（上接B320版）

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型前）

6.1 资产负债表

会计主体:工银瑞信保本混合型证券投资基金

报告截止日：2018年2月8日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2018年2月8日	上年度末 2017年12月31日
资 产:			
银行存款		247,126,949.48	11,237,913.59
结算备付金		2,639,649.01	5,450,559.49
存出保证金		52,626.47	33,090.51
交易性金融资产		–	263,021,520.83
其中:股票投资		–	46,118,339.43
基金投资		–	–
债券投资		–	216,903,181.40
资产支持证券投资		–	–
贵金属投资		–	–
衍生金融资产		–	–
买入返售金融资产		–	39,900,179.95
应收证券清算款		–	14,033,761.09
应收利息		105,698.53	4,258,184.68
应收股利		–	–
应收申购款		–	31,203.00
递延所得税资产		–	–
其他资产		–	–
资产总计		249,924,923.49	337,966,413.04
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年2月8日	上年度末 2017年12月31日
负 债:			
短期借款		–	–
交易性金融负债		–	–
衍生金融负债		–	–
卖出回购金融资产款		–	10,288,087.19
应付证券清算款		–	–
应付赎回款		39,783,489.15	2,387,853.34
应付管理人报酬		75,692.40	334,226.41
应付托管费		12,615.40	55,704.39
应付销售服务费		–	–
应付交易费用		110,293.53	70,432.19
应交税费		26,617.10	–
应付利息		–	2,693.88
应付利润		–	–
递延所得税负债		–	–
其他负债		3,262,870.30	3,235,276.92
负债合计		43,271,577.88	16,374,274.32
所有者权益:			
实收基金		150,335,196.14	236,524,820.84
未分配利润		56,318,149.47	85,067,317.88
所有者权益合计		206,653,345.61	321,592,138.72
负债和所有者权益总计		249,924,923.49	337,966,413.04

注:1、本基金转型前基金合同生效日为2011年12月27日。

2、报告截止日2018年2月8日,基金份额总额为181,435,430.11份,其中A类基金份额净值为人民币1.139元，基金份额总额为181,435,430.11份;无B类基金份额。

3、本期财务报表的实际编制期间系2018年1月1日至2018年2月8日止(基金合同失效前日）。

6.2 利润表

会计主体:工银瑞信保本混合型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年2月8日

单位:人民币元

項 目	附注号	本期 2018年1月1日至2018年2月8日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
一、收入		4,129,878.66	11,208,812.09
1.利息收入		1,364,317.69	6,496,183.19
其中:存款利息收入		100,584.08	94,894.18
债券利息收入		1,033,441.21	6,101,562.32
资产支持证券利息收入		–	–
买入返售金融资产收入		230,292.40	299,726.69
其他利息收入		–	–
2.投资收益（损失以“-”填列）		5,057,228.57	1,752,304.59
其中:股票投资收益		4,934,426.47	2,559,776.88
基金投资收益		–	–
债券投资收益		130,045.10	-866,108.29
资产支持证券投资收益		–	–
贵金属投资收益		–	–
衍生工具收益		–	–
股利收益		-7,246.00	58,636.00
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-2,304,386.08	2,795,454.68
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		–	–
5.其他收入（损失以“-”号填列）		12,721.48	164,869.63
減:二、费用		616,741.26	3,319,497.71
1.管理人报酬		400,274.50	2,453,357.90
2.托管费		66,712.41	408,892.97
3.销售服务费		–	–
4.交易费用		104,043.67	112,946.54
5.利息支出		897.97	132,303.61
其中:卖出回购金融资产支出		897.97	132,303.61
6.税金及附加		2,851.83	–
7.其他费用		41,960.88	211,996.69
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,513,137.40	7,889,314.38
減:所得税费用		–	–
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,513,137.40	7,889,314.38

注:本基金基金合同生效日为2011年12月27日。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体:工银瑞信保本混合型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年2月8日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年2月8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）	236,524,820.84	85,067,317.88	321,592,138.72
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	–	3,513,137.40	3,513,137.40
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值減少以“-”号填列）	-86,189,624.70	-32,262,305.81	-118,451,930.51
其中:1.基金申购款	1,148,968.95	429,077.75	1,578,046.70
2.基金赎回款	-87,338,593.65	-32,691,383.56	-120,029,977.21
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值減少以“-”号填列）	–	–	–
五、期末所有者权益（基金净值）	150,335,196.14	56,318,149.47	206,653,345.61
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	337,296,645.94	107,566,191.97	444,861,837.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	–	7,889,314.38	7,889,314.38
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值減少以“-”号填列）	-55,571,562.25	-18,336,170.73	-73,907,732.98
其中:1.基金申购款	3,909,546.85	1,290,467.54	5,200,014.39
2.基金赎回款	-59,481,109.10	-19,626,638.27	-79,107,747.37
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值減少以“-”号填列）	–	–	–
五、期末所有者权益（基金净值）	281,724,083.69	97,119,335.62	378,843,419.31

注:本基金基金合同生效日为2011年12月27日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

_____郭特华_____ _____赵紫英_____ _____关亚君_____

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

工银瑞信保本混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系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]1831号《关于核准工银瑞信保本混合型证券投资基金募集的批复》的批准，由工银瑞信基金管理有限公司向社会公开募集，基金合同于2011年12月27日正式生效，首次设立募集规模为3,429,896,705.59份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为和注册登记机构均为工银瑞信基金管理有限公司，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

本基金的投资范围包括具有良好流动性的企业债、公司债、短期融资券、中期票据、地方政府债、商业银行金融债与次级债、可转换债券（含分离交易的可转换债券）、资产支持证券、债券回购、国债、中央银行票据、政策性金融债、银行存款等固定收益类资产，股票（包括创业板、中小板或中国证监会核准的上市的股票）等权益类资产，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，但需符合中国证监会相关规定。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。本基金根据中国宏观经济情况和证券市场的阶段性变化，按照投资组合保险机制对安全资产（包括债券、货币市场工具等固定收益资产）和风险资产（股票、权证等权益资产）的投资比例进行动态调整。其中，股票等风险资产占基金资产的比例不高于40%;债券、债券回购、银行存款等安全资产占基金资产的比例不低于60%；现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准:税后三年期银行定期存款利率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《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）》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2018年1月1日至2018年2月8日(基金合同失效前日)止期间的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2018年2月8日(基金合同失效前日)的财务状况以及2018年1月1日至2018年2月8日(基金合同失效前日)止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

1 印花税

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年4月24日起,调整证券（股票）交易印花税税率,由原先的3‰调整为1‰;

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年9月19日起,调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税,受让方不再征收,税率不变;

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让,暂免征收印花税。

2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定,经国务院批准,自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点,金融业纳入试点范围,由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税;国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税;存款利息收入不征收增值税;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《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》的规定,金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定,金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《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,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;

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定,自2018年1月1日起,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（以下简称“资管产品运营业务”）,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税,资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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;

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定,自2018年1月1日起,资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务,按照以下规定确定销售额:提供贷款服务,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;转让2017年12月31日前取得的股票（不包括限售股）、债券、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股票收盘价（2017年最后一个交易日处于停牌期间的股票,为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、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。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加,以实际缴纳的增值税额为计税依据,分别按7%、3%和2%的比例缴纳。

3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定,自2004年1月1日起,对证券投资基金（封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,继续免征企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定,对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定,自2008年10月9日起,对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税;

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《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》的规定,自2013年1月1日起,证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,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,暂减按25%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;

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《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》的规定,自2015年9月8日起,证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限超过1年的,股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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
中国光大银行股份有限公司	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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年2月8日	上年度可比期间 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	400,274.50	2,453,357.90
其中:支付销售机构的客户维护费	157,053.09	1,036,866.46

注:“1.在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下:

H＝E×年管理费率÷当年天数,本基金年管理费率为1.2%

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。"

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年2月8日	上年度可比期间 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	66,712.41	408,892.97

注:1.H＝E×年托管费率÷当年天数,本基金年托管费率为0.2%

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。

6.4.8.2.3 销售服务费

无。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.8.4.2 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。

6.4.8.5 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 2018年1月1日至2018年2月8日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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
中国光大银行股份有限公司	247,126,949.48	97,528.01	5,257,227.96	79,783.58

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末（2018年2月8日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌股票

无。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.10 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（转型后）

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	95,663,632.22	58.74
	其中:股票	95,663,632.22	58.74
2	固定收益投资	38,870,102.80	23.87
	其中:债券	38,870,102.80	23.87
	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	21,000,000.00	12.90
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	–
6	银行存款和结算备付金合计	5,046,515.24	3.10
7	其他各项资产	2,268,088.97	1.39
8	合计	162,848,339.23	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	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	–	–
B	采矿业	–	–
C	制造业	58,912,514.19	37.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,647,576.00	1.04
E	建筑业	1,090,182.00	0.69
F	批发和零售业	13,373,665.59	8.48
G	交通运输、仓储和邮政业	1,579,500.00	1.00
H	住宿和餐饮业	993,447.84	0.63
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,107,290.60	3.87
J	金融业	3,810,995.00	2.42
K	房地产业	4,210,360.00	2.67
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	77,352.00	0.05
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	2,418,899.00	1.53
R	文化、体育和娱乐业	1,441,850.00	0.91
S	综合	–	–
	合计	95,663,632.22	60.65

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前十名股票投资明细

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	002024	苏宁易购	396,600	4,739,328.00	3.00
2	603708	家家悦	210,241	4,623,199.59	2.93
3	600271	航天信息	162,600	4,108,902.00	2.60
4	600521	华海药业	143,160	3,829,940.40	2.42
5	600887	伊利股份	124,900	3,484,710.00	2.21
6	000895	双汇发展	124,878	3,298,027.98	2.09
7	600048	保利地产	245,300	2,992,660.00	1.90
8	000651	格力电器	60,800	2,866,720.00	1.82
9	603883	老百姓	30,700	2,553,012.00	1.62
10	600763	通策医疗	49,700	2,418,899.00	1.53

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于公司网站的半年度报告正文。

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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	000651	格力电器	5,858,713.00	3.71
2	000895	双汇发展	4,905,868.16	3.11
3	603708	家家悦	4,813,889.80	3.05
4	002024	苏宁易购	4,462,675.00	2.83
5	002294	信立泰	4,345,494.00	2.75
6	600271	航天信息	4,169,826.00	2.64
7	600521	华海药业	3,829,291.00	2.43
8	002126	银轮股份	3,742,445.50	2.37
9	000408	藏格控股	3,656,960.00	2.32
10	600887	伊利股份	3,593,700.00	2.28
11	600048	保利地产	3,447,253.37	2.19
12	002751	易尚展示	3,345,456.00	2.12
13	002876	三利谱	3,237,101.00	2.05
14	600570	恒生电子	2,772,224.90	1.76
15	002449	国星光电	2,735,991.44	1.73
16	002236	大华股份	2,641,202.00	1.67
17	601222	林洋能源	2,481,417.00	1.57
18	600085	同仁堂	2,405,153.00	1.52
19	300482	万孚生物	2,385,192.00	1.51
20	600690	青岛海尔	2,361,807.27	1.50

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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	002294	信立泰	4,562,801.07	2.89
2	000408	藏格控股	3,294,607.76	2.09
3	000651	格力电器	2,906,520.00	1.84
4	002876	三利谱	2,426,518.63	1.54
5	002449	国星光电	2,363,690.70	1.50
6	300482	万孚生物	2,338,523.72	1.48
7	603043	广州酒家	2,207,323.00	1.40
8	600884	杉杉股份	2,110,687.60	1.34
9	002126	银轮股份	2,048,304.32	1.30
10	000066	中国长城	2,035,336.10	1.29
11	601222	林洋能源	1,983,527.00	1.26
12	600029	南方航空	1,949,326.00	1.24
13	600038	中直股份	1,896,774.00	1.20
14	000895	双汇发展	1,884,833.45	1.19
15	600028	中国石化	1,841,055.00	1.17
16	603127	昭衍新药	1,764,079.15	1.12
17	601607	上海医药	1,763,725.80	1.12
18	603630	拉芳家化	1,763,247.77	1.12
19	300026	红日药业	1,733,837.00	1.10
20	600756	浪潮软件	1,732,668.72	1.10

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	188,483,906.68
卖出股票收入(成交)总额	86,563,656.14

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	6,882,052.80	4.36
	其中:政策性金融债	6,882,052.80	4.36
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	30,184,000.00	19.14
6	中期票据	–	–
7	可转债(可交换债)	1,804,050.00	1.14
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	38,870,102.80	24.64

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	041760044	17湘高速CP001	100,000	10,076,000.00	6.39
2	011800275	18陕煤化SCP006	100,000	10,058,000.00	6.38
3	011800074	18津城建SCP003	100,000	10,050,000.00	6.37
4	018006	国开1701	68,560	6,882,052.80	4.36
5	123006	东财转债	15,000	1,804,050.00	1.14

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货投资,也无期间损益。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期内,本基金未运用股指期货进行投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本报告期内,本基金未运用国债期货进行投资。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货投资,也无期间损益。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本报告期内,本基金未运用国债期货进行投资。

7.12 投资组合报告附注

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

7.12.2 基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	86,224.21
2	应收证券清算款	1,498,088.11
3	应收股利	–
4	应收利息	680,663.31
5	应收申购款	3,113.34
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	2,268,088.97

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	123006	东财转债	1,804,050.00	1.14

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 投资组合报告（转型前）

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	–	–
	其中:股票	–	–
2	固定收益投资	–	–
	其中:债券	–	–
	资产支持证券	–	–
3	贵金属投资	–	–
4	金融衍生品投资	–	–
5	买入返售金融资产	–	–
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	–
6	银行存款和结算备付金合计	249,766,568.49	99.94
7	其他资产	158,325.00	0.06
8	合计	249,924,923.49	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

无。

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前十名股票投资明细

无。

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	7,027,132.00	2.19

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	601601	中国太保	12,032,678.40	3.74
2	000001	平安银行	8,931,066.60	2.78
3	000651	格力电器	7,594,438.00	2.36
4	600801	华新水泥	5,113,917.73	1.59
5	600340	华夏幸福	3,627,147.76	1.13
6	601009	南京银行	3,001,174.00	0.93
7	000915	山大华特	2,240,775.40	0.70
8	601336	新华保险	1,623,511.92	0.50
9	002027	分众传媒	1,584,151.20	0.49
10	000789	万年青	1,581,852.00	0.49
11	601222	林洋能源	1,515,045.00	0.47
12	002142	宁波银行	1,465,358.92	0.46
13	601318	中国平安	1,387,680.00	0.43
14	601166	兴业银行	1,307,960.00	0.41
15	002202	金风科技	1,170,668.40	0.36
16	600066	宇通客车	1,135,660.65	0.35
17	600518	康美药业	647,896.00	0.20

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	7,027,132.00
卖出股票收入(成交)总额	55,960,981.98

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

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