关于中融中证煤炭指数分级证券投资基金之煤炭A份额及煤炭B份额终止运作、终止上市并修改基金合同的公告

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》和《中融中证煤炭指数分级证券投资基金基金合同》等有关规定，中融中证煤炭指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”，基础份额为中融煤炭份额，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）的基金管理人中融基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）制定了本基金的分级份额终止运作的实施方案。现将煤炭A份额和煤炭B份额终止运作相关内容公告如下：

一、终止运作分级份额的基本信息

1、基金名称：中融中证煤炭指数分级证券投资基金之煤炭A份额

场内简称：煤炭A级

基金代码：150289

2、基金名称：中融中证煤炭指数分级证券投资基金之煤炭B份额

场内简称：煤炭B级

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

基金代码：150290

3、终止上市日：2021年1月4日（最后交易日为2020年12月31日）

二、分级份额终止运作的主要内容

根据《中融中证煤炭指数分级证券投资基金基金合同》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》等相关规定，基金管理人向深圳证券交易所申请煤炭A份额和煤炭B份额终止上市，现已获得深圳证券交易所同意（《终止上市通知书》深证上[2020]1121号）。煤炭A份额和煤炭B份额的终止上市日为2021年1月4日。

煤炭A份额和煤炭B份额将折算为中融煤炭份额，折算完成后投资者可以申请场内赎回基金份额或者转托管至场外后申请赎回基金份额。部分投资者可能由于所在证券公司不具备基金销售资格或其他原因无法直接办理场内赎回，需先转托管至场外后再申请赎回或者先转托管到具有基金销售资格的证券公司后再申请赎回。

三、基金份额的折算

1、份额折算基准日

本次份额折算基准日为2020年12月31日。

2、基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的煤炭A份额和煤炭B份额。

3、基金份额折算方式

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

在份额折算基准日日终，以中融煤炭份额的基金份额净值为基准，煤炭A份额和煤炭B份额按照各自的基金份额参考净值折算为场内中融煤炭份额，煤炭A份额或煤炭B份额的基金份额持有人持有的折算后的场内中融煤炭份额取整计算（最小单位为1份），余额计入基金资产。

份额折算计算公式：

煤炭A份额（或煤炭B份额）的折算比例＝份额折算基准日煤炭A份额（或煤炭B份额）的基金份额参考净值/份额折算基准日中融煤炭份额的基金份额净值

煤炭A份额（或煤炭B份额）基金份额持有人持有的折算后场内中融煤炭份额＝基金份额持有人持有的折算前煤炭A份额（或煤炭B份额）的份额数×煤炭A份额（或煤炭B份额）的折算比例

四、基金份额折算期间的基金业务办理

（一）折算基准日（即2020年12月31日），本基金中融煤炭份额暂停办理申购（含定期定额投资）、赎回、转托管（包括系统内转托管及跨系统转托管，下同）、配对转换业务。当日晚间，基金管理人计算当日基金份额（参考）净值及份额折算比例。

（二）折算基准日后的第一个工作日（即2021年1月4日），本基金中融煤炭份额继续暂停办理申购（含定期定额投资）、赎回、转托管、配对转换业务，煤炭A份额和煤炭B份额终止上市。当日，本基金登记机构为基金份额持有人办理份额登记确认。

（三）折算基准日后的第二个工作日（即2021年1月5日），

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

基金管理人将公告份额折算确认结果，基金份额持有人可以查询其账户内“中融中证煤炭指数型证券投资基金”的基金份额。当日，中融中证煤炭指数型证券投资基金恢复办理申购（含定期定额投资）、赎回、转托管业务。

五、《中融中证煤炭指数型证券投资基金基金合同》的生效

根据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》等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，并报监管部门备案，煤炭A份额和煤炭B份额终止运作后，《中融中证煤炭指数分级证券投资基金基金合同》将修订为《中融中证煤炭指数型证券投资基金基金合同》，《中融中证煤炭指数分级证券投资基金托管协议》将修订为《中融中证煤炭指数型证券投资基金托管协议》。

《中融中证煤炭指数型证券投资基金基金合同》将于2021年1月1日生效，《中融中证煤炭指数分级证券投资基金基金合同》将自同一日起失效。

《中融中证煤炭指数型证券投资基金基金合同》生效后，在符合法律法规和深圳证券交易所规定的上市条件的情况下，基金管理人可根据有关规定，申请中融中证煤炭指数型证券投资基金的基金份额上市交易。

特此公告。

中融基金管理有限公司

2020 年 12 月 2 日

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn