

# 银华中证内地资源主题指数分级证券投资基金 2016 年半年度报告

2016 年 6 月 30 日

基金管理人：银华基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 24 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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 22 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§2 基金简介</b>	<b>5</b>
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	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
<b>§5 托管人报告</b>	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>13</b>
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
<b>§7 投资组合报告</b>	<b>33</b>
7.1 期末基金资产组合情况	33
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	33
7.3 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	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	38
7.6 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	38
7.7 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	38
7.8 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	38
7.9 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	38
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	38
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	39
7.12 投资组合报告附注	39

<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>40</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	40
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	40
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	41
8.4 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的情况.....	41
<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>42</b>
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	<b>42</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	42
10.2 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.....	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	42
10.4 基金投资策略的改变.....	42
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	43
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	43
10.8 其他重大事件.....	45
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>48</b>
<b>§12 备查文件目录</b> .....	<b>48</b>
12.1 备查文件目录.....	48
12.2 存放地点.....	48
12.3 查阅方式.....	48

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	银华中证内地资源主题指数分级证券投资基金		
基金简称	银华中证内地资源指数分级		
场内简称	中证资源		
基金主代码	161819		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2011 年 12 月 8 日		
基金管理人	银华基金管理有限公司		
基金托管人	中国银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	151,706,061.84 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	2011-12-21		
下属分级基金的基金简称	资源 A 级	资源 B 级	中证资源
下属分级基金的交易代码	150059	150060	161819
报告期末下属分级基金份额总额	44,196,130.00 份	66,294,196.00 份	41,215,735.84 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金力争对中证内地资源主题指数进行有效跟踪，并力争将本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的绝对值控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内，以实现基金资产的长期增值。
投资策略	<p>本基金采用完全复制法，按照成份股在中证内地资源主题指数中的组成及其基准权重构建股票投资组合，以拟合、跟踪中证内地资源主题指数的收益表现，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。</p> <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内地资源主题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> <p>本基金投资于股票的资产不低于基金资产的 85%，投资于中证内地资源主题指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>
业绩比较基准	$95\% \times \text{中证内地资源主题指数收益率} + 5\% \times \text{商业银行人民币活期存款利率（税后）}$ 。

风险收益特征	本基金为股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征。从本基金所分离的两类基金份额来看，银华金瑞份额具有低风险、收益相对稳定的特征；银华鑫瑞份额具有高风险、高预期收益的特征。		
下属分级基金的风险收益特征	低风险、收益相对稳定。	高风险、高预期收益。	较高风险、较高预期收益。

## 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		银华基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨文辉	王永民
	联系电话	(010)58163000	010-66594896
	电子邮箱	yhjj@yhfund.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4006783333, (010)85186558	95566
传真		(010)58163027	(010) 66594942
注册地址		广东省深圳市深南大道6008号特区报业大厦19层	北京西城区复兴门内大街1号
办公地址		北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城C2办公楼15层	北京西城区复兴门内大街1号
邮政编码		100738	100818
法定代表人		王珠林	田国立

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.yhfund.com.cn">http://www.yhfund.com.cn</a>
基金半年度报告备置地点	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
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 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	报告期(2016年1月1日 - 2016年6月30日)
本期已实现收益	-12,478,547.53

本期利润	-11,048,130.12
加权平均基金份额本期利润	-0.0697
本期加权平均净值利润率	-6.91%
本期基金份额净值增长率	-8.27%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>报告期末(2016年6月30日)</b>
期末可供分配利润	-88,549,526.07
期末可供分配基金份额利润	-0.5837
期末基金资产净值	157,862,526.49
期末基金份额净值	1.041
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2016年6月30日)</b>
基金份额累计净值增长率	-35.90%

注：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、期末可供分配利润采用期末资产负债表未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3、本报告所列示的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：基金的认购、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 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	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
过去一个月	1.96%	1.12%	1.76%	1.14%	0.20%	-0.02%
过去三个月	2.36%	1.37%	2.27%	1.37%	0.09%	0.00%
过去六个月	-8.27%	2.29%	-6.61%	2.30%	-1.66%	-0.01%
过去一年	-32.22%	2.80%	-31.44%	2.60%	-0.78%	0.20%
过去三年	0.94%	2.12%	0.35%	2.05%	0.59%	0.07%
自基金合同生效起至今	-35.90%	1.92%	-37.85%	1.91%	1.95%	0.01%

注：本基金业绩比较基准为：95%×中证内地资源主题指数收益率+5%×商业银行人民币活期存款利率（税后）。由于本基金投资标的指数为中证内地资源主题指数，且投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值 5%，因此，本基金将业绩比较基准定为 95%×中证内地资源主题指数收益率+5%×商业银行人民币活期存款利率（税后）。

### 3.2.2 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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效起六个月为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例已达到基金合同的规定：本基金投资于股票的资产不低于基金资产的 85%，投资于中证内地资源主题指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。

## § 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

银华基金管理有限公司成立于 2001 年 5 月 28 日，是经中国证监会批准(证监基金字[2001]7 号文)设立的全国性资产管理公司。公司注册资本为 2 亿元人民币，公司的股东及其出资比例分别为：西南证券股份有限公司 49%、第一创业证券股份有限公司 29%、东北证券股份有限公司 21%及山西海鑫实业股份有限公司 1%。公司的主要业务是基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会

许可的其他业务。公司注册地为广东省深圳市。

截至 2016 年 6 月 30 日,本基金管理人管理着 62 只证券投资基金,具体包括银华优势企业证券投资基金、银华保本增值证券投资基金、银华-道琼斯 88 精选证券投资基金、银华货币市场证券投资基金、银华核心价值优选混合型证券投资基金、银华优质增长混合型证券投资基金、银华富裕主题混合型证券投资基金、银华领先策略混合型证券投资基金、银华全球核心优选证券投资基金、银华内需精选混合型证券投资基金(LOF)、银华增强收益债券型证券投资基金、银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金、银华沪深 300 指数分级证券投资基金、银华深证 100 指数分级证券投资基金、银华信用债券型证券投资基金(LOF)、银华成长先锋混合型证券投资基金、银华信用双利债券型证券投资基金、银华抗通胀主题证券投资基金(LOF)、银华中证等权重 90 指数分级证券投资基金、银华永祥保本混合型证券投资基金、银华消费主题分级混合型证券投资基金、银华中证内地资源主题指数分级证券投资基金、银华永泰积极债券型证券投资基金、银华中小盘精选混合型证券投资基金、银华纯债信用主题债券型证券投资基金(LOF)、上证 50 等权重交易型开放式指数证券投资基金、银华上证 50 等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金、银华中证中票 50 指数债券型证券投资基金(LOF)、银华永兴纯债债券型发起式证券投资基金(LOF)、银华交易型货币市场基金、银华信用四季红债券型证券投资基金、银华中证转债指数增强分级证券投资基金、银华信用季季红债券型证券投资基金、银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金、银华永利债券型证券投资基金、银华恒生中国企业指数分级证券投资基金、银华多利宝货币市场基金、银华永益分级债券型证券投资基金和银华活钱宝货币市场基金、银华双月定期理财债券型证券投资基金、银华高端制造业灵活配置混合型证券投资基金、银华惠增利货币市场基金、银华回报灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、银华泰利灵活配置混合型证券投资基金、银华中国梦 30 股票型证券投资基金、银华恒利灵活配置混合型证券投资基金、银华聚利灵活配置混合型证券投资基金、银华汇利灵活配置混合型证券投资基金、银华稳利灵活配置混合型证券投资基金、银华中证国防安全指数分级证券投资基金、银华中证一带一路主题指数分级证券投资基金、银华战略新兴灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、银华逆向投资灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、银华互联网主题灵活配置混合型证券投资基金、银华生态环保主题灵活配置混合型证券投资基金、银华合利债券型证券投资基金、银华添益定期开放债券型证券投资基金、银华远景债券型证券投资基金、银华双动力债券型证券投资基金、银华大数据灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金、银华多元视野灵活配置混合型证券投资基金。同时,本基金管理人管理着多个全国社保基金、企业年金和特定客户资产管理投资组合。

#### 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		
马君女士	本基金的 基金经理	2012年9月4日	-	7年	硕士学位。2008年9月至2009年3月任职大成基金管理有限公司助理金融工程师。2009年3月加盟银华基金管理有限公司，曾担任研究员及基金经理助理职务。2013年12月16日至2015年7月16日兼任银华消费主题分级股票型证券投资基金基金经理，2015年8月6日起兼任银华中证国防安全指数分级证券投资基金基金经理，2015年8月13日起兼任银华中证一带一路主题指数分级证券投资基金基金经理，自2016年1月14日起兼任银华抗通胀主题证券投资基金（LOF）基金经理。具有从业资格。国籍：中国。

注：1、此处的任职日期和离任日期均指基金合同生效日或公司作出决定之日。

2、证券从业的含义符合行业普遍认可的计算标准。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《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》及其各项实施准则、《银华中证内地资源主题指数分级证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，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，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，制定了《公平交易制度》和《公平交易执行制度》等，并建立了健全有效的公平交易执行体系，保证公平对待旗下的每一个投资组合。

在投资决策环节，本基金管理人构建了统一的研究平台，为旗下所有投资组合公平地提供研究支持。同时，在投资决策过程中，各基金经理、投资经理严格遵守本基金管理人的各项投资管理制度和投资授权制度，保证各投资组合的独立投资决策机制。

在交易执行环节，本基金管理人实行集中交易制度，按照“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”的原则，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。

在事后监控环节，本基金管理人定期对股票交易情况进行分析，并出具公平交易执行情况分析报告；另外，本基金管理人还对公平交易制度的遵守和相关业务流程的执行情况进行定期和不定期的检查，并对发现的问题进行及时报告。

综上所述，本基金管理人在本报告期内严格执行了公平交易制度的相关规定。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内，本基金管理人所有投资组合不存在参与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的 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

2016 年上半年，A 股市场开年大跌，叠加熔断机制加剧市场恐慌，上证综指在一个月内大幅下跌 25%，之后小幅反弹底部窄幅震荡。上半年沪深 300 指数下跌 15.47%，中证内地资源指数下跌 7.13%。一季度商品价格暴涨，由于系统性风险，资源类股票跟随大盘大幅下跌，资源类股票相对大盘有超额收益。二季度在商品价格平稳和供给侧改革深入推进的背景下，大家对资源类股票的盈利改善预期发生了变化，资源类股票在二季度后期再度开启了上涨，持续超越大盘。

在报告期内，我们运用自行开发的量化投资管理系统，采用系统管理和人工管理相结合的方式处理基金日常运作中所碰到的申购赎回处理、结构配比较验、风险优化等一系列事件，将本基金的跟踪误差控制在合理水平。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.041 元，本报告期份额净值增长率为-8.27%，同期业绩比较基准收益率为-6.61%。报告期内，本基金日均跟踪误差控制在 0.35%之内，年化跟踪误差控制在 4%之内。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2016 年下半年，原油价格预计会在 35-60 美元震荡的格局中，下半年震荡中枢预计不断提高，但页岩油的弹性使得油价突破 60 美元的可能性较小。英国脱欧事件的长远影响使得大家对全球经济重新进入下行或底部区域的预期中，避险需求导致黄金价格暴涨，并且重新开启的新一轮量化宽松预期，这又使得处于低位的商品价格在二季度末重新启动，加入暴涨的行列。叠加去年底供给侧改革推进的效应，煤炭有色等在去产能、行业整合以及价格暴涨等的背景下终于启动了大幅反弹行情，部分煤炭有色企业已经达到盈利改善弹性最大的拐点，建议关注有业绩支撑和国企改革预期的龙头企业。黑色金属方面，最近国务院又重新将加强基础设施建设放入讨论议程，供给侧改革深入推进已经给部分钢铁龙头企业带来了盈利改善，建议关注政策预期的推进和大型钢铁企业并购重组的投资机会。除此之外，新能源产业链业绩确定，但随着前两个季度股价上涨，估值较高，可关注阶段性回调的介入机会。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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同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（委员包括估值业务分管领导以及投资部、研究部、监察稽核部、运作保障部等部门负责人及相关业务骨干），负责研究、指导基金估值业务。估值委员会委员和负责基金日常估值业务的基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。基金经理不介入基金日常估值业务；估值委员会决议之前会与涉及基金的基金经理进行充分沟通。运作保障部负责执行估值委员会制定的估值政策及决议。

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；本基金管理人未签约与估值相关的任何定价服务。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同的约定，在存续期内，本基金（包括中证资源份额、资源 A 级份额、资

源 B 级份额) 不进行收益分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内, 本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 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, 中国银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在对银华中证内地资源主题指数分级证券投资基金(以下称“本基金”)的托管过程中, 严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定, 不存在损害基金份额持有人利益的行为, 完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

### 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, 本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定, 对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督, 对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核, 未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据核对无误。(注: 财务会计报告中的“金融工具风险管理”部分未在托管人复核范围内。)

## § 6 半年度财务会计报告(未经审计)

### 6.1 资产负债表

会计主体: 银华中证内地资源主题指数分级证券投资基金

报告截止日: 2016 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产:</b>			
银行存款	6.4.7.1	9,642,124.16	9,226,261.45
结算备付金		-	721.45
存出保证金		46,487.00	243,037.43
交易性金融资产	6.4.7.2	148,370,351.24	149,444,933.89

其中：股票投资		148,370,351.24	149,444,933.89
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		1,387,963.26	-
应收利息	6.4.7.5	1,934.58	2,302.08
应收股利		-	-
应收申购款		12,209.08	78,615.40
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		159,461,069.32	158,995,871.70
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年6月30日</b>	<b>上年度末 2015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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	90.83
应付赎回款		1,050,172.54	183,665.78
应付管理人报酬		134,624.00	126,722.32
应付托管费		26,924.79	25,344.46
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	54,883.93	67,886.62
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	331,937.57	423,682.34
负债合计		1,598,542.83	827,392.35
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	246,412,052.56	226,671,701.51
未分配利润	6.4.7.10	-88,549,526.07	-68,503,222.16
所有者权益合计		157,862,526.49	158,168,479.35
负债和所有者权益总计		159,461,069.32	158,995,871.70

注：报告截止日 2016 年 06 月 30 日，中证资源份额净值人民币 1.041 元，资源 A 级份额净值人民币 1.025 元，资源 B 级份额净值人民币 1.052 元；基金份额总额 151,706,061.84 份，其中中证资源份额 41,215,735.84 份，资源 A 级份额 44,196,130.00 份，资源 B 级份额 66,294,196.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：银华中证内地资源主题指数分级证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		-9,646,592.17	101,958,177.44
1.利息收入		45,940.14	148,695.02
其中：存款利息收入	6.4.7.11	45,940.14	148,695.02
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		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-11,218,913.91	115,334,281.22
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-11,548,267.56	113,391,013.30
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	329,353.65	1,943,267.92
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	1,430,417.41	-14,434,553.05
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	95,964.19	909,754.25
<b>减：二、费用</b>		1,401,537.95	4,777,731.67
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	790,068.45	2,369,815.24
2. 托管费	6.4.10.2.2	158,013.78	473,963.14
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	139,398.59	1,593,875.35
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	314,057.13	340,077.94
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-11,048,130.12	97,180,445.77
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-11,048,130.12	97,180,445.77

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银华中证内地资源主题指数分级证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	226,671,701.51	-68,503,222.16	158,168,479.35
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-11,048,130.12	-11,048,130.12
三、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）	19,740,351.05	-8,998,173.79	10,742,177.26
其中：1.基金申购款	142,848,876.09	-54,639,457.05	88,209,419.04
2.基金赎回款	-123,108,525.04	45,641,283.26	-77,467,241.78
四、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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	246,412,052.56	-88,549,526.07	157,862,526.49
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	596,153,809.46	-144,588,500.11	451,565,309.35
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	97,180,445.77	97,180,445.77
三、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）	-186,862,672.19	24,594,535.38	-162,268,136.81
其中：1.基金申购款	620,117,976.29	-13,358,629.94	606,759,346.35
2.基金赎回款	-806,980,648.48	37,953,165.32	-769,027,483.16
四、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)			
五、期末所有者权益（基金净值）	409,291,137.27	-22,813,518.96	386,477,618.31

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 王立新 _____	_____ 杨清 _____	_____ 龚飒 _____
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

银华中证内地资源主题指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2011]1592 号文《关于核准银华中证内地资源主题指数分级证券投资基金募集的批复》的核准，由银华基金管理有限公司于 2011 年 11 月 7 日至 2011 年 12 月 2 日向社会公开募集，基金合同于 2011 年 12 月 8 日生效，首次设立募集规模为 1,301,965,701.68 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为银华基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金的基金份额包括银华中证内地资源主题指数分级证券投资基金之基础份额（即“中证资源份额”）、银华中证内地资源主题指数分级证券投资基金之稳健收益类份额（即“资源 A 级份额”）与银华中证内地资源主题指数分级证券投资基金之积极收益类份额（即“资源 B 级份额”）。其中，资源 A 级份额、资源 B 级份额的基金份额配比始终保持 4:6 的比例不变。（注：根据《关于银华中证内地资源主题指数分级证券投资基金变更子份额场内简称的公告》，自 2015 年 4 月 24 日起，本基金稳健收益类份额的场内简称由“YH 资源 A”更名为“资源 A 级”，本基金积极收益类份额的场内简称由“YH 资源 B”更名为“资源 B 级”。）

在资源 A 级份额、中证资源份额存续期内的每个会计年度（除基金合同生效日所在会计年度外）第一个工作日，本基金将根据基金合同的规定进行基金的定期份额折算。资源 A 级份额和资源 B 级份额按照基金合同规定的净值计算规则进行净值计算，对资源 A 级份额的应得收益进行定期份额折算，每 10 份中证资源份额将按 4 份资源 A 级份额获得约定应得收益的新增折算份额。在基金份额折算前与折算后，资源 A 级份额和资源 B 级份额的份额配比保持 4:6 的比例。对于资源 A 级份额期末的约定应得收益，即资源 A 级份额每个会计年度 12 月 31 日份额净值超出人民币 1.000 元部分，将折算为场内中证资源份额分配给资源 A 级份额持有人。中证资源份额持有人持有的每

10 份中证资源份额将按 4 份资源 A 级份额获得新增中证资源份额的分配。持有场外中证资源份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外中证资源份额的分配；持有场内中证资源份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内中证资源份额的分配。经过上述份额折算，资源 A 级份额和中证资源份额的基金份额净值将相应调整。每个会计年度第一个工作日为基金份额折算基准日，本基金将对资源 A 级份额和中证资源份额进行应得收益的定期份额折算。

除以上定期份额折算外，本基金还将在以下两种情况进行份额折算，即：当中证资源份额的基金份额净值达到人民币 2.500 元及以上；当资源 B 级份额的基金份额净值达到人民币 0.250 元及以下。当中证资源份额的基金份额净值达到人民币 2.500 元后，本基金将分别对资源 A 级份额、资源 B 级份额和中证资源份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保资源 A 级份额和资源 B 级份额的比例为 4:6，份额折算后资源 A 级份额、资源 B 级份额和中证资源份额的基金份额净值均调整为人民币 1.000 元。当资源 B 级份额的基金份额净值达到人民币 0.250 元后，本基金将分别对资源 A 级份额、资源 B 级份额和中证资源份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保资源 A 级份额和资源 B 级份额的比例为 4:6，份额折算后中证资源份额、资源 A 级份额和资源 B 级份额的基金份额净值均调整为人民币 1.000 元。

中证资源份额设置单独的基金代码，只可以进行场内与场外的申购和赎回，但不上市交易。资源 A 级份额与资源 B 级份额交易代码不同，只可在深圳证券交易所上市交易，不可单独进行申购或赎回。投资人可在场外申购和赎回中证资源份额。场外申购的中证资源份额不进行分拆，投资人可将其持有的场外中证资源份额跨系统转托管至场内并申请将其分拆成资源 A 级份额和资源 B 级份额后上市交易。投资人可按 4:6 的配比将其持有的资源 A 级份额和资源 B 级份额合并为中证资源份额后赎回。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括中证内地资源主题指数的成份股、备选成份股、新股（含首次公开发行和增发）、债券、债券回购以及法律法规或中国证监会允许本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）。本基金投资于股票的资产不低于基金资产的 85%，投资于中证内地资源主题指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。如法律法规和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。本基金的业绩比较基准为： $95\% \times \text{中证内地资源主题指数收益率} + 5\% \times \text{商业银行人民币活期存款利率（税后）}$ 。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《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、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具

体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《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 3 号《半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〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2016 年 06 月 30 日的财务状况以及 2016 年上半年的经营成果和净值变动情况。

### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期财务报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.4.1 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期间无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### 6.4.6 税项

#### 6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

#### 6.4.6.2 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，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，暂不征收企业所得税。

#### 6.4.6.3 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金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，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号《财政部国家税务总局关于储蓄存款利息所得

有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
活期存款	9,642,124.16
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	9,642,124.16

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	177,567,762.52	148,370,351.24	-29,197,411.28
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	177,567,762.52	148,370,351.24	-29,197,411.28

##### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

##### 6.4.7.4 买入返售金融资产

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,908.32
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	0.03
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	7.42
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	18.81
合计	1,934.58

#### 6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	54,883.93
银行间市场应付交易费用	-
合计	54,883.93

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2,451.88
标的指数使用基点费	100,000.00
预提费用	201,390.28
其他	28,095.41
合计	331,937.57

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	136,314,777.79	226,671,701.51
本期申购	39,236.60	65,227.09
本期赎回(以“-”号填列)	-35,816.05	-59,540.57
2016 年 1 月 4 日 基金拆分/份额折算前	136,318,198.34	226,677,388.03
基金拆分/份额折算变动份额	3,237,659.23	-
本期申购	87,914,507.39	142,783,649.00
本期赎回(以“-”号填列)	-75,764,303.12	-123,048,984.47
本期末	151,706,061.84	246,412,052.56

注：(1)根据本基金的基金合同、招募说明书及深圳证券交易所（以下简称“深交所”）和中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中登结”）的规定，本基金以 2016 年 1 月 4 日为份额折算基准日，对中证资源份额以及资源 A 级份额实施了定期份额折算。

(2)根据基金合同规定，投资者可申购、赎回中证资源份额，资源 A 级份额和资源 B 级份额只可在深交所上市交易，因此上表不再单独披露资源 A 级份额和资源 B 级份额的情况。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-37,280,682.87	-31,222,539.29	-68,503,222.16
本期利润	-12,478,547.53	1,430,417.41	-11,048,130.12
本期基金份额交易产生的变动数	-2,605,665.19	-6,392,508.60	-8,998,173.79
其中：基金申购款	-24,243,611.41	-30,395,845.64	-54,639,457.05
基金赎回款	21,637,946.22	24,003,337.04	45,641,283.26
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-52,364,895.59	-36,184,630.48	-88,549,526.07

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	44,709.67
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	644.64
其他	585.83
合计	45,940.14

**6.4.7.12 股票投资收益****6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	42,976,339.45
减：卖出股票成本总额	54,524,607.01
买卖股票差价收入	-11,548,267.56

**6.4.7.13 债券投资收益**

注：本基金本报告期无债券投资收益。

**6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益**

注：本基金本报告期无买卖资产支持证券投资收益。

**6.4.7.14 贵金属投资收益**

注：本基金本报告期无买卖贵金属投资收益。

**6.4.7.15 衍生工具收益**

注：本基金本报告期无买卖衍生工具投资收益。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	329,353.65
基金投资产生的股利收益	-
合计	329,353.65

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1. 交易性金融资产	1,430,417.41
——股票投资	1,430,417.41
——债券投资	-
——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	-
合计	1,430,417.41

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	95,964.19
合计	95,964.19

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	139,398.59
银行间市场交易费用	-
合计	139,398.59

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	22,376.90
信息披露费	149,178.12
标的指数使用基点费	100,000.00
银行汇划费用	3,466.85
账户服务费	9,200.00
上市费	29,835.26
合计	314,057.13

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至资产负债表日，本基金无需做披露的资产负债表日后事项。

### 6.4.9 关联方关系

#### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其它重大利害关系的关联方未发生变化。

#### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
西南证券股份有限公司（“西南证券”）	基金管理人股东、基金代销机构
银华基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金代销机构

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。

### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30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
西南证券	24,356,280.94	25.77%	153,764,230.37	15.47%
东北证券	-	-	8,216,501.89	0.83%

##### 6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

##### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

##### 6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

##### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30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
西南证券	22,683.07	25.76%	22,683.07	41.33%
关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30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
东北证券	7,480.81	0.83%	-	-
西南证券	139,986.84	15.47%	124,489.75	16.78%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费和经手费后的净额列示。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。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6 月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30 日
	当期发生的基金应支付的管理费	790,068.45
其中：支付销售机构的客户维护费	86,244.45	235,578.02

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.00% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6 月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30 日
	当期发生的基金应支付的托管费	158,013.78

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20% 的年费率计

提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

注：本基金的管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.10.4.2 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：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未持有本基金份额。

#### 6.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2016年1月1日至2016年6月30日		2015年1月1日至2015年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	9,642,124.16	44,709.67	32,074,735.02	144,220.16

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无需要说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：根据本基金基金合同的约定，在存续期内，本基金（包括中证资源份额、资源 A 级份额、资源 B 级份额）不进行收益分配。

#### 6.4.12 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

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

注：本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

**6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601168	西部矿业	2016年2月1日	重大事项	6.84	2016年7月22日	6.52	442,344	3,975,197.79	3,025,632.96	-
000975	银泰资源	2016年4月19日	重大事项	15.00	-	-	158,348	2,345,765.31	2,375,220.00	-
600497	驰宏锌锗	2016年6月13日	重大事项	9.97	2016年7月11日	10.97	227,782	2,853,830.16	2,270,986.54	-
600614	鼎立股份	2016年4月26日	重大事项	8.14	-	-	168,529	1,770,436.12	1,371,826.06	-
000693	ST华泽	2016年3月1日	重大事项	12.50	-	-	63,043	1,558,035.18	788,037.50	-

**6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

本基金本报告期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

**6.4.13 金融工具风险及管理****6.4.13.1 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财务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。

本基金管理人建立了以董事会风险控制委员会为核心的，由董事会风险控制委员会、经营管理层及各具体业务部门组成的三道风险监控防线；并在后两道监控防线中，由独立于公司管理层和其他业务部门的督察长和监察稽核部对公司合规风险状况及各部门风险控制措施进行检查、监督及报告。

**6.4.13.2 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之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好

信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此，除在 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，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。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（所有者权益）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。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时根据设定的流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

### 6.4.13.4 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。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、存出保证金等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月 -1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	9,642,124.16	-	-	-	-	-	9,642,124.16
存出保证金	46,487.00	-	-	-	-	-	46,487.00

交易性金融资产	-	-	-	-	-	-	-148,370,351.24	148,370,351.24
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	1,387,963.26	1,387,963.26
应收利息	-	-	-	-	-	-	1,934.58	1,934.58
应收申购款	-	-	-	-	-	-	12,209.08	12,209.08
其他资产	-	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	9,688,611.16	-	-	-	-	-	-149,772,458.16	159,461,069.32
负债	-	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	1,050,172.54	1,050,172.54
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	134,624.00	134,624.00
应付托管费	-	-	-	-	-	-	26,924.79	26,924.79
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	54,883.93	54,883.93
其他负债	-	-	-	-	-	-	331,937.57	331,937.57
负债总计	-	-	-	-	-	-	1,598,542.83	1,598,542.83
利率敏感度缺口	9,688,611.16	-	-	-	-	-	-148,173,915.33	157,862,526.49
上年度末 2015 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月 -1 年	1-5 年	5 年以上	不计息		合计
资产								
银行存款	9,226,261.45	-	-	-	-	-	-	9,226,261.45
结算备付金	721.45	-	-	-	-	-	-	721.45
存出保证金	243,037.43	-	-	-	-	-	-	243,037.43
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-	-149,444,933.89	149,444,933.89
应收利息	-	-	-	-	-	-	2,302.08	2,302.08
应收申购款	-	-	-	-	-	-	78,615.40	78,615.40
资产总计	9,470,020.33	-	-	-	-	-	-149,525,851.37	158,995,871.70
负债								
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	90.83	90.83
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	183,665.78	183,665.78
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	126,722.32	126,722.32
应付托管费	-	-	-	-	-	-	25,344.46	25,344.46
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	67,886.62	67,886.62
其他负债	-	-	-	-	-	-	423,682.34	423,682.34
负债总计	-	-	-	-	-	-	827,392.35	827,392.35
利率敏感度缺口	9,470,020.33	-	-	-	-	-	-148,698,459.02	158,168,479.35

注：上表统计了本基金交易的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金于报告期末持有的利率敏感性资产主要为银行存款，除此外的金融资产和金融负债均不计息，因此市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括中证内地资源主题指数的成份股、备选成份股、新股（含首次公开发行和增发）、债券、债券回购以及法律法规或中国证监会允许本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）。

本基金投资于股票的资产不低于基金资产的 85%，投资于中证内地资源主题指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。于本报告期末，本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

##### 6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日		上年度末 2015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	148,370,351.24	93.99	149,444,933.89	94.48
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
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	148,370,351.24	93.99	149,444,933.89	94.48

##### 6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；	
	用期末时点比较基准浮动 5% 基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；	
	Beta 系数是根据过去一个年度的基金资产净值和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。	
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（2016年6月30日）	上年度末（2015年12月31日）
+5%		8,419,443.47	20,543,665.58
-5%		-8,419,443.47	-20,543,665.58

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。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 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	148,370,351.24	93.04
	其中：股票	148,370,351.24	93.04
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	9,642,124.16	6.05
7	其他各项资产	1,448,593.92	0.91
8	合计	159,461,069.32	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	94,449,958.81	59.83
C	制造业	51,581,782.63	32.68

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	1,550,572.30	0.98
	合计	147,582,313.74	93.49

### 7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	采掘业	788,037.50	0.50
C	制造业	-	-
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	788,037.50	0.50

### 7.2.3 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有沪港通股票投资。

## 7.3 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

### 7.3.1 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	600028	中国石化	2,423,129	11,437,168.88	7.25
2	601857	中国石油	1,119,881	8,096,739.63	5.13
3	601899	紫金矿业	2,185,900	7,366,483.00	4.67
4	600111	北方稀土	502,592	6,689,499.52	4.24
5	601088	中国神华	456,182	6,418,480.74	4.07
6	600547	山东黄金	164,090	6,384,741.90	4.04
7	002466	天齐锂业	137,421	5,866,502.49	3.72
8	601600	中国铝业	1,263,488	4,763,349.76	3.02
9	600489	中金黄金	397,877	4,472,137.48	2.83
10	002340	格林美	469,802	4,120,163.54	2.61
11	000630	铜陵有色	1,542,687	3,918,424.98	2.48
12	000060	中金岭南	357,019	3,723,708.17	2.36
13	603993	洛阳钼业	895,698	3,717,146.70	2.35
14	600219	南山铝业	457,681	3,386,839.40	2.15
15	600157	永泰能源	859,588	3,386,776.72	2.15
16	601168	西部矿业	442,344	3,025,632.96	1.92
17	600256	广汇能源	722,297	2,961,417.70	1.88
18	000983	西山煤电	363,175	2,959,876.25	1.87
19	600362	江西铜业	191,411	2,580,220.28	1.63
20	600673	东阳光科	398,328	2,489,550.00	1.58
21	601225	陕西煤业	461,143	2,384,109.31	1.51
22	000762	西藏矿业	96,100	2,375,592.00	1.50
23	000975	银泰资源	158,348	2,375,220.00	1.50
24	000697	炼石有色	103,230	2,358,805.50	1.49

25	600497	驰宏锌锗	227,782	2,270,986.54	1.44
26	601898	中煤能源	422,068	2,177,870.88	1.38
27	600516	方大炭素	237,763	2,173,153.82	1.38
28	600392	盛和资源	130,133	2,131,578.54	1.35
29	000758	中色股份	272,512	2,111,968.00	1.34
30	600259	广晟有色	36,335	2,080,542.10	1.32
31	002155	湖南黄金	156,644	2,063,001.48	1.31
32	000878	云南铜业	195,900	1,994,262.00	1.26
33	601958	金钼股份	223,128	1,818,493.20	1.15
34	002428	云南锗业	105,456	1,811,734.08	1.15
35	601699	潞安环能	275,967	1,804,824.18	1.14
36	600348	阳泉煤业	277,303	1,766,420.11	1.12
37	000969	安泰科技	118,346	1,660,394.38	1.05
38	600175	美都能源	329,909	1,550,572.30	0.98
39	000519	江南红箭	119,083	1,513,544.93	0.96
40	000612	焦作万方	194,262	1,387,030.68	0.88
41	600614	鼎立股份	168,529	1,371,826.06	0.87
42	000937	冀中能源	244,414	1,300,282.48	0.82
43	600395	盘江股份	152,681	1,261,145.06	0.80
44	002128	露天煤业	150,824	1,132,688.24	0.72
45	000552	靖远煤电	316,390	1,113,692.80	0.71
46	601666	平煤股份	272,120	1,112,970.80	0.71
47	601001	大同煤业	193,063	1,036,748.31	0.66
48	600188	XD 兖州煤	88,819	971,679.86	0.62
49	600397	安源煤业	159,800	706,316.00	0.45

### 7.3.2 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	占基金资产净值比例（%）
1	000693	ST 华泽	63,043	788,037.50	0.50

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 7.4.1 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	002466	天齐锂业	6,147,168.56	3.89
2	600028	中国石化	3,035,487.00	1.92
3	000762	西藏矿业	2,521,951.00	1.59
4	601857	中国石油	2,307,587.00	1.46
5	000630	铜陵有色	2,236,846.50	1.41
6	000878	云南铜业	2,005,986.25	1.27
7	601899	紫金矿业	1,968,076.30	1.24
8	601088	中国神华	1,744,058.14	1.10
9	600111	北方稀土	1,732,625.00	1.10
10	603993	洛阳钼业	1,681,195.88	1.06
11	601600	中国铝业	1,548,179.00	0.98
12	600489	中金黄金	1,453,032.08	0.92
13	000060	中金岭南	1,223,464.00	0.77
14	600219	南山铝业	1,193,937.99	0.75
15	600547	山东黄金	1,174,228.00	0.74
16	600157	永泰能源	1,158,972.70	0.73
17	600256	广汇能源	872,830.00	0.55
18	002340	格林美	853,867.00	0.54
19	600673	东阳光科	842,142.62	0.53
20	000552	靖远煤电	829,850.00	0.52

注：“买入金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

#### 7.4.2 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	600549	厦门钨业	3,369,942.88	2.13
2	600028	中国石化	3,329,272.00	2.10
3	000831	*ST 五稀	2,818,870.29	1.78
4	601857	中国石油	2,359,709.00	1.49
5	600111	北方稀土	2,011,420.00	1.27
6	601899	紫金矿业	2,001,734.00	1.27
7	601088	中国神华	1,817,762.26	1.15
8	600547	山东黄金	1,525,192.00	0.96
9	601600	中国铝业	1,477,983.00	0.93
10	000933	*ST 神火	1,313,924.42	0.83

11	600489	中金黄金	1,184,989.38	0.75
12	002340	格林美	1,018,204.00	0.64
13	002203	海亮股份	962,940.61	0.61
14	600219	南山铝业	906,341.00	0.57
15	600157	永泰能源	891,814.00	0.56
16	600256	广汇能源	884,907.00	0.56
17	000969	安泰科技	832,363.25	0.53
18	000983	西山煤电	771,536.00	0.49
19	600673	东阳光科	758,248.50	0.48
20	600362	江西铜业	729,651.70	0.46

注：“卖出金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

### 7.4.3 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	52,019,606.95
卖出股票收入（成交）总额	42,976,339.45

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。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 7.6 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

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 7.7 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。

### 7.8 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。

### 7.9 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。

### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

### 7.11 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。

### 7.12 投资组合报告附注

**7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期不存在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。**

**7.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库之外的情形。**

### 7.12.3 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	46,487.00
2	应收证券清算款	1,387,963.26
3	应收股利	-
4	应收利息	1,934.58
5	应收申购款	12,209.08
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,448,593.92

### 7.12.4 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。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.12.5.1 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情况。

#### 7.12.5.2 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	000693	ST 华泽	788,037.50	0.50	重大事项

### 7.12.6 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可能有尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 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
资源 A 级	214	206,523.97	41,348,413.00	93.56%	2,847,717.00	6.44%
资源 B 级	3,713	17,854.62	4,795,096.00	7.23%	61,499,100.00	92.77%
中证资源	4,804	8,579.46	3,205,248.98	7.78%	38,010,486.86	92.22%
合计	8,731	17,375.57	49,348,757.98	32.53%	102,357,303.86	67.47%

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。

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

资源 A 级

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中国太平洋人寿保险股份有限公司—传统—普通保险产品	13,340,191.00	30.18%
2	上海明汰投资管理有限公司—明汰CTA一号基金	11,213,666.00	25.37%
3	中国太平洋人寿保险股份有限公司—分红—个人分红	10,474,884.00	23.70%
4	上海明汰投资管理有限公司—明汰多策略对冲1号基金	2,737,708.00	6.19%
5	北京千石创富—招商银行—千石资本—华宝证券明汰套利1号资产管理计划	2,048,760.00	4.64%
6	黄志明	1,199,424.00	2.71%
7	易方达基金—农业银行—中油财务有限责任公司	787,000.00	1.78%
8	海通期货有限公司—海通期货锦程2号特定多客户专项资产管理计划	637,480.00	1.44%
9	蔡淑婷	248,935.00	0.56%
10	黄旭	248,935.00	0.56%

资源 B 级

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	滕泰	3,615,600.00	5.45%
2	黎建华	2,108,867.00	3.18%
3	华龙证券股份有限公司客户信用交易担保证券账户	1,005,000.00	1.52%
4	王广印	892,934.00	1.35%
5	中欧盛世资产—兴业银行—兴业信托—兴福 TOP 量化优选 30 集合资金信托计划	801,145.00	1.21%
6	中欧盛世资产—兴业银行—全意通宝（安享）—量金添利五号量化对冲资产管理计划	762,800.00	1.15%
7	东方点石投资管理有限公司—东方点睛 3 号多策略套利型投资基金	699,902.00	1.06%
8	于倍	649,300.00	0.98%
9	岑小平	590,000.00	0.89%
10	王晓刚	520,000.00	0.78%

注：1. 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。

2. 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。

### 8.3 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	资源 A 级	-	-
	资源 B 级	-	-
	中证资源	13,003.56	0.03%
	合计	13,003.56	0.01%

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，合计数比例的分母采用期末基金份额总额。

### 8.4 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的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	资源 A 级	0
	资源 B 级	0
	中证资源	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	资源 A 级	0
	资源 B 级	0

	中证资源	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	资源 A 级	资源 B 级	中证资源
基金合同生效日(2011 年 12 月 8 日)	-	-	1,301,965,701.68
基金份额总额			
本报告期期初基金份额总额	39,492,814.00	59,239,222.00	37,582,741.79
本报告期基金总申购份额	-	-	87,953,743.99
减:本报告期基金总赎回份额	-	-	75,800,119.17
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	4,703,316.00	7,054,974.00	-8,520,630.77
本报告期期末基金份额总额	44,196,130.00	66,294,196.00	41,215,735.84

注：拆分变动份额含本基金三级份额之间的配对转换份额和基金份额折算中的调整份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 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

#### 10.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

#### 10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金托管人未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产以及基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，基金投资策略未发生改变。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未变更为其审计的会计师事务所。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 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	
渤海证券股份有限公司	3	27,687,452.91	29.29%	25,785.60	29.29%	-
西南证券股份有限公司	2	24,356,280.94	25.77%	22,683.07	25.76%	-
中国中投证券有限责任公司	2	10,665,080.13	11.28%	9,932.55	11.28%	-
申万宏源集团股份有限公司	2	9,291,852.19	9.83%	8,655.38	9.83%	-
国海证券股份有限公司	1	8,768,443.76	9.28%	8,166.11	9.28%	-
华泰证券股份有限公司	1	7,424,416.00	7.85%	6,914.30	7.85%	撤销 1 个交易单元
华鑫证券有限责任公司	1	3,158,224.99	3.34%	2,941.22	3.34%	-
中信建投证券股份有限公司	3	2,015,234.00	2.13%	1,876.74	2.13%	-
中信证券股份有限公司	3	1,163,494.00	1.23%	1,083.65	1.23%	-
国元证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
广州证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
上海华信证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-

华西证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
东北证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
国开证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
平安证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
华创证券有限 责任公司	2	-	-	-	-	-
华融证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
国泰君安证券 股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国信证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
大同证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
西部证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
第一创业证券 股份有限公司	1	-	-	-	-	-
恒泰证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
中天证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
方正证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
国金证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
国盛证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
北京高华证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证券 股份有限公司	3	-	-	-	-	-
首创证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
川财证券有限 责任公司	2	-	-	-	-	-
中航证券有限 公司	1	-	-	-	-	-

联讯证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
国联证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
中银国际证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	-
山西证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
财达证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
德邦证券股份 有限公司	0	-	-	-	-	撤销 1 个交易单元

注：1、基金专用交易单元的选择标准为该证券经营机构具有较强的研究服务能力，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析报告、个股分析报告、市场服务报告以及全面的信息服务等。

2、基金专用交易单元的选择程序为根据标准进行考察后，确定证券经营机构的选择。经公司批准后与被选择的证券经营机构签订协议。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

注：本基金本报告期末通过交易单元进行债券交易、债券回购交易及权证交易等除股票交易外的其他证券投资交易。

### 10.8 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	《银华基金管理有限公司 2015 年 12 月 31 日基金净值公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 1 月 4 日
2	《关于银华中证内地资源主题指数分级证券投资基金之资源 A 级份额本次定期折算期间约定年基准收益率的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 1 月 5 日
3	《关于银华中证内地资源主题指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务期间资源 A 级份额停复牌的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 1 月 5 日
4	《银华基金管理有限公司关于因 2016 年 1 月 4 日发生指数熔断调整旗下基金申购、赎回等业务办理时间的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 1 月 5 日
5	《银华基金管理有限公司关于旗下场内基金在指数熔断期间暂停	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 1 月 6 日

	《申购赎回业务的提示性公告》		
6	《关于银华中证内地资源主题指数分级证券投资基金定期份额折算结果及恢复交易的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 1 月 6 日
7	《关于资源 A 级份额定期份额折算后复牌首日收盘价调整的风险提示公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 1 月 6 日
8	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的德尔未来、文化长城、格林美、万里扬、宏图高科估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 1 月 7 日
9	《银华基金管理有限公司关于因 2016 年 1 月 7 日发生指数熔断调整旗下基金申购、赎回等业务办理时间的公告》	本基金管理人网站	2016 年 1 月 7 日
10	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加浙江同花顺基金销售有限公司网上费率优惠活动的公告》	三大证券报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 1 月 12 日
11	《关于增加大泰金石投资管理有限公司为旗下部分基金代销机构并参加其费率优惠活动的公告》	三大证券报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 1 月 21 日
12	《银华中证内地资源主题指数分级证券投资基金更新招募说明书（2016 年第 1 号）》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 1 月 22 日
13	《银华中证内地资源主题指数分级证券投资基金更新招募说明书摘要（2016 年第 1 号）》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 1 月 22 日
14	《银华中证内地资源主题指数分级证券投资基金 2015 年第 4 季度报告》	三大证券报、证券日报	2016 年 1 月 22 日
15	《银华基金管理有限公司关于银华旗下部分基金在平安证券开通定期定额投资业务及参加费率优惠活动的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 2 月 26 日
16	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的西部矿业估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 3 月 9 日
17	《银华基金管理有限公司关于增加上海陆金所资产管理有限公司为旗下部分基金代销机构并参加其费率优惠活动的公告》	三大证券报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 3 月 11 日
18	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加深圳新兰德证券	三大证券报、证券日报及本基金管理人	2016 年 3 月 15 日

	投资咨询有限公司网上费率优惠活动的公告》	网站	
19	《银华基金管理有限公司关于调整招商银行借记卡网上直销费率优惠的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 3 月 24 日
20	《银华中证内地资源主题指数分级证券投资基金 2015 年年度报告摘要》	三大证券报、证券日报	2016 年 3 月 25 日
21	《银华中证内地资源主题指数分级证券投资基金 2015 年年度报告》	三大证券报、证券日报	2016 年 3 月 25 日
22	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 3 月 31 日
23	《银华基金管理有限公司关于调整招商银行借记卡网上直销定期定额申购业务费率优惠的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 4 月 1 日
24	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的大同煤业估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 4 月 15 日
25	《银华基金管理有限公司关于银华旗下部分基金在上海证券开通定期定额投资业务的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 4 月 19 日
26	《银华中证内地资源主题指数分级证券投资基金 2016 年第 1 季度报告》	三大证券报、证券日报	2016 年 4 月 21 日
27	《银华基金管理有限公司关于淘宝店业务及网上直销支付宝渠道下线的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 5 月 18 日
28	《银华基金管理有限公司关于银华旗下部分基金在大同证券开通定期定额投资业务的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 5 月 19 日
29	《关于增加首创证券为旗下部分基金代销、定期定额投资及转换业务办理机构的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 5 月 26 日
30	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金在上海陆金所资产管理有限公司开通定投业务的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 6 月 16 日
31	《关于开通通联支付渠道网上直销定期定额申购业务的公告》	三大证券报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 6 月 17 日
32	《银华基金管理有限公司关于增加诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司为旗下部分基金代	三大证券报及本基金管理人网站	2016 年 6 月 21 日

	销机构并参加其费率优惠活动的公告》		
--	-------------------	--	--

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于 2016 年 7 月 21 日发布公告，自 2016 年 7 月 26 日起调整本基金每笔赎回申请的最低份额、转换转出最低份额及赎回后的最低保有份额。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 12.1.1 中国证监会核准银华中证内地资源主题指数分级证券投资基金设立的文件
- 12.1.2 《银华中证内地资源主题指数分级证券投资基金招募说明书》
- 12.1.3 《银华中证内地资源主题指数分级证券投资基金基金合同》
- 12.1.4 《银华中证内地资源主题指数分级证券投资基金托管协议》
- 12.1.5 《银华基金管理有限公司开放式基金业务规则》
- 12.1.6 银华基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程
- 12.1.7 基金托管人业务资格批件和营业执照
- 12.1.8 报告期内本基金管理人在指定媒体上披露的各项公告

### 12.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人或基金托管人的办公场所。本报告存放在本基金管理人及托管人住所，供公众查阅、复制。

### 12.3 查阅方式

投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（www.yhfund.com.cn）查阅。

银华基金管理有限公司  
2016 年 8 月 24 日