

信诚中证800有色指数分级证券投资基金招募说明书摘要

2015年第2次更新)

本投资组合报告的财务数据截止至2015年6月30日。

1.报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,793,263,663.67	94.55
其中:股票	1,793,263,663.67	94.55	
2	固定收益投资	30,120,000.00	1.59
其中:债券	30,120,000.00	1.59	
资产支持证券	--	--	
3	贵金属投资	--	--
4	金融衍生品投资	--	--
5	买入返售金融资产	--	--
其中:买断式回购的买入返售金融资产	--	--	
6	银行存款和结算备付金合计	70,794,885.00	3.73
7	其他资产	2,534,774.73	0.13
8	合计	1,896,703,323.40	100.00

2.报告期末按行业分类的股票投资组合

1) 指数股权投资行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林牧渔	--	--
B	采矿业	674,879,942.89	35.72
C	制造业	1,118,373,720.78	59.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	--	--
E	建筑业	--	--
F	批发和零售业	--	--
G	交通运输、仓储和邮政业	--	--
H	住宿和餐饮业	--	--
I	信息技术、软件和信息技术服务业	--	--
J	金融业	--	--
K	房地产业	--	--
L	租赁和商业服务业	--	--
M	科学研究和技术服务业	--	--
N	水利、环境和公共设施管理业	--	--
O	居民服务、修理和其他服务业	--	--
P	教育	--	--
Q	卫生和社会工作	--	--
R	文化、体育和娱乐业	--	--
S	综合	--	--
合计		1,793,263,663.67	94.02

2) 积极股权投资行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末,未持有积极投资的股票投资。

3. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

1) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601899	紫金矿业	30,036,252	153,785,610.24	8.14
2	600100	中国铝业	13,896,646	129,562,407.18	6.86
3	600111	北方稀土	6,897,443	125,119,610.02	6.62
4	000060	中金岭南	4,203,061	78,134,903.99	4.14
5	601168	西部矿业	6,027,531	68,820,638.52	3.48
6	600219	南山铝业	6,280,467	63,369,912.03	3.35
7	600489	中国黄金	4,661,558	59,994,251.46	3.18
8	600362	江西铜业	2,629,530	56,561,190.30	2.99
9	600647	山东黄金	2,253,913	56,671,651.10	2.95
10	000678	云南铜业	2,966,490	54,569,059.70	2.91

2) 报告期末积极股权投资公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末,未持有积极投资的股票投资。

4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	--	--
2	央行票据	--	--
3	金融债券	30,120,000.00	1.59
其中:政策性金融债	30,120,000.00	1.59	
4	企业债券	--	--
5	企业短期融资券	--	--
6	中期票据	--	--
7	可转债	--	--
8	其他	--	--
9	合计	30,120,000.00	1.59

5. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140223	14国债23	300,000	30,120,000.00	1.59

6. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未进行资产支持证券投资。

7. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未进行贵金属投资。

8. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未进行权证投资。

9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

1) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

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

2) 本基金股指期货投资的投资政策

基金管理人可运用股指期货,以提高投资组合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应对特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理,以及对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险。

本基金本报告期内,股指期货投资符合既定的投资政策和投资目标。

10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

1) 本期国债期货投资政策

2) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

3) 本期国债期货投资评价

4) 本报告期内国债期货投资概况

5) 股指期货投资评价

6) 股指期货投资评价

7) 股指期货投资评价

8) 股指期货投资评价

9) 股指期货投资评价

10) 股指期货投资评价

11) 股指期货投资评价

12) 股指期货投资评价

13) 股指期货投资评价

14) 股指期货投资评价

15) 股指期货投资评价

16) 股指期货投资评价

17) 股指期货投资评价

18) 股指期货投资评价

19) 股指期货投资评价

20) 股指期货投资评价

21) 股指期货投资评价

22) 股指期货投资评价

23) 股指期货投资评价

24) 股指期货投资评价

25) 股指期货投资评价

26) 股指期货投资评价

27) 股指期货投资评价

28) 股指期货投资评价

29) 股指期货投资评价

30) 股指期货投资评价

31) 股指期货投资评价

32) 股指期货投资评价

33) 股指期货投资评价

34) 股指期货投资评价

35) 股指期货投资评价

36) 股指期货投资评价

37) 股指期货投资评价

38) 股指期货投资评价

39) 股指期货投资评价

40) 股指期货投资评价

41) 股指期货投资评价

42) 股指期货投资评价

43) 股指期货投资评价

44) 股指期货投资评价

45) 股指期货投资评价

46) 股指期货投资评价

47) 股指期货投资评价

48) 股指期货投资评价

49) 股指期货投资评价

50) 股指期货投资评价

51) 股指期货投资评价

52) 股指期货投资评价

53) 股指期货投资评价

54) 股指期货投资评价

55) 股指期货投资评价

56) 股指期货投资评价

57) 股指期货投资评价

58) 股指期货投资评价

59) 股指期货投资评价

60) 股指期货投资评价

61) 股指期货投资评价

62) 股指期货投资评价

63) 股指期货投资评价

64) 股指期货投资评价

65) 股指期货投资评价

66) 股指期货投资评价

67) 股指期货投资评价

68) 股指期货投资评价

69) 股指期货投资评价

70) 股指期货投资评价

71) 股指期货投资评价

72) 股指期货投资评价

73) 股指期货投资评价

74) 股指期货投资评价

75) 股指期货投资评价

76) 股指期货投资评价

77) 股指期货投资评价

78) 股指期货投资评价

79) 股指期货投资评价

80) 股指期货投资评价

81) 股指期货投资评价

82) 股指期货投资评价

83) 股指期货投资评价

84) 股指期货投资评价

85) 股指期货投资评价

86) 股指期货投资评价

87) 股指期货投资评价

88) 股指期货投资评价

89) 股指期货投资评价

90) 股指期货投资评价

91) 股指期货投资评价

92) 股指期货投资评价

93) 股指期货投资评价

94) 股指期货投资评价

95) 股指期货投资评价

96) 股指期货投资评价

97) 股指期货投资评价

98) 股指期货投资评价

99) 股指期货投资评价

100) 股指期货投资评价

101) 股指期货投资评价

102) 股指期货投资评价

103) 股指期货投资评价

104) 股指期货投资评价

105) 股指期货投资评价

106) 股指期货投资评价

107) 股指期货投资评价

108) 股指期货投资评价

109) 股指期货投资评价

110) 股指期货投资评价

111) 股指期货投资评价

112) 股指期货投资评价

113) 股指期货投资评价

114) 股指期货投资评价

115) 股指期货投资评价

116) 股指期货投资评价

117) 股指期货投资评价

118) 股指期货投资评价

119) 股指期货投资评价

120) 股指期货投资评价

121) 股指期货投资评价

122) 股指期货投资评价

123) 股指期货投资评价

124) 股指期货投资评价

125) 股指期货投资评价

126) 股指期货投资评价

127) 股指期货投资评价

128) 股指期货投资评价

129) 股指期货投资评价

130) 股指期货投资评价

131) 股指期货投资评价

132) 股指期货投资评价

133) 股指期货投资评价

134) 股指期货投资评价

135) 股指期货投资评价

136) 股指期货投资评价

137) 股指期货投资评价

138) 股指期货投资评价

139) 股指期货投资评价

140) 股指期货投资评价

141) 股指期货投资评价

142) 股指期货投资评价

143) 股指期货投资评价

144) 股指期货投资评价

145) 股指期货投资评价

146) 股指期货投资评价

147) 股指期货投资评价

148) 股指期货投资评价

149) 股指期货投资评价

150) 股指期货投资评价

151) 股指期货投资评价

152) 股指期货投资评价

153) 股指期货投资评价

154) 股指期货投资评价

155) 股指期货投资评价

156) 股指期货投资评价

157) 股指期货投资评价

158) 股指期货投资评价

159) 股指期货投资评价

160) 股指期货投资评价

161) 股指期货投资评价

162) 股指期货投资评价

163) 股指期货投资评价

164) 股指期货投资评价

165) 股指期货投资评价

166) 股指期货投资评价

167) 股指期货投资评价

168) 股指期货投资评价

169) 股指期货投资评价

170) 股指期货投资评价

171) 股指期货投资评价

172) 股指期货投资评价

173) 股指期货投资评价

174) 股指期货投资评价

175) 股指期货投资评价

176) 股指期货投资评价

177) 股指期货投资评价

178) 股指期货投资评价

179) 股指期货投资评价

180) 股指期货投资评价

181) 股指期货投资评价

182) 股指期货投资评价

183) 股指期货投资评价

184) 股指期货投资评价

185) 股指期货投资评价

186) 股指期货投资评价

187) 股指期货投资评价

188) 股指期货投资评价

189) 股指期货投资评价

190) 股指期货投资评价

191) 股指期货投资评价

192) 股指期货投资评价

193) 股指期货投资评价

194) 股指期货投资评价

195) 股指期货投资评价

196) 股指期货投资评价

197) 股指期货投资评价

198) 股指期货投资评价

199) 股指期货投资评价

200) 股指期货投资评价

201) 股指期货投资评价

202) 股指期货投资评价

203) 股指期货投资评价

204) 股指期货投资评价

205) 股指期货投资评价

206) 股指期货投资评价

207) 股指期货投资评价

208) 股指期货投资评价

209) 股指期货投资评价

210) 股指期货投资评价

211) 股指期货投资评价

212) 股指期货投资评价

213) 股指期货投资评价

214) 股指期货投资评价

215) 股指期货投资评价

216) 股指期货投资评价

217) 股指期货投资评价

218) 股指期货投资评价

219) 股指期货投资评价

220) 股指期货投资评价

221) 股指期货投资评价

222) 股指期货投资评价

22