# 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：

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）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（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

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
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**

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》

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。

**中融基金管理有限公司**
**2020年9月28日**

附件二：

| | | | |
|---|---|---|---|
| **中融中证煤炭指数分级证券投资基金<br>基金份额持有人大会表决票** | | | |
| 基金份额持有人名称： | | | |
| 证件号码(身份证件号/营业执照号) | 基金账户号 | | |
| | | | |
| 受托人（代理人）姓名/名称： | 受托人（代理人）证件号码（身份证件号/营业执照号）： | | |
| | | | |
| 审议事项 | 同意 | 反对 | 弃权 |
| 《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》 | | | |
| 基金份额持有人/受托人签名或盖章<br>年月日 | | | |
| 说明：<br>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。<br>"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。 | | | |

（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。）

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。

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，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）。

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）

（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。

（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。

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：

| | 申购金额（M） | 申购费率 |
|---|---|---|
| 场外申购费 | 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：

| | 持有时间 | 赎回费率 |
|---|---|---|
| 场外赎回费率 | 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。

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。

（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。

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<br>（一）订立本基金合同的目的、依据和原则<br>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。<br>（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。<br>中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值、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。<br>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。 | 第一部分前言<br>一、订立本基金合同的目的、依据和原则<br>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。<br>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"中国证监会"）注册。<br>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。<br>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<br>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：<br>1.基金或本基金：指中融中证煤炭指数分级证券投资基金<br>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<br>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<br>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<br>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修订<br>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<br>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<br>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<br>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<br>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<br>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<br>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<br>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<br>28.销售机构：指直销机构和代销机构<br>29.直销机构：指中融基金管理有限公司<br>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<br>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<br>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<br>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<br>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<br>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<br>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<br>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<br>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<br>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<br>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<br>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<br>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%<br>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<br>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<br>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 | 第二部分释义<br>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：<br>1. 基金或本基金：指中融中证煤炭指数证券投资基金（LOF）<br>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<br>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<br>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<br>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<br>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<br>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<br>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<br>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<br>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<br>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<br>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<br>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<br>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<br>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<br>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<br>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<br>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<br>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<br>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<br>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<br>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<br>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<br>39.T+n日：指自T日起第n个工作日（不包含T日）<br>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<br>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<br>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<br>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%<br>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<br>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<br>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 |
| 删除下列释义：<br>7.基金份额发售公告<br>8.上市交易公告书<br>17.基金份额分级<br>18.中融煤炭份额<br>19.煤炭A份额<br>20.煤炭B份额<br>29.直销机构<br>30.代销机构<br>31.基金销售网点<br>32.销售场所<br>44.基金募集期<br>52.认购<br>55.配对转换<br>56.分拆<br>57.合并<br>58.自动分离<br>73.基金份额参考净值 | |
| 三、基金的基本情况<br>（一）基金的名称<br>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<br>一、基金名称<br>中融中证煤炭指数证券投资基金（LOF）<br>六、基金份额的上市交易<br>本基金在深圳证券交易所上市交易<br>八、其他<br>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。 |
| 删除：<br>（五）基金的最低募集份额总额和金额<br>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。<br>（六）基金份额初始面值和认购费用<br>基金份额的初始面值为人民币1.00元。<br>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：<br>四、基金份额分级与净值计算规则<br>五、基金份额的发售 | 增加：<br>第四部分基金的历史沿革<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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<br>（一）基金备案的条件<br>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。<br>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。<br>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。<br>（二）基金募集失败<br>1.基金募集期届满，未达到基金备案条件，则基金募集失败。<br>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。<br>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。<br>（三）基金存续期内的基金份额持有人数量和资金数额<br>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。 | 第五部分 基金的存续<br>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。<br>法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。 |

（下转B54版）