

中融中证煤炭指数分级证券投资基金 可能发生不定期份额折算的风险提示公告

根据《中融中证煤炭指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）关于基金不定期份额折算的相关约定，当中融中证煤炭指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）之 B 类份额的基金份额参考净值小于或等于 0.250 元时，中融中证煤炭指数分级证券投资基金之基础份额（场内简称：煤炭母基，基金代码：168204）、煤炭 A 份额（场内简称：煤炭 A 级，基金代码：150289）、煤炭 B 份额（场内简称：煤炭 B 级，基金代码：150290）将进行不定期份额折算。

由于近期 A 股市场波动较大，截至 2016 年 5 月 23 日收盘，煤炭 B 份额的基金份额参考净值接近基金合同约定的不定期份额折算阈值，提请投资者密切关注煤炭 B 份额近期基金份额参考净值的波动情况。

针对不定期份额折算可能带来的风险，基金管理人特别提示如下：

1. 由于煤炭 A 份额、煤炭 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，煤炭 A 份额、煤炭 B 份额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高溢价所带来的风险。

2. 煤炭 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. 由于触发折算阈值当日，煤炭 B 份额的参考净值可能已低于阈值，而折算基准日在触发阈值日后才能确定，此折算基准日煤炭 B 份额的净值可能与折算阈值 0.250 元有一定差异。

4. 煤炭 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煤炭 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煤炭 A 份额变为同时持有较低风险收益特征煤炭 A 份额与较高风险收益特征的中融煤炭份额的情况，因此煤炭 A 份额持有人预期收益实现的不确定性将会增加。

本基金管理人的其他重要提示：

1. 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），舍去部分计入基金资产，持有极小数量中融煤炭份额、煤炭 A 份额、煤炭 B 份额的持有人存在折算后份额因为不足 1 份而被强制归入基金资产的风险。

2. 为保证折算期间本基金的平稳运作，基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停煤炭 A 份额与煤炭 B 份额的上市交易以及中融煤炭份额的申购、赎回等相关业务。届时本基金管理人将会对相关事项进行公告，敬请投资者予以关注。

投资者若希望了解基金不定期份额折算业务详情,请参
阅本基金基金合同及《中融中证煤炭指数分级证券投资基
金招募说明书》或者拨打本公司客服电话 400-160-6000
(免长途费)或 010-85003210。

3. 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。投资者投资于本基金前应认真阅读本基金的基金合同和
招募说明书等相关法律文件。

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 5 月 24 日