

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”）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，泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金 B 类份额（以下简称“本基金”）参考净值达到或低于 0.250 元时，本基金将进行不定期份额折算。

截至 2018 年 6 月 19 日，泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金 B 类份额参考净值为 0.203 元，达到基金合同规定的不定期份额折算条件。根据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，本基金将以 2018 年 6 月 20 日为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 2018 年 6 月 20 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（场内简称“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（场内简称“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（场内简称“泰信 400B”，交易代码：150095）。

三、基金份额折算方式

泰信 400A 份额和泰信 400B 份额按照《基金合同》规定的参考净值计算规则进行参考净值计算，当泰信基本面 400B 份额的基金份额参考净值达到或低于 0.250 元时，本基金将按照以下规则进行份额折算：

当泰信基本面 400B 份额的基金份额参考净值达到或低于 0.250 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。

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 400B 份额份额折算原则：

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 份额的资产净值相等。

$$S_{\text{泰信基本面 400B}}^{\text{后}} = \frac{\text{NAV}_{\text{泰信基本面 400B}}^{\text{前}} \times S_{\text{泰信基本面 400B}}^{\text{前}}}{1}$$

其中：

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

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

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

2) 泰信基本面 400A 份额份额折算原则：

A. 份额折算前后泰信基本面 400A 份额与泰信基本面 400B 份额的份额数始终保持 1: 1 配比;

B. 份额折算前泰信基本面 400A 份额的资产净值与份额折算后泰信基本面 400A 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 400A 的持有人在份额折算后将持有泰信基本面 400A 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 400A 份额的份额数=不定期份额折算后泰信基本面 400B 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

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

其中:

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

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

$\text{NAV}_{\text{泰信基本面 400A}}^{\text{前}}$: 份额折算前泰信基本面 400A 份额参考净值

3) 泰信基本面 400 份额份额折算原则:

份额折算前泰信基本面 400 份额的资产净值与份额折算后泰信基本面 400 份额的资产净值相等。

$$S_{\text{泰信基本面 400}}^{\text{后}} = \frac{\text{NAV}_{\text{泰信基本面 400}}^{\text{前}} \times S_{\text{泰信基本面 400}}^{\text{前}}}{1}$$

其中:

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

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

$NAV_{\text{泰信基本面 400}}^{\text{前}}$ ：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。

四、不定期份额折算示例

假设在本基金的不定期份额折算日，泰信基本面 400 份额的基金份额净值、泰信基本面 400A 份额与泰信基本面 400B 份额的基金份额参考净值如下表列示，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、泰信基本面 400B 份额的基金份额参考净值均调整为 1.000 元，则各持有泰信基本面 400 份额、泰信基本面 400A 份额、泰信基本面 400B 份额 10,000 份的基金份额持有人所持有基金份额的变化如下表所示：

	折算前		折算后	
	份额净值/份额参考净值	份额数	份额净值/份额参考净值	份额数
泰信基本面 400 份额	0.657 元	10,000 份	1.000 元	6,570 份泰信基本面 400 份额
泰信 400A	1.064 元	10,000 份	1.000 元	2,500 份泰信

份额				基本 面 400A 份 额+8,140 份 场 内 泰 信 基 本 面 400 份 额
泰 信 400B 份 额	0.250 元	10,000 份	1.000 元	2,500 份 泰 信 基 本 面 400B 份 额

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。

五、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 2018 年 6 月 20 日），本基金暂停办理申购（含定期定额投资，下同）、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；泰信 400A、泰信 400B 于 2018 年 6 月 20 日上午 9:30-10:30 停牌一小时，并将于 2018 年 6 月 20 日上午 10:30 复牌。当日晚间，基金管理人计算当日基金份额净值并进行份额折算。

(2) 不定期份额折算基准日后的第一个工作日（即 2018 年 6 月 21 日），本基金暂停办理申购（含定期定额投资）、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 停牌一天。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。

(3) 不定期份额折算基准日后的第二个工作日（即 2018 年 6 月 22 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 上午开市起复牌。

(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》，2018 年 6 月 22 日泰信 400A、泰信 400B 复牌首日即时行情显示的前收盘价为 2018 年 6 月 21 日泰信 400A、泰信 400B 的份额参考净值（四舍五入至 0.001 元）。2018 年 6 月 22 日当日泰信 400A、泰信 400B 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。

六、重要提示

1、本基金泰信 400A、泰信 400B 将于 2018 年 6 月 20 日上午 9:30-10:30 停牌一小时，并将于 2018 年 6 月 20 日上午 10:30 复牌；

泰信 400A、泰信 400B 将于 2018 年 6 月 21 日停牌一天，并于 2018 年 6 月 22 日上午开市起复牌。

2、泰信 400B 份额折算基准日的基金份额参考净值与折算条件 0.250 元可能存在一定差异。

3、本基金泰信 400A 份额表现为低风险、预期收益相对稳定的特征，但在不定期份额折算后泰信 400A 持有人的风险收益特征将发生较大变化，由持有单一较低风险收益特征的泰信 400A 变为同时持有较低风险收益特征的泰信 400A 与较高收益风险特征的泰信 400 份额，

因此原泰信 400A 持有人的预期收益实现的不确定性将增加；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，其份额净值将随市场涨跌而变化，因此原泰信 400A 持有人还可能会承担因市场下跌而遭受损失的风险。

4、本基金泰信 400B 表现为高风险、高收益预期的特征，不定期份额折算后其杠杆倍数将大幅降低，将恢复到初始的杠杆水平，相应地，泰信 400B 净值随市场涨跌而增长或下降的幅度也可能相应减小。

5、特别提示：近日泰信 400B 二级市场交易价格溢价较大，在不定期折算后，泰信 400B 溢价率可能发生较大变化。特提请参与二级市场交易的投资者注意泰信 400B 高溢价率所带来的风险。

6、根据深圳证券交易所的相关业务规则，泰信 400A、泰信 400B、泰信 400 份额的场内份额经折算后的份额数均取整数计算（最小单位为 1），舍去部分计入基金财产，持有极小数量泰信 400A、泰信 400B、泰信 400 份额持有人，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。

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。

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。

泰信基金管理有限公司

2018年6月20日