

中融基金管理有限公司

关于中融中证一带一路主题指数分级证券投资基金 不定期份额折算结果及恢复交易的公告

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》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，中融基金管理有限公司（以下简称“本公司”）以2016年1月29日为基准日，对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”）实施不定期份额折算，现将相关事项公告如下：

一、份额折算结果

2016年1月29日，中融一带一路份额（场内简称：一带一路，基金代码：168201）的场外份额经折算后的份额数按截位法保留到小数点后两位，尾差部分计入基金资产；中融一带一路的场内份额和一带一路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）经折算后的份额数取整计算（最小单位为1份）。基金份额折算比例精确到小数点后第9位，如下表所示：

基金份额名称	折算前基金份额(单位：份)	折算比例	折算后基金份额(单位：份)	折算后基金份额净值(单位：元)
中融一带一路 场外份额	74,115,640.38	0.642848162	47,645,102.29	1.000

中融一带一路场内份额	143,267,967.00	0.642848162	624,122,576.00 (注1)	1.000
一带一路A份额	730,973,298.00	0.278934029	203,893,327.00	1.000
		0.727828265	532,023,027.00 (注2)	
一带一路B份额	730,973,298.00	0.278934029	203,893,327.00	1.000

注：

- 1、该“折算后基金份额”为折算后中融一带一路场内份额之和，包括原中融一带一路场内份额经折算后的份额以及原中融一带一路A份额经折算后的新增一带一路场内份额。
- 2、该“折算后基金份额”为一带一路A份额经折算后产生的新增中融一带一路场内份额。

投资者自公告之日起可查询经注册登记人及本公司确认的折算后份额。

二、恢复交易

自2016年2月2日起，本基金恢复办理申购（含定期定额投资）、赎回、转换、转托管（包括系统内转托管和跨系统转托管）和配对转换业务，一带A、一带B将于2016年2月2日上午9:30-10:30停牌一小时后复牌。

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2月2日复牌首日一带A即时行情显示的前收盘价将调整为2016年2月1日一带一路A份额的基金份额参考净值（四舍五入至0.001元），即1.000元；一带B即时行情显示的前收盘价将调整为2016年2月1日一带一路B份额的基金份额参考净值（四舍五入至0.001元），即

0.956元。2016年2月2日当日一带A和一带B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。

三、重要提示

1. 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。

2. 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将恢复至初始杠杆水平。

3. 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，其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投资风险。

4. 一带一路A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一带一路份额分拆为一带一路A份额和一带一路B份额。

5. 根据深圳证券交易所的相关业务规则，场内份额数将取整计算（最小单位为1份），舍去部分计入基金财产，持有极小数量中融一带一路份额、一带一路A份额和一带一路B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. 本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。投资有风险，决策须谨慎。

7. 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

2016年2月2日