

# 天弘瑞利分级债券型证券投资基金之瑞利 A 基金份额折算和申购与赎回结果的公告

天弘基金管理有限公司（以下简称“本公司”或“基金管理人”）于 2016 年 1 月 14 日在指定媒介及本公司网站（www.thfund.com.cn）发布了《天弘基金管理有限公司关于天弘瑞利分级债券型证券投资基金之瑞利 A 开放申购与赎回业务的公告》（简称“《开放公告》”）、《天弘瑞利分级债券型证券投资基金之瑞利 A 份额折算方案的公告》（简称“《折算公告》”）和《天弘瑞利分级债券型证券投资基金之瑞利 A 开放申购与赎回及折算期间瑞利 B 份额（000776）的风险提示公告》（简称“《风险提示公告》”）。2016 年 1 月 19 日为瑞利 A 的第 2 个基金份额折算基准日及申购开放日，现将相关事项公告如下：

## 一、本次瑞利 A 的基金份额折算结果

根据本基金《折算公告》的规定，2016 年 1 月 19 日，瑞利 A 折算前的基金份额净值为 1.02751781 元，据此计算的瑞利 A 的折算比例为 1.02751781，折算后，瑞利 A 的基金份额净值调整为 1.000 元，基金份额持有人原来持有的每 1 份瑞利 A 相应增加至 1.02751781 份。折算前，瑞利 A 的基金份额总额为 140,881,155.20 份，折算后，瑞利 A 的基金份额总额为 144,757,895.81 份。各基金份额持有人持有的瑞利 A 在开放日的基金份额净值计算将以四舍五入的方式保留到小数点后 3 位，由此产生的误差计入基金资产。

投资者自 2016 年 1 月 21 日起（含该日）可在销售机构查询其原持有的瑞利 A 份额的折算结果。

## 二、本次瑞利 A 开放申购与赎回的确认结果

经本公司统计，2016 年 1 月 19 日，瑞利 A 的有效申购申请总额 3,066,686.68 元，2016 年 1 月 18 日，瑞利 A 的有效赎回申请总份额为 559,935,620.28 份。

根据《开放公告》的规定，所有经确认有效的瑞利 A 的赎回申请全部予以成交确认，据此确认的瑞利 A 赎回总份额为 559,935,620.28 份。所有经确认有效的瑞利 A 的申购申请全部予以成交确认，据此确认的瑞利 A 申购总份额为 3,066,686.68 份。

瑞利 B 的份额数为 300,350,051.00 份。根据《基金合同》的规定，本基金《基金合同》生效之日起 3 年内，瑞利 A 的份额余额原则上不得超过 7/3 倍瑞利 B 的份额余额（即 700,816,785.66 份，下同）。

对于瑞利 A 的申购申请，如果对瑞利 A 的全部有效申购申请进行确认后，瑞利 A 的份额余额小于或等于 7/3 倍瑞利 B 的份额余额，则所有经确认有效的瑞利 A 的申购申请全部予以成交确认；如果对瑞利 A 的全部有效申购申请进行确认后，瑞利 A 的份额余额大于 7/3 倍瑞利 B 的份额余额，则在经确认后的瑞利 A 份额余额不超过 7/3 倍瑞利 B 的份额余额范围内，对全部有效申购申请按比例进行成交确认。

在发生超额申购时，申购申请的比例确认计算方法如下：

申购申请的确认比例 =  $(700,816,785.66 - \text{瑞利 A 经折算后的份额数}) / \text{比例确认前申购金额}$

投资者申购申请确认金额 = 投资者提交的有效申购申请金额 × 申购申请的确认比例

当发生比例确认时，瑞利 A 的申购申请确认金额不受申购最低限额的限制。申购申请确认金额的计算结果保留到小数点后两位，小数点两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金资产。

经本公司统计，本次瑞利 A 的全部有效申购申请经确认后，瑞利 A 的份额余额小于 7/3 倍瑞利 B 的份额余额，为此，基金管理人对于瑞利 A 的全部有效申购申请全部予以成交

确认。

本基金管理人已经根据上述原则于 2016 年 1 月 19 日对本次瑞利 A 的有效赎回申请进行了确认，于 2016 年 1 月 20 日对本次瑞利 A 的有效申购申请进行了确认，并为投资者办理了有关份额权益的注册登记变更手续。投资者可于 2016 年 1 月 21 日起到各销售网点查询申购与赎回的确认情况。未获成交确认的申购资金将于 2016 年 1 月 20 日起 5 个工作日内通过销售机构划往投资者指定银行账户。投资者赎回申请成功后，本基金管理人将自 2016 年 1 月 20 日起 7 个工作日内通过相关销售机构将赎回款项划往基金份额持有人账户。

本次瑞利 A 实施基金份额折算及开放申购与赎回结束后，本基金的总份额为 448,174,633.49 份，其中，瑞利 A 总份额为 147,824,582.49 份，瑞利 B 的基金份额未发生变化，仍为 300,350,051.00 份，瑞利 A 与瑞利 B 的份额配比为 0.49217432。

经基金管理人与基金托管人协商确定，本基金瑞利 A 自 2016 年 1 月 19 日（不含）到 2016 年 7 月 19 日（含）的利差确定为 0.25%，因此，

瑞利 A 的年约定收益率（单利）=1.5×1 年期银行定期存款利率+0.25%

其中，计算瑞利 A 从首个折算基准日（不含）至其下一折算基准日（含）的年约定收益率所使用的 1 年期银行定期存款利率为折算基准日（2016 年 1 月 19 日）前五个工作日（2016 年 1 月 12 日）中国人民银行公布并执行的金融机构人民币 1 年期定期存款基准利率 1.50%，于是：

本基金瑞利 A 自 2016 年 1 月 19 日（不含）到 2016 年 7 月 19 日（含）的年约定收益率为 2.50%。

瑞利 A 的年约定收益率计算按照四舍五入的方法保留到百分数的小数点后第 2 位。

风险提示

基金管理人承诺以诚实信用、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。投资者投资于本基金时应认真阅读本基金的《基金合同》和《招募说明书》等相关法律文件。

天弘基金管理有限公司

二〇一六年一月二十一日