

关于诺安中证创业成长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《诺安中证创业成长指数分级证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)关于不定期份额折算的相关规定,当诺安中证创业成长指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)之基础份额(诺安创业成长份额)的基金份额净值高至 2.000 元或以上时,本基金将进行不定期份额折算。

截至 2015 年 5 月 26 日,诺安创业成长份额的基金份额净值为 2.035 元,达到基金合同规定的不定期份额折算条件。根据基金合同以及深圳证券交易所、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 5 月 27 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 2015 年 5 月 27 日。

二、基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的本基金之基础份额诺安创业成长份额(场内简称:诺安中创,交易代码:163209)、诺安稳健份额(场内简称:诺安稳健,基金代码:150073)、诺安进取份额(场内简称:诺安进取,基金代码:150075)。

三、基金份额折算方式

诺安创业成长份额、诺安稳健份额和诺安进取份额按照《基金合同》“第二十三部分、基金份额折算”规则进行不定期份额折算。

当诺安创业成长份额的基金份额净值达到 2.000 元后,本基金将分别对诺安稳健份额、诺安进取份额和诺安创业成长份额进行份额折算,份额折算后本基金将确保诺安稳健份额和诺安进取份额的比例为 4:6,份额折算后诺安稳健份额、诺安进取份额和诺安创业成长份额的基金份额净值均调整为 1 元。

当诺安创业成长份额的份额净值达到 2.000 元后,诺安稳健份额、诺安进取份额、诺安创业成长三类份额将按照如下公式进行份额折算:

(1) 诺安稳健份额

份额折算原则:

- 1) 份额折算前诺安稳健份额的份额数与份额折算后诺安稳健份额的份额数相等;
- 2) 诺安稳健份额持有人份额折算后获得新增的份额数,即超出 1 元以上的参考净值部分全部折算为场内诺安创业成长份额。

$$NUM_{\text{诺安稳健}}^{\text{后}} = NUM_{\text{诺安稳健}}^{\text{前}}$$

诺安稳健份额持有人新增的场内诺安创业成长份额的份额数

$$= \frac{NUM_{\text{诺安稳健}}^{\text{前}} \times (NAV_{\text{诺安稳健}}^{\text{前}} - 1.000)}{1.000}$$

其中:

$NUM_{\text{诺安稳健}}^{\text{前}}$: 份额折算前诺安稳健份额的份额数

$NUM_{\text{诺安稳健}}^{\text{后}}$: 份额折算后诺安稳健份额的份额数

$NAV_{\text{诺安稳健}}^{\text{前}}$ ：份额折算前诺安稳健份额参考净值

(2) 诺安进取份额

份额折算原则：

- 1) 份额折算后诺安进取份额与诺安稳健份额的份额数保持 4：6 配比；
- 2) 份额折算前诺安进取份额的资产净值与份额折算后诺安进取份额的资产净值及新增场内诺安创业成长份额的资产净值之和相等；
- 3) 份额折算前诺安进取的持有人在份额折算后将持有诺安进取份额与新增场内诺安创业成长份额。

$$NUM_{\text{诺安进取}}^{\text{后}} = NUM_{\text{诺安进取}}^{\text{前}}$$

诺安进取份额持有人新增的场内诺安创业成长份额的份额数

$$= \frac{NUM_{\text{诺安进取}}^{\text{前}} \times (NAV_{\text{诺安进取}}^{\text{前}} - 1.000)}{1.000}$$

其中：

$NUM_{\text{诺安进取}}^{\text{后}}$ ：份额折算后诺安进取份额的份额数

$NUM_{\text{诺安进取}}^{\text{前}}$ ：份额折算前诺安进取份额的份额数

$NAV_{\text{诺安进取}}^{\text{前}}$ ：份额折算前诺安进取份额参考净值

(3) 诺安创业成长份额

份额折算原则：

场外诺安创业成长份额持有人份额折算后获得新增场外诺安创业成长份额，场内诺安创业成长份额持有人份额折算后获得新增场内诺安创业成长份额。

$$NUM_{\text{创业成长}}^{\text{后}} = \frac{NUM_{\text{创业成长}}^{\text{前}} \times NAV_{\text{创业成长}}^{\text{前}}}{1.000}$$

其中：

$NUM_{\text{创业成长}}^{\text{后}}$ ：份额折算后诺安创业成长份额的份额数

$NUM_{\text{创业成长}}^{\text{前}}$ ：份额折算前诺安创业成长份额的份额数

$NAV_{\text{创业成长}}^{\text{前}}$ ：份额折算前诺安创业成长份额净值

(4) 折算后诺安创业成长份额的总份额数

折算后诺安创业成长份额的总份额数=折算前诺安创业成长份额的份额数+诺安创业成长份额持有人新增的诺安创业成长份额数+诺安稳健份额持有人新增的场内诺安创业成长份额数+诺安进取份额持有人新增的场内诺安创业成长份额数

(5) 举例

某投资人持有诺安创业成长份额、诺安稳健份额和诺安进取份额分别为 10,000 份, 10,000 份和 10,000 份，在本基金的不定期份额折算基准日，假设三类份额的基金份额净值如下表所示（为便于投资者理解，此处采用假设的净值进行计算；基准日折算前准确的净值以当日

日终基金管理人计算并经托管人复核的净值为准), 折算后, 诺安创业成长份额、诺安稳健份额和诺安进取份额的基金份额净值均调整为 1.000 元。

	折算前		折算后	
	基金份额净值 (假设值)	基金份额	基金份额净值	基金份额
诺安创业成长	2.000	10,000	1.000	20,000 份诺安创业成长份额
诺安稳健	1.025	10,000	1.000	10,000 份诺安稳健份额 + 新增 250 份诺安创业成长场内份额
诺安进取	2.650	10,000	1.000	10,000 份诺安进取份额 + 新增 16,500 份诺安创业成长场内份额

四、基金份额折算期间的基金业务办理

1、不定期份额折算基准日(即 2015 年 5 月 27 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)、配对转换业务; 诺安稳健、诺安进取交易正常。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 5 月 28 日), 本基金暂停办理申购、赎回、转托管、配对转换业务, 诺安稳健、诺安进取暂停交易。当日, 本基金注册登记人及基金管理人将完成份额登记确认及份额折算。

3、不定期份额折算基准日后的第二个工作日(即 2015 年 5 月 29 日), 基金管理人将公告份额折算确认结果, 基金份额持有人可以查询其账户内的基金份额; 诺安稳健和诺安进取将于该日上午 9:30-10:30 停牌一小时, 并于该日上午 10:30 之后复牌。自该日起, 本基金恢复办理申购、赎回、转托管、配对转换业务。

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 5 月 29 日诺安稳健和诺安进取复牌首日即时行情显示的前收盘价为 2015 年 5 月 28 日的诺安稳健和诺安进取的份额净值(四舍五入至 0.001 元)。

2015 年 5 月 29 日诺安稳健和诺安进取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。

五、重要提示

1、本基金诺安稳健、诺安进取将于 2015 年 5 月 28 日全天暂停交易, 2015 年 5 月 29 日上午 9:30-10:30 停牌一小时, 并于 2015 年 5 月 29 日上午 10:30 之后复牌。

2、本基金诺安稳健份额表现为低风险、收益相对稳定的特征, 但在不定期份额折算后, 原诺安稳健份额持有人将持有诺安稳健份额和诺安创业成长份额, 由持有单一的较低风险收益特征份额变为同时持有较低风险收益特征份额与较高风险收益特征份额, 风险收益特征将发生较大变化, 预期收益实现的不确定性将会增加; 此外, 诺安创业成长份额为跟踪中证创业成长指数的基础份额, 其份额净值将随市场涨跌而变化, 因此原诺安稳健份额持有人还可能承担因市场下跌而遭受损失的风险。

3、诺安进取份额表现为高风险、高收益的特征, 但在不定期份额折算后, 原诺安进取

额持有人将同时持有较高风险收益特征诺安进取份额与较低风险收益特征诺安创业成长份额，风险收益特征将发生较大变化，且折算后其杠杆倍数将大幅提升，由目前的杠杆恢复到初始的 1.67 倍杠杆水平。此外，诺安进取份额的基金份额参考净值随市场涨跌而增长或者下降的幅度也会大幅增加。

4、由于诺安稳健份额和诺安进取份额折算前可能存在折溢价交易情形，不定期份额折算后，诺安稳健份额和诺安进取份额的折溢价率可能随之发生较大变化。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。

5、原诺安稳健份额和诺安进取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诺安创业成长份额分拆为诺安稳健份额和诺安进取份额。

6、折算后，本基金诺安创业成长份额的份额数量会增加。根据深圳证券交易所的相关业务规则，场内份额数将取整计算（最小单位为 1 份），舍去部分计入基金资产，持有极小数量诺安稳健份额、诺安进取份额和场内诺安创业成长份额的持有人，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。

7、此次基金份额折算基准日不是触发折算阈值当日，折算基准日的诺安创业成长份额净值与折算阈值 2.000 元可能有一定差异。

8、投资者若希望了解基金份额折算业务详情，可致电诺安基金管理有限公司客户服务电话 400-888-8998 或登录本公司网站 www.lionfund.com.cn 进行查询。

风险提示：

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。敬请投资人注意投资风险。

投资者申请使用网上交易业务前，应认真阅读有关网上交易协议、相关规则，了解网上交易的固有风险，投资者应慎重选择，并在使用时妥善保管好网上交易信息，特别是账号和密码。

特此公告。

诺安基金管理有限公司
二〇一五年五月二十七日