工银瑞信主题策略混合型证券投资基金 2019年半年度报告摘要

基金管理人：工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司
送出日期：二〇一九年八月二十八日

§1 重要提示

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。

基金托管人交通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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

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。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	工银主题策略混合
基金主代码	481015
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年10月24日
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	571,143,505.13份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	结合宏观经济转型方向，通过分析社会经济热点动向，把握相关主题投资机会，追求基金资产长期稳定的增值和收益，在控制投资风险的同时，力争持续实现超越业绩基准的收益。
投资策略	类别资产配置上，本基金运用国际化的视野审视中国经济和资本市场，依据定量和定性相结合的方法，考虑经济情景、类别资产收益风险预期等因素，在股票与债券等资产类别之间进行资产配置。在股票投资方面，本基金主要采取主题投资策略，在宏观经济发展的不同阶段，关注经济发展热点，深入挖掘潜在的主题投资机会，寻找实质受益的上市公司，并综合考虑其基本面情况，选择具备投资价值的股票，构建投资组合，并不断优化组合，争取获得超越业绩基准的收益水平。本基金还将在法规允许的范围内，基于谨慎原则利用权证以及其它金融工具进行套利交易或风险管理，为基金收益提供增加价值。
业绩比较基准	80%×沪深300指数收益率＋20%×中债综合指数收益率。
风险收益特征	本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		工银瑞信基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	朱碧艳	陆志俊
	联系电话	400-811-9999	95559
	电子邮箱	customerservice@icbccs.com.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		400-811-9999	95559
传真		010-66583158	021-62701216

2.4 信息披露方式

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

§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	62,401,431.25
本期利润	248,833,885.95
加权平均基金份额本期利润	0.4431
本期基金份额净值增长率	34.75%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.5749
期末基金资产净值	1,029,541,397.97
期末基金份额净值	1.803

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2011年10月24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	-4.75%	1.89%	4.43%	0.93%	-9.18%	0.96%
过去三个月	-4.50%	2.42%	-0.72%	1.22%	-3.78%	1.20%
过去六个月	34.75%	2.29%	21.85%	1.24%	12.90%	1.05%
过去一年	-2.06%	2.04%	8.89%	1.22%	-10.95%	0.82%
过去三年	-13.61%	1.56%	19.99%	0.89%	-33.60%	0.67%
自基金合同生效起至今	80.30%	1.92%	55.48%	1.19%	24.82%	0.73%

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

注：1、本基金基金合同于2011年10月24日生效。

2、根据基金合同规定，本基金建仓期为6个月。截至本报告期末，本基金的投资符合基金合同的相关规定：本基金股票资产占基金资产的比例为60%-95%，债券、现金等金融工具及其他资产占基金资产的比例为5%-40%，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。

§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		
黄安乐	权益投资总监，本基金的基金经理	2011年11月23日	-	16	先后在天相投资顾问有限公司担任研究员，国信证券经济研究所担任资深分析师，国信证券资产管理总部担任投资经理、研究员；2010年加入工银瑞信，现任权益投资总监。2011年11月23日至今，担任工银瑞信主题策略混合型证券投资基金基金经理；2013年9月23日至2019年2月13日，担任工银瑞信精选平衡基金基金经理；2014年10月22日至2017年10月9日，担任工银高端制造行业股票型基金基金经理；2015年4月28日至2018年3月2日，担任工银新材料新能源行业股票型基金基金经理；2016年1月29日至2018年11月30日，担任工银瑞信国家战略主题股票型基金基金经理；2017年4月21日至2019年1月24日，担任工银瑞信互联网加股票型证券投资基金基金经理；2018年3月28日至今，担任工银瑞信中小盘成长混合型证券投资基金基金经理，2018年6月5日至今，担任工银瑞信高端制造行业股票型证券投资基金基金经理。

注：1、任职日期为基金合同生效日或本基金管理人对外披露的任职日期；离职日期为本基金管理人对外披露的离职日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

2019年上半年，A股市场经历了先涨后跌的过程，一季度的上涨，是对市场过度悲观的修复，也是对2018年年底较低估值的修复，背后是货币政策的实际宽松，以及对中美贸易摩擦达成协议的预期。经历一季度上涨之后，市场的估值已经修复到一定的水平，同时货币政策开始有转向的苗头，市场开始调整。五一之后，中美贸易摩擦有升级的趋势，市场的调整加速。

2018年年底和2019年年初，基于对国内宏观经济下行压力较大，上市公司盈利前景不乐观，整体估值处在较低的历史分位数的认识，我们认为，如果A股有行情，大概率是估值修复的行情。因此，在行业选择上，本基金优先选择高景气度行业，包括光伏、养殖和锂电池设备等三个方向；第二，选择部分估值低跌幅较深的行业龙头，作为个股选择的标的。这个组合在一季度取得了较好的投资收益。一季度末二季度初我们认为估值修复暂告一段落，本基金减持了年初配置的低估值龙头。随着市场的继续下跌，我们认为市场重新进入到选股期，同时还认为，压制短期市场行情的中美贸易摩擦，即便达成某种协议，也不改变两国经贸科技关系上的长期竞争关系。因此，在二季度后期，本基金对基于内需的必需消费品行业，包括食品饮料、轻工制造、商贸零售、医疗服务等方向进行择股配置；另外，重新买入基础化工，机械和建材等传统行业中的低估值龙头企业，以及部分5G相关的科技股。同时，前期重点配置的光伏、养殖和锂电池设备等板块，提升了个股持仓集中度，即仓位向板块内的龙头集中。

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34.75%，业绩比较基准收益率为21.85%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2019年下半年，我们认为国内经济增长的下行压力依然存在，从投资、消费、进出口等几个方向来看，消费相对稳定，进出口方面，中美贸易摩擦的影响开始显现，投资方面，地产投资疲弱，制造业投资也还没有显著的起色，基建投资增速幅度不足，独木难支。

相应的，货币政策大概率需要保持宽松，以为解决国内和外围的问题提供时间窗口；财政政策仍需要发力，但目前看，余地并不大。

上市公司业绩方面，从当前时点看，业绩向上拐点推延，需要观察减税降费效果的发酵，也需要等待宽松政策带动的内需增长的作用。

估值上，当前大多数行业的估值水平回落到中位数以下的较低水平，并未存在高估和泡沫。

从宏观和中观层面来看，我们认为A股市场下半年缺乏指数普涨的行情，但会存在一定的结构机会和主题投资的机会；如果国内下半年出现较大面积的改革和开放措施，这一格局才有可能发生改变。

因此，在组合配置层面，我们依然看好供给端受到严重制约的养殖行业，景气度持续的光伏产业，以及受益于全球产业链共振的锂电池设备板块；另外，依赖于内需的必需消费品领域，也是本基金下半年的投资重点；同时我们还关注受益于宽松政策的传统行业龙头以及“新基建”相关的5G及自主可控板块的主题投资机会。

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

2019年上半年，基金托管人在工银瑞信主题策略混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2019年上半年，工银瑞信基金管理有限公司在工银瑞信主题策略混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

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

2019年上半年，由工银瑞信基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关工银瑞信主题策略混合型证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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：工银瑞信主题策略混合型证券投资基金

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		61,869,541.83	88,126,031.29
结算备付金		1,997,365.06	4,446,699.06
存出保证金		578,841.38	452,290.24
交易性金融资产		973,915,256.57	649,075,387.48
其中：股票投资		973,915,256.57	649,075,387.48
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		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息		12,972.05	19,018.68
应收股利		-	-
应收申购款		415,726.63	259,705.79
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		1,038,789,703.52	742,379,132.54
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		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		4,172,130.12	14,153,148.94
应付赎回款		2,168,603.11	487,898.68
应付管理人报酬		1,264,193.62	963,842.11
应付托管费		210,698.94	160,640.37
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		1,314,553.45	873,591.43
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		118,126.31	399,429.36
负债合计		9,248,305.55	17,038,550.89
所有者权益：			
实收基金		571,143,505.13	542,096,458.70
未分配利润		458,397,892.84	183,244,122.95
所有者权益合计		1,029,541,397.97	725,340,581.65
负债和所有者权益总计		1,038,789,703.52	742,379,132.54

注：1、本基金基金合同生效日为2011年10月24日。

2、报告截止日2019年6月30日，基金份额净值为人民币1.803元，基金份额总额为571,143,505.13份。

6.2 利润表

会计主体：工银瑞信主题策略混合型证券投资基金

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		262,550,236.92	-158,543,184.66
1.利息收入		298,411.51	612,188.68
其中：存款利息收入		269,802.90	342,122.80
债券利息收入		-	778.14
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		28,608.61	269,287.74
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		75,338,423.74	-38,827,402.61
其中：股票投资收益		67,101,482.11	-45,813,679.41
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	1,082,376.41
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		8,236,941.63	5,903,900.39
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		186,432,454.70	-120,415,079.25
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		480,946.97	87,108.52
减：二、费用		13,716,350.97	16,683,564.32
1. 管理人报酬		7,327,491.55	9,116,126.26
2. 托管费		1,221,248.59	1,519,354.37
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		5,042,735.06	5,831,831.48
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		124,875.77	216,252.21
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		248,833,885.95	-175,226,748.98
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		248,833,885.95	-175,226,748.98

注：本基金基金合同生效日为2011年10月24日。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：工银瑞信主题策略混合型证券投资基金

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）	542,096,458.70	183,244,122.95	725,340,581.65
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	248,833,885.95	248,833,885.95
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）	29,047,046.43	26,319,883.94	55,366,930.37
其中：1.基金申购款	163,871,606.81	145,477,132.80	309,348,739.61
2.基金赎回款	-134,824,560.38	-119,157,248.86	-253,981,809.24
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）	571,143,505.13	458,397,892.84	1,029,541,397.97
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）	651,056,257.31	743,673,495.64	1,394,729,752.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-175,226,748.98	-175,226,748.98
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）	-102,645,914.28	-107,128,494.69	-209,774,408.97
其中：1.基金申购款	25,374,484.84	25,570,189.35	50,944,674.19
2.基金赎回款	-128,020,399.12	-132,698,684.04	-260,719,083.16
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）	548,410,343.03	461,318,251.97	1,009,728,595.00

注：本基金基金合同生效日为2011年10月24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：

______ 王 海 璐 ______　　______ 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

工银瑞信主题策略混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）(原名“工银瑞信主题策略股票型证券投资基金”)，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]1340号文《关于同意核准工银瑞信主题策略股票型证券投资基金募集的批复》的核准，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10月24日正式生效。首次设立时募集的规模为631,826,498.75份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限为不定期。本基金的基金管理人和注册登记机构均为工银瑞信基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

本基金的投资范围限于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括创业板股票、中小板股票以及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、央票、回购，以及法律法规允许或经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具，但须符合中国证监会相关规定。其中，股票资产占基金资产的比例为60%-95%，债券、现金等金融工具及其他资产占基金资产的比例为5%-40%。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、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：80%×沪深300指数收益率+20%×中债综合指数收益率。

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3号《半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及参考意见。

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年上半年度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

（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；

（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征增值税试点的通知》的规定，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税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

（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[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[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
交通银行股份有限公司	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

无。

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
当期发生的基金应支付的管理费	7,327,491.55	9,116,126.26
其中：支付销售机构的客户维护费	2,706,434.23	3,171,467.95

注：基金管理费按前一日基金资产净值的1.50%的年费率计提，计算方法如下：

H=E×1.50%÷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，按月支付。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	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
当期发生的基金应支付的托管费	1,221,248.59	1,519,354.37

注：基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.25%÷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

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

份额单位：份

项目	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
基金合同生效日（2011年10月24日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	3,467,157.75
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	-	3,467,157.75
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	0.63%

注：1、基金管理人持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

2、期间申购/买入总份额：含红利再投、转换入份额；期间赎回/卖出总份额：含转换出份额。

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
交通银行股份有限公司	61,869,541.83	230,254.81	67,941,877.30	292,990.51

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（ 2019年6月30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

金额单位：人民币元

6.4.9.1.1 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	-

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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

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	973,915,256.57	93.75
	其中：股票	973,915,256.57	93.75
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	63,866,906.89	6.15
8	其他各项资产	1,007,540.06	0.10
9	合计	1,038,789,703.52	100.00

注：由于四舍五入的原因金额占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	142,480,539.32	13.84
B	采矿业	363,431.25	0.04
C	制造业	747,073,570.82	72.56
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	29,514,800.00	2.87
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	21,291,603.76	2.07
J	金融业	33,869.94	0.00
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	10,984,000.00	1.07
Q	卫生和社会工作	22,150,334.88	2.15
R	文化、体育和娱乐业	23,106.60	0.00
S	综合	-	-
	合计	973,915,256.57	94.60

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	300498	温氏股份	2,280,063	81,763,059.18	7.94
2	601012	隆基股份	2,900,074	67,020,710.14	6.51
3	300450	先导智能	1,800,032	60,481,075.20	5.87
4	002157	正邦科技	3,500,000	58,310,000.00	5.66
5	600309	万华化学	1,099,600	47,051,884.00	4.57
6	600031	三一重工	3,590,060	46,957,984.80	4.56
7	300014	亿纬锂能	1,500,043	45,691,309.78	4.44
8	600585	海螺水泥	1,000,000	41,500,000.00	4.03
9	002714	牧原股份	680,066	39,981,080.14	3.88
10	000876	新希望	2,180,086	37,868,093.82	3.68

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	300059	东方财富	89,039,663.50	12.28
2	002714	牧原股份	80,327,680.29	11.07
3	000895	双汇发展	79,532,393.45	10.96
4	002299	圣农发展	72,691,959.24	10.02
5	002458	益生股份	69,139,819.50	9.53
6	002027	分众传媒	60,274,016.24	8.31
7	600309	万华化学	52,311,453.76	7.21
8	600585	海螺水泥	49,653,444.73	6.85
9	300498	温氏股份	49,582,120.64	6.84
10	002191	劲嘉股份	49,492,030.79	6.82
11	600031	三一重工	44,628,685.14	6.15
12	601012	隆基股份	44,288,413.51	6.11
13	600570	恒生电子	41,576,529.76	5.73
14	600588	用友网络	41,105,234.09	5.67
15	600975	新五丰	40,120,008.74	5.53
16	002234	民和股份	39,913,939.90	5.50
17	300014	亿纬锂能	39,141,310.48	5.40
18	002230	科大讯飞	36,944,217.50	5.09
19	002124	天邦股份	34,666,018.85	4.78
20	000876	新希望	34,459,622.24	4.75
21	601688	华泰证券	34,116,549.04	4.70
22	002311	海大集团	29,932,755.71	4.13
23	002938	鹏鼎控股	29,216,073.00	4.03
24	300450	先导智能	25,122,414.20	3.46
25	603899	晨光文具	24,270,798.66	3.35
26	603986	兆易创新	23,618,856.37	3.26
27	002548	金新农	22,581,083.02	3.11
28	002405	四维图新	22,039,763.00	3.04
29	000858	五粮液	21,979,288.40	3.03
30	002385	大北农	21,578,057.50	2.97
31	300747	锐科激光	20,842,953.00	2.87
32	002912	中新赛克	20,597,978.14	2.84
33	603363	傲农生物	20,567,031.00	2.84
34	000932	华菱钢铁	19,890,564.24	2.74
35	600763	通策医疗	19,469,798.80	2.68
36	000063	中兴通讯	19,129,560.00	2.64
37	601933	永辉超市	18,789,265.00	2.59
38	600132	重庆啤酒	18,683,069.90	2.58
39	002607	中公教育	18,564,943.60	2.56
40	002138	顺络电子	18,510,797.32	2.55
41	002567	唐人神	18,411,102.80	2.54
42	600600	青岛啤酒	18,348,951.92	2.53
43	002099	海翔药业	18,327,349.64	2.53
44	002008	大族激光	17,427,745.89	2.40
45	300274	阳光电源	17,015,336.05	2.35
46	002475	立讯精密	16,380,535.00	2.26
47	300188	美亚柏科	16,178,339.10	2.23
48	600660	福耀玻璃	16,130,145.37	2.22
49	002920	德赛西威	15,649,953.96	2.16
50	002129	中环股份	15,633,332.06	2.16
51	600703	三安光电	15,280,461.00	2.11
52	002643	万润股份	15,183,425.70	2.09
53	300134	大富科技	15,028,508.00	2.07
54	601678	滨化股份	14,836,326.52	2.05

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	002027	分众传媒	131,368,862.50	18.11
2	002714	牧原股份	92,870,170.91	12.80
3	300059	东方财富	85,437,890.61	11.78
4	600309	万华化学	84,497,191.60	11.65
5	002458	益生股份	68,925,623.27	9.50
6	002299	圣农发展	68,478,060.62	9.44
7	002124	天邦股份	55,321,130.46	7.63
8	300750	宁德时代	49,470,607.62	6.82
9	600588	用友网络	47,276,888.52	6.52
10	600872	中炬高新	43,280,412.41	5.97
11	000895	双汇发展	43,023,966.46	5.93
12	600570	恒生电子	38,621,770.45	5.32
13	002230	科大讯飞	37,433,597.50	5.16
14	601688	华泰证券	37,362,356.82	5.15
15	002234	民和股份	36,854,823.06	5.08
16	300450	先导智能	35,137,435.15	4.84
17	002157	正邦科技	33,175,079.07	4.57
18	601012	隆基股份	31,872,110.50	4.39
19	600438	通威股份	31,733,809.58	4.38
20	300037	新宙邦	29,174,889.94	4.02
21	300498	温氏股份	28,900,935.19	3.98
22	002191	劲嘉股份	25,658,187.00	3.54
23	002548	金新农	25,468,875.04	3.51
24	300274	阳光电源	25,405,330.00	3.50
25	002938	鹏鼎控股	24,582,881.80	3.39
26	600073	上海梅林	23,310,725.50	3.21
27	603960	克来机电	22,560,017.81	3.11
28	603986	兆易创新	21,338,860.07	2.94
29	002912	中新赛克	20,409,977.81	2.81
30	600201	生物股份	20,348,339.17	2.81
31	300188	美亚柏科	19,782,258.45	2.73
32	600271	航天信息	19,763,692.62	2.72
33	603288	海天味业	19,732,239.00	2.72
34	300747	锐科激光	19,368,555.80	2.67
35	002008	大族激光	18,948,702.75	2.61
36	000932	华菱钢铁	18,847,267.00	2.60
37	600975	新五丰	18,640,392.35	2.57
38	601678	滨化股份	17,790,053.03	2.45
39	600600	青岛啤酒	16,204,204.50	2.23
40	600660	福耀玻璃	15,886,714.91	2.19
41	300073	当升科技	15,876,814.00	2.19
42	002138	顺络电子	15,843,476.31	2.18
43	300014	亿纬锂能	15,771,892.96	2.17
44	002129	中环股份	15,631,201.00	2.16
45	002920	德赛西威	15,325,005.36	2.11
46	002371	北方华创	15,272,583.90	2.11
47	002099	海翔药业	14,767,342.77	2.04

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	2,007,571,010.02
卖出股票收入（成交）总额	1,936,265,077.74

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

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	578,841.38
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	12,972.05
5	应收申购款	415,726.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,007,540.06

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

无。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(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
55,728	10,248.77	5,708,230.77	1.00%	565,435,274.36	99.00%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	1,555,886.35	0.27%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	)=100
本基金基金经理持有本开放式基金	)=100

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011年10月24日）基金份额总额	631,826,498.75
本报告期期初基金份额总额	542,096,458.70
本报告期期间基金总申购份额	163,871,606.81
减:本报告期期间基金总赎回份额	134,824,560.38
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-
本报告期期末基金份额总额	571,143,505.13

注：1、报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额；

2、报告期期间基金总赎回份额含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人： 基金管理人于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： 本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未有改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构为安永华明会计师事务所（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	
中泰证券	3	2,453,301,985.91	62.27%	1,745,030.26	63.30%	-
中金	1	781,371,906.39	19.83%	555,789.46	20.16%	-
中信证券	1	462,618,093.26	11.74%	282,800.61	10.26%	-
长城证券	2	143,001,257.83	3.63%	101,717.66	3.69%	-
安信证券	1	61,410,902.80	1.56%	43,684.92	1.58%	-
方正证券	1	38,198,566.04	0.97%	27,933.83	1.01%	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	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。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中泰证券	-	-	142,600,000.00	57.59%	-	-
中金	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	79,700,000.00	32.19%	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	25,300,000.00	10.22%	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-

§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

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。