泰信中证锐联基本面400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《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(以下简称“本基金”)将在2017年1月3日办理定期份额折算业务。相关事项提示如下:

一、基金份额折算基准日

根据基金合同的约定,定期份额折算基准日为每个会计年度第一个工作日。本次定期折算的基准日为2017年1月3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)和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)。

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,对泰信400A份额的应得收益进行定期份额折算,每2份泰信400份额将按1份泰信400A份额获得约定应得收益的新增折算份额。

对于泰信400A份额期末的约定应得收益,即泰信400A份额每个

会计年度 12 月 31 日份额参考净值超出 1.000 元部分，将折算为场内泰信 400 份额分配给泰信 400A 份额持有人。泰信 400 份额持有人持有的每 2 份泰信 400 份额将按 1 份泰信 400A 份额获得新增泰信 400 份额的分配。持有场外泰信 400 份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外泰信 400 份额的分配；持有场内泰信 400 份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内泰信 400 份额的分配。经过上述份额折算，泰信 400A 份额的基金份额参考净值和泰信 400 份额的基金份额净值将相应调整。

在基金份额折算前与折算后，泰信 400A 份额和泰信 400B 份额的份额配比保持 1:1 的比例。

每个会计年度的第一个工作日进行泰信 400A 份额上一年度应得收益的定期份额折算，有关计算公式如下：

（1）泰信 400A 份额

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

$$NAV^{折}_{泰信基本面\ 400} = \frac{折算前泰信基本面\ 400\ 份额的资产净值 - (每份泰信基本面\ 400A\ 份额期末资产净值 - 1) \times 0.5 \times S^{折}_{泰信基本面\ 400}}{S^{折}_{泰信基本面\ 400}}$$

$$泰信基本面\ 400A\ 份额持有人新增的场内泰信基本面\ 400\ 份额的份额数 = \frac{S^{折}_{泰信基本面\ 400A} \times (每份泰信基本面\ 400A\ 份额期末资产净值 - 1)}{NAV^{折}_{泰信基本面\ 400}}$$

其中：

$NAV^{折}_{泰信基本面400}$：份额折算后泰信 400 份额净值

$S^{前}_{泰信基本面400}$：份额折算前泰信 400 份额的份额数

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

（2）泰信 400B 份额

定期份额折算不改变泰信 400B 份额参考净值及其份额数。

（3）泰信 400 份额

$$NAV^{折}_{泰信基本面400} = \frac{\text{折算前泰信基本面 400 份额为资产净值} - (\text{等份泰信基本面 400A 份额期末资产净值} - 1) \times 0.5 \times S^{前}_{泰信基本面400}}{S^{前}_{泰信基本面400}}$$

$$\text{泰信基本面 400 份额持有人新增的泰信基本面 400 份额的份额数} = \frac{S^{前}_{泰信基本面400} \times 0.5 \times (\text{等份泰信基本面 400A 份额期末资产净值} - 1)}{NAV^{折}_{泰信基本面400}}$$

定期份额折算后泰信 400 份额持有人持有的份额数=定期份额折算前泰信 400 份额的份额数+泰信 400 份额持有人新增的泰信 400 份额的份额数

其中：

$NAV^{折}_{泰信基本面400}$：份额折算后泰信 400 份额净值

$S^{前}_{泰信基本面400}$：份额折算前泰信 400 份额的份额数

（4）折算后泰信 400 份额的总份额数

定期份额折算后泰信 400 份额的总份额数=定期份额折算前泰信 400 份额的份额数+泰信 400 份额持有人新增的泰信 400 份额的份额数+泰信 400A 份额持有人新增的泰信 400 份额的份额数

泰信 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 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 2015 年 1 月 2 日为本基金在 2015 年会计年度的第一个工作日，则须按照基金合同约定对泰信 400 份额与泰信 400 A 份额进行定期折算。

假设截止 2014 年 12 月 31 日，本基金的份额结构为：泰信 400 份额为 1 亿份，泰信 400A 份额为 1 亿份，泰信 400B 份额为 1 亿份。泰信 400 A 份额的基金份额参考净值为 1.070 元，泰信 400 份额的基金份额净值为 1.100 元，折算的主要过程如下：

（1）泰信 400 A 份额

泰信 400A 份额的数量不变，仍为 1 亿份；

折算后的泰信 400 份额的基金份额净值为：

1.065 元=[1 亿份 X1.100 元-（1.070 元-1）X0.5X1 亿份]/1 亿份

泰信 400 A 份额新增的场内泰信 400 份额的份额数为：

0.06572770 亿份=1 亿份 X（1.070 元-1）/1.065 元

（2）定期折算不改变泰信 400B 份额的基金份额参考净值与份额数量。

（3）泰信 400 份额

折算后的泰信 400 份额的基金份额净值为:

1.065 元=[1 亿份 X1.100 元-（1.070 元-1）X0.5X1 亿份]/1 亿份

泰信 400 份额新增的场内泰信 400 份额的份额数为:

0.03286385 亿份=1 亿份 X0.5X（1.070 元-1）/1.065 元

（4）定期折算后泰信 400 份额的总份额数

=1 亿份+0.06572770 亿份+0.03286385 亿份

=1.09859155 亿份

若投资者持有10,000份泰信400A份额,在本次定期折算中其2014年应得的约定收益可按比例增加场内泰信 400 份额 657 份。

若投资者持有 10,000 份场内泰信 400 份额，在本次定期折算中，可增加场内泰信 400 份额 328 份。

若投资者持有 10,000 份场外泰信 400 份额，在本次定期折算中，可增加场外泰信 400 份额 328.63 份。

四、基金份额折算期间的基金业务办理情况

（1）定期份额折算基准日（即 2017 年 1 月 3 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并进行份额折算。

（2）定期份额折算基准日后的第一个工作日（即 2017 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）业务、配对转换业务，泰信 400A 暂停交易、泰信 400B 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。

（3）定期份额折算基准日后的第二个工作日（即 2017 年 1 月 5 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 将于 2017 年 1 月 5 日开市至 10:30 暂停交易，并于 2017 年 1 月 5 日 10:30 恢复交易，泰信 400B 正常交易。

（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》，2017 年 1 月 5 日泰信 400A 复牌首日即时行情显示的前收盘价为 2017 年 1 月 4 日泰信 400A 的份额净值（四舍五入至 0.001 元）。由于泰信 400A 折算前可能存在折溢价交易情形，折算前的收盘价扣除 2016 年约定收益后与 2017 年 1 月 5 日的前收盘价可能有较大差异，2017 年 1 月 5 日当日可能出现交易价格大幅波动的情形。

五、重要提示

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。

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

2016 年 12 月 28 日