

# 诺安中证创业成长指数分级证券投资基金不定期份额折算公告

根据《诺安中证创业成长指数分级证券投资基金基金合同》（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”）之诺安进取份额（场内简称：诺安进取，交易代码：150075）的基金份额净值低至 0.250 元或以下时，本基金进行不定期份额折算。

截至 2015 年 9 月 14 日，本基金诺安进取份额的基金份额参考净值为 0.231 元，达到基金合同规定的不定期份额折算条件。根据本基金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 9 月 15 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 9 月 15 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）、诺安进取份额（场内简称：诺安进取，交易代码：150075）、诺安创业成长份额（场内简称：诺安中创，基金代码：163209）。

## 三、基金份额折算方式

诺安稳健份额、诺安进取份额、诺安创业成长份额将按照《基金合同》的“二十三、基金份额折算”规则进行不定期份额折算。

当诺安进取份额的基金份额参考净值达到 0.250 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 元。

当诺安进取份额参考净值达到 0.250 元后，诺安稳健份额、诺安进取份额、诺安创业成长份额三类份额将按照如下公式进行份额折算。

### （1）诺安进取份额

份额折算原则：

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相等。

=

1.000

NUM NAV

NUM

前 前

后 诺安进取 诺安进取

诺安进取

其中：

NUM 后

诺安进取

： 份额折算后诺安进取份额的份额数

NUM 前

诺安进取

： 份额折算前诺安进取份额的份额数

NAV 前

诺安进取

： 份额折算前诺安进取份额参考净值

(2) 诺安稳健份额

份额折算原则：

1) 份额折算前后诺安稳健份额与诺安进取份额的份额数始终保持 4:6 配比；

2) 份额折算前诺安稳健份额的资产净值与份额折算后诺安稳健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) 份额折算前诺安稳健的持有人在份额折算后将持有诺安稳健份额与新增场内

诺安创

业成长份额。

4

=

6

NUM NUM

后 后

诺安稳健 诺安进取

- 1.000

=

1.000

NUM NAV NUM

NUM

前 前 后

场内 诺安稳健 诺安稳健 诺安稳健

创业成长

其中：

NUM 后

诺安稳健

： 份额折算后诺安稳健份额的份额数

NUM 后

诺安进取

： 份额折算后诺安进取份额的份额数

NUM 场内

创业成长

： 份额折算前诺安稳健份额持有人在份额折算后所持有的新增的场内诺安

创业成长份额的份额数

NUM 前

诺安稳健

： 份额折算前诺安稳健份额的份额数

NAV 前

诺安稳健

： 份额折算前诺安稳健份额参考净值

(3) 诺安创业成长份额

份额折算原则：

份额折算前诺安创业成长份额的资产净值与份额折算后诺安创业成长份额的资产

净值

相等。

=

1.000

NUM NAV

NUM

前 前

后 创业成长 创业成长

创业成长

其中：

NUM 后

创业成长

： 份额折算后诺安创业成长份额的份额数

NUM 前

创业成长

： 份额折算前诺安创业成长份额的份额数

NAV 前

创业成长

： 份额折算前诺安创业成长份额净值

份额折算后场外基金份额的份额数计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的

部分舍弃，余额计入基金财产；场内基金份额的份额数计算结果保留到整数位，余额的处理

方法按照深圳证券交易所或基金注册登记机构的相关规则及有关规定执行。

#### 四、不定期份额折算示例

设在本基金的不定期份额这三日，诺安创业成长份额的基金份额净值、诺安稳健份额与

诺安进取份额的基金份额参考净值如下表所示，折算后，诺安创业成长份额、诺安稳健份额

与诺安进取份额的基金份额参考净值均调整为 1.000 元，则各持有诺安创业成长份额、诺安

稳健份额、诺安进取份额 10,000 份的基金份额持有所持基金份额的变化如下表所示：

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

诺安创业成长份  
额

0.546 10,000 份 1.000 元

5,460 份诺安创

业成长份额

诺安稳健份额 1.018 10,000 份 1.000 元

1,540 份诺安稳

健份额+ 8,640

份诺安创业成长

场内份额

诺安进取份额 0.231 10,000 份 1.000 元

2,310 份诺安进

取份额

五、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(2015年9月15日)，本基金暂停办理申购、赎回、转换、

定期定额投资、转托管(包括系统内转托管、跨系统转托管，下同)、配对转换业务。诺安

稳健份额、诺安进取份额将于2015年9月15日上午开市至10:30停牌，并于2015年9月

15日上午10:30复牌。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(2015年9月16日)，本基金暂停办理申

购、赎回、转换、定期定额投资、转托管、配对转换业务，诺安稳健份额、诺安进取份额暂

停交易。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、不定期份额折算基准日后的第二个工作日(2015年9月17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、转换、定期定额投资、转托管、配对转换业务，诺安稳健份额、诺安进取份额将于 2015

年 9 月 17 日上午开市至 10:30 停牌，并于 2015 年 9 月 17 日上午 10:30 复牌。

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 9 月 17 日，诺安稳健份额、诺安进取份额即时行情显示的前收盘价为 2015 年 9 月 16 日

的诺安稳健份额、诺安进取份额参考净值（四舍五入至 0.001 元），2015 年 9 月 17 日当日

诺安稳健份额、诺安进取份额均可能出现交易价格大幅波动的情形。敬请投资者留意投资风险。

险。

## 六、重要提示

1、诺安稳健份额、诺安进取份额将于 2015 年 9 月 15 日上午开市至 10:30 停牌，并于

2015 年 9 月 15 日上午 10:30 复牌。

诺安稳健份额、诺安进取份额将于 2015 年 9 月 16 日全天停牌。

诺安稳健份额、诺安进取份额将于 2015 年 9 月 17 日上午开市至 10:30 停牌，并于 2015

年 9 月 17 日上午 10:30 复牌。

2、2015 年 9 月 14 日，诺安进取份额的基金份额参考净值已跌至 0.250 元以下，而折

算基准日为 2015 年 9 月 15 日，因此折算基准日诺安进取份额的基金份额参考净值与折算条

件 0.250 元可能有一定差异。

3、特别提示：近日诺安进取份额二级市场交易价格溢价较大，不定期份额折算后，诺

安进取份额的溢价率可能发生较大变化。特提请参与二级市场交易的投资者注意诺安进取份

额高溢价交易所带来的风险。

4、诺安稳健份额表现为低风险、预期收益相对稳定的特征，但在不定期份额折

算后诺

安稳健份额持有人的风险收益特征将发生较大变化，由持有单一的较低风险收益特征的诺安

稳健份额变为同时持有较低风险收益特征的诺安稳健份额与较高风险收益特征的诺安创业

成长份额，因此原诺安稳健份额持有人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会承担因市场下跌而遭受损失的风险。

5、诺安进取份额表现为高风险、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，将恢复到初始的 1.67 倍杠杆水平，相应地，诺安进取份额净值随市场涨跌而增

长或者下降的幅度也会大幅减小。

6、原诺安稳健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、诺安进取份额。

7、根据深圳证券交易所的相关业务规则，诺安稳健份额、诺安进取份额、诺安创业成

长份额的场内份额经折算后的份额数均取整计算（最小单位为 1 份），舍去部分计入基金财

产，持有极小数量诺安创业成长份额、诺安稳健、诺安进取的持有人存在折算后份额因为不

足 1 份而被强制归入基金资产的风险。

8、在二级市场可以做交易的证券公司并不全部具备中国证监会颁发的基金销售资格，

而投资者只能通过具备基金销售资格的证券公司赎回基金份额。因此，如果投资者通过不具

备基金销售资格的证券公司购买诺安稳健份额，在不定期份额折算后，则折算新增的诺安创

业成长份额无法赎回。投资者可以选择在折算前将诺安稳健份额卖出，或者在折算后将新增

的诺安创业成长份额转托管到具有基金销售资格的证券公司后赎回。

9、投资者若希望了解基金不定期份额折算业务详情，请参阅《诺安中证创业成长指数

分级证券投资基金基金合同》及《诺安中证创业成长指数分级证券投资基金招募说明书》等

相关法律文件或者拨打本公司客服电话：400—888—8998（免长途话费）。

10、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。本基金管理人提醒投资者知晓基金投资的“买者自负”原则，

在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。敬

请投资者投资于本基金前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。

特此公告。

诺安基金管理有限公司

二〇一五年九月十五日