

# 工银瑞信新得益混合型证券投资基金 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：中国民生银行股份有限公司

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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 21 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

|  |           |
|--|-----------|
| <b>§1 重要提示及目录</b> .....                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示.....                                | 2         |
| 1.2 目录.....                                  | 3         |
| <b>§2 基金简介</b> .....                         | <b>6</b>  |
| 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         |
| <b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....                | <b>8</b>  |
| 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.....                                | 9         |
| <b>§4 管理人报告</b> .....                        | <b>10</b> |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况.....                        | 10        |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....              | 14        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....                 | 14        |
| 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.....             | 14        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....             | 15        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                | 15        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                 | 16        |
| 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.....       | 16        |
| <b>§5 托管人报告</b> .....                        | <b>17</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....                  | 17        |
| 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..... | 17        |
| 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.....      | 17        |
| <b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....              | <b>18</b> |
| 6.1 资产负债表.....                               | 18        |
| 6.2 利润表.....                                 | 19        |

|  |           |
|--|-----------|
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....                    | 20        |
| 6.4 报表附注.....                              | 21        |
| <b>§7 投资组合报告.....</b>                      | <b>44</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况.....                        | 44        |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....                    | 44        |
| 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.....     | 45        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                   | 46        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                  | 48        |
| 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.....    | 48        |
| 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..... | 49        |
| 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..... | 49        |
| 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.....    | 49        |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....             | 49        |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....             | 50        |
| 7.12 投资组合报告附注.....                         | 50        |
| <b>§8 基金份额持有人信息.....</b>                   | <b>52</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....                 | 52        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....              | 52        |
| 8.3 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.....     | 52        |
| <b>§9 开放式基金份额变动.....</b>                   | <b>53</b> |
| <b>§10 重大事件揭示.....</b>                     | <b>54</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议.....                      | 54        |
| 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.....      | 54        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....           | 54        |
| 10.4 基金投资策略的改变.....                        | 54        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....                 | 54        |
| 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.....         | 54        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....                | 54        |
| 10.8 其他重大事件.....                           | 56        |
| <b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>             | <b>58</b> |

|  |           |
|--|-----------|
| 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 ..... | 58        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....                 | 58        |
| <b>§12 备查文件目录.....</b>                   | <b>59</b> |
| 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       | 工银瑞信新得益混合型证券投资基金 |
| 基金简称       | 工银新得益混合          |
| 基金主代码      | 002006           |
| 基金运作方式     | 契约型开放式           |
| 基金合同生效日    | 2016 年 11 月 22 日 |
| 基金管理人      | 工银瑞信基金管理有限公司     |
| 基金托管人      | 中国民生银行股份有限公司     |
| 报告期末基金份额总额 | 622,512,904.47 份 |
| 基金合同存续期    | 不定期              |

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过资产配置，力求实现基金资产的持续稳健增值。   |
| 投资策略   | 本基金将由投资研究团队及时跟踪市场环境变化，根据对国际及国内宏观经济运行态势、宏观经济政策变化、证券市场运行状况等因素的深入研究，判断证券市场的发展趋势，结合行业状况、公司价值性和成长性分析，综合评价各类资产的风险收益水平。在充分的宏观形势判断和策略分析的基础上，执行“自上而下”的资产配置及动态调整策略。在市场上涨阶段中，增加权益类资产配置比例；在市场下行周期中，增加固定收益类资产配置比例，最终力求实现基金资产组合收益的最大化，从而有效提高不同市场状况下基金资产的整体收益水平。本基金采取“自上而下”与“自下而上”相结合的分析方法进行股票投资。基金管理人在行业分析的基础上，选择治理结构完善、经营稳健、业绩优良、具有可持续增长前景或价值被低估的上市公司股票，以合理价格买入并进行中长期投资。本基金股票投资具体包括行业分析与配置、公司财务状况评价、价值评估及股票选择与组合优化等过程。 |
| 业绩比较基准 | 30%×沪深 300 指数收益率+70%×中债综合财富指数收益率。   |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，预期收益和风险水平低于股票型基金，高于债券型基金与货币市场基金。  |

## 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   | 中国民生银行股份有限公司          |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 朱碧艳  | 罗菲菲                   |
|         | 联系电话 | 400-811-9999   | 010-58560666          |
|         | 电子邮箱 | customerservice@icbccs.com.cn  | tgbfxjdzx@cmbc.com.cn |
| 客户服务电话  |      | 400-811-9999   | 95568                 |
| 传真      |      | 010-66583158   | 010-58560798          |
| 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 2 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 2 号      |
| 邮政编码    |      | 100033   | 100031                |
| 法定代表人   |      | 郭特华  | 洪崎                    |

## 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 | 工银瑞信基金管理有限公司 | 北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 A 座 6-9 层 |

## §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       | 19,236,341.37               |
| 本期利润          | 37,641,122.26               |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0472                      |
| 本期加权平均净值利润率   | 4.67%                       |
| 本期基金份额净值增长率   | 5.23%                       |
| 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      | 16,565,230.75               |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0266                      |
| 期末基金资产净值      | 650,879,183.09              |
| 期末基金份额净值      | 1.046                       |
| 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   | 4.60%                       |

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2016年11月22日。截至报告期末，本基金基金合同生效不满一年。

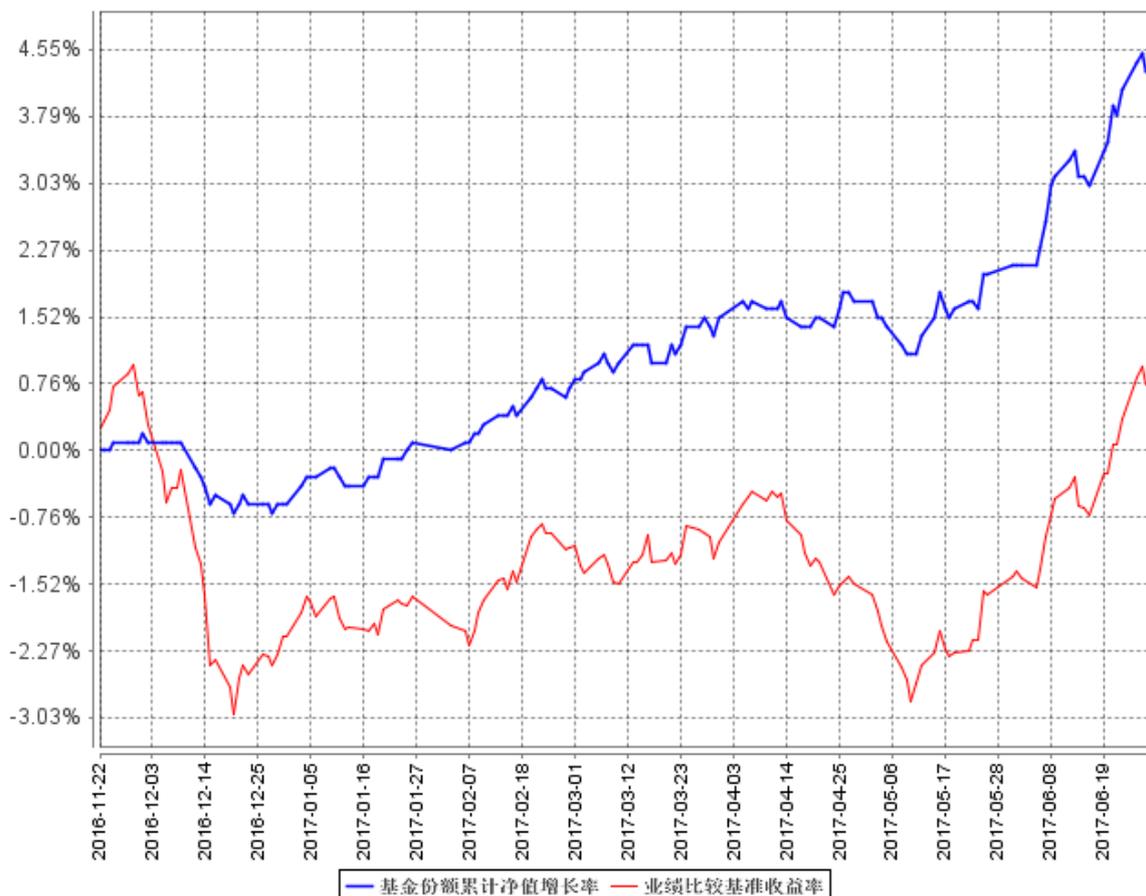
### 3.2 基金净值表现

#### 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      | 2.45%    | 0.19%       | 2.36%      | 0.21%         | 0.09% | -0.02% |
| 过去三个月      | 3.05%    | 0.16%       | 1.97%      | 0.21%         | 1.08% | -0.05% |
| 过去六个月      | 5.23%    | 0.13%       | 3.07%      | 0.19%         | 2.16% | -0.06% |
| 自基金合同生效起至今 | 4.60%    | 0.13%       | 0.90%      | 0.22%         | 3.70% | -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 2016 年 11 月 22 日生效。截至报告期末，本基金基金合同生效不满一年。

2、按基金合同规定，本基金建仓期为 6 个月。建仓期满，本基金的各项投资比例符合基金合同关于投资范围及投资限制的规定：本基金投资组合中股票资产投资比例为基金资产的 0%—30%；每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值的 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券。

### 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 |        |   |
| 魏欣 | 固定收益部副总监，本基金的基金经理 | 2016 年 11 月 22 日 | -    | 12     | 2005 年加入工银瑞信，现任固定收益部副总监；2011 年 4 月 20 日至今，担任工银货币市场基金基金经理；2012 年 8 月 22 日至今，担任工银瑞信 7 天理财债券型基金基金经 |

|  |  |  |  |   |
|--|--|--|--|---|
|  |  |  |  | <p>理；2012 年 10 月 26 日至 2017 年 3 月 10 日，担任工银 14 天理财债券型基金的基金经理；2014 年 9 月 23 日至今，担任工银瑞信现金快线货币市场基金基金经理；2014 年 10 月 22 日至 2017 年 3 月 10 日，担任工银添益快线货币市场基金基金经理；2015 年 5 月 26 日起至今，担任工银新财富灵活配置混合型基金基金经理；2015 年 5 月 26 日起至今，担任工银双利债券型基金基金经理；2015 年 5 月 29 日起至今，担任工银丰盈回报灵活配置混合型基金基金经理；2015 年 6 月 19 日至 2017 年 3 月 10 日，担任工银财富快线货币市场基金基金经理；2016 年 11 月 22 日至今，担任工银瑞信新得益混合型证券投资基金基金经理；2016 年 12 月 7 日至今，担任工银瑞信新得润混合型证券投资基金基金经理；2016 年 12 月 29 日至今，担任工银瑞信新增利混合型证券投资基金基金经理；2016 年 12 月 29 日至今，担任工银瑞信新增益混合型证券投资基金基金经理；2016 年 12 月 29 日至今，担任工银瑞信银和利混合型证券投资基金基金经理；2016 年 12 月 29 日至今，担任工银瑞信新生利混合型证券投资基金基金经理；2017 年 3 月 23 日至今，担任工银瑞信新得利混合型证券投资基金基金经理。</p> |
|--|--|--|--|---|

|    |                   |                  |   |   |
|----|-------------------|------------------|---|---|
|    |                   |                  |   |   |
| 李敏 | 固定收益部副总监，本基金的基金经理 | 2016 年 11 月 22 日 | - | 10<br>先后在中国泛海控股集团担任投资经理，在中诚信国际信用评级有限责任公司担任高级分析师，在平安证券有限责任公司担任高级业务总监；2010 年加入工银瑞信，现任固定收益部副总监；2013 年 10 月 10 日至今，担任工银信用纯债两年定期开放基金基金经理；2014 年 7 月 30 日至 2017 年 2 月 6 日，担任工银保本 2 号混合型发起式基金(自 2016 年 2 月 19 日起，变更为工银瑞信优质精选混合型证券投资基金)基金经理；2015 年 5 月 26 日至 2017 年 4 月 26 日，担任工银双债增强债券型基金(自 2016 年 9 月 26 日起，变更为工银瑞信双债增强债券型证券投资基金(LOF))基金经理；2015 年 5 月 26 日至今，担任工银保本混合型基金基金经理；2016 年 10 月 27 日至今，担任工银瑞信恒丰纯债债券型证券投资基金基金经理；2016 年 11 月 15 日至今，担任工银瑞信恒泰纯债债券型证券投资基金基金经理；2016 年 11 月 22 日至今，担任工银瑞信新得益混合型证券投资基金基金经理；2016 年 12 月 7 日至今，担任工银瑞信新得润混合型证券投资基金基金经理；2016 年 12 月 29 日至今，担任工银瑞信新增利混合型证券投资基金基金经理；2016 年 12 月 29 日至今， |

|    |          |                  |   |   |  |
|----|----------|------------------|---|---|--|
|    |          |                  |   |   | 担任工银瑞信新增益混合型证券投资基金基金经理；2016 年 12 月 29 日至今，担任工银瑞信银和利混合型证券投资基金基金经理；2016 年 12 月 29 日至今，担任工银瑞信新生利混合型证券投资基金基金经理；2017 年 3 月 23 日至今，担任工银瑞信新得利混合型证券投资基金基金经理；2017 年 5 月 24 日至今，担任工银瑞信瑞利两年封闭式债券型证券投资基金基金经理。  |
| 张洋 | 本基金的基金经理 | 2016 年 11 月 22 日 | - | 5 | 宾夕法尼亚大学电子工程专业博士，沃顿商学院统计学硕士；2012 年加入工银瑞信，现任固定收益部基金经理，2015 年 8 月 17 日至今，担任工银瑞信双债增强债券型证券投资基金(自 2016 年 9 月 26 日起，变更为工银瑞信双债增强债券型证券投资基金 (LOF)) 基金经理；2015 年 8 月 17 日至今，担任工银瑞信保本 3 号混合型证券投资基金基金经理；2016 年 11 月 22 日至今，担任工银瑞信新得益混合型证券投资基金基金经理；2016 年 12 月 14 日至今，担任工银瑞信可转债债券型证券投资基金基金经理；2016 年 12 月 29 日至今，担任工银瑞信新增利混合型证券投资基金基金经理；2017 年 1 月 25 日至今，担任工银瑞信瑞盈半年定期开放债券型证券投资基金基金经理。 |

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为，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

2017 年上半年国内经济稳中有进，海外经济复苏延续，美联储继续加息，全球货币政策趋向于收紧。

在此宏观背景下，上半年国内债券收益率调整后高位震荡，股票市场稳中有升，市场情绪有所提升。

本基金在报告期内根据对于市场变化的判断积极调整仓位，同时参与新发可转债申购及新股申购。

#### 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 5.23%，业绩比较基准收益率为 3.07%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2017 年下半年，整体宏观经济仍然将维持稳中有进的局面，全球经济的整体性复苏也会对我国出口起到推动作用。

债券市场方面，去年四季度到今年上半年的调整反映了市场对于宏观经济预期的转变，在当前时点绝对收益率水平开始具有配置价值。

权益市场在当前经济基本面基础和政策环境下具备投资机会，但须注意在点位攀升波动加剧情况下控制仓位做好波段止盈。

#### 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、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，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，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基金托管人应尽的义务。

### 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，按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本报告期内，本基金未进行利润分配。

### 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

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、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：工银瑞信新得益混合型证券投资基金

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<br>2017 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2016 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>      |            |                                |                                  |
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 107,602,329.35                 | 113,638,854.39                   |
| 结算备付金           |            | 4,946,648.79                   | 16,204,936.15                    |
| 存出保证金           |            | 60,908.77                      | 21,413.71                        |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 506,053,094.91                 | 684,314,250.00                   |
| 其中：股票投资         |            | 129,842,749.91                 | 102,206,100.00                   |
| 基金投资            |            | -                              | -                                |
| 债券投资            |            | 376,210,345.00                 | 582,108,150.00                   |
| 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    | 30,000,000.00                  | 70,000,000.00                    |
| 应收证券清算款         |            | 77,470.77                      | 5,033,645.83                     |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 5,257,936.26                   | 6,339,638.46                     |
| 应收股利            |            | -                              | -                                |
| 应收申购款           |            | -                              | -                                |
| 递延所得税资产         |            | -                              | -                                |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                              | -                                |
| 资产总计            |            | 653,998,388.85                 | 895,552,738.54                   |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2017 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2016 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负债：</b>      |            |                                |                                  |
| 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         |            | 1,971,392.72                   | -                                |
| 应付赎回款           |            | 215,048.08                     | -                                |
| 应付管理人报酬         |            | 476,967.99                     | 860,821.21                       |
| 应付托管费           |            | 52,996.44                      | 95,646.80                        |
| 应付销售服务费         |            | -                              | -                                |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 204,289.83                     | 101,880.55                       |

|               |          |                |                |
|---------------|----------|----------------|----------------|
| 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  | 198,510.70     | 1,500.00       |
| 负债合计          |          | 3,119,205.76   | 1,059,848.56   |
| <b>所有者权益：</b> |          |                |                |
| 实收基金          | 6.4.7.9  | 622,512,904.47 | 899,596,713.31 |
| 未分配利润         | 6.4.7.10 | 28,366,278.62  | -5,103,823.33  |
| 所有者权益合计       |          | 650,879,183.09 | 894,492,889.98 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 653,998,388.85 | 895,552,738.54 |

注：1、本基金基金合同生效日为 2016 年 11 月 22 日。

2、报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值为人民币 1.0460 元，基金份额总额为 622,129,904.47 份。

## 6.2 利润表

会计主体：工银瑞信新得益混合型证券投资基金

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<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6<br>月 30 日 |
|-----------------------|------------|--|
| <b>一、收入</b>           |            | 42,363,773.81                            |
| 1.利息收入                |            | 12,294,596.87                            |
| 其中：存款利息收入             | 6.4.7.11   | 3,440,396.61                             |
| 债券利息收入                |            | 7,522,088.35                             |
| 资产支持证券利息收入            |            | -  |
| 买入返售金融资产收入            |            | 1,332,111.91                             |
| 其他利息收入                |            | -  |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      |            | 10,968,265.71                            |
| 其中：股票投资收益             | 6.4.7.12   | 9,846,007.74                             |
| 基金投资收益                |            | -  |
| 债券投资收益                | 6.4.7.13   | 206,921.38                               |
| 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   | 915,336.59                               |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17   | 18,404,780.89                            |
| 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   | 696,130.34                               |

|                            |            |               |
|----------------------------|------------|---------------|
| <b>减：二、费用</b>              |            | 4,722,651.55  |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 3,612,227.54  |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 401,358.65    |
| 3. 销售服务费                   | 6.4.10.2.3 | -             |
| 4. 交易费用                    | 6.4.7.19   | 373,291.78    |
| 5. 利息支出                    |            | 124,352.21    |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | 124,352.21    |
| 6. 其他费用                    | 6.4.7.20   | 211,421.37    |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | 37,641,122.26 |
| 减：所得税费用                    |            | -             |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | 37,641,122.26 |

注：本基金基金合同生效日为 2016 年 11 月 22 日。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：工银瑞信新得益混合型证券投资基金

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<br>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<br>(基金净值)                                | 899,596,713.31                        | -5,103,823.33 | 894,492,889.98  |
| 二、本期经营活动产生的<br>基金净值变动数(本<br>期利润)                   | -                                     | 37,641,122.26 | 37,641,122.26   |
| 三、本期基金份额交易<br>产生的基金净值变动数<br>(净值减少以“-”号<br>填列)      | -277,083,808.84                       | -4,171,020.31 | -281,254,829.15 |
| 其中：1.基金申购款   | 1,097,695.56                          | 15,495.40     | 1,113,190.96    |
| 2.基金赎回款  | -278,181,504.40                       | -4,186,515.71 | -282,368,020.11 |
| 四、本期向基金份额持<br>有人分配利润产生的基<br>金净值变动(净值减少<br>以“-”号填列) | -                                     | -             | -               |
| 五、期末所有者权益<br>(基金净值)                                | 622,512,904.47                        | 28,366,278.62 | 650,879,183.09  |

注：本基金基金合同生效日为 2016 年 11 月 22 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

工银瑞信新得益混合型证券投资基金(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[2015]1679号《关于准予工银瑞信新得益混合型证券投资基金注册的批复》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《工银瑞信新得益混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为混合型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募 899,458,325.95 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第 1414 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《工银瑞信新得益混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 11 月 22 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 899,596,713.31 份基金份额,其中认购资金利息折合 138,387.36 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,基金托管人为中国民生银行股份有限公司(以下简称“民生银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《工银瑞信新得益混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市交易的股票(包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票)、权证、股指期货、国债期货、债券(包括但不限于国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款以及现金,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。基金的投资组合比例为:本基金投资组合中股票资产投资比例为基金资产的 0%—30%;每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值的 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为:  $30\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 70\% \times \text{中债综合财富指数收益率}$ 。

## 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(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《工银瑞信新得益混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协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 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

## (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的

市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供

的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

## 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

## 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<br>2017 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 7,602,329.35           |
| 定期存款           | 100,000,000.00         |
| 其中：存款期限 1-3 个月 | -                      |
| 存款期限 1 个月以内    | 100,000,000.00         |
| 存款期限 3 个月~1 年  | -                      |
| 其他存款           | -                      |
| 合计：            | 107,602,329.35         |

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目        | 本期末<br>2017 年 6 月 30 日 |                |               |
|-----------|------------------------|----------------|---------------|
|           | 成本                     | 公允价值           | 公允价值变动        |
| 股票        | 115,732,860.83         | 129,842,749.91 | 14,109,889.08 |
| 贵金属投资-金交所 | -                      | -              | -             |

|        |       |                |                |               |
|--------|-------|----------------|----------------|---------------|
| 黄金合约   |       |                |                |               |
| 债券     | 交易所市场 | 50,087,729.96  | 48,042,345.00  | -2,045,384.96 |
|        | 银行间市场 | 328,301,542.74 | 328,168,000.00 | -133,542.74   |
|        | 合计    | 378,389,272.70 | 376,210,345.00 | -2,178,927.70 |
| 资产支持证券 |       | -              | -              | -             |
| 基金     |       | -              | -              | -             |
| 其他     |       | -              | -              | -             |
| 合计     |       | 494,122,133.53 | 506,053,094.91 | 11,930,961.38 |

### 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

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2017年6月30日 |           |
|------------|-------------------|-----------|
|            | 账面余额              | 其中：买断式逆回购 |
| 买入返售证券_交易所 | 30,000,000.00     | -         |
| 合计         | 30,000,000.00     | -         |

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告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<br>2017年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息   | 3,037.02          |
| 应收定期存款利息   | 257,500.08        |
| 应收其他存款利息   | -                 |
| 应收结算备付金利息  | 2,226.00          |
| 应收债券利息     | 5,002,433.43      |
| 应收买入返售证券利息 | -7,287.67         |
| 应收申购款利息    | -                 |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -                 |
| 其他         | 27.40             |
| 合计         | 5,257,936.26      |

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<br>2017年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 201,422.91        |
| 银行间市场应付交易费用 | 2,866.92          |
| 合计          | 204,289.83        |

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2017年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                 |
| 应付赎回费       | 773.41            |
| 预提信息披露费     | 148,765.71        |
| 预提审计费       | 39,671.58         |
| 预提账户维护费     | 9,300.00          |
| 合计          | 198,510.70        |

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>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          | 899,596,713.31             | 899,596,713.31  |
| 本期申购          | 1,097,695.56               | 1,097,695.56    |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -278,181,504.40            | -278,181,504.40 |
| - 基金拆分/份额折算前  | -                          | -               |
| 基金拆分/份额折算变动份额 | -                          | -               |
| 本期申购          | -                          | -               |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -                          | -               |
| 本期末           | 622,512,904.47             | 622,512,904.47  |

注：1. 本基金自 2016 年 11 月 7 日至 2016 年 11 月 17 日止期间公开发售，共募集有效净认购资

金 899,458,325.95 元。根据《工银瑞信新得益混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入 138,387.36 元在本基金成立后，折算为 138,387.36 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

2. 根据《工银瑞信新得益混合型证券投资基金基金合同》和《工银瑞信新得益混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告》的相关规定，本基金于 2016 年 11 月 22 日(基金合同生效日)至 2017 年 2 月 19 日止期间暂不向投资人开放基金交易。申购业务、赎回业务和转换业务自 2017 年 2 月 20 日起开始办理。

#### 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           | 1,369,996.18  | -6,473,819.51 | -5,103,823.33 |
| 本期利润           | 19,236,341.37 | 18,404,780.89 | 37,641,122.26 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -4,041,106.80 | -129,913.51   | -4,171,020.31 |
| 其中：基金申购款       | 11,270.18     | 4,225.22      | 15,495.40     |
| 基金赎回款          | -4,052,376.98 | -134,138.73   | -4,186,515.71 |
| 本期已分配利润        | -             | -             | -             |
| 本期末            | 16,565,230.75 | 11,801,047.87 | 28,366,278.62 |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 92,626.61                             |
| 定期存款利息收入  | 3,276,389.06                          |
| 其他存款利息收入  | -                                     |
| 结算备付金利息收入 | 70,916.70                             |
| 其他        | 464.24                                |
| 合计        | 3,440,396.61                          |

注：“其他”为结算保证金利息收入。

#### 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<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 |
|----------|---------------------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 143,214,249.04                        |

|            |                |
|------------|----------------|
| 减：卖出股票成本总额 | 133,368,241.30 |
| 买卖股票差价收入   | 9,846,007.74   |

### 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

单位：人民币元

| 项目                            | 本期<br>2017年1月1日至2017年6月30日 |
|-------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | 206,921.38                 |
| 债券投资收益——赎回差价收入                | -                          |
| 债券投资收益——申购差价收入                | -                          |
| 合计                            | 206,921.38                 |

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                      | 本期<br>2017年1月1日至2017年6月30日 |
|-------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 654,144,550.69             |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 643,556,601.88             |
| 减：应收利息总额                | 10,381,027.43              |
| 买卖债券差价收入                | 206,921.38                 |

#### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

#### 6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

#### 6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期间无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期间无贵金属投资收益。

**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<br>2017年1月1日至2017年6月30日 |
|-------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 915,336.59                 |
| 基金投资产生的股利收益 | -                          |
| 合计          | 915,336.59                 |

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期<br>2017年1月1日至2017年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | 18,404,780.89              |
| ——股票投资     | 20,179,441.95              |
| ——债券投资     | -1,774,661.06              |
| ——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         | 18,404,780.89              |

**6.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2017年1月1日至2017年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 695,828.81                 |

|         |            |
|---------|------------|
| 基金转换费收入 | 301.53     |
| 合计      | 696,130.34 |

#### 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 | 370,091.78           |
| 银行间市场交易费用 | 3,200.00             |
| 合计        | 373,291.78           |

#### 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  | 39,671.58            |
| 信息披露费 | 148,765.71           |
| 账户维护费 | 18,600.00            |
| 银行费用  | 4,384.08             |
| 合计    | 211,421.37           |

### 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、基金注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国民生银行股份有限公司 | 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               |

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<br>2017年1月1日至2017年6月30日 |
|-----------------|----------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 3,612,227.54               |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 215,014.81                 |

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.9% 年费率计提。

管理费的计算方法如下： $H = E \times 0.9\% \div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2017年1月1日至2017年6月30日 |
|----------------|----------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 401,358.65                 |

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 的年费率计提。

托管费的计算方法如下： $H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

无。

#### 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

本基金本报告期末与关联方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<br>2017年1月1日至2017年6月30日 |              |
|--------------|----------------------------|--------------|
|              | 期末余额                       | 当期利息收入       |
| 中国民生银行股份有限公司 | 7,602,329.35               | 2,039,571.14 |

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期内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

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 |      |            |            |        |       |        |              |           |           |    |
|----------------------|------|------------|------------|--------|-------|--------|--------------|-----------|-----------|----|
| 证券代码                 | 证券名称 | 成功认购日      | 可流通日       | 流通受限类型 | 认购价格  | 期末估值单价 | 数量<br>(单位：股) | 期末成本总额    | 期末估值总额    | 备注 |
| 002879               | 长缆科技 | 2017年6月5日  | 2017年7月7日  | 新股流通受限 | 18.02 | 18.02  | 1,313        | 23,660.26 | 23,660.26 | -  |
| 002882               | 金龙羽  | 2017年6月15日 | 2017年7月17日 | 新股流通受限 | 6.20  | 6.20   | 2,966        | 18,389.20 | 18,389.20 | -  |
| 603933               | 睿能科技 | 2017年6月28日 | 2017年7月6日  | 新股流通受限 | 20.20 | 20.20  | 857          | 17,311.40 | 17,311.40 | -  |
| 603305               | 旭升股份 | 2017年6月30日 | 2017年7月10日 | 新股流通受限 | 11.26 | 11.26  | 1,351        | 15,212.26 | 15,212.26 | -  |
| 300670               | 大烨智能 | 2017年6月26日 | 2017年7月3日  | 新股流通受限 | 10.93 | 10.93  | 1,259        | 13,760.87 | 13,760.87 | -  |
| 300672               | 国科微  | 2017年6月30日 | 2017年7月12日 | 新股流通受限 | 8.48  | 8.48   | 1,257        | 10,659.36 | 10,659.36 | -  |
| 603331               | 百达精工 | 2017年6月27日 | 2017年7月5日  | 新股流通受限 | 9.63  | 9.63   | 999          | 9,620.37  | 9,620.37  | -  |
| 300671               | 富满电子 | 2017年6月27日 | 2017年7月5日  | 新股流通受限 | 8.11  | 8.11   | 942          | 7,639.62  | 7,639.62  | -  |
| 603617               | 君禾股份 | 2017年6月23日 | 2017年7月3日  | 新股流通受限 | 8.93  | 8.93   | 832          | 7,429.76  | 7,429.76  | -  |

|        |      |            |            |        |       |       |       |            |            |   |
|--------|------|------------|------------|--------|-------|-------|-------|------------|------------|---|
|        |      |            | 日          |        |       |       |       |            |            |   |
| 002859 | 洁美科技 | 2017年3月24日 | 2018年4月9日  | 新股自愿锁定 | 29.82 | 73.00 | 6,666 | 198,780.12 | 486,618.00 | - |
| 002860 | 星帅尔  | 2017年3月31日 | 2018年4月12日 | 新股自愿锁定 | 19.81 | 48.90 | 7,980 | 158,083.80 | 390,222.00 | - |

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 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和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，将风险控制可在可承受的范围内。

#### 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%，且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，不得超过该证券的 10%。

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

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2017 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2016 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| A-1    | -                      | -                        |

|        |                |                |
|--------|----------------|----------------|
| A-1 以下 | -              | -              |
| 未评级    | 110,252,000.00 | 500,294,000.00 |
| 合计     | 110,252,000.00 | 500,294,000.00 |

注：1、表中所列示的债券投资为短期融资券及超短期融资券，其中超短期融资券无信用评级。

2、上述评级均取自第三方评级机构的债项评级。

#### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2017年6月30日 | 上年度末<br>2016年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA    | 201,313,000.00    | 33,124,150.00       |
| AAA 以下 | 34,642,345.00     | 48,690,000.00       |
| 未评级    | -                 | -                   |
| 合计     | 235,955,345.00    | 81,814,150.00       |

注：1、表中所列示的债券投资为除短期融资券以外的信用债券。

2、上述评级均取自第三方评级机构的债项评级。

#### 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为剩余期限较短、信誉良好的国债、企业债及央行票据等，除在证券交易所的债券回购交易及返售交易，其余均在银行间同业市场交易，均能够及时变现。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，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，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<br>2017年6<br>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                  | 107,602,329.35 | -             | -      | -               | -    | -               | 107,602,329.35 |
| 结算备付金                 | 4,946,648.79   | -             | -      | -               | -    | -               | 4,946,648.79   |
| 存出保证金                 | 60,908.77      | -             | -      | -               | -    | -               | 60,908.77      |
| 交易性金融资产               | 60,135,000.00  | 80,120,000.00 | -      | -235,955,345.00 | -    | -129,842,749.91 | 506,053,094.91 |
| 买入返售金融资产              | 30,000,000.00  | -             | -      | -               | -    | -               | 30,000,000.00  |
| 应收证券清算款               | -              | -             | -      | -               | -    | 77,470.77       | 77,470.77      |
| 应收利息                  | -              | -             | -      | -               | -    | 5,257,936.26    | 5,257,936.26   |
| 资产总计                  | 202,744,886.91 | 80,120,000.00 | -      | -235,955,345.00 | -    | -135,178,156.94 | 653,998,388.85 |
| 负债                    |                |               |        |                 |      |                 |                |
| 应付证券清算款               | -              | -             | -      | -               | -    | 1,971,392.72    | 1,971,392.72   |
| 应付赎回款                 | -              | -             | -      | -               | -    | 215,048.08      | 215,048.08     |
| 应付管理人报酬               | -              | -             | -      | -               | -    | 476,967.99      | 476,967.99     |
| 应付托管费                 | -              | -             | -      | -               | -    | 52,996.44       | 52,996.44      |
| 应付交易费用                | -              | -             | -      | -               | -    | 204,289.83      | 204,289.83     |
| 其他负债                  | -              | -             | -      | -               | -    | 198,510.70      | 198,510.70     |
| 负债总计                  | -              | -             | -      | -               | -    | 3,119,205.76    | 3,119,205.76   |
| 利率敏感度                 | 202,744,886.91 | 80,120,000.00 | -      | -235,955,345.00 | -    | -132,058,951.18 | 650,879,183.09 |

| 缺口                          |                |                |                 |               |           |                 |                 |
|-----------------------------|----------------|----------------|-----------------|---------------|-----------|-----------------|-----------------|
| 上年度末<br>2016 年 12<br>月 31 日 | 1 个月以内         | 1-3 个月         | 3 个月-1 年        | 1-5 年         | 5 年以<br>上 | 不计息             | 合计              |
| 资产                          |                |                |                 |               |           |                 |                 |
| 银行存款                        | 13,638,854.39  |                | -100,000,000.00 |               |           |                 | -113,638,854.39 |
| 结算备付金                       | 16,204,936.15  |                |                 |               |           |                 | 16,204,936.15   |
| 存出保证金                       | 21,413.71      |                |                 |               |           |                 | 21,413.71       |
| 交易性金融<br>资产                 | 110,267,000.00 | 308,298,000.00 | 98,306,150.00   | 65,237,000.00 |           | -102,206,100.00 | 684,314,250.00  |
| 买入返售金<br>融资产                | 70,000,000.00  |                |                 |               |           |                 | 70,000,000.00   |
| 应收证券清<br>算款                 |                |                |                 |               |           | 5,033,645.83    | 5,033,645.83    |
| 应收利息                        |                |                |                 |               |           | 6,339,638.46    | 6,339,638.46    |
| 资产总计                        | 210,132,204.25 | 308,298,000.00 | 198,306,150.00  | 65,237,000.00 |           | -113,579,384.29 | 895,552,738.54  |
| 负债                          |                |                |                 |               |           |                 |                 |
| 应付管理人<br>报酬                 |                |                |                 |               |           | 860,821.21      | 860,821.21      |
| 应付托管费                       |                |                |                 |               |           | 95,646.80       | 95,646.80       |
| 应付交易费<br>用                  |                |                |                 |               |           | 101,880.55      | 101,880.55      |
| 其他负债                        |                |                |                 |               |           | 1,500.00        | 1,500.00        |
| 负债总计                        |                |                |                 |               |           | 1,059,848.56    | 1,059,848.56    |
| 利率敏感度<br>缺口                 | 210,132,204.25 | 308,298,000.00 | 198,306,150.00  | 65,237,000.00 |           | -112,519,535.73 | 894,492,889.98  |

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

|    |                                  |                                 |                            |
|----|----------------------------------|---------------------------------|----------------------------|
| 假设 | 该利率敏感性分析基于本基金报表日的利率风险状况；         |                                 |                            |
|    | 假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他变量不变； |                                 |                            |
|    | 此项影响并未考虑管理层为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。  |                                 |                            |
| 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<br>影响金额（单位：人民币元） |                            |
|    |                                  | 本期末（2017 年 6 月 30 日<br>）        | 上年度末（2016 年 12 月 31 日<br>） |
|    | 利率增加 25 基准点                      | -1,312,837.55                   | -662,241.29                |
|    | 利率减少 25 基准点                      | 1,323,755.38                    | 666,319.40                 |

#### 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<br>2017年6月30日 |                          | 上年度末<br>2016年12月31日 |                       |
|---------------|-------------------|--------------------------|---------------------|-----------------------|
|               | 公允价值              | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) | 公允价值                | 占基金资<br>产净值比<br>例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资  | 129,842,749.91    | 19.95                    | 102,206,100.00      | 11.43                 |
| 交易性金融资产—基金投资  | —                 | —                        | —                   | —                     |
| 交易性金融资产—债券投资  | 376,210,345.00    | 57.80                    | 582,108,150.00      | 65.08                 |
| 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            | 506,053,094.91    | 77.75                    | 684,314,250.00      | 76.50                 |

注：1、本基金投资于股票资产投资比例为基金资产的 0%—30%；每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值的 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券。

2、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。

##### 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% | 18,893,371.32   | 10,236,524.76     |
|  | 业绩比较基准减少 5% | -18,893,371.32  | -10,236,524.76    |

#### 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              | 129,842,749.91 | 19.85         |
|    | 其中：股票             | 129,842,749.91 | 19.85         |
| 2  | 固定收益投资            | 376,210,345.00 | 57.52         |
|    | 其中：债券             | 376,210,345.00 | 57.52         |
|    | 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          | 30,000,000.00  | 4.59          |
|    | 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      | 112,548,978.14 | 17.21         |
| 7  | 其他各项资产            | 5,396,315.80   | 0.83          |
| 8  | 合计                | 653,998,388.85 | 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 报告期末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              | -             | -             |
| C  | 制造业              | 62,584,958.68 | 9.62          |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 5,138,000.00  | 0.79          |
| E  | 建筑业              | -             | -             |
| F  | 批发和零售业           | 17,173,324.61 | 2.64          |
| 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  | 7,639.62      | 0.00          |
| J  | 金融业              | 44,938,827.00 | 6.90          |
| 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            | 129,842,749.91 | 19.95 |

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 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

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  | 601318 | 中国平安 | 250,000   | 12,402,500.00 | 1.91         |
| 2  | 600030 | 中信证券 | 520,000   | 8,850,400.00  | 1.36         |
| 3  | 000333 | 美的集团 | 200,000   | 8,608,000.00  | 1.32         |
| 4  | 000651 | 格力电器 | 200,000   | 8,234,000.00  | 1.27         |
| 5  | 600741 | 华域汽车 | 299,959   | 7,271,006.16  | 1.12         |
| 6  | 601601 | 中国太保 | 200,000   | 6,774,000.00  | 1.04         |
| 7  | 000963 | 华东医药 | 136,000   | 6,759,200.00  | 1.04         |
| 8  | 000338 | 潍柴动力 | 500,000   | 6,600,000.00  | 1.01         |
| 9  | 601818 | 光大银行 | 1,499,940 | 6,074,757.00  | 0.93         |
| 10 | 000895 | 双汇发展 | 250,000   | 5,937,500.00  | 0.91         |
| 11 | 000001 | 平安银行 | 603,000   | 5,662,170.00  | 0.87         |
| 12 | 600887 | 伊利股份 | 260,000   | 5,613,400.00  | 0.86         |
| 13 | 601933 | 永辉超市 | 750,000   | 5,310,000.00  | 0.82         |
| 14 | 002311 | 海大集团 | 289,880   | 5,296,107.60  | 0.81         |
| 15 | 600535 | 天士力  | 125,000   | 5,192,500.00  | 0.80         |
| 16 | 000876 | 新希望  | 629,960   | 5,178,271.20  | 0.80         |
| 17 | 000776 | 广发证券 | 300,000   | 5,175,000.00  | 0.80         |
| 18 | 600011 | 华能国际 | 700,000   | 5,138,000.00  | 0.79         |
| 19 | 002462 | 嘉事堂  | 129,909   | 5,104,124.61  | 0.78         |

|    |        |      |         |              |      |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 20 | 002415 | 海康威视 | 100,000 | 3,230,000.00 | 0.50 |
| 21 | 002859 | 洁美科技 | 6,666   | 486,618.00   | 0.07 |
| 22 | 002860 | 星帅尔  | 7,980   | 390,222.00   | 0.06 |
| 23 | 300657 | 弘信电子 | 1,021   | 48,089.10    | 0.01 |
| 24 | 603801 | 志邦股份 | 1,406   | 47,522.80    | 0.01 |
| 25 | 603043 | 广州酒家 | 1,810   | 45,738.70    | 0.01 |
| 26 | 300666 | 江丰电子 | 2,276   | 43,448.84    | 0.01 |
| 27 | 603326 | 我乐家居 | 1,452   | 40,612.44    | 0.01 |
| 28 | 603380 | 易德龙  | 1,298   | 35,370.50    | 0.01 |
| 29 | 603879 | 永悦科技 | 1,227   | 28,343.70    | 0.00 |
| 30 | 603335 | 迪生力  | 2,230   | 24,864.50    | 0.00 |
| 31 | 603536 | 惠发股份 | 1,008   | 24,141.60    | 0.00 |
| 32 | 002879 | 长缆科技 | 1,313   | 23,660.26    | 0.00 |
| 33 | 002881 | 美格智能 | 989     | 22,608.54    | 0.00 |
| 34 | 603679 | 华体科技 | 809     | 21,438.50    | 0.00 |
| 35 | 603938 | 三孚股份 | 1,246   | 20,932.80    | 0.00 |
| 36 | 002882 | 金龙羽  | 2,966   | 18,389.20    | 0.00 |
| 37 | 603933 | 睿能科技 | 857     | 17,311.40    | 0.00 |
| 38 | 603305 | 旭升股份 | 1,351   | 15,212.26    | 0.00 |
| 39 | 300669 | 沪宁股份 | 841     | 14,650.22    | 0.00 |
| 40 | 300670 | 大烨智能 | 1,259   | 13,760.87    | 0.00 |
| 41 | 603286 | 日盈电子 | 890     | 13,528.00    | 0.00 |
| 42 | 300672 | 国科微  | 1,257   | 10,659.36    | 0.00 |
| 43 | 603331 | 百达精工 | 999     | 9,620.37     | 0.00 |
| 44 | 300671 | 富满电子 | 942     | 7,639.62     | 0.00 |
| 45 | 603617 | 君禾股份 | 832     | 7,429.76     | 0.00 |

## 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  | 601601 | 中国太保 | 10,248,953.25 | 1.15            |
| 2  | 601318 | 中国平安 | 9,493,050.04  | 1.06            |
| 3  | 600030 | 中信证券 | 8,320,482.52  | 0.93            |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 4  | 000333 | 美的集团 | 7,509,871.07 | 0.84 |
| 5  | 000651 | 格力电器 | 7,075,728.31 | 0.79 |
| 6  | 002475 | 立讯精密 | 5,686,919.26 | 0.64 |
| 7  | 000338 | 潍柴动力 | 5,590,660.00 | 0.63 |
| 8  | 600011 | 华能国际 | 5,485,288.00 | 0.61 |
| 9  | 601336 | 新华保险 | 5,424,081.00 | 0.61 |
| 10 | 000895 | 双汇发展 | 5,377,545.01 | 0.60 |
| 11 | 300197 | 铁汉生态 | 5,287,172.84 | 0.59 |
| 12 | 000776 | 广发证券 | 5,253,190.00 | 0.59 |
| 13 | 601006 | 大秦铁路 | 5,233,494.00 | 0.59 |
| 14 | 002462 | 嘉事堂  | 5,197,789.27 | 0.58 |
| 15 | 000876 | 新希望  | 5,192,316.20 | 0.58 |
| 16 | 600887 | 伊利股份 | 5,180,819.47 | 0.58 |
| 17 | 000001 | 平安银行 | 5,131,500.00 | 0.57 |
| 18 | 600597 | 光明乳业 | 5,118,607.42 | 0.57 |
| 19 | 600038 | 中直股份 | 5,046,808.72 | 0.56 |
| 20 | 601933 | 永辉超市 | 5,033,100.00 | 0.56 |

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  | 002241 | 歌尔股份 | 16,291,658.22 | 1.82           |
| 2  | 600271 | 航天信息 | 10,995,974.12 | 1.23           |
| 3  | 600066 | 宇通客车 | 8,734,237.66  | 0.98           |
| 4  | 002739 | 万达电影 | 8,263,334.79  | 0.92           |
| 5  | 002304 | 洋河股份 | 6,625,709.71  | 0.74           |
| 6  | 000858 | 五粮液  | 6,443,957.85  | 0.72           |
| 7  | 601006 | 大秦铁路 | 6,285,000.00  | 0.70           |
| 8  | 601336 | 新华保险 | 5,914,403.00  | 0.66           |
| 9  | 601601 | 中国太保 | 5,654,913.13  | 0.63           |
| 10 | 002475 | 立讯精密 | 5,399,176.14  | 0.60           |
| 11 | 600011 | 华能国际 | 5,281,462.47  | 0.59           |
| 12 | 000651 | 格力电器 | 5,233,843.21  | 0.59           |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 13 | 002594 | 比亚迪  | 5,040,682.52 | 0.56 |
| 14 | 600597 | 光明乳业 | 4,949,491.80 | 0.55 |
| 15 | 600038 | 中直股份 | 4,935,268.51 | 0.55 |
| 16 | 601928 | 凤凰传媒 | 4,862,900.65 | 0.54 |
| 17 | 000027 | 深圳能源 | 4,789,162.00 | 0.54 |
| 18 | 600048 | 保利地产 | 4,679,565.55 | 0.52 |
| 19 | 300197 | 铁汉生态 | 4,641,642.00 | 0.52 |
| 20 | 603885 | 吉祥航空 | 4,457,675.10 | 0.50 |

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 | 140,825,449.26 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 143,214,249.04 |

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值           | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | -              | -            |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 30,003,000.00  | 4.61         |
|    | 其中：政策性金融债 | 30,003,000.00  | 4.61         |
| 4  | 企业债券      | 24,545,000.00  | 3.77         |
| 5  | 企业短期融资券   | 110,252,000.00 | 16.94        |
| 6  | 中期票据      | 187,913,000.00 | 28.87        |
| 7  | 可转债（可交换债） | 23,497,345.00  | 3.61         |
| 8  | 同业存单      | -              | -            |
| 9  | 其他        | -              | -            |
| 10 | 合计        | 376,210,345.00 | 57.80        |

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。

### 7.6 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码      | 债券名称              | 数量（张）   | 公允价值          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|-------------------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 011758047 | 17 苏交通<br>SCP008  | 500,000 | 50,030,000.00 | 7.69         |
| 2  | 101651032 | 16 东航股<br>MTN001  | 500,000 | 48,730,000.00 | 7.49         |
| 3  | 031780001 | 17 招商蛇口<br>MTN001 | 400,000 | 40,088,000.00 | 6.16         |
| 4  | 011698571 | 16 中铝业<br>SCP011  | 300,000 | 30,132,000.00 | 4.63         |
| 5  | 011698773 | 16 陕煤化<br>SCP010  | 300,000 | 30,090,000.00 | 4.62         |

### 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、处罚的投资决策程序说明：

本报告期，本基金持有中信证券，其发行主体（以下简称“该公司”）在司度（上海）贸易有限公司从事证券交易时间连续计算不足半年的情况下，为其提供融资融券服务，涉嫌违反《证券公司融资融券业务管理办法》第十一条的规定，构成《证券公司监督管理条例》第八十四条第（七）项“未按照规定与客户签订业务合同”所述行为。中国证监会拟决定对该公司责令改正、给予警告，没收违法所得并处罚款，并对直接负责的主管人员给予警告，并处以罚款。

该公司为不符合要求的投资者账户开通全国股转系统合格投资者权限，且未如实上报违规开户情况。全国中小企业股份转让系统对该公司采取责令改正的自律监管措施。

该公司北京好运街营业部未经审批同意擅自发布宣传推介材料，宣传推介材料部分表述片面强调收益，违反了《关于加强证券经纪业务管理的规定》第一条、第二条的规定，深圳证监局责令该公司立即改正，并对该公司采取责令增加内部合规检查次数的监督管理措施。

本基金对相关股票的投资主要基于监管处罚和管理层变动已经基本落地、基本面竞争优势仍较强，同时估值回落到历史较低水平具有吸引力，投资决策流程符合基金管理人的制度要求。

### 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   | 60,908.77    |
| 2  | 应收证券清算款 | 77,470.77    |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 5,257,936.26 |
| 5  | 应收申购款   | -            |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 5,396,315.80 |

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称     | 公允价值          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|---------------|--------------|
| 1  | 132006 | 16 皖新 EB | 14,127,099.00 | 2.17         |
| 2  | 120001 | 16 以岭 EB | 33,246.00     | 0.01         |

注：上表包含期末持有的处于转股期的可转换债券和可交换债券明细。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

#### 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

| 持有人户数<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>额比例 | 持有份额          | 占总份<br>额比例 |
| 629          | 989,686.65    | 539,091,740.00 | 86.60%     | 83,421,164.47 | 13.40%     |

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目                   | 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<br>持有本基金 | 102,074.48 | 0.02%    |

### 8.3 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                                 | 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<br>究部门负责人持有本开放式基金 | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                    | 0                 |

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

|                            |                |
|----------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2016年11月22日）基金份额总额 | 899,596,713.31 |
| 本报告期期初基金份额总额               | 899,596,713.31 |
| 本报告期基金总申购份额                | 1,097,695.56   |
| 减：本报告期基金总赎回份额              | 278,181,504.40 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）   | -              |
| 本报告期期末基金份额总额               | 622,512,904.47 |

注：1、报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额；

2、报告期期间基金总赎回份额含转换出份额。

## §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：

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

### 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 |    |
| 中泰证券 | 2      | 238,176,431.69 | 85.08%       | 169,413.31 | 84.11%     | -  |
| 国元证券 | 2      | 30,284,878.87  | 10.82%       | 21,540.47  | 10.69%     | -  |
| 申万宏源 | 2      | 11,487,761.90  | 4.10%        | 10,469.13  | 5.20%      | -  |
| 东方证券 | 2      | -              | -            | -          | -          | -  |

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

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易           |              | 债券回购交易           |                | 权证交易 |              |
|------|----------------|--------------|------------------|----------------|------|--------------|
|      | 成交金额           | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额             | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 中泰证券 | 110,007,707.13 | 92.91%       | 5,123,000,000.00 | 76.41%         | -    | -            |
| 国元证券 | -              | -            | 321,000,000.00   | 4.79%          | -    | -            |
| 申万宏源 | 8,392,051.37   | 7.09%        | 1,261,000,000.00 | 18.81%         | -    | -            |
| 东方证券 | -              | -            | -                | -              | -    | -            |

### 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  | 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  |
| 2  | 工银瑞信新得益混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告  | 中国证监会指定的媒介 | 2017年2月15日 |
| 3  | 关于工银瑞信新得益混合型证券投资基金暂停大额申购、转换转入、定投业务的公告     | 中国证监会指定的媒介 | 2017年2月17日 |
| 4  | 工银瑞信基金管理有限公司关于泛华普益基金销售有限公司基金销售费率调整的公告     | 中国证监会指定的媒介 | 2017年3月10日 |
| 5  | 工银瑞信基金管理有限公司关于宜信普泽投资顾问（北京）有限公司基金销售费率调整的公告 | 中国证监会指定的媒介 | 2017年3月10日 |
| 6  | 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3月17日 |
| 7  | 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 |
| 8  | 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并进行费率调整的公告    | 中国证监会指定的媒介 | 2017年4月20日 |

|    |   |                |                 |
|----|---|----------------|-----------------|
| 9  | 工银瑞信基金管理有限公司关于<br>副总经理变更的公告                             | 中国证监会指定的<br>媒介 | 2017 年 4 月 25 日 |
| 10 | 工银瑞信基金管理有限公司关于<br>一路财富（北京）信息科技股份<br>有限公司基金销售费率调整的公<br>告 | 中国证监会指定的<br>媒介 | 2017 年 5 月 15 日 |
| 11 | 工银瑞信基金管理有限公司关于<br>金惠家保险代理有限公司基金销<br>售费率调整的公告            | 中国证监会指定的<br>媒介 | 2017 年 5 月 24 日 |
| 12 | 关于直销电子自助交易系统开展<br>基金转换费率优惠活动的公告                         | 中国证监会指定的<br>媒介 | 2017 年 6 月 26 日 |
| 13 | 关于增加上海通华财富资产管理<br>有限公司为旗下基金销售机构的<br>公告                  | 中国证监会指定的<br>媒介 | 2017 年 6 月 30 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

| 投资者类别   | 报告期内持有基金份额变化情况 |                          |                    |          |                    | 报告期末持有基金情况         |            |
|---|----------------|--------------------------|--------------------|----------|--------------------|--------------------|------------|
|   | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间 | 期初份额               | 申购份额     | 赎回份额               | 持有份额               | 份额占比       |
| 机构  | 1              | 20170101-<br>20170630    | 800,127,000.0<br>0 | 0.0<br>0 | 261,035,260.0<br>0 | 539,091,740.0<br>0 | 86.60<br>% |
| 个人  | -              | -                        | -                  | -        | -                  | -                  | -          |
| 产品特有风险  |                |                          |                    |          |                    |                    |            |
| 本基金份额持有人较为集中，存在基金规模大幅波动的风险，以及由此导致基金收益较大波动的风险。 |                |                          |                    |          |                    |                    |            |

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予工银瑞信新得益混合型证券投资基金募集申请的注册文件；
- 2、《工银瑞信新得益混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《工银瑞信新得益混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《工银瑞信新得益混合型证券投资基金招募说明书》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、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](http://www.icbccs.com.cn)