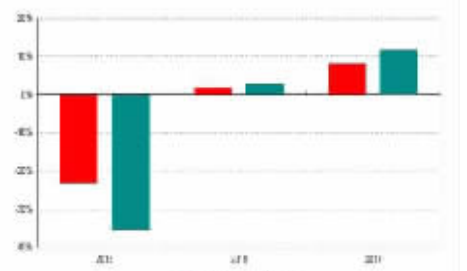


中融中证煤炭指数分级证券投资基金 2017 年年度报告摘要

2017 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
重要提示: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
场内简称:中融煤炭

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
基金合同生效日:2015年06月25日

2.2 基金产品说明

投资目标:本基金采用量化投资策略,通过严谨的数量化管理和严格的投资纪律,力争使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...

2.3 基金管理人

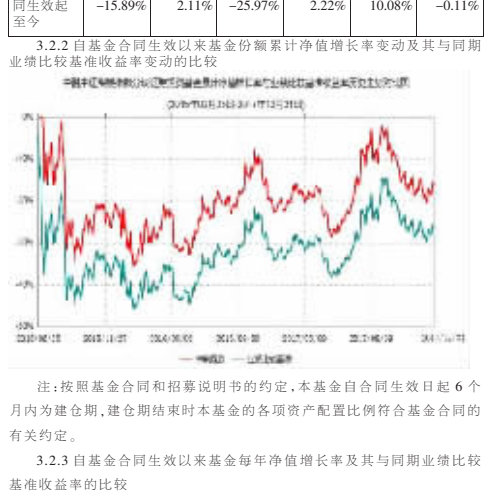
Table with columns: 项目, 基金管理人, 基金托管人. Lists names and contact info for 中融基金管理有限公司 and 海通证券股份有限公司.

3.1 主要财务指标

Table with columns: 项目, 2017年, 2016年, 2015年. Lists financial metrics like 本期已实现收益, 本期利润, 期末可供分配利润.

3.2 基金业绩比较基准

Table comparing 基金业绩比较基准 with 业绩比较基准. Shows percentage differences for various periods.



注:按照基金合同和招募说明书的约定,本基金自合同生效之日起6个月内为建仓期...

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。

4.1 基金管理人及基金托管人

4.1.1 基金管理人及基金托管人的基本情况
基金管理人:中融基金管理有限公司

4.2 基金投资策略

4.2.1 资产配置策略
本基金采用量化投资策略,通过严谨的数量化管理和严格的投资纪律,力争使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...

4.3 基金业绩比较基准

4.3.1 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:中证煤炭指数收益率\*55%+同期银行活期存款利率(税后)45%

4.4 基金管理人

Table with columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 从业年限, 说明. Lists key personnel like 赵菲 and 朱耀明.

4.5 基金托管人

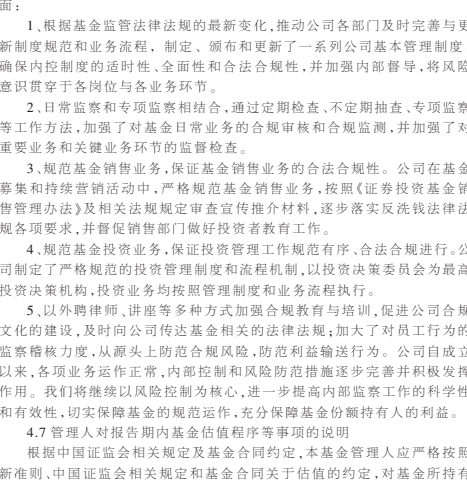
4.5.1 基金托管人
基金托管人:海通证券股份有限公司

4.6 基金投资策略

4.6.1 资产配置策略
本基金采用量化投资策略,通过严谨的数量化管理和严格的投资纪律,力争使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...

4.7 基金业绩比较基准

Table comparing 基金业绩比较基准 with 业绩比较基准. Shows percentage differences for various periods.



注:按照基金合同和招募说明书的约定,本基金自合同生效之日起6个月内为建仓期...

的投资品种进行估值。本基金基金管理人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所在对估值调整导致基金资产净值的变化在0.25%以上时对所采用的估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见。

5.1 报告期内基金托管人履行托管职责的情况

5.1.1 基金托管人
基金托管人:海通证券股份有限公司

5.2 基金投资策略

5.2.1 资产配置策略
本基金采用量化投资策略,通过严谨的数量化管理和严格的投资纪律,力争使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...

5.3 基金业绩比较基准

5.3.1 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:中证煤炭指数收益率\*55%+同期银行活期存款利率(税后)45%

5.4 基金管理人

Table with columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 从业年限, 说明. Lists key personnel like 赵菲 and 朱耀明.

5.5 基金托管人

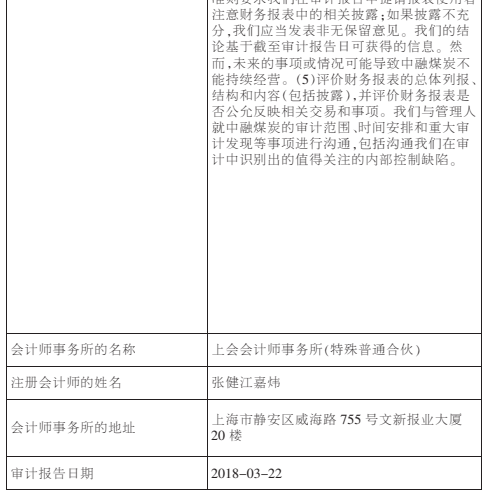
5.5.1 基金托管人
基金托管人:海通证券股份有限公司

5.6 基金投资策略

5.6.1 资产配置策略
本基金采用量化投资策略,通过严谨的数量化管理和严格的投资纪律,力争使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...

5.7 基金业绩比较基准

Table comparing 基金业绩比较基准 with 业绩比较基准. Shows percentage differences for various periods.



注:按照基金合同和招募说明书的约定,本基金自合同生效之日起6个月内为建仓期...

7.1 资产负债表

Table with columns: 资产, 附注号, 2017年12月31日, 2016年12月31日. Lists assets like 货币资金, 结算备付金, 存出保证金.

7.2 利润表

Table with columns: 项目, 附注号, 2017年12月31日, 2016年12月31日. Lists income items like 利息收入, 投资收益, 公允价值变动收益.

7.3 所有者权益变动表

Table with columns: 项目, 2017年01月01日至2017年12月31日, 2016年01月01日至2016年12月31日. Lists equity changes like 期初所有者权益合计, 本期净利润.

7.4 关联方关系

Table with columns: 关联方名称, 与本基金的关系. Lists related parties like 上海融晟投资有限公司, 中融国际信托有限公司.

7.5 关联交易

Table with columns: 关联方名称, 2017年01月01日至2017年12月31日, 2016年01月01日至2016年12月31日. Lists transactions like 成交金额, 成交占比.

7.6 关联方往来余额

Table with columns: 关联方名称, 2017年01月01日至2017年12月31日, 2016年01月01日至2016年12月31日. Lists balances like 应收利息, 应付利息.

7.7 关联方往来余额

Table with columns: 项目, 2017年01月01日至2017年12月31日, 2016年01月01日至2016年12月31日. Lists balances like 应收利息, 应付利息.

7.8 关联方往来余额

Table with columns: 项目, 2017年01月01日至2017年12月31日, 2016年01月01日至2016年12月31日. Lists balances like 应收利息, 应付利息.

7.1 资产负债表

Table with columns: 资产, 附注号, 2017年12月31日, 2016年12月31日. Lists assets like 货币资金, 结算备付金, 存出保证金.

7.2 利润表

Table with columns: 项目, 附注号, 2017年12月31日, 2016年12月31日. Lists income items like 利息收入, 投资收益, 公允价值变动收益.

7.3 所有者权益变动表

Table with columns: 项目, 2017年01月01日至2017年12月31日, 2016年01月01日至2016年12月31日. Lists equity changes like 期初所有者权益合计, 本期净利润.

7.4 关联方关系

Table with columns: 关联方名称, 与本基金的关系. Lists related parties like 上海融晟投资有限公司, 中融国际信托有限公司.

7.5 关联交易

Table with columns: 关联方名称, 2017年01月01日至2017年12月31日, 2016年01月01日至2016年12月31日. Lists transactions like 成交金额, 成交占比.

7.6 关联方往来余额

Table with columns: 关联方名称, 2017年01月01日至2017年12月31日, 2016年01月01日至2016年12月31日. Lists balances like 应收利息, 应付利息.

7.7 关联方往来余额

Table with columns: 项目, 2017年01月01日至2017年12月31日, 2016年01月01日至2016年12月31日. Lists balances like 应收利息, 应付利息.

7.8 关联方往来余额

Table with columns: 项目, 2017年01月01日至2017年12月31日, 2016年01月01日至2016年12月31日. Lists balances like 应收利息, 应付利息.