

# 工银瑞信创新动力股票型证券投资基金 2015 年半年度报告

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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：二〇一五年八月二十八日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 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。

基金托管人中国农业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。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	14
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>15</b>
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>39</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	39
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	44
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.....	44
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	44
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.....	44
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.....	44
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	45

7.12 投资组合报告附注.....	45
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>46</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	46
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.....	46
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>47</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>47</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	47
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.....	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	47
10.4 基金投资策略的改变.....	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	48
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.....	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	48
10.8 其他重大事件.....	50
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>53</b>
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>53</b>
12.1 备查文件目录.....	53
12.2 存放地点.....	53
12.3 查阅方式.....	53

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	工银瑞信创新动力股票型证券投资基金
基金简称	工银创新动力股票
基金主代码	000893
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 12 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	3,903,566,571.65 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	深入研究中国经济在“新常态”下的运行特征，寻找“新常态”下推动经济持续健康稳定发展的创新动力，并积极把握由此带来的投资机会，力争获取超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金将采用“自上而下”的分析方法进行股票筛选和投资。首先，通过对中国宏观经济“新常态”下的运行特征进行全面深入地跟踪、分析以及判断，寻找能够推动经济持续稳定健康发展的创新动力。其次，对创新动力的作用程度以及生命周期进行科学预判和动态把握，积极关注受益于创新动力带动下的行业以及主题投资机会。最后，对相应行业及主题中业绩具有长期稳定成长性、二级市场估值合理、公司治理结构完善并且竞争优势突出的优质上市公司股票进行积极主动的配置。
业绩比较基准	80%×中证 800 指数收益率+20%×中债综合指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，预期收益和风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

### 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
注册地址	北京市西城区金融大街丙 17 号北京银行大厦	北京东城区建国门内大街 69 号
办公地址	北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 A 座 6-9 层	北京复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 9 层
邮政编码	100033	100031
法定代表人	郭特华	刘士余

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、证券时报、上海证券报
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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	工银瑞信基金管理有限公司	北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 A 座 6-9 层

## § 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	1,461,807,683.60
本期利润	2,739,184,881.75
加权平均基金份额本期利润	0.5262
本期加权平均净值利润率	39.29%
本期基金份额净值增长率	55.69%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	1,198,977,655.71
期末可供分配基金份额利润	0.3071
期末基金资产净值	5,818,172,462.39
期末基金份额净值	1.490
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	49.00%

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要

低于所列数字。

2、“本期已实现收益”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 12 月 11 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

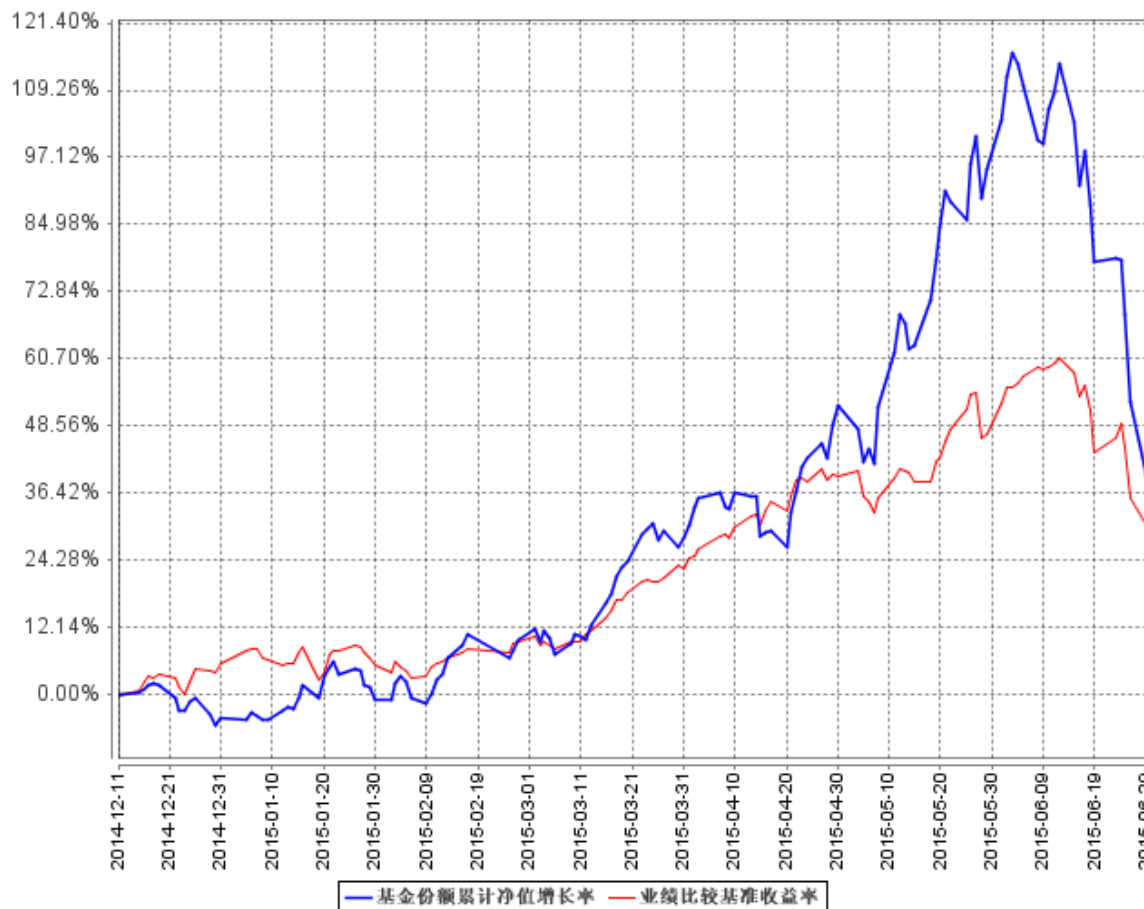
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-23.59%	4.57%	-6.61%	2.81%	-16.98%	1.76%
过去三个月	16.22%	3.76%	11.92%	2.11%	4.30%	1.65%
过去六个月	55.69%	3.00%	29.84%	1.76%	25.85%	1.24%
自基金合同生效起至今	49.00%	2.87%	37.14%	1.71%	11.86%	1.16%

注：1、本基金的业绩比较基准为： $80\% \times \text{中证 800 指数收益率} + 20\% \times \text{中债综合指数收益率}$ ，每日进行再平衡过程；

2、本基金基金合同生效日为 2014 年 12 月 11 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 12 月 11 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：股票占基金资产的比例为 80% - 95%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值的 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券。

### 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		
刘天任	本基金的基金经理	2014 年 12 月 11 日	-	7	曾任埃森哲咨询公司资深分析师。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；2015年6月5日至今，担任工银瑞信互联网加股票型基金基金经理。
王烁杰	本基金的基金经理	2014年12月11日	-	5	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；2015年6月5

					日至今，担任工银瑞信互联网加股票型基金基金经理。
--	--	--	--	--	--------------------------

注：

- 1、任职日期说明：刘天任的任职日期为基金合同生效的日期。  
王烁杰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，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 年二季度，中国宏观经济增长仍然偏弱，市场整体走势前涨后跌，出现了较大的波动。持仓方面，组合以信息产业、互联网、基因技术等为代表的成长股为主，同时配置一些京津冀一体化、国企改革等主题作为辅助。受益于无风险收益率下行、居民的资产配置转移、市场对于创新和成长的偏好等因素，二季度前两个月以创业板为代表的指数出现了较大的上涨，但是在 6 月份市场出现了较大幅度的调整，对组合的收益产生了一定的负面影响。

### 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 55.69%，业绩比较基准增长率为 29.84%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，中国经济增长中枢下移，进入经济结构调整与改善的新常态。在这个阶段，各项改革措施不断推进，进一步释放市场活力。在通胀压力增大以前，货币政策预计仍将保持宽松。由于前期大幅的上涨，部分行业和板块出现了一定的基本面和估值的背离，证券市场的“去杠杆化”使得市场指数出现比较大的调整。随着稳定资本市场的政策不断推出、平准基金的入市、一些公司在经历调整之后凸显了较好的投资价值等因素，我们预计后面指数在快速下行之后会逐渐企稳。

未来，我们认为改革和创新仍是重点方向。在改革方面，我们判断国企改革、产业整合等仍将是值得关注的重点。在创新方面，我们认为互联网+、国家与企业安全、新型消费等是值得关注的领域。在下一阶段，我们将进一步努力发掘具备巨大成长空间与较高估值吸引力的细分行业和龙头个股，力争为投资人取得良好的回报。

## 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、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

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 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 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的行为。

### 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半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，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## § 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：工银瑞信创新动力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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	472,726,357.00	506,405,181.41
结算备付金		5,337,682.28	-
存出保证金		5,775,159.19	-
交易性金融资产	6.4.7.2	5,867,805,667.32	5,929,824,660.68
其中：股票投资		5,867,805,667.32	5,928,344,634.60
基金投资		-	-
债券投资		-	1,480,026.08
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	400,000,000.00
应收证券清算款		-	137,824,237.48
应收利息	6.4.7.5	87,990.10	261,648.06
应收股利		-	-
应收申购款		12,611,248.12	16,542,542.90
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		6,364,344,104.01	6,990,858,270.53
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2015 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-

应付证券清算款		-	256,646,352.89
应付赎回款		525,854,031.67	22,712,520.39
应付管理人报酬		10,396,081.50	5,575,139.19
应付托管费		1,732,680.26	929,189.87
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	7,018,278.92	11,309,852.00
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	1,170,569.27	771.52
负债合计		546,171,641.62	297,173,825.86
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	3,903,566,571.65	6,996,861,015.42
未分配利润	6.4.7.10	1,914,605,890.74	-303,176,570.75
所有者权益合计		5,818,172,462.39	6,693,684,444.67
负债和所有者权益总计		6,364,344,104.01	6,990,858,270.53

注：1、本基金基金合同生效日为 2014 年 12 月 11 日，截至报告期末本基金合同生效不满一年。

2、报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值为人民币 1.490 元，基金份额总额为 3,903,566,571.65 份。

## 6.2 利润表

会计主体：工银瑞信创新动力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
<b>一、收入</b>		2,836,086,777.55
1.利息收入		3,603,782.02
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,921,794.69
债券利息收入		794.10
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		1,681,193.23
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,479,855,017.53
其中：股票投资收益	6.4.7.12	1,471,830,047.73
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	633,224.06
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-



股利收益	6.4.7.16	7,391,745.74
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	1,277,377,198.15
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	75,250,779.85
<b>减：二、费用</b>		96,901,895.80
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	51,624,575.32
2. 托管费	6.4.10.2.2	8,604,095.86
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.19	36,433,827.01
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	6.4.7.20	239,397.61
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		2,739,184,881.75
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		2,739,184,881.75

注：本基金基金合同生效日为 2014 年 12 月 11 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：工银瑞信创新动力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）	6,996,861,015.42	-303,176,570.75	6,693,684,444.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,739,184,881.75	2,739,184,881.75
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）	-3,093,294,443.77	-521,402,420.26	-3,614,696,864.03
其中：1.基金申购款	7,546,048,957.36	3,369,099,615.79	10,915,148,573.15
2.基金赎回款	-10,639,343,401.13	-3,890,502,036.05	-14,529,845,437.18
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）	3,903,566,571.65	1,914,605,890.74	5,818,172,462.39

注：本基金基金合同生效日为 2014 年 12 月 11 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

工银瑞信创新动力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【2014】1158 号《关于准予工银瑞信创新动力股票型证券投资基金注册的批复》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发行募集，基金的募集期为自 2014 年 11 月 24 日至 2014 年 12 月 9 日止。基金合同于 2014 年 12 月 11 日正式生效，本基金截止 2014 年 12 月 11 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 6,715,286,173.40 元，折合 6,715,286,173.40 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 1,067,658.17 元，折合 1,067,658.17 份基金份额；以上收到的实收基金共计人民币 6,716,353,831.57 元，折合 6,716,353,831.57 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及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。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市交易的股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、权证，股指期货，债券资产（包括但不限于国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券逆回购、银行存款等固定收益类资产，现金，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的相关规定）。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。基金的投资组合比例为：股票占基金资产的比例为 80% - 95%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值的 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为：80%×中证 800 指数收益率+20%×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

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 4 次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额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。

#### 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 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
活期存款	472, 726, 357. 00
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	472, 726, 357. 00

注：本基金本报告期末投资于定期存款。

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	4, 861, 340, 175. 47	5, 867, 805, 667. 32	1, 006, 465, 491. 85
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	4, 861, 340, 175. 47	5, 867, 805, 667. 32	1, 006, 465, 491. 85

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本期末无买断式逆回购交易，也无在买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应收活期存款利息	82,989.40
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	2,401.90
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	2,598.80
合计	87,990.10

注：“其他”为应收结算保证金利息。

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
交易所市场应付交易费用	7,018,278.92
银行间市场应付交易费用	-
合计	7,018,278.92

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	967,694.99

预提信息披露费	148,765.71
预提审计费	49,588.57
其他	20.00
预提账户维护费	4,500.00
合计	1,170,569.27

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	6,996,861,015.42	6,996,861,015.42
本期申购	7,546,048,957.36	7,546,048,957.36
本期赎回(以“-”号填列)	-10,639,343,401.13	-10,639,343,401.13
本期末	3,903,566,571.65	3,903,566,571.65

- 注：1、“本期申购”中包含红利再投、转换入份额及金额，“本期赎回”中包含转出份额及金额；
- 2、本基金截止 2014 年 12 月 11 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 6,715,286,173.40 元，折合 6,715,286,173.40 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 1,067,658.17 元，折合 1,067,658.17 份基金份额；以上收到的实收基金共计人民币 6,716,353,831.57 元，折合 6,716,353,831.57 份基金份额；
- 3、本基金基金合同生效日为 2014 年 12 月 11 日。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-30,759,874.50	-272,416,696.25	-303,176,570.75
本期利润	1,461,807,683.60	1,277,377,198.15	2,739,184,881.75
本期基金份额交易产生的变动数	-232,070,153.39	-289,332,266.87	-521,402,420.26
其中：基金申购款	888,268,819.50	2,480,830,796.29	3,369,099,615.79
基金赎回款	-1,120,338,972.89	-2,770,163,063.16	-3,890,502,036.05
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,198,977,655.71	715,628,235.03	1,914,605,890.74

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	1,493,834.07
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	396,345.81
其他	31,614.81
合计	1,921,794.69

注：“其他”为结算保证金利息收入。

#### 6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	13,487,081,702.43
减：卖出股票成本总额	12,015,251,654.70
买卖股票差价收入	1,471,830,047.73

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	633,224.06
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	633,224.06

##### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,830,280.30
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,196,000.00
减：应收利息总额	1,056.24
买卖债券差价收入	633,224.06

**6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益**

本基金本报告期间无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.14 贵金属投资收益**

本基金本报告期间无贵金属投资收益。

**6.4.7.15 衍生工具收益****6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期无买卖权证差价收入。

**6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

本基金本报告期无其他衍生工具投资收益。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
股票投资产生的股利收益	7,391,745.74
基金投资产生的股利收益	-
合计	7,391,745.74

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
1. 交易性金融资产	1,277,377,198.15
——股票投资	1,277,661,224.23
——债券投资	-284,026.08
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	1,277,377,198.15

**6.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
----	----------------------------

基金赎回费收入	70,390,751.74
转换费收入	4,860,028.11
合计	75,250,779.85

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
交易所市场交易费用	36,433,827.01
银行间市场交易费用	-
合计	36,433,827.01

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
审计费用	49,588.57
信息披露费	148,765.71
账户维护费	7,500.00
其他	400.00
银行费用	33,143.33
合计	239,397.61

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

### 6.4.9 关联方关系

#### 6.4.9.1 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。

#### 6.4.9.2 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

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。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 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。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 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	51,624,575.32
其中：支付销售机构的客户维护费	17,840,282.86

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5 %年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.5 \% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

###### 6.4.10.2.2 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	8,604,095.86

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。

##### 6.4.10.3 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。



**6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况****6.4.10.4.1 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。

**6.4.10.4.2 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未持有本基金。

**6.4.10.5 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 2015年1月1日至2015年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	472,726,357.00	1,493,834.07

注：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。

**6.4.10.6 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。

**6.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

无。

**6.4.11 利润分配情况**

本报告期内，本基金未实施收益分配。

**6.4.12 期末（2015年6月30日）本基金持有的流通受限证券****6.4.12.1 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。

**6.4.12.2 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	10,016,433	240,487,122.06	378,420,838.74	指数法估值

002329	皇氏集团	2015年6月12日	重大事项	57.76	2015年8月13日	62.53	5,737,103	191,159,047.07	331,375,069.28	指数法估值
300377	赢时胜	2015年5月20日	重大事项	145.51	2015年7月15日	168.99	1,555,959	174,948,495.78	226,407,594.09	指数法估值
600645	中源协和	2015年4月27日	重大事项	81.32	-	-	2,288,337	115,747,905.35	186,087,564.84	指数法估值
002298	鑫龙电器	2015年6月25日	重大事项	24.86	2015年7月2日	25.34	2,609,654	102,237,069.04	64,875,998.44	指数法估值
002413	常发股份	2015年6月29日	重大事项	52.02	-	-	726,687	15,651,829.93	37,802,257.74	-
002268	卫士通	2015年5月8日	重大事项	80.14	2015年8月4日	76.32	411,870	25,030,018.84	33,007,261.80	指数法估值
000959	首钢股份	2015年4月23日	重大事项	6.19	-	-	2,365,200	11,701,943.45	14,640,588.00	指数法估值
000793	华闻传媒	2015年5月26日	重大事项	20.75	-	-	77,584	1,096,280.86	1,609,868.00	-
002375	亚厦股份	2015年6月17日	重大事项	29.21	2015年7月20日	26.29	49	904.44	1,431.29	-
300084	海默科技	2015年6月3日	重大事项	21.43	2015年7月20日	19.29	16	200.74	342.88	-

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-238,651,336.75元。

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 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。

#### 6.4.12.3.2 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。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人的风险管理机构由董事会下属的公司治理与风险控制委员会、督察长、公司风险管理委员会、法律合规部、风险管理部以及各个业务部门组成。

公司实行全面、系统的风险管理，风险管理覆盖公司所有战略环节、业务环节和操作环节。同时制定了系统化的风险管理程序，对风险管理的整个流程进行评估和改进。公司构建了分工明确、相互协作、彼此牵制的风险管理组织结构，形成了由四大防线共同筑成的风险管理体系：第一道防线由各个业务部门构成，各业务部门总监作为风险责任人，负责制订本部门的作业流程以及风险控制措施；第二道监控防线由公司专属风险管理部门法律合规部和风险管理部构成，法律合规部负责对公司业务的法律合规风险进行监控管理，风险管理部负责对公司投资管理风险和运作风险进行监控管理；第三道防线是由公司经营管理层和风险管理委员会构成，公司管理层通过执行委员会下的风险管理委员会对风险状况进行全面监督并及时制定相应的对策和实施监控措施；在上述这三道风险监控防线中，公司督察长和监察稽核人员对风险控制措施和合规风险情况进行全面检查、监督，并视所发生问题情节轻重及时反馈给各部门经理、公司总经理、公司治理与风险控制委员会、董事会、监管机构。督察长独立于公司其他业务部门和公司管理层，对内部控制制度的执行情况实行严格检查和及时反馈，并独立报告；第四道监控防线由董事会下属的公司治理与风险控制委员会构成，公司治理与风险控制委员会通过督察长和监察稽核人员的工作，掌握整体风险状况并进行决策。公司治理与风险控制委员会负责检查公司业务的内控制度的实施情况，监督公司对相关法律法规和公司制度的执行。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好

信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

#### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

于 2014 年 12 月 31 日和 2015 年 6 月 30 日，本基金未持有按短期信用评级的债券投资。

#### **6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资**

于 2014 年 12 月 31 日和 2015 年 6 月 30 日，本基金未持有按长期信用评级的债券投资。

#### **6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除小部分流通受限证券外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

#### **6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析**

无。

#### **6.4.13.4 市场风险**

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### **6.4.13.4.1 利率风险**

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金

融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	472,726,357.00	-	-	-	-	-	472,726,357.00
结算备付金	5,337,682.28	-	-	-	-	-	5,337,682.28
存出保证金	5,775,159.19	-	-	-	-	-	5,775,159.19
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-5,867,805,667.32	-5,867,805,667.32
应收利息	-	-	-	-	-	87,990.10	87,990.10
应收申购款	-	-	-	-	-	12,611,248.12	12,611,248.12
资产总计	483,839,198.47	-	-	-	-	-5,880,504,905.54	6,364,344,104.01
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	525,854,031.67	525,854,031.67
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	10,396,081.50	10,396,081.50
应付托管费	-	-	-	-	-	1,732,680.26	1,732,680.26
应付交易费用	-	-	-	-	-	7,018,278.92	7,018,278.92
其他负债	-	-	-	-	-	1,170,569.27	1,170,569.27
负债总计	-	-	-	-	-	546,171,641.62	546,171,641.62
利率敏感度缺口	483,839,198.47	-	-	-	-	-5,334,333,263.92	5,818,172,462.39
上年度末 2014年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	506,405,181.41	-	-	-	-	-	506,405,181.41
交易性金融资产	-	-	-1,480,026.08	-	-	-5,928,344,634.60	-5,929,824,660.68
买入返售金融资产	400,000,000.00	-	-	-	-	-	400,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	137,824,237.48	137,824,237.48
应收利息	-	-	-	-	-	261,648.06	261,648.06
应收申购款	-	-	-	-	-	16,542,542.90	16,542,542.90
资产总计	906,405,181.41	-	-1,480,026.08	-	-	-6,082,973,063.04	6,990,858,270.53
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	256,646,352.89	256,646,352.89

应付赎回款	-	-	-	-	22,712,520.39	22,712,520.39
应付管理人报酬	-	-	-	-	5,575,139.19	5,575,139.19
应付托管费	-	-	-	-	929,189.87	929,189.87
应付交易费用	-	-	-	-	11,309,852.00	11,309,852.00
其他负债	-	-	-	-	771.52	771.52
负债总计	-	-	-	-	297,173,825.86	297,173,825.86
利率敏感度缺口	906,405,181.41	-1,480,026.08	-	-	-5,785,799,237.18	6,693,684,444.67

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于 2014 年 12 月 31 日和 2015 年 6 月 30 日，未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

无。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		上年度末 2014 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产—股票投资	5,867,805,667.32	100.85	5,928,344,634.60	88.57
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	1,480,026.08	0.02
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

合计	5,867,805,667.32	100.85	5,929,824,660.68	88.59
----	------------------	--------	------------------	-------

注：1. 基金的投资组合比例为：股票占基金资产的比例为 80% - 95%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值的 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券。

2. 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。

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1、假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；		
	2、用期末时点比较基准浮动 5% 基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；		
	3、Beta 系数是根据组合的净值数据和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2015 年 6 月 30 日）	上年度末（2014 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准增加 5%	361,953,488.98	270,914,928.24
	业绩比较基准减少 5%	-361,953,488.98	-270,914,928.24

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

#### 6.4.14 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	5,867,805,667.32	92.20
	其中：股票	5,867,805,667.32	92.20
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	478,064,039.28	7.51
7	其他各项资产	18,474,397.41	0.29
8	合计	6,364,344,104.01	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（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	325,258.20	0.01
C	制造业	2,642,304,197.96	45.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	261,400.00	0.00
E	建筑业	1,193,624.81	0.02
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	68,735,835.79	1.18
H	住宿和餐饮业	61,761,882.98	1.06
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,556,548,848.66	43.94
J	金融业	-	-
K	房地产业	72,998,457.30	1.25
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	237,850,582.44	4.09
N	水利、环境和公共设施管理业	157,637,001.58	2.71
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	68,188,577.60	1.17
S	综合	-	-
	合计	5,867,805,667.32	100.85

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所有股票投资明细

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	002439	启明星辰	18,318,100	628,310,830.00	10.80
2	300059	东方财富	9,859,890	622,060,460.10	10.69
3	300131	英唐智控	14,706,588	418,549,494.48	7.19
4	002303	美盈森	10,016,433	378,420,838.74	6.50
5	300288	朗玛信息	6,380,035	373,423,448.55	6.42
6	002329	皇氏集团	5,737,103	331,375,069.28	5.70
7	300140	启源装备	8,105,836	322,450,156.08	5.54
8	002312	三泰控股	8,144,936	305,109,302.56	5.24
9	300377	赢时胜	1,555,959	226,407,594.09	3.89
10	002373	千方科技	5,044,957	218,396,188.53	3.75
11	600485	信威集团	4,896,203	214,894,349.67	3.69
12	600645	中源协和	2,288,337	186,087,564.84	3.20
13	002153	石基信息	1,401,850	182,226,481.50	3.13
14	002701	奥瑞金	6,916,480	180,035,974.40	3.09
15	300352	北信源	3,770,015	163,618,651.00	2.81
16	000888	峨眉山 A	10,558,406	157,637,001.58	2.71
17	300018	中元华电	2,341,120	105,818,624.00	1.82
18	300213	佳讯飞鸿	2,075,412	84,656,055.48	1.46
19	600179	黑化股份	5,106,119	84,455,208.26	1.45
20	300369	绿盟科技	1,512,537	77,139,387.00	1.33
21	300252	金信诺	1,841,344	73,046,116.48	1.26
22	002113	天润控股	2,624,780	71,997,715.40	1.24
23	300013	新宁物流	2,652,869	68,735,835.79	1.18
24	300027	华谊兄弟	1,745,640	66,578,709.60	1.14
25	002298	鑫龙电器	2,609,654	64,875,998.44	1.12
26	601007	金陵饭店	2,731,618	61,761,882.98	1.06
27	300332	天壕节能	2,054,088	51,763,017.60	0.89
28	002413	常发股份	726,687	37,802,257.74	0.65
29	002268	卫士通	411,870	33,007,261.80	0.57
30	300248	新开普	730,764	29,347,482.24	0.50
31	300263	隆华节能	1,025,122	22,860,220.60	0.39
32	000959	首钢股份	2,365,200	14,640,588.00	0.25
33	000793	华闻传媒	77,584	1,609,868.00	0.03
34	600118	中国卫星	27,354	1,558,083.84	0.03
35	002280	联络互动	25,837	1,377,112.10	0.02
36	600446	金证股份	9,654	1,191,882.84	0.02
37	601618	中国中冶	161,400	1,166,922.00	0.02
38	600855	航天长峰	18,327	790,260.24	0.01
39	600767	运盛实业	28,615	564,287.80	0.01

40	601992	金隅股份	38,209	456,597.55	0.01
41	600862	南通科技	17,190	436,454.10	0.01
42	300368	汇金股份	15,042	409,894.50	0.01
43	600028	中国石化	46,022	324,915.32	0.01
44	601985	中国核电	20,000	261,400.00	0.00
45	600685	中船防务	1,458	78,352.92	0.00
46	603000	人民网	807	42,068.91	0.00
47	002542	中化岩土	1,956	25,271.52	0.00
48	002149	西部材料	700	19,922.00	0.00
49	002375	亚厦股份	49	1,431.29	0.00
50	300430	诚益通	10	832.70	0.00
51	300084	海默科技	16	342.88	0.00

## 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	002439	启明星辰	798,752,947.25	11.93
2	600149	廊坊发展	701,380,693.55	10.48
3	002373	千方科技	509,387,562.95	7.61
4	002303	美盈森	425,478,165.23	6.36
5	601318	中国平安	422,201,641.87	6.31
6	300059	东方财富	403,072,359.81	6.02
7	601000	唐山港	296,518,118.41	4.43
8	002312	三泰控股	266,380,050.60	3.98
9	000831	五矿稀土	257,211,990.95	3.84
10	300140	启源装备	238,423,666.69	3.56
11	600485	信威集团	232,055,454.86	3.47
12	603000	人民网	212,058,069.24	3.17
13	300377	赢时胜	204,379,504.45	3.05
14	000888	峨眉山A	198,782,672.38	2.97
15	300288	朗玛信息	198,271,240.62	2.96
16	002329	皇氏集团	191,159,047.07	2.86
17	600392	盛和资源	189,773,054.70	2.84
18	002153	石基信息	179,899,395.60	2.69

19	300352	北信源	177,654,773.12	2.65
20	300295	三六五网	177,307,856.28	2.65
21	300248	新开普	176,044,827.84	2.63
22	600585	海螺水泥	173,961,227.09	2.60
23	002701	奥瑞金	167,875,303.28	2.51
24	601601	中国太保	149,020,682.18	2.23
25	002065	东华软件	136,588,019.72	2.04

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	002373	千方科技	808,959,789.13	12.09
2	601000	唐山港	770,980,553.46	11.52
3	600149	廊坊发展	703,546,084.45	10.51
4	300059	东方财富	692,831,621.26	10.35
5	600485	信威集团	545,742,996.07	8.15
6	601318	中国平安	534,639,049.23	7.99
7	002439	启明星辰	516,520,174.05	7.72
8	002520	日发精机	377,521,440.70	5.64
9	600118	中国卫星	333,541,149.14	4.98
10	300288	朗玛信息	308,381,568.95	4.61
11	601988	中国银行	295,246,963.08	4.41
12	601601	中国太保	289,053,812.91	4.32
13	600855	航天长峰	275,196,265.78	4.11
14	002065	东华软件	247,636,188.67	3.70
15	000831	五矿稀土	230,132,890.78	3.44
16	002303	美盈森	219,837,959.33	3.28
17	300295	三六五网	213,169,795.93	3.18
18	000516	国际医学	213,011,142.19	3.18
19	600383	金地集团	209,149,349.30	3.12
20	300248	新开普	193,255,219.92	2.89
21	600900	长江电力	182,299,339.51	2.72
22	603000	人民网	177,461,008.82	2.65
23	000002	万科A	175,163,269.07	2.62

24	300033	同花顺	171,007,475.62	2.55
25	600392	盛和资源	167,545,380.89	2.50
26	000888	峨眉山 A	154,665,216.69	2.31
27	600585	海螺水泥	154,358,583.96	2.31
28	601088	中国神华	153,657,742.52	2.30
29	600143	金发科技	146,776,577.53	2.19
30	002573	清新环境	145,877,236.36	2.18
31	300084	海默科技	142,974,627.59	2.14
32	600685	中船防务	142,625,262.86	2.13
33	601336	新华保险	142,375,908.45	2.13
34	601628	中国人寿	140,769,485.62	2.10
35	300107	建新股份	138,023,222.77	2.06
36	601600	中国铝业	136,328,765.73	2.04

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	10,677,051,463.19
卖出股票收入（成交）总额	13,487,081,702.43

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所有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

本基金于报告期内没有投资股指期货。

## 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

本基金于报告期内没有投资国债期货。

### 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

本基金于报告期内没有投资国债期货。

## 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	5,775,159.19
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	87,990.10
5	应收申购款	12,611,248.12
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,474,397.41

**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	002303	美盈森	378,420,838.74	6.50	重大事项
2	002329	皇氏集团	331,375,069.28	5.70	重大事项
3	300377	赢时胜	226,407,594.09	3.89	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
73,518	53,096.75	1,732,703,256.01	44.39%	2,170,863,315.64	55.61%

**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	775,697.00	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 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12月11日）基金份额总额	6,716,353,831.57
本报告期期初基金份额总额	6,996,861,015.42
本报告期基金总申购份额	7,546,048,957.36
减：本报告期基金总赎回份额	10,639,343,401.13
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	3,903,566,571.65

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。

## § 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

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

**10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况**

本基金的审计机构为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），该审计机构自基金合同生效日起向本基金提供审计服务，无改聘情况。

**10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**

本报告期，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	
兴业证券	1	6,883,703,556.13	28.49%	6,091,392.66	30.06%	-
中信建投	2	1,602,211,304.29	6.63%	947,199.14	4.67%	-
民生证券	1	944,017,682.49	3.91%	835,362.20	4.12%	-
银河证券	1	2,326,080,710.21	9.63%	2,117,651.43	10.45%	-
申万宏源	1	2,055,020,137.23	8.51%	1,818,490.07	8.97%	-
国泰君安	1	4,446,737,165.45	18.40%	4,048,286.89	19.98%	-
瑞银证券	1	1,529,287,736.97	6.33%	1,392,261.99	6.87%	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	4,374,202,924.05	18.10%	3,011,990.36	14.86%	-

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广发证券股份有限公司的 31668 上海交易单元和 396150 深圳交易单元，中信建投证券股份有限公司的 32901 上海交易单元和 399441 深圳交易单元。

## 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
兴业证券	1,746,147.80	95.40%	-	-	-	-
中信建投	84,132.50	4.60%	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	4,790,000,000.00	31.87%	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	4,790,000,000.00	31.87%	-	-

瑞银证券	-	-	5,450,000,000.00	36.26%	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	工银瑞信基金管理有限公司关于电子自助交易系统基金转换费率优惠活动的公告	三大报、公司网站	2015年1月5日
2	工银瑞信基金管理有限公司关于旗下创新动力股票型证券投资基金在兴业银行开通转换业务的公告	三大报、公司网站	2015年1月5日
3	工银瑞信基金管理有限公司关于参加同花顺基金申购、定投费率优惠活动及开通部分基金转换业务的公告	三大报、公司网站	2015年1月14日
4	工银瑞信基金管理有限公司关于增加北京唐鼎耀华投资咨询有限公司为旗下基金销售机构并实行费率优惠的公告	三大报、公司网站	2015年1月26日
5	工银瑞信基金管理有限公司关于旗下部分基金参与上海好买基金销售有限公司费率优惠活动的公告	三大报、公司网站	2015年2月5日
6	工银瑞信基金管理有限公司关于直销渠道基金定投申购费率优惠活动的公告	三大报、公司网站	2015年3月3日

7	工银瑞信基金管理有限公司关于旗下部分基金参与杭州数米基金销售有限公司申购费率优惠活动的公告	三大报、公司网站	2015 年 3 月 6 日
8	工银瑞信基金管理有限公司关于公司董事、监事、高级管理人员以及其他从业人员在子公司兼职情况变更的公告	三大报、公司网站	2015 年 3 月 14 日
9	工银瑞信基金管理有限公司关于增加北京增财基金销售有限公司为旗下基金销售机构并实行费率优惠的公告	三大报、公司网站	2015 年 3 月 16 日
10	工银瑞信基金管理有限公司关于增加海银基金销售有限公司为旗下基金销售机构并实行费率优惠的公告	三大报、公司网站	2015 年 3 月 16 日
11	工银瑞信基金管理有限公司关于直销渠道转换费率优惠活动的公示	三大报、公司网站	2015 年 3 月 27 日
12	工银瑞信基金管理有限公司关于基金直销电子自助交易业务开通中国银行和交通银行支付方式及部分费率优惠的公告	三大报、公司网站	2015 年 3 月 27 日
13	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	三大报、公司网站	2015 年 3 月 27 日
14	关于工银瑞信创新动力股票型证券投资基金暂停申购、转换转入业务的公告	三大报、公司网站	2015 年 4 月 9 日

15	关于工银瑞信创新动力股票型证券投资基金暂停大额定期定额投资的公告	三大报、公司网站	2015 年 4 月 10 日
16	工银瑞信基金管理有限公司关于增加上海大智慧财富管理有限公司为旗下基金销售机构并实行费率优惠的公告	三大报、公司网站	2015 年 4 月 20 日
17	工银瑞信基金管理有限公司关于旗下基金参与深圳众禄基金销售有限公司认/申购费率优惠活动的公告	三大报、公司网站	2015 年 4 月 24 日
18	工银瑞信基金管理有限公司关于副总经理变更的公告	三大报、公司网站	2015 年 4 月 28 日
19	工银瑞信基金管理有限公司关于公司董事、监事、高级管理人员以及其他从业人员在子公司兼职情况变更的公告	三大报、公司网站	2015 年 5 月 12 日
20	关于工银瑞信创新动力股票型证券投资基金恢复申购、转换转入并暂停大额申购、转换转入及定期定额投资的公告	三大报、公司网站	2015 年 5 月 15 日
21	工银瑞信基金管理有限公司关于旗下部分基金参加一路财富（北京）信息科技有限公司网上费率优惠活动的公告	三大报、公司网站	2015 年 5 月 28 日
22	工银瑞信创新动力股票型证券投资基金恢复大额申购、大额转换转入、大额定期定额投资业务的公告	三大报、公司网站	2015 年 6 月 1 日

23	工银瑞信基金管理有限公司关于 副总经理变更的公告	三大报、公司网站	2015 年 6 月 2 日
24	工银瑞信基金管理有限公司关于 增加上海汇付金融服务有限公司 为旗下基金销售机构并实行费率 优惠的公告	三大报、公司网站	2015 年 6 月 30 日

注：三大报包括中国证券报、上海证券报、证券时报。

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准工银瑞信创新动力股票型证券投资基金募集的文件
- 2、《工银瑞信创新动力股票型证券投资基金基金合同》
- 3、《工银瑞信创新动力股票型证券投资基金托管协议》
- 4、《工银瑞信创新动力股票型证券投资基金招募说明书》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照
- 7、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告

### 12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的办公场所。

### 12.3 查阅方式

投资者可于营业时间查阅，或登录基金管理人网站查阅。

投资者可在营业时间免费查阅。也可在支付工本费后，在合理时间内取得上述文件的复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人——工银瑞信基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-811-9999

网址: [www.icbccs.com.cn](http://www.icbccs.com.cn)