

<p>本期末 2016年12月31日</p>	<p>单位:人民币元</p>	<p>(4) 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。</p>				
		<p>7.4.2 关联方关系</p>				
		<table border="1"> <thead> <tr> <th data-bbox="982 332 1089 332">关联方名称</th> <th data-bbox="1089 332 1232 332"></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td data-bbox="982 332 1089 332"></td> <td data-bbox="1089 332 1232 332"></td> </tr> </tbody> </table>	关联方名称			
关联方名称						

序号	股票代码	股票名称	本期资产卖出金额	占期末基金净资产比例(%)
1	600713	北方稀土	613,228,649.97	31.88
2	601600	中国铝业	674,621,082.89	29.69
3	601099	紫金矿业	492,903,209.51	26.54
4	600219	南山铝业	418,049,046.02	21.62
5	000060	中金岭南	354,009,916.67	18.21
6	601168	西部矿业	313,489,600.04	16.22

7	600647	山东黄金	277,519,494.66	14.48
8	000062	江西铜业	279,562,964.98	14.36
9	000060	中金黄金	266,144,430.44	13.71
10	000051	五矿稀土	221,647,731.71	11.54
11	000265	鑫矿材料	222,946,284.11	11.53
12	000073	东方阳光	222,338,211.23	11.50
13	002240	格林美	189,051,224.05	9.83
14	600487	烟台万润	177,167,150.53	9.21
15	000078	云南铜业	173,316,821.38	8.96
16	000090	锡业股份	166,632,812.95	8.82
17	000049	钨业	159,603,436.53	8.27
18	000076	银星能源	136,588,008.77	7.20
19	000053	神火股份	132,666,790.21	6.96
20	001058	金钼股份	131,058,187.34	6.78
21	600711	盛屯矿业	126,339,095.84	6.69
22	600606	中孚实业	126,220,424.72	6.63
23	002501	利源精制	119,435,638.17	6.18
24	002155	湖南黄金	115,212,890.00	5.96

计算公 式	25	000227	云南股份	111,180.500	5.76
	26	000228	恒顺达	111,180.500	5.76
	27	000228	云南城投	109,006,320.73	5.64
	28	000758	中色股份	106,048,748.40	5.53
	29	002460	赣锋锂业	90,268,188.67	5.13
	30	600392	盛和资源	92,362,269.29	4.78
	31	600432	晋嘉煤业	91,794,177.80	4.76
	32	000762	西藏矿业	87,469,749.91	4.52
	33	002167	东方锆业	86,967,143.91	4.39
	34	002093	洛阳钼业	70,820,432.40	4.08
元 公 式	35	600859	贵研铂业	77,340,330.93	4.03
	36	000012	格力电器	73,099,136.05	3.83
	37	000062	东方钨业	71,733,407.92	3.71
	38	000436	矿业开发	70,522,361.08	3.65
	39	300034	钢研高纳	70,416,611.13	3.64
	40	000567	墨江有色	69,354,096.03	3.58
	41	000969	安泰科技	67,354,666.58	3.49
	42	000080	丰源黄金	64,252,411.29	3.32
	43	000856	宝钛股份	61,638,667.37	3.18
	44	000259	广晟有色	57,376,945.13	2.97
元 元 式	45	600331	宏达股份	45,723,404.18	2.37

	46	000003	华信转债	39,250,799.40	2.03
注: 46 期末余额为卖出成交金额 (该债券的票面以成交金额 1 票), 不考虑和交易费用。					
	4.4.3	卖出债券的成本与卖出收入的人总			单位: 人民币元
		买入股票的成本 / 总			
		卖出股票的收入 / 总			13,322,079.44
					8,028,941,133.00
注: 4.4.3 期末余额为, 即: 卖出股票 / 买入股票成交金额 (该债券的票面以成交金额 1 票), 不考虑和交易费用。					
	R5	期末按市值法和分类的资产组合			
	R6	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R7	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R8	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R9	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R10	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R11	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R12	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R13	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R14	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R15	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R16	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R17	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R18	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R19	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R20	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R21	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R22	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R23	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R24	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R25	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R26	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R27	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R28	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R29	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R30	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R31	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R32	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R33	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R34	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R35	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R36	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R37	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R38	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R39	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R40	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R41	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R42	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R43	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R44	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R45	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R46	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R47	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R48	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R49	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R50	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R51	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R52	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R53	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R54	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R55	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R56	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R57	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R58	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R59	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R60	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R61	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R62	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R63	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R64	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R65	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R66	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R67	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R68	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R69	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R70	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R71	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R72	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R73	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R74	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R75	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R76	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R77	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R78	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R79	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R80	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R81	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R82	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R83	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R84	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R85	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R86	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R87	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R88	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R89	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R90	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R91	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R92	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R93	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R94	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R95	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R96	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R97	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R98	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R99	期末按公允价值法和分类的资产组合			
	R100	期末按公允价值法和分类的资产组合			

[illegible][illegible]

10	2	应收证券清算款	6,521,960.88	
	3	应收股利	—	
	4	应收利息	38,373.56	
	5	应收申购款	122,079.98	
	6	其他应收款	—	
	7	待摊费用	—	
	8	其他	—	
	9	合计	6,592,774.39	

8.1.7 资产中有以公允价值计量的可供金融资产
8.1.22 期末前十名股票公允价值变动情况的说明
8.1.23.1 期末前十大股票公允价值变动情况说明

序号	股票代码	股票名称	流通股股份占公允价值	占基金资产净值比例	流通股股份说明
----	------	------	------------	-----------	---------

金额单位：人民币元

[illegible]

序号	持股5%以上主要股东名称	持有股份(%)	占上市股份比例
1	中国银行股份有限公司	94,068,321.00	13.41%
2	中国人寿保险股份有限公司-传统-普通保险产品	60,076,071.00	8.52%
3	中国人寿保险有限责任公司	59,123,360.00	8.50%
4	恒华财富资本-工商保险-恒华财富资产管理(上海)有限公司	48,944,362.00	6.93%
5	中国太平洋保险有限公司	41,176,980.00	5.84%
6	瑞士信贷(香港)有限公司	37,470,580.00	5.32%
7	中国财产再保险有限责任公司	36,020,063.00	5.07%
8	全国社保基金二零四组合	31,703,491.00	4.50%
9	全国社保基金二零三组合	30,881,028.00	4.38%
10	北京瑞达瑞德技术服务有限公司	21,487,243.00	3.05%

注：以上数据根据公开信息查证已清算有破产记录的公司和已破产的公司名称加粗。

序号	持有方名称	持有的股份(份)	上市股份的比例
1	交通银行人寿保险有限公司-自有资金	15,622,700.00	3.84%
2	华融国际信托股份有限公司-国鑫利华证券资管集合资金信托计划	28,063,100.00	8.98%
3	华融国际信托股份有限公司-国鑫利华证券	27,017,000.00	3.93%
4	黄敏钢	15,013,666.00	2.13%
5	张克芳	10,185,813.00	1.44%
6	周耀光	9,560,013.00	1.41%
7	王煜	8,336,919.00	1.18%
8	李怡名	7,461,226.00	1.06%

9	9	华融国际信托有限公司-林德惠利和正定弘安信托资金	6,920,000.00	0.00%
10	10	惠利和正定弘安信托有限公司-外发信托-恒达30期资金多	6,880,000.00	0.00%
注:以上基金名称(含)的认购人持有本公司股份的情况列于后:				
9.3 期末基金管理人认购人持有本公司基金份额的情况				
项目		份额类别	持有基金份额(份)	占基金份额总额
基金管理人所有从业人员持有本基金		国富有色	40,143.43	0.02%
		有色A	0.00	0.00%
		有色B	0.00	0.00%
		合计	40,143.43	0.02%
9.4 期末基金管理人认购人持有本公司发行在外的基金份额的情况			持有基金份额总额的数量区间(万份)	
项目		份额类别	0	
		国富有色	0	

人民币元	本公司高级管理人员、基金投资决策机构和内部/负责人持有本开放式基金	有色A	0	
		有色B	0	
		合计	0	
		国泰有色	0-10	
		有色A	0	
		有色B	0	
		合计	0-10	
3.10 开放式基金持有份额				
单位:份				
人民币元	项目	国泰有色	有色A	有色B
	基金合同生效日(2015年3月30日)基金份额总额	416,571,209.01	-	-
	截至报告期末 基金合同生效日后至报告期期末基金已赎回的份额	10,847,799.91	11.13	-

减：基金合同生效日至报告期内期末基金份额总额	7,291,932,009.43	-
本报告期间基金份额总额	-3,726,638,186.17	704,942,176.00
本报告期间基金份额总额	246,809,713.27	704,942,176.00

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议
报告期内，本基金基金份额持有人未召开大会决议。

11.2 基金经理、基金管理人及持有1%以上权益的持有人发生变动
报告期内，基金管理人、基金经理及持有1%以上权益的持有人未发生变动。

2015年01月01日，本基金管理人发布了《华泰基金管理股份有限公司总经理聘任公告》，经本基金管理人第六届董事会第十七次审议通过，聘任王明海先生担任本公司总经理职务，自2015年01月01日起生效。

2015年01月14日，本基金管理人发布了《华泰基金管理股份有限公司独立董事任免公告》，经本基金管理人第六届董事会第十八次会议审议通过，聘任李强先生担任本公司独立董事，自2015年01月14日起生效。

2015年01月22日，本基金管理人发布了《华泰基金管理股份有限公司高级管理人员任免的公告》，经本基金管理人第六届董事会第十八次会议审议通过，聘任王明海先生担任本公司副总经理职务，自2015年01月22日起生效。

2015年01月22日，本基金管理人发布了《华泰基金管理股份有限公司高级管理人员任免的公告》，经本基金管理人第六届董事会第十八次会议审议通过，聘任林德祥先生担任本公司副总经理职务，自2015年01月22日起生效。

2015年01月22日，本基金管理人发布了《华泰基金管理股份有限公司高级管理人员任免的公告》，经本基金管理人第六届董事会第十八次会议审议通过，聘任林德祥先生担任本公司副总经理职务，自2015年01月22日起生效。

[illegible]

通惠证券	2	6,366,030,467.54	32.87%	4,538,879.71	30.33%	新增
中银证券	1	4,262,106,367.29	22.03%	6,038,077.17	20.24%	新增
中银证券	2	2,220,558,153.39	10.96%	1,516,039.36	10.13%	新增
中国银河证券	2	2,109,437,147.93	10.70%	1,908,416.46	12.75%	新增
招商证券	1	927,270,016.68	4.90%	1,778,270.00	11.75%	新增
长江证券	1	1,727,726,376.93	8.98%	1,552,013.96	10.57%	新增
方正证券	1	669,554,617.02	3.46%	469,339.28	3.26%	新增
东吴证券	1	201,365,690.93	1.04%	147,360.13	0.98%	新增

以上新增信用资产情况如下：

- 1) 客户来源：信用良好；
- 2) 资产来源：合法，全部资产均符合公司信贷资产准入标准；
- 3) 资产用途：合法，在最近一年内无不良用途记录；
- 4) 风险管理：严格，具备健全的风险管理体系；
- 5) 合规性：符合监管要求，符合监管部门关于信贷资产转让业务的相关规定；
- 6) 没有有效担保的资产，其信用风险与具有担保的资产不存在显著差异，资产违约风险和资产违约后追偿风险与资产违约前和资产违约后追偿风险不存在显著差异。

本基金资产，是根据对备选证券公司的各项指标，研究分析考核的结果进行筛选，符合交易席位和佣金标准的，由公司证券业务部门提出租用该席位券商的书面报告（包括券商名称、交易席位和佣金标准），并经过公司决策。

13.7.2 基金租用证券公司交易席位进行证券投资的评估情况

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易		基金席位使用 人民币元
	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	
中泰证券	—	—	982,700, 000.00	100.00%	—	—	—