中融基金管理有限公司
关于以通讯方式召开中融中证煤炭指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的公告

一、召开会议基本情况

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》和《中融中证煤炭指数分级证券投资基金基金合同》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”）经与本基金托管人海通证券股份有限公司协商一致，决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，审议本基金转型有关事项的议案，会议的具体安排如下：

1．会议召开方式：通讯方式。

2．会议投票表决起止时间：自 2020 年 10 月 1 日起，至 2020 年 10 月 27 日 17:00 止（送达时间以本基金管理人指定地址收到表决票时间为准）。

3．会议计票日：2020 年 10 月 29 日

4．会议表决票的寄达地点：

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

收件人：中融基金管理有限公司

地址：北京市朝阳区望京东园四区 2 号中航资本大厦 17 层

联系人：市场服务部

联系电话：400-160-6000、010-56517299

邮政编码：100102

请在信封表面注明："中融中证煤炭指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决专用"。

二、会议审议事项

《关于中融中证煤炭指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》（附件一）。

上述议案的说明请参见《关于中融中证煤炭指数分级证券投资基金转型有关事项的说明》（附件四）。

三、基金份额持有人的权益登记日

本次大会的权益登记日为 2020 年 10 月 21 日，即在 2020 年 10 月 21 日证券交易所的正常交易日的交易时间结束后，在本基金登记机构登记在册的本基金全体基金份额持有人均有权参与本次基金份额持有人大会的表决。

四、表决票的填写和寄交方式

1．本次持有人大会的表决方式仅限于书面纸质表决。本次会议表决票见附件二。基金份额持有人可从相关报纸上剪裁、复印或登录本基金管理人网站（www.zrfunds.com.cn）

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

在“客户服务”——“下载专区”中下载并打印表决票。

2．基金份额持有人应当按照表决票的要求填写相关内容，其中：

（1）个人投资者自行投票的，需在表决票上签字，并提供本人身份证件（包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）正反面复印件；

（2）机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本单位公章，并提供加盖公章的营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）；合格境外机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本单位公章（如有）或由授权代表在表决票上签字（如无公章），并提供该授权代表的身份证件复印件或者护照或其他身份证明文件的复印件，该合格境外机构投资者所签署的授权委托书或者证明该授权代表有权代表该合格境外机构投资者签署表决票的其他证明文件，以及该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件，以及取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件；

（3）个人投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供个人投资者身份证件（包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）正反面复印件，以及填妥的授权委托书原件（可参照附件三）。如代理

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

人为个人，还需提供代理人的身份证件（包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）正反面复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的加盖公章的营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）；

（4）机构投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供机构投资者加盖公章的营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等），以及填妥的授权委托书原件（参照附件三）。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件（包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）正反面复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的加盖公章的营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。合格境外机构投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件，以及取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件，以及填妥的授权委托书原件。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件（包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）正反面复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的加盖公章的营业执照复印件

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。

（5）以上各项中的公章、批文、开户证明及登记证书，以基金管理人的认可为准。

3．基金份额持有人或其代理人需将填妥的表决票和所需的相关文件在前述会议投票表决起止时间内（送达时间以指定地址收到表决票时间为准）通过专人送交、快递或邮寄的方式送达至本次基金份额持有人大会会议表决票的寄达地点，并请在信封表面注明："中融中证煤炭指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决专用"。

五、计票

1．本次通讯会议的计票方式为：由本基金管理人授权的两名监督员在基金托管人（海通证券股份有限公司）授权代表的监督下在表决截止日期后第 2 个工作日，即 2020 年 10 月 29 日进行计票，并由公证机关对计票过程予以公证。

2．中融煤炭份额、煤炭 A 级与煤炭 B 级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。

3．表决票效力的认定如下：

（1）表决票填写完整清晰，所提供文件符合本公告规定，且在规定时间之前送达基金管理人的，为有效表决票；有效表决票按表决意见计入相应的表决结果，其所代表的基

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

（2）如表决票上的表决意见未选、多选或无法辨认、表决意见模糊不清或相互矛盾，但其他各项符合本公告规定的，视为弃权表决，计入有效表决票，并按“弃权”计入对应的表决结果，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

（3）如表决票上的签字或盖章部分填写不完整、不清晰的，或未能提供有效证明基金份额持有人身份或代理人经有效授权的证明文件的，或未能在规定时间之前送达基金管理人的，均为无效表决票；无效表决票不计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

（4）基金份额持有人重复提交表决票的，如各表决票表决意见相同，则视为同一表决票；如各表决票表决意见不相同，则按如下原则处理：

①送达时间不是同一天的，以最后送达的填写有效的表决票为准，先送达的表决票视为被撤回；

②送达时间为同一天的，视为在同一表决票上做出了不同表决意见，计入弃权表决票；

③送达时间按如下原则确定：专人送达的以实际递交时间为准，邮寄的以基金管理人收到的时间为准。

六、决议生效条件

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

1．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级、煤炭B级占权益登记日各自基金份额的二分之一以上（含二分之一）；

2.《关于中融中证煤炭指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》应当由提交有效表决票的中融煤炭份额、煤炭A级、煤炭B级的基金份额持有人或其代理人所持中融煤炭份额、煤炭A级、煤炭B级各自表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方为有效；

3．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、基金合同和本公告的规定，并与登记机构记录相符；

4．本次基金份额持有人大会决议的事项自表决通过之日起生效，基金管理人自通过之日起五日内报中国证监会备案。法律法规另有规定的，从其规定。

七、本次大会相关机构

1.召集人：中融基金管理有限公司

联系人：市场服务部

联系电话：400-160-6000、010-56517299

传真：010-56517001

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

网址：www.zrfunds.com.cn

电子邮件：services@zrfunds.com.cn

2.基金托管人：海通证券股份有限公司

3.公证机构：北京市方圆公证处

联系人：赵蓉

联系方式：010-85197506

4.见证律师：上海市通力律师事务所

八、重要提示

1.如本次基金份额持有人大会未成功召开或议案未通过，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年底完成对本基金的整改,取消分级运作机制,将煤炭A级、煤炭B级按照基金份额参考净值折算为煤炭母基份额。届时，基金管理人将相应变更基金名称、修改基金合同并就取消分级运作的安排进行公告。敬请投资者合理安排投资计划。

2．请基金份额持有人在提交表决票时，充分考虑邮寄在途时间，确保表决票于表决截止时间前送达。

3．本基金的首次停牌时间为本公告刊登日（2020年9月28日）开市起至当日10:30止。本基金第二次停牌时间为基金份额持有人大会计票日（2020年10月29日）开市起至基金份

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

额持有人大会决议生效公告日10:30止。敬请基金份额持有人关注本基金停牌期间的流动性风险。

4．基金管理人将在发布本公告后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告，就持有人大会相关情况做必要说明，请予以留意。

5．本次基金份额持有人大会有关公告可通过本基金管理人网站查阅，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。

6.本通知的有关内容由中融基金管理有限公司负责解释。

中融基金管理有限公司

2020 年 9 月 28 日

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

附件一：《关于中融中证煤炭指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》

附件二：《中融中证煤炭指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决票》

附件三：《授权委托书》（样本）

附件四：《关于中融中证煤炭指数分级证券投资基金转型有关事项的说明》

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

附件一：

关于中融中证煤炭指数分级证券投资基金

转型有关事项的议案

中融中证煤炭指数分级证券投资基金基金份额持有人：

为应对复杂多变的证券市场环境，维护基金份额持有人的利益，提高产品的市场竞争力，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》和《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》”）和《中融中证煤炭指数分级证券投资基金招募说明书》的有关规定，基金管理人经与基金托管人海通证券股份有限公司协商一致，提议以通讯方式召开基金份额持有人大会，审议关于中融中证煤炭指数分级证券投资基金转型有关事项的议案。《关于中融中证煤炭指数分级证券投资基金转型方案的说明》见附件四。

本议案需经参加会议的中融煤炭份额、煤炭 A 级、煤炭 B 级的基金份额持有人或代理人各自所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过。本议案如获得基金份额持有人大会审议批准，基金管理人将根据本议案及《关于中融中证煤炭指数分级证券投资基金转型方案的说明》（附件四）对《基金合同》进行修改，并披露修改后的基金合同、托管协议、招募说明书等法律文件。

以上议案，请予审议。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

中融基金管理有限公司

2020 年 9 月 28 日

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

附件二：

中融中证煤炭指数分级证券投资基金

基金份额持有人大会表决票

<table>
<tr><td colspan="4">基金份额持有人名称：</td></tr>
<tr><td>证件号码(身份证件号/营业执照号)</td><td colspan="3">基金账户号</td></tr>
<tr><td></td><td colspan="3"></td></tr>
<tr><td>受托人（代理人）姓名/名称：</td><td colspan="3">受托人（代理人）证件号码（身份证件号/营业执照号）：</td></tr>
<tr><td></td><td colspan="3"></td></tr>
<tr><td>审议事项</td><td>同意</td><td>反对</td><td>弃权</td></tr>
<tr><td>《关于中融中证煤炭指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》</td><td></td><td></td><td></td></tr>
<tr><td colspan="4">基金份额持有人/受托人签名或盖章

年月日</td></tr>
<tr><td colspan="4">说明：
请以打“√”方式在审议事项后注明表决意见。持有人必须选择一种且只能选择一种表决意见。表决意见代表基金份额持有人所持全部基金份额的表决意见。如表决票上的表决意见未选、多选或无法辨认、表决意见模糊不清或相互矛盾，但其他各项符合本公告规定的，视为弃权表决，计入有效表决票，并按“弃权”计入对应的表决结果，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。
“基金账户号”仅指持有本基金份额的基金账户号，同一基金份额持有人拥有多个此类账户且需要按照不同账户持有基金份额分别行使表决权的，应当填写基金账户号；其他情况可不必填写。此处空白、多填、错填、无法识别等情况的，将被默认为代表此基金份额持有人所持有的本基金所有份额。</td></tr>
</table>

（本表决票可剪报、复印或登录本基金管理人网站（www.zrfunds.com.cn）在“客户服务”——“下载专区”中下载并打印，在填写完整并签字盖章后均为有效。）

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

附件三：

授权委托书

兹委托代表本人（或本机构）参加投票截止日为2020年10月27日的以通讯方式召开的中融中证煤炭指数分级证券投资基金基金份额持有人大会，并代为全权行使对所有议案的表决权。授权有效期自签署日起至本次基金份额持有人大会会议结束之日止。若中融中证煤炭指数分级证券投资基金重新召开审议相同议案的持有人大会的，本授权继续有效。

委托人（签字/盖章）：_____

委托人身份证号或营业执照号：

委托人基金账户号：

受托人签字/盖章：

受托人身份证明编号：

委托日期：　　年　　月　　日

附注：

1、此授权委托书可剪报、复印、登录本基金管理人网站（www.zrfunds.com.cn）在“客户服务”——“下载专区”中下载并打印或按以上格式自制，在填写完整并签字盖章后均为有效。

2、“基金账户号”，仅指持有本基金份额的基金账户号，同一基金份额持有人拥有多个此类账户且需要按照不同账户持有基金份额分别授权的，应当填写基金账户号；其他情况可不必填写。此处空白、多填、错填、无法识别等情况的，将被默认为代表此基金份额持有人所持有的本基金所有份额。

3、受托人的表决意见代表委托人本基金账户下全部基金份额的表决意见。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

附件四：

关于中融中证煤炭指数分级证券投资基金转型有关事项的说明

一、声明

1、为应对复杂多变的证券市场环境，维护基金份额持有人的利益，提高产品的市场竞争力，根据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《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》”）有关规定，基金管理人经与基金托管人海通证券股份有限公司协商一致，决定以通讯方式召开基金份额持有人大会，审议关于中融中证煤炭指数分级证券投资基金转型有关事项的议案。

2、本次关于中融中证煤炭指数分级证券投资基金转型有关事项的议案需经参加会议的中融煤炭份额、煤炭A级与煤炭B级的基金份额持有人或其代理人各自所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过，因此，中融中证煤炭指数分级证券投资基金转型有关事项的议案存在无法获得相关基金份额持有人大会表决通过的可能。

如本次基金份额持有人大会未成功召开或议案未通过，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，

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

于 2020 年底完成对中融中证煤炭指数分级证券投资基金的整改,取消分级运作机制,将煤炭 A 级、煤炭 B 级按照基金份额参考净值折算为煤炭母基份额。届时，基金管理人将相应变更基金名称、修改基金合同并就取消分级运作的安排进行公告。敬请投资者合理安排投资计划。

3、基金份额持有人大会表决通过的事项须报中国证监会备案，且基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。中国证监会对本次中融中证煤炭指数分级证券投资基金持有人大会决议的备案，均不表明其对中融中证煤炭指数分级证券投资基金的投资价值、市场前景或投资者的收益做出实质性判断或保证。

二、基金转型安排

中融中证煤炭指数分级证券投资基金转型为中融中证煤炭指数证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）方案的主要内容如下:

（一） 更名

基金名称由“中融中证煤炭指数分级证券投资基金”更名为“中融中证煤炭指数证券投资基金（LOF）”。

（二）调整运作方式、取消分级机制

中融中证煤炭指数分级证券投资基金转型后，将不再设置基金份额的分级、折算（定期折算及不定期折算）与配对转换等机制，运作方式变更为上市契约型开放式（LOF）。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

原煤炭A级与煤炭B级只上市交易、不接受申购与赎回，转换后的中融中证煤炭指数证券投资基金（LOF）基金份额可通过销售机构进行日常申购与赎回。

（三）煤炭A级与煤炭B级的终止上市

中融中证煤炭指数分级证券投资基金目前上市交易的份额为煤炭A级以及煤炭B级，基金份额持有人大会决议生效后，基金管理人将按照深圳证券交易所的相关规定申请办理煤炭A级和煤炭B级的终止上市等相关业务。

（四）转型选择期的相关安排

持有人大会决议生效后，中融中证煤炭指数分级证券投资基金将在转型正式实施前安排选择期以供基金份额持有人做出赎回、卖出等选择，具体时间安排详见管理人届时发布的相关公告。

对于在选择期内未作出选择的基金份额持有人，其持有的中融煤炭份额、煤炭A级与煤炭B级最终将转换为中融中证煤炭指数证券投资基金（LOF）基金份额。

在选择期期间，由于中融中证煤炭指数分级证券投资基金需应对赎回、转出等情况，基金份额持有人同意在选择期豁免《基金合同》中约定的投资组合比例限制等条款。基金管理人提请基金份额持有人大会授权基金管理人据此落实相关事项，并授权基金管理人可根据实际情况做相应调整，以及根据实际情况调整申购、赎回等安排，具体详见基金管

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

理人届时发布的相关公告。

在选择期期间选择赎回的，根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》要求，对持续持有期少于7日的投资者收取不低于1.5%的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。对于持有期限不少于7天的基金份额持有人，仍适用中融中证煤炭指数分级证券投资基金的赎回费率和赎回费计入基金财产的比例。

（五）基金份额的转换业务

转型选择期届满的次一工作日为份额转换基准日，煤炭A级、煤炭B级终止上市。基金管理人在份额转换基准日将中融中证煤炭指数分级证券投资基金的各类基金份额，最终转换为基金份额净值为 1.0000 元的中融中证煤炭指数证券投资基金（LOF）基金份额。

在份额转换基准日，在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司登记在册的中融煤炭份额、煤炭A级、煤炭B级将转换为中融中证煤炭指数证券投资基金（LOF）的场内份额，在中国证券登记结算有限责任公司登记在册的中融煤炭份额将转换为中融中证煤炭指数证券投资基金（LOF）的场外份额。

中融煤炭份额、煤炭A级或煤炭B级转换为中融中证煤炭指数证券投资基金（LOF）的场内份额数截位取整计算（最小单位为 1 份），取整后的余额计入基金资产。故基金份额

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

转换后，由于基金份额数取整计算产生的误差，基金份额持有人存在着基金资产净值减小的风险。对于持有份额数较少的中融煤炭份额、煤炭 A 级、煤炭 B 级场内份额的持有人，存在着持有的基金份额转换后份额数不足一份而被计入基金资产的风险。

由中融煤炭份额的场内份额或中融煤炭份额的场外份额转换的中融中证煤炭指数证券投资基金（LOF）的份额数=中融煤炭份额的场内份额或中融煤炭份额的场外份额数×份额转换基准日每份中融煤炭份额的参考净值÷1.0000，由中融煤炭的场外份额转换而来的中融中证煤炭指数证券投资基金(LOF)的场外份额保留到小数点后第 2 位，小数点后第 3 位进行四舍五入计算，由此产生的计算误差归入基金资产。由中融煤炭的场内份额转换而来的中融中证煤炭指数证券投资基金(LOF)的场内份额进行取整计算，取整后的余额计入基金资产。

由煤炭 A 级转换的中融中证煤炭指数证券投资基金（LOF）的份额数=煤炭 A 级的场内份额数×份额转换基准日每份煤炭 A 级的参考净值÷1.0000，由煤炭 A 级转换而来的中融中证煤炭指数证券投资基金(LOF)的场内份额进行取整计算，取整后的余额计入基金资产。

由煤炭 B 级转换的中融中证煤炭指数证券投资基金（LOF）的份额数=煤炭 B 级的场内份额数×份额转换基准

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

日每份煤炭 B 级的参考净值÷1.0000，由煤炭 B 级转换而来的中融中证煤炭指数证券投资基金(LOF)的场内份额进行取整计算，取整后的余额计入基金资产。

基金份额转换后，中融中证煤炭指数证券投资基金（LOF）的基金份额净值为 1.0000 元。

（六）《中融中证煤炭指数证券投资基金（LOF）基金合同》的生效

自份额转换基准日次日起，基金名称将由“中融中证煤炭指数分级证券投资基金”更名为“中融中证煤炭指数证券投资基金（LOF）”。《中融中证煤炭指数证券投资基金（LOF）基金合同》生效，《中融中证煤炭指数分级证券投资基金基金合同》同日失效。

中融中证煤炭指数证券投资基金（LOF）基金合同生效后，基金管理人将根据相关规定办理中融中证煤炭指数证券投资基金（LOF）的申购赎回、上市交易等业务。在本基金符合法律法规规定的上市条件的情况下，基金管理人可以根据有关规定，申请本基金的基金份额上市交易。具体安排详见基金管理人届时发布的相关公告。

三、转型后“中融中证煤炭指数证券投资基金（LOF）”概要

（一）基金名称

中融中证煤炭指数证券投资基金（LOF）

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

（二）基金类别

股票型证券投资基金

（三）运作方式

上市契约型开放式

（四）上市交易场所

深圳证券交易所

（五）基金存续期限

不定期

（六）标的指数

本基金的标的指数为中证煤炭指数。

（七）基金的投资

1、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。

2、投资范围

本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、金融债券、企业债券、公司债券、公开发行的次级债、可转换公

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

司债券（含可分离交易可转债）、可交换公司债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、金融衍生工具（包括股指期货、国债期货）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。

本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 90%，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、国债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，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

3、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

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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资比例不低于基金资产的 90%，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、国债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

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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。

①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。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

（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，以套期保值为目的，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。

（5）国债期货投资策略

国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人以套期保值为目的，通过构建量化分析体系，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、隐含波动率水平、套期保值的稳定性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值。

（6）可转换债券投资策略

本基金投资可转换公司债券和可交换公司债券将基于以下三个方面的分析：价值分析、债股性分析和公司基本面分析。通过以上分析，力求选择债券价值有一定支撑、安全性和流动性较好，并且发行人成长性良好的品种进行投资。

（7）资产支持证券投资策略

资产支持证券主要包括资产抵押贷款支持证券（ABS）、住房抵押贷款支持证券（MBS）等证券品种。本基金将重点

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析，并辅助采用数量化定价模型，评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。

（8）其他

未来，随着市场的发展和基金管理运作的需要，基金管理人可以在不改变投资目标的前提下，遵循法律法规的规定，在履行适当程序后相应调整或更新投资策略，并在招募说明书更新中公告。

如法律法规或监管机构以后允许本基金投资于其他衍生金融工具，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金对衍生金融工具的投资主要以对提高组合整体收益为主要目的。本基金将在有效风险管理的前提下，通过对标的品种的研究，谨慎投资。

（八）业绩比较基准

中证煤炭指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%。

（九）风险收益特征

本基金为跟踪指数的股票型基金，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。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

收益特征。

（十）基金的费用

1．基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

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 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 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、公休日等，支付日期顺延。

2．基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10%年费率计提。托管费的计算方法如下：

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 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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。

本基金的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

许可使用基点费的收取下限为每季度人民币 50,000 元（大写：伍万圆），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。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

4. 申购费用

投资人在申购本基金基金份额时，收取申购费用，申购费率随申购金额增加而递减；投资人可以多次申购本基金，申购费用按每笔申购申请单独计算费用。

本基金申购费率如下表所示：

场外申购费	申购金额（M）	申购费率
	M＜100万元	1.00%
	100万元≤M＜500万元	0.50%
	M≥500万元	1000元/笔
场内申购费	深圳证券交易所会员单位应按照场外申购费率设定投资者的场内申购费率	

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。

5.赎回费用

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。对持有期少于 30 日的投资者收取的赎回费，将全额计入基金财产；对于持有期不少于 30 日的投资者收取的赎回费，将不低于赎回费总额的25%计入基金资产，未计入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。

具体赎回费率如下表所示：

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

场外赎回费率	持有时间	赎回费率
	Y＜7日	1.50%
	7日≤Y＜30日	0.75%
	30日≤Y＜180日	0.50%
	Y≥180日	0%
场内赎回费率	Y＜7日	1.50%
	Y≥7日	0.50%

（注：Y为持有时间）

四、基金管理人就转型方案相关事项的说明

（一）中融中证煤炭指数分级证券投资基金的历史沿革

中融中证煤炭指数分级证券投资基金根据2015年5月5日中国证券监督管理委员会《关于准予中融中证煤炭指数分级证券投资基金注册的批复》（证监许可〔2015〕814号）的注册进行募集，基金管理人为中融基金管理有限公司，基金托管人为海通证券股份有限公司，基金合同自2015年6月25日生效。

中融中证煤炭指数分级证券投资基金将以通讯方式召开基金份额持有人大会，审议《关于中融中证煤炭指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》，若该议案获得基金份额持有人大会通过，则基金管理人将根据基金份额持有人大会的授权，对中融中证煤炭指数分级证券投资基金实施转型，中融中证煤炭指数分级证券投资基金将转型为中融中证煤

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

炭指数证券投资基金（LOF），基金名称相应变更为“中融中证煤炭指数证券投资基金（LOF）”。

本次基金份额持有人大会需由持有有效的中融煤炭份额、煤炭 A 级与煤炭 B 级不少于本基金在权益登记日各自基金份额总份额的二分之一（含二分之一）以上的持有人出席方可召开，且本次关于中融中证煤炭指数分级证券投资基金转型有关事项的议案需经参加大会的中融煤炭份额、煤炭 A 级与煤炭B级的基金份额持有人或其代理人所持中融煤炭份额、煤炭 A 级与煤炭 B 级的基金份额各自表决权的三分之二以上（含三分之二）通过，因此，中融中证煤炭指数分级证券投资基金转型有关事项的议案存在无法获得相关基金份额持有人大会表决通过的可能。

基金份额持有人大会表决通过的事项须报中国证监会备案，且基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。中国证监会对本次中融中证煤炭指数分级证券投资基金持有人大会决议的备案，均不表明其对中融中证煤炭指数分级证券投资基金的投资价值、市场前景或投资者的收益做出实质性判断或保证。

（二）基金转型有利于保护份额持有人利益

中融中证煤炭指数分级证券投资基金转型方案是在与相关各方进行广泛沟通的基础上制定出的切实可行的方案。中证煤炭指数作为A股市场具代表性的行业指数之一，容易

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

被投资者所接受与运用，也可以满足投资者对投资收益及资产配置的诉求。

（三）基金转型的可行性

基金管理人已成功操作过中融新优势灵活配置混合型证券投资基金转型、中融新动力灵活配置混合型证券投资基金、中融睿祥一年定期开放债券型证券投资基金转型的工作，管理人在基金转型工作上积累了一定经验。

2、基金转型不存在法律障碍

依据《中融中证煤炭指数分级证券投资基金基金合同》和《基金法》的规定，转换基金运作方式须经出席会议的中融煤炭份额、煤炭A级与煤炭B级的基金份额持有人(或其代理人)所持中融煤炭份额、煤炭A级与煤炭B级各自的表决权的三分之二以上(含三分之二)通过。按照基金份额持有人大会的决议，并经中国证监会备案，基金可以转换基金运作方式。因此，中融中证煤炭指数分级证券投资基金转换为中融中证煤炭指数证券投资基金（LOF）不存在法律障碍。

3、基金转型不存在技术障碍

中融中证煤炭指数分级证券投资基金转型为中融中证煤炭指数证券投资基金（LOF）后，将进行基金份额变更登记。基金管理人、深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司已就变更登记有关事项进行了充分准备，技术可行。因此，基金转型不存在技术障碍。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

4、授权基金管理人修订基金合同的可行性

基金管理人将严格按照基金份额持有人大会决议以及法律法规的规定修订基金合同。修订后的基金合同需经基金管理人和基金托管人盖章以及双方法定代表人或授权代表签章，并报中国证监会备案。

五、基金转型的主要风险及预备措施

（一）持有人大会不能成功召开的风险

根据《基金法》及基金合同的规定，本次份额持有人大会需要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级与煤炭B级占权益登记日各自基金份额的50%以上（含50%）方可召开。为防范本次基金份额持有人大会不符合上述要求而不能成功召开，基金管理人将在会前尽可能与基金份额持有人进行预沟通，争取更多的持有人参加基金份额持有人大会。

如本次基金份额持有人大会未成功召开，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 年底完成对中融中证煤炭指数分级证券投资基金的整改,取消分级运作机制,将煤炭 A 级、煤炭 B 级按照基金份额参考净值折算为煤炭母基份额。届时，基金管理人将相应变更基金名称、修改基金合同并就取消分级运作的安排进行公告。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

（二）转型方案被基金份额持有人大会否决的风险

在设计转型方案之前，基金管理人已对部分基金份额持有人进行了走访，认真听取了基金份额持有人意见，拟定议案综合考虑了基金份额持有人的要求。议案公告后，基金管理人还将再次征询意见。如有必要，基金管理人将根据基金份额持有人意见，对基金转型方案进行适当的修订，并重新公告。基金管理人可在必要情况下，推迟基金份额持有人大会的召开时间。

如本次基金份额持有人大会议案未通过，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 年底完成对中融中证煤炭指数分级证券投资基金的整改,取消分级运作机制,将煤炭 A 级、煤炭 B 级按照基金份额参考净值折算为煤炭母基份额。届时，基金管理人将相应变更基金名称、修改基金合同并就取消分级运作的安排进行公告。

（三）基金转型选择期遭遇大规模赎回的风险

持有人大会审议通过转型方案后，在选择期内中融中证煤炭指数分级证券投资基金可能面临大量赎回的风险，为降低对基金平稳运作的影响，本基金在选择期将保证投资组合的流动性，以应对转型前后可能出现的较大赎回，降低净值波动率。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

若出现基金折价率持续放大或基金净值剧烈波动等极端情况，基金管理人承诺将根据实际情况，加快转型进程。

（四）预防及控制在转型过程中的操作及市场风险

为维护基金份额持有人利益，防范大额申赎或市场风险对基金净值造成大幅波动，基金管理人将根据申购赎回情况及对可能存在的市场投资风险进行有效评估，保持相对合理的仓位水平，科学有效地控制基金的市场风险。

六、《基金合同》修改前后对照表

《中融中证煤炭指数分级证券投资基金基金合同》	**《中融中证煤炭指数证券投资基金（LOF）基金合同》**
一、前言 （一）订立本基金合同的目的、依据和原则 2．订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》（以下简称“《合同法》”）、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险规定》”）和其他有关法律法规。 （三）中融中证煤炭指数分级证券投资基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同及其他有关规定募集，并经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）注册。 中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对	第一部分前言 一、订立本基金合同的目的、依据和原则 2．订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》（以下简称“《合同法》”）、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）和其他有关法律法规。 三、中融中证煤炭指数证券投资基金（LOF）由中融中证煤炭指数分级证券投资基金变更而来。中融中证煤炭指数分级证券投资基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同及其他有关规定募集，并经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

本基金的投资价值、市场前景和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。 投资者应当认真阅读基金合同、招募说明书、基金产品资料概要等信息披露文件，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。	证监会”）注册。 中国证监会对中融中证煤炭指数分级证券投资基金的变更注册，并不表明其对本基金的投资价值和市场前景做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。 投资者应当认真阅读基金招募说明书、基金合同、基金产品资料概要等信息披露文件，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。
二、释义 在本基金合同中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义： 1．基金或本基金：指中融中证煤炭指数分级证券投资基金 4．基金合同或本基金合同：指《中融中证煤炭指数分级证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充 5．托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《中融中证煤炭指数分级证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充 6．招募说明书：指《中融中证煤炭指数分级证券投资基金招募说明书》及其更新 10.《基金法》：指 2012 年 12 月 28 日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订通过，自 2013 年 6 月 1 日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的	第二部分释义 在本基金合同中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义： 1．基金或本基金：指中融中证煤炭指数证券投资基金（LOF） 4．基金合同或本基金合同：指《中融中证煤炭指数证券投资基金（LOF）基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充 5．托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《中融中证煤炭指数证券投资基金（LOF）托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充 6．招募说明书：指《中融中证煤炭指数证券投资基金（LOF）招募说明书》及其更新 7．基金产品资料概要：指《中融中证煤炭指数证券投资基金（LOF）基金产品资料概要》及其更新 9.《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，经 2012 年 12 月 28 日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自 2013 年 6 月 1 日

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

修订	起实施，并经 2015 年 4 月 24 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改<中华人民共和国港口法>等七部法律的决定》修正的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
12.《信息披露办法》：指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日实施的,《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订	11.《信息披露办法》：指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日实施的，并经 2020 年 3 月 20 日中国证监会《关于修改部分证券期货规章的决定》修正的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
14.《流动性风险规定》：指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订	13.《流动性风险管理规定》：指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订
22．个人投资者：依据中国有关法律法规可以投资于证券投资基金的自然人	17．个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人
23．机构投资者：指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法注册登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织	18．机构投资者：指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织
24．合格境外机构投资者：指符合相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者	19．合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理办法》及相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者 20．人民币合格境外机构投资者：指按照《人民币合格境外机构投资者境内证券投资试点办法》及相关法律法规规定，运用来自境外的人民币资金进行境内证券投资的境外法人

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

25．投资者、投资人：指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者的合称	21．投资人、投资者：指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称
26．基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资者	22．基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人
27．基金销售业务：指基金管理人或代销机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管、交易及定期定额投资等业务	23．基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管、交易及定期定额投资等业务
28．销售机构：指直销机构和代销机构 29．直销机构：指中融基金管理有限公司 30．代销机构：指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议，办理基金销售业务的机构，以及可通过深圳证券交易所交易系统办理基金销售业务的会员单位。其中可通过深圳证券交易所交易系统办理本基金销售业务的机构为具有基金销售业务资格、并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的、可通过深圳证券交易所交易系统办理本基金销售业务的深圳证券交易所会员单位	24．销售机构：指中融基金管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务协议，办理基金销售业务的机构，以及可通过深圳证券交易所办理基金销售业务的会员单位。其中，可通过深圳证券交易所办理本基金销售业务的机构必须是具有基金销售业务资格、并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的深圳证券交易所会员单位
33．场外：指通过深圳证券交易所交易系统外的销售机构利用其自身柜台或其他交易系统办理本基金基金份额的认购、申购和赎回的场所。通过该等场所办理基金份额的认购、申购和赎回也称为场外认购、场外申购和场外赎回	25．场外：指通过深圳证券交易所交易系统外的销售机构利用其自身柜台或其他交易系统办理本基金基金份额的申购和赎回的场所。通过该等场所办理基金份额的申购和赎回也称为场外申购和场外赎回
34．场内：指通过具有相应业务资格的深圳证券交易所会员单位利用深圳证券交易所交易系统办	26．场内：指通过具有相应业务资格的深圳证券交易所会员单位利用深圳证券交易所交易系统办

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

理本基金基金份额的认购、申购、赎回和上市交易的场所。通过该等场所办理基金份额的认购、申购、赎回也称为场内认购、场内申购、场内赎回	理本基金基金份额的申购、赎回和上市交易的场所。通过该等场所办理基金份额的申购、赎回也称为场内申购、场内赎回
35．注册登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资者开放式基金账户和/或深圳证券账户的建立和管理、基金份额注册登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户业务等	27．登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资者开放式基金账户和/或深圳证券账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等
36．注册登记机构：指办理注册登记业务的机构。本基金的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司	28．登记机构：指办理登记业务的机构。本基金的登记机构为中国证券登记结算有限责任公司
40．基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构买卖本基金办理认购、申购、赎回、转换、转托管、定期定额投资等业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户	32．基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构买卖本基金、办理申购、赎回、转换、转托管、定期定额投资等业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户
42．基金合同生效日：指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期	34．基金合同生效日：指《中融中证煤炭指数证券投资基金（LOF）基金合同》生效日，原《中融中证煤炭指数分级证券投资基金基金合同》自同一日终止
47.T 日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的工作日	38.T 日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日
48．T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日（不包含 T 日），n 为自然数	39．T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日（不包含 T 日）
50．交易时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段	41．开放时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段
51.《业务规则》：指基金管理人、深圳证券交易所和中国证券登记有限责任公司的相关业务规则	42.《业务规则》：指《中国证券登记结算有限责任公司上市开放式基金登记结算业务实施细则》、《深圳证券交易所开放式基金申购赎回业务实施

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

	细则》、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》等相关业务规则和实施细则
65．定期定额投资计划：指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期扣款日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及受理基金申购申请的一种投资方式	51．定期定额投资计划：指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期申购日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及受理基金申购申请的一种投资方式
66．巨额赎回：指本基金单个开放日，中融煤炭份额净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一开放日基金总份额（包括中融煤炭份额、煤炭 A 份额和煤炭 B 份额）的 10%	52．巨额赎回：指本基金单个开放日，基金净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一开放日基金总份额的 10%
75．指定媒介：指中国证监会指定的用以进行信息披露的全国性报刊及指定互联网网站（包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介	59．规定媒介：指符合中国证监会规定条件的用以进行信息披露的全国性报刊及《信息披露办法》规定的互联网网站（包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介
	61．摆动定价机制：指当开放式基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资人的合法权益不受损害并得到公平对待
76．不可抗力：指本基金合同当事人不能预见、不能避免并不能克服的客观事件	62．不可抗力：指本基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件
77．基金产品资料概要：指《中融中证煤炭指数分级证券投资基金基金产品资料概要》及其更新	
删除下列释义：	

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

7．基金份额发售公告 8．上市交易公告书 17．基金份额分级 18．中融煤炭份额 19．煤炭A份额 20．煤炭B份额 29．直销机构 30．代销机构 31．基金销售网点 32．销售场所 44．基金募集期 52．认购 55．配对转换 56．分拆 57．合并 58．自动分离 73．基金份额参考净值	
三、基金的基本情况 （一）基金的名称 中融中证煤炭指数分级证券投资基金	第三部分基金的基本情况 一、基金名称 中融中证煤炭指数证券投资基金（LOF） 六、基金份额的上市交易 本基金在深圳证券交易所上市交易 八、其他 基金管理人可根据基金实际运作情况，在对基金份额持有人利益无实质不利影响的情况下，经与基金托管人协商一致，增加新的基金份额类别，或取消某基金份额类别，或对基金份额分类办法及规则进行调整并公告，不需召开基金份额持有人大会审议。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

删除： （五）基金的最低募集份额总额和金额 基金募集份额总额不少于 2 亿份，基金募集金额不少于 2 亿元。 （六）基金份额初始面值和认购费用 基金份额的初始面值为人民币 1.00 元。 本基金的具体认购费率情况由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。	
删除下列章节： 四、基金份额分级与净值计算规则 五、基金份额的发售	增加： 第四部分基金的历史沿革 中融中证煤炭指数证券投资基金（LOF）由中融中证煤炭指数分级证券投资基金变更注册而来。中融中证煤炭指数分级证券投资基金经中国证监会证监许可[2015]814 号文注册募集，基金管理人为中融基金管理有限公司，基金托管人为海通证券股份有限公司。 中融中证煤炭指数分级证券投资基金自 2015 年 5 月 27 日起至 2015 年 6 月 18 日公开募集，募集结束后基金管理人向中国证监会办理备案手续。经中国证监会书面确认，《中融中证煤炭指数分级证券投资基金基金合同》于 2015 年 6 月 25 日生效。2020 年 6 月 23 日中国证监会证监许可[2020]1239 号文《关于准予中融中证煤炭指数分级证券投资基金变更注册的批复》准予中融中证煤炭指数分级证券投资基金变更注册。 中融中证煤炭指数分级证券投资基金于 2020 年 X 月 X 日召开基金份额持有人大会，会议审议并通过《关于中融中证煤炭指数分级证券投资基金修改基金合同有关事项的议案》，内容包括中融中证

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

	煤炭指数分级证券投资基金更名为“中融中证煤炭指数证券投资基金（LOF)”，由分级基金转为非分级的 LOF 基金，调整投资范围、投资策略、投资限制、收益分配方式、估值方法等。 自 2020 年 XX 月 XX 日起，《中融中证煤炭指数分级证券投资基金基金合同》失效且《中融中证煤炭指数证券投资基金（LOF）基金合同》同时生效。
六、基金备案 （一）基金备案的条件 1．本基金自基金份额发售之日起 3 个月内，在基金募集份额总额不少于 2 亿份，基金募集金额不少于 2 亿元，并且基金份额持有人的人数不少于 200 人的条件下，基金募集期届满或基金管理人依据法律法规及招募说明书决定停止基金发售，且基金募集达到基金备案条件，基金管理人应当自基金募集结束之日起 10 日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起 10 日内，向中国证监会提交验资报告，办理基金备案手续。自中国证监会书面确认之日起，基金备案手续办理完毕，基金合同生效。 2．基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日对基金合同生效事宜予以公告。 3．本基金合同生效前，投资人的认购款项只能存入专用账户，任何人不得动用。有效认购资金在募集期形成的利息将折为投资人认购的基金份额，归投资人所有。利息转份额的具体数额以注册登记机构的记录为准。 （二）基金募集失败 1．基金募集期届满，未达到基金备案条件，则基	第五部分 基金的存续 基金合同生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当 10 个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并在 6 个月内召集基金份额持有人大会进行表决。 法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

金募集失败。 2．如基金募集失败，基金管理人应以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用，在基金募集期届满后 30 日内返还投资人已缴纳的认购款项，并加计银行同期活期存款利息。 3．如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。 （三）基金存续期内的基金份额持有人数量和资金数额 基金合同生效后的存续期内，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。法律法规另有规定的，从其规定。	
七、基金份额的申购与赎回 本基金合同生效后，投资人可通过场外或场内两种方式对中融煤炭份额进行申购与赎回。煤炭 A 份额、煤炭 B 份额只上市交易，不接受申购与赎回。 （一）申购和赎回场所 投资人办理中融煤炭份额场外申购与赎回业务的场所包括基金管理人和基金管理人委托的场外代销机构。 投资人办理中融煤炭份额场内申购与赎回业务的	第六部分基金份额的申购与赎回 本基金合同生效后，投资人可通过场外或场内两种方式对基金份额进行申购与赎回。 一、申购和赎回场所 投资人办理基金份额场外申购与赎回业务的场所包括基金管理人和基金管理人委托的场外销售机构。 投资人办理基金场内申购与赎回业务的场所为具有基金销售业务资格的深圳证券交易所会员单

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

场所为具有基金销售业务资格的深圳证券交易所会员单位。 本基金场外、场内代销机构名单将由基金管理人在招募说明书或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减代销机构，并在基金管理人网站公示。投资人应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理中融煤炭份额的申购与赎回。若基金管理人或其指定的代销机构开通电话、传真或网上等交易方式，投资人可以通过上述方式进行中融煤炭份额申购与赎回，具体办法由基金管理人另行公告。 （二）申购和赎回的开放日及时间 1．开放日及开放时间 申购与赎回的具体办理时间是指为投资人或中融煤炭份额持有人办理中融煤炭份额的申购和赎回等业务的上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停中融煤炭份额申购、赎回时除外。开放日的具体业务办理时间在招募说明书中载明。 2．申购、赎回开始日及业务办理时间 基金管理人自基金合同生效之日起不超过三个月开始办理中融煤炭份额申购，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。 基金管理人自基金合同生效日起不超过三个月开始办理中融煤炭份额赎回，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。	位。 本基金场外、场内销售机构名单将由基金管理人在招募说明书中列明或见基金管理人网站公示的销售机构名录。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并在基金管理人网站公示。基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。 若基金管理人或其指定的销售机构开通电话、传真或网上等交易方式，投资人可以通过上述方式进行基金份额申购与赎回，具体办法由基金管理人另行公告。 二、申购和赎回的开放日及时间 1．开放日及开放时间 投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。开放日的具体业务办理时间在招募说明书中或相关公告中载明。 2．申购、赎回开始日及业务办理时间 基金管理人自基金合同生效之日起不超过三个月开始办理申购，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。 基金管理人自基金合同生效之日起不超过三个月开始办理赎回，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。 基金份额场内申购、赎回开始办理的时间由基金

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

中融煤炭份额场内申购、赎回开始办理的时间由基金管理人根据基金注册登记机构的规定确定。 在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应在中融煤炭份额申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告申购与赎回的开始时间。 基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理中融煤炭份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请并被确认接受的，其中融煤炭份额申购、赎回价格为下一开放日中融煤炭份额申购、赎回的价格。 （三）申购与赎回的原则 1.“未知价”原则，即中融煤炭份额申购、赎回价格以申请当日收市后计算的中融煤炭份额净值为基准进行计算； 2.“金额申购、份额赎回”原则，即中融煤炭份额申购以金额申请，赎回以份额申请； 3. 中融煤炭份额持有人在场外销售机构赎回中融煤炭份额时，赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人认购、申购的先后次序进行顺序赎回； 4. 当日的中融煤炭份额申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销，在当日业务办理时间结束后不得撤销； 5. 投资人办理中融煤炭份额场外申购、赎回应使用开放式基金账户，办理中融煤炭份额场内申购、赎回应使用深圳证券账户； 6. 投资人办理中融煤炭份额的场内申购、赎回业务时，需遵守深圳证券交易所、中国证券登记结	管理人根据基金登记机构的规定确定。 在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告申购与赎回的开始时间。 基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的，其基金份额申购、赎回价格为下一开放日基金份额申购、赎回的价格。 三、申购与赎回的原则 1.“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算； 2.“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请； 3. 基金份额持有人在场外销售机构赎回基金份额时，赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人认购、申购的先后次序进行顺序赎回； 4. 当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销； 5. 投资人办理基金份额的场内申购、赎回业务时，需遵守深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则。若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对场内申购、赎回业务规则有新的规定，按新规定执行； 6. 办理申购、赎回业务时，应当遵循基金份额持有人利益优先原则，确保投资者的合法权益不受

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

算有限责任公司的相关业务规则。若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对场内申购、赎回业务规则有新的规定，按新规定执行。 基金管理人可根据基金运作的实际情况依法对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。	损害并得到公平对待。 基金管理人可在法律法规允许的情况下，对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。
（四）申购与赎回的程序 1．申购和赎回的申请方式 投资人必须根据销售机构规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出中融煤炭份额申购或赎回的申请。 投资人在提交中融煤炭份额申购申请时须按销售机构规定的方式备足申购资金，投资人在提交赎回申请时须持有足够的中融煤炭份额余额，否则所提交的申购、赎回申请不成立。 2．申购和赎回申请的确认 基金管理人应自身或要求注册登记机构以交易时间结束前受理申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日（T 日），在正常情况下，本基金注册登记机构在 T+1 日内对该交易的有效性进行确认。T 日提交的有效申请，投资人应在 T+2 日及时（包括该日）到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。基金销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购、赎回的确认以注册登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法	四、申购与赎回的程序 1．申购和赎回的申请方式 投资人必须根据销售机构规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。 投资人在提交基金份额申购申请时须按销售机构规定的方式备足申购资金，投资人在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回申请不成立。 2．申购和赎回的款项支付 投资人申购基金份额时，必须全额交付申购款项，投资人交付申购款项，申购成立；基金份额登记机构确认基金份额时，申购生效。 基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；基金份额登记机构确认赎回时，赎回生效。投资者赎回申请生效后，基金管理人将在 T＋7 日（包括该日）内支付赎回款项。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。 3．申购和赎回申请的确认 基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日（T 日），在正常情况下，本基金登记机构在 T+1 日内对该交易的有效性进行确认。T 日提交的有效申请，投

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

权利。 在法律法规允许的范围内，基金管理人或注册登记机构可根据业务规则，对上述业务办理时间进行调整，本基金管理人将于调整实施前按照有关规定予以公告。 3．申购和赎回的款项支付 中融煤炭份额申购采用全额缴款方式，投资人交付申购款项，申购申请成立；注册登记机构确认基金份额时，申购生效。若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成立。若申购不成立或没有生效，基金管理人或基金管理人委托的代销机构将投资人已缴付的申购款项退还给投资人。 基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；注册登记机构确认赎回时，赎回生效。投资人赎回申请生效后，基金管理人将在T＋7日（包括该日）内支付赎回款项。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。 （五）申购和赎回的金额 1．基金管理人可以规定投资人首次申购和每次申购中融煤炭份额的最低金额以及每次赎回的最低份额，具体规定请参见招募说明书。 2．基金管理人可以规定投资人每个基金交易账户的最低中融煤炭份额余额，具体规定请参见招募说明书。 3．基金管理人可以规定单个投资人累计持有的中融煤炭份额上限，具体规定请参见招募说明书。 4．当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比	资人应在 T+2 日后（包括该日）及时到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功，则申购款项退还给投资人。 基金销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申购、赎回申请。申购、赎回的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利。 在法律法规允许的范围内，基金管理人或登记机构可根据业务规则，对上述业务办理时间进行调整，本基金管理人将于调整实施前按照有关规定予以公告。 五、申购和赎回的数量限制 1．基金管理人可以规定投资人首次申购和每次申购的最低金额以及每次赎回的最低份额，具体规定请参见招募说明书或相关公告。 2．基金管理人可以规定投资人每个基金交易账户的最低基金份额余额，具体规定请参见招募说明书或相关公告。 3．基金管理人可以规定单个投资人累计持有的基金份额上限，具体规定请参见招募说明书或相关公告。 4．当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益，具体请参见相关公告。 5．对于场内申购、赎回及持有场内份额的数量限制，深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则有规定的，从其最新规定办理。 基金管理人可以根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额等数量限制。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。	例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体见基金管理人相关公告。 5．对于场内申购、赎回及持有场内份额的数量限制，深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则有规定的，从其最新规定办理。 基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额等数量限制。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。
（六）申购和赎回的价格、费用及其用途 1．中融煤炭份额净值的计算，保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产享有或承担。T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。 2．中融煤炭份额申购份额的计算及余额的处理方式：中融煤炭份额申购份额的计算详见招募说明书。中融煤炭份额的申购费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。 3．中融煤炭份额赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书，赎回金额单位为元。计算结果按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 1．本基金份额净值的计算，保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告。 2．申购份额的计算及余额的处理方式：本基金申购份额的计算详见招募说明书。本基金的申购费率由基金管理人决定，并在招募说明书及基金产品资料概要中列示。申购的有效份额为净申购金额除以当日的基金份额净值，有效份额单位为份，上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。 3．赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书及基金产品资料

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

享有或承担。 4．中融煤炭份额申购费用由投资人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。 5．中融煤炭份额赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用纳入基金财产的比例详见招募说明书，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费，其中对持续持有期少于 7 日的投资者收取不少于 1.5%的赎回费并全额计入基金财产。 6．中融煤炭份额的申购费率、申购份额具体的计算方法、赎回费率、赎回金额具体的计算方法和收费方式由基金管理人根据基金合同的规定确定，并在招募说明书中列示。基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。 7．基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低中融煤炭份额申购费率和赎回费率。	概要中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。 4．申购费用由投资人承担，不列入基金财产。 5．赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用归入基金财产的比例依照相关法律法规设定，具体见招募说明书的规定，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。其中，对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5%的赎回费，并全额计入基金财产。 6．本基金的申购费率、申购份额具体的计算方法、赎回费率、赎回金额具体的计算方法和收费方式由基金管理人根据基金合同的规定确定，并在招募说明书中列示。基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。 7．当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。 8．基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金份额申购费

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

	率和赎回费率。
（七）拒绝或暂停申购的情形 发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的中融煤炭份额申购申请： 1.因不可抗力导致基金无法正常运作或者因不可抗力导致基金管理人无法接受投资人的申购申请。 3．发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况。 4．基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益或对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时。 6．基金管理人、基金托管人、基金销售机构或注册登记机构的异常情况导致基金销售系统、基金登记系统或基金会计系统无法正常运行。 9．接受某一投资者申购申请后导致其持有基金份额达到或超过基金总份额50%的。 10．发生本基金合同约定的份额折算等事项，根据相关业务规则可暂停接受申购申请的情形。 11．法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述1、2、3、5、6、8、10、11情形之一，并且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理并依法公告。	七、拒绝或暂停申购的情形 发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请： 1．因不可抗力导致基金无法正常运作。 2．发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。 4．接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。 6．基金管理人、基金托管人、基金销售机构或登记机构的异常情况导致基金销售系统、基金登记系统或基金会计系统无法正常运行。 9．基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%，或者变相规避50%集中度的情形。 10．法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述1、2、3、5、6、8、10项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在规定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。
（八）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的中融煤炭份额赎回申请或延缓支付赎回款项： 1．因不可抗力导致基金无法正常运作或者因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。 4．发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况。 5．发生继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请。 7．发生本基金合同约定的份额折算等事项，根据相关业务规则可暂停接受赎回申请的情形。 发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已接受的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，对于场外赎回申请，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例支付给赎回申请人，未支付部分可延期支付。若出现上述第 3 项所述情形，按基金合同的相关条款处理，投资人在场外申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以延期赎回或取消赎回。对于场内赎回申请，按照深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关规定办理。在暂停赎回的情况消除后，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并予以公告。 （九）巨额赎回的情形及处理方式 1．巨额赎回的认定 若本基金单个开放日内的中融煤炭份额净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请	的赎回申请或延缓支付赎回款项： 1．因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。 2．发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。 5．发生继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时，基金管理人可暂停接受基金份额持有人的赎回申请。 发生上述情形之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，对于场外赎回申请，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。若出现上述第 4 项所述情形，按基金合同的相关条款处理，投资人在场外申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以延期赎回或取消赎回。对于场内赎回申请，按照深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关规定办理。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。 九、巨额赎回的情形及处理方式 1．巨额赎回的认定 若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过前一开放日的基金总份额（包括中融煤炭份额、煤炭 A 份额和煤炭 B 份额）的 10%，即为巨额赎回。 2．巨额赎回的处理方式 （2）部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的资产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额（包括中融煤炭份额、煤炭 A 份额和煤炭 B 份额）的 10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，按照投资人在提交赎回申请时事先选择的可以选择延期赎回或取消赎回区别处理。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日中融煤炭份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。 当出现巨额赎回时，场内赎回申请按照深圳证券交易所和注册登记机构的有关业务规则办理。 （3）暂停赎回：中融煤炭份额连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受中融煤炭份额的赎回申请；	入申请份额总数后的余额）超过前一开放日的基金总份额的 10%，即认为是发生了巨额赎回。 2．巨额赎回的处理方式 （2）部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的 10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过20个工作日，并应当在指定媒介上进行公告。 （4）若本基金发生巨额赎回，在单个基金份额持有人超过前一开放日基金总份额（包括中融煤炭份额、煤炭A份额和煤炭B份额）20%以上的赎回申请的情形下，基金管理人可以延期办理赎回申请。具体措施如下： 对于该单个基金份额持有人超出前一开放日基金总份额（包括中融煤炭份额、煤炭A份额和煤炭B份额）20%的赎回申请，基金管理人可实施延期办理。对于该单个基金份额持有人未超过前一开放日基金总份额（包括中融煤炭份额、煤炭 A 份额和煤炭B份额）20%（含20%）的赎回申请与当日其他投资者的赎回申请一起，按上述（1）、（2）方式处理。对于上述因延期办理而未能赎回部分，投资人可在提交赎回申请时选择延期赎回或者取消赎回。选择延期赎回的，延期的赎回申请将自动转入下一开放日，与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的该类别基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。 （十）暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或	（3）如发生单个开放日内单个基金份额持有人申请赎回的基金份额超过前一开放日的基金总份额的20%时，本基金管理人对该单个基金份额持有人持有的赎回申请实施延期办理。具体措施如下： 对于该单个基金份额持有人超出前一开放日基金总份额20%的赎回申请，基金管理人可实施延期办理。对于该单个基金份额持有人未超过前一开放日基金总份额20%（含20%）的赎回申请与当日其他投资者的赎回申请一起，按上述（1）、（2）方式处理。对于上述因延期办理而未能赎回的部分，投资人可在提交赎回申请时选择延期赎回或者取消赎回。选择延期赎回的，延期的赎回申请将自动转入下一开放日，与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。 （4）暂停赎回：连续2个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过20个工作日，并应当在规定媒介上进行公告。 当出现巨额赎回时，场内赎回申请按照深圳证券交易所和登记机构的有关业务规则办理。 十、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

赎回的公告 1．发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人应在规定期限内在指定媒介上刊登中融煤炭份额暂停公告。 2．上述暂停申购或赎回情况消除的，基金管理人应于重新开放日公布最近 1 个工作日的中融煤炭份额净值。 （十一）基金转换 基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金合同的规定决定开办中融煤炭份额与基金管理人管理的其他基金之间的转换业务，基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及本基金合同的规定制定并公告，并提前告知基金托管人与相关机构。 （十二）定期定额投资计划 基金管理人可以为投资人办理中融煤炭份额定期定额投资计划，具体规则由基金管理人在届时发布公告或更新的招募说明书中确定。投资人在办理中融煤炭份额定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额，每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。	1．发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人应在规定期限内在规定媒介上刊登暂停公告。 2．上述暂停申购或赎回情况消除的，基金管理人应于重新开放日公布最近 1 个工作日的基金份额净值。 十一、基金转换 基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换业务，基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及本基金合同的规定制定并公告，并提前告知基金托管人与相关机构。 十二、定期定额投资计划 基金管理人可以为投资人办理定期定额投资计划，具体规则由基金管理人另行规定。投资人在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额，每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。
八、基金的上市交易 （一）上市交易的基金份额 本基金合同生效后，基金管理人将根据有关规定，申请煤炭 A 份额与煤炭 B 份额的上市交易。 （二）上市交易的地点	第七部分基金的上市交易 一、上市交易的基金份额 本基金合同生效后，在本基金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，申请本基金的基金份额上市交易。 二、上市交易的地点

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

深圳证券交易所 （三）上市交易的时间 煤炭 A 份额与煤炭 B 份额拟在基金合同生效后六个月内选择适当的时点申请在深圳证券交易所上市交易，但申请上市时应当符合下述第（四）项规定的基金上市条件。 在确定上市交易的时间后，基金管理人最迟在上市前 3 个工作日在指定媒介上刊登公告。 （四）基金上市的条件 如基金具备下列条件，基金管理人可依据《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》，向深圳证券交易所申请上市交易。 1．基金募集金额不低于 2 亿元； 2．基金份额持有人不少于 1000 人； 3.《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》规定的其他条件。 基金上市前，基金管理人应与深圳证券交易所签订上市协议书。基金获准在深圳证券交易所上市的，基金管理人应在基金上市日前至少 3 个工作日发布基金上市交易公告书。 （五）上市交易的规则 1．煤炭 A 份额、煤炭 B 份额分别采用不同的交易代码上市交易； 2．煤炭 A 份额、煤炭 B 份额上市首日的开盘参考价分别为各自前一交易日的基金份额参考净值； 3．煤炭 A 份额、煤炭 B 份额上市交易遵循《深圳证券交易所交易规则》及《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》等其他有关规定。 （六）上市交易的费用	深圳证券交易所 三、上市交易的时间 在确定上市交易的时间后，基金管理人应根据法律法规规定在规定媒介上刊登上市交易公告书。 四、上市交易的规则 本基金上市交易遵循《深圳证券交易所交易规则》及《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》等其他有关规定。 五、上市交易的费用 本基金上市交易的费用按照深圳证券交易所的有关规定办理。 六、上市交易的行情揭示 本基金的深圳证券交易所挂牌交易，交易行情通过行情发布系统揭示。行情发布系统同时揭示本基金前一交易日的基金份额净值。 七、上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市 本基金停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市按照《基金法》相关规定和深圳证券交易所的相关业务规则执行。 当基金发生深圳证券交易所相关业务规则规定的因不再具备上市条件而应当终止上市的情形时，本基金将转型为非上市开放式基金，本基金的基金名称将变更为“中融中证煤炭指数证券投资基金”，除此之外，本基金的基金费率，基金的投资范围和投资策略等均不变，届时无需召开基金份额持有人大会。基金转型并终止上市后，对于本基金场内份额的处理规则由基金管理人提前制定并公告。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

煤炭 A 份额、煤炭 B 份额上市交易的费用按照深圳证券交易所的有关规定办理。 （七）上市交易的行情揭示 煤炭 A 份额、煤炭 B 份额在深圳证券交易所挂牌交易，交易行情通过行情发布系统揭示。行情发布系统同时揭示前一交易日煤炭 A 份额、煤炭 B 份额的基金份额参考净值。 （八）上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市 煤炭 A 份额、煤炭 B 份额的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市按照《基金法》相关规定和深圳证券交易所的相关业务规则执行。	八、相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所对基金上市交易的规则等相关规定内容进行调整的，本基金合同相应予以修改，并按照新规定执行，且此项修改无须召开基金份额持有人大会，但应在本基金更新的招募说明书中列示。
九、基金的非交易过户、转托管、冻结与质押、转让等业务 （一）非交易过户 基金注册登记机构只受理继承、捐赠、司法强制执行和经注册登记机构认可的其他情况下的非交易过户。其中： “继承”指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承； “捐赠”仅指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体的情形； “司法强制执行”是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人、社会团体或其他组织。 办理非交易过户业务必须提供基金注册登记机构规定的相关资料。 对于符合条件的非交易过户申请按基金注册登记	十三、非交易过户 基金的非交易过户是指基金登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资人。继承是指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；捐赠指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体；司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供基金登记机构要求提供的相关资料，对于符合条件的非交易过户申请按基金登记机构的规定办理，并按基金登记机构规定的标准收费。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

机构的规定办理，申请人按基金注册登记机构规定的标准缴纳过户费用。 （二）基金的注册登记、系统内转托管和跨系统转托管 1．基金份额的注册登记 （1）本基金的份额采用分系统登记的原则。场外认购或申购的中融煤炭份额，登记在登记结算系统中基金份额持有人的开放式基金账户下；场内认购、申购的中融煤炭份额，或上市交易的煤炭 A 份额和煤炭 B 份额，登记在证券登记系统基金份额持有人深圳证券账户下。 （2）登记在证券登记系统中的中融煤炭份额，可以直接申请场内赎回，不在深圳证券交易所上市交易，但经基金份额持有人申请，按照 1：1 的份额配比分拆为煤炭 A 份额和煤炭 B 份额后，可在深圳证券交易所上市交易。 （3）登记在证券登记系统中的煤炭 A 份额和煤炭 B 份额在深圳证券交易所上市交易，不能直接申请场内赎回，但可按照 1：1 的份额配比申请合并为中融煤炭份额的场内份额后，再申请场内赎回。 （4）登记在登记结算系统中的中融煤炭份额，既可以直接申请场外赎回，也可以在办理跨系统转托管业务转至证券登记系统后，由基金份额持有人申请，按照 1：1 的份额配比分拆为煤炭 A 份额和煤炭 B 份额，在深圳证券交易所上市交易。 2．系统内转托管 （2）基金份额登记在登记结算系统的基金份额持有人在变更办理中融煤炭份额赎回业务的销售机构（网点）时，须办理已持有中融煤炭份额的系	十四、基金的系统内转托管和跨系统转托管 1．系统内转托管 （2）基金份额登记在登记结算系统的基金份额持有人在变更办理基金份额赎回业务的销售机构（网点）时，须办理已持有基金份额的系统内转

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

统内转托管。 （3）基金份额登记在证券登记系统的基金份额持有人在变更办理煤炭 A 份额、煤炭 B 份额上市交易或中融煤炭份额场内赎回的会员单位（交易单元）时，须办理已持有基金份额的系统内转托管。 （4）募集期内不得办理系统内转托管。 具体办理方法参照注册登记机构业务规则的有关规定以及基金代销机构的业务规则。 3．跨系统转托管 （1）跨系统转托管是指基金份额持有人将持有的中融煤炭份额在登记结算系统和证券登记系统之间进行转登记的行为。 （2）基金份额处于质押、冻结状态、基金份额折算基准日至折算处理日、或出现深圳证券交易所、注册登记机构规定的其他情形时，不得办理跨系统转托管。 （3）中融煤炭份额跨系统转托管的具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司的相关规定办理。 （三）冻结与质押 基金注册登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及注册登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益根据有权机关要求及注册登记机构业务规则决定是否一并冻结。	托管。 （3）基金份额登记在证券登记系统的基金份额持有人在变更办理基金份额上市交易或基金份额场内赎回的会员单位（交易单元）时，须办理已持有基金份额的系统内转托管。 具体办理方法参照登记机构业务规则的有关规定以及基金销售机构的业务规则。 2．跨系统转托管 （1）跨系统转托管是指基金份额持有人将持有的基金份额在登记结算系统和证券登记系统之间进行转登记的行为。 （2）基金份额处于质押、冻结状态、基金份额折算基准日至折算处理日、或出现深圳证券交易所、登记机构规定的其他情形时，不得办理跨系统转托管。 （3）基金份额跨系统转托管的具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司的相关规定办理。 十五、基金份额的冻结和解冻 基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益根据有权机关要求及登记机构业务规则决定是否一并冻结。
删除下列章节：十、基金的份额配对转换	
十一、基金合同当事人及权利义务	第八部分基金合同当事人及权利义务 一、基金管理人

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

（二）基金管理人的权利与义务 根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于： 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； 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； 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； 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； 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： 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净值信息，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； 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； 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；	（二）基金管理人的权利与义务 根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于： 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登记业务并获得基金合同规定的费用； 11．在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请； 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； 16．在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金申购、赎回、转换和非交易过户等业务规则； 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： 8．采取适当合理的措施使计算基金份额申购、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净值信息，确定基金份额申购、赎回的价格； 14．按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
（三）基金托管人	二、基金托管人

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

基金托管业务批准文号：证监许可〔2013〕1643号 经营范围：证券经纪；证券自营；证券承销与保荐；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；直接投资业务；证券投资基金代销；为期货公司提供中间介绍业务；融资融券业务；代销金融产品；中国证监会批准的其他业务。公司可以对外投资设立子公司从事金融产品等投资业务。[企业经营涉及行政许可的，凭许可证件经营] 注册资本：115.0170亿元人民币 （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，基金托管人的义务包括但不限于： 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； （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。	（一）基金托管人简况 批准设立机关和批准设立文号：中国人民银行银复〔1988〕383号 注册资本：人民币壹佰壹拾伍亿零壹佰柒拾万元整 （二）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，基金托管人的义务包括但不限于： 8．复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购、赎回价格； 三、基金份额持有人 基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对基金合同的承认和接受，基金投资者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的当事人，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。每份基金份额具有同等的合法权益。 根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于： 3．依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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： 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； 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： 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；	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： 4．交纳基金申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用；
十二、基金份额持有人大会 （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： （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）； （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； （9）终止煤炭A份额与煤炭B份额的运作； （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；	第九部分基金份额持有人大会 基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。 本基金份额持有人大会不设日常机构。 一、召开事由 1．除法律法规、中国证监会另有规定外，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： （4）变更基金投资目标、投资范围或投资策略； （7）调整基金管理人、基金托管人的报酬标准； （10）终止基金上市，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； （11）单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

（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； （14）法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。	（13）法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。
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； （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。	2．在法律法规规定和基金合同约定的范围内且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会： （1）调整本基金的申购费率、调低赎回费率、变更收费方式； （4）对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或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； （5）基金推出新业务或服务； （6）调整基金收益的分配原则和支付方式； （7）按照法律法规和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	二、会议召集人及召集方式 1．除法律法规规定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。 2．基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。 3．基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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	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，应当由基金托管人自行召集，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。 4.代表基金份额10%以上（含10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，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，代表基金份额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。 5．代表基金份额 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，单独或合计代表基金份额10%以上（含10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前30日报中国证监会备案。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。	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。 6．基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。
（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： （2）会议拟审议的主要事项、议事程序和表决方式；	三、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．召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前30日在规定媒介公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容： （2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；
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。	2．采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议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。	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拒不派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。
（五）基金份额持有人出席会议的方式	四、基金份额持有人出席会议的方式

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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。 （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。	基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规、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。 （2）经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一（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（含三分之一）。 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或基金合同约定的其他方式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式或基金合同约定的其他方式进行表决。
在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效： （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	在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效： （3）本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一（含

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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。	二分之一）；若本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见基金份额持有人所持有的基金份额小于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应当有代表三分之一以上（含三分之一）基金份额的持有人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见； （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，并与基金登记机构记录相符。
（六）议事内容与程序 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	五、议事内容与程序 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下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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。	议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表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所持表决权的50%以上(含50%)选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。 会议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）、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）和联系方式等事项。
（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。	（2）通讯开会 在通讯开会的情况下，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 2 个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。
（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：	六、表决 基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。 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	1．一般决议，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过方为有效；除下列第 2 项所

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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；	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。	2．特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止基金合同、本基金与其他基金合并以特别决议通过方为有效。 基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。 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，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决，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。
（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	七、计票 1、现场开会 （1）如大会由基金管理人或基金托管人召集，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选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或大会虽然由基金管理人或基金托

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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。 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	管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，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中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。 （2）监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。 （3）如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。 2、通讯开会 在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。 八、生效与公告 基金份额持有人大会的决议，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的决议自表决通过之日起生

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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。	效。 基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 日内在规定媒介上公告。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。 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的决议。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。
十三、基金管理人、基金托管人的更换条件和程序 二、基金管理人和基金托管人的更换程序 （一）基金管理人的更换程序 1、提名：新任基金管理人由基金托管人或者单独或合计持有中融煤炭份额、煤炭 A 份额、煤炭 B 份额各自基金份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人提名； 2、决议：基金份额持有人大会在基金管理人职责终止后6个月内对被提名的基金管理人形成决议，该决议需经出席会议的中融煤炭份额、煤炭 A 份额与煤炭 B 份额各自基金份额持有人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）表决通过； 4、备案：基金份额持有人大会选任基金管理人的决议自表决通过之日起生效，自通过之日起五日内报中国证监会备案；7、审计：基金管理人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计，并将审计结果予以公告，	第十部分基金管理人、基金托管人的更换条件和程序 二、基金管理人和基金托管人的更换程序 （一）基金管理人的更换程序 1、提名：新任基金管理人由基金托管人或由单独或合计持有 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人提名； 2、决议：基金份额持有人大会在基金管理人职责终止后6个月内对被提名的基金管理人形成决议，该决议需经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）表决通过，决议自表决通过之日起生效； 4、备案：基金份额持有人大会更换基金管理人的决议须报中国证监会备案； 7、审计：基金管理人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案，审计费用在基金财产中列支；

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

同时报中国证监会备案； （二）基金托管人的更换程序 1、提名：新任基金托管人由基金管理人或者单独或合计持有中融煤炭份额、煤炭 A 份额、煤炭 B 份额各自基金份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金持有人提名； 2、决议：基金份额持有人大会在基金托管人职责终止后 6 个月内对被提名的基金托管人形成决议，该决议需经出席会议的中融煤炭份额、煤炭 A 份额与煤炭 B 份额各自基金份额持有人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）表决通过； 4、备案：基金份额持有人大会选任基金托管人的决议自表决通过之日起生效，自通过之日起五日内报中国证监会备案； 6、交接：基金托管人职责终止的，应当妥善保管基金财产和基金托管业务资料，及时办理基金财产和基金托管业务的移交手续，新任基金托管人或者临时基金托管人应当及时接收。新任基金托管人与基金管理人核对基金资产总值； 7、审计：基金托管人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案。 （三）基金管理人与基金托管人同时更换的条件和程序。 1、提名：如果基金管理人和基金托管人同时更换，由单独或合计持有中融煤炭份额、煤炭 A 份额、煤炭 B 份额各自基金份额 10%以上（含 10%）的基	（二）基金托管人的更换程序 1、提名：新任基金托管人由基金管理人或由单独或合计持有 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人提名； 2、决议：基金份额持有人大会在基金托管人职责终止后 6 个月内对被提名的基金托管人形成决议，该决议需经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）表决通过，决议自表决通过之日起生效； 4、备案：基金份额持有人大会更换基金托管人的决议须报中国证监会备案； 6、交接：基金托管人职责终止的，应当妥善保管基金财产和基金托管业务资料，及时办理基金财产和基金托管业务的移交手续，新任基金托管人或者临时基金托管人应当及时接收。新任基金托管人应与基金管理人核对基金资产总值； 7、审计：基金托管人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案，审计费用在基金财产中列支。 （三）基金管理人与基金托管人同时更换的条件和程序。 1、提名：如果基金管理人和基金托管人同时更换，由单独或合计持有 10%以上（含 10%）的基金份额持有人提名新的基金管理人和基金托管人；

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

金份额持有人提名新的基金管理人和基金托管人；	三、本部分关于基金管理人、基金托管人更换条件和程序的约定，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，基金管理人与基金托管人协商一致并提前公告后，可直接对相应内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。
十四、基金的托管 基金财产由基金托管人保管。基金管理人应与基金托管人按照《基金法》、基金合同及有关规定订立《中融中证煤炭指数分级证券投资基金托管协议》。订立托管协议的目的是明确基金托管人与基金管理人之间在基金份额持有人名册登记、基金财产的保管、基金财产的管理和运作及相互监督等相关事宜中的权利义务及职责，确保基金财产的安全，保护基金份额持有人的合法权益。	第十一部分基金的托管 基金托管人和基金管理人按照《基金法》、基金合同及其他有关规定订立托管协议。 订立托管协议的目的是明确基金托管人与基金管理人之间在基金财产的保管、投资运作、净值计算、收益分配、信息披露及相互监督等相关事宜中的权利义务及职责，确保基金财产的安全，保护基金份额持有人的合法权益。
十五、基金份额的登记 （一）本基金的注册登记业务指基金登记、存管、清算和结算业务，具体内容包括投资人开放式基金账户和/或深圳证券账户建立和管理、基金份额注册登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户业务等。 （二）本基金的注册登记业务由基金管理人或基金管理人委托的其他符合条件的机构负责办理。基金管理人委托其他机构办理本基金注册登记业务的，应与代理人签订委托代理协议，以明确基	第十二部分基金份额的登记 一、基金份额的登记业务 本基金的登记业务指本基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人开放式基金账户和/或深圳证券账户建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等。 二、基金登记业务办理机构 本基金的登记业务由基金管理人或基金管理人委托的其他符合条件的机构办理。基金管理人委托其他机构办理本基金登记业务的，应与代理人签

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

金管理人和代理机构在注册登记业务中的权利义务，保护基金份额持有人的合法权益。 （三）注册登记机构享有如下权利： 2．取得注册登记费； 4．在法律法规允许的范围内，制定和调整注册登记业务的相关规则； 5．法律法规规定的其他权利。 （四）注册登记机构承担如下义务： 1．配备足够的专业人员办理本基金的注册登记业务； 2．严格按照法律法规和基金合同规定的条件办理基金的注册登记业务； 4．对基金份额持有人的基金账户信息负有保密义务，因违反该保密义务对投资人或基金带来的损失，须承担相应的赔偿责任，但司法、行政等强制检查情形除外； 5．按基金合同和招募说明书规定为投资人办理非交易过户等业务，并提供其他必要服务； 7．法律法规规定的其他义务。	订委托代理协议，以明确基金管理人和代理机构在投资者基金账户管理、基金份额登记、清算及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等事宜中的权利和义务，保护基金份额持有人的合法权益。 三、基金登记机构的权利 基金登记机构享有以下权利： 2．取得登记费； 4．在法律法规允许的范围内，对登记业务的办理时间进行调整，并依照有关规定于开始实施前在规定媒介上公告； 5．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。 四、基金登记机构的义务 基金登记机构承担以下义务： 1．配备足够的专业人员办理本基金份额的登记业务； 2．严格按照法律法规和基金合同规定的条件办理本基金份额的登记业务； 4．对基金份额持有人的基金账户信息负有保密义务，因违反该保密义务对投资者或基金带来的损失，须承担相应的赔偿责任，但司法强制检查情形及法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他情形除外； 5．按基金合同及招募说明书规定为投资者办理非交易过户业务、提供其他必要的服务； 7．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。
十六、基金的投资	第十三部分基金的投资

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

（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）。 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，。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。 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。	二、投资范围 本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、金融债券、企业债券、公司债券、公开发行的次级债、可转换公司债券（含可分离交易可转债）、可交换公司债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、金融衍生工具（包括股指期货、国债期货）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）。 本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的90%，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、国债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，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。
（三）投资策略 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资比例不低于基金资产的85%，其中投资	三、投资策略 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资比例不低于基金资产的90%，其中投资

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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 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。 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。	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、国债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。 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，以套期保值为目的，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。 5．国债期货投资策略 国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人以套期保值为目的，通过构建量化分析体系，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、隐含波动率水平、套期保值的稳定性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值。 6．可转换债券投资策略 本基金投资可转换公司债券和可交换公司债券将基于以下三个方面的分析：价值分析、债股性分

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

	析和公司基本面分析。通过以上分析，力求选择债券价值有一定支撑、安全性和流动性较好，并且发行人成长性良好的品种进行投资。 7．资产支持证券投资策略 资产支持证券主要包括资产抵押贷款支持证券（ABS）、住房抵押贷款支持证券（MBS）等证券品种。本基金将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析，并辅助采用数量化定价模型，评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。 8．其他 未来，随着市场的发展和基金管理运作的需要，基金管理人可以在不改变投资目标的前提下，遵循法律法规的规定，在履行适当程序后相应调整或更新投资策略，并在招募说明书更新中公告。如法律法规或监管机构以后允许本基金投资于其他衍生金融工具，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金对衍生金融工具的投资主要以对提高组合整体收益为主要目的。本基金将在有效风险管理的前提下，通过对标的品种的研究，谨慎投资。
（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	四、投资限制 1．组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制： （1）本基金投资于股票的资产不低于基金资产的90%，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%；

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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%； （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； 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%；	（2）本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债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；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等； （3）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%，进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期； （10）本基金参与股指期货、国债期货交易后，需遵守下列比例限制； 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）、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，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%； 6）本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的 15%； 7）持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

	有的债券总市值的 30%； 8）本基金所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定； 9）本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债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 30%；
（18）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使本基金不符合前款所规定比例限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资； （19）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本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。 除第（11）、（15）、（17）、（18）项以外，因证券市场、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合基金合同的有关约	（13）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合该比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资； （14）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 除上述第（2）、（8）、（12）、（13）项情形之外，因证券市场、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动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。 基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符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本基金合同生效之日起开始。 法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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本基金合同生效之日起开始。	基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。
2．禁止行为 （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。	2．禁止行为 （7）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。 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重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，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。
（四）标的指数与业绩比较基准 1．标的指数 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。	五、标的指数与业绩比较基准 1．标的指数
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）。	2．业绩比较基准 本基金业绩比较基准为：中证煤炭指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

（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，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、风险收益特征 本基金为跟踪指数的股票型基金，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。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。
（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； 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	七、基金管理人代表基金行使股东或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或债权人权利，保护基金份额持有人的利益； 2．不谋求对上市公司的控股； 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牟取任何不当利益。
（八）基金的融资、融券及转融通 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。	

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

十七、基金的财产 （一）基金资产总值 基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款以及其他资产的价值总和。 （二）基金资产净值 基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。 （三）基金财产的账户 基金托管人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立资金账户、证券账户以及投资所需的其他专用账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和注册登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。 （四）基金财产的处分 基金财产独立于基金管理人、基金托管人和代销机构的固有财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益归入基金财产。基金管理人、基金托管人可以按基金合同的约定收取管理费、托管费以及其他基金合同约定的费用。基金财产的债权、不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相抵消，不同基金财产的债权债务，不得相互抵消。基金管理人、基金托管人以其自有资产承担法律责任，其债权人不得对基金财产行使请求冻结、扣押和其他权利。 基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。	第十四部分基金的财产 一、基金资产总值 基金资产总值是指购买的各类证券及票据价值、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和。 二、基金资产净值 基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。 三、基金财产的账户 基金托管人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立资金账户、证券账户和期货账户等投资所需账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。 四、基金财产的保管和处分 本基金财产独立于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人、基金登记机构和基金销售机构以其自有的财产承担其自身的法律责任，其债权人不得对本基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除依法律法规和基金合同的规定处分外，基金财产不得被处分。 基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。基金管理人管理运作基金财产所产生的债权，不得与其固有资产产生的债务相互抵销；基金管理人管理运作不同基金的基金财产所产生的债权债务不得相互抵销。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

除依据法律法规、基金合同进行处分外，基金财产不得被处分。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。	执行。
十八、基金资产的估值 （一）估值日 本基金的估值日为本基金相关的证券交易场所的正常营业日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非营业日。 （三）估值对象 基金所拥有的股票、权证、股指期货合约、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产和负债。	第十五部分基金资产的估值 一、估值日 本基金的估值日为本基金相关的证券交易场所的交易日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非交易日。 二、估值对象 基金所拥有的股票、期货合约、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。 三、估值原则 基金管理人在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，应符合《企业会计准则》、监管部门有关规定。 （一）对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，应将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。 与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

	征考虑。此外，基金管理人不应考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。 （二）对不存在活跃市场的投资品种，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。 （三）如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25%以上的，应对估值进行调整并确定公允价值。
（二）估值方法 1．证券交易所上市的有价证券的估值 （1）交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格； （2）交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价或第三方估值机构提供的价格估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价或第三方估值机构提供的价格估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市	四、估值方法 1．证券交易所上市的有价证券的估值 （1）交易所上市的有价证券（包括股票等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价格； （2）交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价或第三方估值机构提供的价格估值，估值日没有交易的，且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的收盘价或第三方估值机构提供的价格估值。如有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价格；

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格； （3）交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；	（3）交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价格；
2．处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理： （2）首次公开发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值； （3）首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。	2．处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理： （2）首次公开发行未上市的股票和债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值； （3）在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。
5．中国金融期货交易所上市的股指期货，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。 根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基	5．股指期货合约以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值； 6．国债期货合约以估值当日结算价进行估值。估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值；

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对基金净值信息的计算结果对外予以公布。 （四）各级基金份额净值的计算 本基金分别计算并公告中融煤炭份额净值、煤炭A份额与煤炭B份额的基金份额参考净值。 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。 T 日的各类基金份额的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日公告。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。 （五）估值程序 1．基金管理人每个工作日计算基金资产净值及各类基金份额的基金份额净值，并按规定公告。 2．基金管理人应每个工作日对基金资产估值。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将各类基金份额的基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人依据基金合同和相关法律法规的规定对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。 （六）估值错误的处理	8．当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。 五、估值程序 1．基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.001 元，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制，国家另有规定的，从其规定。 基金管理人每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。 2．基金管理人应每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或本基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人按规定对外公布。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后 3 位以内（含第 3 位）发生差错时，视为基金份额净值错误。 本基金合同的当事人应按照以下约定处理： 1．差错类型 本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或注册登记机构、或代销机构、或投资人自身的过错造成差错，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该差错遭受损失当事人（“受损方”）的直接损失按下述“差错处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。 上述差错的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等；对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平不能预见、不能避免、不能克服，则属不可抗力，按照下述规定执行。 由于不可抗力原因造成投资人的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。 2．差错处理原则 （1）差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的，由差错责任方对直接损失承担赔偿责	六、估值错误的处理 基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后 3 位以内（含第 3 位）发生估值错误时，视为基金份额净值错误。 本基金合同的当事人应按照以下约定处理： 1．估值错误类型 本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或登记机构、或销售机构、或投资人自身的过错造成估值错误，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该估值错误遭受损失当事人（“受损方”）的直接损失按下述“估值错误处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。 上述估值错误的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等。 2．估值错误处理原则 （1）估值错误已发生，但尚未给当事人造成损失时，估值错误责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正估值错误发生的费用由估值错误责任方承担；由于估值错误责任方未及时更正已产生的估值错误，给当事人造成损失的，由估值错

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

任；若差错责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则有协助义务的当事人其应当承担相应赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正。 （2）差错的责任方对有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对差错的有关直接当事人负责，不对第三方负责。 （3）因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失（“受损方”），则差错责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给差错责任方。 （4）差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。 （5）差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人过错造成基金财产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人过错造成基金财产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。基金管理人和托管人之外的第三方造成基金财产的损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错方追偿；追	误责任方对直接损失承担赔偿责任；若估值错误责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。估值错误责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保估值错误已得到更正。 （2）估值错误的责任方对有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对估值错误的有关直接当事人负责，不对第三方负责。 （3）因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但估值错误责任方仍应对估值错误负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失（“受损方”），则估值错误责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给估值错误责任方。 （4）估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

偿过程中产生的有关费用，应列入基金费用，从基金资产中支付。 （6）如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律法规、基金合同或其他规定，基金管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任，则基金管理人有权向出现过错的当事人进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的直接损失。 （7）按法律法规规定的其他原则处理差错。 3．差错处理程序 差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下： （1）查明差错发生的原因，列明所有的当事人，并根据差错发生的原因确定差错的责任方； （2）根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估； （3）根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失； （4）根据差错处理的方法，需要修改基金注册登记机构交易数据的，由基金注册登记机构进行更正，并就差错的更正向有关当事人进行确认。 4．基金份额净值差错处理的原则和方法如下： （2）错误偏差达到基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到基金份额净值的 0.50%时，基金管理人应当公告。 （3）因基金份额净值计算错误，给基金或基金份额持有人造成损失的，应由基金管理人先行赔付，	3．估值错误处理程序 估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下： （1）查明估值错误发生的原因，列明所有的当事人，并根据估值错误发生的原因确定估值错误的责任方； （2）根据估值错误处理原则或当事人协商的方法对因估值错误造成的损失进行评估； （3）根据估值错误处理原则或当事人协商的方法由估值错误的责任方进行更正和赔偿损失； （4）根据估值错误处理的方法，需要修改基金登记机构交易数据的，由基金登记机构进行更正，并就估值错误的更正向有关当事人进行确认。 4．基金份额净值估值错误处理的方法如下： （2）错误偏差达到基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到基金份额净值的 0.50%时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

基金管理人按差错情形，有权向其他当事人追偿。 （4）基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差，以基金管理人计算结果为准。 （5）前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。	（3）前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。如果行业另有通行做法，基金管理人和基金托管人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。
（七）暂停估值的情形 2．因不可抗力或其它情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时； 3．当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停基金估值；	七、暂停估值的情形 2．因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时； 3．当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停估值；
（八）基金净值的确认 用于基金信息披露的基金资产净值和各类基金份额的基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金资产净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人依据基金合同和相关法律法规的规定对基金净值予以公布。	八、基金净值的确认 用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金资产净值和基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值予以公布。
（九）特殊情况的处理 1．基金管理人或基金托管人按估值方法的第 6 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。 2．由于不可抗力原因，或由于证券、期货交易所	九、特殊情况的处理 1．基金管理人或基金托管人按估值方法的第 7 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

及登记结算公司发送的数据错误等原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。	2．由于不可抗力，或由于证券、期货交易所及登记结算公司等机构发送的数据错误等原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误而造成的基金份额净值计算错误，基金管理人、基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。
十九、基金的费用与税收 （一）基金费用的种类 4．基金合同生效后的基金信息披露费用； 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； 8．基金上市初费和上市月费； 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	第十六部分基金的费用与税收 一、基金费用的种类 4．基金合同生效后的与基金相关的信息披露费用； 6．基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费； 8．基金上市费用； 10．基金的银行汇划费用； 11．按照国家有关规定和基金合同约定，可以在基金财产中列支的其他费用。 二、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 本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.50%年费率计提。管理费的计算方法如下： 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为前一日的基金资产净值 基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前3个

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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 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： 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。 （四）不列入基金费用的项目	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、公休日等，支付日期顺延。 2．基金托管人的托管费 本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.10%年费率计提。托管费的计算方法如下： 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为前一日的基金资产净值 基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前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 本基金的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： 许可使用基点费的收取下限为每季度人民币50,000元（大写：伍万圆），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。 三、不列入基金费用的项目 下列费用不列入基金费用：

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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。	1．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； 2．基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用； 3．基金合同生效前的相关费用； 4．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。 四、基金税收 本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。基金财产投资的相关税收，由基金份额持有人承担，基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。
二十、基金的收益与分配 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。	第十七部分基金的收益与分配 一、基金利润的构成 基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额，基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。 二、基金可供分配利润 基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。 三、基金收益分配原则 1．本基金场外份额的收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

	现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；本基金的场内份额的收益分配方式仅为现金分红； 2．基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值； 3．每一基金份额享有同等分配权； 4．法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。 四、收益分配方案 基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。 五、收益分配方案的确定、公告与实施 基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。 本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。 六、基金收益分配中发生的费用 基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。
删除下列章节： 二十一、基金份额折算	

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

二十二、煤炭A份额与煤炭B份额的终止运作	
二十三、基金的会计和审计 （一）基金的会计政策 1．基金管理人为本基金的会计责任方； 2.本基金的会计年度为公历每年的1月1日至12月31日；基金首次募集的会计年度按如下原则：如果基金合同生效少于 2 个月，可以并入下一个会计年度披露； 3．本基金的会计核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位； 4．会计制度执行国家有关的会计制度； 6．基金管理人保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表； 7．基金托管人定期与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并书面确认。 （二）基金的审计 1．基金管理人聘请具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金年度财务报表及其他规定事项进行审计。会计师事务所及其注册会计师与基金管理人、基金托管人相互独立。	第十八部分基金的会计与审计 一、基金会计政策 1．基金管理人为本基金的基金会计责任方； 2．基金的会计年度为公历年度的 1 月 1 日至 12 月 31 日；基金首次募集的会计年度按如下原则：如果基金合同生效少于 2 个月，可以并入下一个会计年度披露； 3．基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位； 4．会计制度执行国家有关会计制度； 6．基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表； 7．基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。 二、基金的年度审计 1.基金管理人聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所及其注册会计师对本基金年度财务报表及其他规定事项进行审计。会计师事务所及其注册会计师与基金管理人、基金托管人相互独立。
二十四、基金的信息披露 基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《流动性风险管理规定》、基金合同及其他有关规定。基金管理人、基金托管人和其他基金信息披露义务人应当以保护基金份额持有人利益为根本出发点，依法披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性、完整性、	第十九部分基金的信息披露 一、本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《流动性风险管理规定》、基金合同及其他有关规定。 二、信息披露义务人 本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

及时性、简明性和易得性。 本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和非法人组织。基金管理人、基金托管人和其他基金信息披露义务人应按规定将应予披露的基金信息披露事项在规定时间内通过中国证监会指定的全国性报刊（以下简称“指定报刊”）和指定互联网网站（以下简称“指定网站”）等媒介披露。	人等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和非法人组织。 本基金信息披露义务人以保护基金份额持有人利益为根本出发点，按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性、完整性、及时性、简明性和易得性。 本基金信息披露义务人应按规定将应予披露的基金信息披露事项在规定时间内符合中国证监会规定条件的全国性报刊（以下简称“规定报刊”）和《信息披露办法》规定的互联网网站（以下简称“规定网站”）等媒介披露。
本基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证不同文本的内容一致。不同文本之间发生不一致或有歧义的，以中文文本为准。	四、本基金公开披露的信息应采用中文文本。同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证不同文本的内容一致。不同文本之间发生歧义的，以中文文本为准。 五、公开披露的基金信息
公开披露的基金信息包括： （一）基金合同、招募说明书、托管协议、基金产品资料概要 招募说明书是基金向社会公开发售时对基金情况进行说明的法律文件。 基金管理人按照《基金法》、《信息披露办法》、基金合同编制并在基金份额发售的 3 日前，将基金招募说明书登载在指定报刊和网站上。基金合同生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在指定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金	公开披露的基金信息包括： （一）基金合同、招募说明书、托管协议、基金产品资料概要 1．基金合同是界定基金合同当事人的各项权利、义务关系，明确基金份额持有人大会召开的规则及具体程序，说明基金产品的特性等涉及基金投资者重大利益的事项的法律文件。 2．招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。基金合同生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人在三个工作日内，更新基金招募说明

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

招募说明书。 基金产品资料概要是基金招募说明书的摘要文件，用于向投资者提供简明的基金概要信息。基金合同生效后，基金产品资料概要的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金产品资料概要，并登载在指定网站及基金销售机构网站或营业网点；基金产品资料概要其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金产品资料概要。 基金募集申请经中国证监会注册后，基金管理人应当在基金份额发售的三日前，将基金份额发售公告、基金招募说明书提示性公告和基金合同提示性公告登载在指定报刊上，将基金份额发售公告、基金招募说明书、基金产品资料概要、《基金合同》和基金托管协议登载在指定网站上，并将基金产品资料概要登载在基金销售机构网站或营业网点；基金托管人应当同时将基金合同、基金托管协议登载在网站上。 （二）基金份额发售公告 基金管理人将按照《基金法》、《信息披露办法》的有关规定，就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于指定媒介上。 （三）基金合同生效公告 基金管理人将在基金合同生效的次日在指定媒介上登载基金合同生效公告。基金合同生效公告中将说明基金募集情况。 （四）基金份额上市交易公告书	书并登载在规定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。 3. 托管协议是界定基金托管人和基金管理人在基金财产保管及基金运作监督等活动中的权利、义务关系的法律文件。 4. 基金产品资料概要是基金招募说明书的摘要文件，用于向投资者提供简明的基金概要信息。《基金合同》生效后，基金产品资料概要的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金产品资料概要，并登载在规定网站及基金销售机构网站或营业网点；基金产品资料概要其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金产品资料概要。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

煤炭 A 份额与煤炭 B 份额获准在深圳证券交易所上市交易的，基金管理人应当在基金份额上市交易 3 个工作日前，将基金份额上市交易公告书登载在指定网站上，并将上市交易公告书提示性公告登载在指定报刊上。	
（五）基金净值信息 1．本基金的基金合同生效后，在煤炭A份额与煤炭 B 份额开始上市交易前或开始办理中融煤炭份额申购或者赎回前，基金管理人将至少每周在指定网站披露一次中融煤炭份额净值、煤炭 A 份额与煤炭B份额的基金份额参考净值； 2．在开始办理煤炭A份额、煤炭B份额的上市交易或中融煤炭份额申购或者赎回后，基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过其指定网站、基金销售机构网站或营业网点，披露开放日的中融煤炭份额净值、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累计净值； 3．基金管理人应在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在指定网站披露半年度和年度最后一日的中融煤炭份额净值、煤炭 A 份额与煤炭 B 份额的基金份额参考净值。	（二）基金净值信息 基金合同生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周在规定网站披露一次基金份额净值和基金份额累计净值； 在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过其规定网站、基金销售机构网站或营业网点披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值； 基金管理人应在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在规定网站披露半年度和年度最后一日的基金份额净值和基金份额累计净值。
（六）中融煤炭份额申购、赎回价格公告 基金管理人应当在本基金的基金合同、招募说明书等信息披露文件上载明中融煤炭份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资人能够在基金销售机构网站或营业网点查阅或者复制前述信息资料。	（三）基金份额申购、赎回价格 基金管理人应当在基金合同、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资者能够在基金销售机构网站或营业网点查阅或者复制前述信息资料。
（七）基金年度报告、基金中期报告、基金季度报告	（四）基金定期报告，包括基金年度报告、中期

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

1．基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载在指定网站上，将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计； 2．基金管理人应当在上半年结束之日起两个月内，编制完成基金中期报告，将中期报告登载在指定网站上，并将中期报告提示性公告登载在指定报刊上； 3．基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，将季度报告登载在指定网站上，并将季度报告提示性公告登载在指定报刊上； 4．基金合同生效不足 2 个月的，本基金管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。 5．基金持续运作过程中，应当在基金年度报告和中期报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。 6．如报告期内出现单一投资者持有基金份额数的比例达到或超过基金份额总数 20%的情形，为保障其他投资者的权益，基金管理人至少应当在基金定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。 （八）临时报告 在基金运作过程中发生如下可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的事件时，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时	报告和季度报告 基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载在规定网站上，将年度报告提示性公告登载在规定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计； 基金管理人应当在上半年结束之日起两个月内，编制完成基金中期报告，将中期报告登载在规定网站上，并将中期报告提示性公告登载在规定报刊上； 基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，将季度报告登载在规定网站上，并将季度报告提示性公告登载在规定报刊上； 基金合同生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。 如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额 20%的情形，为保障其他投资者的权益，基金管理人至少应当在定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。 基金管理人应当在基金年度报告和中期报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。 （五）临时报告 本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，并登载在规定报刊和

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

报告书，并登载在指定报刊和指定网站上： 17．中融煤炭份额开始办理申购、赎回； 18．中融煤炭份额发生巨额赎回并延期办理； 19．中融煤炭份额连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项； 20．中融煤炭份额暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请； 22．本基金开始接受或暂停接受份额配对转换申请； 23．本基金暂停接受份额配对转换后恢复办理份额配对转换业务； 24．本基金实施基金份额折算； 25．煤炭 A 份额与煤炭 B 份额终止运作后煤炭 A 份额、煤炭 B 份额的份额转换；	规定网站上。 前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件： 17．本基金开始办理申购、赎回； 18．本基金发生巨额赎回并延期办理； 19．本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项； 20．本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请； 22．新增或调整本基金份额类别设置或基金份额分类规则
（九）澄清公告 在基金合同期限内，任何公共媒介中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动，以及可能损害基金份额持有人权益的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会、基金上市交易的证券交易所。	（六）澄清公告 在基金合同存续期限内，任何公共媒介中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动，以及可能损害基金份额持有人权益的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会、基金上市交易的证券交易所。
（十四）信息披露事务管理 基金信息披露义务人公开披露基金信息，应当符合中国证监会相关基金信息披露内容与格式准则等法律的规定。 （十六）本基金信息披露事项以法律法规规定及本章节约定的内容为准。	（七）基金份额持有人大会决议 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。 （十）投资国债期货相关公告 基金管理人应在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

	国债期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示国债期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标等。 六、信息披露事务管理 基金信息披露义务人公开披露基金信息，应当符合中国证监会相关基金信息披露内容与格式准则等法律法规的规定。
二十五、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 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；	第二十部分基金合同的变更、终止与基金财产的清算 一、基金合同的变更 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。对于法律法规规定和基金合同约定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。 二、基金合同的终止事由 有下列情形之一的，经履行相关程序后，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、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的； 4．相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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、具有证券、期货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。	三、基金财产的清算 1．基金财产清算小组：自出现基金合同终止事由之日起 30 个工作日内，成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。 2．基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、符合《中华人民共和国证券法》规定的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。 3．基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。 4．基金财产清算程序 （1）基金合同终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金财产； （4）制作清算报告； （5）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书； （6）将清算报告报中国证监会备案并公告； 5．基金财产清算的期限为 6 个月，但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的，清算期限相应顺延。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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具有证券、期货相关业务资格的会	四、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剩余财产中支付。 五、基金财产清算剩余资产的分配 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。 六、基金财产清算的公告 清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并公告。基金财产

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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，基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。	清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告，基金财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。
二十六、违约责任 一、基金管理人、基金托管人在履行各自职责的过程中，违反《基金法》等法律法规的规定或者《基金合同》约定，给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任；因共同行为给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当承担连带赔偿责任，对损失的赔偿，仅限于直接损失。但是发生下列情况的，当事人可以免责： 3、基金管理人由于按照基金合同规定的投资原则行使或不行使其投资权而造成的损失等。	第二十一部分违约责任 一、基金管理人、基金托管人在履行各自职责的过程中，违反《基金法》等法律法规的规定或者《基金合同》约定，给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任；因共同行为给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当承担连带赔偿责任，对损失的赔偿，仅限于直接损失。但是发生下列情况，当事人免责： 3、基金管理人由于按照基金合同规定的投资原则而行使或不行使其投资权而造成的损失等。
二十七、争议的处理 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。	第二十二部分争议的处理 争议处理期间，基金管理人和基金托管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。
二十八、基金合同的效力 基金合同是约定基金合同当事人之间权利义务关系的法律文件。 （一）本基金合同经基金管理人和基金托管人加盖公章以及双方法定代表人或授权代表签章，在基金募集结束，基金备案手续办理完毕，并获中国证监会书面确认后生效。基金合同的有效期自其生效之日起至该基金财产清算结果报中国证监	第二十三部分基金合同的效力 基金合同是约定基金合同当事人之间权利义务关系的法律文件。 （一）基金合同经基金管理人和基金托管人加盖公章以及双方法定代表人或授权代表签章，经 2020 年 X 月 X 日中融中证煤炭指数分级证券投资基金的基金份额持有人大会决议通过，并报中国证监会备案。自 2020 年 X 月 X 日起，《中融中证

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

会备案并公告之日止。 （二）本基金合同自生效之日起对包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人在内的基金合同各方当事人具有同等的法律约束力。 （三）本基金合同正本一式六份，除中国证监会持两份外，基金管理人和基金托管人各持有两份。每份均具有同等的法律效力。 （四）本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。	煤炭指数证券投资基金（LOF）基金合同》生效，原《中融中证煤炭指数分级证券投资基金基金合同》同日起失效。 （二）基金合同自生效之日起对包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人在内的基金合同各方当事人具有同等的法律约束力。 （三）基金合同正本一式五份，除上报有关监管机构一式二份外，基金管理人持二份、基金托管人持一份，每份具有同等的法律效力。 （四）基金合同可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn