

中银标普全球精选自然资源等权重指数证券投资基金

2016 年半年度报告

2016 年 6 月 30 日

基金管理人：中银基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一六年八月二十四日

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。

基金托管人招商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

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
2 基金简介	5
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.....	5
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人.....	6
2.5 信息披露方式.....	6
2.6 其他相关资料.....	6
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.....	7
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介.....	10
4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	10
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.9 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
5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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的真实、准确和完整发表意见.....	13
6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
7 投资组合报告	31
7.1 期末基金资产组合情况.....	31
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	31
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	32
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细.....	32
7.4.1 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细.....	32
7.4.2 积极投资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益投资明细.....	41
7.5 报告期内股票投资组合的重大变动.....	41
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	43
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	43
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	43
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细.....	43
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细.....	43

7.11 投资组合报告附注	43
8 基金份额持有人信息	44
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	44
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	44
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	44
9 开放式基金份额变动	44
10 重大事件揭示	44
10.1 基金份额持有人大会决议	44
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	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	45
10.4 基金投资策略的改变	45
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况	45
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	45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	45
10.8 其他重大事件	46
11 备查文件目录	47
11.1 备查文件目录	47
11.2 存放地点	47
11.3 查阅方式	47

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中银标普全球精选自然资源等权重指数证券投资基金
基金简称	中银标普全球资源等权重指数 (QDII)
基金主代码	000049
交易代码	000049
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 3 月 19 日
基金管理人	中银基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	24,941,021.74 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，以低成本、低换手率实现对标普全球精选自然资源等权重指数的有效跟踪，追求跟踪误差最小化。本基金控制目标为基金净值收益率与标的指数收益率之间的年化跟踪误差不超过 5%。
投资策略	本基金为被动式指数基金，采用完全复制法，按照成份股在标普全球精选自然资源等权重指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标普全球精选自然资源等权重指数成份股及其权重的变化进行相应调整，达到有效跟踪标的指数的目的。但在因特殊情况（如股票停牌、流动性不足）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。本基金还可能将一定比例的基金资产投资于与标普全球精选自然资源等权重指数相关的公募基金、上市交易型基金以及结构性产品，以优化投资组合的构建，达到节约交易成本和有效追踪标的指数表现的目的。
业绩比较基准	人民币计价的标普全球精选自然资源等权重指数 (NTR) 收益率×95%+人民币活期存款收益率×5% (税后)。
风险收益特征	本基金属于股票型基金，预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及与标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

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		中银基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	薛文成	张燕
	联系电话	021-38834999	0755-83199084
	电子邮箱	clientservice@bocim.com	Yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		021-38834788 400-888-5566	95555
传真		021-68873488	0755-83195201
注册地址		上海市银城中路200号中银大	深圳市深南大道7088 号招商

	厦45层	银行大厦
办公地址	上海市银城中路200号中银大厦26层、27层、45层	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码	200120	518040
法定代表人	白志中	傅育宁

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	-	Brown Brothers Harriman Co.
	中文	-	布朗兄弟哈里曼银行
注册地址		-	-
办公地址		-	-
邮政编码		-	NY 10005

2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.bocim.com
基金半年度报告备置地点	上海市银城中路 200 号中银大厦 26 层

2.6 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日至2016年6月30日）
本期已实现收益	103,179.59
本期利润	4,841,102.16
加权平均基金份额本期利润	0.2045
本期加权平均净值利润率	26.85%
本期基金份额净值增长率	30.73%
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	-3,579,535.19
期末可供分配基金份额利润	-0.1435
期末基金资产净值	21,754,858.84
期末基金份额净值	0.872
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	-12.80%

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中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数

(为期末余额，不是当期发生数)。

3、所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。

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	7.13%	1.80%	6.97%	1.96%	0.16%	-0.16%
过去三个月	13.99%	1.64%	14.23%	1.72%	-0.24%	-0.08%
过去六个月	30.73%	1.70%	37.06%	1.85%	-6.33%	-0.15%
过去一年	7.52%	1.79%	12.93%	1.89%	-5.41%	-0.10%
过去三年	-7.33%	1.23%	6.86%	1.31%	-14.19%	-0.08%
自基金合同生效起至今	-12.80%	1.18%	-11.27%	1.30%	-1.53%	-0.12%

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

中银标普全球精选自然资源等权重指数证券投资基金
 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
 (2013年3月19日至2016年6月30日)



注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期，截至建仓结束时本基金的

各项投资比例已达到基金合同第十二部分（三）的规定，即本基金投资于标普全球精选自然资源等权重指数成份股、备选成份股以及与标普全球精选自然资源等权重指数相关的公募基金、上市交易型基金、中国证监会许可投资的结构性产品及金融衍生产品的比例为基金资产的 80%—95%，其中投资于与标普全球精选自然资源等权重指数相关的公募基金、上市交易型基金、中国证监会许可投资的结构性产品及金融衍生产品的比例不超过基金资产的 10%；投资于现金、银行存款、固定收益类证券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具的比例为基金资产的 5%—20%，其中投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券的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

中银基金管理有限公司前身为中银国际基金管理有限公司，于 2004 年 8 月 12 日正式成立，由中银国际和美林投资管理合资组建（2006 年 9 月 29 日美林投资管理有限公司与贝莱德投资管理有限公司合并，合并后新公司名称为“贝莱德投资管理有限公司”）。2007 年 12 月 25 日，经中国证券监督管理委员会批复，同意中国银行股份有限公司直接控股中银基金。公司注册地为中国上海市，注册资本为一亿元人民币，其中中国银行拥有 83.5% 的股权，贝莱德投资管理拥有 16.5% 的股权。截至 2016 年 6 月 30 日，本管理人共管理六十六只开放式证券投资基金：中银中国精选混合型开放式证券投资基金、中银货币市场证券投资基金、中银持续增长混合型证券投资基金、中银收益混合型证券投资基金、中银动态策略混合型证券投资基金、中银稳健增利债券型证券投资基金、中银行业优选灵活配置混合型证券投资基金、中银中证 100 指数增强型证券投资基金、中银蓝筹精选灵活配置混合型证券投资基金、中银价值精选灵活配置混合型证券投资基金、中银稳健双利债券型证券投资基金、中银全球策略证券投资基金（FOF）、上证国有企业 100 交易型开放式指数证券投资基金、中银转债增强债券型证券投资基金、中银中小盘成长混合型证券投资基金、中银信用增利债券型证券投资基金、中银沪深 300 等权重指数证券投资基金(LOF)、中银主题策略混合型证券投资基金、中银保本混合型证券投资基金、中银理财 14 天债券型证券投资基金、中银理财 60 天债券型发起式证券投资基金、中银纯债债券型证券投资基金、中银理财 7 天债券型证券投资基金、中银理财 30 天债券型证券投资基金、中银稳健添利债券型发起式证券投资基金、中银标普全球精选自然资源等权重指数证券投资基金、中银消费主题混合型证券投资基金、中银美丽中国混合型证券投资基金、中银盛利纯债一年定期开放债券型证券投资基金（LOF）、中银新回报灵活配置混合型证券投资基金、中银互利分级债券型证券投资基金、中银惠利纯债半年定期开放债券型证券投资基金、中银中高等级债券型证券投资基金、中银理财 21 天债券型证券投资基金、中银优秀企业混合型证券投资基金、中

银活期宝货币市场基金、中银多策略灵活配置混合型证券投资基金、中银健康生活混合型证券投资基金、中银聚利分级债券型证券投资基金、中银薪钱包货币市场基金、中银产业债一年定期开放债券型证券投资基金、中银新经济灵活配置混合型证券投资基金、中银安心回报半年定期开放债券型证券投资基金、中银研究精选灵活配置混合型证券投资基金、中银恒利半年定期开放债券型证券投资基金、中银新动力股票型证券投资基金、中银宏观策略灵活配置混合型证券投资基金、中银新趋势灵活配置混合型证券投资基金、中银智能制造股票型证券投资基金、中银互联网+股票型证券投资基金、中银国有企业债债券型证券投资基金、中银新财富灵活配置混合型证券投资基金、中银新机遇灵活配置混合型证券投资基金、中银战略新兴产业股票型证券投资基金、中银机构现金管理货币市场基金、中银美元债债券型证券投资基金(QDII)、中银稳进保本混合型证券投资基金、中银宝利灵活配置混合型证券投资基金、中银瑞利灵活配置混合型证券投资基金、中银珍利灵活配置混合型证券投资基金、中银鑫利灵活配置混合型证券投资基金、中银益利灵活配置混合型证券投资基金、中银裕利灵活配置混合型证券投资基金、中银合利债券型证券投资基金、中银腾利灵活配置混合型证券投资基金、中银永利半年定期开放债券型证券投资基金，同时管理着多个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）及基金经理助理的简介

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		
陈学林	本基金的基金经理、中银全球策略（QDII-FOF）基金基金经理	2013-03-19	-	14	中银基金管理有限公司助理副总裁（AVP），工商管理硕士。曾任统一期货股份有限公司交易员，凯基证券投资信托股份有限公司基金经理。2010 年加入中银基金管理有限公司，曾担任中银全球策略（QDII-FOF）基金基金经理助理。2013 年 3 月至今任中银标普全球资源等权重指数（QDII）基金基金经理，2013 年 7 月至今任中银全球策略（QDII-FOF）基金基金经理。具有 14 年证券从业年限。具备基金从业资格。

注：1、首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日，非首任基金经理的“任职日期”为根据公司决定确定的聘任日期，基金经理的“离任日期”均为根据公司决定确定的解聘日期；

2、证券从业年限的计算标准及含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金目前不设境外投资顾问。基金管理人有权选择、更换或撤销境外投资顾问，并根据法律法规和《基金合同》的有关规定公告。

4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、中国证监会的有关规则和其他有关法律法规的规定，严格遵循本基金基金合同，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。

本报告期内，本基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 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》，公司制定了《中银基金管理有限公司公平交易管理办法》，建立了《新股询价申购和参与公开增发管理办法》、《债券询价申购管理办法》、《集中交易管理办法》等公平交易相关制度体系，通过制度确保不同投资组合在投资管理活动中得到公平对待，严格防范不同投资组合之间进行利益输送。公司建立了投资决策委员会领导下的投资决策及授权制度，以科学规范的投资决策体系，采用集中交易管理加强交易执行环节的内部控制，通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现；通过建立层级完备的公司证券池及组合风格库，完善各类具体资产管理业务组织结构，规范各项业务之间的关系，在保证各投资组合既具有相对独立性的同时，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过对异常交易行为的实时监控、分析评估、监察稽核和信息披露确保公平交易过程和结果的有效监督。

本报告期内，本公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。各投资组合均严格按照法律、法规和公司制度执行投资交易，本报告期内未发生异常交易行为。

4.4.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未发现异常交易行为。

本报告期内，基金管理人未发生所有投资组合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。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

1.宏观经济分析与行情回顾。

今年以来大宗商品的资产价格表现让全球投资者眼前一亮：石油、黄金、工业金属等都取得了不同程度的上涨，这都源于去年产生的低价使得一些商品供给端调整剧烈，而今年上半年需求从环比角度有了一定程度的复苏，因此供需矛盾加剧使得价格上涨。在二季度，石油在 OPEC 与俄罗斯之间冻产协议破裂之后依然往上涨，反应了不仅是 OPEC 甚至非 OPEC 国家如俄罗斯产量逐步下滑的基本面，使得价格一反去年的弱势，逐渐上涨至 50 美元。贵金属因为全球市场在联储局不断反复、游移不定的加息态度下，显现强烈的避险情绪也支撑了价格。二季度因为厄尔尼诺效应使得农产品出现一波行情，而农产品股也跟随大盘反弹。只有基础金属股票在二季度因为海外市场对于中国再次陷入硬着陆的疑虑加上一季度反弹涨幅已高，表现持平，维持区间震荡。

2.运作分析

本基金将继续严格按照基金合同及指数配置投资管理。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 6 月 30 日，本基金的单位净值为 0.872 元，本基金的累计单位净值为 0.872 元。报告期内本基金份额净值增长率为 30.73%，同期业绩比较基准收益率为 37.06%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

整体市场来说，我们认为价格的上涨过程中，驱使产业链生产者利润回升，这使得一些商品的供给端已经有所反应，如中国的钢厂复产，石油生产商减产放缓等；对于需求端我们认为下半年需求改善的力度将会逐渐趋缓。但是因为英国脱欧带来各国央行更加谨慎甚至加大宽松力度的预期，下半年大宗商品的表現将更体现出宏观经济的影响。短期来说，油价将在 40-50 美元/桶震，因为北美页岩油产量在前期大幅下降后已经开始止稳，而之前油价在 50 美元/桶以上时，北美活跃钻机数开始回升，但是中国原油进口阶段性回落，也会在一定程度上压抑油价上涨的动力，但是中长期仍看好油价，原油季度均价有望企稳回升，原油仍可能会回升到 60-70 美元/桶，因为同时过去两年北美在用钻机数快速下降，基本无新增页岩油产能，而全球油气勘探开采资本支出连续两年下降，其对原油产量的影响将在 2017 年下半年开始逐步显现。贵金属部分，英国公投前一天，即 6 月 23 日，美国年底前加息概率为 50.1%，而在公投结果出来后，加息概率迅速降至 15.3%。现在 7 月与 9 月加息概率降为 0%，2016 年不再加息的概率在上升，美元将偏弱势整理，除此之外因为市场依旧担心英国脱欧的连锁政治效应，因此避险的情绪仍将继续支持贵金属的行情。石油价格反弹至目前的 50 美元附近，将在此价位附近消化获利压力。从基本面来讲，上半年全球供应减产主要以非 OPEC 为主，并推动全球过剩得到很大缓解。对下半年，全球供应减产进程可能放缓但是仍然会持续，端看全球需求增长是否能够维持弱增长，短期而言，原油市场将维持震荡，预计能源股会在脱欧避险情

绪缓解后逐渐恢复上涨。有色金属部分，需求难有起色，供给干扰降低。基本金属板块未有明显收缩的供给和持续放缓的需求，中国经济表现会继续主导这板块的行情。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.6.1 有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

根据证监会的相关规定，本公司为建立健全有效的估值政策和程序，经公司执行委员会批准，公司成立估值委员会，明确参与估值流程各方的人员分工和职责，由权益投资管理部、固定收益投资管理部、研究部、风险管理部、基金运营部、法律合规部和信息披露相关人员担任委员会委员。估值委员会委员具备应有的经验、专业胜任能力和独立性，分工明确，在上市公司研究和估值、基金投资、投资品种所属行业的专业研究、估值政策、估值流程和程序、基金的风险控制与绩效评估、会计政策与基金核算以及相关事项的合法合规性审核和监督等各个方面具备专业能力和丰富经验。估值委员会严格按照工作流程诚实守信、勤勉尽责地讨论和决策估值事项。日常估值项目由基金运营部严格按照新会计准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定执行。当经济环境和证券市场发生重大变化时，针对特殊估值工作，按照以下工作流程进行：由公司估值委员会依据行业协会提供的估值模型和行业做法选定与当时市场经济环境相适应的估值模型并征求托管行、会计师事务所的相关意见，由交易部做出提示，风险管理部相关人员负责估值相关数值的处理和计算，待基金运营部人员复核后，将估值结果反馈基金经理，并提交公司估值委员会。基金运营部将收到的公司估值委员会确认的公允价值数据传至托管银行，提示托管银行认真核查，并通知会计事务所审核。公司按上述规定原则进行估值时，导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上的，各方确认无误后，基金运营部可使用上述公允价值进行证券投资基金净值计算处理，与托管行核对无误后产生当日估值结果，并将结果反馈至公司估值委员会，同时按流程对外公布。

4.6.2 基金经理参与或决定估值的程度

基金经理参与对估值问题的讨论，对估值结果提出反馈意见，但不介入基金日常估值业务。

4.6.3 本公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突。

4.6.4 定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

4.8 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，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每份基金份额每次分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 20%。

本报告期末可供分配利润为-3,579,535.19 元。根据本基金基金合同第十六部分基金的收益与分配相关约定，无相关收益分配事项。

4.9 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

截至本报告期末,本基金的基金资产净值自 2014 年 8 月 8 日起已持续超过 60 个工作日低于 5000 万元,基金管理人已向中国证券监督管理委员会报送了解决方案。

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

托管人声明,在本报告期内,基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同,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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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：中银标普全球精选自然资源等权重指数证券投资基金

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	2,320,075.58	1,069,312.68
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	20,588,282.65	12,629,684.34
其中：股票投资		20,588,282.65	12,629,684.34
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
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		-	392,320.29
应收利息	6.4.7.5	456.01	246.17

应收股利		39,871.90	21,017.88
应收申购款		82,146.58	99,484.56
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	6,275.50	1,680.61
资产总计		23,037,108.22	14,213,746.53
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	6.4.7.3	-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		876,134.94	458,731.95
应付管理人报酬		19,442.01	12,944.43
应付托管费		5,302.36	3,530.30
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
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	381,370.07	270,417.52
负债合计		1,282,249.38	745,624.20
所有者权益:		-	-
实收基金	6.4.7.9	24,941,021.74	20,181,895.48
未分配利润	6.4.7.10	-3,186,162.90	-6,713,773.15
所有者权益合计		21,754,858.84	13,468,122.33
负债和所有者权益总计		23,037,108.22	14,213,746.53

注：报告截止日 2016 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.872 元，基金份额总额 24,941,021.74 份。

6.2 利润表

会计主体：中银标普全球精选自然资源等权重指数证券投资基金

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		5,145,910.46	-985,650.43
1.利息收入		5,696.51	15,946.67
其中：存款利息收入	6.4.7.11	5,696.51	15,946.67
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		0.00	0.00
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		384,055.83	-1,314,833.06
其中：股票投资收益	6.4.7.12	210,258.60	-1,549,548.46
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		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	173,797.23	234,715.40
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	4,737,922.57	240,604.90
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		10,579.96	-2,982.19
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	7,655.59	75,613.25
减：二、费用		304,808.30	371,644.17
1. 管理人报酬		97,965.69	129,827.48
2. 托管费		26,717.88	35,407.55
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	12,851.91	26,718.88
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.19	167,272.82	179,690.26
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,841,102.16	-1,357,294.60
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,841,102.16	-1,357,294.60

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中银标普全球精选自然资源等权重指数证券投资基金

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）	20,181,895.48	-6,713,773.15	13,468,122.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,841,102.16	4,841,102.16
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）	4,759,126.26	-1,313,491.91	3,445,634.35
其中：1.基金申购款	12,982,748.05	-2,941,895.11	10,040,852.94
2.基金赎回款	-8,223,621.79	1,628,403.20	-6,595,218.59

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）	24,941,021.74	-3,186,162.90	21,754,858.84
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）	29,274,871.07	-3,754,151.57	25,520,719.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,357,294.60	-1,357,294.60
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）	-7,346,505.67	956,771.10	-6,389,734.57
其中：1.基金申购款	64,260,992.05	-8,049,934.60	56,211,057.45
2.基金赎回款	-71,607,497.72	9,006,705.70	-62,600,792.02
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）	21,928,365.40	-4,154,675.07	17,773,690.33

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：

基金管理人负责人：李道滨，主管会计工作负责人：欧阳向军，会计机构负责人：乐妮

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中银标普全球精选自然资源等权重指数证券投资基金(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[2012]1743 号文《关于核准中银标普全球精选自然资源等权重指数证券投资基金募集的批复》的核准,由中银基金管理有限公司作为发起人于 2013 年 2 月 25 日起至 2013 年 3 月 15 日向社会公开募集,募集期结束经普华永道中天会计师事务所有限公司验证并出具普华永道中天验字(2013)第 125 号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2013 年 3 月 19 日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币 273,988,903.02 元,在募集期间产生的活期存款利息为人民币 66,875.73 元,以上实收基金(本息)合计为人民币 274,055,778.75 元,折合 274,055,778.75 份基金份额。本基金的基金管理人为中银基金管理有限公司,注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司,基金托管人为招商银行股份有限公司,基金境外托管人为布朗兄弟哈里曼银行。

本基金主要投资于标普全球精选自然资源等权重指数成份股（包括股票和/或存托凭证，下同）、备选成份股，与标普全球精选自然资源等权重指数相关的公募基金、上市交易型基金、中国证监会许可投资的结构化产品及金融衍生产品等，固定收益类证券、银行存款、现金等货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他产品或金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。

本基金的业绩比较基准为：人民币计价的标普全球精选自然资源等权重指数（NTR）收益率×95%+人民币活期存款收益率×5%（税后）。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《中银标普全球精选自然资源等权重指数证券投资基金基金合同》和中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

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 6 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 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

本报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

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《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》及其他相关境内外税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

- (1) 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。
- (2) 目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂免征营业税和企业所得税。
- (3) 目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内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	2,320,075.58
定期存款	-
其他存款	-
合计	2,320,075.58

注：于 2016 年 6 月 30 日，活期存款中包括的外币余额为美元活期存款 3,565.53 元(折合人民币 23,643.74 元)，港币活期存款 5,964.00 元(折合人民币 5,097.25 元)，加元活期存款 230.87 元(折合人民币 1,182.56 元)。

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	19,822,968.15	20,588,282.65	765,314.50
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	19,822,968.15	20,588,282.65	765,314.50

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融工具。

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

本基金本报告期末未持有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	450.09

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	-
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	5.92
其他	-
合计	456.01

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
其他应收款	6,275.50
待摊费用	-
合计	6,275.50

6.4.7.7 应付交易费用

本基金本报告期末无应付交易费用。

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	2,304.59
预提费用	372,785.67
应付在途资金	6,279.81
合计	381,370.07

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	20,181,895.48	20,181,895.48
本期申购	12,982,748.05	12,982,748.05
本期赎回（以“-”号填列）	-8,223,621.79	-8,223,621.79
本期末	24,941,021.74	24,941,021.74

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

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	-2,975,111.31	-3,738,661.84	-6,713,773.15
本期利润	103,179.59	4,737,922.57	4,841,102.16
本期基金份额交易产生的变动数	-707,603.47	-605,888.44	-1,313,491.91
其中：基金申购款	-1,919,938.98	-1,021,956.13	-2,941,895.11
基金赎回款	1,212,335.51	416,067.69	1,628,403.20
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,579,535.19	393,372.29	-3,186,162.90

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	5,617.72
定期存款利息收入	0.00
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	0.00
其他	78.79
合计	5,696.51

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	4,240,957.88
减：卖出股票成本总额	4,030,699.28
买卖股票差价收入	210,258.60

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内无买卖权证差价收入。

6.4.7.15 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	173,797.23
基金投资产生的股利收益	-
合计	173,797.23

6.4.7.16 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	4,737,922.57
——股票投资	4,737,922.57
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	4,737,922.57

6.4.7.17 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	7,655.07
其他	0.52
合计	7,655.59

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

6.4.7.18 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	12,851.91
银行间市场交易费用	-
合计	12,851.91

6.4.7.19 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	4,972.24
指数使用费	94,538.00
其他	1,233.76
指数许可费	31,404.10
存托凭证保管费	669.60
银行汇划费	9,592.10
合计	167,272.82

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，指数许可使用费按前一日基金资产净值的 0.06% 年费率计提，逐日累计，且指数许可使用费收取下限为每年 3 万美元，即若不足 3 万美元则按照 3 万美元收取。

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

本基金没有需说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金没有需说明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
中银基金管理有限公司(“中银基金公司”)	基金管理人、基金销售机构
招商银行股份有限公司(“招商银行”)	基金托管人、基金销售机构
布朗兄弟哈里曼银行	境外资产托管人

注：下述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

无。

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 基金交易

无。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

无。

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	97,965.69	129,827.48
其中：支付销售机构的客户维护费	-	51,740.88

注：支付基金管理人中银基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.1% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.1% / 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	26,717.88	35,407.55

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.30% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.30% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

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

本基金本报告期内无管理人运用固有资金投资本基金的情况。

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

本基金本报告期内除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

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
招商银行	2,290,152.03	5,617.72	2,449,546.09	15,874.82
布朗兄弟哈里曼银行	29,923.55	-	322,457.19	-
合计	2,320,075.58	5,617.72	2,772,003.28	15,874.82

注：本基金的银行存款分别由基金托管人招商银行和境外资产托管人布朗兄弟哈里曼银行保管，按适用利率或约定利率计息。

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发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未发生利润分配。

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

本基金本报告期末未持有因认购新发或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

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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

本基金本报告期末无从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

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面临的相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了包括风险管理委员会、风险控制委员会、督察长、风险管理部、法律合规部、稽核部和相关业务部门构成的多级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防

范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由风险管理部负责，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。风险管理部对公司执行总裁负责，并由督察长分管。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制可在可承受的范围内。

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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

为了规避信用风险，本公司在交易前对交易对手的资信状况进行充分的评估。本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小；在场外交易市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金投资于同一机构(政府、国际金融组织除外)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的基金管理人管理的其他基金共同持有同一机构发行的具有投票权的证券不得超过该类证券发行总量的 10%。同时本基金投资于中国证监会签订双边监管合作谅解备忘录的国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不超过基金资产净值的 10%，其中持有任一国家或地区市场的证券资产不超过基金资产净值的 3%。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种的信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券(2015 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险，是指在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时发生资金短缺的风险。对于本基金而言，体现在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。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人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，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持证券在证券交易所上市，因此均能以合理价格适时变现。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投资的公允价值。

于 2016 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同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

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

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担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。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款及部分应收申购款等。

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 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,290,152.03	-	-	29,923.55	2,320,075.58
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	20,588,282.65	20,588,282.65
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-

应收利息	-	-	-	456.01	456.01
应收股利	-	-	-	39,871.90	39,871.90
应收申购款	5,994.04	-	-	76,152.54	82,146.58
其他资产	-	-	-	6,275.50	6,275.50
资产总计	2,296,146.07	-	-	20,740,962.15	23,037,108.22
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	876,134.94	876,134.94
应付管理人报酬	-	-	-	19,442.01	19,442.01
应付托管费	-	-	-	5,302.36	5,302.36
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	381,370.07	381,370.07
负债总计	-	-	-	1,282,249.38	1,282,249.38
利率敏感度缺口	2,296,146.07	-	-	19,458,712.77	21,754,858.84
上年度末 2015 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,043,334.13	-	-	25,978.55	1,069,312.68
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	12,629,684.34	12,629,684.34
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	392,320.29	392,320.29
应收利息	-	-	-	246.17	246.17
应收股利	-	-	-	21,017.88	21,017.88
应收申购款	-	-	-	99,484.56	99,484.56
其他资产	-	-	-	1,680.61	1,680.61
资产总计	1,043,334.13	-	-	13,170,412.40	14,213,746.53
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	458,731.95	458,731.95
应付管理人报酬	-	-	-	12,944.43	12,944.43
应付托管费	-	-	-	3,530.30	3,530.30

应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	270,417.52	270,417.52
负债总计	-	-	-	745,624.20	745,624.20
利率敏感度缺口	1,043,334.13	-	-	12,424,788.20	13,468,122.33

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2015 年 12 月 31 日：同），银行存款以活期存款利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2015 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇风险进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日			合计
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	
以外币计价的资产				
银行存款	23,643.74	5,097.25	1,182.56	29,923.55
交易性金融资产	12,085,430.82	1,928,238.09	6,574,613.74	20,588,282.65
应收证券清算款	-	-	-	0.00
应收股利	26,242.24	10,133.64	3,496.02	39,871.90
其他资产	6,275.70	-	82,596.47	88,872.17
资产合计	12,141,592.50	1,943,468.98	6,661,888.79	20,746,950.27
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	-	-	-

其他负债	-	5,097.25	879,622.09	884,719.34
负债合计	-	5,097.25	879,622.09	884,719.34
资产负债表外 汇风险敞口净 额	12,141,592.50	1,938,371.73	5,782,266.70	19,862,230.93
项目	上年度末 2015年12月31日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的 资产				
银行存款	24,416.33	-	1,680.86	26,097.19
交易性金融资 产	7,772,988.84	981,182.80	3,875,512.70	12,629,684.34
应收证券清算 款	248,266.37	16,259.44	127,794.48	392,320.29
应收股利	18,154.48	1,686.45	1,176.95	21,017.88
其他资产	1,680.61	-	-	1,680.61
资产合计	8,065,506.63	999,128.69	4,006,164.99	13,070,800.31
以外币计价的 负债				
应付证券清算 款	-	-	-	-
其他负债	-	-	1,680.86	1,680.86
负债合计	-	-	1,680.86	1,680.86
资产负债表外 汇风险敞口净 额	8,065,506.63	999,128.69	4,004,484.13	13,069,119.45

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率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：人民币万元）	
		本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
	港币相对人民币升值 5%	增加约 10	增加约 5
	港币相对人民币贬值 5%	减少约 10	减少约 5
	美元相对人民币升值 5%	增加约 61	增加约 40
	美元相对人民币贬值 5%	减少约 61	减少约 40
	其他币种相对人民币升值 5%	增加约 33	增加约 20
	其他币种相对人民币贬值 5%	减少约 33	减少约 20

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他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。本基金主要投资于境外公募基金及证券市场公开发行和挂牌交易的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。基金投资于标普全球精选自然资源等权重指数成份股、备选成份股以及与标普全球精选自然资源等权重指数相关的公募基金、上市交易型基金、中国证监会许可投资的结构性及金融衍生产品的比例为基金资产的 80%~95%，其中投资于与标普全球精选自然资源等权重指数相关的公募基金、上市交易型基金、中国证监会许可投资的结构性及金融衍生产品的比例不超过基金资产的 10%；投资于现金、银行存款、固定收益类证券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具的比例为基金资产的 5%~20%，其中投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，通过特定指标测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 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	20,588,282.65	94.64	12,629,684.34	93.77
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	20,588,282.65	94.64	12,629,684.34	93.77

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1.本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投
----	---

	资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变；		
	2.以下分析，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
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：人民币万元）	
		本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
	1. 业绩比较基准上升5%	增加约 102	增加约 64
	2. 业绩比较基准下降5%	减少约 102	减少约 64

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本报告期内没有有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

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	20,588,282.65	89.37
	其中：普通股	16,102,591.90	69.90
	存托凭证	4,485,690.75	19.47
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
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	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,320,075.58	10.07
8	其他各项资产	128,749.99	0.56
9	合计	23,037,108.22	100.00

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
美国	12,085,430.82	55.55
加拿大	3,745,608.59	17.22
英国	1,973,770.63	9.07
中国香港	1,928,238.09	8.86
澳大利亚	855,234.52	3.93
合计	20,588,282.65	94.64

注：1、国家（地区）类别根据其所在的证券交易所确定，此处股票包括普通股和优先股；

2、ADR、GDR 按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

7.3.1 期末指数投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
原材料	12,637,503.55	58.09
能源	6,184,376.53	28.43
必需消费品	1,185,682.92	5.45
金融	580,719.65	2.67
合计	20,588,282.65	94.64

注：本基金对以上行业分类采用全球行业分类标准（GICS）。

7.3.2 期末积极投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票及存托凭证。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

7.4.1 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代码	所在证 券市场	所属国家 (地区)	数量（股）	公允价值	占基金资 产净值比 例（%）
1	FRESNIL LO PLC	弗雷斯尼 洛有限公 司	FRES LN	伦敦证 券交易 所	英国	1,855	272,062.70	1.25
2	TECK RESOUR CES LTD-CLS B	加拿大泰 克资源有 限公司	TCK/B CN	多伦多 证券交 易所	加拿大	2,954	257,377.95	1.18
3	YANZHO U COAL MINING CO-H	兖州煤业	1171 HK	香港证 券交易 所	香港	60,000	256,913.80	1.18

4	CHINA COAL ENERGY CO-H	中煤能源	1898 HK	香港证 券交易 所	香港	74,000	254,879.69	1.17
5	RANDG OLD RESOUR CES LTD	RANDGO LD 资源有 限公司	RRS LN	伦敦证 券交易 所	英国	332	249,090.61	1.15
6	ROYAL GOLD INC	皇家黄金 股份有限 公司	RGLD US	纽约证 券交易 所	美国	525	250,728.99	1.15
7	VALE SA-SP ADR	淡水河谷 公司	VALE US	纽约证 券交易 所	美国	7,305	245,111.03	1.13
8	ANGLOG OLD ASHANT I-SPON ADR	AngloGold Ashanti 有 限公司	AU US	纽约证 券交易 所	美国	2,011	240,836.30	1.11
9	SILVER WHEATO N CORP	银惠顿公 司	SLW CN	多伦多 证券交 易所	加拿大	1,521	236,920.24	1.09
10	GOLD FIELDS LTD-SPO NS ADR	金田有限 公司	GFI US	纽约证 券交易 所	美国	7,214	234,403.64	1.08
11	TAHOE RESOUR CES INC	塔霍资源 公司	THO CN	多伦多 证券交 易所	加拿大	2,369	234,802.42	1.08
12	CONSOL ENERGY INC	CONSOL 能源公司	CNX US	纽约证 券交易 所	美国	2,208	235,584.79	1.08
13	FORTES CUE METALS GROUP LTD	FMG 集团	FMG AU	澳大利 亚证券 交易所	澳大利亚	13,419	232,258.74	1.07
14	CIA DE MINAS BUENAV ENTUR- ADR	布埃纳文 图拉矿业 公司	BVN US	纽约证 券交易 所	美国	2,917	231,151.36	1.06
15	NEWCRE ST MINING	纽克雷斯 特矿业有 限公司	NCM AU	澳大利 亚证券 交易所	澳大利亚	2,027	230,550.17	1.06

	LTD							
16	CHINA SHENHU A ENERGY CO-H	中国神华	1088 HK	香港证 券交易 所	香港	19,000	231,564.29	1.06
17	STILLWA TER MINING CO	斯蒂尔沃 特矿业公 司	SWC US	纽约证 券交易 所	美国	2,943	231,455.27	1.06
18	BARRIC K GOLD CORP	巴里克黄 金公司	ABX US	纽约证 券交易 所	美国	1,598	226,238.64	1.04
19	AGNICO EAGLE MINES LTD	阿哥尼可 老鹰矿场 有限公司	AEM CN	多伦多 证券交 易所	加拿大	632	223,822.11	1.03
20	FRANCO -NEVAD A CORP	Franco-Nev ada 公司	FNV CN	多伦多 证券交 易所	加拿大	444	223,422.99	1.03
21	NEWMO NT MINING CORP	纽蒙特矿 业	NEM US	纽约证 券交易 所	美国	862	223,613.61	1.03
22	LEE & MAN PAPER MANUFA CTURIN	理文造纸	2314 HK	香港证 券交易 所	香港	45,000	221,145.86	1.02
23	BP PLC	碧辟公司	BP/ LN	伦敦证 券交易 所	英国	5,539	216,509.76	1.00
24	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	荷兰皇家 壳牌	RDSA LN	伦敦证 券交易 所	英国	1,192	217,732.59	1.00
25	ANGLO AMERIC AN PLC	英美公司	AAL LN	伦敦证 券交易 所	英国	3,337	216,398.43	0.99
26	ENI SPA-SPO NSORED ADR	埃尼集团	E US	纽约证 券交易 所	美国	995	213,446.72	0.98
27	PETROL	巴西石油	PBR US	纽约证	美国	4,508	214,037.10	0.98

	EO BRASILE IRO-SPO N ADR	公司		券交易 所				
28	GOLDCO RP INC	Goldcorp 公司	G CN	多伦 多证 券交 易所	加拿大	1,677	212,343.05	0.98
29	GLENCO RE PLC	嘉能可公 司	GLEN LN	伦 敦证 券交 易所	英国	15,566	212,258.81	0.98
30	INGREDI ON INC	宜瑞安公 司	INGR US	纽 约证 券交 易所	美国	248	212,819.61	0.98
31	SIBANY E GOLD- SPON ADR	Sibanye Gold 有 限公 司	SBGL US	纽 约证 券交 易所	美国	2,354	212,606.09	0.98
32	YAMAN A GOLD INC	亚马纳黄 金公司	YRI CN	多 伦 多 证 券 交 易 所	加拿大	6,140	211,346.07	0.97
33	QUIMIC A Y MINERA CHIL-SP ADR	智利化工 矿业公司	SQM US	纽 约证 券交 易所	美国	1,278	209,493.93	0.96
34	CANADI AN NATURA L RESOUR CES	加拿大自 然资源有 限公司	CNQ CN	多 伦 多 证 券 交 易 所	加拿大	1,021	208,458.48	0.96
35	RIO TINTO PLC	力拓公司	RIO LN	伦 敦证 券交 易所	英国	1,025	209,768.64	0.96
36	ANADA RKO PETROL EUM CORP	阿纳达科 石油	APC US	纽 约证 券交 易所	美国	590	208,335.73	0.96
37	FIRST QUANTU M MINERA LS LTD	第一量子 矿业有限 公司	FM CN	多 伦 多 证 券 交 易 所	加拿大	4,430	205,810.51	0.95
38	NINE	玖龙纸业	2689 HK	香 港证 券交 易所	香港	41,000	206,394.26	0.95

	DRAGONS PAPER HOLDINGS			券交易所				
39	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	Archer-Daniels-Midland 公司	ADM US	纽约证券交易所	美国	730	207,620.88	0.95
40	RELIANCE STEEL & ALUMINIUM	Reliance 钢铝公司	RS US	纽约证券交易所	美国	404	206,015.47	0.95
41	ARCELORMITTAL-NY REGISTERED	安赛乐米塔尔	MT US	纽约证券交易所	美国	6,608	204,196.40	0.94
42	STATOIL ASA-SPON ADR	挪威国家石油公司	STO US	纽约证券交易所	美国	1,786	205,007.92	0.94
43	NUCOR CORP	纽柯公司	NUE US	纽约证券交易所	美国	624	204,452.10	0.94
44	ROSNEFT OJSC-REG S GDR	俄罗斯石油公司	ROSN LI	伦敦证券交易所	英国	5,983	203,133.28	0.93
45	SUNCOR ENERGY INC	森科能源公司	SU CN	多伦多证券交易所	加拿大	1,106	203,039.09	0.93
46	CHEVRON CORP	雪佛龙	CVX US	纽约证券交易所	美国	291	202,288.27	0.93
47	INTERNATIONAL PAPER CO	国际纸业	IP US	纽约证券交易所	美国	719	202,060.75	0.93
48	ECOPETROL SA-SPONSORED ADR	哥伦比亚国家石油公司	EC US	纽约证券交易所	美国	3,164	200,579.48	0.92
49	NEW GOLD	New Gold	NGD CN	多伦多	加拿大	6,893	199,486.38	0.92

	GOLD INC	股份有限公司		证券交易所				
50	EOG RESOURCES INC	EOG 资源	EOG US	纽约证券交易所	美国	360	199,142.89	0.92
51	MARATHON PETROLEUM CORP	马拉松石油公司	MPC US	纽约证券交易所	美国	794	199,865.96	0.92
52	SCOTTS MIRACLE-GRO CO-CL A	Scotts Miracle-Gro 公司	SMG US	纽约证券交易所	美国	434	201,196.84	0.92
53	EXXON MOBIL CORP	埃克森美孚石油	XOM US	纽约证券交易所	美国	323	200,779.61	0.92
54	LUKOIL PJSC-SPON DR	卢克石油公司	LKOD LI	伦敦证券交易所	英国	717	198,598.41	0.91
55	NOVATEK OAO-SPONS GDR REG S	诺瓦泰克公司	NVTK LI	伦敦证券交易所	英国	292	197,503.66	0.91
56	POSCO-SPON DR	浦项制铁公司	PKX US	纽约证券交易所	美国	671	198,004.32	0.91
57	SEVERSTEAL - GDR REG S	谢韦尔钢铁公司	SVST LI	伦敦证券交易所	英国	2,733	198,266.38	0.91
58	BHP BILLITON LIMITED	必和必拓有限公司	BHP AU	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	2,139	197,275.65	0.91
59	AGRIUM INC	加阳公司	AGU CN	多伦多证券交易所	加拿大	331	198,180.94	0.91
60	CNOOC LTD	中国海洋石油	883 HK	香港证券交易所	香港	24,000	197,326.21	0.91
61	RAYONIER INC	瑞安公司	RYN US	纽约证券交易所	美国	1,143	198,885.07	0.91

62	SCHWEITZER-MAUDUIT INTL INC	Schweitzer-Mauduit 国际公司	SWM US	纽约证券交易所	美国	843	197,218.78	0.91
63	NOVOLIPETSK STEEL PJSC-GDR	新利佩茨克钢铁公司	NLMK LI	伦敦证券交易所	英国	2,272	195,859.12	0.90
64	RELIANCE INDS-SPONS GDR 144A	印度瑞来斯实业公司	RIGD LI	伦敦证券交易所	英国	1,034	195,757.67	0.90
65	SOUTH32 LTD	South32 有限公司	S32 AU	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	25,625	195,149.96	0.90
66	IMPERIAL OIL LTD	加拿大帝国石油有限公司	IMO CN	多伦多证券交易所	加拿大	930	194,737.85	0.90
67	CP POKPHAND CO LTD	卜蜂国际	43 HK	香港证券交易所	香港	284,000	196,608.29	0.90
68	ALCOA INC	美铝	AA US	纽约证券交易所	美国	3,191	196,154.68	0.90
69	MONSANTO CO	孟山都	MON US	纽约证券交易所	美国	286	196,119.46	0.90
70	PHILLIPS 66	Phillips 66	PSX US	纽约证券交易所	美国	373	196,242.54	0.90
71	TOTAL SA-SPON ADR	道达尔	TOT US	纽约证券交易所	美国	604	192,652.27	0.89
72	ELDORADO GOLD CORP	埃尔拉多黄金公司	ELD CN	多伦多证券交易所	加拿大	6,484	192,963.72	0.89
73	ANTOFAGASTA PLC	Antofagasta 公司	ANTO LN	伦敦证券交易所	英国	4,668	193,895.23	0.89
74	CHINA	中国粮油	606 HK	香港证	香港	89,000	193,967.36	0.89

	AGRI-IN DUSTRIE S HLDGS	控股		券交易 所				
75	CONOCO PHILLIP S	康菲石油	COP US	纽约证 券交易 所	美国	668	193,132.37	0.89
76	DARLIN G INGREDI ENTS INC	Darling Ingredients 公司	DAR US	纽约证 券交易 所	美国	1,950	192,669.52	0.89
77	FREEPO RT-MCM ORAN INC	自由港迈 克默伦股 份有限公 司	FCX US	纽约证 券交易 所	美国	2,624	193,838.99	0.89
78	MOSAIC CO/THE	Mosaic 公 司	MOS US	纽约证 券交易 所	美国	1,120	194,437.39	0.89
79	OCCIDE NTAL PETROL EUM CORP	西方石油	OXY US	纽约证 券交易 所	美国	387	193,907.69	0.89
80	POTLAT CH CORP	Potlatch 公 司	PCH US	纽约证 券交易 所	美国	854	193,109.83	0.89
81	SOUTHE RN COPPER CORP	南方铜业 公司	SCCO US	纽约证 券交易 所	美国	1,088	194,653.84	0.89
82	GAZPRO M PAO -SPON ADR	俄罗斯天 然气工业 公司	OGZD LI	伦敦证 券交易 所	英国	6,731	192,375.16	0.88
83	KINROS S GOLD CORP	金若斯黄 金公司	K CN	多伦多 证券交 易所	加拿大	5,875	190,789.14	0.88
84	FMC CORP	FMC 公司	FMC US	纽约证 券交易 所	美国	626	192,238.89	0.88
85	LOUISIA NA-PACI FIC CORP	路易斯安 娜太平洋	LPX US	纽约证 券交易 所	美国	1,644	189,144.37	0.87
86	POTASH	萨斯喀彻	POT US	纽约证	美国	1,758	189,320.23	0.87

	CORP OF SASKATCHEWAN	温省钾肥股份有限公司		券交易所				
87	WEYERHAEUSER CO	惠好	WY US	纽约证券交易所	美国	956	188,724.75	0.87
88	CAMECO CORP	Comeco 公司	CCO CN	多伦多证券交易所	加拿大	2,559	185,998.40	0.86
89	MONDIPLC	盟迪公共有限公司	MNDI LN	伦敦证券交易所	英国	1,495	186,053.86	0.86
90	MMCNORILSKNICKELPJSC-ADR	诺里尔斯克镍业公司	MNOD LI	伦敦证券交易所	英国	2,088	184,012.62	0.85
91	SYNGENTA AG-ADR	先正达股份公司	SYT US	纽约证券交易所	美国	364	185,352.38	0.85
92	WESTFRASERTIMBERCO LTD	West Fraser 木材有限公司	WFT CN	多伦多证券交易所	加拿大	955	184,759.55	0.85
93	BUNGE LTD	Bunge 有限公司	BG US	纽约证券交易所	美国	464	181,997.26	0.84
94	CANFOR CORP	加福林业公司	CFP CN	多伦多证券交易所	加拿大	2,713	181,349.70	0.83
95	KAPSTONE PAPER AND PACKAGING	KapStone 纸业包装公司	KS US	纽约证券交易所	美国	2,067	178,324.04	0.82
96	DOMTAR CORP	Domtar 公司	UFS US	纽约证券交易所	美国	765	177,601.11	0.82
97	VALERO ENERGY CORP	Valero 能源	VLO US	纽约证券交易所	美国	517	174,844.85	0.80
98	KUANG	光启科学	439 HK	香港证	香港	65,000	169,438.33	0.78

	CHI SCIENCE LTD			券交易 所				
99	CF INDUST RIES HOLDIN GS INC	CF 工业控 股股份有 限公司	CF US	纽约证 券交易 所	美国	1,016	162,368.91	0.75
100	FIBRIA CELULO SE SA-SPON ADR	Fibria Celulose 公 司	FBR US	纽约证 券交易 所	美国	3,255	145,911.60	0.67

7.4.2 积极投资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益投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资的股票及存托凭证。

7.5 报告期内股票投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金 资产净值比例 （%）
1	ARCELORMITTAL-NY REGISTERED	MT US	194,725.76	1.45
2	MARATHON PETROLEUM CORP	MPC US	190,314.91	1.41
3	FMC CORP	FMC US	176,414.36	1.31
4	KUANGCHI SCIENCE LTD	439 HK	165,766.18	1.23
5	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	CF US	145,600.75	1.08
6	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	FM CN	141,237.89	1.05
7	PETROLEO BRASILEIRO S.A.-ADR	PBR US	128,855.38	0.96
8	KAPSTONE PAPER AND PACKAGING	KS US	124,854.25	0.93
9	VALE SA-SP ADR	VALE US	118,402.25	0.88
10	ANGLO AMERICAN PLC	AAL LN	114,869.27	0.85
11	MOSAIC CO/THE	MOS US	112,019.15	0.83
12	POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	POT US	108,650.22	0.81
13	ANADARKO	APC US	108,326.56	0.80

	PETROLEUM CORP			
14	FIBRIA CELULOSE SA-SPON ADR	FBR US	106,048.39	0.79
15	CANFOR CORP	CFP CN	105,846.26	0.79
16	DARLING INTERNATIONAL INC	DAR US	104,631.90	0.78
17	ANTOFAGASTA PLC	ANTO LN	99,764.73	0.74
18	GLENORE XSTRATA PLC	GLEN LN	96,779.01	0.72
19	WEST FRASER TIMBER CO LTD	WFT CN	93,583.63	0.69
20	SIBANYE GOLD- SPON ADR	SBGL US	89,290.32	0.66

注：“买入金额”按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	SIBANYE GOLD- SPON ADR	SBGL US	264,973.51	1.97
2	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	FM CN	178,247.57	1.32
3	KINROSS GOLD CORP	K CN	160,201.90	1.19
4	BARRICK GOLD CORP	ABX US	158,805.47	1.18
5	YAMANA GOLD INC	YRI CN	145,553.72	1.08
6	PLUM CREEK TIMBER CO	PCL US	136,418.51	1.01
7	PETROLEO BRASILEIRO S.A.-ADR	PBR US	136,155.91	1.01
8	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	BVN US	132,182.49	0.98
9	NEWCREST MINING LTD	NCM AU	117,965.55	0.88
10	DARLING INTERNATIONAL INC	DAR US	110,675.90	0.82
11	NEWMONT MINING CORP	NEM US	109,741.39	0.81
12	ANGLOGOLD ASHANTI-SPON ADR	AU US	106,770.40	0.79
13	URALKALI-SPON GDR-REG S	URKA LI	104,970.09	0.78
14	FORTESCUE METALS GROUP LTD	FMG AU	101,489.12	0.75
15	TECK RESOURCES LTD-CLS B	TCK/B CN	99,705.99	0.74
16	NEW GOLD INC	NGD CN	98,301.77	0.73
17	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	RDSB LN	90,419.00	0.67
18	AGNICO EAGLE MINES LTD	AEM CN	90,130.69	0.67
19	QUIMICA Y MINERA CHIL-SP ADR	SQM US	89,383.20	0.66
20	ARCELORMITTAL-NY REGISTERED	MT US	82,945.77	0.62

注：“卖出金额”按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	9,662,023.22
卖出收入（成交）总额	4,192,432.88

注：“买入成本”、“卖出收入”均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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名的前五名债券投资明细

本基金未持有债券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期内未持有资产支持证券。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期内未持有金融衍生品。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期内未持有基金。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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。

7.11.2 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。

7.11.3 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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	39,871.90
4	应收利息	456.01
5	应收申购款	82,146.58
6	其他应收款	6,275.50
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	128,749.99

7.11.4 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.11.4.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.11.4.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票不存在流通受限情况。

7.11.5 投资组合报告附注的其他需要说明的事项

由于计算中四舍五入的原因，本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

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

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
1,109	22,489.65	0.01	0.00%	24,941,021.73	100.00%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

基金管理人的从业人员无持有本基金的情况。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013年3月19日）基金份额总额	274,055,778.75
本报告期期初基金份额总额	20,181,895.48
本报告期基金总申购份额	12,982,748.05
减：本报告期基金总赎回份额	8,223,621.79
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	24,941,021.74

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转出份额。

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内没有召开基金份额持有人大会。

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

本报告期内，经本基金管理人 2016 年第一次股东会会议审议通过，选举杜惠芬女士担任公司第四届董事会的独立董事。经本基金管理人 2016 年第二次股东会会议审议通过，选举曾仲诚（Paul

Tsang) 先生担任公司董事, 葛岱炜 (David Graham) 先生不再担任公司董事。上述事项已报相关机构备案。

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门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

本报告期内没有发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略没有发生改变。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期内没有改聘会计师事务所。

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

本报告期内管理人、托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

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	
Goldman Sachs Asia LLC	1	189,334.45	1.65%	342.21	3.76%	-
Morgan Stanley	1	11,254,473.40	98.35%	8,763.38	96.24%	-

注：1、本公司从事境外投资业务时，将需要委托境外券商代理或协助进行交易操作。公司作为基金管理人将勤勉尽责地承担受信责任，挑选、委托合适的境外券商以取得有益于基金持有人利益的最佳执行；

2、根据相关法规与基金管理人的制度，基金管理人 QDII 业务团队按照以下标准，对 QDII 投资交易单元进行选择：（一）交易执行能力。主要指境外券商是否对交易指令进行了有效的执行以及能否取得较高质量的成交结果。衡量交易执行能力的指标主要有：下单及成交回报的准确性和及时性、券款划拨的准确性和及时性、交易保密能力等；（二）研究团队的实力和水平。衡量境外券商的研究能力的指标主要有：宏观经济研究、行业研究、市场走向分析、专题研究报告的水平，以及推荐投资工具的有效性等；（三）服务水平。主要指是否与基金管理人有较强的长期合作意愿并积极提供个性化服务；（四）交易成本。主要指费用是否总体可控，交易佣金相较于交易执行水平以及投研支持服务而言是否合理、优惠。符合上述条件的境外券商是 QDII 业务团队考虑长期合作的

对象，可成为备选券商，经 QDII 投资决策委员会审核批准，由交易室相关人员与其开设证券账户。

3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：新增 Goldman Sachs Asia LLC 交易单元一个。

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

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
Goldman Sachs Asia LLC	-	-	-	-	-	-	-	-
Morgan Stanley	-	-	-	-	-	-	-	-

注：无。

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	中银标普全球精选自然资源等权重指数证券投资基金 2015 年第 4 季度报告	《证券时报》、 www.bocim.com	2016-01-22
2	中银基金管理有限公司关于在中国银行调整基金定期定额申购限额的公告	《证券时报》、 www.bocim.com	2016-03-10
3	中银标普全球精选自然资源等权重指数证券投资基金 2015 年年度报告	《证券时报》、 www.bocim.com	2016-03-25
4	中银标普全球精选自然资源等权重指数证券投资基金 2015 年年度报告（摘要）	《证券时报》、 www.bocim.com	2016-03-25
5	中银标普全球精选自然资源等权重指数证券投资基金 2016 年第 1 季度报告	《证券时报》、 www.bocim.com	2016-04-21
6	中银基金管理有限公司关于调整电子直销平台中国银行借记卡定期定额申购费率的公告	《证券时报》、 www.bocim.com	2016-04-29
7	中银标普全球精选自然资源等权重指数证券投资基金暂停大额申购及定期定额投资业务的公告	《证券时报》、 www.bocim.com	2016-05-09
8	中银基金管理有限公司关于开通电子直销赎回转认购业务的公告	《证券时报》、 www.bocim.com	2016-05-26
9	中银基金管理有限公司关于开通电子直销赎回转申购业务的公告	《证券时报》、 www.bocim.com	2016-05-26
10	中银基金管理有限公司关于调整电子直销平	《证券时报》、	2016-05-26

	台快速赎回业务规则的公告	www.bocim.com	
11	中银标普全球精选自然资源等权重指数证券投资基金更新招募说明书（2016 年第 1 号）	《证券时报》、 www.bocim.com	2016-06-03
12	中银标普全球精选自然资源等权重指数证券投资基金更新招募说明书摘要（2016 年第 1 号）	《证券时报》、 www.bocim.com	2016-06-03
13	关于调整招商银行借记卡基金电子直销申购业务优惠费率的公告	《证券时报》、 www.bocim.com	2016-06-28
14	中银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、手机银行基金申购手续费费率优惠的公告	《证券时报》、 www.bocim.com	2016-06-28

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准中银标普全球精选自然资源等权重指数证券投资基金募集的文件；
- 2、《中银标普全球精选自然资源等权重指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《中银标普全球精选自然资源等权重指数证券投资基金托管协议》；
- 4、《中银标普全球精选自然资源等权重指数证券投资基金招募说明书》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照、公司章程；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内在指定报刊上披露的各项公告；
- 8、中国证监会要求的其他文件。

11.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所，部分文件同时登载于基金管理人互联网站。

11.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

中银基金管理有限公司
二〇一六年八月二十四日