

# 关于泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金 不定期份额折算结果及恢复交易的公告

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，泰信基金管理有限公司（以下简称“本公司”）以 2018 年 6 月 20 日为份额折算基准日，对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）实施不定期份额折算，现将相关事项公告如下：

## 一、 基金份额折算结果

2018 年 6 月 20 日，泰信 400 份额的场外份额经折算后的份额数采用截位法保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产；泰信 400 份额的场内份额、泰信 400A 份额、泰信 400B 份额经折算后的份额数取整计算（最小单位为 1 份），余额部分计入基金财产。基金份额折算比例按截位法精确到小数点后第 9 位，如下表所示：

基金份额名称	折算前基金份额 (单位:份)	折算前基金份 额净值 (单位:元)	份额折算比例	折算后基金份 额 (单位:份)	折算后基金份 额净值 (单位:元)
泰信 400 场外 份额	69,526,685.21	0.619	0.619389908	43,064,127.15	1.000
泰信 400 场内 份额	275,532.00	0.619	0.619389908	2,977,538.00 (注 1)	1.000
泰信 400A 份 额	3,476,171.00	1.023	0.215658715	749,666.00	1.000
			0.807462384	2,806,877.00 (注 2)	1.000

泰信 400B 份 额	3,476,171.00	0.216	0.215658715	749,666.00	1.000
----------------	--------------	-------	-------------	------------	-------

注：1、该“折算后基金份额”为折算后泰信 400 场内份额之和，包括原泰信 400 场内份额经折算后的份额以及原泰信 400A 份额经折算后产生的新增泰信 400 场内份额。

2、该“折算后基金份额”为泰信 400A 份额经折算后产生的新增泰信 400 场内份额。

投资者自公告之日起可查询经注册登记人及本公司确认的折算后份额。

## 二、恢复交易

自 2018 年 6 月 22 日起，本基金恢复办理申购（包括定投）、赎回、转托管（包括场外转托管、跨系统转托管）和配对转换业务，泰信 400A、泰信 400B 份额于 2018 年 6 月 22 日上午开市起复牌。

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 日的泰信 400A、泰信 400B 的份额参考净值（四舍五入至 0.001），分别为 1.000 元和 0.972 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。

## 三、其他需要提示的事项

1、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。

2、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会大幅减小。

3、近日，泰信 400B 份额二级市场交易价格溢价较大，不定期份额折算后，泰信 400B 份额溢价率可能发生较大变化。提醒参与二级市场交易的投资者注意泰信 400B 份额高溢价交易所带来的风险。

4、原泰信 400A 份额持有人可通过办理配对转换业务将此次折算获得的场内泰信 400 份额分拆为泰信 400A、泰信 400B 份额。

5、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不定期份额折算业务详情，请登陆本公司网：[www.ftfund.com](http://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。

特此公告。

泰信基金管理有限公司

2018年6月22日