

中融基金管理有限公司
关于中融中证银行指数分级证券投资基金
实施转型的公告

中融基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）于2020年7月30日至2020年8月28日17:00以通讯方式组织召开了中融中证银行指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”，其中基础份额为中融银行份额（场内简称：银行母基，基金代码：168205），分级份额为银行A份额（场内简称：银行A份，基金代码：150291）及银行B份额（场内简称：银行B份，基金代码：150292））基金份额持有人大会。会议审议了《关于中融中证银行指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》（以下简称“《议案》”），《议案》于2020年9月1日获得表决通过，自该日起基金份额持有人大会决议生效，并已报中国证券监督管理委员会备案。基金管理人于2020年9月2日发布了《中融基金管理有限公司关于中融中证银行指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》（以下简称“《决议公告》”）。根据《议案》及《决议公告》，现就本基金转型相关信息公告如下：

一、关于基金合同等法律文件的修改

根据《议案》以及相关法律法规的规定，经与基金托管人海通证券股份有限公司协商一致，基金管理人已将《中融

中证银行指数分级证券投资基金基金合同》、《中融中证银行指数分级证券投资基金托管协议》分别修订为《中融中证银行指数证券投资基金（LOF）基金合同》、《中融中证银行指数证券投资基金（LOF）托管协议》，并据此编制《中融中证银行指数证券投资基金（LOF）招募说明书》。

上述文件已经中国证券监督管理委员会证监许可[2020]855号（《关于准予中融中证银行指数分级证券投资基金变更注册的批复》）准予变更注册。《中融中证银行指数证券投资基金（LOF）基金合同》、《中融中证银行指数证券投资基金（LOF）托管协议》将自2020年10月14日起生效，原《中融中证银行指数分级证券投资基金基金合同》、《中融中证银行指数分级证券投资基金托管协议》将自同一起失效。

二、关于选择期的安排

本次转型实施前的选择期为2020年9月2日至2020年10月12日。基金份额持有人在本基金正式实施转型前，可选择赎回中融银行份额或卖出银行A份与银行B份。对于在选择期内未作出选择的基金份额持有人，其持有的中融银行份额、银行A份与银行B份将在份额转换基准日，即2020年10月13日进行转换，最终转换为中融中证银行指数证券投资基金（LOF）基金份额。

在选择期内，基金管理人可根据实际情况对本基金申购、

赎回等业务进行调整，具体安排详见基金管理人发布的相关公告。

在选择期期间选择赎回的，适用中融中证银行指数分级证券投资基金的赎回费率和赎回费计入基金财产的比例。

三、关于银行 A 份及银行 B 份的终止上市和基金份额的转换

基金管理人已按照深圳证券交易所的相关规定和《中融中证银行指数分级证券投资基金基金合同》等的有关规定向深圳证券交易所申请终止本基金之银行A份及银行B份的上市交易。具体安排详见基金管理人发布的相关公告。

本基金的基金份额转换基准日为 2020 年 10 月 13 日。2020 年 10 月 13 日至 2020 年 10 月 14 日，本基金暂停办理中融银行份额的申购（含定期定额投资）、赎回及转托管（含系统内转托管及跨系统转托管）等业务。自 2020 年 10 月 13 日起，本基金终止办理基金份额的拆分及合并业务。基金转型完毕后，中融中证银行指数证券投资基金（LOF）将于 2020 年 10 月 15 日开始办理申购（含定期定额投资）、赎回及转托管等业务。

基金管理人在份额转换基准日将本基金的各类基金份额转换成基金份额净值为 1.0000 元的中融中证银行指数证券投资基金（LOF）基金份额。

在份额转换基准日，在中国证券登记结算有限责任公司

深圳分公司登记在册的中融银行份额、银行 A 份、银行 B 份将转换为中融中证银行指数证券投资基金（LOF）的场内份额，在中国证券登记结算有限责任公司登记在册的中融银行份额将转换为中融中证银行指数证券投资基金（LOF）的场外份额。

中融银行份额、银行 A 份或银行 B 份转换为中融中证银行指数证券投资基金（LOF）的场内份额数截位取整计算（最小单位为 1 份），取整后的余额计入基金资产。故基金份额转换后，由于基金份额数取整计算产生的误差，基金份额持有人存在着基金资产净值减小的风险。对于持有份额数较少的中融银行份额、银行 A 份、银行 B 份场内份额的持有人，存在着持有的基金份额转换后份额数不足一份而被计入基金资产的风险。

由中融银行份额的场内份额或中融银行份额的场外份额转换的中融中证银行指数证券投资基金（LOF）的份额数=中融银行份额的场内份额或中融银行份额的场外份额数×份额转换基准日每份中融银行份额的参考净值÷1.0000，由中融银行的场外份额转换而来的中融中证银行指数证券投资基金(LOF)的场外份额保留到小数点后第 2 位，小数点后第 3 位进行四舍五入计算，由此产生的计算误差归入基金资产。由中融银行的场内份额转换而来的中融中证银行指数证券投资基金(LOF)的场内份额进行取整计算，取整后的余额计

入基金资产。

由银行 A 份转换的中融中证银行指数证券投资基金 (LOF) 的份额数=银行 A 份的场内份额数×份额转换基准日每份银行 A 份额的参考净值÷1.0000, 由银行 A 份转换而来的中融中证银行指数证券投资基金(LOF)的场内份额进行取整计算, 取整后的余额计入基金资产。

由银行 B 份转换的中融中证银行指数证券投资基金 (LOF) 的份额数=银行 B 份的场内份额数×份额转换基准日每份银行 B 份的参考净值÷1.0000, 由银行 B 份转换而来的中融中证银行指数证券投资基金(LOF)的场内份额进行取整计算, 取整后的余额计入基金资产。

基金份额转换后, 中融中证银行指数证券投资基金 (LOF) 的基金份额净值为 1.0000 元。

如银行 A 份和银行 B 份转换后投资者选择赎回的, 赎回费率持有期从 2020 年 10 月 14 日重新计算, 请投资者注意。

四、关于基金转型后的风险收益特征提示

本基金转型前为股票型指数分级基金, 其预期风险和收益高于混合型基金、债券型和货币市场。从本基金所自动分离或分拆的两类基金份额来看, 银行 A 份具有预期风险、预期收益较低的特征, 银行 B 份具有预期风险、预期收益较高的特征。

本基金转型后为跟踪指数的股票型基金, 其预期风险和

预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

投资者欲了解本基金的详细情况，请仔细阅读本基金的《基金合同》和《招募说明书》及其更新等法律文件，如有疑问，请拨打中融基金管理有限公司客户服务电话 400-160-6000、010-56517299 或登录本公司网站 (www.zrfunds.com.cn) 获取相关信息。

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。请投资者于投资前认真阅读本基金的基金合同和招募说明书。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公告

2020年9月29日