

建信中证互联网金融指数分级发起式证券投资基金办理不定期份额折算业务的公告

根据《建信中证互联网金融指数分级发起式证券投资基金基金合同》（简称基金合同），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，当建信中证互联网金融指数分级发起式证券投资基金（简称本基金）之建信网金 B 份额的基金份额参考净值跌至 0.250 元时，本基金将进行不定期份额折算。

截至 2018 年 2 月 6 日，建信网金 B 份额的基金份额净值为 0.2458 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 2018 年 2 月 7 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 2018 年 2 月 7 日。

二、基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的建信中证互联网金融指数分级发起式证券投资基金之建信网金份额（场内简称：网金融；代码：165315）、建信中证互联网金融指数分级发起式证券投资基金之建信网金 A 份额（场内简称：网金融 A；代码：150331）和建信中证互联网金融指数分级发起式证券投资基金之建信网金 B 份额（场内简称：*网金融 B；代码：150332）。

三、基金份额折算方式

当达到不定期折算条件时，本基金将分别对建信网金份额、建信网金 A 份额、建信网金 B 份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保建信网金 A 份额与建信网金 B 份额的比例为 1: 1，份额折算后建信网金份额的基金份额净值、建信网金 A 份额与建信网金 B 份额的基金份额参考净值均调整为 1.000 元。

当建信网金 B 份额的基金份额参考净值跌至 0.250 元时，建信网金份额、建信网金 A 份额、建信网金 B 份额将按照如下公式进行份额折算：

1) 建信网金 B 份额

份额折算前后建信网金 B 份额所对应的基金资产净值不变，即

其中，

：不定期份额折算前建信网金 B 份额的份额数，

：不定期份额折算前建信网金 B 份额的基金份额参考净值，

：不定期份额折算后建信网金 B 份额的份额数。

2) 建信网金 A 份额

份额折算后建信网金 A 份额与建信网金 B 份额的份额数保持 1: 1 配比，即

其中，

：不定期份额折算前建信网金 A 份额的份额数，

：不定期份额折算后建信网金 A 份额的份额数，

：不定期份额折算后建信网金 B 份额的份额数。

份额折算前建信网金 A 的持有人在份额折算后将持有建信网金 A 份额与新增场内建信网金份额，且所对应的基金资产净值不变。

建信网金 A 份额持有人新增的场内建信网金份额的份额数为

其中，

：不定期份额折算前建信网金 A 份额的份额数，

：不定期份额折算前建信网金 A 份额的基金份额参考净值，

：不定期份额折算后建信网金 A 份额的份额数。

3) 建信网金份额

建信网金份额持有人份额折算前后所持有的建信网金份额的资产净值不变。场外建信网金份额持有人份额折算后获得

新增场外建信网金份额，场内建信网金份额持有人份额折算后获得新增场内建信网金份额。

建信网金份额持有人不定期份额折算后的建信网金份额的份额数为

其中，

：不定期份额折算前建信网金份额的份额数，

：不定期份额折算前建信网金份额的基金份额净值，

：不定期份额折算后建信网金份额的份额数。

四、不定期份额折算示例

设在本基金的不定期份额折算日，建信网金份额的基金份额净值、建信网金 A 份额与建信网金 B 份额的基金份额参考净值如下表所示，折算后，建信网金份额的基金份额净值、建信网金 A 份额、建信网金 B 份额的基金份额参考净值均调整为 1.000 元，则各持有建信网金份额、建信网金 A 份额、建信网金 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

建信网金份额 0.624 元 10,000 份 1.000 元 6,240 份建信网金份额

建信网金 A 份额 1.008 元 10,000 份 1.000 元 2,400 份建信网金 A 份额+7,680 份建信网金份额

建信网金 B 份额 0.240 元 10,000 份 1.000 元 2,400 份建信网金 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 2018 年 2 月 7 日），本基金暂停办理申购（含定期定额投资，下同）、赎回、转托管（包括场外转托管、跨系统转托管，下同）业务、配对转换业务；网金融 A、网金融 B 于 2018 年 2 月 7 日上午开市起至 10:30 停牌一小时，并将于 2018 年 2 月 7 日 10:30 之后恢复交易。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。

为了参与二级市场交易的投资者注意网金融 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（2018 年 2 月 7 日）将网金融 B 场内简称变更为*网金融 B，并自 2018 年 2 月 8 日起恢复原证券简称，即证券简称由*网金融 B 恢复为网金融 B，证券编码保持不变。届时不再另行公告，敬请投资者留意参与交易可能带来的风险。

2、不定期份额折算基准日后的第一个工作日（即 2018 年 2 月 8 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，网金融 A、网金融 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。

3、不定期份额折算基准日后的第二个工作日（即 2018 年 2 月 9 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，网金融 A、网金融 B 复牌。

4、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》，2018 年 2 月 9 日网金融 A、网金融 B 即时行情显示的前收盘价为 2018 年 2 月 8 日的网金融 A、网金融 B 的基金份额参考净值(四舍五入至 0.001 元)，2018 年 2 月 9 日当日网金融 A、网金融 B 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、本基金网金融 A、网金融 B 将于 2018 年 2 月 7 日上午开市起至 10:30 停牌一小时，并于 2018 年 2 月 7 日 10:30 复牌。本基金网金融 A、网金融 B 将于 2018 年 2 月 8 日全天停牌，并于 2018 年 2 月 9 日开市起复牌。

2、本基金网金融 A 表现为低风险、预期收益相对稳定的特征，但在不定期份额折算后网金融 A 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网金融 A 变为同时持有较低风险收益特征的网金融 A 与较高风险收益特征的建信网金份额，因此原网金融 A 持有人预期收益实现的不确定性将会增加；此外，建信网金份额为跟踪中证互联网金融指数的基础份额，其份额净值将随市场涨跌而变化，因此原网金融 A 持有人还可能承担因市场下跌而遭受损失的风险。

3、本基金网金融 B 表现为高风险、高收益预期的特征，不定期份额折算后其杠杆倍数将大幅降低，将恢复到初始的

2 倍杠杆水平，相应地，网金融 B 净值随市场涨跌而增长或者下降的幅度也可能相应减小。

4、由于网金融 A、网金融 B 折算前可能存在折溢价交易情形，不定期份额折算后，网金融 A、网金融 B 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、原网金融 A、网金融 B 持有人可通过办理配对转换业务将此次折算获得的场内建信网金份额分拆为网金融 A、网金融 B。

6、根据深圳证券交易所的相关业务规则，网金融 A、网金融 B、建信网金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，持有极小数量网金融 A、网金融 B、建信网金份额的持有人，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。

7、网金融 B 折算基准日的份额净值与折算条件 0.250 元可能有一定差异。

投资者若希望了解基金不定期份额折算业务详情，请登陆本公司网站：www.ccbfund.cn 或者拨打本公司客服电话：

400-81-95533（免长途通话费）。

本公司承诺以诚实信用、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。投资者投资于基金前应认真阅读基金的基金合同、招募说明书等文件。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

建信基金管理有限责任公司

2018 年 2 月 7 日