

工银瑞信主题策略股票型证券投资基金 2015 年半年度报告摘要

2015 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：交通银行股份有限公司

送出日期：二〇一五年八月二十八日

§ 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 8 月 21 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 2015 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	工银主题策略股票
基金主代码	481015
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 10 月 24 日
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,017,895,168.58 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	结合宏观经济转型方向，通过分析社会经济热点动向，把握相关主题投资机会，追求基金资产长期稳定的增值和收益，在控制投资风险的同时，力争持续实现超越业绩基准的收益。
投资策略	类别资产配置上，本基金运用国际化的视野审视中国经济和资本市场，依据定量和定性相结合的方法，考虑经济情景、类别资产收益风险预期等因素，在股票与债券等资产类别之间进行资产配置。在股票投资方面，本基金主要采取主题投资策略，在宏观经济发展的不同阶段，关注经济发展热点，深入挖掘潜在的主题投资机会，寻找实质受益的上市公司，并综合考虑其基本面情况，选择具备投资价值的股票，构建投资组合，并不断优化组合，争取获得超越业绩基准的收益水平。本基金还将在法规允许的范围内，基于谨慎原则利用权证以及其它金融工具进行套利交易或风险管理，为基金收益提供增加价值。
业绩比较基准	80%×沪深 300 指数收益率+20%×中债综合指数收益率
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债券型基金、混合型基金和货币市场基金，属于风险水平较高的基金。

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	交通银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	朱碧艳	汤嵩彦
	联系电话	400-811-9999	95559
	电子邮箱	customerservice@icbccs.com.cn	tangsy@bankcomm.com
客户服务电话		400-811-9999	95559
传真		010-66583158	021-62701216

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(2015年1月1日 - 2015年6月30日)
本期已实现收益	100,975,878.92
本期利润	-96,439,851.89
加权平均基金份额本期利润	-0.1982
本期基金份额净值增长率	75.65%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.8657
期末基金资产净值	2,907,318,093.60
期末基金份额净值	2.856

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、本基金基金合同生效日为 2011 年 10 月 24 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

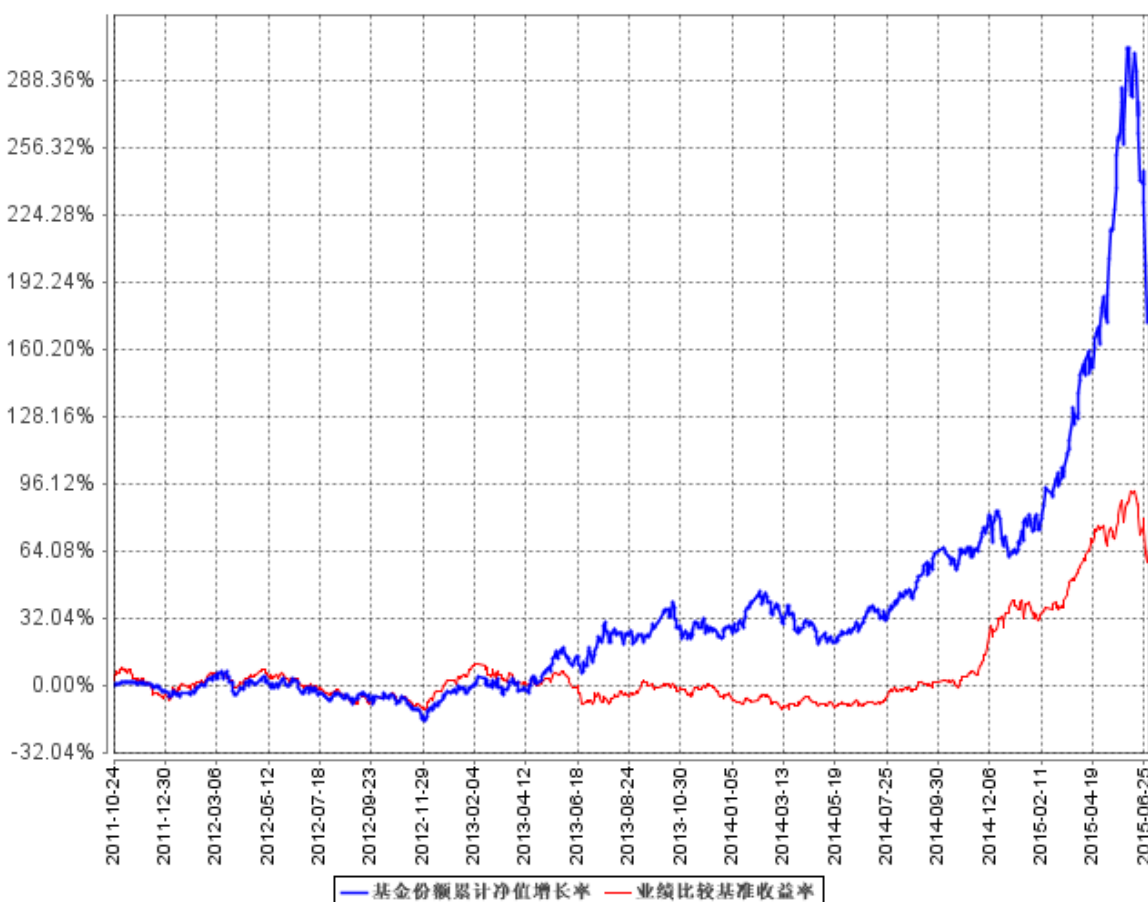
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去一个月	-21.82%	4.21%	-5.88%	2.80%	-15.94%	1.41%
过去三个月	24.01%	3.38%	9.12%	2.09%	14.89%	1.29%
过去六个月	75.65%	2.75%	22.10%	1.81%	53.55%	0.94%
过去一年	111.40%	2.20%	82.54%	1.47%	28.86%	0.73%
过去三年	190.84%	1.74%	67.69%	1.20%	123.15%	0.54%
自基金合同 生效起至今	185.60%	1.63%	67.40%	1.17%	118.20%	0.46%

注：1、本基金的业绩比较基准为： $80\% \times$ 沪深 300 指数收益率 $+20\% \times$ 中债综合指数收益率，每日进行再平衡过程；

2、本基金基金合同生效日为 2011 年 10 月 24 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 2011 年 10 月 24 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，本基金的投资符合基金合同的相关规定：本基金股票资产占基金资产的比例为 60%–95%，债券、现金等金融工具及其他资产占基金

资产的比例为 5%-40%，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%。

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为工银瑞信基金管理有限公司，成立于 2005 年 6 月 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 2015 年 6 月 30 日，公司旗下管理 66 只公募基金——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、工银瑞信国企改革主题股票型证券投资基金、工银瑞信战略转型主题股票型证券投资基金、工银瑞信新金融股票型证券投资基金、工银瑞信美丽城镇主题股票型证券投资基金、工银瑞信总回报灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信新材料新能源行业股票型证券投资基金、工银瑞信养老产业股票型证券投资基金、工银瑞信丰盈回报灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金、工银瑞信农业产业股票型证券投资基金、工银瑞信生态环境行业股票型证券投资基金、工银瑞信互联网加股票型证券投资基金、工银瑞信财富快线货币市场基金、工银瑞信聚焦 30 股票型证券投资基金，证券投资基金管理规模逾 3500 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		
黄安乐	权益投资部总监，本基金的基金经理	2011 年 11 月 23 日	-	12	先后在天相投资顾问有限公司担任研究员，国信证券经济研究所担任资深分析师，国信证券资产管理总部担任投资经理、研究员；2010 年加入工银瑞信，现任权益投资部总监。2011 年 11 月 23 日至今，担任工银主题策略股票基金基金经理；2013 年 9 月 23 日至今，担任工银瑞信精选平衡基金基金经理；2014 年 10 月 22 日至今，担任工银高端制造行业股票型基金基金经理；2015 年 4 月 28 日至今，担任工银新材料新能源行业股票型基金基金经理。

注：

- 1、任职日期说明：黄安乐的任职日期为公司执委会决议正式生效日期。
- 2、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。
- 3、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遵规守信情况的说明

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

4.3 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，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超过该证券当日成交量的 5%的情况有 4 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

2015 年上半年的市场行情，从年初至 6 月份中旬，一直是中小盘成长股的天下，以互

联网产业化和产业互联网化、工业 4.0、精准医疗等主题为核心，蔓延到计算机、传媒、机械、电力设备、医药、轻工等行业中，这些行业得到市场的热烈追捧，股价大幅度上涨。

应该说，今年的中小盘成长股行情，其背后的推动力是流动性，以及对政府鼓励的改革和转型的信心，上市公司的业绩还跟不上股票的估值，在股价快速上涨的过程中，风险不断积聚。6 月中旬之后，相关部门也意识到杠杆隐藏的风险，开始清理和限制；同时市场开始怀疑流动性衰减，因此，在资金做空股指期货的情况下，市场从高位快速下跌；进而引发融资盘的崩盘，中小成长股的流动性日益枯竭，恐慌情绪蔓延，引发了更大范围和幅度的无量暴跌，整个市场笼罩在系统性风险之下。

上半年，本基金的净值增长显著得益于中小盘成长股的上涨，本基金的配置集中在 TMT、医药、机械、轻工等行业，同时在这些行业中进行个股精选集中投资。但在系统性风险爆发的市场环境下，由于基金仓位比较高，因此 6 月中旬之后，本基金的净值也跟随市场出现了较大幅度的回撤。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值增长率为 75.65%，业绩比较基准增长率为 22.10%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年以来，国内宏观经济下行的压力持续存在，政府通过一系列的政策来刺激经济的发展，但其成效也仅仅体现在稳住下行的速度，而非推动经济发展趋势的扭转；我们预计经济在 3 季度末会有一些的反弹，但全年的形势未有明显好转，7%的 GDP 增长，尚有一定的压力。

流动性层面，短期内不会有大的方向性改变，即仍能保持较为充裕的状态；如果经济反弹，可能适度收紧。由于流动性充裕的状态已经持续较长时间，并充分反映在股市层面，因此，我们更关注短期的流动性预期的变化对股票市场的影响。

由于 6 月中旬以来，中小成长股虚高，股指期货做空以及融资盘的平仓，导致了持续的抛压，以中小盘成长股为代表的板块，流动性日趋衰竭，在短期内快速大幅度下跌，造成了严重的系统性风险。

我们认为，在大幅下跌之后，由于巨量融资盘抛压的存在，即便是政府救市，市场也难以很快恢复上涨，我们倾向于认为，在去杠杆的过程中，市场进入博弈阶段，震荡波动加剧，缺乏趋势性行情；到去杠杆的后期，真正优质的公司，因估值和成长性匹配度好，有望重新回到上升轨道。因此，下半年，挑选成长确定性高、估值合理的公司构建投资组合，有望获得好的投资回报。

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

(1) 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。

(2) 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

2015 年上半年度，基金托管人在工银瑞信主题策略股票型证券投资基金的托管过程中，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，尽职尽责地履行了托管

人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2015 年上半年度，工银瑞信基金管理有限公司在工银瑞信主题策略股票型证券投资基金的基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2015 年上半年度，由工银瑞信基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关工银瑞信主题策略股票型证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 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：工银瑞信主题策略股票型证券投资基金
报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款		411,451,862.23	19,156,600.13
结算备付金		20,477,591.72	2,011,972.44
存出保证金		1,125,423.75	137,449.77
交易性金融资产		2,729,505,747.20	269,544,072.82
其中：股票投资		2,729,505,747.20	264,544,072.82
基金投资		-	-
债券投资		-	5,000,000.00
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		138,302,273.75	30,171,132.45
应收利息		73,352.68	120,746.42
应收股利		-	-
应收申购款		19,859,967.11	4,092,251.31
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		3,320,796,218.44	325,234,225.34
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014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		-	3,989,063.09
应付赎回款		400,585,277.90	37,444,103.55
应付管理人报酬		5,367,536.63	396,668.93
应付托管费		894,589.43	66,111.50
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		4,961,030.98	1,031,262.66
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		1,669,689.90	192,563.15
负债合计		413,478,124.84	43,119,772.88
所有者权益:			
实收基金		1,017,895,168.58	173,448,874.51
未分配利润		1,889,422,925.02	108,665,577.95
所有者权益合计		2,907,318,093.60	282,114,452.46
负债和所有者权益总计		3,320,796,218.44	325,234,225.34

注：1、报告截止日 2015 年 06 月 30 日，基金份额净值 2.856 元，基金份额总额 1,017,895,168.58 份。

2、本基金基金合同生效日为 2011 年 10 月 24 日。

6.2 利润表

会计主体：工银瑞信主题策略股票型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
一、收入		-73,890,372.42	7,577,818.48
1.利息收入		603,668.98	179,604.07
其中：存款利息收入		514,585.42	26,954.99
债券利息收入		89,083.56	108,631.51
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	44,017.57
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		116,996,957.12	4,788,165.22
其中：股票投资收益		108,546,262.15	4,322,296.93
基金投资收益		-	-
债券投资收益		9,024.66	23,940.00
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		8,441,670.31	441,928.29
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-197,415,730.81	2,594,643.98
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		5,924,732.29	15,405.21
减：二、费用		22,549,479.47	1,592,764.90
1. 管理人报酬		10,878,063.17	744,505.93
2. 托管费		1,813,010.53	124,084.36
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		9,669,632.71	534,846.35
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		188,773.06	189,328.26
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-96,439,851.89	5,985,053.58
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-96,439,851.89	5,985,053.58

注：本基金基金合同生效日为 2011 年 10 月 24 日。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：工银瑞信主题策略股票型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 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）	173,448,874.51	108,665,577.95	282,114,452.46
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-96,439,851.89	-96,439,851.89
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）	844,446,294.07	1,877,197,198.96	2,721,643,493.03
其中：1.基金申购款	2,414,245,347.76	5,107,362,506.19	7,521,607,853.95
2.基金赎回款	-1,569,799,053.69	-3,230,165,307.23	-4,799,964,360.92
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）	1,017,895,168.58	1,889,422,925.02	2,907,318,093.60
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 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）	77,211,431.44	20,959,143.37	98,170,574.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	5,985,053.58	5,985,053.58
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）	-76,470.69	105,402.33	28,931.64
其中：1.基金申购款	21,732,374.81	7,480,435.82	29,212,810.63
2.基金赎回款	-21,808,845.50	-7,375,033.49	-29,183,878.99
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）	77,134,960.75	27,049,599.28	104,184,560.03

注：本基金基金合同生效日为 2011 年 10 月 24 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：

<u>郭特华</u>	<u>郭特华</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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

工银瑞信主题策略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[2011]1340 号文号文《关于同意核准工银瑞信主题策略股票型证券投资基金募集的批复》的核准，由工银瑞信基金管理有限公司向社会公开募集，基金合同于 2011 年 10 月 24 日正式生效。首次设立时募集的规模为 631,826,498.75 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，基金托管人为交通银行股份有限公司。

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、央票、回购，以及法律法规允许或经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具，但须符合中国证监会相关规定。其中，股票资产占基金资产的比例为 60%-95%，债券、现金等金融工具及其他资产占基金资产的比例为 5%-40%。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： $80\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 20\% \times \text{中债综合指数收益率}$ 。

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《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 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会颁布的相关规定。

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 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年上半年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与最近一期年度报告相一致。会计估计变更请详见 6.4.5.2 的说明。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

根据中国证券投资基金业协会中基协发(2014)24 号关于发布《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》通知的规定，本报告期本基金对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)改为采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值。具体参见我司于 2015 年 3 月 27 日发布的《工银瑞信基金管理有限公司关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告》。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的差错更正事项。

6.4.6 税项

6.4.6.1 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。

6.4.6.2 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。

6.4.6.3 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。

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、基金注册登记机构、基金销售机构

交通银行股份有限公司	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
工银瑞信投资管理有限公司	基金管理人子公司

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

本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的交易。

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	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年6月30日	2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	10,878,063.17	744,505.93
其中：支付销售机构的客户维护费	4,162,473.86	281,452.06

注：基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

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，按月支付。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年6月30日	2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,813,010.53	124,084.36

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。

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

本基金本报告期与上年度可比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。

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自有资金投资本基金的情况**

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年6月30日	2014年1月1日至2014年6月30日
基金合同生效日（2011年10月24日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	0.00	-
期间申购/买入总份额	3,467,157.75	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	3,467,157.75	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.34%	-

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

份额单位：份

关联方名称	本期末		上年度末	
	2015年6月30日		2014年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
工银瑞信投资管理有限公司	6,562,821.88	0.64%	-	-

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		上年度可比期间	
	2015年1月1日至2015年6月30日		2014年1月1日至2014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

交通银行股份 有限公司	411,451,862.23	456,064.62	849,264.71	21,606.83
----------------	----------------	------------	------------	-----------

注：1、本半年度末余额仅为活期存款，利息收入仅为活期存款利息收入。

2、上年度可比期末余额仅为活期存款，利息收入仅为活期存款利息收入。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期和上年度可比期间内均未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末（2015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

本基金本报告期末未持有因新发/增发证券而于期末持有的流通受限的证券。

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
002303	美盈森	2015年6月9日	重大事项	37.78	2015年7月13日	21.43	7,889,485	240,966,944.12	298,064,743.30	指数法估值
000566	海南海药	2015年6月18日	重大事项	40.76	-	-	6,699,929	265,823,193.42	273,089,106.04	指数法估值
002527	新时达	2015年6月15日	重大事项	24.25	-	-	3,299,607	83,006,592.54	80,015,469.75	指数法估值
002268	卫士通	2015年5月8日	重大事项	80.14	2015年8月4日	76.32	880,000	48,699,380.87	70,523,200.00	指数法估值
300373	扬杰科技	2015年6月9日	重大事项	64.92	2015年7月14日	74.25	1,000,640	56,997,042.56	64,961,548.80	指数法估值
002368	太极股份	2015年5月14日	重大事项	65.52	-	-	570,157	30,319,896.82	37,356,686.64	-
300203	聚光科技	2015年4月	重大事项	41.19	2015年8月	33.88	600,023	17,808,438.58	24,714,947.37	指数法估值

		20 日			12 日					
002200	云投生态	2015 年 5 月 29 日	重大 事项	27.07	2015 年 7 月 17 日	24.36	821,500	20,107,221.78	22,238,005.00	-

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 2015 年 6 月 30 日对资产净值和本期净利润的影响均为人民币-181,765,384.32 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

本基金本报告期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.9.3.2 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。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	2,729,505,747.20	82.19
	其中：股票	2,729,505,747.20	82.19
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	431,929,453.95	13.01
7	其他各项资产	159,361,017.29	4.80
8	合计	3,320,796,218.44	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

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	22,238,005.00	0.76
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,963,683,078.38	67.54
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	86,525,706.45	2.98
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	467,616,880.64	16.08
J	金融业	240,380.00	0.01
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	189,201,696.73	6.51
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	2,729,505,747.20	93.88

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

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的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	002690	美亚光电	7,600,902	298,487,421.54	10.27

2	002303	美盈森	7,889,485	298,064,743.30	10.25
3	000566	海南海药	6,699,929	273,089,106.04	9.39
4	000802	北京文化	6,499,543	189,201,696.73	6.51
5	002364	中恒电气	5,500,643	157,208,376.94	5.41
6	002421	达实智能	7,098,380	142,180,551.40	4.89
7	300352	北信源	2,800,035	121,521,519.00	4.18
8	600143	金发科技	10,170,310	121,230,095.20	4.17
9	300136	信维通信	4,299,528	107,058,247.20	3.68
10	002439	启明星辰	2,799,852	96,034,923.60	3.30

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	002690	美亚光电	355,887,404.40	126.15
2	000566	海南海药	267,009,703.98	94.65
3	601566	九牧王	243,150,615.35	86.19
4	300059	东方财富	243,013,599.34	86.14
5	002303	美盈森	241,843,055.28	85.73
6	002364	中恒电气	220,657,657.21	78.22
7	600143	金发科技	202,981,861.13	71.95
8	300352	北信源	197,590,567.90	70.04
9	002421	达实智能	193,567,437.48	68.61
10	000802	北京文化	178,558,475.46	63.29
11	600021	上海电力	143,417,416.59	50.84
12	600280	中央商场	138,236,440.02	49.00
13	600590	泰豪科技	115,585,347.57	40.97
14	600835	上海机电	104,970,094.66	37.21
15	002439	启明星辰	98,249,091.93	34.83
16	002444	巨星科技	90,589,872.68	32.11
17	300136	信维通信	84,892,490.88	30.09
18	002527	新时达	83,006,592.54	29.42
19	002276	万马股份	78,121,292.88	27.69

20	600703	三安光电	75,793,160.40	26.87
21	002029	七匹狼	68,290,794.30	24.21
22	300430	诚益通	65,651,355.59	23.27
23	300053	欧比特	65,373,531.88	23.17
24	603019	中科曙光	65,032,016.75	23.05
25	300207	欣旺达	60,602,504.80	21.48
26	300373	扬杰科技	56,997,042.56	20.20
27	002125	湘潭电化	54,511,582.57	19.32
28	600037	歌华有线	52,779,469.00	18.71
29	600654	中安消	52,142,255.80	18.48
30	002651	利君股份	49,381,618.50	17.50
31	002268	卫士通	48,699,380.87	17.26
32	300337	银邦股份	48,469,016.34	17.18
33	600728	佳都科技	46,907,110.45	16.63
34	002169	智光电气	46,316,703.51	16.42
35	300133	华策影视	33,704,644.11	11.95
36	300263	隆华节能	33,377,873.67	11.83
37	002368	太极股份	30,319,896.82	10.75
38	300140	启源装备	30,143,739.68	10.68
39	002236	大华股份	28,446,836.78	10.08
40	300213	佳讯飞鸿	27,401,378.00	9.71
41	600518	康美药业	26,344,134.33	9.34
42	600513	联环药业	24,497,422.14	8.68
43	300273	和佳股份	23,163,704.00	8.21
44	002223	鱼跃医疗	22,173,640.27	7.86
45	002200	云投生态	21,922,705.06	7.77
46	300266	兴源环境	21,906,303.59	7.77
47	300248	新开普	21,663,952.00	7.68
48	600217	*ST 秦岭	21,574,685.50	7.65
49	601727	上海电气	20,944,698.97	7.42
50	600594	益佰制药	20,928,748.98	7.42
51	601021	春秋航空	20,635,701.36	7.31
52	601199	江南水务	20,485,881.82	7.26
53	600168	武汉控股	20,304,613.34	7.20
54	002030	达安基因	19,981,517.28	7.08
55	300385	雪浪环境	19,019,289.78	6.74

56	600323	瀚蓝环境	18,540,552.58	6.57
57	300370	安控科技	18,049,821.50	6.40
58	300210	森远股份	17,920,554.45	6.35
59	300203	聚光科技	17,808,438.58	6.31
60	002031	巨轮股份	17,628,149.55	6.25
61	601000	唐山港	17,450,484.29	6.19
62	002642	荣之联	16,438,470.40	5.83
63	000028	国药一致	16,199,134.00	5.74
64	002611	东方精工	16,170,674.40	5.73
65	600570	恒生电子	15,319,173.64	5.43
66	000652	泰达股份	14,649,993.56	5.19
67	600749	西藏旅游	14,366,184.30	5.09
68	002189	利达光电	13,245,655.45	4.70
69	002230	科大讯飞	12,753,554.21	4.52
70	002410	广联达	12,627,755.45	4.48
71	002081	金螳螂	12,291,543.20	4.36
72	300037	新宙邦	11,479,803.50	4.07
73	002108	沧州明珠	11,245,140.15	3.99
74	002609	捷顺科技	11,038,582.00	3.91
75	300257	开山股份	10,915,871.18	3.87
76	300016	北陆药业	10,848,477.12	3.85
77	300340	科恒股份	10,397,525.80	3.69
78	002002	鸿达兴业	9,983,361.46	3.54
79	002152	广电运通	9,280,467.60	3.29
80	300329	海伦钢琴	9,091,192.33	3.22
81	600498	烽火通信	8,697,596.24	3.08
82	600149	廊坊发展	8,008,723.00	2.84
83	300369	绿盟科技	7,849,386.20	2.78
84	600111	北方稀土	7,830,755.53	2.78
85	600410	华胜天成	7,686,756.00	2.72
86	300377	赢时胜	7,482,373.80	2.65
87	600010	包钢股份	7,364,781.65	2.61
88	601233	桐昆股份	7,335,635.86	2.60
89	300295	三六五网	7,276,746.00	2.58
90	600647	同达创业	7,246,046.80	2.57
91	300236	上海新阳	7,068,345.86	2.51

92	002299	圣农发展	7,052,726.00	2.50
93	300150	世纪瑞尔	7,025,624.79	2.49
94	600717	天津港	7,000,158.00	2.48
95	002460	赣锋锂业	6,901,649.96	2.45
96	600030	中信证券	6,863,875.63	2.43
97	603588	高能环境	6,792,996.00	2.41
98	300033	同花顺	6,723,908.00	2.38
99	300226	上海钢联	6,598,994.00	2.34
100	600547	山东黄金	6,563,609.81	2.33
101	300253	卫宁软件	6,521,788.00	2.31
102	600180	瑞茂通	6,485,886.35	2.30
103	600155	宝硕股份	6,386,488.00	2.26
104	600158	中体产业	6,343,073.00	2.25
105	002672	东江环保	6,104,961.04	2.16
106	600489	中金黄金	6,048,525.91	2.14
107	300085	银之杰	6,037,297.50	2.14

注：1、买入包括基金申购新股、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	300059	东方财富	257,326,926.02	91.21
2	600021	上海电力	150,430,818.29	53.32
3	002276	万马股份	149,238,596.21	52.90
4	600835	上海机电	107,990,483.32	38.28
5	601566	九牧王	85,584,537.14	30.34
6	600037	歌华有线	66,954,384.00	23.73
7	002444	巨星科技	61,109,284.05	21.66
8	300337	银邦股份	59,101,316.68	20.95
9	300430	诚益通	57,230,031.72	20.29
10	603019	中科曙光	54,147,032.33	19.19
11	300207	欣旺达	52,239,209.17	18.52
12	600143	金发科技	47,780,845.64	16.94
13	300016	北陆药业	46,424,147.44	16.46
14	600654	中安消	43,403,714.30	15.39

15	002364	中恒电气	42,229,447.77	14.97
16	600728	佳都科技	42,077,729.25	14.92
17	300213	佳讯飞鸿	39,073,247.16	13.85
18	300263	隆华节能	37,496,127.34	13.29
19	300140	启源装备	36,227,874.30	12.84
20	601021	春秋航空	35,486,356.20	12.58
21	300133	华策影视	32,504,626.81	11.52
22	600217	*ST 秦岭	31,421,177.54	11.14
23	002236	大华股份	31,053,287.52	11.01
24	600518	康美药业	29,286,277.18	10.38
25	601727	上海电气	26,063,180.70	9.24
26	002611	东方精工	25,668,997.39	9.10
27	300370	安控科技	24,627,063.86	8.73
28	300273	和佳股份	23,580,632.60	8.36
29	002458	益生股份	22,707,142.41	8.05
30	300266	兴源环境	22,503,391.83	7.98
31	600280	中央商场	20,729,693.00	7.35
32	601199	江南水务	20,631,798.20	7.31
33	002223	鱼跃医疗	20,532,807.26	7.28
34	300385	雪浪环境	20,230,328.80	7.17
35	600168	武汉控股	20,159,937.44	7.15
36	300210	森远股份	20,002,386.68	7.09
37	600594	益佰制药	19,647,547.04	6.96
38	600323	瀚蓝环境	19,368,114.40	6.87
39	600749	西藏旅游	19,347,189.52	6.86
40	002642	荣之联	19,037,650.27	6.75
41	002030	达安基因	18,864,689.14	6.69
42	002230	科大讯飞	18,693,675.00	6.63
43	000028	国药一致	17,722,511.20	6.28
44	002031	巨轮股份	17,682,143.29	6.27
45	601000	唐山港	17,089,414.97	6.06
46	300248	新开普	16,736,919.60	5.93
47	000652	泰达股份	16,713,247.00	5.92
48	600570	恒生电子	15,797,184.80	5.60
49	002672	东江环保	15,193,259.03	5.39
50	002108	沧州明珠	15,094,762.37	5.35
51	002410	广联达	14,566,355.20	5.16
52	601233	桐昆股份	13,534,507.34	4.80

53	300037	新宙邦	13,485,770.40	4.78
54	300329	海伦钢琴	13,355,448.24	4.73
55	002189	利达光电	12,824,953.84	4.55
56	600498	烽火通信	12,511,885.18	4.44
57	002081	金螳螂	11,704,532.80	4.15
58	002329	皇氏集团	11,412,077.24	4.05
59	300257	开山股份	11,407,340.20	4.04
60	300226	上海钢联	11,107,277.57	3.94
61	600485	信威集团	10,748,673.65	3.81
62	300150	世纪瑞尔	10,552,587.46	3.74
63	002152	广电运通	10,435,532.32	3.70
64	300085	银之杰	10,407,995.10	3.69
65	600309	万华化学	10,370,519.71	3.68
66	600259	广晟有色	10,046,085.77	3.56
67	002002	鸿达兴业	9,846,627.30	3.49
68	300340	科恒股份	9,827,748.87	3.48
69	000831	五矿稀土	9,824,924.43	3.48
70	002609	捷顺科技	9,720,958.00	3.45
71	600352	浙江龙盛	9,003,157.25	3.19
72	002440	闰土股份	8,888,570.92	3.15
73	300253	卫宁软件	8,512,590.95	3.02
74	300011	鼎汉技术	8,482,120.72	3.01
75	002690	美亚光电	7,942,820.59	2.82
76	002200	云投生态	7,880,505.84	2.79
77	600647	同达创业	7,804,778.69	2.77
78	300369	绿盟科技	7,491,134.86	2.66
79	300033	同花顺	7,463,219.34	2.65
80	600111	北方稀土	7,440,628.66	2.64
81	300352	北信源	7,321,781.30	2.60
82	600606	金丰投资	7,296,957.26	2.59
83	600010	包钢股份	7,250,000.00	2.57
84	600180	瑞茂通	7,184,497.11	2.55
85	600392	盛和资源	7,162,315.80	2.54
86	600410	华胜天成	7,154,597.75	2.54
87	000031	中粮地产	7,133,871.77	2.53
88	300377	赢时胜	7,049,251.02	2.50
89	600149	廊坊发展	7,039,410.36	2.50
90	002299	圣农发展	7,019,100.22	2.49

91	002460	赣锋锂业	6,952,314.00	2.46
92	600030	中信证券	6,920,617.00	2.45
93	600717	天津港	6,746,036.00	2.39
94	603588	高能环境	6,665,277.06	2.36
95	300236	上海新阳	6,658,232.12	2.36
96	300295	三六五网	6,634,661.83	2.35
97	002285	世联行	6,603,216.19	2.34
98	300053	欧比特	6,569,008.00	2.33
99	000568	泸州老窖	6,547,379.00	2.32
100	300262	巴安水务	6,507,148.32	2.31
101	601989	中国重工	6,305,178.00	2.23
102	600547	山东黄金	6,249,218.02	2.22
103	600150	中国船舶	6,213,604.00	2.20
104	002573	清新环境	6,188,020.00	2.19
105	600155	宝硕股份	5,910,860.00	2.10
106	000042	中洲控股	5,790,232.44	2.05
107	600158	中体产业	5,758,923.46	2.04
108	000002	万科A	5,686,657.82	2.02

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	5,235,430,230.41
卖出股票收入（成交）总额	2,681,608,112.03

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。

7.12.2 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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,125,423.75
2	应收证券清算款	138,302,273.75
3	应收股利	-
4	应收利息	73,352.68
5	应收申购款	19,859,967.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	159,361,017.29

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

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	002303	美盈森	298,064,743.30	10.25	重大事项
2	000566	海南海药	273,089,106.04	9.39	重大事项

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
74,767	13,614.23	159,846,692.66	15.70%	858,048,475.92	84.30%

8.2 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	591,939.16	0.06%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2011 年 10 月 24 日) 基金份额总额	631,826,498.75
本报告期期初基金份额总额	173,448,874.51
本报告期基金总申购份额	2,414,245,347.76
减:本报告期基金总赎回份额	1,569,799,053.69
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	1,017,895,168.58

注：1、“本期申购”中包含红利再投、转换入份额及金额；

2、“本期赎回”中包含转出份额及金额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期，本基金未召开持有人大会。

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：

毕万英先生于 2015 年 4 月 26 日离任工银瑞信基金管理有限公司副总经理，公司于 2015 年 4 月 28 日对外披露；库三七先生于 2015 年 5 月 29 日离任工银瑞信基金管理有限公司副总经理，公司于 2015 年 6 月 2 日对外披露。

2、基金托管人托管部门：

本报告期，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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人、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

无。

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，本基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或行政处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
齐鲁证券	1	3,229,083,536.97	40.79%	2,857,413.68	46.75%	-
安信证券	1	1,854,944,989.38	23.43%	1,296,530.09	21.21%	-
广州证券	1	1,706,980,630.33	21.56%	1,169,112.54	19.13%	-
方正证券	1	624,868,024.13	7.89%	443,905.85	7.26%	-
英大证券	1	293,529,871.87	3.71%	201,038.77	3.29%	-
川财证券	1	207,266,699.76	2.62%	143,528.77	2.35%	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
财富里昂	1	-	-	-	-	-
首创证券	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

在报告期内本基金增加安信证券股份有限公司的 31231 上海交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
财富里昂	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

无。