

工银瑞信睿智中证 500 指数分级证券投资 基金 2019 年半年度报告

2019 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：二〇一九年八月二十八日

§ 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 2019 年 8 月 26 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 2019 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.....	13
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.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
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的真实、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.....	38
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	38
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.....	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	55
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.....	55
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细.....	55
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.....	55
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.....	55
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	56
7.12 投资组合报告附注.....	56
§8 基金份额持有人信息.....	58
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	58
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	58
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	59
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.....	59
§9 开放式基金份额变动.....	60
§10 重大事件揭示.....	61
10.1 基金份额持有人大会决议.....	61
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.....	61
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	61
10.4 基金投资策略的改变.....	61
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	61
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.....	61
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	62
10.8 其他重大事件.....	64

§11 影响投资者决策的其他重要信息	66
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	66
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	66
§12 备查文件目录	67
12.1 备查文件目录.....	67
12.2 存放地点.....	67
12.3 查阅方式.....	67

§ 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	172,052,710.20 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	1,631,430.00 份	2,447,146.00 份	167,974,134.20 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		王海璐	刘连舸

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
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(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	-4,921,870.04
本期利润	30,489,765.95
加权平均基金份额本期利润	0.1777
本期加权平均净值利润率	17.14%
本期基金份额净值增长率	19.05%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配利润	29,796,005.81
期末可供分配基金份额利润	0.1732
期末基金资产净值	178,805,385.47
期末基金份额净值	1.0392
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)
基金份额累计净值增长率	19.99%

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、期末可供分配利润，为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

4、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。

5、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

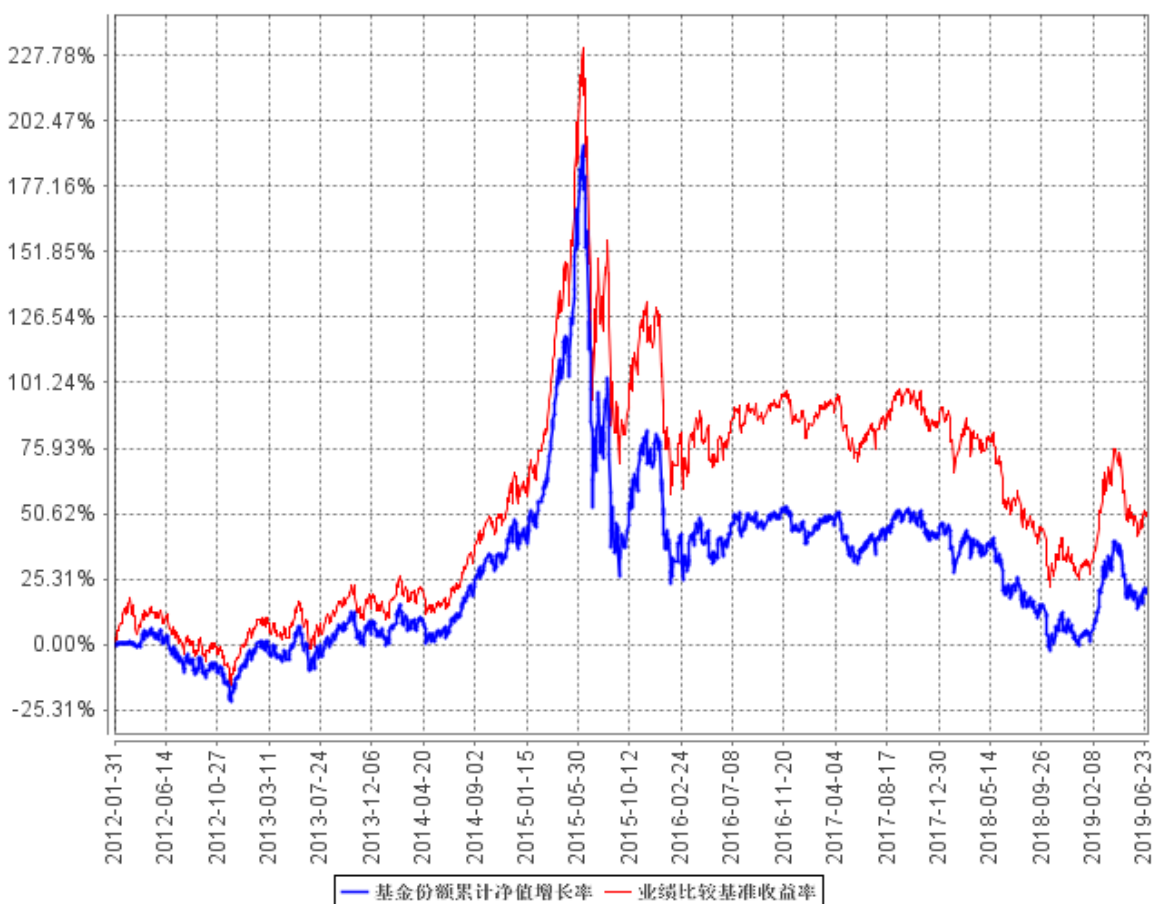
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.92%	1.30%	0.75%	1.32%	0.17%	-0.02%
过去三个月	-9.43%	1.70%	-10.21%	1.72%	0.78%	-0.02%
过去六个月	19.05%	1.68%	17.87%	1.70%	1.18%	-0.02%

过去一年	-2.27%	1.58%	-4.70%	1.60%	2.43%	-0.02%
过去三年	-15.99%	1.23%	-18.00%	1.25%	2.01%	-0.02%
自基金合同生效起至今	19.99%	1.68%	49.44%	1.63%	-29.45%	0.05%

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、根据基金合同规定，本基金建仓期为六个月。截至本报告期末，本基金的投资符合基金合同关于投资范围、投资禁止行为与限制的规定：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%。本基金持有的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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。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。

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 2019 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、工银瑞信添颐债券型证券投资基金、工银瑞信消费服务行业混合型证券投资基金、工银瑞信 60 天理财债券型证券投资基金、工银瑞信金融地产行业混合型证券投资基金、工银瑞信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、深证红利交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信上证 50 交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金（FOF）等逾 130 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	-	9	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

				<p>分析师、投资经理助理、投资经理，现任指数投资中心研究负责人、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(自 2018 年 4 月 17 日起变更为工银瑞信中证京津冀协同发展主题指数证券投资基金(LOF))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；2017 年 9 月 15 日至 2018 年 5 月 4 日，担任工银瑞信深证成份指数证券投资基金(LOF)基金经理；2018 年 6 月 15 日，担任工银瑞信印度市场证券投资基金(LOF)基金经理。2019 年 5 月 20 日至今，担任工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。</p>
--	--	--	--	--

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》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》、《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；未出现清算不到位的情况，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 3 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) 成份股票的停牌；3) 指数成份股调整等。

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 19.05%，业绩比较基准收益率为 17.87%。

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

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

（1）职责分工

估值小组成员为 4 人，分别来自公司运作部、固定收益部（或研究部）、风险管理部、法律合规部，组长由运作部负责人担任。

各部门负责人推荐各部门成员，如需更换，由相应部门负责人提出。小组成员需经运作部分管副总批准同意。

（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。

2、投资经理参与或决定估值的程度

投资经理可参与讨论估值原则和方法，但不得参与最终估值决策。

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、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：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	16,392,785.86	10,135,126.54
结算备付金		-	-
存出保证金		12,223.89	29,547.45
交易性金融资产	6.4.7.2	167,294,563.82	148,955,489.53
其中：股票投资		167,294,563.82	148,955,489.53
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		-	40,121.61
应收利息	6.4.7.5	2,476.20	2,222.57
应收股利		-	-
应收申购款		37,621.19	33,108.93
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		183,739,670.96	159,195,616.63
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 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		4,451,482.37	-
应付赎回款		125,358.02	743,860.80
应付管理人报酬		140,558.54	139,354.26
应付托管费		28,111.74	27,870.85
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	30,941.51	34,946.47

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	157,833.31	242,793.62
负债合计		4,934,285.49	1,188,826.00
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	149,009,379.66	156,764,891.99
未分配利润	6.4.7.10	29,796,005.81	1,241,898.64
所有者权益合计		178,805,385.47	158,006,790.63
负债和所有者权益总计		183,739,670.96	159,195,616.63

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 2019 年 6 月 30 日，基金份额总额 172,052,710.20 份。其中，工银 500 份额净值 1.0392 元，基金份额为 167,974,134.20 份；500A 份额净值 1.0245 元，基金份额为 1,631,430.00 份；500B 份额净值 1.0491 元，基金份额为 2,447,146.00 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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		31,844,590.51	-20,678,519.07
1.利息收入		42,031.90	43,406.51
其中：存款利息收入	6.4.7.11	42,031.90	43,406.51
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）		-3,641,885.10	784,377.93
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-5,179,843.75	-174,423.48
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	1,537,958.65	958,801.41
3.公允价值变动收益（损失以	6.4.7.17	35,411,635.99	-21,601,070.95

“-”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	32,807.72	94,767.44
减:二、费用		1,354,824.56	1,303,113.85
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	879,457.67	787,642.39
2. 托管费	6.4.10.2.2	175,891.51	157,528.45
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	90,380.47	132,501.93
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	209,094.91	225,441.08
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		30,489,765.95	-21,981,632.92
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		30,489,765.95	-21,981,632.92

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: 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 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)	156,764,891.99	1,241,898.64	158,006,790.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	30,489,765.95	30,489,765.95
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)	-7,755,512.33	-1,935,658.78	-9,691,171.11
其中: 1.基金申购款	14,825,771.35	2,641,698.42	17,467,469.77
2.基金赎回款	-22,581,283.68	-4,577,357.20	-27,158,640.88
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）	149,009,379.66	29,796,005.81	178,805,385.47
项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	142,255,629.63	60,923,743.00	203,179,372.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-21,981,632.92	-21,981,632.92
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）	-34,728,927.59	-14,447,377.16	-49,176,304.75
其中：1.基金申购款	17,467,431.78	5,010,860.35	22,478,292.13
2.基金赎回款	-52,196,359.37	-19,458,237.51	-71,654,596.88
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）	107,526,702.04	24,494,732.92	132,021,434.96

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>王海璐</u>	<u>赵紫英</u>	<u>关亚君</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(以下简称“中国银行”)。

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%。本基金持有的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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。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(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》、《工银瑞信睿智中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》和其他中国证监会、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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

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 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 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

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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》、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》、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》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。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。

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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让

2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货,可以选择按照实际买入价计算销售额,或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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 2019 年 6 月 30 日
活期存款	16,392,785.86
定期存款	-
其中:存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计:	16,392,785.86

6.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日

	成本	公允价值	公允价值变动
股票	185,910,571.63	167,294,563.82	-18,616,007.81
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	185,910,571.63	167,294,563.82	-18,616,007.81

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

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

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应收活期存款利息	2,470.70
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	-
应收资产支持证券利息	-
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	5.50
合计	2,476.20

6.4.7.6 其他资产

无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	30,941.51
银行间市场应付交易费用	-
合计	30,941.51

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	249.55
预提审计费	19,835.79
预提信息披露费	57,995.19
指数使用费	50,000.00
预提上市费	29,752.78
合计	157,833.31

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	176,920,940.68	156,764,891.99
本期申购	55,125.06	48,844.96
本期赎回(以“-”号填列)	-545.01	-482.92
2019 年 1 月 2 日 基金拆分/份额 折算前	176,975,520.73	156,813,254.03
基金拆分/份额折算变动份额	4,088,502.72	-
本期申购	17,062,267.28	14,776,926.39
本期赎回(以“-”号填列)	-26,073,580.53	-22,580,800.76
本期末	172,052,710.20	149,009,379.66

注：若本基金有分红及转换业务，申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

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	112,536,519.29	-111,294,620.65	1,241,898.64
本期利润	-4,921,870.04	35,411,635.99	30,489,765.95
本期基金份额交易产生的变动数	-5,691,138.46	3,755,479.68	-1,935,658.78
其中：基金申购款	10,438,195.38	-7,796,496.96	2,641,698.42
基金赎回款	-16,129,333.84	11,551,976.64	-4,577,357.20
本期已分配利润	-	-	-
本期末	101,923,510.79	-72,127,504.98	29,796,005.81

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
活期存款利息收入	41,486.04
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	395.84
其他	150.02
合计	42,031.90

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 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出股票成交总额	42,630,992.75
减：卖出股票成本总额	47,810,836.50
买卖股票差价收入	-5,179,843.75

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

无。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

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

无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

无。

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**

无。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,537,958.65
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,537,958.65

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	35,411,635.99
——股票投资	35,411,635.99
——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	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	35,411,635.99

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	32,807.72
合计	32,807.72

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	90,380.47
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	90,380.47

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
审计费用	19,835.79
信息披露费	57,995.19

上市年费	29,752.78
指数使用费	100,000.00
银行费用	1,511.15
合计	209,094.91

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

无。

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

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日

当期发生的基金应支付的管理费	879,457.67	787,642.39
其中：支付销售机构的客户维护费	105,288.03	94,782.81

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

2、基金管理费每日计提，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	175,891.51	157,528.45

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。

6.4.10.2.3 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

无。

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

无。

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

无。

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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 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	16,392,785.86	41,486.04	11,093,134.54	37,710.99

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

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

无。

6.4.12 期末（2019 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 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601236	红塔证券	2019 年 6 月 26 日	2019 年 7 月 5 日	新股流通受限	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-
300788	中信出版	2019 年 6 月 27 日	2019 年 7 月 5 日	新股流通受限	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

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、内控稽核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，负责根据公司经营计划、业务规则以及自身情况制订本部门的制度流程以及风险控制措施，同时分别在自己的授权范围内对关联部门及岗位进行监督并承担相应的责任；各部门设置兼职或专职合规管理人员，对本部门执行法律法规、监管要求及公司规章制度的情况进行监督。第二道防线由公司专属风险管理部门法律合规部、风险管理部和内控稽核部构成，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业务的投资风险进行监控管理，内控稽核部对业务的风险和合规性以及制度执行情况进行监督检查。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 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级的同业存单投资。

6.4.13.2.4 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。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除小部分流通受限证券外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

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

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

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 2019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	16,392,785.86	-	-	-	-	-	16,392,785.86
存出保证金	12,223.89	-	-	-	-	-	12,223.89
交易性金融资产	-	-	-	-	-	167,294,563.82	167,294,563.82
应收利息	-	-	-	-	-	2,476.20	2,476.20
应收申购款	-	-	-	-	-	37,621.19	37,621.19
资产总计	16,405,009.75	-	-	-	-	167,334,661.21	183,739,670.96
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	4,451,482.37	4,451,482.37
应付赎回款	-	-	-	-	-	125,358.02	125,358.02
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	140,558.54	140,558.54
应付托管费	-	-	-	-	-	28,111.74	28,111.74
应付交易费用	-	-	-	-	-	30,941.51	30,941.51
其他负债	-	-	-	-	-	157,833.31	157,833.31
负债总计	-	-	-	-	-	4,934,285.49	4,934,285.49
利率敏感度缺口	16,405,009.75	-	-	-	-	-162,400,375.72	178,805,385.47
上年度末 2018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	10,135,126.54	-	-	-	-	-	10,135,126.54
存出保证金	29,547.45	-	-	-	-	-	29,547.45
交易性金融资产	-	-	-	-	-	148,955,489.53	148,955,489.53
应收证券清算款	-	-	-	-	-	40,121.61	40,121.61
应收利息	-	-	-	-	-	2,222.57	2,222.57
应收申购款	-	-	-	-	-	33,108.93	33,108.93

其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	10,164,673.99	-	-	-	-149,030,942.64	159,195,616.63
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	743,860.80	743,860.80
应付管理人报酬	-	-	-	-	139,354.26	139,354.26
应付托管费	-	-	-	-	27,870.85	27,870.85
应付交易费用	-	-	-	-	34,946.47	34,946.47
其他负债	-	-	-	-	242,793.62	242,793.62
负债总计	-	-	-	-	1,188,826.00	1,188,826.00
利率敏感度缺口	10,164,673.99	-	-	-	-147,842,116.64	158,006,790.63

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 2019年6月30日		上年度末 2018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	167,294,563.82	93.56	148,955,489.53	94.27
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	167,294,563.82	93.56	148,955,489.53	94.27

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（2019 年 6 月 30 日）	上年度末（2018 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准增加 5%	8,830,423.81	7,809,664.69
	业绩比较基准减少 5%	-8,830,423.81	-7,809,664.69

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

无。

§ 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	167,294,563.82	91.05
	其中：股票	167,294,563.82	91.05
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	16,392,785.86	8.92
8	其他各项资产	52,321.28	0.03
9	合计	183,739,670.96	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	1,851,911.00	1.04
B	采矿业	5,921,152.72	3.31
C	制造业	93,071,471.18	52.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,303,533.08	2.97
E	建筑业	2,969,194.52	1.66
F	批发和零售业	8,861,442.17	4.96
G	交通运输、仓储和邮政业	5,646,366.65	3.16
H	住宿和餐饮业	643,492.00	0.36
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,033,451.28	8.97

J	金融业	7,494,021.40	4.19
K	房地产业	7,758,976.91	4.34
L	租赁和商务服务业	2,298,831.35	1.29
M	科学研究和技术服务业	232,715.64	0.13
N	水利、环境和公共设施管理业	1,485,193.44	0.83
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	565,776.20	0.32
Q	卫生和社会工作	1,021,269.60	0.57
R	文化、体育和娱乐业	3,478,578.56	1.95
S	综合	2,283,274.00	1.28
	合计	166,920,651.70	93.35

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	106,933.10	0.06
C	制造业	170,398.72	0.10
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	39,603.76	0.02
J	金融业	33,869.94	0.02
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	23,106.60	0.01
S	综合	-	-
	合计	373,912.12	0.21

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	002405	四维图新	68,550	1,103,655.00	0.62
2	000860	顺鑫农业	22,700	1,058,955.00	0.59
3	600872	中炬高新	24,300	1,040,769.00	0.58
4	002157	正邦科技	51,800	862,988.00	0.48
5	002049	紫光国微	18,500	816,035.00	0.46
6	300253	卫宁健康	56,701	804,020.18	0.45
7	600201	生物股份	50,570	793,443.30	0.44
8	000066	中国长城	77,032	791,888.96	0.44
9	002195	二三四五	201,723	784,702.47	0.44
10	600739	辽宁成大	53,500	777,890.00	0.44
11	300450	先导智能	23,100	776,160.00	0.43
12	600763	通策医疗	8,400	744,156.00	0.42
13	002506	协鑫集成	110,600	738,808.00	0.41
14	600426	华鲁恒升	49,682	738,274.52	0.41
15	002439	启明星辰	27,400	737,060.00	0.41
16	002507	涪陵榨菜	24,100	735,050.00	0.41
17	000401	冀东水泥	41,200	725,532.00	0.41
18	002127	南极电商	64,300	722,732.00	0.40
19	600642	申能股份	119,400	717,594.00	0.40
20	002129	中环股份	72,900	711,504.00	0.40
21	002463	沪电股份	51,332	699,141.84	0.39
22	600183	生益科技	46,205	695,385.25	0.39
23	600895	张江高科	33,800	693,576.00	0.39
24	600536	中国软件	12,900	692,343.00	0.39
25	000975	银泰资源	51,986	685,695.34	0.38
26	600298	安琪酵母	21,600	683,208.00	0.38

27	002340	格林美	145,052	683,194.92	0.38
28	300383	光环新网	40,400	677,508.00	0.38
29	002465	海格通信	70,500	672,570.00	0.38
30	000623	吉林敖东	40,680	666,745.20	0.37
31	000750	国海证券	128,800	647,864.00	0.36
32	002223	鱼跃医疗	26,289	647,235.18	0.36
33	002268	卫士通	25,660	627,387.00	0.35
34	002384	东山精密	42,100	613,397.00	0.34
35	603369	今世缘	21,900	610,791.00	0.34
36	002075	沙钢股份	77,300	606,032.00	0.34
37	600801	华新水泥	29,720	601,830.00	0.34
38	002926	华西证券	57,300	601,650.00	0.34
39	002500	山西证券	74,100	600,210.00	0.34
40	002821	凯莱英	6,100	598,288.00	0.33
41	002385	大北农	111,300	588,777.00	0.33
42	600879	航天电子	94,988	585,126.08	0.33
43	000998	隆平高科	40,300	583,544.00	0.33
44	002797	第一创业	91,900	582,646.00	0.33
45	600325	华发股份	74,040	578,252.40	0.32
46	600161	天坛生物	22,792	575,498.00	0.32
47	600460	士兰微	34,370	570,542.00	0.32
48	600497	驰宏锌锗	111,100	564,388.00	0.32
49	600528	中铁工业	48,600	562,302.00	0.31
50	000723	美锦能源	53,600	560,120.00	0.31
51	002371	北方华创	8,028	555,939.00	0.31
52	002373	千方科技	32,500	555,750.00	0.31
53	000988	华工科技	35,100	555,282.00	0.31
54	601128	常熟银行	71,700	553,524.00	0.31
55	600848	上海临港	17,700	551,001.00	0.31
56	002299	圣农发展	21,700	549,444.00	0.31
57	600779	水井坊	10,700	543,774.00	0.30
58	000686	东北证券	61,400	540,934.00	0.30
59	000778	新兴铸管	121,800	540,792.00	0.30
60	600584	长电科技	42,000	539,700.00	0.30
61	000997	新大陆	31,920	539,128.80	0.30
62	600745	闻泰科技	16,200	538,164.00	0.30
63	000009	中国宝安	93,800	535,598.00	0.30
64	600699	均胜电子	24,900	531,864.00	0.30
65	600549	厦门钨业	37,100	530,901.00	0.30

66	601168	西部矿业	83,200	530,816.00	0.30
67	002572	索菲亚	28,300	525,248.00	0.29
68	002092	中泰化学	65,701	522,979.96	0.29
69	600572	康恩贝	81,595	522,208.00	0.29
70	600820	隧道股份	82,300	519,313.00	0.29
71	600673	东阳光	66,000	518,100.00	0.29
72	600909	华安证券	79,200	517,968.00	0.29
73	600410	华胜天成	48,129	516,424.17	0.29
74	601005	重庆钢铁	256,100	514,761.00	0.29
75	000060	中金岭南	109,300	512,617.00	0.29
76	600875	东方电气	48,000	509,760.00	0.29
77	600392	盛和资源	45,990	508,649.40	0.28
78	000999	华润三九	17,188	504,295.92	0.28
79	600376	首开股份	56,300	502,759.00	0.28
80	300168	万达信息	38,400	498,048.00	0.28
81	000039	中集集团	46,560	497,260.80	0.28
82	000690	宝新能源	76,000	489,440.00	0.27
83	000960	锡业股份	43,800	489,246.00	0.27
84	600718	东软集团	38,000	487,160.00	0.27
85	000830	鲁西化工	44,700	486,336.00	0.27
86	600811	东方集团	130,100	483,972.00	0.27
87	002353	杰瑞股份	20,900	482,790.00	0.27
88	600166	福田汽车	203,700	482,769.00	0.27
89	600022	山东钢铁	287,020	479,323.40	0.27
90	600959	江苏有线	107,700	479,265.00	0.27
91	600755	厦门国贸	55,520	479,137.60	0.27
92	601333	广深铁路	147,900	477,717.00	0.27
93	002372	伟星新材	27,420	477,108.00	0.27
94	002191	劲嘉股份	38,400	476,544.00	0.27
95	600839	四川长虹	161,200	475,540.00	0.27
96	000581	威孚高科	25,600	475,136.00	0.27
97	600885	宏发股份	19,480	473,364.00	0.26
98	600567	山鹰纸业	140,000	471,800.00	0.26
99	600804	鹏博士	62,700	471,504.00	0.26
100	002281	光迅科技	17,800	471,344.00	0.26
101	601866	中远海发	173,100	470,832.00	0.26
102	000547	航天发展	49,100	469,396.00	0.26
103	002387	维信诺	35,898	468,468.90	0.26
104	002078	太阳纸业	68,000	463,080.00	0.26

105	601872	招商轮船	106,000	462,160.00	0.26
106	603939	益丰药房	6,600	461,934.00	0.26
107	600881	亚泰集团	142,000	461,500.00	0.26
108	600315	上海家化	14,700	457,905.00	0.26
109	002074	国轩高科	34,800	456,228.00	0.26
110	600521	华海药业	32,300	455,430.00	0.25
111	002916	深南电路	4,460	454,563.20	0.25
112	002217	合力泰	81,700	451,801.00	0.25
113	600808	马钢股份	130,400	444,664.00	0.25
114	600486	扬农化工	8,100	443,070.00	0.25
115	603077	和邦生物	231,200	439,280.00	0.25
116	600094	大名城	69,552	437,482.08	0.24
117	002273	水晶光电	37,705	436,623.90	0.24
118	600037	歌华有线	42,500	435,625.00	0.24
119	600260	凯乐科技	21,800	435,564.00	0.24
120	600079	人福医药	41,400	434,700.00	0.24
121	002221	东华能源	50,400	433,944.00	0.24
122	603000	人民网	24,100	429,703.00	0.24
123	002670	国盛金控	33,825	426,195.00	0.24
124	600160	巨化股份	59,940	426,173.40	0.24
125	002038	双鹭药业	18,000	424,080.00	0.24
126	600845	宝信软件	14,830	422,358.40	0.24
127	000970	中科三环	37,200	422,220.00	0.24
128	300027	华谊兄弟	85,500	419,805.00	0.23
129	002002	鸿达兴业	67,811	419,750.09	0.23
130	002085	万丰奥威	57,300	417,144.00	0.23
131	000983	西山煤电	68,700	416,322.00	0.23
132	300274	阳光电源	44,500	416,075.00	0.23
133	601699	潞安环能	52,400	416,056.00	0.23
134	300315	掌趣科技	120,300	415,035.00	0.23
135	600967	内蒙一机	37,000	414,400.00	0.23
136	000513	丽珠集团	12,364	410,855.72	0.23
137	600435	北方导航	45,500	409,045.00	0.23
138	000729	燕京啤酒	61,500	408,360.00	0.23
139	002607	中公教育	29,700	407,781.00	0.23
140	600143	金发科技	83,200	407,680.00	0.23
141	300088	长信科技	80,400	406,824.00	0.23
142	600643	爱建集团	42,462	406,785.96	0.23
143	600282	南钢股份	116,100	406,350.00	0.23

144	600466	蓝光发展	65,280	406,041.60	0.23
145	600737	中粮糖业	46,700	405,356.00	0.23
146	600064	南京高科	37,840	405,266.40	0.23
147	600388	龙净环保	32,700	405,153.00	0.23
148	300009	安科生物	25,100	399,090.00	0.22
149	603444	吉比特	1,900	398,924.00	0.22
150	002589	瑞康医药	52,550	398,854.50	0.22
151	000089	深圳机场	44,800	398,272.00	0.22
152	600171	上海贝岭	24,500	398,125.00	0.22
153	600863	内蒙华电	126,700	397,838.00	0.22
154	002110	三钢闽光	42,770	397,761.00	0.22
155	300166	东方国信	32,319	397,200.51	0.22
156	600266	北京城建	49,240	396,874.40	0.22
157	600021	上海电力	45,700	396,676.00	0.22
158	000878	云南铜业	37,257	396,041.91	0.22
159	601098	中南传媒	31,300	395,632.00	0.22
160	002174	游族网络	23,300	393,304.00	0.22
161	603517	绝味食品	10,100	392,991.00	0.22
162	300001	特锐德	21,800	392,836.00	0.22
163	300207	欣旺达	33,800	389,376.00	0.22
164	002131	利欧股份	203,627	388,927.57	0.22
165	002019	亿帆医药	31,644	387,639.00	0.22
166	600026	中远海能	59,700	387,453.00	0.22
167	601118	海南橡胶	74,800	385,220.00	0.22
168	000563	陕国投 A	86,686	384,885.84	0.22
169	600258	首旅酒店	21,400	384,772.00	0.22
170	002690	美亚光电	11,800	384,680.00	0.22
171	600373	中文传媒	30,101	378,068.56	0.21
172	000636	风华高科	31,200	377,520.00	0.21
173	601106	中国一重	119,900	376,486.00	0.21
174	002440	闰土股份	30,200	376,292.00	0.21
175	601718	际华集团	95,900	374,969.00	0.21
176	000883	湖北能源	85,500	371,070.00	0.21
177	002155	湖南黄金	36,800	370,576.00	0.21
178	000826	启迪桑德	31,200	367,848.00	0.21
179	600380	健康元	42,332	366,171.80	0.20
180	000930	中粮生化	48,500	364,720.00	0.20
181	002233	塔牌集团	31,200	364,416.00	0.20
182	601100	恒立液压	11,500	360,870.00	0.20

183	002152	广电运通	52,600	360,310.00	0.20
184	000732	泰禾集团	21,804	359,766.00	0.20
185	002250	联化科技	32,375	359,038.75	0.20
186	000559	万向钱潮	60,000	358,800.00	0.20
187	600649	城投控股	55,200	357,144.00	0.20
188	601966	玲珑轮胎	21,000	357,000.00	0.20
189	000681	视觉中国	18,400	356,592.00	0.20
190	000598	兴蓉环境	78,300	356,265.00	0.20
191	601000	唐山港	129,395	355,836.25	0.20
192	300316	晶盛机电	27,930	354,431.70	0.20
193	000932	华菱钢铁	73,880	352,407.60	0.20
194	600008	首创股份	99,200	349,184.00	0.20
195	600782	新钢股份	69,800	349,000.00	0.20
196	300182	捷成股份	78,800	347,508.00	0.19
197	600039	四川路桥	94,800	345,072.00	0.19
198	601231	环旭电子	28,600	344,630.00	0.19
199	600827	百联股份	35,000	343,350.00	0.19
200	002399	海普瑞	16,300	342,137.00	0.19
201	600648	外高桥	16,300	341,974.00	0.19
202	600500	中化国际	45,500	339,885.00	0.19
203	600515	海航基础	68,200	337,590.00	0.19
204	002583	海能达	40,200	337,278.00	0.19
205	002004	华邦健康	69,300	336,798.00	0.19
206	000738	航发控制	25,100	336,340.00	0.19
207	600748	上实发展	40,290	334,004.10	0.19
208	600598	北大荒	31,100	333,703.00	0.19
209	601179	中国西电	89,400	330,780.00	0.18
210	000031	大悦城	51,500	330,630.00	0.18
211	000758	中色股份	60,200	330,498.00	0.18
212	000685	中山公用	38,652	330,088.08	0.18
213	603501	韦尔股份	6,000	329,460.00	0.18
214	002368	太极股份	10,850	328,755.00	0.18
215	002266	浙富控股	69,110	328,272.50	0.18
216	601608	中信重工	75,700	327,024.00	0.18
217	300418	昆仑万维	25,200	324,324.00	0.18
218	600729	重庆百货	10,700	323,568.00	0.18
219	000027	深圳能源	52,100	323,020.00	0.18
220	600138	中青旅	25,300	321,057.00	0.18
221	000807	云铝股份	68,400	320,796.00	0.18

222	300058	蓝色光标	75,100	320,677.00	0.18
223	000008	神州高铁	85,000	320,450.00	0.18
224	601678	滨化股份	47,332	319,964.32	0.18
225	600633	浙数文化	34,200	319,770.00	0.18
226	000877	天山股份	27,440	318,852.80	0.18
227	600167	联美控股	29,980	317,188.40	0.18
228	600120	浙江东方	24,897	317,187.78	0.18
229	603228	景旺电子	7,880	315,278.80	0.18
230	002414	高德红外	16,400	314,880.00	0.18
231	600056	中国医药	23,276	313,993.24	0.18
232	000488	晨鸣纸业	58,300	312,488.00	0.17
233	002183	怡亚通	65,000	310,050.00	0.17
234	600507	方大特钢	31,700	310,026.00	0.17
235	603885	吉祥航空	23,600	309,160.00	0.17
236	600777	新潮能源	148,500	308,880.00	0.17
237	000887	中鼎股份	32,100	307,839.00	0.17
238	600511	国药股份	13,400	307,798.00	0.17
239	600348	阳泉煤业	52,600	305,606.00	0.17
240	600409	三友化工	53,950	305,357.00	0.17
241	600155	华创阳安	22,700	304,861.00	0.17
242	002603	以岭药业	26,300	304,554.00	0.17
243	300133	华策影视	45,200	304,196.00	0.17
244	600823	世茂股份	65,800	303,338.00	0.17
245	600216	浙江医药	29,600	303,104.00	0.17
246	600158	中体产业	29,500	301,785.00	0.17
247	000528	柳工	45,120	300,499.20	0.17
248	002408	齐翔腾达	38,693	299,870.75	0.17
249	600418	江淮汽车	57,800	298,248.00	0.17
250	000813	德展健康	39,100	297,942.00	0.17
251	600060	海信电器	34,300	295,666.00	0.17
252	002812	恩捷股份	6,280	293,590.00	0.16
253	600970	中材国际	45,550	292,886.50	0.16
254	600525	长园集团	46,160	291,731.20	0.16
255	600277	亿利洁能	59,700	290,739.00	0.16
256	000301	东方盛虹	52,700	289,323.00	0.16
257	603883	老百姓	4,933	288,481.84	0.16
258	002701	奥瑞金	61,720	288,232.40	0.16
259	601880	大连港	135,120	287,805.60	0.16
260	600597	光明乳业	26,700	287,025.00	0.16

261	600062	华润双鹤	22,721	286,511.81	0.16
262	300010	立思辰	30,400	285,456.00	0.16
263	300113	顺网科技	18,200	285,376.00	0.16
264	600580	卧龙电驱	33,900	285,099.00	0.16
265	002640	跨境通	34,100	284,053.00	0.16
266	601958	金铂股份	42,300	283,410.00	0.16
267	002407	多氟多	23,900	282,976.00	0.16
268	000090	天健集团	57,266	282,894.04	0.16
269	600717	天津港	44,040	282,736.80	0.16
270	002244	滨江集团	68,000	282,200.00	0.16
271	600478	科力远	50,470	282,127.30	0.16
272	002242	九阳股份	13,400	278,854.00	0.16
273	300244	迪安诊断	16,320	277,113.60	0.15
274	600307	酒钢宏兴	136,500	277,095.00	0.15
275	002212	南洋股份	20,200	276,740.00	0.15
276	000156	华数传媒	25,100	276,351.00	0.15
277	000028	国药一致	6,600	276,078.00	0.15
278	002419	天虹股份	21,000	274,260.00	0.15
279	600664	哈药股份	66,190	274,026.60	0.15
280	002056	横店东磁	36,000	273,600.00	0.15
281	300002	神州泰岳	68,600	273,028.00	0.15
282	600312	平高电气	35,500	272,995.00	0.15
283	300026	红日药业	78,700	271,515.00	0.15
284	600557	康缘药业	18,172	270,035.92	0.15
285	601200	上海环境	19,840	270,022.40	0.15
286	002128	露天煤业	31,200	269,880.00	0.15
287	002426	胜利精密	105,400	269,824.00	0.15
288	601928	凤凰传媒	33,400	269,538.00	0.15
289	600316	洪都航空	18,800	269,028.00	0.15
290	603659	璞泰来	5,700	268,014.00	0.15
291	600759	洲际油气	69,380	267,806.80	0.15
292	002491	通鼎互联	33,000	266,970.00	0.15
293	601611	中国核建	34,300	266,854.00	0.15
294	600259	广晟有色	6,600	265,980.00	0.15
295	600073	上海梅林	28,674	263,800.80	0.15
296	002665	首航节能	77,765	263,623.35	0.15
297	002470	金正大	72,000	262,080.00	0.15
298	002030	达安基因	24,384	261,640.32	0.15
299	000021	深科技	32,100	260,973.00	0.15

300	600884	杉杉股份	24,500	260,925.00	0.15
301	601717	郑煤机	45,500	259,805.00	0.15
302	300134	大富科技	16,680	259,040.40	0.14
303	300324	旋极信息	44,714	258,894.06	0.14
304	600859	王府井	17,040	258,837.60	0.14
305	600754	锦江股份	10,500	258,720.00	0.14
306	600125	铁龙物流	40,002	258,012.90	0.14
307	300197	铁汉生态	71,700	257,403.00	0.14
308	002064	华峰氨纶	51,200	257,024.00	0.14
309	002176	江特电机	52,300	254,701.00	0.14
310	600267	海正药业	25,370	253,700.00	0.14
311	600017	日照港	80,500	253,575.00	0.14
312	603816	顾家家居	7,920	252,806.40	0.14
313	000078	海王生物	72,450	252,126.00	0.14
314	600751	海航科技	78,800	250,584.00	0.14
315	000712	锦龙股份	19,500	250,380.00	0.14
316	300115	长盈精密	23,814	249,808.86	0.14
317	600582	天地科技	72,300	249,435.00	0.14
318	600575	皖江物流	84,800	248,464.00	0.14
319	002051	中工国际	21,604	247,797.88	0.14
320	000727	华东科技	118,500	247,665.00	0.14
321	002358	森源电气	24,300	246,645.00	0.14
322	002302	西部建设	22,000	245,080.00	0.14
323	002424	贵州百灵	24,700	244,036.00	0.14
324	000959	首钢股份	69,300	243,936.00	0.14
325	002280	联络互动	66,500	243,390.00	0.14
326	600563	法拉电子	5,900	242,903.00	0.14
327	002317	众生药业	28,510	242,620.10	0.14
328	002285	世联行	53,488	241,230.88	0.13
329	600499	科达洁能	55,000	240,900.00	0.13
330	603866	桃李面包	5,780	240,737.00	0.13
331	600291	西水股份	23,800	239,428.00	0.13
332	000400	许继电气	26,400	239,184.00	0.13
333	600565	迪马股份	63,800	237,974.00	0.13
334	600901	江苏租赁	39,000	237,510.00	0.13
335	000519	中兵红箭	30,522	235,935.06	0.13
336	002505	大康农业	119,560	235,533.20	0.13
337	000158	常山北明	43,320	234,794.40	0.13
338	600317	营口港	85,000	234,600.00	0.13

339	000717	韶钢松山	52,900	234,347.00	0.13
340	600835	上海机电	14,110	234,226.00	0.13
341	002444	巨星科技	23,400	233,532.00	0.13
342	600993	马应龙	13,230	233,509.50	0.13
343	000926	福星股份	33,700	233,204.00	0.13
344	600645	中源协和	13,444	232,715.64	0.13
345	002028	思源电气	23,236	231,430.56	0.13
346	002390	信邦制药	43,750	230,562.50	0.13
347	002573	清新环境	28,500	229,425.00	0.13
348	000718	苏宁环球	66,200	229,052.00	0.13
349	600141	兴发集团	22,260	228,832.80	0.13
350	600908	无锡银行	40,400	227,856.00	0.13
351	600770	综艺股份	34,000	227,120.00	0.13
352	601326	秦港股份	62,300	226,149.00	0.13
353	600151	航天机电	43,900	226,085.00	0.13
354	000006	深振业 A	41,269	224,916.05	0.13
355	002249	大洋电机	51,800	224,812.00	0.13
356	000980	众泰汽车	53,200	223,972.00	0.13
357	000012	南玻 A	53,503	222,572.48	0.12
358	002839	张家港行	39,500	222,385.00	0.12
359	600611	大众交通	47,750	222,037.50	0.12
360	002807	江阴银行	47,420	221,925.60	0.12
361	000543	皖能电力	46,960	221,181.60	0.12
362	600787	中储股份	38,400	220,032.00	0.12
363	600862	中航高科	24,400	219,356.00	0.12
364	002831	裕同科技	11,440	219,304.80	0.12
365	600765	中航重机	23,700	218,751.00	0.12
366	600458	时代新材	20,970	217,878.30	0.12
367	002332	仙琚制药	32,200	217,672.00	0.12
368	603712	七一二	10,200	216,546.00	0.12
369	300055	万邦达	30,300	216,039.00	0.12
370	300308	中际旭创	6,320	214,816.80	0.12
371	000848	承德露露	25,688	213,981.04	0.12
372	002366	台海核电	22,800	213,408.00	0.12
373	603515	欧普照明	6,610	213,172.50	0.12
374	601019	山东出版	27,400	213,172.00	0.12
375	000600	建投能源	31,300	209,710.00	0.12
376	600169	太原重工	78,500	209,595.00	0.12
377	600338	西藏珠峰	11,920	208,361.60	0.12

378	002048	宁波华翔	19,200	207,744.00	0.12
379	603233	大参林	4,580	206,100.00	0.12
380	000564	供销大集	78,900	205,929.00	0.12
381	002431	棕榈股份	52,058	205,629.10	0.12
382	600393	粤泰股份	44,200	205,530.00	0.11
383	601311	骆驼股份	18,900	205,065.00	0.11
384	002672	东江环保	18,038	204,550.92	0.11
385	002093	国脉科技	22,000	204,380.00	0.11
386	002635	安洁科技	15,100	203,699.00	0.11
387	300376	易事特	40,700	200,651.00	0.11
388	300287	飞利信	50,000	198,500.00	0.11
389	002254	泰和新材	18,732	198,184.56	0.11
390	300297	蓝盾股份	32,800	197,784.00	0.11
391	600978	宜华生活	51,940	195,294.40	0.11
392	300159	新研股份	39,200	195,216.00	0.11
393	601689	拓普集团	12,700	194,564.00	0.11
394	002745	木林森	16,600	194,552.00	0.11
395	002544	杰赛科技	14,900	193,700.00	0.11
396	000869	张裕 A	6,000	192,720.00	0.11
397	601016	节能风电	72,400	192,584.00	0.11
398	603198	迎驾贡酒	10,500	188,055.00	0.11
399	603766	隆鑫通用	44,850	187,921.50	0.11
400	600623	华谊集团	24,400	186,416.00	0.10
401	600006	东风汽车	34,949	186,278.17	0.10
402	300266	兴源环境	41,000	186,140.00	0.10
403	600640	号百控股	13,899	185,968.62	0.10
404	002503	搜于特	67,416	185,394.00	0.10
405	300199	翰宇药业	20,100	184,317.00	0.10
406	000062	深圳华强	13,765	182,936.85	0.10
407	600195	中牧股份	13,200	182,820.00	0.10
408	603888	新华网	9,100	181,636.00	0.10
409	002709	天赐材料	7,500	181,500.00	0.10
410	600639	浦东金桥	11,200	181,104.00	0.10
411	600757	长江传媒	26,500	180,465.00	0.10
412	000501	鄂武商 A	16,680	179,310.00	0.10
413	600750	江中药业	13,775	179,212.75	0.10
414	000990	诚志股份	10,900	178,869.00	0.10
415	600694	大商股份	6,400	178,624.00	0.10
416	000937	冀中能源	46,200	178,332.00	0.10

417	600329	中新药业	12,389	177,038.81	0.10
418	600545	卓郎智能	24,800	176,328.00	0.10
419	603056	德邦股份	12,500	176,000.00	0.10
420	600869	智慧能源	38,800	175,376.00	0.10
421	600416	湘电股份	29,100	175,182.00	0.10
422	000426	兴业矿业	32,554	174,814.98	0.10
423	603568	伟明环保	8,102	174,355.04	0.10
424	002382	蓝帆医疗	12,600	174,132.00	0.10
425	002375	亚厦股份	29,200	172,572.00	0.10
426	002815	崇达技术	10,900	169,931.00	0.10
427	000537	广宇发展	24,300	168,156.00	0.09
428	603806	福斯特	4,570	167,856.10	0.09
429	601001	大同煤业	36,700	167,719.00	0.09
430	300257	开山股份	15,000	166,200.00	0.09
431	002707	众信旅游	27,145	164,770.15	0.09
432	601127	小康股份	12,400	162,440.00	0.09
433	002920	德赛西威	7,200	161,280.00	0.09
434	000061	农产品	29,600	160,432.00	0.09
435	002434	万里扬	23,400	158,886.00	0.09
436	600058	五矿发展	18,800	158,860.00	0.09
437	002489	浙江永强	47,428	158,409.52	0.09
438	603377	东方时尚	10,340	157,995.20	0.09
439	000829	天音控股	27,100	157,722.00	0.09
440	600874	创业环保	19,000	157,510.00	0.09
441	601801	皖新传媒	26,100	156,861.00	0.09
442	002509	天广中茂	76,100	156,766.00	0.09
443	600707	彩虹股份	31,200	156,312.00	0.09
444	600657	信达地产	37,300	153,676.00	0.09
445	600971	恒源煤电	26,200	153,270.00	0.09
446	002681	奋达科技	36,104	153,080.96	0.09
447	000536	华映科技	60,460	152,359.20	0.09
448	002437	誉衡药业	38,376	151,585.20	0.08
449	002512	达华智能	33,500	151,420.00	0.08
450	002118	紫鑫药业	22,400	150,976.00	0.08
451	002948	青岛银行	23,300	149,819.00	0.08
452	002517	恺英网络	46,950	149,770.50	0.08
453	000541	佛山照明	28,259	148,077.16	0.08
454	600996	贵广网络	13,700	147,686.00	0.08
455	300459	金科文化	25,800	146,802.00	0.08

456	600098	广州发展	23,700	145,992.00	0.08
457	000766	通化金马	21,193	144,112.40	0.08
458	601139	深圳燃气	25,100	142,819.00	0.08
459	002251	步步高	17,900	142,663.00	0.08
460	600350	山东高速	29,400	141,120.00	0.08
461	600428	中远海特	37,600	139,120.00	0.08
462	002936	郑州银行	26,800	136,144.00	0.08
463	000552	靖远煤电	49,900	135,229.00	0.08
464	603328	依顿电子	13,100	134,537.00	0.08
465	600053	九鼎投资	5,700	132,810.00	0.07
466	600335	国机汽车	19,050	131,826.00	0.07
467	601869	长飞光纤	3,500	131,250.00	0.07
468	002344	海宁皮城	28,000	130,480.00	0.07
469	601615	明阳智能	12,000	130,080.00	0.07
470	002482	广田集团	26,750	130,005.00	0.07
471	601003	柳钢股份	22,400	129,696.00	0.07
472	600903	贵州燃气	9,900	128,997.00	0.07
473	002818	富森美	10,000	128,300.00	0.07
474	601777	力帆股份	28,600	122,694.00	0.07
475	000587	金洲慈航	46,100	118,938.00	0.07
476	603556	海兴电力	8,570	118,437.40	0.07
477	600939	重庆建工	23,800	116,382.00	0.07
478	000987	越秀金控	12,000	108,240.00	0.06
479	000025	特力 A	5,065	102,414.30	0.06
480	002416	爱施德	16,300	101,875.00	0.06
481	601969	海南矿业	17,200	101,136.00	0.06
482	600126	杭钢股份	22,100	100,776.00	0.06
483	600179	ST 安通	32,520	95,283.60	0.05
484	600985	淮北矿业	8,400	95,256.00	0.05
485	002699	美盛文化	15,820	94,920.00	0.05
486	601068	中铝国际	13,500	93,150.00	0.05
487	603225	新风鸣	7,224	90,227.76	0.05
488	600280	中央商场	25,100	90,109.00	0.05
489	601811	新华文轩	7,000	85,470.00	0.05
490	603868	飞科电器	2,100	82,215.00	0.05
491	603486	科沃斯	2,700	81,675.00	0.05
492	002941	新疆交建	3,100	80,600.00	0.05
493	603355	莱克电气	3,500	75,320.00	0.04
494	000761	本钢板材	16,700	71,810.00	0.04

495	002946	新乳业	4,100	62,074.00	0.03
496	603650	彤程新材	2,800	61,152.00	0.03
497	600917	重庆燃气	8,100	56,376.00	0.03
498	603025	大豪科技	4,814	49,295.36	0.03
499	603569	长久物流	3,480	40,333.20	0.02
500	603877	太平鸟	2,500	38,800.00	0.02

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	600968	海油发展	30,122	106,933.10	0.06
2	300782	卓胜微	743	80,927.56	0.05
3	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.02
4	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.02
5	300594	朗进科技	721	31,803.31	0.02
6	603863	松炆资源	1,330	30,696.40	0.02
7	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.02
8	300788	中信出版	1,556	23,106.60	0.01

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	002405	四维图新	1,337,449.00	0.85
2	002157	正邦科技	918,143.00	0.58
3	600739	辽宁成大	738,519.00	0.47
4	600763	通策医疗	694,174.00	0.44
5	002075	沙钢股份	664,346.00	0.42
6	000333	美的集团	609,850.76	0.39
7	002926	华西证券	596,795.00	0.38

8	600549	厦门钨业	592,096.00	0.37
9	600497	驰宏锌锗	588,572.00	0.37
10	002797	第一创业	569,721.00	0.36
11	600745	闻泰科技	565,626.00	0.36
12	002821	凯莱英	552,793.00	0.35
13	002572	索菲亚	522,193.00	0.33
14	600909	华安证券	495,669.00	0.31
15	002387	维信诺	483,220.28	0.31
16	601333	广深铁路	482,427.00	0.31
17	002217	合力泰	474,875.00	0.30
18	601699	潞安环能	434,669.00	0.28
19	600521	华海药业	433,411.00	0.27
20	000983	西山煤电	430,312.00	0.27

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	300347	泰格医药	1,092,137.00	0.69
2	002410	广联达	959,890.08	0.61
3	000656	金科股份	815,352.39	0.52
4	600600	青岛啤酒	794,754.00	0.50
5	300146	汤臣倍健	786,559.00	0.50
6	600256	广汇能源	708,913.30	0.45
7	000418	小天鹅 A	654,467.76	0.43
8	000333	美的集团	594,057.56	0.38
9	000596	古井贡酒	587,678.00	0.37
10	300413	芒果超媒	565,373.00	0.36
11	603899	晨光文具	532,194.00	0.34
12	002013	中航机电	486,032.70	0.31
13	600655	豫园股份	458,770.00	0.29
14	600989	宝丰能源	405,534.80	0.26
15	600270	外运发展	370,551.84	0.23
16	000667	美好置业	343,108.00	0.22

17	600366	宁波韵升	327,605.80	0.21
18	600503	华丽家族	306,649.00	0.19
19	601598	中国外运	303,302.64	0.19
20	600779	水井坊	281,079.00	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	30,738,274.80
卖出股票收入（成交）总额	42,630,992.75

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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受到调查以及处罚的情况的说明

1、中炬高新

本报告期，本基金持有中炬高新，其发行主体因关联交易事项未及时履行信息披露义务、未
及时召开董事会、股东大会进行审议等问题，被上海证券交易所予以监管关注。

本基金对上述股票的投资属于跟踪标的指数的被动投资，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超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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	12,223.89
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,476.20
5	应收申购款	37,621.19
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	52,321.28

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处于转股期的可转换债券。

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**

无。

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	601236	红塔证券	33,869.94	0.02	新股未上市

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	120	13,595.25	399,280.00	24.47%	1,232,150.00	75.53%
500B	201	12,174.86	734,148.00	30.00%	1,712,998.00	70.00%
工银 500	6,025	27,879.52	112,370,569.13	66.90%	55,603,565.07	33.10%
合计	6,346	27,111.99	113,503,997.13	65.97%	58,548,713.07	34.03%

8.2 期末上市基金前十名持有人

500A

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	叶明	334,300.00	20.49%
2	中量投资资产管理有限公司—中量投资量化多策略 1 号私募基金	246,552.00	15.11%
3	刘平	220,824.00	13.54%
4	中量投资资产管理有限公司—中量投资优选 1 号私募基金	152,728.00	9.36%
5	王奕	115,000.00	7.05%
6	陈镇东	55,200.00	3.38%
7	刘向华	37,872.00	2.32%
8	黄晖	34,968.00	2.14%
9	陈兴孝	32,800.00	2.01%
10	王朝波	30,000.00	1.84%

500B

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	利得资本管理有限公司—利得资本—利得盈 1 号资产管理计划	734,148.00	30.00%
2	顾红	330,994.00	13.53%
3	林瑞连	300,000.00	12.26%
4	董翠萍	67,700.00	2.77%

5	黄之林	66,628.00	2.72%
6	顾佐燕	59,004.00	2.41%
7	陈镇东	57,746.00	2.36%
8	李玉华	41,800.00	1.71%
9	苗玉芹	39,500.00	1.61%
10	黄春雄	34,100.00	1.39%

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	66,339.69	0.04%
	合计	66,339.69	0.04%

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	1,945,534.00	2,918,302.00	172,057,104.68
本报告期期间基金总申购份额	-	-	17,117,392.34
减:本报告期期间基金总赎回份额	-	-	26,074,125.54
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-314,104.00	-471,156.00	4,873,762.72
本报告期期末基金份额总额	1,631,430.00	2,447,146.00	167,974,134.20

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及折算调整份额，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。

§ 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 2019 年 5 月 8 日发布《工银瑞信基金管理有限公司关于董事长变更的公告》，尚军先生自 2019 年 5 月 6 日起不再担任董事长。

基金管理人于 2019 年 5 月 9 日发布《工银瑞信基金管理有限公司关于董事长和总经理变更的公告》，郭特华女士自 2019 年 5 月 8 日起担任董事长，不再担任总经理；王海璐女士自 2019 年 5 月 8 日起担任总经理。

2、基金托管人：

2019 年 5 月，陈四清先生因工作调动，辞去中国银行股份有限公司董事长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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

报告期内，本基金管理人收到中国人民银行营业管理部处罚决定，对公司未严格按照反洗钱相关规定履行客户身份识别义务及可疑交易报告义务予以罚款。基金管理人对此高度重视，积极开展整改工作，已完善了反洗钱制度体系和工作机制，深入具体问题整改。前述事项对基金份额持有人利益无不利影响。

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

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	27,863,600.82	40.04%	17,033.13	40.03%	-
申万宏源	2	22,275,589.22	32.01%	13,616.32	32.00%	-
民生证券	2	10,047,608.53	14.44%	6,142.11	14.43%	-
国泰君安	1	8,902,278.85	12.79%	5,441.81	12.79%	-
中信证券	2	319,688.56	0.46%	195.43	0.46%	-
长江证券	1	176,324.45	0.25%	125.39	0.29%	-
中金	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-

注：1. 交易单元的选择标准和程序

基金管理人选择综合实力强、研究能力突出、合规经营的证券公司，向其租用专用交易单元。

(1) 选择标准：

- a) 经营行为规范，在最近一年内无重大违规行为。
- b) 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、个股分析的报告及量化、衍生品和国际市场的研究服务支持。
- c) 在证监会最近一期证券公司年度分类结果中，分类级别原则上不得低于 BBB。
- d) 与其他证券公司相比，能够提供最佳交易执行和优惠合理的佣金费率。

(2) 选择程序

a) 新增证券公司的选定：根据以上标准对证券公司进行考察、选择和确定。在合作之前，证券公司需提供至少两个季度的服务，并在两个季度内与其他已合作证券公司一起参与基金管理人的研究服务评估。根据对其研究服务评估结果决定是否作为新增合作证券公司。

b) 签订协议：与被选择的证券公司签订交易单元租用协议。

2. 证券公司的评估、保留和更换程序

(1) 交易单元的租用期限为一年，合同到期前 30 天内，基金管理人将根据各证券公司在服务期间的综合证券服务质量、费率等情况进行评估。

(2) 对于符合标准的证券公司，与其续约；对于不能达到标准的证券公司，不与其续约，并根据证券公司选择标准和程序，重新选择其他经营稳健、研究能力强、综合服务质量高的证券经营机构，租用其交易单元。

(3) 若证券公司提供的综合证券服务不符合要求，基金管理人有权按照协议约定，提前终止租用其交易单元。

在本报告期内本基金新增华泰证券的 399681 深圳交易单元，40684 上海交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

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
招商证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中金	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

中泰证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-

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	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业务期间暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	中国证监会指定的媒介	2019 年 1 月 2 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 2019 年度约定年基准收益率的公告	中国证监会指定的媒介	2019 年 1 月 3 日
3	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 份额停复牌的公告	中国证监会指定的媒介	2019 年 1 月 3 日
4	关于工银瑞信睿智中证 500 指数分级证券投资基金定期份额折算结果及恢复交易的公告	中国证监会指定的媒介	2019 年 1 月 4 日
5	关于工银瑞信睿智中证 500 指数分级证券投资基金之 A 份额定期折算后次日前收盘价调整的风险提示公告	中国证监会指定的媒介	2019 年 1 月 4 日
6	关于工银瑞信睿智中证 500 指数分级证券投资基金限制大额申购及定期定额投资业务的公告	中国证监会指定的媒介	2019 年 2 月 22 日
7	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	2019 年 3 月 29 日
8	工银瑞信基金管理有限公司关于旗下基金参加工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定的媒介	2019 年 4 月 1 日

9	工银瑞信基金管理有限公司关于董事长变更的公告	中国证监会指定的媒介	2019 年 5 月 8 日
10	工银瑞信基金管理有限公司关于董事长和总经理变更的公告	中国证监会指定的媒介	2019 年 5 月 9 日
11	工银瑞信睿智中证 500 指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示公告	中国证监会指定的媒介	2019 年 6 月 4 日
12	工银瑞信睿智中证 500 指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示公告	中国证监会指定的媒介	2019 年 6 月 10 日
13	工银瑞信睿智中证 500 指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示公告	中国证监会指定的媒介	2019 年 6 月 17 日
14	工银瑞信睿智中证 500 指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示公告	中国证监会指定的媒介	2019 年 6 月 26 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	20190101-20190630	46,438,100.47	1,072,817.08	13,000,000.00	34,510,917.55	20.06%
	2	20190101-20190630	70,922,725.94	6,913,789.22	-	77,836,515.16	45.24%
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

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 2019 年 1 月 2 日办理了定期份额折算业务，详见基金管理人在指定媒介发布的公告。

§ 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媒介上披露的各项公告

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