

# 中融中证煤炭指数型证券投资基金

## 2022 年年度报告

2022 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:2023 年 03 月 30 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。

基金托管人海通股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年3月27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2022年1月1日起至2022年12月31日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	18
§5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	18
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	18
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	18
§6 审计报告	18
6.1 审计报告基本信息	18
6.2 审计报告的基本内容	18
§7 年度财务报表	21
7.1 资产负债表	21
7.2 利润表	23
7.3 净资产（基金净值）变动表	25
7.4 报表附注	28
§8 投资组合报告	66
8.1 期末基金资产组合情况	66
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	67
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	69
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	72
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	74
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	74
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	75
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	75
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	75
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	75
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	75

8.12 投资组合报告附注.....	75
§9 基金份额持有人信息.....	77
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	77
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	77
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	78
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.....	78
§10 开放式基金份额变动.....	78
§11 重大事件揭示.....	78
11.1 基金份额持有人大会决议.....	78
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.....	78
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	79
11.4 基金投资策略的改变.....	79
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	79
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.....	79
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	79
11.8 其他重大事件.....	81
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	83
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	83
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	83
§13 备查文件目录.....	83
13.1 备查文件目录.....	83
13.2 存放地点.....	83
13.3 查阅方式.....	83

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中融中证煤炭指数型证券投资基金	
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	2021年01月01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	513,438,784.74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	2021年06月11日	
下属分级基金的基金简称	中融煤炭A	中融煤炭C
下属分级基金场内简称	中融煤炭（基金扩位简称：煤炭LOF）	-
下属分级基金的交易代码	168204	016814
报告期末下属分级基金的份额总额	498,844,138.52份	14,594,646.22份

注：中融中证煤炭行业指数型证券投资基金由中融中证煤炭行业指数分级证券投资基金终止分级运作并变更而来。中融中证煤炭行业指数型证券投资基金基金合同于2021年1月1日生效。

### 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。

	<p>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。</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. 资产配置策略</li> <li>2. 股票投资组合构建</li> <li>3. 债券投资策略</li> <li>4. 股指期货投资策略</li> </ol>
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。

### 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	周妹云
	联系电话	010-56517000
	电子邮箱	zhoumeiyun@zrfunds.com.cn
客户服务电话	400-160-6000; 010-56517299	95553
传真	010-56517001	021-23187700
注册地址	深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路3088号中洲大厦3202、3203B	上海市广东路689号
办公地址	北京市东城区安定门外大街208号中粮置地广场A座11层	上海市黄浦区中山南路888号海通外滩金融广场
邮政编码	100102	200011
法定代表人	王瑶	周杰

### 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	上会会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市静安区威海路755号文新报业大厦25楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司、中融基金管理有限公司	北京市西城区太平桥大街17号、北京市东城区安定门外大街208号中粮置地广场A座11层

## §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	2022年		2021年01月01日(基金合同生效日)-2021年12月31日	
	中融煤炭A	中融煤炭C	中融煤炭A	中融煤炭C
本期已实现收益	148,303,505.61	-44,716.92	-36,311,164.33	-
本期利润	137,629,745.90	-2,224,707.73	-121,262,380.36	-
加权平均基金份额本期利润	0.2658	-0.2624	-0.4337	-
本期加权平均净值利润率	15.06%	-14.71%	-30.98%	-
本期基金份额净值增长率	15.23%	-13.41%	48.97%	-
3.1.2 期末数据和指标	2022年末		2021年末	

期末可供分配利润	-21,905,844.56	-645,345.87	-213,013,961.09	-
期末可供分配基金份额利润	-0.0439	-0.0442	-0.3496	-
期末基金资产净值	834,198,089.04	24,404,060.45	884,062,370.55	-
期末基金份额净值	1.672	1.672	1.451	-
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	2022年末		2021年末	
基金份额累计净值增长率	71.66%	-13.41%	48.97%	-

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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；

4、本基金自2022年9月28日起增加C类份额。

### 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

中融煤炭A

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	-15.51%	1.45%	-15.84%	1.50%	0.33%	-0.05%
过去六个月	-11.72%	1.86%	-14.11%	1.93%	2.39%	-0.07%
过去一年	15.23%	2.16%	10.04%	2.24%	5.19%	-0.08%
自基金合同生效起至今	71.66%	2.32%	55.04%	2.41%	16.62%	-0.09%

中融煤炭C

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	业绩比较基准收益	①-③	②-④
----	----------	-------------	----------	----------	-----	-----



		准差②	率③	率标准差④		
过去三个月	-15.51%	1.45%	-15.84%	1.50%	0.33%	-0.05%
自基金合同生效起至今	-13.41%	1.46%	-13.62%	1.51%	0.21%	-0.05%

### 3.2.2 自基金转型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

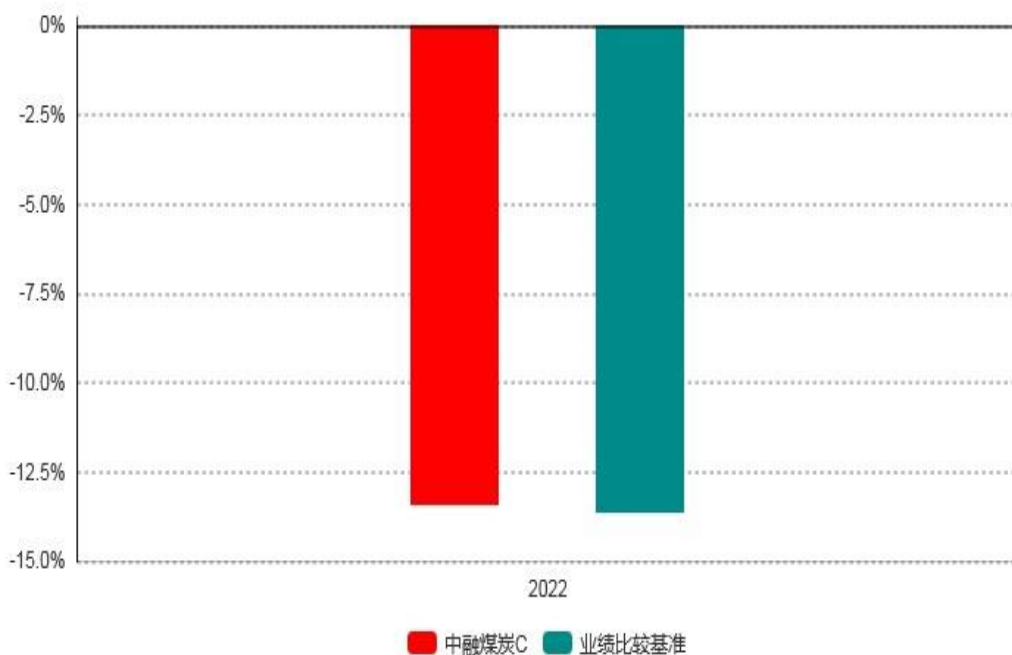
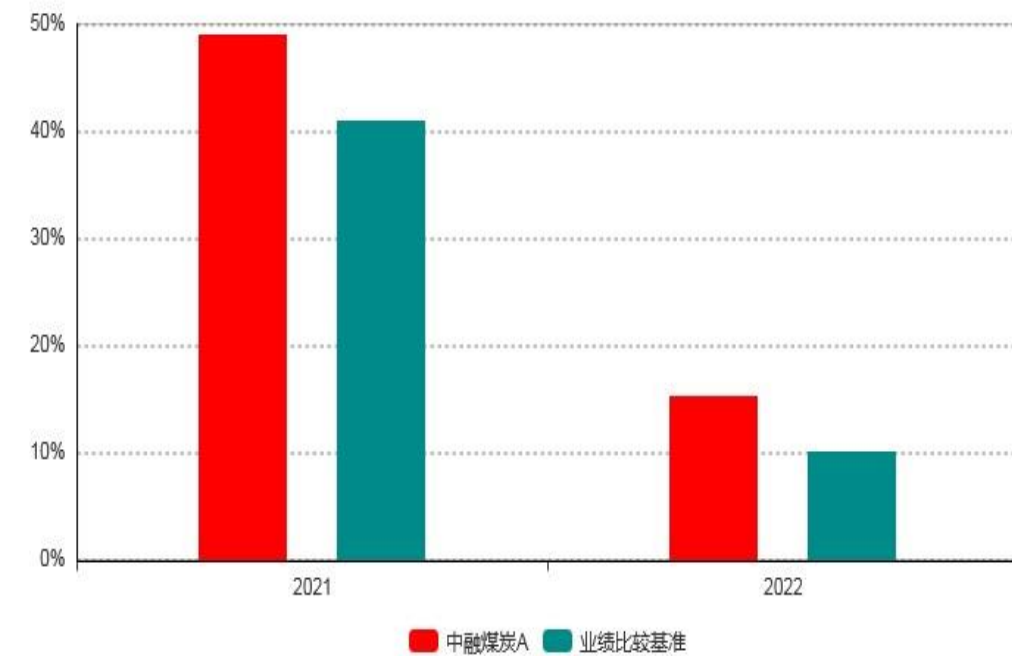


中融煤炭C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2022年09月29日-2022年12月31日)



注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。自2022年9月28日，本基金增加C类基金份额，自2022年9月29日起C类存在有效基金份额。

### 3.2.3 自基金转型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：本基金合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金自合同生效以来未进行利润分配。

## §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。截至2022年12月31日，中融基金管理有限公司共管理82只基金，包括中融货币市场基金、中融国企改革灵活配置混合型证券投资基金、中融新机遇灵活配置混合型证券投资基金、中融鑫起点灵活配置混合型证券投资基金、中融国证钢铁行业指数型证券投资基金、中融中证煤炭指数型证券投资基金、中融融安二号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、中融竞争优势股票型证券投资基金、中融现金增利货币市场基金、中融恒泰纯债债券型证券投资基金、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、中融鑫思路灵活配置混合型证券投资基金、中融物联网主题灵活配置混合型证券投资基金、中融盈泽中短债债券型证券投资基金、中融恒信纯债债券型证券投资基金、中融睿祥纯债债券型证券投资基金、中融核心成长灵活配置混合型证券投资基金、中融沪港深大消费主题灵活配置混合型发起式证券投资基金、中融聚商3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融鑫价值灵活配置混合型证券投资基金、中融季季红定期开放债券型证券投资基金、中融智选红利股票型证券投资基金、中融聚安3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融量化精选混合型基金中基金（FOF）、中融医疗健康精选混合型证券投资基金、中融聚业3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融恒裕纯债债券型证券投资基金、中融聚明3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融恒惠纯债债券型证券投资基金、中融央视财经50交易型开放式指数证券投资基金、中融央视财经50交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中融策略优选混合型证券投资基金、中融恒鑫纯债债券型证券投资基金、中融聚汇3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融高股息精选混合型证券投资基金、中融睿享86个月定期开放债券型证券投资基金、中融中证500交易型开放式指数证券投资基金、中融聚通3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融睿嘉39个月定期开放债券型证券投资基金、中融中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中融恒安纯债债券型证券投资基金、中融智选对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、中融品牌优选混合型证券投资基金、中融1-5年国开行债券指数证券投资基金、中融聚锦一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中融融慧双欣一年定期开放债券型证券投资基金、中融价值成长6个月持有期混合型证券投资基金、中融创业板两年定期开放混合型证券投资基金、中融成长优选混合型证券投资基金、中融景瑞一年持有期混合型证券投资

资基金、中融产业趋势一年定期开放混合型证券投资基金、中融景颐6个月持有期混合型证券投资基金、中融行业先锋6个月持有期混合型证券投资基金、中融鑫锐研究精选一年持有期混合型证券投资基金、中融景盛一年持有期混合型证券投资基金、中融恒益纯债债券型证券投资基金、中融恒阳纯债债券型证券投资基金、中融低碳经济3个月持有期混合型证券投资基金、中融景泓一年持有期混合型证券投资基金、中融金融鑫选3个月持有期混合型证券投资基金、中融匠心优选混合型证券投资基金、中融恒利纯债债券型证券投资基金、中融添益进取3个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)、中融高质量成长混合型证券投资基金、中融景惠混合型证券投资基金、中融聚优一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中融恒泽纯债债券型证券投资基金、中融研发创新混合型证券投资基金、中融优势产业混合型证券投资基金、中融医药消费混合型证券投资基金、中融成长先锋一年持有期混合型证券投资基金、中融益海30天滚动持有短债债券型证券投资基金、中融益泓90天滚动持有债券型证券投资基金、中融兴鸿优选一年封闭运作混合型证券投资基金、中融恒通纯债债券型证券投资基金、中融融盛双盈一年封闭运作债券型证券投资基金、中融养老目标日期2045三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)、中融中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金、中融恒润纯债债券型证券投资基金。

#### 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（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
赵菲	中融国证钢铁行业指数型证券投资基金、中融中证煤炭指数型证券投资基金、中融央视财经50交易型开放式指数证券投资基金、中融央视财经50交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中融中证500交易型开放式指数证券投资基金、中融中证500交易型开放式指数证券投资基	2021-01-01	-	14	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，研究生、硕士学位，具有基金从业资格，证券从业年限14年。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

	金联接基金、中融智选对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、中融智选红利股票型证券投资基金的基金经理及数量投资部总经理。				资部专户投资经理。2012年11月加入中融基金管理有限公司，现任数量投资部总经理。
--	--	--	--	--	---

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；基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。

（2）证券基金从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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、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《公平交易管理办法》，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的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022年，A股全年表现黯淡，宏观冲击成为关键影响因素，中证煤炭指数上涨10.20%。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

截至报告期末中融煤炭A基金份额净值为1.672元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为15.23%，同期业绩比较基准收益率为10.04%；截至报告期末中融煤炭C基金份额净值为1.672元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-13.41%，同期业绩比较基准收益率为-13.62%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

时光荏苒，从年初到年末，相信一直身处市场中的投资者，都充分感受到了现实和资本世界的冷暖。回望2022年，国内的核心矛盾主要是新冠疫情冲击+政府换届人事的确认+地产低迷，国外的核心矛盾主要是美联储加息+俄乌战争冲突。所以2022年全球资本市场主要交易估值模型的分母端，即资金的价格和数量；而2023年如果分母端维持平稳（即基准利率维持平稳），市场大概率会逐步回归交易估值模型的分子端，即企业的基本面和盈利水平。

2022年底在疫情适度放松下，全国迅速完成一次全面感染，春节后各行业的百废待兴让人恍惚，仿佛2个月前的疫情时代早已作古。但事实上大疫三年对个人、企业、地方政府乃至中央财政的现金流和资产负债表都影响很深，经济活动恢复后这些伤疤也需

要较长时间修复。正如一些专家所提到的疤痕效应，疫情对人类的心理也产生一些长久影响：“比如它使你更加不愿意去冒风险，会更加保守，让你重新看待和估计生命、自由、享乐和工作的价值”。这能解释银行近期发生的提前还房贷潮，以及本轮地产危机下的购房信心大幅下降。当然本轮地产低迷并非典型的供给过剩，也来源于地产高杠杆、高周转模式本身的强内部脆弱性。由此，虽然我们看好疫情后的消费复苏，但23年的重点是供给恢复，内需整体呈现慢复苏，因此不建议过度交易复苏。外需层面，市场担心美联储利率维持高位，外销总量扩张难以实现，份额扩张又受到逆全球化和中美关系影响，整体不太乐观。

2023年，外需较弱，内需慢复苏，经济弱复苏已俨然形成市场一致预期，世界经济增速的进一步下滑，波诡云谲的国际秩序以及全球产业链供应链的深刻变革，中国经济面临的三重压力（需求收缩、供给冲击和预期转弱）仍在加大而不是减小。幸而中央经济会议已经把23年的经济建设放在重中之重，而当务之急就是提振市场信心！

展望2023年，需要重点观察疫情的演变和消费复苏节奏，地产销售的走势和开发商现金流情况以及全球经济变化对中国外需的影响。复苏板块中，看好可选消费、医疗服务以及地产链中的消费建材；成长板块中，看好创新药、医疗器械，以内需为主的高端制造业（进口替代），前期充分调整后“新半军”中个别（储能电动车半导体军工）业绩能兑现，景气能持续标的；周期板块中，22年上游周期表现不错，尤其是煤炭，23年上半年美国通胀可能仍是问题，周期仍然有一定机会，看好煤炭价格调整到位后，焦煤紧随经济修复的行情。未来全球经济下行下的黄金以及港股的投资机会也值得关注。

另外国企改革或者国企的估值也值得讨论和关注，在传统资产定价理论中，我们是按照西方经济学的理论定价，前提是资产定性在了市场经济中。但如果企业经营、生产模式并不仅仅是纯市场经济模式，那定价就不能按照市场经济来估值了，其间可能蕴藏着市场错误定价的投资机会。

煤炭板块当前无论是PE还是PB都比较便宜，具有足够高的安全边际，我们仍然认为在需求恢复及供给有限的条件下，碳中和政策将致使煤价长期维持较高位置，煤炭企业的高盈利高分红高股息率也有望得到持续。

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《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》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。会计师事务所对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

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

### §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型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，中融中证煤炭指数型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型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、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，中融中证煤炭指数型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型证券投资基金2022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（2023）第1825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	中融中证煤炭指数型证券投资基金全体份额持

	有人
审计意见	<p>我们审计了中融中证煤炭指数型证券投资基金(以下简称“中融煤炭”)财务报表,包括2022年12月31日的资产负债表,2022年度的利润表、净资产(基金净值)变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为,后附中融煤炭的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》、《中融中证煤炭指数型证券投资基金基金合同》以及中国证券监督管理委员会和中国证券投资基金业协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2022年12月31日的财务状况以及2022年度的经营成果和净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>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。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于中融煤炭,并履行了职业道德方面的其他责任。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>
强调事项	-
其他事项	<p>我们提醒财务报表使用者关注后附财务报表附注中对编制基础的说明。同时该财务报表系中融煤炭管理人(以下简称“管理人”)根据《中融中证煤炭指数型证券投资基金基金合同》的规定为其基金份额持有人编制的,因此财务报表可能不适用于其他用途。本报告仅供管理人提供中融煤炭份额持有人和向中国证券监督管理委员会及其派出机构报送使用,不得用于其他目的。</p>
其他信息	<p>管理人对其他信息负责。其他信息包括中融煤炭2022年年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的</p>

	<p>审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报,我们应当报告该事实。在这方面,我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>管理人负责按照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》、《中融中证煤炭指数型证券投资基金基金合同》以及中国证券监督管理委员会和中国证券投资基金业协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,使其实现公允反映,并设计、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导致的重大错报。在编制财务报表时,管理人负责评估中融煤炭的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项,并运用持续经营假设,除非基金进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作: 1、识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险,设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风</p>

	<p>险。2、了解与审计相关的内部控制，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。3、评价管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。4、对管理人使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对导致对中融煤炭持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致中融煤炭不能持续经营。5、评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与管理人就中融煤炭的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	上会会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	胡治华	江嘉炜
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25楼	
审计报告日期	2023-03-23	

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：中融中证煤炭指数型证券投资基金

报告截止日：2022年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	68,505,702.18	66,699,657.72

结算备付金		623,619.67	1,263,036.81
存出保证金		1,069,455.08	1,789,989.59
交易性金融资产	7.4.7.2	791,857,039.55	823,685,659.13
其中：股票投资		789,397,986.15	823,685,659.13
基金投资		-	-
债券投资		2,459,053.40	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		151,747.66	-
应收股利		-	-
应收申购款		9,585,153.73	17,706,227.31
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	35,924.09
资产总计		871,792,717.87	911,180,494.65
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
		<b>2022年12月31日</b>	<b>2021年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
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		-	-
应付清算款		17.55	13,334,656.19
应付赎回款		11,693,548.41	11,648,054.95
应付管理人报酬		783,834.16	746,445.37
应付托管费		172,443.50	164,217.98
应付销售服务费		5,519.09	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		9.38	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	535,196.29	1,224,749.61
负债合计		13,190,568.38	27,118,124.10
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	678,538,961.26	805,235,375.60
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	180,063,188.23	78,826,994.95
净资产合计		858,602,149.49	884,062,370.55
负债和净资产总计		871,792,717.87	911,180,494.65

注：(1)报告截止日2022年12月31日，基金份额总额513,438,784.74份，其中A类基金份额的份额总额为498,844,138.52份，份额净值1.672元；C类基金份额的份额总额为14,594,646.22份，份额净值1.672元。

(2)以上比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》中的资产负债表格式的要求进行列示：2021年年度报告资产负债表中"应收利息"与"其他资产"项目的"本期末"余额合并列示在2022年年度报告资产负债表中"其他资产"项目的"上年度末"余额，2021年年度报告资产负债表中"应付交易费用"、"应付利息"与"其他负债"科目的"本期末"余额合并列示在2022年年度报告资产负债表"其他负债"项目的"上年度末"余额。

## 7.2 利润表

会计主体：中融中证煤炭指数型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022年01月01日至2 022年12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日(基 金合同生效日)至2 021年12月31日
一、营业总收入		146,925,376.09	-112,250,954.39
1.利息收入		1,454,325.80	713,418.63
其中：存款利息收入	7.4.7.9	1,445,682.10	713,418.63
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 入		8,643.70	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		146,762,757.42	-37,027,206.66
其中：股票投资收益	7.4.7.10	106,454,410.81	-41,321,131.82
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	-12,481.83	-
资产支持证券投资收 益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.12	-	-
衍生工具收益	7.4.7.13	-	-
股利收益	7.4.7.14	40,320,828.44	4,293,925.16
以摊余成本计量的金 融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益(损失 以“-”号填列)	7.4.7.15	-12,853,750.52	-84,951,216.03
4.汇兑收益(损失以“-”号填 列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填 列)	7.4.7.16	11,562,043.39	9,014,049.67



减：二、营业总支出		11,520,337.92	9,011,425.97
1. 管理人报酬		9,138,384.12	3,972,353.10
2. 托管费		2,010,444.53	873,917.76
3. 销售服务费		10,761.36	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		3.54	-
8. 其他费用	7.4.7.18	360,744.37	4,165,155.11
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		135,405,038.17	-121,262,380.36
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		135,405,038.17	-121,262,380.36
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		135,405,038.17	-121,262,380.36

注：以上比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》中的利润表格式的要求进行列示：2021年年度报告利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在2022年年度报告利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

### 7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：中融中证煤炭指数型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年12月31日

单位：人民币元

项目	本期			
	2022年01月01日至2022年12月31日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净	805,235,375.60	-	78,826,994.95	884,062,370.55

资产（基金净值）				
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	805,235,375.60	-	78,826,994.95	884,062,370.55
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-126,696,414.34	-	101,236,193.28	-25,460,221.06
（一）、综合收益总额	-	-	135,405,038.17	135,405,038.17
（二）、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）	-126,696,414.34	-	-34,168,844.89	-160,865,259.23
其中：1.基金申购款	3,148,992,019.03	-	1,101,018,050.28	4,250,010,069.31
2.基金赎回款	-3,275,688,433.37	-	-1,135,186,895.17	-4,410,875,328.54
（三）、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）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-

四、本期期末净资产（基金净值）	678,538,961.26	-	180,063,188.23	858,602,149.49
项目	上年度可比期间 2021年01月01日（基金合同生效日）至2021年12月31日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	419,165,563.64	-	-110,284,369.03	308,881,194.61
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	419,165,563.64	-	-110,284,369.03	308,881,194.61
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	386,069,811.96	-	189,111,363.98	575,181,175.94
（一）、综合收益总额	-	-	-121,262,380.36	-121,262,380.36
（二）、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）	386,069,811.96	-	310,373,744.34	696,443,556.30
其中：1.基金申购款	2,980,750,524.50	-	514,980,837.96	3,495,731,362.46
2.基金赎回款	-2,594,680,712.54	-	-204,607,093.62	-2,799,287,806.16
（三）、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)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	805,235,375.60	-	78,826,994.95	884,062,370.55

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

黄庆

李克

-----  
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 基金基本情况

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

中融中证煤炭指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)2015年5月5日证监许可(2015)814号文批准,由基金发起人中融基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《中融中证煤炭指数分级证券投资基金基金合同》(“基金合同”)发起,于2015年6月25日募集成立。本基金的基金管理人为中融基金管理有限公司,基金托管人为海通证券股份有限公司。

本基金募集期为2015年5月27日至2015年6月18日,本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,募集资金总额为人民币211,452,235.90元,有效认购户数为1,085户。其中,认购资金在募集期间产生的利息共计人民币20,556.44元,折合基金份额20,556.44份,按照基金合同的有关约定计入基金份额持有人的基金账户。本基金募集资金经上会会计师事务所(特殊普通合伙)验资。

自2022年9月28日起,本基金将增加C类基金份额(基金代码:016814),注册登记机构为中融基金管理有限公司,该类份额在申购时不收取申购费但从本类别基金资产中计提销售服务费。本基金增加C类基金份额后,原中融中证煤炭指数型证券投资基金的

基金份额全部自动延续为本基金A类基金份额，投资者可通过场内或场外两种方式对A类基金份额进行申购与赎回，但仅可通过场外方式对C类基金份额进行申购与赎回。

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》和基金合同等有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括中证煤炭指数的成份股、备选成份股、其他股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、固定收益资产(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)、资产支持证券、债券回购、银行存款等)、衍生工具(股指期货、权证等)及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金业绩比较基准为： $95\% \times \text{中证煤炭指数收益率} + 5\% \times \text{同期银行活期存款利率(税后)}$ 。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的《企业会计准则--基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称"企业会计准则")编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合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的要求，真实、完整地反映了本基金2022年12月31日的财务状况以及2022年度的经营成果和基金净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

以人民币为记账本位币，记账本位币单位为元。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

#### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

##### ① 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

##### a) 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

##### b) 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资、资产支持证券投资 and 基金投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

##### ② 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

#### (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### (3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来12个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额。

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；

未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具），按照公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。对于其他金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，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，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，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票投资、债券投资和权证投资等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值，估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，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大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 当金融工具不存在活跃市场，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。采用估值技术时，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；



(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或预期收益率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 转融通证券出借业务中，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益；

(8) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致本基金资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时予以确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 本基金的管理人报酬、托管费、销售服务费、标的指数许可使用费等按《基金合同》约定的方法进行计提。

(2) 卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率法逐日计提，若合同利率与实际利率差异较小，则采用合同利率计算确定利息支出。

(3) 其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

(4) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可进行收益分配；

(2) 本基金场外基金份额收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，登记在登记结算系统基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，持有人可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。登记在证券登记系统基金份额持有人深圳证券账户下的场内 A 类基金份额，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) 本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权, 由于本基金各类基金份额在费用收取上不同, 其对应的可分配收益可能有所不同;

(4) 法律法规或监管机关另有规定的, 从其规定。

#### 7.4.4.12 分部报告

无。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作, 本基金确定以下股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下:

(1) 对于证券交易所上市的股票, 若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况, 本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》, 根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、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流通受限股票, 根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》, 按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券、可分离债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种, 根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券、可分离债券和私募债券除外), 按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中央国债登记结算有限责任公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

根据《企业会计准则第22号--金融工具确认和计量》、《企业会计准则第23号--金融资产转移》、《企业会计准则第24号--套期会计》、《企业会计准则第37号--金融工具列报》(统称“新金融工具准则”)、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求, 本基金自2022年1月1日开始按照新金融工具准则进

行会计处理，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

于首次执行日（2022年1月1日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

(1) 以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币66,699,657.72元，自应收利息转入的重分类金额为人民币34,412.70元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币66,734,070.42元。

结算备付金于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币1,263,036.81元，自应收利息转入的重分类金额为人民币625.24元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币1,263,662.05元。

存出保证金于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币1,789,989.59元，自应收利息转入的重分类金额为人民币886.05元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币1,790,875.64元。

应收申购款于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币17,706,227.31元，自应收利息转入的重分类金额为人民币0.10元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，应收申购款于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币17,706,227.41元。

应收利息于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币35,924.09元，转出至银行存款的重分类金额为人民币34,412.70元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币625.24元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币886.05元，转出至应收申购款的重分类金额为人民币0.10元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

无。

### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局国家税务总局财税[1998]55号《关于证券投资基金税收问题的通知》、财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》、财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、国发[1985]19号发布和国务院令[2011]第588号修订的《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例》、国务院令[2005]第448号《国务院关于修改〈征收教育费附加的暂行规定〉的决定》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1、资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应

税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

2、对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。

3、对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴个人所得税，个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

4、对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

5、基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

6、基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免于缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

7、本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
活期存款	68,505,702.18	66,699,657.72
等于：本金	68,468,359.28	66,699,657.72
加：应计利息	37,342.90	-
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-

等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
其中：存款期限1个月以内	-	-
存款期限1-3个月	-	-
存款期限3个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	68,505,702.18	66,699,657.72

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022年12月31日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		869,054,363.47	-	789,397,986.15	-79,656,377.32
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	2,100,000.00	1,003.40	2,459,053.40	358,050.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	2,100,000.00	1,003.40	2,459,053.40	358,050.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		871,154,363.47	1,003.40	791,857,039.55	-79,298,327.32
项目		上年度末 2021年12月31日			

	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	890,130,235.93	-	823,685,659.13	-66,444,576.80
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	890,130,235.93	-	823,685,659.13	-66,444,576.80

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

#### 7.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
应收利息	-	35,924.09
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	35,924.09

#### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元



项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	52,090.39	56,916.29
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	220,656.18	1,090,023.45
其中：交易所市场	220,656.18	1,090,023.45
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	165,000.00	30,000.00
其他应付	97,449.72	47,809.87
合计	535,196.29	1,224,749.61

#### 7.4.7.7 实收基金

##### 7.4.7.7.1 中融煤炭A

金额单位：人民币元

项目 (中融煤炭A)	本期 2022年01月01日至2022年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	609,270,361.49	805,235,375.60
本期申购	2,352,189,942.74	3,108,565,353.60
本期赎回（以“-”号填列）	-2,462,616,165.71	-3,254,550,052.40
本期末	498,844,138.52	659,250,676.80

##### 7.4.7.7.2 中融煤炭C

金额单位：人民币元

项目 (中融煤炭C)	本期 2022年01月01日至2022年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	30,589,183.89	40,426,665.43

本期赎回（以“-”号填列）	-15,994,537.67	-21,138,380.97
本期末	14,594,646.22	19,288,284.46

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.8 未分配利润

##### 7.4.7.8.1 中融煤炭A

单位：人民币元

项目 (中融煤炭A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-213,013,961.09	291,840,956.04	78,826,994.95
本期利润	148,303,505.61	-10,673,759.71	137,629,745.90
本期基金份额交易产生的变动数	42,804,610.92	-84,313,939.53	-41,509,328.61
其中：基金申购款	-515,742,618.58	1,601,779,127.23	1,086,036,508.65
基金赎回款	558,547,229.50	-1,686,093,066.76	-1,127,545,837.26
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-21,905,844.56	196,853,256.80	174,947,412.24

##### 7.4.7.8.2 中融煤炭C

单位：人民币元

项目 (中融煤炭C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-	-	-
本期利润	-44,716.92	-2,179,990.81	-2,224,707.73
本期基金份额交易产生的变动数	-600,628.95	7,941,112.67	7,340,483.72
其中：基金申购款	-1,262,820.47	16,244,362.10	14,981,541.63
基金赎回款	662,191.52	-8,303,249.43	-7,641,057.91
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-645,345.87	5,761,121.86	5,115,775.99

#### 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至 2022年12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日（基金合同生效 日）至2021年12月31日
活期存款利息收入	1,401,960.58	685,404.44
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	18,962.54	17,532.43
其他	24,758.98	10,481.76
合计	1,445,682.10	713,418.63

**7.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至 2022年12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日（基金合同生效 日）至2021年12月31日
卖出股票成交总额	1,576,616,357.23	1,221,670,202.43
减：卖出股票成本总额	1,465,976,580.61	1,262,991,334.25
减：交易费用	4,185,365.81	-
买卖股票差价收入	106,454,410.81	-41,321,131.82

**7.4.7.11 债券投资收益****7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2 022年12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日（基金合同生效 日）至2021年12月31日
债券投资收益——利息收入	11,374.52	-
债券投资收益——买卖债券 （债转股及债券到期兑付） 差价收入	-23,856.35	-
债券投资收益——赎回差价	-	-

收入		
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	-12,481.83	-

#### 7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022 年12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日（基金合同生效日） 至2021年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	57,311,313.70	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	57,075,041.70	-
减：应计利息总额	260,013.70	-
减：交易费用	114.65	-
买卖债券差价收入	-23,856.35	-

#### 7.4.7.12 贵金属投资收益

##### 7.4.7.12.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

##### 7.4.7.12.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

#### 7.4.7.13 衍生工具收益

注：无。

#### 7.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2022年01月01日至 2022年12月31日	2021年01月01日（基金合同生 效日）至2021年12月31日
股票投资产生的股利收益	40,320,828.44	4,293,925.16
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	40,320,828.44	4,293,925.16

#### 7.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年01月01日至20 22年12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日（基金合同生效日） 至2021年12月31日
1.交易性金融资产	-12,853,750.52	-84,951,216.03
——股票投资	-13,211,800.52	-84,951,216.03
——债券投资	358,050.00	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允 价值变动产生的预估增 值税	-	-
合计	-12,853,750.52	-84,951,216.03

#### 7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至 2022年12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日（基金合同生效 日）至2021年12月31日
基金赎回费收入	11,562,043.39	9,014,049.67

合计	11,562,043.39	9,014,049.67
----	---------------	--------------

**7.4.7.17 信用减值损失**

注：无。

**7.4.7.18 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至 2022年12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日（基金合同生效 日）至2021年12月31日
审计费用	45,000.00	30,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	12,976.61	12,011.80
指数使用费	182,767.76	167,809.87
上市费	-	35,000.00
交易费用	-	3,800,333.44
合计	360,744.37	4,165,155.11

**7.4.7.19 分部报告**

无。

**7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****7.4.8.1 或有事项**

无。

**7.4.8.2 资产负债表日后事项**

无。

**7.4.9 关联方关系**

关联方名称	与本基金的关系
上海融晟投资有限公司	基金管理人股东
中融（北京）资产管理有限公司	基金管理人子公司

中融国际信托有限公司	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	基金托管人、基金销售机构

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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年01月01日（基金合同生效日） 至2021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 股份有限 公司	1,235,851,460.94	41.27%	1,040,910,330.66	33.67%

##### 7.4.10.1.2 权证交易

注：无。

##### 7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年01月01日（基金合同生效日） 至2021年12月31日	
	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例
海通证券	114,126,341.70	100.00%	-	-

股份有限 公司				
------------	--	--	--	--

## 7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名 称	本期 2022年01月01日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年01月01日（基金合同生效日） 至2021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 股份有限 公司	57,000,000.00	100.00%	-	-

## 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名 称	本期 2022年01月01日至2022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
海通证券 股份有限 公司	903,773.18	39.33%	-	-
关联方名 称	上年度可比期间 2021年01月01日（基金合同生效日）至2021年12月31日			
	当期佣金	占当期 佣金总 量的比	期末应付佣金余额	占期末应 付佣金总 额的比例



		例		
海通证券股份有限公司	761,214.02	33.67%	575,034.88	52.75%

注：上述佣金按市场佣金率计算。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日 至2022年12月31 日	上年度可比期间 2021年01月01日（基金合同 生效日）至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	9,138,384.12	3,972,353.10
其中：支付销售机构的客户维护费	3,842,043.73	1,508,681.44

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×1.00%/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。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日 至2022年12月31 日	上年度可比期间 2021年01月01日（基金合同生 效日）至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,010,444.53	873,917.76

注：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×0.22%/当年天数。

### 7.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

自2022年9月28日起，本基金增加收取销售服务费的C类基金份额。本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费将专门用于本基金C类基金份额的销售与基金份额持有人服务。

支付基金销售机构的C类基金份额销售服务费按前一日C类基金资产净值0.30%的年费率计提，每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付给注册登记机构，再由注册登记机构代付给销售机构。A类基金份额不收取销售服务费。C类基金销售服务费的计算公式为：C类基金份额的日销售服务费=前一日C类基金资产净值×0.30%/当年天数。

### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

#### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

#### 7.4.10.4.2 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

注：无。

### 7.4.10.5 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 2022年01月01日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年01月01日（基金合同生效日） 至2021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
海通证券股份有限公司	68,505,702.18	1,401,960.58	66,699,657.72	685,404.44

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行同业利率计息。本基金用于证券交易结算的资金通过托管人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。

### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况--固定净值型货币市场基金之外的基金

注：无。

#### 7.4.12 期末（2022年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688506	百利天恒	2022-12-28	6个交易日	新股未流通	24.70	24.70	15,622	385,863.40	385,863.40	-
688498	源杰科技	2022-12-14	6个月	首次公开发行限售	100.66	113.13	1,582	159,244.12	178,971.66	-
688203	海正生材	2022-08-09	6个月	首次公开发行限售	16.68	15.09	5,761	96,093.48	86,933.49	-
688252	天德钰	2022-09-20	6个月	首次公开发行限售	21.68	15.78	5,201	112,757.68	82,071.78	-
688292	浩瀚深度	2022-08-09	6个月	首次公开发行限售	16.56	14.67	4,503	74,569.68	66,059.01	-

301095	广立微	2022-07-28	6个月	首次公开发售	58.00	86.49	740	42,920.00	64,002.60	-
301308	江波龙	2022-07-27	6个月	首次公开发售	55.67	56.72	819	45,593.73	46,453.68	-
301267	华夏眼科	2022-10-26	6个月	首次公开发售	50.88	66.20	653	33,224.64	43,228.60	-
301327	华宝新能	2022-09-08	6个月	首次公开发售	237.50	176.97	242	57,475.00	42,826.74	-
301367	怡和嘉业	2022-10-21	6个月	首次公开发售	119.88	175.78	223	26,733.24	39,198.94	-
301165	锐捷网络	2022-11-14	6个月	首次公开发售	32.38	31.61	1,013	32,800.94	32,020.93	-
301195	北路智控	2022-07-25	6个月	首次公开发售	71.17	73.04	330	23,486.10	24,103.20	-
301330	熵基科技	2022-08-10	6个月	首次公开发售	43.32	31.31	694	30,064.08	21,729.14	-
301152	天力锂能	2022-08-19	6个月	首次公开	57.00	46.64	433	24,681.00	20,195.12	-

				发行 限售						
3013 91	卡莱 特	2022- 11-24	6个 月	首次 公开发 行 限售	96.00	80.97	247	23,71 2.00	19,99 9.59	-
3013 49	信德 新材	2022- 08-30	6个 月	首次 公开发 行 限售	138.8 8	103.5 2	180	24,99 8.40	18,63 3.60	-
3011 71	易点 天下	2022- 08-10	6个 月	首次 公开发 行 限售	18.18	17.72	985	17,90 7.30	17,45 4.20	-
3012 96	新巨 丰	2022- 08-26	6个 月	首次 公开发 行 限售	18.19	14.90	1,042	18,95 3.98	15,52 5.80	-
3012 23	中荣 股份	2022- 10-13	6个 月	首次 公开发 行 限售	26.28	18.13	815	21,41 8.20	14,77 5.95	-
3013 28	维峰 电子	2022- 08-30	6个 月	首次 公开发 行 限售	78.80	76.96	191	15,05 0.80	14,69 9.36	-
3011 39	元道 通信	2022- 06-30	6个 月	首次 公开发 行 限售	38.46	25.31	566	21,76 8.36	14,32 5.46	-
3013 35	天元 宠物	2022- 11-11	6个 月	首次 公开发 行 限售	49.98	33.82	420	20,99 1.60	14,20 4.40	-

301377	鼎泰高科	2022-11-11	6个月	首次公开发售	22.88	17.63	770	17,617.60	13,575.10	-
301311	昆船智能	2022-11-23	6个月	首次公开发售	13.88	15.86	832	11,548.16	13,195.52	-
301230	泓博医药	2022-10-21	6个月	首次公开发售	40.00	48.32	269	10,760.00	12,998.08	-
301338	凯格精机	2022-08-08	6个月	首次公开发售	46.33	48.99	257	11,906.81	12,590.43	-
301280	珠城科技	2022-12-19	6个月	首次公开发售	67.40	44.80	279	18,804.60	12,499.20	-
301366	一博科技	2022-09-19	6个月	首次公开发售	65.35	45.09	268	17,513.80	12,084.12	-
301283	聚胶股份	2022-08-26	6个月	首次公开发售	52.69	51.41	235	12,382.15	12,081.35	-
301277	新天地	2022-11-09	6个月	首次公开发售	27.00	25.78	439	11,853.00	11,317.42	-
301379	天山电子	2022-10-19	6个月	首次公开	31.51	24.63	449	14,147.99	11,058.87	-

				发行 限售							
3012 82	金禄 电子	2022- 08-18	6个 月	首次 公开发 行 限售	30.38	25.25	434	13,18 4.92	10,95 8.50	-	
3013 61	众智 科技	2022- 11-08	6个 月	首次 公开发 行 限售	26.44	20.96	517	13,66 9.48	10,83 6.32	-	
3013 06	西测 测试	2022- 07-19	6个 月	首次 公开发 行 限售	43.23	42.29	255	11,02 3.65	10,78 3.95	-	
3012 65	华新 环保	2022- 12-08	6个 月	首次 公开发 行 限售	13.28	11.40	819	10,87 6.32	9,33 6.60	-	
3011 76	逸豪 新材	2022- 09-21	6个 月	首次 公开发 行 限售	23.88	16.89	544	12,99 0.72	9,18 8.16	-	
3012 27	森鹰 窗业	2022- 09-16	6个 月	首次 公开发 行 限售	38.25	29.49	284	10,86 3.00	8,37 5.16	-	
3013 26	捷邦 科技	2022- 09-09	6个 月	首次 公开发 行 限售	51.72	36.62	227	11,74 0.44	8,31 2.74	-	
3013 98	星源 卓镁	2022- 12-08	6个 月	首次 公开发 行 限售	34.40	28.94	255	8,77 2.00	7,37 9.70	-	

301313	凡拓数创	2022-09-22	6个月	首次公开发行限售	25.25	29.14	247	6,236.75	7,197.58	-
301276	嘉曼服饰	2022-09-01	6个月	首次公开发行限售	40.66	22.61	303	12,319.98	6,850.83	-
301359	东南电子	2022-11-02	6个月	首次公开发行限售	20.84	19.90	328	6,835.52	6,527.20	-
301388	欣灵电气	2022-10-26	6个月	首次公开发行限售	25.88	21.60	292	7,556.96	6,307.20	-
301319	唯特偶	2022-09-22	6个月	首次公开发行限售	47.75	53.27	115	5,491.25	6,126.05	-
301309	万得凯	2022-09-08	6个月	首次公开发行限售	39.00	24.46	228	8,892.00	5,576.88	-
301233	盛帮股份	2022-06-24	6个月	首次公开发行限售	41.52	34.30	158	6,560.16	5,419.40	-
301316	慧博云通	2022-09-29	6个月	首次公开发行限售	7.60	14.32	359	2,728.40	5,140.88	-

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票



注：无。

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：无。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人实行全面、系统的风险管理，风险管理覆盖公司所有战略环节、业务环节和操作环节，构建了分工明确、相互协作、彼此牵制的风险管理组织结构，形成了由四大防线共同筑成的风险管理体系。本基金管理人的各个业务部门为第一道防线，各业务部门总监作为风险责任人，负责制订本部门的作业流程以及风险控制措施；公司专属风险管理部门法律合规部和风险管理部为第二道防线，负责对公司业务的法律合规风险、投资管理风险和运作风险进行监控管理；公司经营管理层和公司内控及风险管理委员会为第三道防线，负责对风险状况进行全面监督并及时制定相应的对策和实施监控措施；董事会下属的风险与合规委员会为第四道防线，负责审查公司对公司内外部风险识别、评估和分析等情况，及公司内部控制、风险管理政策、风险管理制度的执行情况等。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的信用评级，通过单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。

按信用评级列示的债券、资产支持证券和同业存单的投资情况如下表所示，如无表格，则本基金于本期末及上年年末未持有除国债、地方政府债、政策性金融债、央行票据以外的债券。

#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

#### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

#### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
AAA	2,459,053.40	-
AAA以下	-	-
未评级	-	-
合计	2,459,053.40	-

注：长期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由债券发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。以上按长期信用评级的债券投资中不包含国债、地方政府债、政策性金融债、央行票据。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注7.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注7.4.12.3中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在1个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时关于未来现金流的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

## 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年1 2月31 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	68,505,702.18	-	-	-	68,505,702.18
结算备付金	623,619.67	-	-	-	623,619.67
存出保证金	1,069,455.08	-	-	-	1,069,455.08
交易性金融资产	2,459,053.40	-	-	789,397,986.15	791,857,039.55
应收清算款	-	-	-	151,747.66	151,747.66
应收申购款	-	-	-	9,585,153.73	9,585,153.73
资产总计	72,657,830.33	-	-	799,134,887.54	871,792,717.87
负债					
应付清算款	-	-	-	17.55	17.55
应付赎回款	-	-	-	11,693,548.41	11,693,548.41
应付管理人报酬	-	-	-	783,834.16	783,834.16
应付托管费	-	-	-	172,443.50	172,443.50
应付销售服务费	-	-	-	5,519.09	5,519.09
应交税费	-	-	-	9.38	9.38
其他负债	-	-	-	535,196.29	535,196.29
负债总计	-	-	-	13,190,568.38	13,190,568.38
利率敏感度缺口	72,657,830.33	-	-	785,944,319.16	858,602,149.49

上年度末 2021年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	66,699,657.72	-	-	-	66,699,657.72
结算备付金	1,263,036.81	-	-	-	1,263,036.81
存出保证金	1,789,989.59	-	-	-	1,789,989.59
交易性金融资产	-	-	-	823,685,659.13	823,685,659.13
应收申购款	30.00	-	-	17,706,197.31	17,706,227.31
其他资产	-	-	-	35,924.09	35,924.09
资产总计	69,752,714.12	-	-	841,427,780.53	911,180,494.65
负债					
应付清算款	-	-	-	13,334,656.19	13,334,656.19
应付赎回款	-	-	-	11,648,054.95	11,648,054.95
应付管理人报酬	-	-	-	746,445.37	746,445.37
应付托管费	-	-	-	164,217.98	164,217.98
其他负债	-	-	-	1,224,749.61	1,224,749.61
负债总计	-	-	-	27,118,124.10	27,118,124.10
利率敏感度缺口	69,752,714.12	-	-	814,309,656.43	884,062,370.55

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的情况下，利率发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值可参考的公允价值产生的影响。本基金于本报告期末未持有债券投资或持有的债券投资占比并不重大，因而市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于上市交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日		上年度末 2021年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	789,397,986.15	91.94	823,685,659.13	93.17
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	2,459,053.40	0.29	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-

衍生金融资产				
—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	791,857,039.55	92.23	823,685,659.13	93.17

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1、估测组合市场价格风险的敏感性为考察沪深300指数变动时，因股票资产变动导致对基金资产净值的影响金额；		
	2、假定沪深300指数变化5%，其他市场变量不变；		
	3、Beta系数是根据组合在过去一年的净值数据和沪深300指数数据回归得出，对于成立不足一年的组合，取自成立以来的数据计算。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
	沪深300指数上升5%	33,046,166.78	12,861,991.26
	沪深300指数下降5%	-33,046,166.78	-12,861,991.26

注：本基金管理人运用定量分析方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 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。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	790,358,045.66	820,725,874.88
第二层次	385,863.40	298,063.11
第三层次	1,113,130.49	2,661,721.14
合计	791,857,039.55	823,685,659.13

注：根据《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》的要求，本基金期末使用亚式期权模型计算流动性折扣进行估值的尚处于限售期股票投资、违约债、非指数收益法估值长期停牌股票等估值模型中使用不可观察输入值进行估值的金融资产公允价值由第二层次划分为第三层次，同时本基金对上年度末可比数字按照此标准进行了追溯调整。

#### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券、基金等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内股票涨跌停等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

#### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

##### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	2,661,721.14	2,661,721.14
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	2,483,912.11	2,483,912.11



转出第三层次	-	5,246,353.88	5,246,353.88
当期利得或损失总额	-	1,213,851.12	1,213,851.12
其中：计入损益的利得或损失	-	1,213,851.12	1,213,851.12
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,113,130.49	1,113,130.49
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-87,589.50	-87,589.50
项目	上年度可比同期 2021年01月01日（基金合同生效日）至2021年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	1,434,033.71	1,434,033.71
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	1,541,418.93	1,541,418.93
转出第三层次	-	2,009,226.38	2,009,226.38
当期利得或损失总额	-	1,695,494.88	1,695,494.88
其中：计入损益的利得或损失	-	1,695,494.88	1,695,494.88
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	2,661,721.14	2,661,721.14
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	1,219,782.54	1,219,782.54

## 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售期股票	1,113,130.49	平均价格亚式期权模型	股票在剩余限售期内的股价的预期年化波动率	0.1891%-2.4756%	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售期股票	2,661,721.14	平均价格亚式期权模型	股票在剩余限售期内的股价的预期年化波动率	0.2552%-2.7417%	负相关

## 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

## 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

## 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## §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	789,397,986.15	90.55

	其中：股票	789,397,986.15	90.55
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,459,053.40	0.28
	其中：债券	2,459,053.40	0.28
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	69,129,321.85	7.93
8	其他各项资产	10,806,356.47	1.24
9	合计	871,792,717.87	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（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	583,464,224.48	67.96
C	制造业	101,265,105.05	11.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	71,830,693.98	8.37
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	30,350,754.00	3.53
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	786,910,777.51	91.65

### 8.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,131,585.65	0.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	920.48	0.00
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	285,583.71	0.03
J	金融业	1,341.45	0.00
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	23,782.03	0.00
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	43,228.60	0.01
R	文化、体育和娱乐业	766.72	0.00
S	综合	-	-
	合计	2,487,208.64	0.29

### 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(元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	601225	陕西煤业	4,436,280	82,426,082.40	9.60
2	601088	中国神华	2,935,767	81,085,884.54	9.44
3	600157	永泰能源	46,948,166	71,830,693.98	8.37
4	600188	兖矿能源	1,932,700	64,900,066.00	7.56
5	000983	山西焦煤	4,328,238	50,423,972.70	5.87
6	000723	美锦能源	5,485,289	49,477,306.78	5.76
7	601699	潞安环能	2,528,530	42,605,730.50	4.96
8	600348	华阳股份	2,541,035	36,209,748.75	4.22
9	601898	中煤能源	3,867,840	33,340,780.80	3.88
10	601666	平煤股份	2,935,401	31,731,684.81	3.70
11	600546	山煤国际	2,094,600	30,350,754.00	3.53
12	600985	淮北矿业	2,097,160	26,843,648.00	3.13
13	601001	晋控煤业	1,768,385	21,149,884.60	2.46
14	600123	兰花科创	1,448,403	19,321,696.02	2.25
15	600740	山西焦化	2,707,040	14,645,086.40	1.71
16	000937	冀中能源	2,240,052	14,246,730.72	1.66
17	601918	新集能源	3,284,484	13,761,987.96	1.60
18	000552	靖远煤电	3,179,635	9,984,053.90	1.16
19	601011	宝泰隆	2,833,653	9,832,775.91	1.15

20	600395	盘江股份	1,360,839	9,144,838.08	1.07
21	600997	开滦股份	1,342,088	9,099,356.64	1.06
22	600971	恒源煤电	1,267,892	9,078,106.72	1.06
23	600508	上海能源	610,915	8,754,411.95	1.02
24	603113	金能科技	903,480	8,194,563.60	0.95
25	601015	陕西黑猫	1,726,464	7,838,146.56	0.91
26	601101	昊华能源	1,217,157	7,522,030.26	0.88
27	600121	郑州煤电	1,287,321	6,488,097.84	0.76
28	600758	辽宁能源	1,396,794	5,349,721.02	0.62
29	600403	大有能源	1,010,400	4,657,944.00	0.54
30	600397	安源煤业	1,464,397	4,437,122.91	0.52
31	600792	云煤能源	627,628	2,177,869.16	0.25

### 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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	688475	萤石网络	18,883	489,636.19	0.06
2	688506	百利天恒	15,622	385,863.40	0.04
3	688498	源杰科技	1,582	178,971.66	0.02
4	301361	众智科技	5,169	115,134.16	0.01
5	688496	清越科技	12,000	108,960.00	0.01
6	301176	逸豪新材	5,431	94,661.79	0.01
7	688203	海正生材	5,761	86,933.49	0.01
8	688409	富创精密	800	86,488.00	0.01
9	688252	天德钰	5,201	82,071.78	0.01
10	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.01
11	688292	浩瀚深度	4,503	66,059.01	0.01
12	301095	广立微	740	64,002.60	0.01
13	301308	江波龙	819	46,453.68	0.01
14	301267	华夏眼科	653	43,228.60	0.01

15	301327	华宝新能	242	42,826.74	0.00
16	301367	怡和嘉业	223	39,198.94	0.00
17	301165	锐捷网络	1,013	32,020.93	0.00
18	301195	北路智控	400	29,332.20	0.00
19	301152	天力锂能	526	24,677.72	0.00
20	301330	熵基科技	694	21,729.14	0.00
21	301391	卡莱特	247	19,999.59	0.00
22	301349	信德新材	180	18,633.60	0.00
23	301171	易点天下	985	17,454.20	0.00
24	688416	恒烁股份	415	15,774.15	0.00
25	301296	新巨丰	1,042	15,525.80	0.00
26	301223	中荣股份	815	14,775.95	0.00
27	301328	维峰电子	191	14,699.36	0.00
28	301139	元道通信	566	14,325.46	0.00
29	301335	天元宠物	420	14,204.40	0.00
30	301097	天益医疗	249	14,063.52	0.00
31	301377	鼎泰高科	770	13,575.10	0.00
32	301311	昆船智能	832	13,195.52	0.00
33	301230	泓博医药	269	12,998.08	0.00
34	301338	凯格精机	257	12,590.43	0.00
35	301280	珠城科技	279	12,499.20	0.00
36	301366	一博科技	268	12,084.12	0.00
37	301283	聚胶股份	235	12,081.35	0.00
38	301277	新天地	439	11,317.42	0.00
39	301379	天山电子	449	11,058.87	0.00
40	301282	金禄电子	434	10,958.50	0.00
41	301306	西测测试	255	10,783.95	0.00
42	301265	华新环保	819	9,336.60	0.00
43	301227	森鹰窗业	284	8,375.16	0.00
44	301326	捷邦科技	227	8,312.74	0.00
45	301398	星源卓镁	255	7,379.70	0.00

46	301313	凡拓数创	247	7,197.58	0.00
47	301276	嘉曼服饰	303	6,850.83	0.00
48	301359	东南电子	328	6,527.20	0.00
49	301388	欣灵电气	292	6,307.20	0.00
50	301319	唯特偶	115	6,126.05	0.00
51	301309	万得凯	228	5,576.88	0.00
52	301233	盛帮股份	158	5,419.40	0.00
53	301316	慧博云通	359	5,140.88	0.00
54	301268	铭利达	41	2,058.61	0.00
55	001236	弘业期货	99	1,341.45	0.00
56	001258	立新能源	88	920.48	0.00
57	001330	博纳影业	64	766.72	0.00

#### 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	601225	陕西煤业	145,388,461.80	16.45
2	601088	中国神华	141,818,139.79	16.04
3	600157	永泰能源	127,831,184.16	14.46
4	600188	兖矿能源	116,804,599.01	13.21
5	000723	美锦能源	103,180,269.24	11.67
6	000983	山西焦煤	86,668,887.37	9.80
7	601699	潞安环能	61,019,511.43	6.90
8	600348	华阳股份	57,662,061.04	6.52
9	601898	中煤能源	56,812,259.98	6.43
10	601666	平煤股份	56,618,158.82	6.40
11	600546	山煤国际	50,892,356.00	5.76
12	600985	淮北矿业	47,401,685.40	5.36
13	601001	晋控煤业	41,729,706.29	4.72



14	600123	兰花科创	33,201,561.77	3.76
15	600740	山西焦化	26,049,937.04	2.95
16	601918	新集能源	25,829,449.99	2.92
17	000937	冀中能源	25,110,733.67	2.84
18	000552	靖远煤电	19,973,575.00	2.26
19	601011	宝泰隆	18,195,472.00	2.06
20	600395	盘江股份	18,002,791.24	2.04

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	601225	陕西煤业	175,600,905.80	19.86
2	601088	中国神华	163,822,597.44	18.53
3	600157	永泰能源	125,199,921.00	14.16
4	600188	兖矿能源	120,138,644.31	13.59
5	000723	美锦能源	103,915,234.92	11.75
6	000983	山西焦煤	88,831,060.91	10.05
7	600348	华阳股份	65,453,782.00	7.40
8	601699	潞安环能	64,335,725.56	7.28
9	601898	中煤能源	57,428,334.41	6.50
10	601666	平煤股份	53,755,524.38	6.08
11	600546	山煤国际	52,282,731.24	5.91
12	600985	淮北矿业	49,159,832.00	5.56
13	002128	电投能源	44,351,436.75	5.02
14	601001	晋控煤业	43,098,117.36	4.88
15	600123	兰花科创	33,899,056.71	3.83
16	600740	山西焦化	28,337,541.29	3.21
17	601918	新集能源	27,594,179.00	3.12
18	000937	冀中能源	26,021,755.22	2.94

19	600532	*ST未来	21,036,350.01	2.38
20	600395	盘江股份	19,909,840.05	2.25
21	601011	宝泰隆	17,950,413.00	2.03
22	603113	金能科技	17,788,404.99	2.01

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	1,444,900,708.15
卖出股票收入（成交）总额	1,576,616,357.23

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	2,459,053.40	0.29
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,459,053.40	0.29

#### 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
----	------	------	-------	------	--------------

1	110088	淮22转债	21,000	2,459,053.40	0.29
---	--------	-------	--------	--------------	------

### 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

注：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

注：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

注：本基金本报告期末未持有权证。

### 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

注：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

注：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 报告期内基金投资的前十名证券除兖矿能源(600188),华阳股份(600348)外其他证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。济宁市能源局2022年08月19日发布对兖矿能源集团股份有限公司的处罚(鲁(济)煤安罚(2022)070号),济宁市能源局2022年08月09日发布对兖矿能源集团股份有限公司的处罚,国家矿山安全监察局山东局2022年10月31日发布对兖矿能源集团股份有限公司的处罚,国家矿山安全监察局山东局2022年10月31日发布对兖矿能源集团股份有限公司的处罚,山西省应急管理厅2022年07月26日发布对山西华阳集团新能股份有限公司的处罚(晋应急函(2022)159号),山西省应急管理厅2022年07月26日发布对山西华阳集团新能股份有限公司的处罚,寿阳县交通运输局2022年08月15日发布对山西华阳集团新能股份有限公司的处罚(晋寿交执法运罚(2022)012号),寿阳县交通运输局2022年08月15日发布对山西华阳集团新能股份有限公司的处罚(晋寿交执法运罚(2022)011号),寿阳县交通运输局2022年08月15日发布对山西华阳集团新能股份有限公司的处罚(晋寿交执法运罚(2022)010号)。前述发行主体受到的处罚未影响其正常业务运作,上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的规定。**

**8.12.2 基金投资的前十名股票未超过基金合同规定的备选股票库。**

**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	1,069,455.08
2	应收清算款	151,747.66
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	9,585,153.73
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,806,356.47

**8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

注：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**

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限股票。

**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**

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	688506	百利天恒	385,863.40	0.04	新股未上市
2	688498	源杰科技	178,971.66	0.02	首次公开发行限售
3	301361	众智科技	10,836.32	0.00	首次公开发行限售

**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
中融煤炭A	19,072	2,615.56	369,371.74	0.07%	498,474,766.78	99.93%
中融煤炭C	6,016	2,425.97	21,387.92	0.15%	14,573,258.30	99.85%
合计	19,673	2,609.76	390,759.66	0.08%	513,048,025.08	99.92%

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

中融煤炭A

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	邓建民	2,807,915.00	22.19%
2	吴尚平	844,644.00	6.68%
3	蔡雄民	500,000.00	3.95%
4	张树兵	490,411.00	3.88%
5	汪洋	340,503.00	2.69%
6	史德海	190,866.00	1.51%
7	蔡伟	181,900.00	1.44%
8	吕传鸿	173,201.00	1.37%
9	李风琴	172,458.00	1.36%

10	彩霞	168,748.00	1.33%
----	----	------------	-------

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

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比 例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中融煤炭A	10,961.37	0.00%
	中融煤炭C	165.60	0.00%
	合计	11,126.97	0.00%

### 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

注：1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金；  
2、本基金基金经理未持有本开放式基金。

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

	中融煤炭A	中融煤炭C
基金合同生效日(2021年01月01日)基金份额总额	317,161,017.55	-
本报告期期初基金份额总额	609,270,361.49	-
本报告期基金总申购份额	2,352,189,942.74	30,589,183.89
减：本报告期基金总赎回份额	2,462,616,165.71	15,994,537.67
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	498,844,138.52	14,594,646.22

注：本基金自2022年9月28日起增加C类份额，相关数据按实际存续期计算。

## §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2022年8月6日发布公告，闫军先生担任中融基金管理有限公司副总裁职务。

本基金管理人于2022年8月29日发布公告，卢强先生担任中融基金管理有限公司副总裁职务、黄庆先生担任中融基金管理有限公司首席信息官职务、马荣荣女士卸任中融基金管理有限公司副总裁职务、黎峰先生卸任中融基金管理有限公司首席信息官职务。

本基金管理人于2022年9月30日发布公告，中融基金管理有限公司副总裁黄言先生离任。

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

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 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

本报告期内，未改聘会计师事务所。该审计机构已经连续8年为本基金提供审计服务。报告期内本基金应支付给会计师事务所的报酬为45,000.00元人民币。

### 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

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内管理人及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

#### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内托管人及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

### 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	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的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	

	数量					
银河证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	540,034,801.82	18.04%	502,929.93	21.89%	-
山西证券	2	117,693,631.42	3.93%	86,065.53	3.75%	新增2个交易单元。
首创证券	2	389,967,765.72	13.02%	285,180.39	12.41%	新增2个交易单元。
中信建投	2	336,685,409.94	11.24%	246,210.57	10.72%	-
东方财富证券	4	374,100,817.81	12.49%	273,579.81	11.91%	-
海通证券	4	1,235,851,460.94	41.27%	903,773.18	39.33%	-

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。



## 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	114,126,341.70	100.00%	57,000,000.00	100.00%	-	-	-	-

## 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中融基金管理有限公司关于旗下基金执行新金融工具会计准则的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-04
2	中融基金管理有限公司关于中融基金直销电子交易平台等业务临时暂停服务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-15
3	中融基金管理有限公司关于暂停北京钱景基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-17
4	中融基金管理有限公司关于旗下部分基金调整停牌股票估值方法的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-21
5	中融基金管理有限公司关于公司董事变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-02-19
6	中融基金管理有限公司关于旗下部分基金增加申万宏源西部证券有限公司为销售机	中国证监会指定报刊及网站	2022-02-21

	构的公告		
7	中融基金管理有限公司关于中融基金直销电子交易平台等业务临时暂停服务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-03-24
8	中融基金管理有限公司关于暂停深圳前海凯恩斯基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-22
9	中融基金管理有限公司关于公司董事变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-27
10	中融基金管理有限公司关于旗下部分基金调整停牌股票估值方法的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-30
11	中融基金管理有限公司关于终止北京唐鼎耀华基金销售有限公司、北京植信基金销售有限公司、北京晟视天下基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-05-07
12	中融基金管理有限公司关于暂停喜鹊财富基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-07-14
13	中融基金管理有限公司关于暂停乾道基金销售有限公司、北京微动利基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-07-20
14	中融基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-08-06
15	中融基金管理有限公司关于办公地址变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-08-08
16	中融基金管理有限公司关于	中国证监会指定报刊及网站	2022-08-10

	下线中融基金APP运营及维护服务的公告		
17	中融基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-08-29
18	中融基金管理有限公司关于中融中证煤炭指数型证券投资基金增加C类基金份额并修改基金合同及托管协议的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-09-28

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

注：本基金本报告期间无单一投资者持有基金份额达到或超过20%的情况。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予中融中证煤炭指数分级证券投资基金募集注册的文件
- (2) 《中融中证煤炭指数型证券投资基金基金合同》
- (3) 《中融中证煤炭指数型证券投资基金托管协议》
- (4) 注册登记协议
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (6) 基金托管人业务资格批件、营业执照
- (7) 中国证监会要求的其他文件

### 13.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所

### 13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可在支付工本费后，在合理时间取得上述文件的复印件。

咨询电话：中融基金管理有限公司客户服务电话400-160-6000, (010) 56517299。

网址：<http://www.zrfunds.com.cn/>

中融基金管理有限公司

二〇二三年三月三十日