

## 工银瑞信深证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金

### 2018 第二季度 报告

2018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  
报告送出日期：二〇一八年七月二十日

#### 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。  
基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年7月18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，基金资产净值亦不承诺保本，并可能承担波动风险。  
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2018年4月1日起至6月30日止。

#### 2 基金产品概况

基金名称	工银瑞信深证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金
交易代码	481013
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日期	2016年11月11日
跟踪标的名称	中证红利指数
跟踪标的指数	中证红利指数
业绩比较基准	中证红利指数收益率+1.0%
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

2.1.1 目标基金基本情况	跟踪标的名称	中证红利指数
基金名称	中证红利指数	
基金代码	399005	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日期	2009年11月30日	
基金管理人	中证指数有限公司	
基金托管人	中证指数有限公司	

2.1.2 目标基金产品说明	基金名称	中证红利指数
跟踪标的名称	中证红利指数	
跟踪标的指数	中证红利指数	
业绩比较基准	中证红利指数收益率+1.0%	

3.1 主要财务指标	单位:人民币元
主要财务指标	报告期(2018年4月1日至2018年6月30日)
1.本期基金份额净值增长率	10.1440%
2.本期基金份额净值增长率标准差	-0.9526%
3.本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率之差	-0.8747%
4.本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率之差的标准差	0.0779%

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.本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率之差,是指本基金本期收益率、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.所谓收益到账是指报告最后一日,无论该日是否为开放日或交易日的交易日。  
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

期间	净值增长率	业绩比较基准收益率	跟踪标的指数收益率	净值增长率与业绩比较基准收益率之差	净值增长率与跟踪标的指数收益率之差
过去三个月	-0.95%	1.09%	-0.85%	-1.42%	0.75%



注:1.本基金基金合同于2016年11月11日生效。  
2.根据基金合同规定,本基金合同生效前,本基金的投资比例符合基金合同的规定。本基金投资于目标ETF的资产比例不低于基金资产净值的90%,其中投资于中证红利指数的资产比例不低于90%。  
3.本基金投资于中国证监会允许基金投资的金融工具占基金资产的20%-10%。本基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金不投资权证、股指期货、期权及结构性理财产品,也不投资国债期货。

4.1 基金管理人	基金管理人	基金托管人	基金销售机构
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
基金销售机构	工银瑞信基金管理有限公司	基金销售机构	中国农业银行股份有限公司

4.2 管理人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、招募说明书等基金法律文件的约定,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 公平交易专项说明  
为了公平对待各类投资者,保护各类型投资人利益,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制度,制定了《公平交易管理制度》,对公平交易制度的公平对待原则进行了明确的规定,并制定了买卖策略、债券时点的价格和价格策略,尽可能在授权、利益输送等违法违规风险进行控制。本报告期,按照授权、价格优先的原则,本公司对满足授权条件的且与一逆非同时交易需求的基金投资组合,均采用了系统中的公平交易模块进行交易,实现了公平交易;没有出现清算不到位的现象,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关联交易及交叉交易。

4.3 公平交易专项说明	基金管理人	基金托管人	基金销售机构
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
基金销售机构	工银瑞信基金管理有限公司	基金销售机构	中国农业银行股份有限公司

5.1 主要财务指标	主要财务指标	报告期(2018年4月1日至2018年6月30日)
1.本期基金份额净值增长率	10.1440%	
2.本期基金份额净值增长率标准差	-0.9526%	
3.本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率之差	-0.8747%	
4.本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率之差的标准差	0.0779%	



注:1.本基金基金合同于2016年11月11日生效。  
2.根据基金合同规定,本基金合同生效前,本基金的投资符合基金合同关于投资范围及投资比例的规定,本基金投资于目标ETF的资产比例不低于基金资产净值的90%,其中投资于中证红利指数的资产比例不低于90%。  
3.本基金投资于中国证监会允许基金投资的金融工具占基金资产的20%-10%。本基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金不投资权证、股指期货、期权及结构性理财产品,也不投资国债期货。

4.1 基金管理人	基金管理人	基金托管人	基金销售机构
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
基金销售机构	工银瑞信基金管理有限公司	基金销售机构	中国农业银行股份有限公司

4.2 管理人报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	基金管理人	基金托管人	基金销售机构
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
基金销售机构	工银瑞信基金管理有限公司	基金销售机构	中国农业银行股份有限公司

4.3 公平交易专项说明  
4.3.1 公平交易专项说明  
为了公平对待各类投资者,保护各类型投资人利益,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制度,制定了《公平交易管理制度》,对公平交易制度的公平对待原则进行了明确的规定,并制定了买卖策略、债券时点的价格和价格策略,尽可能在授权、利益输送等违法违规风险进行控制。本报告期,按照授权、价格优先的原则,本公司对满足授权条件的且与一逆非同时交易需求的基金投资组合,均采用了系统中的公平交易模块进行交易,实现了公平交易;没有出现清算不到位的现象,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关联交易及交叉交易。

4.3 公平交易专项说明	基金管理人	基金托管人	基金销售机构
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
基金销售机构	工银瑞信基金管理有限公司	基金销售机构	中国农业银行股份有限公司

## 上证中央企业50交易型开放式指数证券投资基金

### 2018 第二季度 报告

2018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  
报告送出日期：二〇一八年七月二十日

#### 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。  
基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年7月18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，基金资产净值亦不承诺保本，并可能承担波动风险。  
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2018年4月1日起至6月30日止。

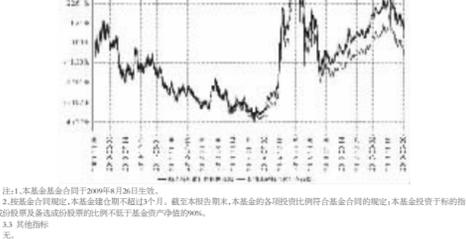
#### 2 基金产品概况

基金名称	上证中央企业50交易型开放式指数证券投资基金
交易代码	501000
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日期	2016年7月16日
跟踪标的名称	上证中央企业50指数
跟踪标的指数	上证中央企业50指数
业绩比较基准	上证中央企业50指数收益率+1.0%
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

2.1.1 目标基金基本情况	跟踪标的名称	上证中央企业50指数
基金名称	上证中央企业50指数	
基金代码	000001	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日期	2016年7月16日	
基金管理人	上证中央企业50指数	
基金托管人	上证中央企业50指数	

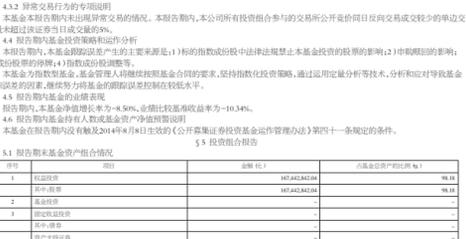
2.1.2 目标基金产品说明	基金名称	上证中央企业50指数
跟踪标的名称	上证中央企业50指数	
跟踪标的指数	上证中央企业50指数	
业绩比较基准	上证中央企业50指数收益率+1.0%	

3.1 主要财务指标	单位:人民币元
主要财务指标	报告期(2018年4月1日至2018年6月30日)
1.本期基金份额净值增长率	1.9710%
2.本期基金份额净值增长率标准差	-1.0441%
3.本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率之差	-1.0149%
4.本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率之差的标准差	1.0176%



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.本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率之差,是指本基金本期收益率、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.所谓收益到账是指报告最后一日,无论该日是否为开放日或交易日的交易日。  
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

期间	净值增长率	业绩比较基准收益率	跟踪标的指数收益率	净值增长率与业绩比较基准收益率之差	净值增长率与跟踪标的指数收益率之差
过去三个月	-0.95%	1.09%	-0.85%	-1.42%	0.75%



4.1 基金管理人	基金管理人	基金托管人	基金销售机构
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
基金销售机构	工银瑞信基金管理有限公司	基金销售机构	中国农业银行股份有限公司

4.2 管理人报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	基金管理人	基金托管人	基金销售机构
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
基金销售机构	工银瑞信基金管理有限公司	基金销售机构	中国农业银行股份有限公司

4.3 公平交易专项说明  
4.3.1 公平交易专项说明  
为了公平对待各类投资者,保护各类型投资人利益,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制度,制定了《公平交易管理制度》,对公平交易制度的公平对待原则进行了明确的规定,并制定了买卖策略、债券时点的价格和价格策略,尽可能在授权、利益输送等违法违规风险进行控制。本报告期,按照授权、价格优先的原则,本公司对满足授权条件的且与一逆非同时交易需求的基金投资组合,均采用了系统中的公平交易模块进行交易,实现了公平交易;没有出现清算不到位的现象,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关联交易及交叉交易。

4.3 公平交易专项说明	基金管理人	基金托管人	基金销售机构
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
基金销售机构	工银瑞信基金管理有限公司	基金销售机构	中国农业银行股份有限公司

5.1 主要财务指标	主要财务指标	报告期(2018年4月1日至2018年6月30日)
1.本期基金份额净值增长率	1.9710%	
2.本期基金份额净值增长率标准差	-1.0441%	
3.本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率之差	-1.0149%	
4.本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率之差的标准差	1.0176%	



注:1.本基金基金合同于2016年7月16日生效。  
2.根据基金合同规定,本基金合同生效前,本基金的投资符合基金合同关于投资范围及投资比例的规定,本基金投资于目标ETF的资产比例不低于基金资产净值的90%。  
3.本基金投资于中国证监会允许基金投资的金融工具占基金资产的20%-10%。本基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金不投资权证、股指期货、期权及结构性理财产品,也不投资国债期货。

跟踪标的名称	上证中央企业50指数
基金名称	上证中央企业50指数
基金代码	000001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日期	2016年7月16日
基金管理人	上证中央企业50指数
基金托管人	上证中央企业50指数

2.1.1 目标基金基本情况	跟踪标的名称	上证中央企业50指数
基金名称	上证中央企业50指数	
基金代码	000001	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日期	2016年7月16日	
基金管理人	上证中央企业50指数	
基金托管人	上证中央企业50指数	

2.1.2 目标基金产品说明	基金名称	上证中央企业50指数
跟踪标的名称	上证中央企业50指数	
跟踪标的指数	上证中央企业50指数	
业绩比较基准	上证中央企业50指数收益率+1.0%	

3.1 主要财务指标	单位:人民币元
主要财务指标	报告期(2018年4月1日至2018年6月30日)
1.本期基金份额净值增长率	1.9710%
2.本期基金份额净值增长率标准差	-1.0441%
3.本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率之差	-1.0149%
4.本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率之差的标准差	1.0176%



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.本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率之差,是指本基金本期收益率、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.所谓收益到账是指报告最后一日,无论该日是否为开放日或交易日的交易日。  
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

期间	净值增长率	业绩比较基准收益率	跟踪标的指数收益率	净值增长率与业绩比较基准收益率之差	净值增长率与跟踪标的指数收益率之差
过去三个月	-0.95%	1.09%	-0.85%	-1.42%	0.75%



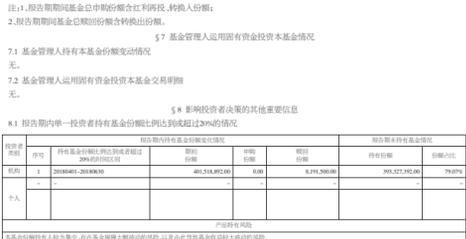
4.1 基金管理人	基金管理人	基金托管人	基金销售机构
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司	基金托管人	中国农业银行股份有限公司
基金销售机构	工银瑞信基金管理有限公司	基金销售机构	中国农业银行股份有限公司

4.2 管理人报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	基金管理人	基金托管人	基金销售机构
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
基金销售机构	工银瑞信基金管理有限公司	基金销售机构	中国农业银行股份有限公司

4.3 公平交易专项说明  
4.3.1 公平交易专项说明  
为了公平对待各类投资者,保护各类型投资人利益,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制度,制定了《公平交易管理制度》,对公平交易制度的公平对待原则进行了明确的规定,并制定了买卖策略、债券时点的价格和价格策略,尽可能在授权、利益输送等违法违规风险进行控制。本报告期,按照授权、价格优先的原则,本公司对满足授权条件的且与一逆非同时交易需求的基金投资组合,均采用了系统中的公平交易模块进行交易,实现了公平交易;没有出现清算不到位的现象,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关联交易及交叉交易。

4.3 公平交易专项说明	基金管理人	基金托管人	基金销售机构
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
基金销售机构	工银瑞信基金管理有限公司	基金销售机构	中国农业银行股份有限公司

5.1 主要财务指标	主要财务指标	报告期(2018年4月1日至2018年6月30日)
1.本期基金份额净值增长率	1.9710%	
2.本期基金份额净值增长率标准差	-1.0441%	
3.本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率之差	-1.0149%	
4.本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率之差的标准差	1.0176%	



注:1.本基金基金合同于2016年7月16日生效。  
2.根据基金合同规定,本基金合同生效前,本基金的投资符合基金合同关于投资范围及投资比例的规定,本基金投资于目标ETF的资产比例不低于基金资产净值的90%。  
3.本基金投资于中国证监会允许基金投资的金融工具占基金资产的20%-10%。本基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金不投资权证、股指期货、期权及结构性理财产品,也不投资国债期货。

4.3 公平交易专项说明	基金管理人	基金托管人	基金销售机构
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
基金销售机构	工银瑞信基金管理有限公司	基金销售机构	中国农业银行股份有限公司