中融中证煤炭指数分级证券投资基金
基金合同的内容摘要

一、基金管理人、基金托管人、基金份额持有人的权利、义务

（一） 基金管理人

名称：中融基金管理有限公司

住所：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室

法定代表人：王瑶

设立日期： 2013 年 5 月 31 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可〔2013〕667 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：人民币伍亿元

存续期限：持续经营

联系电话：010-85003388

（二）基金管理人的权利与义务

根据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下称“《运作办法》”）及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

1．依法募集资金；

2．自基金合同生效之日起，根据法律法规和基金合同独立运用并管理基金财产；

3．依照基金合同收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；

4．销售基金份额；

5．按照规定召集基金份额持有人大会；

6．依据基金合同及有关法律规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了基金合同及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

7．在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

8．选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

9．担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金注册登记业务并获得基金合同规定的费用；

10．依据基金合同及有关法律规定决定基金收益的分配方案；

11．在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理中融煤炭份额申购与赎回申请；

12．依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

13．在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、融券；

14．以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

15．选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；

16．在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换和非交易过户等业务规则；

17．法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

1．依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

2．办理基金备案手续；

3．自基金合同生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；

4．配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

5．建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

6．除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

7．依法接受基金托管人的监督；

8．采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，中融煤炭份额、煤炭 A 份额与煤炭 B 份额的基金份额参考净值和中融煤炭份额申购、赎回的价格；

9．进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

10．编制季度、半年度和年度基金报告；

11．严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

12．保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；

13．按基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；

14．按规定受理中融煤炭份额申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

15．依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

16．按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上；

17．确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照基金合同规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件；

18．组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

19．面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

20．因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

21．监督基金托管人按法律法规和基金合同规定履行自己的义务，基金托管

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

人违反基金合同造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

22．当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；

23．以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；

24．基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，基金合同不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；

25．执行生效的基金份额持有人大会的决议；

26．建立并保存基金份额持有人名册；

27．法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

（三） 基金托管人

名称：海通证券股份有限公司

住所：上海市广东路 689 号

办公地址：上海市广东路 689 号海通证券大厦

邮政编码：200001

法定代表人：王开国

成立时间：1988 年 8 月 15 日

基金托管业务批准文号：中国人民银行银复〔1988〕383 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：95.8472 万元人民币

存续期间：持续经营

（四）基金托管人的权利与义务

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：

1．自基金合同生效之日起，依法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产；

2．依基金合同约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

他费用；

3．监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人有违反基金合同及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

4．根据相关市场规则，为基金开设资金账户、证券账户和期货账户等投资所需账户、为基金办理证券交易资金清算；

5．提议召开或召集基金份额持有人大会；

6．在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

7．法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：

1．以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

2．设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；

3．建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

4．除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；

5．保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

6．按规定开设基金财产的资金账户、证券账户等投资所需账户，按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

7．保守基金商业秘密，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；

8．复核、审查基金管理人计算中融煤炭份额净值、煤炭 A 份额与煤炭 B 份额的基金份额参考净值和中融煤炭份额申购、赎回价格；

9．办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

10．对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见，说明基

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人有未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

11．保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；

12．建立并保存基金份额持有人名册；

13．按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

14．依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；

15．依据《基金法》、基金合同及其他有关规定，召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

16．按照法律法规和基金合同的规定监督基金管理人的投资运作；

17．参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

18．面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；

19．因违反基金合同导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

20．按规定监督基金管理人按法律法规和基金合同规定履行自己的义务，基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿；

21．执行生效的基金份额持有人大会的决议；

22．法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

（五）基金份额持有人

投资人购买本基金基金份额的行为即视为对基金合同的承认和接受，投资人自依据基金合同取得基金份额，即成为本基金份额持有人和基金合同当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为基金合同当事人并不以在基金合同上书面签章或签字为必要条件。

中融煤炭份额、煤炭 A 份额和煤炭 B 份额仅在其各自份额类别内拥有同等的权益。如果煤炭 A 份额和煤炭 B 份额终止运作，则在终止煤炭 A 份额和煤炭 B 份额的运作后，本基金每份基金份额具有同等的合法权益。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

同一类别每份基金份额具有同等的合法权益。

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的权利包括但不限于：

1．分享基金财产收益；

2．参与分配清算后的剩余基金财产；

3．依法申请赎回其持有的中融煤炭份额、依法转让其持有的煤炭 A 份额和煤炭 B 份额；

4．按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会；

5．出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；

6．查阅或者复制公开披露的基金信息资料；

7．监督基金管理人的投资运作；

8．对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；

9．法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

1．认真阅读并遵守基金合同、招募说明书等信息披露文件；

2．了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；

3．关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；

4．缴纳基金认购、申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用；

5．在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；

6．不从事任何有损基金及其他基金合同当事人合法权益的活动；

7．执行生效的基金份额持有人大会的决议；

8．返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；

9．法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

（一）基金份额持有人大会由基金份额持有人或其合法的代理人组成。基金

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

份额持有人大会的审议事项应分别由中融煤炭份额、煤炭 A 份额、煤炭 B 份额的基金份额持有人独立进行表决。基金份额持有人持有的每一基金份额在其对应的份额级别内拥有平等的投票权。

本基金份额持有人大会不设日常机构。

（二）召开事由

1．当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

（1）终止基金合同；

（2）转换基金运作方式；

（3）变更基金类别；

（4）变更基金投资目标、投资范围或投资策略（法律法规、中国证监会另有规定的除外）；

（5）变更基金份额持有人大会程序；

（6）更换基金管理人、基金托管人；

（7）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但法律法规要求提高该等报酬标准的除外；

（8）本基金与其他基金的合并；

（9）终止煤炭 A 份额与煤炭 B 份额的运作；

（10）基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

（11） 终止煤炭 A 份额、煤炭 B 份额上市，但因本基金不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的除外；

（12）单独或合计持有 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（①以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同；②指单独或合计持有中融煤炭份额、煤炭 A 份额、煤炭 B 份额各自的基金总份额 10%以上基金份额的基金份额持有人，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；

（13）对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；

（14）法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

2．出现以下情形之一的，可由基金管理人和基金托管人协商后修改基金合同，不需召开基金份额持有人大会：

（1）调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；

（2）在法律法规和本基金合同规定的范围内且在对基金份额持有人利益无

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

实质不利影响的前提下，调整中融煤炭份额的申购费率、调低赎回费率或收费方式；

（3）因相应的法律法规、深圳证券交易所或登记机构相关业务规则发生变动必须对基金合同进行修改；

（4）法律法规要求增加的基金费用的收取；

（5）对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生重大变化或基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；

（6）按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

（三）会议召集人和召集方式

1．除法律法规或本基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。基金管理人未按规定召集或者不能召集时，由基金托管人召集。

2．基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当自行召集，并自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

3. 单独或合计持有 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，单独或合计持有 10%以上（含 10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

4．单独或合计持有 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

持有 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会，但应当至少提前 30 日向中国证监会备案。

5．基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

（四）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1．基金份额持有人大会的召集人（以下简称“召集人”）负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。召开基金份额持有人大会，召集人必须于会议召开日前 30 日在指定媒介公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容：

（1）会议召开的时间、地点和会议形式；

（2）会议拟审议的主要事项、议事程序和表决方式；

（3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；

（4）授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；

（5）会务常设联系人姓名及联系电话；

（6）出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；

（7）召集人需要通知的其他事项；

2．采用通讯方式开会并进行表决的情况下，由召集人决定并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

3．如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人经有效通知拒不派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

（五）基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式以及法律法规及或监管机构允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

1．现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或基金托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

（1）亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；

（2）经核对，汇总到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示，全部有效凭证所对应的基金份额应占权益登记日基金总份额的二分之一以上（指全部有效凭证所对应的中融煤炭份额、煤炭 A 份额、煤炭 B 份额分别占权益登记日各自基金份额的二分之一以上，含二分之一）。若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一（指全部有效凭证所对应的中融煤炭份额、煤炭 A 份额、煤炭 B 份额分别占权益登记日各自基金份额的三分之一）；

2．通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式在表决截至日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

（1）会议召集人按《基金合同》约定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；

（2）召集人按基金合同约定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力；

（3）本人直接出具书面意见和授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的二分之一以上（指本人直接出具

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的中融煤炭份额、煤炭 A 份额、煤炭 B 份额占权益登记日各自基金份额的二分之一以上，含二分之一）；若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一（指本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的中融煤炭份额、煤炭 A 份额、煤炭 B 份额占权益登记日各自基金份额的三分之一）；

（4）上述第（3）项中直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金注册登记机构记录相符。

3．在法律法规和监管机关允许的情况下，本基金的基金份额持有人亦可采用其他非书面方式授权其代理人出席基金份额持有人大会，具体方式在会议通知中列明。

4．在会议召开方式上，本基金亦可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。基金份额持有人可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式进行表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

（六）议事内容与程序

1．议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如基金合同的重大修改、决定终止基金合同、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及基金合同规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开前及时公告。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

2．议事程序

（1）现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照规定程序宣布会议议事程序及注意事项，确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，经合法执业的律师见证后形成大会决议。

大会由召集人授权代表主持。基金管理人为召集人的，其授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权代表主持；如果基金管理人和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人以所代表的基金份额二分之一以上（含二分之一）多数选举产生一名代表作为该次基金份额持有人大会的主持人。

召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证号码、持有或代表有表决权的基金份额数量、委托人姓名（或单位名称）等事项。

（2）通讯方式开会

在通讯表决开会的方式下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后第 2 个工作日在公证机关及监督人的监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。如监督人经通知但拒绝到场监督，则在公证机关监督下形成的决议有效。

3．基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

（七）决议形成的条件、表决方式、程序

1．中融煤炭份额、煤炭 A 份额与煤炭 B 份额的基金份额持有人所持每一基金份额在其对应的份额级别内享有平等的表决权。

2．基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

（1）一般决议

一般决议须经出席会议的中融煤炭份额、煤炭 A 份额与煤炭 B 份额的基金份额持有人（或其代理人）所持中融煤炭份额、煤炭 A 份额与煤炭 B 份额各自的表决权的二分之一（含二分之一）以上通过方为有效，除下列（2）所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过；

（2）特别决议

特别决议须经出席会议的中融煤炭份额、煤炭 A 份额与煤炭 B 份额的基金份额持有人（或其代理人）所持中融煤炭份额、煤炭 A 份额与煤炭 B 份额各自

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

的表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方为有效；涉及更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、终止基金合同、本基金与其他基金合并、煤炭 A 份额与煤炭 B 份额终止运作必须以特别决议通过方为有效。

3．基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

4．采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

5．基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

6．基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

（八）计票

1．现场开会

（1）如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，则基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与基金管理人、基金托管人授权的一名监督员共同担任监票人；但如果基金管理人和基金托管人的授权代表未出席，则大会主持人可自行选举三名基金份额持有人代表担任监票人。

（2）监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点，由大会主持人当场公布计票结果。

（3）如大会主持人对于提交的表决结果有异议，可以对投票数进行重新清点；如大会主持人未进行重新清点，而出席大会的基金份额持有人或代理人对大会主持人宣布的表决结果有异议，其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，大会主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

（4）计票过程应由公证机关予以公证，基金管理人或基金托管人拒不出席大会的，不影响计票的效力。

2．通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监票人在

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

监督人派出的授权代表的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证；如监督人经通知但拒绝到场监督，则大会召集人可自行授权 3 名监票人进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

（九）基金份额持有人大会决议报中国证监会备案后的公告时间、方式

1．基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会备案。基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效。

2．生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会决议。

3．基金份额持有人大会决议应自生效之日起 2 日内在指定媒介公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

（十）本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规的部分，如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

三、基金收益分配原则、执行方式

本基金（包括中融煤炭份额、煤炭 A 份额、煤炭 B 份额）不进行收益分配。

经基金份额持有人大会决议通过，并经中国证监会备案后，如果终止煤炭 A 份额与煤炭 B 份额的运作，本基金将根据基金份额持有人大会决议调整基金的收益分配原则。具体见基金管理人届时发布的相关公告。

四、与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

（一）基金费用的种类

1．基金管理人的管理费；

2．基金托管人的托管费；

3．基金合同生效后的标的指数许可使用费；

4．基金合同生效后的基金信息披露费用；

5．基金份额持有人大会费用；

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

6．基金合同生效后与基金有关的会计师费、律师费和诉讼费；

7．基金的证券、期货交易费用；

8．基金上市初费和上市月费；

9．基金的账户开户费用、账户维护费用；

10．基金财产拨划支付的银行费用；

11．依法可以在基金财产中列支的其他费用。

（二）上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

（三）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1．基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的1.00%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×年管理费率÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

2．基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.22%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×年托管费率÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送划款指令，基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

3．基金合同生效后的标的指数许可使用费

本基金作为指数基金，需根据与指数所有人中证指数有限公司签署的指数许

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

可使用协议的约定向中证指数有限公司支付指数许可使用费。如上述指数许可使用协议约定的费率发生变更，本条下的指数许可使用费将相应变更，基金管理人将在更新的招募说明书或公告中予以披露，而无需召开基金份额持有人大会。

通常情况下，指数许可使用费按前一日基金资产净值的 0.02%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×年费率/当年天数

H 为每日应计提的指数许可使用费

E 为前一日的基金资产净值

指数许可使用费的收取下限为每季度人民币 4 万元（大写：肆万元整）。计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。

指数许可使用费按前一日基金资产净值每日计算，逐日累计。标的指数许可使用费的支付方式为每季支付一次，基金合同生效后，由基金管理人向基金托管人发送指数许可使用费划付指令，经基金托管人复核后，于每年 1 月、4 月、7 月、10 月的最后一个工作日前从基金财产中一次性支付给中证指数有限公司上一季度的标的指数许可使用费。

4．上述“一、基金费用的种类中第 4－11 项费用 ”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

（四）不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，处理与基金运作无关的事项发生的费用，或其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

（五）基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。调低基金管理费率、基金托管费率等，无须召开基金份额持有人大会，基金管理人必须最迟于新的费率实施前 2 日在指定媒介上刊登公告。

（六）基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

五、基金财产的投资方向和投资限制

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

（一）投资目标

本基金采用指数化投资策略，通过严谨的数量化管理和严格的投资程序，力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在0.35%以内，年跟踪误差控制在4%以内，实现对中证煤炭指数的有效跟踪。

（二）投资范围

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括中证煤炭指数的成份股、备选成份股、其他股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、固定收益资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、资产支持证券、债券回购、银行存款等）、衍生工具（股指期货、权证等）及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金投资于股票的资产不低于基金资产的85%，投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。

如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

（三）投资策略

本基金主要采用完全复制法进行投资，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。

当预期成份股发生调整，成份股发生配股、增发、分红等行为，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪中证煤炭指数的效果可能带来影响，导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以根据市场情况，采取合理措施，在合理期限内进行适当的处理和调整，力争使跟踪误差控制在限定的范围之内。

1．资产配置策略

本基金管理人主要按照中证煤炭指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。本基金的股票资产投

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

资比例不低于基金资产的 85%，其中投资于中证煤炭指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

2．股票投资组合构建

（1）组合构建方法

本基金将采用完全复制法构建股票投资组合，以拟合、跟踪中证煤炭指数的收益表现。

（2）组合调整

本基金所构建的股票投资组合原则上根据中证煤炭指数成份股组成及其权重的变动而进行相应调整。同时，本基金还将根据法律法规和基金合同中的投资比例限制、申购赎回变动情况、股票增发因素等变化，对股票投资组合进行实时调整，以保证基金净值增长率与中证煤炭指数收益率之间的高度正相关和跟踪误差最小化。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使本基金的股票投资组合比例符合基金合同的约定。

定期调整

根据中证煤炭指数的调整规则和备选股票的预期，对股票投资组合及时进行调整。

②不定期调整

A．当上市公司发生增发、配股等影响成份股在指数中权重的行为时，本基金将根据各成份股的权重变化及时调整股票投资组合；

B．根据本基金的申购和赎回情况，对股票投资组合进行调整，从而有效跟踪中证煤炭指数；

C．根据法律、法规的规定，成份股在中证煤炭指数中的权重因其它原因发生相应变化的，本基金将做相应调整，以保持基金资产中该成份股的权重同指数一致。

3．债券投资策略

本基金可以根据流动性管理需要，选取到期日在一年以内的政府债券进行配

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

置。本基金债券投资组合将采用自上而下的投资策略，根据宏观经济分析、资金面动向分析等判断未来利率变化，并利用债券定价技术，进行个券选择。

本基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，降低跟踪误差。

4．股指期货投资策略

本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资。本基金投资股指期货将主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

（四） 标的指数与业绩比较基准

1．标的指数

本基金股票资产的标的指数为中证煤炭指数。

中证煤炭指数从煤与消费用燃料行业中选取相关股票作为成份股，采用自由流通市值加权，并对单个股票设置 10% 权重上限。截至 2015 年 2 月数据显示，中证煤炭指数总市值和自由流通市值分别为 7996 亿和 2301 亿。

2．业绩比较基准

本基金业绩比较基准为：95%×中证煤炭指数收益率+5%×同期银行活期存款利率（税后）。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是指数编制单位变更或停止中证煤炭指数的编制、发布或授权，或市场上出现更加适合用于本基金的业绩比较基准的股票指数时，本基金可以在与基金托管人协商同意后变更标的指数、业绩比较基准并及时公告。若变更标的指数、业绩比较基准涉及本基金投资范围或投资策略等实质性变更，则基金管理人应就变更标的指数、业绩比较基准召开基金份额持有人大会，并报中国证监会备案且在指定媒介公告。若变更标的指数、业绩比较基准对基金投资范围和投资策略等无实质性影响（包括但不限于指数编制单位变更、指数更名等事项），本基金可以在与本基金托管人协商同意后变更标的指数、业绩比较基准并及时公告，而无需基金份额持有人大会审议。

（五）风险收益特征

本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，

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

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。从本基金所自动分离或分拆的两类基金份额来看，煤炭 A 份额具有预期风险、预期收益较低的特征；煤炭 B 份额具有预期风险、预期收益较高的特征。

（六）投资限制

1．组合限制

基金的投资组合将遵循以下限制：

（1）本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%，但标的指数成分股投资不计入受此限；

（2）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

（3）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%，但标的指数成分股投资不计入受此限；

（4）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

（5）本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%，在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购后不展期；

（6）本基金投资于股票的资产不低于基金资产的 85%，投资于中证煤炭指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；

（7）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

（8）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

（9）本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；

（10）本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

（11）本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

（12）基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

（13）本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.50%；

（14）本基金参与股指期货投资后，需遵守下列比例限制；

1）本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；

2）本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%；其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

3）本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；

4）本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；

5）本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；

本基金在开始进行股指期货投资之前，应与基金托管人就股指期货开户、清算、估值、交收等事宜另行具体协商；

（15）本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券；

（16）本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

（17）法律法规规定的其他比例限制。

如果法律法规或监管部门对基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

因证券市场或期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的资产配置比例符

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

2．禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

（1）承销证券；

（2）违反规定向他人贷款或者提供担保；

（3）从事承担无限责任的投资；

（4）买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；

（5）向其基金管理人、基金托管人出资；

（6）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

（7）法律、行政法规和中国证监会禁止的其他活动；

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律、行政法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

（七）基金管理人代表基金行使股东、债权人权利的处理原则及方法

1．基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东、债权人权利，保护基金份额持有人的利益；

2．不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；

3．有利于基金财产的安全与增值；

4．不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人

（八）基金的融资、融券及转融通

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

本基金可以根据届时有效的有关法律法规和政策的规定进行融资融券、转融通。待基金参与融资融券和转融通业务的相关规定颁布后，基金管理人可以在不改变本基金既有投资策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，参与融资融券业务以及通过证券金融公司办理转融通业务，以提高投资效率及进行风险管理。届时本基金参与融资融券、转融通等业务的风险控制原则、具体参与比例限制、费用收支、信息披露、估值方法及其他相关事项按照中国证监会的规定及其他相关法律法规的要求执行。

六、基金资产净值的计算方法和公告方式

本基金的基金份额分级及其基本运作如下：

（一）基金份额结构

本基金的基金份额包括“中融煤炭份额”、“煤炭 A 份额”与“煤炭 B 份额”。其中，煤炭 A 份额、煤炭 B 份额的基金份额配比始终保持 1：1 的比例不变。

（二）基金的基本运作概要

1．本基金通过场外、场内两种方式公开发售。基金发售结束后，场外认购的全部份额将确认为中融煤炭份额；场内认购的全部份额将按 1：1 的比例自动分离并确认为煤炭 A 份额与煤炭 B 份额。（具体认购方法参见基金份额发售公告）

2．基金合同生效后，中融煤炭份额接受场外与场内申购和赎回；煤炭 A 份额、煤炭 B 份额只上市交易，不接受申购和赎回。

3．基金合同生效后，基金管理人将根据基金合同的约定办理中融煤炭份额与煤炭 A 份额、煤炭 B 份额之间的份额配对转换业务。

4．基金合同生效后，基金管理人按照基金合同规定在基金份额折算日对基金份额进行折算。无论是定期份额折算，还是不定期份额折算，因折算而新增的中融煤炭份额不进行自动分离。投资人可选择将上述折算产生的场内中融煤炭份额按 1：1 的比例分拆为煤炭 A 份额、煤炭 B 份额。折算后基金运作方式及煤炭 A 份额与煤炭 B 份额配比不变。

（三）煤炭 A 份额、煤炭 B 份额概要

1．存续期限

自基金合同生效之日起存续。

2．基金份额配比

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

煤炭 A 份额与煤炭 B 份额的基金份额配比始终保持 1：1 的比例不变。

3．煤炭 A 份额与煤炭 B 份额的基金份额参考净值计算

煤炭 A 份额和煤炭 B 份额具有不同的净值计算规则，即煤炭 A 份额和煤炭 B 份额的预期风险和预期收益特征不同。

在本基金的存续期内，本基金将在每个工作日按照基金合同约定的净值计算规则对煤炭 A 份额和煤炭 B 份额分别进行基金份额参考净值计算。

本基金净资产优先分配煤炭 A 份额的本金及煤炭 A 份额的约定收益，本基金在优先分配煤炭 A 份额的本金及煤炭 A 份额的约定收益后的剩余净资产分配予煤炭 B 份额。

煤炭 A 份额的约定年收益率为一年期同期银行定期存款年利率（税后）加计 4%。本基金将以基金合同生效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）为准，设定该日起（含该日）至第一个定期份额折算的折算日（含该日，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。详见基金合同“二十一、基金份额折算”）期间煤炭 A 份额适用的年约定收益率；此后，将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。

例如：若基金合同生效日为 2013 年 6 月 20 日，则以 2013 年 6 月 20 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年利率（税后）加计 4%作为该日起（含该日）至第一个定期份额折算的折算日期间（2013 年 6 月 20 日至 2013 年 12 月 13 日。 2013 年 12 月 15 日为非工作日，根据定期份额折算规则，第一个定期份额折算的折算日为该日之前的最后一个工作日）的约定年收益率。本基金将以 2013 年 12 月 13 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年利率（税后）加计 4%作为该日次日（含该次日）起至第二个定期份额折算的折算日期间的约定年收益率，依此类推。

煤炭 A 份额的约定年收益率除以计算日所在会计年度的实际天数得到煤炭 A 份额的约定日收益率。煤炭 A 份额的基金份额参考净值以 1.000 元为基础，采用

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

煤炭 A 份额的约定日收益率乘以应计约定收益的天数进行单利计算。煤炭 A 份额在净值计算日应计约定收益的天数为自基金合同生效日或最近一个份额折算日次日至净值计算日的实际天数。

基金管理人并不承诺或保证煤炭 A 份额的本金或约定收益，如在本基金存续期内基金资产出现极端损失的情况下，煤炭 A 份额的基金份额持有人可能会面临无法取得约定收益甚至损失本金的风险。

（1）中融煤炭份额净值计算公式

T 日中融煤炭份额净值＝T 日闭市后的基金资产净值/T 日本基金（包括中融煤炭份额、煤炭 A 份额、煤炭 B 份额）的基金份额余额总数

（2）煤炭 A 份额与煤炭 B 份额的基金份额参考净值计算公式

假设 T 日为基金份额净值计算日，t＝min（自基金合同生效日至 T 日实际天数，自最近一个份额折算日次日至 T 日实际天数）， NAV 母 t 为 T 日中融煤炭份额净值，NAVAt 为 T 日煤炭 A 份额的基金份额参考净值，NAVBt 为 T 日煤炭 B 份额的基金份额参考净值，R 年为煤炭 A 份额的约定年收益率。

$$NAVAt＝1.000+R\text{年}\times\frac{t}{\text{T日所在会计年度的实际天数}}$$

NAVBt＝（NAV 母 t-0.5×NAVAt）/0.5

例：假设 t=99，R 年=7.00%，NAV 母 99 =1.400：

NAVA 99＝1.000+7.00%×99/365＝1.019

NAVB 99＝（1.400-0.5×1.019）/0.5＝1.781

中融煤炭份额净值、煤炭 A 份额与煤炭 B 份额的基金份额参考净值的计算均保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入。

（3）煤炭 A 份额与煤炭 B 份额的基金份额参考净值公告

煤炭 A 份额和煤炭 B 份额的基金份额参考净值在当天收市后计算，并在 T+1 内与中融煤炭份额净值一同公告。如遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

4．煤炭 A 份额与煤炭 B 份额的终止运作

经基金份额持有人大会决议通过，煤炭 A 份额与煤炭 B 份额可申请终止运作。该基金份额持有人大会决议须经本基金所有份额以特别决议的形式表决通过，即

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

须经参加基金份额持有人大会的中融煤炭份额、煤炭 A 份额与煤炭 B 份额各自的基金份额持有人或其代理人各自所持中融煤炭份额、煤炭 A 份额与煤炭 B 份额表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方为有效。

七、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

（一）基金合同的变更

（一）基金合同的变更

1．变更基金合同涉及法律法规规定或本基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2．关于基金合同变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，并自决议生效后 2 日内在指定媒介公告。

（二）本基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同应当终止：

1．基金份额持有人大会决定终止的；

2．基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在 6 个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务；

3．基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在 6 个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务；

4．基金合同约定的其他情形；

5．法律法规和中国证监会规定的其他情况。

（三）基金财产的清算

1．基金财产清算组

（1）基金合同终止之日起 30 个工作日内，成立基金财产清算组，基金财产清算组在中国证监会的监督下进行基金清算。

（2）基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

（3）基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

金财产清算组可以依法进行必要的民事活动。

2．基金财产清算程序

基金合同终止，应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。基金财产清算程序主要包括：

（1）基金合同终止后，发布基金财产清算公告；

（2）基金合同终止时，由基金财产清算组统一接管基金财产；

（3）对基金财产和债权债务进行清理和确认；

（4）对基金财产进行估值和变现；

（5）聘请会计师事务所对清算报告进行审计；

（6）聘请律师事务所出具法律意见书；

（7）将基金财产清算结果报告中国证监会；

（8）公布基金财产清算结果；

（9）对基金剩余财产进行分配。

基金财产清算的期限为 6 个月。

3．清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

4．基金财产按下列顺序清偿：

（1）支付清算费用；

（2）交纳所欠税款；

（3）清偿基金债务；

（4）根据基金合同终止日中融煤炭份额净值、煤炭 A 份额与煤炭 B 份额的基金份额参考净值分别计算中融煤炭份额、煤炭 A 份额与煤炭 B 份额三类份额各自的应计分配比例，在此基础上，在中融煤炭份额、煤炭 A 份额与煤炭 B 份额各自类别内按其基金份额持有人持有的该类别基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款（1）—（3）项规定清偿前，不得分配给基金份额持有人。

经基金份额持有人大会决议通过，在本基金的煤炭 A 份额、煤炭 B 份额终止运作后，如果本基金进行基金财产清算，则依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

5．基金财产清算的公告

基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算结果经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算组报中国证监会备案并公告。

6．基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

八、争议解决方式

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力。除非仲裁裁决另有规定，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，基金合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本基金合同适用于中华人民共和国法律并从其解释。

九、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

基金合同可印制成册，供投资人在基金管理人、基金托管人、销售机构和注册登记机构办公场所查阅，但其效力应以基金合同正本为准。

cninf 巨潮资讯
www.cninfo.com.cn
中国证监会指定信息披露网站