

信诚全球商品主题证券投资基金(LOF)2018 年半年度报告

2018 年 06 月 30 日

基金管理人： 中信保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： 2018 年 08 月 28 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 2018 年 8 月 27 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 2018 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
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.....	4
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人.....	5
2.5 信息披露方式.....	5
2.6 其他相关资料.....	5
§ 3 主要财务指标和基金净值表现.....	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
§ 4 管理人报告.....	6
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	6
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.....	8
4.3 报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	8
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	8
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.....	9
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	9
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	9
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	10
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.....	10
§ 5 托管人报告.....	10
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	10
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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真实、准确和完整发表意见.....	10
§ 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.....	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.....	31
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.....	31
7.5	报告期内权益投资组合的重大变动.....	32
7.6	期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	33
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.....	33
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.....	33
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.....	33
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大基金投资明细.....	33
7.11	投资组合报告附注.....	34
§ 8	基金份额持有人信息.....	34
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	34
8.2	期末上市基金前十名持有人.....	35
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
8.5	发起式基金发起资金持有份额情况.....	35
§ 9	开放式基金份额变动.....	35
§ 10	重大事件揭示.....	35
10.1	基金份额持有人大会决议.....	35
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.....	35
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.....	38
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息.....	40
§ 12	备查文件目录.....	40
12.1	备查文件名称.....	40
12.2	备查文件存放地点.....	40
12.3	备查文件查阅方式.....	40

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	信诚全球商品主题证券投资基金(LOF)	
基金简称	信诚全球商品主题(QDII-FOF-LOF)	
场内简称	信诚商品	
基金主代码	165513	
交易代码	-	-
基金运作方式	上市型开放式	
基金合同生效日	2011年12月20日	
基金管理人	中信保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	61,108,587.47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	2012年1月13日	

2.2 基金产品说明

投资目标	通过在全球范围内积极配置商品类相关资产,在有效分散风险的基础上,追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金将根据宏观及商品分析进行资产配置,并通过全球范围内精选基金构建组合,以达到预期的风险收益水平。
业绩比较基准	标准普尔高盛商品总收益指数
风险收益特征	本基金主要投资全球商品类基金,商品价格具有较高的波动性,因此,本基金属于较高预期风险和较高预期收益的证券投资基金品种。

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		中信保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@citicprufunds.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-666-0066	95566
传真		021-50120888	010-66594942
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区世纪大道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		中国(上海)自由贸易试验区世纪大道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	陈四清

注:本基金管理人法定名称于2017年12月18日起变更为“中信保诚基金管理有限公司”。

本基金管理人已于 2017 年 12 月 20 日在中国证监会指定媒介以及公司网站上刊登了公司法定名称变更的公告。

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	Bank of China (Hong Kong) Limited	Bank of China (Hong Kong) Limited
	中文	中国银行(香港)有限公司	中国银行(香港)有限公司
注册地址		香港花园道 1 号中银大厦	香港花园道 1 号中银大厦
办公地址		香港花园道 1 号中银大厦	香港花园道 1 号中银大厦
邮政编码		-	-

2.5 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.citicprufunds.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.6 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(2018 年 01 月 01 日至 2018 年 06 月 30 日)
本期已实现收益	1,375,471.63
本期利润	2,443,970.42
加权平均基金份额本期利润	0.0358
本期加权平均净值利润率	7.89%
本期基金份额净值增长率	8.19%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018 年 06 月 30 日)
期末可供分配利润	-31,236,246.80
期末可供分配基金份额利润	-0.5112
期末基金资产净值	29,872,340.67
期末基金份额净值	0.489
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018 年 06 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-51.10%

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。

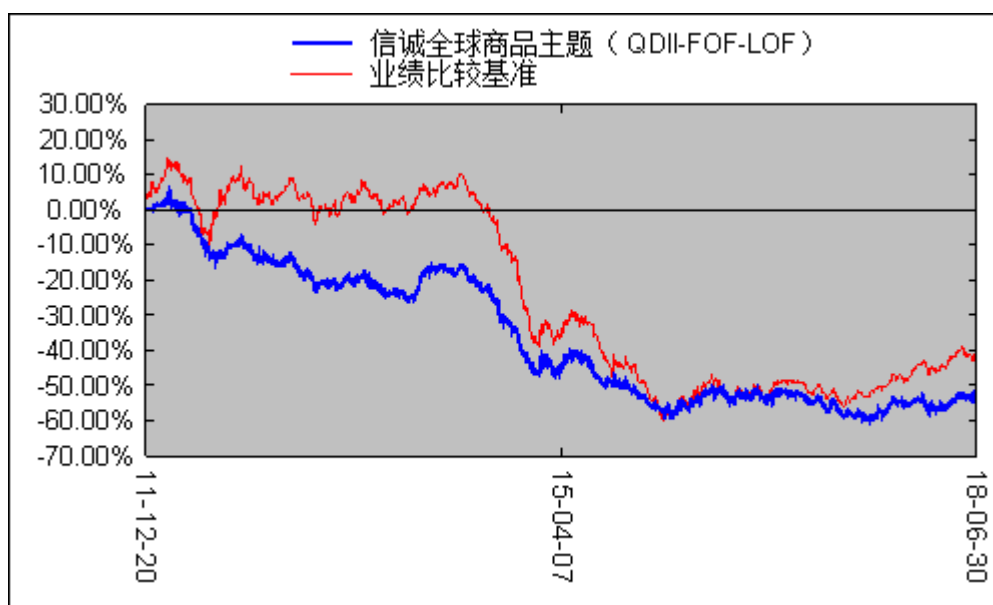
3.2 基金净值表现

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	4.49%	1.09%	1.36%	1.10%	3.13%	-0.01%
过去三个月	11.39%	0.92%	8.00%	0.96%	3.39%	-0.04%
过去六个月	8.19%	1.05%	10.36%	0.92%	-2.17%	0.13%
过去一年	15.88%	0.99%	30.04%	0.88%	-14.16%	0.11%
过去三年	-13.30%	1.03%	-12.54%	1.26%	-0.76%	-0.23%
自基金合同生效起至今	-51.10%	0.90%	-39.87%	1.14%	-11.23%	-0.24%

本基金比较业绩基准为:标准普尔高盛商品总收益指数(S&P GSCI Commodity Total Return Index)

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:本基金建仓期自 2011 年 12 月 20 日至 2012 年 6 月 20 日,建仓期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

本基金管理人中信保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%。因业务发展需要,经国家工商行政管理总局核准,本基金管理人法定名称于 2017 年 12 月 18 日起由“信诚基金管理有限公司”变更为“中信保诚基金管理有限公司”。本基金管理人已于 2017 年 12 月 20 日在中国证监会指定媒介以及公司网站上刊登了公司法定名称变更的公告。

截至 2018 年 6 月 30 日,本基金管理人管理的运作中基金为 64 只,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、信诚至远灵活配置混合型证券投资基金、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、信诚中证基建工程指数型证券投资基金(LOF)、信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、信诚稳利债券型证券投资基金、信诚惠盈债券型证券投资基金、信诚稳健债券型证券投资基金、信诚至利灵活配置混合型证券投资基金、信诚惠泽债券型证券投资基金(LOF)、信诚稳瑞债券型证券投资基金、信诚稳益债券型证券投资基金、信诚至裕灵活配置混合型证券投资基金、信诚至瑞灵活配置混合型证券投资基金、信诚至选灵活配置混合型证券投资基金、信诚景瑞债券型证券投资基金、信诚新悦回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚稳丰债券型证券投资基金、信诚永益一年定期开放混合型证券投资基金、信诚稳悦债券型证券投资基金、信诚稳泰债券型证券投资基金、信诚稳鑫债券型证券投资基金、信诚至诚灵活配置混合型证券投资基金、信诚理财 28 日盈债券型证券投资基金、信诚至泰灵活配置混合型证券投资基金、信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、信诚新泽回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚新丰回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚量化阿尔法股票型证券投资基金、信诚智惠金货币市场基金、中信保诚嘉鑫定期开放债券型发起式证券投资基金、中信保诚稳鸿债券型证券投资基金、中信保诚至兴灵活配置混合型证券投资基金。

截至 2018 年 6 月 30 日,本基金管理人管理的处于清算期中的基金为 10 只,分别为信诚季季定期支付债券型证券投资基金、信诚惠报债券型证券投资基金、信诚至优灵活配置混合型证券投资基金、信诚至鑫灵活配置混合型证券投资基金、信诚主题轮动灵活配置混合型证券投资基金、信诚永鑫一年定期开放混合型证券投资基金、信诚永丰一年定期开放混合型证券投资基金、信诚永利一年定期开放混合型证券投资基金、信诚鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、信诚至盛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		
刘儒明	本基金基金经理,兼任海外投资副总监、信诚金砖四国积极配置证券投资基金(LOF)的基金经理。	2013 年 01 月 15 日	-	24	工学硕士。曾任职于永昌证券投资信托股份有限公司,担任基金经理;于富邦证券投资信托股份有限公司,担任基金经理;于金复华证券投资信托股份有限公司,担任基金经理;

					于台湾工银证券投资信托股份有限公司,担任基金经理;于富国基金管理有限公司,担任境外投资部经理。2009年6月加入中信保诚基金管理有限公司。现任海外投资副总监,信诚金砖四国积极配置证券投资基金(LOF)及信诚全球商品主题证券投资基金(LOF)的基金经理。
李舒禾	本基金基金经理	2011年12月20日	-	13	商学硕士。曾任职于台湾证券投资信托股份有限公司,历任宝来全球ETF稳健组合证券投资信托基金经理、宝来黄金期货信托基金经理。2011年3月加入中信保诚基金管理有限公司。现任信诚全球商品主题证券投资基金(LOF)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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金无境外投资顾问

4.3 报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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《信诚全球商品主题证券投资基金(LOF)基金合同》、《信诚全球商品主题证券投资基金(LOF)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。

4.4 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》,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,未发现违背公平交易的相关情况。

4.4.2 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)。

4.5 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

2018 年上半年,基金基准高盛商品指数(美金)上涨 10.36%,其中能源分类指数(美金)上涨 19.66%,贵金属分类指数(美金)下跌 4.74%,基础金属分类指数(美金)下跌 5.72%、农产品分类指数(美金)下跌 3.3%,人民币兑美元贬值 1.76%,收在 6.62 人民币兑 1 美金,标普 500 指数(美金)上涨 1.67%,美国十年期国债上扬 45bps,收在 2.9394%。基金过去半年能源部位平均仓位 55%,相较于基准超额贡献 87bps;贵金属平均仓位 17%,贡献-166bps,基础金属平均仓位 1.76%,贡献-10bps;农产品平均仓位 4%,贡献 46bps;其他投资平均仓位 3%,贡献 17bps;现金平均仓位 19%,贡献-14bps。上半年主要超配贵金属但受到美元升值影响表现不佳。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金净值增长率为 8.19%,同期业绩比较基准收益率为 10.36%,基金落后业绩比较基准 2.17%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

未来投资策略还是着重于原油的投资,目前处于旺季,加上 Midland 页岩油因为油管瓶颈无法供应到市场,美国对伊朗制裁可能加大原油的紧缺,沙国的产量已经来到一年来最高,最全库存还是持续下降,美国经济先半年仍处于上升状态,利比亚恢复出口,委内瑞拉、墨西哥、北海产量持续减少;近远月差持续走扩, Midland 与 WTI 持续扩大,都显示整个原油市场都非常健康,甚至不需要 OPEC 减产,目前原油技术性修正,未来将择机加仓。

4.7 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严格控制。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。基金管理人采用专用的估值业务系统进行基金核算及账务处理,对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备估值业务所需的专业胜任能力,具有基金从业人员资格。

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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金收益分配应遵循下列原则:

1、本基金的每份基金份额享有同等分配权;

2、基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式。 登记在注册登记系统的基金份额,其持有人可自行选择收益分配方式。基金份额持有人事先未做出选择的,默认的分红方式为现金红利;选择红利再投资的,现金红利则按除权后的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资(具体日期以本基金分红公告为准); 登记在证券登记结算系统中的基金份额只支持现金红利方式,投资人不能选择其他的分红方式,具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定;

3、在符合基金收益分配条件的情况下,本基金收益每年最多分配十二次;

4、基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;

5、每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的 25%;

6、基金红利发放日距离收益分配基准日(即可供分配利润计算截止日)的时间不得超过 15 个工作日;

7、法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

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。

4.9 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

本报告期内,本基金自 2016 年 8 月 22 日起至 2018 年 6 月 29 日止基金资产净值低于五千万元,已经连续六十个工作日以上,本基金管理人已按规定向中国证监会进行了报告并提交了解决方案。

§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

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在对信诚全球商品主题证券投资基金(LOF)(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：信诚全球商品主题证券投资基金(LOF)

报告截止日：2018年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 (2018年06月30日)	上年度末 (2017年12月31日)
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,837,288.30	9,811,922.35
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	25,594,863.71	22,892,135.18
其中：股票投资		312,753.45	-
基金投资		25,282,110.26	22,892,135.18
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		3,273,561.99	531,320.57
应收利息	6.4.7.5	263.20	35.49
应收股利		5,043.80	-
应收申购款		492.13	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		30,711,513.13	33,235,413.59
负债和所有者权益	附注号	本期末 (2018年06月30日)	上年度末 (2017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		455,916.54	786.67
应付管理人报酬		42,346.93	48,353.91
应付托管费		7,259.48	8,289.26
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	333,649.51	370,000.00
负债合计		839,172.46	427,429.84
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	61,108,587.47	72,519,913.65
未分配利润	6.4.7.10	-31,236,246.80	-39,711,929.90
所有者权益合计		29,872,340.67	32,807,983.75
负债和所有者权益总计		30,711,513.13	33,235,413.59

注:截止本报告期末,基金份额净值0.489元,基金份额总额61,108,587.47份。

6.2 利润表

会计主体:信诚全球商品主题证券投资基金(LOF)

本报告期:2018年01月01日至2018年06月30日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 (2018年01月01日至2018 年06月30日)	上年度可比期间 (2017年01月01日-2017 年06月30日)
一、收入		3,053,987.31	-4,495,787.02
1. 利息收入		3,967.28	2,928.12
其中:存款利息收入	6.4.7.11	3,967.28	2,928.12
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)		1,948,875.92	-944,049.57
其中:股票投资收益	6.4.7.12	-212,011.99	-299,426.39
基金投资收益	6.4.7.13	2,150,226.82	-645,199.02
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
资产支持证券投资 收益	6.4.7.14.1	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	10,661.09	575.84
3. 公允价值变动收益(损 失以“-”号填列)	6.4.7.17	1,068,498.79	-3,510,751.55
4. 汇兑收益(损失以“-” 号填列)		23,276.44	-48,620.46
5. 其他收入(损失以“-” 号填列)	6.4.7.18	9,368.88	4,706.44
减:二、费用		610,016.89	722,422.35
1. 管理人报酬		268,438.95	348,483.94

2. 托管费		46,018.10	59,740.10
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	235,460.96	194,936.56
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	60,098.88	119,261.75
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,443,970.42	-5,218,209.37
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,443,970.42	-5,218,209.37

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：信诚全球商品主题证券投资基金(LOF)

本报告期：2018年01月01日至2018年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 (2018年01月01日至2018年06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）	72,519,913.65	-39,711,929.90	32,807,983.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,443,970.42	2,443,970.42
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)	-11,411,326.18	6,031,712.68	-5,379,613.50
其中：1. 基金申购款	5,775,280.64	-3,218,948.61	2,556,332.03
2. 基金赎回款	-17,186,606.82	9,250,661.29	-7,935,945.53
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）	61,108,587.47	-31,236,246.80	29,872,340.67
项目	上年度可比期间 (2017年01月01日至2017年06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）	91,336,814.12	-47,284,629.04	44,052,185.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-5,218,209.37	-5,218,209.37
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)	-9,507,393.05	5,210,551.47	-4,296,841.58
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-9,507,393.05	5,210,551.47	-4,296,841.58

号〈年度报告和半年度报告〉》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日止期间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 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本基金在本报告期末发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期末发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期末发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

(1) 主要税项说明

根据财税 [2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2012] 85 号文《财政部、国家税务总局、证监会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《财政部、国家税务总局、证监会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 [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》、上证交字 [2008] 16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008] 1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016] 36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税 [2016] 140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税 [2017] 2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税 [2017] 56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作, 本基金适用的主要税项列示如下:

(a) 证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。

(b) 自 2016 年 5 月 1 日起, 在全国范围内全面推开营业税改征增值税 (以下称营改增) 试点, 建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人, 纳入试点范围, 由缴纳营业税改为缴纳增值税。

2018 年 1 月 1 日 (含) 以后, 资管产品管理人 (以下称管理人) 运营基金过程中发生的增值税应税行为, 以管理人为增值税纳税人, 暂适用简易计税方法, 按照 3% 的征收率缴纳增值税。对基金在 2018 年 1 月 1 日以前运营过程中发生的增值税应税行为, 未缴纳增值税的, 不再缴纳; 已缴纳增值税的, 已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入免征增值税。

(c) 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。

(d) 对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司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。

(e) 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。

(f) 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，暂不征收企业所得税。

(g) 对基金在 2018 年 1 月 1 日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，按照证券投资基金管理人所在地适用的城市维护建设税税率，计算缴纳城市维护建设税。

(h) 对基金在 2018 年 1 月 1 日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的费率计算缴纳教育费附加、地方教育费附加。

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 (2018 年 06 月 30 日)
活期存款	1,837,288.30
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	1,837,288.30

其他存款为有存款期限、但根据协议可提前支取且没有利息损失的协议存款

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 (2018 年 06 月 30 日)		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	299,122.64	312,753.45	13,630.81
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券交易所市场	-	-	-

债券银行间市场	-	-	-
债券合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	21,919,110.73	25,282,110.26	3,362,999.53
其他	-	-	-
合计	22,218,233.37	25,594,863.71	3,376,630.34

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

本基金本报告期末未持有从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 (2018年06月30日)
应收活期存款利息	263.00
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	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	0.20
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	263.20

其他指应收结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

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

本基金于本报告期末应付交易费用为零。

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 (2018年06月30日)
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,621.84
预提信息披露费	289,878.20
预提审计费	12,396.69

预提指数使用费	-
预提上市费	29,752.78
合计	333,649.51

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 (2018年01月01日至2018年06月30日)	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	72,519,913.65	72,519,913.65
本期申购	5,775,280.64	5,775,280.64
本期赎回(以“-”号填列)	-17,186,606.82	-17,186,606.82
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	61,108,587.47	61,108,587.47

注：此处申购含红利再投资、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	-22,776,006.58	-16,935,923.32	-39,711,929.90
本期利润	1,375,471.63	1,068,498.79	2,443,970.42
本期基金份额交易产生的变动数	3,476,863.77	2,554,848.91	6,031,712.68
其中：基金申购款	-1,831,392.03	-1,387,556.58	-3,218,948.61
基金赎回款	5,308,255.80	3,942,405.49	9,250,661.29
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-17,923,671.18	-13,312,575.62	-31,236,246.80

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 (2018年01月01日至2018年06月30日)
	活期存款利息收入
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	-
其他	-
合计	3,967.28

1. 其他存款利息收入指有存款期限、但根据协议可提前支取且没有利息损失的协议存款利息收入。

2. 其他指申购款利息收入、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 (2018年01月01日至2018年06月30日)
卖出股票成交总额	6,503,881.63
减：卖出股票成本总额	6,715,893.62
买卖股票差价收入	-212,011.99

6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 (2018年01月01日至2018年06月30日)
卖出/赎回基金成交总额	70,769,947.83
减：卖出/赎回基金成本总额	68,619,721.01
基金投资收益	2,150,226.82

6.4.7.14 债券投资收益**6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成**

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益-买卖债券价差收入。

6.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益-赎回差价收入。

6.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益-申购差价收入。

6.4.7.14.5 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。

6.4.7.15 衍生工具收益**6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 (2018年01月01日至2018年06月30日)
股票投资产生的股利收益	4,873.05
基金投资产生的股利收益	5,788.04

合计	10,661.09
----	-----------

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 (2018年01月01日至2018年06月30日)
1. 交易性金融资产	1,068,498.79
——股票投资	13,630.81
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	1,054,867.98
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	1,068,498.79

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 (2018年01月01日至2018年06月30日)
基金赎回费收入	9,368.68
基金转换费收入	-
TA 申购款利息收入	0.20
其他收入	-
合计	9,368.88

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 (2018年01月01日至2018年06月30日)
交易所市场交易费用	235,460.96
银行间市场交易费用	-
合计	235,460.96

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 (2018年01月01日至2018年06月30日)
审计费用	12,396.69
信息披露费	14,878.20
银行费用	3,071.21

上市费	29,752.78
合计	60,098.88

6.4.7.21 分部报告

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,本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日,本基金并无须作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
中信保诚基金管理有限公司(“中信保诚基金”)	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、基金销售机构
中国银行(香港)有限公司(“中银香港”)	基金境外托管人

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

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

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.10.1.5 基金交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

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 (2018年01月01日至2018年	上年度可比期间 (2017年01月01日至2017年
----	--------------------------	-------------------------------

	06月30日)	06月30日)
当期发生的基金应支付的管理费	268,438.95	348,483.94
其中:支付销售机构的客户维护费	28,766.73	34,650.76

注:支付基金管理人中信保诚基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值1.75%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。计算公式为:

$$\text{日基金管理费} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.75\% / \text{当年天数}$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 (2018年01月01日至2018年 06月30日)	上年度可比期间 (2017年01月01日至2017年 06月30日)
当期发生的基金应支付的托管费	46,018.10	59,740.10

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0.30%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×0.30%/当年天数

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期内及上年度可比区间关联方未获得销售服务费。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间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

本基金的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,本基金本报告期内及上年度可比期间基金管理人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

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,本基金本期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

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

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 (2018年01月01日至2018年06月30日)		上年度可比期间 (2017年01月01日至2017年06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	1,220,694.05	3,967.28	1,598,809.18	2,928.12
中银香港	616,594.25	-	10,614,807.44	-

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

6.4.12 期末（2018年06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

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

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

本基金主要投资于全球商品类基金，商品价格具有较高的波动性，因此，本基金属于属于较高风险、较高收益的品种。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括市场风险、流动性风险及信用风险。

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；公司设立独立的监察稽核部和风险管理部，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。监察稽核部和风险管理部日常向督察长汇报工作。

本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析各类风险，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对风险进行持续监控。

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。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管银行，本基金在选择定期存款存放的银行前通过审慎评估其信用风险并通过额度控制的方法以控制银行存款的信用风险。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；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并采用券款对付交割方式以控制相应的信用风险。另外，本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，审慎进行债券投资，通过信用评级和分散化投资以分散信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有短期信用债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有短期资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有短期同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有长期信用债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有长期资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有长期同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。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。

针对兑付赎回资金的流动性风险,本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,并进行适当报告和批露;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。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自2017年10月1日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理,通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不得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一家发行的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制),本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的30%。

本基金所持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,部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12。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。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算,确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。

同时,本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度;按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理,以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外,本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度:根据质押品的资质确定质押率水平;持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额;并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时,可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施,本基金在本报告期内流动性情况良好。

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受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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 (2018 年06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	1,220,694.05	-	-	-	-	616,594.25	1,837,288.30
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	-	-	25,594,863.71	25,594,863.71
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	3,273,561.99	3,273,561.99
应收利	-	-	-	-	-	263.20	263.20

息							
应收股利	-	-	-	-	-	5,043.80	5,043.80
应收申购款	-	-	-	-	-	492.13	492.13
待摊费用	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,220,694.05	-	-	-	-	29,490,819.08	30,711,513.13
负债							
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	0.00	0.00
应付赎回款	-	-	-	-	-	455,916.54	455,916.54
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	42,346.93	42,346.93
应付托管费	-	-	-	-	-	7,259.48	7,259.48
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	-	-	-	-	-	333,649.51	333,649.51
负债总计	-	-	-	-	-	839,172.46	839,172.46
利率敏感度缺口	1,220,694.05	-	-	-	-	28,651,646.62	29,872,340.67
上年度末(2017	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

年12月31日)							
资产							
银行存款	151,089.41	-	-	-	-	9,660,832.94	9,811,922.35
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	-	-	22,892,135.18	22,892,135.18
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	531,320.57	531,320.57
应收利息	-	-	-	-	-	35.49	35.49
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	151,089.41	-	-	-	-	33,084,324.18	33,235,413.59
负债							
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	786.67	786.67
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	48,353.91	48,353.91
应付托	-	-	-	-	-	8,289.26	8,289.26

管费							
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	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	370,000.00	370,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	427,429.84	427,429.84
利率敏感度缺口	151,089.41	-	-	-	-	32,656,894.34	32,807,983.75

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

于本报告期末及上年末,本基金未持有对利率敏感性的交易性债券投资。因此,市场利率的变动对基金资产的净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

汇率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,因此存在相应的汇率风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

本报告期末,本基金各外币资产负债项目汇率风险敞口如下。出于列报考虑,风险敞口金额以人民币列示,以资产负债表日即期汇率折算。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位:人民币元

项目	本期末 (2018年06月30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	187,166.27	429,646.85	-	616,813.12
交易性金融资产	25,594,863.71	-	-	25,594,863.71
应收股利	-	5,043.80	-	5,043.80
应收利息	4.17	-	-	4.17

应收证券清算款	3,273,561.99	-	-	3,273,561.99
资产合计	29,055,596.14	434,690.65	-	29,490,286.79
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	29,055,596.14	434,690.65	-	29,490,286.79
项目	上年度末 (2017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	9,187,745.49	473,297.13	-	9,661,042.62
交易性金融资产	22,892,135.18	-	-	22,892,135.18
应收股利	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-
应收证券清算款	531,320.57	-	-	531,320.57
资产合计	32,611,201.24	473,297.13	-	33,084,498.37
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	32,611,201.24	473,297.13	-	33,084,498.37

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:人民币元)	
		本期末(2018年06月30日)	上年度末(2017年12月31日)
	所有外币相对人民币升值5%	1,474,514.34	1,654,224.92
	所有外币相对人民币贬值5%	-1,474,514.34	-1,654,224.92

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要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。本基金的其他价格风险,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。

本基金持有一定比例的证券交易所上市的股票,因此存在相应的其他价格风险。

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	上年度末
----	-----	------

	(2018年06月30日)		(2017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	312,753.45	1.05	-	-
交易性金融资产-基金投资	25,282,110.26	84.63	22,892,135.18	69.78
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	25,594,863.71	85.68	22,892,135.18	69.78

6.4.13.4.3.2 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(2018年06月30日)	上年度末(2017年12月31日)
	业绩比较基准中的股票指数上升5%	1,445,974.21	1,509,167.25
业绩比较基准中的股票指数下降5%	-1,445,974.21	-1,509,167.25	

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 以公允价值计量的资产和负债

如下列示了本基金在每个资产负债表日持续和非持续以公允价值计量的资产和负债于本报告期末的公允价值信息及其公允价值计量的层次。公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下:

- 第一层次输入值: 在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价;
- 第二层次输入值: 除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值;
- 第三层次输入值: 相关资产或负债的不可观察输入值。

于2018年6月30日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具中属于第一层次的余额为人民币25,594,863.71元,无属于第二层次的余额,无属于第三层次的余额(2017年12月31日:属于第一层次的余额为人民币22,892,135.18元,无属于第二层次的余额,无属于第三层次的余额)。

(a) 第二层次的公允价值计量

对于本基金投资的证券交易所上市的证券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况时,本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关证券公允价值的层次。

(b) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2018年6月30日,本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2017年12月31日:无)。

(2) 其他金融工具的公允价值(年末非以公允价值计量的项目)

其他金融工具主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值之间无重大差异。

(3) 除以上事项外，截至本报告期末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	312,753.45	1.02
	其中：普通股	312,753.45	1.02
	存托凭证	-	-
2	基金投资	25,282,110.26	82.32
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	1,837,288.30	5.98
8	其他各项资产	3,279,361.12	10.68
9	合计	30,711,513.13	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	312,753.45	1.05
合计	312,753.45	1.05

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

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 (%)
材料	312,753.45	1.05
合计	312,753.45	1.05

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

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	BARRICK GOLD CORP	巴里克黄 金	ABX US	纽约交易 所	美国	3,600	312,753.45	1.05

本基金本报告期末仅持有上述权益投资。

7.5 报告期内权益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	ProShares Ultra Silver	AGQ US	4,608,349.26	14.05
2	Micron Technology Inc	MU US	1,103,697.88	3.36
3	NVIDIA Corp	NVDA US	418,522.63	1.28
4	Barrick Gold Corp	ABX US	299,122.64	0.91
5	Zhaojin Mining Industry Co Ltd	1818 HK	294,758.03	0.90
6	Ping An Insurance Group Co of China Ltd	2318 HK	290,565.82	0.89

1. 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。
2. 本基金本报告期仅发生上述权益投资买入交易。

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	ProShares Ultra Silver	AGQ US	4,425,591.30	13.49
2	Micron Technology Inc	MU US	1,055,842.02	3.22
3	NVIDIA Corp	NVDA US	448,181.29	1.37
4	Zhaojin Mining Industry Co Ltd	1818 HK	291,751.77	0.89
5	Ping An Insurance Group Co of China Ltd	2318 HK	282,515.25	0.86

1. 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。
2. 本基金本报告期仅发生上述权益投资卖出交易。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

金额单位：人民币元

买入成本（成交）总额	7,015,016.26
卖出收入（成交）总额	6,503,881.63

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。

7.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

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大基金投资明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	BNO US	ETF 基金	契约型开放式	United States Brent Oil Fund L	4,874,506.78	16.32
2	PROSHARES ULTRA	ETF 基金	契约型开放式	ProShares Ultra Bloomberg Crud	4,617,817.77	15.46
3	POWERSHARES DB OIL FUND	ETF 基金	契约型开放式	PowerShares DB Oil Fund	4,410,691.73	14.77
4	US OIL FUND LP	ETF 基金	契约型开放式	United States Oil Fund LP	3,816,441.65	12.78
5	SLV US	ETF 基金	契约型开放式	iShares Silver Trust	2,676,447.78	8.96
6	INVESCO DB BASE METALS FUND	ETF 基金	契约型开放式	PowerShares DB Base Metals Fun	1,396,631.93	4.68
7	WHITING PETROLEUM CORP	ETF 基金	契约型开放式	无	1,046,481.46	3.50
8	PALL US	ETF 基金	契约型开放式	无	660,446.78	2.21

9	ETFS PHYSICAL PLATINUM SHRS	ETF 基金	契约型开放 式	无	590,558.02	1.98
10	DIREXION DAILY GOLD	ETF 基金	契约型开放 式	无	515,142.01	1.72

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚说明

本基金本期投资的前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

7.11.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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。

7.11.3 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	3,273,561.99
3	应收股利	5,043.80
4	应收利息	263.20
5	应收申购款	492.13
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,279,361.12

7.11.4 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。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票,不存在流通受限情况。

7.11.6 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

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
3826	15,971.93	100.00	0.00%	61,108,487.47	100.00%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	李敏	2,503,100.00	4.10%
2	李华强	1,760,000.00	2.88%
3	刘玉彬	1,730,500.00	2.83%
4	范永刚	1,700,000.00	2.78%
5	李晓松	1,700,000.00	2.78%
6	于莉萍	1,525,000.00	2.50%
7	王艳蓉	1,451,500.00	2.38%
8	许今子	1,282,700.00	2.10%
9	黄卫国	1,221,300.00	2.00%
10	田野	1,207,100.00	1.98%

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

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。

8.5 发起式基金发起资金持有份额情况

无

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2011年12月20日)基金份额总额	294,854,543.97
本报告期期初基金份额总额	72,519,913.65
本报告期基金总申购份额	5,775,280.64
减:本报告期基金总赎回份额	17,186,606.82
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	61,108,587.47

§ 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

1、本报告期内基金管理人无重大人事变动。

2、报告期内，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	
SCOTIA	-	11,418,990.77	84.47%	17,128.61	88.71%	-
Shenwan Hongyuan Securities (H.K.) Limited	-	1,002,182.20	7.41%	1,202.62	6.23%	-
BLOOMBERG TRADEBOOK	-	940,316.24	6.96%	899.57	4.66%	-
China Securities (Internation)	-	157,408.66	1.16%	78.71	0.41%	-
SHENYIN WANGUO	-	-	-	-	-	-
China Merchants Securities (HK)	-	-	-	-	-	-
FLOW TRADERS ASIA PTE	-	-	-	-	-	-
公司行为虚拟券商	-	-	-	-	-	-
DEUTSCHE BK TWN-SYNTHETIC TRDE	-	-	-	-	-	-
INTER BANK TRANS	-	-	-	-	-	-
AEDUMY	-	-	-	-	-	-
CHINA INT' L CAP	-	-	-	-	-	-

CORP HK SECS							
KNIGHT	-	-	-	-	-	-	-
KNIGHT CAPITAL AMERICAS L.P	-	-	-	-	-	-	-
STATE STREET FUND SERVICES (IR)	-	-	-	-	-	-	-
NOMURA INTERNATIONAL HK LTD.	-	-	-	-	-	-	-
RBC DEXIA INVESTOR SERVICES	-	-	-	-	-	-	-
MORGAN STANLEY	-	-	-	-	-	-	-
UBS WARBURG	-	-	-	-	-	-	-

本基金根据券商的研究实力和服务水平选择选择券商以及分配交易量。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

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期成交总额的比例	成交金额	占当期成交总额的比例	成交金额	占当期成交总额的比例	成交金额	占当期成交总额的比例
SCOTIA	-	-	-	-	-	-	133,104,063.14	94.58%
Shenwan Hongyuan Securities (H.K.) Limited	-	-	-	-	-	-	170,316.33	0.12%
BLOOMBERG TRADEBOOK	-	-	-	-	-	-	7,250,772.79	5.15%
China Securities (Internation)	-	-	-	-	-	-	199,624.67	0.14%
SHENYIN WANGUO	-	-	-	-	-	-	-	-
China Merchants Securities (HK)	-	-	-	-	-	-	-	-
FLOW TRADERS ASIA PTE	-	-	-	-	-	-	-	-
公司行为虚拟券商	-	-	-	-	-	-	-	-
DEUTSCHE BK	-	-	-	-	-	-	-	-

TWN-SYNTHETIC TRDE									
INTER BANK TRANS	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AEDUMY	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CHINA INT' L CAP CORP HK SECS	-	-	-	-	-	-	-	-	-
KNIGHT	-	-	-	-	-	-	-	-	-
KNIGHT CAPITAL AMERICAS L.P	-	-	-	-	-	-	-	-	-
STATE STREET FUND SERVICES (IR)	-	-	-	-	-	-	-	-	-
NOMURA INTERNATIONAL HK LTD.	-	-	-	-	-	-	-	-	-
RBC DEXIA INVESTOR SERVICES	-	-	-	-	-	-	-	-	-
MORGAN STANLEY	-	-	-	-	-	-	-	-	-
UBS WARBURG	-	-	-	-	-	-	-	-	-

本基金根据券商的研究实力和服务水平选择选择券商以及分配交易量。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。

10.8 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	中信保诚基金管理有限公司旗下 QDII 证券投资基金 2017 年 12 月 29 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.citicprufunds.com)	2018 年 01 月 03 日
2	中信保诚基金管理有限公司旗下 QDII 证券投资基金 2017 年 12 月 31 日基金资产净值和基金份额净值公告	同上	2018 年 01 月 03 日
3	信诚全球商品主题证券投资基金(LOF)因境外主要市场节假日暂停赎回业务的公告	同上	2018 年 01 月 12 日
4	中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分基金参加泰诚财富基金申购费率优惠活动的公告	同上	2018 年 01 月 15 日
5	信诚全球商品主题证券投资基金(LOF)2017 年第四季度报告	同上	2018 年 01 月 19 日
6	中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分基金增加济安财富为销售机构的公告	同上	2018 年 01 月 29 日
7	信诚全球商品主题证券投资基金(LOF)招募说明书(2018 年第 1 次更新)	同上	2018 年 02 月 02 日

8	信诚全球商品主题证券投资基金(LOF)招募说明书摘要(2018年第1次更新)	同上	2018年02月02日
9	中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分基金增加第一创业证券为销售机构并参加基金申购费率优惠活动的公告	同上	2018年03月05日
10	信诚全球商品主题证券投资基金(LOF)恢复申购及定期定额投资业务的公告	同上	2018年03月08日
11	中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分基金增加恒天明泽为销售机构并参加基金申购费率优惠活动的公告	同上	2018年03月21日
12	关于信诚全球商品主题证券投资基金(LOF)修订基金合同、托管协议部分条款及调整赎回费相关规则的公告	同上	2018年03月24日
13	信诚全球商品主题证券投资基金(LOF)基金合同	同上	2018年03月24日
14	信诚全球商品主题证券投资基金(LOF)托管协议	同上	2018年03月24日
15	信诚全球商品主题证券投资基金(LOF)因境外主要市场节假日暂停申赎及定投业务的公告	同上	2018年03月28日
16	信诚全球商品主题证券投资基金(LOF)2017年年度报告	同上	2018年03月30日
17	信诚全球商品主题证券投资基金(LOF)2017年年度报告摘要	同上	2018年03月30日
18	信诚全球商品主题证券投资基金(LOF)2018年第一季度报告	同上	2018年04月23日
19	信诚全球商品主题证券投资基金(LOF)因境外主要市场节假日暂停申赎及定投业务的公告	同上	2018年05月04日
20	中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分基金参加银河证券基金申购费率优惠活动的公告	同上	2018年05月17日
21	信诚全球商品主题证券投资基金(LOF)因境外主要市场节假日暂停申赎及定投业务的公告	同上	2018年05月18日
22	信诚全球商品主题证券投资基金(LOF)因境外主要市场节假日暂停申赎及定投业务的公告	同上	2018年05月25日
23	中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分基金增加民商基金为销售机构并参加基金申购费率优惠活动的公告	同上	2018年06月22日
24	信诚全球商品主题证券投资基金(LOF)因境外主要市场节假日暂停申赎及定投业务的公告	同上	2018年06月28日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

11.2 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

- | |
|--|
| <ol style="list-style-type: none">1、信诚全球商品主题证券投资基金(LOF)相关批准文件2、中信保诚基金管理公司营业执照3、信诚全球商品主题证券投资基金(LOF)基金合同4、信诚全球商品主题证券投资基金(LOF)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

中信保诚基金管理有限公司办公地--中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 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.citicprufunds.com.cn。

中信保诚基金管理有限公司
2018 年 08 月 28 日