

中融强国制造混合型证券投资基金 2017年第一季度报告

2017年03月31日

基金管理人:中融基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2017年04月21日

重要提示
基金管理人、基金托管人及基金销售机构在本报告期内不存在虚假记载、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责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年4月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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请仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期自2017年1月1日起至2017年3月31日止。

2 基金产品概况
2.1 基金基本情况

Table with 2 columns: 基金简称, 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 报告期末基金份额总额, 投资目标, 投资策略, 业绩比较基准, 风险收益特征, 基金管理人, 基金托管人

3 主要财务指标和基金净值表现
3.1 主要财务指标
单位:人民币元

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2017年01月01日-2017年03月31日)

1. 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。

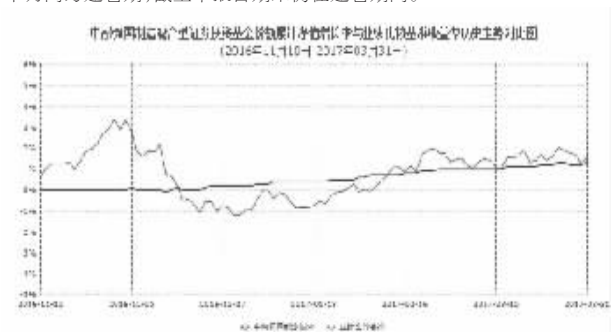
2. 上述本基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,例如:基金的申购、赎回费等,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

Table with 5 columns: 阶段, 净值增长率①, 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

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:按照基金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,截至本报告期末仍处在建仓期内。



4 管理人报告
4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理期限(任职日期, 离任日期), 证券从业年限, 说明

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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

报告期内,本基金管理人严格遵守了《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。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金管理人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。

4.3.2 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。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2017年一季度宏观盈利向好,房地产投资依然显示出较强的韧性和弹性,基建投资则有减速的倾向,BDI持续上涨,大宗商品需求强劲,但是出口集装箱量下降意味着出口数据并不乐观。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中融强国制造混合基金份额净值为1.013元;本报告

期基金份额净值增长率为1.10%,同期业绩比较基准收益率为2.53%。

5 投资组合报告
5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 3 columns: 序号, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 3 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.5 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债券投资明细

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注
5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.6 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。

5.6 开放式基金份额变动
单位:份

Table with 2 columns: 报告期末基金份额总额, 报告期末基金份额总额

申购含红利再投、转换入份额及金额,赎回含转换出份额及金额。

5.7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

5.8 影响投资者决策的其他重要信息
8.1 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

Table with 3 columns: 投资者类别, 持有基金份额比例达到或超过20%的时间区间, 持有份额, 持有比例(%)

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

8.3 影响投资者决策的其他重要信息

8.4 影响投资者决策的其他重要信息

8.5 影响投资者决策的其他重要信息

8.6 影响投资者决策的其他重要信息

8.7 影响投资者决策的其他重要信息

8.8 影响投资者决策的其他重要信息

8.9 影响投资者决策的其他重要信息

8.10 影响投资者决策的其他重要信息

8.11 影响投资者决策的其他重要信息

8.12 影响投资者决策的其他重要信息

8.13 影响投资者决策的其他重要信息

中融中证煤炭指数分级证券投资基金 2017年第一季度报告

2017年03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
报告送出日期:2017年04月21日

重要提示
基金管理人、基金托管人及基金销售机构在本报告期内不存在虚假记载、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责任。

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4月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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请仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期自2017年1月1日起至2017年3月31日止。

2 基金产品概况
2.1 基金基本情况

Table with 2 columns: 基金简称, 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 报告期末基金份额总额, 投资目标, 投资策略, 业绩比较基准, 风险收益特征, 基金管理人, 基金托管人

3 主要财务指标和基金净值表现
3.1 主要财务指标
单位:人民币元

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2017年01月01日-2017年03月31日)

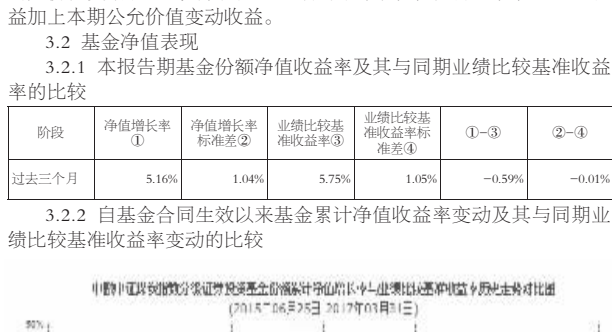
1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2. 上述本基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,例如:基金的申购、赎回费等,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

Table with 5 columns: 阶段, 净值增长率①, 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

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



4 管理人报告
4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理期限(任职日期, 离任日期), 证券从业年限, 说明

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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

报告期内,本基金管理人严格遵守了《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。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金管理人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。

4.3.2 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。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2017年一季度,A股维持窄幅震荡,中证煤炭指数上涨6.04%,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投资策略,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。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中融煤炭基金份额净值为0.775元;本报告期基金份额净值增长率为5.16%,同期业绩比较基准收益率为5.75%。

5 投资组合报告
5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
5.2.1 报告期末(指数投资)按行业分类的股票投资组合

Table with 3 columns: 序号, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

5.2.2 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。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.3.2 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。

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注
5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 流通受限部分公允价值(元), 占基金净值比例(%)

注:拆分变动份额为本基金二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。

7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

8 影响投资者决策的其他重要信息
8.1 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

本基金本报告期末未持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

8.3 影响投资者决策的其他重要信息

8.4 影响投资者决策的其他重要信息

8.5 影响投资者决策的其他重要信息

8.6 影响投资者决策的其他重要信息

8.7 影响投资者决策的其他重要信息

8.8 影响投资者决策的其他重要信息

8.9 影响投资者决策的其他重要信息

8.10 影响投资者决策的其他重要信息

8.11 影响投资者决策的其他重要信息

8.12 影响投资者决策的其他重要信息

8.13 影响投资者决策的其他重要信息

8.14 影响投资者决策的其他重要信息

8.15 影响投资者决策的其他重要信息

8.16 影响投资者决策的其他重要信息

中融基金管理有限公司

二〇一七年四月二十一日

中融基金管理有限公司

二〇一七年四月二十一日