

信诚中证 800 有色指数分级证券投资基金

2018年半年度报告摘要

2018年06月30日
基金管理人:中信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:2018年08月28日

21基金基本情况
基金名称:信诚中证800有色指数基金
基金代码:005200
基金管理人:中信信诚基金管理有限公司

22基金产品说明
基金的投资目标: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和中国证监会允许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)。

23基金管理人及基金托管人
基金管理人:中信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

24信息披露方式
基金管理人网站:www.citicifund.com.cn
基金托管人网站:www.boc.cn

31主要财务指标和基金净值表现
截至2018年06月30日,本基金资产净值1,317,001.12元,基金份额净值1.0000元。

32基金产品净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
截至2018年06月30日,本基金净值增长率为-2.08%,业绩比较基准收益率为-1.83%。

33基金资产配置比例
截至2018年06月30日,本基金资产配置比例为:股票资产占基金资产净值的比例不低于80%。

41基金管理人及基金合同摘要
41.1基金管理人及其管理基金的经验
41.2基金管理人中诚信信诚基金管理有限公司
41.3基金管理人中诚信信诚基金管理有限公司

42基金产品说明
42.1基金的投资目标
42.2基金的投资策略
42.3基金投资组合比例

43基金管理人及基金合同摘要
43.1基金管理人及其管理基金的经验
43.2基金管理人中诚信信诚基金管理有限公司

44基金管理人及基金合同摘要
44.1基金管理人及其管理基金的经验
44.2基金管理人中诚信信诚基金管理有限公司

45基金管理人及基金合同摘要
45.1基金管理人及其管理基金的经验
45.2基金管理人中诚信信诚基金管理有限公司

46基金管理人及基金合同摘要
46.1基金管理人及其管理基金的经验
46.2基金管理人中诚信信诚基金管理有限公司

47基金管理人及基金合同摘要
47.1基金管理人及其管理基金的经验
47.2基金管理人中诚信信诚基金管理有限公司

48基金管理人及基金合同摘要
48.1基金管理人及其管理基金的经验
48.2基金管理人中诚信信诚基金管理有限公司

49基金管理人及基金合同摘要
49.1基金管理人及其管理基金的经验
49.2基金管理人中诚信信诚基金管理有限公司

41.1报告期内基金投资策略和运作分析
报告期内,中美贸易冲突加剧等事件影响,国内股票市场波动加大,整体呈现震荡格局。上半年上证指数下跌-8.93%,与内债相关的行业如食品饮料、家用电器、医药生物、休闲服务等行业涨幅较大。

41.2报告期内基金业绩比较基准
截至2018年6月30日,本基金净值增长率为-2.08%,同期业绩比较基准收益率为-1.83%。

41.3报告期内基金投资组合比例
截至2018年6月30日,本基金资产配置比例为:股票资产占基金资产净值的比例不低于80%。

41.4报告期内基金管理人及其管理基金的经验
41.5基金管理人中诚信信诚基金管理有限公司

41.6基金管理人中诚信信诚基金管理有限公司
41.7基金管理人中诚信信诚基金管理有限公司

41.8基金管理人中诚信信诚基金管理有限公司
41.9基金管理人中诚信信诚基金管理有限公司

41.9基金管理人中诚信信诚基金管理有限公司
41.10基金管理人中诚信信诚基金管理有限公司

41.10基金管理人中诚信信诚基金管理有限公司
41.11基金管理人中诚信信诚基金管理有限公司

41.11基金管理人中诚信信诚基金管理有限公司
41.12基金管理人中诚信信诚基金管理有限公司

41.12基金管理人中诚信信诚基金管理有限公司
41.13基金管理人中诚信信诚基金管理有限公司

41.13基金管理人中诚信信诚基金管理有限公司
41.14基金管理人中诚信信诚基金管理有限公司

41.14基金管理人中诚信信诚基金管理有限公司
41.15基金管理人中诚信信诚基金管理有限公司

41.15基金管理人中诚信信诚基金管理有限公司
41.16基金管理人中诚信信诚基金管理有限公司

41.16基金管理人中诚信信诚基金管理有限公司
41.17基金管理人中诚信信诚基金管理有限公司

41.17基金管理人中诚信信诚基金管理有限公司
41.18基金管理人中诚信信诚基金管理有限公司

41.18基金管理人中诚信信诚基金管理有限公司
41.19基金管理人中诚信信诚基金管理有限公司

41.19基金管理人中诚信信诚基金管理有限公司
41.20基金管理人中诚信信诚基金管理有限公司

41.20基金管理人中诚信信诚基金管理有限公司
41.21基金管理人中诚信信诚基金管理有限公司

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和中国证监会允许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)。

64.2会计报表的编制基础
本基金以持续经营为基础,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,同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“信息披露办法”)和中国证券投资基金业协会于2018年1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。

64.3重要会计估计及变更
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,完整反映了本基金2018年6月30日的财务状况,2018年上半年度的经营成果和现金流量。

64.4重要会计政策和会计估计
64.4.1重要会计政策
64.4.2重要会计估计

64.5重要会计政策和会计估计变更
64.5.1重要会计政策变更
64.5.2重要会计估计变更

64.6重要会计政策和会计估计变更
64.6.1重要会计政策变更
64.6.2重要会计估计变更

64.7重要会计政策和会计估计变更
64.7.1重要会计政策变更
64.7.2重要会计估计变更

64.8重要会计政策和会计估计变更
64.8.1重要会计政策变更
64.8.2重要会计估计变更

64.9重要会计政策和会计估计变更
64.9.1重要会计政策变更
64.9.2重要会计估计变更

64.10重要会计政策和会计估计变更
64.10.1重要会计政策变更
64.10.2重要会计估计变更

64.11重要会计政策和会计估计变更
64.11.1重要会计政策变更
64.11.2重要会计估计变更

64.12重要会计政策和会计估计变更
64.12.1重要会计政策变更
64.12.2重要会计估计变更

64.13重要会计政策和会计估计变更
64.13.1重要会计政策变更
64.13.2重要会计估计变更

64.14重要会计政策和会计估计变更
64.14.1重要会计政策变更
64.14.2重要会计估计变更

64.15重要会计政策和会计估计变更
64.15.1重要会计政策变更
64.15.2重要会计估计变更

64.16重要会计政策和会计估计变更
64.16.1重要会计政策变更
64.16.2重要会计估计变更

64.17重要会计政策和会计估计变更
64.17.1重要会计政策变更
64.17.2重要会计估计变更

64.18重要会计政策和会计估计变更
64.18.1重要会计政策变更
64.18.2重要会计估计变更

64.19重要会计政策和会计估计变更
64.19.1重要会计政策变更
64.19.2重要会计估计变更

64.20重要会计政策和会计估计变更
64.20.1重要会计政策变更
64.20.2重要会计估计变更

64.21重要会计政策和会计估计变更
64.21.1重要会计政策变更
64.21.2重要会计估计变更

64.22重要会计政策和会计估计变更
64.22.1重要会计政策变更
64.22.2重要会计估计变更

64.23重要会计政策和会计估计变更
64.23.1重要会计政策变更
64.23.2重要会计估计变更

64.24重要会计政策和会计估计变更
64.24.1重要会计政策变更
64.24.2重要会计估计变更

64.25重要会计政策和会计估计变更
64.25.1重要会计政策变更
64.25.2重要会计估计变更

64.26重要会计政策和会计估计变更
64.26.1重要会计政策变更
64.26.2重要会计估计变更

64.27重要会计政策和会计估计变更
64.27.1重要会计政策变更
64.27.2重要会计估计变更

64.28重要会计政策和会计估计变更
64.28.1重要会计政策变更
64.28.2重要会计估计变更

64.29重要会计政策和会计估计变更
64.29.1重要会计政策变更
64.29.2重要会计估计变更

64.30重要会计政策和会计估计变更
64.30.1重要会计政策变更
64.30.2重要会计估计变更

64.31重要会计政策和会计估计变更
64.31.1重要会计政策变更
64.31.2重要会计估计变更

64.32重要会计政策和会计估计变更
64.32.1重要会计政策变更
64.32.2重要会计估计变更

64.33重要会计政策和会计估计变更
64.33.1重要会计政策变更
64.33.2重要会计估计变更

64.34重要会计政策和会计估计变更
64.34.1重要会计政策变更
64.34.2重要会计估计变更

64.35重要会计政策和会计估计变更
64.35.1重要会计政策变更
64.35.2重要会计估计变更

64.36重要会计政策和会计估计变更
64.36.1重要会计政策变更
64.36.2重要会计估计变更

7.12报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
7.13中期国债期货投资情况
7.14股指期货投资情况

7.15股指期货投资情况
7.16股指期货投资情况
7.17股指期货投资情况

7.18股指期货投资情况
7.19股指期货投资情况
7.20股指期货投资情况

7.21股指期货投资情况
7.22股指期货投资情况
7.23股指期货投资情况

7.24股指期货投资情况
7.25股指期货投资情况
7.26股指期货投资情况

7.27股指期货投资情况
7.28股指期货投资情况
7.29股指期货投资情况

7.30股指期货投资情况
7.31股指期货投资情况
7.32股指期货投资情况

7.33股指期货投资情况
7.34股指期货投资情况
7.35股指期货投资情况

7.36股指期货投资情况
7.37股指期货投资情况
7.38股指期货投资情况

7.39股指期货投资情况
7.40股指期货投资情况
7.41股指期货投资情况

7.42股指期货投资情况
7.43股指期货投资情况
7.44股指期货投资情况

7.45股指期货投资情况
7.46股指期货投资情况
7.47股指期货投资情况

7.48股指期货投资情况
7.49股指期货投资情况
7.50股指期货投资情况

7.51股指期货投资情况
7.52股指期货投资情况
7.53股指期货投资情况

7.54股指期货投资情况
7.55股指期货投资情况
7.56股指期货投资情况

7.57股指期货投资情况
7.58股指期货投资情况
7.59股指期货投资情况

7.60股指期货投资情况
7.61股指期货投资情况
7.62股指期货投资情况

7.63股指期货投资情况
7.64股指期货投资情况
7.65股指期货投资情况

7.66股指期货投资情况
7.67股指期货投资情况
7.68股指期货投资情况