

中融中证煤炭指数分级证券投资基金  
更新招募说明书  
(2016 年第 2 号)

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

中融中证煤炭指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）根据 2015 年 5 月 5 日中国证券监督管理委员会《关于准予中融中证煤炭指数分级证券投资基金注册的批复》（证监许可〔2015〕814 号）的注册进行募集。本基金基金合同于 2015 年 6 月 25 日生效，自该日起本基金管理人正式开始管理本基金。

本招募说明书是对原《中融中证煤炭指数分级证券投资基金招募说明书》的定期更新，原招募说明书与本招募说明书不一致的，以本招募说明书为准。基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同和其他有关法律、法规规定募集，并经中国证监会核准。中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的投资价值、市场前景和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金投资于证券市场，基金份额净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者根据所持有的基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。投资人在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的指数投资风险、杠杆机制风险、折/溢价交易风险、份额转换风险及基金份额折算等业务办理过程中的特定风险等。投资有风险，投资人在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的招募说明书及基金合同等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。

基金管理人建议投资人根据自身的风险收益偏好，选择适合自己的基金产品，并且中长期持有。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不预示其未来表现，基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。

基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为 2016 年 12 月 22 日，有关财务数据和净值表现数据截止日为 2016 年 9 月 30 日（未经审计）。

## 一、基金管理人

### （一）基金管理人概况

名称	中融基金管理有限公司
注册地址	深圳市福田区莲花街道益田路 6009 号新世界中心 29 层
办公地址	北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 7 层
法定代表人	王瑶
总经理	杨凯
成立日期	2013 年 5 月 31 日
注册资本	7.5 亿元
股权结构	中融国际信托有限公司占注册资本的 51%，上海融晟投资有限公司占注册资本的 49%
存续期间	持续经营
电话	(010) 85003388
传真	(010) 85003386
联系人	肖佳琦

(二) 主要人员情况

1. 基金管理人董事、监事、总经理、高级管理人员基本情况

(1) 基金管理人董事

王瑶女士，董事长，法学硕士。1998年7月至2013年1月在中国证监会工作期间，先后在培训中心、机构监管部、人事教育部等部门工作。2013年5月加入中融基金管理有限公司，先后担任公司督察长、总经理，自2015年3月起至今任公司董事长。

杨凯先生，董事，工商管理硕士。1993年7月至1998年6月在湖南工程学院担任教师。1998年7月至2001年8月在振远科技股份有限公司担任产品部营销经理。2003年7月至2016年8月在宝盈基金管理有限公司工作期间，历任市场开发部执行总监、特定客户资产管理部总监、研究部总监、公司副总经理。2016年9月加入中融基金管理有限公司，自2016年10月起至今任公司总经理。

刘洋先生，董事，毕业于长江商学院，工商管理硕士。曾任职于中国工商银行黑龙江省分行国际业务部、中植高科技投资有限公司、上海中植金智科技投资有限公司、中植企业集团有限公司，现任中融国际信托有限公司董事长。

李骥先生，独立董事，1989年毕业于北京大学法律系，获学士学位，曾任西安飞机工业公司法律顾问、中国管理科学研究院投资与市场研究所办公室主任、银川经济技术开发区投资控股有限公司总裁。现任中农科创投资股份有限公司董事长、中农科创资产管理有限公司董事长。

姜国华先生，独立董事，2002年毕业于美国加利福尼亚大学，获博士学位，并拥有香港科技大学硕士学位以及北京大学学士学位。任职于北京大学光华管理学院，同时担任北京大学研究生院副院长，以及北京大学燕京学堂办公室主任。

董志勇先生，独立董事，2004年毕业于新加坡南洋理工大学，获经济学博士学位，并拥有英国剑桥大学经济学硕士学位以及中国人民大学学士学位。现任北京大学经济学院教授，同时兼任北京大学教务部部长。

(2) 基金管理人监事

裴芸女士，监事，法学学士。曾任职于北京市君泰律师事务所、甘肃太平洋律师事务所。2013年5月加入中融基金管理有限公司，现任公司法律合规部总监。

(3) 基金管理人高级管理人员

杨凯先生，总经理，工商管理硕士。1993年7月至1998年6月在湖南工程学院担任教师。1998年7月至2001年8月在振远科技股份有限公司担任产品部营销经理。2003年7月至2016年8月在宝盈基金管理有限公司工作期间，历任市场开发部执行总监、特定客户资产管理部总监、研究部总监、公司副总经理。2016年9月加入中融基金管理有限公司，自2016年10月起至今任公司总经理。

向祖荣先生，督察长，法学博士。曾就职于北京建工集团总公司、中国证券监督管理委员会、中国证券监督管理委员会中国上市公司协会筹备组、中国上市公司协会。2014年8月加入中融基金管理有限公司，自2014年10月起至今任公司督察长。

侯利鹏先生，副总经理，工商管理硕士。1996年8月至2004年6月任沈阳诚浩证券公司西顺城营业部客服部经理；2004年6月至2015年12月在南方基金管理有限公司，历任北京分公司高级经

理、北部营销中心总经理、市场管理部总监。2015年12月加入中融基金管理有限公司，自2016年5月起至今任公司副总经理。

曹健先生，副总经理，工商管理硕士，注册税务师。曾任黑龙江省国际信托投资公司证券部财务负责人、天元证券公司财务负责人、江海证券有限公司财务负责人。2013年5月加入中融基金管理有限公司，曾任公司首席财务官，自2014年12月起至今任公司副总经理。

代宝香女士，副总经理，毕业于哈尔滨商业大学工业会计专业。1990年10月至1999年5月曾任哈铁分局五营车务段主管会计；1999年5月至2003年3月曾任中植集团驻哈办会计；2003年3月至2006年2月曾历任哈尔滨盟科置业发展有限公司财务经理、主管会计；2006年2月至2016年3月任职于中融国际信托，历任财务部副经理、财务总监兼财务管理部总经理、财务总监、财务管理部总经理、财务管理部总经理兼固有业务部总经理。自2016年6月起至今任公司副总经理。

## 2. 本基金基金经理

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。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。

## 3、投资决策委员会成员

投资决策委员会的成员包括：权益投资部孔学兵先生、固收投资部秦娟女士、量化投资部赵菲先生、战略研究部黄震先生、风险管理部李晓伟先生、交易部王丽梅女士。

上述人员之间均不存在近亲属关系。

## 二. 基金托管人

### （一）基金托管人基本情况

名称：海通证券股份有限公司（简称：海通证券）

住所：上海市广东路689号海通证券大厦

办公地址：上海市广东路689号海通证券大厦

邮政编码：200001

法定代表人：周杰

成立时间：1988年8月15日

批准设立机关和批准设立文号：中国人民银行银复〔1988〕383号

经营范围：证券经纪；证券自营；证券承销与保荐；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；直接投资业务；证券投资基金代销；为期货公司提供中间介绍业务；融资融券业务；代销金融产品；中国证监会批准的其他业务。公司可以对外投资设立子公司从事金融产品等投资业务。[企业经营涉及行政许可的，凭许可证件经营]

组织形式：股份有限公司

注册资本：95.8472亿元人民币

存续期间：持续经营

## （二）主要人员情况

海通证券基金托管部具有符合中国证监会规定的与托管基金相适应的业务人员。目前基金托管部从业人员为35人，全员具有基金从业资格，学历均在本科及以上，硕士以上学历占33.33%，并具有多年金融从业经历。其中，核算、监督等核心业务岗位人员具备2年以上托管业务从业经验。

## （三）基金托管业务经营情况

海通证券于2013年12月取得中国证监会核准证券投资基金托管资格，是国内第一家取得证券投资基金托管资格的证券公司，海通证券始终遵循“务实、开拓、稳健、卓越”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行基金托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。

## 三、相关服务机构

### （一）基金份额发售机构

#### 1. 直销机构

1) 名称：中融基金管理有限公司

住所：深圳市福田区莲花街道益田路 6009 号新世界中心 29 层

办公地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 B 座 12 层

法定代表人：王瑶

邮政编码：100005

电话：010-85003535、010-85003560

传真：010-85003387、010-56580880

邮箱：zhixiao@zrfunds.com.cn

联系人：郭丽苹、赵静

网址：www.zrfunds.com.cn

#### 2) 中融基金直销电子交易平台

本公司直销电子交易方式包括网上交易、移动客户端交易等。投资者可以通过本公司网上交易系统或移动客户端办理业务，具体业务办理情况及业务规则请登录本公司网站查询。

网址：<https://trade.zrfunds.com.cn>

#### 2. 其他销售机构

##### 1) 海通证券股份有限公司

住所：上海市广东路689号

办公地址：上海市广东路689号海通证券大厦

法定代表人：周杰

电话：021-23219275

联系人：李笑鸣

客服电话：95553、4008888001

2) 北京银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街甲17号首层

办公地址：北京市西城区金融大街丙17号首层

法定代表人：闫冰竹

客服电话：95526

3) 宁波银行股份有限公司

住所：浙江省宁波市鄞州区宁南南路700号

办公地址：浙江省宁波市鄞州区宁南南路700号

法定代表人：陆华裕

电话：0574-87050397

联系人：邱艇

客服电话：95574

4) 中天证券股份有限公司

住所：辽宁省沈阳市和平区光荣街23甲

办公地址：辽宁省沈阳市和平区光荣街23甲

法定代表人：马功勋

电话：024-23280810

联系人：王力华

客服电话：400-6180-315

5) 五矿证券有限公司

住所：深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心办公楼47层01单元

办公地址：深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心办公楼47层01单元

法定代表人：赵立功

电话：0755-23902400

联系人：赖君伟

客服电话：40018-40028

6) 东北证券股份有限公司

住所：长春市自由大路1138号

办公地址：长春市自由大路1138号

法定代表人：李福春

电话：0431-85096517

联系人：安岩岩

客服电话：95360

7) 中信证券股份有限公司

住所：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦

法定代表人：王东明

电话：010-60838888

联系人：顾凌

客服电话：95548

8) 中信证券（山东）有限责任公司

住所：青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001

办公地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼20层

法定代表人：杨宝林

电话：0532-85022326

联系人：吴忠超

客服电话：95548

9) 中信建投证券股份有限公司

住所：北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址：北京市东城区朝内大街188号

法定代表人：王常青

电话：010-85156398

联系人：许梦园

客服电话：95587/4008-888-108

10) 中国银河证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街35号2-6层

办公地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

法定代表人：陈共炎

电话：010-66568292

联系人：邓颜

客服电话：95551

11) 国泰君安证券股份有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区商城路618号

办公地址：上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼

法定代表人：杨德红

电话：021-38676666

联系人：芮敏祺

客服电话：95521

12) 太平洋证券股份有限公司

住所：云南省昆明市青年路389号志远大厦18层

办公地址：北京市西城区北展北街9号华远企业号D座3单元

法定代表人：李长伟

电话：010-88321717

联系人：唐昌田

客服电话：400-6650-999

13) 国金证券股份有限公司



住所：四川省成都市东城根上街95号  
办公地址：四川省成都市东城根上街95号  
法定代表人：冉云  
电话：028-86690057、028-86690058  
联系人：刘婧漪、贾鹏  
客服电话：95310  
14) 华西证券股份有限公司

住所：成都市高新区天府二街198号  
办公地址：成都市高新区天府二街198号华西证券大厦  
法定代表人：杨炯洋  
电话：028-86135991  
联系人：周志茹  
客服电话：95584 4008-888-818  
15) 中国民族证券有限责任公司

住所：北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼  
办公地址：北京市朝阳区北四环中路盘古大观A座40层-43层  
法定代表人：赵大建  
电话：010-59355930  
联系人：李小雅  
客服电话：40088-95618  
16) 西南证券股份有限公司

住所：重庆市江北区桥北苑8号  
办公地址：重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦  
法定代表人：余维佳  
电话：023-63786633  
联系人：张煜  
客服电话：95355、4008096096  
17) 华融证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街8号  
办公地址：北京市朝阳区朝阳门北大街18号中国人保寿险大厦  
法定代表人：祝献忠  
电话：010-85556048  
联系人：孙燕波  
客服电话：95390 / 400-898-9999  
18) 平安证券股份有限公司

住所：深圳市福田区中心区金田路4036号荣超大厦16-20层  
办公地址：深圳市福田区中心区金田路4036号荣超大厦16-20层  
法定代表人：谢永林  
电话：021-38637436

联系人：周一涵

客服电话：4000-188-288

19) 兴业证券股份有限公司

住所：福州湖东路268号

办公地址：福州湖东路268号

法定代表人：兰荣

电话：0591-38281963

联系人：夏中苏

客服电话：95562

20) 信达证券股份有限公司

住所：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

法定代表人：张志刚

电话：010-63080985

联系人：唐静

客服电话：95321

21) 华泰证券股份有限公司

住所：南京市江东中路228号

办公地址：南京市建邺区江东中路228号华泰证券广场

法定代表人：周易

电话：0755-82492193

联系人：庞晓芸

客服电话：95597

22) 长江证券股份有限公司

住所：武汉市新华路特8号长江证券大厦

办公地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦

法定代表人：杨泽柱

电话：027-65799999

联系人：奚博宇

客服电话：95579

23) 东海证券股份有限公司

住所：江苏省常州延陵西路23号投资广场18层

办公地址：上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦

法定代表人：赵俊

电话：021-20333333

联系人：王一彦

客服电话：95531

24) 中国国际金融股份有限公司

住所：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

办公地址：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

法定代表人：丁学东

电话：010-65051166-1753

联系人：任敏

客服电话：010- 65051166

25) 宏信证券有限责任公司

住所：四川省成都市人民南路二段18号川信大厦10楼

办公地址：四川省成都市人民南路二段18号川信大厦10楼

法定代表人：吴玉明

电话：028-86199041

联系人：杨磊

客服电话：4008-366-366

26) 安信证券股份有限公司

住所：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35楼、28层A02单元

办公地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35楼、28层A02单元

法定代表人：王连志

电话：0755-82558305

联系人：陈剑虹

客服电话：95517

27) 渤海证券股份有限公司

住所：天津市经济技术开发区第二大街42号写字楼101室

办公地址：天津市南开区宾水西道8号

法定代表人：王春峰

电话：022-28451991

联系人：蔡霆

客服电话：400-651-5988

28) 联讯证券股份有限公司

住所：广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三楼

办公地址：深圳市福田区深南中路2002号中广核大厦北楼10楼

法定代表人：徐刚

电话：0755-83330361

联系人：彭莲

客服电话：95564

29) 光大证券股份有限公司

住所：上海市静安区新闸路1508号

办公地址：上海市静安区新闸路1508号

法定代表人：薛峰

电话：021-22169999

联系人：刘晨、李芳芳

客服电话：95525

30) 北京晟视天下投资管理有限公司

住所：北京市怀柔区九渡河镇黄坎村735号03室

办公地址：北京市朝阳区朝外大街甲6号万通中心D座28层

法定代表人：蒋煜

电话：010-58170949

联系人：殷雯

客服电话：400-818-8866

31) 深圳众禄金融控股股份有限公司

住所：深圳市罗湖区笋岗街道梨园路物资控股置地大厦8楼801

办公地址：深圳市罗湖区笋岗街道梨园路物资控股置地大厦8楼801

法定代表人：薛峰

电话：0755-33227950

联系人：童彩平

客服电话：4006-788-887

32) 上海好买基金销售有限公司

住所：上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号

办公地址：上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903~906室

法定代表人：杨文斌

电话：021-20613999

联系人：张茹

客服电话：400-700-9665

33) 北京增财基金销售有限公司

住所：北京市西城区南礼士路66号1号楼12层1208号

办公地址：北京市西城区南礼士路66号1号楼12层1208号

法定代表人：罗细安

电话：010-67000988

联系人：杜鹃

客服电话：400-001-8811

34) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

住所：杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1栋202室

办公地址：浙江省杭州市西湖区黄龙时代广场B座6层

法定代表人：陈柏青

客服电话：4000-766-123

联系人：韩爱彬

35) 上海天天基金销售有限公司

住所：上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层

办公地址：上海市徐汇区龙田路195号3C座7楼

法定代表人：其实

客服电话：400-1818-188

联系人：潘世友

36) 北京钱景财富投资管理有限公司

住所：北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012

办公地址：北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012

法定代表人：赵荣春

电话：010-57418813

联系人：崔丁元

客服电话：400-893-6885

37) 浙江同花顺基金销售有限公司

住所：浙江省杭州市文二西路1号元茂大厦903

办公地址：杭州市余杭区五常街道同顺路18号同花顺大楼

法定代表人：凌顺平

电话：0571-88911818

联系人：吴强

客服电话：95105885

38) 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

住所：上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室

办公地址：上海市杨浦区昆明路508号北美广场B座12楼

法定代表人：汪静波

电话：021-38509735

联系人：张裕

客服电话：400-821-5399

39) 上海汇付金融服务有限公司

住所：上海市中山南路100号金外滩国际广场19楼

办公地址：上海市中山南路100号金外滩国际广场19楼

法定代表人：冯修敏

电话：021-33323999

联系人：陈云卉

客服电话：400-820-2819

40) 上海陆金所资产管理有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼

法定代表人：郭坚

电话：021-20665952

联系人：宁博宇

客服电话：400-866-6618

41) 大泰金石基金销售有限公司

住所：南京市建邺区江东中路222号南京奥体中心现代五项馆2105室

办公地址：上海市浦东新区峨山路505号东方纯一大厦15楼

法定代表人：袁顾明

电话：021-20324000

联系人：朱海涛

客服电话：400-928-2266

42) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

住所：深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#

办公地址：北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦16层

法定代表人：杨懿

电话：010-83363101

联系人：文雯

客服电话：400-166-1188

43) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

住所：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室

办公地址：上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层

法定代表人：张跃伟

电话：021-20691923

联系人：苗明

客服电话：400-820-2899

44) 上海凯石财富基金销售有限公司

住所：上海市黄浦区西藏南路765号602-115室

办公地址：上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦4楼

法定代表人：陈继武

电话：021-63333389

联系人：王哲宇

客服电话：4000-178-000

45) 奕丰金融服务（深圳）有限公司

住所：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入住深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市南山区海德三路海岸大厦东座1115室，1116室及1307室

法定代表人：TAN YIK KUAN

电话：0755-89460500

联系人：陈广浩

客服电话：400-684-0500

46) 北京新浪仓石基金销售有限公司

住所：北京市海淀区北四环西路58号906室

办公地址：北京市海淀区海淀北二街10号泰鹏大厦12层

法定代表人：张琪

电话：010-62676405

联系人：付文红

客服电话：010-62675369

47) 北京展恒基金销售股份有限公司

住所：北京市顺义区后沙峪镇安富街6号

办公地址：北京市朝阳区安苑路15-1号邮电新闻大厦2层

法定代表人：闫振杰

电话：010-59601366-7024

联系人：李露平

客服电话：400-818-8000

48) 珠海盈米财富管理有限公司

住所：珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼B1201-1203

法定代表人：肖雯

电话：020-896290994

联系人：黄敏嫦

客服电话：020-89629066

49) 一路财富（北京）信息科技有限公司

住所：北京市西城区阜成门外大街2号1幢A2208室

办公地址：北京市西城区阜成门外大街2号1幢A2208室

法定代表人：吴雪秀

电话：010-88312877-8028

联系人：段京璐

客服电话：400-001-1566

50) 上海利得基金销售有限公司

住所：上海市宝山区蕴川路5475号1033室

办公地址：上海浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼

法定代表人：沈继伟

电话：021-50583533

联系人：曹怡晨

客服电话：400-033-7933

51) 深圳富济财富管理有限公司

住所：深圳市南山区粤海街道科苑南路高新南七道惠恒集团二期418室

办公地址：深圳市南山区粤海街道科苑南路高新南七道惠恒集团二期418室

法定代表人：齐小贺

电话：0755-83999907-815

联系人：马力佳

客服电话：0755-83999907

52) 北京广源达信投资管理有限公司

住所：北京市西城区新街口外大街28号C座六层605室

办公地址：北京市朝阳区望京东园四区浦项中心B座19层

法定代表人：齐剑辉

客服电话：400-623-6060

53) 上海云湾投资管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路27号13号楼2层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路27号13号楼2层

法定代表人：戴新装

电话：021-20530224

联系人：江辉

客服电话：400-820-1515

54) 上海联泰资产管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区富特北路277号3层310室

办公地址：上海市长宁区福泉北路518号8号楼3层

法定代表人：燕斌

电话：021-52822063

联系人：兰敏

客服电话：021-52822063

55) 泰诚财富基金销售（大连）有限公司

住所：辽宁省大连市沙河口区星海公园3号

办公地址：辽宁省大连市沙河口区星海公园3号

法定代表人：林卓

电话：0411-88891212

联系人：张晓辉

客服电话：400-6411-999

56) 北京汇成基金销售有限公司

住所：北京市海淀区中关村大街11号11层1108

办公地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1108

法定代表人：王伟刚

电话：010-56282140

联系人：丁向坤

客服电话：400-619-9059

57) 北京肯特瑞财富投资管理有限公司

住所：北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-6

办公地址：北京市大兴区亦庄经济开发区科创十一街18号院京东集团总部

法定代表人：金麟

电话：010-89189285

联系人：徐伯宇

客服电话：4000988511/4000888816

58) 上海大智慧财富管理有限公司

住所：上海市浦东新区杨高南路428号1号楼1102、1103单元



办公地址：上海市浦东新区杨高南路428号1号楼1102、1103单元

法定代表人：申健

电话：021-20219188

联系人：印强明

客服电话：021-20292031

59) 和讯信息科技有限公司

住所：北京市朝阳区大街22号1002室

办公地址：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层

法定代表人：王莉

电话：010-85650628

联系人：刘洋

客服电话：400-920-0022

60) 凤凰金信（银川）投资管理有限公司

住所：宁夏回族自治区银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路142号14层1402

办公地址：北京市朝阳区紫月路18号院朝来高科技产业园18号楼

法定代表人：程刚

电话：010-58160168

联系人：张旭

客服电话：400-810-5919

## 2. 场内销售机构

本基金办理场内认购、申购和赎回业务的销售机构为具有基金销售业务资格、并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的深圳证券交易所会员。具体会员单位名单可在深圳证券交易所网站查询。

基金管理人可根据有关法律法规的要求选择其他机构销售本基金，并及时公告。

### （二）注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街17号

法定代表人：周明

办公地址：北京西城区金融大街27号投资广场23层

联系电话：010-58598839

传真：010-58598907

联系人：朱立元

### （三）出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

办公地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

负责人：俞卫锋

联系电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：安冬

经办律师：安冬、孙睿

（四）审计基金资产的会计师事务所

名称：上会会计师事务所

住所：上海市静安区威海路755号文新报业大厦20楼

办公地址：上海市静安区威海路755号文新报业大厦20楼

执行事务合伙人：张晓荣（首席合伙人）

电话：021-52920000

传真：021-52921369

经办注册会计师：张健、陶喆

联系人：杨伟平

#### 四、基金的名称

本基金名称：中融中证煤炭指数分级证券投资基金

#### 五、基金类别及存续期限

1. 基金类别：股票型证券投资基金
2. 基金运作方式：上市契约型开放式
3. 基金存续期限：不定期

#### 六、基金的投资目标

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。

#### 七、基金的投资范围

本基金投资于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）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金投资于股票的资产不低于基金资产的 85%，投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。

如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

## 八、基金的投资策略

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

本基金管理人主要按照中证煤炭指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的 85%，其中投资于中证煤炭指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

### 2. 股票投资组合构建

#### (1) 组合构建方法

本基金将采用完全复制法构建股票投资组合，以拟合、跟踪中证煤炭指数的收益表现。

#### (2) 组合调整

本基金所构建的股票投资组合原则上根据中证煤炭指数成份股组成及其权重的变动而进行相应调整。同时，本基金还将根据法律法规和基金合同中的投资比例限制、申购赎回变动情况、股票增发因素等变化，对股票投资组合进行实时调整，以保证基金净值增长率与中证煤炭指数收益率之间的高度正相关和跟踪误差最小化。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使本基金的股票投资组合比例符合基金合同的约定。

#### ① 定期调整

根据中证煤炭指数的调整规则和备选股票的预期，对股票投资组合及时进行调整。

#### ② 不定期调整

A. 当上市公司发生增发、配股等影响成份股在指数中权重的行为时，本基金将根据各成份股的权重变化及时调整股票投资组合；

B. 根据本基金的申购和赎回情况，对股票投资组合进行调整，从而有效跟踪中证煤炭指数；

C. 根据法律、法规的规定，成份股在中证煤炭指数中的权重因其它原因发生相应变化的，本基金将做相应调整，以保持基金资产中该成份股的权重同指数一致。

### 3. 债券投资策略

本基金可以根据流动性管理需要，选取到期日在一年以内的政府债券进行配置。本基金债券投资组合将采用自上而下的投资策略，根据宏观经济分析、资金面动向分析等判断未来利率变化，并利用债券定价技术，进行个券选择。

本基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，降低跟踪误差。

### 4. 股指期货投资策略

本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资。本基金投资股指期货将主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

## 九、基金的业绩比较标准

### 1. 标的指数

本基金股票资产的标的指数为中证煤炭指数。

中证煤炭指数从煤与消费用燃料行业中选取相关股票作为成份股，采用自由流通市值加权，并对单个股票设置 10% 权重上限。截至 2015 年 2 月数据显示，中证煤炭指数总市值和自由流通市值分别为 7996 亿和 2301 亿。

### 2. 业绩比较基准

本基金业绩比较基准为： $95\% \times \text{中证煤炭指数收益率} + 5\% \times \text{同期银行活期存款利率（税后）}$ 。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是指数编制单位变更或停止中证煤炭指数的编制、发布或授权，或市场上出现更加适合用于本基金的业绩比较基准的股票指数时，本基金可以在与基金托管人协商同意后变更标的指数、业绩比较基准并及时公告。若变更标的指数、业绩比较基准涉及本基金投资范围或投资策略等实质性变更，则基金管理人应就变更标的指数、业绩比较基准召开基金份额持有人大会，并报中国证监会备案且在指定媒介公告。若变更标的指数、业绩比较基准对基金投资范围和投资策略等无实质性影响（包括但不限于指数编制单位变更、指数更名等事项），本基金可以在与本基金托管人协商同意后变更标的指数、业绩比较基准并及时公告，而无需基金份额持有人大会审议。

## 十、基金的风险收益特征

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。

## 十一. 基金的投资组合报告

本基金管理人董事会及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，并对本报告内容的真实性、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基金合同规定，于2016年12月30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。

本投资组合报告所载数据截至2016年9月30日，本报告中所列财务数据未经审计。

### 1. 报告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	1,145,888,890.37	92.99
	其中：股票	1,145,888,890.37	92.99
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	80,986,114.89	6.57
8	其他资产	5,344,962.28	0.43
9	合计	1,232,219,967.54	100.00

### 2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的股票投资组合

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	985,331,543.54	80.21

C	制造业	160,557,346.83	13.07
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	1,145,888,890.37	93.28

## 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。

## 3. 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

### 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前十名股票投资明细

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	7,186,578	109,235,985.60	8.89
2	000983	西山煤电	9,980,027	95,608,658.66	7.78

3	600157	永泰能源	23,611,759	94,447,036.00	7.69
4	601225	陕西煤业	12,668,199	72,082,052.31	5.87
5	601898	中煤能源	11,593,908	65,505,580.20	5.33
6	601699	潞安环能	7,579,133	60,708,855.33	4.94
7	600348	阳泉煤业	7,616,768	52,327,196.16	4.26
8	601011	宝泰隆	5,197,189	43,292,584.37	3.52
9	000937	冀中能源	6,714,570	41,898,916.80	3.41
10	601001	大同煤业	5,300,723	38,218,212.83	3.11

### 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。

### 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. 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。

### 6. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

### 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投资。

### 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。

### 9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 9.1 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

## 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。

## 11. 投资组合报告附注

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。

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。

### 11.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	925,846.03
2	应收证券清算款	4,245,007.55
3	应收股利	—
4	应收利息	45,108.70
5	应收申购款	129,000.00
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	5,344,962.28

### 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。

### 11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 11.5.1 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不存在流通受限的情况。

#### 11.5.2 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。

### 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。

## 十二. 基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。基金业绩数据截止日为2016年9月30日。

### 1. 本报告期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

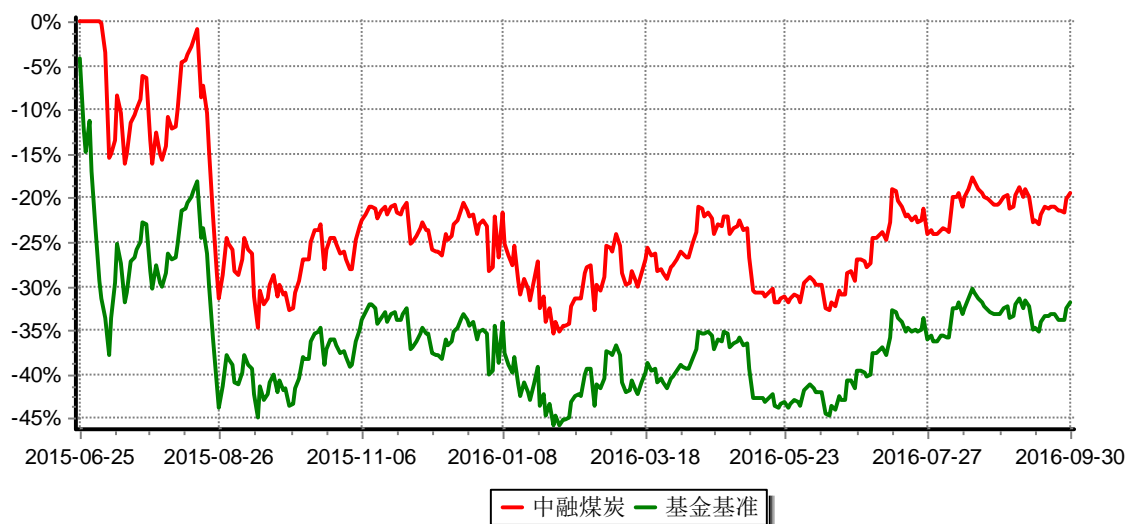
阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准收 益率标准差④	①-③	②-④
自基金合同生效日 (2015年06月25日) 至2016年06月30日	-27.81%	2.77%	-40.22%	2.93%	12.41%	-0.16%
2016年7月01日至 2016年9月30日	11.88%	1.53%	13.92%	1.56%	-2.04%	-0.03%

### 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

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业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2015年06月25日-2016年9月30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。

### 十三、基金的费用与税收

#### (一) 基金费用的种类

1. 基金管理人的管理费；
2. 基金托管人的托管费；
3. 基金合同生效后的标的指数许可使用费；
4. 基金合同生效后的基金信息披露费用；
5. 基金份额持有人大会费用；
6. 基金合同生效后与基金有关的会计师费、律师费和诉讼费；
7. 基金的证券/期货交易费用；
8. 基金上市初费和上市月费；
9. 基金的账户开户费用、账户维护费用；
10. 基金财产拨划支付的银行费用；
11. 依法可以在基金财产中列支的其他费用。

(二) 上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

#### (三) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

##### 1. 基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 1.00% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

##### 2. 基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.22% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

##### 3. 基金合同生效后的标的指数许可使用费

本基金作为指数基金，需根据与指数所有人中证指数有限公司签署的指数许可使用协议的约定向中证指数有限公司支付指数许可使用费。如上述指数许可使用协议约定的费率发生变更，本条下

的指数许可使用费将相应变更，基金管理人将在更新的招募说明书或公告中予以披露，而无需召开基金份额持有人大会。

通常情况下，指数许可使用费按前一日基金资产净值的 0.02% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times \text{年费率} / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的指数许可使用费，

E 为前一日的基金资产净值

指数许可使用费的收取下限为每季度人民币 4 万元（大写：肆万元整）。计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。

指数许可使用费按前一日基金资产净值每日计算，逐日累计。标的指数许可使用费的支付方式为每季支付一次，基金合同生效后，由基金管理人向基金托管人发送指数许可使用费划付指令，经基金托管人复核后，于每年 1 月、4 月、7 月、10 月的最后一个工作日前从基金财产中一次性支付给中证指数有限公司上一季度的标的指数许可使用费。

4. 上述“一、基金费用的种类中第 4-11 项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

#### （四）不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，处理与基金运作无关的事项发生的费用，或其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

（五）基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。调低基金管理费率、基金托管费率等，无须召开基金份额持有人大会，基金管理人必须最迟于新的费率实施前 2 日在指定媒介上刊登公告。

#### （六）基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

## 十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求，对本基金的招募说明书进行了更新，主要更新内容如下：

- （一）更新了“重要提示”中的相关内容。
- （二）更新了“第三部分 基金管理人”中基金管理人的相关信息。
- （三）更新了“第四部分 基金托管人”中基金托管人的相关信息。

- (四) 更新了“第五部分 相关服务机构”中相关服务机构的相关信息。
- (五) 在“第十三部分 基金的投资”中，更新了基金的投资组合报告。
- (六) 更新了“第十四部分 基金的业绩”的相关内容。
- (七) 更新了“第二十八部分 其他应披露事项”的相关内容。

中融基金管理有限公司

2017年2月7日