关于工银瑞信睿智中证500指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务的公告

根据《工银瑞信睿智中证500指数分级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，工银瑞信睿智中证500指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）将在2016年1月4日办理定期份额折算业务。相关事项公告如下：

一、基金份额折算基准日

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2016年1月4日。

二、基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的工银瑞信睿智中证500指数证券投资基金之基础份额（以下简称“工银500”，交易代码：164809）和工银瑞信睿智中证500指数证券投资基金之A份额（以下简称“500A”，交易代码：150055）。

三、基金份额折算方式

本基金在存续期内的每个会计年度最后第一个交易日收市后，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计算规则确定500A份额和500B份额的期末参考净值。然后对500A份额的应得收益进行定期份额折算，每10份工银500份额将按4份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500A份额的基金份额参考净值调整为1.0000元，基金份额折算日前500A份额的基金份额参考净值超出1.0000元的部分将折算为工银500份额的场内份额分配给500A份额持有人。

有关计算公式如下：

1、工银500份额折算

$$NAV_{500}^{E}=NAV_{500}^{E}\times\frac{4\times(NAV_{500}^{E}-1.0000)}{10}$$

工银500份额持有人新增的工银500份额=$\frac{4\times NUM_{500}^{E}\times(NAV_{500}^{E}-1.0000)}{10\times NAV_{500}^{E}}$

其中：

NAV_{500}^{E}：份额折算前工银500份额的基金份额净值，下同

NAV_{500}^{E}：份额折算后工银500份额的基金份额净值，下同

NAV_{500}^{E}：份额折算前500A份额的基金份额净值，下同

NUM_{500}^{E}：份额折算前工银500份额的份额数，下同

2、500A份额折算

应得份额折算后500A份额的基金份额参考净值=1.0000

应得份额折算后500A份额份额数=应得份额折算前500A份额的份额数

500A份额持有人新增的工银500份额=$\frac{NUM_{500}^{E}\times(NAV_{500}^{E}-1.0000)}{NAV_{500}^{E}}$

其中：

NAV_{500}^{E}：份额折算前500A份额的基金份额净值，下同

NUM_{500}^{E}：份额折算前500A份额的份额数，下同

3、500B份额

每个会计年度不对500B进行定期份额折算，不改变其份额参考净值及其份额数。

工银500份额的场外份额经折算后的份额数采用四舍五入的方式保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产；工银500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。

500A的新增工银500场内份额取整计算（最小单位为1份），余额计入基金财产。

4、举例：

假设2016年1月4日为定期份额折算日，当日折算前工银500份额的基金份额净值为0.9000元，500A份额的基金份额净值为1.0641元，500B份额的基金份额净值为0.7906元，投资人甲持有工银500份额的场内份额10000份，投资人乙持有500A份额5000份，投资人丙持有工银500份额的场外份额10000份，投资人丁持有500B份额8000份，则：

份额折算日份额折算后工银500份额的基金份额净值=0.9000−0.4×(1.0641−1.0000)=0.8744元，500A份额的基金份额净值=1.0000元，500B份额的基金份额净值=0.7906元。

投资人甲新增的工银500份额数=[0.4×10000×(1.0641−1.0000)]／0.8744=293份（场内份额截位取整计算，最小单位为1份，余额计入基金财产）

投资人乙新增的工银500份额数=[5000×(1.0641−1.0000)]／0.8744=367份（场内份额截位取整计算，最小单位为1份，余额计入基金财产）

投资人丙新增的工银500份额数=[0.4×10000×(1.0641−1.0000)]／0.8744=293.23份（场外新增份额数采用四舍五入的方式保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产）

即：份额折算日份额折算后，投资人甲共持有工银500份额的场内份额10293份，投资人乙共持有500A份额5000份及工银500份额的场内份额367份，投资人丙共持有工银500份额的场外份额10293.23份，投资人丁仍持有500B份额8000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2016年1月4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、配对转换业务；500A、500B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2016年1月5日），本基金暂停办理申购、赎回、转托管、配对转换业务，500A暂停交易，500B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2016年1月6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，500A恢复交易（自该日上午9:30至10:30仍然暂停交易，自该日上午10:30起恢复交易），500B正常交易。

（四）根据深圳证券交易所《关于分级基金份额折算后次日前收盘价调整的通知》，2016年1月6日500A复牌首日即时行情显示的前收盘价为2016年1月5日的500A的份额净值（四舍五入至0.001元）。由于500A折算前可能存在折/溢价交易情形，折算前的收盘价扣除2015年约定收益后与2016年1月6日的前收盘价可能有较大差异，1月6日当日可能出现交易价格大幅波动的情形。

五、重要提示

根据深圳证券交易所《关于分级基金份额折算后次日前收盘价调整的通知》，2016年1月6日500A复牌首日即时行情显示的前收盘价为2016年1月5日的500A份额净值（四舍五入至0.001元）。由于500A折算前可能存在折/溢价交易情形，折算前的收盘价扣除2015年约定收益后与2016年1月6日的前收盘价可能有较大差异，1月6日当日可能出现交易价格大幅波动的情形。敬请投资者留意投资风险。

由于500A份额新增份额折算成工银500份额的场内份额数和工银500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500A份额数或场内工银500份额数的份额持有人存在无法获得新增场内工银500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.icbccs.com.cn或者拨打本公司客服电话：400—811—9999(免长途话费)。

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。

工银瑞信基金管理有限公司
2015年12月29日

关于工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务的公告

根据《工银瑞信中证传媒指数分级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，工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）将在2016年1月4日办理定期份额折算业务。相关事项公告如下：

一、基金份额折算基准日

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1月份的第一个工作日。本次定期份额折算的基准日为2016年1月4日。

二、基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金之基础份额（以下简称“传媒母基”，交易代码：164818）和工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金之A份额（以下简称“传媒A级”，交易代码：150247）。

三、基金份额折算方式

传媒A级份额和传媒B级份额按照基金合同规定的参考净值计算规则进行计算，对传媒A级份额的应得收益进行定期份额折算，每2份传媒母基份额将按1份传媒A级份额获得约定应得收益的新增折算份额。

在基金份额折算前与折算后，传媒A级份额和传媒B级份额的份额配比保持1:1 的比例。

对于传媒A级份额的约定年化应得收益，即除基金合同另有约定外，传媒A级份额每个基金份额定期折算基准日份额参考净值超过1.0000元的部分，将折算为场内传媒母基份额分配给传媒A级份额持有人。传媒母基份额持有人持有的每2份传媒母基份额将按1份传媒A级份额获得新增传媒母基份额的分配。持有场外传媒母基份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外传媒母基份额的分配；持有场内传媒母基份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内传媒母基份额的分配。经过上述份额折算，传媒A级份额和传媒母基份额的基金份额（参考）净值将相应调整。

有关计算公式如下：

1、传媒母基份额折算

$$NAV_{传媒母}^{E}=NAV_{传媒母}^{E}-\frac{5\times(NAV_{传媒母}^{E}-1.0000)}{10}$$

传媒母基份额持有人新增的传媒母基份额=$\frac{5\times NUM_{传媒母}^{E}\times(NAV_{传媒母}^{E}-1.0000)}{10\times NAV_{传媒母}^{E}}$

其中：

$NAV_{传媒母}^{E}$：份额折算前传媒母基份额的基金份额净值，下同

$NAV_{传媒母}^{E}$：份额折算后传媒母基份额的基金份额净值，下同

$NAV_{传媒母}^{E}$：份额折算前传媒A级份额的基金份额参考净值，下同

$NUM_{传媒母}^{E}$：份额折算前传媒A级份额的份额数，下同

2、传媒A级份额折算

应得份额折算后传媒A级份额的基金份额参考净值=1.0000

应得份额折算后传媒A级份额份额数=应得份额折算前传媒A级份额的份额数

传媒A级份额持有人新增的传媒母基份额=$\frac{NUM_{传媒A}^{E}\times(NAV_{传媒A}^{E}-1.0000)}{NAV_{传媒母}^{E}}$

其中：

$NAV_{传媒A}^{E}$：份额折算前传媒A级份额的基金份额参考净值，下同

$NUM_{传媒A}^{E}$：份额折算前传媒A级份额的份额数，下同

3、传媒B级份额

每个会计年度不对传媒B级进行定期份额折算，不改变其份额参考净值及其份额数。

传媒母基份额的场外份额经折算后的份额数采用四舍五入的方式保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产；传媒母基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。

传媒A级的新增传媒母基场内份额取整计算（最小单位为1份），余额计入基金财产。

4、举例：

假设2016年1月4日为定期份额折算日，当日折算前传媒母基份额的基金份额净值为0.9000元，传媒A级份额的基金份额净值为1.0640元，传媒B级份额的基金份额净值为0.7360元，投资人甲持有传媒母基份额的场内份额10000份，投资人乙持有传媒A级份额5000份，投资人丙持有传媒母基份额的场外份额10000份，投资人丁持有传媒B级份额8000份，则：

份额折算日份额折算后传媒母基份额的基金份额净值=0.9000−0.5×(1.0640−1.0000)=0.8680元，传媒A级份额的基金份额净值=1.0000元，传媒B级份额的基金份额净值=0.7360元。

投资人甲新增的传媒母基份额数=[0.5×10000×(1.0640−1.0000)]／0.8680=293份（场内份额截位取整计算，最小单位为1份，余额计入基金财产）

投资人乙新增的传媒母基份额数=[5000×(1.0640−1.0000)]／0.8680=367份（场内份额截位取整计算，最小单位为1份，余额计入基金财产）

投资人丙新增的传媒母基份额数=[0.5×10000×(1.0640−1.0000)]／0.8680=293.23份（场外新增份额数采用四舍五入的方式保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产）

即：份额折算日份额折算后，投资人甲共持有传媒母基份额的场内份额10293份，投资人乙共持有传媒A级份额5000份及传媒母基份额的场内份额367份，投资人丙共持有传媒母基份额的场外份额10293.23份，投资人丁仍持有传媒B级份额8000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2016年1月4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、配对转换业务；传媒A端、传媒B端正常交易。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2016年1月5日），本基金暂停办理申购、赎回、转托管、配对转换业务，传媒A端暂停交易，传媒B端正常交易。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2016年1月6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，传媒A端恢复交易（自该日上午9:30至10:30仍然暂停交易，自该日上午10:30起恢复交易），传媒B端正常交易。

（四）根据深圳证券交易所《关于分级基金份额折算后次日前收盘价调整的通知》，2016年1月6日传媒A端复牌首日即时行情显示的前收盘价为2016年1月5日的传媒A级份额净值（四舍五入至0.001元）。由于传媒A级折算前可能存在折/溢价交易情形，折算前的收盘价扣除2015年约定收益后与2016年1月6日的前收盘价可能有较大差异，1月6日当日可能出现交易价格大幅波动的情形。

五、重要提示

根据深圳证券交易所《关于分级基金份额折算后次日前收盘价调整的通知》，2016年1月6日传媒A端复牌首日即时行情显示的前收盘价为2016年1月5日的传媒A级份额净值（四舍五入至0.001元）。由于传媒A级折算前可能存在折/溢价交易情形，折算前的收盘价扣除2015年约定收益后与2016年1月6日的前收盘价可能有较大差异，1月6日当日可能出现交易价格大幅波动的情形。敬请投资者留意投资风险。

由于传媒A级份额新增份额折算成传媒母基份额的场内份额数和传媒母基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，持有较少传媒A级份额数或场内传媒母基份额数的份额持有人存在无法获得新增场内传媒母基份额的可能性。

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.icbccs.com.cn或者拨打本公司客服电话：400—811—9999(免长途话费)。

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。

工银瑞信基金管理有限公司
2015年12月29日

关于工银瑞信中证高铁产业指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务的公告

根据《工银瑞信中证高铁产业指数分级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，工银瑞信中证高铁产业指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）将在2016年1月4日办理定期份额折算业务。相关事项公告如下：

一、基金份额折算基准日

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1月份的第一个工作日。本次定期份额折算的基准日为2016年1月4日。

二、基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的工银瑞信中证高铁产业指数分级证券投资基金之基础份额（以下简称“高铁母基”，交易代码：164820）和工银瑞信中证高铁产业指数分级证券投资基金之A份额（以下简称“高铁A端”，交易代码：150325）。

三、基金份额折算方式

高铁A端份额和高铁B端份额按照基金合同规定的参考净值计算规则进行计算，对高铁A端份额的应得收益进行定期份额折算，每2份高铁母基份额将按1份高铁A端份额获得约定应得收益的新增折算份额。

在基金份额折算前与折算后，高铁A端份额和高铁B端份额的份额配比保持1:1 的比例。

对于高铁A端份额的约定年化应得收益，即除基金合同另有约定外，高铁A端份额每个基金份额定期折算基准日份额参考净值超过1.0000元的部分，将折算为场内高铁母基份额分配给高铁A端份额持有人。高铁母基份额持有人持有的每2份高铁母基份额将按1份高铁A端份额获得新增高铁母基份额的分配。持有场外高铁母基份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外高铁母基份额的分配；持有场内高铁母基份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内高铁母基份额的分配。经过上述份额折算，高铁A端份额和高铁母基份额的基金份额（参考）净值将相应调整。

有关计算公式如下：

1、高铁母基份额折算

$$NAV_{高铁母}^{E}=NAV_{高铁母}^{E}-\frac{5\times(NAV_{高铁母}^{E}-1.0000)}{10}$$

高铁母基份额持有人新增的高铁母基份额=$\frac{5\times NUM_{高铁母}^{E}\times(NAV_{高铁母}^{E}-1.0000)}{10\times NAV_{高铁母}^{E}}$

其中：

$NAV_{高铁母}^{E}$：份额折算前高铁母基份额的基金份额净值，下同

$NAV_{高铁母}^{E}$：份额折算后高铁母基份额的基金份额净值，下同

$NAV_{高铁A}^{E}$：份额折算前高铁A端份额的基金份额参考净值，下同

$NUM_{高铁母}^{E}$：份额折算前高铁母基份额的份额数，下同

2、高铁A端份额折算

应得份额折算后高铁A端份额的基金份额参考净值=1.0000

应得份额折算后高铁A端份额份额数=应得份额折算前高铁A端份额的份额数

高铁A端份额持有人新增的高铁母基份额=$\frac{NUM_{高铁A}^{E}\times(NAV_{高铁A}^{E}-1.0000)}{NAV_{高铁母}^{E}}$

其中：

$NAV_{高铁A}^{E}$：份额折算前高铁A端份额的基金份额参考净值，下同

$NUM_{高铁A}^{E}$：份额折算前高铁A端份额的份额数，下同

3、高铁B端份额

每个会计年度不对高铁B端进行定期份额折算（除非定期折算时同时满足不定期折算的条件），不改变其份额参考净值及其份额数。

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。

高铁母基份额的场外份额经折算后的份额数采用四舍五入的方式保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产；高铁母基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。

高铁A端的新增高铁母基场内份额取整计算（最小单位为1份），余额计入基金财产。

4、举例：

假设2016年1月4日为定期份额折算日，当日折算前高铁母基份额的基金份额净值为0.9000元，高铁A端份额的基金份额净值为1.0640元，高铁B端份额的基金份额净值为0.7360元，投资人甲持有高铁母基份额的场内份额10000份，投资人乙持有高铁A端份额5000份，投资人丙持有高铁母基份额的场外份额10000份，投资人丁持有高铁B端份额8000份，则：

份额折算日份额折算后高铁母基份额的基金份额净值=0.9000−0.5×(1.0640−1.0000)=0.8680元，高铁A端份额的基金份额净值=1.0000元，高铁B端份额的基金份额净值=0.7360元。

投资人甲新增的高铁母基份额数=[0.5×10000×(1.0640−1.0000)]／0.8680=368份（场内份额截位取整计算，最小单位为1份，余额计入基金财产）

投资人乙新增的高铁母基份额数=[5000×(1.0640−1.0000)]／0.8680=367份（场内份额截位取整计算，最小单位为1份，余额计入基金财产）

投资人丙新增的高铁母基份额数=[0.5×10000×(1.0640−1.0000)]／0.8680=368.66份（场外新增份额数采用四舍五入的方式保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产）

即：份额折算日份额折算后，投资人甲共持有高铁母基份额的场内份额10368份，投资人乙共持有高铁A端份额5000份及高铁母基份额的场内份额368份，投资人丙共持有高铁母基份额的场外份额10368.66份，投资人丁仍持有高铁B端份额8000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2016年1月4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、配对转换业务；高铁A端、高铁B端正常交易。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2016年1月5日），本基金暂停办理申购、赎回、转托管、配对转换业务，高铁A端暂停交易，高铁B端正常交易。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2016年1月6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，高铁A端恢复交易（自该日上午9:30至10:30仍然暂停交易，自该日上午10:30起恢复交易），高铁B端正常交易。

（四）根据深圳证券交易所《关于分级基金份额折算后次日前收盘价调整的通知》，2016年1月6日高铁A端复牌首日即时行情显示的前收盘价为2016年1月5日的高铁A端的份额净值（四舍五入至0.001元）。由于高铁A端折算前可能存在折/溢价交易情形，折算前的收盘价扣除2015年约定收益后与2016年1月6日的前收盘价可能有较大差异，1月6日当日可能出现交易价格大幅波动的情形。

五、重要提示

根据深圳证券交易所《关于分级基金份额折算后次日前收盘价调整的通知》，2016年1月6日高铁A端复牌首日即时行情显示的前收盘价为2016年1月5日的高铁A端份额净值（四舍五入至0.001元）。由于高铁A端折算前可能存在折/溢价交易情形，折算前的收盘价扣除2015年约定收益后与2016年1月6日的前收盘价可能有较大差异，1月6日当日可能出现交易价格大幅波动的情形。敬请投资者留意投资风险。

由于高铁A端份额新增份额折算成高铁母基份额的场内份额数和高铁母基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，持有较少高铁A端份额数或场内高铁母基份额数的份额持有人存在无法获得新增场内高铁母基份额的可能性。

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.icbccs.com.cn或者拨打本公司客服电话：400—811—9999(免长途话费)。

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。

工银瑞信基金管理有限公司
2015年12月29日

关于工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务的公告

根据《工银瑞信中证环保产业指数分级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，工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）将在2016年1月4日办理定期份额折算业务。相关事项公告如下：

一、基金份额折算基准日

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1月份的第一个工作日。本次定期份额折算的基准日为2016年1月4日。

二、基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金之基础份额（以下简称“环保母基”，交易代码：164819）和工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金之A份额（以下简称“环保A端”，交易代码：150323）。

三、基金份额折算方式

环保A端份额和环保B端份额按照基金合同规定的参考净值计算规则进行计算，对环保A端份额的应得收益进行定期份额折算，每2份环保母基份额将按1份环保A端份额获得约定应得收益的新增折算份额。

在基金份额折算前与折算后，环保A端份额和环保B端份额的份额配比保持1:1 的比例。

对于环保A端份额的约定年化应得收益，即除基金合同另有约定外，环保A端份额每个基金份额定期折算基准日份额参考净值超过1.0000元的部分，将折算为场内环保母基份额分配给环保A端份额持有人。环保母基份额持有人持有的每2份环保母基份额将按1份环保A端份额获得新增环保母基份额的分配。持有场外环保母基份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外环保母基份额的分配；持有场内环保母基份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内环保母基份额的分配。经过上述份额折算，环保A端份额和环保母基份额的基金份额（参考）净值将相应调整。

有关计算公式如下：

1、环保母基份额折算

$$NAV_{环保母}^{E}=NAV_{环保母}^{E}-0.5\times(NAV_{环保母}^{E}-1.0000)$$

环保母基份额持有人新增的环保母基份额=$\frac{0.5\times NUM_{环保母}^{E}\times(NAV_{环保母}^{E}-1.0000)}{NAV_{环保母}^{E}}$

定期份额折算后环保母基份额份额数=定期份额折算前环保母基份额份额数+应得定期份额折算后环保母基份额份额数

其中：

$NAV_{环保母}^{E}$：份额折算前环保母基份额的基金份额净值，下同

$NAV_{环保母}^{E}$：份额折算后环保母基份额的基金份额净值，下同

$NAV_{环保A}^{E}$：份额折算前环保A端份额的基金份额参考净值，下同

$NUM_{环保母}^{E}$：份额折算前环保母基份额的份额数，下同

2、环保A端份额折算

应得份额折算后环保A端份额的基金份额参考净值=1.0000

定期份额折算后环保A端份额份额数=定期份额折算前环保A端份额的份额数+应得份额折算后环保A端份额份额数

环保A端份额持有人新增的环保母基份额=$\frac{NUM_{环保A}^{E}\times(NAV_{环保A}^{E}-1.0000)}{NAV_{环保母}^{E}}$

其中：

$NUM_{环保A}^{E}$：份额折算前环保A端份额的份额数，下同

3、环保B端份额

每个会计年度不对环保B端进行定期份额折算（除非定期折算时同时满足不定期折算的条件），不改变其份额参考净值及其份额数。

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。

环保母基份额的场外份额经折算后的份额数采用四舍五入的方式保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产；环保母基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。

环保A端的新增环保母基场内份额取整计算（最小单位为1份），余额计入基金财产。

4、举例：

假设2016年1月4日为定期份额折算日，当日折算前环保母基份额的基金份额净值为0.9000元，环保A端份额的基金份额净值为1.0640元，环保B端份额的基金份额净值为0.7360元，投资人甲持有环保母基份额的场内份额10000份，投资人乙持有环保A端份额5000份，投资人丙持有环保母基份额的场外份额10000份，投资人丁持有环保B端份额8000份，则：

份额折算日份额折算后环保母基份额的基金份额净值=0.9000−0.5×(1.0640−1.0000)=0.8680元，环保A端份额的基金份额净值=1.0000元，环保B端份额的基金份额净值=0.7360元。

投资人甲新增的环保母基份额数=[0.5×10000×(1.0640−1.0000)]／0.8680=368份（场内份额截位取整计算，最小单位为1份，余额计入基金财产）

投资人乙新增的环保母基份额数=[5000×(1.0640−1.0000)]／0.8680=368份（场内份额截位取整计算，最小单位为1份，余额计入基金财产）

投资人丙新增的环保母基份额数=[0.5×10000×(1.0640−1.0000)]／0.8680=368.66份（场外新增份额数采用四舍五入的方式保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产）

即：份额折算日份额折算后，投资人甲共持有环保母基份额的场内份额10368份，投资人乙共持有环保A端份额5000份及环保母基份额的场内份额368份，投资人丙共持有环保母基份额的场外份额10368.66份，投资人丁仍持有环保B端份额8000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2016年1月4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、配对转换业务；环保A端、环保B端正常交易。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2016年1月5日），本基金暂停办理申购、赎回、转托管、配对转换业务，环保A端暂停交易，环保B端正常交易。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2016年1月6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，环保A端恢复交易（自该日上午9:30至10:30仍然暂停交易，自该日上午10:30起恢复交易），环保B端正常交易。

（四）根据深圳证券交易所《关于分级基金份额折算后次日前收盘价调整的通知》，2016年1月6日环保A端复牌首日即时行情显示的前收盘价为2016年1月5日的环保A端份额净值（四舍五入至0.001元）。由于环保A端折算前可能存在折/溢价交易情形，折算前的收盘价扣除2015年约定收益后与2016年1月6日的前收盘价可能有较大差异，1月6日当日可能出现交易价格大幅波动的情形。敬请投资者留意投资风险。

由于环保A端份额新增份额折算成环保母基份额的场内份额数和环保母基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，持有较少环保A端份额数或场内环保母基份额数的份额持有人存在无法获得新增场内环保母基份额的可能性。

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.icbccs.com.cn或者拨打本公司客服电话：400—811—9999(免长途话费)。

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。

工银瑞信基金管理有限公司
2015年12月29日

关于工银瑞信中证新能源指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务的公告

根据《工银瑞信中证新能源指数分级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，工银瑞信中证新能源指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）将在2016年1月4日办理定期份额折算业务。相关事项公告如下：

一、基金份额折算基准日

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1月份的第一个工作日。本次定期份额折算的基准日为2016年1月4日。

二、基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的工银瑞信中证新能源指数分级证券投资基金之基础份额（以下简称“新能母基”，交易代码：164821）和工银瑞信中证新能源指数分级证券投资基金之A份额（以下简称“新能A级”，交易代码：150327）。

三、基金份额折算方式

新能A级份额和新能B级份额按照基金合同规定的参考净值计算规则进行计算，对新能A级份额的应得收益进行定期份额折算，每2份新能母基份额将按1份新能A级份额获得约定应得收益的新增折算份额。

在基金份额折算前与折算后，新能A级份额和新能B级份额的份额配比保持1:1 的比例。

对于新能A级份额的约定年化应得收益，即除基金合同另有约定外，新能A级份额每个基金份额定期折算基准日份额参考净值超过1.0000元的部分，将折算为场内新能母基份额分配给新能A级份额持有人。新能母基份额持有人持有的每2份新能母基份额将按1份新能A级份额获得新增新能母基份额的分配。持有场外新能母基份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外新能母基份额的分配；持有场内新能母基份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内新能母基份额的分配。经过上述份额折算，新能A级份额和新能母基份额的基金份额（参考）净值将相应调整。

有关计算公式如下：

1、新能母基份额折算

$$NAV_{新能母}^{E}=NAV_{新能母}^{E}-\frac{5\times(NAV_{新能母}^{E}-1.0000)}{10}$$

新能母基份额持有人新增的新能母基份额=$\frac{5\times NUM_{新能母}^{E}\times(NAV_{新能母}^{E}-1.0000)}{10\times NAV_{新能母}^{E}}$

定期份额折算后新能母基份额份额数=定期份额折算前新能母基份额份额数+应得定期份额折算后新能母基份额份额数

其中：

$NAV_{新能母}^{E}$：份额折算前新能母基份额的基金份额净值，下同

$NAV_{新能母}^{E}$：份额折算后新能母基份额的基金份额净值，下同

$NAV_{新能A}^{E}$：份额折算前新能A端份额的基金份额参考净值，下同

$NUM_{新能母}^{E}$：份额折算前新能母基份额的份额数，下同

2、新能A级份额折算

应得份额折算后新能A端份额的基金份额参考净值=1.0000

定期份额折算后新能A端份额份额数=定期份额折算前新能A端份额的份额数+应得份额折算后新能A端份额份额数

新能A端份额持有人新增的新能母基份额=$\frac{NUM_{新能A}^{E}\times(NAV_{新能A}^{E}-1.0000)}{NAV_{新能母}^{E}}$

其中：

$NUM_{新能A}^{E}$：份额折算前新能A端份额的份额数，下同

3、新能B级份额

每个会计年度不对新能B级进行定期份额折算（除非定期折算时同时满足不定期折算的条件），不改变其份额参考净值及其份额数。

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。

新能母基份额的场外份额经折算后的份额数采用四舍五入的方式保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产；新能母基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。

新能A级的新增新能母基场内份额取整计算（最小单位为1份），余额计入基金财产。

4、举例：

假设2016年1月4日为定期份额折算日，当日折算前新能母基份额的基金份额净值为0.9000元，新能A级份额的基金份额净值为1.0640元，新能B级份额的基金份额净值为0.7360元，投资人甲持有新能母基份额的场内份额10000份，投资人乙持有新能A级份额5000份，投资人丙持有新能母基份额的场外份额10000份，投资人丁持有新能B级份额8000份，则：

份额折算日份额折算后新能母基份额的基金份额净值=0.9000−0.5×(1.0640−1.0000)=0.8680元，新能A级份额的基金份额净值=1.0000元，新能B级份额的基金份额净值=0.7360元。

投资人甲新增的新能母基份额数=[0.5×10000×(1.0640−1.0000)]／0.8680=368份（场内份额截位取整计算，最小单位为1份，余额计入基金财产）

投资人乙新增的新能母基份额数=[5000×(1.0640−1.0000)]／0.8680=368份（场内份额截位取整计算，最小单位为1份，余额计入基金财产）

投资人丙新增的新能母基份额数=[0.5×10000×(1.0640−1.0000)]／0.8680=368.66份（场外新增份额数采用四舍五入的方式保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产）

即：份额折算日份额折算后，投资人甲共持有新能母基份额的场内份额10368份，投资人乙共持有新能A级份额5000份及新能母基份额的场内份额368份，投资人丙共持有新能母基份额的场外份额10368.66份，投资人丁仍持有新能B级份额8000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2016年1月4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、配对转换业务；新能A级、新能B级正常交易。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2016年1月5日），本基金暂停办理申购、赎回、转托管、配对转换业务，新能A级暂停交易，新能B级正常交易。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2016年1月6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，新能A级恢复交易（自该日上午9:30至10:30仍然暂停交易，自该日上午10:30起恢复交易），新能B级正常交易。

（四）根据深圳证券交易所《关于分级基金份额折算后次日前收盘价调整的通知》，2016年1月6日新能A级复牌首日即时行情显示的前收盘价为2016年1月5日的新能A级的份额净值（四舍五入至0.001元）。由于新能A级折算前可能存在折/溢价交易情形，折算前的收盘价扣除2015年约定收益后与2016年1月6日的前收盘价可能有较大差异，1月6日当日可能出现交易价格大幅波动的情形。

五、重要提示

根据深圳证券交易所《关于分级基金份额折算后次日前收盘价调整的通知》，2016年1月6日新能A级复牌首日即时行情显示的前收盘价为2016年1月5日的新能A级份额净值（四舍五入至0.001元）。由于新能A级折算前可能存在折/溢价交易情形，折算前的收盘价扣除2015年约定收益后与2016年1月6日的前收盘价可能有较大差异，1月6日当日可能出现交易价格大幅波动的情形。敬请投资者留意投资风险。

由于新能A级份额新增份额折算成新能母基份额的场内份额数和新能母基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，持有较少新能A级份额数或场内新能母基份额数的份额持有人存在无法获得新增场内新能母基份额的可能性。

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.icbccs.com.cn或者拨打本公司客服电话：400—811—9999(免长途话费)。

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。