

关于中融中证煤炭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《中融中证煤炭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，中融中证煤炭指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）将以 2020 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 2020 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煤炭份额（场内简称：煤炭母基，基金代码：168204）和煤炭 A 份额（场内简称：煤炭 A 级，基金代码：150289）。

三、基金份额折算方式

根据基金合同的规定，定期份额折算后煤炭 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煤炭 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煤炭份额的场内份额分配给煤炭 A 份额持有人。中融煤

炭份额持有人持有的每两份中融煤炭份额将按一份煤炭 A 份额获得新增中融煤炭份额的分配，经过上述份额折算后，中融煤炭份额净值将相应调整。在基金份额折算前与折算后，煤炭 A 份额，煤炭 B 份额的份额配比保持 1: 1 的比例。

有关计算公式如下：

1. 中融煤炭份额折算

$$NAV_{母}^{后} = NAV_{母}^{前} - 0.5 \times (NAV_A^{前} - 1.000)$$

$$\text{中融煤炭份额持有人新增的中融煤炭份额数} = 0.5 \times NUM_{母}^{前} \times (NAV_A^{前} - 1.000) / NAV_{母}^{后}$$

其中：

$NAV_{母}^{前}$ ：定期份额折算前中融煤炭份额净值，下同

$NAV_{母}^{后}$ ：定期份额折算后中融煤炭份额净值，下同

$NAV_A^{前}$ ：定期份额折算前煤炭 A 份额的基金份额参考净值，下同

$NUM_{母}^{前}$ ：定期份额折算前中融煤炭份额的份额数，下同

持有中融煤炭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煤炭份额的场外份额的分配；持有中融煤炭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煤炭份额的场内份额的分配。

中融煤炭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；中融煤炭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. 煤炭 A 份额折算

定期份额折算后煤炭 A 份额的基金份额参考净值=1.000 元

定期份额折算后煤炭 A 份额的份额数=定期份额折算前煤炭 A 份额的份额数

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

其中：

$\text{NUM}_{\text{前 A}}$ ：定期份额折算前煤炭 A 份额的份额数，下同

煤炭 A 份额折算成中融煤炭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. 煤炭 B 份额折算

煤炭 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. 折算后中融煤炭份额的总份额数

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

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2020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；煤炭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。煤炭B份额（场内简称：煤炭B级，基金代码：150290）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2020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，煤炭A份额暂停交易。当日，本基金注册登记机构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2020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），煤炭A份额自2020年12月17日开市起恢复交易。

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》，2020年12月17日煤炭A级即时行情显示的前收盘价为2020年12月16日的煤炭A份额的基金份额参考净值（四舍五入至0.001元）。由于煤炭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2020年12月17日的前收盘价可能有较大差异，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。敬请投资者注意投资

风险。

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

4. 本基金管理人于2020年2月6日发布了《中融中证煤炭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《中融中证煤炭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《关于中融中证煤炭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《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 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，将煤炭 A 级与煤炭 B 级按照基金份额参考净值折算为场内中融煤炭份额，并终止煤炭 A 级与煤炭 B 级上市。

根据本基金管理人 2020 年 12 月 2 日发布的《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》，中融中证煤炭指数分级证券投资基金（中融煤炭份额（基础份额），场内简称：煤炭母基，基金代码：168204）之煤炭 A 份额（场内简称：煤炭 A 级，基金代码：150289）和煤炭 B 份额（场内简称：煤炭 B 级，基金代码：150290）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 份额将按照各自的基金份额参考净值折算成场内中融煤炭份额。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。

本基金整改将煤炭 A 级、煤炭 B 级按照基金份额参考净值（而不是二级市场价格）折算为场内中融煤炭份额。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。

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。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。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

2020 年 12 月 10 日