

信诚中证 800 有色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：信诚基金管理有限公司

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 23 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 2016 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	2
§ 2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	10
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	10
§ 5 托管人报告	10
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	10
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	10
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	11
§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)	11
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	12

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	13
6.4 报表附注.....	14
§ 7 投资组合报告.....	27
7.1 期末基金资产组合情况.....	27
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	28
7.3 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.....	29
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	30
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	32
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.....	32
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.....	32
7.8 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.....	32
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.....	32
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	32
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	32
7.12 投资组合报告附注.....	32
§ 8 基金份额持有人信息.....	33
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	33
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	34
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	35
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.....	35
§ 9 开放式基金份额变动.....	35
§ 10 重大事件揭示.....	36
10.1 基金份额持有人大会决议.....	36
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.....	36
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	36
10.4 基金投资策略的改变.....	36
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	36
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.....	36
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	36
10.8 其他重大事件.....	37
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	38
§ 12 备查文件目录.....	38
12.1 备查文件名称.....	38
12.2 备查文件存放地点.....	38
12.3 备查文件查阅方式.....	38

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	信诚中证 800 有色指数分级证券投资基金		
基金简称	信诚中证 800 有色指数分级		
场内简称	信诚有色		
基金主代码	165520		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2013 年 8 月 30 日		
基金管理人	信诚基金管理有限公司		
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	187,656,186.63 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	2013 年 9 月 18 日		
下属分级基金的基金简称	信诚中证 800 有色 指数分级 A	信诚中证 800 有色 指数分级 B	信诚中证 800 有色 指数分级
下属分级基金的场内简称	有色 800A	有色 800B	信诚有色
下属分级基金的交易代码	150150	150151	165520
报告期末下属分级基金的份额总额	63,628,835.00 份	63,628,835.00 份	60,398,516.63 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行数量化指数投资,通过严谨的数量化管理和投资纪律约束,实现对中证 800 有色金属指数的有效跟踪,为投资者提供一个有效的投资工具。
投资策略	本基金原则上采用完全复制法跟踪指数,即原则上按照标的指数中成份股组成及其权重构建股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整,力争保持基金净值收益率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%,年跟踪误差不超过 4%。 基金管理人可运用股指期货,以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与股指期货的投资,以管理投资组合的系统性风险,改善组合的风险收益特性。此外,本基金还将运用股指期货来对冲特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理,如预期大额申购赎回、大量分红等,以及对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险。
业绩比较基准	$95\% \times \text{中证 800 有色金属指数收益率} + 5\% \times \text{金融同业存款利率}$
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。从本基金所分离的两类基金份额来看,有色 800A 份额具有预期风险、预期收益较低的特征;有色

	800B 份额具有预期风险、预期收益较高的特征		
下属分级基金的风险收益特征	有色 800A 份额具有预期风险、预期收益较低的特征。	有色 800B 份额具有预期风险、预期收益较高的特征。	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。

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		信诚基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周浩	王永民
	联系电话	021-68649788	010-66594896
	电子邮箱	hao.zhou@xcfunds.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-666-0066	95566
传真		021-50120888	010-66594942
注册地址		上海市浦东世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 9 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		上海市浦东世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 9 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		200120	100818
法定代表人		张翔燕	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	上海证券报、中国证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.xcfunds.com
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

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市东长安街 1 号东方广场东二办公楼八层

§ 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 日至 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-21,944,678.73
本期利润	-37,658,341.45
加权平均基金份额本期利润	-0.1214
本期加权平均净值利润率	-13.11%
本期基金份额净值增长率	-6.28%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-71,443,555.81
期末可供分配基金份额利润	-0.3807
期末基金资产净值	187,736,123.17
期末基金份额净值	1.000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-3.28%

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、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。

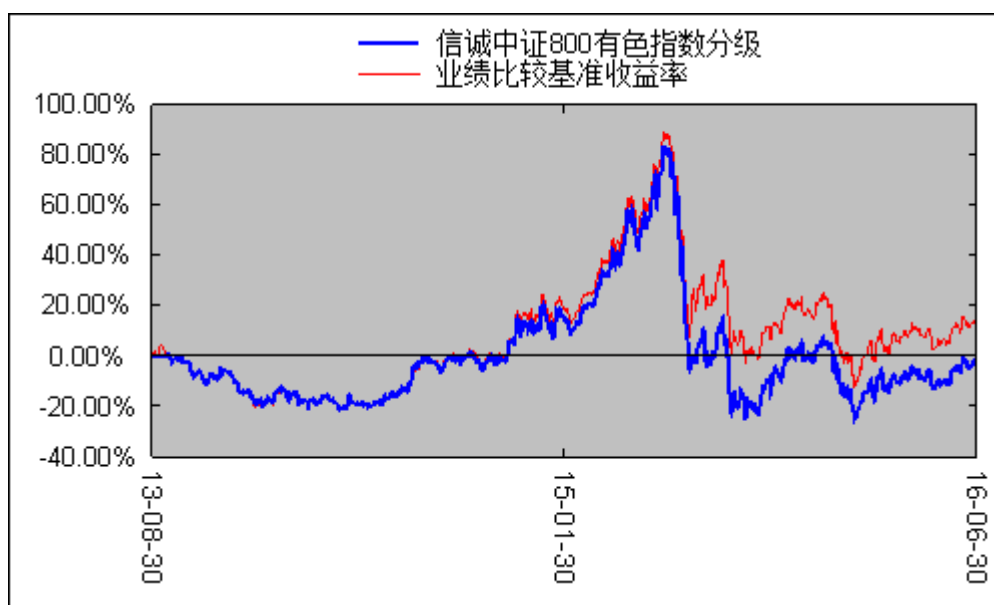
3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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	3.84%	1.28%	2.98%	1.40%	0.86%	-0.12%
过去三个月	6.04%	1.56%	5.00%	1.62%	1.04%	-0.06%
过去六个月	-6.28%	2.55%	-5.11%	2.55%	-1.17%	0.00%
过去一年	-31.47%	3.06%	-24.78%	2.79%	-6.69%	0.27%
自基金合同生效起至今	-3.28%	2.29%	12.96%	2.15%	-16.24%	0.14%

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



注:本基金建仓日自 2013 年 8 月 30 日至 2014 年 2 月 28 日,建仓日结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

§ 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

本基金管理人信诚基金管理有限公司经中国证监会批准,于 2005 年 9 月 30 日正式成立,注册资本 2 亿元,注册地为上海。公司股东为中信信托有限责任公司、英国保诚集团股份有限公司和中新苏州工业园区创业投资有限公司,各股东出资比例分别为 49%、49%、2%。截至 2016 年 6 月 30 日,本基金管理人共管理 40 只基金,分别为信诚四季红混合型证券投资基金、信诚精萃成长混合型证券投资基金、信诚盛世蓝筹混合型证券投资基金、信诚三得益债券型证券投资基金、信诚经典优债债券型证券投资基金、信诚优胜精选混合型证券投资基金、信诚中小盘混合型证券投资基金、信诚深度价值混合型证券投资基金(LOF)、信诚增强收益债券型证券投资基金(LOF)、信诚金砖四国积极配置证券投资基金(LOF)、信诚中证 500 指数分级证券投资基金、信诚货币市场证券投资基金、信诚新机遇混合型证券投资基金(LOF)、信诚全球商品主题证券投资基金(LOF)、信诚沪深 300 指数分级证券投资基金、信诚双盈债券型证券投资基金(LOF)、信诚周期轮动混合型证券投资基金(LOF)、信诚理财 7 日盈债券型证券投资基金、信诚添金分级债券型证券投资基金、信诚优质纯债债券型证券投资基金、信诚新双盈分级债券型证券投资基金、信诚新兴产业混合型证券投资基金、信诚中证 800 医药指数分级证券投资基金、信诚中证 800 有色指数分级证券投资基金、信诚季季定期支付债券型证券投资基金、信诚年年有余定期开放债券型证券投资基金、信诚中证 800 金融指数分级证券投资基金、信诚月月定期支付债券型证券投资基金、信诚幸福消费混合型证券投资基金、信诚薪金宝货币市场基金、信诚中证 TMT 产业主题指数分级证券投资基金、信诚新选回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚新锐回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚新鑫回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、信诚中证信息安全指数分级证券投资基金、信诚中证智能家居指数分级证券投资基金、信诚中证建筑工程指数分级证券投资

基金、信诚惠报债券型证券投资基金和信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金。

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		
杨旭	本基金基金经理, 兼任信诚沪深 300 指数分级基金、信诚中证 500 指数分级基金、信诚中证 800 医药指数分级基金、信诚中证 800 金融指数分级基金及信诚中证 TMT 产业主题指数分级基金、信诚中证信息安全指数分级基金、信诚中证智能家居指数分级基金、信诚新选回报灵活配置混合基金、信诚新旺回报灵活配置混合基金、信诚中证建筑工程指数分级基金、信诚鼎利定增灵活配置混合型基金的基金经理	2015 年 1 月 15 日	-	3	数学金融硕士、运筹管理学硕士、纽约大学化学硕士。曾担任美国对冲基金 Robust methods 公司数量分析师, 华尔街对冲基金 WSFA Group 公司助理基金经理, 该基金为股票多空型对冲基金。2012 年 8 月加入信诚基金, 曾分别担任助理投资经理、专户投资经理。现任信诚中证 500 指数分级基金、信诚沪深 300 指数分级基金、信诚中证 800 医药指数分级基金、信诚中证 800 有色指数分级基金、信诚中证 800 金融指数分级基金、信诚中证 TMT 产业主题指数分级基金、信诚中证信息安全指数分级基金、信诚中证智能家居指数分级基金、信诚新选回报灵活配置混合基金、信诚新旺回报灵活配置混合基金、信诚中证建筑工程指数分级基金、信诚鼎利定增灵活配置混合型基金的基金经理。

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 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内, 本基金管理人严格按照《证券投资基金法》和其他相关法律法规的规定以及《信诚

中证 800 有色指数分级证券投资基金基金合同》、《信诚中证 800 有色指数分级证券投资基金招募说明书》的约定,本着诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金财产。本基金管理人通过不断完善法人治理结构和内部控制制度,加强内部管理,规范基金运作。本报告期内,基金运作合法合规,没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

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

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》,以及公司拟定的《信诚基金公平交易管理制度》,公司采取了一系列的行动实际落实公平交易管理的各项要求。各部门在公平交易执行中各司其职,投资研究前端不断完善研究方法和投资决策流程,确保各投资组合享有公平的投资决策机会,建立公平交易的制度环境;交易环节加强交易执行的内部控制,利用恒生交易系统公平交易相关程序,及其它的流程控制,确保不同基金在一、二级市场对同一证券交易时的公平;公司同时不断完善和改进公平交易分析系统,在事后加以了严格的行为监控,分析评估以及报告与信息披露。当期公司整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金与其它投资组合之间有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。报告期内,未出现参与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 5% 的交易(完全复制的指数基金除外)。

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

上半年,随着转方式、调结构稳步推进,中国经济运行整体平稳。一方面,国内生产总值同比增长 6.7%,较去年同期 7% 的增速下降 0.3 个百分点;固定资产投资、居民可支配收入较去年同比有所回落,1-6 月份民间投资增速快速下滑,经济增速有所回落。另一方面,居民消费稳健增长,居民消费价格基本稳定,对外贸易顺差继续扩大,经济运行呈现平稳态势。市场逐步形成对经济长期运行“L”型的一致预期。

金融市场上,上半年国内低风险金融产品收益率不断下降,信托计划、银行理财产品、债券等收益率逐步下行;同时,债券违约等金融市场风险事件频发。收益率下滑和风险事件频发证实了“资产荒”预期。海外市场,6 月份英国脱欧公投增加了金融市场的不确定性,虽然全球市场经过短暂动荡后趋于平稳,但未来风险仍然未知。

A 股市场经历了熔断后的快速下跌,随着紧急暂停“熔断”,之后逐步企稳,投资者信心逐步恢复,沪深 300 指数从 1 月份收盘最低点 2853 点逐步企稳。虽然中间有波折,但截止到 6 月 30 日收盘为 3153 点。虽然比 2015 年 12 月 31 日收盘的 3731 点下跌 15.5%,但比 1 月收盘最低点上涨 10.5%。未来“资产荒”的大环境下,随着风险资产的风险被证实、低风险(或无风险)产品收益率的下降、以及部分题材炒作逐步被证伪,低估值盈利稳定或低估值盈利稳定增长的股票资产的价值可能被市场逐步认可。

上半年,我们在震荡市场环境及时处理每日申购赎回现金流,有效地管理跟踪误差;在市场震荡期间,也利用股指期货多头套保应对申赎的现金管理;同时,积极参与网下新股申购,以提高基金的净值。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金份额净值增长率为-6.28%,同期业绩比较基准收益率为-5.11%,基金落后业绩比较基准 1.17%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

市场格局并没有发生变化,核心矛盾依旧是美联储开始收缩使资本回流美国,全球资本再配置,而中国缺乏吸收流动性的实体资产,流动性在资本市场里创造泡沫,从股票到房地产到大宗期货等。核心的不确定性,也就是可能造成趋势的依旧来源于两个,一个是美联储何时开始缩表,另一个来自于国内的经济政策取向。在目前这两个因素都缓和的条件下,市场有博弈行情的基础,但缺乏增量资金,指数上涨空间有限,所以目前谨慎,仍然以反转操作为主。结构上关注的两类策略,一类策略之前一直关注的是风险偏好持续下降,市场结构对低估蓝筹再平衡过程,但市场观点在不断加强,目前已经进入后半段。另外,另一

类策略是偏博弈型, 远离筹码松动区的交易型策略。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1. 基金估值程序

为了向基金投资人提供更好的证券投资管理服务, 本基金管理人对估值和定价过程进行了最严格的控制。本基金管理人通过估值决策委员会来更有效的完善估值服务。估值决策委员会包括下列成员: 分管基金运营业务的领导(委员会主席)、风险管理部负责人、股票投资负责人、债券投资负责人、交易部负责人、运营部负责人、基金会计主管(委员会秘书)。本基金管理人在充分衡量市场风险、信用风险、流动性风险、货币风险、衍生工具和结构性产品等影响估值和定价因素的基础上, 综合运营部、稽核部、投资部、风控部和其它相关部门的意见, 确定本基金管理人采用的估值政策。

估值政策和程序的确立和修订须经本基金管理人总经理批准后方可实行。基金在采用新投资策略或投资新品种时, 应评价现有估值政策和程序的适用性, 并在不适用的情况下, 及时召开估值决策委员会。

在每个估值日, 本基金管理人的运营部使用估值政策确定的估值方法, 确定证券投资基金的份额净值。基金管理人根据基金资产进行估值后, 将基金份额净值结果发送基金托管人, 基金托管人按照托管协议中“基金资产净值计算和会计核算”确定的规则复核, 复核无误后, 由基金管理人对外公布。

2. 基金管理人估值业务的职责分工

本基金管理人的估值业务采用双人双岗, 所有业务操作需经复核方可生效。

3. 基金管理人估值人员的专业胜任能力和相关工作经历

本基金管理人的估值人员均具有专业会计学习经历, 具有会计上岗证和基金从业人员资格

4. 基金经理参与或决定估值的程度

本基金管理人的后台与投资业务隔离, 基金经理不直接参与或决定估值

基金经理持续保持对基金估值所采用估值价格的关注, 在认为基金估值所采用的估值价格不足够公允时, 将通过首席投资官提请召开估值决策委员会会议, 通过会议讨论决定是否调整基金管理人所采用的估值政策。

5. 参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

6. 已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

本基金未与任何第三方签订定价服务协议。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的约定, 本基金(包括信诚有色份额、信诚有色 A 份额、信诚有色 B 份额)不进行收益分配。

本基金于本期间未进行过利润分配, 该处理符合基金利润分配原则。

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

本报告期内, 本基金未出现连续 20 个工作日基金资产净值低于五千万元(基金份额持有人数量不满两百人)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”)在对信诚中证 800 有色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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 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: 信诚中证 800 有色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
资 产:			
银行存款	6.4.7.1	9,668,533.92	27,928,391.41
结算备付金		571,725.79	965,595.36
存出保证金		158,752.96	1,583,147.90
交易性金融资产	6.4.7.2	177,839,192.63	417,188,826.37
其中: 股票投资		177,839,192.63	417,188,826.37
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		2,495,385.00	-
应收利息	6.4.7.5	3,259.12	7,270.96
应收股利		-	-
应收申购款		399.52	19,348.14
递延所得税资产			
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		190,737,248.94	447,692,580.14
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
负 债:			
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		-	-
应付赎回款		2,217,392.97	243,283.17
应付管理人报酬		164,980.62	379,101.80

应付托管费		36,295.72	83,402.40
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	170,278.35	519,700.44
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	412,178.11	465,916.87
负债合计		3,001,125.77	1,691,404.68
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	194,096,168.89	432,268,496.18
未分配利润	6.4.7.10	-6,360,045.72	13,732,679.28
所有者权益合计		187,736,123.17	446,001,175.46
负债和所有者权益总计		190,737,248.94	447,692,580.14

注：截至本报告期末日，基金份额总额 187,656,186.63 份。信诚中证 800 有色指数分级基金份额净值 1.000 元，基金份额总额 60,398,516.63 份。下属分级基金：信诚中证 800 有色指数分级 A 的基金份额净值 1.025 元，基金份额总额 63,628,835.00 份；信诚中证 800 有色指数分级 B 的基金份额净值 0.975 元，基金份额总额 63,628,835.00 份。

6.2 利润表

会计主体：信诚中证 800 有色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
一、收入		-35,003,162.60	418,193,952.96
1. 利息收入		98,073.08	1,451,486.83
其中：存款利息收入	6.4.7.11	98,073.08	200,629.42
债券利息收入		-	1,250,857.41
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）		-19,796,998.14	360,284,747.57
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-20,097,003.69	356,979,200.12
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-105,691.00
资产支持证券投资	6.4.7.13.1	-	-
收益		-	-
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	300,005.55	3,411,238.45
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-15,713,662.72	54,128,299.48
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	409,425.18	2,329,419.08
减：二、费用		2,655,178.85	17,038,866.24
1. 管理人报酬		1,437,849.69	8,938,102.46
2. 托管费		316,326.98	1,966,382.53
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	581,597.47	5,690,830.77
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	319,404.71	443,550.48
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-37,658,341.45	401,155,086.72
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-37,658,341.45	401,155,086.72

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：信诚中证 800 有色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）	432,268,496.18	13,732,679.28	446,001,175.46
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-37,658,341.45	-37,658,341.45
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）	-238,172,327.29	17,565,616.45	-220,606,710.84
其中：1. 基金申购款	117,472,497.19	-10,472,374.33	107,000,122.86
2. 基金赎回款	-355,644,824.48	28,037,990.78	-327,606,833.70
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）	194,096,168.89	-6,360,045.72	187,736,123.17
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）	1,026,184,311.63	119,114,884.76	1,145,299,196.39
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	401,155,086.72	401,155,086.72
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）	312,742,536.82	30,049,423.55	342,791,960.37
其中：1. 基金申购款	1,528,126,812.65	679,924,623.25	2,208,051,435.90
2. 基金赎回款	-1,215,384,275.83	-649,875,199.70	-1,865,259,475.53
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）	1,338,926,848.45	550,319,395.03	1,889,246,243.48

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：

吕涛	陈逸辛	时慧
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

信诚中证 800 有色指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于核准信诚中证 800 有色指数分级证券投资基金募集的批复》(证监许可[2013]831 号文)和《关于信诚中证 800 有色指数分级证券投资基金备案确认的函》(基金部函[2013]761 号文)批准,由信诚基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《信诚中证 800 有色指数分级证券投资基金基金合同》发售,基金合同于 2013 年 8 月 30 日生效。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信诚基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金于 2013 年 8 月 5 日至 2013 年 8 月 23 日募集,首次向社会公开发售募集且扣除认购费用后的有效认购资金人民币 301,728,990.92 元,利息人民币 52,777.02 元,共计人民币 301,781,767.94 元。上述认购资金折合 301,781,767.94 份基金份额。上述募集资金已由毕马威华振会计师事务所验证,并出具了毕马威华振验字第 1300165 号验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《信诚中证 800 有色指数分级证券投资基金基金合同》和《信诚中证 800 有色指数分级证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括中证 800 有色金属指数的成份股、备选成份股、新股(含首次公开发行和增发)、债券、债券回购、中期票据、银行存款、权证、股指期货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)。本基金所持有的股

票市值和买入、卖出股指期货合约价值, 合计(轧差计算)占基金资产的比例为 85%-100%, 其中投资于股票的资产不低于基金资产的 85%, 投资于中证 800 有色金属指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金资产的 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。

本基金的业绩比较标准为: $95\% \times \text{中证 800 有色金属指数收益率} + 5\% \times \text{金融同业存款利率}$ 。

根据《证券投资基金信息披露管理办法》, 本基金定期报告在公开披露的第二个工作日, 报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金按照财政部颁布的企业会计准则、中国证券业协会于 2012 年颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《信诚中证 800 有色指数分级证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的基金行业实务操作的规定编制会计报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则要求, 真实、完整地反映了本基金的财务状况、经营成果和基金净值变动情况。

此外, 本财务报表同时符合如会计报表附注 6.4.2 所列示的其他有关规定的要求。

6.4.4 重要会计政策和会计估计(本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明)

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计除 6.4.5 所列变更外, 与最近一期年度报告相一致。

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

本基金本报告期无需说明的会计政策变更事项。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计估计变更事项。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无差错事项。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《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》、财税[2015]101 号《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》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作, 主要税项列示如下:

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前, 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围, 不征收营业税。管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起, 金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税, 对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价, 暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(3) 对基金取得的股票的股息、红利收入, 债券的利息收入, 由上市公司、发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起, 对所取得的股息红利收入根据持股期限

差别化计算个人所得税的应纳税所得额: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,股权登记日为自 2013 年 1 月 1 日起至 2015 年 9 月 7 日期间的,暂减按 25%计入应纳税所得额,股权登记日在 2015 年 9 月 8 日及以后的,暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 对投资者(包括个人和机构投资者)从基金分配中取得的收入,暂不征收个人所得税和企业所得税。

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	9,668,533.92
定期存款	-
其中:存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计	9,668,533.92

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		185,325,752.93	177,839,192.63	-7,486,560.30
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		185,325,752.93	177,839,192.63	-7,486,560.30

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本报告期末未持有任何衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有任何买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

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	2,489.12
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	0.04
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	602.88
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	167.08
合计	3,259.12

注：其他指应收结算保证金利息，应收期货清算备付金利息。

6.4.7.6 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	170,278.35
银行间市场应付交易费用	-
合计	170,278.35

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	8,301.71
预提审计费	24,863.02
预提信息披露费	299,178.12
基金上市费	29,835.26
应付指数使用费	50,000.00
合计	412,178.11

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	417,945,658.39	432,268,496.18
本期申购	113,575,567.64	117,472,497.19

本期赎回（以“-”号填列）	-343,865,039.40	-355,644,824.48
本期末	187,656,186.63	194,096,168.89

注：1、此处申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

2、根据本基金合同规定，投资者可申购、赎回信诚中证 800 有色指数分级份额，信诚中证 800 有色指数分级 A 份额和信诚中证 800 有色指数分级 B 份额只可在深圳证券交易所上市交易，因此上表不再单独披露信诚中证 800 有色指数分级 A 份额和信诚中证 800 有色指数分级 B 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	-130,758,309.99	144,490,989.27	13,732,679.28
本期利润	-21,944,678.73	-15,713,662.72	-37,658,341.45
本期基金份额交易产生的变动数	81,259,432.91	-63,693,816.46	17,565,616.45
其中：基金申购款	-39,152,820.25	28,680,445.92	-10,472,374.33
基金赎回款	120,412,253.16	-92,374,262.38	28,037,990.78
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-71,443,555.81	65,083,510.09	-6,360,045.72

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	91,101.24
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	1,678.68
其他	5,293.16
合计	98,073.08

注：其他指申购款利息收入、期货清算备付金利息收入和结算保证金利息收入。

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	261,105,107.72
减：卖出股票成本总额	281,202,111.41
买卖股票差价收入	-20,097,003.69

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

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	300,005.55
基金投资产生的股利收益	-
合计	300,005.55

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	-15,713,662.72
——股票投资	-15,713,662.72
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-15,713,662.72

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	409,271.56
转换费收入	153.62
合计	409,425.18

注：本基金赎回费和转换费的 25% 归入基金资产。

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	581,597.47
银行间市场交易费用	-
合计	581,597.47

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	24,863.02
信息披露费	149,178.12
指数使用费	100,000.00
银行费用	6,528.31
债券帐户维护费	9,000.00
基金上市费	29,835.26
合计	319,404.71

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

截至本报告期末, 本基金未发生需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日, 本基金未发生需要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

本报告期存在控制关系或其他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
信诚基金管理有限公司	基金管理人
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均根据正常的商业交易条件进行, 并以一般交易价格为定价基础。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金在本报告期内未通过关联方交易单元进行过交易。

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	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
当期发生的基金应支付的管理费	1,437,849.69	8,938,102.46
其中：支付销售机构的客户维护费	62,356.59	232,000.61

注：支付基金管理人信诚基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.0%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金管理人费=前一日基金资产净值×1.0%/当年天数。

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	316,326.98	1,966,382.53

注：支付基金托管人中国银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.22%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.22%/当年天数。

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

本基金本报告期内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

基金管理人运用固有资金投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执行。本基金的基金管理人在本报告期内及上年度可比期间均未投资过本基金。

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

信诚中证 800 有色指数分级

份额单位：份

关联方名称	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份 额 占基金总份 额 的比例	持有的 基金份额	持有的基金份 额 占基金总份 额 的比例
中信信托有限责 任公司	1.00	-	1.00	-

注：1、除上表外，本基金其它关联方在本报告期末及上年度末均未持有本基金。

2、本基金除基金管理人之外的其他关联方投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执行。

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 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	9,668,533.92	91,101.24	61,777,286.37	140,107.47

注：本基金通过“中国银行基金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

司的结算备付金,于 2016 年 6 月 30 日的相关余额为人民币 0.00 元。(2015 年 6 月 30 日余额为 9,017,598.63 元)

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

本基金于本报告期内未进行过利润分配,该处理符合基金利润分配原则。

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

金额单位:人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别:股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601966	玲珑轮胎	2016-06-24	2016-07-06	新股申购	12.98	12.98	1,369	17,769.62	17,769.62	-
603016	新宏泰	2016-06-23	2016-07-01	新股申购	8.49	8.49	1,401	11,894.49	11,894.49	-
300520	科大国创	2016-06-30	2016-07-08	新股申购	10.05	10.05	926	9,306.30	9,306.30	-
002805	丰元股份	2016-06-29	2016-07-07	新股申购	5.80	5.80	971	5,631.80	5,631.80	-
6.4.12.1.2 受限证券类别:债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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	2016-02-01	筹划重大事项	6.84	2016-07-22	6.52	1,645,150	12,037,539.76	11,252,826.00	-
000511	*ST 烯碳	2016-04-26	筹划重大事项	8.92	-	-	655,206	9,174,861.94	5,844,437.52	-
000975	银泰资源	2016-04-19	筹划重大事项	15.00	-	-	317,713	4,403,063.10	4,765,695.00	-
600497	驰宏锌锗	2016-06-13	筹划重大事项	9.97	2016-07-11	10.97	403,437	4,238,701.63	4,022,266.89	-
000693	ST 华泽	2016-03-01	筹划重大事项	12.50	-	-	234,499	4,958,806.15	2,931,237.50	-

600614	鼎立股份	2015-04-26	筹划重大事项	8.14	-	-	338,500	3,657,082.92	2,755,390.00	-
601611	中国核建	2016-06-30	交易异常波动	20.92	2016-07-01	23.01	5,546	19,244.62	116,022.32	-

注：截至本报告批准报出日，“*ST 烯碳”、“银泰资源”、“ST 华泽”和“鼎立股份”仍未发布复牌公告。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

于本报告期末,本基金未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

于本报告期末,本基金未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

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

本基金金融工具的风险主要包括:信用风险、流动性风险、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。

本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设,在董事会下设立风控与审计委员会,负责制定风险管理的宏观政策,设定最高风险承受度以及审议批准防范风险和内部控制的政策等;在管理层层面设立风险管理委员会,实施董事会风控与审计委员会制定的各项风险管理和内部控制政策;在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责,协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部和风险管理部对公司首席执行官负责,其中监察稽核部还须向督察长报告工作。

本基金管理人建立了以风险管理委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行,因而与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程,通过对投资品种和证券发行人进行信用等级评估来控制信用风险,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。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%,且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券,不得超过该证券的 10%。

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;本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与可能遭受的损失。本基金的流动性风险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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现,另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。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求,并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求,对流动性指标进行持续的监测和分析。

针对投资品种变现的流动性风险,本基金的基金管理人对流通受限证券的投资交易进行限制和控制,

对缺乏流动性的证券投资比率事先确定最高上限,控制基金的流动性结构;加强对投资组合变现周期和冲击成本的定量分析,定期揭示基金的流动性风险;通过分散投资降低基金财产的非系统性风险,保持基金组合良好的流动性。本基金所持证券均可在证券交易所或银行间同业市场交易,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。此外,对于基金投资的股指期货等场内金融衍生品,管理人会对衍生品的流动性、交割日等予以关注。

针对兑付赎回资金的流动性风险,本基金的基金管理人根据申购赎回变动情况,制定现金头寸预测表,及时采取措施满足流动性需要;分析基金持有人结构,加强与主要持有机构的沟通,及时揭示可能的赎回需求;按照有关法律法规规定应对固定赎回,并进行适当报告和披露;在基金合同中设计了巨额赎回条款,约定在非常情况下赎回申请的处理方式,控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险,有效保障基金持有人利益。

本基金所持有的全部金融负债无固定到期日或合约约定到期日均为一个月以内且不计息,可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息,因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

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、结算备付金及债券投资等。本基金的基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控,并通过对所持投资品种修正久期等参数的监控进行利率风险管理。

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	6个月以内	3个月 -1年	6个月-1年	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产										
银行存款	9,668,533.92	-	-	-	-	-	-	-	-	9,668,533.92
结算备付金	571,725.79	-	-	-	-	-	-	-	-	571,725.79
存出保证金	158,752.96	-	-	-	-	-	-	-	-	158,752.96
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-	-	-	177,839,192.63	177,839,192.63
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	2,495,385.00	2,495,385.00
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	-	3,259.12	3,259.12
应收股利	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-	-	399.52	399.52
待摊费用	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
其他应收款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	10,399,012.67	-	-	-	-	-	-	-	180,338,236.27	190,737,248.94
负债										

卖出回购金 融资产款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清 算款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-	-	2,217,392.97	2,217,392.97
应付管理人 报酬	-	-	-	-	-	-	-	-	164,980.62	164,980.62
应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	-	36,295.72	36,295.72
应付销售服 务费	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费 用	-	-	-	-	-	-	-	-	170,278.35	170,278.35
应交税费	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	-	-	-	412,178.11	412,178.11
负债总计	-	-	-	-	-	-	-	-	3,001,125.77	3,001,125.77
利率敏感 度缺口	10,399,012.67	-	-	-	-	-	-	-	-177,337,110.50	187,736,123.17
上年度末 2015 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	6 个月以内	3 个月 -1 年	6 个月 -1 年	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产										
银行存款	27,928,391.41	-	-	-	-	-	-	-	-	27,928,391.41
结算备付金	965,595.36	-	-	-	-	-	-	-	-	965,595.36
存出保证金	1,583,147.90	-	-	-	-	-	-	-	-	1,583,147.90
交易性金融 资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-417,188,826.37	417,188,826.37
买入返售金 融资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清 算款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	-	7,270.96	7,270.96
应收股利	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-	-	19,348.14	19,348.14
待摊费用	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
其他应收款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	30,477,134.67	-	-	-	-	-	-	-	-417,215,445.47	447,692,589.20
负债	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金 融资产款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清 算款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-	-	243,283.17	243,283.17
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	-	-	379,101.80	379,101.80
应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	-	83,402.40	83,402.40
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-	-	519,700.44	519,700.44
应交税费	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	-	-	-	465,916.87	465,916.87
负债总计	-	-	-	-	-	-	-	-	1,691,404.68	1,691,404.68
利率敏感度缺口	30,477,134.67	-	-	-	-	-	-	-	-415,524,040.79	-446,001,175.12

注：上表统计了本基金面临的利率风险敞口，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

本基金于本期末及上年度末，未持有债券等受利率波动明显的金融资产，因此可认为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

本基金承受的其他市场价格风险，主要是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。本基金的其他市场价格风险，主要受到证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的影响，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其他市场价格风险，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，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。特别是针对股指期货等高风险的金融衍生工具，管理人会每日对股指期货已占用保证金占总可用资金比例，股指期货账户未占用保证金占总期货账户权益比例，持仓占套保额度上限比例，以及股指期货合约成交金额占上一交易日基金资产净值比例，持有的买入、卖出股指期货合约占基金资产净值比例，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和占基金资产比例等法律法规、基金合同约定的合规、风险比例进行严格监控。

于本报告期末，本基金面临的其他市场价格风险列示如下：

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	177,839,192.63	94.73	417,188,826.37	93.54
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
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	177,839,192.63	94.73	417,188,826.37	93.54

注：本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。此外，本基金还将运用股指期货来对冲特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理，以及对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险。

6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准中的股票指数以外的其他市场变量保持不变		
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）
	业绩比较基准中的股票指数上升 5%	8,924,411.77	20,859,441.32
	业绩比较基准中的股票指数下降 5%	-8,924,411.77	-20,859,441.32

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无需要说明的此类事项。

§ 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	177,839,192.63	93.24
	其中：股票	177,839,192.63	93.24
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	10,240,259.71	5.37
7	其他各项资产	2,657,796.60	1.39
8	合计	190,737,248.94	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	79,961,876.06	42.59
C	制造业	88,584,289.55	47.19
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	168,546,165.61	89.78

7.2.2 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	2,931,237.50	1.56
C	制造业	6,180,354.00	3.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	116,022.32	0.06
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	45,287.10	0.02

	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	20,126.10	0.01
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	9,293,027.02	4.95

7.2.3 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

7.3 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

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	601899	紫金矿业	3,662,900	12,343,973.00	6.58
2	601168	西部矿业	1,645,150	11,252,826.00	5.99
3	600111	北方稀土	842,655	11,215,738.05	5.97
4	600547	山东黄金	274,802	10,692,545.82	5.70
5	002466	天齐锂业	230,400	9,835,776.00	5.24
6	601600	中国铝业	2,116,865	7,980,581.05	4.25
7	600489	中金黄金	665,948	7,485,255.52	3.99
8	002340	格林美	786,182	6,894,816.14	3.67
9	000630	铜陵有色	2,595,395	6,592,303.30	3.51
10	000060	中金岭南	598,261	6,239,862.23	3.32
11	603993	洛阳钼业	1,497,615	6,215,102.25	3.31
12	600219	南山铝业	766,623	5,673,010.20	3.02
13	000975	银泰资源	317,713	4,765,695.00	2.54
14	600362	江西铜业	320,636	4,322,173.28	2.30
15	600673	东阳光科	666,558	4,165,987.50	2.22
16	600497	驰宏锌锗	403,437	4,022,266.89	2.14
17	000762	西藏矿业	161,100	3,982,392.00	2.12
18	000697	炼石有色	172,938	3,951,633.30	2.10
19	600516	方大炭素	398,500	3,642,290.00	1.94
20	600392	盛和资源	218,287	3,575,541.06	1.90
21	000758	中色股份	456,466	3,537,611.50	1.88
22	600259	广晟有色	60,800	3,481,408.00	1.85

23	002155	湖南黄金	262,300	3,454,491.00	1.84
24	000878	云南铜业	328,300	3,342,094.00	1.78
25	601958	金钼股份	373,926	3,047,496.90	1.62
26	002428	云南锗业	177,125	3,043,007.50	1.62
27	000969	安泰科技	198,198	2,780,717.94	1.48
28	600614	鼎立股份	338,500	2,755,390.00	1.47
29	000519	江南红箭	199,388	2,534,221.48	1.35
30	000612	焦作万方	324,763	2,318,807.82	1.24
31	000426	兴业矿业	229,944	1,729,178.88	0.92
32	600456	宝钛股份	83,100	1,671,972.00	0.89

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	000511	*ST 烯碳	655,206	5,844,437.52	3.11
2	000693	ST 华泽	234,499	2,931,237.50	1.56
3	601611	中国核建	5,546	116,022.32	0.06
4	603131	上海沪工	1,263	76,664.10	0.04
5	601127	小康股份	2,830	67,552.10	0.04
6	300515	三德科技	1,355	63,508.85	0.03
7	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.03
8	300518	盛讯达	768	35,980.80	0.02
9	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.01
10	603958	哈森股份	1,462	21,199.00	0.01
11	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.01
12	601966	玲珑轮胎	1,369	17,769.62	0.01
13	603016	新宏泰	1,401	11,894.49	0.01
14	300520	科大国创	926	9,306.30	—
15	002805	丰元股份	971	5,631.80	—

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	11,078,644.85	2.48
2	601899	紫金矿业	4,476,539.52	1.00
3	600219	南山铝业	3,976,670.62	0.89
4	000878	云南铜业	3,490,339.37	0.78
5	601600	中国铝业	3,459,487.00	0.78
6	000603	盛达矿业	3,408,764.00	0.76
7	000630	铜陵有色	3,281,148.00	0.74

8	603993	洛阳钼业	3,066,712.00	0.69
9	600489	中金黄金	1,902,920.92	0.43
10	600111	北方稀土	1,885,214.68	0.42
11	000762	西藏矿业	1,041,367.00	0.23
12	000060	中金岭南	1,024,865.00	0.23
13	601958	金钼股份	994,703.35	0.22
14	600547	山东黄金	986,161.00	0.22
15	000969	安泰科技	978,970.00	0.22
16	600259	广晟有色	822,023.00	0.18
17	000426	兴业矿业	821,248.00	0.18
18	000933	神火股份	801,475.00	0.18
19	002340	格林美	795,785.00	0.18
20	600673	东阳光科	746,526.20	0.17

注：买入金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

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	601899	紫金矿业	18,568,615.00	4.16
2	600111	北方稀土	17,053,890.44	3.82
3	000519	江南红箭	16,132,372.53	3.62
4	601600	中国铝业	14,418,684.00	3.23
5	600547	山东黄金	12,551,544.07	2.81
6	000831	*ST 五稀	11,902,401.82	2.67
7	600489	中金黄金	10,434,378.59	2.34
8	600549	厦门钨业	10,431,989.78	2.34
9	000060	中金岭南	9,300,071.86	2.09
10	600673	东阳光科	8,232,993.04	1.85
11	002340	格林美	7,931,864.65	1.78
12	600362	江西铜业	7,351,325.68	1.65
13	000630	铜陵有色	7,293,081.00	1.64
14	000697	炼石有色	7,066,043.80	1.58
15	002237	恒邦股份	6,198,282.25	1.39
16	600516	方大炭素	6,176,914.98	1.38
17	600497	驰宏锌锗	6,147,855.00	1.38
18	000758	中色股份	5,870,418.26	1.32
19	603993	洛阳钼业	5,456,755.28	1.22
20	000933	*ST 神火	5,415,918.78	1.21

注：卖出金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

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	57,566,140.39
--------------	---------------

卖出股票收入（成交）总额	261,105,107.72
--------------	----------------

注：买入股票成本和卖出股票收入按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末，未持有债券投资。

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

本基金本报告期末，未持有债券投资。

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

本基金本报告期内未进行资产支持证券投资。

7.8 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

本基金本报告期内未进行贵金属投资。

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

本基金本报告期内未进行权证投资。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

按照股指期货每日无负债结算的结算规则、《基金股指期货投资会计业务核算细则（试行）》及《企业会计准则—金融工具列报》的相关规定，“其他衍生工具—股指期货投资”与“证券清算款—股指期货每日无负债结算暂收暂付款”，符合金融资产与金融负债相抵销的条件，故将“其他衍生工具—股指期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报，净额为零。

本基金本报告期初及报告期内均未持有股指期货投资。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

基金管理人可运用股指期货，以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。此外，本基金还将运用股指期货来对冲特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理，以及对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险。

本基金本报告期内，股指期货投资符合既定的投资政策和投资目标。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金投资范围不包括国债期货投资。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金投资范围不包括国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金本期投资的前十名证券的发行主体没有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。

7.12.2 本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定备选库之外的股票。

7.12.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	158,752.96
2	应收证券清算款	2,495,385.00
3	应收股利	-
4	应收利息	3,259.12

5	应收申购款	399.52
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	2,657,796.60

7.12.4 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。

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

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	601168	西部矿业	11,252,826.00	5.99	筹划重大事项

注：本基金本报告期末指数基金前十名股票中仅上述一只股票存在流通受限情况

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	000511	*ST 烯碳	5,844,437.52	3.11	筹划重大事项
2	000693	ST 华泽	2,931,237.50	1.56	筹划重大事项
3	601611	中国核建	116,022.32	0.06	股票交易异常波动

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中仅上述三只股票存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§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
信诚中证800有色指数分级A	420	151,497.23	54,553,130.00	85.74%	9,075,705.00	14.26%
信诚	7,328	8,682.97	2,518,141.00	3.96%	61,110,694.00	96.04%

中 证 800 有 色 指 数 分 级 B						
信 诚 中 证 800 有 色 指 数 分 级	6,901	8,752.14	32,718,499.75	54.17%	27,680,016.88	45.83%
合计	14,649	12,810.17	89,789,770.75	47.85%	97,866,415.88	52.15%

注：本表列示“占基金总份额比例”中，对下属分级基金，为占各自级别份额的比例；对合计数，为占期末基金份额总额的比例。

8.2 期末上市基金前十名持有人

信诚中证 800 有色指数分级 A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中国大地财产保险股份有限公司	10,990,262.00	17.27%
2	英大泰和人寿保险股份有限公司—团险万能	10,000,000.00	15.72%
3	中国财产再保险有限责任公司	9,960,859.00	15.65%
4	中国人民保险集团股份有限公司	7,787,788.00	12.24%
5	中国人寿再保险有限责任公司	6,303,686.00	9.91%
6	陈杰	2,429,151.00	3.82%
7	北京快快网络技术有限公司	1,729,334.00	2.72%
8	北京鑫维隆电子技术咨询有限公司	1,620,691.00	2.55%
9	韩冬	1,503,975.00	2.36%
10	吉林省农村信用社联合社企业年金计划—交行	1,203,627.00	1.89%

信诚中证 800 有色指数分级 B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	李刚	1,300,000.00	2.04%
2	宗彬	1,086,870.00	1.71%
3	周梅英	800,000.00	1.26%
4	周昭玲	729,356.00	1.15%
5	魏章平	726,213.00	1.14%

6	刘柏英	702,211.00	1.10%
7	上海明泓投资管理有限公司—明泓 CTA 一号基金	679,781.00	1.07%
8	陈志豪	677,267.00	1.06%
9	中信盈时资产管理有限公司—中信盈时—昊沅 2 号资产管理计划	513,760.00	0.81%
10	姚淼	500,000.00	0.79%
10	朱娟萍	500,000.00	0.79%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

期末本公司基金从业人员未持有本基金的基金份额。

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	信诚中证 800 有色指数分级 A	0
	信诚中证 800 有色指数分级 B	0
	信诚中证 800 有色指数分级	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	信诚中证 800 有色指数分级 A	0
	信诚中证 800 有色指数分级 B	0
	信诚中证 800 有色指数分级	0
	合计	0

注：1、期末本基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金的基金份额。

2、期末本基金的基金经理未持有本基金的基金份额。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	信诚中证 800 有色指数分级 A	信诚中证 800 有色指数分级 B	信诚中证 800 有色指数分级
基金合同生效日(2013 年 8 月 30 日)基金份额总额	28,416,747.00	28,416,747.00	244,948,273.94
本报告期期初基金份额总额	96,454,532.00	96,454,532.00	225,036,594.39
本报告期基金总申购份额	—	—	113,575,567.64
减：本报告期基金总赎回份额	—	—	343,865,039.40
本报告期基金拆分变动份额	-32,825,697.00	-32,825,697.00	65,651,394.00
本报告期期末基金份额总额	63,628,835.00	63,628,835.00	60,398,516.63

注：1. 拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

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

报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金进行审计的会计师事务所是毕马威华振会计师事务所。该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

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

报告期内管理人、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	
招商证券	2	94,353,228.95	29.75%	85,984.56	29.41%	-
海通证券	2	80,480,871.40	25.37%	74,952.68	25.64%	-
中信证券	1	61,446,659.56	19.37%	57,224.80	19.57%	-
浙商证券	1	57,922,608.31	18.26%	52,785.35	18.06%	-
中信建投	2	22,972,532.32	7.24%	21,395.91	7.32%	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
大通证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-

注：本基金根据券商的研究实力和服务水平选择专用席位。由研究部牵头对席位候选券商的研究实力和服务质量进行评估，并综合考虑候选券商的综合实力，由研究总监和投资总监审核批准。

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

金额单位：人民币元

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	信诚基金管理有限公司旗下证券投资基金 2015 年 12 月 31 日基金资产净值和基金份额净值公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	2016-01-04
2	信诚基金管理有限公司关于因指数熔断调整旗下部分基金开放时间的公告	同上	2016-01-04
3	信诚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申购赎回业务的提示性公告	同上	2016-01-06
4	信诚基金管理有限公司关于因指数熔断调整旗下部分基金开放时间的公告	同上	2016-01-07
5	信诚中证 800 有色指数分级证券投资基金 2015 年第四季度报告	同上	2016-01-22
6	信诚基金管理有限公司关于旗下部分基金增加钱景财富为销售机构并参加基金申购费率优惠活动公告	同上	2016-03-17
7	信诚中证 800 有色指数分级证券投资基金 2015 年年度报告	同上	2016-03-25
8	信诚中证 800 有色指数分级证券投资基金 2015 年年度报告摘要	同上	2016-03-25
9	信诚基金管理有限公司关于旗下部分基金增加利得基金为销售机构并参加基金申购费率优惠活动公告	同上	2016-03-30
10	信诚基金管理有限公司关于旗下基金参加同花顺申购费率优惠活动的公告	同上	2016-03-31
11	信诚中证 800 有色指数分级证券投资基金招募说明书更新 (2016 年第 1 次)	同上	2016-04-13
12	信诚中证 800 有色指数分级证券投资基金招募说明书摘要更新 (2016 年第 1 次)	同上	2016-04-13
13	信诚中证 800 有色指数分级证券投资基金 2016 年第一季度报告	同上	2016-04-21
14	关于信诚基金管理有限公司淘宝店关闭申购服务的公告	同上	2016-05-05
15	关于信诚基金管理有限公司网上交易支付宝渠道关闭基金支付服务的公告	同上	2016-05-05

16	信诚基金管理有限公司关于旗下部分基金增加好买基金为销售机构并参加费率优惠活动的公告	同上	2016-05-31
17	信诚基金管理有限公司关于调整网上直销招商银行卡直联渠道费率优惠折扣的公告	同上	2016-06-02
18	信诚基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动公告	同上	2016-06-29
19	信诚基金管理有限公司关于旗下部分基金增加云湾投资为销售机构的公告	同上	2016-06-29

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件名称

- 1、信诚中证 800 有色指数分级证券投资基金相关批准文件
- 2、信诚基金管理公司营业执照、公司章程
- 3、信诚中证 800 有色指数分级证券投资基金基金合同
- 4、信诚中证 800 有色指数分级证券投资基金招募说明书
- 5、本报告期内按照规定披露的各项公告

12.2 备查文件存放地点

信诚基金管理有限公司办公地--上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 9 层。

12.3 备查文件查阅方式

投资者可在营业时间至公司办公地点免费查阅，也可按工本费购买复印件。
亦可通过公司网站查阅，公司网址为 www.xcfunds.com。

信诚基金管理有限公司
2016 年 8 月 24 日