关于以通讯方式召开招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告

招商基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）已于2020年9月21日在《证券时报》和基金管理人网站（www.cmfchina.com）发布了《关于以通讯方式召开招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的公告》。为了使本次基金份额持有人大会顺利召开，现发布关于以通讯方式召开招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告。

一、会议基本情况

招商基金管理有限公司（以下称“基金管理人”）依据中国证监会证监许可【2015】667号文注册募集的招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金（以下称“本基金”）于2015年5月20日成立。本基金共有三类基金份额：招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金之基础份额（简称“招商中证煤炭份额”）、招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金之稳健收益类份额（简称“招商中证煤炭A份额”）与招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金之积极收益类份额（简称“招商中证煤炭B份额”）。

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》（以下简称“《运作办法》”）等法律法规的规定和《招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的约定，本基金管理人经与本基金的基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，提议召开本基金的基金份额持有人大会，审议《关于招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金转型的议案》。

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9月24日0:00起，至2020年10月22日17:00止（以表决票收件人收到表决票时间为准）。

3、通讯表决票将送达至本基金管理人，具体地址和联系方式如下：

收件人：招商基金管理有限公司基金份额持有人大会投票处

地址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦23层

邮政编码：518040

联系电话：400-887-9555

基金管理人有权根据实际需要增加或调整招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的投票方式并在规定媒介上公告。

二、会议审议事项

本次持有人大会审议的事项为《关于招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金转型的议案》（以下称“《议案》”），《议案》详见附件一。

三、权益登记日

本次大会的权益登记日为2020年9月24日，即在2020年9月24日在登记机构登记在册的本基金全体基金份额持有人（包括招商中证煤炭份额、招商中证煤炭A份额与招商中证煤炭B份额的基金份额持有人）均有权参加本次基金份额持有人大会。

四、纸质表决票的填写和寄交方式

1、本次会议表决票见附件四。基金份额持有人可通过剪报、复印或登录基金管理人网站（www.cmfchina.com）下载等方式获取表决票。

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或相关的业务专用章，并提供加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人证书、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机构公章（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、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加盖公章（如有）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）基金份额持有人可根据本公告“五、授权”的规定授权其他个人或机构代其在本次基金份额持有人大会上投票。代理人接受基金份额持有人纸面方式授权代理投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供授权委托书原件以及本公告“五、授权”中所规定的基金份额持有人以及代理人的身份证明文件或机构主体资格证明文件，但下述第（4）项另有规定的除外；

（4）基金份额持有人使用基金管理人邮寄的专用授权委托征集信函授权基金管理人、基金托管人或非直销销售机构投票的，接受有效委托的基金管理人、基金托管人或非直销销售机构应在表决票上加盖本单位公章，并提供加盖公章的企业法人营业执照复印件。

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于会议投票表决起止时间内（自2020年9月24日0:00起至2020年10月22日17:00止，以本基金管理人收到表决票的时间为准）通过专人送交或邮寄的方式送达至本基金管理人的办公地址（深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦23层），并请在信封表面注明：“招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

五、授权

1、纸面方式授权

（1）个人投资者授权他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供被代理的个人投资者身份证件复印件，以及填妥的授权委托书（见附件三）原件。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件复印件；如代理人为机构，还需提供代理人加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人证书、有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。

（2）如果个人投资者使用其收到的基金管理人邮寄的专用授权委托征集信函授权时，无需提供身份证明文件复印件，在专用回邮信函上填写个人姓名、身份证明文件号码和具体表决意见，并回寄给基金管理人，该专用回邮信函即视为有效授权，若委托人签署的专用回邮信函没有表示具体表决意见的，视为委托人授权基金管理人按照其意志行使表决权。

（3）机构投资者授权他人投票的，应由代理人在表决票上签字或加盖公

章，并提供被代理的机构投资者加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人证书、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（见附件三）原件。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件复印件；如代理人为机构，还需提供代理人加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人证书、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加盖公章，并提供该合格境外机构投资者加盖公章（如有）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和填妥的授权委托书（见附件三）原件。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件复印件；如代理人为机构，还需提供代理人加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人证书、有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。

2、网络授权（仅适用于个人投资者）

为方便基金份额持有人参与本次大会，基金管理人提供官方微信（微信号：招商基金）、官方APP（APP名称：招商基金）和官方网站(www.cmfchina.com)通道供个人投资者进行授权，由基金管理人根据授权人的表决意见代为行使表决权。

网络授权的起止时间自2020年9月24日0:00起至2020年10月21日15:00止（授权时间以系统记录时间为准）。通过网络进行授权的基金份额持有人，应正确填写姓名、证件号码等信息，以核实基金份额持有人的身份，确保基金份额持有人权益。

基金份额持有人通过上述网络授权的方式仅适用于个人投资者，对机构投资者暂不开通。

3、电话授权（仅适用于个人投资者）

为方便基金份额持有人参与本次大会，基金管理人可开设录音电话授权方式，基金管理人和部分销售机构可通过各自的客服代表与基金份额持有人取得联系，在通话过程中以回答提问方式核实基金份额持有人身份并由客服代表根

据客户意愿进行授权记录从而完成授权。为保护基金份额持有人利益，整个通话过程将被录音。

电话授权的起止时间自2020年9月24日0:00起至2020年10月21日15:00止（授权时间以系统记录的电话授权时间为准），敬请投资者注意。

基金份额持有人通过电话授权的方式仅适用于个人投资者，对机构投资者暂不开通。

4、授权效力的确定原则

（1）直接表决优先规则

如果基金份额持有人进行了授权委托，又存在直接投票表决，则以直接表决为有效表决，授权委托无效。

（2）最后授权优先规则

如果同一基金份额持有人在不同时间多次进行有效授权，无论表决意见是否相同，均以最后一次授权为准。如最后时间收到的授权委托有多次，不能确定最后一次授权的，按以下原则处理：若多次授权的表决意见一致的，按照该表决意见计票；若多次授权但授权意见不一致的，视为委托人授权受托人投弃权票。

六、计票

1、本次通讯会议的计票方式为：由基金管理人授权的2名监督员在基金托管人（中国银行股份有限公司）授权代表的监督下进行计票，并在所通知的表决截止日期后5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，并由公证机关对其计票过程予以公证。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。

2、招商中证煤炭份额、招商中证煤炭A份额与招商中证煤炭B份额的基金份额持有人所持每份基金份额在其对应份额类别内享有同等表决权。

3、表决票效力的认定规则如下：

（1）纸面表决票通过专人送交的，表决时间以实际递交时间为准；邮寄送达本公告规定的收件人的地址，表决时间以收件人收到时间为准。2020年10月22日17:00以后送达收件人的纸面表决票，均为无效表决。

（2）基金份额持有人重复寄送纸面表决票的，若各表决票之意思相同时，

则视为同一表决票；表决之意思相异时，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作出了不同表决意见，视为弃权表决，计入有效表决票。

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，邮寄的以本公告列明的收件人收到的时间为准。

（3）如表决票有下列情形之一者，该表决票无效，并且不视为该基金份额持有人已参与本次基金份额持有人大会表决，亦不计入参与本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数之内。

1）基金份额持有人未在纸面表决票上签字或未附个人或机构有效身份证明文件复印件的或提供的文件不符合本公告规定的。

2）通过委托代理人表决的，未同时提供代理人有效身份证明文件复印件的或提供的文件不符合本公告规定的。

3）纸面表决票上的签字或盖章部分填写不完整、不清晰的。

4）未能在截止时间之前送达指定地址或指定系统的。

（4）如纸面表决票有下列情形之一但其他要素符合会议公告规定者，该纸面表决意见视为弃权，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：

1）对同一议案表决超过一项意见或未表示意见的；

2）纸面表决票“表决意见”一栏有涂改的、模糊不清或相互矛盾的；

3）纸面表决票污染或破损，并且无法辨认其表决意见的。

七、决议生效条件

1、本人直接或委托授权代表出具有效表决意见的基金份额持有人所代表的招商中证煤炭份额、招商中证煤炭A份额与招商中证煤炭B份额不少于在权益登记日各自基金份额总数的1/2（含1/2）；

2、《议案》应当由提交有效表决意见的招商中证煤炭份额、招商中证煤炭A份额与招商中证煤炭B份额的各自基金份额持有人(或其代理人)所持表决权的2/3以上（含2/3）通过方为有效；

3、根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》相关规定，本基金份额持有人大会决议自持有人大会表决通过之日起生效，基金管理人依法将决议报中国证监会备案。

八、本次大会相关机构

1、召集人：招商基金管理有限公司

地址：深圳市福田区深南大道7088号

联系人：赖思斯

联系电话：（0755）83199596

邮政编码：518040

网址：www.cmfchina.com

2、公证机关：北京市中信公证处

地址：北京市西城区太平桥大街109号湘西大厦6层

联系人：甄真

联系电话：010-66216866

邮政编码：100032

3、见证律师：上海源泰律师事务所

注册及办公地址：上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦14楼

联系电话：（021）51150298

九、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的，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年底完成本基金的整改，取消分级运作机制，将招商中证煤炭A份额与招商中证煤炭B份额按照基金份额参考净值转换为招商中证煤炭份额。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邮寄表决票时，充分考虑邮寄在途时间，提前寄出表决票。

3、根据深圳证券交易所业务规则要求，本基金招商中证煤炭A份额与招商

中证煤炭B份额将于基金份额持有人大会计票之日（2020年10月23日）开市起至基金份额持有人大会决议生效公告日10:30止停牌（如基金份额持有人大会决议生效公告发布日为非交易日，则发布日后首个交易日开市起复牌）。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、上述基金份额持有人大会有关公告可通过招商基金管理有限公司网站(www.cmfchina.com)查阅，投资者如有任何疑问，可致电400-887-9555咨询。

附件一：《关于招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金转型的议案》

附件二：《关于招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金转型议案的说明》

附件三：授权委托书（样本）

附件四：招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决票

附件五：《招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金基金合同》与《招商中证煤炭等权指数证券投资基金（LOF）基金合同》简明对照表

招商基金管理有限公司

2020 年 9 月 23 日

附件一：

关于招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金转型的议案

招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金基金份额持有人：

根据市场环境变化，为更好地满足投资者需求，保护基金份额持有人的利益，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》的有关规定，本基金管理人经与基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，决定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。本基金管理人提议将招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金转型为招商中证煤炭等权指数证券投资基金（LOF），取消两级份额的分级机制，同时调整运作方式、修改投资范围、投资策略、收益分配方式、估值方法以及因法律法规变更及前述调整而需要修改的部分基金合同条款。

为实施本基金转型方案，提议授权基金管理人根据基金份额持有人大会决议对《基金合同》进行修改，并办理本次转型的相关具体事宜。

转型的具体方案和程序可参见《关于招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金转型议案的说明》。

以上提案，请予审议。

招商基金管理有限公司

2020 年 9 月 21 日

附件二：

关于招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金转型议案的说明

一、声明

综合市场需求分析，为维护基金份额持有人利益，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《招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金基金合同》有关规定，经基金管理人与基金托管人中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）协商一致，拟对招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金实施转型。

本次招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金转型方案需经参加持有人大会表决的招商中证煤炭份额、招商中证煤炭A份额和招商中证煤炭B份额的基金份额持有人(或其代理人)各自所持招商中证煤炭份额、招商中证煤炭A份额和招商中证煤炭B份额表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方为有效，存在无法获得持有人大会表决通过的可能。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》相关规定，本次基金份额持有人大会决议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。中国证监会对本次招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金变更注册所作的任何决定或意见，均不表明其对本次招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金或变更注册后基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

二、转型方案要点

（一）更名

基金名称由“招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金”变更为“招商中证煤炭等权指数证券投资基金（LOF）”（以下简称“新基金”）。

（二）取消分级运作机制

变更后新基金将终止分级运作，因而不再设置基金份额的分级、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）。

（三）终止招商中证煤炭 A 份额与招商中证煤炭 B 份额的上市交易

在本次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业务规则申请办理招商中证煤炭A份额和招商中证煤炭B份额的终止上市等相关业务。

（四）变更后基金的投资

1、投资目标

新基金进行被动式指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，实现对标的指数的有效跟踪，获得与标的指数收益相似的回报。新基金的投资目标是保持基金净值收益率与业绩基准日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%。

2、投资范围

新基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，以中证煤炭等权指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标，新基金也可投资于国内依法发行上市的其他股票（非标的指数成份股及其备选成份股，包括主板、中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券、可分离交易可转债、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、股指期货、国债期货，以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。

新基金投资的信用债券的债项评级或主体评级须在AA（含AA）以上，相关资信评级机构须取得中国证监会证券评级业务许可。

新基金可根据相关法律法规和基金合同的约定，参与融资业务和转融通证券出借业务。

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。

新基金投资于中证煤炭等权指数成份股和备选成份股的资产不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%；新基金每个交易日日终在扣除

股指期货、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，现金类资产不包括结算备付金、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，新基金的投资比例会做相应调整。

3、投资策略

（1）股票投资策略

新基金以中证煤炭等权指数为标的指数，采用完全复制法，按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，进行被动式指数化投资。股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合复制标的指数，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以复制和跟踪标的指数。新基金的投资目标是保持基金净值收益率与业绩基准日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。

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新基金跟踪标的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，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。

基金管理人将对成份股的流动性进行分析，如发现流动性欠佳的个股将可能采用合理方法寻求替代。基金管理人运用以下策略构造替代股组合：

①基本面替代：按照与被替代股票所属行业，基本面及规模相似的原则，选取一揽子标的指数成份股票作为替代股备选库；

②相关性检验：计算备选库中各股票与被替代股票日收益率的相关系数并选取与被替代股票相关性较高的股票组成模拟组合，以组合与被替代股票的日收益率序列的相关系数最大化为优化目标，求解组合中替代股票的权重，并构建替代股组合。

基金管理人每日跟踪基金组合与标的指数表现的偏离度，每月末、季度末定期分析基金的实际组合与标的指数表现的累计偏离度、跟踪误差变化情况及其原因，并优化跟踪偏离度管理方案。

（2）股指期货投资策略

基金管理人可运用股指期货，以提高投资效率更好地达到新基金的投资目标。新基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，参与股指期货的投资，以改善组合的风险收益特性。新基金主要通过对现货和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货定价模型寻求其合理估值水平，采用流动性好、交易活跃的期货合约，达到有效跟踪标的指数的目的。此外，新基金还将运用股指期货来对冲特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理，如预期大额申购赎回、大量分红等，以及对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险。

（3）债券投资策略

基金管理人将具体采用期限结构配置、市场转换、信用利差和相对价值判断、信用风险评估、现金管理等管理手段进行个券选择。新基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。

信用债的投资策略方面，一方面，新基金将从经济周期、国家政策、行业景气度和债券市场的供求状况等多个方面考量信用利差的整体变化趋势；另一方面，新基金还将以内部信用评级为主、外部信用评级为辅，即采用内外结合的信用研究和评级制度，研究债券发行主体企业的基本面，以确定企业主体债的实际信用状况。

（4）国债期货投资策略

新基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的进行国债期货投资，将构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效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管理利率波动风险，实现基金资产保值增值。

（5）资产支持证券投资策略

新基金将综合运用战略资产配置和战术资产配置进行资产支持证券的投资组合管理，投资资产支持证券将综合运用类别资产配置、久期管理、收益率曲线、个券选择和利差定价管理等策略，在严格遵守法律法规和基金合同基础上，进行资产支持证券产品的投资，在保证本金安全和基金资产流动性的基础上获得稳定收益。

（6）参与融资及转融通证券出借业务策略

为更好地实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下，新基金可根据投资管理的需要参与融资及转融通证券出借业务。参与融资业务时，新基金将力争利用融资的杠杆作用，降低因申购造成基金仓位较低带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。参与转融通证券出借业务时，新基金将在分析市场情况、投资者类型与结构、基金历史申赎情况、出借证券流动性情况等因素的基础上，合理确定出借证券的范围、期限和比例。若相关融资及转融通证券出借业务法律法规发生变化，新基金将从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。

4、投资限制

新基金的投资组合将遵循以下限制：

（1）新基金投资于中证煤炭等权指数成份股和备选成份股的资产不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；

（2）新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，债券回购到期后不展期；

（3）新基金参与股票发行申购，新基金所申报的金额不超过新基金的总资产，新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；

（4）新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%；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%；新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；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%；

（5）新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%；在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%；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；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%；

（6）在任何交易日日终，持有的买入国债期货和股指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；

（7）新基金每个交易日日终在扣除股指期货和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，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

（8）新基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

（9）新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％；

（10）新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％；

（11）新基金持有的同一（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％；

（12）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％；

（13）新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；

（14）新基金参与融资的，每个交易日日终，新基金持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；

（15）新基金参与转融通证券出借业务的，应当符合下列要求：①参与转融通证券出借业务的资产不得超过基金资产净值的 30%，其中出借期限在 10 个交易日以上的出借证券应纳入《流动性规定》所述流动性受限证券的范围；②参与转融通证券出借业务的单只证券不得超过基金持有该证券总量的 50%；③最近 6 个月内日均基金资产净值不得低于 2 亿元；④证券出借的平均剩余期限不得超过 30 天，平均剩余期限按照市值加权平均计算。

因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合本条上述规定的，基金管理人不得新增出借业务；

（16）新基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过新基金资产净值的 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前述所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

（17）新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）法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他比例限制。

除上述第（7）、（13）、（15）、（16）、（17）项外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制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。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。期间，新基金的投资范围、投资策略应当符合新基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自新基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或调整上述限制，如适用于新基金，基金管理人在履行适当程序后，则新基金投资不再受相关限制或按照调整后的规定执行。

5、标的指数

新基金股票资产的标的指数为中证煤炭等权指数。

如果指数编制单位变更或停止中证煤炭等权指数的编制、发布或授权，或中证煤炭等权指数由其他指数替代、或由于指数编制方法的重大变更等事项导致中证煤炭等权指数不宜继续作为标的指数，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出，基金管理人认为有必要作相应调整时，基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，在履行适当程序后变更新基金的标的指数、业绩比较基准和基金名称。其中，若变更标的指数涉及新基金投资范围或

投资策略的实质性变更，则基金管理人应就变更标的指数召开基金份额持有人大会，并报中国证监会备案且在规定媒介公告。若变更标的指数对基金投资范围和投资策略无实质性影响（包括但不限于指数编制单位变更、指数更名等事项），则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人应与基金托管人协商一致后，报中国证监会备案并及时公告。

6、业绩比较基准

新基金业绩比较基准：中证煤炭等权指数收益率×95％＋金融机构人民币活期存款基准利率（税后）×5%

由于新基金投资标的指数为中证煤炭等权指数，且每个交易日日终在扣除股指期货和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，因此，新基金将业绩比较基准定为中证煤炭等权指数收益率×95％＋金融机构人民币活期存款基准利率（税后）×5%。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于新基金的业绩比较基准，以及如果未来指数发布机构不再公布上述指数或更改指数名称时，新基金可以在与新基金托管人协商一致后变更业绩比较基准并及时公告。

7、风险收益特征

新基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金。新基金为被动式投资的股票型指数基金，主要采用完全复制策略跟踪标的指数的表现，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

（五）摆动定价机制

指当新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，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待。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。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。

（六）变更后基金的费用

1、管理费率

新基金的管理费按前一日基金资产净值的1.00%年费率计提。

2、托管费率

新基金的托管费按前一日基金资产净值的0.22%的年费率计提。

3、指数使用费

通常情况下，指数使用费按照前一日基金资产净值的0.02%的年费率进行计提，且收取下限为每季人民币5万元（即不足5万元部分按照5万元收取）。计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。

4、申购费率

申购费用由基金申购人承担，并应在投资者申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于新基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

（1）场外申购费率根据申购金额设定如下：

申购金额（M）	申购费率
M＜50万	1.0%
50万≤M＜100万	0.5%
M≥100万	每笔1000元

（2）场内申购费率由基金销售机构比照场外申购费率执行。

5、赎回费率

（1）场外赎回费率按基金份额持有人持有该部分基金份额的时间分段设定如下：

持有期限	赎回费率
N＜7日	1.5%
7日≤N＜1年	0.5%
1年≤N＜2年	0.25%
N≥2年	0%

（注：1年指365天，2年为730天，依此类推）

（2）场内赎回时，对持续持有期少于7日的投资者收取1.5%的赎回费；除此之外，新基金的场内赎回费率为固定0.5%。

赎回费用由基金赎回人承担，在投资者赎回基金份额时收取。对持续持有期少于 7 日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产，除此之外，扣除赎回手续费后的余额归基金财产，赎回费归入基金财产的部分不低于赎回费总额的 25%。

（七）变更后基金的收益分配原则

1、若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、新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的基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额可选择现金红利或将现金红利自动转为新基金基金份额进行再投资；若投资者不选择，新基金默认的收益分配方式是现金分红；

新基金场内收益分配方式仅为现金分红：登记在证券登记结算系统的场内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、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；

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不影响基金份额持有人利益的情况下，基金管理人可在法律法规允许的前提下酌情调整以上基金收益分配原则，此项调整不需要召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在规定媒介公告。

（八）变更后基金的终止条款

《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，基金管理人应当在 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。

法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。

（九）转型选择期的相关安排

本次持有人大会决议生效后，招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金将安排不少于20个工作日的赎回选择期（具体以基金管理人公告为准）。选择期期间，基金份额持有人可以选择卖出招商中证煤炭A份额、招商中证煤炭B份额或者赎回招商中证煤炭份额。对于在选择期内未作出选择的基金份额持有人，其持有的招商中证煤炭A份额、招商中证煤炭B份额和招商中证煤炭份额将最终转换为招商中证煤炭等权指数证券投资基金（LOF）基金份额。具体安排详见基金管理人届时发布的相关公告。

在选择期期间，基金份额持有人选择赎回的，仍适用招商中证煤炭等权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。

在选择期期间，招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金豁免基金合同中约定的投资组合比例限制等条款。具体安排详见基金管理人届时发布的相关公告。

（十）原基金份额转换的业务规则

1、份额转换基准日

转型选择期届满的次一工作日为份额转换基准日，也是招商中证煤炭A份额与招商中证煤炭B份额终止上市日。

2、份额转换方式

（1）招商中证煤炭A份额及招商中证煤炭B份额：

在份额转换基准日日终，以招商中证煤炭份额的基金份额净值为基准，招商中证煤炭A份额、招商中证煤炭B份额按照各自的基金份额参考净值转换成招商中证煤炭份额的场内份额，招商中证煤炭份额的场内份额再按照1:1的比例转换为招商中证煤炭等权指数证券投资基金（LOF）的场内份额。招商中证煤炭A份额（或招商中证煤炭B份额）基金份额持有人持有的转换后招商中证煤炭等权指数证券投资基金（LOF）的场内份额取整计算（最小单位为1份），余额计入基金财产。

份额转换计算公式：

招商中证煤炭A份额（或招商中证煤炭B份额）的转换比例＝份额转换基准日招商中证煤炭A份额（或招商中证煤炭B份额）的基金份额参考净值/份额转换基准日招商中证煤炭份额的基金份额净值

招商中证煤炭 A 份额（或招商中证煤炭 B 份额）基金份额持有人持有的转换后招商中证煤炭等权指数证券投资基金（LOF）的场内份额＝基金份额持有人持有的转换前招商中证煤炭 A 份额（或招商中证煤炭 B 份额）的份额数×招商中证煤炭 A 份额（或招商中证煤炭 B 份额）的转换比例

（2）招商中证煤炭份额：

原招商中证煤炭份额的场内份额、场外份额按照 1:1 的比例分别转换为招商中证煤炭等权指数证券投资基金（LOF）的场内份额、场外份额。

（十一）转型后的基金合同的生效

自基金份额转换完成后，《招商中证煤炭等权指数证券投资基金（LOF）基金合同》生效，原《招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金基金合同》同日起失效。

综上所述，基金管理人拟提请基金份额持有人大会授权基金管理人按照法律法规和监管机构要求及以上转型方案要点修订基金合同并实施转型方案。

三、基金转型的主要风险及预备措施

（一）转型方案被持有人大会否决的风险

在设计转型方案之前，基金管理人已对基金份额持有人进行了走访，认真听取了相关意见，拟定议案综合考虑了基金份额持有人的要求。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。

（二）基金转换的特别风险

1、招商中证煤炭A份额和招商中证煤炭B份额转换后风险收益特征发生较大变化的风险

份额转换完成后，招商中证煤炭A份额持有人原持有的招商中证煤炭A份额将变为招商中证煤炭等权指数证券投资基金（LOF）的场内份额，基金份额风险收益特征将因转换而发生较大变化。份额转换完成后，招商中证煤炭B份额持有人原持有的招商中证煤炭B份额将变为招商中证煤炭等权指数证券投资基金（LOF）的场内份额，基金份额风险收益特征将因转换而发生较大变化。

2、招商中证煤炭A份额和招商中证煤炭B份额的流动性风险

招商中证煤炭A份额和招商中证煤炭B份额转换为招商中证煤炭等权指数证券投资基金（LOF）的场内份额前，招商中证煤炭A份额和招商中证煤炭B份额的持有人有两种方式退出：1）在场内按市价卖出基金份额；2）在场内买入等量的对应份额（即招商中证煤炭A份额持有人买入等量的招商中证煤炭B份额，或者招商中证煤炭B份额持有人买入等量的招商中证煤炭A份额），合并为招商中证煤炭份额，按照招商中证煤炭份额的基金份额净值申请场内赎回或转托管至场外后申请赎回。

由于招商中证煤炭A份额和招商中证煤炭B份额的持有人可能选择场内卖出或合并赎回，场内份额数量可能发生较大下降，可能出现场内流动性不足的情况，特提请投资者注意流动性风险。

3、转换前存在溢价交易的招商中证煤炭A份额和招商中证煤炭B份额的持有人因溢价消失而造成损失的风险

基金份额转换基准日前，招商中证煤炭A份额和招商中证煤炭B份额仍可正常交易。期间，招商中证煤炭A份额和招商中证煤炭B份额可能存在折溢价交易情形，其折溢价率可能发生较大变化。

由于基金份额转换完成后，招商中证煤炭A份额和招商中证煤炭B份额均按各自的基金份额参考净值（而不是二级市场价格）转换为招商中证煤炭等权指数证券投资基金（LOF）的场内份额，如果投资者在转换前以溢价买入，转换后可能遭受较大损失。特提请参与二级市场交易的投资者注意折溢价所带来的风险。

投资者应密切关注招商中证煤炭A份额和招商中证煤炭B份额的基金份额参考净值变化情况，可通过本公司网站（www.cmfchina.com）等方式进行查询。

4、招商中证煤炭A份额和招商中证煤炭B份额的基金份额持有人持有的基金份额数量将会在转换后发生变化的风险

基金份额转换完成后，招商中证煤炭A份额和招商中证煤炭B份额均按各自的基金份额参考净值（而不是二级市场价格）转换为招商中证煤炭等权指数证券投资基金（LOF）的场内份额。因此招商中证煤炭A份额和招商中证煤炭B份额的基金份额持有人持有的基金份额数量将会在转换后发生变化。根据深圳证券交易所的相关业务规则，场内份额数将取整计算（最小单位为1份），舍去部分

计入基金资产，持有极小数量招商中证煤炭A份额、招商中证煤炭B份额的持有人，存在转换后份额因为不足1份而导致相应的资产被强制归入基金资产的风险。

5、招商中证煤炭A份额和招商中证煤炭B份额转换为招商中证煤炭等权指数证券投资基金（LOF）的场内份额后无法办理场内赎回的风险

招商中证煤炭A份额和招商中证煤炭B份额转换为招商中证煤炭等权指数证券投资基金（LOF）的场内份额后，投资者可以申请场内赎回基金份额或者转托管至场外后申请赎回基金份额。可以在二级市场办理基金买卖的证券公司并不全部具备中国证监会颁发的基金销售资格，而投资者只能通过具备基金销售资格的证券公司赎回基金份额。如果投资者通过不具备基金销售资格的证券公司在二级市场买入招商中证煤炭A份额和招商中证煤炭B份额，转换为招商中证煤炭等权指数证券投资基金（LOF）场内份额后可能无法办理场内赎回。对于无法办理场内赎回的投资者，需先转托管至场外后再申请赎回或者先转托管到具有基金销售资格的证券公司后再申请赎回。

6、在招商中证煤炭等权指数证券投资基金（LOF）开放赎回之前，投资者将无法办理基金赎回业务；在招商中证煤炭等权指数证券投资基金（LOF）上市交易之前，投资者将无法进行基金份额的上市交易，存在一定的流动性风险。

（三）基金转型后的运作风险

1、基金转型后运作过程中的相关运作风险，基金管理人将提前做好充分的内部沟通及外部沟通，避免基金转型后基金运作过程中出现相关操作风险和管理风险。

2、基金转型开放后遭遇大规模赎回的风险

为应对转型后遭遇大规模赎回，本基金在转型期间将保证投资组合的流动性，应对转型前后可能出现的较大赎回，降低净值波动率。

3、基金变更后风险等级变化的风险，由于基金变更后运作方式等发生较大变化，影响基金的风险收益特征，同时不同的销售机构采用的风险评价方法也不同，因此存在基金变更前后风险等级不一致的可能。提示投资者关注。

四、基金管理人联系方式

基金份额持有人若对本方案的内容有任何意见和建议，请通过以下方式联系基金管理人：

招商基金管理有限公司

电话：（0755）83199596

传真：（0755）83076974

招商基金网址：www.cmfchina.com

招商基金电子邮箱：cmf@cmfchina.com

招商基金管理有限公司

2020年9月21日

附件三：

授权委托书

兹全权委托先生／女士或机构代表本人（或本机构）参加以通讯开会方式召开的招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金基金份额持有人大会，并代为全权行使所有议案的表决权。表决意见以受托人（代理人）的表决意见为准。本授权不得转授权。

委托人（签字/盖章）：

委托人身份证件号或营业执照注册号或统一社会信用代码：

委托人基金账户号/证券账户号：

受托人（代理人）（签字/盖章）：

受托人（代理人）身份证件号或营业执照注册号或统一社会信用代码：

委托日期：年月日

附注：

1、以上授权是基金份额持有人就其基金账户号/证券账户号下持有的本基金全部份额向受托人（代理人）所做授权。

2、本授权委托书中“基金账户号”指持有招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金场外份额的基金账户号，“证券账户号”指持有招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金场内份额的证券账户号。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/证券账户号；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、此授权委托书可剪报、复印或按以上格式自制，在填写完整并签字盖章后均为有效。

附件四：

招商中证煤炭等权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">基金份额持有人姓名或名称：</td></tr>
<tr><td colspan="4">证件号码(身份证件号/营业执照号/统一社会信用代码)：</td></tr>
<tr><td colspan="4">基金账户号/证券账户号：</td></tr>
<tr><td>审议事项</td><td>同意</td><td>反对</td><td>弃权</td></tr>
<tr><td>关于招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金转型的议案</td><td></td><td></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td colspan="3">基金份额持有人（或受托人、代理人）签名或盖章：

年月日</td></tr>
<tr><td></td><td colspan="3">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。如持有人未在上述审议事项表决栏中进行特殊说明，则上述表决意见代表基金份额持有人持有的全部基金份额（招商中证煤炭份额、招商中证煤炭A份额、招商中证煤炭B份额）的表决意见。表决意见未选、多选、字迹无法辨认、意愿模糊不清、无法判断、相互矛盾或表决意见空白的表决票均视为投票人放弃表决权利，该持有人持有的全部基金份额的表</td></tr>
</table>

	决结果均计为“弃权”。签名或盖章部分填写不完整、不清晰的表决票计为无效表决票。表决票应附个人或机构有效身份证明文件复印件。 本表决票中“基金账户号”指持有招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金场外份额的基金账户号，“证券账户号”指持有招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金场内份额的证券账户号。同一基金份额持有人拥有多个此类账户号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/证券账户号，其他情况可不必填写。此处空白、多填、错填、无法识别等情况，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。 表决票效力认定的其他规则详见本次持有人大会公告。

附件五：《招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金基金合同》与《招商中证煤炭等权指数证券投资基金（LOF）基金合同》简明对照表

章节	原文条款 内容	修改后条款 内容	修改理由
基金名称	招商中证煤炭等权指数**分级**证券投资基金	招商中证煤炭等权指数证券投资基金**（LOF）**	根据本基金变更注册的实际情况调整，基金合同中关于基金名称的修改不再一一列举。
第一部分前言	三、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**基金募集**的注册审查以要件齐备和内容合规为基础，以充分的信息披露和投资者适当性为核心，以加强投资者利益保护和防范系统性风险为目标。……	三、**招商中证煤炭等权指数证券投资基金（LOF）（以下简称"本基金"）由招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金转型而来。招商中证煤炭等权指数分级**证券投资基金由基金管理人依照《基金法》、**《招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金**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**招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金变更为招商中证煤炭等权指数证券投资基金（LOF）**的注册审查以要件齐备和内容合规为基础，以充分的信息披露和投资者适当性为核心，以加强投资者利益保护和防范系统性风险为目标。……	根据本基金变更注册的实际情况调整。
第二部分释义	~~**7、基金份额发售公告：指《招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金基金份额发售公告》**~~	删除	删除变更注册后基金不适用的条款。
	~~**2**~~7、上市交易公告书：指《招商中证煤炭等权指数**分级**证券投资	7、上市交易公告书：指《招商中证煤炭等权指数证券投资基金	根据本基金变更注

	基金~~之招商中证煤炭 A 份额与招商中证煤炭 B 份额~~上市交易公告书》	（LOF）上市交易公告书》	册的实际情况调整。
	15、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会	15、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行保险监督管理委员会	根据实际情况更新。
	~~22、招商中证煤炭份额：指招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金之基础份额~~ ~~23、招商中证煤炭 A 份额：指招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金之稳健收益类份额~~ ~~24、招商中证煤炭 B 份额：指招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金之积极收益类份额~~ ~~25、基金份额分级：指本基金的基金份额包括招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金之基础份额、招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金之稳健收益类份额与招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金之积极收益类份额。其中，招商中证煤炭 A 份额、招商中证煤炭 B 份额的基金份额配比始终保持 1:1 的比率不变~~ ~~26、年基准收益率：指招商中证煤炭 A 份额约定年基准收益率为“同期银行人民币一年期定期存款利率（税后）+3%”，同期银行人民币一年期定期存款利率以最近一次定期份额折算基准日次日中国人民银行公布的金融机构人民币一年期存款基准利率为准。基金合同生效日所在年度的年基准收益率为“基金合同生效日中国人民银行公布的金融机构人民币一年期存款基准利率（税后）+3%”。每份招商中证煤炭 A 份额年基准收益均以 1.00 元为基准进行计算，但基金管理人并不承诺或保证招商中证煤炭 A 份额持有人的该等收益，如在某一会计年度内本基金资产出现极端损失情况下，招商中证煤炭 A 份额的基~~	删除	删除变更注册后基金不适用的条款。

	~~金份额持有人可能会面临无法取得约定应得收益的风险甚至损失本金的风险~~		
	2~~9~~、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、转托管及定期定额投资等业务	2**3**、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务	删除变更注册后基金不适用的表述。
	~~30~~、销售机构：指招商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~~代理~~协议，~~代为~~办理基金销售业务的机构	**24**、销售机构：指招商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**，以及可以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**	完善相关表述。
	~~31~~、登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、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	**25**、登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人**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、**基金交易的确认、**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	根据本基金变更注册的实际情况完善释义。
	~~33~~、基金账户：指~~登记机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户~~	**27**、**开放式**基金账户：指**投资者通过场外销售机构在中国证券登记结算有限责任公司注册的开放式基金账户。基金投资者办理场外申购和场外赎回等业务时需具有开放式基金账户**	根据本基金变更注册的实际情况调整。
	无	**28、深圳证券账户：指投资者在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开设的深圳证券交易所人民币普通股票账户或证券投资基金账户。基金投资者通过深圳证券交易所交易系统办理基金交易、场内申购和场内赎回等业务时需持有深圳证券账户**	根据本基金变更注册的实际情况补充释义。
	3~~5~~、~~注册~~登记系统：指中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统，通过场外销售机构~~认购、~~申购的基金份额登记	3**0**、登记**结算**系统：指中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统，通过场外销售机构申购的基金份额登记在登记	根据本基金变更注册的实际情况调

	在~~注册~~登记系统	**结算**系统	整。
	3~~6~~、证券登记结算系统：指中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记结算系统，通过场内会员单位~~认购、~~申购或买入的基金份额登记在证券登记结算系统	3**1**、证券登记结算系统：指中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记结算系统，通过场内会员单位申购或买入的基金份额登记在证券登记结算系统	删除变更注册后基金不适用的表述。
	~~5~~2、场外：指通过深圳证券交易所~~交易系统~~外的销售机构办理~~本基金~~基金份额~~的认购（场外认购的全部份额将确认为招商中证煤炭份额）、招商中证煤炭份额的~~申购和赎回的场所 ~~5~~3、场内：指通过深圳证券交易所~~内~~具有相应业务资格的会员单位利用~~深圳证券~~交易所交易系统办理~~本基金~~基金份额~~的认购（场内认购的全部份额将按 1:1 的比率确认为招商中证煤炭 A 份额与招商中证煤炭 B 份额）、招商中证煤炭 A 份额与招商中证煤炭 B 份额上市交易、招商中证煤炭份额的~~申购~~和~~赎回的场所	**3**2、场外：指通过深圳证券交易所外的销售机构办理基金份额申购和赎回的场所**。通过该等场所办理基金份额的申购、赎回也称为场外申购、场外赎回** **3**3、场内：指通过深圳证券交易所具有相应业务资格的会员单位利用交易所**开放式基金**交易系统办理基金份额申购**、**赎回**和上市交易等业务**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**	根据本基金变更注册的实际情况调整。
	~~37、场外份额：指登记在注册登记系统下的基金份额~~ ~~38、场内份额：指登记在证券登记结算系统下的基金份额~~ ~~39、系统内转托管：指基金份额持有人将其持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（交易单元）之间进行转托管的行为~~ ~~40、跨系统转托管：指基金份额持有人将其持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统之间进行转登记的行为~~ ~~41、份额配对转换：指根据基金合同的约定，本基金的招商中证煤炭份额与招商中证煤炭 A 份额、招商中证煤炭 B 份额之间的配对转换，包括分拆与合并两个方面~~ ~~42、分拆：指根据基金合同的约~~	删除	删除变更注册后基金不适用的条款。

	~~定，基金份额持有人将其持有的每两份招商中证煤炭份额的场内份额申请转换成一份招商中证煤炭 A 份额与一份招商中证煤炭 B 份额的行为~~ ~~43、合并：指根据基金合同的约定，基金份额持有人将其持有的每一份招商中证煤炭 A 份额与一份招商中证煤炭 B 份额进行配对申请转换成两份招商中证煤炭份额的场内份额的行为~~		
	~~4~~4、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~~	~~3~~4、基金合同生效日：指《招商中证煤炭等权指数证券投资基金（LOF）基金合同》生效日，原《招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金基金合同》自同一日起失效	根据本基金变更注册的实际情况调整。
	~~46、基金募集期：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过 3 个月~~	删除	删除变更注册后基金不适用的条款。
	无	40、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日 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	根据本基金变更注册的实际情况补充相关释义。
	~~51~~、《业务规则》：指~~本基金登记机构办理登记业务的相应规则~~	~~42~~、《业务规则》：指深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司、基金管理人、销售机构等的相关业务规则和实施细则	根据本基金变更注册的实际情况调整。
	~~54~~、上市交易：投资~~者~~通过~~场内~~会员单位以集中竞价的方式买卖~~招商中证煤炭 A 份额、招商中证煤炭 B~~ 份额的行为	~~43~~、上市交易：~~指~~投资~~人~~通过~~深圳证券交易所~~会员单位以集中竞价的方式买卖~~基金~~份额的行为	根据本基金变更注册的实际情况调整。
	~~55、发售：指在本基金募集期内，销售机构向投资者销售本基金份额的行为~~ ~~56、认购：指在基金募集期内，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为~~	删除	删除变更注册后基金不适用的条款。

	~~60~~、转托管：指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的操作	47、转托管：指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的操作，包括系统内转托管和跨系统转托管	根据本基金变更注册的实际情况完善释义。
	无	48、系统内转托管：指基金份额持有人将其持有的基金份额在登记结算系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（交易单元）之间进行转托管的行为 49、跨系统转托管：指基金份额持有人将其持有的基金份额在登记结算系统和证券登记结算系统之间进行转登记的行为	根据本基金变更注册的实际情况补充相关释义。
	~~62~~、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~~（包括招商中证煤炭份额、招商中证煤炭 A 份额、招商中证煤炭 B 份额）~~的 10%	51、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%	删除变更注册后基金不适用的表述。
	~~70、虚拟清算：指假定 T 日为本基金在存续期内的提前终止日，本基金按照基金合同约定的份额收益分配和资产分配规则进行资产分配从而计算得到 T 日本基金两级基金份额的估算价值~~ ~~71、基金份额参考净值：指在 T 日基金资产净值计算的基础上，采用“虚拟清算”原则计算得到 T 日本基金两级基金份额的估算价值。基金份额参考净值是对两类基金份额价值的一个估算，并不代表基金份额持有人可获得的实际价值~~	删除	删除变更注册后基金不适用的条款。
	~~73~~、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	60、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	根据法律法规修订的实际情况调整（《基金合同》中

		站）等媒介	关于“规定媒介”的同类修改不再一一列举）。
	无	**61、摆动定价机制：指当本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**	根据本基金变更注册的实际情况补充相关释义。
第三部分基金的基本情况	三、基金的运作方式 契约型~~、~~开放式 ~~五、基金的最低募集份额总额~~ ~~本基金的最低募集份额总额为 2 亿份。~~ ~~六、基金份额面值和认购费用~~ ~~本基金基金份额发售面值为人民币 1.00 元。~~ ~~本基金认购费率按招募说明书的规定执行。~~ ~~八、标的指数~~ ~~本基金的标的指数为中证煤炭等权指数。~~ ~~九、基金份额自动分离与分拆~~ ~~基金发售结束后，投资者场内认购的全部招商中证煤炭份额将按 1：1 的比例自动分离成预期收益与风险不同的两个份额类别，即稳健收益类的招商中证煤炭 A 份额和积极收益类的招商中证煤炭 B 份额，两类基金份额的基金资产合并运作。投资者可在场内申购招商中证煤炭份额，并可选择将其申购的招商中证煤炭份额按 1：1 的比例分拆为招商中证煤炭 A 份额和招商中证煤炭 B 份额。~~ ~~投资者在场外认购和申购的招商中证煤炭份额不进行分拆，其通过跨系统转托管至场内后，可选择将其持有的招商中证煤炭份额~~	三、基金的运作方式 上市契约型开放式（LOF） 四、上市交易所 深圳证券交易所 五、标的指数 中证煤炭等权指数	根据本基金变更注册的实际情况调整。

	~~按 1：1 的比例分拆为招商中证煤炭 A 份额和招商中证煤炭 B 份额。~~ ~~十、基金份额的上市交易~~ ~~本基金基金合同生效后，场内的招商中证煤炭 A 份额和招商中证煤炭 B 份额将同时申请在深圳证券交易所上市交易。~~		
	无	八、基金份额的类别 在不违反法律法规、基金合同的约定以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，根据基金实际运作情况，在履行适当程序后，基金管理人可增加新的基金份额类别、调低某类基金份额类别的费率水平等，调整实施前基金管理人需及时公告并报中国证监会备案，但无需召开基金份额持有人大会。 九、未来条件许可情况下的基金模式转型 若将来本基金管理人推出跟踪同一标的指数的交易型开放式指数基金（ETF），则基金管理人可以在履行适当程序后使本基金采取 ETF 联接基金模式运作并相应修改《基金合同》，届时无需召开基金份额持有人大会，但需报中国证监会备案并提前公告。ETF 联接基金是指其绝大部分基金资产投资于跟踪同一标的指数的交易型开放式指数基金（ETF），以紧密跟踪标的指数为目的的指数化产品。法律法规另有规定的从其规定。	1、补充基金份额类别设置的原则性规定； 2、补充基金模式转型的原则性规定。
（原基金合同第四部分基金份额的分类与	~~第四部分基金份额的分类与净值计算规则~~ ~~一、基金份额结构~~ ~~本基金的基金份额包括招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金之基础份额（简称“招商中证煤炭份额”）、招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金之稳健收益类份额（简称“招商中证煤炭 A~~	删除	删除变更注册后基金不适用的条款。

净值计算规则）	~~份额”）与招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金之积极收益类份额（简称“招商中证煤炭 B 份额”）。其中，招商中证煤炭 A 份额、招商中证煤炭 B 份额的基金份额配比始终保持 1:1 的比率不变。~~ ……		
第四部分基金的历史沿革	第五部分基金份额的发售 ~~一、基金份额的发售时间、发售方式、发售对象~~ ~~1、发售时间~~ ~~自基金份额发售之日起最长不得超过三个月，具体发售时间见基金份额发售公告。~~ ~~2、发售方式~~ ~~本基金通过场外、场内两种方式公开发售。场外将通过基金管理人的直销中心及基金场外代销机构的代销网点发售（具体名单详见发售公告）。场内将通过深圳证券交易所内具有基金代销业务资格的会员单位发售（具体名单详见基金份额发售公告或相关业务公告）。本基金募集期结束前获得基金代销业务资格的会员单位也可代理场内基金份额的发售。基金发售结束后，投资者场外认购所得的全部份额将确认为招商中证煤炭份额；投资者场内认购所得的全部份额将按 1:1 的比率确认为招商中证煤炭 A 份额与招商中证煤炭 B 份额。~~ ~~通过场内认购的基金份额登记在证券登记结算系统投资者的证券账户下。通过场外认购的基金份额登记在注册登记系统投资者的开放式基金账户下。其中，证券账户是指投资者在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开立的深圳证券交易所人民币普通股票账户或者证券投资基金账户。~~ ~~本基金认购采取全额缴款认购的~~	第四部分基金的历史沿革 招商中证煤炭等权指数证券投资基金（LOF）由招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金变更注册而来。 招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金于 2015 年 4 月 20 日经中国证监会《关于准予招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金注册的批复》（中国证监会证监许可[2015]667 号文）注册募集。基金管理人为招商基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。 招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金于 2015 年 5 月 4 日至 2015 年 5 月 15 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，《招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金基金合同》于 2015 年 5 月 20 日生效。 招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金经中国证监会证监许可[2020]854 号文准予变更注册。 根据《招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金基金合同》的约定，招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，并于 2020 年 XX 月 XX 日决议通过《XXXX 的议案》，基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。自 2020 年 XX 月 XX 日起，《招商中证煤炭等权指数证券投资基金（LOF）基金合同》生效，《招商	根据本基金变更注册的实际情况调整。

	~~方式。基金投资者在募集期内可多次认购，认购一经受理不得撤销。本基金的具体发售方式和发售机构见发售公告。~~ ~~基金发售机构认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表发售机构确实接收到认购申请。认购的确认以登记机构或基金管理公司的确认结果为准。~~ ~~3、发售对象~~ ~~符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、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人。~~ ~~二、基金份额的认购~~ ~~1、认购费用~~ ~~本基金的认购费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。基金认购费用不列入基金财产。~~ ~~2、募集期利息的处理方式~~ ~~有效认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有，其中利息转份额以登记机构的记录为准。~~ ~~3、基金认购份额的计算~~ ~~基金认购份额具体的计算方法在招募说明书中列示。~~ ~~4、认购份额余额的处理方式~~ ~~场外认购份额的计算保留到小数点后2位，小数点2位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。场内认购份额按整数申报。~~ ~~三、基金份额认购金额的限制~~ ~~1、投资人认购时，需按销售机构规定的方式全额缴款。~~ ~~2、基金管理人可以对每个基金交易账户的单笔最低认购金额进行限制，具体限制请参看招募说明书或相关公告。~~ ~~3、基金管理人可以对募集期间的单个投资人的累计认购金额进行限制，具体限制和处理方法请~~	中证煤炭等权指数分级证券投资基金基金合同》同日起失效。	

	~~参看招募说明书或相关公告。~~ ~~4、投资人在基金募集期内可以多次认购基金份额。认购申请一经受理不得撤销。~~		
第五部分基金的存续	~~第六部分基金备案~~ ~~一、基金备案的条件~~ ~~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 亿元人民币且基金认购人数不少于 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可以决定停止基金发售，并在 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，向中国证监会办理基金备案手续。~~ ~~基金募集达到基金备案条件的，自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起，《基金合同》生效；否则《基金合同》不生效。基金管理人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。基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。~~ ~~二、基金合同不能生效时募集资金的处理方式~~ ~~如果募集期限届满，未满足募集生效条件，基金管理人应当承担下列责任：~~ ~~1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；~~ ~~2、在基金募集期限届满后 30 日内返还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息；~~ ~~3、如基金募集失败，基金管理人及销售机构不得请求报酬。基金管理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~~	<u>第五部分基金的存续</u> 《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<u>在 10 个工作日内</u>向中国证监会报告并提出解决方案，如<u>持续运作、</u>转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并<u>在 6 个月内召集</u>基金份额持有人大会。 法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。	根据本基金变更注册的实际情况调整。

	~~有人数量和资产规模~~ 《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~~。 法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。		
第六部分基金份额的上市交易	~~第八部分招商中证煤炭 A 份额与招商中证煤炭 B~~ 份额的上市交易 ~~本基金《~~基金合同~~》~~生效后，基金管理人~~将~~根据有关规定，申请~~招商中证煤炭 A 份额、招商中证煤炭 B~~ 份额上市交易。 二、上市交易的时间 ~~本基金《基金合同》生效后六个月内开始在深圳证券交易所上市交易。在确定上市交易时间后，基金管理人最迟在上市前 3 个工作日在至少一家指定媒介和基金管理人网站上公告~~。 三、上市交易的规则 1、招商中证煤炭 A 份额、招商中证煤炭 B 份额分别采用不同的交易代码上市交易； 2、招商中证煤炭 A 份额、招商中证煤炭 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、招商中证煤炭 A 份额、招商中证煤炭 B 份额实行价格涨跌幅限制，涨跌幅比例为 10%，自上市首日起实行； 4、招商中证煤炭 A 份额、招商中证煤炭 B 份额买入申报数量为 100 份或其整数倍； 5、招商中证煤炭 A 份额、招商	第六部分基金份额的上市交易 一、上市交易的基金份额 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，基金管理人可以根据有关规定，申请本基金的基金份额上市交易。 基金份额申请上市交易后，登记在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记结算系统中的基金份额可直接在深圳证券交易所上市交易；登记在中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统中的基金份额通过办理跨系统转托管业务将基金份额转至场内证券登记结算系统后，方可上市交易。 三、上市交易的时间 本基金合同生效后，基金管理人可以根据有关规定，在符合基金上市交易条件下，申请本基金在深圳证券交易所上市交易。 在确定上市交易的时间后，基金管理人应依据法律法规规定在规定媒介上刊登基金份额上市交易公告书。 四、上市交易的规则 本基金基金份额在深圳证券交易所的上市交易遵循《深圳证券交	根据本基金变更注册的实际情况调整。

	中证煤炭 B 份额申报价格最小变动单位为 0.001 元人民币； ~~6、招商中证煤炭 A 份额、招商中证煤炭 B 份额~~上市交易遵循《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》、《深圳证券交易所交易规则》及~~相关~~规定。 ~~四~~、上市交易的费用 ~~招商中证煤炭 A 份额、招商中证煤炭 B~~ 份额上市交易的费用按照深圳证券交易所相关规则及有关规定执行。 ~~五~~、上市交易的行情揭示 ~~招商中证煤炭 A 份额、招商中证煤炭 B 份额~~在深圳交易所挂牌交易，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的基金份额~~参考~~净值。 ~~六~~、上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市 ~~招商中证煤炭 A 份额、招商中证煤炭 B 份额~~的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市按照相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所的相关规定执行。	易所证券投资基金上市规则》、《深圳证券交易所交易规则》及其他有关规定。 五、上市交易的费用 本基金基金份额上市交易的费用按照深圳证券交易所相关规则及有关规定执行。 六、上市交易的行情揭示 本基金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 本基金的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市按照相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所的相关规定执行。 当本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“招商中证煤炭等权指数证券投资基金”，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。	
第七部分基金份额的申购与赎回	~~本基金不接受投资者单独申购或赎回招商中证煤炭 A 份额或招商中证煤炭 B 份额。~~ ~~本基金基金合同生效后，投资者可通过场外或场内两种方式对招商中证煤炭份额进行申购与赎回。~~	删除	删除变更注册后基金不适用的条款。
	一、申购和赎回场所 ~~招商中证煤炭份额场外申购与赎回的场所包括基金管理人和基金管理人委托的代销机构，投资者可使用基金账户，通过基金管理人、场外代销机构办理场外申~~	一、申购和赎回场所 本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。本基金场外申购和赎回场所为基金管理人的直销柜台、网上直销系统及各场外销售机构的基金销售网点，场内申购	根据本基金变更注册的实际情况调整。

	~~购、赎回业务；招商中证煤炭份额场内申购与赎回的场所为具有基金代销业务资格且符合深圳证券交易所风险控制要求的深圳证券交易所会员单位，投资者使用深圳证券账户，通过深圳证券交易所交易系统办理场内申购、赎回业务。~~ 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~~招商中证煤炭~~份额的申购与赎回。~~基金管理人可根据情况变更或增减基金代销机构，并在基金管理人网站公示。~~	和赎回场所为深圳证券交易所内具有相应业务资格的会员单位，具体的销售机构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销售机构。 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。	
	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~~招商中证煤炭~~份额的申购和赎回，具体办理时间为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。 基金合同生效后，若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在~~指定~~媒介上公告。	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本基金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。 基金合同生效后，若出现新的证券/期货交易市场、证券/期货交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。	根据本基金变更注册的实际情况调整完善相关表述。
	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 3 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。 …… 基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理~~招商中证煤炭~~份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外	2、申购、赎回开始日及业务办理时间 基金管理人可根据实际情况依法决定本基金开始办理申购的具体日期，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。 …… 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本基金基金份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外	根据本基金变更注册的实际情况调整完善相关表述。

	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**收**的，其基金份额申购、赎回或转换价格为下一开放日**招商中证煤炭**份额申购、赎回或转换的价格。	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、赎回或转换价格为下一开放日**基金**份额申购、赎回或转换的价格。	
	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**招商中证煤炭**份额净值为基准进行计算； 3、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； **4**、投资人通过深圳证券交易所交易系统办理**招商中证煤炭**份额的场内申购、赎回业务时，需遵守深圳证券交易所的相关业务规则。……	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**受理**当日收市后计算的**基金**份额净值为基准进行计算； 3、当日的**场外**申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销； **4、场外赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人持有基金份额登记日期的先后次序进行顺序赎回；** **5**、投资人通过深圳证券交易所交易系统办理**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。……	根据本基金变更注册的实际情况调整。
	四、申购与赎回的程序 1、申购和赎回的申请方式 …… ~~投资者在申购招商中证煤炭份额时须按销售机构规定的方式备足申购资金，投资者在提交赎回申请时，必须有足够的招商中证煤炭份额余额，否则所提交的申购、赎回的申请无效而不予成交。~~ ~~投资者办理申购、赎回等业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守基金合同和招募说明书规定的前提下，以各销售机构的具体规定为准。~~	四、申购与赎回的程序 1、申购和赎回的申请方式 …… 删除	删除变更注册后基金不适用的条款。
	2、申购和赎回的款项支付 投资人申购**招商中证煤炭**份额时，必须在规定时间内全额交付申购款项，投资人交付申购款项，申购成立；基金份额登记机	2、申购和赎回的款项支付 投资人申购**基金**份额时，必须在规定时间内全额交付申购款项，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	根据本基金变更注册的实际情况调整完善相关

	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时，赎回成立；登记机构确认赎回时，赎回生效。投资人赎回申请~~成功~~后，基金管理人将~~通过基金登记机构及其相关基金销售机构~~在 T＋7 日~~(~~包括该日~~)内将~~赎回款项~~划往基金份额持有人账户~~。 在发生巨额赎回或本《基金合同》载明的其他暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。 遇交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其它非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程，则赎回款顺延至下一个工作日~~划往基金份额持有人的银行账户~~。	份额时，申购生效。 基金份额持有人递交赎回申请时，赎回成立；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。在发生巨额赎回或本《基金合同》载明的其他暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。 遇**证券/期货**交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其它非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程，则赎回款顺延至下一个工作日**划出**。	表述。
	无	**4、如未来法律法规或监管机构对上述内容另有规定，从其规定。基金管理人可在不违反法律法规且在不对基金份额持有人利益造成损害的前提下，对上述业务的办理时间、方式等规则进行调整。基金管理人应在新规则开始实施前按照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。**	补充相关内容调整的原则性规定。
	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。	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，**也可以对基金的总规模进行限制，**具体规定请参见招募说明书或相关公告。 **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。**	根据本基金变更注册的实际情况完善相关表述。
	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 1、~~招商中证煤炭份额~~份额净值	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 1、**本基金基金**份额净值的计算，	1、根据本基金变更注册的

	的计算，保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 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，并按照基金合同的约定进行公告。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、申购份额的计算及余额的处理方式：~~招商中证煤炭份额~~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，并在招募说明书中列示。申购的有效份额为净申购金额除以当日的~~招商中证煤炭份额~~份额净值，有效份额单位为份。…… 3、赎回金额的计算及处理方式：~~招商中证煤炭份额~~赎回金额的计算详见《招募说明书》~~，赎回金额单位为元。招商中证煤炭份额~~的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。…… 6、~~招商中证煤炭份额~~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。…… ~~7~~、……在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行相关手续后基金管理人可以适当调低~~招商中证煤炭份额~~的申购费率和基金赎回费率。	保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 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，并按照基金合同的约定进行公告。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。…… 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，并在招募说明书中列示。…… 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。…… **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**、……在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行相关手续后基金管理人可以适当调低**本基金**的申购费率和基金赎回费率。 **9、办理基金份额的场内申购、赎回业务应遵守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**	实际情况调整完善相关表述； 2、根据本基金变更注册的实际情况补充摆动定价的相关规定； 3、补充办理场内申购、赎回业务的原则性规定。

		有新的规定，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。	
	~~七、申购和赎回的注册登记~~ ~~招商中证煤炭份额的份额采用分系统登记的原则。场外申购的招商中证煤炭份额登记在注册登记系统持有人开放式基金账户下；场内申购的招商中证煤炭份额登记在证券登记结算系统持有人证券账户下。~~ ~~招商中证煤炭份额申购与赎回的注册登记业务，按照中国证券登记结算有限责任公司的有关规定办理。通常情况下，投资者申购基金成功后，基金登记机构在 T+1 日为投资者登记权益并办理注册登记手续，投资者自 T+2 日（含该日）后有权赎回或转换转出该部分基金份额。~~ ~~投资者赎回基金成功后，基金登记机构在 T+1 日为投资者办理扣除权益的注册登记手续。~~ ~~中国证券登记结算有限责任公司可以在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，但不得实质影响投资者的合法权益，基金管理人最迟于开始实施调整前 3 个工作日在指定媒介上公告。~~	删除	删除变更注册后基金不适用的条款。
	~~八~~、拒绝或暂停申购的情形 3、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。 …… 发生上述第 1、2、3、5、7、8 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停**或拒绝**接受基金投资者的申购申请时，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拒绝，被拒绝的申购~~本金款项~~将退还给投资人。在暂	七、拒绝或暂停申购的情形 3、证券**/期货**交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。 …… 发生上述第 1、2、3、5、7、8 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受基金投资者的申购申请时，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拒绝，被拒绝的申购**款项本金**将退还给投资人。在暂停申购的	根据本基金变更注册的实际情况补充、调整拒绝或暂停申购的情形，并完善相关表述。

	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。	情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。	
	~~九~~、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 3、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。 …… 发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受基金投资者的赎回申请时，基金管理人应按规定报中国证监会备案，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，~~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。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销~~。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。	**八**、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 3、证券**/期货**交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。 …… 发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受基金投资者的赎回申请时，基金管理人应按规定报中国证监会备案，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**，未支付部分可延期支付。**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业务规则办理**。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。	根据本基金变更注册的实际情况补充、调整暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形，并完善相关表述。
	~~十~~、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~~（包括招商中证煤炭份额、招商中证煤炭A份额、招商中证煤炭B份额）~~的10%时，即认为是发生了巨额赎回。 2、巨额赎回的处理方式 当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回**或**部分延期赎回。 （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	**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%时，即认为是发生了巨额赎回。 2、巨额赎回的**场外**处理方式 当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回**、**部分延期赎回**或暂停赎回**。 （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，	根据本基金变更注册的实际情况调整，并完善相关表述。

	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。~~若进行上述延期办理，对于单个基金份额持有人当日赎回申请超过上一开放日基金总份额 10%以上的部分，将自动进行延期办理。对于其余当日非自动延期办理的赎回申请，应当按单个账户非自动延期办理的赎回申请量占非自动延期办理的赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额。投资者未能赎回部分，除投资者在提交赎回申请时选择将当日未获办理部分予以撤销外，延迟至下一个开放日办理，赎回价格为下一个开放日的价格。依照上述规定转入下一个开放日的赎回不享有赎回优先权，并以此类推，直到全部赎回为止。部分顺延赎回不受单笔赎回最低份额的限制。~~ **3**、巨额赎回的公告 当发生上述**延期**赎回并延期办理时，基金管理人应当在 3 个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，并在 2 日内在**指定**媒介上刊登公告。	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。** **（3）当本基金出现巨额赎回时且基金管理人决定部分延期赎回的，在单个基金份额持有人赎回申请超过前一日基金总份额 10%的情形下，基金管理人认为支付该基金份额持有人的全部赎回申请有困难或者因支付该基金份额持有人的全部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，可以对该基金份额持有人的赎回申请超过前一日基金总份额 10%的部分进行延期办理。对于其余当日未延期办理的赎回申请，应当按单个账户未延期办理的赎回申请量占未延期办理的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。部分延期赎回不受单笔赎回最低份额的限制。 **3**、巨额赎回的场内处理方式 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。 **4**、巨额赎回的公告 当发生上述巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，并在 2 日内在规定媒介上刊登公告。	
	十~~二~~、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告 ~~**2、如发生暂停的时间为 1 日，基金管理人应于重新开放日，在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近 1 个开放日的基金份额净值。**~~ ~~**如果发生暂停的时间超过 1 天但少于 2 周，暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 2 日在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开始办理申购或赎回的开放日公告最近一个工作日的基金份额净值。**~~ ~~**如果发生暂停的时间超过 2 周，暂停期间，基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次。暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 2 日在指定媒介上连续刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开**~~	十、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告 **2、暂停申购或赎回结束、基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应依照《信息披露办法》的有关规定，在规定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告；也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间，届时不再另行发布重新开放的公告。**	根据本基金变更注册的实际情况调整暂停申赎时的信息披露规则。

	~~放申购或赎回日公告最近一个工作日的基金份额净值。~~		
	十~~五~~、基金的冻结、解冻及质押…… 如相关法律法规允许基金管理人办理基金份额的质押业务或其他基金业务，基金管理人将制定和实施相应的业务规则。	十**四**、基金的冻结、解冻及质押…… 如相关法律法规允许基金管理人办理基金份额的质押业务或其他基金业务，基金管理人将制定和实施相应的业务规则。**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，从其规定办理。**	完善相关表述。
（原基金合同第九部分基金份额的登记、系统内转托管和跨系统转托管等其他相关业务）	~~第九部分基金份额的登记、系统内转托管和跨系统转托管等其他相关业务~~ ~~一、基金份额的登记~~ ~~1、本基金的基金份额采用分系统登记的原则。场外认购或申购的招商中证煤炭份额登记在注册登记系统基金份额持有人开放式基金账户下；场内认购或申购的招商中证煤炭份额、或上市交易的招商中证煤炭 A 份额、招商中证煤炭 B 份额登记在证券登记结算系统基金份额持有人证券账户下。~~ ~~2、登记在证券登记结算系统中的招商中证煤炭份额可以申请场内赎回；登记在注册登记系统中的招商中证煤炭份额可申请场外赎回。~~ ~~3、登记在证券登记结算系统中的招商中证煤炭 A 份额、招商中证煤炭 B 份额只能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 1:1 的比例申请合并为招商中证煤炭份额后再申请场内赎回。~~	删除	删除变更注册后基金不适用的条款。
	~~三~~、系统内转托管 ~~1、~~系统内转托管是指基金份额持有人将持有的基金份额在~~注册~~登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（交易单元）之间进行转托管的行为。	**十六、基金的转托管** **1**、系统内转托管 系统内转托管是指基金份额持有人将**其**持有的基金份额在登记**结算**系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（交易单元）之间进行	根据本基金变更注册的实际情况调整，并完善相关表述。

	~~2、基金份额登记在注册登记系统的基金份额持有人在变更办理招商中证煤炭份额赎回业务的销售机构（网点）时，须办理已持有招商中证煤炭份额的系统内转托管。~~ ~~3、基金份额登记在证券登记结算系统的基金份额持有人在变更办理招商中证煤炭 A 份额、招商中证煤炭 B 份额上市交易或招商中证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、~~基金销售机构可以按照规定~~的标准~~收取转托管费。 ~~三~~、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~~招商中证煤炭~~份额在~~注册~~登记系统和证券登记结算系统之间进行转~~托管~~的行为。 ~~2、招商中证煤炭~~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。 ~~3、~~基金销售机构可以按照规定~~的标准~~收取转托管费。	转托管的行为。 本基金基金份额的系统内转托管按照中国证券登记结算有限责任公司的相关规定办理。基金销售机构可以按照相关规定，向基金份额持有人收取转托管费。 2、跨系统转托管 跨系统转托管是指基金份额持有人将其持有的基金份额在登记结算系统和证券登记结算系统之间进行转登记的行为。 本基金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。基金销售机构可以按照相关规定，向基金份额持有人收取转托管费。	
（原基金合同第十部分基金的份额配对转换）	~~第十部分基金的份额配对转换~~ ~~本基金《基金合同》生效后，基金管理人将为基金份额持有人办理份额配对转换业务。~~ ~~一、份额配对转换是指本基金的招商中证煤炭份额与招商中证煤炭 A 份额、招商中证煤炭 B 份额之间的配对转换，包括分拆和合并两个方面。~~ ~~1、分拆。基金份额持有人将其持有的每两份招商中证煤炭份额的场内份额申请转换成一份招商中证煤炭 A 份额与一份招商中证煤炭 B 份额的行为。~~ ~~2、合并。基金份额持有人将其持有的每一份招商中证煤炭 A 份额与一份招商中证煤炭 B 份额进行配对申请转换成两份招商中证~~	删除	删除变更注册后基金不适用的条款。

	~~煤炭份额的场内份额的行为。~~ ……		
第八部分基金合同当事人及权利义务	一、基金管理人 （二） 基金管理人的权利与义务 1、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： （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~~、~~转融通； （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、转换和非交易过户的业务规则； 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于： （1）依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的~~发售、~~申购、赎回和登记事宜； （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，确定基金份额申购、赎回的价格； （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； （14）按规定受理~~招商中证煤炭份额的~~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~~	一、基金管理人 （二） 基金管理人的权利与义务 1、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： （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**及**转融通**证券出借业务**； （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**的业务规则； 2、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； （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； （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**，向审计、法律等外部专业顾问提供的除外**； （14）按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；	根据相关法律法规及实际情况，补充、完善基金管理人的相关权利和义务。

	~~基金认购人；~~		
	二、基金托管人 （二） 基金托管人的权利与义务 1、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： （4）根据相关市场规则，为基金开设证券账户、为基金办理证券交易资金清算； 2、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： （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资产净值~~，招商中证煤炭份额的~~基金份额净值、~~招商中证煤炭 A 份额与招商中证煤炭 B 份额的~~基金份额~~参考净值~~； （12）~~建立~~并保存基金份额持有人名册；	二、基金托管人 （二） 基金托管人的权利与义务 1、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： （4）根据相关市场规则，为基金开设**资金账户、**证券账户**及投资所需其他账户**、为基金办理证券交易资金清算； 2、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： （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**，向审计、法律等外部专业顾问提供的除外**； （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**； （12）**从基金管理人或其委托的登记机构处接收**并保存基金份额持有人名册；	根据相关法律法规及实际情况，补充、完善基金托管人的相关权利和义务。
	三、基金份额持有人 …… ~~本基金除招商中证煤炭 A 份额与招商中证煤炭 B 份额的基金份额参考净值计算、基金合同终止时的基金清算财产分配、招商中证煤炭 A 份额与招商中证煤炭 B 份额终止运作后的份额转换外，本基金每份基金份额具有同等的合法权益。如果招商中证煤炭 A 份额与招商中证煤炭 B 份额的运作出现终止，则在终止招商中证煤炭 A 份额与招商中证煤炭 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。~~ 每份基金份额具有同等的合法权益。 1、根据《基金法》、《运作办	三、基金份额持有人 …… **本基金**每份基金份额具有同等的合法权益。 1、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）依照法律法规及基金合同的规定，依法转让**或者**申请赎回其持有的**基金**份额； 2、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；	根据相关法律法规及实际情况，补充、完善基金份额持有人的相关权利和义务。

	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）依照法律法规及基金合同的规定，依法转让~~其持有的招商中证煤炭 A 份额与招商中证煤炭 B 份额，依法~~申请赎回其持有的~~招商中证煤炭~~份额； 2、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~~、赎回~~款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；		
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~~或~~基金份额持有人的合法授权代表~~共同组成。~~基金份额持有人~~大会的审议事项应分别由招商中证煤炭份额、招商中证煤炭 A 份额与招商中证煤炭 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未立设日常机构。	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**进行表决。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未设立日常机构**，若未来本基金份额持有人大会成立日常机构，则按照届时有效的法律法规的规定执行**。	根据本基金变更注册的实际情况调整完善相关表述。
	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： （5）~~提高~~基金管理人、基金托管人的报酬标准； （11）单独或合计~~代表招商中证煤炭份额、招商中证煤炭 A 份额与招商中证煤炭 B 份额各自基金~~份额 10%以上（含 10%）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； 2、在不违反法律法规、基金合同的约定以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，以下情况可由基金管理人和	一、召开事由 1、除法律法规、中国证监会另有规定**或基金合同另有约定**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： （5）**调整**基金管理人、基金托管人的报酬标准； （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； **（12）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；** 2、在不违反法律法规、基金合同的约定以及对基金份额持有人利	根据本基金变更注册的实际情况调整召开及豁免召开基金份额持有人大会的情形。

	基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会： ~~（1）调低基金管理费、基金托管费及其他应由基金承担的费用；~~ ~~（3）在法律法规和基金合同规定的范围内调整招商中证煤炭份额~~的申购费率、调低赎回费率、变更收费方式； （4）因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改； （6）~~在符合法律法规规定、基金合同约定，且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，经中国证监会允许，~~基金推出新业务或服务； （7）~~在符合法律法规规定、基金合同约定，且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，经中国证监会允许，~~基金管理人、基金登记机构、销售机构在法律法规规定的范围内调整有关基金交易、非交易过户、转托管等业务规则； （8）按照法律法规和基金合同规定~~应当~~召开基金份额持有人大会~~的以外~~的其他情形。	益无实质性不利影响的情况下，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： **（2）调整本基金**的申购费率、调低赎回费率、变更收费方式； **（3）增加或调整本基金的基金份额类别设置；** （4）因相应的法律法规**、深圳证券交易所或登记机构的相关业务规则**发生变动而应当对基金合同进行修改； （6）基金推出新业务或服务； （7）基金管理人、基金登记机构、销售机构在法律法规规定的范围内调整有关基金交易、非交易过户、转托管等业务规则； （8）按照法律法规和基金合同规定**无需**召开基金份额持有人大会的其他情形。	
	二、会议召集人及召集方式 2、基金管理人未按规定召集或不能召~~开~~时，由基金托管人召集~~；~~ 4、~~单独或合计代表招商中证煤炭份额、招商中证煤炭 A 份额与招商中证煤炭 B 份额各自~~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	二、会议召集人及召集方式 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**。** 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或在规定时间内未能作出书面答复，**代表**基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人仍认为	根据本基金变更注册的实际情况调整完善相关表述。

	管理人决定不召集或在规定时间内未能作出书面答复，~~单独或合计代表招商中证煤炭份额、招商中证煤炭 A 份额与招商中证煤炭 B 份额各自~~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。 5、~~单独或合计代表招商中证煤炭份额、招商中证煤炭 A 份额与招商中证煤炭 B 份额各自~~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或在规定时间内未能作出书面答复，单独或合计代表~~招商中证煤炭份额、招商中证煤炭 A 份额与招商中证煤炭 B 份额各自~~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。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。	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或在规定时间内未能作出书面答复，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。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。	
	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 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、表决意见寄交的截止时间和收取方式。~~在法律法规和监管机构允许的情况下，也可以采用网络、电话或其他方式进行表决或者授权他人表决。~~	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 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、表决意见寄交的截止时间和收取方式。	删除变更注册后基金不适用的表述。

	四、基金份额持有人出席会议的方式 1、现场开会。…… （2）经核对，汇总到会者出示的在权**利**登记日持有基金份额的凭证显示，有效的~~**招商中证煤炭份额、招商中证煤炭 A 份额与招商中证煤炭 B 份额的**~~基金份额不少于在权益登记日**各自**基金总份额的 50%（含 50%）。 2、通讯开会。…… （3）本人直接出具表决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~~**招商中证煤炭份额、招商中证煤炭 A 份额与招商中证煤炭 B** 份额~~不小于在权益登记日**各自**基金份额的 50%（含 50%）； （4）……并与基金登记~~**注册**~~机构记录相符~~**，并且委托人出具的代理投票授权委托书符合法律法规、基金合同和会议通知的规定**~~； 3、重新召集基金份额持有人大会的条件 基金份额持有人大会应当有代表~~**招商中证煤炭份额、招商中证煤炭 A 份额与招商中证煤炭 B 份额各自份额**~~二分之一以上的持有人参加，方可召开。 参加基金份额持有人大会的持有人的基金份额低于上述规定比例的，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内，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~~**招商中证煤炭份额、招商中证煤炭 A 份额与招商中证煤炭 B 份额各自份额**~~三分之一以上的持有人参加，方可召开。	四、基金份额持有人出席会议的方式 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在权益登记日基金总份额的 50%（含 50%）。 2、通讯开会。…… （3）本人直接出具表决意见或授权他人代表出具**表决**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份额的 50%（含 50%）； （4）……并与基金登记机构记录相符； 3、重新召集基金份额持有人大会的条件 基金份额持有人大会应当有代表二分之一以上**（含二分之一）基金份额**的持有人参加，方可召开。 参加基金份额持有人大会的持有人的基金份额低于上述规定比例的，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内，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**的持有人参加，方可召开。 **5、基金份额持有人授权他人代为出席会议并表决的，授权方式可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式，具体方式在会议通知中列明。**	根据本基金变更注册的实际情况调整完善相关表述。
	五、议事内容与程序 2、议事程序	五、议事内容与程序 2、议事程序	根据本基金变更注

	（1）现场开会 ……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~~**招商中证煤炭份额、招商中证煤炭 A 份额与招商中证煤炭 B 份额各自**~~基金份额持有人和代理人所持表决权~~**合计**~~ 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~~**号码**~~、~~**住所地址、**~~持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）等事项。 （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 **5** 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。	（1）现场开会 ……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**、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。	册的实际情况调整完善相关表述。
	六、表决 ~~**招商中证煤炭份额、招商中证煤炭 A 份额与招商中证煤炭 B 份额的**~~基金份额持有人所持每份基金份额~~**在其对应份额级别内**~~享有平等的表决权。 1、一般决议，一般决议须经参加大会的~~**招商中证煤炭份额、招商中证煤炭 A 份额与招商中证煤炭 B 份额的各自**~~基金份额持有人或其代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）通过方为有效；除下列第 2 项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，特别决议应当经参加大会的~~**招商中证煤炭份额、**~~	六、表决 基金份额持有人所持每份基金份额享有平等的表决权。 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 50%以上（含 50%）通过方为有效；除下列第 2 项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。 **除法律法规另有规定或本基金合同另有约定外，**转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托	根据本基金变更注册的实际情况调整完善相关表述。

	~~招商中证煤炭 A 份额与招商中证煤炭 B 份额的各自~~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、与其他基金合并以特别决议通过方为有效。	管人、终止基金合同、与其他基金合并以特别决议通过方为有效。	
	九、本部分关于份额持有人大会的召开事由、召开条件、议事程序和表决条件等内容，凡是直接引用法律法规或监管规定的部分，如法律法规或监管规定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后可直接对该部分内容进行修改或调整，无需召开份额持有人大会。	九、本部分关于**基金**份额持有人大会的召开事由、召开条件、议事程序和表决条件等内容，凡是直接引用法律法规或监管规定的部分，如法律法规或监管规定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后可直接对该部分内容进行修改或调整，无需召开份额持有人大会。	完善相关表述。
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~~持有代表招商中证煤炭份额、招商中证煤炭 A 份额与招商中证煤炭 B 份额各自~~份额 10%以上（含 10%）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~~同时~~经参加大会的~~招商中证煤炭份额、招商中证煤炭 A 份额与招商中证煤炭 B 份额各自~~基金份额持有人所持表决权~~合计~~ 2/3 以上（含 2/3）表决通过，并自表决通过之日起生效； 4、备案：基金份额持有人大会~~选任~~基金管理人的决议须报中国证监会备案； 5、公告：基金管理人更换后，由基金托管人在基金份额持有人大会~~选任基金管理人的~~决议生效后 ~~2 日内在指定~~媒介公告； 6、交接：……新任基金管理人	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**代表基金**份额 10%以上（含 10%）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** 2/3 以上（含 2/3）表决通过，并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； 5、公告：基金管理人更换后，由基金托管人在**更换基金管理人的**基金份额持有人大会决议生效后**依照《信息披露办法》的有关规定在规定**媒介公告； 6、交接：……**临时基金管理人或**新任基金管理人应与基金托管人核对基金资产总值**和基金资产净值**；	根据本基金变更注册的实际情况相应调整基金管理人的更换程序，《基金合同》中关于更换程序的同类修改不再一一列举。

	应与基金托管人核对基金资产总值； 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；	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；**	
	无	**（四）基金份额持有人大会审议变更基金管理人、基金托管人事项时，除应遵守本部分的约定外，还应符合本基金合同第九部分的约定。**	明确变更基金管理人、基金托管人的其他规则。
	无	**三、新基金管理人或临时基金管理人接收基金管理业务，或新基金托管人或临时基金托管人接收基金财产和基金托管业务前，原基金管理人或原基金托管人应继续履行相关职责，并保证不做出对基金份额持有人的利益造成损害的行为。原基金管理人或原基金托管人在继续履行相关职责期间，仍有权按照本基金合同的规定收取基金管理费或基金托管费。**	补充原基金管理人和原基金托管人继续履行相关职责的规定。
第十二部分基金份额的登记	一、基金的份额登记业务 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基金账户的建立和管理、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。	一、基金的份额登记业务 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**的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的确认、**基金交易的确认、**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。	根据本基金变更注册的实际情况完善相关表述。
	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委托的中国证券登记结算有限责任公司负责办理。基金管理人应与中国证券登记结算有限责任公司签订委托代理协议，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、	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委托的中国证券登记结算有限责任公司负责办理。基金管理人应与中国证券登记结算有限责任公司签订委托代理协议，以明确基金管理人和代理机构在投资者**开放式**基金账户**和/或深圳证券账户**管理、基金份额登记、清算及基	根据本基金变更注册的实际情况完善相关表述。

	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。	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 2、建立和管理投资者基金账户；	三、基金登记机构的权利 2、建立和管理投资者**开放式**基金账户**和/或深圳证券账户**；	根据本基金变更注册的实际情况完善相关表述。
	四、基金登记机构的义务 3、妥善保存登记数据，并将基金份额持有人名称、身份信息及基金份额明细等数据备份至中国证监会认定的机构，其保存期限自基金账户销户之日起不得少于20年；	四、基金登记机构的义务 3、妥善保存登记数据，并将基金份额持有人名称、身份信息及基金份额明细等数据备份至中国证监会认定的机构，其保存期限自**开放式**基金账户**和/或深圳证券账户**销户之日起不得少于20年；	根据本基金变更注册的实际情况完善相关表述。
第十三部分基金的投资	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**中证煤炭等权指数的成份股~~、~~备选成份股~~、股指期货、固定收益投资品种（如~~债券、资产支持证券、货币市场工具~~等）~~以及法律法规或中国证监会允许~~本~~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%，~~投资于中证煤炭等权指数成份股和备选成份股的资产不低于**股票资产**的90%，且不低于非现金资产的80%；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，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。 ……	二、投资范围 本基金**的**投资**范围为**具有良好流动性的金融工具，**以**中证煤炭等权指数的成份股**及其**备选成份股**为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金也可投资于国内依法发行上市的其他股票（非标的指数成份股及其备选成份股，包括主板、中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、**债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券、可分离交易可转债、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）**、资产支持证券、**债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、**货币市场工具**、股指期货、国债期货，**以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。 **本基金投资的信用债券的债项评**	根据本基金变更注册的实际情况调整。

		级或主体评级须在 AA（含 AA）以上，相关资信评级机构须取得中国证监会证券评级业务许可。本基金可根据相关法律法规和基金合同的约定，参与融资业务和转融通证券出借业务。 …… 本基金投资于中证煤炭等权指数成份股和备选成份股的资产不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货、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，现金类资产不包括结算备付金、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，本基金的投资比例会做相应调整。	
	~~三、投资理念~~ ~~指数化投资可以以较低的成本获取良好的市场长期回报，投资于具有良好代表性、流动性与投资性的指数可以有效分享该指数所代表的股票市场中的投资机会。~~	删除	删除变更注册后基金不适用的条款。
	~~四~~、投资策略 本基金以中证煤炭等权指数为标的指数…… 本基金管理人可运用股指期货，……	三、投资策略 1、股票投资策略 本基金以中证煤炭等权指数为标的指数…… 2、股指期货投资策略 本基金管理人可运用股指期货，…… 3、债券投资策略 本基金管理人将具体采用期限结构配置、市场转换、信用利差和相对价值判断、信用风险评估、现金管理等管理手段进行个券选择。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，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。 信用债的投资策略方面，一方	根据本基金变更注册的实际情况调整。

		面，本基金将从经济周期、国家政策、行业景气度和债券市场的供求状况等多个方面考量信用利差的整体变化趋势；另一方面，本基金还将以内部信用评级为主、外部信用评级为辅，即采用内外结合的信用研究和评级制度，研究债券发行主体企业的基本面，以确定企业主体债的实际信用状况。 **4**、国债期货投资策略 本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的进行国债期货投资，将构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效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管理利率波动风险，实现基金资产保值增值。 **5**、资产支持证券投资策略 本基金将综合运用战略资产配置和战术资产配置进行资产支持证券的投资组合管理，投资资产支持证券将综合运用类别资产配置、久期管理、收益率曲线、个券选择和利差定价管理等策略，在严格遵守法律法规和基金合同基础上，进行资产支持证券产品的投资，在保证本金安全和基金资产流动性的基础上获得稳定收益。 **6**、参与融资及转融通证券出借业务策略 为更好地实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与融资及转融通证券出借业务。参与融资业务时，本基金将力争利用融资的杠杆作用，降低因申购造成基金仓位较低带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。参与转融通证券出借业务时，本基金将在分析市场情	

		况、投资者类型与结构、基金历史申赎情况、出借证券流动性情况等因素的基础上，合理确定出借证券的范围、期限和比例。若相关融资及转融通证券出借业务法律法规发生变化，本基金将从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。	
	~~五、投资决策程序~~ ~~本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理团队制。投资决策委员负责制定基金投资方面的整体投资计划与投资原则；决定有关标的指数重大调整应对决策、其他重大组合调整决策以及重大的单项投资决策；基金经理根据投资决策委员会的决策,负责投资组合的构建、调整和日常管理等工作。~~ ~~（1）投资决策委员会依据相关研究分析报告,定期召开或遇重大事项时召开投资决策会议,决策相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议,进行基金投资管理的日常决策。~~ ~~（2）基金经理依据指数编制单位公布的指数成份股名单及权重，进行投资组合构建；~~ ~~（3）基金经理及风险管理部定期对投资组合的偏离度和跟踪误差进行跟踪和评估，并对风险隐患提出预警；~~ ~~（4）基金经理根据指数成份股或权重变化情况、基金申购赎回情况、指数成份股派息情况等，适时进行投资组合调整；~~ ~~在投资决策过程中，风险管理部负责对各决策环节的事前及事后风险、操作风险等投资风险进行监控，并在整个投资流程完成后，对投资风险及绩效做出评估，提供给投资决策委员会、投资总监、基金经理等相关人员，以供决策参考。~~	删除	删除变更注册后基金不适用的条款。

	~~六~~、投资限制 （~~三~~）投资组合限制 1、~~本基金投资于股票的资产不低于基金资产的 85%，~~投资于中证煤炭等权指数成份股和备选成份股的资产不低于~~股票资产~~的 90%，且不低于非现金资产的 80%； 4、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%；~~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；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%；~~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）~~不低于基金资产的 85%，且不得超过基金资产的 100%；~~ ~~5~~、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，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等； ~~6、本基金投资权证，在任何交易日买入的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，本基金管理人管理的基金托管人托管的全部基金持有同一权证的比例不超~~	~~四~~、投资限制 （~~一~~）投资组合限制 1、~~本基金~~投资于中证煤炭等权指数成份股和备选成份股的资产不低于~~基金资产净值~~的 90%，且不低于非现金~~基金~~资产的 80%； 4、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%；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%；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；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%；~~ ~~5、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%；在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%；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；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%；~~ ~~6、在任何交易日日终，持有的买入国债期货和股指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；~~ ~~7~~、本基金每个交易日日终在扣除	1、根据本基金变更注册的实际情况调整投资限制； 2、调整完善投资比例调整期限和投资限制变更的具体规定。

	~~过该权证 10%。投资于其他权证的投资比例，遵从法律法规或监管部门的相关规定；~~ ~~15、本基金不得违反基金合同关于投资范围和投资比例的约定；~~ …… 除上述第 ~~5、12、13、14~~ 项外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、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。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。 …… ~~如果法律法规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，则本基金投资不再受相关限制~~，但需提前公告，不需要再经基金份额持有人大会审议~~。	股指期货**和国债期货**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，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等； **14、本基金参与融资的，每个交易日日终，本基金持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；** **15、本基金参与转融通证券出借业务的，应当符合下列要求：①参与转融通证券出借业务的资产不得超过基金资产净值的 30%，其中出借期限在 10 个交易日以上的出借证券应纳入《流动性规定》所述流动性受限证券的范围；②参与转融通证券出借业务的单只证券不得超过基金持有该证券总量的 50%；③最近 6 个月内日均基金资产净值不得低于 2 亿元；④证券出借的平均剩余期限不得超过 30 天，平均剩余期限按照市值加权平均计算。** **因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合本条上述规定的，基金管理人不得新增出借业务；** …… 除上述第 **7、13、15、16、17** 项外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、**标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制**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。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。…… 法律法规或监管部门取消**或调整**上述限制，如适用于本基金，**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**或按照调整后的规定执行**。	
	（~~二~~）禁止行为 …… 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，应当符合本基金的投资目标和投资策略，遵循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。…… 如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。	（**二**）禁止行为 …… 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，应当符合本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。…… 如法律法规或监管部门取消**或调整**上述禁止性规定，基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制**或按照调整后的规定执行**。	完善相关表述。
	~~七~~、标的指数与业绩比较基准 2、业绩比较基准 …… 由于本基金投资标的指数为中证煤炭等权指数，且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，因此，本基金将业绩比较基准定为中证煤炭等权指数收益率×95％＋金融机构人民币活期存款基准利率（税后）×5%。 如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准**的股票指数时**，本基金可以在与本基金托管人协商**同意**后变更业绩比较基准并及时公告。**本基金由于上述原因变更标的指数和业绩比较基准，基金管理人应于变更前在中国证监会**	**五**、标的指数与业绩比较基准 2、业绩比较基准 …… 由于本基金投资标的指数为中证煤炭等权指数，且每个交易日日终在扣除股指期货**和国债期货**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，因此，本基金将业绩比较基准定为中证煤炭等权指数收益率×95％＋金融机构人民币活期存款基准利率（税后）×5%。 如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩**比较**基准，**以及如果未来指数发布机构不再公布上述指数或更改指数名称时，**本基金可以在与本基金托管人协商**一致**后变更业绩比较基准并及时公告。	根据本基金变更注册的实际情况调整。

	~~指定的媒介上公告。~~		
	~~八~~、风险收益特征 ~~本基金为股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征。从本基金所分离的两类基金份额来看，招商中证煤炭 A 份额具有低风险、收益相对稳定的特征；招商中证煤炭 B 份额具有高风险、高预期收益的特征~~。	六、风险收益特征 本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金。本基金为被动式投资的股票型指数基金，主要采用完全复制策略跟踪标的指数的表现，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。	根据本基金变更注册的实际情况调整。
	~~九~~、基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法 2、有利于基金~~资~~产的安全与增值； 3、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益~~。~~ ~~4、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利，保护基金份额持有人的利益。~~	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 2、有利于基金财产的安全与增值； 3、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； 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。	根据本基金变更注册的实际情况调整。
	~~十、基金的融资融券、转融通业务~~ ~~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、转融通业务。~~	删除	删除变更注册后基金不适用的条款。
第十四部分基金的财产	四、基金财产的保管和处分 ……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。	四、基金财产的保管和处分 ……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执行。	完善相关表述。
第十五部分基金资产估值	二、估值对象 基金所拥有的股票、债券、衍生工具和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。	二、估值对象 基金所拥有的股票、债券、资产支持证券、衍生工具和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。	根据本基金变更注册的实际情况调整。
	无	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。	根据本基金变更注册的实际情况补充估值原

		（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。	则。
	三、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	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	根据估值政策及本基金变更注册的实

	（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；…… （2）交易所上市实行净价交易的债券，对于存在活跃市场的情况下，按估值日~~收盘价估值；对于存在活跃市场但收盘价未能代表估值日公允价值的情况下，使用调整后的收盘价估值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下~~，采用估值技术确定公允价值。 （3）交易所上市未实行净价交易的债券，对于存在活跃市场的情况下，按估值日收盘价减去收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值；~~对于存在活跃市场但收盘价未能代表估值日公允价值的情况下，使用调整后的~~收盘价减去收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值；~~对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下~~，采用估值技术确定公允价值。 （4）交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券~~、中小企业私募债~~，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。 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~~	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，且最近交易日后经济环境未发生重大变化**以及**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；…… （2）交易所上市实行净价交易的债券，对于存在活跃市场的情况下，按估值日**第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；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，按估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的**，采用估值技术确定公允价值。 （3）交易所上市未实行净价交易的债券，对于存在活跃市场的情况下，按估值日收盘价**或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价**减去收盘价**或估值全价**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**收盘价**或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价**减去收盘价**或估值全价**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**，采用估值技术确定公允价值。 （4）交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，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。 2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：	际情况调整相应估值方法。

	~~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。~~ 3、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用~~估值技术确定公允价值~~。 ~~4、本基金可以采用第三方估值机构按照上述公允价值确定原则提供的估值价格数据。~~ ~~5~~、同一~~债~~券同时在两个或两个以上市场交易的，按~~债~~券所处的市场分别估值。 ~~6~~、本基金投资股指期货等衍生品种合约，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。	（2）首次公开发行未上市的股票、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）**流通受限的股票，包括非公开发行股票、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。** 3、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用**第三方估值机构提供的估值价格数据进行估值**。 **4**、同一**证**券同时在两个或两个以上市场交易的，按**证**券所处的市场分别估值。 **5**、本基金投资股指期货**、国债期货**等衍生品种合约，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。 **6、本基金投资同业存单，采用估值日第三方估值机构提供的估值价格数据进行估值。** **8、本基金参与转融通证券出借业务的，按照相关法律法规和行业协会的相关规定进行估值。** **10、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。**	
	~~四~~、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 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。 每个工作日计算基金资产净值及	**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 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。**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	根据本基金变更注册的实际情况完善相关表述。

	基金份额净值，并按规定公告。	其规定。 **基金管理人于**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。	
	~~五~~、估值错误的处理 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0.5%时，基金管理人应当公告。	**六**、估值错误的处理 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0.5%时，基金管理人应当公告**，并报中国证监会备案**。	完善相关表述。
	~~七~~、基金净值的确认 用于基金信息披露的基金净值信息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信息予以公布。	**八**、基金净值的确认 用于基金信息披露的基金净值信息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**工作**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信息予以公布。	完善相关表述。
	~~八~~、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。 2、由于证券交易所、期货公司及登记结算公司等第三方机构发送的数据错误或~~由于其他不可抗力原因~~，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、基金托管人应免除赔偿责任。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。	**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**9**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**由于证券交易所、期货公司及登记结算公司等第三方机构发送的数据错误或**国家会计政策变更、市场规则变更等**，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、基金托管人应免除赔偿责任。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。	根据本基金变更注册的实际情况调整完善相关表述。
第十六部	一、基金费用的种类 10、证券账户开户费用、银行账	一、基金费用的种类 10、证券账户**、期货账户**开户费	根据基金实际情况

分基金费用与税收	户维护费用；	用、银行账户维护费用；	增加基金费用的种类。
	二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式 …… 3、基金的指数使用费 ~~本基金作为指数基金，需根据与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的约定向中证指数有限公司支付指数使用费。通常情况下，指数使用费按照前一日基金资产净值的 0.02%的年费率进行计提，且收取下限为每季人民币 5 万元（即不足 5 万元部分按照 5 万元收取）。计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。~~ ~~计算方法如下：~~ ~~H＝E×0.02%÷当年天数~~ ~~H 为每日应计提的标的指数使用费~~ ~~E 为前一日的基金资产净值~~ ~~指数使用费每日计算，逐日累计，每季支付一次，由基金管理人向基金托管人发送指数使用费划付指令，经基金托管人复核后，于每年 1 月、4 月、7 月、10 月的前十个工作日内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指数使用费。~~ 上述“一、基金费用的种类”中第 ~~3—11~~ 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。	二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式 …… 3、基金的指数使用费 本基金按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数许可使用费计提方法支付指数许可使用费。指数许可使用费的计算方法、费率及支付方法在招募说明书中列示。 如果指数使用许可协议约定的指数许可使用费的计算方法、费率和支付方式等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数许可使用费，而无需召开基金份额持有人大会，基金管理人将在招募说明书更新或其他公告中披露基金最新适用的方法。 上述“一、基金费用的种类”中第 4—11 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。	根据本基金变更注册的实际情况调整。
	三、不列入基金费用的项目 3、《基金合同》生效前的相关费用；	三、不列入基金费用的项目 3、《基金合同》生效前的相关费用按照《招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金基金合同》的约定执行；	根据本基金变更注册的实际情况调整相关表述。
	四、费用调整 基金管理人和基金托管人协商一	四、费用调整 基金管理人和基金托管人协商一	根据本基金变更注

	致后，可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率。 ~~调高基金管理费率、基金托管费率等费率，须召开基金份额持有人大会审议（法律法规或中国证监会另有规定的除外）；调低基金管理费率、基金托管费率等费率，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日前 **2** ~~日在指定~~媒介上公告。	致并履行适当程序后，可根据基金发展情况并根据法律法规规定和基金合同约定调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前按照《信息披露办法》的规定在规定媒介上公告。	册的实际情况调整，并完善相关表述。
	五、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。~~	五、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。 本基金支付给基金管理人、基金托管人的各项费用均为含税价格，具体税率适用中国税务机关的相关规定。	根据本基金变更注册的实际情况调整。
第十七部分基金的收益与分配	三、基金收益分配原则 ~~在存续期内，本基金（包括招商中证煤炭份额、招商中证煤炭 A 份额、招商中证煤炭 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，如果终止招商中证煤炭 A 份额与招商中证煤炭 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。具体见基金管理人届时发布的相关公告。~~	三、基金收益分配原则 1、若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配； 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的基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额可选择现金红利或将现金红利自动转为本基金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； 本基金场内收益分配方式仅为现金分红：登记在证券登记结算系统的场内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	根据本基金变更注册的实际情况调整。

		任公司的相关规定； 3、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； 4、每一基金份额享有同等分配权； 5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。 在不影响基金份额持有人利益的情况下，基金管理人可在法律法规允许的前提下酌情调整以上基金收益分配原则，此项调整不需要召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在规定媒介公告。 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，依照《信息披露办法》在规定媒介公告。 六、基金收益分配中发生的费用 收益分配采用红利再投资方式免收再投资的费用。 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。对于场外份额，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本基金基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。 场内基金份额收益分配时发生的费用，遵循深圳证券交易所和登记机构的相关规定。	

（原基金合同第二十一部分基金份额折算）	~~第二十一部分基金份额折算~~ ~~一、定期份额折算~~ ~~在存续期内的每个会计年度（基金合同生效不足六个月的除外）的 12 月 15 日（遇节假日顺延），本基金将按照以下规则进行基金的定期份额折算。~~ ~~1、基金份额折算基准日~~ ~~每个会计年度的 12 月 15 日（遇节假日顺延）。~~ ~~2、基金份额折算对象~~ ~~基金份额折算基准日登记在册的招商中证煤炭 A 份额、招商中证煤炭份额。~~ ~~3、基金份额折算频率~~ ~~每年折算一次。~~ ……	删除	删除变更注册后基金不适用的条款。
第十八部分基金的会计与审计	一、基金会计政策 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；~~	一、基金会计政策 2、基金的会计年度为公历年度的 1 月 1 日至 12 月 31 日；	根据本基金变更注册的实际情况调整。
	二、基金的年度审计 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的~~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的年度财务报表进行审计。	二、基金的年度审计 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的**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的年度财务报表进行审计。	根据法律法规修订的实际情况调整。
第十九部分基金的信息披露	二、信息披露义务人 …… 本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会**指定**的全国性报刊（以下简称“**指定**报刊”）及**指定**互联网网站（以下简称“**指定**网站”）等媒介披露，并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。	二、信息披露义务人 …… 本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过**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”）及**《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，并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。	根据法律法规修订的实际情况调整。
	五、公开披露的基金信息	五、公开披露的基金信息	根据本基

	（一）基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议、基金产品资料概要 2、基金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。……	（一）基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议、基金产品资料概要 2、基金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。……	金变更注册的实际情况调整。
	~~（二）基金份额发售公告~~ ~~基金管理人应当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~~ ~~基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日在指定媒介上登载《基金合同》生效公告。~~	删除	删除变更注册后基金不适用的条款。
	（~~四~~）基金份额上市交易公告书 ~~招商中证煤炭 A 份额、招商中证煤炭 B~~ 份额获准在证券交易所上市交易的，基金管理人应当在~~招商中证煤炭 A 份额、招商中证煤炭 B~~ 份额上市交易 3 个工作日前，将上市交易公告书登载在~~指定报刊和网站上~~。	（~~二~~）基金份额上市交易公告书 ~~基金~~份额获准在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~~规定网站上，并将上市交易公告书提示性公告登载在规定报刊上~~。	根据本基金变更注册的实际情况调整。
	~~（五）招商中证煤炭份额开始申购、赎回公告~~ ~~基金管理人应于招商中证煤炭份额申购开始日、赎回开始日前 2 日在指定媒介及基金管理人网站上公告。~~	删除	删除变更注册后基金不适用的条款。
	（~~六~~）基金净值信息 基金合同生效后，在~~招商中证煤炭 A 份额、招商中证煤炭 B~~ 份额上市交易前~~或者~~开始办理~~招商中证煤炭份额~~申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周~~公告~~一次~~基金资产净值和招商中证煤炭份额的~~基金份额净值~~、招商中证煤炭 A 份额与招商中证煤炭 B 份额的~~基金份额~~参考~~净值。 在~~招商中证煤炭 A 份额、招商中~~	（~~三~~）基金净值信息 基金合同生效后，在~~基金~~份额上市交易前~~且~~开始办理申购或者赎回前，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~~基金~~份额上市交易或者开始办理申购或者赎回后，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营业网点披露开放日的	根据本基金变更注册的实际情况调整。

	~~证煤炭~~ **B** 份额上市交易或者开始办理~~招商中证煤炭份额~~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~~指定~~网站、基金销售机构网站或营业网点披露开放日~~招商中证煤炭份额~~的基金份额净值和基金份额累计净值~~、招商中证煤炭 A 份额与招商中证煤炭 B 份额的基金份额参考净值~~。 基金管理人应当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~~招商中证煤炭份额~~的基金份额净值和基金份额累计净值~~、招商中证煤炭 A 份额与招商中证煤炭 B 份额的基金份额参考净值~~。	基金份额净值和基金份额累计净值。 基金管理人应当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。	
	（~~七~~）~~招商中证煤炭~~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~~招商中证煤炭~~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。	（~~四~~）~~基金~~份额~~的~~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。	根据本基金变更注册的实际情况调整。
	（~~八~~）基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告 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~~指定~~网站上，并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。 …… ~~《基金合同》生效不足两个月的，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。~~	（~~五~~）基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告 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，并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。 ……	1、根据法律法规修订的实际情况调整； 2、删除变更注册后基金不适用的条款。
	（~~九~~）临时报告 ~~8、基金募集期延长或提前结束~~	（~~六~~）临时报告 ~~15、~~基金份额净值计价错误达基	根据相关法律法规

	~~募集；~~ ~~16、招商中证煤炭份额的基金份额净值、招商中证煤炭 A 份额与招商中证煤炭 B 份额的~~基金份额~~参考~~净值计价错误达基金份额净值百分之零点五； ~~17、招商中证煤炭~~份额开始办理申购、赎回； ~~20、招商中证煤炭~~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、招商中证煤炭 A 份额、招商中证煤炭 B 份额上市交易；~~ ~~25、招商中证煤炭 A 份额、招商中证煤炭 B 份额~~暂停上市、恢复上市或终止上市； ~~26、本基金实施基金份额折算；~~	金份额净值百分之零点五； **16、基金**份额开始办理申购、赎回； **19、基金**份额暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请； **21、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；** **22、基金份额停复牌**、暂停上市、恢复上市或终止上市；	及本基金变更注册的实际情况调整。
	~~（十三）中国证监会规定的其他信息。~~ 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**的**股指期货交易情况，应当包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示股指期货交易对本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。 基金管理人应在基金~~季度报告~~中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期~~未按市值占基金净资产比例大小排序的前 10 名~~资产支持证券明细。基金管理人应在基金~~年度报告及中期报告~~中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期~~内所有的~~资产支持证券明细。	**（十）基金投资股指期货和国债期货的信息披露** **基金管理人应**在**基金**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）等文件中披露股指期货**、国债期货**交易情况，应当包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示股指期货**、国债期货**交易对本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。 **（十一）基金投资资产支持证券的信息披露** **本基金投资资产支持证券，**基金管理人应在基金**年度报告及中期报告**中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期**内所有的**资产支持证券明细。基金管理人应在基金**季度报告**中披露其持有的资产支持证券总额、资产支	根据本基金变更注册的实际情况调整。

		持证券市值占基金净资产的比例和报告期**末按市值占基金净资产比例大小排序的前 10 名**资产支持证券明细。 **（十二）基金参与融资和转融通证券出借业务的信息披露** **本基金参与融资和转融通证券出借业务，基金管理人应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露参与融资和转融通证券出借交易情况，包括投资策略、业务开展情况、损益情况、风险及其管理情况等，并就报告期内本基金参与转融通证券出借业务发生的重大关联交易事项做详细说明。** **（十三）中国证监会规定的其他信息。**	
	六、信息披露事务管理 …… 基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、~~**基金份额参考净值、**~~基金份额申购赎回价格、基金定期报告、更新的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人进行书面或电子确认。	六、信息披露事务管理 …… 基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告、更新的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人进行书面或电子确认。	根据本基金变更注册的实际情况调整。
	八、暂停或延迟披露基金相关信息的情形 2、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；	八、暂停或延迟披露基金相关信息的情形 2、基金投资所涉及的证券**/期货**交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；	完善相关表述。
第二十部分基金合同的变更、	三、基金财产的清算 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、~~**具有从事证券、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。基金财产清算小组	三、基金财产的清算 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	根据法律法规修订的实际情况调整，并完善相关表述。

终止与基金财产的清算	可以聘用必要的工作人员。 5、基金财产清算的期限为 6 个月。	可以聘用必要的工作人员。 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**。	
	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，**~~分别计算招商中证煤炭份额、招商中证煤炭 A 份额与招商中证煤炭 B 份额各自的应计分配比例，并据此由招商中证煤炭份额、招商中证煤炭 A 份额与招商中证煤炭 B 份额各自的~~**基金份额持有人**~~根据其~~**持有的基金份额比例进行分配。	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。	根据本基金变更注册的实际情况调整。
	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**~~具有证券、期货相关业务资格~~**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。	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。	根据法律法规修订的实际情况调整。
第二十一部分违约责任	一、……但是如发生下列情况，当事人**~~可以~~**免责： 2、基金管理人和/或基金托管人按照**当**时有效的法律法规或中国证监会的规定作为或不作为而造成的损失等；	一、……但是如发生下列情况，当事人免责： 2、基金管理人和/或基金托管人按照**届**时有效的法律法规或中国证监会的规定作为或不作为而造成的损失等；	完善相关表述。
第二十二部分争议的处理和适用的法律	各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会**当**时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，仲裁费和律师费由败诉方承担。	各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会**届**时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，仲裁费和律师费由败诉方承担。	完善相关表述。

	…… 本《基金合同》受中国法律管辖。	…… 本《基金合同》受中国法律**（为本合同之目的，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区）**管辖。	
第二十三部分 基金合同的效力	《基金合同》是约定基金当事人之间~~、基金与基金当事人之间~~权利义务关系的法律文件。 1、《基金合同》经~~基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字并在募集结束后经基金管理人向中国证监会办理基金备案手续，并经中国证监会书面确认后生效。~~ 4、《基金合同》正本一式六份，除上报有关监管机构~~一式~~二份外，基金管理人、基金托管人各持有二份，每份具有同等的法律效力。	《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。 1、《基金合同》经**招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决通过后，自【】年【】月【】日起生效，《招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金基金合同》同时失效。** 4、《基金合同》正本一式六份，除上报有关监管机构二份外，基金管理人、基金托管人各持有二份，每份具有同等的法律效力。	根据实际情况调整。