

中融中证煤炭指数型证券投资基金 上市交易公告书

基金管理人：中融基金管理有限公司

基金托管人：海通证券股份有限公司

基金登记结算机构：中国证券登记结算有限责任公司

上市地点：深圳证券交易所

上市日期：2021年6月11日

公告日期：2021年6月8日

目录

一、重要声明与提示.....	3
二、基金概览.....	3
三、基金的历史沿革与上市交易.....	5
四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人.....	6
五、基金主要当事人简介.....	8
六、基金合同摘要.....	13
七、基金财务状况.....	14
八、基金投资组合.....	15
九、重大事件揭示.....	20
十、基金管理人承诺.....	20
十一、基金托管人承诺.....	20
十二、基金上市推荐人意见.....	21
十三、备查文件目录.....	21
附件：基金合同摘要.....	23

一、重要声明与提示

《中融中证煤炭指数型证券投资基金上市交易公告书》(以下简称“本公告”)依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号〈上市交易公告书的内容与格式〉》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制,中融中证煤炭指数型证券投资基金(以下简称“本基金”)管理人中融基金管理有限公司(以下简称“本基金管理人”或“本公司”)的董事会及董事保证本公告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本基金托管人海通证券股份有限公司保证本公告中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性,承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、深圳证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见,均不表明对本基金的任何保证。

凡本公告未涉及的有关内容,请投资者详细查阅刊登在中国证监会指定媒介和中融基金管理有限公司网站(www.zrfunds.com.cn)上的本基金的基金合同、招募说明书等法律文件。

二、基金概览

- 1、基金名称:中融中证煤炭指数型证券投资基金
- 2、基金类型:股票型证券投资基金
- 3、基金运作方式:上市契约型开放式
- 4、基金场内简称:中融煤炭
- 5、基金代码:168204
- 6、基金份额总额:截至2021年6月4日,本基金总份额为134,616,258.49份
- 7、基金份额净值:截至2021年6月4日,本基金基金份额净值为1.167元
- 8、本次上市交易份额:33,813,376份(截至2021年6月4日)
- 9、上市交易的证券交易所:深圳证券交易所

10、上市交易日期：2021年6月11日

11、基金管理人：中融基金管理有限公司

12、基金托管人：海通证券股份有限公司

13、本次上市交易的基金份额注册登记机构：中国证券登记结算有限责任公司

14、基金份额的申购与赎回：本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。

投资者办理基金份额场外申购和赎回业务的场所为基金管理人直销机构和基金管理人委托的其他销售机构的销售网点（具体包括北京银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、宁波银行股份有限公司、中国中金财富证券有限公司、中天证券股份有限公司、五矿证券有限公司、中泰证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、中信建投证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、太平洋证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、华西证券股份有限公司、西南证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、华融证券股份有限公司、平安证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、东海证券股份有限公司、中国国际金融股份有限公司、宏信证券有限责任公司、安信证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、粤开证券股份有限公司、华龙证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、国都证券股份有限公司、民生证券股份有限公司、大同证券有限责任公司、万联证券股份有限公司、天风证券股份有限公司、第一创业证券股份有限公司、中山证券有限责任公司、华安证券股份有限公司、联储证券有限责任公司、中信证券华南股份有限公司、北京唐鼎耀华基金销售有限公司、北京晟视天下基金销售有限公司、北京恒天明泽基金销售有限公司、浦领基金销售有限公司、深圳众禄基金销售股份有限公司、上海好买基金销售有限公司、北京增财基金销售有限公司、蚂蚁（杭州）基金销售有限公司、上海天天基金销售有限公司、北京钱景基金销售有限公司、浙江同花顺基金销售有限公司、诺亚正行基金销售有限公司、上海汇付基金销售有限公司、上海陆金所基金销售有限公司、北京虹点基金销售有限公司、深圳市新兰德证券投资咨询有限公司、上海长量基金销售有限公司、上海凯石财富基金销售有限公司、奕丰基金销售有限公司、北京新浪仓石基金销售有限公司、北京展恒基

金销售股份有限公司、珠海盈米基金销售有限公司、一路财富（北京）基金销售有限公司、上海利得基金销售有限公司、深圳富济基金销售有限公司、北京广源达信基金销售有限公司、上海云湾基金销售有限公司、上海联泰基金销售有限公司、上海万得基金销售有限公司、北京汇成基金销售有限公司、深圳市金斧子基金销售有限公司、京东肯特瑞基金销售有限公司、万家财富基金销售（天津）有限公司、上海大智慧基金销售有限公司、和讯信息科技有限公司、上海基煜基金销售有限公司、凤凰金信（海口）基金销售有限公司、南京苏宁基金销售有限公司、乾道盈泰基金销售（北京）有限公司、北京蛋卷基金销售有限公司、武汉市伯嘉基金销售有限公司、天津国美基金销售有限公司、北京格上富信基金销售有限公司、上海华夏财富投资管理有限公司、中民财富基金销售（上海）有限公司、深圳信诚基金销售有限公司、通华财富（上海）基金销售有限公司、财咨道信息技术有限公司、厦门市鑫鼎盛控股有限公司、中证金牛（北京）投资咨询有限公司、济安财富（北京）基金销售有限公司、嘉实财富管理有限公司、宜信普泽（北京）基金销售有限公司、民商基金销售（上海）有限公司、大连网金基金销售有限公司、腾安基金销售（深圳）有限公司、中信期货有限公司、东海期货有限责任公司、玄元保险代理有限公司（排序不分先后）。

本基金场内销售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会员单位。

三、基金的历史沿革与上市交易

（一）本基金的历史沿革

中融中证煤炭指数型证券投资基金由中融中证煤炭指数分级证券投资基金终止分级运作并变更而来。

中融中证煤炭指数分级证券投资基金依据《基金法》于 2015 年 5 月 5 日获中国证监会证监许可【2015】814 号文准予募集。中融中证煤炭指数分级证券投资基金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。基金管理人于 2015 年 6 月 25 日获得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生效。

根据《中融中证煤炭指数分级证券投资基金基金合同》约定，中融中证煤炭

指数分级证券投资基金应根据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》等法律法规规定终止煤炭 A 份额与煤炭 B 份额的运作，无需召开基金份额持有人大会。据此，基金管理人已于 2020 年 12 月 2 日在指定媒介发布《关于中融中证煤炭指数分级证券投资基金之煤炭 A 份额及煤炭 B 份额终止运作、终止上市并修改基金合同的公告》，向深圳证券交易所申请中融中证煤炭指数分级证券投资基金的两级子份额退市，并于 2020 年 12 月 31 日（基金折算基准日）进行基金份额折算，《中融中证煤炭指数型证券投资基金基金合同》于 2021 年 1 月 1 日正式生效，《中融中证煤炭指数分级证券投资基金基金合同》同时失效。

（二）本基金的日常申购、赎回业务情况

本基金基金份额的日常申购、赎回业务已于 2021 年 1 月 5 日起恢复办理。详情可查阅本基金管理人于 2020 年 12 月 29 日发布在《证券时报》及本公司网站（www.zrfunds.com.cn）上的《中融基金管理有限公司关于中融中证煤炭指数分级证券投资基金暂停赎回及转托管等业务的公告》。

（三）本基金上市交易的主要内容

1、基金上市交易的核准机构和核准文号：深圳证券交易所深证上【2021】558 号

2、上市交易日期：2021 年 6 月 11 日

3、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所

4、上市交易份额场内简称：中融煤炭

5、交易代码：168204

6、本次上市交易份额：33,813,376 份（截至 2021 年 6 月 4 日）

7、基金净值的披露：在基金上市交易或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，通过规定网站、基金销售机构网站或者营业网点，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值，并在深圳证券交易所行情发布系统揭示基金份额净值。

8、未上市交易份额的流通规定：未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，将其跨系统转托管至深圳证券交易所场内后即可上市流通。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

（一）持有人户数

截至 2021 年 6 月 4 日，本基金持有人户数为 22,587 户，平均每户持有的基金份额为 5,959.90 份。其中场内基金份额持有人户数为 1,583 户，平均每户持有的基金份额为 21,360.31 份。

（二）持有人结构

1、截至 2021 年 6 月 4 日，个人投资者持有的本次上市交易的场内基金份额为 31,132,630 份，占本次基金份额上市交易基金份额比例为 92.07%。机构投资者持有的本次上市交易的场内基金份额为 2,680,746.00 份，占本次基金份额上市交易基金份额比例为 7.93%。

2、截至 2021 年 6 月 4 日，本基金管理人的从业人员持有本基金基金份额数量为 0 份，占基金总份额比例为 0。本基金管理人的高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本基金基金份额总量的数量区间为 0。本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

（三）截至 2021 年 6 月 4 日，前十名场内基金份额持有人情况

序号	持有人名称（全称）	持有基金份额	占场内基金份额的比例（%）
1	张美芳	6,854,177.00	20.27
2	邓建民	2,807,915.00	8.30
3	朱洁瑛	1,438,649.00	4.25
4	欧静虹	1,323,179.00	3.91
5	鹏华基金—交通银行—中国人寿财产保险—中国人寿财产保险股份有限公司委托鹏华基金管理有限公司多策略绝对收益组合	1,026,231.00	3.03
6	史德海	1,009,166.00	2.98
7	西南证券股份有限公司客户信用交易担保证券账户	717,754.00	2.12
8	温心	706,354.00	2.09
9	蔡雄民	699,537.00	2.07
10	温渭泉	693,310.00	2.05

合计		17,276,272.00	51.09
----	--	---------------	-------

注：以上信息依据中国证券登记结算有限公司提供的持有人信息编制。

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人

- 1、名称：中融基金管理有限公司
- 2、法定代表人：王瑶
- 3、总裁：黄震
- 4、注册资本：人民币 7.5 亿元
- 5、注册地址：深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路 3088 号中洲大厦 3202、3203B
- 6、设立批准文号：中国证监会证监许可〔2013〕667 号
- 7、工商登记注册的法人营业执照文号：914403007178853609
- 8、经营范围：基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。（依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动）
- 9、股权结构：中融国际信托有限公司占注册资本的 51%，上海融晟投资有限公司占注册资本的 49%
- 10、信息披露负责人：周妹云
- 11、客户服务电话：010-56517299、400-160-6000
- 12、公司组织结构与人员情况

公司目前下设部门共计二十八个，分别为：权益投资部、固收投资部、量化投资部、指数投资部、策略投资部、研究部、信评部、权益交易部、固收交易部、渠道管理总部、市场服务部、机构部、北方营销中心、华北营销中心、上海营销中心、华东营销中心、华南营销中心、华中营销中心、互联网金融部、产品开发部、基金运营部、信息技术部、法律合规部、风险管理部、人力资源部、总裁办公室（董事会办公室）、财务部、企划部。同时，公司在北京、上海各设立了一家分公司，并拥有一家子公司，即中融（北京）资产管理有限公司。

截至 2021 年 6 月 4 日，我公司共有员工 182 人（含借调人员），大学本科及

以上学历 173 名，占员工总数 95%。

13、基金管理业务情况简介：

截至 2021 年 6 月 4 日，本公司已成立公募产品数量为 66 只。

序号	产品名称	类型
1	中融货币市场基金	货币型
2	中融国企改革灵活配置混合型证券投资基金	混合型
3	中融融安灵活配置混合型证券投资基金	混合型
4	中融新机遇灵活配置混合型证券投资基金	混合型
5	中融中证银行指数证券投资基金（LOF）	股票型
6	中融鑫起点灵活配置混合型证券投资基金	混合型
7	中融国证钢铁行业指数型证券投资基金	股票型
8	中融中证煤炭指数型证券投资基金	股票型
9	中融融安二号灵活配置混合型证券投资基金	混合型
10	中融稳健添利债券型证券投资基金	债券型
11	中融新经济灵活配置混合型证券投资基金	混合型
12	中融日日盈交易型货币市场基金	货币型
13	中融产业升级灵活配置混合型证券投资基金	混合型
14	中融融裕双利债券型证券投资基金	债券型
15	中融竞争优势股票型证券投资基金	股票型
16	中融融信双盈债券型证券投资基金	债券型
17	中融现金增利货币市场基金	货币型
18	中融上海清算所银行间 1-3 年高等级信用债指数发起式证券投资基金	债券型
19	中融上海清算所银行间 1-3 年中高等级信用债指数发起式证券投资基金	债券型
20	中融恒泰纯债债券型证券投资基金	债券型
21	中融鑫思路灵活配置混合型证券投资基金	混合型
22	中融物联网主题灵活配置混合型证券投资基金	混合型
23	中融量化智选混合型证券投资基金	混合型
24	中融盈泽中短债债券型证券投资基金	债券型
25	中融恒信纯债债券型证券投资基金	债券型
26	中融睿祥纯债债券型证券投资基金	债券型
27	中融核心成长灵活配置混合型证券投资基金	混合型
28	中融沪港深大消费主题灵活配置混合型发起式证券投资基金	混合型

29	中融鑫价值灵活配置混合型证券投资基金	混合型
30	中融聚商 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金	债券型
31	中融季季红定期开放债券型证券投资基金	债券型
32	中融智选红利股票型证券投资基金	股票型
33	中融聚安 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金	债券型
34	中融量化精选混合型基金中基金（FOF）	混合型基金 中基金
35	中融医疗健康精选混合型证券投资基金	混合型
36	中融聚业 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金	债券型
37	中融恒裕纯债债券型证券投资基金	债券型
38	中融聚明 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金	债券型
39	中融恒惠纯债债券型证券投资基金	债券型
40	中融央视财经 50 交易型开放式指数证券投资基金	股票型
41	中融央视财经 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	股票型
42	中融策略优选混合型证券投资基金	混合型
43	中融聚汇 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金	债券型
44	中融恒鑫纯债债券型证券投资基金	债券型
45	中融高股息精选混合型证券投资基金	混合型
46	中融睿享 86 个月定期开放债券型证券投资基金	债券型
47	中融中证 500 交易型开放式指数证券投资基金	股票型
48	中融聚通 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金	债券型
49	中融睿嘉 39 个月定期开放债券型证券投资基金	债券型
50	中融中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	股票型
51	中融恒安纯债债券型证券投资基金	债券型
52	中融智选对冲策略 3 个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金	混合型
53	中融品牌优选混合型证券投资基金	混合型
54	中融中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金	债券型
55	中融聚锦一年定期开放债券型发起式证券投资基金	债券型
56	中融融慧双欣一年定期开放债券型证券投资基金	债券型
57	中融价值成长 6 个月持有期混合型证券投资基金	混合型
58	中融中证煤炭指数型证券投资基金	混合型
59	中融成长优选混合型证券投资基金	混合型
60	中融景瑞一年持有期混合型证券投资基金	混合型

61	中融产业趋势一年定期开放混合型证券投资基金	混合型
62	中融景颐 6 个月持有期混合型证券投资基金	混合型
63	中融行业先锋 6 个月持有期混合型证券投资基金	混合型
64	中融鑫锐研究精选一年持有期混合型证券投资基金	混合型
65	中融景盛一年持有期混合型证券投资基金	混合型
66	中融恒益纯债债券型证券投资基金	债券型

14、本基金基金经理简介

赵菲先生，中国国籍，毕业于北京师范大学概率论与数理统计专业，硕士研究生学历，具有基金从业资格。2008年8月至2011年5月曾任国泰君安证券股份有限公司证券及衍生品投资总部投资经理；2011年5月至2012年11月曾任嘉实基金管理有限公司结构产品投资部专户投资经理。2012年11月加入中融基金管理有限公司，现任指数投资部总经理。现任本基金（2021年1月起至今）、中融中证一带一路主题指数分级证券投资基金（2015年5月至2020年11月）、中融中证银行指数分级证券投资基金（2015年6月至2020年10月）、中融中证银行指数证券投资基金（LOF）（2020年10月起至今）、中融国证钢铁行业指数分级证券投资基金（2015年6月至2020年12月）、中融国证钢铁行业指数型证券投资基金（2021年1月起至今）、中融中证白酒指数分级证券投资基金（2015年9月至2016年5月）、中融中证煤炭指数分级证券投资基金（2015年6月至2020年12月）、中融量化多因子混合型发起式证券投资基金（2016年12月至2019年3月）、中融量化小盘股票型发起式证券投资基金（2017年5月至2019年3月）、中融央视财经 50 交易型开放式指数证券投资基金（2019年3月起至今）、中融央视财经 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（2019年3月起至今）、中融中证 500 交易型开放式指数证券投资基金（2019年11月起至今）、中融中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（2019年12月起至今）、中融智选对冲策略 3 个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金（2020年4月起至今）、中融智选红利股票型证券投资基金（2020年5月起至今）的基金经理。

（二）基金托管人

1、基本情况

名称：海通证券股份有限公司

注册地址：上海市黄浦区广东路 689 号海通证券大厦

成立时间：1988 年 8 月 15 日

法定代表人：周杰

注册资本：人民币壹佰叁拾亿陆仟肆佰贰拾万元整

电话：021-23219000

联系人：凌如水

海通证券股份有限公司（以下简称“海通证券”）成立于 1988 年，是国内最早成立的大型证券公司之一。海通证券 A 股于 2007 年在上海证券交易所挂牌上市并完成定向增发，H 股于 2012 年 4 月在香港联合交易所挂牌上市。

海通证券设基金托管部，现有员工具有多年金融从业经历，丰富的证券相关业务经验。全员具备基金从业资格，员工的学历均在本科以上，硕士以上学历占 25%，专业分布合理，是一支诚实勤勉，开拓创新的资产托管从业人员团队。

2、基金托管部门及主要人员情况

周杰先生，海通证券董事长、党委书记，上海交通大学管理学院管理工程专业工学硕士。1992 年 2 月至 1996 年 6 月在上海万国证券有限公司投资银行部工作；1996 年 6 月至 2001 年 12 月先后担任上海上实资产经营有限公司投资部经理、副总经理、董事长兼总经理；2001 年 12 月至 2003 年 4 月担任上海实业医药科技（集团）有限公司董事兼总经理；2002 年 1 月至 2016 年 7 月，先后担任上海实业控股有限公司（于香港联交所上市，股份代号：0363）执行董事兼行政总裁、执行董事兼常务副总裁、副董事长兼行政总裁；2004 年 8 月至 2016 年 7 月，先后担任上海上实（集团）有限公司策划总监、执行董事兼副总裁、执行董事兼常务副总裁、总裁兼党委副书记；2010 年 3 月至 2012 年 5 月担任上海医药集团股份有限公司（于上海证券交易所上市，股份代号：601607；于香港联交所上市，股份代号：2607）监事长，2012 年 6 月至 2013 年 6 月、2016 年 5 月至 2016 年 7 月担任上海医药集团股份有限公司董事长兼党委书记；2009 年 1 月至 2016 年 7 月担任中芯国际集成电路制造有限公司（于纽约证券交易所上市，股份代号：SMI；于香港联交所上市，股份代号：0981）非执行董事；2016 年 7 月起担任海通证券党委书记，2016 年 10 月起担任海通证券董事长。

陈春钱先生，海通证券总经理助理，负责公司经纪业务。陈先生还兼任公司经纪业务委员会主任、国际业务协调委员会委员、战略发展与 IT 治理委员会委

员和中国证券业协会证券经纪业专业委员会委员。陈先生于 1988 年 7 月获安徽财经学院经济学硕士学位并于 1995 年 7 月获厦门大学经济学博士学位，拥有 17 年的证券业工作及管理经验。1997 年 10 月至 1998 年 1 月，担任公司深圳分公司业务部负责人；1998 年 1 月至 2000 年 3 月，担任国际业务部副总经理；2000 年 3 月至 2000 年 12 月，担任深圳分公司副总经理；2000 年 12 月至 2006 年 5 月，担任投资管理部（深圳）总经理；2006 年 5 月至 2013 年 2 月，担任销售交易总部总经理，其间 2007 年 11 月至 2009 年 3 月兼任机构业务部总经理。

凌如水先生，海通证券基金托管部总经理，本科学历，拥有丰富的证券业工作及管理经验。1992 年 8 月加入海通证券，曾任海通证券绍兴营业部业务经理，2001 年 5 月起任海通证券上虞营业部总经理，2013 年 3 月起任海通证券企业及私人客户部副总经理，2015 年 8 月起任海通证券基金托管部总经理。

3、基金托管业务经营情况

海通证券于 2013 年 12 月取得中国证监会核准证券投资基金托管资格，是国内第一家取得证券投资基金托管资格的证券公司，海通证券始终遵循“务实、开拓、稳健、卓越”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。

（三）验资机构

名称：上会会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：上海市静安区威海路 755 号文新报业大厦 25 楼

办公地址：上海市静安区威海路 755 号文新报业大厦 25 楼

执行事务合伙人：张晓荣（首席合伙人）

联系人：杨伟平

联系电话：021-52920000

传真：021-52921369

经办注册会计师：陈大愚、江嘉炜

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件。

七、基金财务状况

本基金募集结束后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

本基金 2021 年 6 月 4 日资产负债表如下（未经审计）：

单位：人民币元

资产	本期末 2021-6-4
银行存款	19,300,378.43
结算备付金	742,285.65
存出保证金	396,769.96
交易性金融资产	145,544,679.93
其中：股票投资	145,544,679.93
基金投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	7,084,499.26
应收利息	38,584.76
应收股利	-
应收申购款	1,258,685.55
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	174,365,883.54
负债和所有者权益	本期末 2021-6-4
负债：	
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-
应付证券清算款	-
应付赎回款	16,923,564.15
应付管理人报酬	18,122.20
应付托管费	3,986.89
应付销售服务费	-

应付交易费用	86,457.31
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	179,209.47
负债合计	17,211,340.02
所有者权益：	
实收基金	177,912,103.07
未分配利润	-20,757,559.55
所有者权益合计	157,154,543.52
负债和所有者权益总计	174,365,883.54

八、基金投资组合

截至 2021 年 6 月 4 日，本基金的投资组合如下：

（一）基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	145,544,679.93	83.47
	其中：股票	145,544,679.93	83.47
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	20,042,664.08	11.49
8	其他资产	8,778,539.53	5.03
9	合计	174,365,883.54	100.00

(二) 按行业分类的股票投资组合

截至 2021 年 6 月 4 日，本基金按行业分类的股票投资组合如下：

1. 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	114,711,603.56	72.99
C	制造业	29,464,925.66	18.75
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	144,176,529.22	91.74

2. 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
----	------	---------	--------------

A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	890,939.37	0.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	33,007.80	0.02
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	12,775.84	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	336,943.32	0.21
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	32,959.30	0.02
M	科学研究和技术服务业	55,956.39	0.04
N	水利、环境和公共设施管理业	5,568.69	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,368,150.71	0.87

(三) 按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

1、截至 2021 年 6 月 4 日，本基金指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细如下：

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601225	陕西煤业	1,152,975.00	13,801,110.75	8.78
2	601088	中国神华	618,271.00	12,538,535.88	7.98
3	000723	美锦能源	1,280,931.00	9,709,456.98	6.18
4	000983	山西焦煤	1,286,638.00	9,508,254.82	6.05
5	601699	潞安环能	751,677.00	9,065,224.62	5.77

6	601898	中煤能源	1,149,773.00	8,496,822.47	5.41
7	600188	兖州煤业	557,807.00	8,088,201.50	5.15
8	601666	平煤股份	731,114.00	5,388,310.18	3.43
9	600985	淮北矿业	430,961.00	5,175,841.61	3.29
10	002128	露天煤业	482,869.00	5,142,554.85	3.27

2、截至 2021 年 6 月 4 日，本基金积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	688699	明微电子	1,869.00	336,943.32	0.21
2	688136	科兴制药	4,981.00	192,316.41	0.12
3	300932	三友联众	4,819.00	155,648.78	0.10
4	688656	浩欧博	1,371.00	111,599.40	0.07
5	688323	瑞华泰	4,513.00	93,509.36	0.06

(四) 按债券品种分类的债券投资组合

截至 2021 年 6 月 4 日，本基金未持有债券投资。

(五) 按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

截至 2021 年 6 月 4 日，本基金未持有债券投资。

(六) 按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资
 明细

截至 2021 年 6 月 4 日，本基金未持有资产支持证券。

(七) 按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名贵金属投资明细

截至 2021 年 6 月 4 日，本基金未持有贵金属投资。

(八) 按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

截至 2021 年 6 月 4 日，本基金未持有权证投资。

(九) 本基金投资的股指期货交易情况说明

截至 2021 年 6 月 4 日，本基金未持有股指期货。

(十) 本基金投资的国债期货交易情况说明

截至 2021 年 6 月 4 日，本基金未持有国债期货。

(十一) 投资组合报告附注

1、截至 2021 年 6 月 4 日，本基金投资的前十名证券除中国神华(601088),山西焦煤(000983)外其他证券的发行主体未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。忻州市应急管理局 2020 年 11 月 12 日发布对中国神华能源股份有限公司的处罚(忻地煤执罚[2020]86 号),山西煤矿安全监察局太原监察分局 2021 年 01 月 27 日发布对山西焦煤能源集团股份有限公司的处罚((2021)第 4 号)。前述发行主体受到的处罚未影响其正常业务运作，上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的规定。

2、截至 2021 年 6 月 4 日，基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

3、截至 2021 年 6 月 4 日，其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	交易保证金	396,769.96
2	应收证券清算款	7,084,499.26
3	应收股利	-
4	应收利息	38,584.76
5	应收申购款	1,258,685.55
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,778,539.53

4、持有的处于转股期的可转换债券明细

截至 2021 年 6 月 4 日，本基金未持有债券。

5、前十名股票中存在流通受限情况的说明

(1) 截至 2021 年 6 月 4 日,本基金投资的指数投资前十名股票中不存在流

通受限情况。

(2) 截至 2021 年 6 月 4 日,本基金积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	688699	明微电子	336,943.32	0.21	新股锁定
2	688136	科兴制药	192,316.41	0.12	新股锁定
3	300932	三友联众	155,648.78	0.10	新股锁定
4	688656	浩欧博	111,599.40	0.07	新股锁定
5	688323	瑞华泰	93,509.36	0.06	新股锁定

6、投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。

九、重大事件揭示

本基金自合同生效至上市交易期间未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

十、基金管理人承诺

本基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出承诺:

(一) 严格遵守《基金法》及其他法律法规、《基金合同》的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

(二) 真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件,披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息,并接受中国证监会、深圳证券交易所的监督管理。

(三) 在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后,将及时予以公开澄清。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺：

（一）严格遵守《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本基金《基金合同》、《托管协议》的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则托管基金资产。

（二）根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本基金《基金合同》、《托管协议》的规定，对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金份额净值计算进行监督和核查；如发现基金管理人违反《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本基金《基金合同》、《托管协议》的规定，将及时通知基金管理人纠正；基金管理人对本基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人将及时向中国证监会报告。

十二、基金上市推荐人意见

本基金无上市推荐人。

十三、备查文件目录

以下备查文件存放于基金管理人和基金托管人办公场所，投资者可在办公时间免费查阅，或通过指定的信息披露媒体、本基金管理人网站（www.zrfunds.com.cn）查阅，但应以基金合同正本为准。

- （一）中国证监会准予中融中证煤炭指数型证券投资基金募集注册的文件
- （二）《中融中证煤炭指数型证券投资基金基金合同》
- （三）《中融中证煤炭指数型证券投资基金托管协议》
- （四）《中融中证煤炭指数型证券投资基金招募说明书》
- （五）《中融中证煤炭指数分级证券投资基金基金合同》
- （六）《中融中证煤炭指数分级证券投资基金托管协议》
- （七）《中融中证煤炭指数分级证券投资基金招募说明书》
- （八）基金管理人业务资格批件、营业执照
- （九）基金托管人业务资格批件、营业执照
- （十）中国证监会要求的其他文件。

风险提示：基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。敬请投资者留意投资风险。

中融基金管理有限公司

2021年6月8日

附件：基金合同摘要**一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利义务****(一) 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：

1. 依法募集资金；
2. 自基金合同生效之日起，根据法律法规和基金合同独立运用并管理基金财产；
3. 依照基金合同收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
4. 销售基金份额；
5. 按照规定召集基金份额持有人大会；
6. 依据基金合同及有关法律规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了基金合同及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
7. 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
8. 选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
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手续并获得基金合同规定的费用；
10. 依据基金合同及有关法律规规定决定基金收益的分配方案；
11. 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理本基金份额申购与赎回申请；
12. 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
13. 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、融券；
14. 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
15. 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；
16. 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金申购、赎回、转换和非交易过户等业务规则；

17. 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

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

2. 办理基金备案手续；

3. 自基金合同生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；

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

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

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

7. 依法接受基金托管人的监督；

8. 采取适当合理的措施使计算基金份额申购、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；

9. 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

10. 编制季度报告、中期报告和年度报告；

11. 严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

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

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

14. 按规定受理基金份额申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

15. 依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或

配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

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

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

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

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

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

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

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

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

24. 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

25. 建立并保存基金份额持有人名册；

26. 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

（二）基金托管人的权利与义务

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：

1. 自基金合同生效之日起，依法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产；

2. 依基金合同约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用；

3. 监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人违反基金合

同及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

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

5. 提议召开或召集基金份额持有人大会；

6. 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

7. 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：

1. 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

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

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

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

5. 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

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

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

8. 复核、审查基金管理人计算的基金份额净值和申购、赎回价格；

9. 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

10. 对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

11. 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；

12. 建立并保存基金份额持有人名册；
13. 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
14. 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；
15. 依据《基金法》、基金合同及其他有关规定，召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
16. 按照法律法规和基金合同的规定监督基金管理人的投资运作；
17. 参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
18. 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；
19. 因违反基金合同导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
20. 按规定监督基金管理人按法律法规和基金合同规定履行自己的义务，基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿；
21. 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
22. 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

（三）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。

本基金每份基金份额具有同等的合法权益。

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的权利包括但不限于：

1. 分享基金财产收益；
2. 参与分配清算后的剩余基金财产；
3. 依法申请赎回其持有的基金份额、依法转让其持有的基金份额；
4. 按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会；
5. 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审

议事项行使表决权；

6. 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；

7. 监督基金管理人的投资运作；

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

9. 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。

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

1. 认真阅读并遵守基金合同、招募说明书等信息披露文件；

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

3. 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；

4. 缴纳基金认购、申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用；

5. 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；

6. 不从事任何有损基金及其他基金合同当事人合法权益的活动；

7. 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

8. 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；

9. 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

（一）基金份额持有人大会由基金份额持有人或其合法的代理人组成。基金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。

（二）召开事由

1. 当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

（1）终止基金合同；

（2）转换基金运作方式；

（3）变更基金类别；

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

- (5) 变更基金份额持有人大会程序；
- (6) 更换基金管理人、基金托管人；
- (7) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但法律法规要求提高该等报酬标准的除外；
- (8) 本基金与其他基金的合并；
- (9) 终止基金份额的运作；
- (10) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- (11) 终止基金份额上市，但因本基金不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的除外；
- (12) 单独或合计持有 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（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；
- (13) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；
- (14) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

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

- (1) 调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；
- (2) 在法律法规和本基金合同规定的范围内且在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，调整本基金的申购费率、调低赎回费率或收费方式；
- (3) 因相应的法律法规、深圳证券交易所或登记机构相关业务规则发生变动必须对基金合同进行修改；
- (4) 法律法规要求增加的基金费用的收取；
- (5) 对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生重大变化或基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；
- (6) 按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

（三）会议召集人和召集方式

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

2. 基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人

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

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

4. 单独或合计持有 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计持有 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会，但应当至少提前 30 日向中国证监会备案。

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

（四）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

- （1）会议召开的时间、地点和会议形式；
- （2）会议拟审议的主要事项、议事程序和表决方式；
- （3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
- （4）授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；
- （5）会务常设联系人姓名及联系电话；

(6) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续;

(7) 召集人需要通知的其他事项;

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

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

(五) 基金份额持有人出席会议的方式

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

1. 现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席, 现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会, 基金管理人或基金托管人不派代表列席的, 不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时, 可以进行基金份额持有人大会议程:

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

(2) 经核对, 汇总到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示, 全部有效凭证所对应的基金份额应占权益登记日基金总份额的二分之一以上(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在表决截至日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式进行表

决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

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

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

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

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

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

(六) 议事内容与程序

1. 议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如基金合同的重大修改、

决定终止基金合同、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及基金合同规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

2. 议事程序

(1) 现场开会

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

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

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

(2) 通讯方式开会

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

3. 基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

(七) 决议形成的条件、表决方式、程序

1. 基金份额持有人所持每一基金份额享有平等的表决权。
2. 基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议:

(1) 一般决议

一般决议须经出席会议的基金份额持有人(或其代理人)所持表决权的二分之一(含二分之一)以上通过方为有效,除下列(2)所规定的须以特别决议通

过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过；

（2）特别决议

特别决议须经出席会议的基金份额持有人（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必须以特别决议通过方为有效。

3. 基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

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

5. 基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

（八）计票

1. 现场开会

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

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

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

（4）计票过程应由公证机关予以公证，基金管理人或基金托管人拒不出席

大会的，不影响计票的效力。

2. 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监票人在监督人派出的授权代表的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证；如监督人经通知但拒绝到场监督，则大会召集人可自行授权 3 名监票人进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

（九）基金份额持有人大会决议报中国证监会备案后的公告时间、方式

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

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

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

（十）实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定

若本基金实施侧袋机制，则相关基金份额或表决权的比例指主袋份额持有人和侧袋份额持有人分别持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例，但若相关基金份额持有人大会召集和审议事项不涉及侧袋账户的，则仅指主袋份额持有人持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例：

1、基金份额持有人行使提议权、召集权、提名权所需单独或合计代表相关基金份额 10%以上（含 10%）；

2、现场开会的到会者在权益登记日代表的基金份额不少于本基金在权益登记日相关基金份额的二分之一（含二分之一）；

3、通讯开会的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相关基金份额的二分之一（含二分之一）；

4、在参与基金份额持有人大会投票的基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日相关基金份额的二分之一、召集人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）相关基金份额的持有人参与或授权他人参与基金份额持有人大会投票；

5、现场开会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；

6、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；

7、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。

同一主侧袋账户内的每份基金份额具有平等的表决权。

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

三、基金收益分配原则、执行方式

（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、在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可进行收益分配；

2、本基金场外收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，登记在登记结算系统基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，持有人可选择现金红利或将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；登记在证券登记系统基金份额持有人深圳证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

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

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，在 2 日内在指定媒介公告。

（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。

（七）实施侧袋机制期间的收益分配

本基金实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配，详见招募说明书的规定。

四、基金费用与税收

（一）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：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

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

2. 基金托管人的托管费

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

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

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

3. 基金合同生效后的标的指数许可使用费

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

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

$H = E \times \text{年费率} / \text{当年天数}$

H 为每日应计提的指数许可使用费

E 为前一日的基金资产净值

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

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

(三)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。

(四) 实施侧袋机制期间的基金费用

本基金实施侧袋机制的,与侧袋账户有关的费用可以从侧袋账户中列支,但应待侧袋账户资产变现后方可列支,有关费用可酌情收取或减免,但不得收取管理费,详见招募说明书的规定。

(五) 基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定,履行纳税义务。

五、基金财产的投资方向和投资限制

（一）投资目标

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

（二）投资范围

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

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

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

（三）组合限制

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%，但标的指数成份股投资不计入受此限；

（2）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的3%；

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

（4）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的10%；

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

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

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

(8) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

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

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

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

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

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

(14) 本基金参与股指期货投资后，需遵守下列比例限制；

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

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

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

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

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

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

(15) 本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

(16) 本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

(17) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

(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。

2. 禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

(1) 承销证券；

- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- (6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (7) 法律、行政法规和中国证监会禁止的其他活动；

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

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

六、基金资产净值公告、基金份额净值公告、基金份额参考净值公告

1. 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，通过其指定网站、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份额累计净值；

2. 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基金份额净值和份额累计净值。

七、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

（一）基金合同的变更

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

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

（二）本基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同应当终止：

1. 基金份额持有人大会决定终止的；
2. 基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在 6 个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务；
3. 基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在 6 个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务；
4. 出现标的指数不符合要求（因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求或法律法规、监管机构另有规定的情形除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人召集基金份额持有人大会对解决方案进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的；
5. 基金合同约定的其他情形；
6. 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。

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) 按基金份额持有人持有的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。

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。

6. 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

八、争议解决方式

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

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

本基金合同适用于中华人民共和国法律并从其解释。

九、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

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。