

关于中融中证煤炭指数分级证券投资基金之 煤炭 A 份额定期调整约定年基准收益率的公告

根据《中融中证煤炭指数分级证券投资基金基金合同》中关于中融中证煤炭指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）之煤炭 A 份额（场内简称：煤炭 A 级，基金代码：150289）约定年基准收益率的相关规定：煤炭 A 份额的约定年基准收益率为“一年期同期银行定期存款年利率（税后）加计 4%”。同期银行定期存款年利率以每个定期份额折算的折算日（即使当日并未发生定期折算的情形）中国人民银行公布并执行的金融机构人民币一年期整存整取基准利率（税后）为准，重新设定该日次日起（含该日的次日）至下一个定期份额折算日（含该日）期间煤炭 A 份额适用的年约定收益率。定期份额折算日原则上为每年的 12 月 15 日，若该日非工作日，则提前至该日之前的最后一个工作日。

基金管理人已于 2020 年 12 月 2 日发布了《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》，煤炭 A 份额和煤炭 B 份额将于 2021 年 1 月 4 日终止上市，最后交易日为 2020 年 12 月 31 日。

鉴于 2020 年 12 月 15 日中国人民银行公布并执行的金融机构人民币一年期整存整取基准利率（税后）为 1.5%，因

此 2020 年 12 月 16 日起（含该日）至最后交易日 2020 年 12 月 31 日期间煤炭 A 份额适用的约定年基准收益率为 5.5%。

投资者若希望了解有关详情，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：

本基金煤炭 A 份额表现为低风险、收益相对稳定的特征，但在本基金资产出现极端损失情况下，煤炭 A 份额持有人仍可能面临无法取得约定应得收益乃至投资本金受损的风险。投资者投资于本基金时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。

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。

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

2020 年 12 月 16 日