}}$$

$$\text{折算后工银 500A 份额持有人的新增场内工银 500B 份额} = \frac{\text{折算前工银 500A 份额持有人的基金份额} \times (\text{折算前工银 500A 份额的基金份额参考净值} - 1.0000)}{10 \times \text{折算前工银 500B 份额的基金份额参考净值}}$$

$$\text{折算后工银 500B 份额持有人的新增场内工银 500A 份额} = \frac{\text{折算前工银 5$$