

中融中证一带一路主题指数分级证券投资基金 办理不定期份额折算公告

根据《中融中证一带一路主题指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）关于基金不定期份额折算的相关约定，当中融中证一带一路主题指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）之 B 类份额的基金份额参考净值小于或等于 0.250 元时，本基金将进行不定期份额折算。

截至 2015 年 7 月 28 日，一带一路 B 份额的基金份额参考净值为 0.239 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 7 月 29 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 7 月 29 日。

二、基金份额折算对象

中融中证一带一路主题指数分级证券投资基金之基础份额（场内简称：一带一路，基金代码：168201）、一带一路 A 份额（场内简称：一带 A，基金代码：150265）、一带一路 B 份额（场内简称：*一带 B，基金代码：150266）。

三、基金份额折算方式

中融一带一路份额、一带一路 A 份额、一带一路 B 份额按照《基金合同》“二十一、基金份额折算”规则进行不定期份额折算。

当一带一路 B 份额的基金份额参考净值小于或等于 0.250 元时，本基金将在基金份额折算日分别对中融一带一路份额、一带一路 A 份额和一带一路 B 份额进行份额折算，份额折算后一带一路 A 份额和一带一路 B 份额的比例仍保持 1:1 不变。份额折算后中融一带一路份额净值、一带一路 A 份额和一带一路 B 份额的基金份额参考净值均调整为 1.000 元，中融一带一路份额、一带一路 A 份额和一带一路 B 份额的份额数将得到相应的缩减。

1. 中融一带一路份额折算

$$\text{NUM}_{\text{母}}^{\text{后}} = (\text{NUM}_{\text{母}}^{\text{前}} \times \text{NAV}_{\text{母}}^{\text{前}}) / 1.000$$

其中，

$\text{NUM}_{\text{母}}^{\text{后}}$ ：折算后中融一带一路份额的份额数

$\text{NAV}_{\text{母}}^{\text{前}}$ ：折算前中融一带一路份额净值

$\text{NUM}_{\text{母}}^{\text{前}}$ ：折算前中融一带一路份额的份额数

中融一带一路份额的场外份额经折算后的份额数采用四舍五入的方式保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金资产；中融一带一路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），余额计入基金资产。

2. 一带一路 B 份额折算

$$\text{NUM}_{\text{B}}^{\text{后}} = (\text{NUM}_{\text{B}}^{\text{前}} \times \text{NAV}_{\text{B}}^{\text{前}}) / 1.000$$

其中，

$\text{NUM}_{\text{B}}^{\text{前}}$ ：折算前一带一路 B 份额的份额数

$\text{NUM}_{\text{B}}^{\text{后}}$ ：折算后一带一路 B 份额的份额数

$\text{NAV}_{\text{B}}^{\text{前}}$ ：折算前一带一路 B 份额的基金份额参考净值

一带一路 B 份额经折算后的份额数取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金资产。

3. 一带一路 A 份额折算

折算后一带一路 A 份额和一带一路 B 份额的份额配比保持 1:1 不变。

$$\text{一带一路 A 份额持有人新增的中融一带一路份额数} = (\text{NUM}_{\text{A}}^{\text{前}} \times \text{NAV}_{\text{A}}^{\text{前}} - \text{NUM}_{\text{A}}^{\text{后}} \times 1.000) / 1.000$$

其中：

$\text{NUM}_{\text{A}}^{\text{前}}$ ：折算前一带一路 A 份额的份额数

$\text{NUM}_{\text{A}}^{\text{后}}$ ：折算后一带一路 A 份额的份额数

$\text{NAV}_{\text{A}}^{\text{前}}$ ：折算前一带一路 A 份额的基金份额参考净值

一带一路 A 份额经折算后的份额数取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金资产。一带一路 A 份额折算成中融一带一路份额的场内份额取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金资产。

4. 折算后中融一带一路份额的总份额数

折算后中融一带一路份额的总份额数 = 不定期份额折

算后中融一带一路份额的份额数+一带一路 A 份额持有人新增的中融一带一路份额数。

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，中融一带一路份额的基金份额净值、一带一路 A 份额与一带一路 B 份额的基金份额参考净值如下表所示，折算后，中融一带一路份额的基金份额净值、一带一路 A 份额、一带一路 B 份额的基金份额参考净值均调整 1.000 元，则各持有中融一带一路份额、一带一路 A 份额、一带一路 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	
	份额净值/份额参考净值	份额数	份额净值/份额参考净值	份额数
中融一带一路份额	0.620 元	10,000 份	1.000 元	6,200 份中融一带一路份额
一带一路 A 份额	1.004 元	10,000 份	1.000 元	2,360 份一带一路 A 份额 +7,680 份一带一路份额
一带一路 B 份额	0.236 元	10,000 份	1.000 元	2,360 份一带一路 B 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（即 2015 年 7 月 29 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）、配对转换业务；一带一路 A 份额、一带一路 B 份额将于 2015 年 7 月 29 日上午 9:30-10:30 停牌一小时，并于 2015 年 7 月 29 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（即 2015 年 7 月 30 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）、配对转换业务，一带一路 A 份额、一带一路 B 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（即 2015 年 7 月 31 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，一带一路 A 份额、一带一路 B 份额将于 2015 年 7 月 31 日上午 9:30-10:30 停牌一小时，并于 2015 年 7 月 31 日上午 10:30 复牌。

4. 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 7 月 31 日一带一路 A 份额、一带一路 B 份额即时行情显示的前收盘价为 2015 年 7 月 30 日的一带一路 A 份额、一带一路 B 份额的基金份额参考净值，2015 年 7 月 31 日当日一带一路 A 份额和一带一路 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. 本基金一带一路 A 份额、一带一路 B 份额将于 2015 年 7 月 29 日上午 9:30-10:30 停牌一小时，并于 2015 年 7 月 29 日上午 10:30 复牌。

本基金一带一路 A 份额、一带一路 B 份额将于 2015 年 7 月 30 日全天停牌。

本基金一带一路 A 份额、一带一路 B 份额将于 2015 年 7 月 31 日上午 9:30-10:30 停牌一小时，并于 2015 年 7 月 31 日上午 10:30 复牌。

2. 本基金一带一路 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一带一路 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一带一路 A 份额变为同时持有较低风险收益特征的一带一路 A 份额与较高风险收益特征的中融一带一路份额，因此原一带一路 A 份额持有人预期收益实现的不确定性将会增加；此外，中融一带一路份额为跟踪中证一带一路主题指数的基础份额，其份额净值将随市场涨跌而变化，因此原一带一路 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. 本基金一带一路 B 份额表现为高风险、高收益的特征，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，一带一路 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. 由于一带一路 A 份额、一带一路 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,一带一路 A 份额、一带一路 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,一带一路 A 份额、一带一路 B 份额、中融一带一路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,持有极小数量一带一路 A 份额、一带一路 B 份额、中融一带一路份额的持有人,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. 一带一路 B 折算基准日的基金份额参考净值与折算条件 0.250 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。

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.zrfunds.com.cn 或拨打本公司客服电话 400-160-6000 (免长途费)、010-85003210 咨询相关情况。

敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

中融基金管理有限公司

2015 年 7 月 29 日