

# 华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金

## 不定期份额折算公告

根据《华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金合同》（简称“基金合同”）第二十一部分中关于不定期份额折算的相关规定，当华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）之B份额的基金份额参考净值跌至0.2500元时，本基金将进行不定期份额折算。

截至2015年8月24日，本基金华安中证证券B份额的基金份额参考净值为0.2332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8月25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8月25日。

### 二、基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的华安中证证券份额（场内简称“证券股基”，基金代码：160419）、华安中证证券A份额（场内简称“证券股A”，基金代码150301）、华安中证证券B份额（场内简称“证券股B”，基金代码150302）。

### 三、基金份额折算方式

华安中证证券份额、华安中证证券A份额、华安中证证券B份额按照基金合同“第二十一部分 基金的份额折算”规则进行不定期份额折算。

当华安中证证券B份额的参考净值小于或等于0.2500元后，本基金在根据市场情况确定份额折算基准日后将分别对华安中证证券A份额、华安中证证券B份额和华安中证证券份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保华安中证证券A份额和华安中证证券B份额的比例为1:1，份额折算后华安中证证券份额的基金份额净值以及华安中证证券A份额和华安中证证券B份额的基金份额参考净值均调整为1.0000元。华安中证证券A份额、华安中证证券B份额、华安中证证券份额三

类份额按照如下公式进行份额折算。

具体折算如下：

### 1、华安中证证券 B 份额

份额折算原则：

份额折算前华安中证证券 B 份额的资产净值与份额折算后华安中证证券 B 份额的资产净值相等。

$$NUM_B^{\text{后}} = \frac{NAV_B^{\text{前}} \times NUM_B^{\text{前}}}{1.0000}$$

其中：

$NAV_B^{\text{前}}$ ：不定期份额折算前华安中证证券 B 份额的基金份额参考净值

$NUM_B^{\text{前}}$ ：不定期份额折算前华安中证证券 B 份额的基金份额数

$NUM_B^{\text{后}}$ ：不定期份额折算后华安中证证券 B 份额的基金份额数

### 2、华安中证证券 A 份额

份额折算原则：

A. 份额折算前后华安中证证券 A 份额与华安中证证券 B 份额始终保持 1：1 配比；

B. 份额折算前华安中证证券 A 份额的资产与份额折算后华安中证证券 A 份额的资产净值及其新增场内华安中证证券份额的资产净值之和相等；

C. 份额折算前华安中证证券 A 份额的持有人在份额折算后将持有华安中证证券 A 份额与新增场内华安中证证券份额。

$$NUM_A^{\text{后}} = NUM_B^{\text{后}}$$

华安中证证券 A 份额持有新增的场内华安中证证券份额的份额数=

$$\frac{NAV_A^{\text{前}} \times NUM_A^{\text{前}} - NUM_A^{\text{后}} \times 1.0000}{1.0000}$$

其中：

$NAV_A^{\text{前}}$ ：不定期份额折算前华安中证证券 A 份额的基金份额参考净值

$NUM_A^{\text{前}}$ ：不定期份额折算前华安中证证券 A 份额的基金份额数

$NUM_A^{\text{后}}$ ：不定期份额折算后华安中证证券 A 份额的基金份额数

$NUM_B^{\text{后}}$ ：不定期份额折算后华安中证证券 B 份额的基金份额数

### 3、华安中证证券份额：

份额折算原则：

份额折算前华安中证证券份额的资产净值与份额折算后华安中证证券份额的资产净值相等。

$$NUM^{\text{后}} = \frac{NAV^{\text{前}} \times NUM^{\text{前}}}{1.0000}$$

其中：

$NAV^{\text{前}}$ ：不定期份额折算前华安中证证券份额的基金份额净值

$NUM^{\text{前}}$ ：不定期份额折算前华安中证证券份额的基金份额数

$NUM^{\text{后}}$ ：不定期份额折算后华安中证证券份额的基金份额数

华安中证证券份额的场外份额经折算后的份额数采用截位法保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产；华安中证证券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），余额计入基金财产。

### 四、不定期份额折算示例

假设在本基金的不定期份额折算日，华安中证证券份额的基金份额净值、华安中证证券A份额与华安中证证券B份额的基金份额参考净值如下表所示，折算后，华安中证证券份额的基金份额净值、华安中证证券A份额和华安中证证券B份额的基金份额参考净值均调整1.0000元，则各持有华安中证证券份额、华安中证证券A份额、华安中证证券B份额10,000份的基金份额持有人所持基金份额的变化如下

表所示:

	折算前		折算后		
	份额(参考) 净值	份额数	份额(参考) 净值	份额数	新增场 内份额
华安中证证券份额	0.6170 元	10,000 份	1.0000 元	6,170	
华安中证证券 A 份额	1.0280 元	10,000 份	1.0000 元	2,060	8,220
华安中证证券 B 份额	0.2060 元	10,000 份	1.0000 元	2,060	

## 五、基金份额折算期间的基金业务办理

(一) 不定期份额折算基准日(即2015年8月25日), 本基金暂停办理申购(含定期定额投资)、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; 证券股A、证券股B将于2015年8月25日上午9:30-10:30停牌一小时, 并于2015年8月25日上午10:30复牌。当日晚间, 基金管理人计算当日基金份额(参考)净值及份额折算比例。

为了参与二级市场交易的投资者注意证券股B已经触发不定期份额折算, 基金管理人将向深圳证券交易所申请临时(2015年8月25日)将证券股B场内简称变更为“\*证券股B”, 敬请投资者留意参与交易可能带来的风险。

(二) 不定期份额折算基准日后的第一个工作日(即2015年8月26日), 本基金暂停办理申购(含定期定额投资)、赎回、转托管、配对转换业务, 证券股A、证券股B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。

(三) 不定期份额折算基准日后的第二个工作日(即2015年8月27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(含定期定额投资)、赎回、转托管、配对转换业务, 证券股A、证券股B将于2015年8月27日上午9:30-10:30停牌一小时, 并于2015年8月27日上午10:30复牌。

(四) 根据《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8月27日证券股A、证券股B即时行情显示的前收盘价为2015年8月26日的证券股A、证券股B的基金份额参考净值, 2015年8月26日当日华安中证证券A份额和华安中证证券B份额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。

## 六、重要提示

1、本基金证券股A、证券股B将于2015年8月25日上午9:30-10:30停牌一小时，并于2015年8月25日上午10:30复牌。

本基金证券股A、证券股B将于2015年8月26日全天停牌，2015年8月27日上午9:30-10:30停牌一小时，并于2015年8月27日上午10:30复牌。

2、本基金华安中证证券A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华安中证证券A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华安中证证券A份额变为同时持有较低风险收益特征的华安中证证券A份额与较高风险收益特征的华安中证证券份额，因此原华安中证证券A份额持有人预期收益实现的不确定性将会增加；此外，华安中证证券份额为跟踪中证全指证券公司指数的基础份额，其份额净值将随市场涨跌而变化，因此原华安中证证券A份额持有人还可能会承担因市场下跌而遭受损失的风险。

3、本基金华安中证证券B份额表现为高风险、高预期收益的特征，不定期份额折算后其杠杆倍数将大幅降低，将恢复到初始杠杆水平，相应地，华安中证证券B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。

4、由于华安中证证券A份额、华安中证证券B份额折算前可能存在折溢价交易情形，不定期份额折算后，华安中证证券A份额、华安中证证券B份额的折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折溢价所带来的风险。

5、根据深圳证券交易所的相关业务规则，华安中证证券A份额、华安中证证券B份额、华安中证证券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，持有极小数量华安中证证券A份额、华安中证证券B份额、华安中证证券份额的持有人，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。

6、华安中证证券B份额折算基准日的基金份额参考净值与折算条件0.2500元可能有一定差异。

7、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。敬请投资者注意投资风险。

8、投资者若希望了解基金不定期份额折算业务详情，可访问本公司网站（[www.huaan.com.cn](http://www.huaan.com.cn)）或拨打全国免长途话费的客户服务电话（40088-50099）咨询相关情况。

特此公告。

华安基金管理有限公司  
二〇一五年八月二十五日