

工银瑞信沪深300指数证券投资基金

2019年第二季度报告

基金管理人：工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一九年七月十八日
1.1 重要提示
基金管理人的董事会保证本基金报告不存在虚假记载、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责任。
基金托管人中行建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年7月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、基金净值增长率和标准差等信息，保证复核结果与基金管理人的计算结果一致。
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。
本基金报告中财务资料未经审计。

报告期为2019年4月1日至6月30日止。

2. 基金产品概况

基金简称 工银沪深300指数
交易代码 461009
基金运作方式 灵活配置开放式
基金合同生效日 2009年12月6日
报告期末基金资产总额 3,461,404,247.00
投资目标 本基金主要投资于沪深300指数成份股，同时根据市场情况，适当投资于其他股票、债券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许的其他金融工具，以期在有效控制风险的前提下，力争实现超越基准的收益。

投资策略 本基金主要投资于沪深300指数成份股，同时根据市场情况，适当投资于其他股票、债券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许的其他金融工具，以期在有效控制风险的前提下，力争实现超越基准的收益。

业绩比较基准 沪深300指数收益率×90%+银行存款活期利率(税后)×10%
风险收益特征 风险收益特征：股票型基金，风险适中，适合风险承受能力中等的投资者。

基金管理人 工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人 中国建设银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称 工银沪深300指数A
下属分级基金的交易代码 461009
报告期末下属分级基金的份额总额 3,220,814,863.00
430,639,577.00

单位：人民币元

报告期(2019年4月1日～2019年6月30日)

1. 本期已实现收益 16,709,404.30 1,213,631.16

2. 本期利润 8,509,656.02 -16,944,830.01

3. 加权平均基金份额本期利润 0.00202 -0.0466

4. 期末基金资产净值 3,389,069,063.10 402,071,534.76

5. 期末基金份额净值 1.0040 1.0040

6. 期末可供分配基金份额利润 0.0000

7. 期末可供分配利润 0.0000

8. 期末可供分配基金份额净额 0.0000

9. 期末持有的现金 10,400.00

10. 期末持有的存出保证金 0.0000

11. 期末持有的其他资产 0.0000

12. 期末持有的现金及现金等价物 10,400.00

13. 期末持有的存出保证金 0.0000

14. 期末持有的其他资产 0.0000

15. 其他资产 0.0000

16. 期末持有的现金及现金等价物 10,400.00

17. 期末持有的存出保证金 0.0000

18. 期末持有的其他资产 0.0000

19. 期末持有的现金及现金等价物 10,400.00

20. 期末持有的存出保证金 0.0000

21. 期末持有的其他资产 0.0000

22. 期末持有的现金及现金等价物 10,400.00

23. 期末持有的存出保证金 0.0000

24. 期末持有的其他资产 0.0000

25. 期末持有的现金及现金等价物 10,400.00

26. 期末持有的存出保证金 0.0000

27. 期末持有的其他资产 0.0000

28. 期末持有的现金及现金等价物 10,400.00

29. 期末持有的存出保证金 0.0000

30. 期末持有的其他资产 0.0000

31. 期末持有的现金及现金等价物 10,400.00

32. 期末持有的存出保证金 0.0000

33. 期末持有的其他资产 0.0000

34. 期末持有的现金及现金等价物 10,400.00

35. 期末持有的存出保证金 0.0000

36. 期末持有的其他资产 0.0000

37. 期末持有的现金及现金等价物 10,400.00

38. 期末持有的存出保证金 0.0000

39. 期末持有的其他资产 0.0000

40. 期末持有的现金及现金等价物 10,400.00

41. 期末持有的存出保证金 0.0000

42. 期末持有的其他资产 0.0000

43. 期末持有的现金及现金等价物 10,400.00

44. 期末持有的存出保证金 0.0000

45. 期末持有的其他资产 0.0000

46. 期末持有的现金及现金等价物 10,400.00

47. 期末持有的存出保证金 0.0000

48. 期末持有的其他资产 0.0000

49. 期末持有的现金及现金等价物 10,400.00

50. 期末持有的存出保证金 0.0000

51. 期末持有的其他资产 0.0000

52. 期末持有的现金及现金等价物 10,400.00

53. 期末持有的存出保证金 0.0000

54. 期末持有的其他资产 0.0000

55. 期末持有的现金及现金等价物 10,400.00

56. 期末持有的存出保证金 0.0000

57. 期末持有的其他资产 0.0000

58. 期末持有的现金及现金等价物 10,400.00

59. 期末持有的存出保证金 0.0000

60. 期末持有的其他资产 0.0000

61. 期末持有的现金及现金等价物 10,400.00

62. 期末持有的存出保证金 0.0000

63. 期末持有的其他资产 0.0000

64. 期末持有的现金及现金等价物 10,400.00

65. 期末持有的存出保证金 0.0000

66. 期末持有的其他资产 0.0000

67. 期末持有的现金及现金等价物 10,400.00

68. 期末持有的存出保证金 0.0000

69. 期末持有的其他资产 0.0000

70. 期末持有的现金及现金等价物 10,400.00

71. 期末持有的存出保证金 0.0000

72. 期末持有的其他资产 0.0000

73. 期末持有的现金及现金等价物 10,400.00

74. 期末持有的存出保证金 0.0000

75. 期末持有的其他资产 0.0000

76. 期末持有的现金及现金等价物 10,400.00

77. 期末持有的存出保证金 0.0000

78. 期末持有的其他资产 0.0000

79. 期末持有的现金及现金等价物 10,400.00

80. 期末持有的存出保证金 0.0000

81. 期末持有的其他资产 0.0000

82. 期末持有的现金及现金等价物 10,400.00

83. 期末持有的存出保证金 0.0000

84. 期末持有的其他资产 0.0000

85. 期末持有的现金及现金等价物 10,400.00

86. 期末持有的存出保证金 0.0000

87. 期末持有的其他资产 0.0000

88. 期末持有的现金及现金等价物 10,400.00

89. 期末持有的存出保证金 0.0000

90. 期末持有的其他资产 0.0000

91. 期末持有的现金及现金等价物 10,400.00

92. 期末持有的存出保证金 0.0000

93. 期末持有的其他资产 0.0000

94. 期末持有的现金及现金等价物 10,400.00

95. 期末持有的存出保证金 0.0000

96. 期末持有的其他资产 0.0000

97. 期末持有的现金及现金等价物 10,400.00

98. 期末持有的存出保证金 0.0000

99. 期末持有的其他资产 0.0000

100. 期末持有的现金及现金等价物 10,400.00

101. 期末持有的存出保证金 0.0000

102. 期末持有的其他资产 0.0000

103. 期末持有的现金及现金等价物 10,400.00

104. 期末持有的存出保证金 0.0000

105. 期末持有的其他资产 0.0000

106. 期末持有的现金及现金等价物 10,400.00

107. 期末持有的存出保证金 0.0000

108. 期末持有的其他资产 0.0000

109. 期末持有的现金及现金等价物 10,400.00

110. 期末持有的存出保证金 0.0000

111. 期末持有的其他资产 0.0000

112. 期末持有的现金及现金等价物 10,400.00

113. 期末持有的存出保证金 0.0000

114. 期末持有的其他资产 0.0000

115. 期末持有的现金及现金等价物 10,400.00

116. 期末持有的存出保证金 0.0000

117. 期末持有的其他资产 0.0000

118. 期末持有的现金及现金等价物 10,400.00

119. 期末持有的存出保证金 0.0000

120. 期末持有的其他资产 0.0000

121. 期末持有的现金及现金等价物 10,400.00

122. 期末持有的存出保证金 0.0000

123. 期末持有的其他资产 0.0000

124. 期末持有的现金及现金等价物 10,400.00

125. 期末持有的存出保证金 0.0000

126. 期末持有的其他资产 0.0000

127. 期末持有的现金及现金等价物 10,400.00

128. 期末持有的存出保证金 0.0000

129. 期末持有的其他资产 0.0000