

# 工银瑞信沪深 300 指数证券投资基金

# 2017年年度报告摘要

[illegible][illegible][illegible][illegible][illegible][illegible]

|                          |                     |               |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|--------------------------|---------------------|---------------|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|
| 电子邮箱                     | customer@jdc.com.cn | liang@jdc.com |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 客户服务热线                   | 400-811-9999        | 07-8795096    |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 客户服务热线                   | 07-6668158          | 07-6627583    |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| <b>2.4 信息披露方式</b>        |                     |               |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 定期报告刊登的证券交易所网站和上海证券交易所网站 |                     |               |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 公司半年度报告和年度报告             |                     |               |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 半年度财务报告和季度财务             |                     |               |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| <b>3 主要财务指标</b>          |                     |               |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 主要财务指标表现及同比变化情况          |                     |               |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |

[illegible][illegible]

|                                       |  |        |        |      |      |       |      |  |  |
|---------------------------------------|--|--------|--------|------|------|-------|------|--|--|
| <p>3.2 基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较</p> |  |        |        |      |      |       |      |  |  |
| 阶段                                    |  | ①-①    | ②-②    |      |      |       |      |  |  |
| 业绩比较基准                                |  | 业绩比较基准 | 业绩比较基准 |      |      |       |      |  |  |
| 基金净资产                                 |  | 4.2%   | 0.7%   | 4.2% | 0.7% | -0.5% | 0.0% |  |  |
| 基金总资产                                 |  | 9.2%   | 0.6%   | 9.4% | 0.6% | 0.3%  | 0.0% |  |  |

[illegible]

|          |          |          |
|----------|----------|----------|
| 基金名称     | 基金名称     | 基金名称     |
| 基金简称     | 基金简称     | 基金简称     |
| 基金代码     | 基金代码     | 基金代码     |
| 基金管理人    | 基金管理人    | 基金管理人    |
| 基金托管人    | 基金托管人    | 基金托管人    |
| 基金类型     | 基金类型     | 基金类型     |
| 基金规模     | 基金规模     | 基金规模     |
| 基金净值     | 基金净值     | 基金净值     |
| 基金收益     | 基金收益     | 基金收益     |
| 基金费用     | 基金费用     | 基金费用     |
| 基金风险     | 基金风险     | 基金风险     |
| 基金投资     | 基金投资     | 基金投资     |
| 基金业绩     | 基金业绩     | 基金业绩     |
| 基金公告     | 基金公告     | 基金公告     |
| 基金募集     | 基金募集     | 基金募集     |
| 基金合同     | 基金合同     | 基金合同     |
| 基金托管协议   | 基金托管协议   | 基金托管协议   |
| 基金招募说明书  | 基金招募说明书  | 基金招募说明书  |
| 基金产品资料概要 | 基金产品资料概要 | 基金产品资料概要 |
| 基金投资策略   | 基金投资策略   | 基金投资策略   |
| 基金风险控制   | 基金风险控制   | 基金风险控制   |
| 基金信息披露   | 基金信息披露   | 基金信息披露   |
| 基金估值     | 基金估值     | 基金估值     |
| 基金申购赎回   | 基金申购赎回   | 基金申购赎回   |
| 基金转换     | 基金转换     | 基金转换     |
| 基金分红     | 基金分红     | 基金分红     |
| 基金清算     | 基金清算     | 基金清算     |
| 基金终止     | 基金终止     | 基金终止     |
| 基金其他     | 基金其他     | 基金其他     |
| 基金风险提示   | 基金风险提示   | 基金风险提示   |
| 基金重要提示   | 基金重要提示   | 基金重要提示   |
| 基金管理人承诺  | 基金管理人承诺  | 基金管理人承诺  |
| 基金托管人承诺  | 基金托管人承诺  | 基金托管人承诺  |
| 基金销售机构承诺 | 基金销售机构承诺 | 基金销售机构承诺 |
| 基金投资者承诺  | 基金投资者承诺  | 基金投资者承诺  |
| 基金其他承诺   | 基金其他承诺   | 基金其他承诺   |
| 基金风险提示   | 基金风险提示   | 基金风险提示   |
| 基金重要提示   | 基金重要提示   | 基金重要提示   |
| 基金管理人承诺  | 基金管理人承诺  | 基金管理人承诺  |
| 基金托管人承诺  | 基金托管人承诺  | 基金托管人承诺  |
| 基金销售机构承诺 | 基金销售机构承诺 | 基金销售机构承诺 |
| 基金投资者承诺  | 基金投资者承诺  | 基金投资者承诺  |
| 基金其他承诺   | 基金其他承诺   | 基金其他承诺   |
| 基金风险提示   | 基金风险提示   | 基金风险提示   |
| 基金重要提示   | 基金重要提示   | 基金重要提示   |
| 基金管理人承诺  | 基金管理人承诺  | 基金管理人承诺  |
| 基金托管人承诺  | 基金托管人承诺  | 基金托管人承诺  |
| 基金销售机构承诺 | 基金销售机构承诺 |          |

|                                                                                                                                                                                                                                                                            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |                                                                                                                                                                                          |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>7. 报告期内管理人对本基金投资股指期货等金融衍生品情况的说明</p> <p>本基金在报告期内没有使用 2014 年 8 月 8 日生效的《公募基金投资股指期货运作管理办法》第九条规定的条件。</p> <p><b>5. 股指期货报告</b></p> <p>5.1 报告期内本基金未参与股指期货行情说明</p> <p>报告期内, 中国建设银行股份有限公司为本基金的投资托管中, 严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议取得有关信息, 不存在损害基金份额持有人利益的行为, 完全尽职尽责履行了基金托管人应尽的义务。</p> | <p>95% 投资于标的指数成分股票, 该等成分股票占本基金资产净值比例不低于 80% (但法律法规另有规定时, 按照本基金基金合同相关规定执行, 而本基金基金合同不违反上述比例的限制); 同时, 本基金持有的全部权证, 其市值不超过本基金资产净值的 5%。</p> <p>-10%: 本基金投资于到期日在一年以内的国债的市值不超过本基金资产净值 5%, 以及本基金持有的其他资产市值不得超过基金资产净值的比例。本基金的投资比例较为宽松; 沪深 300 指数基金为 95% 以上投资于沪深 300 指数成分股票。</p> <p>7.4.2 投资组合的业绩归因</p> <p>本基金管理人根据中国证监会的《证券投资基金业绩评价办法》以及内部有具体规定的业绩归因方法, 将本基金业绩归因于以下三类: 基金资产配置、个股选择、以及个股择时。</p> | <p>本基金以公允价值计量的金融工具, 其公允价值变动, 公允价值变动与账面价值相符。</p> <p>(1) 货币金融工具公允价值</p> <p>本基金持有的货币金融工具公允价值计量的工具与前一报告期末一致的数据为人民币 1,886,396,613.78 元, 属于第二层次的余额为人民币 39,772,403.35 元, 属于第三层次的余额为人民币 1,507,926.18 元 (上年末, 第一层次人民币 1,512,254,475.00 元, 第二层次人民币 47,382,861.89 元, 第三层次人民币 0.00 元)。</p> <p>(2) 公允价值所属资产的重大变动</p> | <p>8.10 报告期内, 本基金未使用股指期货, 故不存在股指期货持仓期限超过持仓期限限制本基金未使用股指期货, 故不存在股指期货持仓期限超过持仓期限限制</p> <p>8.11 报告期内, 本基金未使用股指期货, 故不存在股指期货持仓期限超过持仓期限限制</p> <p>8.12 报告期内, 本基金未使用股指期货, 故不存在股指期货持仓期限超过持仓期限限制</p> |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|                   |                    |                    |                     |                     |                     |                     |                       |                       |                        |                        |                        |                        |                        |                        |                        |                        |                        |                        |                        |                        |                        |                        |                        |                        |                        |                        |                        |                        |                        |                        |                        |                        |                        |                        |                        |                        |                        |                        |                        |                        |                        |                        |                        |                        |                        |                        |                        |                        |                        |
|-------------------|--------------------|--------------------|---------------------|---------------------|---------------------|---------------------|-----------------------|-----------------------|------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|
| <p>1.1.1 基金名称</p> | <p>1.1.2 基金管理人</p> | <p>1.1.3 基金托管人</p> | <p>1.1.4 基金募集日期</p> | <p>1.1.5 基金募集规模</p> | <p>1.1.6 基金募集费用</p> | <p>1.1.7 基金募集期间</p> | <p>1.1.8 基金募集截止日期</p> | <p>1.1.9 基金募集截止日期</p> | <p>1.1.10 基金募集截止日期</p> | <p>1.1.11 基金募集截止日期</p> | <p>1.1.12 基金募集截止日期</p> | <p>1.1.13 基金募集截止日期</p> | <p>1.1.14 基金募集截止日期</p> | <p>1.1.15 基金募集截止日期</p> | <p>1.1.16 基金募集截止日期</p> | <p>1.1.17 基金募集截止日期</p> | <p>1.1.18 基金募集截止日期</p> | <p>1.1.19 基金募集截止日期</p> | <p>1.1.20 基金募集截止日期</p> | <p>1.1.21 基金募集截止日期</p> | <p>1.1.22 基金募集截止日期</p> | <p>1.1.23 基金募集截止日期</p> | <p>1.1.24 基金募集截止日期</p> | <p>1.1.25 基金募集截止日期</p> | <p>1.1.26 基金募集截止日期</p> | <p>1.1.27 基金募集截止日期</p> | <p>1.1.28 基金募集截止日期</p> | <p>1.1.29 基金募集截止日期</p> | <p>1.1.30 基金募集截止日期</p> | <p>1.1.31 基金募集截止日期</p> | <p>1.1.32 基金募集截止日期</p> | <p>1.1.33 基金募集截止日期</p> | <p>1.1.34 基金募集截止日期</p> | <p>1.1.35 基金募集截止日期</p> | <p>1.1.36 基金募集截止日期</p> | <p>1.1.37 基金募集截止日期</p> | <p>1.1.38 基金募集截止日期</p> | <p>1.1.39 基金募集截止日期</p> | <p>1.1.40 基金募集截止日期</p> | <p>1.1.41 基金募集截止日期</p> | <p>1.1.42 基金募集截止日期</p> | <p>1.1.43 基金募集截止日期</p> | <p>1.1.44 基金募集截止日期</p> | <p>1.1.45 基金募集截止日期</p> | <p>1.1.46 基金募集截止日期</p> | <p>1.1.47 基金募集截止日期</p> | <p>1.1.48 基金募集截止日期</p> | <p>1.1.49 基金募集截止日期</p> | <p>1.1.50 基金募集截止日期</p> |
| <p>1.2 基金管理人</p>  | <p>1.2.1 基金管理人</p> | <p>1.2.2 基金管理人</p> | <p>1.2.3 基金管理人</p>  | <p>1.2.4 基金管理人</p>  | <p>1.2.5 基金管理人</p>  | <p>1.2.6 基金管理人</p>  | <p>1.2.7 基金管理人</p>    | <p>1.2.8 基金管理人</p>    | <p>1.2.9 基金管理人</p>     | <p>1.2.10 基金管理人</p>    | <p>1.2.11 基金管理人</p>    | <p>1.2.12 基金管理人</p>    | <p>1.2.13 基金管理人</p>    | <p>1.2.14 基金管理人</p>    | <p>1.2.15 基金管理人</p>    | <p>1.2.16 基金管理人</p>    | <p>1.2.17 基金管理人</p>    | <p>1.2.18 基金管理人</p>    | <p>1.2.19 基金管理人</p>    | <p>1.2.20 基金管理人</p>    | <p>1.2.21 基金管理人</p>    | <p>1.2.22 基金管理人</p>    | <p>1.2.23 基金管理人</p>    | <p>1.2.24 基金管理人</p>    | <p>1.2.25 基金管理人</p>    | <p>1.2.26 基金管理人</p>    | <p>1.2.27 基金管理人</p>    | <p>1.2.28 基金管理人</p>    | <p>1.2.29 基金管理人</p>    | <p>1.2.30 基金管理人</p>    | <p>1.2.31 基金管理人</p>    | <p>1.2.32 基金管理人</p>    | <p>1.2.33 基金管理人</p>    | <p>1.2.34 基金管理人</p>    | <p>1.2.35 基金管理人</p>    | <p>1.2.36 基金管理人</p>    | <p>1.2.37 基金管理人</p>    | <p>1.2.38 基金管理人</p>    | <p>1.2.39 基金管理人</p>    | <p>1.2.40 基金管理人</p>    | <p>1.2.41 基金管理人</p>    | <p>1.2.42 基金管理人</p>    | <p>1.2.43 基金管理人</p>    | <p>1.2.44 </p>         |                        |                        |                        |                        |                        |

| <p>注：1.基金合同于2009年3月5日生效。</p> <p>2.本基金自成立起至2009年6月30日止的报告期末，本基金的投资组合比例符合基金合同关于投资范围及投资限制的规定：本基金投资于股票资产占基金资产的比例为90%-95%，投资于债券资产的比例为5%-10%，投资于货币市场基金资产的比例不超过80%，由上述比例范围限制所形成的资产类别分布，导致本基金资产配置与收益水平发生波动，但在报告期内未有违反本基金合同有关资产配置比例限制的行为。而收益本基金除投资于上述比例范围外，现金、银行存款以及中国境内允许基金投资的其它证券品种占基金资产的比例为5%-10%，其中现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。</p> <p>3.23 过去五年基金平均净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较</p> |         | <p>6.1 审计报告基本信息</p> <p>财务报表是否经审计 是</p> <p>审计意见类型 标准无保留意见</p> <p>审计报告日期 2010年03月28日 审计报告编号 68002022.1-008</p> |              | <p>6.2 审计报告的基本内容</p> |  | <p>8.1 期末基金资产组合情况</p> <p>8.2 投资组合报告</p> <p>金额单位：人民币元</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>代码</th><th>简称</th><th>金额</th><th>基金总资产占比</th></tr> </thead> <tbody> <tr> <td>1</td><td>沪深300指数</td><td>51,330.28</td><td>4.474(28.04)</td></tr> <tr> <td>2</td><td>国债逆回购</td><td></td><td></td></tr> <tr> <td>3</td><td>债券资产</td><td></td><td></td></tr> <tr> <td>4</td><td>货币资产</td><td></td><td></td></tr> <tr> <td>5</td><td>其他资产</td><td></td><td></td></tr> </tbody> </table> |  | 代码 | 简称 | 金额 | 基金总资产占比 | 1 | 沪深300指数 | 51,330.28 | 4.474(28.04) | 2 | 国债逆回购 |  |  | 3 | 债券资产 |  |  | 4 | 货币资产 |  |  | 5 | 其他资产 |  |  | <p>12.9 13 日的财务状况以及 2017 年度业绩和基金净值变动情况等有关信息。</p> <p>7.4.4 本报告期会计估计与截止上一报告期所采用的会计估计一致的情况说明</p> <p>本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。</p> <p>7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明</p> <p>7.4.5.1 会计政策变更的说明</p> <p>7.4.5.2 会计估计变更的说明</p> <p>7.4.5.3 差错更正的说明</p> |  | <p>12.9 13 日的财务状况以及 2017 年度业绩和基金净值变动情况等有关信息。</p> <p>7.4.4 本报告期会计估计与截止上一报告期所采用的会计估计一致的情况说明</p> <p>本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。</p> <p>7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明</p> <p>7.4.5.1 会计政策变更的说明</p> <p>7.4.5.2 会计估计变更的说明</p> <p>7.4.5.3 差错更正的说明</p> |  | <p>12.9 13 日的财务状况以及 2017 年度业绩和基金净值变动情况等有关信息。</p> <p>7.4.4 本报告期会计估计与截止上一报告期所采用的会计估计一致的情况说明</p> <p>本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。</p> <p>7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明</p> <p>7.4.5.1 会计政策变更的说明</p> <p>7.4.5.2 会计估计变更的说明</p> <p>7.4.5.3 差错更正的说明</p> |  | <p>12.9 13 日的财务状况以及 2017 年度业绩和基金净值变动情况等有关信息。</p> <p>7.4.4 本报告期会计估计与截止上一报告期所采用的会计估计一致的情况说明</p> <p>本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。</p> <p>7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明</p> <p>7.4.5.1 会计政策变更的说明</p> <p>7.4.5.2 会计估计变更的说明</p> <p>7.4.5.3 差错更正的说明</p> |  | <p>12.9 13 日的财务状况以及 2017 年度业绩和基金净值变动情况等有关信息。</p> <p>7.4.4 本报告期会计估计与截止上一报告期所采用的会计估计一致的情况说明</p> <p>本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。</p> <p>7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明</p> <p>7.4.5.1 会计政策变更的说明</p> <p>7.4.5.2 会计估计变更的说明</p> <p>7.4.5.3 差错更正的说明</p> |  | <p>12.9 13 日的财务状况以及 2017 年度业绩和基金净值变动情况等有关信息。</p> <p>7.4.4 本报告期会计估计与截止上一报告期所采用的会计估计一致的情况说明</p> <p>本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。</p> <p>7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明</p> <p>7.4.5.1 会计政策变更的说明</p> <p>7.4.5.2 会计估计变更的说明</p> <p>7.4.5.3 差错更正的说明</p> |  | <p>12.9 13 日的财务状况以及 2017 年度业绩和基金净值变动情况等有关信息。</p> <p>7.4.4 本报告期会计估计与截止上一报告期所采用的会计估计一致的情况说明</p> <p>本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。</p> <p>7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明</p> <p>7.4.5.1 会计政策变更的说明</p> <p>7.4.5.2 会计估计变更的说明</p> <p>7.4.5.3 差错更正的说明</p> |  | <p>12.9 13 日的财务状况以及 2017 年度业绩和基金净值变动情况等有关信息。</p> <p>7.4.4 本报告期会计估计与截止上一报告期所采用的会计估计一致的情况说明</p> <p>本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。</p> <p>7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明</p> <p>7.4.5.1 会计政策变更的说明</p> <p>7.4.5.2 会计估计变更的说明</p> <p>7.4.5.3 差错更正的说明</p> |  | <p>12.9 13 日的财务状况以及 2017 年度业绩和基金净值变动情况等有关信息。</p> <p>7.4.4 本报告期会计估计与截止上一报告期所采用的会计估计一致的情况说明</p> <p>本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。</p> <p>7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明</p> <p>7.4.5.1 会计政策变更的说明</p> <p>7.4.5.2 会计估计变更的说明</p> <p>7.4.5.3 差错更正的说明</p> |  | <p>12.9 13 日的财务状况以及 2017 年度业绩和基金净值变动情况等有关信息。</p> <p>7.4.4 本报告期会计估计与截止上一报告期所采用的会计估计一致的情况说明</p> <p>本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。</p> <p>7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明</p> <p>7.4.5.1 会计政策变更的说明</p> <p>7.4.5.2 会计估计变更的说明</p> <p>7.4.5.3 差错更正的说明</p> |  | <p>12.9 13 日的财务状况以及 2017 年度业绩和基金净值变动情况等有关信息。</p> <p>7.4.4 本报告期会计估计与截止上一报告期所采用的会计估计一致的情况说明</p> <p>本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。</p> <p>7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明</p> <p>7.4.5.1 会计政策变更的说明</p> <p>7.4.5.2 会计估计变更的说明</p> <p>7.4.5.3 差错更正的说明</p> |  | <p>12.9 13 日的财务状况以及 2017 年度业绩和基金净值变动情况等有关信息。</p> <p>7.4.4 本报告期会计估计与截止上一报告期所采用的会计估计一致的情况说明</p> <p>本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。</p> <p>7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明</p> <p>7.4.5.1 会计政策变更的说明</p> <p>7.4.5.2 会计估计变更的说明</p> <p>7.4.5.3 差错更正的说明</p> |  | <p>12.9 13 日的财务状况以及 2017 年度业绩和基金净值变动情况等有关信息。</p> <p>7.4.4 本报告期会计估计与截止上一报告期所采用的会计估计一致的情况说明</p> <p>本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。</p> <p>7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明</p> <p>7.4.5.1 会计政策变更的说明</p> <p>7.4.5.2 会计估计变更的说明</p> <p>7.4.5.3 差错更正的说明</p> |  | <p>12.9 13 日的财务状况以及 2017 年度业绩和基金净值变动情况等有关信息。</p> <p>7.4.4 本报告期会计估计与截止上一报告期所采用的会计估计一致的情况说明</p> <p>本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。</p> <p>7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明</p> <p>7.4.5.1 会计政策变更的说明</p> <p>7.4.5.2 会计估计变更的说明</p> <p>7.4.5.3 差错更正的说明</p> |  | <p>12.9 13 日的财务状况以及 2017 年度业绩和基金净值变动情况等有关信息。</p> <p>7.4.4 本报告期会计估计与截止上一报告期所采用的会计估计一致的情况说明</p> <p>本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。</p> <p>7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明</p> <p>7.4.5.1 会计政策变更的说明</p> <p>7.4.5.2 会计估计变更的说明</p> <p>7.4.5.3 差错更正的说明</p> |  | <p>12.9 13 日的财务状况以及 2017 年度业绩和基金净值变动情况等有关信息。</p> <p>7.4.4 本报告期会计估计与截止上一报告期所采用的会计估计一致的情况说明</p> <p>本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。</p> <p>7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明</p> <p>7.4.5.1 会计政策变更的说明</p> <p>7.4.5.2 会计估计变更的说明</p> <p>7.4.5.3 差错更正的说明</p> |  | <p>12.9 13 日的财务状况以及 2017 年度业绩和基金净值变动情况等有关信息。</p> <p>7.4.4 本报告期会计估计与截止上一报告期所采用的会计估计一致的情况说明</p> <p>本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。</p> <p>7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明</p> <p>7.4.5.1 会计政策变更的说明</p> <p>7.4.5.2 会计估计变更的说明</p> <p>7.4.5.3 差错更正的说明</p> |  | <p>12.9 13 日的财务状况以及 2017 年度业绩和基金净值变动情况等有关信息。</p> <p>7.4.4 本报告期会计估计与截止上一报告期所采用的会计估计一致的情况说明</p> <p>本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。</p> <p>7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明</p> <p>7.4.5.1 会计政策变更的说明</p> <p>7.4.5.2 会计估计变更的说明</p> <p>7.4.5.3 差错更正的说明</p> |  | <p>12.9 13 日的财务状况以及 2017 年度业绩和基金净值变动情况等有关信息。</p> <p>7.4.4 本报告期会计估计与截止上一报告期所采用的会计估计一致的情况说明</p> <p>本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。</p> <p>7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明</p> <p>7.4.5.1 会计政策变更的说明</p> <p>7.4.5.2 会计估计变更的说明</p> <p>7.4.5.3 差错更正的说明</p> |  | <p>12.9 13 日的财务状况以及 2017 年度业绩和基金净值变动情况等有关</p> |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------|----------------------|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|----|----|----|---------|---|---------|-----------|--------------|---|-------|--|--|---|------|--|--|---|------|--|--|---|------|--|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|-----------------------------------------------|
| 代码                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         | 简称      | 金额                                                                                                           | 基金总资产占比      |                      |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |  |    |    |    |         |   |         |           |              |   |       |  |  |   |      |  |  |   |      |  |  |   |      |  |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                               |
| 1                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | 沪深300指数 | 51,330.28                                                                                                    | 4.474(28.04) |                      |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |  |    |    |    |         |   |         |           |              |   |       |  |  |   |      |  |  |   |      |  |  |   |      |  |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                               |
| 2                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | 国债逆回购   |                                                                                                              |              |                      |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |  |    |    |    |         |   |         |           |              |   |       |  |  |   |      |  |  |   |      |  |  |   |      |  |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                               |
| 3                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | 债券资产    |                                                                                                              |              |                      |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |  |    |    |    |         |   |         |           |              |   |       |  |  |   |      |  |  |   |      |  |  |   |      |  |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                               |
| 4                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | 货币资产    |                                                                                                              |              |                      |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |  |    |    |    |         |   |         |           |              |   |       |  |  |   |      |  |  |   |      |  |  |   |      |  |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                               |
| 5                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | 其他资产    |                                                                                                              |              |                      |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |  |    |    |    |         |   |         |           |              |   |       |  |  |   |      |  |  |   |      |  |  |   |      |  |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                                                                                                                                                                                                                           |  |                                               |

|                                                                                                                                                                                                                                                                                          |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                          |                                                                                      |                                                                                         |                                                   |                                       |                                               |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|---------------------------------------|-----------------------------------------------|
| <p>7.4.6 税项</p> <p>7.4.6.1 印花税</p> <p>根据财政部、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,由原来的 3‰调整为 1‰。</p> <p>根据财政部、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溢价收入的 1‰缴纳印花税和不征收,由受让方不再缴纳。</p> <p>根据财政部、国家税务总局[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非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让</p> |  | <p>7.4.6 税项</p> <p>7.4.6.1 印花税</p> <p>根据财政部、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,由原来的 3‰调整为 1‰。</p> <p>根据财政部、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溢价收入的 1‰缴纳印花税和不征收,由受让方不再缴纳。</p> <p>根据财政部、国家税务总局[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非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让</p> | <p>1 权益类证券</p> <p>其中:股票</p> <p>2 债权类证券</p> <p>其中:债券</p> <p>3 金融衍生品</p> <p>4 其他资产</p> | <p>1,927,098,952.11</p> <p>1,927,098,952.11</p> <p>2,580,528.45</p> <p>2,580,528.45</p> | <p>75.59</p> <p>75.59</p> <p>0.11</p> <p>0.11</p> | <p>7 持有资产</p> <p>8 其他</p> <p>9 合计</p> | <p>75.59</p> <p>75.59</p> <p>4,751,123.11</p> |
| <p>8.2.4 前十大持有者中的处于限售期的持股股东及可转换债券明细</p>                                                                                                                                                                                                                                                  |  | <p>金额单位:人民币元</p>                                                                                                                                                                                                                                                                         |                                                                                      | <p>金额单位:人民币元</p>                                                                        |                                                   | <p>10 合计</p>                          | <p>4,751,123.11</p>                           |

[illegible][illegible][illegible]

|      |       |                |                |                |
|------|-------|----------------|----------------|----------------|
| 2015 | 3,016 | 496,146,942.72 | 192,655,022.18 | 686,881,949.91 |
| 2016 | 3,023 | 501,495,402.78 | 195,851,812.25 | 698,347,215.04 |

4.1 基金管理人及基金托管情况

4.1.1 基金管理人及基金托管情况

本基金管理人上海国富证券股份有限公司，成立于2005年6月，是我国第一家由银行发起设立并控股的综合性基金管理公司。公司总部在上海，设有分公司，在重庆和上海设有全资子公司——国富证券资产管理（重庆）有限公司、上海国富证券资产管理有限公司。

4.1.2 基金托管人及基金托管情况

本基金托管人上海国富证券股份有限公司，成立于2005年6月，是我国第一家由银行发起设立并控股的综合性基金管理公司。公司总部在上海，设有分公司，在重庆和上海设有全资子公司——国富证券资产管理（重庆）有限公司、上海国富证券资产管理有限公司。

4.1.3 基金管理人及基金托管情况

本基金管理人上海国富证券股份有限公司，成立于2005年6月，是我国第一家由银行发起设立并控股的综合性基金管理公司。公司总部在上海，设有分公司，在重庆和上海设有全资子公司——国富证券资产管理（重庆）有限公司、上海国富证券资产管理有限公司。

[illegible][illegible]

|    |          |             |            |  |            |           |  |          |           |          |          |          |          |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |           |            |            |            |            |            |            |            |            |            |            |            |            |            |            |            |            |            |            |            |            |            |            |            |            |            |            |            |            |            |            |            |            |            |            |            |            |            |            |            |            |            |            |            |            |            |            |            |            |            |            |            |            |            |            |            |            |            |            |            |            |            |            |            |            |            |            |            |            |            |            |            |            |            |            |            |            |            |            |            |            |            |            |            |            |            |            |            |            |
|----|----------|-------------|------------|--|------------|-----------|--|----------|-----------|----------|----------|----------|----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|
| 列明 | 本基金的资金用途 | 2014年10月17日 | 7.1 资产负债状况 |  | 7.2 年度财务报表 | 7.3 关联方关系 |  | 7.4 关联交易 | 7.5 关联方关系 | 7.6 关联交易 | 7.7 关联交易 | 7.8 关联交易 | 7.9 关联交易 | 7.10 关联交易 | 7.11 关联交易 | 7.12 关联交易 | 7.13 关联交易 | 7.14 关联交易 | 7.15 关联交易 | 7.16 关联交易 | 7.17 关联交易 | 7.18 关联交易 | 7.19 关联交易 | 7.20 关联交易 | 7.21 关联交易 | 7.22 关联交易 | 7.23 关联交易 | 7.24 关联交易 | 7.25 关联交易 | 7.26 关联交易 | 7.27 关联交易 | 7.28 关联交易 | 7.29 关联交易 | 7.30 关联交易 | 7.31 关联交易 | 7.32 关联交易 | 7.33 关联交易 | 7.34 关联交易 | 7.35 关联交易 | 7.36 关联交易 | 7.37 关联交易 | 7.38 关联交易 | 7.39 关联交易 | 7.40 关联交易 | 7.41 关联交易 | 7.42 关联交易 | 7.43 关联交易 | 7.44 关联交易 | 7.45 关联交易 | 7.46 关联交易 | 7.47 关联交易 | 7.48 关联交易 | 7.49 关联交易 | 7.50 关联交易 | 7.51 关联交易 | 7.52 关联交易 | 7.53 关联交易 | 7.54 关联交易 | 7.55 关联交易 | 7.56 关联交易 | 7.57 关联交易 | 7.58 关联交易 | 7.59 关联交易 | 7.60 关联交易 | 7.61 关联交易 | 7.62 关联交易 | 7.63 关联交易 | 7.64 关联交易 | 7.65 关联交易 | 7.66 关联交易 | 7.67 关联交易 | 7.68 关联交易 | 7.69 关联交易 | 7.70 关联交易 | 7.71 关联交易 | 7.72 关联交易 | 7.73 关联交易 | 7.74 关联交易 | 7.75 关联交易 | 7.76 关联交易 | 7.77 关联交易 | 7.78 关联交易 | 7.79 关联交易 | 7.80 关联交易 | 7.81 关联交易 | 7.82 关联交易 | 7.83 关联交易 | 7.84 关联交易 | 7.85 关联交易 | 7.86 关联交易 | 7.87 关联交易 | 7.88 关联交易 | 7.89 关联交易 | 7.90 关联交易 | 7.91 关联交易 | 7.92 关联交易 | 7.93 关联交易 | 7.94 关联交易 | 7.95 关联交易 | 7.96 关联交易 | 7.97 关联交易 | 7.98 关联交易 | 7.99 关联交易 | 7.100 关联交易 | 7.101 关联交易 | 7.102 关联交易 | 7.103 关联交易 | 7.104 关联交易 | 7.105 关联交易 | 7.106 关联交易 | 7.107 关联交易 | 7.108 关联交易 | 7.109 关联交易 | 7.110 关联交易 | 7.111 关联交易 | 7.112 关联交易 | 7.113 关联交易 | 7.114 关联交易 | 7.115 关联交易 | 7.116 关联交易 | 7.117 关联交易 | 7.118 关联交易 | 7.119 关联交易 | 7.120 关联交易 | 7.121 关联交易 | 7.122 关联交易 | 7.123 关联交易 | 7.124 关联交易 | 7.125 关联交易 | 7.126 关联交易 | 7.127 关联交易 | 7.128 关联交易 | 7.129 关联交易 | 7.130 关联交易 | 7.131 关联交易 | 7.132 关联交易 | 7.133 关联交易 | 7.134 关联交易 | 7.135 关联交易 | 7.136 关联交易 | 7.137 关联交易 | 7.138 关联交易 | 7.139 关联交易 | 7.140 关联交易 | 7.141 关联交易 | 7.142 关联交易 | 7.143 关联交易 | 7.144 关联交易 | 7.145 关联交易 | 7.146 关联交易 | 7.147 关联交易 | 7.148 关联交易 | 7.149 关联交易 | 7.150 关联交易 | 7.151 关联交易 | 7.152 关联交易 | 7.153 关联交易 | 7.154 关联交易 | 7.155 关联交易 | 7.156 关联交易 | 7.157 关联交易 | 7.158 关联交易 | 7.159 关联交易 | 7.160 关联交易 | 7.161 关联交易 | 7.162 关联交易 | 7.163 关联交易 | 7.164 关联交易 | 7.165 关联交易 | 7.166 关联交易 | 7.167 关联交易 | 7.168 关联交易 | 7.169 关联交易 | 7.170 关联交易 | 7.171 关联交易 | 7.172 关联交易 | 7.173 关联交易 | 7.174 关联交易 | 7.175 关联交易 | 7.176 关联交易 | 7.177 关联交易 | 7.178 关联交易 | 7.179 关联交易 | 7.180 关联交易 | 7.181 关联交易 | 7.182 关联交易 | 7.183 关联交易 | 7.184 关联交易 | 7.185 关联交易 | 7.186 关联交易 | 7.187 关联交易 |
|----|----------|-------------|------------|--|------------|-----------|--|----------|-----------|----------|----------|----------|----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|

[illegible]

|                                                                                                                               |                        |       |          |       |       |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------|-------|----------|-------|-------|
| 本报告期间,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、招募说明书及基金法律文件的规定,严格依法合规地开展投资管理,并切实履行受托人职责,严格控制投资风险,为基金份额持有人谋求最大利益,无异常交易行为发生。             | 4.3 管理人报告期内公平交易情况的专项说明 |       |          |       |       |
| 4.3.1 公平交易原则和制度                                                                                                               |                        |       |          |       |       |
| 1. 公平交易原则                                                                                                                     |                        |       |          |       |       |
| 根据《证券投资基金管理人公平交易制度指导意见》,为公平对待不同基金份额持有人,公平对待基金公司和人和其他投资者,严格防范利益冲突,保护基金份额持有人的合法权益,维护基金财产的安全和客户资产,不得直接或通过第三方交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。 |                        |       |          |       |       |
| 4.3.2 关联方说明                                                                                                                   |                        |       |          |       |       |
| 关联方名称                                                                                                                         | 关联方关系                  | 关联方业务 | 关联方名称    | 关联方关系 | 关联方业务 |
| 中国工商银行                                                                                                                        | 基金托管人                  | 银行    | 中国工商银行   | 基金托管人 | 银行    |
| 中国建设银行                                                                                                                        | 基金托管人                  | 银行    | 中国建设银行   | 基金托管人 | 银行    |
| 交通银行                                                                                                                          | 基金托管人                  | 银行    | 交通银行     | 基金托管人 | 银行    |
| 招商局集团                                                                                                                         | 基金管理人                  | 航运    | 招商局集团    | 基金管理人 | 航运    |
| 招商局资本运营                                                                                                                       | 基金管理人                  | 资本运营  | 招商局资本运营  | 基金管理人 | 资本运营  |
| 招商局地产                                                                                                                         | 基金管理人                  | 地产    | 招商局地产    | 基金管理人 | 地产    |
| 招商局金融                                                                                                                         | 基金管理人                  | 金融    | 招商局金融    | 基金管理人 | 金融    |
| 招商局港口                                                                                                                         | 基金管理人                  | 港口    | 招商局港口    | 基金管理人 | 港口    |
| 招商局轮船                                                                                                                         | 基金管理人                  | 轮船    | 招商局轮船    | 基金管理人 | 轮船    |
| 招商局置业                                                                                                                         | 基金管理人                  | 置业    | 招商局置业    | 基金管理人 | 置业    |
| 招商局旅游                                                                                                                         | 基金管理人                  | 旅游    | 招商局旅游    | 基金管理人 | 旅游    |
| 招商局文化                                                                                                                         | 基金管理人                  | 文化    | 招商局文化    | 基金管理人 | 文化    |
| 招商局教育                                                                                                                         | 基金管理人                  | 教育    | 招商局教育    | 基金管理人 | 教育    |
| 招商局医疗                                                                                                                         | 基金管理人                  | 医疗    | 招商局医疗    | 基金管理人 | 医疗    |
| 招商局养老                                                                                                                         | 基金管理人                  | 养老    | 招商局养老    | 基金管理人 | 养老    |
| 招商局保险                                                                                                                         | 基金管理人                  | 保险    | 招商局保险    | 基金管理人 | 保险    |
| 招商局证券                                                                                                                         | 基金管理人                  | 证券    | 招商局证券    | 基金管理人 | 证券    |
| 招商局期货                                                                                                                         | 基金管理人                  | 期货    | 招商局期货    | 基金管理人 | 期货    |
| 招商局信托                                                                                                                         | 基金管理人                  | 信托    | 招商局信托    | 基金管理人 | 信托    |
| 招商局基金                                                                                                                         | 基金管理人                  | 基金    | 招商局基金    | 基金管理人 | 基金    |
| 招商局资管                                                                                                                         | 基金管理人                  | 资管    | 招商局资管    | 基金管理人 | 资管    |
| 招商局投行                                                                                                                         | 基金管理人                  | 投行    | 招商局投行    | 基金管理人 | 投行    |
| 招商局租赁                                                                                                                         | 基金管理人                  | 租赁    | 招商局租赁    | 基金管理人 | 租赁    |
| 招商局保理                                                                                                                         | 基金管理人                  | 保理    | 招商局保理    | 基金管理人 | 保理    |
| 招商局供应链                                                                                                                        | 基金管理人                  | 供应链   | 招商局供应链   | 基金管理人 | 供应链   |
| 招商局物流                                                                                                                         | 基金管理人                  | 物流    | 招商局物流    | 基金管理人 | 物流    |
| 招商局仓储                                                                                                                         | 基金管理人                  | 仓储    | 招商局仓储    | 基金管理人 | 仓储    |
| 招商局贸易                                                                                                                         | 基金管理人                  | 贸易    | 招商局贸易    | 基金管理人 | 贸易    |
| 招商局进出口                                                                                                                        | 基金管理人                  | 进出口   | 招商局进出口   | 基金管理人 | 进出口   |
| 招商局跨境电商                                                                                                                       | 基金管理人                  | 跨境电商  | 招商局跨境电商  | 基金管理人 | 跨境电商  |
| 招商局电子商务                                                                                                                       | 基金管理人                  | 电子商务  | 招商局电子商务  | 基金管理人 | 电子商务  |
| 招商局互联网金融                                                                                                                      | 基金管理人                  | 互联网金融 | 招商局互联网金融 | 基金管理人 | 互联网金融 |
| 招商局金融科技                                                                                                                       | 基金管理人                  | 金融科技  | 招商局金融科技  | 基金管理人 | 金融科技  |
| 招商局大数据                                                                                                                        | 基金管理人                  | 大数据   | 招商局大数据   | 基金管理人 | 大数据   |
| 招商局云计算                                                                                                                        | 基金管理人                  | 云计算   | 招商局云计算   | 基金管理人 | 云计算   |
| 招商局人工智能                                                                                                                       | 基金管理人                  | 人工智能  | 招商局人工智能  | 基金管理人 | 人工智能  |
| 招商局区块链                                                                                                                        | 基金管理人                  | 区块链   | 招商局区块链   | 基金管理人 | 区块链   |
| 招商局数字货币                                                                                                                       | 基金管理人                  | 数字货币  | 招商局数字货币  | 基金管理人 | 数字货币  |
| 招商局数字资产                                                                                                                       | 基金管理人                  | 数字资产  | 招商局数字资产  | 基金管理人 | 数字资产  |
| 招商局数字版权                                                                                                                       | 基金管理人                  | 数字版权  | 招商局数字版权  | 基金管理人 | 数字版权  |
| 招商局数字营销                                                                                                                       | 基金管理人                  | 数字营销  | 招商局数字营销  | 基金管理人 | 数字营销  |
| 招商局数字服务                                                                                                                       | 基金管理人                  | 数字服务  | 招商局数字服务  | 基金管理人 | 数字服务  |
| 招商局数字治理                                                                                                                       | 基金管理人                  | 数字治理  | 招商局数字治理  | 基金管理人 | 数字治理  |
| 招商局数字安全                                                                                                                       | 基金管理人                  | 数字安全  | 招商局数字安全  | 基金管理人 | 数字安全  |
| 招商局数字生态                                                                                                                       | 基金管理人                  | 数字生态  | 招商局数字生态  | 基金管理人 | 数字生态  |
| 招商局数字未来                                                                                                                       | 基金管理人                  | 数字未来  | 招商局数字未来  | 基金管理人 | 数字未来  |
| 招商局数字梦想                                                                                                                       | 基金管理人                  | 数字梦想  | 招商局数字梦想  | 基金管理人 | 数字梦想  |
| 招商局数字希望                                                                                                                       | 基金管理人                  | 数字希望  | 招商局数字希望  | 基金管理人 | 数字希望  |
| 招商局数字未来                                                                                                                       | 基金管理人                  | 数字未来  | 招商局数字未来  | 基金管理人 | 数字未来  |
| 招商局数字梦想                                                                                                                       | 基金管理人                  | 数字梦想  | 招商局数字梦想  | 基金管理人 | 数字梦想  |
| 招商局数字希望                                                                                                                       | 基金管理人                  | 数字希望  | 招商局数字希望  | 基金管理人 | 数字希望  |
| 招商局数字未来                                                                                                                       | 基金管理人                  | 数字未来  | 招商局数字未来  | 基金管理人 | 数字未来  |
| 招商局数字梦想                                                                                                                       | 基金管理人                  | 数字梦想  | 招商局数字梦想  | 基金管理人 | 数字梦想  |
| 招商局数字希望                                                                                                                       | 基金管理人                  | 数字希望  | 招商局数字希望  | 基金管理人 | 数字希望  |
| 招商局数字未来                                                                                                                       | 基金管理人                  | 数字未来  | 招商局数字未来  | 基金管理人 | 数字未来  |
| 招商局数字梦想                                                                                                                       | 基金管理人                  | 数字梦想  | 招商局数字梦想  | 基金管理人 | 数字梦想  |
| 招商局数字希望                                                                                                                       | 基金管理人                  | 数字希望  | 招商局数字希望  | 基金管理人 | 数字希望  |
| 招商局数字未来                                                                                                                       | 基金管理人                  | 数字未来  | 招商局数字未来  | 基金管理人 | 数字未来  |
| 招商局数字梦想                                                                                                                       | 基金管理人                  | 数字梦想  | 招商局数字梦想  | 基金管理人 | 数字梦想  |
| 招商局数字希望                                                                                                                       | 基金管理人                  | 数字希望  | 招商局数字希望  | 基金管理人 | 数字希望  |
| 招商局数字未来                                                                                                                       | 基金管理人                  | 数字未来  | 招商局数字未来  | 基金管理人 | 数字未来  |
| 招商局数字梦想                                                                                                                       | 基金管理人                  | 数字梦想  | 招商局数字梦想  | 基金管理人 | 数字梦想  |
| 招商局数字希望                                                                                                                       | 基金管理人                  | 数字希望  | 招商局数字希望  | 基金管理人 | 数字希望  |
| 招商局数字未来                                                                                                                       | 基金管理人                  | 数字未来  | 招商局数字未来  | 基金管理人 | 数字未来  |
| 招商局数字梦想                                                                                                                       | 基金管理人                  | 数字梦想  | 招商局数字梦想  | 基金管理人 | 数字梦想  |
| 招商局数字希望                                                                                                                       |                        |       |          |       |       |

[illegible][illegible]

|                                                                   |  |  |  |  |  |                                                                                                                                                  |
|-------------------------------------------------------------------|--|--|--|--|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>3.2.2 在受托资产账户的公、证证书所管理的任何资金账户,受托资产账户的资产情况;</p>                 |  |  |  |  |  | <p>D) 在商定的估值日,与选择的估值机构商定估值,明确商定估值及双方公司名称、委托代理估值机构名称、联系人及联系方式,经签署有效;</p>                                                                          |
| <p>3.2.3 在受托资产账户的公、证证书所管理的任何资金账户,受托资产账户的资产情况;</p>                 |  |  |  |  |  | <p>2) 商定的估值,保持和更新估值;</p>                                                                                                                         |
| <p>3.2.3.2 在受托资产系统中设置“公平交易”模块,对于涉及同一证券品种的交易所交易,系自动通过公平交易模块完成;</p> |  |  |  |  |  | <p>1) 原定的估值期限暂定为一年,合同到期后 15 天内,投资研究部将根据各券商研究在服务的证券品种估值情况,与主做估值机构商定估值,对于不能达到标准的券商,不与其续约,并顺延至券商选择标准和程序,重新选择其它经营稳健、研究能力强、综合服务素质高的证券经营机构,重新执行估值;</p> |
| <p>公平交易模块执行原理如下:</p>                                              |  |  |  |  |  | <p>3) 若券商提供的综合估值不符合要求,主做估值机构有权要求估值,提前终止估值</p>                                                                                                    |
| <p>公平交易模块执行原理如下:</p>                                              |  |  |  |  |  |                                                                                                                                                  |
| <p>公平交易模块执行原理如下:</p>                                              |  |  |  |  |  |                                                                                                                                                  |
| <p>公平交易模块执行原理如下:</p>                                              |  |  |  |  |  |                                                                                                                                                  |
| <p>公平交易模块执行原理如下:</p>                                              |  |  |  |  |  |                                                                                                                                                  |

[illegible][illegible]

|                                                                                                                                                                     |                                                 |                                                                                                                                |                                                                               |                                                                       |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------|
| <p>公司公开发行公司债券,以公司名义进行的债券交易由申购的申购方案和分配过程进行审批,由该审批,保证分配结果符合公平交易的原则。交易所大宗交易,填写《大宗交易申请表》,经公司内部审批后执行。债券一级市场交易,填写《债券投标审批表》及《债券分销审批表》,经公司内部审批后执行。其他非集中竞价交易,参考上述审批流程执行。</p> | <p>7.2 风险管理</p> <p>会计主体:工银瑞信沪深 300 指数证券投资基金</p> | <p>2017 年 1 月 31 日,基金资产净值为人民币 1.1707 元,基金份额总额为 1,746,627,100.89 份。</p> <p>2. 南网中期/买入总份额:吉胜利再投,转换入份额;南网中期/卖出总份额:吉胜利再投转换出份额。</p> | <p>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年度报告正文。</p> <p>8.4 报告期内股票投资组合的重大变动</p> | <p>12.1 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</p> <p>12.2 影响投资者决策的其他重要信息</p> |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------|