中融中证煤炭指数分级证券投资基金
可能发生不定期份额折算的风险提示公告

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”）关于基金不定期份额折算的相关约定，当中融中证煤炭指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）之 B 类份额的基金份额参考净值小于或等于 0.250 元时，中融中证煤炭指数分级证券投资基金之基础份额（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）将进行不定期份额折算。

由于近期 A 股市场波动较大，截至 2018 年 5 月 24 日收盘，煤炭 B 份额的基金份额参考净值接近基金合同约定的不定期份额折算阀值，提请投资者密切关注煤炭 B 份额近期基金份额参考净值的波动情况。

针对不定期份额折算可能带来的风险，基金管理人特别提示如下：

1．由于煤炭 A 份额、煤炭 B 份额折算前可能存在折溢价交易情形，不定期份额折算后，煤炭 A 份额、煤炭 B 份额的折溢价率可能发生较大变化。特提请参与二级市场交易的投资者注意高溢价所带来的风险。

2．煤炭 B 份额表现为高风险、高收益的特征，不定期份额折算后其杠杆将恢复至初始杠杆水平。

3．由于触发折算阀值当日，煤炭 B 份额的参考净值可能已低于阀值，而折算基准日在触发阀值日后才能确定，此折算基准日煤炭 B 份额的净值可能与折算阀值 0.250 元有一定差异。

4．煤炭 A 份额表现为低风险、收益相对稳定的特征，但在不定期份额折算后煤炭 A 份额持有人的风险收益特征将发生较大变化，由持有单一的较低风险收益特征煤炭 A 份额变为同时持有较低风险收益特征煤炭 A 份额与较高风险收益特征的中融煤炭份额的情况，因此煤炭 A 份额持有人预期收益实现的不确定性将会增加。

本基金管理人的其他重要提示：

1．根据深圳证券交易所的相关业务规则，场内份额数将取整计算（最小单位为 1 份），舍去部分计入基金资产，持有极小数量中融煤炭份额、煤炭 A 份额、煤炭 B 份额的持有人存在折算后份额因为不足 1 份而被强制归入基金资产的风险。

2．为保证折算期间本基金的平稳运作，基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停煤炭 A 份额与煤炭 B 份额的上市交易以及中融煤炭份额的申购、赎回等相关业务。届时本基金管理

人将会对相关事项进行公告，敬请投资者予以关注。

投资者若希望了解基金不定期份额折算业务详情,请参阅本基金基金合同及《中融中证煤炭指数分级证券投资基金招募说明书》或者拨打本公司客服电话 400-160-6000（免长途话费）或 010-56517299。

3．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等相关法律文件。

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

2018 年 5 月 25 日