（上接B324版）

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2018年1月1日至2018年4月16日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
一、收入		-2,785,045.97	4,976,341.93
1.利息收入		8,512.97	12,074.84
其中：存款利息收入		8,512.97	12,074.84
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,528,089.28	-4,452,424.58
其中：股票投资收益		1,527,592.14	-4,712,398.19
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
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		497.14	259,973.61
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-4,324,036.14	9,378,641.79
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		2,387.92	38,049.88
减：二、费用		421,553.77	417,274.81
1.管理人报酬		145,010.74	169,262.36
2.托管费		29,002.14	33,852.47
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		99,461.17	64,331.41
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		148,079.72	149,828.57
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-3,206,599.74	4,559,067.12
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-3,206,599.74	4,559,067.12

注：本基金基金合同生效日为2012年10月25日。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：工银瑞信睿智深证100指数分级证券投资基金

本报告期：2018年1月1日至2018年4月16日

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年4月16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）	26,631,164.06	16,110,323.15	42,741,487.21
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-3,206,599.74	-3,206,599.74
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）	7,022,637.65	4,402,655.42	11,425,293.07
其中：1.基金申购款	8,535,254.95	5,372,087.51	13,907,342.46
2.基金赎回款	-1,512,617.30	-969,432.09	-2,482,049.39
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）	33,653,801.71	17,306,378.83	50,960,180.54

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）	43,554,734.39	13,641,112.06	57,195,846.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,559,067.12	4,559,067.12
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-14,222,799.37	-4,697,105.95	-18,919,905.32
其中：1.基金申购款	8,721,406.92	3,039,789.35	11,761,196.27
2.基金赎回款	-22,944,206.29	-7,736,895.30	-30,681,101.59
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）	29,331,935.02	13,503,073.23	42,835,008.25

注：本基金基金合同生效日为2012年10月25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

工银瑞信睿智深证100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[2012]1123号《关于核准工银瑞信睿智深证100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《工银瑞信睿智深证100指数分级证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集470,766,812.34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389号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《工银瑞信睿智深证100指数分级证券投资基金基金合同》于2012年10月25日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为470,909,001.94份基金份额，其中认购资金利息折合142,189.60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。

根据《工银瑞信睿智深证100指数分级证券投资基金基金合同》和《工银瑞信睿智深证100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深证100指数分级证券投资基金之基础份额(以下简称“工银深证100份额”)，工银瑞信睿智深证100指数分级证券投资基金之A份额（以下简称“工银深证100A份额”）及工银瑞信睿智深证100指数分级证券投资基金之B份额(以下简称“工银深证100B份额”)。其中，工银深证100A份额、工银深证100B份额的基金份额配比始终保持1:1的比例不变。本基金净资产优先确保工银深证100A份额的本金及工银深证100A份额累计约定日应得收益，则工银深证100A份额为低风险且预期收益相对稳定的基金份额；本基金在优先确保工银深证100A份额的本金及累计约定日应得收益后的剩余净资产计为工银深证100B份额的净资产，则工银深证100B份额为高风险且预期收益相对较高的基金份额。基金发售结束后，场外认购的全部份额将确认为工银深证100份额；场内认购的全部份额将按1:1的比例确认为工银深证100A份额与工银深证100B份额。合同生效后，工银深证100份额可办理场外与场内申购和赎回，但不上市交易；工银深证100A份额、工银深证100B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，工银深证100A份额与工银深证100B份额可申请终止运作。工银深证100A份额与工银深证100B份额终止运作后，工银深证100A份额与工银深证100B份额将全部转换为工银深证100份额的场内份额。本基金转为上市开放式基金(LOF)后，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（基金合同生效日所在会计年度除外)7月份的第一个工作日对登记在册的工银深证100份额、工银深证100A份额进行基金的定期份额折算。工银深证100A份额和工银深证100B份额按照基金合同规定的参考净值计算规则进行计算，对工银深证100A份额的应得收益进行定期份额折算，每2份工银深证100份额将按1份工银深证100A份额获得约定应得收益的新增折算份额。在基金份额折算前与折算后，工银深证100A份额和工银深证100B份额的份额配比保持1:1的比例。对于工银深证100A份额的约定年化应得收益，即工银深证100A份额每个会计年度6月30日份额净值超过1.0000元的部分，将折算为场内工银深证100份额分配给工银深证100A份额持有人。当工银深证100份额的基金份额净值达到2.0000元或工银深证100B份额的基金份额参考净值达到0.2500元时，本基金即可确定折算基准日，进行不定期份额折算。在折算基准日，本基金将对登记在册的工银深证100份额、工银深证100A份额和工银深证100B份额分别进行折算。份额折算后本基金将确保工银深证100A份额和工银深证100B份额的比例为1:1；份额折算后工银深证100份额的基金份额净值、工银深证100A份额和工银深证100B份额的参考净值均调整为1.0000元。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2012]第362号文审核同意，投资者场内认购的全部工银深证100份额按1:1比例自动分拆成的工银深证100A份额和工银深证100B份额于2012年11月5日在深圳证券交易所上市。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《工银瑞信睿智深证100指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定，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。本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具，包括深证100指数的成份股及其备选成份股、首发和增发新股、债券、资产支持证券、债券回购、货币市场工具、股指期货、权证及法律法规或经中国证监会允许基金投资的其它金融工具。如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。本基金投资于标的指数成份股票及其备选成份股票的资产比例不低于基金资产净值的90%；任何交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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的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。股指期货、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。本基金投资组合的业绩比较基准为深证100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》、《工银瑞信睿智深证100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

本基金2018年1月1日至2018年4月16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4月16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4月16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 重要会计政策和会计估计

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[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 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、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4月16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	145,010.74	169,262.36
其中：支付销售机构的客户维护费	12,103.10	14,127.22

注：基金管理人的基金管理费按基金资产净值的1.0%年费率计提。

在通常情况下，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×1.0%÷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

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，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4月16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	29,002.14	33,852.47

注：基金托管人的基金托管费按基金资产净值的0.2%年费率计提。

在通常情况下，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×0.2%÷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

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，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4月16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
中国民生银行股份有限公司	3,237,359.76	7,721.43	2,631,236.15	10,701.89

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4月16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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002450	康得新	2018年2月6日	重大事项	19.78	2018年6月1日	18.79	23,970	471,824.51	474,126.60	-
300072	三聚环保	2018年4月16日	临时停牌	31.05	2018年4月17日	31.00	12,450	414,613.81	386,572.50	-
002252	上海莱士	2018年2月23日	重大事项	19.54	-	-	19,280	399,902.68	376,731.20	-
002739	万达电影	2017年7月4日	重大事项	44.82	-	-	5,811	396,604.11	260,449.02	指数法估值
000540	中天金融	2017年8月21日	重大事项	7.35	-	-	34,700	277,451.06	255,045.00	-
000826	启迪桑德	2018年4月16日	重大事项	29.32	2018年5月8日	30.20	7,340	263,773.16	215,208.80	-
000415	渤海金控	2018年1月17日	重大事项	5.84	2018年7月17日	5.26	19,400	131,059.00	113,296.00	-

注：本基金因重大事项停牌的股票中包含按指数收益法确定公允价值的长期停牌股票，该类股票估值采用中国证券业协会基金估值小组提供的估值方法，并于2018年4月16日对资产净值和本期净利润的影响均为人民币-41,955.42元。

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	1,001,713.43	3.07
	其中：股票	1,001,713.43	3.07
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	31,556,598.62	96.81
7	其他各项资产	39,671.68	0.12
8	合计	32,597,983.73	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

无。

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	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	413,941.60	1.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	253,483.50	0.78
L	租赁和商务服务业	113,296.00	0.35
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	220,992.33	0.68
S	综合	-	-
	合计	1,001,713.43	3.09

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前十名股票投资明细

无。

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前五名股票投资明细

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	002252	上海莱士	19,280	413,941.60	1.28
2	000540	中天金融	52,050	253,483.50	0.78
3	002739	万达电影	5,811	220,992.33	0.68
4	000415	渤海金控	19,400	113,296.00	0.35

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

本基金本报告期无买入股票明细。

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	002450	康得新	494,067.70	1.52
2	300072	三聚环保	333,162.00	1.03
3	000826	启迪桑德	224,163.60	0.69

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	0.00
卖出股票收入（成交）总额	1,051,393.30

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	28,417.59
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	7,134.64
5	应收申购款	4,119.45
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	39,671.68

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	002252	上海莱士	413,941.60	1.28	重大事项
2	000540	中天金融	253,483.50	0.78	重大事项
3	002739	万达电影	220,992.33	0.68	重大事项
4	000415	渤海金控	113,296.00	0.35	重大事项

§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	占基金资产的比例（%）
1	权益投资	2,081,429.12	4.07
	其中：股票	2,081,429.12	4.07
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	3,238,150.90	6.33
7	其他资产	45,817,799.03	89.60
8	合计	51,137,379.05	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,237,430.30	2.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	255,045.00	0.50
L	租赁和商务服务业	113,296.00	0.22
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	215,208.80	0.42
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	260,449.02	0.51
S	综合	-	-
	合计	2,081,429.12	4.08

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

无。

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	002450	康得新	23,970	474,126.60	0.93
2	300072	三聚环保	12,450	386,572.50	0.76
3	002252	上海莱士	19,280	376,731.20	0.74
4	002739	万达电影	5,811	260,449.02	0.51
5	000540	中天金融	34,700	255,045.00	0.50
6	000826	启迪桑德	7,340	215,208.80	0.42
7	000415	渤海金控	19,400	113,296.00	0.22

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前五名股票投资明细

无。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	000651	格力电器	853,263.00	0.17
2	000333	美的集团	845,262.00	0.16
3	000002	万科A	484,839.00	0.09
4	000858	五粮液	476,871.00	0.09
5	000725	京东方A	474,335.00	0.09
6	002027	分众传媒	458,753.00	0.09
7	002415	海康威视	426,317.00	0.08
8	000001	平安银行	392,877.00	0.08
9	002594	比亚迪	336,529.00	0.07
10	300498	温氏股份	301,912.00	0.06
11	002475	立讯精密	236,195.00	0.05
12	000063	中兴通讯	232,140.00	0.05
13	002304	洋河股份	229,893.00	0.04
14	000413	东旭光电	215,102.00	0.04
15	002508	老板电器	196,672.00	0.04
16	000776	广发证券	184,842.00	0.04
17	300003	乐普医疗	180,887.00	0.04
18	001979	招商蛇口	172,774.00	0.03
19	002572	索菲亚	172,359.00	0.03
20	002271	东方雨虹	170,162.00	0.03

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	000333	美的集团	3,298,659.35	0.64
2	000651	格力电器	3,285,294.21	0.64
3	002415	海康威视	1,968,047.82	0.38
4	000725	京东方A	1,943,372.00	0.38
5	000858	五粮液	1,887,968.00	0.37
6	000002	万科A	1,832,482.40	0.36
7	000001	平安银行	1,417,334.76	0.28
8	300498	温氏股份	1,174,587.48	0.23
9	000063	中兴通讯	1,105,096.11	0.22
10	002304	洋河股份	929,256.43	0.18
11	002230	科大讯飞	858,080.15	0.17
12	002027	分众传媒	741,346.80	0.14
13	000776	广发证券	722,863.80	0.14
14	002008	大族激光	711,970.00	0.14
15	300059	东方财富	709,174.10	0.14
16	002024	苏宁易购	686,938.86	0.13
17	002594	比亚迪	661,597.00	0.13
18	000568	泸州老窖	644,204.75	0.13
19	000538	云南白药	635,199.60	0.12
20	001979	招商蛇口	633,949.92	0.12

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	13,540,145.00
卖出股票收入（成交）总额	49,238,241.91

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	7,340.42
2	应收证券清算款	45,806,544.91
3	应收股利	-
4	应收利息	2,155.43
5	应收申购款	1,758.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	45,817,799.03

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

7.12.6 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	002450	康得新	474,126.60	0.93	重大事项
2	300072	三聚环保	386