

工银瑞信信息产业股票型证券投资基金 2014 年年度报告摘要

2014 年 12 月 31 日

基金管理人：工银瑞信基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：二〇一五年三月三十日

§ 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 2015 年 3 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2014 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	工银信息产业股票
基金主代码	000263
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 11 月 11 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	1,908,066,104.27 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	分析信息产业的变化趋势和新技术的发展方向，前瞻性地把握信息产业内通过研发不断创造出新的市场需求，并通过选择具有领先优势、创新能力及成长潜力良好的上市公司进行投资，在控制投资风险的同时，力争通过主动管理实现超越业绩基准的收益。
投资策略	本基金的资产配置策略主要是通过对宏观经济周期运行规律的研究，基于定量与定性相结合的宏观及市场分析，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例，规避系统性风险。
业绩比较基准	80%×中证 TMT 产业主题指数收益率+20%×上证国债指数收益率
风险收益特征	本基金是股票型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金、债券型基金与混合型基金，属于风险水平较高的基金。本基金主要投资于信息产业股票基金，其风险高于全市场范围内投资的股票型基金。

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	林葛
	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

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.icbccs.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2014 年	2013 年 11 月 11 日(基金合同生效日)-2013 年 12 月 31 日
本期已实现收益	263,416,386.57	749,114.12
本期利润	430,260,665.76	1,052,766.72
加权平均基金份额本期利润	0.6735	0.0052
本期基金份额净值增长率	64.31%	0.60%
3.1.2 期末数据和指标	2014 年末	2013 年末
期末可供分配基金份额利润	0.3785	0.0038
期末基金资产净值	3,154,654,285.03	157,755,593.54
期末基金份额净值	1.653	1.006

注：1、所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、本基金基金合同生效日为 2013 年 11 月 11 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

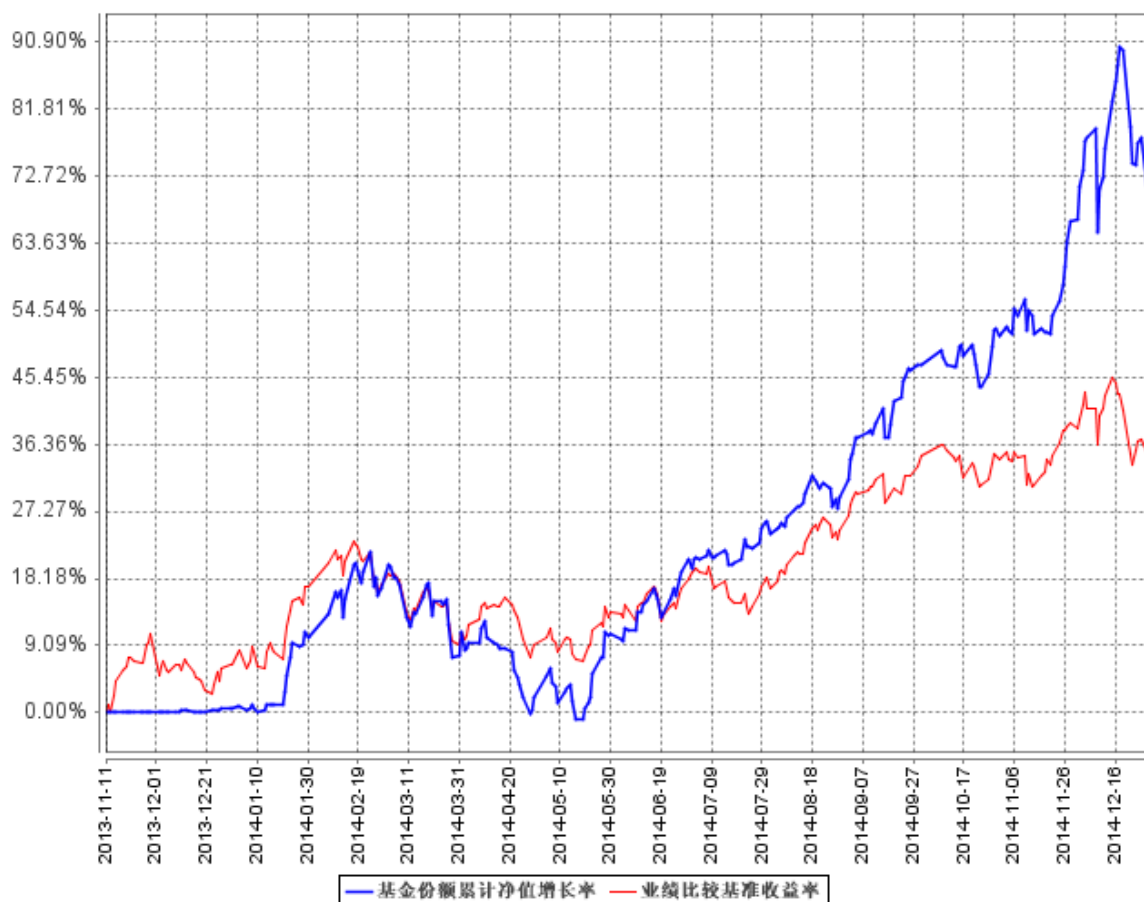
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	12.45%	2.03%	-1.47%	1.28%	13.92%	0.75%
过去六个月	36.84%	1.56%	12.67%	1.09%	24.17%	0.47%
过去一年	64.31%	1.57%	24.86%	1.19%	39.45%	0.38%
自基金合同生效起至今	65.30%	1.47%	32.92%	1.21%	32.38%	0.26%

注：1、本基金的业绩比较基准为： $80\% \times \text{中证 TMT 产业主题指数收益率} + 20\% \times \text{上证国债指数收益率}$ ，每日进行再平衡过程；

2、本基金基金合同生效日为 2013 年 11 月 11 日。

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

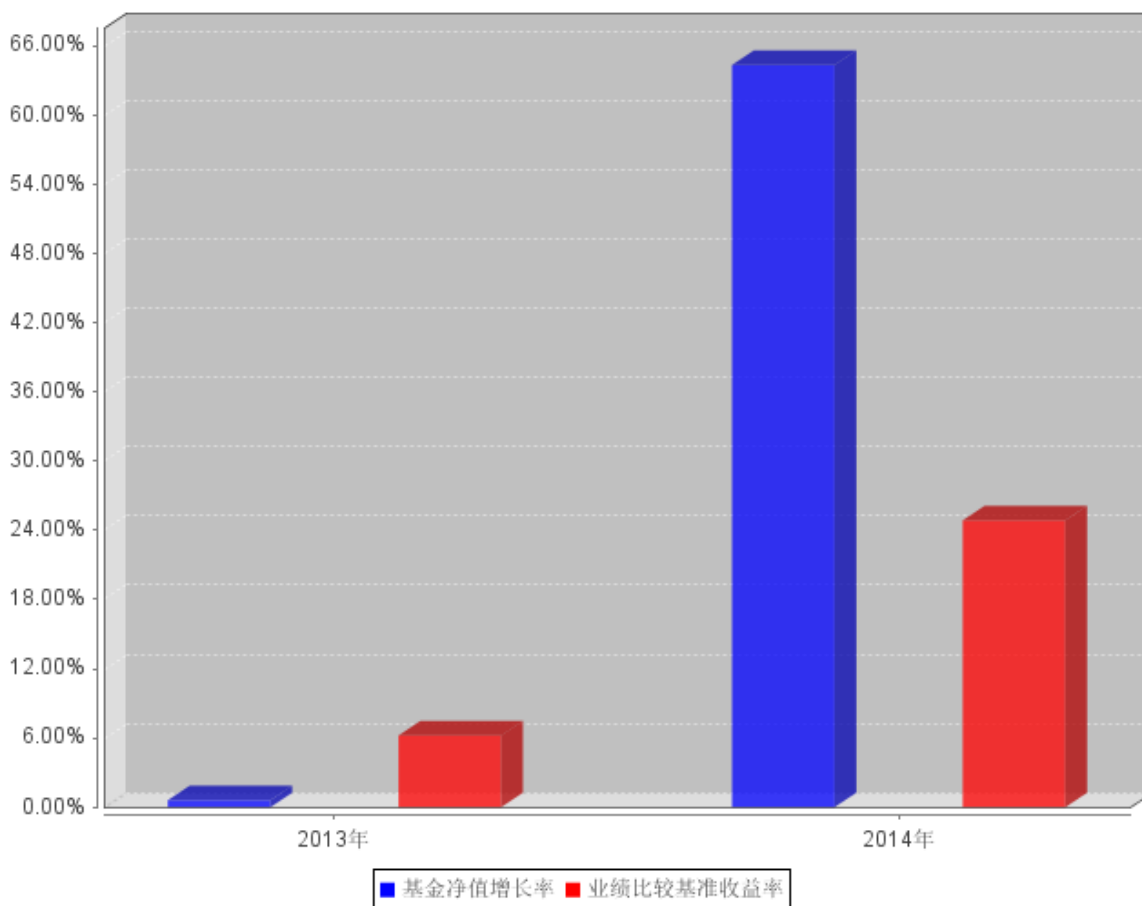


注：1、本基金基金合同于 2013 年 11 月 11 日生效。

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：股票资产占基金资产的比例不低于 60%，债券等固定收益类资产占基金资产的比例为 5%-40%。其中，本基金投资于基金合同界定的信息产业股票资产占非现金基金资产的比例不低于 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%。

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

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：基金合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自 2013 年 11 月 11 日成立以来未实施利润分配。

§ 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 21 日，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，注册资本为 2 亿元人民币，注册地在北京。公司目前拥有共同基金募集和管理资格、境外证券投资管理业务资格、企业年金基金投资管理人资格、特定客户资产管理业务资格、全国社保基金境内投资管理人资格。

截至 2014 年 12 月 31 日，公司旗下管理 52 只开放式基金——工银瑞信核心价值股票型证券投资基金、工银瑞信货币市场基金、工银瑞信精选平衡混合型证券投资基金、工银瑞信稳健成长

股票型证券投资基金、工银瑞信增强收益债券型证券投资基金、工银瑞信红利股票型证券投资基金、工银瑞信中国机会全球配置股票证券投资基金、工银瑞信信用添利债券型证券投资基金、工银瑞信大盘蓝筹股票型证券投资基金、工银瑞信沪深 300 指数证券投资基金、上证中央企业 50 交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信中小盘成长股票型证券投资基金、工银瑞信全球精选股票型证券投资基金、工银瑞信双利债券型证券投资基金、深证红利交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信深证红利 ETF 联接基金、工银瑞信四季收益债券型证券投资基金、工银瑞信消费服务行业股票型证券投资基金、工银瑞信添颐债券型证券投资基金、工银瑞信主题策略股票型证券投资基金、工银瑞信保本混合型证券投资基金、工银瑞信睿智中证 500 指数分级证券投资基金、工银瑞信基本面量化策略股票型证券投资基金、工银瑞信纯债定期开放债券型证券投资基金、工银瑞信 7 天理财债券型证券投资基金、工银瑞信睿智深证 100 指数分级证券投资基金、工银瑞信 14 天理财债券型发起式证券投资基金、工银瑞信信用纯债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、工银瑞信保本 2 号混合型发起式证券投资基金、工银瑞信增利分级债券型证券投资基金、工银瑞信产业债债券型证券投资基金、工银瑞信信用纯债一年定期开放债券型证券投资基金、工银瑞信信用纯债两年定期开放债券型证券投资基金、工银瑞信标普全球自然资源指数证券投资基金、工银瑞信保本 3 号混合型证券投资基金、工银瑞信月月薪定期支付债券型证券投资基金、工银瑞信金融地产行业股票型证券投资基金、工银瑞信双债增强债券型证券投资基金、工银瑞信添福债券型证券投资基金、工银瑞信信息产业股票型证券投资基金、工银瑞信薪金货币市场基金、工银瑞信纯债债券型证券投资基金、工银瑞信绝对收益策略混合型发起式证券投资基金、工银瑞信目标收益一年定期开放债券型投资基金、工银瑞信新财富灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信现金快线货币市场基金、工银瑞信添益快线货币市场基金、工银瑞信高端制造行业股票型证券投资基金、工银瑞信研究精选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、工银瑞信创新动力股票型证券投资基金，证券投资基金管理规模逾 2500 亿元人民币。

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		
刘天任	本基金的基金经理	2013 年 11 月 11 日	-	6	曾任埃森哲咨询公司资深分析员。2008 年加入工银瑞信，现任研究部基金经理。2013 年 11 月 11 日至今，担任工银瑞信信息产业股票型基金基金经理；

					2014年6月5日至今，担任工银瑞信稳健成长股票基金基金经理；2014年12月11日至今，担任工银瑞信创新动力股票型基金基金经理。
王烁杰	本基金的基金经理	2014年4月28日	-	4	先后在中国移动北京分公司担任行业分析经理，在中邮创业基金担任行业研究员；2011年加入工银瑞信，现任研究部高级研究员、基金经理，2014年4月28日至今，担任工银瑞信信息产业股票型基金基金经理；2014年12月11日至今，担任工银瑞信创新动力股票型基金基金经理。
曹冠业	权益投资总监兼权益投资部总监，曾任本基金的基金经理。	2013年11月11日	2014年6月12日	13	CFA、FRM；先后在东方汇理担任结构基金和亚太股票基金经理，香港恒生投资管理公司担任香港中国股票和 QFII 基金投资经理； 2007年加入工银瑞信，现任权益投资总监兼权益投资部总监，兼任工银瑞信资产管理(国际)有限公司权益投资总监； 2007年11月29日至2009年5月17日，担任工银核心价值基金基金经理；2008年2月14日至2009年12月25日，担任工银全球基金基金经理；2009年5月18日至2014年6月12日，担任工银成长基金基金经理；2011年10月24日至2014年6月12日，担任工银主题策略股票基金基金经理；2013年9月23日至2014年6月12日，担任工银瑞信中国机会全球配置基金基金经理；2013年11月11日至2014年6月12日，担任工银瑞信信息产业股票型基金基金经理。

注：1、任职日期说明：

- 1) 刘天任的任职日期为基金合同生效的日期
- 2) 王烁杰的任职日期为公司执委会决议正式生效日期

3) 曹冠业的任职日期为基金合同生效的日期

2、离任日期说明：曹冠业的离任日期为公司执委会决议正式生效日期，从该日起不再担任本基金基金经理

3、说明证券从业年限的计算标准：证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定等

4、本基金无基金经理助理

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

1、公平交易原则

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，为公平对待不同基金份额持有人，公平对待基金持有人和其他资产委托人，在投资管理活动中公平对待公司所管理的不同基金财产和客户资产，不得直接或通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

2、适用范围

本制度适用于本公司所管理的不同投资组合，包括封闭式基金、开放式基金，以及社保组合、企业年金、特定客户资产管理组合等其他受托资产。基金经理，指管理公募基金基金经理，如封闭式基金、开放式基金。投资经理，指管理其他受托资产的投资经理，如企业年金、特定客户资产管理等专项受托资产。

3、公平交易的具体措施

3.1 在研究和投资决策环节：

3.1.1 在公司股票池的基础上，研究部根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和关联交易限制等，参考公司《股票池管理办法》，建立股票池，各基金基金经理、其他受托资产投资经理在此基础上根据投资授权构建具体的投资组合。

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

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

格分离。

3.1.4 对于涉及到关联交易的投资行为，参考公司《关联交易管理制度》执行。

3.2 在交易执行环节：

3.2.1 交易人员、投资交易系统权限的适当分离。在必要的情况下，对于社保基金或其他专项受托资产组合配备专门的交易员，未经授权，其他交易员不得参与社保基金或其他专项受托资产组合的日常交易，并进行交易系统权限的屏蔽。

3.2.2 公平交易执行原则：价格优先、时间优先、综合平衡、比例实施，保证交易在不同基金资产、不同受托资产间的公正，保证公司所管理的不同基金资产、受托资产间的利益公平。

3.2.3 公平交易执行方法：

3.2.3.1 交易员必须严格按照“价格优先、时间优先”的交易执行原则，及时、迅速、准确地执行。

3.2.3.2 在投资交易系统中设置“公平交易模块”，对于涉及到同一证券品种的交易执行，系统自动通过公平交易模块完成。

公平交易模块执行原理如下：

1) 同向交易指令：

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

2) 反向交易指令

a) 交易员不得接受可能导致同一投资组合或不同投资组合之间对敲的同一证券品种的指令，并由风险中台在投资系统中设置严禁所有产品在证券交易时对敲。b) 根据证监会 2011 年修订的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》中相关条款，公司规定同一公募基金、年金、专户、社保组合或前述组合之间不允许同日针对同一证券的反向投资指令；c) 同一公募基金不允许两日内针对同一证券的反向投资指令。d) 确因投资组合要求的投资策略或流动性等需求而发生的同日反向交易，按要求投资组合经理要填写反向交易申请表，并要求相关投资经理提供决策依据，并保留记录备查。e) 以上反向交易要求完全按照指数的构成进行投资的组合等除外。

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

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

3.2.6 对于由于特殊原因不能参与公平交易程序的交易指令，中央交易室填写《公平交易审批单》，经公司主管领导、法律合规部及其公司主管领导审核批准后执行。对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，各投资组合经理应在交易前独立确定各投资组合的交易价格和数量，有关申购方案和分配方案应报公司主管领导、法律合规部，以保证分配结果符合公平交易的原则。

3.2.7 公平交易争议处理

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

3.3 公平交易的检查和价格监控

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

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

3.3.3 法律合规部应对不同投资组合在交易所公开竞价交易中同日同向交易的交易时机和交易价差进行监控，同时对不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析，如发现异常应向基金/投资经理提出，相关基金/投资经理应对异常交易情况进行合理

性解释。风险管理部和法律合规部应对其他可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，对于异常交易发生前后不同投资组合买卖该异常交易证券的情况进行分析。相关基金/投资经理应对异常交易情况进行合理性解释。

3.4 评估和分析

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

3.4.2 中央交易室负责在各投资组合的定期报告中披露公司整体公平交易制度执行情况。法律合规部负责在各投资组合的定期报告中对异常交易行为进行专项说明，其中，如果报告期内所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%，应说明该类交易的次数及原因。各投资组合的年度报告中，除上述内容外，还应披露公平交易制度和控制方法，并在公司整体公平交易制度执行情况中，对当年度同向交易价差做专项分析。其中，中央交易室负责公平交易制度的披露，法律合规部负责公平交易控制方法的披露，风险管理部负责按本制度 3.4.1 条的规定对公平交易制度执行情况中当年度同向交易价差的专项分析。

4. 报告

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

为了公平对待各类投资人，保护各类投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，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。

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2014 年年初基金投资既定目标是聚焦互联网、军工信息化、信息安全等领域，优选标的进行投资，同时在可控的范围内进行一定的择时操作，以期给投资人稳健的汇报。从核心仓位配置上，我们选择的投资方向以及标的选择上取得了成功，也为投资人带来了较好的回报。择时方面，前三季度取得了良好效果，但随着基金规模在 4 季度的快速膨胀，为我们的操作带来了难度。从总体来看，我们在 2014 年的基金运作方面是成功的。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2014 年，本基金份额净值增长率为 64.31%，比较基准收益率为 24.86%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观面看，2015 年实体经济难有改观，经济增速降速将成为常态。整体需求不足的局面将持续。从货币层面看，全球流动性宽松将持续，国内货币供应处于相对较好的水平。从结构看，全面的经济刺激无法预期，但围绕拉动内需、经济转型的定向刺激与扶植将成为常态。综合看，在货币相对宽松以及经济新常态的引导下，资本市场会保持活跃态势。我们认为 2015 年股市将呈现震荡上行的慢牛局面。以互联网、信息安全、军工、区域经济刺激等领域或主题是全年的主线，权重股受到流动性的影响也将阶段性活跃，但震荡的频次和幅度有可能会大于 2014 年，因此还是必要做好风险防范工作。从标的选择看，我们坚定看好并长期持有互联网、信息安全以及军工相关的优质标的作为核心配置，主题投资辅助配置。

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、风险管理部负责人和法律合规部负责人，组长由运作部负责人担任。

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

4.6.1.2 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

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 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 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

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 审计报告

本年度报告被出具了无保留意见的审计报告，且在审计报告中无强调事项，投资者欲了解详细内容，可阅读年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：工银瑞信信息产业股票型证券投资基金

报告截止日：2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款		208,152,576.93	16,551,991.83
结算备付金		32,554,451.18	2,516,670.79
存出保证金		2,049,192.55	549.87
交易性金融资产		2,979,069,754.22	21,593,228.56
其中：股票投资		2,979,069,754.22	21,593,228.56
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		-	120,000,000.00
应收证券清算款		129,207,456.85	1,618,989.08
应收利息		78,749.07	117,571.92
应收股利		-	-
应收申购款		26,362,153.87	132,543.41
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		3,377,474,334.67	162,531,545.46
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013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		34,947,062.42	2,883,349.11
应付赎回款		168,934,479.18	1,584,539.09
应付管理人报酬		4,026,679.29	237,444.16
应付托管费		671,113.22	39,574.01
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		13,512,180.89	25,073.91
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		728,534.64	5,971.64
负债合计		222,820,049.64	4,775,951.92
所有者权益:			
实收基金		1,908,066,104.27	156,860,820.07
未分配利润		1,246,588,180.76	894,773.47
所有者权益合计		3,154,654,285.03	157,755,593.54
负债和所有者权益总计		3,377,474,334.67	162,531,545.46

注：本基金基金合同生效日为 2013 年 11 月 11 日。

报告截止日 2014 年 12 月 31 日，基金份额净值为人民币 1.653 元，基金份额总额为 1,908,066,104.27 份。

7.2 利润表

会计主体：工银瑞信信息产业股票型证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2014年1月1日至 2014年12月31日	上年度可比期间 2013年11月11日(基 金合同生效日)至 2013年12月31日
一、收入		493,137,817.65	1,569,814.97
1. 利息收入		1,828,967.56	1,255,918.85
其中：存款利息收入		1,225,239.97	429,527.90
债券利息收入		6,863.02	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		596,864.57	826,390.95
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		321,767,925.97	-78,903.23
其中：股票投资收益		319,595,548.78	-78,903.23
基金投资收益		-	-
债券投资收益		9,780.00	-
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		2,162,597.19	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		166,844,279.19	303,652.60
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		2,696,644.93	89,146.75
减：二、费用		62,877,151.89	517,048.25
1. 管理人报酬		13,774,273.03	414,880.67
2. 托管费		2,295,712.17	69,146.76
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		46,371,114.40	31,719.82
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		436,052.29	1,301.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		430,260,665.76	1,052,766.72
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		430,260,665.76	1,052,766.72

注：本基金基金合同生效日为 2013 年 11 月 11 日。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：工银瑞信信息产业股票型证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	156,860,820.07	894,773.47	157,755,593.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	430,260,665.76	430,260,665.76
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）	1,751,205,284.20	815,432,741.53	2,566,638,025.73
其中：1. 基金申购款	3,235,796,354.33	1,492,511,356.69	4,728,307,711.02
2. 基金赎回款	-1,484,591,070.13	-677,078,615.16	-2,161,669,685.29
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）	1,908,066,104.27	1,246,588,180.76	3,154,654,285.03
项目	上年度可比期间 2013 年 11 月 11 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	227,090,220.27	-	227,090,220.27
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,052,766.72	1,052,766.72
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）	-70,229,400.20	-157,993.25	-70,387,393.45
其中：1. 基金申购款	925,258.61	3,109.59	928,368.20
2. 基金赎回款	-71,154,658.81	-161,102.84	-71,315,761.65
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）	156,860,820.07	894,773.47	157,755,593.54

注：本基金基金合同生效日为 2013 年 11 月 11 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>郭特华</u>	<u>毕万英</u>	<u>朱辉毅</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

工银瑞信信息产业股票型证券投资基金（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[2013]848 号文《关于核准工银瑞信信息产业股票型证券投资基金募集的批复》的批准，由基金管理人工银瑞信基金管理有限公司向社会公开募集，基金合同于 2013 年 11 月 11 日正式生效，首次设立募集规模为 227,090,220.27 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和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。

本基金的投资范围限于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括创业板股票、中小板股票以及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、债券回购、资产支持证券、货币市场工具、股指期货与权证等金融衍生工具以及法律法规允许基金投资的其它金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例不低于 60%，债券等固定收益类资产占基金资产的比例为 5%-40%。其中，本基金投资于本基金合同界定的信息产业股票资产占非现金基金资产的比例不低于 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%。本基金的业绩比较基准为： $80\% \times \text{中证 TMT 产业主题指数收益率} + 20\% \times \text{上证国债指数收益率}$ 。

7.4.2 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《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《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。

采用若干修订后/新会计准则

2014 年 1 至 3 月，财政部制定了《企业会计准则第 39 号——公允价值计量》、《企业会计准则第 40 号——合营安排》和《企业会计准则第 41 号——在其他主体中权益的披露》；修订了《企业会计准则第 2 号——长期股权投资》、《企业会计准则第 9 号——职工薪酬》、《企业会计准则第 30 号——财务报表列报》和《企业会计准则第 33 号——合并财务报表》；上述 7 项会计准则均自 2014 年 7 月 1 日起施行。2014 年 6 月，财政部修订了《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》，在 2014 年年度及以后期间的财务报告中施行。

上述会计准则的变化对本财务报表无重大影响。

7.4.3 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 2014 年 12 月 31 日的财务状况以及 2014 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资等；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认，即从本基金账户和资产负债表内予以转销；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(5) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票投资、债券投资和权证投资等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的市价作为公允价值；估值日无市价，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易市价确定公允价值；如估值日无市价，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，参考类似投

资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定公允价值。本基金采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术，优先使用相关可观察输入值，只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融资产公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行

企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 的年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率逐日计提；

(3) 卖出回购证券支出，按卖出回购金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(4) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为六次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 30%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减

去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

- (4) 每一基金份额享有同等分配权；
- (5) 法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 分部报告

无。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

会计政策变更的说明可参见 7.4.2 会计报表的编制基础。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

7.4.6.1 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。

7.4.6.2 营业税、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，继续免征营业税和企业所得税；

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。

7.4.6.3 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税；

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《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。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
工银瑞信基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中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
瑞士信贷银行股份有限公司	基金管理人股东
工银瑞信资产管理（国际）有限公司	基金管理人的子公司
工银瑞信投资管理有限公司	基金管理人的子公司
工银瑞信添益快线货币市场基金	基金管理人控制的结构化主体
工银瑞信新瑞分级资产管理计划	基金管理人子公司控制的结构化主体

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金于本报告期及上年度可比期间 2013 年 11 月 11 日（基金合同生效日）至 2013 年 12 月 31 日止期间均未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	2013 年 11 月 11 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	13,774,273.03	414,880.67
其中：支付销售机构的客户维护费	2,718,278.04	94,330.21

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	2013 年 11 月 11 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,295,712.17	69,146.76

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金于本报告期及上年度可比期间 2013 年 11 月 11 日（基金合同生效日）至 2013 年 12 月 31 日止期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的管理人在本报告期内与上年度可比期间 2013 年 11 月 11 日（基金合同生效日）至 2013 年 12 月 31 日止均未运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 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

本基金除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末与上年度末均未持有本基金。

7.4.8.5 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		上年度可比期间	
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日		2013 年 11 月 11 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 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	208,152,576.93	1,016,609.40	16,551,991.83	58,294.71

注：本年度及上年度期末余额仅为活期存款，利息收入仅为活期存款利息收入。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与上述各关联方及托管人股东承销的证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.9 期末（2014 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.9.2 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
002329	皇氏集团	2014 年 12 月 1 日	重大事项	29.60	2015 年 1 月 30 日	27.61	5,793,530	116,973,061.52	171,488,488.00	-
002439	启明星辰	2014 年 12 月 8 日	重大事项	23.84	2015 年 3 月 12 日	28.86	6,671,174	166,992,818.24	159,040,788.16	-
002507	涪陵榨菜	2014 年 12 月 22 日	重大事项	28.80	2015 年 3 月 23 日	31.68	697,030	19,345,977.62	20,074,464.00	-
300011	鼎汉技术	2014 年 11 月	重大事项	20.25	2015 年 2 月 3 日	18.98	323,903	5,568,326.96	6,559,035.75	-

		24 日			日					
000996	中国中期	2014 年 12 月 8 日	重大事项	28.60	-	-	7,371	154,309.15	210,810.60	-
600767	运盛实业	2014 年 10 月 27 日	重大事项	16.38	2015 年 2 月 9 日	12.30	10,858	124,576.93	177,854.04	-
000883	湖北能源	2014 年 11 月 18 日	重大事项	6.43	-	-	16,694	64,232.17	107,342.42	-
300347	泰格医药	2014 年 12 月 10 日	重大事项	30.22	2015 年 1 月 22 日	33.24	1,800	66,887.06	54,396.00	-

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.10.1 公允价值

银行存款、结算备付金、买入返售金融资产、应收证券清算款、应付证券清算款等，因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

(1) 各层次金融工具公允价值

本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 2,621,356,575.25 元，属于第二层次的余额为人民币 357,713,178.97 元，属于第三层次的余额为人民币零元。

(2) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具，在第一层次和第二层次之间无重大转移。

本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具未发生转入或转出第三层次公允价值的情况。

7.4.10.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.10.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	2,979,069,754.22	88.20
	其中：股票	2,979,069,754.22	88.20
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	240,707,028.11	7.13
7	其他各项资产	157,697,552.34	4.67
8	合计	3,377,474,334.67	100.00

注：由于四舍五入的原因金额占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	238,631.89	0.01
B	采矿业	805,860.32	0.03
C	制造业	1,440,725,156.18	45.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	83,879,024.87	2.66
E	建筑业	23,440.56	0.00
F	批发和零售业	210,810.60	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	198,665,225.89	6.30
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,008,885,126.09	31.98
J	金融业	32,012,156.72	1.01
K	房地产业	194,220,074.98	6.16
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	19,195,129.32	0.61
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	54,396.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	154,720.80	0.00
	合计	2,979,069,754.22	94.43

注：由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

8.3 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

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	300288	朗玛信息	1,445,364	268,837,704.00	8.52
2	002373	千方科技	9,892,372	267,094,044.00	8.47
3	600485	信威集团	5,676,588	246,080,089.80	7.80
4	300059	东方财富	7,408,126	207,131,202.96	6.57
5	300131	英唐智控	7,097,182	203,050,377.02	6.44
6	601000	唐山港	21,490,341	197,926,040.61	6.27
7	002329	皇氏集团	5,793,530	171,488,488.00	5.44
8	002520	日发精机	6,254,102	168,235,343.80	5.33
9	600855	航天长峰	5,773,653	160,276,607.28	5.08
10	002439	启明星辰	6,671,174	159,040,788.16	5.04

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年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	600485	信威集团	409,904,162.16	259.83
2	002373	千方科技	383,510,754.25	243.10
3	002520	日发精机	341,663,351.85	216.58
4	600383	金地集团	303,421,864.18	192.34
5	300288	朗玛信息	298,509,810.20	189.22

6	601000	唐山港	247,640,932.46	156.98
7	300131	英唐智控	245,155,097.02	155.40
8	300238	冠昊生物	242,832,288.29	153.93
9	300059	东方财富	238,394,257.55	151.12
10	601601	中国太保	233,161,351.71	147.80
11	300033	同花顺	227,789,450.69	144.39
12	300213	佳讯飞鸿	218,988,824.38	138.82
13	300367	东方网力	193,861,727.52	122.89
14	300212	易华录	184,314,041.42	116.84
15	600855	航天长峰	181,522,133.64	115.07
16	300003	乐普医疗	177,058,977.23	112.24
17	002439	启明星辰	168,859,763.24	107.04
18	600505	西昌电力	150,360,329.46	95.31
19	600118	中国卫星	144,686,288.44	91.72
20	603019	中科曙光	139,486,542.16	88.42
21	000905	厦门港务	132,819,393.12	84.19
22	002170	芭田股份	130,439,782.92	82.68
23	300348	长亮科技	119,467,018.75	75.73
24	002413	常发股份	117,367,463.88	74.40
25	002329	皇氏集团	116,973,061.52	74.15
26	601668	中国建筑	114,604,005.08	72.65
27	300253	卫宁软件	111,522,481.35	70.69
28	600010	包钢股份	109,598,363.26	69.47
29	600995	文山电力	108,039,597.02	68.49
30	600310	桂东电力	103,383,378.38	65.53
31	002279	久其软件	101,994,243.67	64.65
32	000959	首钢股份	101,134,342.00	64.11
33	000901	航天科技	100,475,779.06	63.69
34	300287	飞利信	96,072,376.29	60.90
35	601377	兴业证券	95,894,044.12	60.79
36	300396	迪瑞医疗	94,155,437.36	59.68
37	300093	金刚玻璃	93,106,663.94	59.02
38	300137	先河环保	91,720,310.48	58.14
39	002280	新世纪	90,279,225.62	57.23
40	600061	中纺投资	89,480,286.37	56.72
41	600975	新五丰	88,535,263.55	56.12

42	002569	步森股份	87,862,408.15	55.70
43	300248	新开普	86,735,141.32	54.98
44	000821	京山轻机	83,860,690.02	53.16
45	002576	通达动力	83,196,033.74	52.74
46	601688	华泰证券	81,666,244.79	51.77
47	002234	*ST 民和	80,343,619.68	50.93
48	000831	五矿稀土	78,324,600.99	49.65
49	300392	腾信股份	78,210,820.48	49.58
50	601318	中国平安	76,998,594.57	48.81
51	300011	鼎汉技术	74,768,457.67	47.40
52	300053	欧比特	72,620,503.05	46.03
53	000555	神州信息	71,536,258.77	45.35
54	300285	国瓷材料	70,164,380.39	44.48
55	600739	辽宁成大	68,155,338.18	43.20
56	002205	国统股份	67,495,150.51	42.78
57	002007	华兰生物	66,381,847.31	42.08
58	600850	华东电脑	65,527,143.93	41.54
59	300254	仟源医药	65,484,538.61	41.51
60	300188	美亚柏科	63,502,780.67	40.25
61	000002	万科A	62,951,856.51	39.90
62	000403	ST 生化	60,647,477.92	38.44
63	300085	银之杰	60,529,426.40	38.37
64	000024	招商地产	60,321,716.06	38.24
65	300087	荃银高科	59,969,215.33	38.01
66	002432	九安医疗	59,538,630.52	37.74
67	002149	西部材料	59,369,473.65	37.63
68	002124	天邦股份	58,627,318.69	37.16
69	600149	廊坊发展	58,384,516.38	37.01
70	600973	宝胜股份	56,864,699.04	36.05
71	300271	华宇软件	56,641,138.54	35.90
72	601336	新华保险	56,378,129.10	35.74
73	002712	思美传媒	55,838,267.43	35.40
74	000925	众合机电	55,794,479.08	35.37
75	000100	TCL 集团	55,724,130.01	35.32
76	000709	河北钢铁	54,723,580.49	34.69
77	600990	四创电子	53,408,079.88	33.85

78	601231	环旭电子	53,350,415.67	33.82
79	601939	建设银行	53,322,453.61	33.80
80	000685	中山公用	53,256,286.31	33.76
81	002699	美盛文化	53,001,387.54	33.60
82	601788	光大证券	52,541,784.47	33.31
83	300279	和晶科技	52,489,853.45	33.27
84	600259	广晟有色	51,977,209.01	32.95
85	600315	上海家化	51,872,281.13	32.88
86	300070	碧水源	51,869,501.17	32.88
87	300098	高新兴	51,456,639.38	32.62
88	601600	中国铝业	51,302,242.91	32.52
89	002253	川大智胜	51,113,202.84	32.40
90	600372	中航电子	49,756,484.41	31.54
91	002664	信质电机	48,937,924.41	31.02
92	600327	大东方	48,789,923.25	30.93
93	002580	圣阳股份	48,698,701.77	30.87
94	300170	汉得信息	48,595,137.78	30.80
95	300116	坚瑞消防	48,432,666.10	30.70
96	002559	亚威股份	48,069,272.83	30.47
97	300281	金明精机	47,998,034.62	30.43
98	300347	泰格医药	47,983,962.46	30.42
99	000686	东北证券	47,873,281.76	30.35
100	600815	厦工股份	47,586,496.97	30.16
101	600862	南通科技	46,745,042.98	29.63
102	300104	乐视网	46,730,387.88	29.62
103	300173	松德股份	46,689,841.58	29.60
104	600837	海通证券	46,219,668.00	29.30
105	002728	台城制药	46,202,306.69	29.29
106	000656	金科股份	46,146,176.35	29.25
107	002404	嘉欣丝绸	44,923,314.56	28.48
108	002683	宏大爆破	44,791,681.08	28.39
109	600028	中国石化	44,724,573.16	28.35
110	002389	南洋科技	44,346,897.17	28.11
111	300242	明家科技	44,312,772.10	28.09
112	002631	德尔家居	43,760,562.36	27.74
113	000423	东阿阿胶	43,486,216.87	27.57

114	002421	达实智能	43,472,014.57	27.56
115	000538	云南白药	43,307,709.76	27.45
116	000776	广发证券	42,757,963.93	27.10
117	601988	中国银行	42,411,252.78	26.88
118	000562	宏源证券	42,401,381.76	26.88
119	000883	湖北能源	42,270,813.39	26.80
120	002475	立讯精密	42,063,924.86	26.66
121	300252	金信诺	41,651,307.17	26.40
122	600050	中国联通	41,516,276.47	26.32
123	600549	厦门钨业	41,295,822.59	26.18
124	300269	联建光电	40,704,699.19	25.80
125	300065	海兰信	40,563,957.23	25.71
126	300322	硕贝德	39,877,159.53	25.28
127	600970	中材国际	39,771,360.39	25.21
128	600590	泰豪科技	39,686,534.65	25.16
129	002285	世联行	39,575,520.97	25.09
130	002338	奥普光电	39,561,173.63	25.08
131	300107	建新股份	39,269,957.28	24.89
132	000590	紫光古汉	39,086,896.37	24.78
133	603456	九洲药业	38,905,892.24	24.66
134	600436	片仔癀	38,619,732.50	24.48
135	002354	科冕木业	37,447,872.93	23.74
136	600392	盛和资源	36,872,107.01	23.37
137	600432	吉恩镍业	36,533,977.10	23.16
138	000783	长江证券	36,450,221.27	23.11
139	000888	峨眉山A	36,304,557.72	23.01
140	601669	中国电建	35,930,569.99	22.78
141	000712	锦龙股份	35,339,733.82	22.40
142	600979	广安爱众	35,270,936.96	22.36
143	600893	航空动力	34,947,902.84	22.15
144	600155	宝硕股份	34,239,270.93	21.70
145	300246	宝莱特	33,670,282.05	21.34
146	600221	海南航空	33,461,587.00	21.21
147	000725	京东方A	33,452,209.00	21.21
148	600036	招商银行	32,638,471.99	20.69
149	300386	飞天诚信	32,549,470.95	20.63

150	300379	东方通	32,547,057.27	20.63
151	600048	保利地产	32,376,246.12	20.52
152	300397	天和防务	31,962,419.55	20.26
153	000851	高鸿股份	31,773,933.25	20.14
154	600720	祁连山	31,686,991.88	20.09
155	300020	银江股份	31,667,291.93	20.07
156	600320	振华重工	31,652,135.32	20.06
157	600233	大杨创世	31,210,931.43	19.78
158	002655	共达电声	31,001,234.15	19.65
159	000592	平潭发展	30,997,633.18	19.65
160	002390	信邦制药	30,969,886.47	19.63
161	002102	冠福股份	30,827,165.55	19.54
162	000418	小天鹅A	30,750,959.93	19.49
163	600016	民生银行	30,658,450.60	19.43
164	300334	津膜科技	30,071,038.75	19.06
165	601618	中国中冶	29,843,300.16	18.92
166	002348	高乐股份	29,739,877.95	18.85
167	600236	桂冠电力	29,579,323.23	18.75
168	601800	中国交建	29,569,873.31	18.74
169	002240	威华股份	29,511,076.93	18.71
170	002146	荣盛发展	29,368,623.95	18.62
171	002615	哈尔斯	29,360,993.82	18.61
172	000807	云铝股份	29,293,741.30	18.57
173	600210	紫江企业	29,074,330.63	18.43
174	300050	世纪鼎利	28,517,441.71	18.08
175	300049	福瑞股份	28,487,338.51	18.06
176	000980	金马股份	28,459,945.60	18.04
177	300096	易联众	28,277,874.86	17.93
178	600446	金证股份	28,258,057.12	17.91
179	600969	郴电国际	28,153,449.82	17.85
180	600581	八一钢铁	28,028,395.06	17.77
181	002414	高德红外	28,025,399.91	17.77
182	600458	时代新材	27,363,407.08	17.35
183	002268	卫士通	27,346,887.64	17.33
184	002136	安纳达	26,985,785.26	17.11
185	601992	金隅股份	26,137,362.83	16.57

186	002458	益生股份	25,666,389.68	16.27
187	600358	国旅联合	25,583,809.27	16.22
188	600737	中粮屯河	25,420,523.01	16.11
189	002174	游族网络	25,315,279.15	16.05
190	002579	中京电子	24,936,814.24	15.81
191	601158	重庆水务	24,873,010.79	15.77
192	600031	三一重工	24,521,479.82	15.54
193	002556	辉隆股份	24,381,245.21	15.46
194	002312	三泰电子	24,328,921.27	15.42
195	600723	首商股份	24,310,246.06	15.41
196	000996	中国中期	24,104,131.91	15.28
197	600999	招商证券	23,688,634.25	15.02
198	600598	*ST 大荒	23,460,781.53	14.87
199	300037	新宙邦	23,328,973.73	14.79
200	601328	交通银行	23,298,476.35	14.77
201	000998	隆平高科	22,952,339.01	14.55
202	601998	中信银行	22,853,909.89	14.49
203	300324	旋极信息	22,498,041.59	14.26
204	300169	天晟新材	22,468,909.28	14.24
205	600588	用友软件	22,359,854.02	14.17
206	002524	光正集团	22,250,731.73	14.10
207	601299	中国北车	22,166,840.76	14.05
208	600651	飞乐音响	22,039,307.91	13.97
209	000961	中南建设	21,982,979.36	13.93
210	002241	歌尔声学	21,961,951.09	13.92
211	300227	光韵达	21,952,452.00	13.92
212	000768	中航飞机	21,836,127.53	13.84
213	600776	东方通信	21,759,494.03	13.79
214	300113	顺网科技	21,502,933.14	13.63
215	000596	古井贡酒	21,431,852.97	13.59
216	000728	国元证券	21,344,045.76	13.53
217	600369	西南证券	21,301,159.73	13.50
218	600998	九州通	21,194,505.90	13.44
219	002214	大立科技	21,119,612.73	13.39
220	600745	中茵股份	21,083,920.01	13.36
221	600565	迪马股份	21,069,716.33	13.36

222	000059	华锦股份	20,921,822.02	13.26
223	600120	浙江东方	20,858,514.23	13.22
224	300166	东方国信	20,723,285.20	13.14
225	600115	东方航空	20,690,987.23	13.12
226	300378	鼎捷软件	20,684,899.25	13.11
227	601111	中国国航	20,655,496.10	13.09
228	600029	南方航空	20,623,081.10	13.07
229	300321	同大股份	20,600,849.87	13.06
230	000673	当代东方	20,576,862.85	13.04
231	600391	成发科技	20,328,656.97	12.89
232	600240	华业地产	20,197,587.75	12.80
233	000417	合肥百货	20,100,536.79	12.74
234	601166	兴业银行	20,057,927.23	12.71
235	300340	科恒股份	20,000,546.56	12.68
236	000568	泸州老窖	19,904,211.58	12.62
237	002051	中工国际	19,691,358.97	12.48
238	600585	海螺水泥	19,564,424.29	12.40
239	002507	涪陵榨菜	19,345,977.62	12.26
240	600767	运盛实业	19,280,183.11	12.22
241	002466	天齐锂业	19,119,877.38	12.12
242	300058	蓝色光标	19,064,229.89	12.08
243	300398	飞凯材料	19,057,749.71	12.08
244	000612	焦作万方	18,868,218.54	11.96
245	000858	五粮液	18,709,199.24	11.86
246	002502	骅威股份	18,563,776.45	11.77
247	601099	太平洋	18,488,079.94	11.72
248	300086	康芝药业	18,465,968.53	11.71
249	600655	豫园商城	18,340,522.04	11.63
250	002711	欧浦钢网	18,271,797.69	11.58
251	603000	人民网	18,235,262.22	11.56
252	002416	爱施德	18,230,567.16	11.56
253	300155	安居宝	17,946,496.67	11.38
254	601186	中国铁建	17,878,612.00	11.33
255	300016	北陆药业	17,823,171.12	11.30
256	000638	万方发展	17,699,959.26	11.22
257	000587	金叶珠宝	17,612,125.22	11.16

258	600189	吉林森工	17,567,597.09	11.14
259	600116	三峡水利	17,548,786.82	11.12
260	601225	陕西煤业	17,497,310.80	11.09
261	600173	卧龙地产	17,420,424.38	11.04
262	300172	中电环保	17,283,443.15	10.96
263	002445	中南重工	17,239,143.52	10.93
264	300317	珈伟股份	17,011,381.38	10.78
265	000958	东方能源	16,809,170.55	10.66
266	000933	神火股份	16,625,121.06	10.54
267	300369	绿盟科技	16,490,695.87	10.45
268	600662	强生控股	16,450,307.94	10.43
269	000895	双汇发展	16,449,545.94	10.43
270	600694	大商股份	16,427,086.21	10.41
271	002368	太极股份	16,371,246.68	10.38
272	002436	兴森科技	16,322,061.60	10.35
273	600094	大名城	16,169,593.23	10.25
274	000570	苏常柴A	16,167,549.37	10.25
275	000733	振华科技	16,123,245.57	10.22
276	600559	老白干酒	16,084,902.30	10.20
277	600808	马钢股份	16,047,037.29	10.17
278	300073	当升科技	15,991,836.56	10.14
279	600715	松辽汽车	15,890,996.47	10.07
280	600109	国金证券	15,721,200.98	9.97
281	000869	张裕A	15,655,387.80	9.92
282	002410	广联达	15,614,851.28	9.90
283	300391	康跃科技	15,605,975.26	9.89
284	601628	中国人寿	15,603,140.02	9.89
285	600497	驰宏锌锗	15,491,554.10	9.82
286	300055	万邦达	15,254,406.43	9.67
287	600455	博通股份	15,220,502.44	9.65
288	000688	建新矿业	15,016,673.09	9.52
289	600212	江泉实业	14,927,819.00	9.46
290	600570	恒生电子	14,767,902.55	9.36
291	600509	天富能源	14,742,256.37	9.34
292	600498	烽火通信	14,520,736.32	9.20
293	603005	晶方科技	14,354,905.85	9.10

294	000718	苏宁环球	13,886,563.15	8.80
295	300019	硅宝科技	13,764,597.87	8.73
296	002551	尚荣医疗	13,539,650.77	8.58
297	300220	金运激光	13,474,035.01	8.54
298	300071	华谊嘉信	13,271,904.57	8.41
299	002640	百圆裤业	13,185,769.60	8.36
300	600545	新疆城建	12,978,250.91	8.23
301	300235	方直科技	12,847,423.61	8.14
302	300295	三六五网	12,672,461.83	8.03
303	002412	汉森制药	12,533,741.13	7.95
304	002491	通鼎光电	12,469,397.75	7.90
305	600489	中金黄金	12,307,675.85	7.80
306	600779	水井坊	12,248,286.06	7.76
307	002008	大族激光	12,195,187.13	7.73
308	601857	中国石油	12,159,770.09	7.71
309	002108	沧州明珠	12,135,987.00	7.69
310	000066	长城电脑	12,054,995.02	7.64
311	600971	恒源煤电	11,933,819.28	7.56
312	002181	粤传媒	11,819,060.35	7.49
313	300012	华测检测	11,803,506.00	7.48
314	002005	德豪润达	11,789,561.00	7.47
315	600556	北生药业	11,686,235.13	7.41
316	002182	云海金属	11,620,246.31	7.37
317	002673	西部证券	11,552,543.75	7.32
318	000697	炼石有色	11,495,916.31	7.29
319	002366	丹甫股份	11,383,991.75	7.22
320	000060	中金岭南	11,350,305.49	7.19
321	600763	通策医疗	11,259,545.90	7.14
322	000018	中冠 A	10,856,846.80	6.88
323	600568	中珠控股	10,833,224.19	6.87
324	002307	北新路桥	10,831,350.32	6.87
325	300034	钢研高纳	10,744,587.45	6.81
326	600616	金枫酒业	10,743,956.91	6.81
327	601989	中国重工	10,717,867.86	6.79
328	002325	洪涛股份	10,695,380.74	6.78
329	300129	泰胜风能	10,497,594.49	6.65

330	000711	京蓝科技	10,486,629.91	6.65
331	600376	首开股份	10,432,483.41	6.61
332	000975	银泰资源	10,357,377.65	6.57
333	000932	华菱钢铁	10,313,251.59	6.54
334	002030	达安基因	10,299,659.47	6.53
335	600280	中央商场	10,234,220.43	6.49
336	603369	今世缘	10,231,383.39	6.49
337	300061	康耐特	10,174,284.10	6.45
338	600884	杉杉股份	10,164,693.03	6.44
339	300226	上海钢联	10,159,834.26	6.44
340	600366	宁波韵升	10,139,727.89	6.43
341	002273	水晶光电	10,066,450.83	6.38
342	002544	杰赛科技	10,055,352.26	6.37
343	000960	锡业股份	10,020,329.50	6.35
344	002142	宁波银行	9,935,820.00	6.30
345	601169	北京银行	9,915,344.52	6.29
346	600429	三元股份	9,913,962.76	6.28
347	600015	华夏银行	9,912,622.60	6.28
348	600000	浦发银行	9,873,177.21	6.26
349	002180	艾派克	9,865,735.36	6.25
350	002276	万马股份	9,822,633.58	6.23
351	600645	中源协和	9,799,986.90	6.21
352	002713	东易日盛	9,795,600.35	6.21
353	600022	山东钢铁	9,766,727.30	6.19
354	000860	顺鑫农业	9,746,617.00	6.18
355	300006	莱美药业	9,704,955.78	6.15
356	600180	瑞茂通	9,683,968.62	6.14
357	000620	新华联	9,680,353.36	6.14
358	002465	海格通信	9,666,971.88	6.13
359	002207	准油股份	9,630,449.15	6.10
360	002649	博彦科技	9,630,368.25	6.10
361	300101	振芯科技	9,571,049.27	6.07
362	600519	贵州茅台	9,546,443.06	6.05
363	000838	国兴地产	9,437,994.82	5.98
364	000561	烽火电子	9,389,094.58	5.95
365	000753	漳州发展	9,193,185.56	5.83

366	000995	皇台酒业	8,923,364.63	5.66
367	002126	银轮股份	8,881,049.34	5.63
368	000540	中天城投	8,602,884.06	5.45
369	600879	航天电子	8,483,609.30	5.38
370	002428	云南锗业	8,275,859.26	5.25
371	600428	中远航运	8,257,775.14	5.23
372	300074	华平股份	8,234,826.70	5.22
373	600640	号百控股	8,205,101.99	5.20
374	601808	中海油服	8,189,615.80	5.19
375	000732	泰禾集团	8,115,375.40	5.14
376	601958	金钼股份	8,111,153.91	5.14
377	601633	长城汽车	8,105,435.88	5.14
378	000957	中通客车	8,084,823.73	5.12
379	600169	太原重工	8,040,821.78	5.10
380	000693	华泽钴镍	7,921,869.80	5.02
381	600168	武汉控股	7,876,327.73	4.99
382	002037	久联发展	7,840,471.00	4.97
383	600633	浙报传媒	7,820,784.00	4.96
384	000681	视觉中国	7,804,016.10	4.95
385	300177	中海达	7,723,086.68	4.90
386	002195	海隆软件	7,660,205.46	4.86
387	600525	长园集团	7,647,040.99	4.85
388	300209	天泽信息	7,575,154.52	4.80
389	600761	安徽合力	7,447,314.98	4.72
390	600583	海油工程	7,220,103.16	4.58
391	000559	万向钱潮	7,216,597.10	4.57
392	600816	安信信托	7,188,780.06	4.56
393	600390	金瑞科技	7,057,900.40	4.47
394	600562	国睿科技	7,019,828.65	4.45
395	600809	山西汾酒	7,003,985.85	4.44
396	000401	冀东水泥	7,003,514.57	4.44
397	300161	华中数控	6,989,744.56	4.43
398	600059	古越龙山	6,938,207.20	4.40
399	300363	博腾股份	6,916,814.41	4.38
400	300351	永贵电器	6,892,117.69	4.37
401	600759	洲际油气	6,864,651.00	4.35

402	300273	和佳股份	6,852,934.58	4.34
403	300315	掌趣科技	6,831,181.23	4.33
404	000988	华工科技	6,809,804.85	4.32
405	002476	宝莫股份	6,777,346.66	4.30
406	000530	大冷股份	6,646,558.78	4.21
407	002552	宝鼎重工	6,644,430.12	4.21
408	002244	滨江集团	6,453,400.27	4.09
409	300202	聚龙股份	6,399,635.80	4.06
410	300150	世纪瑞尔	6,357,233.79	4.03
411	002516	江苏旷达	6,321,723.69	4.01
412	600580	卧龙电气	6,307,006.23	4.00
413	600399	抚顺特钢	6,281,184.44	3.98
414	600778	友好集团	6,238,868.50	3.95
415	000967	上风高科	6,144,838.96	3.90
416	002190	成飞集成	6,061,593.15	3.84
417	300133	华策影视	6,061,215.88	3.84
418	600340	华夏幸福	6,002,350.99	3.80
419	300368	汇金股份	5,969,412.90	3.78
420	600648	外高桥	5,914,000.32	3.75
421	002555	顺荣股份	5,865,829.90	3.72
422	300140	启源装备	5,852,609.90	3.71
423	002415	海康威视	5,847,903.05	3.71
424	600699	均胜电子	5,762,736.69	3.65
425	600060	海信电器	5,688,578.44	3.61
426	002380	科远股份	5,645,284.30	3.58
427	002080	中材科技	5,577,308.80	3.54
428	000898	鞍钢股份	5,504,559.95	3.49
429	000801	四川九洲	5,459,468.32	3.46
430	002700	新疆浩源	5,394,363.39	3.42
431	002097	山河智能	5,389,130.52	3.42
432	300115	长盈精密	5,379,758.24	3.41
433	601766	中国南车	5,376,320.30	3.41
434	002296	辉煌科技	5,375,632.50	3.41
435	002601	佰利联	5,374,065.13	3.41
436	601519	大智慧	5,353,546.59	3.39
437	600742	一汽富维	5,222,111.70	3.31

438	002714	牧原股份	5,218,792.35	3.31
439	002666	德联集团	5,199,976.80	3.30
440	002669	康达新材	5,181,442.71	3.28
441	601901	方正证券	5,158,637.90	3.27
442	600765	中航重机	5,127,779.28	3.25
443	002152	广电运通	5,123,320.24	3.25
444	601890	亚星锚链	5,041,066.68	3.20
445	002318	久立特材	5,019,901.80	3.18
446	600456	宝钛股份	4,998,497.31	3.17
447	300068	南都电源	4,955,296.01	3.14
448	600895	张江高科	4,938,627.87	3.13
449	600256	广汇能源	4,928,482.74	3.12
450	000937	冀中能源	4,916,851.07	3.12
451	000825	太钢不锈	4,916,800.00	3.12
452	002665	首航节能	4,911,609.10	3.11
453	600677	航天通信	4,883,967.00	3.10
454	000625	长安汽车	4,869,988.81	3.09
455	000917	电广传媒	4,847,653.00	3.07
456	600490	鹏欣资源	4,835,865.86	3.07
457	002091	江苏国泰	4,810,842.52	3.05
458	002236	大华股份	4,778,040.64	3.03
459	300041	回天新材	4,769,056.46	3.02
460	600085	同仁堂	4,748,366.38	3.01
461	600557	康缘药业	4,711,456.50	2.99
462	000966	长源电力	4,601,590.18	2.92
463	002407	多氟多	4,562,508.26	2.89
464	002573	国电清新	4,557,284.36	2.89
465	002223	鱼跃医疗	4,554,229.10	2.89
466	600026	中海发展	4,551,195.82	2.88
467	002049	同方国芯	4,541,785.02	2.88
468	600978	宜华木业	4,477,290.00	2.84
469	600444	国通管业	4,420,278.87	2.80
470	300298	三诺生物	4,350,611.92	2.76
471	000099	中信海直	4,312,177.50	2.73
472	600303	曙光股份	4,299,922.90	2.73
473	300274	阳光电源	4,265,965.82	2.70

474	002143	高金食品	4,251,438.92	2.69
475	600495	晋西车轴	4,250,117.84	2.69
476	000687	恒天天鹅	4,240,127.50	2.69
477	600536	中国软件	4,216,695.30	2.67
478	000425	徐工机械	4,191,048.00	2.66
479	300275	梅安森	4,178,391.02	2.65
480	300162	雷曼光电	4,146,363.45	2.63
481	002292	奥飞动漫	4,142,898.53	2.63
482	600290	华仪电气	4,125,572.95	2.62
483	600316	洪都航空	4,114,022.01	2.61
484	600624	复旦复华	4,097,865.12	2.60
485	002235	安妮股份	4,096,564.55	2.60
486	300339	润和软件	4,095,315.20	2.60
487	000877	天山股份	4,079,463.09	2.59
488	300027	华谊兄弟	4,064,849.98	2.58
489	000965	天保基建	4,007,187.00	2.54
490	600787	中储股份	4,000,587.70	2.54
491	300194	福安药业	3,996,213.72	2.53
492	002013	中航机电	3,969,263.10	2.52
493	002543	万和电气	3,919,054.80	2.48
494	300043	互动娱乐	3,900,626.07	2.47
495	600801	华新水泥	3,865,672.27	2.45
496	300128	锦富新材	3,852,174.18	2.44
497	600237	铜峰电子	3,846,947.00	2.44
498	300251	光线传媒	3,814,364.00	2.42
499	600266	北京城建	3,801,030.20	2.41
500	603993	洛阳钼业	3,732,118.80	2.37
501	300203	聚光科技	3,679,050.30	2.33
502	000409	山东地矿	3,674,498.74	2.33
503	002678	珠江钢琴	3,666,187.98	2.32
504	600157	永泰能源	3,657,798.94	2.32
505	000793	华闻传媒	3,639,865.93	2.31
506	000541	佛山照明	3,579,036.01	2.27
507	600073	上海梅林	3,490,393.10	2.21
508	002484	江海股份	3,483,587.84	2.21
509	000786	北新建材	3,458,617.04	2.19

510	002371	七星电子	3,421,352.24	2.17
511	600185	格力地产	3,355,045.94	2.13
512	600089	特变电工	3,316,116.22	2.10
513	002153	石基信息	3,280,304.61	2.08
514	000716	黑芝麻	3,267,410.00	2.07
515	002709	天赐材料	3,263,894.50	2.07
516	002024	苏宁云商	3,255,935.00	2.06
517	600335	国机汽车	3,242,147.99	2.06
518	002155	辰州矿业	3,236,494.59	2.05
519	601899	紫金矿业	3,221,684.20	2.04
520	600540	新赛股份	3,175,984.00	2.01
521	601258	庞大集团	3,163,781.32	2.01

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票；
2、买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 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	601601	中国太保	245,779,848.92	155.80
2	300033	同花顺	234,917,902.32	148.91
3	600485	信威集团	211,210,571.78	133.88
4	300367	东方网力	188,957,930.65	119.78
5	300238	冠昊生物	185,157,168.19	117.37
6	300003	乐普医疗	178,644,534.88	113.24
7	600383	金地集团	178,016,536.78	112.84
8	300212	易华录	160,549,382.20	101.77
9	002373	千方科技	146,597,717.23	92.93
10	002520	日发精机	140,000,685.74	88.75
11	002170	芭田股份	133,105,969.54	84.37
12	000905	厦门港务	126,371,193.62	80.11
13	300392	腾信股份	121,349,141.83	76.92
14	601668	中国建筑	118,815,108.57	75.32
15	600995	文山电力	116,235,952.94	73.68
16	600010	包钢股份	111,740,886.43	70.83
17	300253	卫宁软件	111,156,889.52	70.46
18	603019	中科曙光	110,503,616.72	70.05

19	600310	桂东电力	107,985,182.94	68.45
20	002280	新世纪	107,552,678.10	68.18
21	601377	兴业证券	104,119,437.16	66.00
22	300213	佳讯飞鸿	102,569,859.88	65.02
23	300396	迪瑞医疗	100,621,325.84	63.78
24	300137	先河环保	99,253,399.50	62.92
25	002279	久其软件	97,862,313.34	62.03
26	300287	飞利信	94,934,987.57	60.18
27	000959	首钢股份	94,318,497.00	59.79
28	300288	朗玛信息	93,598,008.34	59.33
29	601000	唐山港	92,364,296.81	58.55
30	300093	金刚玻璃	92,096,574.00	58.38
31	002413	常发股份	91,764,085.65	58.17
32	600975	新五丰	91,596,322.49	58.06
33	000821	京山轻机	87,826,374.11	55.67
34	601688	华泰证券	86,244,982.96	54.67
35	300248	新开普	85,950,704.08	54.48
36	601318	中国平安	85,320,764.79	54.08
37	002569	步森股份	84,245,267.23	53.40
38	600061	中纺投资	82,658,296.72	52.40
39	002576	通达动力	81,832,141.07	51.87
40	002234	*ST 民和	80,471,923.37	51.01
41	000831	五矿稀土	75,634,317.96	47.94
42	000555	神州信息	74,948,969.70	47.51
43	300285	国瓷材料	74,948,027.25	47.51
44	300053	欧比特	73,207,332.38	46.41
45	000024	招商地产	71,166,647.59	45.11
46	300011	鼎汉技术	68,802,508.35	43.61
47	002205	国统股份	68,129,615.75	43.19
48	600505	西昌电力	67,484,333.44	42.78
49	002007	华兰生物	65,960,004.74	41.81
50	600850	华东电脑	65,691,989.18	41.64
51	300254	仟源医药	64,276,255.01	40.74
52	000403	ST 生化	64,146,563.26	40.66
53	300188	美亚柏科	64,134,379.33	40.65
54	002149	西部材料	63,849,343.14	40.47
55	300085	银之杰	63,197,626.60	40.06
56	300087	荃银高科	62,265,322.16	39.47

57	000709	河北钢铁	61,924,319.48	39.25
58	002432	九安医疗	61,574,223.21	39.03
59	600739	辽宁成大	60,696,818.22	38.48
60	300348	长亮科技	60,632,070.17	38.43
61	002124	天邦股份	60,284,810.79	38.21
62	300131	英唐智控	58,430,155.75	37.04
63	600973	宝胜股份	57,842,375.39	36.67
64	600149	廊坊发展	57,835,045.73	36.66
65	002712	思美传媒	56,604,394.62	35.88
66	600837	海通证券	56,246,293.75	35.65
67	000100	TCL 集团	54,632,142.72	34.63
68	300070	碧水源	54,108,061.60	34.30
69	300271	华宇软件	53,656,684.79	34.01
70	601231	环旭电子	52,914,900.23	33.54
71	600990	四创电子	52,770,585.89	33.45
72	002699	美盛文化	52,592,527.51	33.34
73	002253	川大智胜	52,444,892.52	33.24
74	000685	中山公用	52,333,210.88	33.17
75	601939	建设银行	52,270,271.40	33.13
76	601600	中国铝业	52,136,738.63	33.05
77	601788	光大证券	51,929,447.22	32.92
78	300281	金明精机	51,310,243.12	32.53
79	300173	松德股份	50,909,834.33	32.27
80	600315	上海家化	50,891,103.04	32.26
81	300170	汉得信息	50,823,429.02	32.22
82	300098	高新兴	50,669,636.62	32.12
83	002664	信质电机	50,431,849.61	31.97
84	600259	广晟有色	49,919,432.95	31.64
85	300279	和晶科技	49,318,203.91	31.26
86	002559	亚威股份	49,181,438.19	31.18
87	000925	众合机电	48,768,963.13	30.91
88	002404	嘉欣丝绸	48,735,334.29	30.89
89	300059	东方财富	48,401,189.95	30.68
90	002580	圣阳股份	48,369,482.70	30.66
91	600327	大东方	48,284,173.15	30.61
92	000686	东北证券	48,122,247.71	30.50
93	002631	德尔家居	47,942,969.32	30.39
94	002421	达实智能	47,809,203.77	30.31

95	600028	中国石化	47,651,734.66	30.21
96	002728	台城制药	47,554,905.59	30.14
97	600372	中航电子	47,554,262.41	30.14
98	000562	宏源证券	46,398,898.21	29.41
99	300347	泰格医药	45,935,965.75	29.12
100	300242	明家科技	45,834,506.17	29.05
101	002683	宏大爆破	45,083,700.26	28.58
102	600815	厦工股份	45,043,028.07	28.55
103	600862	南通科技	45,010,090.01	28.53
104	300065	海兰信	44,973,472.89	28.51
105	000538	云南白药	44,718,850.75	28.35
106	300116	坚瑞消防	44,303,362.49	28.08
107	002475	立讯精密	43,777,289.66	27.75
108	000776	广发证券	43,627,909.28	27.66
109	600590	泰豪科技	43,479,244.86	27.56
110	300104	乐视网	43,221,439.43	27.40
111	000423	东阿阿胶	42,649,060.99	27.03
112	002389	南洋科技	42,306,171.08	26.82
113	300269	联建光电	41,679,324.31	26.42
114	000783	长江证券	41,375,578.40	26.23
115	000656	金科股份	41,219,863.52	26.13
116	000883	湖北能源	41,173,492.40	26.10
117	600050	中国联通	41,013,658.83	26.00
118	300322	硕贝德	40,564,746.95	25.71
119	603456	九洲药业	40,346,383.36	25.58
120	300252	金信诺	40,043,308.00	25.38
121	601988	中国银行	39,927,498.05	25.31
122	600221	海南航空	39,798,266.00	25.23
123	600549	厦门钨业	39,762,590.18	25.21
124	600436	片仔癀	39,591,820.09	25.10
125	002338	奥普光电	39,551,535.01	25.07
126	002354	科冕木业	38,506,409.17	24.41
127	600979	广安爱众	37,722,236.34	23.91
128	000590	紫光古汉	37,641,073.43	23.86
129	002285	世联行	37,153,050.98	23.55
130	000851	高鸿股份	36,712,369.16	23.27
131	600970	中材国际	36,326,756.36	23.03
132	002655	共达电声	36,236,574.27	22.97

133	600432	吉恩镍业	35,967,335.35	22.80
134	601669	中国电建	35,306,663.82	22.38
135	600392	盛和资源	35,298,675.12	22.38
136	000901	航天科技	34,952,384.97	22.16
137	600893	航空动力	34,762,751.92	22.04
138	000712	锦龙股份	34,419,444.78	21.82
139	600233	大杨创世	34,361,014.47	21.78
140	000592	平潭发展	34,163,047.17	21.66
141	300020	银江股份	34,025,879.31	21.57
142	002102	冠福股份	33,646,217.25	21.33
143	600048	保利地产	33,261,743.07	21.08
144	000725	京东方A	32,944,279.17	20.88
145	600720	祁连山	32,318,803.49	20.49
146	600036	招商银行	32,262,233.72	20.45
147	300386	飞天诚信	32,076,556.11	20.33
148	002348	高乐股份	31,774,720.95	20.14
149	000418	小天鹅A	31,516,440.65	19.98
150	300334	津膜科技	31,463,495.98	19.94
151	002146	荣盛发展	31,231,598.36	19.80
152	300397	天和防务	31,071,785.87	19.70
153	002240	威华股份	30,992,724.47	19.65
154	002390	信邦制药	30,623,064.66	19.41
155	300379	东方通	30,579,816.72	19.38
156	002268	卫士通	30,472,653.35	19.32
157	601800	中国交建	30,406,502.85	19.27
158	600446	金证股份	30,396,478.90	19.27
159	600155	宝硕股份	30,396,202.00	19.27
160	600236	桂冠电力	30,224,035.80	19.16
161	600016	民生银行	30,064,737.20	19.06
162	300049	福瑞股份	30,002,885.80	19.02
163	002615	哈尔斯	29,671,421.97	18.81
164	000807	云铝股份	29,523,241.91	18.71
165	002136	安纳达	29,313,232.24	18.58
166	600210	紫江企业	29,198,542.60	18.51
167	600581	八一钢铁	29,154,142.39	18.48
168	000980	金马股份	28,941,768.45	18.35
169	601618	中国中冶	28,854,845.08	18.29
170	300096	易联众	28,740,048.44	18.22

171	300246	宝莱特	28,668,465.80	18.17
172	600320	振华重工	28,495,710.22	18.06
173	002414	高德红外	28,267,957.90	17.92
174	600969	郴电国际	27,971,037.36	17.73
175	300050	世纪鼎利	27,527,042.20	17.45
176	600458	时代新材	27,292,260.98	17.30
177	601992	金隅股份	27,056,284.77	17.15
178	601158	重庆水务	26,845,417.39	17.02
179	601998	中信银行	26,318,958.57	16.68
180	300037	新宙邦	26,146,119.87	16.57
181	600029	南方航空	26,145,349.88	16.57
182	002458	益生股份	26,024,986.10	16.50
183	002556	辉隆股份	25,802,352.00	16.36
184	600588	用友软件	25,681,894.17	16.28
185	600358	国旅联合	25,551,062.24	16.20
186	601336	新华保险	25,361,849.19	16.08
187	601111	中国国航	25,122,608.68	15.93
188	600737	中粮屯河	24,957,596.80	15.82
189	000768	中航飞机	24,917,019.80	15.79
190	300378	鼎捷软件	24,794,955.22	15.72
191	600115	东方航空	24,773,799.70	15.70
192	002174	游族网络	24,566,699.27	15.57
193	000961	中南建设	24,437,406.65	15.49
194	600723	首商股份	24,294,745.62	15.40
195	002312	三泰电子	24,100,678.70	15.28
196	600598	*ST 大荒	24,060,254.72	15.25
197	002579	中京电子	23,941,702.13	15.18
198	300324	旋极信息	23,636,888.28	14.98
199	600999	招商证券	23,209,385.71	14.71
200	000998	隆平高科	23,146,820.79	14.67
201	600031	三一重工	23,132,987.84	14.66
202	600776	东方通信	22,970,324.10	14.56
203	601328	交通银行	22,850,113.63	14.48
204	000612	焦作万方	22,813,818.24	14.46
205	601299	中国北车	22,710,540.85	14.40
206	600651	飞乐音响	22,617,445.40	14.34
207	000996	中国中期	22,501,948.63	14.26
208	300169	天晟新材	22,402,556.50	14.20

209	000596	古井贡酒	22,254,588.23	14.11
210	002524	光正集团	22,233,715.04	14.09
211	300227	光韵达	22,229,236.13	14.09
212	600998	九州通	21,972,802.71	13.93
213	600120	浙江东方	21,914,472.78	13.89
214	000059	华锦股份	21,831,494.34	13.84
215	002241	歌尔声学	21,798,245.72	13.82
216	300321	同大股份	21,784,753.48	13.81
217	300016	北陆药业	20,906,486.22	13.25
218	300113	顺网科技	20,699,031.61	13.12
219	002051	中工国际	20,675,237.63	13.11
220	002214	大立科技	20,660,912.18	13.10
221	300166	东方国信	20,555,676.08	13.03
222	000417	合肥百货	20,534,768.60	13.02
223	600369	西南证券	20,381,835.26	12.92
224	603000	人民网	20,256,601.74	12.84
225	600745	中茵股份	20,189,841.67	12.80
226	600391	成发科技	20,181,745.00	12.79
227	000673	当代东方	20,135,723.24	12.76
228	300086	康芝药业	20,100,833.95	12.74
229	000002	万科A	20,022,718.90	12.69
230	000728	国元证券	20,016,484.22	12.69
231	600565	迪马股份	19,952,840.67	12.65
232	601166	兴业银行	19,859,941.76	12.59
233	000688	建新矿业	19,719,858.96	12.50
234	600585	海螺水泥	19,606,966.11	12.43
235	600240	华业地产	19,416,156.34	12.31
236	000568	泸州老窖	19,406,846.38	12.30
237	300058	蓝色光标	19,269,263.98	12.21
238	002502	骅威股份	19,184,276.92	12.16
239	300340	科恒股份	18,619,198.74	11.80
240	300398	飞凯材料	18,586,933.63	11.78
241	601099	太平洋	18,539,428.23	11.75
242	000733	振华科技	18,190,324.95	11.53
243	300155	安居宝	18,187,719.40	11.53
244	600767	运盛实业	18,133,444.84	11.49
245	002416	爱施德	18,022,280.10	11.42
246	002711	欧浦钢网	17,955,897.48	11.38

247	000858	五 粮 液	17,919,080.31	11.36
248	601225	陕西煤业	17,915,510.59	11.36
249	002466	天齐锂业	17,889,075.56	11.34
250	000958	东方能源	17,799,904.74	11.28
251	600189	吉林森工	17,761,020.47	11.26
252	600655	豫园商城	17,710,915.86	11.23
253	600116	三峡水利	17,625,688.79	11.17
254	600173	卧龙地产	17,499,401.65	11.09
255	601186	中国铁建	17,397,725.44	11.03
256	000638	万方发展	17,300,261.65	10.97
257	601628	中国人寿	17,206,434.07	10.91
258	600662	强生控股	16,957,480.00	10.75
259	300172	中电环保	16,832,166.35	10.67
260	600212	江泉实业	16,819,320.17	10.66
261	002445	中南重工	16,642,789.80	10.55
262	600694	大商股份	16,588,401.32	10.52
263	002436	兴森科技	16,553,959.52	10.49
264	000587	金叶珠宝	16,380,420.32	10.38
265	002368	太极股份	16,307,366.91	10.34
266	000888	峨眉山 A	16,192,756.71	10.26
267	300317	珈伟股份	16,190,751.15	10.26
268	600455	博通股份	16,148,232.86	10.24
269	300073	当升科技	16,112,787.87	10.21
270	600109	国金证券	16,054,427.17	10.18
271	000570	苏常柴 A	16,006,748.35	10.15
272	600559	老白干酒	15,979,317.89	10.13
273	600094	大名城	15,948,249.46	10.11
274	600715	松辽汽车	15,924,223.18	10.09
275	000895	双汇发展	15,906,519.47	10.08
276	300369	绿盟科技	15,856,473.22	10.05
277	600808	马钢股份	15,797,947.63	10.01
278	000933	神火股份	15,701,331.39	9.95
279	000869	张 裕 A	15,612,308.42	9.90
280	002410	广联达	15,278,979.82	9.69
281	600497	驰宏锌锗	15,172,215.33	9.62
282	300019	硅宝科技	14,934,990.31	9.47
283	300107	建新股份	14,700,843.43	9.32
284	600498	烽火通信	14,670,578.05	9.30

285	600570	恒生电子	14,663,815.97	9.30
286	603005	晶方科技	14,606,769.85	9.26
287	002181	粤传媒	14,534,159.77	9.21
288	300391	康跃科技	14,431,457.74	9.15
289	300055	万邦达	14,309,503.08	9.07
290	600509	天富能源	14,283,264.97	9.05
291	601857	中国石油	13,951,254.88	8.84
292	300220	金运激光	13,801,444.75	8.75
293	600545	新疆城建	13,614,585.97	8.63
294	002640	百圆裤业	13,511,294.55	8.56
295	000718	苏宁环球	13,310,703.30	8.44
296	002366	丹甫股份	13,215,374.00	8.38
297	002491	通鼎光电	13,031,358.69	8.26
298	300235	方直科技	12,752,849.62	8.08
299	002551	尚荣医疗	12,738,777.39	8.08
300	002412	汉森制药	12,692,513.64	8.05
301	300071	华谊嘉信	12,370,274.12	7.84
302	300295	三六五网	12,120,635.90	7.68
303	600971	恒源煤电	12,095,670.12	7.67
304	600489	中金黄金	12,074,405.42	7.65
305	002008	大族激光	12,023,422.12	7.62
306	600779	水井坊	11,908,570.70	7.55
307	002673	西部证券	11,872,742.84	7.53
308	000697	炼石有色	11,783,416.34	7.47
309	002005	德豪润达	11,768,042.36	7.46
310	002307	北新路桥	11,747,785.80	7.45
311	600568	中珠控股	11,707,163.82	7.42
312	000066	长城电脑	11,685,731.98	7.41
313	000060	中金岭南	11,647,884.42	7.38
314	000975	银泰资源	11,524,118.51	7.31
315	002108	沧州明珠	11,514,922.99	7.30
316	300012	华测检测	11,396,869.51	7.22
317	600763	通策医疗	11,306,201.60	7.17
318	002182	云海金属	11,227,873.45	7.12
319	601989	中国重工	11,058,949.04	7.01
320	600556	北生药业	11,028,030.89	6.99
321	300034	钢研高纳	10,953,951.64	6.94
322	000681	视觉中国	10,845,302.74	6.87

323	600616	金枫酒业	10,842,207.46	6.87
324	600376	首开股份	10,817,105.27	6.86
325	002544	杰赛科技	10,741,422.83	6.81
326	002325	洪涛股份	10,738,959.69	6.81
327	002030	达安基因	10,666,406.39	6.76
328	300006	莱美药业	10,569,066.81	6.70
329	000711	京蓝科技	10,495,533.00	6.65
330	600280	中央商场	10,317,683.77	6.54
331	600366	宁波韵升	10,314,640.62	6.54
332	600884	杉杉股份	10,263,967.77	6.51
333	600015	华夏银行	10,123,340.40	6.42
334	300129	泰胜风能	10,105,206.80	6.41
335	300226	上海钢联	10,088,818.04	6.40
336	000620	新华联	10,083,884.06	6.39
337	600000	浦发银行	10,050,770.69	6.37
338	000753	漳州发展	10,043,791.43	6.37
339	002649	博彦科技	9,999,545.10	6.34
340	000960	锡业股份	9,993,130.00	6.33
341	000932	华菱钢铁	9,947,332.16	6.31
342	600633	浙报传媒	9,924,604.78	6.29
343	603369	今世缘	9,905,543.91	6.28
344	600519	贵州茅台	9,895,528.10	6.27
345	002180	艾派克	9,783,759.56	6.20
346	601169	北京银行	9,712,512.20	6.16
347	300061	康耐特	9,712,390.78	6.16
348	600022	山东钢铁	9,693,470.25	6.14
349	002465	海格通信	9,651,225.70	6.12
350	600429	三元股份	9,639,373.18	6.11
351	002142	宁波银行	9,595,417.20	6.08
352	002276	万马股份	9,593,271.32	6.08
353	000860	顺鑫农业	9,581,730.31	6.07
354	000838	国兴地产	9,536,981.09	6.05
355	000561	烽火电子	9,517,949.29	6.03
356	002273	水晶光电	9,441,564.00	5.98
357	300101	振芯科技	9,405,621.32	5.96
358	600645	中源协和	9,111,404.50	5.78
359	002126	银轮股份	9,023,916.00	5.72
360	002207	准油股份	8,980,884.43	5.69

361	000540	中天城投	8,965,303.42	5.68
362	002713	东易日盛	8,835,697.35	5.60
363	002037	久联发展	8,787,694.40	5.57
364	600180	瑞茂通	8,731,653.60	5.53
365	601958	金钼股份	8,701,564.30	5.52
366	002552	宝鼎重工	8,655,493.97	5.49
367	600640	号百控股	8,430,091.81	5.34
368	600879	航天电子	8,419,302.22	5.34
369	000559	万向钱潮	8,410,124.64	5.33
370	000995	皇台酒业	8,368,157.81	5.30
371	601633	长城汽车	8,333,316.68	5.28
372	600428	中远航运	8,324,777.86	5.28
373	601808	中海油服	8,209,765.47	5.20
374	600169	太原重工	8,147,602.84	5.16
375	300074	华平股份	8,146,313.26	5.16
376	600759	洲际油气	8,143,400.07	5.16
377	000732	泰禾集团	8,129,258.54	5.15
378	002428	云南锗业	8,079,069.01	5.12
379	600168	武汉控股	8,004,674.70	5.07
380	300177	中海达	7,810,626.11	4.95
381	600761	安徽合力	7,679,010.49	4.87
382	300209	天泽信息	7,678,535.79	4.87
383	000957	中通客车	7,561,202.55	4.79
384	600525	长园集团	7,480,588.24	4.74
385	600562	国睿科技	7,444,635.04	4.72
386	600390	金瑞科技	7,175,633.80	4.55
387	300351	永贵电器	7,128,105.02	4.52
388	600583	海油工程	7,102,409.18	4.50
389	300150	世纪瑞尔	7,076,395.30	4.49
390	000693	华泽钴镍	7,054,735.72	4.47
391	002195	海隆软件	7,033,907.11	4.46
392	300202	聚龙股份	7,012,331.83	4.45
393	600816	安信信托	6,899,751.82	4.37
394	300363	博腾股份	6,897,284.65	4.37
395	000401	冀东水泥	6,853,288.70	4.34
396	600059	古越龙山	6,828,019.38	4.33
397	000988	华工科技	6,803,900.78	4.31
398	600060	海信电器	6,769,853.68	4.29

399	002516	江苏旷达	6,739,089.63	4.27
400	300315	掌趣科技	6,678,479.54	4.23
401	300161	华中数控	6,673,705.60	4.23
402	600809	山西汾酒	6,663,625.99	4.22
403	002415	海康威视	6,605,371.48	4.19
404	000530	大冷股份	6,507,288.81	4.12
405	002244	滨江集团	6,369,948.11	4.04
406	600580	卧龙电气	6,263,908.91	3.97
407	002476	宝莫股份	6,262,472.02	3.97
408	600399	抚顺特钢	6,244,763.86	3.96
409	600778	友好集团	6,181,542.91	3.92
410	600340	华夏幸福	6,174,246.97	3.91
411	300133	华策影视	6,119,733.89	3.88
412	002080	中材科技	6,061,691.48	3.84
413	002190	成飞集成	5,977,715.30	3.79
414	300273	和佳股份	5,975,756.71	3.79
415	000967	上风高科	5,938,699.34	3.76
416	002601	佰利联	5,910,781.10	3.75
417	300115	长盈精密	5,803,068.75	3.68
418	601766	中国南车	5,799,306.00	3.68
419	002380	科远股份	5,775,246.19	3.66
420	600648	外高桥	5,761,345.02	3.65
421	600490	鹏欣资源	5,711,008.40	3.62
422	300140	启源装备	5,698,216.30	3.61
423	600765	中航重机	5,664,804.77	3.59
424	300368	汇金股份	5,620,676.75	3.56
425	002665	首航节能	5,397,775.00	3.42
426	600699	均胜电子	5,379,708.88	3.41
427	000625	长安汽车	5,318,334.59	3.37
428	002669	康达新材	5,306,079.00	3.36
429	002097	山河智能	5,304,668.80	3.36
430	601890	亚星锚链	5,279,755.61	3.35
431	000801	四川九洲	5,274,530.46	3.34
432	002700	新疆浩源	5,269,056.51	3.34
433	600256	广汇能源	5,244,597.13	3.32
434	000898	鞍钢股份	5,207,218.28	3.30
435	600742	一汽富维	5,180,235.43	3.28
436	300068	南都电源	5,152,223.45	3.27

437	002152	广电运通	5,152,153.54	3.27
438	002296	辉煌科技	5,119,633.16	3.25
439	600456	宝钛股份	5,060,151.41	3.21
440	002318	久立特材	5,048,029.92	3.20
441	600085	同仁堂	5,044,984.11	3.20
442	000825	太钢不锈	5,044,720.00	3.20
443	601901	方正证券	5,041,005.00	3.20
444	300041	回天新材	5,040,000.48	3.19
445	601519	大智慧	5,033,002.47	3.19
446	600855	航天长峰	4,902,640.24	3.11
447	600895	张江高科	4,894,586.47	3.10
448	000937	冀中能源	4,859,503.36	3.08
449	002091	江苏国泰	4,856,121.31	3.08
450	002714	牧原股份	4,854,606.90	3.08
451	002407	多氟多	4,847,908.13	3.07
452	002666	德联集团	4,782,965.42	3.03
453	002236	大华股份	4,761,622.02	3.02
454	000917	电广传媒	4,711,583.66	2.99
455	300274	阳光电源	4,610,621.96	2.92
456	300298	三诺生物	4,586,819.07	2.91
457	600557	康缘药业	4,567,672.70	2.90
458	600444	国通管业	4,560,937.47	2.89
459	000966	长源电力	4,531,818.35	2.87
460	600978	宜华木业	4,519,742.91	2.87
461	600677	航天通信	4,502,974.37	2.85
462	600303	曙光股份	4,449,728.80	2.82
463	002573	国电清新	4,435,030.11	2.81
464	600536	中国软件	4,431,233.70	2.81
465	002049	同方国芯	4,366,001.96	2.77
466	002223	鱼跃医疗	4,364,633.44	2.77
467	600026	中海发展	4,323,104.19	2.74
468	000099	中信海直	4,319,998.47	2.74
469	002555	顺荣股份	4,289,872.68	2.72
470	000877	天山股份	4,237,796.37	2.69
471	600495	晋西车轴	4,165,079.24	2.64
472	002143	高金食品	4,164,866.39	2.64
473	000425	徐工机械	4,152,174.91	2.63
474	000687	恒天天鹅	4,130,808.95	2.62

475	300043	互动娱乐	4,078,356.44	2.59
476	300275	梅安森	4,074,141.42	2.58
477	300194	福安药业	4,070,880.63	2.58
478	600801	华新水泥	4,067,832.22	2.58
479	600316	洪都航空	4,064,704.20	2.58
480	002013	中航机电	4,026,702.00	2.55
481	300027	华谊兄弟	3,997,412.50	2.53
482	002543	万和电气	3,995,153.91	2.53
483	300162	雷曼光电	3,983,529.27	2.53
484	002235	安妮股份	3,970,042.12	2.52
485	600624	复旦复华	3,956,071.70	2.51
486	600290	华仪电气	3,932,237.63	2.49
487	600787	中储股份	3,916,521.92	2.48
488	002292	奥飞动漫	3,879,360.00	2.46
489	000965	天保基建	3,863,521.00	2.45
490	600237	铜峰电子	3,847,990.88	2.44
491	000793	华闻传媒	3,820,613.95	2.42
492	300339	润和软件	3,816,377.84	2.42
493	600266	北京城建	3,778,481.53	2.40
494	300128	锦富新材	3,752,686.97	2.38
495	002371	七星电子	3,743,115.64	2.37
496	603993	洛阳钼业	3,726,081.95	2.36
497	000409	山东地矿	3,718,957.12	2.36
498	002678	珠江钢琴	3,694,158.08	2.34
499	000541	佛山照明	3,649,313.20	2.31
500	300203	聚光科技	3,631,101.69	2.30
501	600157	永泰能源	3,596,012.49	2.28
502	300251	光线传媒	3,436,031.06	2.18
503	002153	石基信息	3,430,543.00	2.17
504	002484	江海股份	3,412,293.70	2.16
505	000786	北新建材	3,392,790.21	2.15
506	601258	庞大集团	3,386,200.19	2.15
507	600705	中航资本	3,383,097.50	2.14
508	002024	苏宁云商	3,339,818.00	2.12
509	600704	物产中大	3,278,403.78	2.08
510	600185	格力地产	3,260,036.68	2.07
511	600073	上海梅林	3,240,955.00	2.05
512	600540	新赛股份	3,225,447.36	2.04

513	002095	生意宝	3,212,050.32	2.04
514	600089	特变电工	3,178,459.47	2.01
515	601899	紫金矿业	3,177,725.90	2.01

注：1、卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票；
2、卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	17,475,397,140.57
卖出股票收入（成交）总额	15,004,360,442.88

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的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。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货投资，也无期间损益。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期无股指期货投资。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期无国债期货投资。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货投资，也无期间损益。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期无国债期货投资。

8.12 投资组合报告附注

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

8.12.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,049,192.55
2	应收证券清算款	129,207,456.85
3	应收股利	-
4	应收利息	78,749.07
5	应收申购款	26,362,153.87
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	157,697,552.34

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	002329	皇氏集团	171,488,488.00	5.44	重大事项
2	002439	启明星辰	159,040,788.16	5.04	重大事项

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
67,902	28,100.29	826,936,119.39	43.34%	1,081,129,984.88	56.66%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	2,195,392.28	0.1151%

9.3 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	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	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013年11月11日）基金份额总额	227,090,220.27
本报告期期初基金份额总额	156,860,820.07
本报告期基金总申购份额	3,235,796,354.33
减:本报告期基金总赎回份额	1,484,591,070.13
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-

本报告期末基金份额总额	1,908,066,104.27
-------------	------------------

注：1、报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额；
2、报告期期间基金总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期，本基金未召开持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人：

报告期内基金管理人无重大人事变动。

2、基金托管人：

因中国农业银行股份有限公司（以下简称“本行”）工作需要，任命余晓晨先生主持本行托管业务部/养老金管理中心工作。余晓晨先生的基金行业高级管理人员任职资格已在中国基金业协会备案。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期无投资策略的改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内应支付给安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用玖万元整，该审计机构自基金合同生效日起向本基金提供审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，管理人及其高级管理人员，托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到稽查或任何处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	2	9,715,898,204.89	29.91%	8,689,705.90	31.53%	-
中信建投	2	4,645,996,204.32	14.30%	3,180,454.17	11.54%	-
申银万国	2	2,666,483,533.30	8.21%	1,894,262.98	6.87%	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	1,862,367.50	0.01%	1,647.99	0.01%	-
光大证券	2	6,839,575,032.41	21.06%	6,099,022.77	22.13%	-
安信证券	2	8,609,690,386.03	26.51%	7,690,753.41	27.91%	-
中投证券	1	-	-	-	-	-

注：1. 券商的选择标准和程序

(1) 选择标准：注重综合服务能力

a) 券商财务状况良好、经营行为规范、风险管理先进、投资风格与工银瑞信有互补性、在最近一年内无重大违规行为。

b) 券商具有较强的综合研究能力：能及时、全面、定期提供高质量的关于宏观、行业、资本市场、个股分析报告及其他丰富全面的信息咨询服务；有很强的分析能力，能根据工银瑞信所管理基金的特定要求，提供专门研究报告；具有开发量化投资组合模型的能力以及其他综合服务能力。

c) 与其他券商相比，该券商能够提供最佳交易执行和优惠合理的佣金率。

(2) 选择程序

a) 确定券商数量：根据以上标准对不同券商进行考察、选择和确定。投资研究部门（权益投资部，固定收益部，专户投资部，研究部和中央交易室）根据公司基金规模和服务需求等因素确定对合作券商的数量，每年根据公司经营规模变化及券商评估结果决定是否需要新增或调整合作券商，选定的名单需经主管投资副总和总经理审批同意。

b) 签订委托协议：与被选择的券商签订委托代理协议，明确签定协议双方的公司名称、委托代理期限、佣金率、双方的权利义务等，经签章有效。委托代理协议一式五份，协议双方及证券主管机关各留存一份，工银瑞信法律合规部留存备案，并报相关证券主管机关留存报备。

2. 券商的评估，保留和更换程序

(1) 席位的租用期限暂定为一年，合同到期 15 天内，投资研究部门将根据各券商研究在服务期间的综合证券服务质量等情况，进行评估。

(2) 对于符合标准的券商，工银瑞信将与其续约；对于不能达到标准的券商，不与其续约，并根

据券商选择标准和程序，重新选择其它经营稳健、研究能力强、综合服务质量高的证券经营机构，租用其交易席位。

(3) 若券商提供的综合证券服务不符合要求，工银瑞信有权按照委托协议规定，提前中止租用其交易席位。

证券公司席位的变更情况

在报告期内本基金新增光大证券股份有限公司的 28504 上海交易单元和 394547 深圳交易单元，中信证券股份有限公司的 29209 上海交易单元和 391090 深圳交易单元，中信建投证券有限责任公司的 29691 上海交易单元和 394994 深圳交易单元，申银万国证券股份有限公司的 29609 上海交易单元和 394584 深圳交易单元，中国中投证券有限责任公司的 31062 上海交易单元和国信证券股份有限公司的 396091 深圳交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信证券	-	-	373,900,000.00	21.99%	-	-
中信建投	-	-	50,000,000.00	2.94%	-	-
安信证券	-	-	1,096,100,000.00	64.48%	-	-
申银万国	-	-	180,000,000.00	10.59%	-	-

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

无。