

关于中融中证煤炭指数分级证券投资基金 之煤炭 A 份额与煤炭 B 份额基金份额折算结果的公告

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》等的有关规定，中融中证煤炭指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”，其中基础份额为中融煤炭份额（场内简称：煤炭母基，基金代码：168204），分级份额为煤炭 A 级（场内简称：煤炭 A 级，基金代码：150289）及煤炭 B 级（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，并于 2020 年 12 月 2 日发布《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》、2020 年 12 月 29 日发布《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 份额基金份额折算的公告》。

根据上述公告，基金管理人以 2020 年 12 月 31 日为基金份额折算基准日，对在该日登记在册的煤炭 A 份额和煤炭 B 份额办理向场内中融煤炭份额折算的业务，现将折算结果公告如下：

一、份额折算结果

1、煤炭A份额和煤炭B份额经折算后的份额数取整计算（最小单位为1份），取整后余额计入基金财产。份额折算比例按截位法精确到小数点后第9位，具体结果如下表所示：

折算前基金份额名称	折算前份额数量（份）	折算比例	折算后基金份额名称	折算后份额数量（份）
煤炭A份额	121,322,027	1.029274676	场内中融煤炭份额	124,873,690
煤炭B份额	121,322,027	0.970725324		117,770,363

2、折算完成后中融煤炭份额数量如下：

折算前基金份额名称	折算前基金份额数量（份）	折算后基金份额名称	折算后份额数量（份）
场内中融煤炭份额	50,397,327	场内中融煤炭份额	293,041,380 (注1)
场外中融煤炭份额	24,119,637.55	场外中融煤炭份额	24,119,637.55

注1：该“折算后份额”为煤炭A级份额和煤炭B级份额经折算后产生的新增场内中融煤炭份额与折算前场内中融煤炭份额的合计数。

二、重要提示

1、在基金份额折算过程中，场内份额数将取整计算（最小单位为1份），取整后的余额部分计入基金资产，对于持有份额数较少的煤炭A份额与煤炭B份额的持有人，存在着持有的基金份额折算后份额数不足一份而被计入基金资产的风险。

2、《中融中证煤炭指数型证券投资基金基金合同》已于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》自同一日失效。

《中融中证煤炭指数型证券投资基金基金合同》生效后，中融中证煤炭指数分级证券投资基金的基金名称变更为“中融中证煤炭指数型证券投资基金”，场外简称不变，仍为“中融煤炭”；场内简称由“煤炭母基”变更为“中融煤炭”；基金代码不变，仍为168204。

3、中融中证煤炭指数型证券投资基金为跟踪指数的股票型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

4、《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。

在中融中证煤炭指数型证券投资基金上市交易前，中融中证煤炭指数型证券投资基金的场内份额持有人可通过赎回基金份额或转托管至场外后申请赎回的方式退出投资。中融中证煤炭指数型证券投资基金场内份额上市交易后，基金份额持有人可通过赎回或卖出的方式退出投资。

5、基金管理人自2021年1月5日起，恢复办理中融中证煤炭指数型证券投资基金的申购（含定期定额投资）、赎回、转托管（包括系统内转托管和跨系统转托管）业务。

投资者如有任何疑问，请拨打中融基金管理有限公司客

户服务电话400-160-6000、010-56517299或登录本公司网站
(www.zrfunds.com.cn) 获取相关信息。

中融基金管理有限公司

2021年1月5日