

# 信息披露 Disclosure

## 深证红利交易型开放式指数证券投资基金

### 2014 半年度报告摘要

差控制在较低水平。

4.6 管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明  
4.6.1 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  
4.6.1.1 联合分工。  
(1) 参与估值小组的成员分为A、分别是公司运作部负责人、研究部负责人、风险管理部负责人、法律合规部负责人、组长由运作部负责人担任。  
(2) 小组内负责人也可推荐代表各部门参与估值小组的成员,如需更换,由相应部门/负责人提出,小组成员需经运作部主管副批准同意。  
4.6.1.2 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。

4.6.2 基金经理参与或决定估值的程度  
本基金基金经理参与讨论估值原则及方法,但不参与最终估值决策。  
4.6.3 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。  
4.6.4 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 管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明  
报告期内,本基金未实施利润分配,符合相关法律法规及基金合同的规定。

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明  
在托管本基金的过程中,本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格按照《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定,对本基金基金管理人—工银瑞信基金管理有限公司2014年1月1日至2014年6月30日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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  
本托管人认为,工银瑞信基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同约定的方式进行。  
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等情况的真实、准确和完整发表意见  
本托管人认为,工银瑞信基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有任何损害基金份额持有人利益的行为。

6.1 资产负债表  
会计主体:深证红利交易型开放式指数证券投资基金  
报告截止日:2014年6月30日

资产	附注号	2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
资产:			
银行存款		12,129,008.28	3,842,478.62
结算备付金		1,646.88	—
存出保证金		1,465.71	8,286.37
交易性金融资产		634,043,173.14	792,673,494.97
其中:股票投资		634,043,173.14	792,673,494.97
基金投资		—	—
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		2,453.26	851.71
应收股利		—	—
应收申购款		—	—
预付证券机构客户的管理费		—	—
递延所得税资产		—	—
其他资产		—	—
资产总计		646,177,748.39	796,525,111.67
负债和所有者权益:			
负债:			
短期借款		—	—
交易性金融负债		—	—
应付证券清算款		—	—
卖出回购金融资产款		—	—
应付证券清算款		886,176.15	—
应付赎回款		—	—
应付管理人报酬		264,912.56	341,071.11
应付托管费		52,982.49	68,214.24
应付销售服务费		—	—
应付交易费用		109,471.40	8,700.95
应交税费		—	—
应付利息		—	—
应付股利		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债		326,530.63	358,687.53
所有者权益:		1,640,093.23	776,673.83
实收基金		981,443,951.00	12,146,943,951.00
未分配利润		-336,906,295.84	-351,195,513.16
所有者权益合计		644,537,655.16	795,748,437.84
负债和所有者权益总计		646,177,748.39	796,525,111.67

注:1.报告截止日2014年06月30日,基金份额净值0.6567元,基金份额总额981,443,951.00份;股票投资项下可退替代估值增值。  
2.本基金基金合同生效日为2010年11月05日。  
6.2 利润表  
会计主体:深证红利交易型开放式指数证券投资基金  
本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

资产	附注号	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、收入		-41,227,084.26	-119,221,750.08
1.利息收入		28,122.13	45,085.64
其中:存款利息收入		28,122.13	45,085.64
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“-”号填列)		-54,392,335.17	-71,838,109.50
其中:股票投资收益		-70,018,402.60	-82,801,487.48
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		—	—
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		15,626,067.43	10,963,577.98
其中:交易性金融资产公允价值变动收益		13,108,111.10	-47,371,982.39
4.反洗钱收益(损失以“-”号填列)		—	—
5.其他收入(损失以“-”号填列)		19,017.68	-56,748.63
减:二、费用		2,525,971.28	3,645,131.06
1.管理人报酬		1,665,523.51	2,567,106.23
2.托管费		333,104.71	513,421.24
3.销售服务费		—	—
4.交易费用		205,536.41	183,564.62
其中:卖出回购金融资产支出		—	—
6.其他费用		326,806.63	381,103.57
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-43,763,055.54	-122,866,886.74
减:所得税费用		—	—
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-43,763,055.54	-122,866,886.74

注:本基金基金合同生效日为2010年11月05日。  
6.3 所有者权益(基金净值)变动表  
会计主体:深证红利交易型开放式指数证券投资基金  
本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

项目	2014年1月1日至2014年6月30日	2013年1月1日至2013年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)	1,146,943,951.00	—
二、本期损益活动产生的基金净值变动(基金净值)	—	-43,763,055.54
三、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	-165,500,000.00	58,052,272.86
四、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	-107,447,727.14
五、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
六、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
七、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
八、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
九、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
十、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
十一、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
十二、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
十三、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
十四、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
十五、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
十六、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
十七、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
十八、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
十九、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
二十、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
二十一、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
二十二、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
二十三、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
二十四、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
二十五、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
二十六、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
二十七、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
二十八、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
二十九、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
三十、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
三十一、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
三十二、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
三十三、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
三十四、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
三十五、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
三十六、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
三十七、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
三十八、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
三十九、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
四十、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
四十一、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
四十二、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
四十三、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
四十四、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
四十五、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
四十六、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
四十七、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
四十八、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
四十九、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
五十、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
五十一、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
五十二、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
五十三、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
五十四、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
五十五、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
五十六、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
五十七、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
五十八、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
五十九、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
六十、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
六十一、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
六十二、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
六十三、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
六十四、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
六十五、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
六十六、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
六十七、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
六十八、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
六十九、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
七十、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
七十一、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
七十二、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
七十三、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
七十四、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
七十五、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
七十六、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
七十七、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
七十八、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
七十九、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
八十、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
八十一、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
八十二、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
八十三、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
八十四、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
八十五、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
八十六、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
八十七、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
八十八、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
八十九、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
九十、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
九十一、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
九十二、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
九十三、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
九十四、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
九十五、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
九十六、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
九十七、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
九十八、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
九十九、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—
一百、本期基金份额变动产生的基金净值变动(基金净值)	—	—

注:1.任职日期说明:何江的任职日期为公司执委会决议正式生效日期。  
赵超的任职日期为公司执委会决议正式生效日期。  
2.证券从业年限的计算标准:证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定等。  
3.本基金无基金经理助理。  
4.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介  
姓名 职务 在本基金的基金经理(或基金经理小组)的任职日期 在本基金的基金经理(或基金经理小组)的任职日期 说明  
何江 基金经理 2011年5月25日 9 先后在北京万信信通科技有限公司担任高级分析师,金融信用风险管理部负责人,2011年5月25日至2013年7月22日担任工银瑞信信通基金管理有限公司基金经理,2013年7月22日至2014年6月30日担任工银瑞信信通基金管理有限公司基金经理,2014年6月30日至2015年1月1日担任工银瑞信信通基金管理有限公司基金经理,2015年1月1日至2015年6月30日担任工银瑞信信通基金管理有限公司基金经理。  
赵超 基金经理 2012年10月9日 6 2008年加入工银瑞信,曾任风险管理部金融风险分析师,2011年10月加入工银瑞信信通基金管理有限公司,2012年10月9日至2013年7月22日担任工银瑞信信通基金管理有限公司基金经理,2013年7月22日至2014年6月30日担任工银瑞信信通基金管理有限公司基金经理,2014年6月30日至2015年1月1日担任工银瑞信信通基金管理有限公司基金经理,2015年1月1日至2015年6月30日担任工银瑞信信通基金管理有限公司基金经理。

注:1.任职日期说明:何江的任职日期为公司执委会决议正式生效日期。  
赵超的任职日期为公司执委会决议正式生效日期。  
2.证券从业年限的计算标准:证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定等。  
3.本基金无基金经理助理。  
4.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介  
姓名 职务 在本基金的基金经理(或基金经理小组)的任职日期 在本基金的基金经理(或基金经理小组)的任职日期 说明  
何江 基金经理 2011年5月25日 9 先后在北京万信信通科技有限公司担任高级分析师,金融信用风险管理部负责人,2011年5月25日至2013年7月22日担任工银瑞信信通基金管理有限公司基金经理,2013年7月22日至2014年6月30日担任工银瑞信信通基金管理有限公司基金经理,2014年6月30日至2015年1月1日担任工银瑞信信通基金管理有限公司基金经理,2015年1月1日至2015年6月30日担任工银瑞信信通基金管理有限公司基金经理。  
赵超 基金经理 2012年10月9日 6 2008年加入工银瑞信,曾任风险管理部金融风险分析师,2011年10月加入工银瑞信信通基金管理有限公司,2012年10月9日至2013年7月22日担任工银瑞信信通基金管理有限公司基金经理,2013年7月22日至2014年6月30日担任工银瑞信信通基金管理有限公司基金经理,2014年6月30日至2015年1月1日担任工银瑞信信通基金管理有限公司基金经理,2015年1月1日至2015年6月30日担任工银瑞信信通基金管理有限公司基金经理。

90%。本基金的业绩比较基准为深证红利价格指数。  
6.4.2 基金会计政策的编制基础  
本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]6号《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》、《中国证券业协会于2007年6月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《深证红利交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和中国证券投资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。  
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2014年6月30日的财务状况以及2014年上半年度的经营成果和净值变动情况。  
6.4.4 本报告期内采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明  
本报告期内采用的会计政策、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  
本基金本报告期无需说明的差错更正事项。

6.4.6 税项  
根据财政部、国家税务总局财税[2002]122号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金企业所得税政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、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》及其他相关税收法规和税务处理,主要列明如下:  
(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。  
(2)基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。  
(3)对基金取得的企业债券利息收入,由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴20%的个人所得税,暂不征收企业所得税;对基金取得的企业债券利息收入,由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按50%计入个人应纳税所得额,依照现行税法规定由上市公司代扣代缴个人所得税;暂不征收企业所得税。自2013年1月1日起,对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得,按照持股期限在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。  
(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。  
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所有关联方

项目	与本基金的关系
工银瑞信基金管理有限公司	基金管理人
中国农业银行股份有限公司	基金托管人
工银瑞信深证红利交易型开放式指数证券投资基金	基金管理人管理的其他基金

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  
本基金本报告期末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

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的基金管理费	1,665,523.51	2,567,106.23
其中:支付给机构客户的管	—	—
注: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0.05% 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。		

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	333,104.71	513,421.24
注:在通常情况下,基金托管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×年托管费率÷当年天数,本基金年托管费率为0.1% 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。 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易 本基金本报告期与上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。		

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  
本基金的管理人在本报告期与与上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。  
6.4.8.4.2 本报告期除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位:份

关联方名称	2014年6月30日	持有的基金份额 占基金总份额的比例	2013年12月31日	持有的基金份额 占基金总份额的比例
工银瑞信深证红利交易型开放式指数证券投资基金	922,445,492.00	93.99%	1,082,169,592.00	94.35%

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

关联方名称	2014年1月1日至2014年6月30日	2013年1月1日至2013年6月30日
中国工商银行股份有限公司	12,129,008.28	27,922.64
期末余额	12,129,008.28	27,922.64
当期利息收入	—	37,941.17

注:1.本半年度末余额仅为活期存款,利息收入仅为活期存款利息收入。  
2.上年度可比期末余额仅为活期存款,利息收入仅为活期存款利息收入。  
6.4.8.6 本基金在承销期间参与关联方承销证券的情况  
本基金本报告期与上年度可比期间均未在承销期间参与关联方承销证券。  
6.4.8.7 其他关联方交易事项的说明  
无。

6.4.9 期末(2014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  
本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。  
6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

股票代码	证券名称	停牌日期	停牌前估值(元)	复牌日期	复牌开盘价(元)	数量(股)	期末成本总额	期末公允价值	备注
000562	中顺洁柔	2013年12月16日	8.22	2014年1月21日	8.93	1,775,684	15,906,378.54	14,996,122.48	—

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  
本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。  
6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购  
本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。  
6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项  
截至资产负债表日,本基金无需要说明的其他重要事项。

7.1 期末基金资产组合情况

2	货币支持证券	-	-
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	12,130,656.28	1.88
7	其他各项资产	3,918.97	0.00
8	合计	646,177,748.39	100.00

注:1.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;  
2.股票投资资产可退替代款估值增值。  
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股票投资组合

金额单位:人民币元