

# 工银瑞信医疗保健行业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：中国银行股份有限公司

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。

基金托管人中国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       | 工银医疗保健股票           |
| 基金主代码      | 000831             |
| 基金运作方式     | 契约型开放式             |
| 基金合同生效日    | 2014 年 11 月 18 日   |
| 基金管理人      | 工银瑞信基金管理有限公司       |
| 基金托管人      | 中国银行股份有限公司         |
| 报告期末基金份额总额 | 4,610,274,371.44 份 |
| 基金合同存续期    | 不定期                |

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 通过深入分析医疗保健行业的成长驱动力，把握以创新为主的核心竞争力，在合理风险限度内，追求基金资产长期稳定增值，力争实现超越业绩基准的超额收益。                         |
| 投资策略   | 本基金的类别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，从而在一定程度上规避系统性风险。 |
| 业绩比较基准 | 85%×中证医药指数收益率+15%×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。本基金主要投资于医疗保健行业股票，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                 | 中国银行股份有限公司           |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 朱碧艳                          | 王永民                  |
|         | 联系电话 | 400-811-9999                 | 010-66594896         |
|         | 电子邮箱 | customerservice@icbcs.com.cn | fcid@bankofchina.com |
| 客户服务电话  |      | 400-811-9999                 | 95566                |
| 传真      |      | 010-66583158                 | 010-66594942         |

## 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       | 849,474,841.38              |
| 本期利润          | 771,851,407.67              |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.2911                      |
| 本期基金份额净值增长率   | 82.66%                      |
| 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  | 0.3908                      |
| 期末基金资产净值      | 8,690,303,090.84            |
| 期末基金份额净值      | 1.885                       |

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 2014 年 11 月 18 日，截至报告期末，本基金基金合同生效不满一年。

### 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 | -18.40%  | 3.82%       | -8.79%     | 3.12%         | -9.61% | 0.70% |
| 过去三个月 | 26.60%   | 3.13%       | 17.14%     | 2.40%         | 9.46%  | 0.73% |
| 过去六个月 | 82.66%   | 2.44%       | 46.60%     | 1.87%         | 36.06% | 0.57% |

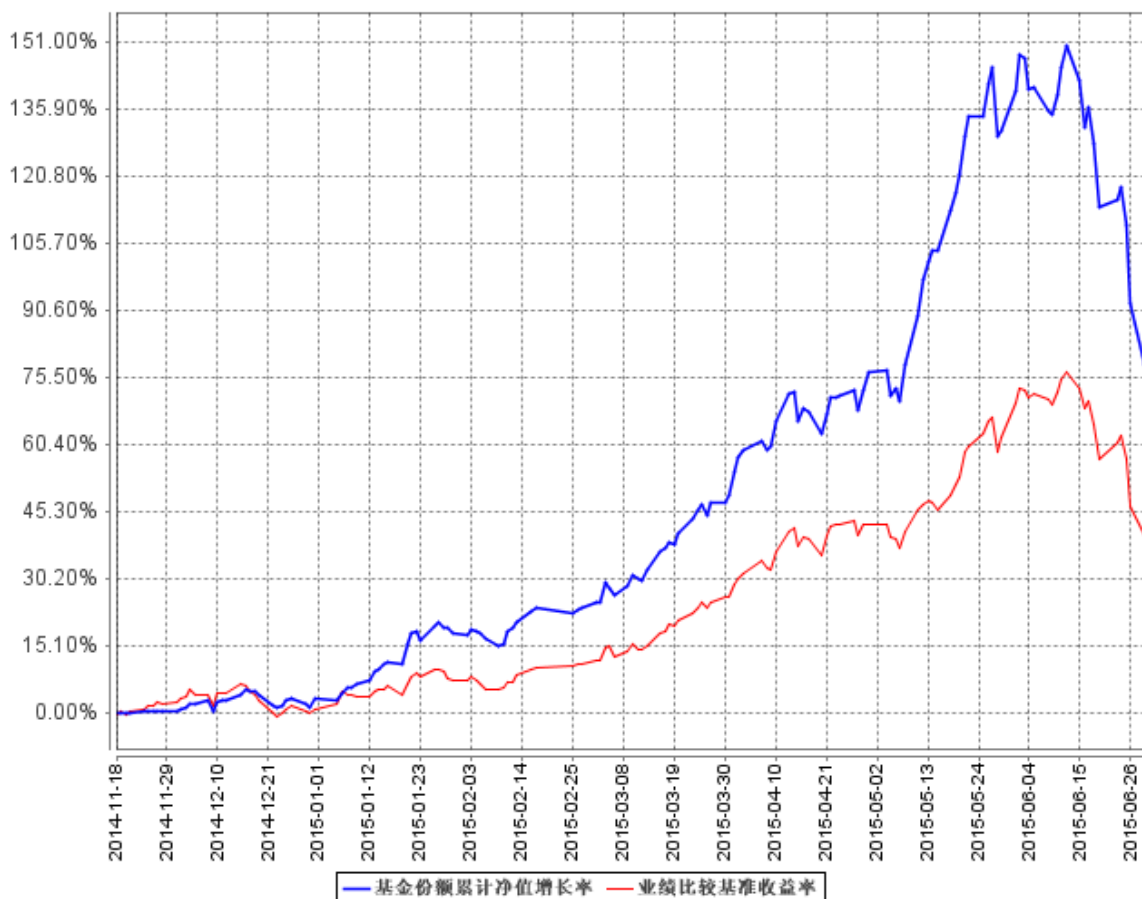
|            |        |       |        |       |        |       |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 自基金合同生效起至今 | 88.50% | 2.21% | 47.86% | 1.74% | 40.64% | 0.47% |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|

注：1、本基金的业绩比较基准为： $85\% \times$  中证医药指数收益率  $+15\% \times$  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 2014 年 11 月 18 日，截至报告期末，本基金基金合同生效不满一年。

### 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 2014 年 11 月 18 日生效，截至报告期末，本基金基金合同生效不满一年。

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：股票投资占基金资产的比例为 80%-95%。其中，本基金投资于本基金界定的医疗保健行业内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%。

### 3.3 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 |        |   |
| 赵蓓  | 本基金的基金经理        | 2014 年 11 月 18 日 | -    | 7      | 曾在中再资产管理股份有限公司担任投资经理助理。2010 年加入工银瑞信，现任基金经理兼高级研究员，2014 年 11 月 18 日至今，担任工银医疗保健行业股票型基金基金经理；2015 年 4 月 28 日至今，担任工银瑞信养老产业股票型基金基金经理。  |
| 宋炳坤 | 权益投资总监，本基金的基金经理 | 2014 年 11 月 18 日 | -    | 11     | 曾任中信建投证券有限公司研究员；2007 年加入工银瑞信，现任权益投资总监。2012 年 2 月 14 日至今，担任工银瑞信添颐债券型证券投资基金基金经理；2013 年 1 月 18 日至今，担任工银双利债券基金基金经理；2013 年 1 月 28 日至 2014 年 12 月 5 日，担任工银瑞信 60 天理财债券型基金基金经理；2014 年 1 月 20 日至今，担任工银红利基金基金经理；2014 年 1 月 20 日至今，担任工银核心价值基金基金经理；2014 年 10 月 23 日至今，担任工银瑞信研究精选股票型基金基金经理；2014 年 11 月 18 日至今，担任工银瑞信医疗保健行业股票型基金基金经理；2015 年 2 月 16 日至今，担任工银瑞信战略转型主题股票型基金基金经理。 |

注：1、任职日期说明：宋炳坤的任职日期为基金合同生效的日期。

赵蓓的任职日期为基金合同生效的日期。

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合规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量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

报告期内，由于本基金规模增长很快，故大幅增加了大市值、低估值、稳健成长白马股的配置。在报告期末，市场出现急速大幅下跌的过程中，稳健成长白马股的配置增加起到了一定的防



御作用。但也由于基金规模较大，较难迅速灵活的降低仓位，也受到了市场断崖式下跌的较大冲击。报告期内，本基金紧扣投资主题，主要投资在医疗保健、纺织服装、餐饮旅游等与健康相关的产业。

#### 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 82.66%，业绩比较基准增长率为 46.60%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

二季度以来，国内宏观经济略有企稳，但基础并不稳固。在经济增长依然乏力的情况下，预计稳增长已成为短期政府经济工作的首要任务。6 月份降息与定向降准齐发表明货币政策偏松的主基调仍将延续。而财政政策上，多个举措显示政策正在走向实质性积极。随着政府稳增长政策的继续加码，同时结合地产销售的不断改善，预计三季度国内投资对经济增长的拉动作用将会提升。通货膨胀方面，在国内经济增长动能仍弱的情况下，预计低通胀势头也还将延续，为货币政策的实施提供了基础。外需方面，美国经济复苏迹象继续强化，欧日经济相对平稳，预计三季度外需对国内经济增长的贡献会保持平稳。预计三季度经济增长环比继续改善将是大概率事件，但改善幅度仍需观察。

股票市场方面，监管层在 4 月下旬、6 月中旬在逐步规范场外融资、配资市场，对股票市场产生了冲击，引发大幅下跌。目前，各类资金的去杠杆化引发市场的挤兑性抛售行为，股价迅速回调。健康发展的股票市场对当前中国经济的转型发展是重要的，对居民的财产性收入是有利的，我们相信国家对股票市场的救市政策将缓解或化解本次股票市场危机。我们认为短期市场面临下跌风险，许多股票的下跌并非来自经营基本面，而是投资者交易行为导致的，因此要克服恐慌。本基金坚持在受益于中国医疗保健产业发展过程中的行业及上市公司中持续发掘投资机会，坚持通过自下而上地选择优质投资标的，在市场稳定后能够为投资者取得好的投资业绩。

### 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

小组成员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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对工银瑞信医疗保健股票型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购

赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 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：工银瑞信医疗保健行业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<br>2015 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2014 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>      |            |                                |                                  |
| 银行存款            |            | 1,359,030,574.97               | 82,260,546.71                    |
| 结算备付金           |            | 56,211,964.74                  | 29,816,862.67                    |
| 存出保证金           |            | 4,834,744.57                   | 105,059.72                       |
| 交易性金融资产         |            | 8,086,975,838.52               | 1,203,860,906.36                 |
| 其中：股票投资         |            | 8,086,975,838.52               | 1,203,860,906.36                 |
| 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        |            | -                              | 50,000,000.00                    |
| 应收证券清算款         |            | 273,393,051.11                 | -                                |
| 应收利息            |            | 234,594.04                     | 93,946.54                        |
| 应收股利            |            | -                              | -                                |
| 应收申购款           |            | 25,057,029.54                  | -                                |
| 递延所得税资产         |            | -                              | -                                |
| 其他资产            |            | -                              | -                                |
| 资产总计            |            | 9,805,737,797.49               | 1,366,137,322.00                 |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2015 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2014 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负债：</b>      |            |                                |                                  |

|               |  |                  |                  |
|---------------|--|------------------|------------------|
| 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       |  | -                | 7,562,506.23     |
| 应付赎回款         |  | 1,075,051,721.39 | 6,522,469.36     |
| 应付管理人报酬       |  | 15,688,875.57    | 1,551,457.48     |
| 应付托管费         |  | 2,614,812.58     | 258,576.25       |
| 应付销售服务费       |  | -                | -                |
| 应付交易费用        |  | 20,697,333.46    | 1,292,486.29     |
| 应交税费          |  | -                | -                |
| 应付利息          |  | -                | -                |
| 应付利润          |  | -                | -                |
| 递延所得税负债       |  | -                | -                |
| 其他负债          |  | 1,381,963.65     | 8,189.53         |
| 负债合计          |  | 1,115,434,706.65 | 17,195,685.14    |
| <b>所有者权益：</b> |  |                  |                  |
| 实收基金          |  | 4,610,274,371.44 | 1,307,179,226.18 |
| 未分配利润         |  | 4,080,028,719.40 | 41,762,410.68    |
| 所有者权益合计       |  | 8,690,303,090.84 | 1,348,941,636.86 |
| 负债和所有者权益总计    |  | 9,805,737,797.49 | 1,366,137,322.00 |

注：1、报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.885 元，基金份额总额 4,610,274,371.44 份。

2、本基金基金合同生效日为 2014 年 11 月 18 日，截至报告期末本基金合同生效不满一年。

## 6.2 利润表

会计主体：工银瑞信医疗保健行业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<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月<br>30 日 |
|------------------|-----|--|
| <b>一、收入</b>      |     | 856,031,478.45                           |
| 1.利息收入           |     | 3,608,591.67                             |
| 其中：存款利息收入        |     | 2,193,239.79                             |
| 债券利息收入           |     | 12,142.25                                |
| 资产支持证券利息收入       |     | -  |
| 买入返售金融资产收入       |     | 1,403,209.63                             |
| 其他利息收入           |     | -  |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） |     | 854,761,135.46                           |
| 其中：股票投资收益        |     | 732,947,706.70                           |

|                            |  |                |
|----------------------------|--|----------------|
| 基金投资收益                     |  | -              |
| 债券投资收益                     |  | 111,653,744.82 |
| 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                       |  | 10,159,683.94  |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）      |  | -77,623,433.71 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）          |  | -              |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          |  | 75,285,185.03  |
| <b>减：二、费用</b>              |  | 84,180,070.78  |
| 1. 管理人报酬                   |  | 36,669,992.42  |
| 2. 托管费                     |  | 6,111,665.43   |
| 3. 销售服务费                   |  | -              |
| 4. 交易费用                    |  | 41,163,229.96  |
| 5. 利息支出                    |  | -              |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |  | -              |
| 6. 其他费用                    |  | 235,182.97     |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |  | 771,851,407.67 |
| 减：所得税费用                    |  | -              |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |  | 771,851,407.67 |

注：本基金基金合同生效日为 2014 年 11 月 18 日，截至报告期末本基金合同生效不满一年。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：工银瑞信医疗保健行业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<br>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）                   | 1,307,179,226.18                      | 41,762,410.68     | 1,348,941,636.86   |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）         | -                                     | 771,851,407.67    | 771,851,407.67     |
| 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） | 3,303,095,145.26                      | 3,266,414,901.05  | 6,569,510,046.31   |
| 其中：1.基金申购款                        | 9,682,950,912.89                      | 9,286,488,096.21  | 18,969,439,009.10  |
| 2.基金赎回款                           | -6,379,855,767.63                     | -6,020,073,195.16 | -12,399,928,962.79 |

|  |                  |                  |                  |
|--|------------------|------------------|------------------|
| 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）                        | 4,610,274,371.44 | 4,080,028,719.40 | 8,690,303,090.84 |

注：本基金基金合同生效日为 2014 年 11 月 18 日，截至报告期末本基金合同生效不满一年。

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

工银瑞信医疗保健行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”）证监基金字[2014]635 号文《关于同意工银瑞信医疗保健行业股票型证券投资基金募集的批复》批准，由工银瑞信基金管理有限公司作为发起人自 2014 年 10 月 27 日至 2014 年 11 月 14 日向社会公开发行募集，基金合同于 2014 年 11 月 18 日正式生效。截至 2014 年 11 月 18 日止，已收到首次募集扣除认购费用后的有效认购金额为人民币 1,157,140,955.73 元，折合 1,157,140,955.73 份基金份额；有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币 207,300.20 元，折合 207,300.20 份基金份额；以上收到的实收基金共计人民币 1,157,348,255.93 元，折合 1,157,348,255.93 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为工银瑞信基金管理有限公司，注册登记机构为工银瑞信基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

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、银行存款、股指期货与权证等金融工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金目标为：通过深入分析医疗保健行业的成长驱动力，把握以创新为主的核心竞争力，在合理风险限度内，追求基金资产长期稳定增值，力争实现超越业绩基准的超额收益。本基金投资组合资产配置范围为：股票投资占基金资产的比例为 80%-95%。其中，本基金投资于本基金界定的医疗保健行业内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%。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金

管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为：85%×中证医药指数收益率+15%×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 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。

### 6.4.4.1 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。

### 6.4.4.2 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。

### 6.4.4.3 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。

#### 6.4.4.4 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。

## 6.4.4.5 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。

#### 6.4.4.6 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。

#### 6.4.4.7 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。

#### 6.4.4.8 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）”。

#### 6.4.4.9 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。

#### **6.4.4.10 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。

#### **6.4.4.11 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) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 6.4.4.12 分部报告

无。

#### 6.4.4.13 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，会计估计的变更请详见 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 |
| 中国银行股份有限公司   | 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        |

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

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行交易。

##### 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                              |
|-----------------|---------------------------------|
|                 | 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 36,669,992.42                   |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 13,402,481.31                   |

注：1、基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.5% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

2、基金管理人的管理费每日计提，按月支付。

###### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                              |
|----------------|---------------------------------|
|                | 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 6,111,665.43                    |

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，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**

本基金本报告期末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均未运用固有资金投资本基金。

**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**

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。

**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<br>2015年1月1日至2015年6月30日 |              |
|------------|----------------------------|--------------|
|            | 期末余额                       | 当期利息收入       |
| 中国银行股份有限公司 | 1,359,030,574.97           | 1,906,300.25 |

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. 本基金的银行存款由基金托管人中国银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

**6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金在本报告期内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认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

**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    |
|--------|------|------------|------|--------|------|--------|------------|----------------|----------------|-------|
| 000566 | 海南海药 | 2015年6月18日 | 重大事项 | 40.76  | -    | -      | 21,308,214 | 817,551,034.54 | 868,522,802.64 | 指数法估值 |
| 002223 | 鱼跃   | 2015       | 重大   | 57.76  | 2015 | 60.48  | 11,755,749 | 567,755,907.16 | 679,012,062.24 | 指数法   |

|        | 医疗    | 年 6 月 25 日      | 事项   |       | 年 7 月 13 日      |       |           |                |                | 估值    |
|--------|-------|-----------------|------|-------|-----------------|-------|-----------|----------------|----------------|-------|
| 600763 | 通策医疗  | 2015 年 5 月 25 日 | 重大事项 | 84.72 | -               | -     | 3,870,953 | 265,416,297.71 | 327,947,138.16 | 指数法估值 |
| 603939 | 益丰药房  | 2015 年 6 月 8 日  | 重大事项 | 78.14 | 2015 年 8 月 17 日 | 89.89 | 4,022,162 | 310,305,239.51 | 314,291,738.68 | 指数法估值 |
| 002727 | 一心堂   | 2015 年 4 月 13 日 | 重大事项 | 82.62 | 2015 年 8 月 17 日 | 70.42 | 2,402,191 | 163,388,611.28 | 198,469,020.42 | 指数法估值 |
| 300030 | 阳普医疗  | 2015 年 6 月 25 日 | 重大事项 | 23.49 | 2015 年 7 月 2 日  | 24.61 | 7,000,000 | 143,162,114.85 | 164,430,000.00 | 指数法估值 |
| 000403 | ST 生化 | 2015 年 4 月 29 日 | 重大事项 | 28.53 | -               | -     | 2,390,700 | 45,667,087.58  | 68,206,671.00  | 指数法估值 |

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-488,923,689.72 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银行间市场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  | 8,086,975,838.52 | 82.47         |
|    | 其中：股票 | 8,086,975,838.52 | 82.47         |



|   |                   |                  |        |
|---|-------------------|------------------|--------|
| 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      | 1,415,242,539.71 | 14.43  |
| 7 | 其他各项资产            | 303,519,419.26   | 3.10   |
| 8 | 合计                | 9,805,737,797.49 | 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         | -                | -            |
| B  | 采矿业              | 24,750.00        | 0.00         |
| C  | 制造业              | 6,306,854,329.41 | 72.57        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -                | -            |
| E  | 建筑业              | 124,648,406.51   | 1.43         |
| F  | 批发和零售业           | 1,074,261,743.10 | 12.36        |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -                | -            |
| H  | 住宿和餐饮业           | -                | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | -                | -            |
| J  | 金融业              | -                | -            |
| K  | 房地产业             | 101,199,304.43   | 1.16         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 22,565.00        | 0.00         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 20,290.00        | 0.00         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 151,997,311.91   | 1.75         |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -                | -            |
| P  | 教育               | -                | -            |
| Q  | 卫生和社会工作          | 327,947,138.16   | 3.77         |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | -                | -            |
| S  | 综合               | -                | -            |

|  |    |                  |       |
|--|----|------------------|-------|
|  | 合计 | 8,086,975,838.52 | 93.06 |
|--|----|------------------|-------|

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

### 7.3 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  | 000566 | 海南海药 | 21,308,214 | 868,522,802.64 | 9.99         |
| 2  | 600276 | 恒瑞医药 | 18,399,349 | 819,507,004.46 | 9.43         |
| 3  | 002223 | 鱼跃医疗 | 11,755,749 | 679,012,062.24 | 7.81         |
| 4  | 000078 | 海王生物 | 25,522,772 | 561,500,984.00 | 6.46         |
| 5  | 002614 | 蒙发利  | 27,493,253 | 490,204,700.99 | 5.64         |
| 6  | 002390 | 信邦制药 | 24,411,714 | 436,481,446.32 | 5.02         |
| 7  | 600085 | 同仁堂  | 11,559,669 | 415,107,713.79 | 4.78         |
| 8  | 600763 | 通策医疗 | 3,870,953  | 327,947,138.16 | 3.77         |
| 9  | 600422 | 昆药集团 | 8,564,715  | 316,294,924.95 | 3.64         |
| 10 | 603939 | 益丰药房 | 4,022,162  | 314,291,738.68 | 3.62         |

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  | 600276 | 恒瑞医药 | 950,280,815.84 | 70.45          |
| 2  | 000566 | 海南海药 | 946,274,841.90 | 70.15          |
| 3  | 002223 | 鱼跃医疗 | 762,357,837.29 | 56.52          |
| 4  | 002614 | 蒙发利  | 678,886,571.78 | 50.33          |
| 5  | 000078 | 海王生物 | 648,014,269.85 | 48.04          |
| 6  | 002390 | 信邦制药 | 582,343,478.20 | 43.17          |
| 7  | 603555 | 贵人鸟  | 580,128,586.73 | 43.01          |
| 8  | 002312 | 三泰控股 | 500,394,943.09 | 37.10          |
| 9  | 601607 | 上海医药 | 465,819,068.36 | 34.53          |

|    |        |      |                |       |
|----|--------|------|----------------|-------|
| 10 | 600085 | 同仁堂  | 437,988,472.69 | 32.47 |
| 11 | 600372 | 中航电子 | 430,111,091.27 | 31.89 |
| 12 | 600422 | 昆药集团 | 387,513,999.70 | 28.73 |
| 13 | 600446 | 金证股份 | 365,626,860.65 | 27.10 |
| 14 | 600557 | 康缘药业 | 346,408,833.54 | 25.68 |
| 15 | 002491 | 通鼎互联 | 342,809,741.34 | 25.41 |
| 16 | 300199 | 翰宇药业 | 328,628,440.41 | 24.36 |
| 17 | 601989 | 中国重工 | 322,706,981.11 | 23.92 |
| 18 | 603939 | 益丰药房 | 310,305,239.51 | 23.00 |
| 19 | 300003 | 乐普医疗 | 300,172,552.59 | 22.25 |
| 20 | 601166 | 兴业银行 | 275,949,007.79 | 20.46 |
| 21 | 601318 | 中国平安 | 275,201,319.90 | 20.40 |
| 22 | 600028 | 中国石化 | 270,092,747.10 | 20.02 |
| 23 | 600812 | 华北制药 | 266,208,933.18 | 19.73 |
| 24 | 600518 | 康美药业 | 256,821,219.29 | 19.04 |
| 25 | 600763 | 通策医疗 | 254,584,184.72 | 18.87 |
| 26 | 600818 | 中路股份 | 251,467,473.08 | 18.64 |
| 27 | 002029 | 七匹狼  | 250,075,612.43 | 18.54 |
| 28 | 601058 | 赛轮金宇 | 237,533,613.91 | 17.61 |
| 29 | 002690 | 美亚光电 | 225,007,098.92 | 16.68 |
| 30 | 300273 | 和佳股份 | 209,674,292.09 | 15.54 |
| 31 | 600645 | 中源协和 | 201,654,683.75 | 14.95 |
| 32 | 300171 | 东富龙  | 195,466,751.55 | 14.49 |
| 33 | 300030 | 阳普医疗 | 193,529,435.50 | 14.35 |
| 34 | 002421 | 达实智能 | 184,479,949.32 | 13.68 |
| 35 | 300281 | 金明精机 | 181,428,833.02 | 13.45 |
| 36 | 000516 | 国际医学 | 178,302,436.00 | 13.22 |
| 37 | 600750 | 江中药业 | 173,104,379.43 | 12.83 |
| 38 | 002727 | 一心堂  | 163,388,611.28 | 12.11 |
| 39 | 600158 | 中体产业 | 158,632,957.35 | 11.76 |
| 40 | 000538 | 云南白药 | 157,013,399.44 | 11.64 |
| 41 | 600138 | 中青旅  | 141,437,609.77 | 10.49 |
| 42 | 000009 | 中国宝安 | 134,241,192.48 | 9.95  |
| 43 | 002533 | 金杯电工 | 130,406,758.46 | 9.67  |
| 44 | 600993 | 马应龙  | 128,635,004.13 | 9.54  |
| 45 | 000401 | 冀东水泥 | 125,623,714.45 | 9.31  |

|    |        |      |                |      |
|----|--------|------|----------------|------|
| 46 | 000802 | 北京文化 | 124,988,089.09 | 9.27 |
| 47 | 600436 | 片仔癀  | 123,967,615.74 | 9.19 |
| 48 | 603309 | 维力医疗 | 120,382,391.98 | 8.92 |
| 49 | 600594 | 益佰制药 | 118,970,866.22 | 8.82 |
| 50 | 300298 | 三诺生物 | 118,090,975.08 | 8.75 |
| 51 | 300356 | 光一科技 | 117,258,154.13 | 8.69 |
| 52 | 002007 | 华兰生物 | 113,567,026.88 | 8.42 |
| 53 | 000961 | 中南建设 | 113,469,437.42 | 8.41 |
| 54 | 600685 | 中船防务 | 111,996,679.44 | 8.30 |
| 55 | 600055 | 华润万东 | 111,362,804.46 | 8.26 |
| 56 | 600021 | 上海电力 | 111,007,529.50 | 8.23 |
| 57 | 600222 | 太龙药业 | 110,671,809.25 | 8.20 |
| 58 | 300253 | 卫宁软件 | 108,301,910.53 | 8.03 |
| 59 | 002125 | 湘潭电化 | 103,262,857.79 | 7.66 |
| 60 | 600266 | 北京城建 | 99,628,885.00  | 7.39 |
| 61 | 300263 | 隆华节能 | 98,321,266.78  | 7.29 |
| 62 | 600048 | 保利地产 | 91,715,808.65  | 6.80 |
| 63 | 300340 | 科恒股份 | 83,359,613.35  | 6.18 |
| 64 | 000917 | 电广传媒 | 75,744,309.35  | 5.62 |
| 65 | 600761 | 安徽合力 | 75,450,399.14  | 5.59 |
| 66 | 600511 | 国药股份 | 73,637,001.73  | 5.46 |
| 67 | 300289 | 利德曼  | 68,021,083.47  | 5.04 |
| 68 | 000639 | 西王食品 | 65,477,768.24  | 4.85 |
| 69 | 600485 | 信威集团 | 60,079,046.59  | 4.45 |
| 70 | 002219 | 恒康医疗 | 59,817,748.95  | 4.43 |
| 71 | 002443 | 金洲管道 | 59,747,528.07  | 4.43 |
| 72 | 600536 | 中国软件 | 57,035,591.88  | 4.23 |
| 73 | 600143 | 金发科技 | 56,973,969.59  | 4.22 |
| 74 | 600999 | 招商证券 | 56,904,387.60  | 4.22 |
| 75 | 600975 | 新五丰  | 56,671,644.13  | 4.20 |
| 76 | 600587 | 新华医疗 | 56,241,634.54  | 4.17 |
| 77 | 601857 | 中国石油 | 54,949,153.60  | 4.07 |
| 78 | 300244 | 迪安诊断 | 53,777,125.78  | 3.99 |
| 79 | 600590 | 泰豪科技 | 52,310,480.01  | 3.88 |
| 80 | 000652 | 泰达股份 | 50,759,054.75  | 3.76 |
| 81 | 601788 | 光大证券 | 48,409,600.00  | 3.59 |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 82 | 600079 | 人福医药 | 47,604,091.12 | 3.53 |
| 83 | 300146 | 汤臣倍健 | 42,839,325.18 | 3.18 |
| 84 | 300016 | 北陆药业 | 41,995,025.07 | 3.11 |
| 85 | 002030 | 达安基因 | 40,006,270.35 | 2.97 |
| 86 | 002383 | 合众思壮 | 38,450,346.81 | 2.85 |
| 87 | 600015 | 华夏银行 | 36,355,752.43 | 2.70 |
| 88 | 600196 | 复星医药 | 36,238,650.51 | 2.69 |
| 89 | 002508 | 老板电器 | 36,134,988.09 | 2.68 |
| 90 | 600208 | 新潮中宝 | 33,729,350.06 | 2.50 |
| 91 | 600513 | 联环药业 | 33,137,959.75 | 2.46 |
| 92 | 000002 | 万科A  | 32,457,782.85 | 2.41 |
| 93 | 601000 | 唐山港  | 28,194,199.44 | 2.09 |

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

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计卖出金额       | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|----------------|----------------|
| 1  | 603555 | 贵人鸟  | 577,185,791.85 | 42.79          |
| 2  | 601607 | 上海医药 | 458,517,736.56 | 33.99          |
| 3  | 601989 | 中国重工 | 369,294,951.84 | 27.38          |
| 4  | 300273 | 和佳股份 | 333,110,629.56 | 24.69          |
| 5  | 600028 | 中国石化 | 332,532,003.33 | 24.65          |
| 6  | 600557 | 康缘药业 | 310,573,058.83 | 23.02          |
| 7  | 600446 | 金证股份 | 293,411,277.12 | 21.75          |
| 8  | 000566 | 海南海药 | 282,349,310.50 | 20.93          |
| 9  | 300003 | 乐普医疗 | 280,630,482.16 | 20.80          |
| 10 | 300171 | 东富龙  | 274,333,601.95 | 20.34          |
| 11 | 600818 | 中路股份 | 273,997,426.34 | 20.31          |
| 12 | 601166 | 兴业银行 | 263,482,532.89 | 19.53          |
| 13 | 601318 | 中国平安 | 261,409,129.45 | 19.38          |
| 14 | 600518 | 康美药业 | 256,447,871.38 | 19.01          |
| 15 | 600158 | 中体产业 | 227,487,191.90 | 16.86          |
| 16 | 600645 | 中源协和 | 222,111,727.80 | 16.47          |
| 17 | 002491 | 通鼎互联 | 218,356,461.66 | 16.19          |
| 18 | 000516 | 国际医学 | 214,112,422.80 | 15.87          |

|    |        |      |                |       |
|----|--------|------|----------------|-------|
| 19 | 002223 | 鱼跃医疗 | 207,778,627.09 | 15.40 |
| 20 | 002312 | 三泰控股 | 179,095,801.94 | 13.28 |
| 21 | 002421 | 达实智能 | 176,058,485.75 | 13.05 |
| 22 | 600372 | 中航电子 | 175,781,923.89 | 13.03 |
| 23 | 002390 | 信邦制药 | 168,747,007.78 | 12.51 |
| 24 | 600750 | 江中药业 | 162,778,093.92 | 12.07 |
| 25 | 601058 | 赛轮金宇 | 161,065,102.35 | 11.94 |
| 26 | 300253 | 卫宁软件 | 160,430,927.08 | 11.89 |
| 27 | 600436 | 片仔癀  | 157,920,663.04 | 11.71 |
| 28 | 300356 | 光一科技 | 153,396,843.30 | 11.37 |
| 29 | 002007 | 华兰生物 | 147,257,573.45 | 10.92 |
| 30 | 000538 | 云南白药 | 146,364,971.77 | 10.85 |
| 31 | 002533 | 金杯电工 | 144,343,402.29 | 10.70 |
| 32 | 600138 | 中青旅  | 140,222,932.77 | 10.40 |
| 33 | 603309 | 维力医疗 | 133,202,523.63 | 9.87  |
| 34 | 600021 | 上海电力 | 132,836,886.43 | 9.85  |
| 35 | 300016 | 北陆药业 | 127,224,920.36 | 9.43  |
| 36 | 300340 | 科恒股份 | 126,845,486.64 | 9.40  |
| 37 | 000009 | 中国宝安 | 126,120,389.97 | 9.35  |
| 38 | 300298 | 三诺生物 | 122,524,769.01 | 9.08  |
| 39 | 600594 | 益佰制药 | 114,603,406.70 | 8.50  |
| 40 | 600993 | 马应龙  | 113,112,380.92 | 8.39  |
| 41 | 600485 | 信威集团 | 109,893,284.66 | 8.15  |
| 42 | 300199 | 翰宇药业 | 108,630,662.45 | 8.05  |
| 43 | 002125 | 湘潭电化 | 106,991,352.05 | 7.93  |
| 44 | 600222 | 太龙药业 | 105,732,060.61 | 7.84  |
| 45 | 600079 | 人福医药 | 102,022,882.37 | 7.56  |
| 46 | 300263 | 隆华节能 | 100,953,076.70 | 7.48  |
| 47 | 600685 | 中船防务 | 100,153,582.85 | 7.42  |
| 48 | 000401 | 冀东水泥 | 100,096,908.73 | 7.42  |
| 49 | 600055 | 华润万东 | 98,174,081.00  | 7.28  |
| 50 | 002736 | 国信证券 | 97,186,742.61  | 7.20  |
| 51 | 600048 | 保利地产 | 91,894,270.35  | 6.81  |
| 52 | 002029 | 七匹狼  | 86,889,460.45  | 6.44  |
| 53 | 601857 | 中国石油 | 83,147,557.39  | 6.16  |
| 54 | 000917 | 电广传媒 | 82,181,232.99  | 6.09  |
| 55 | 601000 | 唐山港  | 81,119,721.76  | 6.01  |
| 56 | 600511 | 国药股份 | 77,637,867.68  | 5.76  |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 57 | 600761 | 安徽合力 | 72,169,692.19 | 5.35 |
| 58 | 600420 | 现代制药 | 71,202,355.73 | 5.28 |
| 59 | 300030 | 阳普医疗 | 61,757,892.08 | 4.58 |
| 60 | 000002 | 万科A  | 61,450,173.17 | 4.56 |
| 61 | 600998 | 九州通  | 60,452,084.84 | 4.48 |
| 62 | 300244 | 迪安诊断 | 59,537,002.61 | 4.41 |
| 63 | 600999 | 招商证券 | 58,288,668.31 | 4.32 |
| 64 | 002219 | 恒康医疗 | 57,654,115.79 | 4.27 |
| 65 | 600536 | 中国软件 | 57,265,576.28 | 4.25 |
| 66 | 600975 | 新五丰  | 56,837,103.08 | 4.21 |
| 67 | 600276 | 恒瑞医药 | 56,199,926.42 | 4.17 |
| 68 | 002443 | 金洲管道 | 56,034,393.79 | 4.15 |
| 69 | 600587 | 新华医疗 | 55,725,199.74 | 4.13 |
| 70 | 601788 | 光大证券 | 53,256,249.76 | 3.95 |
| 71 | 002030 | 达安基因 | 52,235,184.41 | 3.87 |
| 72 | 600855 | 航天长峰 | 51,153,797.91 | 3.79 |
| 73 | 000712 | 锦龙股份 | 50,933,190.06 | 3.78 |
| 74 | 000652 | 泰达股份 | 50,324,113.03 | 3.73 |
| 75 | 600590 | 泰豪科技 | 49,639,318.33 | 3.68 |
| 76 | 300095 | 华伍股份 | 48,252,262.28 | 3.58 |
| 77 | 600143 | 金发科技 | 44,958,810.00 | 3.33 |
| 78 | 300146 | 汤臣倍健 | 44,612,334.39 | 3.31 |
| 79 | 601567 | 三星电气 | 43,285,759.72 | 3.21 |
| 80 | 000639 | 西王食品 | 42,984,171.16 | 3.19 |
| 81 | 002413 | 常发股份 | 41,695,425.33 | 3.09 |
| 82 | 002383 | 合众思壮 | 38,422,135.36 | 2.85 |
| 83 | 600606 | 金丰投资 | 36,889,255.45 | 2.73 |
| 84 | 002508 | 老板电器 | 36,549,635.74 | 2.71 |
| 85 | 600196 | 复星医药 | 35,361,167.10 | 2.62 |
| 86 | 600015 | 华夏银行 | 35,207,469.52 | 2.61 |
| 87 | 000963 | 华东医药 | 34,998,579.60 | 2.59 |
| 88 | 600208 | 新湖中宝 | 33,090,814.16 | 2.45 |
| 89 | 000403 | ST生化 | 28,639,511.52 | 2.12 |
| 90 | 600513 | 联环药业 | 28,284,430.35 | 2.10 |
| 91 | 600466 | 蓝光发展 | 27,747,433.48 | 2.06 |
| 92 | 600115 | 东方航空 | 27,534,633.09 | 2.04 |
| 93 | 600325 | 华发股份 | 27,258,347.04 | 2.02 |
| 94 | 300140 | 启源装备 | 27,142,559.06 | 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。

#### 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 | 19,039,368,980.71 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 12,811,578,321.54 |

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没有超出基金合同规定的备选股票库。**

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额             |
|----|---------|----------------|
| 1  | 存出保证金   | 4,834,744.57   |
| 2  | 应收证券清算款 | 273,393,051.11 |
| 3  | 应收股利    | -              |
| 4  | 应收利息    | 234,594.04     |
| 5  | 应收申购款   | 25,057,029.54  |
| 6  | 其他应收款   | -              |
| 7  | 待摊费用    | -              |
| 8  | 其他      | -              |
| 9  | 合计      | 303,519,419.26 |

#### 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  | 000566 | 海南海药 | 868,522,802.64 | 9.99          | 重大事项     |
| 2  | 002223 | 鱼跃医疗 | 679,012,062.24 | 7.81          | 重大事项     |
| 3  | 600763 | 通策医疗 | 327,947,138.16 | 3.77          | 重大事项     |
| 4  | 603939 | 益丰药房 | 314,291,738.68 | 3.62          | 重大事项     |

### § 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<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>额比例 | 持有份额             | 占总份<br>额比例 |
| 260,153      | 17,721.40     | 722,598,542.66 | 15.67%     | 3,887,675,828.78 | 84.33%     |

#### 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 | 756,969.67 | 0.02%    |

#### 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<br>究部门负责人持有本开放式基金 | 0                  |
| 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（2014年11月18日）基金份额总额 | 1,157,348,255.93 |
| 本报告期期初基金份额总额               | 1,307,179,226.18 |
| 本报告期基金总申购份额                | 9,682,950,912.89 |
| 减：本报告期基金总赎回份额              | 6,379,855,767.63 |
| 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                | 4,610,274,371.44 |

注：1、总申购份额含红利再投、转换入份额；

2、总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期，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：

2015 年 4 月，李爱华先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 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 |    |
| 招商证券 | 1      | 386,570,241.67   | 1.21%        | 342,075.93   | 1.37%      | -  |
| 瑞银证券 | 1      | -                | -            | -            | -          | -  |
| 中信证券 | 2      | 1,640,328,105.07 | 5.15%        | 1,451,526.85 | 5.83%      | -  |
| 兴业证券 | 1      | 3,926,475,053.70 | 12.33%       | 3,574,647.54 | 14.35%     | -  |
| 中投证券 | 2      | 346,939,310.29   | 1.09%        | 307,007.53   | 1.23%      | -  |
| 长城证券 | 1      | 1,858,684,101.66 | 5.84%        | 1,692,147.93 | 6.79%      | -  |
| 中金   | 1      | 613,570,062.75   | 1.93%        | 549,087.34   | 2.20%      | -  |
| 国信证券 | 1      | 1,704,437,729.30 | 5.35%        | 1,508,258.76 | 6.05%      | -  |
| 长江证券 | 1      | 7,305,573,605.12 | 22.94%       | 5,003,591.59 | 20.09%     | -  |
| 民生证券 | 1      | 508,332,234.01   | 1.60%        | 449,823.35   | 1.81%      | -  |
| 国开证券 | 1      | 294,294,789.38   | 0.92%        | 260,422.07   | 1.05%      | -  |
| 民族证券 | 1      | 7,965,381,616.20 | 25.01%       | 5,554,457.07 | 22.30%     | -  |
| 申万宏源 | 2      | 2,399,660,810.40 | 7.53%        | 2,123,461.12 | 8.52%      | -  |
| 光大证券 | 1      | 313,916,547.41   | 0.99%        | 277,784.86   | 1.12%      | -  |
| 国泰君安 | 1      | -                | -            | -            | -          | -  |
| 银河证券 | 1      | -                | -            | -            | -          | -  |

|      |   |                  |       |              |       |   |
|------|---|------------------|-------|--------------|-------|---|
| 中信建投 | 1 | -                | -     | -            | -     | - |
| 广发证券 | 1 | 2,586,334,360.29 | 8.12% | 1,816,112.25 | 7.29% | - |

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、个股分析的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

无。

## 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 |
| 招商证券 | -              | -            | -                | -              | -    | -            |
| 瑞银证券 | -              | -            | -                | -              | -    | -            |
| 中信证券 | 134,108,546.94 | 35.30%       | -                | -              | -    | -            |
| 兴业证券 | -              | -            | 3,170,000,000.00 | 37.83%         | -    | -            |
| 中投证券 | -              | -            | -                | -              | -    | -            |
| 长城证券 | -              | -            | -                | -              | -    | -            |
| 中金   | -              | -            | 360,000,000.00   | 4.30%          | -    | -            |
| 国信证券 | 245,774,434.01 | 64.70%       | -                | -              | -    | -            |
| 长江证券 | -              | -            | -                | -              | -    | -            |
| 民生证券 | -              | -            | -                | -              | -    | -            |
| 国开证券 | -              | -            | -                | -              | -    | -            |
| 民族证券 | -              | -            | 3,220,000,000.00 | 38.42%         | -    | -            |
| 申万宏源 | -              | -            | -                | -              | -    | -            |
| 光大证券 | -              | -            | -                | -              | -    | -            |
| 国泰君安 | -              | -            | -                | -              | -    | -            |
| 银河证券 | -              | -            | -                | -              | -    | -            |
| 中信建投 | -              | -            | -                | -              | -    | -            |
| 广发证券 | -              | -            | 1,630,000,000.00 | 19.45%         | -    | -            |

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

无。