

# 关于中融国证钢铁行业指数分级证券投资基金 定期份额折算结果及恢复交易的公告

根据中融国证钢铁行业指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）基金合同的相关业务规定，中融基金管理有限公司（以下简称“本公司”）以2020年12月15日为基金份额折算基准日，对在该日登记在册的中融钢铁份额（场内简称：钢铁母基，基金代码：168203）和钢铁A份额（场内简称：钢铁A，基金代码：150287）办理了定期份额折算业务，现将折算结果及恢复交易相关事项公告如下：

## 一、份额折算结果

2020年12月15日，中融钢铁份额的场外份额经折算后的份额数保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产；中融钢铁份额的场内份额、钢铁A份额经折算后的份额数取整计算（最小单位为1份），舍去部分计入基金财产。基金份额折算比例按截位法精确到小数点后第9位，具体结果如下表所示：

基金份额名称	折算前份额 (单位：份)	新增份额折算 比例	折算后份额（单位： 份）	折算后份额 净值（单 位：元）
中融钢铁 场内份额	5,648,173.00	0.030204025	8,233,530.00*	0.915
中融钢铁 场外份额	15,609,796.75	0.030204025	16,081,274.89	0.915
钢铁A份额	39,974,145.00	0.060408051	39,974,145.00	1.000

			新增钢铁母基金份额： 2,414,760.00	
--	--	--	----------------------------	--

\*注：该“折算后份额”包括钢铁A份额经折算后产生的新增场内中融钢铁份额。

中融钢铁场外份额经份额折算后产生新增的中融钢铁场外份额；中融钢铁场内份额经份额折算后产生新增的份额为中融钢铁场内份额；钢铁A份额经份额折算后产生新增的份额为中融钢铁场内份额。

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2020年12月17日起，本基金恢复办理赎回、转托管（但是其中场外转场内的跨系统转托管业务继续暂停）及配对转换业务（但是其中场内分拆业务继续暂停）。

钢铁A份额将于2020年12月17日上午开市起恢复交易。

## 三、重要提示

1. 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》，2020年12月17日钢铁A即时行情显示的前收盘价为2020年12月16日的钢铁A的基金份额参考净值（四舍五入至0.001元），即1.000元。由于钢铁A份额折算前存在折价交易情形，2020年12月15日的收盘价为1.031元，扣除约定收益后为0.976元，与2020年12月17日的前收盘价存在较大差异，

因此2020年12月17日当日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。

2. 本基金钢铁A份额期末的约定应得收益将折算为场内中融钢铁份额分配给钢铁A份额的持有人，而中融钢铁份额为跟踪国证钢铁指数的基础份额，其份额净值将随市场涨跌而变化，因此钢铁A份额持有人预期收益的实现存在一定的不确定性，其可能会承担因市场下跌而遭受损失的风险。

3. 由于钢铁A份额经折算产生的新增场内中融钢铁份额数和场内中融钢铁份额经折算后的份额数将取整计算（最小单位为1份），舍去部分计入基金财产，持有极小数量钢铁A份额或场内中融钢铁份额的持有人存在无法获得新增场内中融钢铁份额的可能性。

4. 本基金管理人于2020年2月6日发布了《中融国证钢铁行业指数分级证券投资基金调整场内大额申购及跨系统转托管（场外转场内）业务的公告》，2020年2月26日发布了《中融国证钢铁行业指数分级证券投资基金调整大额申购及定期定额投资业务的公告》，2020年3月10日发布了《中融基金管理有限公司关于中融国证钢铁行业指数分级证券投资基金暂停申购及定期定额投资业务的公告》，2020年3月19日发布了《中融基金管理有限公司关于旗下分级基金暂停场内份额分拆业务的公告》。根据上述公告，本基金自2020年12月17日（含当日）起恢复办理赎回、转托管（即系统内转托管、

跨系统转托管（场内转场外）业务）及配对转换业务（即场内合并业务）。本基金申购业务、定期定额投资业务、场内分拆业务及跨系统转托管（场外转场内）业务将继续暂停。详见相关公告。

5. 投资者若希望了解基金定期份额折算业务详情，可访问本公司网站 [www.zrfunds.com.cn](http://www.zrfunds.com.cn) 或拨打本公司客服电话 400-160-6000、010-56517299 咨询相关情况。

风险提示：

基金管理人将根据中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会、中国证券监督管理委员会、国家外汇管理局联合发布的《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》的要求于 2020 年底完成本基金的整改，取消分级运作机制，将钢铁 A 份额与钢铁 B 份额按照基金份额参考净值折算为场内中融钢铁份额，并终止钢铁 A 份额与钢铁 B 份额上市。

根据本基金管理人 2020 年 12 月 2 日发布的《关于中融国证钢铁行业指数分级证券投资基金之钢铁 A 份额及钢铁 B 份额终止运作、终止上市并修改基金合同的公告》，中融国证钢铁行业指数分级证券投资基金（中融钢铁份额（基础份额），场内简称：钢铁母基，基金代码：168203）之钢铁 A 份额（场内简称：钢铁 A，基金代码：150287）和钢铁 B 份额（场内简称：钢铁 B，基金代码：150288）的终止上市日为 2021 年 1 月 4 日（最后交易日为 2020 年 12 月 31 日），基

金份额折算基准日为 2020 年 12 月 31 日。以基金份额折算基准日日终中融钢铁份额的基金份额净值为基准，钢铁 A 份额和钢铁 B 份额将按照各自的基金份额参考净值折算成场内中融钢铁份额。敬请投资者关注相关风险以及基金管理人发布的相关公告，合理安排投资计划。

本基金整改将钢铁 A 份额、钢铁 B 份额按照基金份额参考净值（而不是二级市场价格）折算为场内中融钢铁份额。如果投资者在整改前以溢价买入或持有，折算后可能遭受因溢价消失带来的较大损失。请投资者注意相关投资风险。

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。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

2020 年 12 月 17 日