

工银瑞信信息产业股票型证券投资基金 2014 年半年度报告

2014 年 6 月 30 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：二〇一四年八月二十九日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2014 年 8 月 25 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2014 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	8
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	38
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	53
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	53
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	53
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	53
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	53
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	53
7.12 投资组合报告附注.....	54

§8 基金份额持有人信息	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	55
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	55
§9 开放式基金份额变动	55
§10 重大事件揭示	56
10.1 基金份额持有人大会决议.....	56
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	56
10.4 基金投资策略的改变.....	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	56
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	56
10.8 其他重大事件.....	58
§11 影响投资者决策的其他重要信息	58
§12 备查文件目录	59
12.1 备查文件目录.....	59
12.2 存放地点.....	59
12.3 查阅方式.....	59

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	工银瑞信信息产业股票型证券投资基金
基金简称	工银信息产业股票
基金主代码	000263
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 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	348,152,170.73 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	分析信息产业的发展趋势和新技术的发展方向，前瞻性地把握信息产业内通过研发不断创造出新的市场需求，并通过选择具有领先优势、创新能力及成长潜力良好的上市公司进行投资，在控制投资风险的同时，力争通过主动管理实现超越业绩基准的收益。
投资策略	本基金的投资策略主要有类属资产投资策略、股票选择策略、股指期货投资策略以及其他策略。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为： $80\% \times$ 中证 TMT 产业主题指数收益率 $+20\% \times$ 上证国债指数收益率。
风险收益特征	本基金是股票型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金、债券型基金与混合型基金，属于风险水平较高的基金。本基金主要投资于信息产业股票基金，其风险高于全市场范围内投资的股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		工银瑞信基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	朱碧艳	李芳菲
	联系电话	400-811-9999	010-66060069
	电子邮箱	customerservice@icbccs.com.cn	lifangfei@abchina.com
客户服务电话		400-811-9999	95599
传真		010-66583158	010-68121816
注册地址		北京市西城区金融大街丙 17 号北京银行大厦	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		北京市西城区金融大街丙 17 号北	北京市西城区复兴门内大街 28

	京银行大厦 8 层	号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	100033	100031
法定代表人	郭特华	蒋超良

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、证券时报、上海证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.icbccs.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	工银瑞信基金管理有限公司	北京市西城区金融大街丙 17 号北京银行大厦

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2014 年 1 月 1 日 - 2014 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	14,619,344.18
本期利润	42,939,615.49
加权平均基金份额本期利润	0.2231
本期加权平均净值利润率	20.27%
本期基金份额净值增长率	20.08%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	35,180,206.85
期末可供分配基金份额利润	0.1010
期末基金资产净值	420,665,953.12
期末基金份额净值	1.208
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2014 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	20.80%

注：1. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

2. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

3. 本基金基金合同生效日为 2013 年 11 月 11 日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

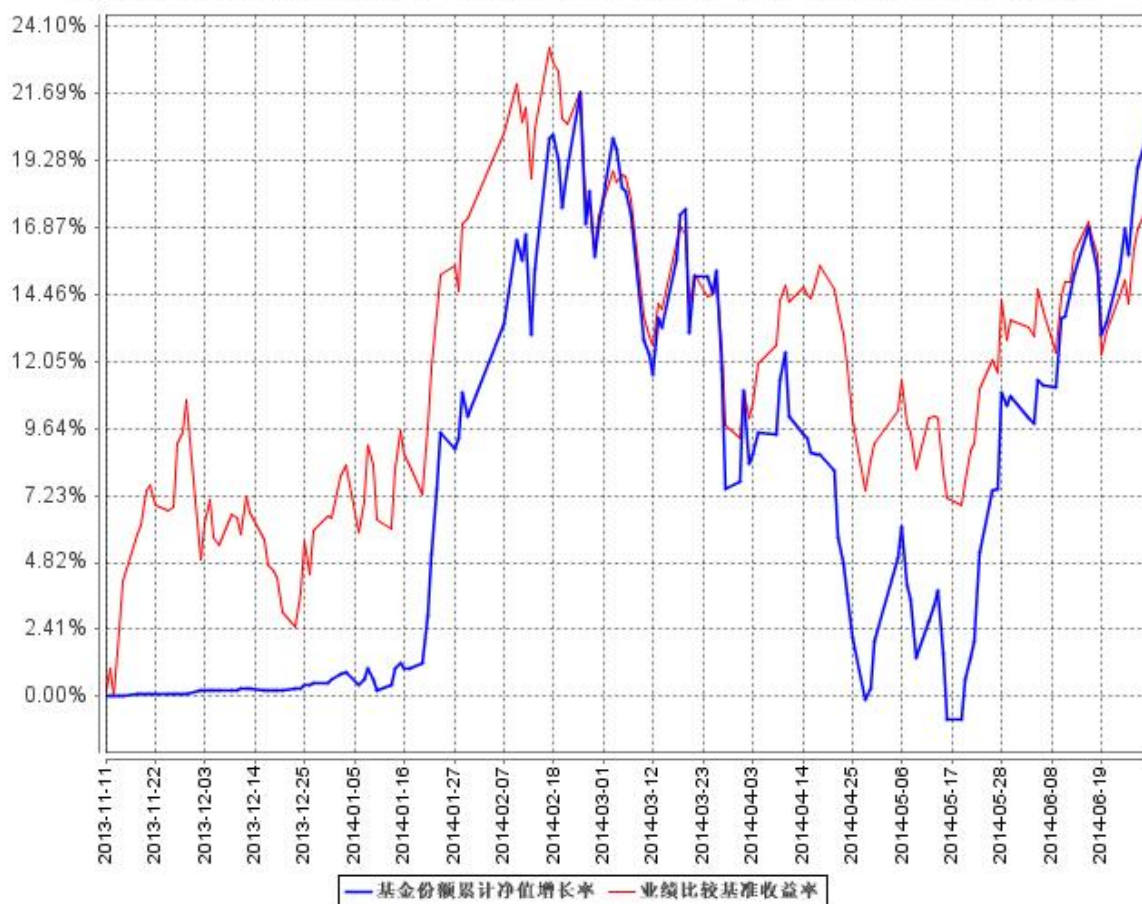
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	9.03%	1.11%	3.92%	1.16%	5.11%	-0.05%
过去三个月	12.16%	1.44%	7.91%	1.10%	4.25%	0.34%
过去六个月	20.08%	1.59%	10.82%	1.28%	9.26%	0.31%
自基金合同生效起至今	20.80%	1.39%	17.97%	1.29%	2.83%	0.10%

注：1、本基金的业绩比较基准为： $80\% \times$ 中证 TMT 产业主题指数收益率 $+20\% \times$ 上证国债指数收益率，每日进行再平衡过程；

2、本基金基金合同生效日为 2013 年 11 月 11 日，截至报告期末，本基金基金合同生效不满一年。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2013 年 11 月 11 日生效，截至报告期末，本基金基金合同生效未满一年。

2、根据基金合同规定，本基金建仓期为 6 个月。截至报告期末，本基金的各项投资比例符合基金合同关于投资范围及投资限制的规定：股票资产占基金资产的比例不低于 60%，债券等固定收益类资产占基金资产的比例为 5%-40%。其中，本基金投资于本基金合同界定的信息产业股票资产占非现金基金资产的比例不低于 80%，任何交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为工银瑞信基金管理有限公司，成立于 2005 年 6 月 21 日，是我国第一家由银行直接发起设立并控股的合资基金管理公司，注册资本为 2 亿元人民币，注册地在北京。公司目前拥有共同基金募集和管理资格、境外证券投资管理业务资格、企业年金基金投资管理人资格、特定客户资产管理业务资格、全国社保基金境内投资管理人资格。

截至 2014 年 6 月 30 日，公司旗下管理 45 只开放式基金——工银瑞信核心价值股票型证券投资基金、工银瑞信货币市场基金、工银瑞信精选平衡混合型证券投资基金、工银瑞信稳健成长股票型证券投资基金、工银瑞信增强收益债券型证券投资基金、工银瑞信红利股票型证券投资基金、工银瑞信中国机会全球配置股票证券投资基金、工银瑞信信用添利债券型证券投资基金、工银瑞信大盘蓝筹股票型证券投资基金、工银瑞信沪深 300 指数证券投资基金、上证中央企业 50 交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信中小盘成长股票型证券投资基金、工银瑞信全球精选股票型证券投资基金、工银瑞信双利债券型证券投资基金、深证红利交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信深证红利 ETF 联接基金、工银瑞信四季收益债券型证券投资基金、工银瑞信消费服务行业股票型证券投资基金、工银瑞信添颐债券型证券投资基金、工银瑞信主题策略股票型证券投资基金、工银瑞信保本混合型证券投资基金、工银瑞信睿智中证 500 指数分级证券投资基金、工银瑞信基本面量化策略股票型证券投资基金、工银瑞信纯债定期开放债券型证券投资基金、工银瑞信 7 天理财债券型证券投资基金、工银瑞信睿智深证 100 指数分级证券投资基金、工银瑞信 14 天理财债券型发起式证券投资基金、工银瑞信信用纯债债券型证券投资基金、工银瑞信 60 天理财债券型证券投资基金、工银瑞信保本 2 号混合型发起式证券投资基金、工银瑞信增利分级债券型证券投资基金、工银瑞信安心增利场内实时申赎货币市场基金、工银瑞信产业债债券型证券投资基金、工银瑞信信用纯债一年定期开放债券型证券投资基金、工银瑞信信用纯债两年定期开放债券型证券投资基金、工银瑞信标普全球自然资源指数证券投资基金、工银瑞信保本 3 号混合型证券投资基金、工银瑞信月月薪定期支付债券型证券投资基金、工银瑞信金融地产行业股票型证券投资基金、工银瑞信双债增强债券型证券投资基金、工银瑞信添福债券型证券投资基金、工银瑞信信息产业股票型证券投资基金、工银瑞信薪金货币市场基金、工银瑞信纯债债券型证券投资基金、工银瑞信绝对收益策略混合型发起式证券投资基金，证券投资基金管理规模逾 1900 亿元人民币。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘天任	本基金的基金经理	2013年11月11日	-	6	曾任埃森哲咨询公司资深分析员。2008年加入工银瑞信，曾任研究部高级研究员。2013年11月11日至今，担任工银瑞信信息产业股票型基金基金经理；2014年6月5日至今，担任工银瑞信稳健成长股票基金基金经理。
王烁杰	本基金的基金经理	2014年4月28日	-	4	先后在中国移动北京分公司担任行业分析经理，在中邮创业基金担任行业研究员；2011年加入工银瑞信，曾任研究部研究员，2014年4月28日至今，担任工银瑞信信息产业股票型基金基金经理。
曹冠业	权益投资部总监，曾任本基金的基金经理。	2013年11月11日	2014年6月12日	13	CFA、FRM；先后在东方汇理担任结构基金和亚太股票基金经理，香港恒生投资管理公司担任香港中国股票和QFII基金投资经理；2007年加入工银瑞信，现任权益投资部总监，兼任工银瑞信资产管理（国际）有限公司权益投资总监；2007年11月29日至2009年5月17日，担任工银核心价值基金基金经理；2008年2月14日至2009年12月25日，担任工银全球基金基金经理；2009年5月18日至2014年6月12日，担任工银成长基金基金经理；2011年10月24日至2014年6月12日，担任工银主题策略股票基金基金经理；2013年9月23日至2014年6月12日担任工银瑞信中国机会全球配置基金基金经理；2013年11月11日至2014年6月12日担任工银瑞信信息产业股票型基金基金经理。

注：

1、任职日期说明：刘天任的任职日期为基金合同生效日期。

王烁杰的任职日期为公司执委会决议正式生效日期。

曹冠业的任职日期为基金合同生效日期。

2、离任日期说明：曹冠业的离任日期为公司执委会决议正式生效日期，从该日起不再担任本基金基金经理。

3、证券从业年限的计算标准：证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的

相关规定等。

4、本基金无基金经理助理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了公平对待各类投资人，保护各类投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，公司根据《证券投资基金法》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部规章，拟定了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》，对公司管理的各类资产的公平对待做了明确具体的规定，并规定对买卖股票、债券时候的价格和市场价格差距较大，可能存在操纵股价、利益输送等违法违规情况进行监控。本报告期，按照时间优先、价格优先的原则，本公司对满足限价条件且对同一证券有相同交易需求的基金等投资组合，均采用了系统中的公平交易模块进行操作，实现了公平交易；且本基金及本基金与本基金管理人管理的其他投资组合之间未发生法律法规禁止的反向交易及交叉交易。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的 5%。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年整体看信息产业领域经历了较大的波动，但经历了 3、4 月份的充分调整后，以计算机指数为代表的信息产业相关指数相对比较强势。从经济层面看国内宏观经济处于底部区域，流动性逐步温和释放。但二级市场整体资金并不活跃，市场总体看较为低迷，后创业板题材类各股在某些时段有阶段性的表现，市场整体上分化较为明显。

上半年工银信息产业基金总体表现良好，但期间也经历了大幅波动。3、4 月份净值大幅回撤。但通过 4 月份及时调整仓位与优化各股配置，在市场较为低迷的时候重点配置了互联网、信息安

全、军工信息化等领域的优质品种，为 5 月份之后取得了良好的成绩奠定了基础，基金业绩与排名均获得大幅提升。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值增长率为 20.08%，业绩比较基准增长率为 10.82%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

习近平总书记提出中国经济进入“新常态”，即经济增长从过去的高速演变成中速。虽然总量增速放缓，但经济增长质量的提升、经济结构的优化。结构性调整使很多产业面临新的发展机遇。在这个过程中，股市参与经济运行的质量提升，告别投机市，真正做到将资源有效分配到反应社会、经济发展中最有效率的领域。

另一方面，证券市场制度的完善也为股市的长期繁荣奠定了基础。国务院新“国九条”展望了资本市场未来发展蓝图，资本市场逐步走向市场化、立体化、国际化，投资工具和领域将更加广泛。在这种宏观经济和制度变革背景下，未来两年的 A 股市场仍充满机会，顺应转型大势，把握产业发展脉络，有望获得良好收益。

我们整体判断下半年 A 股市场会是一个震荡向上的过程。前途光明，道路曲折。结构方面，大盘蓝筹下半年的机会明显好于上半年，但从大方向上看，以信息产业为代表的新兴产业依然长期向好。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.6.1 参与估值流程各方及人员（或小组）的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

4.6.1.1 职责分工

（1）参与估值小组成员为 4 人，分别是公司运作部负责人、研究部负责人、风险管理部负责人、法律合规部负责人，组长由运作部负责人担任。

（2）各部门负责人也可推荐代表各部门参与估值小组的成员，如需更换，由相应部门负责人提出。小组成员需经运作部主管副总批准同意。

4.6.1.2 专业胜任能力及相关工作经历

小组由具有多年从事估值运作、证券行业研究、风险管理及熟悉业内法律法规的专家型人员组成。

4.6.2 基金经理参与或决定估值的程度

本公司基金经理参与讨论估值原则及方法，但不参与最终估值决策。

4.6.3 参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.6.4 已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

尚无已签约的任何定价服务。本基金所采用的估值流程及估值结果均已经过会计师事务所鉴证，并经托管银行复核确认。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未实施利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，工银瑞信基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，工银瑞信基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：工银瑞信信息产业股票型证券投资基金

报告截止日：2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
资产:			
银行存款	6.4.7.1	107,873,454.45	16,551,991.83
结算备付金		3,232,806.38	2,516,670.79
存出保证金		405,433.33	549.87
交易性金融资产	6.4.7.2	332,700,482.67	21,593,228.56
其中: 股票投资		332,700,482.67	21,593,228.56
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	120,000,000.00
应收证券清算款		8,866,737.23	1,618,989.08
应收利息	6.4.7.5	22,426.30	117,571.92
应收股利		-	-
应收申购款		2,923,461.68	132,543.41
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		456,024,802.04	162,531,545.46
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		21,878,904.47	2,883,349.11
应付赎回款		10,772,623.98	1,584,539.09
应付管理人报酬		396,372.40	237,444.16
应付托管费		66,062.06	39,574.01
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	2,018,788.38	25,073.91
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	226,097.63	5,971.64
负债合计		35,358,848.92	4,775,951.92
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	348,152,170.73	156,860,820.07
未分配利润	6.4.7.10	72,513,782.39	894,773.47
所有者权益合计		420,665,953.12	157,755,593.54

负债和所有者权益总计		456,024,802.04	162,531,545.46
------------	--	----------------	----------------

注：1、报告截止日 2014 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.208 元，基金份额总额 348,152,170.73 元。

2、本基金基金合同生效日为 2013 年 11 月 11 日。

6.2 利润表

会计主体：工银瑞信信息产业股票型证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
一、收入		51,356,749.34
1.利息收入		423,165.61
其中：存款利息收入	6.4.7.11	186,154.38
债券利息收入		6,863.02
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		230,148.21
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		22,305,273.03
其中：股票投资收益	6.4.7.12	21,234,320.87
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	9,780.00
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	1,061,172.16
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	28,320,271.31
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	308,039.39
减：二、费用		8,417,133.85
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,560,563.56
2. 托管费	6.4.10.2.2	260,093.95
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.19	6,403,140.20
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	6.4.7.20	193,336.14
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		42,939,615.49
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		42,939,615.49

注：本基金基金合同生效日为 2013 年 11 月 11 日。

华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具（2013）验字第 60802052_A66 号验资报告。经向中国证监会备案，《工银瑞信信息产业股票型证券投资基金基金合同》于 2013 年 11 月 11 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 227,090,220.27 份基金份额，其中认购资金利息折合 39,284.84 份基金份额。本基金的基金管理人为工银瑞信基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《工银瑞信信息产业股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为本基金的投资范围限于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括创业板股票、中小板股票以及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、债券回购、资产支持证券、货币市场工具、股指期货与权证等金融衍生工具以及法律法规允许基金投资的其它金融工具。其中，股票、权证等权益类资产占基金资产的比例为 60%-95%，债券等固定收益类资产占基金资产的比例为 5%-40%。其中，本基金投资于信息产业内的股票资产占基金股票资产的比例不低于 80%，任何交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（统称“企业会计准则”）、中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会颁布的相关规定而编制。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2014 年 6 月 30 日的财务状况以及 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日止会计期间内的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成一个单位的金融资产（负债），并形成其他单位的金融负债（资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

金融资产应当在初始确认时划分为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、持有至到期投资、贷款和应收款项，以及可供出售金融资产。金融资产分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。

本基金将持有的股票投资、债券投资和衍生工具（主要系权证投资）于初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金将持有的其他金融资产划分为贷款和应收款项，包括银行存款和各类应收款项等。

(2) 金融负债分类

金融负债应当在初始确认时划分为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债两类。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

基金初始确认金融资产或金融负债，应当按照取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票投资、债券投资等，以及不作为有效套期工具的衍生金融工具，相关的交易费用在发生时计入当期损益。对于本基金的其他金融资产和其他金融负债，相关交易费用在发生时计入初始确认金额。

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益。对于本基金的其他金融资产和其他金融负债，采用实际利率法，按摊余成本进行后续计量。

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，其中包括同时结转的公允价值变动收益。

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，终止确认该金融负债或其一部分。

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方（转入方）。本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产。本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

因股权分置改革而获得非流通股股东支付的现金对价，于股权分置改革方案实施后的股票复牌日，冲减股票投资成本；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，出售股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账。其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限计算应收利息，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，出售债券的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

配股权证及由股权分置改革而被动获得的权证，在确认日记录所获分配的权证数量，该类权证初始成本为零；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，出售权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于确认日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(5) 回购协议

基金持有的回购协议（封闭式回购）以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。存在活跃市场的金融资产或金融负债以活跃市场中的报价确定公允价值。不存在活跃市场的金融资产或金融负债采用估值技术确定公允价值。采用估值技术得出的结果反映估值日在公平交易中可能采用的交易价格。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。本基金以上述原则确定的公允价值进行估值。

本基金主要金融工具的估值方法如下：

(1) 股票投资

1) 上市流通的股票的估值

上市流通的股票按估值日该股票在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

2) 未上市的股票的估值

A. 送股、转增股、公开增发新股或配股的股票，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值；

B. 首次公开发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按其成本价计算；

C. 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值；

D. 非公开发行有明确锁定期的股票的估值

本基金投资的非公开发行的股票按以下方法估值：

a. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价低于非公开发行股票的非公开发行股票的初始取得成本时，应采用在证券交易所的同一股票的市价作为估值日该非公开发行股票的价值；

b. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价高于非公开发行股票的非公开发行股票的初始取得成本时，应按中国证监会相关规定处理；

(2) 债券投资

1) 证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值；估值日无交易的且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

2) 证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日无交易的且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

3) 未上市债券采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量；

4) 在全国银行间债券市场交易的债券及交易所固定收益平台交易的债券等，采用估值技术确定公允价值；

5) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

(3) 权证投资

1) 上市流通的权证按估值日该权证在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

2) 未上市流通的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量；

3) 因持有股票而享有的配股权证，采用估值技术确定公允价值进行估值；

(4) 分离交易可转债

分离交易可转债，上市日前，采用估值技术分别对债券和权证进行估值；自上市日起，上市流通的债券和权证分别按上述 2)、3) 中相关原则进行估值；

(5) 其他

1) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融资产公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在实际持有期间内逐日计提；

(5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/(损失)于卖出债券成交日确认,并按卖出债券成交金额与其成本、应收利息的差额入账;

(7) 衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认,并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账;

(8) 股利收益于除息日确认,并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账;

(9) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失;

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方,经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

在存续期内,本基金按照基金合同的约定每月定期向基金份额持有人支付一定的现金,即按照招募说明书约定的年度支付比率以及在定期支付日满足定期支付机制参与条件的基金份额数计算当期支付份额数,自动赎回基金份额持有人所持的基金份额,并按照定期支付日的基金份额净值向基金份额持有人进行现金支付。除上述定期支付外,本基金不另外进行收益分配。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部,以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分:(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用;(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果,以决定向其配置资源、评价其业绩;(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征,并且满足一定条件的,则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作,不需要披露分部信息。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作,本基金确定以下类别债

券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的差错更正事项。

6.4.6 税项

1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3%调整为1%；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[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因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

2. 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[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，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

3. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]107 号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定，自 2005 年 6 月 13 日起，对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得，按照财税[2005]102 号文规定，扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时，减按 50% 计算应纳税所得额；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[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，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号《财政部国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
活期存款	107,873,454.45

定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	107,873,454.45

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	304,076,558.76	332,700,482.67	28,623,923.91
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	304,076,558.76	332,700,482.67	28,623,923.91

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易，也无在买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	20,789.10
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,454.70

应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	182.50
合计	22,426.30

注：“其他”为应收结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
交易所市场应付交易费用	2,018,788.38
银行间市场应付交易费用	-
合计	2,018,788.38

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	40,599.44
预提信息披露费用	148,765.71
账户维护费用	4,500.00
预提审计费	32,232.48
合计	226,097.63

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	156,860,820.07	156,860,820.07
本期申购	410,740,622.82	410,740,622.82
本期赎回(以“-”号填列)	-219,449,272.16	-219,449,272.16
本期末	348,152,170.73	348,152,170.73

注：1、本基金在募集期间净认购金额为人民币 227,050,935.43 元，折合 227,050,935.43 份基金份额，基金份额有效认购款项产生的利息为人民币 39,284.84 元，折合 39,284.84 份基金份额；以上收到的实收基金共计人民币 227,050,935.43 元，折合 227,050,935.43 份基金份额。

2、本期申购中包含红利再投、转入份额及金额，本期赎回中包含转出份额及金额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	596,060.90	298,712.57	894,773.47
本期利润	14,619,344.18	28,320,271.31	42,939,615.49
本期基金份额交易产生的变动数	19,964,801.77	8,714,591.66	28,679,393.43
其中：基金申购款	35,791,128.76	19,858,146.80	55,649,275.56
基金赎回款	-15,826,326.99	-11,143,555.14	-26,969,882.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	35,180,206.85	37,333,575.54	72,513,782.39

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	145,849.85
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	38,784.26
其他	1,520.27
合计	186,154.38

注：“其他”为结算保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	2,033,521,986.76
减：卖出股票成本总额	2,012,287,665.89
买卖股票差价收入	21,234,320.87

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2014年1月1日至2014年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	10,040,272.88
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	9,992,060.00
减：应收利息总额	38,432.88
债券投资收益	9,780.00

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无其他投资收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2014年1月1日至2014年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,061,172.16
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,061,172.16

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2014年1月1日至2014年6月30日
1. 交易性金融资产	28,320,271.31
——股票投资	28,320,271.31
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-

2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	28,320,271.31

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2014年1月1日至2014年6月30日
基金赎回费收入	303,853.63
转换费收入	4,185.76
合计	308,039.39

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2014年1月1日至2014年6月30日
交易所市场交易费用	6,402,790.20
银行间市场交易费用	350.00
合计	6,403,140.20

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2014年1月1日至2014年6月30日
审计费用	32,232.48
信息披露费	148,765.71
银行间账户维护费	9,000.00
其他	20.00
银行费用	3,317.95
合计	193,336.14

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金并无须作披露的重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
工银瑞信基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金管理人股东、基金销售机构

注：1、本报告期本基金关联方未发生变化。

2、以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,560,563.56
其中：支付销售机构的客户维护费	312,123.16

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	260,093.95

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金的管理人本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的管理人在本报告期内与上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末未投资本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	107,873,454.45	145,849.85	-	-

注：本半年度末余额仅为活期存款，利息收入包括活期存款和存款投资收入。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末进行利润分配。

6.4.12 期末（2014 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600485	中创信测	2014年6月25日	重大事项	18.21	2014年7月3日	20.03	377,240	6,917,075.44	6,869,540.40	-
300295	三六五网	2014年4月11日	重大事项	100.10	2014年7月8日	105.00	41,728	4,116,772.14	4,176,972.80	指数法估值
002551	尚荣医疗	2014年6月12日	重大事项	34.01	-	-	89,529	3,032,345.33	3,044,881.29	-
300137	先河环保	2014年6月16日	重大事项	20.86	2014年8月15日	14.31	141,100	3,031,833.00	2,943,346.00	-

注：本基金因重大事项停牌的股票中包含按指数收益法确定公允价值的长期停牌股票，该类股票估值采用中国证券业协会基金估值小组提供的估值方法，并于2014年6月30日对资产净值和本期净利润的影响均为人民币95,557.12元。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理**6.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人的风险管理机构由董事会下属的公司治理与风险控制委员会、督察长、公司风险管理委员会、法律合规部、风险管理部以及各个业务部门组成。

公司实行全面、系统的风险管理，风险管理覆盖公司所有战略环节、业务环节和操作环节。

同时制定了系统化的风险管理程序，对风险管理的整个流程进行评估和改进。公司构建了分工明确、相互协作、彼此牵制的风险管理组织结构，形成了由四大防线共同筑成的风险管理体系：第一道防线由各个业务部门构成，各业务部门总监作为风险责任人，负责制订本部门的作业流程以及风险控制措施；第二道监控防线由公司专属风险管理部门法律合规部和风险管理部构成，法律合规部负责对公司业务的法律合规风险进行监控管理，风险管理部负责对公司投资管理风险和运作风险进行监控管理；第三道防线是由公司经营管理层和风险管理委员会构成，公司管理层通过执行委员会下的风险管理委员会对风险状况进行全面监督并及时制定相应的对策和实施监控措施；在上述这三道风险监控防线中，公司督察长和监察稽核人员对风险控制措施和合规风险情况进行全面检查、监督，并视所发生问题情节轻重及时反馈给各部门经理、公司总经理、公司治理与风险控制委员会、董事会、监管机构。督察长独立于公司其他业务部门和公司管理层，对内部控制制度的执行情况实行严格检查和及时反馈，并独立报告；第四道监控防线由董事会下属的公司治理与风险控制委员会构成，公司治理与风险控制委员会通过督察长和监察稽核人员的工作，掌握整体风险状况并进行决策。公司治理与风险控制委员会负责检查公司业务的内控制度的实施情况，监督公司对相关法律法规和公司制度的执行。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

于 2013 年 12 月 31 日和 2014 年 6 月 30 日，本基金未持有按短期信用评级的债券投资。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

于 2013 年 12 月 31 日和 2014 年 6 月 30 日，本基金未持有按长期信用评级的债券投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除小部分流通受限证券外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2014年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	107,873,454.45	-	-	-	-	-	107,873,454.45
结算备付金	3,232,806.38	-	-	-	-	-	3,232,806.38
存出保证金	405,433.33	-	-	-	-	-	405,433.33
交易性金融资产	-	-	-	-	-	332,700,482.67	332,700,482.67
应收证券清算款	-	-	-	-	-	8,866,737.23	8,866,737.23
应收利息	-	-	-	-	-	22,426.30	22,426.30
应收申购款	-	-	-	-	-	2,923,461.68	2,923,461.68
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	111,511,694.16	-	-	-	-	344,513,107.88	456,024,802.04
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	21,878,904.47	21,878,904.47
应付赎回款	-	-	-	-	-	10,772,623.98	10,772,623.98
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	396,372.40	396,372.40
应付托管费	-	-	-	-	-	66,062.06	66,062.06
应付交易费用	-	-	-	-	-	2,018,788.38	2,018,788.38
其他负债	-	-	-	-	-	226,097.63	226,097.63
负债总计	-	-	-	-	-	35,358,848.92	35,358,848.92
利率敏感度缺口	111,511,694.16	-	-	-	-	-309,154,258.96	420,665,953.12
上年度末 2013年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	16,551,991.83	-	-	-	-	-	16,551,991.83
结算备付金	2,516,670.79	-	-	-	-	-	2,516,670.79
存出保证金	549.87	-	-	-	-	-	549.87
交易性金融资产	-	-	-	-	-	21,593,228.56	21,593,228.56
买入返售金融资产	120,000,000.00	-	-	-	-	-	120,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,618,989.08	1,618,989.08
应收利息	-	-	-	-	-	117,571.92	117,571.92
应收申购款	-	-	-	-	-	132,543.41	132,543.41
资产总计	139,069,212.49	-	-	-	-	23,462,332.97	162,531,545.46
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	2,883,349.11	2,883,349.11
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,584,539.09	1,584,539.09
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	237,444.16	237,444.16
应付托管费	-	-	-	-	-	39,574.01	39,574.01
应付交易费用	-	-	-	-	-	25,073.91	25,073.91
其他负债	-	-	-	-	-	5,971.64	5,971.64

负债总计	-	-	-	-	4,775,951.92	4,775,951.92
利率敏感度缺口	139,069,212.49	-	-	-	18,686,381.05	157,755,593.54

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于 2013 年 12 月 31 日和 2014 年 6 月 30 日，未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

无。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日		上年度末 2013 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	332,700,482.67	79.09	21,593,228.56	13.69
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	332,700,482.67	79.09	21,593,228.56	13.69

注：1. 本基金投资组合中股票资产占基金资产的比例为 60%-95%，债券、现金等金融工具占基金资产的比例为 5%-40%。

2. 由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2014年6月30日）	上年度末（2013年12月31日）
	业绩比较基准增加 5%	16,834,398.07	-
	业绩比较基准减少 5%	-16,834,398.07	-

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告**7.1 期末基金资产组合情况**

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	332,700,482.67	72.96
	其中：股票	332,700,482.67	72.96
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	111,106,260.83	24.36
7	其他各项资产	12,218,058.54	2.68
8	合计	456,024,802.04	100.00

注：由于四舍五入的原因金额占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-

B	采矿业	29,860,934.55	7.10
C	制造业	171,051,453.98	40.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	98,263,358.41	23.36
J	金融业	19,363,315.53	4.60
K	房地产业	6,823,004.10	1.62
L	租赁和商务服务业	5,855,514.00	1.39
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,482,902.10	0.35
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	332,700,482.67	79.09

注：由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002373	联信永益	1,494,784	35,276,902.40	8.39
2	300213	佳讯飞鸿	1,183,810	18,869,931.40	4.49
3	300348	长亮科技	358,416	18,720,067.68	4.45
4	002354	科冕木业	355,298	15,633,112.00	3.72
5	002559	亚威股份	756,899	15,342,342.73	3.65
6	002280	新世纪	455,369	14,353,230.88	3.41
7	300269	联建光电	393,558	13,550,201.94	3.22
8	300065	海兰信	520,074	8,810,053.56	2.09
9	300053	欧比特	516,939	8,756,946.66	2.08
10	300085	银之杰	491,803	8,513,109.93	2.02

11	002414	高德红外	466,172	8,479,668.68	2.02
12	600028	中国石化	1,563,350	8,238,854.50	1.96
13	300170	汉得信息	607,692	7,839,226.80	1.86
14	300086	康芝药业	567,202	7,662,899.02	1.82
15	300285	国瓷材料	259,877	7,627,389.95	1.81
16	601939	建设银行	1,783,237	7,364,768.81	1.75
17	601988	中国银行	2,755,074	7,025,438.70	1.67
18	600485	中创信测	377,240	6,869,540.40	1.63
19	300252	金信诺	222,523	6,081,553.59	1.45
20	002712	思美传媒	114,814	5,855,514.00	1.39
21	000596	古井贡酒	264,274	5,039,705.18	1.20
22	600559	老白干酒	229,795	4,818,801.15	1.15
23	600050	中国联通	1,333,564	4,307,411.72	1.02
24	600562	国睿科技	80,275	4,298,726.25	1.02
25	002669	康达新材	272,700	4,295,025.00	1.02
26	002552	宝鼎重工	464,255	4,234,005.60	1.01
27	002520	日发精机	201,132	4,223,772.00	1.00
28	300295	三六五网	41,728	4,176,972.80	0.99
29	300275	梅安森	270,729	4,169,226.60	0.99
30	300041	回天新材	272,697	4,144,994.40	0.99
31	601225	陕西煤业	1,002,332	4,139,631.16	0.98
32	600651	飞乐音响	555,469	4,110,470.60	0.98
33	300006	莱美药业	140,603	4,091,547.30	0.97
34	600583	海油工程	527,424	3,887,114.88	0.92
35	600266	北京城建	506,030	3,780,044.10	0.90
36	300203	聚光科技	236,554	3,761,208.60	0.89
37	603993	洛阳钼业	554,600	3,715,820.00	0.88
38	000409	山东地矿	398,877	3,629,780.70	0.86
39	600489	中金黄金	461,300	3,505,880.00	0.83
40	002551	尚荣医疗	89,529	3,044,881.29	0.72
41	600048	保利地产	613,500	3,042,960.00	0.72
42	600036	招商银行	293,100	3,001,344.00	0.71
43	300137	先河环保	141,100	2,943,346.00	0.70
44	600882	华联矿业	361,509	2,743,853.31	0.65
45	000561	烽火电子	310,400	2,076,576.00	0.49
46	601788	光大证券	248,333	1,971,764.02	0.47
47	300194	福安药业	80,987	1,639,176.88	0.39
48	000888	峨眉山A	80,505	1,482,902.10	0.35
49	300113	顺网科技	37,488	907,209.60	0.22

50	002491	通鼎光电	39,606	645,577.80	0.15
----	--------	------	--------	------------	------

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300269	联建光电	40,704,699.19	25.80
2	002354	科冕木业	37,447,872.93	23.74
3	300170	汉得信息	34,891,113.51	22.12
4	300065	海兰信	32,886,096.99	20.85
5	002373	联信永益	32,795,534.35	20.79
6	300379	东方通	32,547,057.27	20.63
7	000712	锦龙股份	32,446,829.92	20.57
8	300287	飞利信	29,772,426.76	18.87
9	300248	新开普	28,341,163.04	17.97
10	002280	新世纪	26,156,370.04	16.58
11	002279	久其软件	26,136,577.48	16.57
12	002174	游族网络	25,315,279.15	16.05
13	300253	卫宁软件	25,254,048.51	16.01
14	002712	思美传媒	25,109,137.37	15.92
15	300059	东方财富	24,969,896.17	15.83
16	600485	中创信测	24,373,975.00	15.45
17	300037	新宙邦	23,328,973.73	14.79
18	600651	飞乐音响	22,039,307.91	13.97
19	600776	东方通信	21,759,494.03	13.79
20	300113	顺网科技	21,502,933.14	13.63
21	300348	长亮科技	20,418,941.64	12.94
22	300213	佳讯飞鸿	19,724,959.24	12.50
23	300367	东方网力	18,665,971.65	11.83
24	002502	骅威股份	18,563,776.45	11.77
25	002711	欧浦钢网	18,271,797.69	11.58
26	300285	国瓷材料	18,240,656.57	11.56
27	002416	爱施德	18,230,567.16	11.56
28	300254	仟源制药	18,185,146.28	11.53

29	601788	光大证券	17,765,924.84	11.26
30	300252	金信诺	17,568,846.03	11.14
31	300033	同花顺	17,057,302.59	10.81
32	300049	福瑞股份	17,003,635.30	10.78
33	002268	卫士通	16,601,527.79	10.52
34	300369	绿盟科技	16,490,695.87	10.45
35	300073	当升科技	15,991,836.56	10.14
36	600109	国金证券	15,721,200.98	9.97
37	600720	祁连山	15,285,680.35	9.69
38	300137	先河环保	14,925,118.08	9.46
39	002312	三泰电子	14,593,244.73	9.25
40	603005	晶方科技	14,354,905.85	9.10
41	002559	亚威股份	13,946,591.22	8.84
42	002551	尚荣医疗	13,539,650.77	8.58
43	300086	康芝药业	13,539,600.62	8.58
44	002664	信质电机	13,533,068.53	8.58
45	300235	方直科技	12,847,423.61	8.14
46	601988	中国银行	12,694,385.00	8.05
47	300295	三六五网	12,672,461.83	8.03
48	002491	通鼎光电	12,469,397.75	7.90
49	002414	高德红外	12,332,483.96	7.82
50	002008	大族激光	12,195,187.13	7.73
51	002108	沧州明珠	12,135,987.00	7.69
52	300104	乐视网	12,105,947.60	7.67
53	002005	德豪润达	11,789,561.00	7.47
54	002421	达实智能	11,454,458.81	7.26
55	600149	廊坊发展	11,448,408.60	7.26
56	600763	通策医疗	11,259,545.90	7.14
57	002214	大立科技	11,217,826.75	7.11
58	300058	蓝色光标	10,807,038.00	6.85
59	600016	民生银行	10,559,373.85	6.69
60	300129	泰胜风能	10,497,594.49	6.65
61	600376	首开股份	10,432,483.41	6.61
62	300085	银之杰	10,263,901.27	6.51
63	600585	海螺水泥	10,213,976.50	6.47
64	600884	杉杉股份	10,164,693.03	6.44

65	300226	上海钢联	10,159,834.26	6.44
66	300322	硕贝德	10,146,533.83	6.43
67	601992	金隅股份	10,042,535.42	6.37
68	000851	高鸿股份	10,011,678.64	6.35
69	002180	万力达	9,865,735.36	6.25
70	600050	中国联通	9,810,891.00	6.22
71	002713	东易日盛	9,795,600.35	6.21
72	600180	瑞茂通	9,683,968.62	6.14
73	000620	新华联	9,680,353.36	6.14
74	002465	海格通信	9,666,971.88	6.13
75	002207	准油股份	9,630,449.15	6.10
76	300101	振芯科技	9,571,049.27	6.07
77	601299	中国北车	9,554,386.76	6.06
78	601939	建设银行	9,301,233.41	5.90
79	300070	碧水源	9,076,153.34	5.75
80	300053	欧比特	8,273,421.00	5.24
81	300074	华平股份	8,234,826.70	5.22
82	600640	号百控股	8,205,101.99	5.20
83	601808	中海油服	8,189,615.80	5.19
84	603000	人民网	8,163,321.88	5.17
85	600010	包钢股份	8,119,144.43	5.15
86	000732	泰禾集团	8,115,375.40	5.14
87	000957	中通客车	8,084,823.73	5.12
88	600028	中国石化	8,007,970.50	5.08
89	000681	远东股份	7,804,016.10	4.95
90	300177	中海达	7,723,086.68	4.90
91	002475	立讯精密	7,715,079.29	4.89
92	300006	莱美药业	7,667,179.96	4.86
93	002195	海隆软件	7,660,205.46	4.86
94	300209	天泽信息	7,575,154.52	4.80
95	600761	安徽合力	7,447,314.98	4.72
96	600497	驰宏锌锗	7,329,853.65	4.65
97	600583	海油工程	7,220,103.16	4.58
98	000559	万向钱潮	7,216,597.10	4.57
99	600816	安信信托	7,188,780.06	4.56
100	600990	四创电子	7,182,145.61	4.55

101	000587	金叶珠宝	7,059,539.45	4.47
102	600390	金瑞科技	7,057,900.40	4.47
103	000401	冀东水泥	7,003,514.57	4.44
104	300351	永贵电器	6,892,117.69	4.37
105	300273	和佳股份	6,852,934.58	4.34
106	300315	掌趣科技	6,831,181.23	4.33
107	000988	华工科技	6,809,804.85	4.32
108	002476	宝莫股份	6,777,346.66	4.30
109	000530	大冷股份	6,646,558.78	4.21
110	002552	宝鼎重工	6,644,430.12	4.21
111	300271	华宇软件	6,625,928.69	4.20
112	000697	炼石有色	6,537,721.12	4.14
113	000656	金科股份	6,492,481.72	4.12
114	000002	万科A	6,486,769.93	4.11
115	600879	航天电子	6,456,702.30	4.09
116	300202	聚龙股份	6,399,635.80	4.06
117	600778	友好集团	6,238,868.50	3.95
118	300133	华策影视	6,061,215.88	3.84
119	600340	华夏幸福	6,002,350.99	3.80
120	300368	汇金股份	5,969,412.90	3.78
121	600648	外高桥	5,914,000.32	3.75
122	002555	顺荣股份	5,865,829.90	3.72
123	002415	海康威视	5,847,903.05	3.71
124	600699	均胜电子	5,762,736.69	3.65
125	600060	海信电器	5,688,578.44	3.61
126	600525	长园集团	5,666,335.43	3.59
127	000709	河北钢铁	5,662,336.00	3.59
128	002380	科远股份	5,645,284.30	3.58
129	002080	中材科技	5,577,308.80	3.54
130	601225	陕西煤业	5,561,995.20	3.53
131	002241	歌尔声学	5,531,107.23	3.51
132	002700	新疆浩源	5,394,363.39	3.42
133	300115	长盈精密	5,379,758.24	3.41
134	601519	大智慧	5,353,546.59	3.39
135	000561	烽火电子	5,277,217.50	3.35
136	600742	一汽富维	5,222,111.70	3.31

137	002714	牧原股份	5,218,792.35	3.31
138	601901	方正证券	5,158,637.90	3.27
139	000024	招商地产	5,139,649.43	3.26
140	300238	冠昊生物	5,135,274.96	3.26
141	002152	广电运通	5,123,320.24	3.25
142	002240	威华股份	5,101,829.20	3.23
143	300068	南都电源	4,955,296.01	3.14
144	000625	长安汽车	4,869,988.81	3.09
145	600489	中金黄金	4,853,107.32	3.08
146	000917	电广传媒	4,847,653.00	3.07
147	002146	荣盛发展	4,842,737.56	3.07
148	002091	江苏国泰	4,810,842.52	3.05
149	601231	环旭电子	4,809,590.70	3.05
150	600559	老白干酒	4,797,632.62	3.04
151	000596	古井贡酒	4,796,724.50	3.04
152	002236	大华股份	4,778,040.64	3.03
153	600557	康缘药业	4,711,456.50	2.99
154	002573	国电清新	4,557,284.36	2.89
155	300166	东方国信	4,492,419.10	2.85
156	601628	中国人寿	4,485,283.61	2.84
157	600978	宜华木业	4,477,290.00	2.84
158	300298	三诺生物	4,350,611.92	2.76
159	000728	国元证券	4,318,908.24	2.74
160	002253	川大智胜	4,315,136.00	2.74
161	000099	中信海直	4,312,177.50	2.73
162	600256	广汇能源	4,302,220.74	2.73
163	300274	阳光电源	4,265,965.82	2.70
164	002143	高金食品	4,251,438.92	2.69
165	600495	晋西车轴	4,250,117.84	2.69
166	600369	西南证券	4,240,164.26	2.69
167	000687	恒天天鹅	4,240,127.50	2.69
168	600536	中国软件	4,216,695.30	2.67
169	000425	徐工机械	4,191,048.00	2.66
170	002520	日发精机	4,180,585.65	2.65
171	300275	梅安森	4,178,391.02	2.65
172	300041	回天新材	4,155,556.46	2.63

173	002669	康达新材	4,155,113.00	2.63
174	600562	国睿科技	4,151,204.81	2.63
175	002292	奥飞动漫	4,142,898.53	2.63
176	600290	华仪电气	4,125,572.95	2.62
177	600624	复旦复华	4,097,865.12	2.60
178	002235	安妮股份	4,096,564.55	2.60
179	000877	天山股份	4,079,463.09	2.59
180	300016	北陆药业	4,068,293.52	2.58
181	300027	华谊兄弟	4,064,849.98	2.58
182	000965	天保基建	4,007,187.00	2.54
183	600787	中储股份	4,000,587.70	2.54
184	601166	兴业银行	3,972,521.95	2.52
185	002013	中航机电	3,969,263.10	2.52
186	600240	华业地产	3,951,703.88	2.50
187	002543	万和电气	3,919,054.80	2.48
188	300043	互动娱乐	3,900,626.07	2.47
189	600801	华新水泥	3,865,672.27	2.45
190	300128	锦富新材	3,852,174.18	2.44
191	600999	招商证券	3,849,050.56	2.44
192	600237	铜峰电子	3,846,947.00	2.44
193	300251	光线传媒	3,814,364.00	2.42
194	600266	北京城建	3,801,030.20	2.41
195	000718	苏宁环球	3,747,215.71	2.38
196	603993	洛阳钼业	3,732,118.80	2.37
197	300203	聚光科技	3,679,050.30	2.33
198	000409	山东地矿	3,674,498.74	2.33
199	002678	珠江钢琴	3,666,187.98	2.32
200	600157	永泰能源	3,657,798.94	2.32
201	000793	华闻传媒	3,639,865.93	2.31
202	000060	中金岭南	3,636,318.29	2.31
203	000541	佛山照明	3,579,036.01	2.27
204	600073	上海梅林	3,490,393.10	2.21
205	002484	江海股份	3,483,587.84	2.21
206	000786	北新建材	3,458,617.04	2.19
207	601328	交通银行	3,426,500.00	2.17
208	002371	七星电子	3,421,352.24	2.17

209	600185	格力地产	3,355,045.94	2.13
210	600089	特变电工	3,316,116.22	2.10
211	002153	石基信息	3,280,304.61	2.08
212	002709	天赐材料	3,263,894.50	2.07
213	002024	苏宁云商	3,255,935.00	2.06
214	600335	国机汽车	3,242,147.99	2.06
215	002155	辰州矿业	3,236,494.59	2.05
216	601899	XD 紫金矿	3,221,684.20	2.04
217	601258	庞大集团	3,163,781.32	2.01

- 注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票；
2、买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000712	锦龙股份	31,118,759.08	19.73
2	300379	东方通	30,579,816.72	19.38
3	300248	新开普	29,766,696.65	18.87
4	300170	汉得信息	29,229,105.50	18.53
5	300269	联建光电	29,219,769.73	18.52
6	300065	海兰信	28,817,413.11	18.27
7	300287	飞利信	28,560,481.27	18.10
8	002279	久其软件	27,309,010.91	17.31
9	300059	东方财富	26,527,134.44	16.82
10	300037	新宙邦	26,146,119.87	16.57
11	300253	卫宁软件	24,853,926.03	15.75
12	002174	游族网络	24,566,699.27	15.57
13	600776	东方通信	22,970,324.10	14.56
14	002354	科冕木业	22,190,391.05	14.07
15	002280	新世纪	20,153,362.01	12.78
16	002712	思美传媒	19,862,183.18	12.59
17	300113	顺网科技	19,788,073.21	12.54
18	002268	卫士通	19,569,972.02	12.41
19	002502	骅威股份	19,184,276.92	12.16
20	300367	东方网力	19,124,424.96	12.12
21	300254	仟源制药	18,754,116.63	11.89

22	300049	福瑞股份	18,590,678.93	11.78
23	600651	飞乐音响	18,572,211.56	11.77
24	600485	中创信测	18,106,503.47	11.48
25	002416	爱施德	18,022,280.10	11.42
26	002711	欧浦钢网	17,955,897.48	11.38
27	300033	同花顺	17,057,206.53	10.81
28	300073	当升科技	16,112,787.87	10.21
29	600109	国金证券	16,054,427.17	10.18
30	300369	绿盟科技	15,856,473.22	10.05
31	600720	祁连山	15,826,694.81	10.03
32	601788	光大证券	15,755,849.67	9.99
33	603005	晶方科技	14,606,769.85	9.26
34	002312	三泰电子	13,912,614.10	8.82
35	002664	信质电机	13,850,388.97	8.78
36	300137	先河环保	13,259,281.95	8.40
37	000851	高鸿股份	13,049,368.41	8.27
38	300235	方直科技	12,752,849.62	8.08
39	300104	乐视网	12,535,630.41	7.95
40	002491	通鼎光电	12,397,662.69	7.86
41	600149	廊坊发展	12,298,086.72	7.80
42	002008	大族激光	12,023,422.12	7.62
43	002421	达实智能	11,784,950.72	7.47
44	002005	德豪润达	11,768,042.36	7.46
45	002108	沧州明珠	11,514,922.99	7.30
46	600763	通策医疗	11,306,201.60	7.17
47	300252	金信诺	11,293,866.97	7.16
48	000681	远东股份	10,845,302.74	6.87
49	600376	首开股份	10,817,105.27	6.86
50	002214	大立科技	10,800,640.24	6.85
51	601992	金隅股份	10,647,551.72	6.75
52	300058	蓝色光标	10,537,432.96	6.68
53	300285	国瓷材料	10,407,187.68	6.60
54	600585	海螺水泥	10,397,412.06	6.59
55	600016	民生银行	10,374,060.40	6.58
56	600884	杉杉股份	10,263,967.77	6.51
57	300129	泰胜风能	10,105,206.80	6.41
58	300226	上海钢联	10,088,818.04	6.40
59	000620	新华联	10,083,884.06	6.39

60	300322	硕贝德	10,077,613.54	6.39
61	002180	万力达	9,783,759.56	6.20
62	002465	海格通信	9,651,225.70	6.12
63	601299	中国北车	9,465,468.85	6.00
64	300101	振芯科技	9,405,621.32	5.96
65	002551	尚荣医疗	9,399,733.89	5.96
66	002207	准油股份	8,980,884.43	5.69
67	300070	碧水源	8,924,043.79	5.66
68	002475	立讯精密	8,863,844.51	5.62
69	002713	东易日盛	8,835,697.35	5.60
70	600180	瑞茂通	8,731,653.60	5.53
71	600640	号百控股	8,430,091.81	5.34
72	000559	万向钱潮	8,410,124.64	5.33
73	603000	人民网	8,347,022.81	5.29
74	002373	联信永益	8,342,705.79	5.29
75	601808	中海油服	8,209,765.47	5.20
76	300074	华平股份	8,146,313.26	5.16
77	000732	泰禾集团	8,129,258.54	5.15
78	300295	三六五网	8,026,016.04	5.09
79	600010	包钢股份	7,983,180.75	5.06
80	300177	中海达	7,810,626.11	4.95
81	600761	安徽合力	7,679,010.49	4.87
82	300209	天泽信息	7,678,535.79	4.87
83	000957	中通客车	7,561,202.55	4.79
84	600497	驰宏锌锗	7,309,041.75	4.63
85	600990	四创电子	7,195,005.79	4.56
86	600390	金瑞科技	7,175,633.80	4.55
87	300351	永贵电器	7,128,105.02	4.52
88	002195	海隆软件	7,033,907.11	4.46
89	300202	聚龙股份	7,012,331.83	4.45
90	000002	万科A	6,917,928.77	4.39
91	600816	安信信托	6,899,751.82	4.37
92	000401	冀东水泥	6,853,288.70	4.34
93	000988	华工科技	6,803,900.78	4.31
94	000587	金叶珠宝	6,788,722.74	4.30
95	600060	海信电器	6,769,853.68	4.29
96	300315	掌趣科技	6,678,479.54	4.23
97	300086	康芝药业	6,677,428.28	4.23

98	300271	华宇软件	6,659,243.72	4.22
99	002415	海康威视	6,605,371.48	4.19
100	000697	炼石有色	6,589,291.89	4.18
101	000530	大冷股份	6,507,288.81	4.12
102	600879	航天电子	6,362,876.52	4.03
103	002476	宝莫股份	6,262,472.02	3.97
104	600778	友好集团	6,181,542.91	3.92
105	600340	华夏幸福	6,174,246.97	3.91
106	300133	华策影视	6,119,733.89	3.88
107	000656	金科股份	6,104,007.86	3.87
108	002080	中材科技	6,061,691.48	3.84
109	300273	和佳股份	5,975,756.71	3.79
110	000709	河北钢铁	5,870,634.92	3.72
111	300115	长盈精密	5,803,068.75	3.68
112	002380	科远股份	5,775,246.19	3.66
113	000024	招商地产	5,771,921.77	3.66
114	600648	外高桥	5,761,345.02	3.65
115	002241	歌尔声学	5,758,328.76	3.65
116	600050	中国联通	5,694,120.64	3.61
117	300016	北陆药业	5,649,502.70	3.58
118	300368	汇金股份	5,620,676.75	3.56
119	600699	均胜电子	5,379,708.88	3.41
120	600525	长园集团	5,361,116.21	3.40
121	000625	长安汽车	5,318,334.59	3.37
122	002700	新疆浩源	5,269,056.51	3.34
123	600742	一汽富维	5,180,235.43	3.28
124	300068	南都电源	5,152,223.45	3.27
125	002152	广电运通	5,152,153.54	3.27
126	601231	环旭电子	5,132,680.50	3.25
127	601988	中国银行	5,092,808.92	3.23
128	002146	荣盛发展	5,059,854.96	3.21
129	002240	威华股份	5,048,535.82	3.20
130	600633	浙报传媒	5,047,372.78	3.20
131	601901	方正证券	5,041,005.00	3.20
132	601519	大智慧	5,033,002.47	3.19
133	300238	冠昊生物	4,955,614.74	3.14
134	300348	长亮科技	4,932,822.86	3.13
135	002091	江苏国泰	4,856,121.31	3.08

136	002714	牧原股份	4,854,606.90	3.08
137	002236	大华股份	4,761,622.02	3.02
138	000917	电广传媒	4,711,583.66	2.99
139	300274	阳光电源	4,610,621.96	2.92
140	300298	三诺生物	4,586,819.07	2.91
141	600557	康缘药业	4,567,672.70	2.90
142	600256	广汇能源	4,562,348.37	2.89
143	300166	东方国信	4,534,727.70	2.87
144	600978	宜华木业	4,519,742.91	2.87
145	002552	宝鼎重工	4,511,748.34	2.86
146	300213	佳讯飞鸿	4,448,267.44	2.82
147	002573	国电清新	4,435,030.11	2.81
148	600536	中国软件	4,431,233.70	2.81
149	002253	川大智胜	4,388,282.39	2.78
150	601628	中国人寿	4,372,444.73	2.77
151	000099	中信海直	4,319,998.47	2.74
152	002555	顺荣股份	4,289,872.68	2.72
153	000728	国元证券	4,266,663.18	2.70
154	000877	天山股份	4,237,796.37	2.69
155	000060	中金岭南	4,184,847.29	2.65
156	600495	晋西车轴	4,165,079.24	2.64
157	002143	高金食品	4,164,866.39	2.64
158	000425	徐工机械	4,152,174.91	2.63
159	000687	恒天天鹅	4,130,808.95	2.62
160	600369	西南证券	4,111,947.86	2.61
161	601166	兴业银行	4,102,994.76	2.60
162	002414	高德红外	4,097,344.80	2.60
163	300043	互动娱乐	4,078,356.44	2.59
164	600801	华新水泥	4,067,832.22	2.58
165	002013	中航机电	4,026,702.00	2.55
166	300006	莱美药业	4,014,389.16	2.54
167	300027	华谊兄弟	3,997,412.50	2.53
168	002543	万和电气	3,995,153.91	2.53
169	002235	安妮股份	3,970,042.12	2.52
170	600624	复旦复华	3,956,071.70	2.51
171	600290	华仪电气	3,932,237.63	2.49
172	600787	中储股份	3,916,521.92	2.48
173	002292	奥飞动漫	3,879,360.00	2.46

174	600999	招商证券	3,875,950.05	2.46
175	000965	天保基建	3,863,521.00	2.45
176	600237	铜峰电子	3,847,990.88	2.44
177	000793	华闻传媒	3,820,613.95	2.42
178	600240	华业地产	3,775,439.26	2.39
179	300128	锦富新材	3,752,686.97	2.38
180	002371	七星电子	3,743,115.64	2.37
181	002678	珠江钢琴	3,694,158.08	2.34
182	000718	苏宁环球	3,690,158.39	2.34
183	000541	佛山照明	3,649,313.20	2.31
184	600157	永泰能源	3,596,012.49	2.28
185	300251	光线传媒	3,436,031.06	2.18
186	601328	交通银行	3,431,312.63	2.18
187	002153	石基信息	3,430,543.00	2.17
188	002484	江海股份	3,412,293.70	2.16
189	000786	北新建材	3,392,790.21	2.15
190	601258	庞大集团	3,386,200.19	2.15
191	600705	中航投资	3,383,097.50	2.14
192	002024	苏宁云商	3,339,818.00	2.12
193	601958	金钼股份	3,314,389.80	2.10
194	600315	上海家化	3,287,043.00	2.08
195	600704	物产中大	3,278,403.78	2.08
196	000561	烽火电子	3,268,930.94	2.07
197	600185	格力地产	3,260,036.68	2.07
198	600073	上海梅林	3,240,955.00	2.05
199	600759	正和股份	3,216,838.07	2.04
200	002095	生意宝	3,212,050.32	2.04
201	601099	太平洋	3,200,989.15	2.03
202	600583	海油工程	3,193,958.00	2.02
203	600089	特变电工	3,178,459.47	2.01
204	601899	XD紫金矿	3,177,725.90	2.01
205	601318	中国平安	3,175,389.41	2.01

- 注：1、卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票；
2、卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,295,074,648.69
--------------	------------------

卖出股票收入（成交）总额	2,033,521,986.76
--------------	------------------

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货投资，也无期间损益。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期内，本基金未运用股指期货进行投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本报告期内，本基金未进行国债期货的投资。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货投资，也无期间损益。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本报告期内，本基金未运用国债期货进行投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2013 年 1 月 30 日，海兰信对外披露了 2012 年度业绩预告，预计 2012 年度净利润为 24.51 万元~490.22 万元，同比下降 80%~99%。2013 年 2 月 28 日，公司披露业绩快报，显示 2012 年净利润为亏损 1288.81 万元。2013 年 4 月 19 日，公司披露 2012 年年报，实际亏损 1329.68 万元。公司 2012 年业绩预告披露的业绩与实际业绩差异较大，且盈亏性质发生了变化。

公司的上述行为违反了深圳证券交易所《创业板股票上市规则（2012 年修订）》第 2.1 条、第 11.3.1 条、第 11.3.4 条的规定。深圳证券交易所于 2013 年 9 月 3 日给与公开批评处分。

上述事项对公司的生产经营活动基本无影响。

7.12.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	405,433.33
2	应收证券清算款	8,866,737.23
3	应收股利	-
4	应收利息	22,426.30
5	应收申购款	2,923,461.68
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,218,058.54

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
5,339	65,209.25	138,061,112.11	39.66%	210,091,058.62	60.34%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	425,813.16	0.1223%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013年11月11日）基金份额总额	227,090,220.27
本报告期期初基金份额总额	156,860,820.07
本报告期基金总申购份额	410,740,622.82
减：本报告期基金总赎回份额	219,449,272.16
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	348,152,170.73

注：1、报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额；

2、报告期期间基金总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期，本基金未召开持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人：

本报告期，基金管理人未发生重大人事变动。

2、基金托管人托管部门：

本报告期，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

无。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），该审计机构自基金合同生效日起向本基金提供审计服务，无改聘情况。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
安信证券	2	3,133,731,129.17	72.40%	2,795,424.94	72.41%	-
国信证券	1	-	-	-	-	-

光大证券	2	1,192,827,268.78	27.56%	1,063,356.96	27.55%	-
华创证券	1	1,862,367.50	0.04%	1,647.99	0.04%	-

注：1. 券商的选择标准和程序

(1) 选择标准：注重综合服务能力

a) 券商财务状况良好、经营行为规范、风险管理先进、投资风格与工银瑞信有互补性、在最近一年内无重大违规行为。

b) 券商具有较强的综合研究能力：能及时、全面、定期提供高质量的关于宏观、行业、资本市场、个股分析的报告及其他丰富全面的信息咨询服务；有很强的分析能力，能根据工银瑞信所管理基金的特定要求，提供专门研究报告；具有开发量化投资组合模型的能力以及其他综合服务能力。

c) 与其他券商相比，该券商能够提供最佳交易执行和优惠合理的佣金率。

(2) 选择程序

a) 确定券商数量：根据以上标准对不同券商进行考察、选择和确定。投资研究部门（权益投资部，固定收益部，专户投资部，研究部和中央交易室）根据公司基金规模和服务需求等因素确定对合作券商的数量，每年根据公司经营规模变化及券商评估结果决定是否需要新增或调整合作券商，选定的名单需经主管投资副总和总经理审批同意。

b) 签订委托协议：与被选择的券商签订委托代理协议，明确签定协议双方的公司名称、委托代理期限、佣金率、双方的权利义务等，经签章有效。委托代理协议一式五份，协议双方及证券主管机关各留存一份，工银瑞信法律合规部留存备案，并报相关证券主管机关留存报备。

2. 券商的评估，保留和更换程序

(1) 席位的租用期限暂定为一年，合同到期 15 天内，投资研究部门将根据各券商研究在服务期间的综合证券服务质量等情况，进行评估。

(2) 对于符合标准的券商，工银瑞信将与其续约；对于不能达到标准的券商，不与其续约，并根据券商选择标准和程序，重新选择其它经营稳健、研究能力强、综合服务质量高的证券经营机构，租用其交易席位。

(3) 若券商提供的综合证券服务不符合要求，工银瑞信有权按照委托协议规定，提前中止租用其交易席位。

证券公司席位的变更情况

在报告期内本基金新增光大证券股份有限公司的 28504 上海交易单元和 394547 深圳交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
安信证券	-	-	1,096,100,000.00	100.00%	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	工银瑞信基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的长期停牌股票估值方法调整的公告	三大报、公司网站	2014年3月12日
2	工银瑞信基金管理有限公司关于增聘基金经理的公告	三大报、公司网站	2014年5月1日
3	工银瑞信基金管理有限公司关于调整客户服务热线人工服务及在线客服服务时间的通知	三大报、公司网站	2014年5月27日
4	工银瑞信基金管理有限公司关于变更基金经理的公告	三大报、公司网站	2014年6月14日
5	关于账户查询及直销交易系统整合升级的通知	三大报、公司网站	2014年6月30日

注：三大报包括中国证券报、上海证券报、证券时报。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准工银瑞信信息产业股票型证券投资基金募集的文件
- 2、《工银瑞信信息产业股票型证券投资基金基金合同》
- 3、《工银瑞信信息产业股票型证券投资基金托管协议》
- 4、《工银瑞信信息产业股票型证券投资基金招募说明书》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照
- 7、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告

12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可于营业时间查阅，或登录基金管理人网站查阅。

投资者可在营业时间免费查阅。也可在支付工本费后，在合理时间内取得上述文件的复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人——工银瑞信基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-811-9999

网址：www.icbccs.com.cn