

工银瑞信沪港深精选灵活配置混合型证券 投资基金 2019 年半年度报告

2019 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：二〇一九年八月二十八日

§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 2019 年 8 月 26 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 2019 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	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 其他指标.....	11
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	14
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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	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.....	16
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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.....	17
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.....	17
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	18
6.1 资产负债表.....	18
6.2 利润表.....	19

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20
6.4 报表附注.....	21
§7 投资组合报告.....	44
7.1 期末基金资产组合情况.....	44
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	44
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.....	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	49
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.....	49
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细.....	49
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.....	49
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.....	50
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	50
7.12 投资组合报告附注.....	50
§8 基金份额持有人信息.....	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	52
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.....	52
§9 开放式基金份额变动.....	54
§10 重大事件揭示.....	55
10.1 基金份额持有人大会决议.....	55
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.....	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	55
10.4 基金投资策略的改变.....	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	55
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.....	55
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.....	60

11.1 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	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	60
§12 备查文件目录.....	61
12.1 备查文件目录.....	61
12.2 存放地点.....	61
12.3 查阅方式.....	61

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	工银瑞信沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	工银沪港深精选混合	
基金主代码	005197	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 11 月 9 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	828,782,106.62 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	工银沪港深精选混合 A	工银沪港深精选混合 C
下属分级基金的交易代码:	005197	005198
报告期末下属分级基金的份额总额	792,477,392.78 份	36,304,713.84 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在合理配置股票与债券等资产的基础上，重点通过精选内地与香港股票市场交易互联互通机制下的港股投资标的和沪深两市优质上市公司，以及采取积极有效的风险防控措施，力争获取超越业绩比较基准的最大化收益。
投资策略	本基金将由投资研究团队及时跟踪市场环境变化，根据宏观经济运行态势、宏观经济政策变化、证券市场运行状况、国际市场变化情况等因素的深入研究，判断国内及香港证券市场的发展趋势，结合行业状况、公司价值性和成长性分析，综合评价各类资产的风险收益水平。在充足的宏观形势判断和策略分析的基础上，采用动态调整策略，在市场上涨阶段中，适当增加权益类资产配置比例，在市场下行周期中，适当降低权益类资产配置比例。在股票选择策略方面，本基金将通过定性分析和定量分析相结合的办法，精选具有核心竞争优势和持续增长潜力，且估值水平相对合理的股票进行重点投资。本基金将主要通过港股通投资于香港股票市场。
业绩比较基准	50%×恒生指数收益率+50%×中债综合财富（总值）指数。
风险收益特征	本基金为混合型基金，预期收益和风险水平低于股票型基金，高于债券型基金与货币市场基金。

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	贺倩
	联系电话	400-811-9999	010-66060069

	电子邮箱	customerservice@icbccs.com.cn	tgxxpl@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 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 5 号新盛大厦 A 座 6-9 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		100033	100031
法定代表人		王海璐	周慕冰

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
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 5 号新盛大厦 A 座 6-9 层

§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

基金级别	工银沪港深精选混合 A	工银沪港深精选混合 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	-7,070,854.11	-467,082.90
本期利润	78,237,305.91	4,007,105.44
加权平均基金份额本期利润	0.0941	0.0996
本期加权平均净值利润率	10.35%	11.03%
本期基金份额净值增长率	10.81%	10.70%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)	
期末可供分配利润	-85,885,779.46	-4,138,513.89
期末可供分配基金份额利润	-0.1084	-0.1140
期末基金资产净值	736,784,464.17	33,541,932.09
期末基金份额净值	0.9297	0.9239
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	-7.03%	-7.61%

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、期末可供分配利润，为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

4、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。

5、本基金基金合同生效日为 2017 年 11 月 9 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

工银沪港深精选混合 A

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

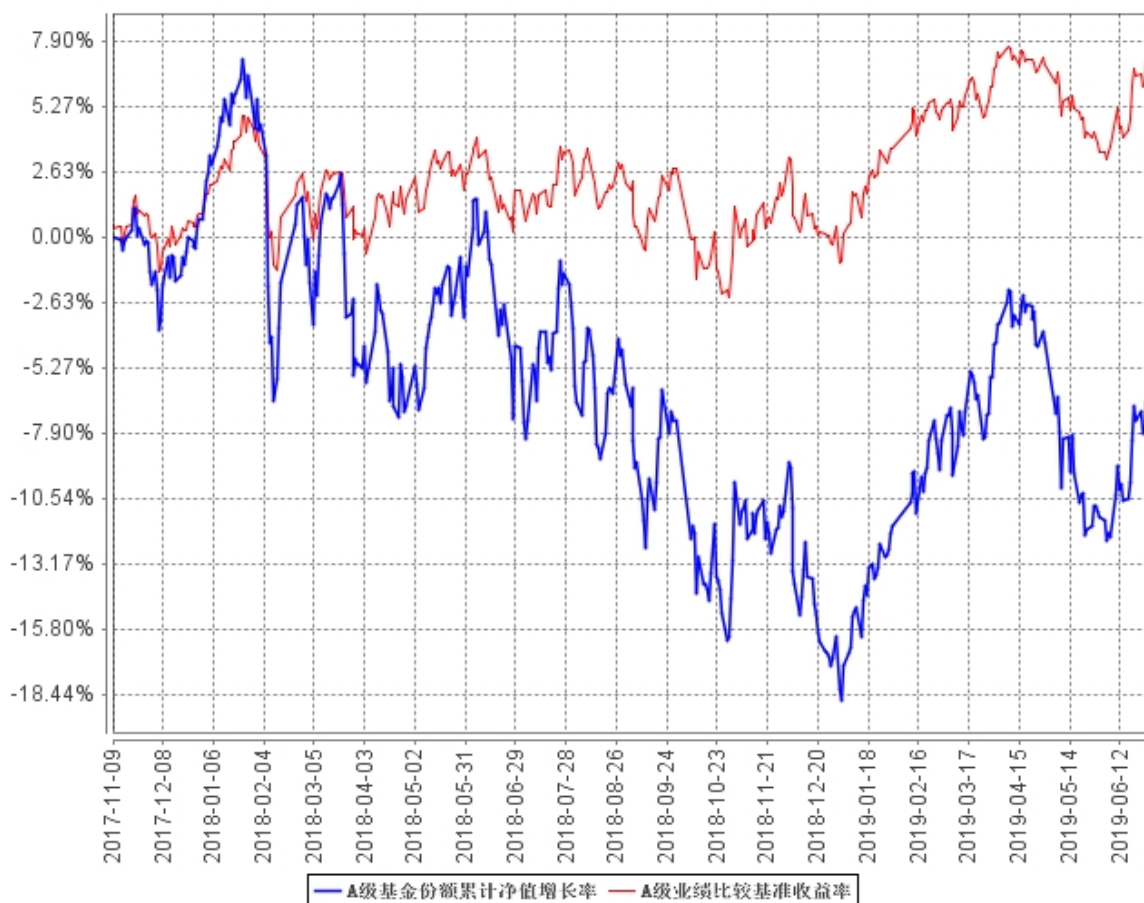
过去一个月	4.79%	0.91%	3.34%	0.52%	1.45%	0.39%
过去三个月	-1.43%	1.03%	0.77%	0.45%	-2.20%	0.58%
过去六个月	10.81%	1.01%	6.41%	0.48%	4.40%	0.53%
过去一年	-2.77%	1.18%	4.90%	0.57%	-7.67%	0.61%
自基金合同生效起至今	-7.03%	1.19%	6.83%	0.57%	-13.86%	0.62%

工银沪港深精选混合 C

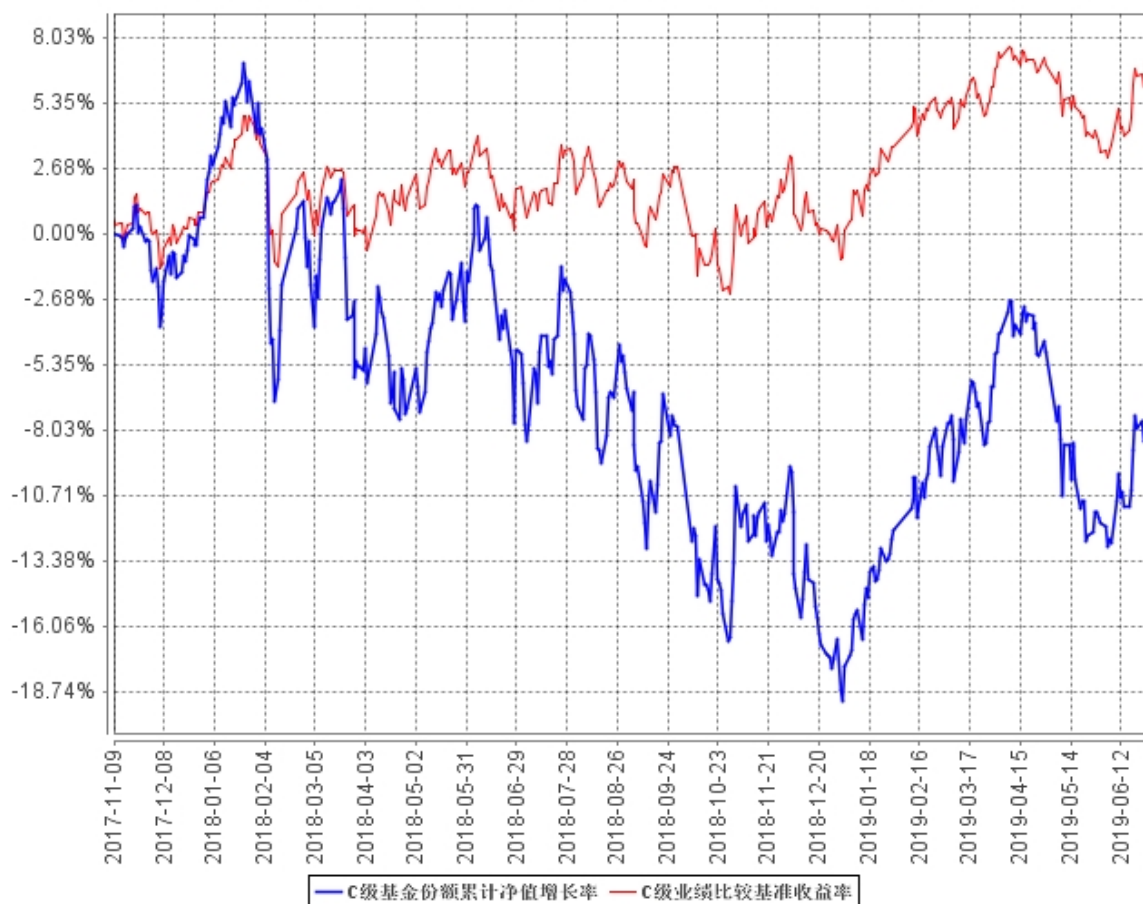
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	4.77%	0.92%	3.34%	0.52%	1.43%	0.40%
过去三个月	-1.48%	1.03%	0.77%	0.45%	-2.25%	0.58%
过去六个月	10.70%	1.01%	6.41%	0.48%	4.29%	0.53%
过去一年	-3.01%	1.18%	4.90%	0.57%	-7.91%	0.61%
自基金合同生效起至今	-7.61%	1.19%	6.83%	0.57%	-14.44%	0.62%

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

A级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



C级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 11 月 9 日生效。

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，本基金的投资符合基金合同关于投资范围及投资限制的规定：股票占基金资产的比例为 0% - 95%（其中投资于港股通投资标的股票占非现金基金资产的比例不低于 80%）。每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值的 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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，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 2019 年 6 月 30 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、工银瑞信上证 50 交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金（FOF）等逾 130 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		
郝康	权益投资总监，本基金的	2017 年 11 月 9 日	-	21	先后在澳大利亚首源投资管理公司担任基金经理，在联和运通投资顾问管理公司担任执行董事，在工

	基金经 理			银瑞信担任国际业务总监，在工银瑞信资产管理（国际）有限公司担任副总经理；2016 年加入工银瑞信基金管理有限公司，现任权益投资总监，兼任工银瑞信（国际）副总经理，2016 年 12 月 30 日至今，担任工银瑞信沪港深股票型证券投资基金基金经理；2017 年 11 月 9 日至今，担任工银瑞信沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2018 年 5 月 10 日至今，担任工银瑞信新经济灵活配置混合型证券投资基金（QDII）基金经理；2018 年 12 月 25 日至今，担任工银瑞信红利优享灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
--	----------	--	--	--

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》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》、《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。

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

中国股市在 2019 年上半年喜忧参半。在经历了 2018 年的大幅下跌之后，受到中美贸易争端缓解的刺激以及因 MSCI 纳入因子权重提升带来的流动性改善，市场从 2019 年初开始持续上涨，尤其以消费、信息技术、医疗和房地产等板块表现出色。但是自 5 月份以来备受瞩目的中美贸易谈判出现重大逆转，严重打击了市场信心，无论是 A 股还是港股均从 4 月中旬达到的年内高点回落，其后市场表现则随着中美贸易争端的演化而反复震荡。

年初以来，我们比较好地把握住了市场风格转换所带来的投资机会，通过保持较高的组合暴露度，并将资金集中配置于消费、信息技术和房地产等板块，获得了不错的超额收益。在其后的市场回调过程中，投资组合也遭受一定程度的损失。但是我们认为，当前的市场已经比较充分的消化了对于中美贸易争端的较为悲观的预期，加之估值也处于具有吸引力的位置，我们应该以更为积极的心态布局投资组合。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，工银沪港深精选混合 A 份额净值增长率为 10.81%，工银沪港深精选混合 C 份额净值增长率为 10.70%，业绩比较基准收益率为 6.41%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从国际市场环境看，在全球经济增长的后周期下，全球央行均重启宽松政策。美联储已经打开降息空间，目前市场预期 19 年下半年减息 1-2 次。欧洲主要央行都已经趋向加速实施宽松政策，短期内全球衰退的可能将进一步被推迟或平坦化。从流动性角度来看，无论 A 股还是港股市场的流动性在货币宽松的环境下都将边际改善。而中美两国领导人在 G20 的会面，则在相当大程度上缓减了市场对贸易争端恶化的担忧，有助于整个资本市场对于风险偏好的恢复。

在经过了长达 15 个月的下滑之后，中国企业的盈利预期已经触底，今年 2 季度大概率会是企业盈利预期的低点。基于我们目前的估值模型，市场进一步下行的风险较小，风险回报比偏向正面。从中长期的角度，无论是组合的暴露度还是行业配置，我们都应该以更为积极主动的策略进行布局，其中保险、地产、可选消费、券商和资本品将是我们重点关注和配置的板块。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

（1）职责分工

估值小组成员为 4 人，分别来自公司运作部、固定收益部（或研究部）、风险管理部、法律合规部，组长由运作部负责人担任。

各部门负责人推荐各部门成员，如需更换，由相应部门负责人提出。小组成员需经运作部分管副总批准同意。

（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。

2、投资经理参与或决定估值的程度

投资经理可参与讨论估值原则和方法，但不得参与最终估值决策。

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、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。

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 2019 年 1 月 1 日至 2019 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：工银瑞信沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	163,195,910.98	126,532,956.62
结算备付金		6,831,790.55	6,971,406.52
存出保证金		1,899,704.47	184,955.49
交易性金融资产	6.4.7.2	554,981,989.88	573,939,676.00
其中：股票投资		554,981,989.88	573,939,676.00
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	-	70,000,000.00
应收证券清算款		57,389,959.85	-
应收利息	6.4.7.5	44,191.35	24,653.72
应收股利		2,923,990.20	147,516.78
应收申购款		3,147.70	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		787,270,684.98	777,801,165.13
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 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		14,059,122.21	4,956,849.95
应付赎回款		1,265,355.61	-
应付管理人报酬		927,706.56	1,028,157.03
应付托管费		154,617.76	171,359.50
应付销售服务费		5,408.75	6,621.16
应付交易费用	6.4.7.7	421,268.68	547,995.53

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	110,809.15	354,500.00
负债合计		16,944,288.72	7,065,483.17
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	828,782,106.62	918,882,447.05
未分配利润	6.4.7.10	-58,455,710.36	-148,146,765.09
所有者权益合计		770,326,396.26	770,735,681.96
负债和所有者权益总计		787,270,684.98	777,801,165.13

注：1、本基金基金合同生效日为 2017 年 11 月 9 日。

2、报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额总额为 828,782,106.62 份，其中 A 类基金份额净值为人民币 0.9297 元，份额总额为 792,477,392.78 份；C 类基金份额净值为人民币 0.9239 元，份额总额为 36,304,713.84 份。

6.2 利润表

会计主体：工银瑞信沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		91,699,469.20	-11,162,698.61
1.利息收入		1,008,262.19	1,983,338.41
其中：存款利息收入	6.4.7.11	551,176.64	690,654.61
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		457,085.55	1,292,683.80
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		828,777.35	863,400.92
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-5,758,986.15	-7,883,350.45
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
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	6,587,763.50	8,746,751.37

3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	89,782,348.36	-17,065,074.88
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	80,081.30	3,055,636.94
减：二、费用		9,455,057.85	15,884,797.25
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	5,896,739.12	7,723,888.79
2. 托管费	6.4.10.2.2	982,789.87	1,287,314.82
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	36,123.81	61,130.97
4. 交易费用	6.4.7.19	2,411,357.69	6,580,918.18
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	128,047.36	231,544.49
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		82,244,411.35	-27,047,495.86
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		82,244,411.35	-27,047,495.86

注：本基金基金合同生效日为 2017 年 11 月 9 日。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：工银瑞信沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 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）	918,882,447.05	-148,146,765.09	770,735,681.96
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	82,244,411.35	82,244,411.35
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	-90,100,340.43	7,446,643.38	-82,653,697.05

填列)			
其中：1.基金申购款	17,898,931.69	-1,043,166.18	16,855,765.51
2.基金赎回款	-107,999,272.12	8,489,809.56	-99,509,462.56
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）	828,782,106.62	-58,455,710.36	770,326,396.26
项目	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30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）	1,661,581,568.21	11,407,565.44	1,672,989,133.65
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-27,047,495.86	-27,047,495.86
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）	-623,787,836.18	-30,001,549.16	-653,789,385.34
其中：1.基金申购款	305,334,581.24	-1,069,919.56	304,264,661.68
2.基金赎回款	-929,122,417.42	-28,931,629.60	-958,054,047.02
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）	1,037,793,732.03	-45,641,479.58	992,152,252.45

注：本基金基金合同生效日为 2017 年 11 月 9 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

王海璐

基金管理人负责人

赵紫英

主管会计工作负责人

关亚君

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

工银瑞信沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系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[2017]1581号文《关于准予工银瑞信深证信用债综指交易型开放式指数证券投资基金变更注册的批复》的批准，由基金管理人工银瑞信基金管理有限公司于2017年10月11日至2017年11月7日向社会公开发行募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具（2017）验字第60802052_A01号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2017年11月9日正式生效，设立时募集扣除认购费用后的有效认购金额为人民币1,661,026,700.77元，折合1,661,026,700.77份基金份额；有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币554,867.44元，折合554,867.44份基金份额；以上收到的实收基金共计人民币1,661,581,568.21元，折合1,661,581,568.21份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限为不定期。本基金的基金管理人及注册登记机构均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。

指本基金根据认购/申购费用、赎回费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用、赎回时收取赎回费用，且不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为A类基金份额；在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用、赎回时收取赎回费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为C类基金份额。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市交易的股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票、权证、股指期货、债券（包括但不限于国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、国债期货、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、现金，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。其中，股票占基金资产的比例为0% - 95%（其中投资于港股通投资标的股票占非现金基金资产的比例不低于80%）。每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值的5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为： $50\% \times \text{恒生指数收益率} + 50\% \times \text{中债综合财富（总值）指数}$ 。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《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〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定及参考意见。

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 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年上半年度的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需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

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

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;

(2) 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定, 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、债券的转让收入免征增值税; 国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税; 存款利息收入不征收增值税;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定, 金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定, 金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定, 自 2018 年 1 月 1 日起, 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(以下简称“资管产品运营业务”), 暂适用简易计税方法, 按照 3%的征收率缴纳增值税, 资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定, 自 2018 年 1 月 1 日起, 资管产品管理人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, 按照以下规定确定销售额: 提供贷款服务, 以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额; 转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票(不包括限售股)、债券、基金、非货物期货, 可以选择按照实际买入价计算销售额, 或者以 2017 年最后一个

交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

（3） 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。

（4） 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《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；

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、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 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，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

（5） 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

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 2019年6月30日
活期存款	163,195,910.98
定期存款	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
合计：	163,195,910.98

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	502,121,522.38	554,981,989.88	52,860,467.50
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	502,121,522.38	554,981,989.88	52,860,467.50

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

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**

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应收活期存款利息	41,788.77
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	2,023.40
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
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	379.18
合计	44,191.35

6.4.7.6 其他资产

无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	421,268.68
银行间市场应付交易费用	-
合计	421,268.68

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2019 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2,602.70
预提审计费	44,630.98
预提信息披露费	59,075.47
预提账户维护费	4,500.00
合计	110,809.15

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

工银沪港深精选混合 A		
项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	873,466,121.71	873,466,121.71
本期申购	16,209,443.51	16,209,443.51
本期赎回(以“-”号填列)	-97,198,172.44	-97,198,172.44
- 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	792,477,392.78	792,477,392.78

金额单位：人民币元

工银沪港深精选混合 C		
项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	45,416,325.34	45,416,325.34
本期申购	1,689,488.18	1,689,488.18
本期赎回(以“-”号填列)	-10,801,099.68	-10,801,099.68
- 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	36,304,713.84	36,304,713.84

注：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。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

工银沪港深精选混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-88,066,533.66	-52,567,579.67	-140,634,113.33
本期利润	-7,070,854.11	85,308,160.02	78,237,305.91
本期基金份额交易产生的变动数	9,251,608.31	-2,547,729.50	6,703,878.81
其中：基金申购款	-1,853,838.60	962,996.34	-890,842.26
基金赎回款	11,105,446.91	-3,510,725.84	7,594,721.07
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-85,885,779.46	30,192,850.85	-55,692,928.61

单位：人民币元

工银沪港深精选混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-4,794,131.47	-2,718,520.29	-7,512,651.76
本期利润	-467,082.90	4,474,188.34	4,007,105.44
本期基金份额交易产生的变动数	1,122,700.48	-379,935.91	742,764.57
其中：基金申购款	-207,665.21	55,341.29	-152,323.92
基金赎回款	1,330,365.69	-435,277.20	895,088.49
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-4,138,513.89	1,375,732.14	-2,762,781.75

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	461,658.19
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	82,373.12
其他	7,145.33
合计	551,176.64

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
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	730,277,203.08
减：卖出股票成本总额	736,036,189.23
买卖股票差价收入	-5,758,986.15

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

无。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

无。

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

无。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	6,587,763.50

基金投资产生的股利收益	-
合计	6,587,763.50

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
1. 交易性金融资产	89,782,348.36
——股票投资	89,782,348.36
——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	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	89,782,348.36

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	75,025.03
基金转换费收入	5,056.27
合计	80,081.30

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
交易所市场交易费用	2,388,970.14
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-

赎回费	-
港股通证券组合费	22,387.55
合计	2,411,357.69

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
审计费用	44,630.98
信息披露费	59,075.47
账户维护费	9,000.00
银行费用	15,340.91
其他	-
合计	128,047.36

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

无。

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

无。

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 2019年1月1日至2019年6 月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	5,896,739.12	7,723,888.79
其中：支付销售机构的客户维护费	2,292,249.06	3,140,859.19

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6 月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30 日
当期发生的基金应支付的托管费	982,789.87	1,287,314.82

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：H

$$= E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	工银沪港深精选混合 A	工银沪港深精选混合 C	合计
	工银瑞信基金管理有限公司	-	799.60
合计	-	799.60	799.60
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	工银沪港深精选混合 A	工银沪港深精选混合 C	合计
	工银瑞信基金管理有限公司	-	1,411.75
合计	-	1,411.75	1,411.75

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。C 类基金份额的销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

C 类基金份额销售服务费每日计算，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

无。

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

无。

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

无。

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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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	163,195,910.98	461,658.19	201,901,081.55	478,669.35

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

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

无。

6.4.12 期末（2019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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 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
601236	红塔证券	2019年6月26日	2019年7月5日	新股流通受限	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	
300788	中信出版	2019年6月27日	2019年7月5日	新股流通受限	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

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、内控稽核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，负责根据公司经营计划、业务规则以及自身情况制订本部门的制度流程以及风险控制措施，同时分别在自己的授权范围内对关联部门及岗位进行监督并承担相应的责任；各部门设置兼职或专职合规管理人员，对本部门执行法律法规、监管要求及公司规章制度的情况进行监督。第二道防线由公司专属风险管理部门法律合规部、风险管理部和内控稽核部构成，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业务的投资风险进行监控管理，内控稽核部对业务的风险和合规性以及制度执行情况进行监督检查。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。

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

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级的债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级的同业存单投资。

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。

6.4.13.3.2 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。

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 2019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	163,195,910.98	-	-	-	-	-	163,195,910.98
结算备付金	6,831,790.55	-	-	-	-	-	6,831,790.55
存出保证金	1,899,704.47	-	-	-	-	-	1,899,704.47
交易性金融资产	-	-	-	-	-	554,981,989.88	554,981,989.88
应收证券清算款	-	-	-	-	-	57,389,959.85	57,389,959.85
应收利息	-	-	-	-	-	44,191.35	44,191.35
应收股利	-	-	-	-	-	2,923,990.20	2,923,990.20
应收申购款	-	-	-	-	-	3,147.70	3,147.70
资产总计	171,927,406.00	-	-	-	-	615,343,278.98	787,270,684.98
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	14,059,122.21	14,059,122.21
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,265,355.61	1,265,355.61
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	927,706.56	927,706.56
应付托管费	-	-	-	-	-	154,617.76	154,617.76
应付销售服务费	-	-	-	-	-	5,408.75	5,408.75
应付交易费用	-	-	-	-	-	421,268.68	421,268.68
其他负债	-	-	-	-	-	110,809.15	110,809.15
负债总计	-	-	-	-	-	16,944,288.72	16,944,288.72
利率敏感度缺口	171,927,406.00	-	-	-	-	598,398,990.26	770,326,396.26
上年度末 2018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	126,532,956.62	-	-	-	-	126,532,956.62
结算备付金	6,971,406.52	-	-	-	-	6,971,406.52
存出保证金	184,955.49	-	-	-	-	184,955.49
交易性金融资产	-	-	-	-	-573,939,676.00	573,939,676.00
买入返售金融资产	70,000,000.00	-	-	-	-	70,000,000.00
应收利息	-	-	-	-	24,653.72	24,653.72
应收股利	-	-	-	-	147,516.78	147,516.78
资产总计	203,689,318.63	-	-	-	-574,111,846.50	777,801,165.13
负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	4,956,849.95	4,956,849.95
应付管理人报酬	-	-	-	-	1,028,157.03	1,028,157.03
应付托管费	-	-	-	-	171,359.50	171,359.50
应付销售服务费	-	-	-	-	6,621.16	6,621.16
应付交易费用	-	-	-	-	547,995.53	547,995.53
其他负债	-	-	-	-	354,500.00	354,500.00
负债总计	-	-	-	-	7,065,483.17	7,065,483.17
利率敏感度缺口	203,689,318.63	-	-	-	-567,046,363.33	770,735,681.96

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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度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。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末			
	2019年6月30日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	-	-	-	-

交易性金融资产	-	495,414,087.86	-	495,414,087.86
衍生金融资产	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-
应收股利	-	2,923,990.20	-	2,923,990.20
其他应收款	-	-	-	-
资产合计	-	498,338,078.06	-	498,338,078.06
以外币计价的负债				
其他应付款	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	498,338,078.06	-	498,338,078.06
项目	上年度末			
	2018 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	-	-	-	-
交易性金融资产	-	557,437,208.40	-	557,437,208.40
衍生金融资产	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-
应收股利	-	147,516.78	-	147,516.78
其他应收款	-	-	-	-
资产合计	-	557,584,725.18	-	557,584,725.18
以外币计价的负债				
其他应付款	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	557,584,725.18	-	557,584,725.18

6.4.13.4.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变，且未考虑基金管理人为降低汇率风险而可能采取的风险管理活动。		
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（2019年6月30日）	上年度末（2018年12月31日）
	港币相对人民币升值 5%	24,916,903.90	27,879,236.26
港币相对人民币贬值 5%	-24,916,903.90	-27,879,236.26	

注：表中列示了以外币计价的资产中主要币种的汇率变动对基金资产净值的影响。

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 2019年6月30日		上年度末 2018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	554,981,989.88	72.05	573,939,676.00	74.47
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	554,981,989.88	72.05	573,939,676.00	74.47
----	----------------	-------	----------------	-------

注：1、本基金的投资组合比例为：股票占基金资产的比例为 0% - 95%（其中投资于港股通投资标的股票占非现金基金资产的比例不低于 80%）。每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值的 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或中国证监会允许，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

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

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（2019 年 6 月 30 日）	上年度末（2018 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准增加 5%	73,685,918.57	75,046,511.15
	业绩比较基准减少 5%	-73,685,918.57	-75,046,511.15

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

无。

§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	554,981,989.88	70.49
	其中：股票	554,981,989.88	70.49
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	170,027,701.53	21.60
8	其他各项资产	62,260,993.57	7.91
9	合计	787,270,684.98	100.00

注：1、由于四舍五入的原因金额占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

2、本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 495,414,087.86 元，占期末基金资产净值比例为 64.31%。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末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（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	8,097,044.56	1.05
B	采矿业	206,176.90	0.03
C	制造业	50,826,494.38	6.60
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	39,603.76	0.01
J	金融业	33,869.94	0.00
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	341,605.88	0.04
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	23,106.60	0.00
S	综合	-	-
	合计	59,567,902.02	7.73

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。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
Consumer Discretionary 非日常生活消费品	25,540,746.00	3.32
Consumer Staples 日常消费品	12,117,345.00	1.57
Energy 能源	18,130,705.00	2.35
Financials 金融	213,000,420.86	27.65
Health Care 医疗保健	20,174,440.00	2.62
Industrials 工业	26,123,771.00	3.39
Real Estate 房地产	108,176,510.00	14.04
Telecommunication Services 通讯服务	46,773,636.00	6.07
Information Technology 信息技术	15,358,194.00	1.99
Utilities 公用事业	10,018,320.00	1.30
合计	495,414,087.86	64.31

注：1、以上分类采用全球行业分类标准（GICS）；

2、由于四舍五入的原因市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	00939	建设银行	8,946,000	52,960,320.00	6.88
2	00700	腾讯控股	150,800	46,773,636.00	6.07
3	02318	中国平安	470,500	38,820,955.00	5.04
4	01299	友邦保险	390,200	28,917,722.00	3.75
5	03968	招商银行	798,261	27,348,421.86	3.55
6	00688	中国海外发展	778,000	19,706,740.00	2.56
7	000858	五粮液	136,900	16,147,355.00	2.10
8	02601	中国太保	511,400	13,741,318.00	1.78
9	00883	中国海洋石油	1,164,000	13,677,000.00	1.78
10	01030	新城发展控股	1,450,000	13,108,000.00	1.70
11	00288	万洲国际	1,738,500	12,117,345.00	1.57
12	02669	中海物业	3,250,000	11,635,000.00	1.51
13	00016	新鸿基地产	99,500	11,596,725.00	1.51
14	000651	格力电器	207,323	11,402,765.00	1.48
15	00855	中国水务	1,482,000	10,018,320.00	1.30
16	02313	申洲国际	104,700	9,892,056.00	1.28
17	01336	新华保险	257,800	8,618,254.00	1.12
18	600809	山西汾酒	123,310	8,514,555.50	1.11
19	02628	中国人寿	499,000	8,443,080.00	1.10
20	01448	福寿园	1,343,000	8,098,290.00	1.05
21	300498	温氏股份	225,796	8,097,044.56	1.05
22	600519	贵州茅台	8,121	7,991,064.00	1.04
23	03908	中金公司	562,800	7,800,408.00	1.01
24	02020	安踏体育	160,000	7,550,400.00	0.98
25	00874	白云山	234,000	7,256,340.00	0.94
26	01628	禹洲地产	2,217,000	7,160,910.00	0.93
27	00011	恒生银行	39,600	6,775,164.00	0.88
28	06030	中信证券	473,000	6,773,360.00	0.88
29	00017	新世界发展	619,000	6,654,250.00	0.86
30	02388	中银香港	245,000	6,627,250.00	0.86
31	002157	正邦科技	395,900	6,595,694.00	0.86
32	02338	潍柴动力	549,000	6,373,890.00	0.83
33	06837	海通证券	800,800	6,174,168.00	0.80
34	02005	石四药集团	986,000	6,123,060.00	0.79
35	01093	石药集团	538,000	5,961,040.00	0.77
36	01918	融创中国	175,000	5,911,500.00	0.77
37	00763	中兴通讯	284,800	5,650,432.00	0.73

38	00586	海螺创业	226,000	5,487,280.00	0.71
39	00012	恒基地产	139,700	5,290,439.00	0.69
40	00522	ASM PACIFIC	74,600	5,249,602.00	0.68
41	00083	信合置业	454,000	5,230,080.00	0.68
42	00683	嘉里建设	179,000	5,164,150.00	0.67
43	01157	中联重科	1,041,600	4,697,616.00	0.61
44	01966	中骏集团控股	1,383,000	4,577,730.00	0.59
45	00992	联想集团	838,000	4,458,160.00	0.58
46	01088	中国神华	309,500	4,453,705.00	0.58
47	02007	碧桂园	425,000	4,441,250.00	0.58
48	03339	中国龙工	2,393,000	4,379,190.00	0.57
49	03808	中国重汽	345,500	4,107,995.00	0.53
50	00817	中国金茂	920,000	3,845,600.00	0.50
51	00813	世茂房地产	178,000	3,727,320.00	0.48
52	00257	中国光大国际	170,000	1,077,800.00	0.14
53	01177	中国生物制药	108,000	759,240.00	0.10
54	603259	药明康德	3,941	341,605.88	0.04
55	600968	海油发展	58,078	206,176.90	0.03
56	02777	富力地产	9,600	126,816.00	0.02
57	300782	卓胜微	743	80,927.56	0.01
58	01066	威高股份	12,000	74,760.00	0.01
59	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.01
60	603863	松炆资源	1,532	35,358.56	0.00
61	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.00
62	300594	朗进科技	721	31,803.31	0.00
63	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.00
64	300788	中信出版	1,556	23,106.60	0.00

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	00700	腾讯控股	30,751,118.75	3.99
2	02318	中国平安	24,913,408.85	3.23
3	00939	建设银行	20,715,759.29	2.69

4	00688	中国海外发展	19,293,418.90	2.50
5	000895	双汇发展	18,293,383.63	2.37
6	02018	瑞声科技	17,750,259.42	2.30
7	000651	格力电器	16,318,171.84	2.12
8	300498	温氏股份	15,875,704.99	2.06
9	000858	五粮液	14,584,073.48	1.89
10	02601	中国太保	13,926,740.78	1.81
11	01336	新华保险	12,693,032.91	1.65
12	00257	中国光大国际	11,369,952.91	1.48
13	02382	舜宇光学科技	11,146,878.29	1.45
14	600887	伊利股份	10,506,090.42	1.36
15	01088	中国神华	10,064,179.81	1.31
16	00992	联想集团	10,039,882.49	1.30
17	00883	中国海洋石油	9,900,114.83	1.28
18	01628	禹洲地产	9,649,608.67	1.25
19	601318	中国平安	9,529,856.00	1.24
20	00522	ASM PACIFIC	9,084,039.84	1.18

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	00941	中国移动	25,063,369.78	3.25
2	000895	双汇发展	18,300,037.00	2.37
3	02018	瑞声科技	15,609,670.73	2.03
4	00384	中国燃气	14,949,795.39	1.94
5	00960	龙湖地产	14,666,217.32	1.90
6	00966	中国太平	14,328,098.88	1.86
7	02238	广汽集团	14,276,225.35	1.85
8	02202	万科企业	13,528,687.80	1.76
9	06169	宇华教育	13,418,047.67	1.74
10	01177	中国生物制药	13,400,302.75	1.74

11	00688	中国海外发展	12,846,027.69	1.67
12	02688	新奥能源	12,639,513.71	1.64
13	01109	华润置地	12,633,407.43	1.64
14	01030	新城发展控股	12,562,215.77	1.63
15	601318	中国平安	12,082,632.00	1.57
16	002124	天邦股份	11,587,974.55	1.50
17	01113	长实地产	10,897,069.32	1.41
18	02628	中国人寿	10,803,735.35	1.40
19	00386	中国石油化工股份	10,798,015.49	1.40
20	600887	伊利股份	10,277,325.21	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。

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	627,296,154.75
卖出股票收入（成交）总额	730,277,203.08

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，本基金未运用国债期货进行投资。

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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

1、建设银行

本报告期，本基金持有建设银行，其发行主体因票据业务贷前调查、贸易背景真实性审查严重不尽职，违规向小微企业客户收取银行承兑汇票承诺费、超出合同约定收取银行承兑汇票承诺费，被银保监会滨州监管局处以罚款。

2、招商银行

本报告期，本基金持有招商银行，其发行主体因授信调查不全面，未能有效识别、反映客户授信集中风险等问题，被中国银保监会广西监管局处以罚款。

上述情形对上市公司的财务和经营状况无重大影响，投资决策流程符合基金管理人的制度要求。

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票没有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	1,899,704.47
2	应收证券清算款	57,389,959.85
3	应收股利	2,923,990.20
4	应收利息	44,191.35
5	应收申购款	3,147.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	62,260,993.57

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处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

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

份额级别	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
工银沪港深精选混合 A	12,511	63,342.45	125,951,226.92	15.89%	666,526,165.86	84.11%
工银沪港深精选混合 C	1,402	25,894.95	0.00	0.00%	36,304,713.84	100.00%
合计	13,913	59,568.90	125,951,226.92	15.20%	702,830,879.70	84.80%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	工银沪港深精选混合 A	210,759.62	0.03%
	工银沪港深精选混合 C	9,542.90	0.03%
	合计	220,302.52	0.03%

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	份额级别	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	工银沪港深精选混合 A	0

持有本开放式基金	工银沪港深精选混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	工银沪港深精选混合 A	0
	工银沪港深精选混合 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	工银沪港深精选 混合 A	工银沪港深精选 混合 C
基金合同生效日（2017 年 11 月 9 日）基金 份额总额	1,506,193,407.15	155,388,161.06
本报告期期初基金份额总额	873,466,121.71	45,416,325.34
本报告期期间基金总申购份额	16,209,443.51	1,689,488.18
减：本报告期期间基金总赎回份额	97,198,172.44	10,801,099.68
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少 以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	792,477,392.78	36,304,713.84

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

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

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：

基金管理人于 2019 年 5 月 8 日发布《工银瑞信基金管理有限公司关于董事长变更的公告》，尚军先生自 2019 年 5 月 6 日起不再担任董事长。

基金管理人于 2019 年 5 月 9 日发布《工银瑞信基金管理有限公司关于董事长和总经理变更的公告》，郭特华女士自 2019 年 5 月 8 日起担任董事长，不再担任总经理；王海璐女士自 2019 年 5 月 8 日起担任总经理。

2、基金托管人：

2019 年 1 月，中国农业银行总行决定免去史静欣托管业务部副总裁职务。

2019 年 4 月，中国农业银行总行决定免去马曙光托管业务部总裁职务。

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，无涉及基金管理业务、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

本报告期内基金投资策略未有改变。

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

报告期内，本基金管理人收到中国人民银行营业管理部处罚决定，对公司未严格按照反洗钱相关规定履行客户身份识别义务及可疑交易报告义务予以罚款。基金管理人对此高度重视，积极开展整改工作，已完善了反洗钱制度体系和工作机制，深入具体问题整改。前述事项对基金份额持有人利益无不利影响。

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

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	
兴业证券	2	451,559,518.54	33.29%	309,674.24	33.55%	-
国泰君安	1	293,437,705.69	21.64%	195,708.21	21.20%	-
光大证券	2	285,882,610.23	21.08%	195,852.03	21.22%	-
中金	2	175,358,853.19	12.93%	120,498.88	13.05%	-
广发证券	3	134,040,091.63	9.88%	91,618.60	9.92%	-
华创证券	1	15,973,809.21	1.18%	9,764.71	1.06%	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	3	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-

注：1. 交易单元的选择标准和程序

基金管理人选择综合实力强、研究能力突出、合规经营的证券公司，向其租用专用交易单元。

(1) 选择标准：

- a) 经营行为规范，在最近一年内无重大违规行为。
- b) 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、个股分析报告及量化、衍生品和国际市场的研究服务支持。

c) 在证监会最近一期证券公司年度分类结果中，分类级别原则上不得低于 BBB。

d) 与其他证券公司相比，能够提供最佳交易执行和优惠合理的佣金费率。

(2) 选择程序

a) 新增证券公司的选定：根据以上标准对证券公司进行考察、选择和确定。在合作之前，证券公司需提供至少两个季度的服务，并在两个季度内与其他已合作证券公司一起参与基金管理人的研究服务评估。根据对其研究服务评估结果决定是否作为新增合作证券公司。

b) 签订协议：与被选择的证券公司签订交易单元租用协议。

2. 证券公司的评估、保留和更换程序

(1) 交易单元的租用期限为一年，合同到期前 30 天内，基金管理人将根据各证券公司在服务期间的综合证券服务质量、费率等情况进行评估。

(2) 对于符合标准的证券公司，与其续约；对于不能达到标准的证券公司，不与其续约，并根据证券公司选择标准和程序，重新选择其他经营稳健、研究能力强、综合服务质量高的证券经营机构，租用其交易单元。

(3) 若证券公司提供的综合证券服务不符合要求，基金管理人有权按照协议约定，提前终止租用其交易单元。

在本报告期内本基金新增中信证券的 395288 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
兴业证券	-	-	1,715,000,000.00	41.96%	-	-
国泰君安	-	-	1,295,000,000.00	31.68%	-	-
光大证券	-	-	452,300,000.00	11.07%	-	-
中金	-	-	340,000,000.00	8.32%	-	-
广发证券	-	-	285,000,000.00	6.97%	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-

华泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-

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基金参加工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定的媒介	2019年4月1日
2	工银瑞信基金管理有限公司关于增加北京百度百盈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	2019年4月1日
3	工银瑞信基金管理有限公司关于增加玄元保险代理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	2019年4月3日
4	工银瑞信基金管理有限公司关于董事长变更的公告	中国证监会指定的媒介	2019年5月8日
5	工银瑞信基金管理有限公司关于董事长和总经理变更的公告	中国证监会指定的媒介	2019年5月9日
6	关于工银瑞信基金管理有限公司旗下部分基金2019年开放日的提示性公告	中国证监会指定的媒介	2019年6月12日
7	工银瑞信基金管理有限公司关于旗下基金投资科创板股票的公告	中国证监会指定的媒介	2019年6月22日
8	工银瑞信基金管理有限公司	中国证监会指定的	2019年6月25日

	关于增加江苏汇林保大基金销售有限公司为旗下基金销售机构并进行费率调整的公告	媒介	
--	---------------------------------------	----	--

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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。

11.2 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、中国证监会准予工银瑞信沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金募集申请的注册文件；
- 2、《工银瑞信沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《工银瑞信沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《工银瑞信沪港深精选灵活配置混合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媒介上披露的各项公告。

12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所。

12.3 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