

泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金 办理不定期份额折算业务的公告

根据《泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）的相关规定，泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）之基础份额泰信 400 份额的基金份额净值达到 2.000 元时，本基金将办理不定期份额折算业务。

截至 2015 年 4 月 7 日，泰信 400 份额净值为 2.031 元，达到基金合同规定的不定期折算条件。根据基金合同及深圳证券交易所、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 4 月 8 日为基准日办理不定期折算业务。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 4 月 8 日。

二、基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金之基础份额（以下简称“泰信 400”，交易代码：162907）、泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金之 A 份额（以下简称“泰信 400A”，交易代码：150094）和泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金之 B 份额（以下简称“泰信 400B”，交易代码：150095）。

三、基金份额折算方式

当泰信基本面 400 份额的基金份额净值达到 2.000 元后，本基金将分别对泰信基本面 400A 份额、泰信基本面 400B 份额和泰信基本面 400 份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保泰信基本面 400A 份额和泰信基本面 400B 份额的比例为 1:1，份额折算后泰信基本面 400 份额的基金份额净值、泰信基本面 400A 份额和泰信基本面 400B 份额的基金份额参考净值均调整为 1 元。

当泰信基本面 400 份额的份额净值达到 2.000 元后，泰信基本面 400A 份额、泰信基本面 400B 份额、泰信基本面 400 份额三类份额将按照如下公式进行份额折算：

1) 泰信基本面 400A 份额折算原则：

A. 份额折算前泰信基本面 400A 份额的份额数与份额折算后泰信基本面 400A 份额的份额数相等；

B. 泰信基本面 400A 份额持有人份额折算后获得新增的份额数，即超出 1 元以上的净值部分全部折算为场内泰信基本面 400 份额。

不定期份额折算后泰信基本面 400A 份额的份额数=不定期份额折算前泰信基本面 400A 份额的份额数

泰信基本面 400A 份额持有人新增的场内泰信基本面 400 份额的份额数

$$= \frac{S_{\text{泰信基本面 400A}}^{\text{折前}} \times (\text{NAV}_{\text{泰信基本面 400A}}^{\text{折前}} - 1)}{1}$$

其中：

$S_{\text{泰信基本面 400A}}^{\text{折前}}$ ：份额折算前泰信基本面 400A 份额的份额数

$S_{泰信基本面400A}^{折}$ ：份额折算后泰信基本面 400A 份额的份额数

$NAV_{泰信基本面400A}^{折}$ ：份额折算前泰信基本面 400A 份额参考净值

2) 泰信基本面 400B 份额份额折算原则：

A. 份额折算后泰信基本面 400B 份额与泰信基本面 400A 份额的份额数保持 1:1 配比；

B. 份额折算前泰信基本面 400B 份额的资产净值与份额折算后泰信基本面 400B 份额的资产净值及新增场内泰信基本面 400 份额的资产净值之和相等；

C. 份额折算前泰信基本面 400B 的持有人在份额折算后将持有泰信基本面 400B 份额与新增场内泰信基本面 400 份额。

不定期份额折算后泰信基本面 400B 份额的份额数=不定期份额折算后泰信基本面 400A 份额的份额数

泰信基本面 400B 份额持有人新增的场内泰信基本面 400 份额的份额数

$$= \frac{S_{泰信基本面400B}^{折} \times (NAV_{泰信基本面400B}^{折} - 1)}{1}$$

其中：

$S_{泰信基本面400B}^{折}$ ：份额折算前泰信基本面 400B 份额的份额数

$S_{泰信基本面400B}^{折}$ ：份额折算后泰信基本面 400B 份额的份额数

$S_{泰信基本面400A}^{折}$ ：份额折算后泰信基本面 400A 份额的份额数

$NAV_{\text{泰信基本面 400B}}^{\text{折}}$ ：份额折算前泰信基本面 400B 份额参考净值

3) 泰信基本面 400 份额份额折算原则：

场外泰信基本面 400 份额持有人份额折算后获得新增场外泰信基本面 400 份额，场内泰信基本面 400 份额持有人份额折算后获得新增场内泰信基本面 400 份额。

$$S_{\text{泰信基本面 400}}^{\text{折}} = \frac{NAV_{\text{泰信基本面 400}}^{\text{折}} \times S_{\text{泰信基本面 400}}^{\text{折}}}{1}$$

其中：

$S_{\text{泰信基本面 400}}^{\text{折}}$ ：份额折算前泰信基本面 400 份额的份额数

$S_{\text{泰信基本面 400}}^{\text{折}}$ ：份额折算后泰信基本面 400 份额的份额数

$NAV_{\text{泰信基本面 400}}^{\text{折}}$ ：份额折算前泰信基本面 400 份额净值

泰信基本面 400 份额的场外份额经折算后的份额数保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分舍去，舍去部分所代表的资产归基金所有；泰信基本面 400 份额的场内份额经折算后的份额数保留至整数位（最小单位为 1 份），小数点以后的部分舍去，舍去部分所代表的资产归基金所有。

例：若 2012 年 11 月 1 日泰信基本面 400 份额的基金份额净值为 2.000 元，则须根据基金合同约定对泰信基本面 400 份额、泰信基本面 400 A 份额与泰信基本面 400 B 份额进行折算。

假设截止 2012 年 10 月 31 日，本基金的份额结构为：泰信基本面

400 份额为 1 亿份，泰信基本面 400A 份额为 1 亿份，泰信基本面 400B 份额为 1 亿份。泰信基本面 400 份额的基金份额净值为 2.000 元，泰信基本面 400 A 份额的基金份额参考净值为 1.064 元，泰信基本面 400 B 的基金份额参考净值为 2.936 元，那么折算的主要过程如下：

1) 泰信基本面 400A 份额折算：

泰信基本面 400A 份额的数量不变，仍为 1 亿份；

泰信基本面 400A 份额持有人新增的场内泰信基本面 400 份额的份额数为：

$$0.064 \text{ 亿份} = 1 \text{ 亿份} \times (1.064 \text{ 元} - 1 \text{ 元}) / 1 \text{ 元}$$

2) 泰信基本面 400B 份额折算：

折算后泰信基本面 400B 份额与泰信基本面 400A 份额的份额数始终保持 1: 1 配比，即折算后泰信基本面 400B 份额数量为：1 亿份；

泰信基本面 400B 份额持有人新增的场内泰信基本面 400 份额的份额数为：

$$1.936 \text{ 亿份} = 1 \text{ 亿份} \times (2.936 \text{ 元} - 1) / 1 \text{ 元}$$

3) 泰信基本面 400 份额折算：

折算后泰信基本面 400 份额的份额数为：

$$2 \text{ 亿份} = (2.000 \text{ 元} \times 1 \text{ 亿份}) / 1 \text{ 元}$$

若投资者持有 10,000 份泰信基本面 400 份额，在本次折算后其持有的份额为：泰信基本面 400 份额 20,000 份（场内与场外的数量可能略有差异）；

若投资者持有 10,000 份泰信基本面 400A 份额，在本次折算后其

持有的份额为：泰信基本面 400A 份额 10,00 份加上场内泰信基本面 400 份额 640 份；

若投资者持有 10,000 份泰信基本面 400B 份额，在本次折算后其持有的份额为：泰信基本面 400B 份额 10,000 份加上场内基本面 400 份额 1,9360 份。

以上数据均为计算方便而假设，不代表真实情况的发生。份额计算过程中，场外份额经折算后的份额数保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分舍去，舍去部分所代表的资产归基金所有；场内份额经折算后的份额数保留至整数位（最小单位为 1 份），小数点以后的部分舍去，舍去部分所代表的资产归基金所有。

四、基金份额折算期间的基金业务办理情况

（1）不定期份额折算基准日（即 2015 年 4 月 8 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）业务、配对转换业务；泰信 400A、泰信 400B 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。

（2）不定期份额折算基准日后的第一个工作日（即 2015 年 4 月 9 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）业务、配对转换业务，泰信 400A、泰信 400B 于该日停牌一天。当日，本基金注册登记人及基金管理人完成份额折算及份额登记确认。

（3）不定期份额折算基准日后的第二个工作日（即 2015 年 4 月 10 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（包括场外转托管、跨系统转托管）业务、配对转换业务，泰信 400A、泰信 400B 于 2015 年 4 月 10 日上午 9:30-10:30 停牌一小时，并于该日上午 10:30 恢复交易。

（4）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》，2015 年 4 月 10 日泰信 400A、泰信 400B 即时行情显示的前收盘价为 2015 年 4 月 9 日泰信 400A、泰信 400B 的份额净值（四舍五入至 0.001 元）。

五、重要提示

（1）泰信 400A 份额表现出低风险、收益稳定特征。但在不定期折算后，原泰信 400A 份额的持有人将持有泰信 400A 份额和场内泰信 400 份额。因此，持有人的风险收益特征将发生一定的变化，由持有单一的低风险收益特征份额变为同时持有低风险收益特征份额与较高风险收益特征份额的情况。此外，泰信 400 份额为跟踪中证锐联基本面 400 指数的基础份额，其份额净值随市场涨跌而变化，因此原泰信 400A 份额持有人可能会承担市场下跌而遭受损失的风险。

（2）泰信 400B 份额表现出高风险、高收益的特征。但在不定期折算后，原泰信 400B 份额的持有人将持有泰信 400B 份额和场内泰信 400 份额。因此，持有人的风险收益特征将发生一定的变化，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。此外，不定期折算后，杠杆倍数将大幅提升，由目前的杠杆恢复到初始的 2 倍杠杆水平，相应的，泰信 400B

份额净值随市场涨跌而增长或下降的幅度也可能相应增加。

(3) 泰信 400A 份额、泰信 400B 份额在折算前可能存在折溢价交易情形。不定期份额折算后，泰信 400A 份额、泰信 400B 份额均可能出现交易大幅波动的情形。特提请参与二级市场交易的投资者注意折溢价所带来的风险。

(4) 基金份额计算过程中，场外份额经折算后的份额数保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分舍去，舍去部分所代表的资产归基金所有；场内份额经折算后的份额数保留至整数位（最小单位为 1 份），小数点以后的部分舍去，舍去部分所代表的资产归基金所有。持有较少泰信 400A 或场内泰信 400 的份额持有人存在无法获得新增场内泰信 400 份额的可能性。

(5) 根据合同规定，折算基准日在触发阈值日后才能确定，因此折算基准日泰信 400 份额的净值可能与触发折算阈值的 2.000 元有一定差异。

(6) 本公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。投资者投资于本公司管理的基金时应认真阅读基金合同、招募说明书等文件。敬请投资者注意投资风险。

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：www.ftfund.com 或拨打本公司客服电话：400-888-5988 021-38784566。

特此公告。

泰信基金管理有限公司

2015年4月8日