

中融中证煤炭指数分级证券投资基金2016年年度报告摘要

2016年12月31日

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

送出日期：2017年03月31日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经全体独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人海通证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年3月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中的财务资料经审计，上会会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自2016年1月1日起至2016年12月31日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中融中证煤炭指数分级证券投资基金		
基金简称	中融煤炭		
基金主代码	168204		
基金运作方式	上市契约型开放式		
基金合同生效日	2015年06月25日		
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		
报告期末基金份额总额	2,487,228,950.81份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2015-07-03		
下属分级基金的基金简称	煤炭A级	煤炭B级	煤炭母基
下属分级基金的交易代码	150289	150290	168204
报告期末下属分级基金的份 额总额	1,188,148,976.00份	1,188,148,976.00份	110,930,998.81份

2.2 基金产品说明

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。
投资策略	本基金主要采用完全复制法进行投资，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。 当预期成份股发生调整，成份股发生配股、增发、分红等行为，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪中证煤炭指数的效果可能带来影响，导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以根据市场情况，采取合理措施，在合理期限内进行适当的处理和调整，

	力争使跟踪误差控制在限定的范围之内。 1. 资产配置策略 2. 股票投资组合构建 3. 债券投资策略 4. 股指期货投资策略
业绩比较基准	95%×中证煤炭指数收益率+5%×同期银行活期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为跟踪指数的股票型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。从本基金所自动分离或分拆的两类基金份额来看，煤炭A份额具有预期风险、预期收益较低的特征；煤炭B份额具有预期风险、预期收益较高的特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中融基金管理有限公司	海通证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	裴芸	朱稼翔
	联系电话	85003300	021-63411463
	电子邮箱	peiyun@zrfunds.com.cn	zhujx@htsec.com
客户服务电话		400-160-6000; 010-85003210	021-95553
传真		010-85003386	021-63410637

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.zrfunds.com.cn/
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016年	2015年06月25日-2015年12月31日
本期已实现收益	10,251,780.13	-23,158,569.16
本期利润	-21,160,414.38	-23,411,138.11
加权平均基金份额本期利润	-0.0199	-0.2290
本期基金加权平均净值利润率	-2.55%	-28.17%
本期基金份额净值增长率	1.55%	-23.31%
3.1.2 期末数据和指标	2016年末	2015年末
期末可供分配利润	-775,566,100.25	-86,537,452.73
期末可供分配基金份额利润	-0.3118	-0.3092
期末基金资产净值	1,832,356,640.77	210,394,627.16
期末基金份额净值	0.7370	0.7520
3.1.3 累计期末指标	2016年末	2015年末
基金份额累计净值增长率	-22.10%	-23.31%

注：1.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

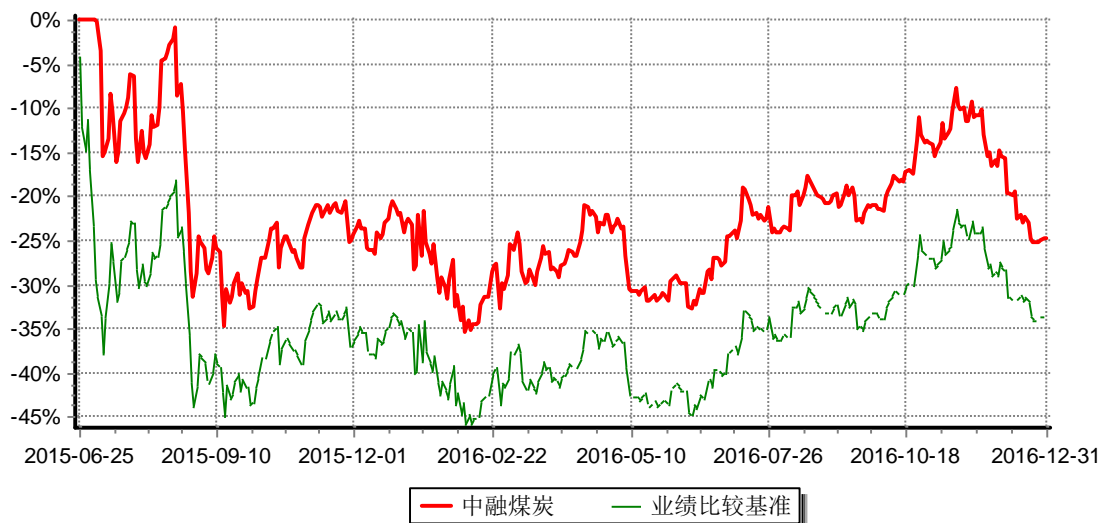
3.期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-3.45%	1.57%	-2.55%	1.61%	-0.90%	-0.04%
过去六个月	8.02%	1.55%	11.01%	1.58%	-2.99%	-0.03%
过去一年	1.55%	2.12%	2.88%	2.14%	-1.33%	-0.02%
自基金合同生效日起至 至今（2015年06月25日-2016年12月31日）	-22.10%	2.43%	-33.64%	2.60%	11.54%	-0.17%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

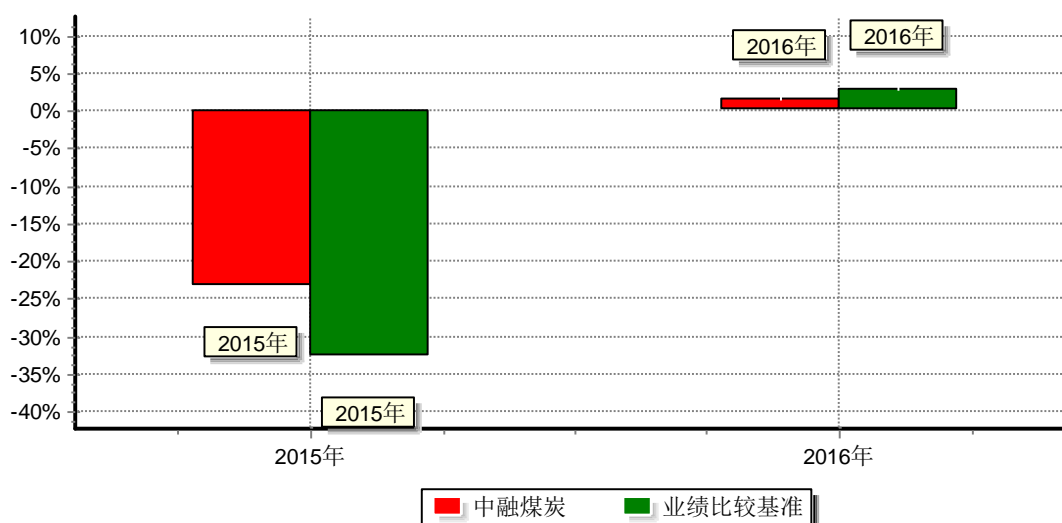


图：中融中证煤炭指数分级证券投资基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2015年6月25日至2016年12月31日)

注：按照合同和招募说明书的约定，本基金自合同生效日起6个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：2015年为实际存续期2015年6月25日（基金合同生效日）至2015年12月31日

3.3 过去三年基金的利润分配情况

根据本基金基金合同的约定，在存续期内，本基金（包括中融煤炭份额、煤炭A份额、煤炭B份额）不进行收益分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为中融基金管理有限公司，成立于2013年5月31日，由中融国际信托有限公司与上海融晟投资有限公司共同出资，注册资金7.5亿元人民币。

截止2016年12月31日，中融基金管理有限公司共管理29只基金，包括中融增鑫一年定期开放债券型证券投资基金、中融货币市场基金、中融国企改革灵活配置混合型证券投资基金、中融融安保本混合型证券投资基金、中融国证钢铁行业指数分级证券投资基金、中融中证煤炭指数分级证券投资基金、中融中证银行指数分级证券投资基金、中融中证一带一路主题指数分级证券投资基金、中融新机遇灵活配置混合型证券投资基金、中融新经济灵活配置混合型证券投资基金、中融新优势灵活配置混合型证券投资基金、中融新动力灵活配置混合型证券投资基金、中融稳健添利债券型证券投资基金、中融融安二号保本混合型证券投资基金、中融日日盈交易型货币市场基金、中融产业升级灵活配置混合型证券投资基金、中融融丰纯债债券型证券投资基金、中融融裕双利债券型证券投资基金、中融竞争优势股票型证券投资基金、中融融信双盈债券型证券投资基金、中融强国制造灵活配置混合型证券投资基金、中融现金增利货币市场基金、中融上海清算所银行间3-5年中高等级信用债指数发起式证券投资基金、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、中融鑫回报灵活配置混合型证券投资基金、中融上海清算所银行间0-1年中高等级信用债指数发起式证券投资基金、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、中融恒泰纯债债券型证券投资基金、中融量化多因子混合型发起式证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
赵菲	本基金、中融一带一路、中融银行、中融	2015年06月25日	—	8年	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，证券从业年限8年。

	钢铁、中融量化多因子混合基金基金经理、量化投资部负责人			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，任量化投资部总监及基金经理，于2015年6月至今任本基金基金经理。
--	-----------------------------	--	--	--

注：（1）上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

（2）证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项配套法规、《中融中证煤炭行业指数分级证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

公司制定了《公平交易管理制度》，按照证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规的规定，从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施和信息披露等多方面，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，杜绝不同投资组合之间进行利益输送，保护投资者合法权益。

公司公平交易管理制度要求境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易以及投资管理过程中各个相关环节符合公平交易的监管要求。各投资组合能够公平地获得投资信息、投资建议，并在投资决策委员会的制度规范下独立决策，实施投资决策时享有公平的机会。所有组合投资决策与交易执行保持隔离，任何组合必须经过公司交易部集中交易。各组合享有平等的交易权利，共享交易资源。对交易所公开竞价交易以及银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易制定专门的交易规则，保证各投资组

合获得公平的交易机会。对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，严格遵循各投资组合交易前独立确定交易要素，交易后按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本公司制定了《公平交易管理办法》并严格执行，公司通过建立科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，在研究、决策、交易执行等各环节，通过制度、流程、技术手段等各方面措施确保了公平对待所管理的投资组合，保证公平交易原则的实现。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好，不同的投资组合受到了公平对待，未发生不公平的交易事项。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾2016年，A股年初经历熔断大幅下挫，在低位震荡后缓慢上行，中证煤炭指数最终收涨2.69%。本基金严格按照基金合同的各项要求，采取完全复制的被动式指数基金管理策略，虽然申赎等因素对指数基金管理带来了一定影响，本基金仍保持了对指数的有效跟踪。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中融中证煤炭份额净值为0.737元；本报告期基金份额净值增长率为1.55%，业绩比较基准收益率为2.88%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016年国内经济在地产投资、基建投资以及工业企业补库存等因素带动下持续复苏，国企改革与供给侧改革不断深化，尽管英国脱欧、特朗普当选、美联储加息等风险事件一定程度上影响了市场的风险偏好，但A股仍在年初熔断后震荡上行，最终跌幅大幅收窄。展望2017年，宏观经济受地产投资下行、企业补库存结束等影响存在一定压力，但在去产能、去杠杆、PPP项目持续加码等政策的持续推动下，企业盈利预计继续回升。从大类资产来看，相比于楼市的持续调控，债市的风险加剧，股市的配置价值凸显。

煤炭价格在经历今年的暴涨后存在较大回调的压力，这一趋势在发改委年底释放先进产能后已有所体现。但在供给侧改革持续去产能的背景下煤价大幅下跌的概率较低，

大概率会趋于稳定。煤企也通过签订中长期合同锁定煤价，加之近期盈利明显提升负债情况有所好转，上市大型煤企的盈利状态有望维持。

本基金将积极应对各种因素对指数跟踪效果带来的冲击，努力将跟踪误差控制在基金合同规定的范围内，力争使投资者充分分享煤炭行业的长期收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人在内部监察稽核工作中，一切从合规运作、保障基金份额持有人的利益出发，由督察长领导法律合规部及风险管理部对公司经营、基金运作及员工行为的合规性进行定期和不定期检查，推动公司内部控制机制的完善与优化，保证各项法规和管理制度的落实，发现问题及时提出建议，并跟踪改进落实情况。本报告期内，公司内部控制体系运行顺利，本基金运作没有出现违法违规行为。

本报告期内，本基金管理人内部监察稽核工作重点集中于以下几个方面：

- 1、根据基金监管法律法规的最新变化，推动公司各部门及时完善与更新制度规范和业务流程，制定、颁布和更新了一系列公司基本管理制度，确保内控制度的适时性、全面性和合法合规性，并加强内部督导，将风险意识贯穿于各岗位与各业务环节。
- 2、日常监察和专项监察相结合，通过定期检查、不定期抽查、专项监察等工作方法，加强了对基金日常业务的合规审核和合规监测，并加强了对重要业务和关键业务环节的监督检查。
- 3、规范基金销售业务，保证基金销售业务的合法合规性。公司在基金募集和持续营销活动中，严格规范基金销售业务，按照《证券投资基金销售管理办法》及相关法规规定审查宣传推介材料，逐步落实反洗钱法律法规各项要求，并督促销售部门做好投资者教育工作。
- 4、规范基金投资业务，保证投资管理工作规范有序、合法合规进行。公司制定了严格规范的投资管理制度和流程机制，以投资决策委员会为最高投资决策机构，投资业务均按照管理制度和业务流程执行。
- 5、以外聘律师、讲座等多种方式加强合规教育与培训，促进公司合规文化的建设，及时向公司传达基金相关的法律法规；加大了对员工行为的监察稽核力度，从源头上防范合规风险，防范利益输送行为。公司自成立以来，各项业务运作正常，内部控制和风险防范措施逐步完善并积极发挥作用。我们将继续以风险控制为核心，进一步提高内部监察工作的科学性和有效性，切实保障基金的规范运作，充分保障基金份额持有人的利益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国

证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所所在估值调整导致基金资产净值的变化在0.25%以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值委员会，成员由高级管理人员、投资研究部门、基金运营部门、风险管理部门、法律合规部门人员组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。报告期内，基金经理参加估值委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；与估值相关的机构包括上海、深圳证券交易所，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司以及中国证券业协会等。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同的约定，在存续期内，本基金（包括中融煤炭份额、煤炭A份额、煤炭B份额）不进行收益分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金存在基金资产连续20个工作日低于5000万的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对中融中证煤炭指数分级证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，中融中证煤炭指数分级证券投资基金的管理人--中融基金管理有限公司在中融中证煤炭指数分级证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、定期份额折算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，中

融中证煤炭指数分级证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对中融基金管理有限公司编制和披露的中融中证煤炭指数分级证券投资基金2016年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	上会师报字(2017)第0845号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	中融中证煤炭指数分级证券投资基金全体持有人
引言段	我们审计了后附的中融中证煤炭指数分级证券投资基金(以下简称"中融煤炭")的财务报表,包括2016年12月31日的资产负债表、2016年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是中融煤炭的管理人中融基金管理有限公司的责任,这种责任包括:(1)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表,并使其实现公允反映;(2)设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在实施审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守职业道德规范,计划和实施审计工

	<p>作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，我们考虑与财务报表编制相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
审计意见段	<p>我们认为，中融煤炭的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了中融煤炭2016年12月31日的财务状况以及2016年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
注册会计师的姓名	张健 陶喆
会计师事务所的名称	上会会计师事务所（特殊普通合伙）
会计师事务所的地址	上海市静安区威海路755号文新报业大厦20楼
审计报告日期	2017-03-24

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：中融中证煤炭指数分级证券投资基金

报告截止日：2016年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末	上年度末
----	-----	-----	------

中融中证煤炭指数分级证券投资基金2016年年度报告摘要

		2016年12月31日	2015年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	123,927,805.31	20,269,820.97
结算备付金		3,172,619.60	786,973.44
存出保证金		1,417,312.99	359,641.92
交易性金融资产	7.4.7.2	1,709,451,985.58	188,856,945.46
其中：股票投资		1,709,451,985.58	188,856,945.46
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	7.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	7.4.7.4	—	—
应收证券清算款		—	—
应收利息	7.4.7.5	64,243.88	9,892.36
应收股利		—	—
应收申购款		8,823,776.10	2,763,998.32
递延所得税资产		—	—
其他资产	7.4.7.6	—	—
资产总计		1,846,857,743.46	213,047,272.47
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
负 债：			
短期借款		—	—
交易性金融负债		—	—
衍生金融负债	7.4.7.3	—	—
卖出回购金融资产款		—	—
应付证券清算款		10,748,447.36	2,143,773.48
应付赎回款		795,985.03	6,352.83
应付管理人报酬		1,510,980.80	154,535.81

应付托管费		332,415.76	33,997.91
应付销售服务费		—	—
应付交易费用	7.4.7.7	896,818.51	178,351.69
应交税费		—	—
应付利息		—	—
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	7.4.7.9	216,455.23	135,633.59
负债合计		14,501,102.69	2,652,645.31
所有者权益：			
实收基金		2,352,966,825.05	274,304,435.29
未分配利润	7.4.7.10	-520,610,184.28	-63,909,808.13
所有者权益合计		1,832,356,640.77	210,394,627.16
负债和所有者权益总计		1,846,857,743.46	213,047,272.47

注：报告截止日2016年12月31日，煤炭母基金份额净值0.737元，煤炭A份额净值1.002元，煤炭B份额净值0.471元。基金份额总额2,487,228,950.81份，其中煤炭母基金份额110,930,998.81份，煤炭A份额1,188,148,976.00份，煤炭B份额1,188,148,976.00份。

7.2 利润表

会计主体：中融中证煤炭指数分级证券投资基金

本报告期：2016年01月01日至2016年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016年01月01日至 2016年12月31日	上年度可比期间 2015年06月25日至 2015年12月31日
一、收入		-7,631,349.96	-21,936,661.42
1.利息收入		1,272,892.86	232,938.06
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,272,892.86	180,555.81
债券利息收入		—	—
资产支持证券利息收入		—	—
买入返售金融资产收		—	52,382.25

入			
其他利息收入		—	—
2.投资收益(损失以“-”填列)		20,940,290.24	-22,304,921.78
其中: 股票投资收益	7.4.7.12	18,303,190.34	-22,323,816.97
基金投资收益		—	—
债券投资收益	7.4.7.13	—	—
资产支持证券投资收 益		—	—
贵金属投资收益		—	—
衍生工具收益	7.4.7.14	—	—
股利收益	7.4.7.15	2,637,099.90	18,895.19
3.公允价值变动收益(损失以 “-”号填列)	7.4.7.16	-31,412,194.51	-252,568.95
4.汇兑收益(损失以“-”号 填列)		—	—
5.其他收入(损失以“-”号填 列)	7.4.7.17	1,567,661.45	387,891.25
减: 二、费用		13,529,064.42	1,474,476.69
1. 管理人报酬		8,137,495.33	410,111.26
2. 托管费		1,790,249.01	90,224.43
3. 销售服务费		—	—
4. 交易费用	7.4.7.18	3,196,609.81	735,938.54
5. 利息支出		—	—
其中: 卖出回购金融资产支出		—	—
6. 其他费用	7.4.7.19	404,710.27	238,202.46
三、利润总额(亏损总额以“-” 号填列)		-21,160,414.38	-23,411,138.11
减: 所得税费用		—	—
四、净利润(净亏损以“-” 号填列)		-21,160,414.38	-23,411,138.11

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：中融中证煤炭指数分级证券投资基金

本报告期：2016年01月01日至2016年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2016年01月01日至2016年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	274,304,435.29	-63,909,808.13	210,394,627.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）		-21,160,414.38	-21,160,414.38
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	2,078,662,389.76	-435,539,961.77	1,643,122,427.99
其中：1.基金申购款	3,204,684,222.46	-665,757,409.78	2,538,926,812.68
2.基金赎回款	-1,126,021,832.70	230,217,448.01	-895,804,384.69
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	—	—	—
五、期末所有者权益（基金净值）	2,352,966,825.05	-520,610,184.28	1,832,356,640.77
项 目	上年度可比期间2015年06月25日至2015年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	211,452,235.90	—	211,452,235.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	-23,411,138.11	-23,411,138.11
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	62,852,199.39	-40,498,670.02	22,353,529.37

其中：1.基金申购款	315,307,825.91	-71,488,766.17	243,819,059.74
2.基金赎回款	-252,455,626.52	30,990,096.15	-221,465,530.37
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	—	—	—
五、期末所有者权益（基金净值）	274,304,435.29	-63,909,808.13	210,394,627.16

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

王瑶

曹健

鞠帅平

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

7.4.2 差错更正的说明

本基金本报告期无差错事项。

7.4.3 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中融国际信托有限公司	基金管理人股东
上海融晟投资有限公司	基金管理人股东
中融基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
海通证券股份有限公司（“海通证券”）	基金托管人、基金销售机构
中融（北京）资产管理有限公司	基金管理人子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.4.1.1 股票交易

关联方名称	本期 2016年01月01日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年6月25日(基金合同生效日) 至2015年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交 总额的比例	成交金额	占当期股票成交 总额的比例
海通证券	-	-	360,936,419.81	57.03%

7.4.4.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间2015年6月25日(基金合同生效日)至2015年12月31日止未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.4.1.3 应支付关联方的佣金

关联方名称	本期 2016年01月01日至2016年12月31日				上年度可比期间 2015年6月25日(基金合同生效日)至 2015年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
海通证券	-	-	-	-	256,421.57	56.31%	-	-

7.4.4.1.4 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间2015年6月25日(基金合同生效日)至2015年12月31日止未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.4.1.5 债券回购交易

关联方名称	本期 2016年01月01日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年6月25日(基金合同生效日) 至2015年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例
海通证券	-	-	211,000,000.00	100.00%

7.4.4.2 关联方报酬**7.4.4.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2016年01月01日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年06月25日至2015年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	8,137,495.33	410,111.26
其中：支付销售机构的客户维护费	73,039.10	13,741.63

注：①支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值1.00%的年费率计提，每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值 X1.00% / 当年天数。

②客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

7.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年01月01日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年06月25日至2015年12 月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,790,249.01	90,224.43

注：①支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值0.22%的年费率计提，每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值 X 0.22% / 当年天数。

7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金于本报告期及上年度可比期间2015年6月25日（基金合同生效日）至2015年12月31日均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况**7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本基金本报告期内及上年度可比期间2015年6月25日（基金合同生效日）至2015年12月31日止未运用固有资金投资本基金。

7.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间2015年6月25日（基金合同生效日）至2015年12月31日止除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末未持有本基金份额。

7.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年01月01日至2016年12月31 日		上年度可比期间 2015年06月25日至2015年12月31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
海通证券活期存款	123,927,805.31	1,234,734.60	20,269,820.97	172,786.36

注：1、本基金的银行存款由基金托管人海通证券保管，按银行同业利率计息。

2、本基金用于证券交易结算的资金通过"海通证券股份有限公司基金托管结算资金专用存款账户"转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。2016年12月31日的相关余额在资产负债表中的"结算备付金"科目中单独列示，产生的利息收入在"重要财务报表项目的说明"中的"结算备付金利息收入"下列示。

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期及上年度可比期间2015年6月25日（基金合同生效日）至2015年12月31日均未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.4.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间2015年6月25日（基金合同生效日）至2015年12月31日均无其他关联交易事项。

7.4.5 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券**7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金本期末及上年度期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末及上年度期末未持有的暂时停牌等流通受限股票。

7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末及上年度期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末及上年度期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.6 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1. 公允价值

(1) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值接近于公允价值。

(2) 以公允价值计量的金融工具

①金融工具公允价值计量的方法

本基金以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债，其公允价值计量基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，被划分为三个层次：

第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

②各层级金融工具公允价值

于2016年12月31日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为1,709,451,985.58元，无属于第二层级和第三层级的余额(2015年12月31日：第一层级为181,036,640.81元，第二层级为7,820,304.65元，无第三层级)。

③公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具，在第一层次和第二层次之间无重大转换。

2. 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,709,451,985.58	92.56
	其中：股票	1,709,451,985.58	92.56
2	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	127,100,424.91	6.88
7	其他各项资产	10,305,332.97	0.56
8	合计	1,846,857,743.46	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

8.2.1.1 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	1,498,253,161.03	81.77
C	制造业	211,198,824.55	11.53
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	1,709,451,985.58	93.29

8.2.1.2 报告期末（积极投资）按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

8.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	601088	中国神华	10,815,785	174,999,401.30	9.55
2	600157	永泰能源	43,441,218	174,199,284.18	9.51
3	000983	西山煤电	15,133,216	128,027,007.36	6.99
4	601898	中煤能源	17,580,431	102,142,304.11	5.57
5	601225	陕西煤业	19,209,399	93,165,585.15	5.08
6	601699	潞安环能	11,492,672	92,516,009.60	5.05
7	600348	阳泉煤业	11,549,691	77,729,420.43	4.24
8	000937	冀中能源	10,181,600	68,623,984.00	3.75

9	601011	宝泰隆	7,880,689	56,189,312.57	3.07
10	601666	平煤股份	11,339,167	55,221,743.29	3.01
11	002128	露天煤业	6,279,050	53,999,830.00	2.95
12	600123	兰花科创	6,583,485	52,931,219.40	2.89
13	600395	盘江股份	6,358,472	51,312,869.04	2.80
14	000552	靖远煤电	13,179,435	49,950,058.65	2.73
15	601001	大同煤业	8,037,723	49,110,487.53	2.68
16	000571	新大洲A	6,255,086	47,663,755.32	2.60
17	600997	开滦股份	5,929,225	42,393,958.75	2.31
18	600740	山西焦化	5,148,014	40,720,790.74	2.22
19	600188	兖州煤业	3,695,857	40,137,007.02	2.19
20	600397	安源煤业	6,655,817	34,344,015.72	1.87
21	601101	昊华能源	4,610,266	30,796,576.88	1.68
22	600508	上海能源	2,776,556	30,153,398.16	1.65
23	600971	恒源煤电	4,802,427	30,111,217.29	1.64
24	000723	美锦能源	1,971,850	29,814,372.00	1.63
25	601015	陕西黑猫	2,679,750	25,564,815.00	1.40
26	000780	平庄能源	3,896,883	22,796,765.55	1.24
27	600121	郑州煤电	3,900,854	21,259,654.30	1.16
28	600714	金瑞矿业	1,107,175	17,061,566.75	0.93
29	600792	云煤能源	2,852,431	16,515,575.49	0.90

8.3.2 期末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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600157	永泰能源	221,810,728.45	105.43

中融中证煤炭指数分级证券投资基金2016年年度报告摘要

2	601088	中国神华	214,408,951.81	101.91
3	000983	西山煤电	177,467,427.43	84.35
4	601225	陕西煤业	135,905,998.25	64.60
5	601898	中煤能源	128,980,260.97	61.30
6	601699	潞安环能	117,249,306.61	55.73
7	600348	阳泉煤业	105,406,413.54	50.10
8	000937	冀中能源	83,917,292.35	39.89
9	600395	盘江股份	72,506,304.86	34.46
10	601011	宝泰隆	70,400,926.50	33.46
11	000552	靖远煤电	70,048,910.64	33.29
12	002128	露天煤业	68,442,280.85	32.53
13	601666	平煤股份	68,063,015.05	32.35
14	601001	大同煤业	65,241,736.28	31.01
15	600123	兰花科创	64,975,343.99	30.88
16	000571	新大洲A	56,240,139.00	26.73
17	600188	兖州煤业	55,479,534.72	26.37
18	000835	长城动漫	49,958,156.44	23.75
19	600997	开滦股份	48,442,267.85	23.02
20	600740	山西焦化	46,180,195.49	21.95
21	600971	恒源煤电	38,596,164.90	18.34
22	600397	安源煤业	37,342,705.57	17.75
23	000723	美锦能源	36,842,910.39	17.51
24	600508	上海能源	36,275,421.85	17.24
25	601101	昊华能源	32,008,657.99	15.21
26	000780	平庄能源	28,118,415.31	13.36
27	601015	陕西黑猫	26,246,261.50	12.47
28	600121	郑州煤电	26,199,546.36	12.45
29	600403	大有能源	22,013,654.61	10.46
30	600792	云煤能源	21,541,679.39	10.24
31	600714	金瑞矿业	19,760,163.09	9.39

32	600721	*ST百花	5,673,435.24	2.70
33	600333	长春燃气	4,700,400.88	2.23

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601088	中国神华	69,074,410.95	32.83
2	600157	永泰能源	57,260,702.35	27.22
3	000983	西山煤电	56,518,978.67	26.86
4	000835	长城动漫	48,515,511.26	23.06
5	601225	陕西煤业	43,616,810.34	20.73
6	601898	中煤能源	40,936,477.10	19.46
7	601699	潞安环能	36,961,482.39	17.57
8	600348	阳泉煤业	33,208,219.72	15.78
9	000937	冀中能源	26,805,345.83	12.74
10	600403	大有能源	23,462,227.31	11.15
11	600395	盘江股份	23,219,387.84	11.04
12	000552	靖远煤电	22,262,330.32	10.58
13	601666	平煤股份	21,607,974.89	10.27
14	601011	宝泰隆	20,954,547.90	9.96
15	601001	大同煤业	20,876,157.61	9.92
16	600123	兰花科创	20,632,032.98	9.81
17	002128	露天煤业	19,548,255.97	9.29
18	600188	兖州煤业	17,619,167.16	8.37
19	600997	开滦股份	15,461,146.14	7.35
20	600740	山西焦化	13,734,269.09	6.53
21	600971	恒源煤电	12,202,124.48	5.80
22	600508	上海能源	11,470,422.50	5.45
23	000723	美锦能源	11,153,813.79	5.30

24	000571	新大洲 A	10,566,435.02	5.02
25	000780	平庄能源	8,876,431.99	4.22
26	600121	郑州煤电	8,082,525.61	3.84
27	600792	云煤能源	8,071,757.71	3.84
28	600397	安源煤业	7,181,367.03	3.41
29	600333	长春燃气	6,988,866.89	3.32
30	600721	*ST百花	5,695,856.69	2.71
31	600714	金瑞矿业	5,432,185.92	2.58

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,268,150,272.14
卖出股票收入（成交）总额	734,446,227.85

注：“买入股票成本总额”和“卖出股票收入总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**8.11.1 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。

8.12.2 报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,417,312.99
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	64,243.88
5	应收申购款	8,823,776.10
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	10,305,332.97

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末指数投资前十名股票中无流通受限股票。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，各比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息**9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例	持有 份额	占总份 额比例
煤炭A级	725	1,638,826.17	1,104,962,815.00	93.00%	83,186,161.00	7.00%
煤炭B级	9,473	125,424.78	111,210,168.00	9.36%	1,076,938,808.00	90.64%
煤炭母基	2,705	41,009.61	53,982,507.82	48.66%	56,948,490.99	51.34%
合计	12,903	192,763.62	1,270,155,490.82	51.07%	1,217,073,459.99	48.93%

注：对于分级基金，下属分级份额比例的分母采用各自级别的份额，对于合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

9.2 期末上市基金前十名持有人

煤炭A级

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中国太平洋人寿保险股份有限公司— 传统—普通保险产品	219,044,148.00	18.44%
2	中国银河证券股份有限公司	133,331,215.00	11.22%
3	中国太平洋财产保险—传统—普通保 险产品-013C-CT001深	64,390,364.00	5.42%
4	中国太保集团股份有限公司—本级— 集团自有资金-012G-ZY001	44,323,728.00	3.73%
5	全国社保基金二零七组合	43,617,345.00	3.67%

6	华西证券股份有限公司	40,644,341.00	3.42%
7	全国社保基金一零零五组合	33,280,693.00	2.80%
8	银华基金—工商银行—中国工商银行股份有限公司私人银行部	27,048,433.00	2.28%
9	中荷人寿保险有限公司—分红险	25,000,000.00	2.10%
10	融通基金—广州农商银行—南方资本管理有限公司	23,307,503.00	1.96%

煤炭B级

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	黄山	39,750,261.00	3.35%
2	楼芳珍	18,957,700.00	1.60%
3	谭志全	18,055,200.00	1.52%
4	高琦	17,471,951.00	1.47%
5	平安资管—工商银行—创赢39—4号资产管理产品	15,999,955.00	1.35%
6	刘柏英	15,427,112.00	1.30%
7	上海偏锋投资有限公司—偏锋2期证券投资基金	14,843,058.00	1.25%
8	赵兴强	11,490,200.00	0.97%
9	戴宇衍	11,154,483.00	0.94%
10	沈爱芬	10,559,200.00	0.89%

注：以上信息中持有人名称及持有份额数量由中国证券登记结算有限责任公司提供。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本报告期末，本基金管理人的从业人员未持有本基金。

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

本报告期末，本基金管理人的从业人员未持有本基金。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

	煤炭A级	煤炭B级	煤炭母基

基金合同生效日(2015年06月25日)基金份额总额	—	—	211,452,235.90
本报告期期初基金份额总额	133,368,794.00	133,368,794.00	13,105,553.56
本报告期基金总申购份额	—	—	3,277,937,275.11
减：本报告期基金总赎回份额	—	—	1,150,668,259.45
本报告期基金拆分变动份额	1,054,780,182.00	1,054,780,182.00	-2,029,443,570.41
本报告期期末基金份额总额	1,188,148,976.00	1,188,148,976.00	110,930,998.81

注：拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换的变化份额及定期折算的变化份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 基金管理人的重大人事变动情况

本基金管理人于2016年5月6日发布公告，侯利鹏先生担任中融基金管理有限公司副总经理。

本基金管理人于2016年7月1日发布公告，代宝香女士担任中融基金管理有限公司副总经理。

本基金管理人于2016年7月30日发布公告，王瑶女士代任中融基金管理有限公司总经理，严九鼎先生不再担任中融基金管理有限公司总经理。

本基金管理人于2016年10月22日发布公告，杨凯先生担任中融基金管理有限公司总经理，自杨凯先生担任总经理之日起，董事长王瑶女士不再代任总经理职务。

本基金管理人于2016年5月18日经中融基金管理有限公司第二届股东会第二十三次会议审议通过，任命刘洋先生为董事，同意范韬先生辞去董事职务。

本基金管理人于2016年7月28日经中融基金管理有限公司第二届董事会第五十五次会议决议通过，同意严九鼎先生辞去公司总经理及董事职务。

本基金管理人于2016年10月24日经中融基金管理有限公司第二届股东会第二十六次会议审议通过，任命杨凯先生为董事。

公司其他高管人员未变动。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本基金托管人2016年7月29日发布《海通证券股份有限公司关于董事长辞职的公告》，海通证券股份有限公司董事长王开国同志于2016年7月29日离任。

本基金托管人2016年10月28日发布《海通证券股份有限公司第六届董事会第十九次会议决议公告》，选举周杰先生为海通证券股份有限公司董事长。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构是上会会计师事务所(特殊普通合伙)，报告期内本基金应支付给聘任会计师事务所的报酬共计人民币30,000.00元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金托管人于2016年11月29日发布《海通证券股份有限公司收到中国证券监督管理委员会〈行政处罚决定书〉的公告》。（详见上海证券交易所公告，公告编号：临2016-053）。基金托管人托管部门及托管高级管理人员不涉及该处罚。

本报告期基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚的情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况**11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
银河证券	2	2,280,010,927.77	75.93%	1,667,376.14	75.93%	-
东兴证券	2	520,605,979.35	17.34%	380,725.81	17.34%	新增
宏信证券	2	201,979,592.87	6.73%	147,706.92	6.73%	新增
海通证券	2	—	—	—	—	-

中信建投	2	—	—	—	—	新增
------	---	---	---	---	---	----

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

- i 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为。
- ii 公司财务状况良好。
- iii 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。
- iv 有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告。
- v 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

②券商专用交易单元选择程序：

- i 对交易单元候选券商的研究服务进行评估

本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

- ii 协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

中融基金管理有限公司
二〇一七年三月三十一日