信诚中证800有色指数分级证券投资基金

【2015】半年度报告摘要

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:2015年8月26日

§1重要提示

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2015年8月25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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年1月1日起至6月30日止。

§2基金简介

2.1 基金基本情况

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	165620
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	2,090,154,887.91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	165620
报告期末下属分级基金的份额总额	909,056,638.00份	909,056,628.00份	272,041,611.91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%×中证800有色金属指数收益率+5%×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	唐世春	王永民
	联系电话	021-68649788	010-66594896
	电子邮箱	shichun.tang@ticpru.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-666-0066	95566
传真		021-50120888	010-66594942

2.4 信息披露方式

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

§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(2015年1月1日至2015年6月30日)
本期已实现收益	347,026,787.24
本期利润	401,155,086.72
加权平均基金份额本期利润	0.2435
本期基金份额净值增长率	26.48%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0934
期末基金资产净值	1,889,246,243.48
期末基金份额净值	0.904

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。

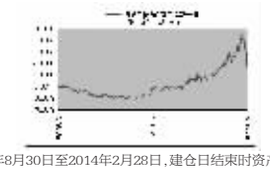
3、期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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	-12.15%	4.01%	-9.59%	3.66%	-2.56%	0.35%
过去三个月	6.79%	3.04%	9.37%	2.78%	-2.58%	0.26%
过去六个月	26.48%	2.55%	29.81%	2.39%	-3.33%	0.16%
过去一年	68.99%	2.06%	80.23%	1.98%	-11.24%	0.08%
自基金合同生效起至今	41.14%	1.73%	50.18%	1.70%	-9.04%	0.03%

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2015年6月30日,本基金管理人共管理38只基金,分别为信诚四季红混合型证券投资基金、信诚精萃成长股票型证券投资基金、信诚盛世蓝筹股票型证券投资基金、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、信诚优胜精选股票型证券投资基金、信诚中小盘股票型证券投资基金、信诚深度价值股票型证券投资基金(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、信诚新机遇股票型证券投资基金(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)、信诚周期轮动股票型证券投资基金(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、信诚新兴产业股票型证券投资基金、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性证券投资基金、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、信诚幸福消费股票型证券投资基金、信诚薪金宝货币市场基金、信诚3个月理财债券型证券投资基金、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、信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)和信诚新鑫回报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1000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的基金经理	2015年1月15日	-	2	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的基金经理。
吴鹰楠	本基金基金经理、兼任信诚中证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金融指数分级基金及信诚中证TMT产业主题指数分级证券投资基金的基金经理,信诚基金管理有限公司投资管理部最投资总监	2013年8月30日	2015年3月27日	18	统计物理学博士,CFA,18年证券、基金从业经验。拥有丰富的量化投资和指数基金管理经验。曾任职于加拿大Gluyas&Bloecth & Associates公司和加拿大道明资产管理公司(TD Asset Management)。

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

今年以来,在经济增长中枢下移,经济结构改善与充裕的市场流动性的大背景下,经济围绕着两条主线,一方面是是改善国有资产负债表,整合行业以增强竞争力,输出过剩产能,即国企改革与以一代一路为战略的产能输出,给经济转型提供时间。另一方面是代表未来中国经济增长方向的“新经济”行业,包括“互联网+”,中国制造2025,新能源汽车等产业主题。投资机会也在这两条大的主线里面。 上半年股票市场是以第二条主线为主,第一条主线,即国企改革在会逐步成为热点,而二季度股票市场投机氛围过大,过渡使用杠杆,监管层打压配资政策,各类配资盘触发平仓线而使市场出现连锁反应,市场大幅回调。

本报告期内,我们继续利用自行开发的量化分层抽样技术,在震荡市场环境及处理每日申购赎回现金流中,有效地管理跟踪误差。

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26.48%,同期业绩比较基准收益率为29.81%,基金落后业绩比较基准3.33%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度,我们认为上半年政府的一系列稳定经济的带动下,3季度经济进入企稳的概率较大,不过短期内市场去杠杆的过程仍然没有结束,由于市场快速下跌,引发的一系列融资盘强行平仓,短期股票市场走势是由去杠杆造成的流动性塌陷与救市政策的力度决定的。如果政策能及时缓解流动性与歇制住A股的恐慌,那么市场会进入相对理性,市场会优先选择对于上市公司业绩与估值合理的股票。长期看来,改革与创新的逻辑依然存在,我们依旧看好国家战略与国企改革方向,和能代表未来经济增长的方向,如先进制造行业,高端装备等

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

本基金管理人的估值人员平均拥有6年金融从业经验和3年本基金管理公司的基金从业和基金估值经验

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。

§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:2015年6月30日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
资产:			
银行存款		61,777,286.37	869,054.25
结算备付金		9,017,598.63	3,162,544.93
存出保证金		1,266,572.98	451,966.16
交易性金融资产		1,823,373,663.67	1,141,981,948.30
其中:股票投资		1,793,253,663.67	1,086,827,290.30
基金投资		-	-
债券投资		30,120,000.00	55,154,658.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息		1,033,101.90	1,375,783.47
应收股利		-	-
应收申购款		207,528.49	137,619.31
递延所得税资产		-	-
其他资产		28,571.36	-
资产总计		1,896,703,323.40	1,147,968,916.42
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		4,754.36	
应付赎回款		1,674,563.38	150,290.47
应付管理人报酬		2,146,062.46	889,069.25
应付托管费		471,913.76	195,595.27
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		2,727,509.26	1,069,198.59
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		433,276.72	365,566.45
负债合计		7,457,079.92	2,669,720.03
所有者权益:			
实收基金		1,338,926,848.46	1,026,184,311.63
未分配利润		550,319,395.03	119,114,884.76
所有者权益合计		1,889,246,243.48	1,145,299,196.39
负债和所有者权益总计		1,896,703,323.40	1,147,968,916.42

注:截至本报告期末日,基金份额总额2,090,154,887.91份。信诚中证800有色指数分级基金份额净值0.904元,基金份额总额272,041,611.91份。下属两级基金:信诚800有色A的基金份额净值1.011元,基金份额总额909,056,638.00份;信诚800有色B的基金份额净值0.797元,基金份额总额909,056,638.00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:2015年1月1日至2015年6月30日

单位:人民币元

资产	附注号	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
一、收入		418,193,062.96	-1,167,621.00
1.利息收入		1,451,486.83	42,245.66
其中:存款利息收入		200,629.42	874.22
债券利息收入		1,250,857.41	41,371.44
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)		360,294,747.57	-3,079,870.97
其中:股票投资收益		356,979,200.12	-3,207,428.20
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-105,691.00	1,320.00
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		3,411,238.46	126,227.23
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		54,128,299.48	1,850,408.31
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)		2,329,419.08	19,596.00
减:二、费用		17,038,866.24	482,973.84
1、管理人报酬		8,938,102.46	196,799.30
2、托管费		1,966,382.53	43,295.92
3、销售服务费		-	-
4、交易费用		5,690,830.77	35,963.64
5、利息支出		-	34.17
其中:卖出回购金融资产支出		-	34.17
6、其他费用		443,550.48	206,880.81
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		401,155,086.72	-1,650,594.84
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		401,155,086.72	-1,650,594.84

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:2015年1月1日至2015年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 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	1,529,126,812.65	679,924,623.25	2,209,051,435.90
2.基金赎回款	-1,216,384,275.83	-649,875,199.70	-1,866,259,475.53
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)	1,338,926,848.46	550,319,395.03	1,889,246,243.48
项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014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)	56,162,032.33	-7,734,329.80	48,427,702.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-1,650,594.84	-1,650,594.84
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)	-16,064,796.40	2,793,951.17	-13,280,845.23
其中:1.基金申购款	2,923,334.54	-527,780.33	2,395,554.21
2.基金赎回款	-18,988,130.94	3,311,731.50	-15,676,399.44
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)	40,097,235.93	-6,600,972.47	33,496,262.46

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.6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%×中证800有色金属指数收益率+5%×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

根据财税字[1998]55号文、[2001]61号文《关于证券投资基金税收问题的通知》、财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税字[2005]11号文《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、财税[2005]107号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2007]84号文《财政部国家税务总局关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、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》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:(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) 基金买卖股票、债券的投资收益暂免征收营业税和企业所得税。 (3) 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。(4) 自2005年1月24日起,基金买卖A股、B股股权所书立的股权转让书据按照0.1%的税率征收证券(股票)交易印花税。自2007年5月30日起,该税率上调至0.3%。自2008年4月24日起,根据上海证券交易所与深圳证券交易所的相关规定,调整证券(股票)交易印花税税率,由0.3%降至0.1%。自2008年9月19日起,根据上海证券交易所与深圳证券交易所的相关规定,证券交易印花税改为单边征收,即仅对卖出A股、B股股权按0.1%的税率征收。 (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。

自2013年1月1日起, 根据财税[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》,个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

6.4.7关联方关系

6.4.7.1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。

6.4.7.2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
信诚人寿保险有限公司	基金管理人主要股东控制的机构

6.4.8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。

6.4.8.1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。

6.4.8.2关联方报酬

6.4.8.2.1基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	8,938,102.46	196,799.30
其中:支付销售机构的客户维护费	232,000.61	67,735.38

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:日基金管理费=前一日基金资产净值×1.0%/当年天数。

6.4.8.2.2基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,966,382.53	43,295.92

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。

6.4.8.3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。

6.4.8.4各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1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。

6.4.8.4.2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A

份额单位:份

关联方名称	本期末 2015年6月30日		上年度末 2014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
信诚人寿保险有限公司	98,471.00	0.01%	-	-

信诚中证800有色指数分级B

份额单位:份

关联方名称	本期末 2015年6月30日		上年度末 2014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
信诚人寿保险有限公司	1,790,471.00	0.20%	1,350,000.00	0.27%
中信信托有限责任公司	-	-	715,000.00	0.14%

信诚中证800有色指数分级

份额单位:份

关联方名称	本期末 2015年6月30日		上年度末 2014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
信诚人寿保险有限公司	1.00	-	-	-
中信信托有限责任公司	1.00	-	-	-

注:1、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。

6.4.8.5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 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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	61,777,286.37	140,107.47	102,960.48	460.62

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2015年6月30日的相关余额为人民币9,017,598.63元。(2014年6月30日余额为5,532.09元)

6.4.8.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

1、本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.9期末(2015年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

于本报告期末,本基金未持有因认购新发/增发流通受限证券。

6.4.9.2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
002203	海亮股份	2015-06-18	筹划重大事项	12.71	-	-	1,440,975	13,305,761.18	18,314,792.25	-
000693	华泽钴镍	2015-06-30	筹划重大事项	20.57	2015-08-18	22.63	688,699	19,387,848.25	14,166,538.43	-
000619	江南红箭	2015-06-15	筹划重大事项	19.89	-	-	885,743	15,640,836.13	17,537,711.40	-
000630	铜陵有色	2015-03-09	筹划重大事项	10.33	-	-	4,097,438	27,861,288.49	42,326,534.54	-
000688	建新矿业	2015-06-10	筹划重大资产重组事项	14.01	-	-	1,404,737	13,651,231.77	19,680,369.37	-