

关于诺安中证创业成长指数分级证券投资基金定期份额折算公告

根据《诺安中证创业成长指数分级证券投资基金基金合同》（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，诺安中证创业成长指数分级证券投资基金（简称“本基金”）将在2016年1月4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

根据基金合同的规定，定期份额折算基准日为每个会计年度第一个工作日。本次定期份额折算的基准日为2016年1月4日。

二、基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的诺安稳健份额（场内简称：诺安稳健，交易代码：150073）、诺安创业成长份额（场内简称：诺安中创，交易代码：163209）。

三、基金份额折算方式

诺安稳健份额和诺安进取份额按照基金合同规定的净值计算规则进行净值计算，对诺安稳健份额的应得收益进行定期份额折算，每10份诺安创业成长份额将按4份诺安稳健份额获得约定应得收益的新增折算份额。

在基金份额折算前与折算后，诺安稳健份额和诺安进取份额的份额配比保持4:6的比例。

对于诺安稳健份额期末的约定应得收益，即诺安稳健份额每个会计年度12月31日份额参考净值超出1.000元部分，将折算为场内诺安创业成长份额分配给诺安稳健份额持有人。诺安创业成长份额持有人持有的每10份诺安创业成长份额将按4份诺安稳健份额获得新增诺安创业成长份额的分配。持有场外诺安创业成长份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外诺安创业成长份额的分配；持有场内诺安创业成长份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内诺安创业成长份额的分配。经过上述份额折算，诺安稳健份额和诺安创业成长份额的基金份额净值将相应调整。

每个会计年度第一个工作日为基金份额折算基准日，本基金将对诺安稳健份额和诺安创业成长份额进行应得收益的定期份额折算。

每个会计年度第一个工作日进行诺安稳健份额上一年度应得收益的定期份额折算时，有关计算公式如下：

$$NAV_{\text{诺安进取}} = \frac{10 \times NAV_{\text{创业成长}} - 4 \times NAV_{\text{诺安稳健}}}{6}$$

1、诺安稳健份额

定期份额折算后诺安稳健份额的份额数 = 定期份额折算前诺安稳健份额的份额数

$$NAV_{\text{创业成长}}^{\text{后}} = \frac{NAV_{\text{创业成长}}^{\text{前}} \times NUM_{\text{创业成长}}^{\text{前}} - (NAV_{\text{诺安稳健}}^{\text{期末}} - 1.000) \times \frac{4}{10} \times NUM_{\text{创业成长}}^{\text{前}}}{NUM_{\text{创业成长}}^{\text{前}}}$$

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 =

$$NUM_{\text{诺安稳健}}^{\text{前}} \times \frac{NAV_{\text{诺安稳健}}^{\text{期末}} - 1.000}{NAV_{\text{创业成长}}^{\text{后}}}$$

其中：

$NAV_{\text{创业成长}}^{\text{后}}$ ：定期份额折算后诺安创业成长份额净值

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

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

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

$NAV_{\text{诺安稳健}}^{\text{期末}}$ ：每份诺安稳健份额期末参考净值

2、诺安进取份额

每个会计年度的定期份额折算不改变诺安进取份额参考净值及其份额数。

3、诺安创业成长份额

$$NAV_{\text{创业成长}}^{\text{后}} = \frac{NAV_{\text{创业成长}}^{\text{前}} \times NUM_{\text{创业成长}}^{\text{前}} - (NAV_{\text{诺安稳健}}^{\text{期末}} - 1.000) \times \frac{4}{10} \times NUM_{\text{创业成长}}^{\text{前}}}{NUM_{\text{创业成长}}^{\text{前}}}$$

诺安创业成长份额持有人新增的诺安创业成长份额=

$$\frac{4}{10} \times NUM_{\text{创业成长}}^{\text{前}} \times \frac{NAV_{\text{诺安稳健}}^{\text{期末}} - 1.000}{NAV_{\text{创业成长}}^{\text{后}}}$$

定期份额折算后诺安创业成长份额的份额数 = 定期份额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的份额数 + 诺安稳健份额持有人新增的场内诺安创业成长份额的份额数。

其中：

$NAV_{\text{创业成长}}^{\text{后}}$ ：定期份额折算后诺安创业成长份额净值

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

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

$NAV_{\text{诺安稳健}}^{\text{期末}}$ ：每份诺安稳健份额期末参考净值

四、基金份额折算期间的基金业务办理

1、定期份额折算基准日（即 2016 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，下同）及配对转换业务；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、定期份额折算基准日后的第一个工作日（即 2016 年 1 月 5 日），本基金暂停办理申购、赎回、转托管、配对转换业务，诺安稳健暂停交易，诺安进取交易正常。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 2016 年 1 月 6 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、配对转换业务，诺安稳健上午 10 点 30 分恢复交易，诺安进取交易正常。

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》，2016 年 1 月 6 日诺安稳健复牌首日即时行情显示的前收盘价将调整为 2016 年 1 月 5 日的诺安稳健的份额净值。由于诺安稳健折算前可能存在折溢价交易情形，且诺安稳健份额折算后恢复交易首日的前收盘价以前一日的诺安稳健的基金份额净值确定，因此，诺安稳健份额 2016 年 1 月 6 日的前收盘价与份额折算前收盘价扣除 2015 年约定收益后的价格可能发生较大差异，2016 年 1 月 6 日当天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、由于诺安稳健份额新增份额折算成诺安创业成长份额的场内份额数和诺安创业成长份额的场内份额经折算后的份额数取整计算（最小单位为 1 份），舍去部分计入基金财产，持有较少诺安稳健份额数或场内诺安创业成长份额数的份额持有人存在无法获得新增场内诺安创业成长份额的可能性。因此，上述份额持有人可在基金份额折算基准日之前将原有份额卖出或者增加持有份额的数量来保证自身权益不受损害。

2、投资者可以通过访问本公司网站 www.lionfund.com.cn，或拨打本公司客户服务电话 400-888-8998 了解本次基金定期份额折算业务的相关情况。

3、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。投资者投资于基金前应认真阅读基金的基金合同、招募说明书等文件。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

诺安基金管理有限公司
二〇一五年十二月二十九日