（上接 D384 版）

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2017 年 01 月 01 日至 2017 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中融增鑫定期开放债券 A	中融增鑫定期开放债券 C	合计
中国工商银行股份有限公司	–	105,592.69	105,592.69
合计	–	105,592.69	105,592.69

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2016 年 01 月 01 日至 2016 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中融增鑫定期开放债券 A	中融增鑫定期开放债券 C	合计
中国工商银行股份有限公司	–	257,462.64	257,462.64
合计	–	257,462.64	257,462.64

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 0.40%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 X0.40*%/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

无。

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

无。

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

无。

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 2017 年 01 月 01 日至 2017 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2016 年 01 月 01 日至 2016 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
中国工商银行股份有限公司	31,533.80	21,068.58	84,824.92	23,705.39

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。

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.5 期末（2017 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

无。

7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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

无。

7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

无。

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

(a)金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由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决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：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：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于 2017 年 12 月 31 日，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中属于第二层次的余额为 54,589,140.00 元，无属于第一层次或第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日：第一层次 566,093.86 元，第二层次 120,859,360.00 元，无第三层次)。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

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)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售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。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2017 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2016 年 12 月 31 日：同)。

(d)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，其账面价值与公允价值相差很小。

(2)增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《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》的规定，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。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，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。

此外，财政部、国家税务总局于 2017 年 12 月 25 日颁布的财税[2017]90 号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自 2018 年 1 月 1 日起运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售额确定做出规定。

上述税收政策对本基金 2017 年 12 月 31 日财务状况和 2017 年度经营成果无影响。

(3)除公允价值和增值税外，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	–	–
	其中：股票	–	–
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	54,589,140.00	89.79
	其中：债券	54,589,140.00	89.79
	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	5,060,127.59	8.32
	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	31,533.80	0.05
8	其他各项资产	1,115,956.91	1.84
9	合计	60,796,758.30	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

本基金本报告期末未持有股票投资。

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

本基金本报告期末未持有股票投资。

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

本基金本报告期无股票累计买入金额。

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	600016	民生银行	278,289.00	0.11
2	600356	恒丰纸业	204,391.29	0.08
3	603868	飞科电器	45,218.40	0.02
4	600926	杭州银行	20,450.00	0.01
5	002408	齐翔腾达	12,544.56	0.01
6	002521	齐峰新材	6,473.50	0.00
7	000089	深圳机场	264.32	0.00

"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	–
卖出股票收入(成交)总额	567,631.07

"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	1,266,840.00	2.09
5	企业短期融资券	29,053,300.00	47.96
6	中期票据	4,729,000.00	7.81
7	可转债(可交换债)	–	–
8	同业存单	19,540,000.00	32.26
9	其他	–	–
10	合计	54,589,140.00	90.11

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	111781415	17 盛京银行 CD163	200,000	19,540,000.00	32.26
2	041760034	17 平安租赁 CP002	60,000	6,016,200.00	9.93
3	041754018	17 沪城建 CP001	60,000	6,010,200.00	9.92
4	011772029	17 津海泰 SCP002	60,000	5,999,400.00	9.90
5	011761066	17 鲁钢铁 SCP003	60,000	5,994,000.00	9.89

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

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

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 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	773.99
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	1,115,182.92
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	1,115,956.91

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限股票。

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
中融增鑫定期开放债券 A	234	115,903.90	–	–	27,121,512.55	100.00%
中融增鑫定期开放债券 C	317	65,791.27	1,000.00	0.0048%	20,854,833.96	99.9952%
合计	551	87,073.22	1,000.00	0.0021%	47,976,346.51	99.9979%

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。

9.3 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

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

	中融增鑫定期开放债券 A	中融增鑫定期开放债券 C
基金合同生效日(2013 年 12 月 03 日)基金份额总额	147,817,578.64	297,892,000.40
本报告期期初基金份额总额	145,047,246.22	52,664,575.54
本报告期基金总申购份额	8,640,806.48	5,660,438.62
减：本报告期基金总赎回份额	126,566,540.15	37,469,180.20
本报告期基金拆分变动份额	–	–
本报告期期末基金份额总额	27,121,512.55	20,855,833.96

§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 2017 年 11 月 9 日发布公告，易海波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 2017 年 12 月 21 日发布公告，侯利鹏先生不再担任中融基金管理有限公司副总经理。

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 4 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 60,000.00 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

本报告期无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

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的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
安信证券	1	–	–	–	–	–
国泰君安	2	–	–	–	–	新增 2 个交易单元
华泰证券	2	–	–	–	–	–
广发证券	2	–	–	–	–	新增 2 个交易单元
招商证券	2	–	–	–	–	新增 2 个交易单元
天风证券	2	–	–	–	–	新增 2 个交易单元
恒泰证券	2	567,631.07	100.00%	415.05	100.00%	–
信达证券	2	–	–	–	–	–
兴业证券	2	–	–	–	–	新增 2 个交易单元

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
安信证券	–	–	29,140,000.00	3.29%	–	–	–	–
国泰君安	–	–	–	–	–	–	–	–
华泰证券	15,877,630.60	100.00%	337,300,000.00	38.08%	–	–	–	–
广发证券	–	–	10,800,000.00	1.22%	–	–	–	–
招商证券	–	–	–	–	–	–	–	–
天风证券	–	–	–	–	–	–	–	–
恒泰证券	–	–	508,525,000.00	57.41%	–	–	–	–
信达证券	–	–	–	–	–	–	–	–
兴业证券	–	–	–	–	–	–	–	–

中融基金管理有限公司
二〇一八年三月三十日

（上接 D386 版）

于 2017 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次的余额为人民币 982,844,833.38 元，属于第二层次的余额为人民币 72,763,904.50 元，无属于第三层次的余额。（2016 年 12 月 31 日：属于第一层次的余额为人民币 1,709,451,985.58 元，无属于第二层次和第三层次的余额。）

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	1,055,608,737.88	92.91
	其中：股票	1,055,608,737.88	92.91
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	–	–
	其中：债券	–	–
	资产支持证券	–	–
4	贵金属投资	–	–
5	金融衍生品投资	–	–
6	买入返售金融资产	–	–
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	–	–
7	银行存款和结算备付金合计	79,026,212.95	6.96
8	其他各项资产	1,495,451.99	0.13
9	合计	1,136,130,402.82	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)	占基金资产净值的比例(%)
A	农、林、牧、渔业	–	–
B	采矿业	884,427,702.92	78.34
C	制造业	149,623,316.96	13.25
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	21,557,718.00	1.91
	合计	1,055,608,737.88	93.50

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

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	4,761,546	110,325,020.82	9.77
2	601225	陕西煤业	12,868,449	105,006,543.84	9.30
3	000983	西山煤电	7,726,742	78,349,163.88	6.94
4	600157	永泰能源	20,789,687	72,763,904.50	6.45
5	601699	潞安环能	5,868,001	66,777,851.38	5.91
6	601898	中煤能源	8,976,266	51,344,241.52	4.55
7	600348	阳泉煤业	5,897,062	43,520,317.56	3.85
8	000723	美锦能源	6,040,656	41,620,119.84	3.69
9	601666	平煤股份	5,789,634	36,474,694.20	3.23
10	002128	露天煤业	3,206,051	35,523,045.08	3.15
11	601011	宝泰隆	3,950,589	35,081,230.32	3.11
12	600123	兰花科创	3,361,447	30,824,468.99	2.73
13	000937	冀中能源	5,198,612	30,255,921.84	2.68
14	601918	新集能源	7,622,372	29,574,803.36	2.62
15	600188	兖州煤业	1,887,057	27,400,067.64	2.43
16	600740	山西焦化	2,628,497	25,706,700.66	2.28
17	600971	恒源煤电	2,452,026	25,574,631.18	2.27
18	601001	大同煤业	4,103,923	24,828,734.15	2.20
19	600395	盘江股份	3,246,602	22,304,155.74	1.98
20	000571	新大洲 A	3,992,170	21,557,718.00	1.91
21	000552	靖远煤电	5,607,635	19,738,875.20	1.75
22	600758	红阳能源	2,611,697	19,274,323.86	1.71
23	600997	开滦股份	3,114,658	19,186,293.28	1.70
24	601101	昊华能源	2,353,963	19,067,100.30	1.69
25	600508	上海能源	1,417,761	17,197,440.93	1.52
26	600397	安源煤业	3,398,390	13,185,753.20	1.17
27	601015	陕西黑猫	1,229,650	12,825,249.50	1.14
28	603113	金能科技	397,796	9,014,057.36	0.80
29	600792	云煤能源	1,456,392	6,189,666.00	0.55
30	600714	金瑞矿业	565,375	5,116,643.75	0.45

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

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	601225	陕西煤业	130,071,186.33	7.10
2	601088	中国神华	102,034,763.19	5.57
3	000983	西山煤电	85,755,113.38	4.68
4	600157	永泰能源	82,082,940.41	4.48
5	000723	美锦能源	70,857,575.48	3.87
6	601699	潞安环能	64,730,621.72	3.53
7	601898	中煤能源	62,067,653.01	3.39
8	600348	阳泉煤业	49,729,068.12	2.71
9	601011	宝泰隆	40,766,782.00	2.22
10	601666	平煤股份	40,248,530.54	2.20
11	000937	冀中能源	39,952,146.91	2.18
12	600758	红阳能源	38,192,288.11	2.08
13	002128	露天煤业	35,190,822.63	1.92
14	600123	兰花科创	33,276,915.66	1.82
15	601918	新集能源	30,256,975.96	1.65
16	601001	大同煤业	29,946,587.35	1.63
17	000552	靖远煤电	29,577,911.08	1.61
18	600395	盘江股份	29,078,730.11	1.59
19	000571	新大洲 A	27,551,090.60	1.50
20	600740	山西焦化	26,871,690.73	1.47

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	226,418,532.13	12.36
2	601225	陕西煤业	169,395,377.15	9.24
3	600157	永泰能源	165,269,665.48	9.02
4	000983	西山煤电	145,151,216.64	7.92
5	601898	中煤能源	110,972,828.88	6.06
6	601699	潞安环能	104,421,282.80	5.70
7	600348	阳泉煤业	87,206,458.87	4.76
8	000937	冀中能源	72,215,723.08	3.94
9	601666	平煤股份	68,985,901.49	3.76
10	002128	露天煤业	66,469,525.54	3.63
11	601011	宝泰隆	60,313,057.25	3.29
12	000552	靖远煤电	56,541,256.90	3.09
13	600123	兰花科创	56,448,962.91	3.08
14	600395	盘江股份	51,884,871.90	2.83
15	601001	大同煤业	49,738,189.45	2.71
16	000723	美锦能源	48,902,521.40	2.67
17	000571	新大洲 A	47,694,032.74	2.60
18	600188	兖州煤业	46,860,000.53	2.56
19	600971	恒源煤电	44,117,032.62	2.41
20	600740	山西焦化	41,574,067.23	2.27
21	600997	开滦股份	41,067,419.93	2.24
22	601101	昊华能源	40,189,158.45	2.19

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	1,236,981,619.71
卖出股票收入(成交)总额	1,988,728,834.07

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

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

本基金本报告期末未持有国债期货投资。

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	1,173,694.43
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	40,068.26
5	应收申购款	281,689.30
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	1,495,451.99

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

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	600157	永泰能源	72,763,904.50	6.45	公告重大事项

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	295	1,738,649.52	485,314,615.00	94.62%	27,586,994.00	5.38%
煤炭 B 级	3,396	151,031.10	74,365,042.00	14.50%	438,536,567.00	85.50%
中融煤炭	3,522	126,867.63	370,856,673.01	83.00%	75,971,112.58	17.00%
合计	7,213	204,163.46	930,536,330.01	63.19%	542,094,673.58	36.81%

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	工银瑞信基金-招商银行-招商财富资产管理有限公司	177,720,826.00	34.65
2	中国银河证券股份有限公司	52,900,057.00	10.31
3	工银瑞信添颐混合型养老金产品-中国工商银行股份有限公司	46,138,240.00	9.00
4	深圳快快资产管理有限公司	27,827,871.00	5.43
5	中国太平洋财产保险-传统-普通保险产品-013C-CT001 深	19,317,697.00	3.77
6	工银瑞信基金-广州农商银行-广州银行股份有限公司	17,743,145.00	3.46
7	中信资本(深圳)投资管理有限公司-中信资本稳健回报 1 期私募证	17,331,301.00	3.38
8	北京快快网络技术有限公司	14,762,522.00	2.88
9	中信资本(深圳)投资管理有限公司-中信资本债券收益增强型私募	14,365,038.00	2.80
10	鹏华基金-民生银行-万家共赢资产管理有限公司	10,240,179.00	2.00

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	32,695,171.00	6.37
2	嘉实基金-工商银行-嘉实资本管理有限公司	22,000,000.00	4.29
3	赵兴强	17,500,000.00	3.41
4	上海偏锋投资有限公司-偏锋 2 期证券投资基金	12,000,000.00	2.34
5	王树江	11,266,200.00	2.20
6	平安资产-工商银行-平安资产如意 21 号资产管理产品	10,000,000.00	1.95
7	陈杏花	9,177,312.00	1.79
8	泰康资产丰选 1 号股票型 fof 养老金产品-中国工商银行股份有限公司	8,058,969.00	1.57
9	严怡丰	5,788,000.00	1.13
10	杨锦成	5,611,300.00	1.09

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	煤炭 A 级	0.00	–
	煤炭 B 级	0.00	–
	中融煤炭	27.22	–
	合计	27.22	–

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

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、本基金的基金经理未持有本基金。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

	煤炭 A 级	煤炭 B 级	中融煤炭
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	1,188,148,976.00	1,188,148,976.00	110,930,998.81
本报告期基金总申购份额	–	–	1,531,831,112.07
减：本报告期基金总赎回份额	–	–	2,601,647,730.13
本报告期基金拆分变动份额	–675,247,367.00	–675,247,367.00	1,405,713,404.84
本报告期期末基金份额总额	512,901,609.00	512,901,609.00	446,827,785.59

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 2017 年 11 月 9 日发布公告，易海波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 2017 年 12 月 21 日发布公告，侯利鹏先生不再担任中融基金管理有限公司副总经理。

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 60,000.00 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

本报告期无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

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的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券	1	63,836,190.56	1.98%	46,685.33	1.93%	新增
国信证券	2	271,749,072.09	8.42%	253,079.58	10.49%	新增
中信建投	2	1,165,603,712.25	36.14%	852,417.01	35.32%	–
银河证券	2	552,026,075.79	17.11%	403,702.12	16.73%	–
宏信证券	2	–	–	–	–	–
西藏东方财富证券	2	409,545,288.39	12.70%	299,489.66	12.41%	新增
东兴证券	2	532,166,661.40	16.50%	389,122.80	16.12%	–
海通证券	4	230,636,143.30	7.15%	168,669.32	6.99%	新增 2 个交易单元

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
二〇一八年三月三十日