

工银瑞信睿智中证 500 指数分级证券投资
基金
2017 年半年度报告

2017 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：二〇一七年八月二十五日

§ 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 2017 年 8 月 23 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 2017 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	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 其他指标.....	10
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告.....	40
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	40
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.....	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	57
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.....	57
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.....	57
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.....	57
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.....	57
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	57
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	58
7.12 投资组合报告附注.....	58
§8 基金份额持有人信息.....	60
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	60
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	60
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	61
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.....	61
§9 开放式基金份额变动.....	63
§10 重大事件揭示.....	64
10.1 基金份额持有人大会决议.....	64
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.....	64
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	64
10.4 基金投资策略的改变.....	64
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	64
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.....	64
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	65
10.8 其他重大事件.....	66

§11 影响投资者决策的其他重要信息	68
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	68
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	68
§12 备查文件目录	69
12.1 备查文件目录.....	69
12.2 存放地点.....	69
12.3 查阅方式.....	69

§ 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	82,115,558.50 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 年 3 月 30 日		
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	11,988,426.00 份	17,982,640.00 份	52,144,492.50 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(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	-2,841,132.87
本期利润	-1,714,191.04
加权平均基金份额本期利润	-0.0223
本期加权平均净值利润率	-1.73%
本期基金份额净值增长率	-2.56%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	29,861,828.28
期末可供分配基金份额利润	0.3637
期末基金资产净值	103,760,573.82
期末基金份额净值	1.2636
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	40.41%

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、本期已实现收益是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、所列数据截止到报告期最后一日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

4、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	5.13%	0.87%	5.12%	0.89%	0.01%	-0.02%
过去三个月	-4.18%	0.97%	-3.90%	0.97%	-0.28%	0.00%
过去六个月	-2.56%	0.85%	-1.87%	0.85%	-0.69%	0.00%
过去一年	-1.70%	0.85%	0.29%	0.86%	-1.99%	-0.01%
过去三年	30.83%	2.11%	54.18%	1.96%	-23.35%	0.15%

自基金合同生效以来	40.41%	1.78%	82.78%	1.70%	-42.37%	0.08%
-----------	--------	-------	--------	-------	---------	-------

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，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。公司目前在北京、上海、深圳设有分公司，在香港和上海设有全资子公司——工银瑞信资产管理（国际）有限公司、工银瑞信投资管理有限公司。

公司（含子公司）拥有公募基金、特定资产管理、企业年金基金投资管理、全国社会保障基金境内外投资管理、基本养老保险基金证券投资管理、保险资产管理、企业年金养老金产品投资管理、QDII、QFII、RQFII 等多项业务资格。

截至 2017 年 6 月 30 日，公司旗下管理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 7 天理财债券型证券投资基金、工银瑞信增强收益债券型证券投资基金、工银瑞信金融地产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、工银瑞信沪港深股票型证券投资基金、工银瑞信中国机会全球配置股票型证券投资基金、工银瑞信沪深 300 指数证券投资基金、深证红利交易型开放式指数证券投资基金、上证中央企业 50 交易型开放式指数证券投资基金等 110 只公募基金。

公司始终坚持“以稳健的投资管理，为客户提供卓越的理财服务”为使命，依托强大的股东背景、稳健的经营理念、科学的投研体系、严密的风控机制和资深的管理团队，立足市场化、专业化、规范化和国际化，坚持“稳健投资、价值投资、长期投资”，致力于为广大投资者提供一流的投资管理服务。

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	-	7	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、任职日期为基金合同生效日或本基金管理人对外披露的任职日期；离职日期为本基金管理人对外披露的离职日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券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 2 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，本基金跟踪误差产生的主要来源是：1) 申购赎回的影响；2) 成分股票的停牌；3) 指数成分股调整等。

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-2.56%，业绩比较基准收益率为-1.87%。

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

本基金在报告期内没有触及 2014 年 8 月 8 日生效的《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条规定的条件。

§ 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：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	5,742,598.00	7,999,700.48
结算备付金		-	129,792.77
存出保证金		17,002.96	18,497.06
交易性金融资产	6.4.7.2	98,411,250.84	90,647,044.92
其中：股票投资		98,411,250.84	90,647,044.92
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		-	-
应收利息	6.4.7.5	1,096.62	2,000.23
应收股利		-	-
应收申购款		19,094.48	37,726.48
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		104,191,042.90	98,834,761.94
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 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		113,908.14	349,085.60
应付管理人报酬		81,622.15	84,658.20
应付托管费		16,324.43	16,931.61
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	73,970.21	91,358.19

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	144,644.15	151,315.58
负债合计		430,469.08	693,349.18
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	73,898,745.54	68,100,563.27
未分配利润	6.4.7.10	29,861,828.28	30,040,849.49
所有者权益合计		103,760,573.82	98,141,412.76
负债和所有者权益总计		104,191,042.90	98,834,761.94

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 2017 年 6 月 30 日，基金份额总额 82,115,558.50 份。其中，工银 500 份额净值 1.2636 元，基金份额为 52,144,492.50 份；500A 份额净值 1.0245 元，基金份额为 11,988,426.00 份；500B 份额净值 1.4230 元，基金份额为 17,982,640.00 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		-816,618.27	-10,338,546.68
1.利息收入		25,627.30	14,357.02
其中：存款利息收入	6.4.7.11	25,627.30	14,357.02
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）		-2,025,625.64	-1,399,515.47
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-2,546,963.62	-1,659,119.26
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	521,337.98	259,603.79
3.公允价值变动收益（损失以	6.4.7.17	1,126,941.83	-8,963,286.33

“-”号填列)			
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	56,438.24	9,898.10
减：二、费用		897,572.77	524,985.43
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	487,854.53	242,544.86
2. 托管费	6.4.10.2.2	97,570.91	48,508.90
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	116,680.87	27,205.31
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	195,466.46	206,726.36
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)		-1,714,191.04	-10,863,532.11
减：所得税费用		-	-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)		-1,714,191.04	-10,863,532.11

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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 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)	68,100,563.27	30,040,849.49	98,141,412.76
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	-1,714,191.04	-1,714,191.04
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)	5,798,182.27	1,535,169.83	7,333,352.10
其中：1. 基金申购款	37,970,381.59	16,825,852.88	54,796,234.47
2. 基金赎回款	-32,172,199.32	-15,290,683.05	-47,462,882.37
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)	-	-	-

号填列)			
五、期末所有者权益(基金净值)	73,898,745.54	29,861,828.28	103,760,573.82
项目	上年度可比期间 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

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：

<u>郭特华</u>	<u>郝炜</u>	<u>朱辉毅</u>
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，场外认购的全部份额将确认为睿智 500 份额；场内认购的全部份额将按 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。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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年上半年的经营成果和净值变动情况。

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。

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[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政策的补充通知》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。对证券投资基金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，对国债、地方政府债以及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，股票的股息、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，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 2017 年 6 月 30 日
活期存款	5,742,598.00
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	5,742,598.00

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	104,722,605.10	98,411,250.84	-6,311,354.26
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	104,722,605.10	98,411,250.84	-6,311,354.26

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 2017年6月30日
应收活期存款利息	1,089.02
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	-
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	7.60
合计	1,096.62

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 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	73,970.21
银行间市场应付交易费用	-
合计	73,970.21

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
----	-------------------

应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	426.41
预提信息披露费	44,629.17
预提上市费	29,752.78
预提审计费	19,835.79
指数使用费	50,000.00
合计	144,644.15

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	74,533,429.54	68,100,563.27
本期申购	164,977.14	150,739.19
本期赎回(以“-”号填列)	-22,399.23	-20,466.12
2017年1月3日 基金拆分/份额折算前	74,676,007.45	68,230,836.34
基金拆分/份额折算变动份额	1,142,240.57	-
本期申购	42,024,407.19	37,819,642.40
本期赎回(以“-”号填列)	-35,727,096.71	-32,151,733.20
本期末	82,115,558.50	73,898,745.54

注：“本期申购”中包含红利再投、转入份额及金额，“本期赎回”中包含转出份额及金额。

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	56,969,547.01	-26,928,697.52	30,040,849.49
本期利润	-2,841,132.87	1,126,941.83	-1,714,191.04
本期基金份额交易产生的变动数	4,710,860.34	-3,175,690.51	1,535,169.83
其中：基金申购款	31,241,011.43	-14,415,158.55	16,825,852.88
基金赎回款	-26,530,151.09	11,239,468.04	-15,290,683.05
本期已分配利润	-	-	-
本期末	58,839,274.48	-28,977,446.20	29,861,828.28

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	24,076.61
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	910.05
其他	640.64
合计	25,627.30

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
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	35,820,331.41
减：卖出股票成本总额	38,367,295.03
买卖股票差价收入	-2,546,963.62

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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	521,337.98
基金投资产生的股利收益	-
合计	521,337.98

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	1,126,941.83
——股票投资	1,126,941.83
——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	1,126,941.83

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	56,438.24
合计	56,438.24

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	116,680.87
银行间市场交易费用	-
合计	116,680.87

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
审计费用	19,835.79
信息披露费	44,629.17
指数使用费	100,000.00
上市年费	29,752.78
银行费用	1,248.72
合计	195,466.46

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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	487,854.53	242,544.86
其中：支付销售机构的客户维护费	95,467.53	73,652.69

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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	97,570.91	48,508.90

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 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016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	5,742,598.00	24,076.61	2,691,456.40	14,042.40

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

无。

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（2017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/增发证券而流通受限的证券。

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
600643	爱建集团	2017年4月17日	重大事项	16.31	2017年8月2日	16.48	40,500	527,881.65	660,555.00	指数法估值
000656	金科股份	2017年5月5日	重大事	6.54	2017年7月5日	5.92	84,157	459,329.24	550,386.78	-

		日	项		日					
002168	深圳惠程	2017年1月23日	重大事件	16.99	-	-	19,160	262,849.39	325,528.40	-
000887	中鼎股份	2017年4月27日	重大事件	22.09	2017年7月14日	19.88	12,140	273,175.07	268,172.60	-
600655	豫园商城	2016年12月20日	重大事件	11.32	-	-	23,600	335,146.20	267,152.00	-
600673	东阳光科	2016年11月15日	重大事件	7.29	-	-	34,500	286,627.83	251,505.00	-
002127	南极电商	2017年6月29日	重大事件	12.08	2017年7月6日	12.61	18,800	232,660.00	227,104.00	-
002013	中航机电	2017年5月12日	重大事件	10.33	2017年8月2日	11.36	21,487	243,453.55	221,960.71	-
300134	大富科技	2017年2月9日	重大事件	23.36	-	-	9,180	269,033.09	214,444.80	-
300088	长信科技	2016年9月12日	重大事件	15.75	2017年8月9日	14.50	11,800	144,453.55	185,850.00	-
002399	海普瑞	2017年4月28日	重大事件	20.23	-	-	8,236	152,924.85	166,614.28	-
600545	新疆城建	2017年6月22日	重大事件	11.96	2017年7月3日	12.44	13,300	159,966.29	159,068.00	-
601717	郑煤机	2017年4月24日	重大事件	7.79	-	-	20,300	159,338.08	158,137.00	-

		日	项								
300291	华录百纳	2017年4月19日	重大事项	20.02	-	-	7,800	229,273.04	156,156.00	-	
600277	亿利洁能	2017年3月6日	重大事项	7.83	-	-	19,500	129,481.85	152,685.00	-	
000061	农产品	2017年6月28日	重大事项	9.06	-	-	16,700	151,859.86	151,302.00	-	
002358	森源电气	2017年5月12日	重大事项	17.02	2017年7月12日	16.68	8,400	167,444.61	142,968.00	-	
002642	荣之联	2017年4月10日	重大事项	25.06	2017年7月7日	22.54	5,690	188,158.04	142,591.40	-	
002505	大康农业	2017年3月13日	重大事项	3.50	-	-	38,460	140,176.69	134,610.00	-	
002128	露天煤业	2017年3月17日	重大事项	8.70	2017年8月14日	9.57	15,300	143,194.28	133,110.00	-	
002122	天马股份	2017年4月24日	重大事项	9.66	2017年7月24日	11.15	13,592	147,022.07	131,298.72	-	指数法估值
002681	奋达科技	2017年6月22日	重大事项	12.59	2017年7月3日	12.70	9,200	145,078.46	115,828.00	-	
000099	中信海直	2017年5月4日	重大事项	11.26	-	-	9,600	127,898.46	108,096.00	-	
601001	大同煤业	2017年6月22日	重大事	5.25	2017年7月21日	5.78	20,500	140,598.22	107,625.00	-	

		日	项		日						
600289	亿阳 信通	2017 年 5 月 10 日	重 大 事 项	10.94	2017 年 8 月 18 日	12.03	9,800	140,334.84	107,212.00		-
600657	信达 地产	2017 年 2 月 20 日	重 大 事 项	5.76	2017 年 8 月 10 日	6.19	18,200	122,707.18	104,832.00		-
600460	士兰 微	2017 年 5 月 12 日	重 大 事 项	6.07	2017 年 8 月 15 日	6.68	17,170	121,486.12	104,221.90		-
002025	航天 电器	2016 年 9 月 12 日	重 大 事 项	24.95	2017 年 7 月 4 日	22.46	3,750	82,899.72	93,562.50		-
000511	*ST 烯碳	2017 年 5 月 2 日	重 大 事 项	5.27	-	-	15,300	138,373.83	80,631.00		-
600468	百利 电气	2017 年 5 月 16 日	重 大 事 项	6.50	-	-	7,350	72,521.32	47,775.00		-
000693	*ST 华泽	2016 年 3 月 1 日	重 大 事 项	12.50	-	-	3,420	91,898.93	42,750.00		-

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 2017 年 6 月 30 日对资产净值和本期净利润的影响均为人民币 45,166.12 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

本基金本报告期末未持有银行间市场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

本基金本报告期末未持有交易所市场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

本基金本报告期末及上年度末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

本基金本报告期末及上年度末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约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 2017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	5,742,598.00	-	-	-	-	-	5,742,598.00
存出保证金	17,002.96	-	-	-	-	-	17,002.96
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-98,411,250.84	98,411,250.84
应收利息	-	-	-	-	-	1,096.62	1,096.62
应收申购款	-	-	-	-	-	19,094.48	19,094.48
资产总计	5,759,600.96	-	-	-	-	-98,431,441.94	104,191,042.90
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	113,908.14	113,908.14
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	81,622.15	81,622.15
应付托管费	-	-	-	-	-	16,324.43	16,324.43
应付交易费用	-	-	-	-	-	73,970.21	73,970.21
其他负债	-	-	-	-	-	144,644.15	144,644.15
负债总计	-	-	-	-	-	430,469.08	430,469.08
利率敏感度缺口	5,759,600.96	-	-	-	-	-98,000,972.86	103,760,573.82
上年度末 2016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	7,999,700.48	-	-	-	-	-	7,999,700.48
结算备付金	129,792.77	-	-	-	-	-	129,792.77
存出保证金	18,497.06	-	-	-	-	-	18,497.06
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-90,647,044.92	90,647,044.92
应收利息	-	-	-	-	-	2,000.23	2,000.23
应收申购款	-	-	-	-	-	37,726.48	37,726.48
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	8,147,990.31	-	-	-	-	-90,686,771.63	98,834,761.94
负债							

应付赎回款	-	-	-	-	349,085.60	349,085.60
应付管理人报酬	-	-	-	-	84,658.20	84,658.20
应付托管费	-	-	-	-	16,931.61	16,931.61
应付交易费用	-	-	-	-	91,358.19	91,358.19
其他负债	-	-	-	-	151,315.58	151,315.58
负债总计	-	-	-	-	693,349.18	693,349.18
利率敏感度缺口	8,147,990.31	-	-	-	-89,993,422.45	98,141,412.76

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

本基金本报告期末及上年度末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 2017年6月30日		上年度末 2016年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产—股票投资	98,411,250.84	94.84	90,647,044.92	92.36
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	98,411,250.84	94.84	90,647,044.92	92.36
----	---------------	-------	---------------	-------

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	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；		
	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；		
	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（2017 年 6 月 30 日）	上年度末（2016 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准增加 5%	5,172,261.34	4,946,322.83
	业绩比较基准减少 5%	-5,172,261.34	-4,946,322.83

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

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定：（1）金融商品持有期间（含到期）取得的非保本收益（合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益），不征收增值税；（2）纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；（3）资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管

理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

§ 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	98,411,250.84	94.45
	其中：股票	98,411,250.84	94.45
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	5,742,598.00	5.51
7	其他各项资产	37,194.06	0.04
8	合计	104,191,042.90	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	1,235,893.90	1.19
B	采矿业	3,089,241.41	2.98
C	制造业	60,459,977.05	58.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,378,843.70	3.26
E	建筑业	2,222,499.26	2.14
F	批发和零售业	4,930,890.55	4.75
G	交通运输、仓储和邮政业	2,607,020.24	2.51
H	住宿和餐饮业	105,690.00	0.10
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,736,035.86	6.49
J	金融业	1,631,126.40	1.57
K	房地产业	6,083,686.35	5.86

L	租赁和商务服务业	1,847,482.42	1.78
M	科学研究和技术服务业	237,267.92	0.23
N	水利、环境和公共设施管理业	852,424.80	0.82
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	116,529.00	0.11
Q	卫生和社会工作	252,309.20	0.24
R	文化、体育和娱乐业	1,144,820.00	1.10
S	综合	454,479.00	0.44
	合计	97,386,217.06	93.86

注：由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例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	采矿业	42,750.00	0.04
C	制造业	982,283.78	0.95
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	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
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	1,025,033.78	0.99

注：由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例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港股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	300136	信维通信	19,300	772,386.00	0.74
2	600643	爱建集团	40,500	660,555.00	0.64
3	600487	亨通光电	21,300	597,465.00	0.58
4	002460	赣锋锂业	12,900	596,625.00	0.58
5	002572	索菲亚	13,600	557,600.00	0.54
6	000656	金科股份	84,157	550,386.78	0.53
7	600201	生物股份	14,800	526,436.00	0.51
8	601012	隆基股份	29,346	501,816.60	0.48
9	300156	神雾环保	14,900	488,124.00	0.47
10	002271	东方雨虹	12,966	481,038.60	0.46
11	600176	中国巨石	43,056	472,754.88	0.46
12	600219	南山铝业	136,150	461,548.50	0.44
13	603799	华友钴业	7,300	443,694.00	0.43
14	600525	长园集团	32,360	439,772.40	0.42
15	002405	四维图新	21,965	434,028.40	0.42
16	600079	人福医药	22,100	433,602.00	0.42
17	000661	长春高新	3,320	428,645.20	0.41
18	600315	上海家化	13,200	428,340.00	0.41
19	000050	深天马 A	20,600	423,742.00	0.41
20	600642	申能股份	67,000	422,100.00	0.41
21	600584	长电科技	25,400	407,670.00	0.39
22	000998	隆平高科	18,500	407,370.00	0.39
23	002092	中泰化学	31,601	401,332.70	0.39
24	002340	格林美	65,552	396,589.60	0.38
25	000066	中国长城	43,332	390,421.32	0.38
26	300115	长盈精密	13,314	388,502.52	0.37
27	300266	兴源环境	12,400	380,928.00	0.37
28	300296	利亚德	20,000	376,000.00	0.36

29	000997	新大陆	16,120	365,762.80	0.35
30	002050	三花智控	22,090	360,508.80	0.35
31	601168	西部矿业	46,800	359,892.00	0.35
32	600516	方大炭素	25,300	359,766.00	0.35
33	600291	西水股份	16,100	354,200.00	0.34
34	600879	航天电子	39,988	351,494.52	0.34
35	002422	科伦药业	21,250	351,050.00	0.34
36	600325	华发股份	41,640	347,694.00	0.34
37	000786	北新建材	21,900	346,896.00	0.33
38	600056	中国医药	13,076	339,322.20	0.33
39	002407	多氟多	15,400	338,646.00	0.33
40	600266	北京城建	23,100	335,874.00	0.32
41	000039	中集集团	18,600	335,358.00	0.32
42	600022	山东钢铁	161,020	331,701.20	0.32
43	000778	新兴铸管	48,900	327,630.00	0.32
44	600839	四川长虹	90,500	327,610.00	0.32
45	600426	华鲁恒升	27,782	326,160.68	0.31
46	600388	龙净环保	21,000	326,130.00	0.31
47	600166	福田汽车	114,600	325,464.00	0.31
48	600521	华海药业	15,379	323,574.16	0.31
49	000581	威孚高科	12,300	318,570.00	0.31
50	600161	天坛生物	8,190	317,853.90	0.31
51	600435	北方导航	22,000	314,820.00	0.30
52	600528	中铁工业	21,800	311,522.00	0.30
53	002410	广联达	16,479	309,805.20	0.30
54	000970	中科三环	20,700	305,946.00	0.29
55	000999	华润三九	9,600	304,800.00	0.29
56	002179	中航光电	9,739	303,759.41	0.29
57	002217	合力泰	30,700	303,316.00	0.29
58	002366	台海核电	6,400	300,224.00	0.29
59	000028	国药一致	3,700	299,330.00	0.29
60	600138	中青旅	14,200	299,052.00	0.29
61	600699	均胜电子	9,300	298,437.00	0.29
62	600600	青岛啤酒	8,500	298,350.00	0.29
63	002573	清新环境	15,700	295,474.00	0.28
64	002038	双鹭药业	10,100	294,415.00	0.28
65	600978	宜华生活	29,140	292,857.00	0.28
66	601000	唐山港	55,896	291,777.12	0.28
67	600260	凯乐科技	11,500	291,410.00	0.28

68	002223	鱼跃医疗	12,289	291,003.52	0.28
69	300383	光环新网	21,300	288,828.00	0.28
70	603589	口子窖	7,400	287,046.00	0.28
71	600614	鹏起科技	26,000	286,000.00	0.28
72	002311	海大集团	15,560	284,281.20	0.27
73	600158	中体产业	16,600	283,860.00	0.27
74	000488	晨鸣纸业	21,900	282,510.00	0.27
75	300002	神州泰岳	33,700	281,058.00	0.27
76	002583	海能达	17,100	275,139.00	0.27
77	000878	云南铜业	20,857	275,103.83	0.27
78	300113	顺网科技	10,200	274,380.00	0.26
79	300055	万邦达	14,900	274,160.00	0.26
80	002078	太阳纸业	37,300	274,155.00	0.26
81	002004	华邦健康	34,900	273,267.00	0.26
82	600511	国药股份	7,500	271,800.00	0.26
83	600503	华丽家族	39,200	270,872.00	0.26
84	002030	达安基因	12,422	270,675.38	0.26
85	002019	亿帆医药	16,200	270,216.00	0.26
86	002273	水晶光电	13,042	269,056.46	0.26
87	000400	许继电气	14,900	267,604.00	0.26
88	603019	中科曙光	9,500	267,330.00	0.26
89	600655	豫园商城	23,600	267,152.00	0.26
90	002244	滨江集团	38,200	264,344.00	0.25
91	600298	安琪酵母	10,100	261,287.00	0.25
92	000566	海南海药	19,700	261,222.00	0.25
93	600392	盛和资源	19,800	261,162.00	0.25
94	600755	厦门国贸	28,620	261,014.40	0.25
95	002001	新和成	13,400	260,094.00	0.25
96	002384	东山精密	10,500	259,350.00	0.25
97	600808	马钢股份	73,200	259,128.00	0.25
98	600635	大众公用	47,450	258,602.50	0.25
99	600717	天津港	20,600	257,294.00	0.25
100	300324	旋极信息	14,100	257,184.00	0.25
101	000547	航天发展	24,600	257,070.00	0.25
102	000930	中粮生化	23,700	255,486.00	0.25
103	600633	浙数文化	13,200	255,024.00	0.25
104	000418	小天鹅A	5,439	254,490.81	0.25
105	000401	冀东水泥	16,500	253,935.00	0.24
106	600240	华业资本	27,960	253,317.60	0.24

107	300244	迪安诊断	8,020	252,309.20	0.24
108	002176	江特电机	28,900	252,008.00	0.24
109	600122	宏图高科	22,700	251,970.00	0.24
110	600673	东阳光科	34,500	251,505.00	0.24
111	601231	环旭电子	16,000	251,360.00	0.24
112	600872	中炬高新	13,700	250,710.00	0.24
113	002491	通鼎互联	18,600	249,984.00	0.24
114	600160	巨化股份	20,700	249,021.00	0.24
115	300146	汤臣倍健	18,000	247,320.00	0.24
116	000598	兴蓉环境	44,000	247,280.00	0.24
117	300058	蓝色光标	31,600	247,112.00	0.24
118	000960	锡业股份	18,100	246,341.00	0.24
119	002601	龙麟佰利	15,000	245,700.00	0.24
120	002439	启明星辰	13,200	245,520.00	0.24
121	600418	江淮汽车	23,200	244,760.00	0.24
122	600500	中化国际	25,500	243,780.00	0.23
123	000825	太钢不锈	56,000	243,600.00	0.23
124	600062	华润双鹤	8,834	242,316.62	0.23
125	300159	新研股份	18,300	242,292.00	0.23
126	002408	齐翔腾达	21,793	241,466.44	0.23
127	600143	金发科技	40,000	241,200.00	0.23
128	002400	省广股份	29,944	240,450.32	0.23
129	002354	天神娱乐	11,080	238,220.00	0.23
130	000685	中山公用	21,752	238,184.40	0.23
131	600594	益佰制药	15,500	236,530.00	0.23
132	000089	深圳机场	25,200	235,620.00	0.23
133	000078	海王生物	39,050	235,471.50	0.23
134	000513	丽珠集团	3,440	234,264.00	0.23
135	000729	燕京啤酒	34,600	232,512.00	0.22
136	000979	中弘股份	88,377	231,547.74	0.22
137	601699	潞安环能	29,400	229,908.00	0.22
138	600312	平高电气	16,700	229,458.00	0.22
139	600409	三友化工	22,750	229,092.50	0.22
140	600811	东方集团	35,000	228,200.00	0.22
141	600884	杉杉股份	13,800	227,286.00	0.22
142	002127	南极电商	18,800	227,104.00	0.22
143	600881	亚泰集团	44,700	227,076.00	0.22
144	000926	福星股份	18,600	226,920.00	0.22
145	600967	内蒙一机	16,600	226,258.00	0.22

146	002051	中工国际	10,904	226,039.92	0.22
147	300122	智飞生物	11,800	225,498.00	0.22
148	002640	跨境通	10,600	225,250.00	0.22
149	000697	炼石有色	10,999	225,149.53	0.22
150	601880	大连港	75,920	224,723.20	0.22
151	600566	济川药业	5,900	224,377.00	0.22
152	600970	中材国际	25,750	223,767.50	0.22
153	000690	宝新能源	37,400	223,652.00	0.22
154	002431	棕榈股份	20,258	223,243.16	0.22
155	000988	华工科技	15,300	223,227.00	0.22
156	002373	千方科技	16,300	222,332.00	0.21
157	600026	中远海能	33,500	222,105.00	0.21
158	600809	山西汾酒	6,400	222,016.00	0.21
159	002013	中航机电	21,487	221,960.71	0.21
160	002701	奥瑞金	34,620	221,221.80	0.21
161	600499	科达洁能	27,800	220,732.00	0.21
162	600307	酒钢宏兴	76,900	219,165.00	0.21
163	000806	银河生物	16,200	218,700.00	0.21
164	002390	信邦制药	25,050	218,185.50	0.21
165	600664	哈药股份	37,490	217,816.90	0.21
166	002048	宁波华翔	10,400	216,944.00	0.21
167	002512	达华智能	13,400	216,410.00	0.21
168	002221	东华能源	19,800	216,018.00	0.21
169	000600	建投能源	17,600	215,952.00	0.21
170	300253	卫宁健康	27,501	214,782.81	0.21
171	300134	大富科技	9,180	214,444.80	0.21
172	600094	大名城	27,952	214,391.84	0.21
173	600863	内蒙华电	71,200	214,312.00	0.21
174	600787	中储股份	27,000	213,570.00	0.21
175	600183	生益科技	17,300	213,482.00	0.21
176	600572	康恩贝	30,795	213,101.40	0.21
177	000012	南玻A	22,600	210,858.00	0.20
178	002635	安洁科技	5,800	210,076.00	0.20
179	002191	劲嘉股份	22,400	209,664.00	0.20
180	002665	首航节能	29,095	209,484.00	0.20
181	600874	创业环保	10,700	209,399.00	0.20
182	000592	平潭发展	37,900	209,208.00	0.20
183	300026	红日药业	44,300	208,653.00	0.20
184	300166	东方国信	15,519	208,420.17	0.20

185	000667	美好置业	62,800	207,868.00	0.20
186	002028	思源电气	13,036	207,793.84	0.20
187	000816	智慧农业	27,800	206,832.00	0.20
188	002444	巨星科技	13,200	205,656.00	0.20
189	600478	科力远	23,870	205,520.70	0.20
190	002477	雏鹰农牧	46,280	205,020.40	0.20
191	300001	特锐德	12,200	204,472.00	0.20
192	002603	以岭药业	11,700	204,282.00	0.20
193	000006	深振业 A	23,169	204,118.89	0.20
194	600017	日照港	45,300	203,850.00	0.20
195	000732	泰禾集团	12,200	203,496.00	0.20
196	000758	中色股份	29,000	203,290.00	0.20
197	603077	和邦生物	39,500	201,055.00	0.19
198	000031	中粮地产	26,700	201,051.00	0.19
199	600064	南京高科	13,300	200,830.00	0.19
200	000975	银泰资源	15,900	200,817.00	0.19
201	600125	铁龙物流	22,402	200,721.92	0.19
202	600348	阳泉煤业	29,600	200,688.00	0.19
203	002672	东江环保	11,838	199,943.82	0.19
204	600120	浙江东方	7,400	198,912.00	0.19
205	000158	常山股份	12,500	197,500.00	0.19
206	600565	迪马股份	35,800	197,258.00	0.19
207	000939	凯迪生态	38,600	196,860.00	0.19
208	000563	陕国投 A	38,020	196,563.40	0.19
209	000027	深圳能源	29,200	196,516.00	0.19
210	000860	顺鑫农业	9,800	196,098.00	0.19
211	002250	联化科技	13,575	194,122.50	0.19
212	300287	飞利信	21,100	193,698.00	0.19
213	300274	阳光电源	17,400	192,966.00	0.19
214	600198	大唐电信	15,100	192,827.00	0.19
215	600597	光明乳业	15,100	192,525.00	0.19
216	600410	华胜天成	21,729	192,518.94	0.19
217	300116	坚瑞沃能	17,900	192,425.00	0.19
218	002261	拓维信息	16,400	192,044.00	0.19
219	000877	天山股份	15,140	191,823.80	0.18
220	002468	申通快递	7,500	190,575.00	0.18
221	600416	湘电股份	13,900	190,430.00	0.18
222	002308	威创股份	14,590	190,399.50	0.18
223	002266	浙富控股	38,910	189,880.80	0.18

224	000727	华东科技	66,800	189,044.00	0.18
225	603766	隆鑫通用	25,850	188,188.00	0.18
226	600687	刚泰控股	14,600	188,048.00	0.18
227	600200	江苏吴中	14,200	187,440.00	0.18
228	002517	恺英网络	5,300	186,507.00	0.18
229	600582	天地科技	40,600	186,354.00	0.18
230	300088	长信科技	11,800	185,850.00	0.18
231	002002	鸿达兴业	23,711	185,657.13	0.18
232	600039	四川路桥	44,500	185,120.00	0.18
233	601929	吉视传媒	53,500	185,110.00	0.18
234	002353	杰瑞股份	11,700	185,094.00	0.18
235	601928	凤凰传媒	18,700	182,512.00	0.18
236	600466	蓝光发展	21,000	181,230.00	0.17
237	601689	拓普集团	5,400	180,846.00	0.17
238	002544	杰赛科技	7,900	180,120.00	0.17
239	000712	锦龙股份	11,000	180,070.00	0.17
240	600282	南钢股份	48,500	179,935.00	0.17
241	600751	天海投资	31,600	179,804.00	0.17
242	600086	东方金钰	16,600	179,446.00	0.17
243	603000	人民网	13,600	179,112.00	0.17
244	002396	星网锐捷	9,250	178,987.50	0.17
245	300257	开山股份	8,400	177,072.00	0.17
246	600380	健康元	19,400	176,152.00	0.17
247	002375	亚厦股份	19,700	175,527.00	0.17
248	002022	科华生物	10,080	175,089.60	0.17
249	000501	鄂武商 A	9,480	175,000.80	0.17
250	002670	国盛金控	10,980	174,582.00	0.17
251	600151	航天机电	21,200	174,476.00	0.17
252	000519	中兵红箭	13,822	174,157.20	0.17
253	000830	鲁西化工	25,200	173,880.00	0.17
254	300199	翰宇药业	11,300	173,342.00	0.17
255	002268	卫士通	10,260	172,573.20	0.17
256	002440	闰土股份	11,300	172,438.00	0.17
257	002281	光迅科技	7,700	171,094.00	0.16
258	600169	太原重工	44,200	170,612.00	0.16
259	002489	浙江永强	26,728	170,524.64	0.16
260	600316	洪都航空	10,600	170,342.00	0.16
261	002368	太极股份	6,150	170,293.50	0.16
262	002589	瑞康医药	11,050	170,170.00	0.16

263	600611	大众交通	30,750	169,740.00	0.16
264	000703	恒逸石化	11,900	169,456.00	0.16
265	002155	湖南黄金	17,700	169,389.00	0.16
266	600366	宁波韵升	9,600	169,344.00	0.16
267	600759	洲际油气	27,880	168,952.80	0.16
268	600270	外运发展	8,900	168,477.00	0.16
269	002657	中科金财	5,800	168,142.00	0.16
270	000528	柳工	19,400	167,616.00	0.16
271	600694	大商股份	4,300	167,571.00	0.16
272	600835	上海机电	7,910	167,217.40	0.16
273	002342	巨力索具	16,500	166,155.00	0.16
274	600267	海正药业	14,170	165,505.60	0.16
275	600108	亚盛集团	38,300	165,073.00	0.16
276	002709	天赐材料	4,000	164,680.00	0.16
277	300273	和佳股份	13,500	164,160.00	0.16
278	000612	焦作万方	20,380	164,059.00	0.16
279	600187	国中水务	32,400	163,620.00	0.16
280	000090	天健集团	14,695	163,114.50	0.16
281	600563	法拉电子	3,300	163,053.00	0.16
282	600557	康缘药业	9,772	162,312.92	0.16
283	601678	滨化股份	23,340	162,213.00	0.16
284	600993	马应龙	7,430	161,825.40	0.16
285	600645	中源协和	7,544	161,667.92	0.16
286	002285	世联行	20,088	161,105.76	0.16
287	002503	搜于特	22,916	161,099.48	0.16
288	600729	重庆百货	6,000	161,040.00	0.16
289	600848	上海临港	7,400	159,544.00	0.15
290	000937	冀中能源	26,000	159,120.00	0.15
291	600545	新疆城建	13,300	159,068.00	0.15
292	600098	广州发展	20,100	158,991.00	0.15
293	000049	德赛电池	3,065	158,797.65	0.15
294	601717	郑煤机	20,300	158,137.00	0.15
295	600765	中航重机	11,400	157,092.00	0.15
296	002437	誉衡药业	21,576	157,073.28	0.15
297	300291	华录百纳	7,800	156,156.00	0.15
298	002325	洪涛股份	21,380	156,074.00	0.15
299	000021	深科技	18,100	155,298.00	0.15
300	000587	金洲慈航	10,400	154,960.00	0.15
301	000543	皖能电力	26,460	154,261.80	0.15

302	300376	易事特	17,000	154,190.00	0.15
303	000810	创维数字	12,700	154,051.00	0.15
304	600300	维维股份	28,800	153,792.00	0.15
305	600073	上海梅林	16,055	153,325.25	0.15
306	002249	大洋电机	23,300	153,314.00	0.15
307	600422	昆药集团	13,500	153,090.00	0.15
308	600750	江中药业	4,400	152,900.00	0.15
309	002018	华信国际	22,300	152,755.00	0.15
310	600277	亿利洁能	19,500	152,685.00	0.15
311	000829	天音控股	14,100	152,280.00	0.15
312	002011	盾安环境	13,400	152,090.00	0.15
313	000766	通化金马	9,493	151,698.14	0.15
314	002056	横店东磁	20,200	151,500.00	0.15
315	000061	农产品	16,700	151,302.00	0.15
316	000777	中核科技	7,580	151,296.80	0.15
317	601016	节能风电	40,900	150,512.00	0.15
318	000669	金鸿能源	8,300	150,479.00	0.15
319	600639	浦东金桥	8,300	150,396.00	0.14
320	000636	风华高科	17,600	149,776.00	0.14
321	002317	众生药业	12,010	149,164.20	0.14
322	000897	津滨发展	31,700	148,990.00	0.14
323	603188	亚邦股份	8,500	148,240.00	0.14
324	002242	九阳股份	7,500	147,525.00	0.14
325	601311	骆驼股份	10,400	147,264.00	0.14
326	600284	浦东建设	13,620	146,006.40	0.14
327	000572	海马汽车	28,200	145,794.00	0.14
328	000762	西藏矿业	10,200	144,534.00	0.14
329	600259	广晟有色	3,700	144,448.00	0.14
330	600651	飞乐音响	17,040	144,328.80	0.14
331	600770	综艺股份	19,200	144,000.00	0.14
332	600496	精工钢构	29,620	143,064.60	0.14
333	002358	森源电气	8,400	142,968.00	0.14
334	000596	古井贡酒	2,800	142,660.00	0.14
335	002642	荣之联	5,690	142,591.40	0.14
336	603444	吉比特	500	141,665.00	0.14
337	002123	梦网荣信	12,700	141,097.00	0.14
338	600587	新华医疗	7,922	140,853.16	0.14
339	002106	莱宝高科	13,900	140,807.00	0.14
340	600216	浙江医药	14,200	140,722.00	0.14

341	000062	深圳华强	5,300	140,609.00	0.14
342	002254	泰和新材	10,532	140,075.60	0.13
343	600536	中国软件	7,300	139,868.00	0.13
344	002276	万马股份	13,780	139,040.20	0.13
345	002064	华峰氨纶	28,800	138,816.00	0.13
346	000848	承德露露	13,888	138,602.24	0.13
347	300010	立思辰	10,700	138,565.00	0.13
348	002479	富春环保	11,640	138,516.00	0.13
349	002428	云南锗业	12,800	136,704.00	0.13
350	002073	软控股份	16,100	136,528.00	0.13
351	002482	广田集团	15,150	136,198.50	0.13
352	600458	时代新材	11,870	135,911.50	0.13
353	002707	众信旅游	10,300	135,239.00	0.13
354	002332	仙琚制药	15,700	135,020.00	0.13
355	002505	大康农业	38,460	134,610.00	0.13
356	600171	上海贝岭	13,200	134,244.00	0.13
357	000652	泰达股份	25,300	134,090.00	0.13
358	002128	露天煤业	15,300	133,110.00	0.13
359	000680	山推股份	24,400	132,980.00	0.13
360	000620	新华联	18,600	132,246.00	0.13
361	002122	天马股份	13,592	131,298.72	0.13
362	600428	中远海特	21,100	131,242.00	0.13
363	000969	安泰科技	15,020	131,124.60	0.13
364	000541	佛山照明	14,390	131,092.90	0.13
365	002463	沪电股份	28,732	130,730.60	0.13
366	600058	五矿发展	10,500	130,305.00	0.13
367	603883	老百姓	2,633	128,095.45	0.12
368	001696	宗申动力	16,800	127,176.00	0.12
369	300297	蓝盾股份	11,600	127,020.00	0.12
370	002690	美亚光电	6,600	126,588.00	0.12
371	600329	中新药业	6,989	126,570.79	0.12
372	601233	桐昆股份	9,100	126,126.00	0.12
373	600517	置信电气	16,640	125,964.80	0.12
374	000726	鲁泰A	10,600	125,716.00	0.12
375	300043	星辉娱乐	15,300	125,613.00	0.12
376	600894	广日股份	10,600	125,504.00	0.12
377	600736	苏州高新	17,600	124,432.00	0.12
378	000426	兴业矿业	13,754	124,061.08	0.12
379	601777	力帆股份	15,400	123,816.00	0.12

380	600859	王府井	7,640	123,386.00	0.12
381	600805	悦达投资	16,740	123,039.00	0.12
382	603556	海兴电力	2,800	122,892.00	0.12
383	002063	远光软件	11,793	122,883.06	0.12
384	600880	博瑞传播	18,800	122,764.00	0.12
385	603369	今世缘	9,300	122,760.00	0.12
386	600586	金晶科技	25,000	122,250.00	0.12
387	600790	轻纺城	17,900	121,899.00	0.12
388	600338	西藏珠峰	3,200	121,568.00	0.12
389	603888	新华网	3,750	121,462.50	0.12
390	000616	海航投资	28,120	120,916.00	0.12
391	000552	靖远煤电	33,800	120,666.00	0.12
392	600220	江苏阳光	35,000	120,050.00	0.12
393	002663	普邦股份	21,926	119,058.18	0.11
394	600720	祁连山	15,195	118,976.85	0.11
395	600395	盘江股份	16,200	118,746.00	0.11
396	600773	西藏城投	10,700	118,449.00	0.11
397	002727	一心堂	6,400	117,760.00	0.11
398	603816	顾家家居	2,000	117,560.00	0.11
399	603355	莱克电气	2,000	117,540.00	0.11
400	300147	香雪制药	11,390	116,975.30	0.11
401	603377	东方时尚	3,100	116,529.00	0.11
402	002681	奋达科技	9,200	115,828.00	0.11
403	601886	江河集团	11,300	115,825.00	0.11
404	600006	东风汽车	19,749	115,531.65	0.11
405	300039	上海凯宝	15,820	115,011.40	0.11
406	002269	美邦服饰	30,750	114,697.50	0.11
407	002041	登海种业	8,650	114,612.50	0.11
408	002005	德豪润达	24,000	114,480.00	0.11
409	600801	华新水泥	12,000	114,360.00	0.11
410	002120	韵达股份	2,200	113,520.00	0.11
411	002345	潮宏基	10,400	113,048.00	0.11
412	002190	成飞集成	4,200	112,560.00	0.11
413	600596	新安股份	13,300	112,385.00	0.11
414	603198	迎驾贡酒	5,900	112,277.00	0.11
415	002277	友阿股份	17,400	112,230.00	0.11
416	600053	九鼎投资	3,200	111,872.00	0.11
417	600280	中央商场	14,100	111,813.00	0.11
418	300032	金龙机电	8,000	111,600.00	0.11

419	600757	长江传媒	14,900	111,303.00	0.11
420	300202	聚龙股份	6,715	110,931.80	0.11
421	000417	合肥百货	13,400	110,550.00	0.11
422	600059	古越龙山	11,890	109,982.50	0.11
423	600628	新世界	9,500	109,725.00	0.11
424	600869	智慧能源	16,300	109,699.00	0.11
425	002588	史丹利	14,220	109,351.80	0.11
426	600141	兴发集团	8,800	108,856.00	0.10
427	600580	卧龙电气	15,900	108,438.00	0.10
428	002371	北方华创	4,528	108,309.76	0.10
429	000099	中信海直	9,600	108,096.00	0.10
430	000681	视觉中国	6,900	108,054.00	0.10
431	601001	大同煤业	20,500	107,625.00	0.10
432	002147	新光圆成	6,900	107,226.00	0.10
433	600289	亿阳信通	9,800	107,212.00	0.10
434	002233	塔牌集团	8,800	107,096.00	0.10
435	600754	锦江股份	3,900	105,690.00	0.10
436	600481	双良节能	19,802	105,148.62	0.10
437	600657	信达地产	18,200	104,832.00	0.10
438	002344	海宁皮城	12,600	104,832.00	0.10
439	600460	士兰微	17,170	104,221.90	0.10
440	600292	远达环保	9,610	103,595.80	0.10
441	600195	中牧股份	5,300	102,767.00	0.10
442	600537	亿晶光电	20,160	100,396.80	0.10
443	601002	晋亿实业	11,600	100,340.00	0.10
444	600971	恒源煤电	12,300	99,999.00	0.10
445	600862	中航高科	10,300	99,807.00	0.10
446	600640	号百控股	5,899	99,693.10	0.10
447	002309	中利集团	7,900	98,829.00	0.10
448	600748	上实发展	13,590	97,848.00	0.09
449	600743	华远地产	23,167	97,764.74	0.09
450	600184	光电股份	5,000	93,800.00	0.09
451	002699	美盛文化	6,720	92,736.00	0.09
452	600251	冠农股份	11,600	92,452.00	0.09
453	603169	兰石重装	7,600	92,340.00	0.09
454	600826	兰生股份	5,100	92,310.00	0.09
455	600996	贵广网络	7,700	92,169.00	0.09
456	600335	国机汽车	7,550	90,298.00	0.09
457	600831	广电网络	9,000	89,550.00	0.09

458	002551	尚荣医疗	5,459	88,053.67	0.08
459	002392	北京利尔	14,700	87,171.00	0.08
460	002093	国脉科技	9,900	87,120.00	0.08
461	002118	紫鑫药业	12,600	86,058.00	0.08
462	002414	高德红外	4,600	84,180.00	0.08
463	002416	爱施德	7,600	82,004.00	0.08
464	600776	东方通信	11,700	79,326.00	0.08
465	000536	华映科技	13,560	78,783.60	0.08
466	603005	晶方科技	2,800	78,372.00	0.08
467	002251	步步高	6,300	78,057.00	0.08
468	600551	时代出版	4,900	77,371.00	0.07
469	002646	青青稞酒	4,408	76,963.68	0.07
470	603698	航天工程	3,000	75,600.00	0.07
471	603868	飞科电器	1,200	74,208.00	0.07
472	603001	奥康国际	3,900	73,281.00	0.07
473	000517	荣安地产	15,700	73,005.00	0.07
474	603568	伟明环保	3,350	72,427.00	0.07
475	603567	珍宝岛	4,100	69,003.00	0.07
476	603328	依顿电子	4,800	67,920.00	0.07
477	000025	特力A	1,300	67,262.00	0.06
478	600936	广西广电	8,300	66,981.00	0.06
479	603528	多伦科技	4,600	66,102.00	0.06
480	600126	杭钢股份	9,600	65,856.00	0.06
481	002807	江阴银行	5,200	65,156.00	0.06
482	603806	福斯特	2,000	64,020.00	0.06
483	600618	氯碱化工	5,500	58,740.00	0.06
484	603228	景旺电子	1,200	57,900.00	0.06
485	603515	欧普照明	1,600	57,792.00	0.06
486	002315	焦点科技	2,302	57,411.88	0.06
487	601020	华钰矿业	2,600	57,278.00	0.06
488	603866	桃李面包	1,600	56,928.00	0.05
489	002194	武汉凡谷	5,500	48,675.00	0.05
490	002818	富森美	1,100	43,417.00	0.04
491	603658	安图生物	1,000	43,100.00	0.04
492	002815	崇达技术	1,300	42,952.00	0.04
493	600917	重庆燃气	4,200	39,606.00	0.04
494	603877	太平鸟	1,400	39,186.00	0.04
495	601811	新华文轩	2,500	38,900.00	0.04
496	000761	本钢板材	7,400	38,702.00	0.04

497	603569	长久物流	1,100	36,773.00	0.04
498	603025	大豪科技	1,200	31,680.00	0.03

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	002168	深圳惠程	19,160	325,528.40	0.31
2	000887	中鼎股份	12,140	268,172.60	0.26
3	002399	海普瑞	8,236	166,614.28	0.16
4	002025	航天电器	3,750	93,562.50	0.09
5	000511	*ST 烯碳	15,300	80,631.00	0.08
6	600468	百利电气	7,350	47,775.00	0.05
7	000693	*ST 华泽	3,420	42,750.00	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	000066	中国长城	508,483.04	0.52
2	600642	申能股份	416,396.00	0.42
3	600525	长园集团	373,401.00	0.38
4	000778	新兴铸管	347,711.00	0.35
5	000547	航天发展	347,318.00	0.35
6	603799	华友钴业	329,647.00	0.34
7	000039	中集集团	315,356.00	0.32
8	600839	四川长虹	313,996.00	0.32
9	300002	神州泰岳	283,162.00	0.29
10	300136	信维通信	270,690.00	0.28
11	300383	光环新网	267,909.00	0.27
12	002583	海能达	259,352.00	0.26

13	000050	深天马 A	258,976.00	0.26
14	300058	蓝色光标	256,262.00	0.26
15	600176	中国巨石	242,431.00	0.25
16	000729	燕京啤酒	233,204.00	0.24
17	002127	南极电商	232,660.00	0.24
18	002601	龙麟佰利	229,076.00	0.23
19	600566	济川药业	223,651.00	0.23
20	300146	汤臣倍健	212,782.00	0.22

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	600522	中天科技	672,375.50	0.69
2	002508	老板电器	670,704.72	0.68
3	600682	南京新百	564,561.00	0.58
4	600436	片仔癀	536,122.00	0.55
5	000959	首钢股份	372,502.00	0.38
6	002602	世纪华通	341,853.00	0.35
7	600497	驰宏锌锗	333,376.00	0.34
8	002595	豪迈科技	294,300.30	0.30
9	600601	方正科技	271,540.00	0.28
10	000961	中南建设	240,071.00	0.24
11	600549	厦门钨业	233,223.00	0.24
12	600575	皖江物流	226,727.00	0.23
13	600067	冠城大通	222,352.20	0.23
14	000066	中国长城	207,164.00	0.21
15	600851	海欣股份	206,868.00	0.21
16	600175	美都能源	194,526.25	0.20
17	002581	未名医药	190,553.00	0.19
18	000973	佛塑科技	190,375.00	0.19
19	601010	文峰股份	179,379.25	0.18
20	600823	世茂股份	178,587.22	0.18

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	45,004,559.12
卖出股票收入（成交）总额	35,820,331.41

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 基金投资的前十名股票没有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	17,002.96
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,096.62
5	应收申购款	19,094.48
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	37,194.06

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

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	600643	爱建集团	660,555.00	0.64	重大事项
2	000656	金科股份	550,386.78	0.53	重大事项

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	002168	深圳惠程	325,528.40	0.31	重大事项
2	000887	中鼎股份	268,172.60	0.26	重大事项
3	002399	海普瑞	166,614.28	0.16	重大事项
4	002025	航天电器	93,562.50	0.09	重大事项
5	000511	*ST 烯碳	80,631.00	0.08	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	177	67,731.22	8,847,181.00	73.80%	3,141,245.00	26.20%
500B	310	58,008.52	6,016,148.00	33.46%	11,966,492.00	66.54%
工银500	6,041	8,631.77	8,422,674.56	16.15%	43,721,817.94	83.85%
合计	6,528	12,578.98	23,286,003.56	28.36%	58,829,554.94	71.64%

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	恒天中岩投资管理有限公司—恒天华夏未来一期证券投资基金	1,720,926.00	14.35%
2	华夏未来资本管理有限公司—华夏未来添时1号基金	1,327,404.00	11.07%
3	华夏未来资本管理有限公司—华夏未来添时2号基金	1,218,078.00	10.16%
4	未来泽时(上海)资产管理中心(有限合伙)—华夏未来添时三号私	1,137,788.00	9.49%
5	鲁利玲	587,844.00	4.90%
6	华夏未来资本管理有限公司—华夏未来泽时进取1号基金	544,868.00	4.54%
7	梁小红	535,912.00	4.47%
8	中国对外经济贸易信托有限公司—外贸信托—华夏未来泽时进取6号	483,728.00	4.03%
9	郑志坤	462,688.00	3.86%
10	鹏华资产—中信银行—鹏华资产华夏未来泽时进取7号1期资产	349,080.00	2.91%

500B

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额
----	-------	---------	--------

			比例
1	冯建霖	6,756,034.00	37.57%
2	福建道冲投资管理有限公司一道冲补天 1 号私募基金	4,995,900.00	27.78%
3	鲁利玲	881,766.00	4.90%
4	利得资本管理有限公司一利得资本一利得盈 1 号资产管理计划	734,148.00	4.08%
5	郑志坤	444,570.00	2.47%
6	顾红	330,994.00	1.84%
7	林瑞连	300,000.00	1.67%
8	工银瑞信基金一农业银行一中油财务有限责任公司	260,478.00	1.45%
9	郑凯鹏	201,794.00	1.12%
10	黄之林	189,900.00	1.06%

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	16,907.75	0.02%
	合计	16,907.75	0.02%

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
本报告期期初基金份额总额	12,284,858.00	18,427,288.00	43,821,283.54
本报告期基金总申购份额	-	-	42,189,384.33
减：本报告期基金总赎回份额	-	-	35,749,495.94
本报告期基金拆分变动份额（份额减少 以“-”填列）	-296,432.00	-444,648.00	1,883,320.57
本报告期末基金份额总额	11,988,426.00	17,982,640.00	52,144,492.50

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 2017 年 1 月 3 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 2017 年 2 月 8 日发布《工银瑞信基金管理有限公司董事长变更公告》，经基金管理人第六十一次股东会和第四届董事会第二十六次会议审议通过，沈立强先生辞去公司董事长职务，董事长变更为尚军先生。

基金管理人于 2017 年 4 月 25 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》，郝炜先生自 2017 年 4 月 19 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	42,924,626.39	53.42%	39,117.46	52.88%	-
海通证券	1	37,422,378.06	46.58%	34,852.75	47.12%	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	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。

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	2017 年 1 月 4 日
2	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 2017 年度约定年基准收益率的公告	中国证监会指定的媒介	2017 年 1 月 4 日
3	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	2017 年 1 月 5 日
4	关于 500A 定期份额折算后次日前收盘价调整的公告	中国证监会指定的媒介	2017 年 1 月 5 日
5	关于增加大同证券有限责任公司为工银瑞信基金管理有限公司旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会指定的媒介	2017 年 1 月 26 日
6	工银瑞信基金管理有限公司董事长变更公告	中国证监会指定的媒介	2017 年 2 月 8 日
7	工银瑞信基金管理有限公司关于增加上海基煜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	2017 年 3 月 21 日
8	关于增加江海证券有限公司为工银瑞信基金管理有限公司旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会指定的媒介	2017 年 3 月 23 日
9	关于增加北京肯特瑞财富投资管理有限公司为旗下基金销售机构	中国证监会指定的媒介	2017 年 4 月 20 日

	并进行费率调整的公告		
10	工银瑞信基金管理有限公司关于旗下基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	中国证监会指定的媒介	2017 年 4 月 22 日
11	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	2017 年 4 月 25 日
12	《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施风险提示公告	中国证监会指定的媒介	2017 年 4 月 25 日
13	《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施风险提示公告	中国证监会指定的媒介	2017 年 4 月 26 日
14	《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施风险提示公告	中国证监会指定的媒介	2017 年 4 月 27 日
15	《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施风险提示公告	中国证监会指定的媒介	2017 年 4 月 28 日
16	《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施风险提示公告	中国证监会指定的媒介	2017 年 4 月 29 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

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》的规定，基金定期份额折算基准日为每个会计年度第一个工作日。工银瑞信睿智中证 500 指数分级证券投资基金在 2017 年 1 月 3 日办理定期份额折算业务，详见基金管理人官网 2017 年 1 月 5 日《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》。

§ 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