

工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金 2018 年半年度报告摘要

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：国信证券股份有限公司

送出日期：二〇一八年八月二十四日

§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。

基金托管人国信证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 22 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	工银中证传媒指数分级		
场内简称	传媒母基		
基金主代码	164818		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015 年 5 月 21 日		
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司		
基金托管人	国信证券股份有限公司		
报告期末基金份额总额	120,623,972.41 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	2015 年 5 月 29 日		
下属分级基金的基金简称	传媒 A 级	传媒 B 级	传媒母基
下属分级基金的交易代码	150247	150248	164818
报告期末下属分级基金份额总额	18,046,642.00 份	18,046,642.00 份	84,530,688.41 份

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。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。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	中证传媒指数收益率×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，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型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，跟踪标的指数表现，目标为获取指数的平均收益，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。工银传媒 A 份额具有

	低风险、低预期收益的特征；工银传媒 B 份额具有高风险、高预期收益的特征。
--	---------------------------------------

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	国信证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	朱碧艳	孙常新
	联系电话	400-811-9999	0755-22940646
	电子邮箱	customerservice@icbccs.com.cn	03356@guosen.com.cn
客户服务电话		400-811-9999	0755-22940701
传真		010-66583158	0755-22940165

2.4 信息披露方式

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018 年 1 月 1 日 - 2018 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-65,901,648.38
本期利润	-32,067,027.10
加权平均基金份额本期利润	-0.1269
本期基金份额净值增长率	-18.04%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	-2.7762
期末基金资产净值	124,176,539.20
期末基金份额净值	1.0295

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 2015 年 5 月 21 日。

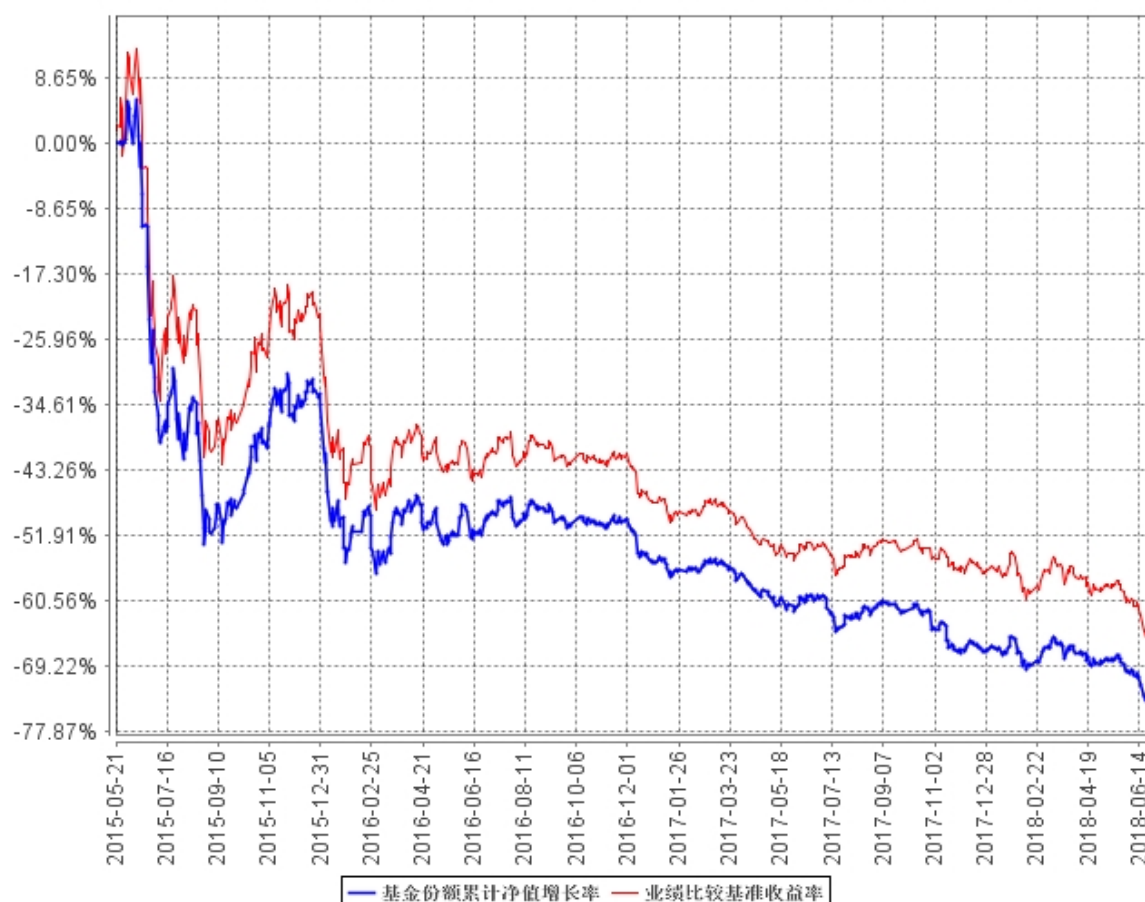
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去一个月	-10.96%	2.00%	-9.58%	1.95%	-1.38%	0.05%
过去三个月	-19.14%	1.52%	-17.93%	1.50%	-1.21%	0.02%
过去六个月	-18.04%	1.58%	-17.28%	1.55%	-0.76%	0.03%
过去一年	-31.94%	1.41%	-22.89%	1.28%	-9.05%	0.13%
过去三年	-63.94%	1.93%	-55.89%	1.81%	-8.05%	0.12%
自基金合同 生效起至今	-72.83%	2.02%	-63.90%	1.93%	-8.93%	0.09%

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 2015 年 5 月 21 日生效。

2、按基金合同规定，本基金建仓期为 6 个月。截至报告期末，本基金的各项投资比例符合基金合同关于投资范围及投资限制的规定：股票资产投资比例不低于基金资产的 90%，其中投资于中证传媒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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。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。

§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 2018 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、工银瑞信增强收益债券型证券投资基金、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 60 天理财债券型证券投资基金、工银瑞信金融地产股票型证券投资基金、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	2015 年 5 月 21 日	—	8	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

					<p>日至今，担任工银深证 100 指数分级基金（自 2018 年 4 月 17 日起变更为工银瑞信中证京津冀协同发展主题指数证券投资基金（LOF））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 2018 年 5 月 4 日，担任工银瑞信深证成份指数证券投资基金（LOF）基金经理；2018 年 6 月 15 日，担任工银瑞信印度市场证券投资基金（LOF）基金经理。</p>
--	--	--	--	--	--

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内，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）指数成份股调整等。

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-18.04%，业绩比较基准收益率为-17.28%。

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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.6.1.1 职责分工

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

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

4.6.1.2 专业胜任能力及相关工作经历

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

4.6.2 基金经理参与或决定估值的程度

本公司基金经理参与讨论估值原则及方法，但不参与最终估值决策。

4.6.3 参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.6.4 已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未实施利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

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

托管人声明，在本报告期间，本基金托管人——国信证券股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，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信息的真实、准确和完整发表意见

基金管理人本年度报告中的财务指标、净值表现、投资组合报告等内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§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：工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款		11,366,799.64	12,315,981.68
结算备付金		-	83,573.18
存出保证金		128,175.98	167,418.74
交易性金融资产		114,016,762.96	197,424,439.68
其中：股票投资		114,016,762.96	197,424,439.68
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		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		-	67,306.64
应收利息		2,522.13	3,041.51
应收股利		-	-
应收申购款		95,594.16	81,535.56
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		125,609,854.87	210,143,296.99
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 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		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		484.09	-
应付赎回款		967,268.22	477,738.50
应付管理人报酬		117,782.28	173,942.88
应付托管费		23,556.43	34,788.59
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		65,233.70	57,541.04

应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		258,990.95	407,289.32
负债合计		1,433,315.67	1,151,300.33
所有者权益：			
实收基金		452,121,835.25	630,408,716.51
未分配利润		-327,945,296.05	-421,416,719.85
所有者权益合计		124,176,539.20	208,991,996.66
负债和所有者权益总计		125,609,854.87	210,143,296.99

注：1、本基金基金合同生效日为 2015 年 5 月 21 日。

2、报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额总额 120,623,972.41 份。其中，传媒母基金份额净值

1.0295 元，基金份额为 84,530,688.41 份； 传媒 A 级份额净值 1.0012 元，基金份额为

18,046,642.00 份； 传媒 B 级份额净值 1.0577 元，基金份额为 18,046,642.00 份。

6.2 利润表

会计主体：工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		-30,342,602.93	-73,235,203.04
1.利息收入		65,836.83	264,008.18
其中：存款利息收入		65,836.83	264,008.18
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）		-64,633,355.27	-127,706,444.68
其中：股票投资收益		-65,129,822.53	-128,660,249.14
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		496,467.26	953,804.46

3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		33,834,621.28	53,085,822.05
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		390,294.23	1,121,411.41
减：二、费用		1,724,424.17	5,216,051.59
1. 管理人报酬		988,950.96	2,988,672.44
2. 托管费		197,790.20	597,734.51
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		230,327.22	1,319,836.33
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		307,355.79	309,808.31
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-32,067,027.10	-78,451,254.63
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-32,067,027.10	-78,451,254.63

注：本基金基金合同生效日为 2015 年 5 月 21 日。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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）	630,408,716.51	-421,416,719.85	208,991,996.66
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-32,067,027.10	-32,067,027.10
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）	-178,286,881.26	125,538,450.90	-52,748,430.36
其中：1.基金申购款	213,835,160.54	-143,601,987.02	70,233,173.52
2.基金赎回款	-392,122,041.80	269,140,437.92	-122,981,603.88

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）	452,121,835.25	-327,945,296.05	124,176,539.20
项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	1,477,631,915.62	-818,540,051.78	659,091,863.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-78,451,254.63	-78,451,254.63
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）	-781,146,732.60	478,554,483.37	-302,592,249.23
其中：1.基金申购款	801,061,443.85	-458,828,546.12	342,232,897.73
2.基金赎回款	-1,582,208,176.45	937,383,029.49	-644,825,146.96
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）	696,485,183.02	-418,436,823.04	278,048,359.98

注：本基金基金合同生效日为 2015 年 5 月 21 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：

_____ 郭特华	_____ 赵紫英	_____ 关亚君
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金（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[2015]595 号文《关于准予工银瑞信中证传媒指数分

级证券投资基金注册的批复》的注册，由工银瑞信基金管理有限公司社会公开募集，基金合同于 2015 年 5 月 21 日正式生效，首次设立募集规模为 1,243,869,392.48 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为工银瑞信基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为国信证券股份有限公司。

本基金的基金份额包括工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金之基础份额（简称“工银传媒份额”）、工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金之 A 份额（简称“工银传媒 A 份额”）和工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金之 B 份额（简称“工银传媒 B 份额”）。其中，工银传媒 A 份额、工银传媒 B 份额的基金份额配比始终保持 1:1 的比例不变。本基金合同生效后，工银传媒份额可办理场外与场内申购和赎回；工银传媒 A 份额、工银传媒 B 份额只上市交易，不可单独申购和赎回。基金管理人将根据基金合同的约定办理场内工银传媒份额与工银传媒 A 份额、工银传媒 B 份额之间的份额配对转换业务。基金管理人按照基金合同规定在基金份额折算日对基金份额进行折算。折算后基金运作方式及工银传媒 A 份额与工银传媒 B 份额配比不变。

本基金在存续期内的每个会计年度（除基金合同生效日所在会计年度外）1 月份的第一个工作日为基金份额定期折算基准日，本基金将对登记在册的工银中证传媒份额、工银中证传媒 A 份额进行基金的定期份额折算。但基金合同生效日至第 1 个定期份额折算基准日不足 6 个月的，则该年度可不进行定期份额折算；定期份额折算基准日前 3 个月内发生过不定期份额折算的，则该年度可不进行定期份额折算。

工银传媒 A 份额和工银传媒 B 份额按照基金合同规定的参考净值计算规则进行计算，对工银传媒 A 份额的应得收益进行定期份额折算，每 2 份工银传媒份额将按 1 份工银传媒 A 份额获得约定应得收益的新增折算份额。在基金份额折算前与折算后，工银传媒 A 份额和工银传媒 B 份额的份额配比保持 1:1 的比例。对于工银传媒 A 份额的约定年化应得收益，即除基金合同另有约定外，工银传媒 A 份额每个基金份额定期折算基准日份额参考净值超过人民币 1.0000 元的部分，将折算为场内工银传媒份额分配给工银传媒 A 份额持有人。工银传媒份额持有人持有的每 2 份工银传媒份额将按 1 份工银传媒 A 份额获得新增工银传媒份额的分配。持有场外工银传媒份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外工银传媒份额的分配；持有场内工银传媒份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内工银传媒份额的分配。经过上述份额折算，工银传媒 A 份额和工银传媒 B 份额的基金份额（参考）净值将相应调整。

本基金在存续期内，本基金将在每个工作日对工银传媒基金份额净值、工银传媒 A 份额和工银传媒 B 份额参考净值分别计算，如工银传媒份额的基金净值达到人民币 1.5000 元或工银传媒 B 份额的基金份额参考净值达到人民币 0.2500 元时进行份额折算。当工银传媒份额的基金份额

净值达到人民币 1.5000 元时，本基金即可确定折算基准日，并在折算基准日，本基金将对登记在册的工银传媒份额、工银传媒 A 份额和工银传媒 B 份额分别进行折算。份额折算后本基金将确保工银传媒 A 份额和工银传媒 B 份额的比例为 1:1；份额折算后工银传媒份额的基金份额净值、工银传媒 B 份额的参考净值均调整为人民币 1.0000 元。当工银传媒 B 份额的参考净值达到人民币 0.2500 元时，本基金即可确定折算基准日，并在折算基准日，对基金份额折算基准日登记在册的工银传媒份额、工银传媒 A 份额和工银传媒 B 份额进行分别折算。份额折算后工银传媒份额基金份额净值、工银传媒 A 和工银传媒 B 份额的基金份额参考净值均调整为人民币 1.0000 元；折算后将保持工银传媒 A 和工银传媒 B 份额的比例为 1:1。

工银传媒份额的场外份额经折算后的份额数采用四舍五入的方式保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产；工银传媒份额的场内份额经折算后的份额数取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。工银传媒 A（或工银传媒 B）的新增工银传媒场内份额取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。

本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具，包括中证传媒指数的成份股及其备选成份股、首发和增发新股、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））、资产支持证券、债券回购、股指期货、权证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）。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%，其中投资于中证传媒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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。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：中证传媒指数收益率 $\times 95\%$ + 金融机构人民币活期存款基准利率（税后） $\times 5\%$ 。

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

2 号《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。

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

本基金 2018 年上半年度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 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

1 印花税

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转

让，暂免征收印花税。

2 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，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。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 7%、3%和 2%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[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税;

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

4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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、基金销售机构
国信证券股份有限公司	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

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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
国信证券股份有限公司	156,915,972.12	100.00%	909,963,484.78	100.00%

6.4.8.1.2 债券交易

无。

6.4.8.1.3 债券回购交易

无。

6.4.8.1.4 权证交易

无。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30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
国信证券股份 有限公司	111,614.32	100.00%	65,233.70	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30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
国信证券股份 有限公司	647,256.71	100.00%	647,256.71	100.00%

6.4.8.2 关联方报酬**6.4.8.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6 月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30 日
当期发生的基金应支付 的管理费	988,950.96	2,988,672.44
其中：支付销售机构的 客户维护费	73,967.07	52,637.96

注：基金管理人的基金管理费按基金资产净值的1.0%年费率计提。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的1.0%年费率计提。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 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	197,790.20	597,734.51

注：基金托管人的基金托管费按基金资产净值的 0.2% 年费率计提。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。

6.4.8.2.3 销售服务费

无。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.8.4.2 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。

6.4.8.5 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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 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
国信证券股份有 限公司	11,366,799.64	62,976.22	16,031,769.25	252,941.33

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末（2018 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券**6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

无。

6.4.9.2 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
002739	万达电影	2017 年 7 月 4 日	重大事项	38.03	-	-	171,823	11,555,098.64	6,534,428.69	指数法估值
000793	华闻传媒	2018 年 2 月 1 日	重大事项	6.91	2018 年 7 月 16 日	7.56	597,208	6,467,200.30	4,126,707.28	-

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 2018 年 6 月 30 日对资产净值和本期净利润的影响均为人民币-3,297,080.15 元。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购**

无。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.10 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	114,016,762.96	90.77
	其中：股票	114,016,762.96	90.77
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	11,366,799.64	9.05
7	其他各项资产	226,292.27	0.18
8	合计	125,609,854.87	100.00

注：由于四舍五入的原因金额占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	1,209,480.30	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	1,934,788.24	1.56
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	64,479,694.40	51.93
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—

L	租赁和商务服务业	12,537,686.94	10.10
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	32,527,471.31	26.19
S	综合	-	-
	合计	112,689,121.19	90.75

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 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（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	962,981.05	0.78
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	108,893.38	0.09
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	176,375.84	0.14
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	79,391.50	0.06
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	1,327,641.77	1.07

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。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细**7.3.1 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前十名股票投资明细**

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	002027	分众传媒	1,144,902	10,956,712.14	8.82
2	300059	东方财富	766,106	10,097,277.08	8.13
3	002739	万达电影	171,823	6,534,428.69	5.26
4	000503	国新健康	152,273	4,839,235.94	3.90
5	600637	东方明珠	279,651	4,211,544.06	3.39
6	000793	华闻传媒	597,208	4,126,707.28	3.32
7	300017	网宿科技	309,207	3,311,606.97	2.67
8	002558	巨人网络	128,680	3,060,010.40	2.46
9	300383	光环新网	214,414	2,875,291.74	2.32
10	000839	中信国安	581,197	2,749,061.81	2.21

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于公司网站的半年度报告正文。

7.3.2 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前五名股票投资明细

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	300750	宁德时代	5,130	369,154.80	0.30
2	300454	深信服	1,604	176,375.84	0.14
3	002925	盈趣科技	3,052	169,019.76	0.14
4	300747	锐科激光	1,543	123,995.48	0.10
5	300504	天邑股份	3,062	120,734.66	0.10

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于公司网站的半年度报告正文。

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	002027	分众传媒	4,398,214.60	2.10
2	601360	三六零	3,444,564.00	1.65
3	300059	东方财富	2,997,463.40	1.43
4	300182	捷成股份	2,579,318.00	1.23
5	300413	快乐购	2,228,024.72	1.07
6	002555	三七互娱	2,031,094.00	0.97
7	000503	国新健康	1,674,560.30	0.80
8	600804	鹏博士	1,456,178.00	0.70
9	000839	中信国安	1,455,124.00	0.70
10	600637	东方明珠	1,434,664.12	0.69
11	300459	金科文化	1,380,581.29	0.66
12	300315	掌趣科技	1,356,816.00	0.65
13	002558	巨人网络	1,228,853.00	0.59
14	300017	网宿科技	1,144,567.00	0.55
15	300418	昆仑万维	1,128,297.00	0.54
16	300027	华谊兄弟	1,061,941.00	0.51
17	300383	光环新网	962,053.00	0.46
18	600977	中国电影	792,166.00	0.38
19	002195	二三四五	778,149.00	0.37
20	002624	完美世界	774,618.02	0.37

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票；

2、买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300104	乐视网	10,534,401.54	5.04
2	002027	分众传媒	10,263,258.71	4.91
3	600804	鹏博士	7,778,051.99	3.72
4	300059	东方财富	7,023,437.00	3.36
5	000503	国新健康	3,938,339.00	1.88
6	600637	东方明珠	3,402,293.10	1.63
7	000839	中信国安	2,687,276.00	1.29
8	002558	巨人网络	2,511,738.40	1.20
9	300017	网宿科技	2,448,992.17	1.17
10	002400	省广集团	2,349,142.32	1.12
11	600936	广西广电	2,328,823.00	1.11
12	300027	华谊兄弟	2,090,835.00	1.00
13	002624	完美世界	2,001,575.00	0.96
14	600977	中国电影	1,912,604.15	0.92
15	002439	启明星辰	1,896,526.00	0.91
16	300058	蓝色光标	1,776,703.00	0.85
17	300315	掌趣科技	1,727,091.00	0.83
18	002195	二三四五	1,691,954.00	0.81
19	300383	光环新网	1,627,645.02	0.78
20	600986	科达股份	1,506,452.00	0.72

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	52,679,961.36
卖出股票收入（成交）总额	104,792,436.83

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的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。

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、处罚的投资决策程序说明：

1、分众传媒

本报告期，本基金持有分众传媒，其发行主体因部分临时报告信息未披露、披露不及时、不完整，2015 年年报信息披露存在遗漏、未在股东大会授权范围内购买银行理财产品等违规行为，被中国证监会广东监管局采取出具警示函的监管措施。

本基金对上述股票的投资属于跟踪标的指数的被动投资，投资决策流程符合基金管理人的制度要求。

2、网宿科技

本报告期，本基金持有网宿科技，其发行主体因 未及时披露购买理财产品事项，被中国证券监督管理委员会上海监管局采取出具警示函的监管措施。

本基金对上述股票的投资属于跟踪标的指数的被动投资，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	128,175.98
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,522.13
5	应收申购款	95,594.16
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	226,292.27

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**7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

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	002739	万达电影	6,534,428.69	5.26	重大事项
2	000793	华闻传媒	4,126,707.28	3.32	重大事项

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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
传媒 A 级	447	40,372.80	3,564,273.00	19.75%	14,482,369.00	80.25%
传媒 B 级	4,468	4,039.09	2,489,519.00	13.79%	15,557,123.00	86.21%
传媒母基	12,710	6,650.72	4,741,922.49	5.61%	79,788,765.92	94.39%
合计	17,625	6,843.91	10,795,714.49	8.95%	109,828,257.92	91.05%

8.2 期末上市基金前十名持有人

传媒 A 级

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中国银河证券股份有限公司	2,442,873.00	13.54%
2	傅喜元	2,232,208.00	12.37%
3	李星影	1,037,231.00	5.75%
4	王回生	756,854.00	4.19%
5	高明桂	640,620.00	3.55%
6	祁丽君	632,668.00	3.51%
7	凌岗	567,463.00	3.14%
8	深圳德威资本投资管理有限公司—德威一中量投尊享 1 号私募基金	457,897.00	2.54%
9	中量投资资产管理有限公司—中量投资量化多策略 1 号私募基金	457,897.00	2.54%
10	刘广军	440,000.00	2.44%

传媒 B 级

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中国银河证券股份有限公司	1,471,219.00	8.15%
2	郑英勇	356,587.00	1.98%
3	李健祥	335,468.00	1.86%
4	释海璋	323,691.00	1.79%
5	高春	317,673.00	1.76%

6	陈志伟	277,505.00	1.54%
7	吴美生	257,833.00	1.43%
8	斯培华	256,255.00	1.42%
9	焦宝玉	245,789.00	1.36%
10	王回生	208,000.00	1.15%

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。

8.3 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	传媒 A 级	0.00	0.00%
	传媒 B 级	0.00	0.00%
	传媒母基	131,046.06	0.16%
	合计	131,046.06	0.11%

8.4 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	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持有本开放式基金	传媒 A 级	0
	传媒 B 级	0
	传媒母基	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	传媒 A 级	0
	传媒 B 级	0
	传媒母基	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	传媒 A 级	传媒 B 级	传媒母基
基金合同生效日（2015 年 5 月 21 日）基金份额总额	531,812,278.00	531,812,278.00	180,244,836.48
本报告期期初基金份额总额	67,346,464.00	67,346,464.00	119,010,353.95
本报告期基金总申购份额	-	-	87,934,408.44
减:本报告期基金总赎回份额	-	-	153,769,324.20
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-49,299,822.00	-49,299,822.00	31,355,250.22
本报告期期末基金份额总额	18,046,642.00	18,046,642.00	84,530,688.41

注：1、拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额及折算调整份额，报告期末基金份额总额为三级份额之和；

2、报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额；

3、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 2018 年 4 月 9 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》，江明波先生自 2018 年 4 月 4 日起不再担任工银瑞信基金管理有限公司副总经理。

2、基金托管人：

无。

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

本报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	
国信证券	2	156,915,972.12	100.00%	111,614.32	100.00%	—

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、个股分析的报告及量化、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。

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	成交金额	占当期权证成交总额的

		例		成交总额 的比例		比例
国信证券	-	-	-	-	-	-

§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

1、根据《工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金基金合同》的规定，基金定期份额折算基准日为每个会计年度第一个工作日。工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金在 2018 年 1 月 2 日办理了定期份额折算业务，详见基金管理人在指定媒介发布的公告。

2、根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法律法规的要求，基金管理人经与基金托管人协商一致，对本基金基金合同、托管协议的有关条款进行了修改，修改后的基金合同、托管协议自 2018 年 4 月 1 日起生效。详见基金管理人在指定媒介发布的公告。

3、根据《工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金基金合同》的规定，工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金以 2018 年 6 月 22 日为基准日办理了不定期份额折算业务，详见基金管理人在指定媒介发布的公告。