工银瑞信14天理财债券型发起式证券投资基金

2014 第二季度 报告

2014年6月30日

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一四年七月十七日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年7月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	工银14天理财债券发起	
交易代码	485120	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年10月26日	
报告期末基金份额总额	9,675,409,661.05份	
投资目标	在控制风险并保持资产流动性的基础上,力争实现超过业绩比较基准的投资收益。	
投资策略	将采取利率策略、信用策略、相对价值策略等积极投资策略,在严格控制风险的前提下,发掘和利用市场失衡提供的投资机会,实现组合增值。	
业绩比较基准	人民币七天通知存款税后利率。	
风险收益特征	本基金为发起式债券型基金,预期收益和风险水平低于混合型基金、股票型基金,高于货币市场基金。	
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	工银14天理财债券发起A	工银14天理财债券发起B
下属两级基金的交易代码	485120	485020
报告期末下属两级基金的份额总额	4,202,305,694.80份	5,473,103,966.25份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年4月1日 - 2014年6月30日)	
	工银14天理财债券发起A	工银14天理财债券发起B
1. 本期已实现收益	45,305,631.54	63,071,075.14
2.本期利润	45,305,631.54	63,071,075.14
3.期末基金资产净值	4,202,305,694.80	5,473,103,966.25

注:(1)本基金收益分配是按日结转份额。
(2)所列数据截止到2014年6月30日。
(3)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。
(4)本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。
(5)本基金基金合同生效日为2012年10月26日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

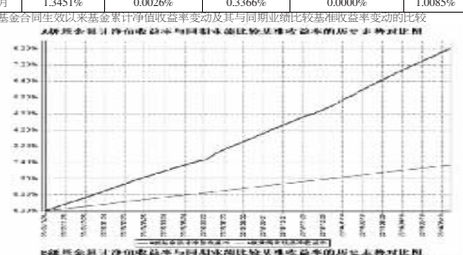
工银14天理财债券发起A

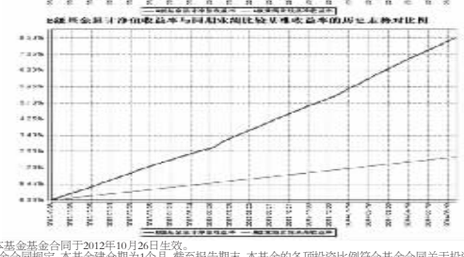
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.2724%	0.0026%	0.3366%	0.0000%	0.9358%	0.0026%

工银14天理财债券发起B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	1.3451%	0.0026%	0.3366%	0.0000%	1.0085%	0.0026%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较





注:1.本基金基金合同于2012年10月26日生效。
2.按基金合同规定,本基金建仓期为1个月,截至报告期末,本基金的各项投资比例符合基金合同关于投资范围及投资限制的规定;本基金主要投资于具有良好流动性的工具,包括现金、通知存款、一年以内(含一年)的银行定期存款和大额存单、剩余期限(或回售期限)在397 天以内(含397 天)的债券、资产支持证券、中期票据;期限在一年以内(含一年)的债券回购、期限在一年以内(含一年)的中央银行票据、短期融资券,及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他固定收益类金融工具;本基金不直接在二级市场上买入股票、权证等权益类资产,也不参与一级市场新股申购和新股增发。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
魏欣	本基金的基金经理	2012年10月26日	-	9	2005年加入工银瑞信,曾任债券交易员、固定收益研究员;2011年4月20日起至今担任工银货币市场基金基金经理;2012年8月22日起至今担任工银瑞信7天理财债券型基金基金经理;2012年10月26日起至今担任工银瑞信14天理财债券型发起式基金的基金经理。
谷衡	本基金的基金经理	2012年11月13日	-	9	先后在华夏银行总行担任交易员,在中信银行总行担任交易员;2012年加入工银瑞信,现任固定收益部基金经理;2012年11月13日起至今担任工银瑞信14天理财债券型发起式证券投资基金基金经理;2013年1月28日至今,担任工银瑞信60天理财债券型基金基金经理;2013年3月28日至今,担任工银安心纯内实时申赎货币基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了公平对待各类投资人,保护各类投资人利益,避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为,公司根据《证券投资基金法》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部规章,拟定了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》,对公司管理的各类资产的公平对待做了明确具体的规定,并规定对买卖股票、债券时候的价格和市场价格差距较大,可能存在操纵股价、利益输送等违法违规情况进行监控。本报告期,按照时间优先、价格优先的原则,本公司对满足限价条件且对同一证券有相同交易需求的基金等投资组合,均采用了系统中的公平交易模块进行操作;实现了公平交易;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未超过该证券当日成交量的5%。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

一季度,经济的被软让货币政策逐步转向宽松,并导致国内经济基本面在二季度末出现了企稳回升态势。CPI由于猪价的上涨出现一定波动,但整体仍处于低位。

市场表现方面,由于经济仍处于底部区间,货币政策保持宽松态势,整体无风险利率水平在二季度仍然继续下行。1年期国开债收益率从4.87%下行至4.28%;1年期AAA短融收益率从5.18%下行至4.72%,1年期AA+短融收益率从5.66下行至5.01%。

二季度,由于对市场利率走势较为乐观,本基金采取了较为积极的操作策略,适度提高了债券仓位,并保持相对较高的组合期限和杠杆;同时,通过对组合规模的判断,合理安排组合内生现金流,平衡组合流动性与收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内,工银14天理财A净值收益率1.2724%,工银14天理财B净值收益率1.3451%,业绩比较基准收益率为0.3366%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2014年三季度,虽然经济底部温和回升,但我们判断货币政策转紧的概率较低,因此整体货币市场利率水平中枢有望继续维持低位。协议存款收益率曲线会继续陡峭化下行,短融收益率也存在进一步下行空间。

本基金在三季度将维持现有产品配置的中高等级水平,严格控制低评级信用产品和中长期Shibor浮息债持仓比例,继续努力做好组合内生现金流的安排,并进行适当的期限管理,重点在月末季末把握好存款的投资机会。此外,本基金将密切关注新股申购对基金规模及货币市场利率带来的冲击。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	5,980,117,272.52	47.48
	其中:债券	5,980,117,272.52	47.48
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	6,338,383,904.10	50.33
4	其他资产	276,150,881.83	2.19
5	合计	12,594,652,058.45	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。

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	24.16	
	其中:买断式回购融资	0.00	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	2,912,393,128.40	30.10
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产余额比例的简单平均值。
债券正回购的资金余额超过基金资产净值的40%的说明
本报告期内本基金进入全国银行间同业市场进行债券正回购的资金余额未超过基金资产净值的40%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	133
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	133
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	96

报告期内投资组合平均剩余期限超过134天情况说明
本报告期内无投资组合平均剩余期限超过134天情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	11.88	30.10
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	17.67	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	41.44	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	24.63	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天 (含)	31.69	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	127.32	30.10

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,120,317,398.74	11.58
	其中:政策性金融债	1,120,317,398.74	11.58
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	4,859,799,873.78	50.23
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	5,980,117,272.52	61.81
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

注:上表中,债券的成本包括债券面值和折溢价

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	130227	13国开27	5,500,000	550,018,120.39	5.68
2	041459042	14包钢集CP002	2,500,000	250,037,473.18	2.58
3	100209	10国开09	2,200,000	221,050,106.71	2.28
4	041356031	13中铝CP002	2,000,000	200,271,181.48	2.07
5	011482001	14太钢SCP001	1,900,000	190,411,850.60	1.97
6	041460023	14陕有色CP001	1,500,000	150,920,640.42	1.56
7	011415005	14中铝业SCP005	1,500,000	149,985,844.28	1.55
8	011441002	14鞍钢SCP002	1,200,000	120,316,407.90	1.24
9	011473002	14鲁高速SCP002	1,100,000	110,070,198.80	1.14
10	041456003	14包钢集CP001	1,000,000	101,097,065.33	1.04

注:上表中,债券的成本包括债券面值和折溢价。

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	5
报告期内偏离度的最高值	0.2535%
报告期内偏离度的最低值	0.1197%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.2078%

注:上表中"偏离情况"根据报告期内各工作日数据计算。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 本基金采用固定份额净值,基金账面份额净值始终保持为人民币1.00元。本基金估值采用摊余成本法,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内按实际利率法进行摊销,每日计提收益或损失。

5.8.2 本报告期内本基金未持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券。

5.8.3 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。

5.8.4 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	44,726.77
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	142,178,910.13
4	应收申购款	133,927,244.93
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	276,150,881.83

5.8.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分
无。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	工银14天理财债券发起A	工银14天理财债券发起B
报告期期初基金份额总额	2,106,380,366.14	2,845,641,967.93
报告期期间基金总申购份额	6,512,802,109.54	6,867,827,640.87
减:报告期期间基金总赎回份额	4,416,876,780.88	4,240,365,642.55
报告期期末基金份额总额	4,202,305,694.80	5,473,103,966.25

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。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	红利再投	2014年4月14日	22,529.18	22,529.18	0.00%
2	红利再投	2014年4月28日	23,277.02	23,277.02	0.00%
3	红利再投	2014年5月12日	21,804.35	21,804.35	0.00%
4	红利再投	2014年5月26日	21,293.68	21,293.68	0.00%
5	红利再投	2014年6月9日	20,421.32	20,421.32	0.00%
6	红利再投	2014年6月23日	24,260.13	24,260.13	0.00%
合计			133,585.68	133,585.68	

注:1.本基金管理人本报告期内未运用固有资金投资本基金。
2.期间交易总份额为被动红利再投所得,非公司主动投资。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,840,762.49	0.11	10,000,200.00	0.10	3年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,840,762.49	0.11	10,000,200.00	0.10	-

§9 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录
1、中国证监会批准工银瑞信14天理财债券型发起式证券投资基金设立的文件;
2、《工银瑞信14天理财债券型发起式证券投资基金合同》;
3、《工银瑞信14天理财债券型发起式证券投资基金托管协议》;
4、基金管理人业务资格批件和营业执照;
5、基金托管人业务资格批件和营业执照;
6、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

10.2 存放地点
基金管理人或基金托管人住所。

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

工银瑞信睿智中证500指数分级证券投资基金

2014 第二季度 报告

2014年6月30日

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一四年七月十七日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年7月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	工银中证500指数(场内简称:工银500)		
交易代码	164809		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2012年1月31日		
报告期末基金份额总额	57,466,236.12份		
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。通过产品分级设置,为不同份额投资者提供具有差异化收益和风险特征的投资工具。		
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、成分股被限制投资等)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。本基金对标的指数的跟踪目标是:力争使得基金日收益率与业绩比较基准日收益率偏离度的年度平均值不超过0.35%,偏离度年化标准差不超过4%。		
业绩比较基准	中证500 指数收益率×95%+商业银行税后活期存款利率×5%		
风险收益特征	本基金属于股票型基金,其风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。此外,本基金作为指数型基金,采用完全复制策略,跟踪标的指数市场表现,目标为获取市场平均收益,是股票基金中处于中等风险水平的基金产品。本基金的分级设定则决定了不同份额具有不同的风险和收益特征。睿智A 份额具有低风险、低预期收益的特征;睿智B 份额具有高风险、高预期收益的特征。		
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司		
基金托管人	中国银行股份有限公司		
下属三级基金简称	工银500A	工银500B	工银500
下属三级基金交易代码	150055	150056	164809
下属三级基金报告期末基金份额总额	657,418.00份	986,128.00份	55,822,690.12份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年4月1日 - 2014年6月30日)
1.本期已实现收益	1,239,766.94
2.本期利润	1,386,375.65
3.加权平均基金份额本期利润	0.0236
4.期末基金资产净值	58,425,765.13
5.期末基金份额净值	1.0167

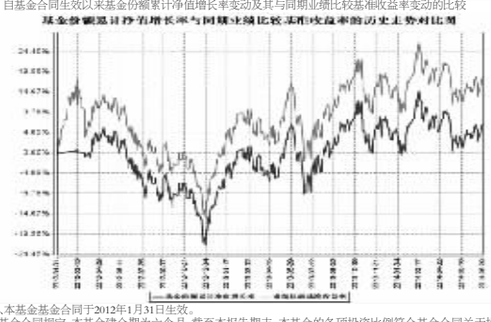
注:(1)上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
(2)"本期已实现收益"指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额;"本期利润"为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
(3)本基金已于2014年01月02日进行了基金份额拆算。
(4)所列数据截止到2014年6月30日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	2.19%	1.04%	2.11%	1.01%	0.08%	0.03%

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



注:1.本基金基金合同于2012年1月31日生效。
2.按基金合同规定,本基金建仓期为六个月,截至报告期末,本基金的各项投资比例符合基金合同关于投资范围、投资禁止行为与限制的规定;本基金投资于股票资产占基金资产净值的比例为90%-95%,其中标的指数成分股票、备选成分股票占基金资产净值的比例不低于90%;现金、债券资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产净值的比例为5%-10%,其中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5%。

3.3 其他指标
无。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
何江	指数投资部副总监,本基金的基金经理。	2012年1月31日	-	9	先后在北京方速信融科技有限公司担任高级分析师、金诚信用评估有限公司担任分析师;2005年加入工银瑞信,现任指数投资部副总监。曾任风险管理部投资风险管理业务主管;2011年5月25日至2013年7月22日担任工银上证央企ETF基金基金经理;2011年5月25日至今担任工银沪深300基金、工银深证红利ETF基金、工银深证红利ETF联接基金的基金经理;2012年1月31日至今担任工银中证500基金的基金经理;2012年10月25日至今担任工银深证100指数投资基金的基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了公平对待各类投资人,保护各类投资人利益,避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为,公司根据《证券投资基金法》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部规章,拟定了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》,对公司管理的各类资产的公平对待做了明确具体的规定,并规定对买卖股票、债券时候的价格和市场价格差距较大,可能存在操纵股价、利益输送等违法违规情况进行监控。本报告期,按照时间优先、价格优先的原则,本公司对满足限价条件且对同一证券有相同交易需求的基金等投资组合,均采用了系统中的公平交易模块进行操作,实现了公平交易;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未超过该证券当日成交量的5%。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内,本基金跟踪标的指数的日均偏离度为0.03%,偏离度年化标准差为1.00%。本基金跟踪误差产生的主要来源是:1)申购赎回的影响;2)成份股票的停牌;3)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

本报告期本基金净值增长率为2.19%,业绩比较基准收益率为2.11%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产的比例(%)
1	权益投资	54,489,950.61	92.53
	其中:股票	54,489,950.61	92.53
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	4,289,672.34	7.28
7	其他资产	108,137.86	0.18
8	合计	58,887,760.81	100.00

注:由于四舍五入的原因公允价值占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

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	997,346.02	1.71
B	采矿业	1,685,321.52	2.88
C	制造业	33,205,732.08	56.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,285,847.80	2.20
E	建筑业	1,475,181.84	2.52
F	批发和零售业	3,621,068.89	6.20
G	交通运输、仓储和邮政业	1,523,010.85	2.61
H	住宿和餐饮业	83,691.00	0.14
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,763,545.91	4.73
J	金融业	868,399.30	1.49
K	房地产业	3,950,244.01	6.76
L	租赁和商务服务业	835,884.76	1.43
M	科学研究和技术服务业	220,446.00	0.38
N	水利、环境和公共设施管理业	504,549.75	0.86
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	539,622.00	0.92
S	综合	361,637.60	0.62
	合计	53,921,529.33	92.29

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。

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	568,421.28	0.97
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	568,421.28	0.97

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。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

5.3.1 报告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前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600570	恒生电子	14,100	414,540.00	0.71
2	600587	新华医疗	3,911	291,565.05	0.50
3	002190	成飞集成	4,865	287,035.00	0.49
4	600557	康缘药业	9,960	285,852.00	0.49
5	600418	江淮汽车	27,900	285,696.00	0.49
6	000559	万向钱潮	27,246	280,088.88	0.48
7	600879	航天电子	23,660	278,714.80	0.48
8	000998	隆平高科	9,950	273,426.00	0.47
9	600312	平高电气	19,400	270,436.00	0.46
10	002022	科华生物	11,200	258,160.00	0.44

5.3.2 报告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前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002252	上海莱士	5,080	321,564.00	0.55
2	002167	东方锆业	12,252	136,487.28	0.23
3	002638	勤上光电	7,800	110,370.00	0.19

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细
本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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投资股指期货。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 本期国债期货投资评价
无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	11,350.93
2	应收证券清算款	95,586.56
3	应收股利	-
4	应收利息	876.50
5	应收申购款	323.87
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	108,137.86

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600418	江淮汽车	285,696.00	0.49	重大事项

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002252	上海莱士	321,564.00	0.55	重大事项
2	002167	东方锆业	136,487.28	0.23	重大事项
3	002638	勤上光电	110,370.00	0.19	重大事项

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分
无。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	工银500A	工银500B	工银500
报告期期初基金份额总额	895,126.00	1,342,690.00	57,858,963.28
报告期期间基金总申购份额	-	-	3,338,578.32
减:报告期期间基金总赎回份额	-	-	5,969,121.48
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-237,708.00	-356,562.00	594,270.00
报告期期末基金份额总额	657,418.00	986,128.00	55,822,690.12

注:拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额及定期折算调整份额,报告期末基金份额总额为三级份额之和。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况
无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录
1、中国证监会批准工银瑞信睿智中证500指数分级证券投资基金设立的文件;
2、《工银瑞信睿智中证500指数分级证券投资基金基金合同》;
3、《工银瑞信睿智中证500指数分级证券