

# 关于中融中证煤炭指数分级证券投资基金 定期份额折算结果及恢复交易的公告

根据中融中证煤炭指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）基金合同的相关业务规定，中融基金管理有限公司（以下简称“本公司”）以2020年12月15日为基金份额折算基准日，对在该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）办理了定期份额折算业务，现将折算结果及恢复交易相关事项公告如下：

## 一、份额折算结果

2020年12月15日，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财产；中融煤炭份额的场内份额、煤炭A级经折算后的份额数取整计算（最小单位为1份），舍去部分计入基金财产。基金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：

| 基金份额名称   | 折算前份额（单位：份）    | 新增份额折算比例    | 折算后份额（单位：份）    | 折算后份额净值（单位：元） |
|----------|----------------|-------------|----------------|---------------|
| 中融煤炭场内份额 | 41,007,484.00  | 0.030949035 | 54,100,462.00* | 0.893         |
| 中融煤炭场外份额 | 25,104,436.71  | 0.030949035 | 25,881,394.36  | 0.893         |
| 煤炭A份额    | 191,021,085.00 | 0.061898070 | 191,021,085.00 | 1.000         |

|  |  |  |                                |  |
|--|--|--|--------------------------------|--|
|  |  |  | 新增煤炭母基份<br>额：<br>11,823,836.00 |  |
|--|--|--|--------------------------------|--|

\*注：该“折算后份额”包括煤炭A份额经折算后新增场内中融煤炭份额。

中融煤炭场外份额经份额折算后产生新增的中融煤炭场外份额；中融煤炭场内份额经份额折算后产生新增的份额为中融煤炭场内份额；煤炭A份额经份额折算后产生新增的份额为中融煤炭场内份额。

投资者自公告之日起可查询经注册登记人及本公司确认的折算后份额。

## 二、恢复交易

自2020年12月17日起，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份额将于2020年12月17日上午开市起恢复交易。

## 三、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级的基金份额参考净值（四舍五入至0.001元），即1.000元。由于煤炭A份额折算前存在折价交易情形，2020年12月15日的收盘价为1.028元，扣除约定收益后为0.973元，与2020年12月17日的前收盘价存在较大

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。敬请投资者留意投资风险。

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](http://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。

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。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

中融基金管理有限公司

2020 年 12 月 17 日