

关于中融中证银行指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务的公告

根据《中融中证银行指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）的相关规定，中融中证银行指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）将以 2015 年 12 月 15 日为基金份额折算基准日办理定期份额折算业务。相关事项公告如下：

一、基金份额折算基准日

根据基金合同的规定，基金份额折算基准日为每年 12 月 15 日（若该日为非工作日，则提前至该日之前的最后一个工作日）。本次定期份额折算基准日为 2015 年 12 月 15 日。

二、基金份额折算对象

基金份额定期折算日登记在册的中融银行份额（场内简称：银行母基，基金代码：168205）和银行 A 份额（场内简称：银行 A 份，基金代码：150291）。

三、基金份额折算方式

根据基金合同的规定，定期份额折算后银行 A 份额的基金份额参考净值调整为 1.000 元，基金份额折算日折算前银行 A 份额的基金份额参考净值超出 1.000 元的部分将折算为中融银行份额的场内份额分配给银行 A 份额持有人。中融银行份额持有人持有的每两份中融银行份额将按一份银行 A 份额获得新增中融银行份额的分配，经过上述份额折算后，中融银行份额净值将相应调整。在基金份额折算前与折算后，银行 A 份额，银行 B 份额的份额配比保持 1:1 的比例。

有关计算公式如下：

1. 中融银行份额折算

$$\text{NAV 后母} = \text{NAV 前母} - 0.5 \times (\text{NAV 前 A} - 1.000)$$

$$\text{中融银行份额持有人新增的中融银行份额数} = 0.5 \times \text{NUM 前母} \times (\text{NAV 前 A} - 1.000) / \text{NAV 后母}$$

其中：

NAV 前母：定期份额折算前中融银行份额净值，下同

NAV 后母：定期份额折算后中融银行份额净值，下同

NAV 前 A：定期份额折算前银行 A 份额的基金份额参考净值，下同

NUM 前母：定期份额折算前中融银行份额的份额数，下同

持有中融银行份额的场外份额的持有人将按上述折算方式获得新增中融银行份额的场外份额的分配；持有中融银行份额的场内份额的持有人将按上述折算方式获得新增中融银行份额的场内份额的分配。

中融银行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资产；中融银行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. 银行 A 份额折算

定期份额折算后银行 A 份额的基金份额参考净值=1.000 元

定期份额折算后银行 A 份额的份额数=定期份额折算前银行 A 份额的份额数

$$\text{银行 A 份额持有人新增的中融银行份额数} = [\text{NUM 前 A} \times (\text{NAV 前 A} - 1.000)] / \text{NAV 后母}$$

其中：

NUM 前 A：定期份额折算前银行 A 份额的份额数，下同

银行 A 份额折算成中融银行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。

3. 银行 B 份额折算

银行 B 份额不进行份额折算，其基金份额参考净值和份额数保持不变。

4. 折算后中融银行份额的总份额数

折算后中融银行份额的总份额数=定期份额折算前中融银行份额的份额数+中融银行份额持有人新增的中融银行份额数+银行 A 份额持有人新增的中融银行份额数。

四、基金份额折算期间的基金业务办理

1. 定期份额折算基准日（即 2015 年 12 月 15 日），本基金暂停办理申购（含定期定额投资，下同）、赎回、转托管（包括系统内转托管和跨系统转托管，下同）及配对转换业务；银行 A 份额正常交易。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。银行 B 份额（场内简称：银行 B 份，基金代码：150292）在整个定期折算期间交易正常进行。

2. 定期份额折算基准日后的第一个工作日（即 2015 年 12 月 16 日），本基金暂停办理申购、赎回、转托管及配对转换业务，银行 A 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. 定期份额折算基准日后的第二个工作日（即 2015 年 12 月 17 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、转托管及配对转换业务，银行 A 份额自 2015 年 12 月 17 日上午 10:30 起恢复交易。

五、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》，2015 年 12 月 17 日银行 A 份即时行情显示的前收盘价为 2015 年 12 月 16 日的银行 A 份额的基金份额参考净值（四舍五入至 0.001 元）。由于银行 A 份额折算前可能存在折溢价交易情形，折算前的收盘价扣除约定收益后与 2015 年 12 月 17 日的前收盘价可能有较大差异，因此 2015 年 12 月 17 日当日可能出现交易价格大幅波动的情形。敬请投资者注意投资风险。

2. 本基金银行 A 份额期末的约定应得收益将折算为场内中融银行份额分配给银行 A 份额的持有人，而中融银行份额为跟踪中证银行指数的基础份额，其份额净值将随市场涨跌而变化，因此银行 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. 由于银行 A 份额经折算产生的新增场内中融银行份额数和场内中融银行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，持有极小数量银行 A 份额或场内中融银行份额的持有人存在无法获得新增场内中融银行份额的可能性。

4. 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 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。

风险提示：

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。敬请投资者留意投资风险。

特此公告。

中融基金管理有限公司

2015 年 12 月 10 日