

工银瑞信美丽城镇主题股票型证券投资基金 2015 年年度报告

2015 年 12 月 31 日

基金管理人：工银瑞信基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：二〇一六年三月二十八日

§ 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 3 月 18 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。

本报告期自 2015 年 3 月 26 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
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
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
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.....	9
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4 管理人报告	9
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.....	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	17
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	18
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	19
4.9 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.....	19
§5 托管人报告	19
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	19
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.....	19
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	19
§6 审计报告	19
6.1 审计报告基本信息.....	19
6.2 审计报告的基本内容.....	20
§7 年度财务报表	21
7.1 资产负债表.....	21
7.2 利润表.....	22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	23
7.4 报表附注.....	24
§8 投资组合报告	45
8.1 期末基金资产组合情况.....	45
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	45
8.3 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.....	46
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	48
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	57
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	57

8.7 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	57
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	58
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	58
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	58
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	58
8.12 投资组合报告附注	58
§9 基金份额持有人信息	59
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	59
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	59
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	59
§10 开放式基金份额变动	60
§11 重大事件揭示	60
11.1 基金份额持有人大会决议	60
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	60
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	61
11.4 基金投资策略的改变	61
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	61
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	61
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	61
11.8 其他重大事件	63
§12 影响投资者决策的其他重要信息	68
§13 备查文件目录	68
13.1 备查文件目录	68
13.2 存放地点	68
13.3 查阅方式	68

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	工银瑞信美丽城镇主题股票型证券投资基金
基金简称	工银美丽城镇股票
基金主代码	001043
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 3 月 26 日
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	890,013,126.42 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在全面推进新型城镇化发展的背景下，积极选择深度受益于此类主题的股票进行投资，并通过积极有效的风险防范措施，力争获取超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金将由投资研究团队及时跟踪市场环境变化，根据宏观经济运行态势、宏观经济政策变化、证券市场运行状况、国际市场变化情况等因素的深入研究，判断证券市场的发展趋势，结合行业状况、公司价值性和成长性分析，综合评价各类资产的风险收益水平。在充足的宏观形势判断和策略分析的基础上，采用动态调整策略，在市场上涨阶段中，适当增加权益类资产配置比例，在市场下行周期中，适当降低权益类资产配置比例，力求实现基金财产的长期稳定增值，从而有效提高不同市场状况下基金资产的整体收益水平。
业绩比较基准	80%×沪深 300 指数收益率+20%×中债综合指数收益率。
风险收益特征	本基金为股票型基金，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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	朱碧艳	田青
	联系电话	400-811-9999	010-67595096
	电子邮箱	customerservice@icbccs.com.cn	tianqing1.zh@ccb.cn
客户服务电话		400-811-9999	010-67595096
传真		010-66583158	010-66275853
注册地址		北京市西城区金融大街 5 号、甲 5 号 6 层甲 5 号 601、甲 5 号 7 层甲	北京市西城区金融大街 25 号

	5 号 701、甲 5 号 8 层甲 5 号 801、甲 5 号 9 层甲 5 号 901	
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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	100033	100033
法定代表人	郭特华	王洪章

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 16 层
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、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015 年 3 月 26 日(基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日
本期已实现收益	111,166,465.30
本期利润	149,390,578.48
加权平均基金份额本期利润	0.1112
本期加权平均净值利润率	11.11%
本期基金份额净值增长率	-0.80%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末
期末可供分配利润	-8,029,200.09
期末可供分配基金份额利润	-0.0090
期末基金资产净值	882,667,302.76
期末基金份额净值	0.992
3.1.3 累计期末指标	2015 年末
基金份额累计净值增长率	-0.80%

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

低于所列数字；

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

3、本基金基金合同生效日为 2015 年 3 月 26 日。截至报告期末，本基金基金合同生效不满一年。

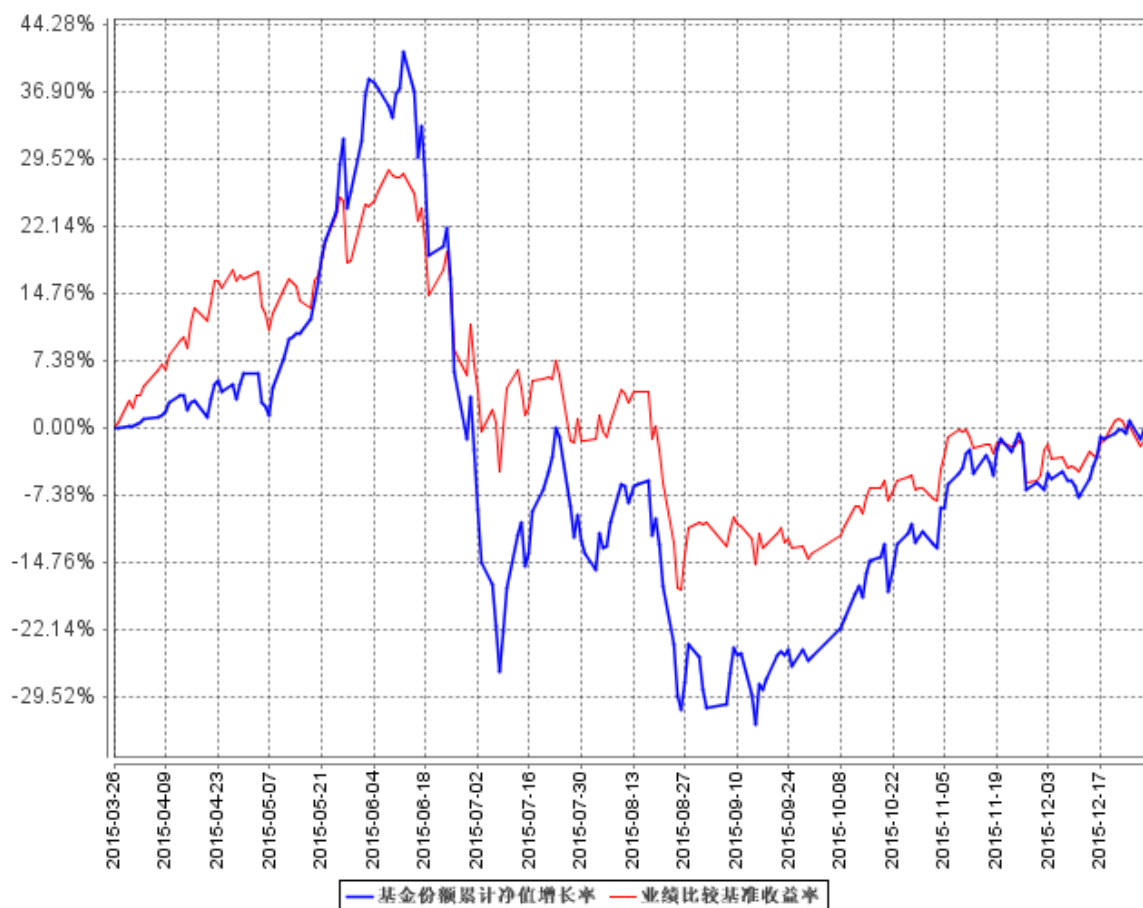
3.2 基金净值表现

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
过去三个月	32.44%	1.97%	13.75%	1.34%	18.69%	0.63%
过去六个月	-3.97%	3.21%	-12.03%	2.14%	8.06%	1.07%
自基金合同生效起至今	-0.80%	3.02%	-1.98%	2.11%	1.18%	0.91%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

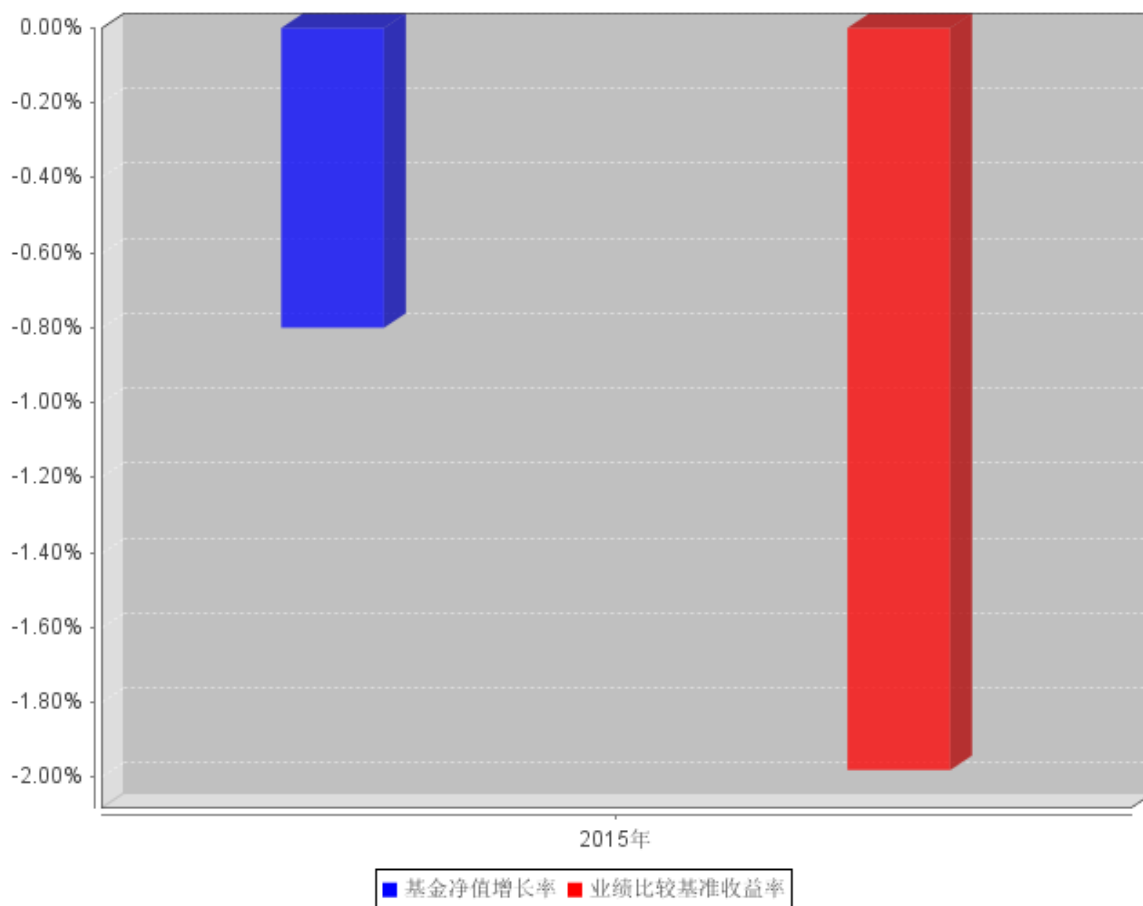


注：1、本基金基金合同于 2015 年 3 月 26 日生效。截至报告期末，本基金基金合同生效不满一年。

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%，其中投资于本基金界定的美丽城镇主题范围内股票不低于非现金资产的 80%。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。

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

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：1、本基金基金合同生效日为 2015 年 3 月 26 日。

2、合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

本基金自成立以来未实施利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为工银瑞信基金管理有限公司，成立于 2005 年 6 月 21 日，是我国第一家由银行直接发起设立并控股的合资基金管理公司，注册资本为 2 亿元人民币，注册地在北京。公司目

前拥有共同基金募集和管理资格、境外证券投资管理业务资格、企业年金基金投资管理人资格、特定客户资产管理业务资格、全国社保基金境内投资管理人资格。

截至 2015 年 12 月 31 日，公司旗下管理 74 只公募基金——工银瑞信核心价值混合型证券投资基金、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、工银瑞信稳健成长混合型证券投资基金、工银瑞信增强收益债券型证券投资基金、工银瑞信红利混合型证券投资基金、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、工银瑞信大盘蓝筹混合型证券投资基金、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混合型证券投资基金、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混合型证券投资基金、工银瑞信添颐债券型证券投资基金、工银瑞信主题策略混合型证券投资基金、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混合型证券投资基金、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混合型证券投资基金、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、工银瑞信信息产业混合型证券投资基金、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、工银瑞信中证新能源指数分级证券投资基金、工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金、工银瑞信中证高铁产业指数分级证券投资基金、工银瑞信新蓝筹股票型证券投资基金、工银瑞信丰收回报灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信中高等级信用债债券型证券投资基金、工银瑞信新趋势灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信文体产业股票型证券投资基金，证券投资基金管理规模逾 4400 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		
王君正	研究部副总监，本基金的基金经理	2015 年 3 月 26 日	-	7	曾任泰达宏利基金管理有限公司研究员；2011 年加入工银瑞信，现任研究部副总监。2013 年 8 月 26 日至今，担任工银瑞信金融地产行业混合型证券投资基金基金经理；2015 年 1 月 27 日至今，担任工银国企改革主题股票型基金基金经理；2015 年 3 月 19 日至今，担任工银瑞信新金融股票型基金基金经理；2015 年 3 月 26 日至今，担任工银瑞信美丽城镇主题股票型基金基金经理；2015 年 5 月 22 日至今，担任工银丰盈回报灵活配置混合型基金基金经理。
鄢耀	本基金的基金经理	2015 年 3 月 26 日	-	8	先后在德勤华永会计师事务所有限公司担任高级审计员，中国国际金融有限公司担任分析员；2010 年加入工银瑞信，曾任研究部研究员。2013 年 8 月 26 日至今，担任工银瑞信金融地产行业混合型证券投资基金基金经理；2014 年 1 月 20 日至今，担任工银添福债券基金基金经理；2014 年 1 月 20 日至 2015 年 11 月 11 日，担任工银月月薪定期支付债券基金基金经理；2014 年 9 月 19 日起至今，担任工银新财富灵活配置混合型基金基金经理；2015 年 3 月 19 日至今，担任工银瑞信新金融股票型基金基金经理；2015 年

					3月26日至今，担任工银瑞信美丽城镇主题股票型基金基金经理；2015年4月17日至今，担任工银总回报灵活配置混合型基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：1、任职日期说明：

1) 王君正的任职日期为基金合同生效的日期

2) 鄢耀的任职日期为基金合同生效的日期

2、离任日期说明：无

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

4、本基金无基金经理助理

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

1、公平交易原则

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

2、适用范围

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

3、公平交易的具体措施

3.1 在研究和投资决策环节：

3.1.1 在公司股票池的基础上，研究部根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和关联交易限制等，参考公司《股票池管理办法》，建立股票池，各基金基金经理、其他受托资产

投资经理在此基础上根据投资授权构建具体的投资组合。

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

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

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

3.2 在交易执行环节：

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

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

3.2.3 公平交易执行方法：

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

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

公平交易模块执行原理如下：

1) 同向交易指令：

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

2) 反向交易指令

a) 交易员不得接受可能导致同一投资组合或不同投资组合之间对敲的同一证券品种的指令，并由风险中台在投资系统中设置严禁所有产品在证券交易时对敲。b) 根据证监会 2011 年修订的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》中相关条款，公司规定同一公募基金、年金、

专户、社保组合或前述组合之间不允许同日针对同一证券的反向投资指令；c)同一公募基金不允许两日内针对同一证券的反向投资指令。d)确因投资组合要求的投资策略或流动性等需求而发生的同日反向交易，按要求投资组合经理要填写反向交易申请表，并要求相关投资经理提供决策依据，并保留记录备查。e)以上反向交易要求完全按照指数的构成进行投资的组合等除外。

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

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

3.2.6 对于由于特殊原因不能参与公平交易程序的交易指令，中央交易室填写《公平交易审批单》，经公司内部审批后执行。

3.2.7 公平交易争议处理

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

3.3 公平交易的检查和价格监控

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

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

3.3.3 法律合规部应对不同投资组合在交易所公开竞价交易中同日同向交易的交易时机和交易价差进行监控，同时对不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差

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

3.4 评估和分析

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

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

4. 报告

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

律法规禁止的反向交易及交叉交易。

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情况有 10 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

本基金从 2015 年 3 月末开始建仓，建仓期 6 个月。建仓期内，本基金采取了相对稳健的投资策略。然而过去的一年，市场发生了历史罕见的剧烈波动，本基金的净值也不可避免地随之产生大幅波动。

回顾市场，本基金经历了三个阶段，牛市阶段，股灾阶段和反弹阶段。

牛市阶段，15 年 3 月末基金成立到 6 月中旬，经济二季度企稳叠加货币政策持续宽松，为股市进一步上涨提供了稳定有利的环境。高杠杆资金跑步入场，快速推高股市，上证指数上涨 60%，创业板指上涨近 170%，创造了 A 股史上前所未有的杠杆牛市。本基金基于大牛市和成长性行业存在结构性机会的判断，超配智能制造、核能核电、环保产业等契合经济转型升级方向的新兴产业，低配银行、非银行金融等行业。

股灾阶段，6 月中旬到 8 月底，证监会启动去杠杆政策，意外地触发场内场外杠杆连环平仓，导致了史无前例的股灾。后来 8 月份汇率快速贬值，再度引发市场担忧，导致二次股灾。股灾期间，上证指数下跌 42%，创业板指下跌 51%。本基金基于快速下跌趋势难以阻挡的判断，将仓位降低到合约规定最低的 80%。同时进行配置调整，增持银行、传统地产，减持机械、电力及公用事业。

反弹阶段，9 月到年底，经济三季度下行四季度有所回升，货币政策保持宽松，汇率企稳，在 6.3 到 6.5 之间波动，外部环境稳定下来，市场进入反弹阶段。本基金基于市场风险偏好回升的判断，增持机械、环保、基础化工，减持银行、非银金融、电力设备。

从全年整体情况来看，总体超配智能制造、环保产业等新兴行业和房地产产业链，低配银行、

非银行金融。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金净值增长率为-0.80%，业绩比较基准收益率为-1.98%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016 年，我们预计实体经济增长延续弱企稳。供给侧改革背景下，地产去库存、传统产业去产能、新经济增长动能仍待形成，当前经济企稳的基础尚不牢固。通胀方面，大宗商品价格小幅反弹，但全球经济并未明显反弹，未来工业品价格或维持低位，而考虑到食品价格波动，在内需仍较为疲弱的背景下，短期通胀可能小幅反弹，整体向上压力并不大。流动性方面，在实体经济依然疲弱的背景下，人民币贬值预期仍较为强烈，由于外汇占款仍有所下行，未来央行降准的概率有所提高。货币政策仍将持续保持宽松，但考虑到汇率的影响，相对于 2015 年在边际上会有所收紧。总体而言，我们对于 2016 年的 A 股保持谨慎乐观，市场依然存在结构性机会。

2016 年，本基金在风格、配置方面将更加均衡，兼顾新兴行业成长的结构性和低估值蓝筹的投资机会。行业方面同样做均衡配置，主要通过精选个股实现超额收益。主题投资方面，围绕城镇居民的消费升级趋势，重点关注健康产业、环保产业、智慧城市、房地产产业链的投资机会。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人持续加强法律合规风险管理和监察稽核工作，使得法律合规风险被及时识别并得到控制，保障公司各项业务的合法合规。

合规管理方面，一是积极跟踪法律法规的变化和监管动态，及时向业务部门解读、传达最新法规和监管要求及其对公司业务的影响，落实各项要求的责任部门，使得公司从业人员知法、守法；二是严格事前的监督审查和控制机制，保障业务开展的合法合规性。事前合法合规审核全面覆盖公司的新产品设计、基金募集和持续营销、宣传推介、基金等各受托资产的投资交易管理、基金信息披露等业务，并利用系统对相关投资组合的投资合规风险实现事前控制。三是严格的事中指标监控机制，保证投资过程的合规性：公司设置专人专岗监控投资指标，利用系统和人工相结合的方式，实现重点监控环节的刚性控制，系统无法实现控制的环节进行人工审核与复核。四是及时的事后风险管理机制，保证潜在合规风险得到及时解决：通过系统事后监测并提示各投资组合的被动超标情况，跟踪其限期回归到合规范围之内；五是继续开展合规培训，不断增强公司员工合规意识，促进公司合规文化的建设。公司通过对新员工的合规培训、对全体人员的年度合规

培训、对投研人员、销售人员等的专项培训等多种形式，结合新出台的法律法规和行业风险事件，加深员工对法律法规和风险的理解，从而使得相关法规、政策、制度在公司内部更有效的得到落实。

监察稽核方面，一是定期对本基金投资、销售和后台运营等各项业务开展情况、内部规章制度执行情况、合规控制和风险控制情况进行系统全面的检查和评价，并及时督促业务部门改进存在的问题。二是采用有效手段，日常监控投资管理人员的个人行为，以及利用公平交易监控模型分析投资人员的投资行为，防范出现违反“三条底线”的情形。三是在开展定期稽核同时，有针对性的开展专项稽核工作。2015 年度，公司对反洗钱管理、销售管理、投资与研究业务、内部交易及关联交易管理、交易管理业务、“八条底线”防范的专项检查工作，组织开展了工会管理、信息安全管理自查和报告工作，对发现的风险隐患予以提示，使得前述业务进一步规范化。四是全面梳理各项业务的工作流程，对其中的各项风险进行识别、评估，并对现有的控制手段提出改进性建议。同时，结合出台的法律法规和行业的新要求，督促公司及时制定、更新规章制度和完善业务流程，2015 年度，公司完成了 52 项现有制度的更新。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.7.1 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

4.7.1.1 职责分工

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

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

4.7.1.2 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。

4.7.2 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。

4.7.3 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。

4.7.4 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。

4.8 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。

4.9 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2016）审字第 60802052_A46 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告	
审计报告收件人	工银瑞信美丽城镇主题股票型证券投资基金全体基金份额持有人	
引言段	我们审计了后附的工银瑞信美丽城镇主题股票型证券投资基金财务报表，包括 2015 年 12 月 31 日的资产负债表和 2015 年 3 月 26 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。	
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是基金管理人工银瑞信基金管理有限公司的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。	
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>	
审计意见段	我们认为，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了工银瑞信美丽城镇主题股票型证券投资基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年 3 月 26 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。	
注册会计师的姓名	汤骏	贺耀
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 16 层	
审计报告日期	2016 年 3 月 23 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：工银瑞信美丽城镇主题股票型证券投资基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	7.4.7.1	89,623,332.43
结算备付金		6,899,713.09
存出保证金		1,001,918.39
交易性金融资产	7.4.7.2	790,334,241.30
其中：股票投资		790,334,241.30
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	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		14,999,490.00
应收利息	7.4.7.5	22,220.86
应收股利		-
应收申购款		634,537.02
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		903,515,453.09
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		14,686,948.83
应付赎回款		1,428,094.37
应付管理人报酬		1,112,072.48
应付托管费		185,345.41
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	3,236,896.29
应交税费		-

应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	198,792.95
负债合计		20,848,150.33
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	890,013,126.42
未分配利润	7.4.7.10	-7,345,823.66
所有者权益合计		882,667,302.76
负债和所有者权益总计		903,515,453.09

注：1、本期财务报表的实际编制期间系 2015 年 3 月 26 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日止。

2、报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值为人民币 0.992 元，基金份额总额为 890,013,126.42 份。

7.2 利润表

会计主体：工银瑞信美丽城镇主题股票型证券投资基金

本报告期：2015 年 3 月 26 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2015 年 3 月 26 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		191,041,296.44
1. 利息收入		3,870,027.36
其中：存款利息收入	7.4.7.11	3,326,449.63
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		543,577.73
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		137,489,562.10
其中：股票投资收益	7.4.7.12	130,638,558.57
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-
股利收益	7.4.7.16	6,851,003.53
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	38,224,113.18
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-

5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	11,457,593.80
减：二、费用		41,650,717.96
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	15,330,728.88
2. 托管费	7.4.10.2.2	2,555,121.55
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-
4. 交易费用	7.4.7.19	23,451,203.32
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	7.4.7.20	313,664.21
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		149,390,578.48
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		149,390,578.48

注：本期财务报表的实际编制期间系 2015 年 3 月 26 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日止。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：工银瑞信美丽城镇主题股票型证券投资基金

本报告期：2015 年 3 月 26 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 3 月 26 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,380,276,036.62	-	2,380,276,036.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	149,390,578.48	149,390,578.48
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-1,490,262,910.20	-156,736,402.14	-1,646,999,312.34
其中：1. 基金申购款	1,039,503,034.96	75,344,131.96	1,114,847,166.92
2. 基金赎回款	-2,529,765,945.16	-232,080,534.10	-2,761,846,479.26
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）	890,013,126.42	-7,345,823.66	882,667,302.76

注：本期财务报表的实际编制期间系 2015 年 3 月 26 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日

日止。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>郭特华</u>	<u>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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

工银瑞信美丽城镇主题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[2015]96 号文《关于准予工银瑞信美丽城镇主题股票型证券投资基金注册的批复》的注册，由工银瑞信基金管理有限公司于 2015 年 3 月 9 日至 2015 年 3 月 24 日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具（2015）验字第 60802052_A04 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2015 年 3 月 26 日正式生效，设立时募集扣除认购费用后的有效净认购金额为人民币 2,379,973,540.60 元，折合 2,379,973,540.60 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 302,496.02 元，折合 302,496.02 份基金份额；以上收到的实收基金共计人民币 2,380,276,036.62 元，折合 2,380,276,036.62 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构均为工银瑞信基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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（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、债券回购、银行存款、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。本基金的投资组合比例为：股票占基金资产的比例为 80%-95%，其中投资于本基金界定的美丽城镇主题范围内股票不低于非现金资产的 80%。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。如法律法规或中国证监会允许，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：80%× 沪深 300 指数收益率+20%× 中债综合指数收益率。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年 3 月 26 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

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

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2015 年 3 月 26 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产分类

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

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

(2) 金融负债分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

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

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

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

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

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

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

(2) 债券投资

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

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

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3) 权证投资

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

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

(4) 分离交易可转债

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

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(5) 回购协议

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

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

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

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

利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

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

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

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

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

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

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

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50%的年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率逐日计提；

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为四次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 30%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

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

(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 分部报告

无。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

7.4.6.1 印花税

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

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

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

7.4.6.2 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

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

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

7.4.6.3 个人所得税

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税；

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

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号《财政部国家税务总局关于储蓄存款利息所得

有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	89,623,332.43
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	89,623,332.43

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	752,110,128.12	790,334,241.30	38,224,113.18
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	752,110,128.12	790,334,241.30	38,224,113.18

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告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。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日
应收活期存款利息	18,309.70
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	3,415.28
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	495.88
合计	22,220.86

注：“其他”为应收结算保证金利息。

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日
交易所市场应付交易费用	3,236,896.29
银行间市场应付交易费用	-
合计	3,236,896.29

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	4,292.95
预提信息披露费	140,000.00
预提审计费	50,000.00
预提账户维护费	4,500.00
合计	198,792.95

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015年3月26日(基金合同生效日)至2015年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	2,380,276,036.62	2,380,276,036.62
本期申购	1,039,503,034.96	1,039,503,034.96
本期赎回(以“-”号填列)	-2,529,765,945.16	-2,529,765,945.16
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	890,013,126.42	890,013,126.42

注：(1) 申购含转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额；

(2) 本基金合同生效日为 2015 年 3 月 26 日，截至报告期末，本基金基金合同生效不满一年；

(3) 本基金设立时募集扣除认购费用后的有效认购金额为人民币 2,379,973,540.60 元，折合 2,379,973,540.60 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 302,496.02 元，折合 302,496.02 份基金份额；以上收到的实收基金共计人民币 2,380,276,036.62 元，折合 2,380,276,036.62 份基金份额。

7.4.7.10 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	111,166,465.30	38,224,113.18	149,390,578.48
本期基金份额交易产生的变动数	-119,195,665.39	-37,540,736.75	-156,736,402.14
其中：基金申购款	60,399,403.03	14,944,728.93	75,344,131.96
基金赎回款	-179,595,068.42	-52,485,465.68	-232,080,534.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-8,029,200.09	683,376.43	-7,345,823.66

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年3月26日(基金合同生效日)至

	2015 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	1,522,740.26
定期存款利息收入	1,638,000.00
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	153,393.65
其他	12,315.72
合计	3,326,449.63

注：“其他”为结算保证金利息收入。

7.4.7.12 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 3 月 26 日(基金合同生效日) 至 2015 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	7,648,339,718.23
减：卖出股票成本总额	7,517,701,159.66
买卖股票差价收入	130,638,558.57

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金于 2015 年 3 月 26 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日止会计期间无债券投资收益。

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金于 2015 年 3 月 26 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日止会计期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金于 2015 年 3 月 26 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日止会计期间无贵金属投

资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金于 2015 年 3 月 26 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日止会计期间无买卖权证差价收入。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金于 2015 年 3 月 26 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日止会计期间无衍生工具其他投资收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 3 月 26 日(基金合同生效日) 至 2015 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	6,851,003.53
基金投资产生的股利收益	-
合计	6,851,003.53

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015 年 3 月 26 日(基金合同生效日) 至 2015 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	38,224,113.18
——股票投资	38,224,113.18
——债券投资	-
——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	38,224,113.18

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年3月26日(基金合同生效日) 至2015年12月31日
基金赎回费收入	10,909,019.49
基金转换费收入	548,574.31
合计	11,457,593.80

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年3月26日(基金合同生效日) 至2015年12月31日
交易所市场交易费用	23,451,203.32
银行间市场交易费用	-
合计	23,451,203.32

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年3月26日(基金合同生效 日)至2015年12月31日
审计费用	50,000.00
信息披露费	210,000.00
其他	400.00
账户维护费	12,000.00
银行费用	41,264.21
合计	313,664.21

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**7.4.8.1 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。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无须作披露的重大资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
工银瑞信基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司	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
瑞士信贷银行股份有限公司	基金管理人股东
工银瑞信资产管理（国际）有限公司	基金管理人的子公司
工银瑞信投资管理有限公司	基金管理人的子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金于 2015 年 3 月 26 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日止会计期间未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 3 月 26 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	15,330,728.88
其中：支付销售机构的客户维护费	7,851,815.01

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

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 3 月 26 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,555,121.55

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

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

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。

7.4.10.2.3 销售服务费

无。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金于 2015 年 3 月 26 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日止会计期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的管理人于 2015 年 3 月 26 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日止会计期间内未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 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 3 月 26 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	89,623,332.43	1,522,740.26

注：1、本年度期末余额仅为活期存款，利息收入仅为活期存款利息收入。

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

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与上述各关联方及托管人股东承销的证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金的管理人于 2015 年 3 月 26 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日止会计期间内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2015 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券**7.4.12.1 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/增发证券而流通受限的证券。

7.4.12.2 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
002065	东华软件	2015 年 12 月 21 日	重大事项	25.10	-	-	697,800	17,749,468.74	17,514,780.00	-
002340	格林美	2015 年 12 月 29 日	重大事项	15.20	2016 年 1 月 6 日	14.35	946,056	12,161,394.67	14,380,051.20	-
002207	准油股份	2015 年 12 月 16 日	重大事项	21.42	-	-	426,300	8,405,527.90	9,131,346.00	-
300043	互动娱乐	2015 年 12 月 17 日	重大事项	15.80	-	-	259,300	4,522,489.00	4,096,940.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

本基金本报告期末在银行间市场未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末在交易所市场未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.13 金融工具风险及管理**7.4.13.1 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和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。

7.4.13.2 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发行的证券，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。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

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

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

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

7.4.13.3 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。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015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	89,623,332.43	-	-	-	-	-	89,623,332.43

结算备付金	6,899,713.09	-	-	-	-	-	6,899,713.09
存出保证金	1,001,918.39	-	-	-	-	-	1,001,918.39
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-790,334,241.30	790,334,241.30
应收利息	-	-	-	-	-	22,220.86	22,220.86
应收申购款	-	-	-	-	-	634,537.02	634,537.02
应收证券清算款	-	-	-	-	-	14,999,490.00	14,999,490.00
资产总计	97,524,963.91	-	-	-	-	-805,990,489.18	903,515,453.09
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-14,686,948.83	14,686,948.83
应付赎回款	-	-	-	-	-	-1,428,094.37	1,428,094.37
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-1,112,072.48	1,112,072.48
应付托管费	-	-	-	-	-	-185,345.41	185,345.41
应付交易费用	-	-	-	-	-	-3,236,896.29	3,236,896.29
其他负债	-	-	-	-	-	-198,792.95	198,792.95
负债总计	-	-	-	-	-	-20,848,150.33	20,848,150.33
利率敏感度缺口	97,524,963.91	-	-	-	-	-785,142,338.85	882,667,302.76
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							
负债							

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2015 年 12 月 31 日，本基金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。

7.4.13.4.2 外汇风险

无。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	790,334,241.30	89.54
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-
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	790,334,241.30	89.54

注：1、本基金的投资组合比例为：股票占基金资产的比例为 80% - 95%，其中投资于本基金界定的美丽城镇主题范围内股票不低于非现金资产的 80%。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。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；	
	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；	
	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 12 月 31 日）
	业绩比较基准增加 5%	54,079,451.56
	业绩比较基准减少 5%	-54,079,451.56

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**7.4.14.1 公允价值**

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

(1) 各层次金融工具公允价值

本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 745,211,124.10 元，属于第二层次的余额为人民币 45,123,117.20 元，无属于第三层次的余额。

(2) 公允价值所属层次间的重大变动

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

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

7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	790,334,241.30	87.47
	其中：股票	790,334,241.30	87.47
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	96,523,045.52	10.68
7	其他各项资产	16,658,166.27	1.84
8	合计	903,515,453.09	100.00

注：由于四舍五入的原因金额占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	14,064,000.92	1.59
B	采矿业	26,819,634.00	3.04
C	制造业	412,111,024.55	46.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	57,307,900.51	6.49
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	18,222,634.24	2.06
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	31,220,003.80	3.54
J	金融业	88,389,749.40	10.01
K	房地产业	115,873,838.24	13.13
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	11,805,571.80	1.34
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	14,519,883.84	1.65
S	综合	-	-
	合计	790,334,241.30	89.54

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

8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

无。

8.3 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	002444	巨星科技	2,740,734	56,733,193.80	6.43
2	000042	中洲控股	1,703,237	35,614,685.67	4.03

3	300398	飞凯材料	364,720	29,024,417.60	3.29
4	000566	海南海药	723,250	28,105,495.00	3.18
5	600900	长江电力	1,963,300	26,622,348.00	3.02
6	300325	德威新材	1,184,100	24,641,121.00	2.79
7	600077	宋都股份	3,147,300	22,880,871.00	2.59
8	002241	歌尔声学	649,406	22,469,447.60	2.55
9	600340	华夏幸福	714,280	21,942,681.60	2.49
10	002026	山东威达	1,146,692	20,204,713.04	2.29
11	300161	华中数控	510,200	18,734,544.00	2.12
12	000078	海王生物	760,544	18,222,634.24	2.06
13	600098	广州发展	1,408,371	17,787,725.73	2.02
14	000001	平安银行	1,479,345	17,737,346.55	2.01
15	600590	泰豪科技	1,129,887	17,705,329.29	2.01
16	600497	驰宏锌锗	1,602,200	17,688,288.00	2.00
17	600801	华新水泥	2,165,100	17,645,565.00	2.00
18	000563	陕国投 A	1,164,110	17,601,343.20	1.99
19	601166	兴业银行	1,028,483	17,556,204.81	1.99
20	002065	东华软件	697,800	17,514,780.00	1.98
21	600585	海螺水泥	1,004,500	17,176,950.00	1.95
22	600507	方大特钢	2,790,681	17,023,154.10	1.93
23	300003	乐普医疗	435,761	16,820,374.60	1.91
24	300203	聚光科技	478,100	16,394,049.00	1.86
25	000802	北京文化	428,568	14,519,883.84	1.65
26	002340	格林美	946,056	14,380,051.20	1.63
27	600158	中体产业	529,945	13,820,965.60	1.57
28	002500	山西证券	866,381	13,203,646.44	1.50
29	601009	南京银行	712,532	12,611,816.40	1.43
30	600622	嘉宝集团	740,563	12,582,165.37	1.43
31	002573	清新环境	526,095	11,805,571.80	1.34
32	300285	国瓷材料	235,100	10,697,050.00	1.21
33	002474	榕基软件	429,584	10,288,536.80	1.17
34	600116	三峡水利	454,395	9,860,371.50	1.12
35	002690	美亚光电	244,044	9,847,175.40	1.12
36	000733	振华科技	387,938	9,698,450.00	1.10
37	601318	中国平安	268,872	9,679,392.00	1.10
38	002207	准油股份	426,300	9,131,346.00	1.03
39	002458	益生股份	235,162	8,889,123.60	1.01
40	002402	和而泰	305,388	8,669,965.32	0.98
41	002614	蒙发利	446,209	8,651,992.51	0.98

42	300213	佳讯飞鸿	222,100	8,439,800.00	0.96
43	002289	宇顺电子	243,200	8,409,856.00	0.95
44	000878	云南铜业	599,101	8,297,548.85	0.94
45	600225	天津松江	965,700	8,102,223.00	0.92
46	300429	强力新材	53,843	7,484,177.00	0.85
47	300078	思创医惠	101,997	4,977,453.60	0.56
48	002200	云投生态	172,300	4,462,570.00	0.51
49	300043	互动娱乐	259,300	4,096,940.00	0.46
50	000605	渤海股份	92,072	3,037,455.28	0.34
51	002292	奥飞动漫	22,240	1,150,030.40	0.13
52	300245	天玑科技	25,400	1,067,562.00	0.12
53	600756	浪潮软件	19,800	1,018,314.00	0.12
54	600745	中茵股份	22,700	930,246.00	0.11
55	002512	达华智能	41,100	928,860.00	0.11
56	300449	汉邦高科	8,200	877,810.00	0.10
57	300136	信维通信	29,325	866,553.75	0.10
58	000820	金城股份	50,200	805,710.00	0.09
59	300302	同有科技	11,100	804,195.00	0.09
60	300089	文化长城	18,133	716,797.49	0.08
61	300143	星河生物	24,097	712,307.32	0.08
62	300310	宜通世纪	7,200	448,776.00	0.05
63	002108	沧州明珠	24,700	436,449.00	0.05
64	603508	思维列控	1,000	77,840.00	0.01

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600048	保利地产	221,165,128.54	25.06
2	000002	万科A	219,636,968.33	24.88
3	000001	平安银行	145,943,969.85	16.53
4	000042	中洲控股	117,896,477.47	13.36
5	002298	中电鑫龙	116,428,208.61	13.19
6	600590	泰豪科技	111,251,043.57	12.60
7	601318	中国平安	110,124,153.32	12.48
8	601788	光大证券	108,213,641.64	12.26

9	002444	巨星科技	100,299,062.90	11.36
10	002508	老板电器	94,333,248.69	10.69
11	601166	兴业银行	91,430,054.38	10.36
12	601633	长城汽车	90,482,493.92	10.25
13	002101	广东鸿图	84,012,058.26	9.52
14	600310	桂东电力	82,232,255.21	9.32
15	000605	渤海股份	82,033,887.34	9.29
16	603015	弘讯科技	78,085,280.95	8.85
17	600507	方大特钢	69,437,507.27	7.87
18	600340	华夏幸福	65,708,754.08	7.44
19	600446	金证股份	65,679,980.15	7.44
20	300163	先锋新材	63,986,860.31	7.25
21	000566	海南海药	63,843,826.22	7.23
22	600179	黑化股份	61,551,502.45	6.97
23	000009	中国宝安	61,241,135.66	6.94
24	600038	中直股份	59,750,474.84	6.77
25	000923	河北宣工	59,280,877.51	6.72
26	300350	华鹏飞	58,929,617.62	6.68
27	300376	易事特	58,578,424.18	6.64
28	300159	新研股份	58,171,533.95	6.59
29	600067	冠城大通	57,869,360.70	6.56
30	002715	登云股份	57,428,869.84	6.51
31	002153	石基信息	57,251,842.05	6.49
32	601199	江南水务	55,946,083.92	6.34
33	002157	正邦科技	55,899,951.34	6.33
34	000802	北京文化	54,737,037.64	6.20
35	300125	易世达	54,597,531.53	6.19
36	300416	苏试试验	53,907,145.14	6.11
37	601011	宝泰隆	52,483,366.22	5.95
38	600093	禾嘉股份	51,936,423.62	5.88
39	300250	初灵信息	51,867,245.61	5.88
40	002312	三泰控股	51,082,536.91	5.79
41	000826	启迪桑德	50,584,034.85	5.73
42	601899	紫金矿业	50,423,242.95	5.71
43	601857	中国石油	50,402,817.29	5.71
44	300288	朗玛信息	50,329,557.96	5.70

45	002285	世联行	49,980,564.57	5.66
46	300266	兴源环境	49,807,956.73	5.64
47	600466	蓝光发展	49,145,177.42	5.57
48	300070	碧水源	49,107,077.94	5.56
49	600325	华发股份	48,789,785.37	5.53
50	002318	久立特材	48,329,776.86	5.48
51	300273	和佳股份	48,177,579.58	5.46
52	300059	东方财富	47,740,352.49	5.41
53	002651	利君股份	47,721,694.50	5.41
54	000998	隆平高科	47,279,602.95	5.36
55	300329	海伦钢琴	47,277,806.90	5.36
56	002276	万马股份	45,330,332.50	5.14
57	002169	智光电气	45,303,399.87	5.13
58	000157	中联重科	45,004,903.69	5.10
59	002013	中航机电	44,565,505.25	5.05
60	002527	新时达	43,985,836.42	4.98
61	300136	信维通信	43,702,349.94	4.95
62	300137	先河环保	43,650,571.02	4.95
63	600016	民生银行	40,576,662.15	4.60
64	603555	贵人鸟	40,276,426.73	4.56
65	300409	道氏技术	39,092,682.34	4.43
66	002125	湘潭电化	38,839,412.40	4.40
67	601998	中信银行	38,157,467.48	4.32
68	600281	太化股份	38,137,103.99	4.32
69	600015	华夏银行	37,536,743.01	4.25
70	600284	浦东建设	37,128,482.19	4.21
71	300334	津膜科技	36,825,042.37	4.17
72	300404	博济医药	36,289,033.00	4.11
73	600061	国投安信	36,182,176.36	4.10
74	002500	山西证券	35,919,291.43	4.07
75	601699	潞安环能	33,021,479.64	3.74
76	601989	中国重工	32,506,469.00	3.68
77	300228	富瑞特装	32,315,402.94	3.66
78	300078	思创医惠	31,686,323.40	3.59
79	000975	银泰资源	31,647,436.78	3.59
80	300263	隆华节能	30,876,618.67	3.50

81	600585	海螺水泥	30,530,225.49	3.46
82	002690	美亚光电	30,264,882.64	3.43
83	002350	北京科锐	29,747,050.67	3.37
84	600705	中航资本	29,347,973.63	3.32
85	002458	益生股份	29,136,189.39	3.30
86	600681	万鸿集团	28,909,419.66	3.28
87	002367	康力电梯	28,872,290.50	3.27
88	300063	天龙集团	28,758,207.00	3.26
89	601009	南京银行	28,255,724.99	3.20
90	300398	飞凯材料	27,212,014.17	3.08
91	000768	中航飞机	27,153,877.50	3.08
92	000046	泛海控股	27,016,538.59	3.06
93	300038	梅泰诺	26,758,409.00	3.03
94	600077	宋都股份	26,675,907.40	3.02
95	600900	长江电力	26,533,883.88	3.01
96	600098	广州发展	26,273,392.64	2.98
97	000718	苏宁环球	26,097,803.43	2.96
98	002510	天汽模	26,011,116.73	2.95
99	300313	天山生物	25,675,949.00	2.91
100	002241	歌尔声学	25,539,145.90	2.89
101	600366	宁波韵升	25,435,218.70	2.88
102	000063	中兴通讯	25,225,066.08	2.86
103	002383	合众思壮	25,133,475.64	2.85
104	600498	烽火通信	24,977,263.00	2.83
105	000878	云南铜业	24,961,753.77	2.83
106	600158	中体产业	24,939,451.47	2.83
107	300198	纳川股份	24,818,808.24	2.81
108	002657	中科金财	24,806,012.00	2.81
109	000887	中鼎股份	24,616,708.02	2.79
110	300119	瑞普生物	24,535,941.13	2.78
111	300427	红相电力	24,303,453.89	2.75
112	002400	省广股份	24,237,848.10	2.75
113	600138	中青旅	24,199,303.83	2.74
114	600999	招商证券	24,129,148.86	2.73
115	000090	天健集团	24,116,173.92	2.73
116	002314	南山控股	24,112,385.60	2.73

117	002578	闽发铝业	24,100,373.06	2.73
118	002439	启明星辰	24,081,793.22	2.73
119	600323	瀚蓝环境	24,076,092.21	2.73
120	000060	中金岭南	24,065,697.90	2.73
121	600000	浦发银行	24,042,020.90	2.72
122	300359	全通教育	23,992,539.36	2.72
123	000917	电广传媒	23,988,022.00	2.72
124	603588	高能环境	23,892,825.30	2.71
125	600369	西南证券	23,811,797.78	2.70
126	002543	万和电气	23,752,352.55	2.69
127	600749	西藏旅游	23,666,085.41	2.68
128	601021	春秋航空	23,518,472.05	2.66
129	000524	岭南控股	23,227,436.58	2.63
130	600262	北方股份	23,209,181.43	2.63
131	300465	高伟达	23,119,569.90	2.62
132	601777	力帆股份	22,208,812.07	2.52
133	300140	启源装备	22,073,767.21	2.50
134	002664	信质电机	21,700,148.18	2.46
135	601169	北京银行	21,474,866.66	2.43
136	600143	金发科技	21,200,383.98	2.40
137	600684	珠江实业	21,125,009.63	2.39
138	300325	德威新材	21,122,316.10	2.39
139	002056	横店东磁	21,037,095.10	2.38
140	002146	荣盛发展	20,977,348.00	2.38
141	300243	瑞丰高材	20,969,676.29	2.38
142	002385	大北农	20,868,160.98	2.36
143	600231	凌钢股份	20,754,929.64	2.35
144	601007	金陵饭店	20,390,794.70	2.31
145	000961	中南建设	20,313,423.47	2.30
146	600622	嘉宝集团	20,163,530.99	2.28
147	600116	三峡水利	20,063,207.14	2.27
148	300203	聚光科技	19,472,723.93	2.21
149	000666	经纬纺机	19,356,824.60	2.19
150	300104	乐视网	19,048,324.15	2.16
151	300161	华中数控	19,025,795.50	2.16
152	300458	全志科技	18,960,969.50	2.15

153	002614	蒙发利	18,691,492.30	2.12
154	000078	海王生物	18,353,663.39	2.08
155	000733	振华科技	18,136,702.60	2.05
156	300341	麦迪电气	18,010,006.70	2.04
157	300213	佳讯飞鸿	17,947,906.00	2.03
158	600240	华业资本	17,901,112.15	2.03
159	600292	中电远达	17,867,519.20	2.02
160	000697	炼石有色	17,829,529.90	2.02
161	002065	东华软件	17,749,468.74	2.01
162	002433	太安堂	17,722,528.10	2.01
163	300429	强力新材	17,721,473.90	2.01
164	601336	新华保险	17,683,487.08	2.00
165	600497	驰宏锌锗	17,669,892.28	2.00

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

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

8.4.2 累计卖出金额超期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	000002	万科A	228,483,208.04	25.89
2	600048	保利地产	223,336,780.38	25.30
3	000001	平安银行	116,760,581.19	13.23
4	601788	光大证券	109,268,159.32	12.38
5	002508	老板电器	109,021,319.59	12.35
6	600310	桂东电力	105,507,970.01	11.95
7	002298	中电鑫龙	104,250,726.49	11.81
8	000605	渤海股份	102,668,067.64	11.63
9	601318	中国平安	93,372,746.36	10.58
10	601633	长城汽车	89,576,476.60	10.15
11	002276	万马股份	88,221,287.51	9.99
12	000042	中洲控股	85,865,341.24	9.73
13	300125	易世达	79,586,493.55	9.02
14	000923	河北宣工	77,114,141.23	8.74
15	600590	泰豪科技	77,089,815.60	8.73
16	601166	兴业银行	73,386,906.08	8.31
17	601899	紫金矿业	70,385,685.99	7.97

18	600038	中直股份	69,865,230.32	7.92
19	601199	江南水务	66,444,907.60	7.53
20	300266	兴源环境	66,288,689.03	7.51
21	600093	禾嘉股份	64,366,726.71	7.29
22	603015	弘讯科技	63,895,270.31	7.24
23	002101	广东鸿图	63,190,767.03	7.16
24	600446	金证股份	63,106,368.16	7.15
25	600466	蓝光发展	62,523,523.87	7.08
26	002157	正邦科技	60,703,880.56	6.88
27	000009	中国宝安	58,746,990.49	6.66
28	002153	石基信息	58,478,361.31	6.63
29	600067	冠城大通	58,163,475.21	6.59
30	000802	北京文化	57,884,223.31	6.56
31	601011	宝泰隆	57,440,007.58	6.51
32	300376	易事特	57,103,011.23	6.47
33	002444	巨星科技	55,921,341.69	6.34
34	002013	中航机电	55,874,953.19	6.33
35	300288	朗玛信息	55,469,123.63	6.28
36	300416	苏试试验	54,793,106.03	6.21
37	603555	贵人鸟	53,677,679.50	6.08
38	000826	启迪桑德	53,485,586.34	6.06
39	000157	中联重科	53,363,487.54	6.05
40	300159	新研股份	51,877,290.71	5.88
41	300163	先锋新材	51,000,293.22	5.78
42	601857	中国石油	49,780,451.86	5.64
43	300070	碧水源	49,742,644.54	5.64
44	000998	隆平高科	49,709,150.53	5.63
45	300329	海伦钢琴	49,628,600.35	5.62
46	002285	世联行	49,246,560.96	5.58
47	300350	华鹏飞	48,401,801.19	5.48
48	300273	和佳股份	47,433,084.11	5.37
49	600340	华夏幸福	45,857,353.50	5.20
50	300136	信维通信	44,100,106.23	5.00
51	600507	方大特钢	43,972,277.94	4.98
52	600281	太化股份	43,583,588.64	4.94
53	002527	新时达	42,709,876.10	4.84
54	002318	久立特材	42,302,648.59	4.79
55	002715	登云股份	39,923,158.93	4.52

56	600016	民生银行	39,621,164.37	4.49
57	002651	利君股份	39,063,495.99	4.43
58	600325	华发股份	38,962,257.79	4.41
59	000566	海南海药	38,863,862.14	4.40
60	600015	华夏银行	38,194,985.42	4.33
61	601998	中信银行	37,464,787.20	4.24
62	600681	万鸿集团	37,021,054.16	4.19
63	002169	智光电气	36,857,719.74	4.18
64	600061	国投安信	36,380,432.90	4.12
65	300059	东方财富	35,992,402.68	4.08
66	000887	中鼎股份	35,747,140.53	4.05
67	600179	黑化股份	34,932,053.70	3.96
68	600284	浦东建设	34,655,740.02	3.93
69	002125	湘潭电化	34,049,220.37	3.86
70	002578	闽发铝业	33,964,528.31	3.85
71	002312	三泰控股	33,676,502.14	3.82
72	300334	津膜科技	33,648,557.27	3.81
73	601989	中国重工	33,571,078.00	3.80
74	300137	先河环保	33,154,433.59	3.76
75	300250	初灵信息	32,720,559.85	3.71
76	300063	天龙集团	32,618,837.27	3.70
77	002350	北京科锐	32,569,513.70	3.69
78	601699	潞安环能	32,301,982.90	3.66
79	600749	西藏旅游	31,979,676.78	3.62
80	300263	隆华节能	31,432,995.13	3.56
81	000060	中金岭南	30,920,557.64	3.50
82	601021	春秋航空	30,638,170.05	3.47
83	002510	天汽模	30,231,787.94	3.43
84	002367	康力电梯	29,650,118.74	3.36
85	300198	纳川股份	29,107,553.23	3.30
86	600705	中航资本	28,989,002.04	3.28
87	002690	美亚光电	28,659,924.34	3.25
88	600369	西南证券	27,941,807.35	3.17
89	000975	银泰资源	27,701,654.04	3.14
90	000768	中航飞机	27,653,005.96	3.13
91	600498	烽火通信	27,516,569.93	3.12
92	600366	宁波韵升	27,097,692.26	3.07
93	000046	泛海控股	26,515,385.47	3.00

94	000063	中兴通讯	26,505,681.46	3.00
95	000917	电广传媒	26,345,131.00	2.98
96	002543	万和电气	26,218,564.17	2.97
97	300078	思创医惠	26,162,136.40	2.96
98	002314	南山控股	25,977,014.27	2.94
99	600138	中青旅	25,762,252.30	2.92
100	600323	瀚蓝环境	25,575,901.18	2.90
101	601007	金陵饭店	25,497,901.75	2.89
102	000718	苏宁环球	25,356,759.16	2.87
103	002664	信质电机	25,205,161.49	2.86
104	000090	天健集团	25,142,707.56	2.85
105	002657	中科金财	25,084,968.62	2.84
106	300404	博济医药	25,053,968.43	2.84
107	603588	高能环境	24,788,582.50	2.81
108	002400	省广股份	24,488,888.24	2.77
109	601777	力帆股份	24,314,315.86	2.75
110	002383	合众思壮	24,157,735.42	2.74
111	600000	浦发银行	24,032,045.14	2.72
112	300427	红相电力	23,621,926.79	2.68
113	300313	天山生物	23,389,410.02	2.65
114	600262	北方股份	23,335,592.68	2.64
115	300017	网宿科技	23,122,805.76	2.62
116	300359	全通教育	22,665,609.00	2.57
117	300409	道氏技术	22,207,165.89	2.52
118	600231	凌钢股份	22,182,442.88	2.51
119	300458	全志科技	21,820,042.55	2.47
120	002460	赣锋锂业	21,808,658.30	2.47
121	000524	岭南控股	21,649,929.00	2.45
122	300119	瑞普生物	21,571,152.68	2.44
123	600143	金发科技	21,537,289.40	2.44
124	601169	北京银行	21,335,705.00	2.42
125	600999	招商证券	21,109,313.87	2.39
126	300140	启源装备	21,048,042.34	2.38
127	600684	珠江实业	20,906,865.16	2.37
128	000559	万向钱潮	20,863,420.41	2.36
129	300104	乐视网	20,522,717.40	2.33
130	002146	荣盛发展	20,482,279.52	2.32
131	002385	大北农	20,404,241.78	2.31

132	300228	富瑞特装	20,354,334.60	2.31
133	002500	山西证券	20,252,168.52	2.29
134	300038	梅泰诺	19,852,871.34	2.25
135	300465	高伟达	19,319,444.04	2.19
136	002439	启明星辰	19,181,647.05	2.17
137	300243	瑞丰高材	19,090,578.45	2.16
138	000567	海德股份	19,072,852.14	2.16
139	600240	华业资本	19,040,543.63	2.16
140	002701	奥瑞金	18,994,222.13	2.15
141	002279	久其软件	18,971,926.76	2.15
142	002458	益生股份	18,535,474.81	2.10
143	000961	中南建设	18,349,850.75	2.08
144	600701	工大高新	18,334,340.70	2.08
145	000666	经纬纺机	18,207,481.46	2.06
146	000628	高新发展	18,179,288.24	2.06
147	600561	江西长运	17,778,542.62	2.01
148	300341	麦迪电气	17,719,761.56	2.01

注：1、卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票；

2、卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	8,269,811,287.78
卖出股票收入（成交）总额	7,648,339,718.23

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的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。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有股指期货投资，也无期间损益。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期内，本基金未运用股指期货进行投资。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**8.11.1 本期国债期货投资政策**

本报告期内，本基金未运用国债期货进行投资。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货投资，也无期间损益。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本报告期内，本基金未运用国债期货进行投资。

8.12 投资组合报告附注**8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形****8.12.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库****8.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,001,918.39
2	应收证券清算款	14,999,490.00
3	应收股利	-
4	应收利息	22,220.86
5	应收申购款	634,537.02
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	16,658,166.27
---	----	---------------

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
20,161	44,145.29	51,314.33	0.01%	889,961,812.09	99.99%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	665,406.70	0.07%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年3月26日）基金份额总额	2,380,276,036.62
本报告期期初基金份额总额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	1,039,503,034.96
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	2,529,765,945.16
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	890,013,126.42

注：1. 报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额；

2. 报告期期间基金总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人

基金管理人于2015年4月28日在指定媒介上披露了《工银瑞信基金管理有限公司关于副总经理变更的公告》，经基金管理人第四届董事会第四次会议审议并通过，毕万英先生不再担任副总经理职务。

基金管理人于2015年6月2日在指定媒介上披露了《工银瑞信基金管理有限公司关于副总经理变更的公告》，经基金管理人第四届董事会第七次会议审议并通过，库三七先生不再担任副总经理职务。

基金管理人于2015年9月16日在指定媒介上披露了《工银瑞信基金管理有限公司董事长变更公告》，经基金管理人第五十七次股东会 and 第四届董事会第十次会议审议通过，陈焕祥先生辞去公司董事长职务，董事长变更为沈立强先生。

2、基金托管人：

本基金托管人2015年1月4日发布任免通知，聘任张力铮为中国建设银行投资托管业务部副总经理。本基金托管人2015年9月18日发布任免通知，解聘纪伟中国建设银行投资托管业务部副总经理职务。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

无。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内应支付给安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用伍万元整，该审计机构自基金合同生效日起向本基金提供审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
广发证券		11,672,919,541.12	10.51%	1,523,023.84	10.77%	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
中金公司		12,784,203,194.70	17.49%	2,555,438.39	18.07%	-
北京高华		12,394,749,516.92	15.05%	2,119,118.81	14.98%	-
中泰证券		13,196,313,284.62	20.08%	2,862,581.87	20.24%	-
中银国际		11,985,560,884.11	12.48%	1,780,206.71	12.58%	-
民族证券		11,062,789,752.73	6.68%	759,738.80	5.37%	-
国金证券		12,399,422,406.50	15.08%	2,154,032.52	15.23%	-
国泰君安	1	345,645,832.95	2.17%	321,900.39	2.28%	-
财富里昂	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

招商证券	1	74,613,631.45	0.47%	69,486.95	0.49%	-
------	---	---------------	-------	-----------	-------	---

注：1. 券商的选择标准和程序

(1) 选择标准：注重综合服务能力

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

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

c) 与其他券商相比，该券商能够提供最佳交易执行和优惠合理的佣金率。

(2) 选择程序

a) 新增券商的选定：根据以上标准对券商进行考察、选择和确定。在合作之前，券商需提供至少两个季度的服务，并与其他已合作券商一起参与投资研究部门（权益投资部，固定收益部，专户投资部，研究部和中央交易室）两个季度对券商的研究服务评估。公司投委会根据对券商研究服务评估结果决定是否作为新增合作券商。

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，我方协议由研究部和战略发展部存档，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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易	债券回购交易	权证交易
------	------	--------	------

	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
广发证券	-	-	7,610,400,000.00	88.39%	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
北京高华	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	1,000,000,000.00	11.61%	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
财富里昂	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

11.8 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	工银瑞信美丽城镇主题股票型证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会指定的媒介	2015年3月27日
2	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	中国证监会指定的媒介	2015年3月27日
3	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	中国证监会指定的媒介	2015年3月27日
4	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	中国证监会指定的媒介	2015年3月27日

5	工银瑞信美丽城镇主题股票型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告	中国证监会指定的媒介	2015 年 4 月 17 日
6	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	中国证监会指定的媒介	2015 年 4 月 20 日
7	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	中国证监会指定的媒介	2015 年 4 月 24 日
8	工银瑞信基金管理有限公司关于副总经理变更的公告	中国证监会指定的媒介	2015 年 4 月 28 日
9	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	中国证监会指定的媒介	2015 年 5 月 12 日
10	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	中国证监会指定的媒介	2015 年 5 月 28 日
11	工银瑞信基金管理有限公司关于副总经理变更的公告	中国证监会指定的媒介	2015 年 6 月 2 日
12	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	中国证监会指定的媒介	2015 年 6 月 30 日
13	工银瑞信基金管理有限公司关于公司、高管及基金经理投资旗下基金相关事宜的公告	中国证监会指定的媒介	2015 年 7 月 6 日
14	工银瑞信基金管理有限公司关于在“京东金融”平台实行基金申购费率	中国证监会指定的媒介	2015 年 7 月 7 日

	优惠的公告		
15	工银瑞信基金管理有限公司关于参加数米基金网费率优惠活动的公告	中国证监会指定的媒介	2015 年 7 月 8 日
16	工银瑞信基金管理有限公司关于直销电子自助交易系统申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定的媒介	2015 年 7 月 8 日
17	工银瑞信基金管理有限公司关于增加汉口银行股份有限公司为旗下基金销售机构并实行费率优惠的公告	中国证监会指定的媒介	2015 年 7 月 21 日
18	工银瑞信基金管理有限公司关于住所变更的公告	中国证监会指定的媒介	2015 年 7 月 30 日
19	工银瑞信基金管理有限公司关于在北京京东世纪贸易有限公司“京东金融”平台实行基金申购费率优惠的公告	中国证监会指定的媒介	2015 年 8 月 13 日
20	工银瑞信基金管理有限公司关于增加诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司为旗下部分基金销售机构并实行费率优惠的公告	中国证监会指定的媒介	2015 年 8 月 13 日
21	工银瑞信基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中金公司申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定的媒介	2015 年 8 月 19 日
22	工银瑞信基金管理有限公司关于增加上海陆金所资产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	中国证监会指定的媒介	2015 年 9 月 1 日
23	工银瑞信基金管理有限公司董事长变更公告	中国证监会指定的媒介	2015 年 9 月 16 日
24	工银瑞信基金管理有限公司关于增加北京乐融多源投资咨询有限公司为旗	中国证监会指定的媒介	2015 年 9 月 30 日

	下基金销售机构并实行费率优惠的公告		
25	工银瑞信基金管理有限公司关于增加上海联泰资产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	中国证监会指定的媒介	2015年10月22日
26	工银瑞信基金管理有限公司关于增加东莞农村商业银行股份有限公司为旗下基金销售机构并实行费率优惠的公告	中国证监会指定的媒介	2015年10月22日
27	工银瑞信基金管理有限公司关于增加齐商银行股份有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证监会指定的媒介	2015年10月28日
28	工银瑞信基金管理有限公司关于增加北京君德汇富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	中国证监会指定的媒介	2015年10月29日
29	工银瑞信基金管理有限公司关于参加上海长量基金销售投资顾问有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会指定的媒介	2015年11月2日
30	工银瑞信基金管理有限公司关于增加成都农村商业银行股份有限公司为旗下部分基金销售机构并实行费率优惠的公告	中国证监会指定的媒介	2015年11月5日
31	工银瑞信基金管理有限公司关于参加乐融多源费率优惠活动的公告	中国证监会指定的媒介	2015年11月11日
32	工银瑞信基金管理有限公司关于参加嘉实财富费率优惠活动的公告	中国证监会指定的媒介	2015年11月12日
33	工银瑞信基金管理有限公司关于增加上海凯石财富基金销售有限公司为旗	中国证监会指定的媒介	2015年11月17日

	下基金销售机构并实行费率优惠的公告		
34	工银瑞信基金管理有限公司关于增加北京微动利投资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	中国证监会指定的媒介	2015年11月23日
35	关于增加广发银行股份有限公司为工银瑞信基金管理有限公司旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会指定的媒介	2015年11月23日
36	工银瑞信基金管理有限公司关于参加上海利得费率优惠活动的公告	中国证监会指定的媒介	2015年11月27日
37	工银瑞信基金管理有限公司关于增加德州银行股份有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证监会指定的媒介	2015年11月27日
38	工银瑞信基金管理有限公司关于增加威海市商业银行股份有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证监会指定的媒介	2015年12月1日
39	工银瑞信基金管理有限公司关于增加深圳富济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	中国证监会指定的媒介	2015年12月3日
40	工银瑞信基金管理有限公司关于在北京京东世纪贸易有限公司“京东金融”平台实行基金申购费率优惠的公告	中国证监会指定的媒介	2015年12月4日
41	工银瑞信基金管理有限公司关于诺亚正行费率调整的公告	中国证监会指定的媒介	2015年12月17日
42	工银瑞信基金管理有限公司关于增加宁波银行股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会指定的媒介	2015年12月21日
43	工银瑞信基金管理有限公司关于旗下	中国证监会指定的	2015年12月31日

	基金在指数熔断期间调整开放时间的提示性公告	媒介	
--	-----------------------	----	--

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

根据《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》，自 2015 年 3 月 26 日起，本基金管理人对旗下证券投资基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），主要依据由第三方估值机构（中证指数有限公司）提供的价格数据进行估值。详情请见 2015 年 3 月 27 日在中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站发布的《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》。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予工银瑞信美丽城镇主题股票型证券投资基金募集申请的注册文件；
- 2、《工银瑞信美丽城镇主题股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《工银瑞信美丽城镇主题股票型证券投资基金托管协议》；
- 4、《工银瑞信美丽城镇主题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。

13.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的办公场所。

13.3 查阅方式

投资者可于营业时间免费查阅，或登录基金管理人网站查阅。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