

工银瑞信睿智中证 500 指数分级证券投资 基金 2016 年半年度报告

2016 年 6 月 30 日

基金管理人：工银瑞信基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：二〇一六年八月二十六日

§ 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 2016 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 01 月 01 日起至 06 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.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	8
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.8 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.....	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
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.....	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
§7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况.....	34
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	35
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	51
7.6 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.....	51
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	51
7.8 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贵金属投资明细.....	52
7.9 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.....	52
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	52

7.12 投资组合报告附注.....	52
§8 基金份额持有人信息.....	53
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	53
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	54
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	54
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.....	55
§9 开放式基金份额变动.....	55
§10 重大事件揭示.....	55
10.1 基金份额持有人大会决议.....	55
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.....	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	56
10.4 基金投资策略的改变.....	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	56
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.....	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	56
10.8 其他重大事件.....	58
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	59
§12 备查文件目录.....	59
12.1 备查文件目录.....	59
12.2 存放地点.....	59
12.3 查阅方式.....	59

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	工银瑞信睿智中证 500 指数分级证券投资基金		
基金简称	工银中证 500 指数		
场内简称	工银 500		
基金主代码	164809		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2012 年 1 月 31 日		
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司		
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	38,950,661.52 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	2012-03-30		
下属分级基金的基金简称	500A	500B	工银 500
下属分级基金的交易代码	150055	150056	164809
报告期末下属分级基金份额总额	2,297,610.00 份	3,446,416.00 份	33,206,635.52 份

2.2 基金产品说明

投资目标	采用指数化投资,通过控制基金投资组合相对于标的指数的偏离度,实现对标的指数的有效跟踪。通过产品分级设置,为不同份额投资者提供具有差异化收益和风险特征的投资工具。
投资策略	本基金采取完全复制策略,即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但因特殊情况(如市场流动性不足、成份股被限制投资等)导致基金无法获得足够数量的股票时,基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合,追求尽可能贴近目标指数的表现。本基金对标的指数的跟踪目标是:力争使得基金日收益率与业绩比较基准日收益率偏离度的年度平均值不超过 0.35%,偏离度年化标准差不超过 4%。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95%+商业银行税后活期存款利率×5%。
风险收益特征	本基金属于股票型基金,其风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。此外,本基金作为指数型基金,采用完全复制策略,跟踪标的指数市场表现,目标为获取市场平均收益,是股票基金中处于中等风险水平的基金产品。本基金的分级设定则决定了不同份额具有不同的风险和收益特征。睿智 A 份额具有低风险、低预期收益的特征;睿智 B 份额具有高风险、高预期收益的特征。

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		工银瑞信基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	朱碧艳	王永民
	联系电话	400-811-9999	010-66594896
	电子邮箱	customerservice@icbccs.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-811-9999	95566
传真		010-66583158	010-66594942
注册地址		北京市西城区金融大街 5 号、甲 5 号 6 层甲 5 号 601、甲 5 号 7 层甲 5 号 701、甲 5 号 8 层甲 5 号 801、甲 5 号 9 层甲 5 号 901	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 A 座 6-9 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		100033	100818
法定代表人		郭特华	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、证券时报、上海证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.icbccs.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 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(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-1,900,245.78
本期利润	-10,863,532.11
加权平均基金份额本期利润	-0.2826
本期加权平均净值利润率	-22.28%
本期基金份额净值增长率	-18.90%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	15,245,289.13

期末可供分配基金份额利润	0.3914
期末基金资产净值	50,834,103.11
期末基金份额净值	1.3051
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016年6月30日)
基金份额累计净值增长率	42.84%

注：1、所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、本基金基金合同生效日为 2012 年 1 月 31 日。

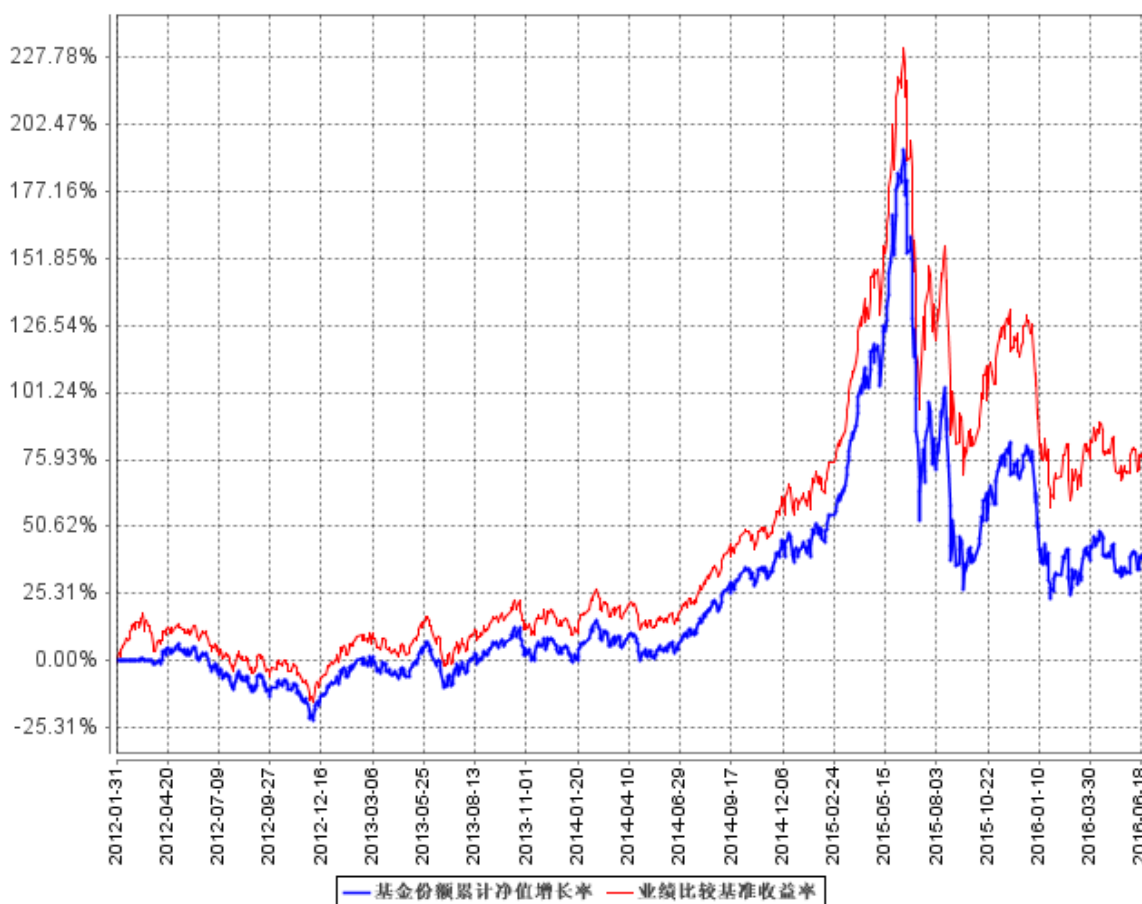
3.2 基金净值表现

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	3.00%	1.47%	2.82%	1.47%	0.18%	0.00%
过去三个月	-0.29%	1.56%	-0.46%	1.57%	0.17%	-0.01%
过去六个月	-18.90%	2.46%	-18.57%	2.43%	-0.33%	0.03%
过去一年	-36.48%	3.08%	-29.57%	2.77%	-6.91%	0.31%
过去三年	57.78%	2.18%	84.89%	2.03%	-27.11%	0.15%
自基金合同生效以来	42.84%	1.93%	82.24%	1.84%	-39.40%	0.09%

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2012 年 1 月 31 日生效。

2、按基金合同规定，本基金建仓期为六个月。截至报告期末，本基金的各项投资比例符合基金合同第十七条（二）投资范围、（七）投资禁止行为与限制中规定的各项比例：本基金投资于股票资产占基金资产净值的比例为 90%-95%，其中标的指数成分股票、备选成分股票占基金资产净值的比例不低于 90%；现金、债券资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产净值的比例为 5%-10%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值 5%；权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定；法律法规及本基金合同规定的其他比例限制。

3.3 其他指标

无。

§ 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

本基金管理人为工银瑞信基金管理有限公司，成立于 2005 年 6 月 21 日，是我国第一家由银行直接发起设立并控股的合资基金管理公司，注册资本为 2 亿元人民币，注册地在北京。公司目前拥有共同基金募集和管理资格、境外证券投资管理业务资格、企业年金基金投资管理人资格、特定客户资产管理业务资格、全国社保基金境内投资管理人资格。

截至 2016 年 6 月 30 日，公司旗下管理 83 只公募基金——工银瑞信核心价值混合型证券投资基金、工银瑞信货币市场基金、工银瑞信精选平衡混合型证券投资基金、工银瑞信稳健成长混合型证券投资基金、工银瑞信增强收益债券型证券投资基金、工银瑞信红利混合型证券投资基金、工银瑞信中国机会全球配置股票证券投资基金、工银瑞信信用添利债券型证券投资基金、工银瑞信大盘蓝筹混合型证券投资基金、工银瑞信沪深 300 指数证券投资基金、上证中央企业 50 交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信中小盘成长混合型证券投资基金、工银瑞信全球精选股票型证券投资基金、工银瑞信双利债券型证券投资基金、深证红利交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信深证红利 ETF 联接基金、工银瑞信四季收益债券型证券投资基金、工银瑞信消费服务行业混合型证券投资基金、工银瑞信添颐债券型证券投资基金、工银瑞信主题策略混合型证券投资基金、工银瑞信保本混合型证券投资基金、工银瑞信睿智中证 500 指数分级证券投资基金、工银瑞信基本面量化策略混合型证券投资基金、工银瑞信纯债定期开放债券型证券投资基金、工银瑞信 7 天理财债券型证券投资基金、工银瑞信睿智深证 100 指数分级证券投资基金、工银瑞信 14 天理财债券型发起式证券投资基金、工银瑞信信用纯债债券型证券投资基金、工银瑞信 60 天理财债券型证券投资基金、工银瑞信优质精选混合型证券投资基金、工银瑞信增利债券型证券投资基金、工银瑞信产业债债券型证券投资基金、工银瑞信信用纯债一年定期开放债券型证券投资基金、工银瑞信信用纯债两年定期开放债券型证券投资基金、工银瑞信标普全球自然资源指数证券投资基金、工银瑞信保本 3 号混合型证券投资基金、工银瑞信月月薪定期支付债券型证券投资基金、工银瑞信金融地产行业混合型证券投资基金、工银瑞信双债增强债券型证券投资基金、工银瑞信添福债券型证券投资基金、工银瑞信信息产业混合型证券投资基金、工银瑞信薪金货币市场基金、工银瑞信纯债债券型证券投资基金、工银瑞信绝对收益策略混合型发起式证券投资基金、工银瑞信目标收益一年定期开放债券型投资基金、工银瑞信新财富灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信现金快线货币市场基金、工银瑞信添益快线货币市场基金、工银瑞信高端制造行业股票型证

券投资基金、工银瑞信研究精选股票型证券投资基金、工银瑞信医疗保健行业股票型证券投资基金、工银瑞信创新动力股票型证券投资基金、工银瑞信国企改革主题股票型证券投资基金、工银瑞信战略转型主题股票型证券投资基金、工银瑞信新金融股票型证券投资基金、工银瑞信美丽城镇主题股票型证券投资基金、工银瑞信总回报灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信新材料新能源行业股票型证券投资基金、工银瑞信养老产业股票型证券投资基金、工银瑞信丰盈回报灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金、工银瑞信农业产业股票型证券投资基金、工银瑞信生态环境行业股票型证券投资基金、工银瑞信互联网加股票型证券投资基金、工银瑞信财富快线货币市场基金、工银瑞信聚焦 30 股票型证券投资基金、工银瑞信中证新能源指数分级证券投资基金、工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金、工银瑞信中证高铁产业指数分级证券投资基金、工银瑞信新蓝筹股票型证券投资基金、工银瑞信丰收回报灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信中高等级信用债债券型证券投资基金、工银瑞信新趋势灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信文体产业股票型证券投资基金、工银瑞信物流产业股票型证券投资基金、工银瑞信前沿医疗股票型证券投资基金、工银瑞信国家战略主题股票型证券投资基金、工银瑞信香港中小盘股票型证券投资基金、工银瑞信沪港深股票型证券投资基金、工银瑞信瑞丰纯债半年定期开放债券型证券投资基金、工银瑞信泰享三年理财债券型证券投资基金、工银瑞信安盈货币市场基金、工银瑞信恒享纯债债券型证券投资基金，证券投资基金管理规模逾 4800 亿元人民币。

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		
刘伟琳	本基金的 基金经理	2014 年 10 月 17 日	-	6	中国人民大学金融工程博士；2010 年加入工银瑞信，历任金融工程分析师、投资经理助理、投资经理，现任指数投资部基金经理。2014 年 10 月 17 日至今，担任工银深证 100 指数分级基金基金经理；2014 年 10 月 17 日至今，担任工银沪深 300 指数基金基金经理；2014 年 10 月 17 日至今，担任工银中证

					500 指数分级基金基金经理；2015 年 5 月 21 日至今，担任工银瑞信中证传媒指数分级基金基金经理；2015 年 7 月 23 日至今，担任工银中证高铁产业指数分级基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：

- 1、任职日期说明：刘伟琳的任职日期为公司执委会决议正式生效日期
- 2、离任日期说明：无
- 3、证券从业年限的计算标准：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》的相关规定等
- 4、本基金无基金经理助理

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无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

为了公平对待各类投资人，保护各类投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行，公司根据《证券投资基金法》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部规章，拟定了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》，对公司管理的各类资产的公平对待做了明确具体的规定，并规定对买卖股票、债券时候的价格和市场价格差距较大，可能存在操纵股价、利益输送等违法违规情况进行监控。本报告期，按照时间优先、价格优先的原则，本公司对满足限价条件且对同一证券有相同交易需求的基金等投资组合，均采用了系统中的公平交易模块进行操作，实现了公平交易；且本基金及本基金与本基金管理人管理的其他投资组合之间未发生法律法规禁止的反向交易及交叉交易。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内，本公司所有投资组合参与的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的 5%的情况有 9 次。投资组

合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易，未导致不公平交易和利益输送。

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

本报告期内，本基金跟踪标的指数的日均偏离度为 0.04%，偏离度年化标准差为 1.10%。本基金跟踪误差产生的主要来源是：1) 申购赎回的影响；2) 成份股票的停牌；3) 指数中成份股票的调整等。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金净值增长率为-18.90%，业绩比较基准收益率为-18.57%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金为指数型基金，基金管理人将继续按照基金合同的要求，坚持指数化投资策略，通过运用定量分析等技术，分析和应对导致基金跟踪误差的因素，继续努力将基金的跟踪误差控制在较低水平。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.6.1 参与估值流程各方及人员（或小组）的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

4.6.1.1 职责分工

(1) 参与估值小组成员为 4 人，分别是公司运作部负责人、研究部负责人、风险管理部负责人和法律合规部负责人，组长由运作部负责人担任。

(2) 各部门负责人也可推荐代表各部门参与估值小组的成员，如需更换，由相应部门负责人提出。小组成员需经运作部主管副总批准同意。

4.6.1.2 专业胜任能力及相关工作经历

小组由具有多年从事估值运作、证券行业研究、风险管理及熟悉业内法律法规的专家型人员组成。

4.6.2 基金经理参与或决定估值的程度

本公司基金经理参与讨论估值原则及方法，但不参与最终估值决策。

4.6.3 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。

4.6.4 已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

尚无已签约的任何定价服务。本基金所采用的估值流程及估值结果均已经过会计师事务所鉴证，并经托管银行复核确认。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未实施利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 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

本基金在报告期内出现连续二十个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形。

§ 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”）在对工银瑞信睿智中证 500 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：工银瑞信睿智中证 500 指数分级证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	2,691,456.40	3,788,726.58
结算备付金		17,142.47	161.96
存出保证金		2,797.58	39,614.90
交易性金融资产	6.4.7.2	47,973,564.65	55,669,225.90

其中：股票投资		47,973,564.65	55,669,225.90
基金投资		-	-
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		682,105.41	-
应收利息	6.4.7.5	561.33	946.36
应收股利		-	-
应收申购款		15,650.16	9,550.68
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		51,383,278.00	59,508,226.38
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015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		327,012.69	229,343.77
应付管理人报酬		41,218.46	50,951.94
应付托管费		8,243.67	10,190.40
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	17,470.79	20,352.72
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	155,229.28	205,141.43
负债合计		549,174.89	515,980.26
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	35,588,813.98	33,493,876.75
未分配利润	6.4.7.10	15,245,289.13	25,498,369.37
所有者权益合计		50,834,103.11	58,992,246.12
负债和所有者权益总计		51,383,278.00	59,508,226.38

注：1、本基金基金合同生效日为 2012 年 1 月 31 日。

2、报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额总额 38,950,661.52 份。其中工银 500 基金份额净值 1.3051 元，基金份额总额 33,206,635.52 份，500A 基金份额净值 1.0246 元，基金份额总额 2,297,610.00 份；500B 基金份额净值 1.4921 元，基金份额总额 3,446,416.00 份。

6.2 利润表

会计主体：工银瑞信睿智中证 500 指数分级证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		-10,338,546.68	33,608,640.19
1.利息收入		14,357.02	22,809.58
其中：存款利息收入	6.4.7.11	14,357.02	22,809.58
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）		-1,399,515.47	30,170,961.01
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-1,659,119.26	29,891,897.65
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	259,603.79	279,063.36
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-8,963,286.33	3,229,367.84
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	9,898.10	185,501.76
减：二、费用		524,985.43	1,039,009.20
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	242,544.86	411,343.15
2. 托管费	6.4.10.2.2	48,508.90	82,268.63
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	27,205.31	300,000.18
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	206,726.36	245,397.24
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-10,863,532.11	32,569,630.99
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-10,863,532.11	32,569,630.99

注：本基金基金合同生效日为 2012 年 1 月 31 日。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：工银瑞信睿智中证 500 指数分级证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	33,493,876.75	25,498,369.37	58,992,246.12
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-10,863,532.11	-10,863,532.11
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）	2,094,937.23	610,451.87	2,705,389.10
其中：1.基金申购款	8,519,967.47	3,189,735.91	11,709,703.38
2.基金赎回款	-6,425,030.24	-2,579,284.04	-9,004,314.28
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）	35,588,813.98	15,245,289.13	50,834,103.11
项目	上年度可比期间 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）	51,142,008.27	20,695,438.02	71,837,446.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	32,569,630.99	32,569,630.99
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）	-14,773,877.32	-7,857,363.25	-22,631,240.57
其中：1.基金申购款	68,590,761.33	83,864,017.79	152,454,779.12
2.基金赎回款	-83,364,638.65	-91,721,381.04	-175,086,019.69
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)	36,368,130.95	45,407,705.76	81,775,836.71

注：本基金基金合同生效日为 2012 年 1 月 31 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 郭特华 _____	_____ 朱碧艳 _____	_____ 朱辉毅 _____
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

工银瑞信睿智中证 500 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”)证监许可[2011]第 1541 号《关于核准工银瑞信睿智中证 500 指数分级证券投资基金募集的批复》核准，由工银瑞信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《工银瑞信睿智中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为上市开放式基金(LOF)，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 341,078,123.87 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第 007 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《工银瑞信睿智中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》于 2012 年 1 月 31 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 341,299,798.53 份基金份额，其中认购资金利息折合 221,674.66 份基金份额。本基金的基金管理人为工银瑞信基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《工银瑞信睿智中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》和《工银瑞信睿智中证 500 指数分级证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案，本基金的基金份额包括确认为工银瑞信睿智中证 500 指数分级证券投资基金之基础份额(以下简称“睿智 500 份额”)，工银瑞信睿智中证 500 指数分级证券投资基金之 A 份额(以下简称“睿智 A 份额”)及工银瑞信睿智中证 500 指数分级证券投资基金之 B 份额(以下简称“睿智 B 份额”)。其中，睿智 A 份额、睿智 B 份额的基金份额配比始终保持 4:6 的比例不变。本基金净资产优先确保睿智 A 份额的本金及睿智 A 份额累计约定日应得收益，则睿智 A 份额为低风险且预期收益相对稳定的基金份额；本基金在优先确保睿智 A 份额的本金及累计约定日应得收益后的剩余净资产计为睿智 B 份额的净资产，则睿智 B 份额为高风险且预期收益相对较高的基金份额。基金合同生效后，场外认购的全部分额将确认为睿智 500 份额；场内认购的全部分额将按 4:6 的比例确认为睿智 A 份额与睿智 B 份额。睿智 500 份额可办理场外与场内申购和赎回，睿智 A 份额、睿智 B 份额只上市交易，不可单独申购和赎回。

经基金份额持有人大会决议通过，睿智 A 份额与睿智 B 份额可申请终止运作。睿智 A 份额与睿智 B 份额终止运作后，睿智 A 份额与睿智 B 份额将全部转换为睿智 500 份额的场内份额。本基金转为上市开放式基金(LOF)，投资者可通过场内、场外进行基金份额的申购、赎回。

本基金在存续期内的每个会计年度(除基金合同生效日所在会计年度外)第一个工作日进行基金的定期份额折算。本基金在存续期内的每个会计年度(除基金合同生效日所在会计年度外)最后一个交易日收市后，基金管理人根据基金资产净值计算睿智 500 份额净值，根据基金份额净值计算规则确定睿智 A 份额和睿智 B 份额的期末参考净值。然后对睿智 A 份额的应得收益进行定期份额折算，每 10 份睿智 500 份额将按 4 份睿智 A 份额获得约定应得收益的新增折算份额。定期份额折算后睿智 A 份额的基金份额参考净值调整为 1.0000 元，基金份额折算日前睿智 A 份额的基金份额参考净值超出 1.0000 元的部分将折算为睿智 500 份额的场内份额分配给睿智 A 份额持有人。睿智 B 份额的基金份额参考净值达到 0.2500 元时，基金管理人即可确定折算基准日，进行不定期份额折算。对基金份额折算基准日登记在册的睿智 500 份额、睿智 A 和睿智 B 份额进行折算。份额折算后睿智 500 份额的基金份额净值、睿智 A 和睿智 B 份额的基金份额参考净值均调整为 1.0000 元，折算后睿智 500 份额、睿智 A 和睿智 B 份额的基金份额均相应缩减，睿智 A 和睿智 B 份额的比例为 4:6。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2012]第 66 号文审核同意，工银瑞信睿智中证 500 指数分级证券投资基金之睿智 A 份额和睿智 B 份额于 2012 年 3 月 30 日开始在深圳证券交易所上市交易。未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《工银瑞信睿智中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具，包括中证 500 指数的成份股及其备选成份股、首发和增发新股、债券、权证以及经中国证监会批准的允许基金投资的其它金融工具。法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金投资于股票资产占基金资产净值的比例为 90%-95%，其中标的指数成份股票、备选成份股票占基金资产净值的比例不低于 90%。现金、债券资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产净值的比例为 5%-10%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值 5%。权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。本基金的业绩比较基准为中证 500 指数收益率×95%+商业银行税后活期存款利率×5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本

准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《工银瑞信睿智中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》和中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年上半年的经营成果和净值变动情况。

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

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的差错更正事项。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[1998]55 号《关于证券投资基金税收问题的通知》[适用于 CEF]/财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》[适用于 OEF]、财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、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》、财税[2015]101 号《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[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前,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。管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起,金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税,

对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25% 计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 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。

(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。

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 2016 年 6 月 30 日
活期存款	2,691,456.40
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	2,691,456.40

注：本基金本报告期末投资于定期存款。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	55,732,120.75	47,973,564.65	-7,758,556.10
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-

其他	-	-	-
合计	55,732,120.75	47,973,564.65	-7,758,556.10

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

本基金本期末无买断式逆回购交易，也无在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 2016年6月30日
应收活期存款利息	552.43
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	7.70
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	1.20
合计	561.33

注：“其他”为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

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	17,470.79
银行间市场应付交易费用	-
合计	17,470.79

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	803.14
预提信息披露费	54,700.10
预提上市费	29,835.26
预提审计费	19,890.78
指数使用费	50,000.00
应付指数使用费	-
预提账户维护费	-
合计	155,229.28

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	36,048,604.90	33,493,876.75
本期申购	10,797.75	10,032.73
本期赎回(以“-”号填列)	-95,474.88	-88,710.62
2016年1月4日 基金拆分/份额折算前	35,963,927.77	33,415,198.86
基金拆分/份额折算变动份额	607,767.40	-
本期申购	9,313,796.78	8,509,934.74
本期赎回(以“-”号填列)	-6,934,830.43	-6,336,319.62
本期末	38,950,661.52	35,588,813.98

注：根据基金合同规定，500A 份额和 500B 份额只上市交易，不接受申购与赎回。因此上表不再单独披露 500A 份额和 500B 份额的情况。

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	30,740,802.49	-5,242,433.12	25,498,369.37
本期利润	-1,900,245.78	-8,963,286.33	-10,863,532.11
本期基金份额交易产生的变动数	1,926,850.26	-1,316,398.39	610,451.87
其中：基金申购款	7,714,770.06	-4,525,034.15	3,189,735.91
基金赎回款	-5,787,919.80	3,208,635.76	-2,579,284.04

本期已分配利润	-	-	-
本期末	30,767,406.97	-15,522,117.84	15,245,289.13

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
活期存款利息收入	14,042.40	
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	153.89	
其他	160.73	
合计	14,357.02	

注：“其他”为结算保证金利息收入和申购款利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
卖出股票成交总额	8,047,454.75	
减：卖出股票成本总额	9,706,574.01	
买卖股票差价收入	-1,659,119.26	

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期内未有债券投资收益。

6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内未有资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内未有贵金属投资收益。

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

本基金本报告期无买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

本基金本报告期无其他衍生工具投资收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	259,603.79
基金投资产生的股利收益	-
合计	259,603.79

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-8,963,286.33
——股票投资	-8,963,286.33
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-8,963,286.33

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	9,898.10
合计	9,898.10

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	27,205.31

银行间市场交易费用	-
合计	27,205.31

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
审计费用	19,890.78
信息披露费	54,700.10
指数使用费	100,000.00
上市年费	29,835.26
账户维护费	1,500.00
银行费用	800.22
合计	206,726.36

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，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金并无须作披露的重大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，与本基金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
工银瑞信基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金管理人股东、基金销售机构

注：1、本报告期本基金关联方未发生变化。

2、以下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

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

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	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	242,544.86	411,343.15
其中：支付销售机构的客户维护费	73,652.69	118,381.85

注：1、基金管理费按前一日基金资产净值的 1.0% 年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

2、基金管理费每日计提，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	48,508.90	82,268.63

注：1、基金托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

2、基金托管费每日计提，按月支付。

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

本基金本报告期与上年度可比期间与关联方均没有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

本基金的管理人在本报告期内与上年度可比期间均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

本基金除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末与上年度末均未持有本基金。

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

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		2015 年 1 月 1 日至 2015 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
中国银行股份有限公司	2,691,456.40	14,042.40	5,978,849.75	21,260.75

注：1、本报告期末余额仅为活期存款，利息收入（本期）仅为活期存款利息收入；

2、上年度可比期间报告期末余额仅为活期存款，利息收入（上年度可比期间）仅为活期存款利息收入；

3、本基金的银行存款由基金托管人中国银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期和上年度可比期间内均未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2016 年 6 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**

本基金本报告期末未持有因认购新发/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
600654	中安消	2016 年 5 月 19 日	重大事项	18.54	2016 年 8 月 8 日	20.39	10,200	194,279.26	189,108.00	-
000718	苏宁环球	2016 年 1 月 4 日	重大事项	13.09	2016 年 7 月 18 日	11.78	13,440	122,193.41	175,929.60	-

600166	福田汽车	2016年6月30日	重大事项	5.52	2016年7月1日	5.62	30,400	165,254.00	167,808.00	-
000547	航天发展	2016年4月19日	重大事项	15.36	-	-	9,500	240,587.11	145,920.00	-
601168	西部矿业	2016年2月1日	重大事项	5.93	2016年7月22日	6.52	24,000	170,400.00	142,320.00	-
000511	*ST 烯碳	2016年4月26日	重大事项	8.92	-	-	15,300	138,373.83	136,476.00	-
600497	驰宏锌锗	2016年6月13日	重大事项	9.97	2016年7月11日	10.97	12,400	127,825.47	123,628.00	-
002512	达华智能	2016年6月21日	重大事项	20.28	2016年7月21日	19.38	5,600	110,172.00	113,568.00	-
600759	洲际油气	2016年6月27日	重大事项	7.58	2016年7月11日	8.10	14,880	154,870.55	112,790.40	-
000975	银泰资源	2016年4月19日	重大事项	15.00	-	-	7,200	113,328.92	108,000.00	-
600511	国药股份	2016年2月18日	重大事项	27.42	2016年8月4日	30.16	3,900	140,203.23	106,938.00	-
002266	浙富控股	2016年5月25日	重大事项	5.35	-	-	19,110	171,819.50	102,238.50	-
002672	东江环保	2016年5月23日	重大事项	17.33	2016年7月15日	19.06	5,538	99,555.89	95,973.54	-
300032	金龙机电	2016年6月28日	重大事项	20.10	2016年7月7日	19.80	4,400	78,206.00	88,440.00	-
600773	西藏城投	2016年6月30日	重大事项	15.67	-	-	5,600	83,129.12	87,752.00	-
002373	千方科技	2016年5月12日	重大事项	14.94	2016年8月16日	16.43	5,800	162,571.70	86,652.00	-
002190	成飞集成	2016年4月21日	重大事项	35.44	2016年7月12日	38.98	2,300	111,041.16	81,512.00	-

000401	冀东水泥	2016年 4月6日	重大 事项	10.60	2016年 7月14日	11.32	7,100	95,576.50	75,260.00	-
601005	重庆钢铁	2016年 6月2日	重大 事项	2.52	-	-	27,000	115,434.44	68,040.00	-
002663	普邦园林	2016年 4月28日	重大 事项	7.36	-	-	9,026	84,779.91	66,431.36	-
600614	鼎立股份	2016年 4月26日	重大 事项	8.14	-	-	7,900	85,953.91	64,306.00	-
000636	风华高科	2016年 3月15日	重大 事项	8.84	2016年 7月13日	9.72	7,100	70,740.03	62,764.00	-
600545	新疆城建	2016年 5月31日	重大 事项	6.91	-	-	7,500	88,086.17	51,825.00	-
600640	号百控股	2016年 4月18日	重大 事项	16.79	2016年 8月22日	18.44	2,899	60,318.68	48,674.21	-
000693	ST华泽	2016年 3月1日	重大 事项	12.50	-	-	3,420	91,898.93	42,750.00	-
000517	荣安地产	2016年 6月14日	重大 事项	4.84	2016年 7月14日	4.98	8,200	42,043.00	39,688.00	-
002249	大洋电机	2016年 6月8日	重大 事项	11.97	2016年 7月28日	10.77	2,900	30,358.62	34,713.00	-
600751	天海投资	2016年 2月15日	重大 事项	6.11	2016年 7月26日	6.72	3,900	37,124.00	23,829.00	-
000582	北部湾港	2016年 2月29日	重大 事项	16.32	-	-	1,100	25,602.06	17,952.00	-

注：本基金因重大事项停牌的股票中包含按指数收益法确定公允价值的长期停牌股票，该类股票估值采用中国证券业协会基金估值小组提供的估值方法，并于 2016 年 6 月 30 日对资产净值和本期净利润的影响均为人民币-2,130.00 元。

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

本基金本报告期末在银行间市场未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末在交易所市场未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

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

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，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持续监控上述各类风险。

本基金管理人的风险管理机构由董事会下属的公司治理与风险控制委员会、督察长、公司风险管理委员会、法律合规部、风险管理部以及各个业务部门组成。

公司实行全面、系统的风险管理，风险管理覆盖公司所有战略环节、业务环节和操作环节。同时制定了系统化的风险管理程序，对风险管理的整个流程进行评估和改进。公司构建了分工明确、相互协作、彼此牵制的风险管理组织结构，形成了由四大防线共同筑成的风险管理体系：第一道防线由各个业务部门构成，各业务部门总监作为风险责任人，负责制订本部门的作业流程以及风险控制措施；第二道监控防线由公司专属风险管理部门法律合规部和风险管理部构成，法律合规部负责对公司业务的法律合规风险进行监控管理，风险管理部负责对公司投资管理风险和运作风险进行监控管理；第三道防线是由公司经营管理层和风险管理委员会构成，公司管理层通过执行委员会下的风险管理委员会对风险状况进行全面监督并及时制定相应的对策和实施监控措施；在上述这三道风险监控防线中，公司督察长和监察稽核人员对风险控制措施和合规风险情况进行全面检查、监督，并视所发生问题情节轻重及时反馈给各部门经理、公司总经理、公司治理与风险控制委员会、董事会、监管机构。督察长独立于公司其他业务部门和公司管理层，对内部控制制度的执行情况实行严格检查和及时反馈，并独立报告；第四道监控防线由董事会下属的公司治理与风险控制委员会构成，公司治理与风险控制委员会通过督察长和监察稽核人员的工作，掌握整体风险状况并进行决策。公司治理与风险控制委员会负责检查公司业务的内控制度的实施情况，监督公司对相关法律法规和公司制度的执行。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风

险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

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。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，但标的指数成分股不受此限；本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不超过该证券的 10%，但标的指数成分股不受此限。

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；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，以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

于 2015 年 12 月 31 日和 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有按短期信用评级的债券投资。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

于 2015 年 12 月 31 日和 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有按长期信用评级的债券投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险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，另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。

本基金所持大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，因此除小部分流通受限证券外，其余均能及时变现。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资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

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

利率风险是指基金的财务状况和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。本基金主要投资于债券市场，因此本基金的收入及经营活动的现金流量受到市场利率变化的影响。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年6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	2,691,456.40	-	-	-	-	-	2,691,456.40
结算备付金	17,142.47	-	-	-	-	-	17,142.47
存出保证金	2,797.58	-	-	-	-	-	2,797.58
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-47,973,564.65	-47,973,564.65
应收证券清算款	-	-	-	-	-	682,105.41	682,105.41
应收利息	-	-	-	-	-	561.33	561.33
应收申购款	-	-	-	-	-	15,650.16	15,650.16
资产总计	2,711,396.45	-	-	-	-	-48,671,881.55	51,383,278.00
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	327,012.69	327,012.69
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	41,218.46	41,218.46
应付托管费	-	-	-	-	-	8,243.67	8,243.67
应付交易费用	-	-	-	-	-	17,470.79	17,470.79
其他负债	-	-	-	-	-	155,229.28	155,229.28
负债总计	-	-	-	-	-	549,174.89	549,174.89
利率敏感度缺口	2,711,396.45	-	-	-	-	-48,122,706.66	50,834,103.11
上年度末 2015年12月31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	3,788,726.58	-	-	-	-	-	3,788,726.58
结算备付金	161.96	-	-	-	-	-	161.96
存出保证金	39,614.90	-	-	-	-	-	39,614.90
交易性金融资产	-	-	-	-	-	55,669,225.90	55,669,225.90
应收利息	-	-	-	-	-	946.36	946.36
应收申购款	-	-	-	-	-	9,550.68	9,550.68
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	3,828,503.44	-	-	-	-	55,679,722.94	59,508,226.38
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	229,343.77	229,343.77
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	50,951.94	50,951.94
应付托管费	-	-	-	-	-	10,190.40	10,190.40
应付交易费用	-	-	-	-	-	20,352.72	20,352.72
其他负债	-	-	-	-	-	205,141.43	205,141.43
负债总计	-	-	-	-	-	515,980.26	515,980.26
利率敏感度缺口	3,828,503.44	-	-	-	-	-55,163,742.68	58,992,246.12

注：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分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金为指数型证券投资基金，于 2015 年 12 月 31 日和 2016 年 6 月 30 日，未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

无。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险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市场价格风险，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。

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 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金	公允价值	占基金资

		资产净 值比例 (%)		产净值比 例 (%)
交易性金融资产—股票投资	47,973,564.65	94.37	55,669,225.90	94.37
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	47,973,564.65	94.37	55,669,225.90	94.37

注：本基金投资于股票资产占基金资产净值的比例为 90%-95%，其中标的指数成分股票、备选成分股票占基金资产净值的比例不低于 90%。现金、债券资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产净值的比例为 5%-10%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值 5%。权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1、假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；		
	2、用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；		
	3、Beta 系数是根据组合的净值数据和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
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（2016 年 6 月 30 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准增加 5%	2,572,087.50	3,252,867.85
	业绩比较基准减少 5%	-2,572,087.50	-3,252,867.85

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，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	47,973,564.65	93.36
	其中：股票	47,973,564.65	93.36
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	2,708,598.87	5.27
7	其他各项资产	701,114.48	1.36
8	合计	51,383,278.00	100.00

注：由于四舍五入的原因金额占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	904,036.60	1.78
B	采矿业	1,988,415.63	3.91
C	制造业	28,363,555.67	55.80
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,364,620.86	2.68
E	建筑业	1,439,957.96	2.83
F	批发和零售业	2,742,132.75	5.39
G	交通运输、仓储和邮政业	1,287,958.64	2.53
H	住宿和餐饮业	83,650.00	0.16
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,063,380.18	6.03
J	金融业	231,019.80	0.45
K	房地产业	3,174,372.45	6.24
L	租赁和商务服务业	687,316.81	1.35
M	科学研究和技术服务业	220,100.16	0.43
N	水利、环境和公共设施管理业	318,447.24	0.63
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	135,877.60	0.27
R	文化、体育和娱乐业	845,284.00	1.66
S	综合	561,222.70	1.10
	合计	47,411,349.05	93.27

注：由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值比例的分项之和与合计可能有尾差。

7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	42,750.00	0.08
C	制造业	136,476.00	0.27
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	17,952.00	0.04
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	189,108.00	0.37
J	金融业	-	-
K	房地产业	175,929.60	0.35
L	租赁和商务服务业	-	-
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	562,215.60	1.11

注：由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值比例的分项之和与合计可能有尾差。

7.2.3 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002466	天齐锂业	7,560	322,736.40	0.63
2	002405	四维图新	11,065	272,199.00	0.54

3	600584	长电科技	13,300	269,857.00	0.53
4	002340	格林美	26,348	231,071.96	0.45
5	600522	中天科技	23,350	228,830.00	0.45
6	300072	三聚环保	7,640	211,169.60	0.42
7	002085	万丰奥威	11,800	202,842.00	0.40
8	600201	生物股份	7,400	202,242.00	0.40
9	002049	紫光国芯	4,600	202,170.00	0.40
10	300113	顺网科技	5,200	197,392.00	0.39
11	600521	华海药业	8,040	195,532.80	0.38
12	600079	人福医药	11,600	194,532.00	0.38
13	002572	索菲亚	3,400	190,468.00	0.37
14	600503	华丽家族	20,700	189,819.00	0.37
15	600219	南山铝业	25,600	189,440.00	0.37
16	600525	长园集团	13,560	187,806.00	0.37
17	000661	长春高新	1,720	183,489.60	0.36
18	300253	卫宁健康	7,390	182,533.00	0.36
19	002426	胜利精密	18,500	182,225.00	0.36
20	600682	南京新百	6,400	182,208.00	0.36
21	002030	达安基因	6,522	181,311.60	0.36
22	601012	隆基股份	13,746	179,385.30	0.35
23	000887	中鼎股份	7,840	173,342.40	0.34
24	002439	启明星辰	6,700	173,061.00	0.34
25	002508	老板电器	4,663	171,458.51	0.34
26	600436	片仔癀	3,800	171,038.00	0.34
27	000997	新大陆	8,520	170,740.80	0.34
28	002400	省广股份	12,080	170,690.40	0.34
29	600978	宜华生活	15,240	169,773.60	0.33
30	600699	均胜电子	4,400	168,520.00	0.33
31	002004	华邦健康	18,400	167,992.00	0.33
32	600166	福田汽车	30,400	167,808.00	0.33
33	002273	水晶光电	5,942	166,316.58	0.33
34	000983	西山煤电	20,400	166,260.00	0.33
35	600879	航天电子	10,660	166,082.80	0.33
36	600498	烽火通信	6,800	165,104.00	0.32
37	000748	长城信息	8,400	164,808.00	0.32
38	002131	利欧股份	9,600	164,064.00	0.32
39	600482	中国动力	5,000	163,850.00	0.32
40	000988	华工科技	8,100	162,405.00	0.32
41	002701	奥瑞金	18,320	161,765.60	0.32

42	002179	中航光电	3,730	161,583.60	0.32
43	002038	双鹭药业	5,300	159,954.00	0.31
44	600664	哈药股份	19,290	159,914.10	0.31
45	000970	中科三环	11,000	159,610.00	0.31
46	600122	宏图高科	11,600	155,208.00	0.31
47	300088	长信科技	10,400	154,648.00	0.30
48	600158	中体产业	8,700	154,425.00	0.30
49	000998	隆平高科	8,100	153,738.00	0.30
50	600635	大众公用	25,450	153,463.50	0.30
51	002310	东方园林	6,400	153,088.00	0.30
52	600478	科力远	12,570	151,719.90	0.30
53	000050	深天马 A	7,200	150,264.00	0.30
54	600266	北京城建	12,000	149,880.00	0.29
55	000656	金科股份	39,157	149,579.74	0.29
56	600143	金发科技	23,200	149,408.00	0.29
57	002001	新 和 成	7,000	147,910.00	0.29
58	002299	圣农发展	5,700	147,630.00	0.29
59	603019	中科曙光	3,700	147,334.00	0.29
60	000547	航天发展	9,500	145,920.00	0.29
61	000078	海王生物	19,550	145,256.50	0.29
62	600138	中青旅	7,500	144,900.00	0.29
63	002276	万马股份	7,280	144,216.80	0.28
64	600643	爱建集团	14,700	143,619.00	0.28
65	600418	江淮汽车	11,300	143,284.00	0.28
66	601168	西部矿业	24,000	142,320.00	0.28
67	300055	万邦达	7,800	142,038.00	0.28
68	002168	深圳惠程	10,060	141,644.80	0.28
69	600655	豫园商城	13,000	140,920.00	0.28
70	600487	亨通光电	11,200	140,896.00	0.28
71	600673	东阳光科	22,300	139,375.00	0.27
72	600645	中源协和	3,944	138,592.16	0.27
73	600388	龙净环保	11,000	138,160.00	0.27
74	002191	劲嘉股份	11,900	137,921.00	0.27
75	600312	平高电气	8,800	137,808.00	0.27
76	000930	中粮生化	12,500	137,250.00	0.27
77	002573	清新环境	8,100	137,052.00	0.27
78	000012	南 玻 A	11,900	136,374.00	0.27
79	300244	迪安诊断	4,120	135,877.60	0.27
80	600198	大唐电信	6,800	135,184.00	0.27

81	002074	国轩高科	3,400	134,198.00	0.26
82	600200	江苏吴中	6,900	133,653.00	0.26
83	000762	西藏矿业	5,400	133,488.00	0.26
84	600094	大名城	14,000	133,000.00	0.26
85	000031	中粮地产	14,100	132,963.00	0.26
86	000697	炼石有色	5,799	132,507.15	0.26
87	002595	豪迈科技	6,200	132,494.00	0.26
88	002221	东华能源	10,800	131,652.00	0.26
89	600594	益佰制药	8,200	131,036.00	0.26
90	600410	华胜天成	11,629	130,477.38	0.26
91	000581	威孚高科	6,400	129,024.00	0.25
92	600240	华业资本	12,860	128,857.20	0.25
93	600435	北方导航	9,600	127,776.00	0.25
94	600151	航天机电	11,300	127,690.00	0.25
95	000979	中弘股份	46,477	127,346.98	0.25
96	002714	牧原股份	2,500	126,325.00	0.25
97	002048	宁波华翔	5,500	125,785.00	0.25
98	002311	海大集团	7,960	125,529.20	0.25
99	600687	刚泰控股	7,700	125,202.00	0.25
100	600851	海欣股份	9,400	125,114.00	0.25
101	002308	威创股份	7,590	124,703.70	0.25
102	600770	综艺股份	10,000	124,600.00	0.25
103	300274	阳光电源	5,100	124,440.00	0.24
104	600160	巨化股份	11,700	124,371.00	0.24
105	000671	阳光城	20,923	124,282.62	0.24
106	002410	广联达	8,679	124,109.70	0.24
107	300010	立思辰	5,900	123,782.00	0.24
108	600497	驰宏锌锗	12,400	123,628.00	0.24
109	600499	科达洁能	7,300	123,443.00	0.24
110	600811	东方集团	18,400	122,544.00	0.24
111	000566	海南海药	11,200	122,192.00	0.24
112	600500	中化国际	13,500	122,040.00	0.24
113	000598	兴蓉环境	23,100	121,968.00	0.24
114	600601	方正科技	28,300	121,690.00	0.24
115	600171	上海贝岭	7,000	121,590.00	0.24
116	600516	方大炭素	13,300	121,562.00	0.24
117	002268	卫士通	3,400	121,516.00	0.24
118	000860	顺鑫农业	5,100	121,278.00	0.24
119	002477	雏鹰农牧	20,280	121,071.60	0.24

120	002657	中科金财	2,200	120,868.00	0.24
121	600176	中国巨石	12,597	120,553.29	0.24
122	600884	杉杉股份	7,000	120,470.00	0.24
123	000400	许继电气	7,800	120,432.00	0.24
124	002665	首航节能	15,195	119,888.55	0.24
125	600392	盛和资源	7,300	119,574.00	0.24
126	002353	杰瑞股份	6,200	119,536.00	0.24
127	600755	厦门国贸	15,020	119,409.00	0.23
128	600366	宁波韵升	5,000	119,350.00	0.23
129	000758	中色股份	15,300	118,575.00	0.23
130	002051	中工国际	6,020	118,413.40	0.23
131	300199	翰宇药业	5,800	118,030.00	0.23
132	600565	迪马股份	18,200	117,572.00	0.23
133	002366	台海核电	2,200	117,282.00	0.23
134	300115	长盈精密	5,680	117,008.00	0.23
135	300273	和佳股份	6,100	116,815.00	0.23
136	002092	中泰化学	13,701	115,910.46	0.23
137	002155	湖南黄金	8,800	115,896.00	0.23
138	000727	华东科技	35,100	115,830.00	0.23
139	600633	浙报传媒	7,700	115,808.00	0.23
140	000008	神州高铁	10,600	115,434.00	0.23
141	002223	鱼跃医疗	3,626	115,016.72	0.23
142	000690	宝新能源	16,900	114,582.00	0.23
143	600259	广晟有色	2,000	114,520.00	0.23
144	600881	亚泰集团	23,600	113,752.00	0.22
145	002512	达华智能	5,600	113,568.00	0.22
146	601929	吉视传媒	28,100	113,243.00	0.22
147	002217	合力泰	7,400	113,220.00	0.22
148	600651	飞乐音响	8,940	113,180.40	0.22
149	300182	捷成股份	6,600	112,926.00	0.22
150	600759	洲际油气	14,880	112,790.40	0.22
151	300001	特锐德	5,200	112,788.00	0.22
152	002022	科华生物	5,280	112,516.80	0.22
153	002013	中航机电	8,325	112,221.00	0.22
154	300043	互动娱乐	7,900	111,943.00	0.22
155	000878	云南铜业	10,957	111,542.26	0.22
156	002271	东方雨虹	6,466	111,409.18	0.22
157	300026	红日药业	6,400	111,296.00	0.22
158	002489	浙江永强	14,028	111,101.76	0.22

159	600611	大众交通	16,150	109,981.50	0.22
160	002444	巨星科技	5,400	109,728.00	0.22
161	600216	浙江医药	8,300	109,477.00	0.22
162	603766	隆鑫通用	5,400	109,188.00	0.21
163	601311	骆驼股份	5,500	109,175.00	0.21
164	002250	联化科技	7,575	108,474.00	0.21
165	000975	银泰资源	7,200	108,000.00	0.21
166	600528	中铁二局	9,300	107,973.00	0.21
167	600316	洪都航空	5,500	107,305.00	0.21
168	000066	长城电脑	8,400	107,100.00	0.21
169	600511	国药股份	3,900	106,938.00	0.21
170	601155	新城控股	11,500	106,490.00	0.21
171	300291	华录百纳	4,500	105,885.00	0.21
172	600787	中储股份	14,200	105,506.00	0.21
173	600572	康恩贝	16,195	104,943.60	0.21
174	600064	南京高科	7,000	104,650.00	0.21
175	600026	中海发展	17,700	104,430.00	0.21
176	600056	中国医药	6,576	104,295.36	0.21
177	000028	国药一致	1,600	104,160.00	0.20
178	000021	深科技	9,400	103,494.00	0.20
179	000973	佛塑科技	9,900	103,356.00	0.20
180	600058	五矿发展	5,500	103,235.00	0.20
181	601880	大连港	17,400	102,834.00	0.20
182	002073	软控股份	8,500	102,425.00	0.20
183	002266	浙富控股	19,110	102,238.50	0.20
184	002431	棕榈股份	8,858	101,867.00	0.20
185	000592	平潭发展	15,000	101,700.00	0.20
186	600108	亚盛集团	20,100	101,505.00	0.20
187	600597	光明乳业	8,000	101,440.00	0.20
188	002428	云南锗业	5,900	101,362.00	0.20
189	300134	大富科技	3,380	101,264.80	0.20
190	601699	潞安环能	15,400	100,716.00	0.20
191	600426	华鲁恒升	11,340	99,905.40	0.20
192	300287	飞利信	7,400	99,160.00	0.20
193	000685	中山公用	9,552	99,149.76	0.20
194	002325	洪涛股份	10,780	99,068.20	0.19
195	000786	北新建材	10,900	98,972.00	0.19
196	002437	誉衡药业	11,376	98,971.20	0.19
197	000543	皖能电力	13,860	98,960.40	0.19

198	000616	海航投资	18,520	98,896.80	0.19
199	000829	天音控股	7,400	98,790.00	0.19
200	600325	华发股份	8,900	98,523.00	0.19
201	002161	远望谷	6,600	98,274.00	0.19
202	600422	昆药集团	7,200	98,208.00	0.19
203	600260	凯乐科技	6,000	98,160.00	0.19
204	002624	完美环球	2,600	98,150.00	0.19
205	600348	阳泉煤业	15,400	98,098.00	0.19
206	001696	宗申动力	8,900	97,188.00	0.19
207	002375	亚厦股份	8,600	97,180.00	0.19
208	600073	上海梅林	8,455	96,809.75	0.19
209	600067	冠城大通	13,420	96,758.20	0.19
210	600017	日照港	23,800	96,390.00	0.19
211	002672	东江环保	5,538	95,973.54	0.19
212	600298	安琪酵母	5,300	94,552.00	0.19
213	000667	美好集团	26,400	94,248.00	0.19
214	601777	力帆股份	8,000	94,160.00	0.19
215	002368	太极股份	2,650	94,154.50	0.19
216	002063	远光软件	6,093	94,136.85	0.19
217	002002	鸿达兴业	5,000	94,000.00	0.18
218	600717	天津港	10,800	93,852.00	0.18
219	600380	健康元	10,200	93,636.00	0.18
220	002699	美盛文化	2,800	93,492.00	0.18
221	002371	七星电子	2,228	93,174.96	0.18
222	600580	卧龙电气	8,300	93,043.00	0.18
223	600808	马钢股份	38,500	92,785.00	0.18
224	000418	小天鹅 A	2,839	92,608.18	0.18
225	000969	安泰科技	6,600	92,598.00	0.18
226	002603	以岭药业	5,800	92,278.00	0.18
227	600536	中国软件	3,700	92,204.00	0.18
228	600039	四川路桥	23,400	92,196.00	0.18
229	000777	中核科技	3,880	91,412.80	0.18
230	000488	晨鸣纸业	11,500	91,310.00	0.18
231	600267	海正药业	7,500	91,125.00	0.18
232	600320	振华重工	21,414	91,009.50	0.18
233	600006	东风汽车	10,249	90,908.63	0.18
234	000848	承德露露	7,588	90,676.60	0.18
235	600967	北方创业	8,500	90,355.00	0.18
236	000810	创维数字	5,000	90,350.00	0.18

237	002056	横店东磁	5,300	90,100.00	0.18
238	000006	深振业 A	12,169	89,685.53	0.18
239	002050	三花股份	9,290	89,648.50	0.18
240	600557	康缘药业	5,472	89,357.76	0.18
241	002440	闰土股份	6,000	89,100.00	0.18
242	600161	天坛生物	3,200	88,928.00	0.17
243	600872	中炬高新	7,200	88,848.00	0.17
244	300032	金龙机电	4,400	88,440.00	0.17
245	300147	香雪制药	5,990	88,232.70	0.17
246	002640	跨境通	5,000	88,100.00	0.17
247	600773	西藏城投	5,600	87,752.00	0.17
248	600765	中航重机	6,000	87,480.00	0.17
249	000563	陕国投 A	15,920	87,400.80	0.17
250	601010	文峰股份	16,775	87,062.25	0.17
251	000939	凯迪生态	9,700	86,815.00	0.17
252	002373	千方科技	5,800	86,652.00	0.17
253	000816	智慧农业	14,600	86,286.00	0.17
254	600183	生益科技	9,300	86,211.00	0.17
255	600970	中材国际	13,650	85,995.00	0.17
256	002589	瑞康医药	2,800	85,988.00	0.17
257	000926	福星股份	7,300	85,629.00	0.17
258	002642	荣之联	3,250	85,507.50	0.17
259	600169	太原重工	21,900	85,410.00	0.17
260	002384	东山精密	4,300	85,398.00	0.17
261	000587	金洲慈航	5,500	84,865.00	0.17
262	600433	冠豪高新	9,800	84,672.00	0.17
263	600120	浙江东方	3,900	84,669.00	0.17
264	600187	国中水务	18,900	84,294.00	0.17
265	600086	东方金钰	8,700	84,216.00	0.17
266	000519	江南红箭	6,622	84,165.62	0.17
267	600736	苏州高新	9,200	83,996.00	0.17
268	600220	江苏阳光	18,400	83,904.00	0.17
269	600062	华润双鹤	4,600	83,812.00	0.16
270	600754	锦江股份	2,500	83,650.00	0.16
271	002414	高德红外	3,100	83,607.00	0.16
272	600416	湘电股份	6,700	83,549.00	0.16
273	600869	智慧能源	8,100	83,430.00	0.16
274	600880	博瑞传播	9,800	83,398.00	0.16
275	600517	置信电气	8,740	83,117.40	0.16

276	002505	大康农业	21,260	82,914.00	0.16
277	000681	视觉中国	3,500	82,775.00	0.16
278	300202	聚龙股份	3,415	82,677.15	0.16
279	600289	亿阳信通	5,900	82,541.00	0.16
280	002285	世联行	10,588	82,480.52	0.16
281	600639	浦东金桥	3,300	82,434.00	0.16
282	600537	亿晶光电	10,660	82,188.60	0.16
283	002390	信邦制药	8,850	81,774.00	0.16
284	002190	成飞集成	2,300	81,512.00	0.16
285	600587	新华医疗	3,522	81,322.98	0.16
286	000600	建投能源	9,300	81,189.00	0.16
287	601000	唐山港	20,896	81,076.48	0.16
288	002244	滨江集团	12,100	81,070.00	0.16
289	002681	奋达科技	4,800	81,024.00	0.16
290	600575	皖江物流	18,700	80,971.00	0.16
291	600694	大商股份	2,100	80,892.00	0.16
292	000961	中南建设	14,400	80,784.00	0.16
293	600458	时代新材	5,170	80,548.60	0.16
294	600409	三友化工	11,950	80,543.00	0.16
295	600270	外运发展	4,600	80,454.00	0.16
296	002358	森源电气	5,200	80,236.00	0.16
297	002011	盾安环境	7,100	80,088.00	0.16
298	002078	太阳纸业	16,400	80,032.00	0.16
299	002396	星网锐捷	4,050	79,785.00	0.16
300	600277	亿利洁能	13,400	79,730.00	0.16
301	603188	亚邦股份	4,400	79,024.00	0.16
302	600835	上海机电	4,110	78,870.90	0.16
303	600850	华东电脑	2,743	78,696.67	0.15
304	002025	航天电器	3,150	77,773.50	0.15
305	600993	马应龙	3,730	77,695.90	0.15
306	000612	焦作万方	10,880	77,683.20	0.15
307	002261	拓维信息	5,600	77,448.00	0.15
308	600563	法拉电子	1,700	77,384.00	0.15
309	000572	海马汽车	14,900	77,331.00	0.15
310	000541	佛山照明	7,490	77,072.10	0.15
311	002281	光迅科技	1,200	77,040.00	0.15
312	002635	安洁科技	2,000	76,760.00	0.15
313	600460	士兰微	9,670	76,683.10	0.15
314	002106	莱宝高科	6,400	76,032.00	0.15

315	002254	泰和新材	5,532	75,899.04	0.15
316	000513	丽珠集团	1,640	75,620.40	0.15
317	000062	深圳华强	2,800	75,600.00	0.15
318	600284	浦东建设	7,220	75,376.80	0.15
319	000401	冀东水泥	7,100	75,260.00	0.15
320	600125	铁龙物流	11,802	75,178.74	0.15
321	600805	悦达投资	8,640	74,995.20	0.15
322	002028	思源电气	6,836	74,854.20	0.15
323	002498	汉缆股份	17,200	74,648.00	0.15
324	600894	广日股份	5,600	74,648.00	0.15
325	002005	德豪润达	12,600	74,466.00	0.15
326	600729	重庆百货	3,000	74,400.00	0.15
327	002588	史丹利	6,020	74,347.00	0.15
328	600175	美都能源	15,735	73,954.50	0.15
329	600004	白云机场	6,000	73,560.00	0.14
330	000669	金鸿能源	4,400	73,480.00	0.14
331	600750	江中药业	2,300	73,140.00	0.14
332	000937	冀中能源	13,600	72,352.00	0.14
333	000869	张裕 A	1,800	72,324.00	0.14
334	000596	古井贡酒	1,500	71,925.00	0.14
335	600112	天成控股	6,440	71,870.40	0.14
336	000861	海印股份	14,490	71,580.60	0.14
337	000099	中信海直	5,500	71,500.00	0.14
338	002269	美邦服饰	16,250	71,500.00	0.14
339	601717	郑煤机	12,500	71,250.00	0.14
340	600351	亚宝药业	7,100	71,213.00	0.14
341	002344	海宁皮城	7,300	71,175.00	0.14
342	600395	盘江股份	8,600	71,036.00	0.14
343	300257	开山股份	4,300	71,036.00	0.14
344	600809	山西汾酒	3,200	70,976.00	0.14
345	600826	兰生股份	2,700	70,686.00	0.14
346	600823	世茂股份	10,370	70,412.30	0.14
347	002093	国脉科技	5,600	69,496.00	0.14
348	600859	王府井	4,540	69,189.60	0.14
349	002041	登海种业	4,450	69,153.00	0.14
350	002242	九阳股份	3,800	69,084.00	0.14
351	002479	富春环保	6,140	68,952.20	0.14
352	000090	天健集团	7,795	68,596.00	0.13
353	002317	众生药业	5,710	68,462.90	0.13

354	002463	沪电股份	12,932	68,280.96	0.13
355	601005	重庆钢铁	27,000	68,040.00	0.13
356	000620	新华联	7,400	67,710.00	0.13
357	000158	常山股份	4,800	66,672.00	0.13
358	600496	精工钢构	15,620	66,541.20	0.13
359	002663	普邦园林	9,026	66,431.36	0.13
360	002309	中利科技	3,700	66,267.00	0.13
361	600831	广电网络	5,100	66,096.00	0.13
362	000049	德赛电池	1,565	65,636.10	0.13
363	000528	柳 工	10,100	65,448.00	0.13
364	600757	长江传媒	7,800	65,442.00	0.13
365	600812	华北制药	10,500	65,205.00	0.13
366	300039	上海凯宝	6,400	65,088.00	0.13
367	600628	新世界	5,500	64,900.00	0.13
368	600059	古越龙山	6,290	64,724.10	0.13
369	002503	搜于特	5,208	64,683.36	0.13
370	000897	津滨发展	16,700	64,629.00	0.13
371	000726	鲁 泰 A	5,800	64,438.00	0.13
372	000088	盐 田 港	10,000	64,400.00	0.13
373	600614	鼎立股份	7,900	64,306.00	0.13
374	600300	维维股份	10,800	64,152.00	0.13
375	600292	远达环保	5,010	63,476.70	0.12
376	603077	和邦生物	12,900	63,468.00	0.12
377	000680	山推股份	12,800	63,104.00	0.12
378	002128	露天煤业	8,400	63,084.00	0.12
379	000636	风华高科	7,100	62,764.00	0.12
380	002727	一心堂	2,500	62,500.00	0.12
381	600236	桂冠电力	9,300	62,496.00	0.12
382	002064	华峰氨纶	13,000	62,400.00	0.12
383	000552	靖远煤电	17,700	62,304.00	0.12
384	600428	中远航运	11,100	62,271.00	0.12
385	002551	尚荣医疗	2,659	62,167.42	0.12
386	601666	平煤股份	15,100	61,759.00	0.12
387	000900	现代投资	9,158	61,724.92	0.12
388	000652	泰达股份	13,400	61,640.00	0.12
389	002267	陕天然气	5,800	60,900.00	0.12
390	000550	江铃汽车	2,500	60,900.00	0.12
391	601886	江河集团	5,900	60,593.00	0.12
392	002118	紫鑫药业	4,100	60,270.00	0.12

393	600509	天富能源	8,200	60,270.00	0.12
394	600282	南钢股份	25,600	60,160.00	0.12
395	000830	鲁西化工	13,300	60,116.00	0.12
396	002029	七匹狼	5,878	59,661.70	0.12
397	600481	双良节能	10,402	59,603.46	0.12
398	601908	京运通	7,700	59,059.00	0.12
399	600053	九鼎投资	1,700	58,871.00	0.12
400	002277	友阿股份	5,100	58,752.00	0.12
401	000426	兴业矿业	7,754	58,310.08	0.11
402	000501	鄂武商 A	3,700	58,053.00	0.11
403	601001	大同煤业	10,800	57,996.00	0.11
404	002482	广田集团	7,650	57,987.00	0.11
405	600180	瑞茂通	3,800	57,418.00	0.11
406	600586	金晶科技	13,200	56,760.00	0.11
407	000417	合肥百货	7,000	56,630.00	0.11
408	603328	依顿电子	1,900	56,126.00	0.11
409	000931	中关村	7,000	55,860.00	0.11
410	600790	轻纺城	9,500	55,765.00	0.11
411	600456	宝钛股份	2,769	55,712.28	0.11
412	600761	安徽合力	5,512	55,616.08	0.11
413	601801	皖新传媒	4,700	54,849.00	0.11
414	601126	四方股份	5,200	54,756.00	0.11
415	601678	滨化股份	10,740	54,666.60	0.11
416	002345	潮宏基	5,500	53,790.00	0.11
417	600720	祁连山	7,995	53,646.45	0.11
418	601369	陕鼓动力	8,400	53,592.00	0.11
419	600825	新华传媒	6,700	53,265.00	0.10
420	601002	晋亿实业	6,100	53,070.00	0.10
421	600748	上实发展	5,500	53,020.00	0.10
422	002332	仙琚制药	4,700	52,640.00	0.10
423	002354	天神娱乐	600	52,368.00	0.10
424	603806	福斯特	1,000	52,190.00	0.10
425	601233	桐昆股份	4,800	52,128.00	0.10
426	600551	时代出版	2,600	51,896.00	0.10
427	002251	步步高	4,000	51,880.00	0.10
428	600545	新疆城建	7,500	51,825.00	0.10
429	603699	纽威股份	2,900	51,446.00	0.10
430	600776	东方通信	6,100	51,179.00	0.10
431	600596	新安股份	7,000	51,030.00	0.10

432	600280	中央商场	7,500	50,700.00	0.10
433	002408	齐翔腾达	9,193	50,469.57	0.10
434	600329	中新药业	2,900	50,083.00	0.10
435	002698	博实股份	2,590	49,883.40	0.10
436	002342	巨力索具	8,600	49,880.00	0.10
437	603169	兰石重装	4,000	49,840.00	0.10
438	603883	老百姓	1,000	49,740.00	0.10
439	000919	金陵药业	3,775	49,414.75	0.10
440	000703	恒逸石化	5,000	49,350.00	0.10
441	000877	天山股份	7,940	49,069.20	0.10
442	002181	粤传媒	5,960	48,931.60	0.10
443	600251	冠农股份	6,100	48,800.00	0.10
444	600640	号百控股	2,899	48,674.21	0.10
445	600657	信达地产	9,700	48,306.00	0.10
446	002602	世纪华通	2,600	48,178.00	0.09
447	603567	珍宝岛	2,200	48,070.00	0.09
448	002122	天马股份	7,692	47,844.24	0.09
449	002293	罗莱生活	3,475	47,607.50	0.09
450	600195	中牧股份	2,600	47,580.00	0.09
451	601515	东风股份	4,200	47,460.00	0.09
452	002646	青青稞酒	2,300	47,403.00	0.09
453	601965	中国汽研	4,922	47,300.42	0.09
454	000030	富奥股份	6,500	46,605.00	0.09
455	000631	顺发恒业	9,496	46,245.52	0.09
456	600466	蓝光发展	5,400	46,224.00	0.09
457	600141	兴发集团	4,000	46,080.00	0.09
458	600864	哈投股份	4,100	46,043.00	0.09
459	002327	富安娜	5,378	45,766.78	0.09
460	603005	晶方科技	1,200	45,444.00	0.09
461	600132	重庆啤酒	2,990	45,418.10	0.09
462	600483	福能股份	4,000	45,400.00	0.09
463	600184	光电股份	2,000	45,280.00	0.09
464	600425	青松建化	10,600	45,050.00	0.09
465	002194	武汉凡谷	3,500	44,730.00	0.09
466	603001	奥康国际	2,100	44,646.00	0.09
467	600743	华远地产	9,436	44,632.28	0.09
468	002315	焦点科技	651	43,916.46	0.09
469	600874	创业环保	5,600	43,512.00	0.09
470	600617	国新能源	3,600	41,256.00	0.08

471	603698	航天工程	1,500	41,160.00	0.08
472	600335	国机汽车	3,650	40,916.50	0.08
473	601226	华电重工	4,400	40,348.00	0.08
474	600088	中视传媒	1,700	40,324.00	0.08
475	603555	贵人鸟	1,600	39,888.00	0.08
476	600801	华新水泥	6,300	39,753.00	0.08
477	000517	荣安地产	8,200	39,688.00	0.08
478	600468	百利电气	2,800	39,620.00	0.08
479	600397	安源煤业	8,800	38,896.00	0.08
480	002392	北京利尔	7,800	38,532.00	0.08
481	600618	氯碱化工	2,900	38,077.00	0.07
482	002233	塔牌集团	4,600	36,938.00	0.07
483	600971	恒源煤电	6,500	35,880.00	0.07
484	002216	三全食品	4,056	34,881.60	0.07
485	002249	大洋电机	2,900	34,713.00	0.07
486	600510	黑牡丹	3,933	34,295.76	0.07
487	002238	天威视讯	2,356	34,091.32	0.07
488	002745	木林森	1,000	33,990.00	0.07
489	600507	方大特钢	6,800	32,640.00	0.06
490	002461	珠江啤酒	2,700	31,374.00	0.06
491	002678	珠江钢琴	2,500	30,675.00	0.06
492	603589	口子窖	800	28,968.00	0.06
493	603198	迎驾贡酒	1,000	23,910.00	0.05
494	600751	天海投资	3,900	23,829.00	0.05
495	603355	莱克电气	600	22,860.00	0.04
496	603568	伟明环保	950	21,945.00	0.04
497	600917	重庆燃气	2,200	21,890.00	0.04
498	603025	大豪科技	600	20,142.00	0.04
499	600623	华谊集团	1,000	19,810.00	0.04

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600654	中安消	10,200	189,108.00	0.37
2	000718	苏宁环球	13,440	175,929.60	0.35
3	000511	*ST 烯碳	15,300	136,476.00	0.27
4	000693	ST 华泽	3,420	42,750.00	0.08

5	000582	北部湾港	1,100	17,952.00	0.04
---	--------	------	-------	-----------	------

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300113	顺网科技	214,144.00	0.36
2	002572	索菲亚	184,865.00	0.31
3	002426	胜利精密	182,063.00	0.31
4	600682	南京新百	176,099.00	0.30
5	600166	福田汽车	165,254.00	0.28
6	002131	利欧股份	160,221.00	0.27
7	002038	双鹭药业	159,734.00	0.27
8	000983	西山煤电	149,603.00	0.25
9	600266	北京城建	146,527.00	0.25
10	002310	东方园林	145,854.00	0.25
11	002353	杰瑞股份	131,368.00	0.22
12	002074	国轩高科	130,017.00	0.22
13	000008	神州高铁	128,538.00	0.22
14	600687	刚泰控股	128,505.00	0.22
15	000581	威孚高科	123,460.00	0.21
16	000598	兴蓉环境	122,900.00	0.21
17	600633	浙报传媒	120,485.00	0.20
18	002366	台海核电	120,452.00	0.20
19	600565	迪马股份	120,406.00	0.20
20	000400	许继电气	120,155.57	0.20

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票；
2、买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600074	保千里	202,677.00	0.34
2	600816	安信信托	202,638.00	0.34

3	600376	首开股份	171,842.00	0.29
4	002018	华信国际	162,734.51	0.28
5	002174	游族网络	147,489.00	0.25
6	300122	智飞生物	139,152.32	0.24
7	000982	中银绒业	132,618.46	0.22
8	002219	恒康医疗	126,504.00	0.21
9	300267	尔康制药	120,344.00	0.20
10	300085	银之杰	118,798.80	0.20
11	600885	宏发股份	118,231.09	0.20
12	600704	物产中大	117,755.00	0.20
13	600797	浙大网新	117,320.00	0.20
14	002180	艾派克	109,482.00	0.19
15	000732	泰禾集团	103,916.00	0.18
16	000748	长城信息	99,279.00	0.17
17	603369	今世缘	94,511.50	0.16
18	002237	恒邦股份	92,340.00	0.16
19	000650	仁和药业	92,203.50	0.16
20	600978	宜华生活	86,428.00	0.15

注：1、卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票；
2、卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	10,974,199.09
卖出股票收入（成交）总额	8,047,454.75

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 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

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序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。

7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 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持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有股指期货投资，也无期间损益。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期内，本基金未运用股指期货进行投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**7.11.1 本期国债期货投资政策**

本报告期内，本基金未运用国债期货进行投资。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货投资，也无期间损益。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本报告期内，本基金未运用国债期货进行投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 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	2,797.58
2	应收证券清算款	682,105.41
3	应收股利	-
4	应收利息	561.33
5	应收申购款	15,650.16
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	701,114.48

7.12.4 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可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600654	中安消	189,108.00	0.37	重大事项
2	000718	苏宁环球	175,929.60	0.35	重大事项
3	000511	*ST 烯碳	136,476.00	0.27	重大事项
4	000693	ST 华泽	42,750.00	0.08	重大事项
5	000582	北部湾港	17,952.00	0.04	重大事项

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 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

份额级别	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
500A	209	10,993.35	70,032.00	3.05%	2,227,578.00	96.95%
500B	320	10,770.05	734,174.00	21.30%	2,712,242.00	78.70%
工银 500	3,846	8,634.07	2,510.00	0.01%	33,204,125.52	99.99%
合计	4,375	8,903.01	806,716.00	2.07%	38,143,945.52	97.93%

8.2 期末上市基金前十名持有人

500A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	叶明	334,400.00	14.55%
2	郑志坤	272,720.00	11.87%
3	王奕	115,000.00	5.01%
4	周鹏林	102,600.00	4.47%
5	万美芳	85,000.00	3.70%
6	管艳萍	70,000.00	3.05%
7	工银瑞信基金—农业银行—中油财务有限责任公司	60,880.00	2.65%
8	张焕君	57,000.00	2.48%
9	罗杰	52,972.00	2.31%
10	苏秋刚	51,216.00	2.23%

500B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	利得资本管理有限公司—利得资本—利得盈 1 号资产管理计划	734,148.00	21.30%
2	顾红	330,994.00	9.60%
3	穆轶	300,006.00	8.70%
4	林瑞连	300,000.00	8.70%
5	黄志勤	100,000.00	2.90%
6	陈贵仁	83,756.00	2.43%
7	董翠萍	67,700.00	1.96%
8	陈镇东	64,746.00	1.88%
9	曾志坚	62,200.00	1.80%
10	姜一鸣	61,800.00	1.79%

注：以上数据由中国证券登记结算有限公司提供，持有人为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	500A	0.00	0.00%
	500B	0.00	0.00%
	工银 500	36,311.28	0.11%
	合计	36,311.28	0.09%

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

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	500A	0
	500B	0
	工银 500	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	500A	0
	500B	0
	工银 500	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	500A	500B	工银 500
基金合同生效日（2012 年 1 月 31 日） 基金份额总额	7,672,942.00	11,509,414.00	322,117,442.53
本报告期初基金份额总额	2,167,122.00	3,250,684.00	30,630,798.90
本报告期基金总申购份额	-	-	9,324,594.53
减:本报告期基金总赎回份额	-	-	7,030,305.31
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	130,488.00	195,732.00	281,547.40
本报告期末基金份额总额	2,297,610.00	3,446,416.00	33,206,635.52

注：1. 拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额，报告期末基金份额总额为三级份额之和；

2. 报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额；

3. 报告期期间基金总赎回份额含转换出份额；

4. 本基金于 2016 年 1 月 4 日进行了定期折算。

§ 10 重大事件揭示**10.1 基金份额持有人大会决议**

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

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、基金管理人：

基金管理人于 2016 年 1 月 30 日发布《工银瑞信基金管理有限公司关于副总经理变更的公告》，江明波先生、杜海涛先生、赵紫英女士自 2016 年 1 月 29 日起担任工银瑞信基金管理有限公司副总经理。

2、基金托管人托管部门：

本报告期内，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

本报告期内，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未有改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），该审计机构自基金合同生效日起向本基金提供审计服务，无改聘情况。

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

本报告期内，本基金管理人、托管人及其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	
招商证券	1	11,343,652.36	59.70%	10,337.53	59.17%	-
海通证券	1	7,658,815.88	40.30%	7,133.26	40.83%	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

国信证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-

注：1. 券商的选择标准和程序

(1) 选择标准：注重综合服务能力

a) 券商财务状况良好、经营行为规范、风险管理先进、投资风格与工银瑞信有互补性、在最近一年内无重大违规行为。

b) 券商具有较强的综合研究能力：能及时、全面、定期提供高质量的关于宏观、行业、资本市场、个股分析报告及其他丰富全面的信息咨询服务；有很强的分析能力，能根据工银瑞信所管理基金的特定要求，提供专门研究报告；具有开发量化投资组合模型的能力以及其他综合服务能力。

c) 与其他券商相比，该券商能够提供最佳交易执行和优惠合理的佣金率。

(2) 选择程序

a) 新增券商的选定：根据以上标准对券商进行考察、选择和确定。在合作之前，券商需提供至少两个季度的服务，并与其他已合作券商一起参与投资研究部门（权益投资部，固定收益部，专户投资部，研究部和中央交易室）两个季度对券商的研究服务评估。公司投委会根据对券商研究服务评估结果决定是否作为新增合作券商。

b) 签订委托协议：与被选择的券商签订委托代理协议，明确签定协议双方的公司名称、委托代理期限、佣金率、双方的权利义务等，经签章有效。

2. 券商的评估，保留和更换程序

(1) 席位的租用期限暂定为一年，合同到期 15 天内，投资研究部门将根据各券商研究在服务期间的综合证券服务质量等情况，进行评估。

(2) 对于符合标准的券商，工银瑞信将与其续约；对于不能达到标准的券商，不与其续约，并根据券商选择标准和程序，重新选择其它经营稳健、研究能力强、综合服务质量高的证券经营机构，租用其交易席位。

(3) 若券商提供的综合证券服务不符合要求，工银瑞信有权按照委托协议规定，提前中止租用其交易席位。

证券公司席位的变更情况

在报告期内本基金退租西南证券股份有限公司的 26435 上海交易单元。

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

无。

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	关于工银瑞信睿智中证 500 指数分级证券投资基金之 A 份额 2016 年度约定年基准收益率的公告	中国证监会指定的媒介	2016 年 1 月 5 日
2	关于工银瑞信睿智中证 500 指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务期间 500A 份额停牌的公告	中国证监会指定的媒介	2016 年 1 月 5 日
3	关于 500A 定期份额折算后次日前收盘价调整的风险提示公告	中国证监会指定的媒介	2016 年 1 月 6 日
4	关于工银瑞信睿智中证 500 指数分级证券投资基金定期份额折算结果及恢复交易的公告	中国证监会指定的媒介	2016 年 1 月 6 日
5	工银瑞信基金管理有限公司关于浙江金观诚财富管理有限公司费率调整的公告	中国证监会指定的媒介	2016 年 1 月 12 日
6	工银瑞信基金管理有限公司关于副总经理变更的公告	中国证监会指定的媒介	2016 年 1 月 30 日
7	工银瑞信基金管理有限公司北京分公司关于营业场所变更的公告	中国证监会指定的媒介	2016 年 3 月 15 日
8	工银瑞信基金管理有限公司关于增加浙江同花顺基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会指定的媒介	2016 年 3 月 25 日
9	工银瑞信基金管理有限公司关于深圳市新兰德证券投资咨询有限公司费率调整的公告	中国证监会指定的媒介	2016 年 4 月 5 日
10	工银瑞信基金管理有限公司关于增加奕丰金融服务（深圳）有限公司为旗下基金销售机构并实行费率优惠的公告	中国证监会指定的媒介	2016 年 4 月 22 日
11	工银瑞信基金管理有限公司关于中证金牛（北京）投资咨询有限公司费率调整的公告	中国证监会指定的媒介	2016 年 5 月 7 日
12	关于工银瑞信基金管理有限公司网上交易支付宝渠道关闭基金支付服务的公告	中国证监会指定的媒介	2016 年 5 月 11 日
13	关于工银瑞信基金管理有限公司淘宝基金店关闭申购服务的公告	中国证监会指定的媒介	2016 年 5 月 11 日
14	工银瑞信基金管理有限公司关于增加杭州银行股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会指定的媒介	2016 年 5 月 27 日
15	工银瑞信基金管理有限公司关于	中国证监会指定的	2016 年 6 月 2 日

	增加珠海盈米财富管理有限公司为旗下基金销售机构并进行费率调整的公告	媒介	
16	关于直销电子自助交易系统继续开展基金转换费率优惠活动的公告	中国证监会指定的媒介	2016 年 6 月 28 日
17	工银瑞信基金管理有限公司关于直销渠道招商银行网银支付方式基金申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定的媒介	2016 年 6 月 30 日
18	工银瑞信基金管理有限公司关于调整京东金融平台基金申购费率优惠的公告	中国证监会指定的媒介	2016 年 6 月 30 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

本基金以 2016 年 1 月 4 日为份额折算基准日，对工银瑞信睿智中证 500 指数分级证券投资基金之基础份额的场外份额、场内份额和工银瑞信睿智中证 500 指数分级证券投资基金之 A 份额实施定期份额折算。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准工银瑞信睿智中证 500 指数分级证券投资基金设立的文件
- 2、《工银瑞信睿智中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》
- 3、《工银瑞信睿智中证 500 指数分级证券投资基金托管协议》
- 4、《工银瑞信睿智中证 500 指数分级证券投资基金招募说明书》
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 7、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告

12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

投资者可于营业时间免费查阅，或登录基金管理人网站查阅。也可在支付工本费后，在合理时间内取得上述文件的复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人——工银瑞信基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-811-9999

网址：www.icbccs.com.cn