

工银瑞信深证成份指数证券投资基金
(LOF)
2017 年年度报告

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：中信建投证券股份有限公司

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。

基金托管人中信建投证券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。

本报告期自 2017 年 9 月 15 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	9
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
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.....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	17
§5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	18
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.....	18
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	18
§6 审计报告	19
6.1 审计报告基本信息.....	19
6.2 审计报告的基本内容.....	19
§7 年度财务报表	22
7.1 资产负债表.....	22
7.2 利润表.....	23
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	24
7.4 报表附注.....	25
§8 投资组合报告	50
8.1 期末基金资产组合情况.....	50
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	50
8.3 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.....	52
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	65
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	66
8.6 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.....	66
8.7 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.....	66

8.8	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	67
8.9	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	67
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	67
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	67
8.12	投资组合报告附注	67
§9	基金份额持有人信息	69
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	69
9.2	期末上市基金前十名持有人	69
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	69
9.4	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	69
§10	开放式基金份额变动	71
§11	重大事件揭示	72
11.1	基金份额持有人大会决议	72
11.2	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	72
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	72
11.4	基金投资策略的改变	72
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	72
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	72
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	73
11.8	其他重大事件	74
§12	影响投资者决策的其他重要信息	75
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	75
12.2	影响投资者决策的其他重要信息	75
§13	备查文件目录	76
13.1	备查文件目录	76
13.2	存放地点	76
13.3	查阅方式	76

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	工银瑞信深证成份指数证券投资基金（LOF）
基金简称	深成 LOF
基金主代码	164823
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 9 月 15 日
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人	中信建投证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	61,611,122.14 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2017 年 10 月 13 日

2.2 基金产品说明

投资目标	采用指数化投资，通过控制基金投资组合相对于标的指数的偏离度，实现对标的指数的有效跟踪。
投资策略	本基金采取完全复制策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但因特殊情况（如市场流动性不足、成份股被限制投资等）导致基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。
业绩比较基准	深证成份指数收益率 * 95% + 金融机构人民币活期存款基准利率（税后）* 5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

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	中信建投证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	朱碧艳	朱志明
	联系电话	400-811-9999	4008-888-108
	电子邮箱	customerservice@icbccs.com.cn	service@csc.com.cn

客户服务电话	400-811-9999	95587
传真	010-66583158	010-85130975
注册地址	北京市西城区金融大街 5 号、甲 5 号 6 层甲 5 号 601、甲 5 号 7 层甲 5 号 701、甲 5 号 8 层甲 5 号 801、甲 5 号 9 层甲 5 号 901	北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼
办公地址	北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 A 座 6-9 层	北京市东城区朝内大街 2 号凯恒中心 B 座 10 层
邮政编码	100033	100010
法定代表人	郭特华	王常青

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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.icbccs.com.cn
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2017 年 9 月 15 日(基金合同生效日)-2017 年 12 月 31 日
本期已实现收益	600,721.09
本期利润	-1,159,676.06
加权平均基金份额本期利润	-0.0079
本期加权平均净值利润率	-0.80%
本期基金份额净值增长率	-3.51%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末
期末可供分配利润	-2,164,052.56
期末可供分配基金份额利润	-0.0351
期末基金资产净值	59,447,069.58
期末基金份额净值	0.9649
3.1.3 累计期末指标	2017 年末
基金份额累计净值增长率	-3.51%

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

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

3、所列数据截止到报告期最后一日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

4、本基金基金合同生效日为 2017 年 9 月 15 日。截至报告期末，本基金基金合同生效不满一年。

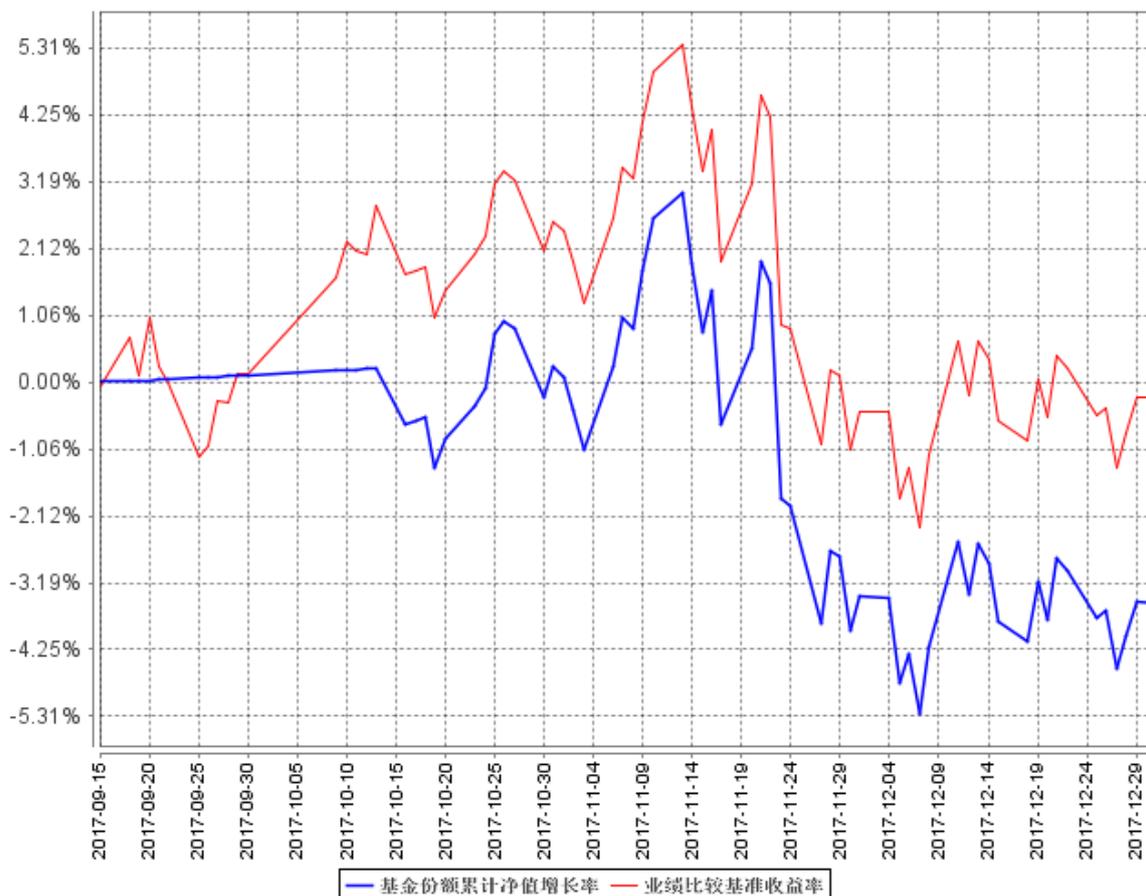
3.2 基金净值表现

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
过去三个月	-3.62%	0.93%	-0.38%	0.94%	-3.24%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-3.51%	0.85%	-0.24%	0.90%	-3.27%	-0.05%

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

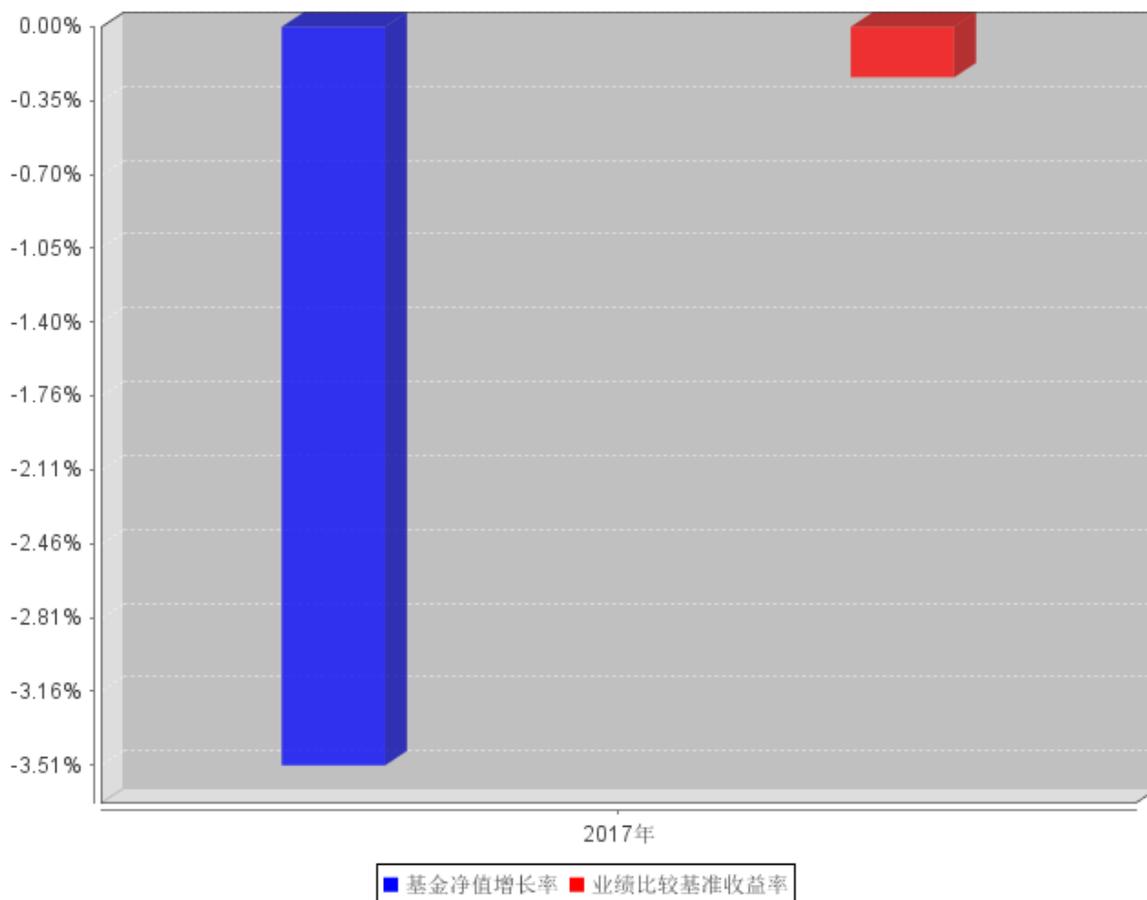


注：1、本基金基金合同于 2017 年 9 月 15 日生效。截至报告期末，本基金尚处于建仓期。

2、按基金合同规定，本基金建仓期为 6 个月。建仓期满，本基金的各项投资比例应符合基金合同关于投资范围及投资限制的规定：本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的 90%，其中投资于深证成份指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 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%。股指期货、权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：1、本基金基金合同生效日为 2017 年 09 月 14 日。

2、合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

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，是我国第一家由银行直接发起设立并控股的合资基金管理公司。公司目前在北京、上海、深圳设有分公司，在香港和上海设有全资子公司——工银瑞信资产管理（国际）有限公司、工银瑞信投资管理有限公司。

公司（含子公司）拥有公募基金、特定资产管理、企业年金基金投资管理、全国社会保障基金境内外投资管理、基本养老保险基金证券投资管理、保险资产管理、企业年金养老金产品投资管理、QDII、QFII、RQFII 等多项业务资格。

截至 2017 年 12 月 31 日，公司旗下管理工银瑞信核心价值混合型证券投资基金、工银瑞信货币市场基金、工银瑞信中国机会全球配置股票型证券投资基金、工银瑞信沪深 300 指数证券投资基金、工银瑞信添颐债券型证券投资基金、工银瑞信消费服务行业混合型证券投资基金、工银瑞信 60 天理财债券型证券投资基金、工银瑞信金融地产行业混合型证券投资基金、工银瑞信医疗保健行业股票型证券投资基金、工银瑞信沪港深股票型证券投资基金、深证红利交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信香港中小盘股票型证券投资基金（QDII）等 113 只公募基金。

公司始终坚持“以稳健的投资管理，为客户提供卓越的理财服务”为使命，依托强大的股东背景、稳健的经营理念、科学的投研体系、严密的风控机制和资深的管理团队，立足市场化、专业化、规范化和国际化，坚持“稳健投资、价值投资、长期投资”，致力于为广大投资者提供一流的投资管理服务。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘伟琳	本基金的基金经理	2017 年 9 月 15 日	-	7	中国人民大学金融工程博士；2010 年加入工银瑞信，历任金融工程分析师、投资经理助理、投资经理，现任指数投资中心研究负责人、基金经理。2014 年 10 月 17 日至今，担任工银深证 100 指数分级基金基

					金经理；2014 年 10 月 17 日至今，担任工银沪深 300 指数基金基金经理；2014 年 10 月 17 日至今，担任工银中证 500 指数分级基金基金经理；2015 年 5 月 21 日至今，担任工银瑞信中证传媒指数分级基金基金经理；2015 年 7 月 23 日至今，担任工银中证高铁产业指数分级基金基金经理；2017 年 9 月 15 日至今，担任工银瑞信深证成份指数证券投资基金（LOF）基金经理。
--	--	--	--	--	--

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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，公平对待基金持有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，不得直接或通过与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、特定客户资产管理组合等其他受托资产。基金经理，指管理公募基金基金经理，如封闭式基金、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限制等，参考公司《股票池管理办法》，建立股票池，各基金基金经理、其他受托资产投资经理在此基础上根据投资授权构建具体的投资组合。

3.1.2 各基金基金经理、其他受托资产投资经理投资决策参照《投资授权管理办法》执行，在授权的范围內，独立、自主、审慎决策。

3.1.3 基金经理不得兼任投资经理，且各投资组合的基金经理、投资经理投资系统权限要严格分离。

3.1.4 对于涉及到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 交易人员、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组合配备专门的交易员，未经授权，其他交易员不得参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、比例实施，保证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、准确地执行。

3.2.3.2 在投资交易系统中设置“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模块完成。

公平交易模块执行原理如下：

1) 同向交易指令：

a) 限价指令：交易员采用投资交易系统中的公平委托系统，按照各组合委托数量设置委托比例，按比例具体执行；b) 市价指令：对于市价同向交易指令，交易员首先应该按照“时间优先”的原则执行交易指令，并在接到后到达指令后按照先到指令剩余数量和新到指令数量采用公平委托系统执行；对于同时同向交易指令，交易员应采用投资交易系统中的公平委托模块，按照各基金委托数量设置委托比例，按比例具体执行；c) 部分限价指令与部分市价指令：对于不同基金经理下达的不同类型的同向交易指令，交易员应该按照“价格优先”的原则执行交易指令，在市场

价格未达到限价时，先执行市价指令、后执行限价指令；

2) 反向交易指令

a) 交易员不得接受可能导致同一投资组合或不同投资组合之间对敲的同一证券品种的指令，并由风险中台在投资系统中设置严禁所有产品在证券交易时对敲。b) 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》中相关条款，公司规定同一公募基金、年金、专户、社保组合或前述组合之间不允许同日针对同一证券的反向投资指令；c) 同一公募基金不允许两日内针对同一证券的反向投资指令。d) 确因投资组合要求的投资策略或流动性等需求而发生的同日反向交易，按要求投资组合经理要填写反向交易申请表，并要求相关投资经理提供决策依据，并保留记录备查。e) 以上反向交易要求完全按照指数的构成进行投资的组合等除外。

3.2.4 对于银行间市场交易、交易所大宗交易、债券一级市场申购等非集中竞价交易，涉及到两个或以上基金或投资组合参与同一证券交易的情况，各基金/投资经理在交易前独立确定各投资组合的交易价格和数量，中央交易室按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。参照《集中交易管理办法》，银行间市场债券买卖和回购交易，由交易员填写《银行间市场交易审批单》，经相关基金经理/投资经理、交易主管审批，并由交易员双人复核后方可执行。公司对非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购的申购方案和分配过程进行审核和监控，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。

3.2.5 对于非公开发行股票申购，各基金/投资经理在申购前参照《投资流通受限证券工作流程》，独立确定申购价格和数量，中央交易室按照价格优先、比例分配的原则进行分配。

3.2.6 对于由于特殊原因不能参与公平交易程序的交易指令，中央交易室填写《公平交易审批单》，经公司内部审批后执行。

3.2.7 公平交易争议处理

在公平交易执行过程中若发生争议，或出现基金/投资经理对交易员执行公平交易结果不满情况，交易主管将具体情况报告公司主管领导，公司主管领导与相关基金/投资经理、交易主管就争议内容进行协调处理。

3.3 公平交易的检查和价格监控

3.3.1 内控稽核部可通过投资交易系统对于公平交易的执行情况进行稽核，并定期向督察长报告。如发现有疑问的交易情况，就交易时间、交易价格、交易数量、交易理由等提出疑问，由基金/投资经理作出合理解释。

3.3.2 风险管理部根据市场公认的第三方信息，对于投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，如发现异常情况的，基金/投资经理应对交易价格的异常情况进行合理解释。

3.3.3 内控稽核部应对不同投资组合在交易所公开竞价交易中同日同向交易的交易时机和交易价差进行监控，同时对不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析，如发现异常应向基金/投资经理提出，相关基金/投资经理应对异常交易情况进行合理解释。风险管理部和内控稽核部应对其他可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，对于异常交易发生前后不同投资组合买卖该异常交易证券的情况进行分析。相关基金/投资经理应对异常交易情况进行合理解释。

3.4 评估和分析

3.4.1 风险管理部应分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3日内、5日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，由投资组合经理、督察长、总经理签署后，妥善保存分析报告备查。如果在上述分析期间内，公司管理的所有投资组合同向交易价差出现异常情况，应重新核查公司投资决策和交易执行环节的内部控制，针对潜在问题完善公平交易制度，进行专项说明，提交内控稽核部，内控稽核部应将此说明载入监察稽核季度报告和年度报告中对此做专项说明。

3.4.2 中央交易室负责在各投资组合的定期报告中披露公司整体公平交易制度执行情况。风险管理部负责在各投资组合的定期报告中对异常交易行为进行专项说明，其中，如果报告期内所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%，应说明该类交易的次数及原因。各投资组合的年度报告中，除上述内容外，还应披露公平交易制度和控制方法，并在公司整体公平交易制度执行情况中，对当年度同向交易价差做专项分析。

4. 报告

公司相关部门如果发现涉嫌违背公平交易原则的行为，应及时向公司管理层汇报并采取相关控制和改进措施。

4.3.2 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，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；未出现清算不到位的情况，且本基金及本基金与本基金管理人管理的其他投资组合之间未发生法律法规禁止的反向交易及交叉交易。

公司于每季度和年度对公司管理的不同投资组合进行了同向交易价差分析，采用了日内、3日内、5日内的时间窗口，假设不同组合间价差为零，进行了T分布检验。对于没有通过检验的交易，公司根据交易价格、交易频率、交易数量、交易时间进行了具体分析。经分析，本报告期未出现公司管理的不同投资组合间有同向交易价差异常的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况有3次。投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易，未导致不公平交易和利益输送。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内，本基金跟踪误差产生的主要来源是：1) 建仓期仓位变动；2) 申购赎回的影响；3) 成份股票的停牌；4) 指数中成份股票的调整等。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金净值增长率为-3.51%，业绩比较基准收益率为-0.24%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金为指数型基金，基金管理人将继续按照基金合同的要求，坚持指数化投资策略，通过运用定量分析等技术，分析和应对导致基金跟踪误差的因素，继续努力将基金的跟踪误差控制在较低水平。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人持续加强法律合规风险管理和监察稽核工作，使得法律合规风险被

及时识别并得到控制，保障公司各项业务的合法合规。

合规管理方面，一是积极跟踪法律法规的变化和监管动态，及时向业务部门解读、传达最新法规和监管要求及其对公司业务的影响，落实各项要求的责任部门，使得公司从业人员知法、守法；二是严格事前的监督审查和控制机制，保障业务开展的合法合规性。事前合法合规审核全面覆盖公司的新产品设计、基金募集和持续营销、宣传推介、基金等各受托资产的投资交易管理、基金信息披露等业务，并利用系统对相关投资组合的投资合规风险实现事前控制。三是严格的事中指标监控机制，保证投资过程的合规性：公司设置专人专岗监控投资指标，利用系统和人工结合的方式，实现重点监控环节的刚性控制，系统无法实现控制的环节进行人工审核与复核。四是及时的事后风险管理机制，保证潜在合规风险得到及时解决：通过系统事后监测并提示各投资组合的被动超标情况，跟踪其限期回归到合规范围之内；五是继续开展合规培训，不断增强公司员工合规意识，促进公司合规文化的建设。公司通过对新员工的合规培训、对全体人员的年度合规培训、对投研人员、销售人员等的专项培训等多种形式，结合新出台的法律法规和行业风险事件，加深员工对法律法规和风险的理解，从而使得相关法规、政策、制度在公司内部更有效的得到落实。

监察稽核方面，一是定期对本基金投研交易、销售和后台运营等各项业务开展情况、内部规章制度执行情况、合规控制和风险控制情况进行系统全面的检查和评价，跟进后续改进情况，向监管机构报送监察稽核季报。同时，按照年度监察稽核计划开展有针对性的专项稽核工作。二是持续完善制度流程和监控模型，采用有效手段，日常监控投资管理人员的个人行为，利用公平交易、异常交易监控模型分析投资人员的投资行为，防范出现违反“三条底线”的情形。三是关注内部控制的健全性和有效性，全面梳理各项业务的工作流程，对其中的各项风险进行识别、评估，并对现有的控制手段提出改进性建议。同时，结合出台的法律法规和行业的新要求，督促公司及时制定、更新规章制度和完善业务流程。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.7.1 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

4.7.1.1 职责分工

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、风险管理部负责人和法律合规部负责人，组长由运作部负责人担任。

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。

4.7.1.2 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。

4.7.2 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。

4.7.3 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。

4.7.4 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。

4.7.1 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未实施利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金在报告期内没有触及 2014 年 8 月 8 日生效的《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条规定的条件。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在本报告期内，本基金托管人在托管基金过程中，严格遵守了基金合同和其他有关法律法规的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务

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

在本报告期内，托管人按照相关法律法规、基金合同和其他有关规定，对本基金的资产净值计算、基金费用等方面进行了认真的复核，对本产品的投资运作进行了监督，未发现产品管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核了本年度报告中的财务指标、净值表现的相关内容，所复核内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2018)第 22197 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	工银瑞信深证成份指数证券投资基金(LOF)全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了工银瑞信深证成份指数证券投资基金(LOF)（以下简称“深成 LOF 基金”）的财务报表，包括 2017 年 12 月 31 日的资产负债表，2017 年 9 月 15 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了深成 LOF 基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年 9 月 15 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于深成 LOF 基金，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	-

其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>深成 LOF 基金的基金管理人工银瑞信基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估深成 LOF 基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算深成 LOF 基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督深成 LOF 基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。</p>

	<p>同时，根据获取的审计证据，就可能对深成 LOF 基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致深成 LOF 基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	单峰 朱宏宇
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2018 年 3 月 23 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：工银瑞信深证成份指数证券投资基金（LOF）

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	7.4.7.1	3,512,291.10
结算备付金		2,723.49
存出保证金		305,342.07
交易性金融资产	7.4.7.2	56,297,737.74
其中：股票投资		56,297,737.74
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	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		6,132.69
应收利息	7.4.7.5	979.01
应收股利		-
应收申购款		49,701.79
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		60,174,907.89
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		266,287.96
应付管理人报酬		51,516.96
应付托管费		7,727.56
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	212,302.25
应交税费		-

应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	190,003.58
负债合计		727,838.31
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	61,611,122.14
未分配利润	7.4.7.10	-2,164,052.56
所有者权益合计		59,447,069.58
负债和所有者权益总计		60,174,907.89

注：1、本期财务报表的实际编制期间系 2017 年 9 月 15 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日止。

2、报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值为人民币 0.9649 元，基金份额总额为 61,611,122.14 份。

7.2 利润表

会计主体：工银瑞信深证成份指数证券投资基金（LOF）

本报告期：2017 年 9 月 15 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2017 年 9 月 15 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日
一、收入		-47,358.69
1.利息收入		1,081,169.85
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,081,169.85
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		333,869.87
其中：股票投资收益	7.4.7.12	312,969.07
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-
股利收益	7.4.7.16	20,900.80
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-1,760,397.15
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	297,998.74

减：二、费用		1,112,317.37
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	448,977.16
2. 托管费	7.4.10.2.2	67,346.57
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-
4. 交易费用	7.4.7.19	359,146.08
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	7.4.7.20	236,847.56
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,159,676.06
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,159,676.06

注：本期财务报表的实际编制期间系 2017 年 9 月 15 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日止。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：工银瑞信深证成份指数证券投资基金（LOF）

本报告期：2017 年 9 月 15 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 9 月 15 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	297,644,248.43	-	297,644,248.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,159,676.06	-1,159,676.06
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-236,033,126.29	-1,004,376.50	-237,037,502.79
其中：1. 基金申购款	1,371,672.47	-11,963.84	1,359,708.63
2. 基金赎回款	-237,404,798.76	-992,412.66	-238,397,211.42
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	61,611,122.14	-2,164,052.56	59,447,069.58

注：本期财务报表的实际编制期间系 2017 年 9 月 15 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日止。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>郭特华</u>	<u>赵紫英</u>	<u>朱辉毅</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

工银瑞信深证成份指数证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]第 1566 号《关于准予工银瑞信深证成份指数证券投资基金(LOF)注册的批复》及机构部函[2017]第 482 号《关于工银瑞信深证成份指数证券投资基金(LOF)延期募集备案的回函》核准,由工银瑞信基金管理有限公司工银瑞信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《工银瑞信深证成份指数证券投资基金(LOF)基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 297,575,745.19 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2017)第 158 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《工银瑞信深证成份指数证券投资基金(LOF)基金合同》于 2017 年 9 月 15 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 297,644,248.43 份基金份额,其中认购资金利息折合 68,503.24 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,基金托管人为中信建投证券股份有限公司(以下简称“中信建投证券”)。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2017]第 636 号核准,本基金 158,274,003.00 份额于 2017 年 10 月 13 日在深交所挂牌交易。未上市交易的份额在中国证券登记结算有限责任公司开放式基金注册登记系统基金份额持有人开放式基金账户下,基金份额持有人将其转托管至深圳证券交易所场内(即中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记结算系统)后即可上市流通

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《工银瑞信深证成份指数证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括深证成份指数的成份股及其备选成份股(包括但不限于中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、短期融资券(含超短期融资券)等债券)、资产支持证券、债券回购、股指期货、权证、银行存款以及经中国证监会允许基金投资的其它金融工具。法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的 90%,

其中投资于深证成份指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 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%。股指期货、权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。本基金的业绩比较基准为深证成份指数收益率×95%+金融机构人民币活期存款基准利率（税后）×5%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《工银瑞信深证成份指数证券投资基金（LOF）基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的相关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 年 9 月 15 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日止期间的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 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及和 2017 年 9 月 15 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 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。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2017 年 9 月 15 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。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。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金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；或者(3) 该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现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损益占基金净值比例计算的金额。未实现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损益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认列，并于期末全额转入未分配利润/（累计亏损）。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 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。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资，其中场外基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资，场内基金份额持有人只能选择现金分红。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 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。

7.4.4.13 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股票投资和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股票，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[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 于2017年12月20日前，对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会字[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》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。自2017年12月20日起，对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按

照中央国债登记结算有限责任公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》，对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，本基金自2017年12月20日起改为按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于2016年5月1日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对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，股票的股息、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)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日
活期存款	3,512,291.10
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	3,512,291.10

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	58,058,134.89	56,297,737.74	-1,760,397.15
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	58,058,134.89	56,297,737.74	-1,760,397.15

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产**7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	826.55
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	1.32
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	151.14
合计	979.01

7.4.7.6 其他资产

无。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	212,302.25
银行间市场应付交易费用	-
合计	212,302.25

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,003.58
预提审计费	49,000.00
预提信息披露费	90,000.00
指数使用费	50,000.00
合计	190,003.58

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017 年 9 月 15 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	297,644,248.43	297,644,248.43
本期申购	1,371,672.47	1,371,672.47
本期赎回(以“-”号填列)	-237,404,798.76	-237,404,798.76
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	61,611,122.14	61,611,122.14

注：1. 若本基金有分红及转换业务，申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

2. 本基金自 2017 年 8 月 14 日至 2017 年 9 月 8 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金 297,575,745.19 元。根据《工银瑞信深证成份指数证券投资基金(LOF)基金合同》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入 68,503.24 元在本基金成立后，折算为 68,503.24 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

3. 根据《工银瑞信深证成份指数证券投资基金(LOF)基金合同》和《工银瑞信深证成份指数证券投资基金(LOF)开放日常申购、赎回、定期定额投资业务的公告》的相关规定，本基金于 2016 年 9 月 15 日(基金合同生效日)至 2017 年 10 月 12 日止期间暂不向投资人开放基金交易。申购业务、赎回业务自 2017 年 10 月 13 日起开始办理。

7.4.7.10 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	600,721.09	-1,760,397.15	-1,159,676.06

本期基金份额交易产生的变动数	-623,570.26	-380,806.24	-1,004,376.50
其中：基金申购款	4,848.02	-16,811.86	-11,963.84
基金赎回款	-628,418.28	-363,994.38	-992,412.66
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-22,849.17	-2,141,203.39	-2,164,052.56

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年9月15日(基金合同生效日)至2017年12月31日
活期存款利息收入	52,060.73
定期存款利息收入	1,024,555.56
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	3,813.31
其他	740.25
合计	1,081,169.85

7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年9月15日(基金合同生效日)至2017年12月31日
卖出股票成交总额	120,366,983.52
减：卖出股票成本总额	120,054,014.45
买卖股票差价收入	312,969.07

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

无。

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

无。

7.4.7.14 贵金属投资收益

无。

7.4.7.15 衍生工具收益**7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

无。

7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

无。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年9月15日(基金合同生效日)至2017年12月31日
股票投资产生的股利收益	20,900.80
基金投资产生的股利收益	-
合计	20,900.80

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年9月15日(基金合同生效日)至2017年12月31日
1. 交易性金融资产	-1,760,397.15
——股票投资	-1,760,397.15
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-

合计	-1,760,397.15
----	---------------

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017年9月15日(基金合同生效日)至2017年12月31日
基金赎回费收入	297,998.74
合计	297,998.74

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017年9月15日(基金合同生效日)至2017年12月31日
交易所市场交易费用	359,146.08
银行间市场交易费用	-
合计	359,146.08

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017年9月15日(基金合同生效日)至2017年12月31日
审计费用	49,000.00
信息披露费	90,000.00
其他	400.00
上市费	45,000.00
指数使用费	52,447.56
合计	236,847.56

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的重大资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

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
中信建投证券股份有限公司	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
瑞士信贷银行股份有限公司	基金管理人股东
工银瑞信资产管理（国际）有限公司	基金管理人的子公司
工银瑞信投资管理有限公司	基金管理人的子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年9月15日(基金合同生效日)至2017年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
中信建投证券股份有限公司	298,470,008.36	100.00%

7.4.10.1.2 债券交易

无。

7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

7.4.10.1.4 权证交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年9月15日(基金合同生效日)至2017年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
中信建投证 券股份有限 公司	212,302.25	100.00%	212,302.25	100.00%

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年9月15日(基金合同生效日)至2017年12月 31日
当期发生的基金应支付的管理费	448,977.16
其中：支付销售机构的客户维护费	60,809.74

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.0%年费率计提。

管理费的计算方法如下： $H=E \times 1.0\% \div \text{当年天数}$

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年9月15日(基金合同生效日)至2017年12月 31日
当期发生的基金应支付的托管费	67,346.57

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.15%的年费率计提。

托管费的计算方法如下： $H=E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$

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。

7.4.10.2.3 销售服务费

无。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

无。

7.4.10.4.2 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

无。

7.4.10.5 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 2017年9月15日(基金合同生效日)至2017年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中信建投证券股份有限公司	3,512,291.10	52,060.73

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期未进行利润分配。

7.4.12 期末（2017年12月31日）本基金持有的流通受限证券**7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002466	天齐锂业	2017年12月26日	2018年1月3日	配股流通受限	11.06	53.21	825	9,124.50	43,898.25	-

7.4.12.2 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
002470	金正大	2017年10月25日	重大事项	9.15	2018年2月9日	8.24	35,800	309,046.21	327,570.00	-
000930	中粮生化	2017年10月24日	重大事项	13.34	-	-	21,600	288,705.78	288,144.00	-
300383	光环新网	2017年11月7日	重大事项	13.19	2018年3月19日	14.51	15,400	233,044.23	203,126.00	-
000547	航天发展	2017年10月30日	重大事项	10.83	-	-	18,500	219,564.17	200,355.00	-
002366	台海核电	2017年12月6日	重大事项	26.45	-	-	4,500	126,053.94	119,025.00	-
000566	海南海药	2017年11月22日	重大事项	12.89	-	-	8,200	107,812.34	105,698.00	-
300159	新研股份	2017年11月23日	重大事项	10.40	2018年3月22日	9.36	8,700	105,529.91	90,480.00	-
000939	凯迪生态	2017年11月16日	重大事项	4.99	-	-	17,312	97,727.01	86,386.88	-
002004	华邦健康	2017年12月14日	重大事项	6.73	2018年3月14日	7.30	11,300	87,990.21	76,049.00	-
000926	福星股份	2017年12月26日	重大事项	10.89	2018年1月10日	11.98	6,800	83,776.00	74,052.00	-

300090	盛运环保	2017年12月1日	重大事项	9.24	-	-	7,500	80,612.28	69,300.00	-
002512	达华智能	2017年12月6日	重大事项	18.07	2018年3月6日	16.26	3,600	70,676.68	65,052.00	-
300134	大富科技	2017年12月18日	重大事项	16.45	2018年3月19日	14.81	3,500	60,217.82	57,575.00	-
000766	通化金马	2017年11月24日	重大事项	13.60	-	-	3,900	57,740.96	53,040.00	-
000156	华数传媒	2017年12月26日	重大事项	11.40	-	-	4,200	61,916.90	47,880.00	-
002130	沃尔核材	2017年12月25日	重大事项	5.76	2018年1月10日	6.15	8,200	55,130.47	47,232.00	-
300010	立思辰	2017年11月17日	重大事项	10.07	2018年2月22日	10.05	4,500	56,631.74	45,315.00	指数法估值
300116	坚瑞沃能	2017年12月18日	重大事项	7.62	-	-	5,000	54,724.20	38,100.00	-
002358	森源电气	2017年12月7日	重大事项	14.86	2018年3月7日	15.05	2,500	39,505.94	37,150.00	-
300216	千山药机	2017年12月25日	重大事项	15.95	2018年1月18日	14.36	2,200	52,926.34	35,090.00	-
002625	光启技术	2017年12月20日	重大事项	28.07	2018年1月4日	30.88	1,200	32,778.00	33,684.00	-
000615	京汉股份	2017年12月26日	重大事项	9.76	2018年1月10日	10.74	3,300	31,430.56	32,208.00	-
300292	吴通控股	2017年12月4日	重大事项	5.67	2018年3月5日	5.72	5,400	34,248.67	30,618.00	-

300364	中文 在线	2017 年 12 月 28 日	重大 事项	9.23	2018 年 1 月 5 日	10.00	3,200	44,162.29	29,536.00	-
000564	供销 大集	2017 年 11 月 28 日	重大 事项	4.78	-	-	4,400	25,821.23	21,032.00	-

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 2017 年 12 月 31 日对资产净值和本期净利润的影响均为人民币-4,950.00 元。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 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。

7.4.12.3.2 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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和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。

7.4.13.2 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。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末未持有按短期信用评级的债券投资。

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末未持有按长期信用评级的债券投资。

7.4.13.3 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，本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不超过基金资产净值的40%。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。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 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	3,512,291.10	-	-	-	-	-	3,512,291.10
结算备付金	2,723.49	-	-	-	-	-	2,723.49
存出保证金	305,342.07	-	-	-	-	-	305,342.07
交易性金融资产	-	-	-	-	-	56,297,737.74	56,297,737.74
应收证券清算款	-	-	-	-	-	6,132.69	6,132.69
应收利息	-	-	-	-	-	979.01	979.01
应收申购款	-	-	-	-	-	49,701.79	49,701.79
资产总计	3,820,356.66	-	-	-	-	56,354,551.23	60,174,907.89
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	266,287.96	266,287.96
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	51,516.96	51,516.96
应付托管费	-	-	-	-	-	7,727.56	7,727.56
应付交易费用	-	-	-	-	-	212,302.25	212,302.25
其他负债	-	-	-	-	-	190,003.58	190,003.58
负债总计	-	-	-	-	-	727,838.31	727,838.31
利率敏感度缺口	3,820,356.66	-	-	-	-	-55,626,712.92	59,447,069.58

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末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。

7.4.13.4.2 外汇风险

无。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	56,297,737.74	94.70
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	56,297,737.74	94.70

注：具有良好流动性的金融工具，包括深证成份指数的成份股及其备选成份股（包括但不限于中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、短期融资券（含超短期融资券）等债券）、资产支持证券、债券回购、股指期货、权证、银行存款以及经中国证监会允许基金投资的其它金融工具，但需符合中国证监会的规定。

本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的 90%，其中投资于深证成份指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 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%。股指期货、权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；	
	用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；	
	Beta 系数是根据组合的净值数据和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。	
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（2017 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准增加 5%	2,621,313.73
	业绩比较基准减少 5%	-2,621,313.73

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2017 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 54,084,039.86 元，属于第二层次的余额为 2,213,697.88 元，无属于第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2017 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

此外，财政部、国家税务总局于 2017 年 12 月 25 日颁布的财税[2017]90 号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自 2018 年 1 月 1 日起运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售额确定做出规定。

上述税收政策对本基金截至 2017 年 12 月 31 日止的财务状况和经营成果无影响。

(3) 除公允价值和增值税外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	56,297,737.74	93.56
	其中：股票	56,297,737.74	93.56
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	3,515,014.59	5.84
7	其他各项资产	362,155.56	0.60
8	合计	60,174,907.89	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。

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,298,355.00	2.18
B	采矿业	589,591.00	0.99
C	制造业	35,662,042.96	59.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	811,222.88	1.36
E	建筑业	1,193,968.00	2.01
F	批发和零售业	1,312,100.00	2.21
G	交通运输、仓储和邮政业	369,613.00	0.62
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,280,567.98	8.88
J	金融业	3,681,424.00	6.19
K	房地产业	2,678,719.92	4.51

L	租赁和商务服务业	785,773.00	1.32
M	科学研究和技术服务业	50,326.00	0.08
N	水利、环境和公共设施管理业	989,080.00	1.66
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	515,622.00	0.87
R	文化、体育和娱乐业	792,353.00	1.33
S	综合	150,663.00	0.25
	合计	56,161,421.74	94.47

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。

8.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	136,316.00	0.23
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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	136,316.00	0.23

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。

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无

8.3 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

8.3.1 期末指数投资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	000333	美的集团	37,400	2,073,082.00	3.49
2	000651	格力电器	40,600	1,774,220.00	2.98
3	000858	五粮液	15,800	1,262,104.00	2.12
4	000725	京东方A	216,000	1,250,640.00	2.10
5	000002	万科A	34,600	1,074,676.00	1.81
6	002415	海康威视	27,300	1,064,700.00	1.79
7	000001	平安银行	71,900	956,270.00	1.61
8	300498	温氏股份	32,350	773,165.00	1.30
9	000063	中兴通讯	20,400	741,744.00	1.25
10	002304	洋河股份	4,800	552,000.00	0.93
11	002230	科大讯飞	8,700	514,518.00	0.87
12	002450	康得新	19,700	437,340.00	0.74
13	000776	广发证券	25,800	430,344.00	0.72
14	000568	泸州老窖	6,100	402,600.00	0.68
15	000538	云南白药	3,800	386,802.00	0.65
16	002024	苏宁云商	29,800	366,242.00	0.62
17	002008	大族激光	7,400	365,560.00	0.61
18	002142	宁波银行	19,600	349,076.00	0.59
19	002202	金风科技	18,400	346,840.00	0.58
20	000338	潍柴动力	40,800	340,272.00	0.57
21	002466	天齐锂业	6,325	336,553.25	0.57
22	300136	信维通信	6,600	334,620.00	0.56
23	002456	欧菲科技	16,200	333,558.00	0.56
24	300059	东方财富	25,400	328,930.00	0.55
25	002470	金正大	35,800	327,570.00	0.55
26	001979	招商蛇口	16,700	326,652.00	0.55
27	002594	比亚迪	4,900	318,745.00	0.54
28	002027	分众传媒	22,600	318,208.00	0.54

29	002236	大华股份	13,600	314,024.00	0.53
30	002460	赣锋锂业	4,300	308,525.00	0.52
31	000166	申万宏源	56,200	301,794.00	0.51
32	002241	歌尔股份	16,800	291,480.00	0.49
33	000930	中粮生化	21,600	288,144.00	0.48
34	000100	TCL 集团	70,000	273,000.00	0.46
35	002475	立讯精密	11,500	269,560.00	0.45
36	300072	三聚环保	7,600	266,988.00	0.45
37	000423	东阿阿胶	4,400	265,188.00	0.45
38	000503	海虹控股	6,100	263,276.00	0.44
39	300124	汇川技术	9,000	261,180.00	0.44
40	000069	华侨城 A	27,600	234,324.00	0.39
41	000625	长安汽车	18,300	230,580.00	0.39
42	300070	碧水源	13,000	225,810.00	0.38
43	000413	东旭光电	24,000	225,120.00	0.38
44	000839	中信国安	23,100	221,529.00	0.37
45	000783	长江证券	28,000	220,360.00	0.37
46	000895	双汇发展	8,300	219,950.00	0.37
47	000661	长春高新	1,200	219,600.00	0.37
48	002044	美年健康	10,000	218,700.00	0.37
49	002252	上海莱士	10,700	212,395.00	0.36
50	000963	华东医药	3,800	204,744.00	0.34
51	300383	光环新网	15,400	203,126.00	0.34
52	002673	西部证券	16,400	202,048.00	0.34
53	000547	航天发展	18,500	200,355.00	0.34
54	300024	机器人	10,600	199,492.00	0.34
55	002508	老板电器	4,100	197,210.00	0.33
56	002310	东方园林	9,600	193,632.00	0.33
57	002405	四维图新	7,300	192,647.00	0.32
58	000768	中航飞机	11,300	190,857.00	0.32
59	300003	乐普医疗	7,800	188,448.00	0.32
60	300408	三环集团	9,300	187,488.00	0.32
61	002085	万丰奥威	10,280	184,012.00	0.31
62	002081	金螳螂	11,900	182,308.00	0.31
63	000157	中联重科	40,300	180,141.00	0.30
64	002271	东方雨虹	4,500	179,820.00	0.30
65	002340	格林美	24,700	177,593.00	0.30
66	002797	第一创业	18,100	177,380.00	0.30
67	002129	中环股份	15,400	176,946.00	0.30

68	000728	国元证券	16,000	176,000.00	0.30
69	000425	徐工机械	37,900	175,477.00	0.30
70	000998	隆平高科	6,600	169,752.00	0.29
71	002736	国信证券	15,600	169,260.00	0.28
72	000623	吉林敖东	7,500	168,750.00	0.28
73	002572	索菲亚	4,500	165,600.00	0.28
74	000786	北新建材	7,300	164,250.00	0.28
75	000792	盐湖股份	11,800	164,138.00	0.28
76	002001	新和成	4,300	163,658.00	0.28
77	000039	中集集团	7,100	162,235.00	0.27
78	000793	华闻传媒	16,000	160,160.00	0.27
79	000630	铜陵有色	54,600	159,432.00	0.27
80	002049	紫光国芯	3,300	158,367.00	0.27
81	002714	牧原股份	2,900	153,294.00	0.26
82	002422	科伦药业	6,100	151,890.00	0.26
83	000050	深天马A	7,700	151,767.00	0.26
84	000060	中金岭南	13,500	150,795.00	0.25
85	300142	沃森生物	8,200	149,650.00	0.25
86	000826	启迪桑德	4,500	148,590.00	0.25
87	000709	河钢股份	38,000	148,200.00	0.25
88	002146	荣盛发展	15,300	145,809.00	0.25
89	300015	爱尔眼科	4,600	141,680.00	0.24
90	300017	网宿科技	13,300	141,512.00	0.24
91	000977	浪潮信息	7,100	141,148.00	0.24
92	002294	信立泰	3,100	140,089.00	0.24
93	000983	西山煤电	13,600	137,904.00	0.23
94	002179	中航光电	3,500	137,830.00	0.23
95	300266	兴源环境	5,100	137,700.00	0.23
96	002311	海大集团	5,800	135,720.00	0.23
97	002074	国轩高科	6,000	133,560.00	0.22
98	000008	神州高铁	15,100	132,125.00	0.22
99	002050	三花智控	7,200	132,048.00	0.22
100	000876	新希望	17,700	131,865.00	0.22
101	002092	中泰化学	9,900	131,769.00	0.22
102	002465	海格通信	13,700	131,383.00	0.22
103	300088	长信科技	16,700	130,761.00	0.22
104	300296	利亚德	6,700	130,583.00	0.22
105	002500	山西证券	14,100	130,002.00	0.22
106	000418	小天鹅A	1,900	128,915.00	0.22

107	000488	晨鸣纸业	7,700	128,359.00	0.22
108	002573	清新环境	5,600	127,288.00	0.21
109	002007	华兰生物	4,700	126,336.00	0.21
110	300433	蓝思科技	4,200	125,370.00	0.21
111	002185	华天科技	14,500	123,540.00	0.21
112	002176	江特电机	10,800	122,256.00	0.21
113	300027	华谊兄弟	14,000	122,220.00	0.21
114	000559	万向钱潮	12,000	121,800.00	0.20
115	002558	巨人网络	3,300	121,440.00	0.20
116	002065	东华软件	14,800	121,360.00	0.20
117	000690	宝新能源	15,000	120,000.00	0.20
118	000750	国海证券	24,400	119,560.00	0.20
119	000066	中国长城	16,400	119,556.00	0.20
120	000009	中国宝安	16,500	119,295.00	0.20
121	002366	台海核电	4,500	119,025.00	0.20
122	000402	金融街	10,700	118,877.00	0.20
123	000581	威孚高科	4,900	117,600.00	0.20
124	300274	阳光电源	6,200	116,374.00	0.20
125	300355	蒙草生态	9,200	115,368.00	0.19
126	000671	阳光城	14,500	114,115.00	0.19
127	300122	智飞生物	4,016	112,729.12	0.19
128	002385	大北农	18,600	112,716.00	0.19
129	000887	中鼎股份	6,200	112,654.00	0.19
130	000046	泛海控股	14,982	111,765.72	0.19
131	002038	双鹭药业	3,600	111,492.00	0.19
132	000686	东北证券	12,700	111,379.00	0.19
133	002019	亿帆医药	5,000	111,250.00	0.19
134	000970	中科三环	7,700	110,726.00	0.19
135	000656	金科股份	22,300	110,385.00	0.19
136	002410	广联达	5,500	107,800.00	0.18
137	300055	万邦达	5,100	107,253.00	0.18
138	300144	宋城演艺	5,700	106,362.00	0.18
139	000513	丽珠集团	1,600	106,320.00	0.18
140	002273	水晶光电	4,500	106,155.00	0.18
141	002583	海能达	5,700	105,507.00	0.18
142	002439	启明星辰	4,500	105,075.00	0.18
143	000997	新大陆	5,800	103,994.00	0.17
144	000878	云南铜业	7,300	103,587.00	0.17
145	000933	神火股份	10,100	102,515.00	0.17

146	002384	东山精密	3,600	102,456.00	0.17
147	300315	掌趣科技	18,400	102,304.00	0.17
148	000961	中南建设	15,900	101,919.00	0.17
149	002217	合力泰	9,900	99,000.00	0.17
150	002244	滨江集团	12,400	98,580.00	0.17
151	000778	新兴铸管	18,800	98,136.00	0.17
152	002407	多氟多	4,800	98,016.00	0.16
153	002223	鱼跃医疗	5,000	98,000.00	0.16
154	000825	太钢不锈	19,700	97,712.00	0.16
155	300146	汤臣倍健	6,500	97,630.00	0.16
156	002195	二三四五	16,700	97,528.00	0.16
157	002078	太阳纸业	10,500	97,440.00	0.16
158	300182	捷成股份	11,300	97,293.00	0.16
159	300009	安科生物	3,700	95,941.00	0.16
160	002600	江粉磁材	11,400	95,418.00	0.16
161	300203	聚光科技	2,673	95,025.15	0.16
162	002493	荣盛石化	6,600	94,710.00	0.16
163	000988	华工科技	5,700	94,506.00	0.16
164	000938	紫光股份	1,300	93,639.00	0.16
165	002426	胜利精密	16,000	93,280.00	0.16
166	000807	云铝股份	9,100	93,093.00	0.16
167	000999	华润三九	3,400	92,480.00	0.16
168	300115	长盈精密	4,600	92,322.00	0.16
169	000732	泰禾集团	4,600	92,092.00	0.15
170	300347	泰格医药	2,600	91,468.00	0.15
171	300197	铁汉生态	7,500	91,125.00	0.15
172	000960	锡业股份	6,900	91,080.00	0.15
173	000917	电广传媒	10,000	90,600.00	0.15
174	300159	新研股份	8,700	90,480.00	0.15
175	002280	联络互动	11,800	90,388.00	0.15
176	002183	怡亚通	12,700	89,535.00	0.15
177	002408	齐翔腾达	7,000	88,760.00	0.15
178	000415	渤海金控	15,400	88,704.00	0.15
179	000598	兴蓉环境	16,300	88,509.00	0.15
180	002221	东华能源	7,100	86,691.00	0.15
181	300418	昆仑万维	4,200	86,394.00	0.15
182	000939	凯迪生态	17,312	86,386.88	0.15
183	000830	鲁西化工	5,400	85,968.00	0.14
184	300251	光线传媒	8,200	85,690.00	0.14

185	300166	东方国信	6,800	85,340.00	0.14
186	300033	同花顺	1,700	84,966.00	0.14
187	300168	万达信息	6,300	84,924.00	0.14
188	002013	中航机电	7,800	84,162.00	0.14
189	002373	千方科技	5,700	83,505.00	0.14
190	002048	宁波华翔	3,500	83,300.00	0.14
191	002285	世联行	7,400	82,510.00	0.14
192	002281	光迅科技	2,800	82,320.00	0.14
193	002517	恺英网络	3,700	82,177.00	0.14
194	002030	达安基因	4,400	81,752.00	0.14
195	000883	湖北能源	17,500	81,025.00	0.14
196	300014	亿纬锂能	4,100	80,401.00	0.14
197	300450	先导智能	1,400	79,758.00	0.13
198	000078	海王生物	13,300	78,470.00	0.13
199	002268	卫士通	3,400	78,268.00	0.13
200	000627	天茂集团	9,700	77,600.00	0.13
201	000800	一汽轿车	7,200	77,472.00	0.13
202	002051	中工国际	4,200	77,406.00	0.13
203	000898	鞍钢股份	12,100	76,835.00	0.13
204	002127	南极电商	6,300	76,797.00	0.13
205	002640	跨境通	4,000	76,560.00	0.13
206	002138	顺络电子	4,600	76,268.00	0.13
207	002004	华邦健康	11,300	76,049.00	0.13
208	002610	爱康科技	32,000	75,840.00	0.13
209	002491	通鼎互联	6,000	75,600.00	0.13
210	000729	燕京啤酒	11,200	75,488.00	0.13
211	000059	华锦股份	7,900	75,287.00	0.13
212	002440	闰土股份	3,800	74,822.00	0.13
213	002343	慈文传媒	2,100	74,781.00	0.13
214	002153	石基信息	2,800	74,648.00	0.13
215	000012	南玻A	8,800	74,360.00	0.13
216	002383	合众思壮	3,700	74,111.00	0.12
217	000926	福星股份	6,800	74,052.00	0.12
218	000400	许继电气	5,600	73,864.00	0.12
219	002056	横店东磁	6,900	73,830.00	0.12
220	002624	完美世界	2,200	73,612.00	0.12
221	000028	国药一致	1,200	72,300.00	0.12
222	000596	古井贡酒	1,100	72,237.00	0.12
223	000089	深圳机场	8,300	72,210.00	0.12

224	002601	龙鳞佰利	4,500	72,090.00	0.12
225	300145	中金环境	6,000	71,700.00	0.12
226	000712	锦龙股份	4,200	71,316.00	0.12
227	002191	劲嘉股份	7,700	71,225.00	0.12
228	000758	中色股份	11,000	70,730.00	0.12
229	002108	沧州明珠	6,200	70,432.00	0.12
230	002292	奥飞娱乐	4,900	70,021.00	0.12
231	002701	奥瑞金	11,200	70,000.00	0.12
232	002152	广电运通	9,400	69,936.00	0.12
233	000975	银泰资源	5,200	69,472.00	0.12
234	002035	华帝股份	2,300	69,322.00	0.12
235	300090	盛运环保	7,500	69,300.00	0.12
236	002444	巨星科技	5,000	69,150.00	0.12
237	002174	游族网络	3,100	69,130.00	0.12
238	000703	恒逸石化	3,200	69,024.00	0.12
239	300058	蓝色光标	12,400	68,448.00	0.12
240	002249	大洋电机	9,800	68,306.00	0.11
241	300113	顺网科技	3,700	67,673.00	0.11
242	002389	南洋科技	3,200	67,616.00	0.11
243	000040	东旭蓝天	4,800	67,440.00	0.11
244	300287	飞利信	9,000	66,690.00	0.11
245	300170	汉得信息	5,600	66,640.00	0.11
246	002371	北方华创	1,600	66,304.00	0.11
247	002477	雏鹰农牧	14,800	65,712.00	0.11
248	002131	利欧股份	25,202	65,525.20	0.11
249	002352	顺丰控股	1,300	65,468.00	0.11
250	002501	利源精制	6,300	65,331.00	0.11
251	000860	顺鑫农业	3,400	65,314.00	0.11
252	002665	首航节能	9,800	65,268.00	0.11
253	000021	深科技	6,700	65,191.00	0.11
254	300199	翰宇药业	4,000	65,120.00	0.11
255	002512	达华智能	3,600	65,052.00	0.11
256	300133	华策影视	6,000	65,040.00	0.11
257	000516	国际医学	13,300	65,037.00	0.11
258	300253	卫宁健康	9,618	64,536.78	0.11
259	002709	天赐材料	1,400	64,386.00	0.11
260	300002	神州泰岳	10,500	64,260.00	0.11
261	300244	迪安诊断	2,700	63,774.00	0.11
262	300068	南都电源	3,900	62,712.00	0.11

263	000738	航发控制	4,100	62,689.00	0.11
264	002396	星网锐捷	2,900	62,611.00	0.11
265	300271	华宇软件	4,200	62,496.00	0.11
266	002589	瑞康医药	4,600	61,870.00	0.10
267	002555	三七互娱	3,000	61,620.00	0.10
268	300324	旋极信息	4,200	61,446.00	0.10
269	000027	深圳能源	10,100	61,206.00	0.10
270	002151	北斗星通	1,900	60,838.00	0.10
271	002155	湖南黄金	6,200	60,140.00	0.10
272	002506	协鑫集成	14,000	59,780.00	0.10
273	002595	豪迈科技	3,100	59,706.00	0.10
274	002018	华信国际	8,400	59,388.00	0.10
275	300026	红日药业	13,800	58,788.00	0.10
276	002128	露天煤业	5,300	58,724.00	0.10
277	002424	贵州百灵	3,800	58,520.00	0.10
278	002672	东江环保	3,600	58,500.00	0.10
279	300053	欧比特	4,100	58,466.00	0.10
280	002670	国盛金控	3,000	58,350.00	0.10
281	002400	省广股份	10,900	58,097.00	0.10
282	002421	达实智能	9,600	58,080.00	0.10
283	300073	当升科技	2,200	57,838.00	0.10
284	002602	世纪华通	1,700	57,766.00	0.10
285	300134	大富科技	3,500	57,575.00	0.10
286	002390	信邦制药	6,800	57,460.00	0.10
287	002635	安洁科技	2,200	57,398.00	0.10
288	000591	太阳能	9,900	57,123.00	0.10
289	002431	棕榈股份	6,800	57,120.00	0.10
290	002468	申通快递	2,300	56,787.00	0.10
291	002002	鸿达兴业	8,300	56,772.00	0.10
292	000718	苏宁环球	13,100	56,723.00	0.10
293	300413	快乐购	1,900	56,715.00	0.10
294	000717	韶钢松山	6,400	56,704.00	0.10
295	300207	欣旺达	5,800	56,608.00	0.10
296	000762	西藏矿业	3,600	56,520.00	0.10
297	002354	天神娱乐	3,300	56,430.00	0.09
298	002353	杰瑞股份	4,300	56,416.00	0.09
299	000685	中山公用	5,500	56,375.00	0.09
300	000877	天山股份	5,400	56,160.00	0.09
301	002411	必康股份	2,100	56,007.00	0.09

302	002497	雅化集团	4,200	55,986.00	0.09
303	000937	冀中能源	9,600	55,872.00	0.09
304	300367	东方网力	3,700	55,796.00	0.09
305	000902	新洋丰	5,700	55,746.00	0.09
306	002266	浙富控股	12,868	55,718.44	0.09
307	002023	海特高新	5,400	55,674.00	0.09
308	002245	澳洋顺昌	5,400	55,350.00	0.09
309	000667	美好置业	18,200	55,328.00	0.09
310	002250	联化科技	5,200	55,224.00	0.09
311	002036	联创电子	3,400	55,182.00	0.09
312	002043	兔宝宝	4,500	55,170.00	0.09
313	000727	华东科技	23,100	54,978.00	0.09
314	300496	中科创达	1,700	54,944.00	0.09
315	000563	陕国投A	12,900	54,825.00	0.09
316	002716	金贵银业	2,900	54,723.00	0.09
317	300098	高新兴	4,100	54,530.00	0.09
318	000612	焦作万方	5,800	54,520.00	0.09
319	002603	以岭药业	3,500	54,460.00	0.09
320	300083	劲胜智能	7,100	53,889.00	0.09
321	002489	浙江永强	8,900	53,489.00	0.09
322	300459	金科文化	4,800	53,424.00	0.09
323	002145	中核钛白	8,900	53,311.00	0.09
324	002299	圣农发展	3,700	53,280.00	0.09
325	002368	太极股份	2,100	53,277.00	0.09
326	000766	通化金马	3,900	53,040.00	0.09
327	300077	国民技术	5,300	53,000.00	0.09
328	000587	金洲慈航	7,500	52,500.00	0.09
329	000751	锌业股份	10,200	52,326.00	0.09
330	000829	天音控股	5,500	52,250.00	0.09
331	000848	承德露露	5,500	52,030.00	0.09
332	300001	特锐德	3,800	52,022.00	0.09
333	002359	北讯集团	2,300	51,865.00	0.09
334	002608	江苏国信	5,100	51,816.00	0.09
335	002668	奥马电器	2,700	51,786.00	0.09
336	002308	威创股份	4,200	51,240.00	0.09
337	002429	兆驰股份	14,200	50,836.00	0.09
338	002428	云南锗业	4,200	50,694.00	0.09
339	300020	银江股份	4,300	50,310.00	0.08
340	300316	晶盛机电	2,400	50,184.00	0.08

341	000426	兴业矿业	5,100	50,133.00	0.08
342	002277	友阿股份	8,500	49,895.00	0.08
343	002025	航天电器	2,200	49,654.00	0.08
344	300078	思创医惠	4,600	49,634.00	0.08
345	002157	正邦科技	8,600	49,278.00	0.08
346	002047	宝鹰股份	6,500	49,075.00	0.08
347	000061	农产品	6,400	49,024.00	0.08
348	002022	科华生物	3,600	48,996.00	0.08
349	002237	恒邦股份	4,600	48,852.00	0.08
350	300212	易华录	1,800	48,780.00	0.08
351	300185	通裕重工	21,300	48,351.00	0.08
352	300101	振芯科技	3,600	48,312.00	0.08
353	300431	暴风集团	2,200	47,960.00	0.08
354	000156	华数传媒	4,200	47,880.00	0.08
355	002106	莱宝高科	4,700	47,799.00	0.08
356	000980	众泰汽车	4,000	47,760.00	0.08
357	300310	宜通世纪	4,100	47,519.00	0.08
358	002399	海普瑞	3,100	47,368.00	0.08
359	300118	东方日升	3,900	47,307.00	0.08
360	002302	西部建设	2,700	47,304.00	0.08
361	002130	沃尔核材	8,200	47,232.00	0.08
362	000090	天健集团	4,700	47,188.00	0.08
363	300618	寒锐钴业	200	47,154.00	0.08
364	002437	誉衡药业	6,800	46,852.00	0.08
365	000901	航天科技	2,000	46,720.00	0.08
366	000543	皖能电力	9,300	46,686.00	0.08
367	002123	梦网集团	4,500	46,575.00	0.08
368	000088	盐田港	6,000	46,020.00	0.08
369	300079	数码科技	10,900	45,889.00	0.08
370	300377	赢时胜	3,700	45,732.00	0.08
371	002544	杰赛科技	2,900	45,617.00	0.08
372	300010	立思辰	4,500	45,315.00	0.08
373	002375	亚厦股份	6,000	45,120.00	0.08
374	002055	得润电子	2,200	44,946.00	0.08
375	300294	博雅生物	1,500	44,925.00	0.08
376	002073	软控股份	5,600	44,800.00	0.08
377	000600	建投能源	5,800	44,718.00	0.08
378	000969	安泰科技	5,000	44,450.00	0.07
379	002597	金禾实业	1,700	44,064.00	0.07

380	002276	万马股份	5,100	43,962.00	0.07
381	002643	万润股份	4,100	43,829.00	0.07
382	000049	德赛电池	1,100	43,549.00	0.07
383	002699	美盛文化	2,400	43,464.00	0.07
384	002657	中科金财	1,900	43,358.00	0.07
385	002089	新海宜	7,700	43,274.00	0.07
386	000680	山推股份	8,500	43,265.00	0.07
387	300036	超图软件	2,800	43,232.00	0.07
388	002434	万里扬	4,100	43,050.00	0.07
389	002326	永太科技	3,700	42,254.00	0.07
390	000158	常山北明	5,300	42,082.00	0.07
391	002010	传化智联	2,600	42,068.00	0.07
392	002505	大康农业	14,800	42,032.00	0.07
393	300257	开山股份	3,000	42,000.00	0.07
394	002479	富春环保	4,300	41,753.00	0.07
395	000981	银亿股份	4,700	41,501.00	0.07
396	002120	韵达股份	900	41,202.00	0.07
397	002041	登海种业	3,200	41,120.00	0.07
398	000687	华讯方舟	3,900	40,989.00	0.07
399	002180	纳思达	1,500	40,965.00	0.07
400	300273	和佳股份	4,500	40,770.00	0.07
401	000973	佛塑科技	6,800	40,732.00	0.07
402	002642	荣之联	3,100	40,641.00	0.07
403	000617	中油资本	2,700	40,500.00	0.07
404	002261	拓维信息	5,200	40,248.00	0.07
405	002413	雷科防务	4,000	40,000.00	0.07
406	002303	美盈森	5,700	39,900.00	0.07
407	300458	全志科技	1,400	39,844.00	0.07
408	000036	华联控股	4,400	39,776.00	0.07
409	002028	思源电气	2,500	39,625.00	0.07
410	000620	新华联	6,900	39,330.00	0.07
411	002099	海翔药业	6,800	39,304.00	0.07
412	002482	广田集团	4,900	39,298.00	0.07
413	000018	神州长城	6,300	38,556.00	0.06
414	000875	吉电股份	9,900	38,511.00	0.06
415	000957	中通客车	3,400	38,284.00	0.06
416	300116	坚瑞沃能	5,000	38,100.00	0.06
417	000062	深圳华强	1,600	37,584.00	0.06
418	000869	张裕A	1,000	37,500.00	0.06

419	002358	森源电气	2,500	37,150.00	0.06
420	000539	粤电力A	7,700	37,114.00	0.06
421	002773	康弘药业	600	37,008.00	0.06
422	002143	印纪传媒	2,800	36,960.00	0.06
423	002147	新光圆成	2,830	36,620.20	0.06
424	002563	森马服饰	4,600	36,156.00	0.06
425	000959	首钢股份	6,000	35,880.00	0.06
426	000723	美锦能源	5,200	35,828.00	0.06
427	000799	酒鬼酒	1,300	35,646.00	0.06
428	002242	九阳股份	2,100	35,637.00	0.06
429	300075	数字政通	2,200	35,596.00	0.06
430	300037	新宙邦	1,700	35,462.00	0.06
431	300291	华录百纳	3,100	35,185.00	0.06
432	300216	千山药机	2,200	35,090.00	0.06
433	002503	搜于特	6,300	34,902.00	0.06
434	300352	北信源	8,700	34,626.00	0.06
435	002190	成飞集成	1,600	34,624.00	0.06
436	002522	浙江众成	3,900	34,320.00	0.06
437	300304	云意电气	4,600	33,718.00	0.06
438	002625	光启技术	1,200	33,684.00	0.06
439	300222	科大智能	1,700	33,541.00	0.06
440	300137	先河环保	1,600	33,488.00	0.06
441	002681	奋达科技	3,000	33,480.00	0.06
442	002325	洪涛股份	6,900	32,913.00	0.06
443	002449	国星光电	1,900	32,908.00	0.06
444	000507	珠海港	3,200	32,576.00	0.05
445	300474	景嘉微	600	32,352.00	0.05
446	002284	亚太股份	3,600	32,328.00	0.05
447	002032	苏泊尔	800	32,304.00	0.05
448	000615	京汉股份	3,300	32,208.00	0.05
449	000881	中广核技	2,400	31,368.00	0.05
450	300463	迈克生物	1,300	31,161.00	0.05
451	000666	经纬纺机	1,600	31,072.00	0.05
452	002110	三钢闽光	1,600	30,944.00	0.05
453	000921	海信科龙	2,200	30,624.00	0.05
454	300157	恒泰艾普	3,300	30,096.00	0.05
455	300364	中文在线	3,200	29,536.00	0.05
456	300323	华灿光电	1,800	29,340.00	0.05
457	000801	四川九洲	5,100	29,172.00	0.05

458	002695	煌上煌	1,700	28,866.00	0.05
459	300317	珈伟股份	1,800	28,188.00	0.05
460	300284	苏交科	1,700	27,778.00	0.05
461	000558	莱茵体育	5,600	27,720.00	0.05
462	002233	塔牌集团	2,300	27,393.00	0.05
463	000822	山东海化	3,000	27,150.00	0.05
464	300506	名家汇	1,200	26,700.00	0.04
465	300628	亿联网络	200	26,660.00	0.04
466	300359	全通教育	2,700	26,082.00	0.04
467	300558	贝达药业	400	25,316.00	0.04
468	002664	长鹰信质	900	24,480.00	0.04
469	000987	越秀金控	2,400	23,640.00	0.04
470	002091	江苏国泰	2,600	23,322.00	0.04
471	002175	东方网络	2,800	22,680.00	0.04
472	000710	贝瑞基因	400	22,548.00	0.04
473	000990	诚志股份	1,300	22,438.00	0.04
474	002831	裕同科技	400	22,352.00	0.04
475	000802	北京文化	1,500	22,035.00	0.04
476	002011	盾安环境	2,700	21,708.00	0.04
477	002342	巨力索具	3,600	21,564.00	0.04
478	000564	供销大集	4,400	21,032.00	0.04
479	002636	金安国纪	1,300	20,579.00	0.03
480	002648	卫星石化	1,200	19,920.00	0.03
481	002307	北新路桥	1,700	19,227.00	0.03
482	002542	中化岩土	2,400	17,688.00	0.03
483	002841	视源股份	200	14,500.00	0.02
484	002839	张家港行	1,000	11,720.00	0.02

8.3.2 期末积极投资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	000566	海南海药	8,200	105,698.00	0.18
2	300292	吴通控股	5,400	30,618.00	0.05

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	000333	美的集团	5,542,484.02	9.32
2	000651	格力电器	5,082,701.74	8.55
3	000725	京东方A	3,542,626.00	5.96
4	002415	海康威视	3,115,025.08	5.24
5	000858	五粮液	2,989,709.00	5.03
6	000002	万科A	2,864,941.91	4.82
7	000001	平安银行	2,567,941.00	4.32
8	300498	温氏股份	2,348,461.30	3.95
9	000063	中兴通讯	1,962,825.00	3.30
10	002304	洋河股份	1,580,525.00	2.66
11	000776	广发证券	1,538,068.00	2.59
12	002230	科大讯飞	1,485,892.00	2.50
13	002450	康得新	1,401,999.60	2.36
14	002024	苏宁云商	1,325,450.00	2.23
15	002466	天齐锂业	1,189,501.50	2.00
16	002460	赣锋锂业	1,185,524.00	1.99
17	002456	欧菲科技	1,118,174.00	1.88
18	002236	大华股份	1,111,751.00	1.87
19	002241	歌尔股份	1,103,618.00	1.86
20	000568	泸州老窖	1,099,866.00	1.85

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。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	000333	美的集团	4,067,342.00	6.84
2	000651	格力电器	3,739,033.45	6.29
3	000725	京东方A	2,714,658.00	4.57

4	000858	五 粮 液	2,271,354.00	3.82
5	002415	海康威视	2,234,907.86	3.76
6	000002	万 科 A	2,027,680.80	3.41
7	000001	平安银行	1,836,141.00	3.09
8	300498	温氏股份	1,697,713.99	2.86
9	000063	中兴通讯	1,403,519.00	2.36
10	002304	洋河股份	1,154,166.00	1.94
11	002230	科大讯飞	1,023,256.00	1.72
12	002450	康得新	1,013,358.00	1.70
13	000776	广发证券	989,459.00	1.66
14	002024	苏宁云商	869,467.00	1.46
15	002466	天齐锂业	819,997.00	1.38
16	002456	欧菲科技	813,475.00	1.37
17	000538	云南白药	807,691.00	1.36
18	002008	大族激光	805,606.00	1.36
19	002236	大华股份	791,090.00	1.33
20	000568	泸州老窖	789,058.00	1.33

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。

8.4.3 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	178,112,149.34
卖出股票收入（成交）总额	120,366,983.52

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。

8.5 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。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**8.10.1 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。

8.10.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**8.11.1 本期国债期货投资政策**

本报告期内，本基金未运用国债期货进行投资。

8.11.2 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。

8.11.3 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。

8.12 投资组合报告附注

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

8.12.2 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。

8.12.3 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	305,342.07
2	应收证券清算款	6,132.69
3	应收股利	-
4	应收利息	979.01
5	应收申购款	49,701.79
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	362,155.56

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	000566	海南海药	105,698.00	0.18	重大事项
2	300292	吴通控股	30,618.00	0.05	重大事项

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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
1,574	39,143.03	248,904.59	0.40%	61,362,217.55	99.60%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额 比例
1	华忠明	1,250,024.00	4.26%
2	郑红	500,034.00	1.70%
3	李晓蓉	500,025.00	1.70%
4	杜兴民	500,024.00	1.70%
5	吴文	464,957.00	1.58%
6	涂琴	400,054.00	1.36%
7	陈天仪	400,054.00	1.36%
8	黄家龙	400,007.00	1.36%
9	李天娇	376,023.00	1.28%
10	杨一薇	350,051.00	1.19%

注：以上数据由中国证券登记结算有限公司提供，持有人为场内持有人。

9.3 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	0.00	0.00%

9.4 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	0

本基金基金经理持有本开放式基金	0
-----------------	---

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2017 年 9 月 15 日）基金份额总额	297,644,248.43
本报告期期初基金份额总额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	1,371,672.47
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	237,404,798.76
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	61,611,122.14

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。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人

基金管理人于 2017 年 2 月 8 日发布《工银瑞信基金管理有限公司董事长变更公告》，经基金管理人第六十一次股东会和第四届董事会第二十六次会议审议通过，沈立强先生辞去公司董事长职务，董事长变更为尚军先生。

基金管理人于 2017 年 4 月 25 日发布《工银瑞信基金管理有限公司关于副总经理变更的公告》，郝炜先生自 2017 年 4 月 19 日起担任工银瑞信基金管理有限公司副总经理。

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。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未有改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用肆万玖仟元整，该审计机构自基金合同生效日起向本基金提供审计服务。

11.6 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，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信建投		2298,470,008.36	100.00%	212,302.25	100.00%	-

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) 新增券商的选定：根据以上标准对券商进行考察、选择和确定。在合作之前，券商需提供至少两个季度的服务，并与其他已合作券商一起参与投资研究部门（权益投资部，固定收益部，专户投资部，研究部和中央交易室）两个季度对券商的研究服务评估。公司投委会根据对券商研究服务评估结果决定是否作为新增合作券商。

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。

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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信建投	-	-	-	-	-	-

11.8 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	工银瑞信深证成份指数证券投资基金（LOF）基金合同生效公告	中国证监会指定的媒介	2017年9月16日
2	工银瑞信深证成份指数证券投资基金（LOF）开放日常申购、赎回、定期定额投资业务的公告	中国证监会指定的媒介	2017年10月10日
3	工银瑞信深证成份指数证券投资基金（LOF）上市交易公告书	中国证监会指定的媒介	2017年10月10日
4	工银瑞信基金管理有限公司关于工银瑞信深证成份指数证券投资基金（LOF）上市交易提示性公告	中国证监会指定的媒介	2017年10月13日
5	工银瑞信基金管理有限公司关于工银瑞信深证成份指数证券投资基金（LOF）开通系统内转托管及跨系统转托管业务的公告	中国证监会指定的媒介	2017年10月13日
6	关于增加上海挖财金融信息服务有限公司为旗下基金销售机构并进行费率调整的公告	中国证监会指定的媒介	2017年11月8日
7	工银瑞信基金管理有限公司关于增加上海万得基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会指定的媒介	2017年11月22日
8	工银瑞信基金管理有限公司关于增加通华财富(上海)基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会指定的媒介	2017年12月7日
9	工银瑞信基金管理有限公司关于旗下基金调整流通受限股票估值方法的公告	中国证监会指定的媒介	2017年12月21日
10	工银瑞信基金管理有限公司关于旗下基金参加工商银行网上银行、手机银行基金定投申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定的媒介	2017年12月29日
11	工银瑞信基金管理有限公司关于旗下基金参加浙商银行电子银行渠道基金定投申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定的媒介	2017年12月30日
12	工银瑞信基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金缴纳增值税的公告	中国证监会指定的媒介	2017年12月30日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

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

无。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予工银瑞信深证成份指数证券投资基金（LOF）募集申请的注册文件；
- 2、《工银瑞信深证成份指数证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3、《工银瑞信深证成份指数证券投资基金（LOF）托管协议》；
- 4、《工银瑞信深证成份指数证券投资基金（LOF）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。

13.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所。

13.3 查阅方式

投资者可于营业时间免费查阅，或登录基金管理人网站查阅。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