

# 工银瑞信深证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2017年年度报告摘要

2017年12月31日  
基金管理人：工银瑞信基金管理有限公司  
基金托管人：中国农业银行股份有限公司  
送出日期：二〇一八年三月二十七日

§1 重要提示  
基金管理人承诺，基金管理人所披露资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三十三位以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年3月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。  
本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自2017年01月01日起至2017年12月31日止。

## §2 基金简介

| 2.1 基金基本情况 |                |
|------------|----------------|
| 基金名称       | 工银瑞信深证红利基金     |
| 基金代码       | 48052          |
| 基金运作方式     | 契约型开放式         |
| 基金合同生效日期   | 2013年11月21日    |
| 基金管理人      | 工银瑞信基金管理有限公司   |
| 基金托管人      | 中国农业银行股份有限公司   |
| 报告期末基金份额总额 | 662,715,037.21 |
| 基金合同期限     | 不定期            |

| 2.1.1 目标基金基本情况 |                    |
|----------------|--------------------|
| 基金名称           | 深证红利交易型开放式指数证券投资基金 |
| 基金代码           | 159905             |
| 基金运作方式         | 交易型开放式             |
| 基金合同生效日期       | 2015年11月11日        |
| 基金管理人          | 工银瑞信基金管理有限公司       |
| 基金托管人          | 中国农业银行股份有限公司       |
| 报告期末基金份额总额     | 1,000,000,000.00   |
| 基金合同期限         | 不定期                |

| 2.2 基金产品说明 |                                                                                                                                                  |
|------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标       | 本基金投资于目标ETF基金份额，采用被动式投资策略，紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。                                                                                            |
| 投资范围       | 本基金的投资范围包括目标ETF基金份额、国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、股指期货、国债期货、资产支持证券、金融衍生品及法律法规允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合比例为：本基金投资于目标ETF基金份额的比例不低于基金资产净值的90%，且不低于基金资产净值的5%。 |
| 投资策略       | 本基金主要采用被动式投资策略，紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。本基金的投资组合比例为：本基金投资于目标ETF基金份额的比例不低于基金资产净值的90%，且不低于基金资产净值的5%。                                             |
| 业绩比较基准     | 深证红利交易型开放式指数证券投资基金基金份额净值增长率-1.5%                                                                                                                 |

| 2.2.1 目标基金产品说明 |                                                                                                                                                  |
|----------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标           | 本基金投资于目标ETF基金份额，采用被动式投资策略，紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。                                                                                            |
| 投资范围           | 本基金的投资范围包括目标ETF基金份额、国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、股指期货、国债期货、资产支持证券、金融衍生品及法律法规允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合比例为：本基金投资于目标ETF基金份额的比例不低于基金资产净值的90%，且不低于基金资产净值的5%。 |
| 投资策略           | 本基金主要采用被动式投资策略，紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。本基金的投资组合比例为：本基金投资于目标ETF基金份额的比例不低于基金资产净值的90%，且不低于基金资产净值的5%。                                             |
| 业绩比较基准         | 深证红利交易型开放式指数证券投资基金基金份额净值增长率-1.5%                                                                                                                 |

| 2.3 基金管理人 |                   |
|-----------|-------------------|
| 名称        | 工银瑞信基金管理有限公司      |
| 住所        | 北京市西城区金融大街6号C座12层 |
| 法定代表人     | 张光华               |
| 总经理       | 王军                |
| 基金管理人     | 王军                |
| 基金托管人     | 中国农业银行股份有限公司      |
| 基金托管人     | 中国农业银行股份有限公司      |

| 2.4 信息披露方式   |                |
|--------------|----------------|
| 基金年度报告全文披露网站 | www.icb.com.cn |
| 基金年度报告全文披露网站 | www.icb.com.cn |

| 3.1 主要会计数据和财务指标 |              |
|-----------------|--------------|
| 基金名称            | 工银瑞信深证红利基金   |
| 基金代码            | 48052        |
| 基金运作方式          | 契约型开放式       |
| 基金合同生效日期        | 2013年11月21日  |
| 基金管理人           | 工银瑞信基金管理有限公司 |
| 基金托管人           | 中国农业银行股份有限公司 |

| 3.2 基金净值表现 |              |
|------------|--------------|
| 基金名称       | 工银瑞信深证红利基金   |
| 基金代码       | 48052        |
| 基金运作方式     | 契约型开放式       |
| 基金合同生效日期   | 2013年11月21日  |
| 基金管理人      | 工银瑞信基金管理有限公司 |
| 基金托管人      | 中国农业银行股份有限公司 |

| 3.3 主要会计数据和财务指标 |              |
|-----------------|--------------|
| 基金名称            | 工银瑞信深证红利基金   |
| 基金代码            | 48052        |
| 基金运作方式          | 契约型开放式       |
| 基金合同生效日期        | 2013年11月21日  |
| 基金管理人           | 工银瑞信基金管理有限公司 |
| 基金托管人           | 中国农业银行股份有限公司 |

| 3.4 基金净值表现 |              |
|------------|--------------|
| 基金名称       | 工银瑞信深证红利基金   |
| 基金代码       | 48052        |
| 基金运作方式     | 契约型开放式       |
| 基金合同生效日期   | 2013年11月21日  |
| 基金管理人      | 工银瑞信基金管理有限公司 |
| 基金托管人      | 中国农业银行股份有限公司 |

| 3.5 基金净值表现 |              |
|------------|--------------|
| 基金名称       | 工银瑞信深证红利基金   |
| 基金代码       | 48052        |
| 基金运作方式     | 契约型开放式       |
| 基金合同生效日期   | 2013年11月21日  |
| 基金管理人      | 工银瑞信基金管理有限公司 |
| 基金托管人      | 中国农业银行股份有限公司 |

| 3.6 基金净值表现 |              |
|------------|--------------|
| 基金名称       | 工银瑞信深证红利基金   |
| 基金代码       | 48052        |
| 基金运作方式     | 契约型开放式       |
| 基金合同生效日期   | 2013年11月21日  |
| 基金管理人      | 工银瑞信基金管理有限公司 |
| 基金托管人      | 中国农业银行股份有限公司 |

| 3.7 基金净值表现 |              |
|------------|--------------|
| 基金名称       | 工银瑞信深证红利基金   |
| 基金代码       | 48052        |
| 基金运作方式     | 契约型开放式       |
| 基金合同生效日期   | 2013年11月21日  |
| 基金管理人      | 工银瑞信基金管理有限公司 |
| 基金托管人      | 中国农业银行股份有限公司 |

| 3.8 基金净值表现 |              |
|------------|--------------|
| 基金名称       | 工银瑞信深证红利基金   |
| 基金代码       | 48052        |
| 基金运作方式     | 契约型开放式       |
| 基金合同生效日期   | 2013年11月21日  |
| 基金管理人      | 工银瑞信基金管理有限公司 |
| 基金托管人      | 中国农业银行股份有限公司 |

| 3.9 基金净值表现 |              |
|------------|--------------|
| 基金名称       | 工银瑞信深证红利基金   |
| 基金代码       | 48052        |
| 基金运作方式     | 契约型开放式       |
| 基金合同生效日期   | 2013年11月21日  |
| 基金管理人      | 工银瑞信基金管理有限公司 |
| 基金托管人      | 中国农业银行股份有限公司 |

| 3.10 基金净值表现 |              |
|-------------|--------------|
| 基金名称        | 工银瑞信深证红利基金   |
| 基金代码        | 48052        |
| 基金运作方式      | 契约型开放式       |
| 基金合同生效日期    | 2013年11月21日  |
| 基金管理人       | 工银瑞信基金管理有限公司 |
| 基金托管人       | 中国农业银行股份有限公司 |

| 3.11 基金净值表现 |              |
|-------------|--------------|
| 基金名称        | 工银瑞信深证红利基金   |
| 基金代码        | 48052        |
| 基金运作方式      | 契约型开放式       |
| 基金合同生效日期    | 2013年11月21日  |
| 基金管理人       | 工银瑞信基金管理有限公司 |
| 基金托管人       | 中国农业银行股份有限公司 |

| 3.12 基金净值表现 |              |
|-------------|--------------|
| 基金名称        | 工银瑞信深证红利基金   |
| 基金代码        | 48052        |
| 基金运作方式      | 契约型开放式       |
| 基金合同生效日期    | 2013年11月21日  |
| 基金管理人       | 工银瑞信基金管理有限公司 |
| 基金托管人       | 中国农业银行股份有限公司 |

| 3.13 基金净值表现 |              |
|-------------|--------------|
| 基金名称        | 工银瑞信深证红利基金   |
| 基金代码        | 48052        |
| 基金运作方式      | 契约型开放式       |
| 基金合同生效日期    | 2013年11月21日  |
| 基金管理人       | 工银瑞信基金管理有限公司 |
| 基金托管人       | 中国农业银行股份有限公司 |

| 3.14 基金净值表现 |              |
|-------------|--------------|
| 基金名称        | 工银瑞信深证红利基金   |
| 基金代码        | 48052        |
| 基金运作方式      | 契约型开放式       |
| 基金合同生效日期    | 2013年11月21日  |
| 基金管理人       | 工银瑞信基金管理有限公司 |
| 基金托管人       | 中国农业银行股份有限公司 |

| 3.15 基金净值表现 |              |
|-------------|--------------|
| 基金名称        | 工银瑞信深证红利基金   |
| 基金代码        | 48052        |
| 基金运作方式      | 契约型开放式       |
| 基金合同生效日期    | 2013年11月21日  |
| 基金管理人       | 工银瑞信基金管理有限公司 |
| 基金托管人       | 中国农业银行股份有限公司 |

| 3.16 基金净值表现 |              |
|-------------|--------------|
| 基金名称        | 工银瑞信深证红利基金   |
| 基金代码        | 48052        |
| 基金运作方式      | 契约型开放式       |
| 基金合同生效日期    | 2013年11月21日  |
| 基金管理人       | 工银瑞信基金管理有限公司 |
| 基金托管人       | 中国农业银行股份有限公司 |

| 3.17 基金净值表现 |              |
|-------------|--------------|
| 基金名称        | 工银瑞信深证红利基金   |
| 基金代码        | 48052        |
| 基金运作方式      | 契约型开放式       |
| 基金合同生效日期    | 2013年11月21日  |
| 基金管理人       | 工银瑞信基金管理有限公司 |
| 基金托管人       | 中国农业银行股份有限公司 |

| 3.18 基金净值表现 |              |
|-------------|--------------|
| 基金名称        | 工银瑞信深证红利基金   |
| 基金代码        | 48052        |
| 基金运作方式      | 契约型开放式       |
| 基金合同生效日期    | 2013年11月21日  |
| 基金管理人       | 工银瑞信基金管理有限公司 |
| 基金托管人       | 中国农业银行股份有限公司 |

| 3.19 基金净值表现 |              |
|-------------|--------------|
| 基金名称        | 工银瑞信深证红利基金   |
| 基金代码        | 48052        |
| 基金运作方式      | 契约型开放式       |
| 基金合同生效日期    | 2013年11月21日  |
| 基金管理人       | 工银瑞信基金管理有限公司 |
| 基金托管人       | 中国农业银行股份有限公司 |

| 3.20 基金净值表现 |              |
|-------------|--------------|
| 基金名称        | 工银瑞信深证红利基金   |
| 基金代码        | 48052        |
| 基金运作方式      | 契约型开放式       |
| 基金合同生效日期    | 2013年11月21日  |
| 基金管理人       | 工银瑞信基金管理有限公司 |
| 基金托管人       | 中国农业银行股份有限公司 |

| 3.21 基金净值表现 |              |
|-------------|--------------|
| 基金名称        | 工银瑞信深证红利基金   |
| 基金代码        | 48052        |
| 基金运作方式      | 契约型开放式       |
| 基金合同生效日期    | 2013年11月21日  |
| 基金管理人       | 工银瑞信基金管理有限公司 |
| 基金托管人       | 中国农业银行股份有限公司 |

| 3.22 基金净值表现 |              |
|-------------|--------------|
| 基金名称        | 工银瑞信深证红利基金   |
| 基金代码        | 48052        |
| 基金运作方式      | 契约型开放式       |
| 基金合同生效日期    | 2013年11月21日  |
| 基金管理人       | 工银瑞信基金管理有限公司 |
| 基金托管人       | 中国农业银行股份有限公司 |

| 3.23 基金净值表现 |              |
|-------------|--------------|
| 基金名称        | 工银瑞信深证红利基金   |
| 基金代码        | 48052        |
| 基金运作方式      | 契约型开放式       |
| 基金合同生效日期    | 2013年11月21日  |
| 基金管理人       | 工银瑞信基金管理有限公司 |
| 基金托管人       | 中国农业银行股份有限公司 |

| 3.24 基金净值表现 |              |
|-------------|--------------|
| 基金名称        | 工银瑞信深证红利基金   |
| 基金代码        | 48052        |
| 基金运作方式      | 契约型开放式       |
| 基金合同生效日期    | 2013年11月21日  |
| 基金管理人       | 工银瑞信基金管理有限公司 |
| 基金托管人       | 中国农业银行股份有限公司 |

| 3.25 基金净值表现 |              |
|-------------|--------------|
| 基金名称        | 工银瑞信深证红利基金   |
| 基金代码        | 48052        |
| 基金运作方式      | 契约型开放式       |
| 基金合同生效日期    | 2013年11月21日  |
| 基金管理人       | 工银瑞信基金管理有限公司 |
| 基金托管人       | 中国农业银行股份有限公司 |

| 3.26 基金净值表现 |              |
|-------------|--------------|
| 基金名称        | 工银瑞信深证红利基金   |
| 基金代码        | 48052        |
| 基金运作方式      | 契约型开放式       |
| 基金合同生效日期    | 2013年11月21日  |
| 基金管理人       | 工银瑞信基金管理有限公司 |
| 基金托管人       | 中国农业银行股份有限公司 |

| 3.27 基金净值表现 |              |
|-------------|--------------|
| 基金名称        | 工银瑞信深证红利基金   |
| 基金代码        | 48052        |
| 基金运作方式      | 契约型开放式       |
| 基金合同生效日期    | 2013年11月21日  |
| 基金管理人       | 工银瑞信基金管理有限公司 |
| 基金托管人       | 中国农业银行股份有限公司 |

| 3.28 基金净值表现 |              |
|-------------|--------------|
| 基金名称        | 工银瑞信深证红利基金   |
| 基金代码        | 48052        |
| 基金运作方式      | 契约型开放式       |
| 基金合同生效日期    | 2013年11月21日  |
| 基金管理人       | 工银瑞信基金管理有限公司 |
| 基金托管人       | 中国农业银行股份有限公司 |

| 3.29 基金净值表现 |              |
|-------------|--------------|
| 基金名称        | 工银瑞信深证红利基金   |
| 基金代码        | 48052        |
| 基金运作方式      | 契约型开放式       |
| 基金合同生效日期    | 2013年11月21日  |
| 基金管理人       | 工银瑞信基金管理有限公司 |
| 基金托管人       | 中国农业银行股份有限公司 |

| 3.30 基金净值表现 |              |
|-------------|--------------|
| 基金名称        | 工银瑞信深证红利基金   |
| 基金代码        | 48052        |
| 基金运作方式      | 契约型开放式       |
| 基金合同生效日期    | 2013年11月21日  |
| 基金管理人       | 工银瑞信基金管理有限公司 |
| 基金托管人       | 中国农业银行股份有限公司 |

2. 证券投资基金的含义遵照行业协会《证券投资基金管理暂行办法》的相关规定。  
4. 基金管理人对于报告期内本基金运作遵守诚信情况的说明  
本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的约定，恪尽职守，勤勉尽责，严格管理，运用基金资产，在控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

4. 基金管理人对于报告期内公平交易情况的专项说明  
4.3.1 公平交易原则和控制方法  
1. 公平交易原则  
根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，为公平对待不同基金份额持有人，公平对待基金管理人和其他资产委托人，在投资管理活动中公平对待公司所管理的不同基金财产和客户资产，不得直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。  
2. 适用范围  
本制度适用于本公司所管理的不同投资组合，包括封闭式基金、开放式基金，以及社保组合、企业年金、特定客户资产管理等其他受托资产。本基金经、指管理公募基金基金、封闭式基金、开放式基金、投资经理、指管理其他受托资产的投资经理，如企业年金、特定客户资产管理等专项受托资产。

3. 公平交易的具体措施  
3.1 在研究和投资决策环节：  
3.1.1 在公司股票池的基础上，研究部根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和关联交易等因素，参考公司《股票池管理办法》，建立股票池，各基金基金经理、其他受托资产管理人在此基础上按照授权权限具体的投资组合。  
3.1.2 各基金基金经理、其他受托资产管理人按照授权权限具体的投资组合，在授权范围内，独立、自主、审慎决策。  
3.1.3 基金管理人不得兼任投资经理，且各投资组合的基金经理、投资经理投资系统权限严格分离。

3.1.4 对于涉及及关联交易的投资行为，参考公司《关联交易管理制度》执行。  
3.2 在交易执行环节：  
3.2.1 交易人、投资交易系统权限的适当分离。在必要的情况下，对于社保基金或其他专项受托资产配备专门的交易人，未经授权，其他交易人不得与社保基金或其他专项受托资产组合的日常交易，并进行交易系统权限的屏蔽。  
3.2.2 公平交易执行原则：价格优先、时间优先、综合平衡、比例受限，禁止交易在不同基金资产、不同受托资产间的公正，保证公司所管理的不同基金资产、受托资产间的利益公平。  
3.2.3 公平交易执行方法：  
3.2.3.1 交易员必须严格按照“价格优先、时间优先”的交易执行原则，及时、迅速、准确执行。

3.2.3.2 投资交易系统设置“公平交易模块”，对于涉及到同一证券品种的交易执行，系统自动通过公平交易系统完成。  
3.2.3.3 交易员不得接受或导致同一投资组合或不同投资组合之间对同一证券品种的指令，并由风险中台在投资系统中设置资产所产品证券交易限制。  
3.2.3.4 根据证监会2011年修订的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》中相关要求，公司规定同一公募基金、年金、专户、社保基金或前或后组合之间不允许针对同一证券品种进行反向交易。  
3.2.3.5 公平交易执行原则：价格优先、时间优先、综合平衡、比例受限，禁止交易在不同基金资产、不同受托资产间的公正，保证公司所管理的不同基金资产、受托资产间的利益公平。  
3.2.3.6 公平交易执行方法：  
3.2.3.6.1 交易员必须严格按照“价格优先、时间优先”的交易执行原则，及时、迅速、准确执行。

3.2.3.7 交易员不得接受或导致同一投资组合或不同投资组合之间对同一证券品种的指令，并由风险中台在投资系统中设置资产所产品证券交易限制。  
3.2.3.8 根据证监会2011年修订的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》中相关要求，公司规定同一公募基金、年金、专户、社保基金或前或后组合之间不允许针对同一证券品种进行反向交易。  
3.2.3.9 公平交易执行原则：价格优先、时间优先、综合平衡、比例受限，禁止交易在不同基金资产、不同受托资产间的公正，保证公司所管理的不同基金资产、受托资产间的利益公平。  
3.2.3.10 公平交易执行方法：  
3.2.3.10.1 交易员必须严格按照“价格优先、时间优先”的交易执行原则，及时、迅速、准确执行。

3.2.3.11 交易员不得接受或导致同一投资组合或不同投资组合之间对同一证券品种的指令，并由风险中台在投资系统中设置资产所产品证券交易限制。  
3.2.3.12 根据证监会2011年修订的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》中相关要求，公司规定同一公募基金、年金、专户、社保基金或前或后组合之间不允许针对同一证券品种进行反向交易。  
3.2.3.13 公平交易执行原则：价格优先、时间优先、综合平衡、比例受限，禁止交易在不同基金资产、不同受托资产间的公正，保证公司所管理的不同基金资产、受托资产间的利益公平。  
3.2.3.14 公平交易执行方法：  
3.2.3.14.1 交易员必须严格按照“价格优先、时间优先”的交易执行原则，及时、迅速、准确执行。

3.2.3.15 交易员不得接受或导致同一投资组合或不同投资组合之间对同一证券品种的指令，并由风险中台在投资系统中设置资产所产品证券交易限制。  
3.2.3.16 根据证监会2011年修订的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》中相关要求，公司规定同一公募基金、年金、专户、社保基金或前或后组合之间不允许针对同一证券品种进行反向交易。  
3.2.3.17 公平交易执行原则：价格优先、时间优先、综合平衡、比例受限，禁止交易在不同基金资产、不同受托资产间的公正，保证公司所管理的不同基金资产、受托资产间的利益公平。  
3.2.3.18 公平交易执行方法：  
3.2.3.18.1 交易员必须严格按照“价格优先、时间优先”的交易执行原则，及时、迅速、准确执行。

3.2.3.19 交易员不得接受或导致同一投资组合或不同投资组合之间对同一证券品种的指令，并由风险中台在投资系统中设置资产所产品证券交易限制。  
3.2.3.20 根据证监会2011年修订的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》中相关要求，公司规定同一公募基金、年金、专户、社保基金或前或后组合之间不允许针对同一证券品种进行反向交易。  
3.2.3.21 公平交易执行原则：价格优先、时间优先、综合平衡、比例受限，禁止交易在不同基金资产、不同受托资产间的公正，保证公司所管理的不同基金资产、受托资产间的利益公平。  
3.2.3.22 公平交易执行方法：  
3.2.3.22.1 交易员必须严格按照“价格优先、时间优先”的交易执行原则，及时、迅速、准确执行。

3.2.3.23 交易员不得接受或导致同一投资组合或不同投资组合之间对同一证券品种的指令，并由风险中台在投资系统中设置资产所产品证券交易限制。  
3.2.3.24 根据证监会2011年修订的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》中相关要求，公司规定同一公募基金、年金、专户、社保基金或前或后组合之间不允许针对同一证券品种进行反向交易。  
3.2.3.25 公平交易执行原则：价格优先、时间优先、综合平衡、比例受限，禁止交易在不同基金资产、不同受托资产间的公正，保证公司所管理的不同基金资产、受托资产间的利益公平。  
3.2.3.26 公平交易执行方法：  
3.2.3.26.1 交易员必须严格按照“价格优先、时间优先”的交易执行原则，及时、迅速、准确执行。

3.2.3.27 交易员不得接受或导致同一投资组合或不同投资组合之间对同一证券品种的指令，并由风险中台在投资系统中设置资产所产品证券交易限制。  
3.2.3.28 根据证监会2011年修订的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》中相关要求，公司规定同一公募基金、年金、专户、社保基金或前或后组合之间不允许针对同一证券品种进行反向交易。  
3.2.3.29 公平交易执行原则：价格优先、时间优先、综合平衡、比例受限，禁止交易在不同基金资产、不同受托资产间的公正，保证公司所管理的不同基金资产、受托资产间的利益公平。  
3.2.3.30 公平交易执行方法：  
3.2.3.30.1 交易员必须严格按照“价格优先、时间优先”的交易执行原则，及时、迅速、准确执行。

3.2.3.31 交易员不得接受或导致同一投资组合或不同投资组合之间对同一证券品种的指令，并由风险中台在投资系统中设置资产所产品证券交易限制。  
3.2.3.32 根据证监会2011年修订的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》中相关要求，公司规定同一公募基金、年金、专户、社保基金或前或后组合之间不允许针对同一证券品种进行反向交易。  
3.2.3.33 公平交易执行原则：价格优先、时间优先、综合平衡、比例受限，禁止交易在不同基金资产、不同受托资产间的公正，保证公司所管理的不同基金资产、受托资产间的利益公平。  
3.2.3.34 公平交易执行方法：  
3.2.3.34.1 交易员必须严格按照“价格优先、时间优先”的交易执行原则，及时、迅速、准确执行。

3.2.3.35 交易员不得接受或导致同一投资组合或不同投资组合之间对同一证券品种的指令，并由风险中台在投资系统中设置资产所产品证券交易限制。  
3.2.3.36 根据证监会2011年修订的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》中相关要求，公司规定同一公募基金、年金、专户、社保基金或前或后组合之间不允许针对同一证券品种进行反向交易。  
3.2.3.37 公平交易执行原则：价格优先、时间优先、综合平衡、比例受限，禁止交易在不同基金资产、不同受托资产间的公正，保证公司所管理的不同基金资产、受托资产间的利益公平。  
3.2.3.38 公平交易执行方法：  
3.2.3.38.1 交易员必须严格按照“价格优先、时间优先”的交易执行原则，及时、迅速、准确执行。

3.2.3.39 交易员不得接受或导致同一投资组合或不同投资组合之间对同一证券品种的指令，并由风险中台在投资系统中设置资产所产品证券交易限制。  
3.2.3.40 根据证监会2011年修订的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》中相关要求，公司规定同一公募基金、年金、专户、社保基金或前或后组合之间不允许针对同一证券品种进行反向交易。  
3.2.3.41 公平交易执行原则：价格优先、时间优先、综合平衡、比例受限，禁止交易在不同基金资产、不同受托资产间的公正，保证公司所管理的不同基金资产、受托资产间的利益公平。  
3.2.3.42 公平交易执行方法：  
3.2.3.42.1 交易员必须严格按照“价格优先、时间优先”的交易执行原则，及时、迅速、准确执行。

3.2.3.43 交易员不得接受或导致同一投资组合或不同投资组合之间对同一证券品种的指令，并由风险中台在投资系统中设置资产所产品证券交易限制。  
3.2.3.44 根据证监会2011年修订的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》中相关要求，公司规定同一公募基金、年金、专户、社保基金或前或后组合之间不允许针对同一证券品种进行反向交易。  
3.2.3.45 公平交易执行原则：价格优先、时间优先、综合平衡、比例受限，禁止交易在不同基金资产、不同受托资产间的公正，保证公司所管理的不同基金资产、受托资产间的利益公平。  
3.2.3.46 公平交易执行方法：  
3.2.3.46.1 交易员必须严格按照“价格优先、时间优先”的交易执行原则，及时、迅速、准确执行。

3.2.3.47 交易员不得接受或导致同一投资组合或不同投资组合之间对同一证券品种的指令，并由风险中台在投资系统中设置资产所产品证券交易限制。  
3.2.3.48 根据证监会2011年修订的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》中相关要求，公司规定同一公募基金、年金、专户、社保基金或前或后组合之间不允许针对同一证券品种进行反向交易。  
3.2.3.49 公平交易执行原则：价格优先、时间优先、综合平衡、比例受限，禁止交易在不同基金资产、不同受托资产间的公正，保证公司所管理的不同基金资产、受托资产间的利益公平。  
3.2.3.50 公平交易执行方法：  
3.2.3.50.1 交易员必须严格按照“价格优先、时间优先”的交易执行原则，及时、迅速、准确执行。

3.2.3.51 交易员不得接受或导致同一投资组合或不同投资组合之间对同一证券品种的指令，并由风险中台在投资系统中设置资产所产品证券交易限制。  
3.2.3.52 根据证监会2011年修订的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》中相关要求，公司规定同一公募基金、年金、专户、社保基金或前或后组合之间不允许针对同一证券品种进行反向交易。  
3.2.3.53 公平交易执行原则：价格优先、时间优先、综合平衡、比例受限，禁止交易在不同基金资产、不同受托资产间的公正，保证公司所管理的不同基金资产、受托资产间的利益公平。  
3.2.3.54 公平交易执行方法：  
3.2.3.54.1 交易员必须严格按照“价格优先、时间优先”的交易执行原则，及时、迅速、准确执行。

3.2.3.55 交易员不得接受或导致同一投资组合或不同投资组合之间对同一证券品种的指令，并由风险中台在投资系统中设置资产所产品证券交易限制。  
3.2.3.56 根据证监会2011年修订的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》中相关要求，公司规定同一公募基金、年金、专户、社保基金或前或后组合之间不允许针对同一证券品种进行反向交易。  
3.2.3.57 公平交易执行原则：价格优先、时间优先、综合平衡、比例受限，禁止交易在不同基金资产、不同受托资产间的公正，保证公司所管理的不同基金资产、受托资产间的利益公平。  
3.2.3.58 公平交易执行方法：  
3.2.3.58.1 交易员必须严格按照“价格优先、时间优先”的交易执行原则，及时、迅速、准确执行。</