

# 工银瑞信基本面量化策略混合型证券投资 基金 2016 年年度报告

2016 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：中国银行股份有限公司

送出日期：二〇一七年三月二十八日

## §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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 24 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 2016 年 01 月 01 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况</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.....	9
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	9
<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.....	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
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>19</b>
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
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>19</b>
6.1 审计报告基本信息.....	19
6.2 审计报告的基本内容.....	20
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>20</b>
7.1 资产负债表.....	20
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
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>50</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	50
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	50
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.....	51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	65
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	71
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.....	71

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.....	71
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.....	71
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.....	71
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	71
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	72
8.12 投资组合报告附注.....	72
<b>§9 基金份额持有人信息.....</b>	<b>73</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	73
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	73
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.....	73
<b>§10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>74</b>
<b>§11 重大事件揭示.....</b>	<b>74</b>
11.1 基金份额持有人大会决议.....	74
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.....	74
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	74
11.4 基金投资策略的改变.....	74
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	75
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.....	75
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	75
11.8 其他重大事件.....	77
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>82</b>
<b>§13 备查文件目录.....</b>	<b>82</b>
13.1 备查文件目录.....	82
13.2 存放地点.....	82
13.3 查阅方式.....	82

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	工银瑞信基本面量化策略混合型证券投资基金
基金简称	工银量化策略混合
基金主代码	481017
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012 年 4 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	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	72,374,693.53 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	合理分散投资，有效控制投资组合风险，追求超越业绩基准的长期投资收益。
投资策略	本基金在基本面分析的基础上，采用数量化投资管理系统，对股票进行多角度、多视野、系统化分析研究，精选股票构建投资组合，在控制风险的前提下实现收益最大化，实现超越市场平均水平的长期投资业绩。主要包括大类资产配置策略、行业配置策略、股票资产投资策略、债券及其他金融工具投资策略。
业绩比较基准	80%×中证 800 指数收益率 + 20%×上证国债指数收益率。
风险收益特征	本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平高于货币型基金和债券型基金，低于股票型基金，属于风险较高的基金。本基金基于数量化投资管理系统进行投资，在混合型基金中属于风险中性的投资产品。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		工银瑞信基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	朱碧艳	王永民
	联系电话	400-811-9999	010-66594896
	电子邮箱	customerservice@icbccs.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-811-9999	95566
传真		010-66583158	010-66594942
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 5 号 701、甲 5 号 8 层甲 5 号	北京市西城区复兴门内大街 1 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	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	100033	100818
法定代表人	郭特华	田国立

## 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住所

## 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	2016 年	2015 年	2014 年
本期已实现收益	-25,716,550.51	91,995,369.99	47,904,528.10
本期利润	-31,370,911.73	82,978,746.33	55,003,099.02
加权平均基金份额本期利润	-0.3128	0.9612	0.2945
本期加权平均净值利润率	-16.80%	50.25%	27.43%
本期基金份额净值增长率	-15.10%	60.30%	35.87%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配利润	66,803,730.08	110,810,758.51	46,964,059.95
期末可供分配基金份额利润	0.9230	1.2654	0.4130
期末基金资产净值	139,178,423.61	198,383,210.31	160,671,130.07
期末基金份额净值	1.923	2.265	1.413
3.1.3 累计期末指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
基金份额累计净值增长率	92.30%	126.50%	41.30%

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

3、所列数据截止到报告期最后一日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

4、本基金基金合同生效日为 2012 年 4 月 26 日。

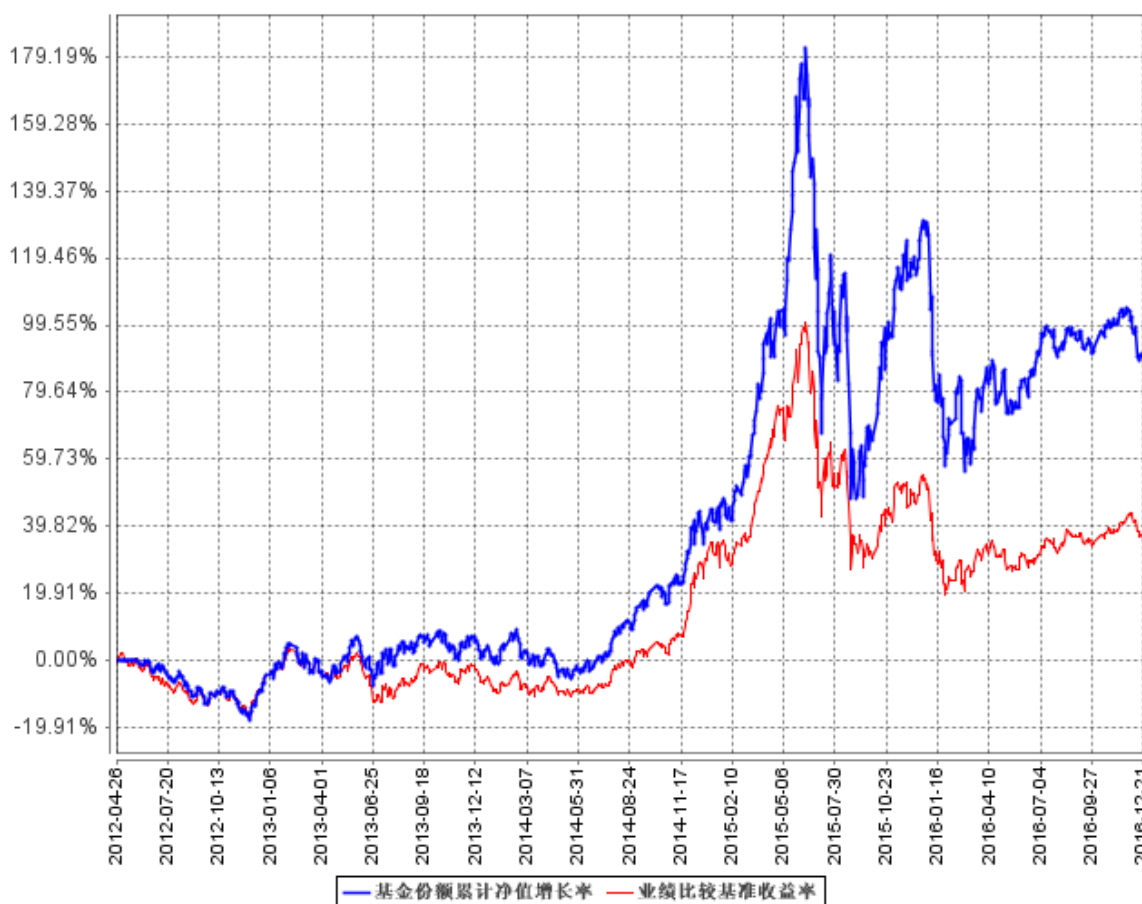
## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-0.26%	0.81%	0.75%	0.57%	-1.01%	0.24%
过去六个月	0.68%	0.79%	3.64%	0.62%	-2.96%	0.17%
过去一年	-15.10%	1.76%	-9.75%	1.22%	-5.35%	0.54%
过去三年	84.90%	2.03%	43.22%	1.45%	41.68%	0.58%
自基金合同生效起至今	92.30%	1.77%	36.22%	1.32%	56.08%	0.45%

### 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



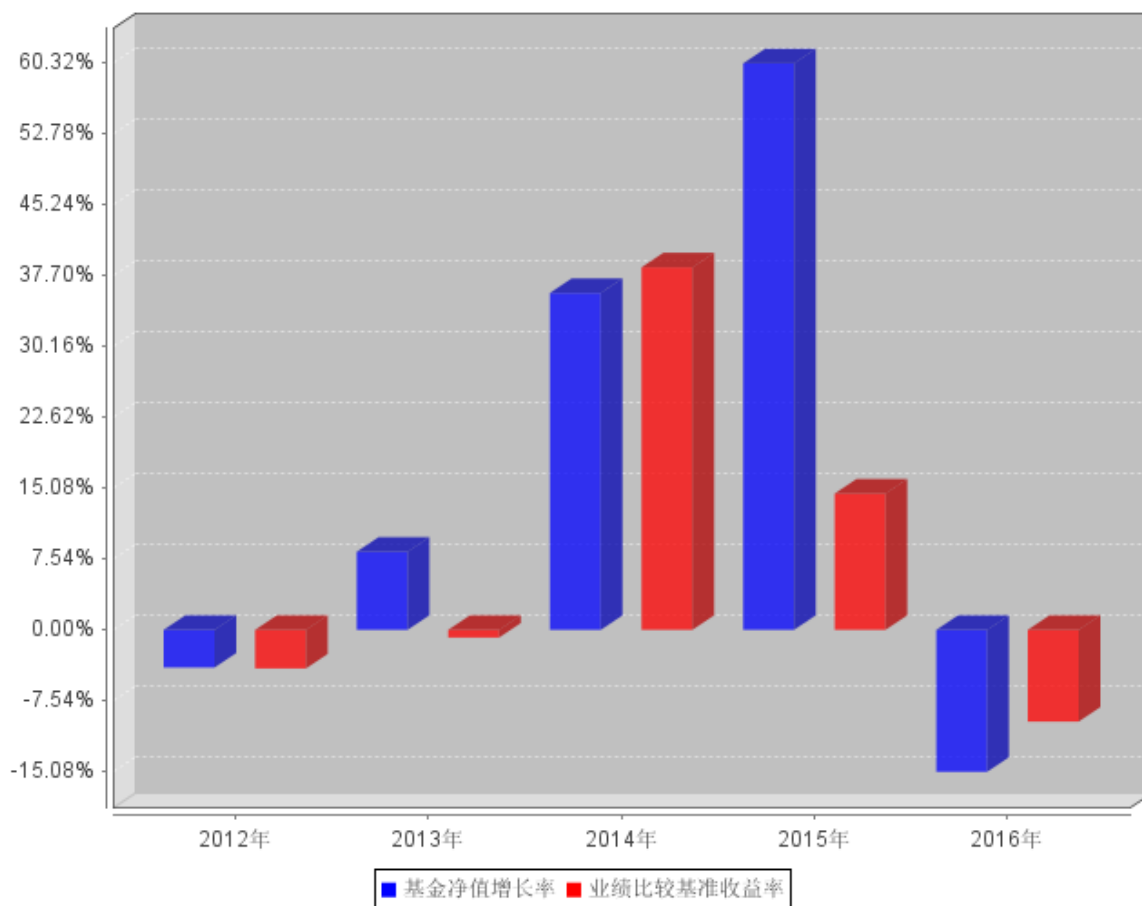
注：1、本基金基金合同于 2012 年 4 月 26 日生效；

2、按基金合同规定，本基金建仓期为 6 个月。截至报告期末，本基金的各项投资比例符合基金合同关于投资范围、投资禁止行为与限制的规定：本基金的股票资产占基金资产的比例为 60%–95%，债券、现金等金融工具占基金资产的比例为 5%–40%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。



### 3.2.3 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 2012 年 4 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

本基金过去三年均未实施利润分配。

## §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 2016 年 12 月 31 日，公司旗下管理 99 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、工银瑞信优质精选混合型证券投资基金、工银瑞信政府债纯债债券型证券投资基金 (LOF)、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、工银瑞信国际原油证券投资基金 (LOF)、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 (LOF)、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、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、工银瑞信物流产业股票型证券投资基金、工银瑞信前沿医疗股票型证券投资基金、工银瑞信国家战略主题股票型证券投资基金、工银瑞信香港中小盘股票型证券投资基金、工银瑞信沪港深股票型证券投资基金、工银瑞信瑞丰纯债半年定期开放债券型证券投资基金、工银瑞信泰享三年理财债券型证券投资基金、工银瑞信安盈货币市场基金、工银瑞信恒享纯债债券型证券投资基金、工银瑞信新焦点灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信现代服务业灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信新得益混合型证券投资基金、工银瑞信新得润混合型证券投资基金、工银瑞信新增利混合型证券投资基金、工银瑞信新生利混合型证券投资基金、工银瑞信新增益混合型证券投资基金、工银瑞信银和利混合型证券投资基金、工银瑞信瑞享纯债债券型证券投资基金、工银瑞信瑞盈 18 个月定期开放债券型证券投资基金、工银瑞信恒丰纯债债券型证券投资基金、工银瑞信恒泰纯债债券型证券投资基金、工银瑞信国债纯债债券型证券投资基金、工银瑞信可转债债券型证券投资基金、工银瑞信丰益一年定期开放债券型证券投资基金、工银瑞信如意货币市场基金，证券投资基金管理规模逾 4600 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		
游凇峰	本基金的基金经理	2012 年 4 月 26 日	-	21	斯坦福大学统计学专业博士；先后在 Merrill Lynch Investment Managers 担任美林集中基金和美林保本基金基金经理，Fore Research & Management 担任 Fore Equity Market Neutral 组合基金经理，Jasper Asset Management 担任 Jasper Gemini Fund 基金基金经理；2009 年加入工银瑞信基金管理有

					限公司，现任基金经理；2009 年 12 月 25 日至今，担任工银瑞信中国机会全球配置股票基金的基金经理；2010 年 5 月 25 日至今，担任工银全球精选股票基金的基金经理；2012 年 4 月 26 日至今担任工银瑞信基本面量化策略混合型证券投资基金基金经理；2014 年 6 月 26 日至今，担任工银瑞信绝对收益混合型基金基金经理；2015 年 12 月 15 日至今，担任工银瑞信新趋势灵活配置混合型基金基金经理；2016 年 3 月 9 日至今，担任工银瑞信香港中小盘股票型基金基金经理；2016 年 10 月 10 日至今，担任工银瑞信新焦点灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：1、任职日期为基金合同生效日或本基金管理人对外披露的任职日期；离职日期为本基金管理人对外披露的离职日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 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，不得直接或通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

## 2、适用范围

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

## 3、公平交易的具体措施

### 3.1 在研究和投资决策环节：

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

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

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

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

### 3.2 在交易执行环节：

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

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

### 3.2.3 公平交易执行方法：

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

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

公平交易模块执行原理如下：

#### 1) 同向交易指令：

a) 限价指令：交易员采用投资交易系统中的公平委托系统，按照各组合委托数量设置委托比例，按比例具体执行；b) 市价指令：对于市价同向交易指令，交易员首先应该按照“时间优

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

## 2) 反向交易指令

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

3.2.4 对于银行间市场交易、交易所大宗交易、债券一级市场申购等非集中竞价交易，涉及到两个或以上基金或投资组合参与同一证券交易的情况，各基金/投资经理在交易前独立确定各投资组合的交易价格和数量，中央交易室按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。参照《集中交易管理办法》，银行间市场债券买卖和回购交易，由交易员填写《银行间市场交易审批单》，经相关基金经理/投资经理、交易主管审批，并由交易员双人复核后方可执行。公司对非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购的申购方案和分配过程进行审核和监控，保证分配结果符合公平交易的原则。交易所大宗交易，填写《大宗交易申请表》，经公司内部审批后执行。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 11 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

回顾 2016 年，A 股市场在经过年初两次熔断及之后的剧烈下跌之后，市场的风险偏好下降。同时为了防范整体经济的金融资产的巨大泡沫膨胀、传统企业的长期健康发展、社会的长期文明稳定发展，经济采取了金融资产去杠杆、传统产业的去产能与去库存。整体市场偏好是低估值的蓝筹股；除了超小盘因为壳价值的巨大吸引力表现仍然靓丽之外，其他小盘及成长股在不同程度上估值受到压制。这导致在 2016 年价值投资成为市场重要主线。以白酒、家电、建筑为代表的蓝筹股吸引了大量来自机构投资者的配置资金，成为 2016 年的亮点。煤炭、钢铁行业由于去库存的正面影响，一整年都较为显著的跑赢了大盘。

2016 年，上证指数下跌 12.31%，中小板指数下跌 22.89%，创业板指数下跌 27.71%。从行业上来看，食品饮料、家电、银行全年涨幅最高，分别上涨 7.56%、1.78%、0.69%；传媒、计算机、



餐饮旅游全年跌幅最大，分别下跌 37.71%、36.12%、37.80%。

本基金在操作上以量化选股为主，根据市场风格在基本面量化策略、技术策略、事件驱动等多种策略中进行动态配置。在年初的下跌中由于配置了较多的成长类型股票，1 月损失较大；之后及时调整了策略配比，以稳健性策略为主，同时利用部分仓位投资事件类机会，在随后的月份中逐步追回了部分负收益，但全年来看依然略微跑输基准。

#### 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-15.10%，业绩比较基准收益率为-9.75%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为，2017 年中国经济将继续平稳运行，基建方面将继续维稳，制造业随着 PPI 的回升，企业盈利有望改善，相应投资也有望扩大。但是中国经济面临最大的挑战是特朗普对传统贸易规则的颠覆对中国及其他贸易大国的经济带来的不确定性以及相关的地缘政治的不稳定性。我们认为，A 股市场在 2017 年可能没有大作为，还有可能伴随的因为地缘政治不稳定性导致的小规模军事摩擦性的黑天鹅事件。从风格角度来看，价值与成长、大盘与小盘间的分化不一定会像今年这么大，但军工及抗风险的贵金属等机会阶段性的会有突出表现。个别基本面健康行业，如计算机与传媒在去年估值大幅压缩之后，相应的个股机会有望好于 2016 年。

经过 2015、2016 年的估值调整，大量成长股的估值已经进入合理区间，在中国新经济对旧经济的替代过程中，新兴行业将迎来利润的高速增长阶段。因此在基金操作上，我们在坚持基本面量化策略、技术策略等稳健量化投资策略的同时，将重点通过事件驱动把握成长的个股机会。

#### 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研交易、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，跟进后续改进情况，向监管机构报送监察稽核季报。同时，按照年度监察稽核计划开展有针对性的专项稽核工作。二是持续完善制度流程和监控模型，采用有效手段，日常监控投资管理人员的个人行为，利用公平交易、异常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。三是关注内部控制的健全性和有效性，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。

#### 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

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

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

## §6 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（2017）审字第 60802052_A17 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	工银瑞信基本面量化策略混合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基本面量化策略混合型证券投资基金财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表，2016 年度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基本面量化策略混合型证券投资基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度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	2017 年 3 月 23 日	

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：工银瑞信基本面量化策略混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	8,835,580.26	2,804,957.59
结算备付金		762,667.54	2,020,443.59
存出保证金		106,821.11	189,701.60
交易性金融资产	7.4.7.2	125,991,948.33	172,183,838.93
其中：股票投资		125,991,948.33	164,470,418.93
基金投资		-	-
债券投资		-	7,713,420.00
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	-	20,000,000.00
应收证券清算款		5,000,769.86	2,004,430.56
应收利息	7.4.7.5	2,555.39	67,464.96
应收股利		-	-
应收申购款		15,162.86	529,826.32
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		140,715,505.35	199,800,663.55
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2015 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		68.18	-
应付赎回款		278,005.92	194,353.95
应付管理人报酬		172,349.62	216,057.41
应付托管费		28,724.94	36,009.59
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	912,996.42	795,892.55
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	144,936.66	175,139.74
负债合计		1,537,081.74	1,417,453.24
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	72,374,693.53	87,572,451.80
未分配利润	7.4.7.10	66,803,730.08	110,810,758.51
所有者权益合计		139,178,423.61	198,383,210.31
负债和所有者权益总计		140,715,505.35	199,800,663.55

注：1、本基金基金合同生效日为 2012 年 4 月 26 日。

2、报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值为人民币 1.923 元，基金份额总额为 72,374,693.53 份。

## 7.2 利润表

会计主体：工银瑞信基本面量化策略混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		-23,172,531.42	91,836,039.43
1. 利息收入		476,597.15	390,415.43
其中：存款利息收入	7.4.7.11	103,859.97	87,037.43
债券利息收入		165,186.19	290,000.46
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		207,550.99	13,377.54
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-18,143,868.10	100,211,490.65
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-19,781,718.90	99,656,204.06
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	6,480.00	-41,199.92
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.3	-	-
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	1,631,370.80	596,486.51
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-5,654,361.22	-9,016,623.66
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	149,100.75	250,757.01

<b>减：二、费用</b>		8,198,380.31	8,857,293.10
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,792,117.53	2,458,574.88
2. 托管费	7.4.10.2.2	465,352.93	409,762.48
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	4,705,788.26	5,719,692.49
5. 利息支出		4,737.74	446.69
其中：卖出回购金融资产支出		4,737.74	446.69
6. 其他费用	7.4.7.20	230,383.85	268,816.56
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-31,370,911.73	82,978,746.33
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-31,370,911.73	82,978,746.33

注：本基金基金合同生效日为 2012 年 4 月 26 日。

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：工银瑞信基本面量化策略混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	87,572,451.80	110,810,758.51	198,383,210.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-31,370,911.73	-31,370,911.73
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）	-15,197,758.27	-12,636,116.70	-27,833,874.97
其中：1. 基金申购款	55,064,366.23	51,779,617.40	106,843,983.63
2. 基金赎回款	-70,262,124.50	-64,415,734.10	-134,677,858.60
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）	72,374,693.53	66,803,730.08	139,178,423.61





业板股票、中小板股票以及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、权证、中央银行票据、中期票据、银行存款、债券回购、资产支持证券,以及法律法规允许或经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具,但需符合中国证监会的相关规定。其中,股票资产占基金资产的比例为 60%-95%,债券、现金等金融工具占基金资产的比例为 5%-40%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为: 80%×中证 800 指数收益率+20%×上证国债指数收益率。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下统称“企业会计准则”)编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会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 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和净值变动情况。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

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

#### 7.4.4.1 会计年度

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

#### 7.4.4.2 记账本位币

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

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

#### (1) 金融资产分类

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

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

#### (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) 基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式，基金份额持有人可自行选择收益分配方式；基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金红利；选择红利再投资的，现金红利则按除权日经除权后的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；如投资者在不同销售机构选择的分红方式不同，注册登记机构将以投资者最后一次选择的分红方式为准；

(2) 每一基金份额享有同等分配权；

(3) 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，基金收益分配基准日即期末可供分配利润计算截止日；

(4) 在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至多四次；每次基金收益分配比例不得低于期末可供分配利润的 30%。基金的收益分配比例以期末可供分配利润为基准计算，期末可供分配利润以期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数为准。基金合同生效不满三个月，可不进行收益分配；

(5) 基金红利发放日距离收益分配基准日的时间不超过 15 个工作日；

(6) 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、增值税

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；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。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、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通

知》的规定，2017 年 7 月 1 日（含）以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

#### 7.4.6.3 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。

#### 7.4.6.4 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 号文《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；

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。



## 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 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
活期存款	8,835,580.26	2,804,957.59
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	8,835,580.26	2,804,957.59

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	126,005,348.87	125,991,948.33	-13,400.54	
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	126,005,348.87	125,991,948.33	-13,400.54	
项目	上年度末 2015年12月31日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	158,830,238.25	164,470,418.93	5,640,180.68	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	7,712,640.00	7,713,420.00	780.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	7,712,640.00	7,713,420.00	780.00
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	166,542,878.25	172,183,838.93	5,640,960.68	

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均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

单位：人民币元

项目	上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_交易所	20,000,000.00	-
合计	20,000,000.00	-

注：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

本基金本报告期末及上年度末均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 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	2,125.16	3,692.44
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	377.43	1,000.12
应收债券利息	-	62,678.57
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	52.80	93.83
合计	2,555.39	67,464.96

注：“其他”为应收结算保证金利息。

### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	912,821.42	795,892.55
银行间市场应付交易费用	175.00	-
合计	912,996.42	795,892.55

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	436.66	639.74
预提信息披露费	100,000.00	120,000.00
预提审计费	40,000.00	50,000.00
预提账户维护费	4,500.00	4,500.00
合计	144,936.66	175,139.74

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	87,572,451.80	87,572,451.80
本期申购	55,064,366.23	55,064,366.23
本期赎回（以“-”号填列）	-70,262,124.50	-70,262,124.50
本期末	72,374,693.53	72,374,693.53

注：申购含红利再投、转换入份额及金额；赎回含转换出份额及金额。

#### 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
上年度末	124,465,309.91	-13,654,551.40	110,810,758.51
本期利润	-25,716,550.51	-5,654,361.22	-31,370,911.73
本期基金份额交易产生的变动数	-12,536,502.43	-99,614.27	-12,636,116.70
其中：基金申购款	68,244,569.88	-16,464,952.48	51,779,617.40
基金赎回款	-80,781,072.31	16,365,338.21	-64,415,734.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	86,212,256.97	-19,408,526.89	66,803,730.08

**7.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
活期存款利息收入	69,681.24	57,380.01
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	31,200.84	27,199.16
其他	2,977.89	2,458.26
合计	103,859.97	87,037.43

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 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
卖出股票成交总额	1,574,553,884.73	1,999,336,801.42
减：卖出股票成本总额	1,594,335,603.63	1,899,680,597.36
买卖股票差价收入	-19,781,718.90	99,656,204.06

**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**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31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	6,480.00	-41,199.92
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	6,480.00	-41,199.92

**7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑	17,946,894.10	27,246,448.88

付)成交总额		
减:卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额	17,708,910.00	26,580,984.82
减:应收利息总额	231,504.10	706,663.98
买卖债券差价收入	6,480.00	-41,199.92

#### 7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

#### 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

本基金本报告期及上年度可比期间均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

本基金本报告期及上年度可比期间均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 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月 31日
股票投资产生的股利收益	1,631,370.80	596,486.51
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	1,631,370.80	596,486.51

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位:人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至 2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年 12月31日
1.交易性金融资产	-5,654,361.22	-9,016,623.66
——股票投资	-5,653,581.22	-9,001,159.28
——债券投资	-780.00	-15,464.38
——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	-5,654,361.22	-9,016,623.66

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月 31日
基金赎回费收入	125,425.04	165,559.17
基金转换费收入	23,675.71	85,197.84
合计	149,100.75	250,757.01

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12 月31日
交易所市场交易费用	4,705,438.26	5,719,342.49
银行间市场交易费用	350.00	350.00
合计	4,705,788.26	5,719,692.49

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12 月31日
审计费用	40,000.00	50,000.00
信息披露费	150,000.00	180,000.00
账户维护费	18,000.00	18,000.00
银行费用	22,383.85	20,616.56
其他	-	200.00
合计	230,383.85	268,816.56

注：“其他”为上交所证书费。

## 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，除 7.4.6.2 营业税、增值税中披露的事项外，本基金无其他需要披露的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
中国银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金管理人股东、基金销售机构
瑞士信贷银行股份有限公司	基金管理人股东
工银瑞信资产管理（国际）有限公司	基金管理人的子公司
工银瑞信投资管理有限公司	基金管理人的子公司

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

本基金本报告期与上年度可比期间均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	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,792,117.53	2,458,574.88
其中：支付销售机构的客户维护费	742,743.75	900,968.60

注：1、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

2、基金管理费每日计提，按月支付。

**7.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	465,352.93	409,762.48

注：1、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

2、基金托管费每日计提，按月支付。

**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**

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

**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自有资金投资本基金的情况**

本基金的管理人在本报告期内与上年度可比期间均未运用自有资金投资本基金。

**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和上年度末未持有本基金。

**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		上年度可比期间	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	8,835,580.26	69,681.24	2,804,957.59	57,380.01

注：1、本报告期末余额仅为活期存款，利息收入（本期）仅为活期存款利息收入；

2、上年度可比期间报告期末余额仅为活期存款，利息收入（上年度可比期间）仅为活期存款利息收入；

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



**7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

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

**7.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

无。

**7.4.11 利润分配情况**

本基金本报告期末进行利润分配。

**7.4.12 期末（2016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**

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601375	中原证券	2016年12月20日	2017年1月3日	新股流通受限	4.00	4.00	17,761	71,044.00	71,044.00	-
300583	赛托生物	2016年12月29日	2017年1月6日	新股流通受限	40.29	40.29	1,582	63,738.78	63,738.78	-
603877	太平鸟	2016年12月29日	2017年1月9日	新股流通受限	21.30	21.30	1,876	39,958.80	39,958.80	-
603689	皖天然气	2016年12月30日	2017年1月10日	新股流通受限	7.87	7.87	4,818	37,917.66	37,917.66	-
603266	天龙股份	2016年12月30日	2017年1月10日	新股流通受限	14.63	14.63	1,344	19,662.72	19,662.72	-
300587	天铁股份	2016年12月28日	2017年1月5日	新股流通受限	14.11	14.11	1,280	18,060.80	18,060.80	-
603035	常熟汽饰	2016年12月27日	2017年1月5日	新股流通受限	10.44	10.44	1,334	13,926.96	13,926.96	-
603228	景旺电子	2016年12月28日	2017年1月6日	新股流通受限	23.16	23.16	561	12,992.76	12,992.76	-

002840	华统股份	2016年12月29日	2017年1月10日	新股流通受限	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	-
002838	道恩股份	2016年12月28日	2017年1月6日	新股流通受限	15.28	15.28	682	10,420.96	10,420.96	-
603186	华正新材	2016年12月26日	2017年1月3日	新股流通受限	5.37	5.37	1,874	10,063.38	10,063.38	-
603032	德新交运	2016年12月27日	2017年1月5日	新股流通受限	5.81	5.81	1,628	9,458.68	9,458.68	-
300586	美联新材	2016年12月26日	2017年1月4日	新股流通受限	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-
300591	万里马	2016年12月30日	2017年1月10日	新股流通受限	3.07	3.07	2,397	7,358.79	7,358.79	-
300588	熙菱信息	2016年12月27日	2017年1月5日	新股流通受限	4.94	4.94	1,380	6,817.20	6,817.20	-

#### 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
002635	安洁科技	2016年11月8日	重大事项	36.40	2017年2月8日	33.50	80,179	2,814,199.69	2,918,515.60	-
002071	长城影视	2016年6月15日	重大事项	13.64	2017年1月3日	15.00	182,280	2,735,699.45	2,486,299.20	-
002567	唐人神	2016年12月22日	重大事项	12.64	2017年1月3日	12.75	196,215	2,517,795.99	2,480,157.60	-
600711	盛屯矿业	2016年12月19日	重大事项	7.02	2017年1月11日	7.38	133,355	1,078,018.42	936,152.10	-

600421	仰帆控股	2016年12月19日	重大事项	25.48	2017年1月9日	22.93	21,638	490,481.44	551,336.24	-
600768	宁波富邦	2016年3月31日	重大事项	24.42	2017年3月14日	24.00	21,848	420,906.57	533,528.16	-
002159	三特索道	2016年12月29日	重大事项	32.00	2017年1月6日	31.60	12,500	375,457.00	400,000.00	-
601727	上海电气	2016年8月31日	重大事项	8.42	-	-	39,628	308,756.87	333,667.76	-
000563	陕国投A	2016年10月14日	重大事项	7.48	2017年1月18日	6.73	25,815	150,591.90	193,096.20	-
600979	广安爱众	2016年11月14日	重大事项	7.92	-	-	14,500	109,040.00	114,840.00	-
300496	中科创达	2016年10月11日	重大事项	52.28	2017年1月6日	47.49	1,839	92,155.47	96,142.92	-
601700	风范股份	2016年11月25日	重大事项	8.47	-	-	11,254	82,542.12	95,321.38	-
000050	深天马A	2016年9月12日	重大事项	18.82	2017年3月23日	20.70	974	19,451.18	18,330.68	-
600763	通策医疗	2016年12月19日	重大事项	33.54	2017年1月3日	34.80	488	15,577.19	16,367.52	-
000912	泸天化	2016年12月12日	重大事项	13.22	-	-	885	5,420.67	11,699.70	-
300212	易华录	2016年11月30日	重大事项	34.00	-	-	343	11,236.68	11,662.00	-
300450	先导智能	2016年11月15日	重大事项	33.99	2017年2月8日	33.00	288	7,862.61	9,789.12	-

002400	省广股份	2016年11月28日	重大事项	13.79	-	-	439	6,674.99	6,053.81	-
002440	闰土股份	2016年10月24日	重大事项	16.34	2017年1月12日	15.22	365	5,786.47	5,964.10	-
600239	云南城投	2016年12月30日	重大事项	5.66	2017年1月3日	5.70	958	5,230.68	5,422.28	-
002462	嘉事堂	2016年9月28日	重大事项	42.53	2017年1月12日	38.98	126	4,851.63	5,358.78	-
300150	世纪瑞尔	2016年11月8日	重大事项	9.97	2017年3月21日	10.97	533	5,434.09	5,314.01	-
600537	亿晶光电	2016年12月27日	重大事项	7.43	2017年1月13日	8.17	690	5,968.50	5,126.70	-

### 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

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 7.4.12.3.2 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。

### 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，将风险控制在此可承受的范围内。

#### **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 2016 年 12 月 31 日和 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 2016 年 12 月 31 日和 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约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	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
-----	--------	--------	-------	-------	-------	-----	----

2016年12月31日			1年				
资产							
银行存款	8,835,580.26	-	-	-	-	-	8,835,580.26
结算备付金	762,667.54	-	-	-	-	-	762,667.54
存出保证金	106,821.11	-	-	-	-	-	106,821.11
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-125,991,948.33	125,991,948.33
应收证券清算款	-	-	-	-	-	5,000,769.86	5,000,769.86
应收利息	-	-	-	-	-	2,555.39	2,555.39
应收申购款	-	-	-	-	-	15,162.86	15,162.86
资产总计	9,705,068.91	-	-	-	-	-131,010,436.44	140,715,505.35
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	68.18	68.18
应付赎回款	-	-	-	-	-	278,005.92	278,005.92
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	172,349.62	172,349.62
应付托管费	-	-	-	-	-	28,724.94	28,724.94
应付交易费用	-	-	-	-	-	912,996.42	912,996.42
其他负债	-	-	-	-	-	144,936.66	144,936.66
负债总计	-	-	-	-	-	1,537,081.74	1,537,081.74
利率敏感度缺口	9,705,068.91	-	-	-	-	-129,473,354.70	139,178,423.61
上年度末 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	2,804,957.59	-	-	-	-	-	2,804,957.59
结算备付金	2,020,443.59	-	-	-	-	-	2,020,443.59
存出保证金	189,701.60	-	-	-	-	-	189,701.60
交易性金融资产	-	-7,713,420.00	-	-	-	-164,470,418.93	172,183,838.93
买入返售金融资产	20,000,000.00	-	-	-	-	-	20,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	2,004,430.56	2,004,430.56
应收利息	-	-	-	-	-	67,464.96	67,464.96
应收申购款	-	-	-	-	-	529,826.32	529,826.32
资产总计	25,015,102.78	7,713,420.00	-	-	-	-167,072,140.77	199,800,663.55
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	194,353.95	194,353.95
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	216,057.41	216,057.41
应付托管费	-	-	-	-	-	36,009.59	36,009.59
应付交易费用	-	-	-	-	-	795,892.55	795,892.55
其他负债	-	-	-	-	-	175,139.74	175,139.74
负债总计	-	-	-	-	-	1,417,453.24	1,417,453.24
利率敏感度缺口	25,015,102.78	7,713,420.00	-	-	-	-165,654,687.53	198,383,210.31

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

假设	该利率敏感性分析基于本基金报表日的利率风险状况；	
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他变量不变；	
	此项影响并未考虑管理层为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。	
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） 上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	利率增加 25 基准点	-2,804.21
	利率减少 25 基准点	2,806.24

注：于 2016 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 2016 年 12 月 31 日		上年度末 2015 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	125,991,948.33	90.53	164,470,418.93	82.91
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	7,713,420.00	3.89
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	125,991,948.33	90.53	172,183,838.93	86.79

注：1、基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 60%-95%，债券、现金等金融工具占基金资产的比例为 5%-40%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

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（2016 年 12 月 31 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准增加 5%	9,405,069.67	12,689,027.81
	业绩比较基准减少 5%	-9,405,069.67	-12,689,027.81

#### 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、应收利息、应收申购款、应付赎回款等，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 114,409,143.48 元，属于第二层次的余额为人民币 11,582,804.85 元，无属于第三层次的余额（2015 年 12 月 31 日：第一层次人民币 151,725,727.83 元，第二层次人民币 20,458,111.10 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，由第一层次转入第二层次的金额为人民币 6,924,113.81 元

(2015 年度：人民币 612,834.08 元)，由第二层次转入第一层次的金额为人民币 10,118,926.59 元 (2015 年度：人民币 3,484,853.90)。

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 (2015 年度：无)。

#### 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	125,991,948.33	89.54
	其中：股票	125,991,948.33	89.54
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	9,598,247.80	6.82
7	其他各项资产	5,125,309.22	3.64
8	合计	140,715,505.35	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	1,771,490.47	1.27
B	采矿业	4,808,582.12	3.45

C	制造业	66,466,776.76	47.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,342,506.69	1.68
E	建筑业	3,082,706.72	2.21
F	批发和零售业	4,300,269.24	3.09
G	交通运输、仓储和邮政业	2,913,452.35	2.09
H	住宿和餐饮业	428,103.86	0.31
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,612,008.54	9.06
J	金融业	17,491,735.40	12.57
K	房地产业	2,208,843.84	1.59
L	租赁和商务服务业	427,925.02	0.31
M	科学研究和技术服务业	10,106.80	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	1,484,616.72	1.07
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	411,521.43	0.30
Q	卫生和社会工作	21,749.52	0.02
R	文化、体育和娱乐业	3,976,952.02	2.86
S	综合	1,232,600.83	0.89
	合计	125,991,948.33	90.53

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	000538	云南白药	78,015	5,940,842.25	4.27
2	300458	全志科技	36,882	3,372,121.26	2.42
3	002456	欧菲光	96,593	3,311,208.04	2.38
4	300302	同有科技	135,461	3,015,361.86	2.17
5	002635	安洁科技	80,179	2,918,515.60	2.10
6	600155	宝硕股份	187,173	2,801,979.81	2.01
7	600056	中国医药	137,217	2,611,239.51	1.88

8	000975	银泰资源	165,856	2,593,987.84	1.86
9	002071	长城影视	182,280	2,486,299.20	1.79
10	002567	唐人神	196,215	2,480,157.60	1.78
11	002439	启明星辰	104,390	2,170,268.10	1.56
12	002268	卫士通	68,812	2,162,073.04	1.55
13	600643	爱建集团	156,740	1,945,143.40	1.40
14	002368	太极股份	60,043	1,837,916.23	1.32
15	601058	赛轮金宇	447,428	1,821,031.96	1.31
16	300474	景嘉微	32,186	1,733,859.82	1.25
17	300398	飞凯材料	27,813	1,619,829.12	1.16
18	000651	格力电器	58,695	1,445,070.90	1.04
19	601668	中国建筑	159,745	1,415,340.70	1.02
20	600030	中信证券	88,015	1,413,520.90	1.02
21	601169	北京银行	141,847	1,384,426.72	0.99
22	300101	振芯科技	71,355	1,322,921.70	0.95
23	002142	宁波银行	78,518	1,306,539.52	0.94
24	601009	南京银行	120,078	1,301,645.52	0.94
25	300033	同花顺	18,885	1,298,910.30	0.93
26	300327	中颖电子	38,400	1,282,560.00	0.92
27	300059	东方财富	72,923	1,234,586.39	0.89
28	002343	慈文传媒	23,838	1,076,762.46	0.77
29	601555	东吴证券	75,758	1,005,308.66	0.72
30	300136	信维通信	35,000	997,500.00	0.72
31	600369	西南证券	138,697	988,909.61	0.71
32	601788	光大证券	61,591	984,840.09	0.71
33	000970	中科三环	73,638	983,067.30	0.71
34	002057	中钢天源	57,020	967,629.40	0.70
35	600711	盛屯矿业	133,355	936,152.10	0.67
36	002205	国统股份	30,504	929,761.92	0.67
37	600213	亚星客车	56,927	886,922.66	0.64
38	300285	国瓷材料	22,598	883,807.78	0.64
39	600385	山东金泰	36,805	876,327.05	0.63
40	600561	江西长运	62,892	872,940.96	0.63
41	600448	华纺股份	111,550	872,321.00	0.63
42	002627	宜昌交运	34,800	860,952.00	0.62
43	600778	友好集团	75,978	855,512.28	0.61
44	000713	丰乐种业	71,699	835,293.35	0.60
45	600791	京能置业	101,710	834,022.00	0.60
46	000004	国农科技	18,504	830,829.60	0.60

47	600219	南山铝业	256,201	791,661.09	0.57
48	601288	农业银行	240,361	745,119.10	0.54
49	600436	片仔癀	14,196	650,034.84	0.47
50	600099	林海股份	32,785	620,620.05	0.45
51	601166	兴业银行	36,868	595,049.52	0.43
52	601669	中国电建	81,485	591,581.10	0.43
53	600421	仰帆控股	21,638	551,336.24	0.40
54	600768	宁波富邦	21,848	533,528.16	0.38
55	601318	中国平安	14,889	527,517.27	0.38
56	600853	龙建股份	70,271	486,978.03	0.35
57	000737	南风化工	65,389	486,494.16	0.35
58	002580	圣阳股份	26,931	482,334.21	0.35
59	300344	太空板业	29,659	472,764.46	0.34
60	600249	两面针	50,621	463,182.15	0.33
61	600302	标准股份	42,789	462,976.98	0.33
62	600802	福建水泥	44,038	458,875.96	0.33
63	300029	天龙光电	30,139	457,510.02	0.33
64	600781	辅仁药业	24,235	456,829.75	0.33
65	000785	武汉中商	31,986	456,120.36	0.33
66	000692	惠天热电	70,731	454,800.33	0.33
67	600731	湖南海利	42,950	453,552.00	0.33
68	000985	大庆华科	14,676	450,553.20	0.32
69	002105	信隆健康	31,200	449,904.00	0.32
70	000929	兰州黄河	23,222	448,184.60	0.32
71	600593	大连圣亚	11,267	447,074.56	0.32
72	600605	汇通能源	18,850	445,425.50	0.32
73	600603	*ST 兴业	29,221	441,237.10	0.32
74	600738	兰州民百	46,166	439,961.98	0.32
75	600985	雷鸣科化	29,428	438,771.48	0.32
76	600444	国机通用	19,454	437,520.46	0.31
77	002715	登云股份	12,166	432,987.94	0.31
78	600898	三联商社	25,044	429,254.16	0.31
79	600774	汉商集团	18,900	426,195.00	0.31
80	000159	国际实业	50,052	425,442.00	0.31
81	600573	惠泉啤酒	27,300	424,515.00	0.31
82	000619	海螺型材	34,900	421,592.00	0.30
83	000153	丰原药业	32,600	420,214.00	0.30
84	600192	长城电工	45,000	419,850.00	0.30
85	000779	三毛派神	21,700	417,942.00	0.30

86	002420	毅昌股份	41,400	417,726.00	0.30
87	601007	金陵饭店	29,600	417,064.00	0.30
88	002200	云投生态	17,800	416,876.00	0.30
89	600540	新赛股份	52,300	413,693.00	0.30
90	600128	弘业股份	27,100	412,191.00	0.30
91	600080	金花股份	32,400	406,944.00	0.29
92	002066	瑞泰科技	21,432	406,350.72	0.29
93	002136	安纳达	23,446	406,084.72	0.29
94	600232	金鹰股份	31,800	405,132.00	0.29
95	600117	西宁特钢	71,800	402,798.00	0.29
96	002134	天津普林	25,000	400,250.00	0.29
97	002159	三特索道	12,500	400,000.00	0.29
98	002144	宏达高科	17,600	398,112.00	0.29
99	600455	博通股份	6,761	397,749.63	0.29
100	600283	钱江水利	32,000	395,200.00	0.28
101	000526	紫光学大	10,100	393,799.00	0.28
102	000609	绵石投资	24,678	393,614.10	0.28
103	000809	铁岭新城	66,100	389,990.00	0.28
104	600883	博闻科技	23,900	384,312.00	0.28
105	600992	贵绳股份	22,402	380,385.96	0.27
106	002072	凯瑞德	12,951	375,579.00	0.27
107	600536	中国软件	15,599	375,311.94	0.27
108	600215	长春经开	29,231	360,710.54	0.26
109	600015	华夏银行	32,180	349,153.00	0.25
110	600021	上海电力	28,703	348,454.42	0.25
111	601939	建设银行	63,545	345,684.80	0.25
112	601727	上海电气	39,628	333,667.76	0.24
113	600000	浦发银行	19,908	322,708.68	0.23
114	600727	鲁北化工	29,866	317,475.58	0.23
115	300545	联得装备	3,500	300,300.00	0.22
116	600519	贵州茅台	888	296,725.20	0.21
117	002682	龙洲股份	16,900	236,262.00	0.17
118	300127	银河磁体	13,080	226,284.00	0.16
119	600019	宝钢股份	33,638	213,601.30	0.15
120	000423	东阿阿胶	3,825	206,052.75	0.15
121	000568	泸州老窖	6,142	202,686.00	0.15
122	601601	中国太保	7,186	199,555.22	0.14
123	000563	陕国投 A	25,815	193,096.20	0.14
124	000959	首钢股份	28,646	189,636.52	0.14

125	002341	新纶科技	8,384	176,818.56	0.13
126	601088	中国神华	10,877	175,989.86	0.13
127	600383	金地集团	13,370	173,275.20	0.12
128	600109	国金证券	12,862	167,591.86	0.12
129	600585	海螺水泥	9,095	154,251.20	0.11
130	600005	武钢股份	44,850	152,938.50	0.11
131	600028	中国石化	28,160	152,345.60	0.11
132	600048	保利地产	16,605	151,603.65	0.11
133	000635	英力特	4,862	149,360.64	0.11
134	601628	中国人寿	6,125	147,551.25	0.11
135	002214	大立科技	13,339	147,395.95	0.11
136	601857	中国石油	18,381	146,128.95	0.10
137	601117	中国化学	19,277	130,505.29	0.09
138	000400	许继电气	7,099	128,846.85	0.09
139	601998	中信银行	19,788	126,841.08	0.09
140	600011	华能国际	17,817	125,609.85	0.09
141	601899	紫金矿业	37,552	125,423.68	0.09
142	600018	上港集团	24,259	124,206.08	0.09
143	601186	中国铁建	10,247	122,554.12	0.09
144	300071	华谊嘉信	12,240	120,686.40	0.09
145	601020	华钰矿业	3,078	120,596.04	0.09
146	600060	海信电器	6,922	118,504.64	0.09
147	600527	江南高纤	16,566	117,287.28	0.08
148	600979	广安爱众	14,500	114,840.00	0.08
149	603027	千禾味业	2,541	114,268.77	0.08
150	601333	广深铁路	22,509	114,120.63	0.08
151	000895	双汇发展	5,452	114,110.36	0.08
152	600415	小商品城	12,915	111,714.75	0.08
153	300429	强力新材	3,397	108,704.00	0.08
154	600600	青岛啤酒	3,655	107,603.20	0.08
155	600332	白云山	4,471	107,214.58	0.08
156	600741	华域汽车	6,688	106,673.60	0.08
157	600803	新奥股份	7,466	106,465.16	0.08
158	601898	中煤能源	18,068	104,975.08	0.08
159	601600	中国铝业	24,786	104,596.92	0.08
160	601098	中南传媒	6,253	104,174.98	0.07
161	600795	国电电力	32,841	104,105.97	0.07
162	601808	中海油服	8,083	103,704.89	0.07
163	600089	特变电工	11,217	102,411.21	0.07

164	000876	新希望	12,680	102,074.00	0.07
165	600816	安信信托	4,317	101,967.54	0.07
166	000712	锦龙股份	4,340	101,729.60	0.07
167	002028	思源电气	7,657	100,919.26	0.07
168	600066	宇通客车	5,135	100,594.65	0.07
169	600900	长江电力	7,878	99,735.48	0.07
170	002331	皖通科技	5,559	98,950.20	0.07
171	000999	华润三九	3,953	97,757.69	0.07
172	600115	东方航空	13,810	97,636.70	0.07
173	600062	华润双鹤	4,382	97,411.86	0.07
174	601018	宁波港	19,023	96,256.38	0.07
175	600221	海南航空	29,494	96,150.44	0.07
176	300496	中科创达	1,839	96,142.92	0.07
177	600688	上海石化	14,926	96,123.44	0.07
178	600340	华夏幸福	3,999	95,576.10	0.07
179	000797	中国武夷	5,465	95,473.55	0.07
180	601700	风范股份	11,254	95,321.38	0.07
181	603858	步长制药	1,000	95,300.00	0.07
182	600027	华电国际	19,202	95,049.90	0.07
183	600582	天地科技	18,976	94,310.72	0.07
184	601111	中国国航	13,071	94,111.20	0.07
185	002410	广联达	6,440	94,024.00	0.07
186	603366	日出东方	9,858	93,749.58	0.07
187	000028	国药一致	1,397	93,459.30	0.07
188	002493	荣盛石化	6,046	93,229.32	0.07
189	600978	宜华生活	8,719	92,857.35	0.07
190	600170	上海建工	19,549	92,466.77	0.07
191	601992	金隅股份	20,730	92,455.80	0.07
192	000729	燕京啤酒	13,184	91,628.80	0.07
193	000065	北方国际	3,372	91,381.20	0.07
194	603919	金徽酒	2,908	90,351.56	0.06
195	000716	黑芝麻	11,187	90,167.22	0.06
196	600705	中航资本	14,732	90,159.84	0.06
197	601888	中国国旅	2,072	89,924.80	0.06
198	000596	古井贡酒	1,976	89,908.00	0.06
199	601928	凤凰传媒	8,582	89,853.54	0.06
200	600873	梅花生物	13,738	89,571.76	0.06
201	600983	惠而浦	7,650	89,199.00	0.06
202	600664	哈药股份	10,340	88,717.20	0.06



203	600308	华泰股份	16,304	88,693.76	0.06
204	603001	奥康国际	3,865	88,508.50	0.06
205	600466	蓝光发展	9,138	88,364.46	0.06
206	300214	日科化学	9,781	88,224.62	0.06
207	600889	南京化纤	6,705	88,170.75	0.06
208	002789	建艺集团	1,103	86,927.43	0.06
209	000933	*ST 神火	15,625	86,718.75	0.06
210	000698	沈阳化工	10,889	85,914.21	0.06
211	000069	华侨城 A	12,352	85,846.40	0.06
212	002329	皇氏集团	6,025	85,073.00	0.06
213	002603	以岭药业	4,916	84,751.84	0.06
214	601179	中国西电	15,071	84,096.18	0.06
215	600261	阳光照明	11,645	84,076.90	0.06
216	600167	联美控股	5,044	83,831.28	0.06
217	600888	新疆众和	10,674	83,577.42	0.06
218	601000	唐山港	20,774	83,303.74	0.06
219	600183	生益科技	7,554	83,094.00	0.06
220	002324	普利特	2,779	82,980.94	0.06
221	000430	张家界	6,736	82,246.56	0.06
222	601877	正泰电器	4,092	81,840.00	0.06
223	002677	浙江美大	6,943	81,233.10	0.06
224	600835	上海机电	4,147	80,949.44	0.06
225	600327	大东方	8,693	80,844.90	0.06
226	000587	金洲慈航	5,430	80,798.40	0.06
227	600231	凌钢股份	29,791	80,733.61	0.06
228	601139	深圳燃气	8,832	80,282.88	0.06
229	600987	航民股份	6,499	80,197.66	0.06
230	600686	金龙汽车	5,641	80,158.61	0.06
231	600398	海澜之家	7,406	79,910.74	0.06
232	600706	曲江文旅	4,005	79,459.20	0.06
233	601126	四方股份	8,149	79,289.77	0.06
234	600240	华业资本	7,369	79,143.06	0.06
235	002238	天威视讯	5,383	78,860.95	0.06
236	603608	天创时尚	3,426	78,798.00	0.06
237	002565	顺灏股份	9,771	78,754.26	0.06
238	002267	陕天然气	8,194	78,580.46	0.06
239	600401	海润光伏	33,849	78,529.68	0.06
240	002281	光迅科技	1,000	78,500.00	0.06
241	000627	天茂集团	10,258	78,473.70	0.06

242	002705	新宝股份	4,606	77,887.46	0.06
243	000001	平安银行	8,556	77,859.60	0.06
244	002595	豪迈科技	3,697	77,821.85	0.06
245	600023	浙能电力	14,272	77,496.96	0.06
246	002641	永高股份	9,151	76,959.91	0.06
247	600665	天地源	14,493	76,957.83	0.06
248	002661	克明面业	4,635	76,384.80	0.05
249	300269	联建光电	3,266	75,509.92	0.05
250	002534	杭锅股份	6,762	75,463.92	0.05
251	601900	南方传媒	4,823	75,383.49	0.05
252	000650	仁和药业	10,589	74,652.45	0.05
253	600743	华远地产	16,735	74,470.75	0.05
254	000156	华数传媒	4,143	74,201.13	0.05
255	603008	喜临门	4,048	74,078.40	0.05
256	601799	星宇股份	1,924	74,074.00	0.05
257	600236	桂冠电力	12,135	74,023.50	0.05
258	002518	科士达	3,458	73,966.62	0.05
259	600188	兖州煤业	6,769	73,511.34	0.05
260	300258	精锻科技	5,008	73,417.28	0.05
261	601872	招商轮船	14,798	73,102.12	0.05
262	002244	滨江集团	10,419	72,724.62	0.05
263	002543	万和电气	4,154	72,279.60	0.05
264	300204	舒泰神	4,076	72,267.48	0.05
265	002790	瑞尔特	1,498	72,053.80	0.05
266	600483	福能股份	6,487	71,811.09	0.05
267	600377	宁沪高速	8,394	71,768.70	0.05
268	300118	东方日升	4,326	71,076.18	0.05
269	603288	海天味业	2,423	71,066.59	0.05
270	601375	中原证券	17,761	71,044.00	0.05
271	000732	泰禾集团	3,942	69,733.98	0.05
272	603369	今世缘	5,254	68,932.48	0.05
273	002557	洽洽食品	4,263	68,463.78	0.05
274	600297	广汇汽车	7,932	67,897.92	0.05
275	002563	森马服饰	6,571	67,484.17	0.05
276	300171	东富龙	4,414	65,724.46	0.05
277	603218	日月股份	1,538	64,057.70	0.05
278	000802	北京文化	3,312	64,054.08	0.05
279	300583	赛托生物	1,582	63,738.78	0.05
280	002466	天齐锂业	1,958	63,537.10	0.05

281	002793	东音股份	951	63,155.91	0.05
282	603339	四方冷链	1,693	63,115.04	0.05
283	002454	松芝股份	4,604	62,752.52	0.05
284	600980	北矿科技	2,512	61,795.20	0.04
285	600597	光明乳业	4,657	60,820.42	0.04
286	002046	轴研科技	4,862	57,128.50	0.04
287	000709	河钢股份	16,990	56,746.60	0.04
288	300457	赢合科技	852	53,318.16	0.04
289	600560	金自天正	3,252	53,235.24	0.04
290	300017	网宿科技	989	53,020.29	0.04
291	600016	民生银行	5,705	51,801.40	0.04
292	600348	阳泉煤业	7,608	51,201.84	0.04
293	000032	深桑达 A	3,415	51,020.10	0.04
294	000798	中水渔业	4,263	48,171.90	0.03
295	600563	法拉电子	1,295	47,487.65	0.03
296	002108	沧州明珠	2,307	46,993.59	0.03
297	603877	太平鸟	1,876	39,958.80	0.03
298	603689	皖天然气	4,818	37,917.66	0.03
299	601006	大秦铁路	5,319	37,658.52	0.03
300	600690	青岛海尔	3,788	37,425.44	0.03
301	000937	冀中能源	5,443	36,685.82	0.03
302	600362	江西铜业	2,138	35,768.74	0.03
303	000600	建投能源	3,995	35,475.60	0.03
304	300582	英飞特	1,359	35,157.33	0.03
305	000100	TCL 集团	10,351	34,158.30	0.02
306	000983	西山煤电	3,969	33,577.74	0.02
307	002558	世纪游轮	558	33,418.62	0.02
308	002833	弘亚数控	1,760	31,011.20	0.02
309	002716	金贵银业	1,312	30,359.68	0.02
310	600395	盘江股份	3,084	24,887.88	0.02
311	000630	铜陵有色	8,039	24,760.12	0.02
312	600489	中金黄金	1,938	23,430.42	0.02
313	002155	湖南黄金	2,013	23,048.85	0.02
314	603528	多伦科技	350	22,872.50	0.02
315	600547	山东黄金	619	22,599.69	0.02
316	601069	西部黄金	994	22,225.84	0.02
317	600988	赤峰黄金	1,304	20,107.68	0.01
318	603266	天龙股份	1,344	19,662.72	0.01
319	300329	海伦钢琴	1,163	18,724.30	0.01

320	000050	深天马 A	974	18,330.68	0.01
321	000403	ST 生化	555	18,209.55	0.01
322	300587	天铁股份	1,280	18,060.80	0.01
323	603377	东方时尚	439	17,722.43	0.01
324	000617	*ST 济柴	943	17,681.25	0.01
325	300351	永贵电器	668	17,147.56	0.01
326	600085	同仁堂	545	17,102.10	0.01
327	600763	通策医疗	488	16,367.52	0.01
328	002643	万润股份	446	16,189.80	0.01
329	603868	飞科电器	345	16,166.70	0.01
330	600742	一汽富维	993	16,017.09	0.01
331	600837	海通证券	1,009	15,891.75	0.01
332	000977	浪潮信息	747	15,836.40	0.01
333	600729	重庆百货	669	15,674.67	0.01
334	603929	亚翔集成	2,193	15,592.23	0.01
335	300511	雪榕生物	319	15,426.84	0.01
336	600975	新五丰	1,689	14,711.19	0.01
337	300219	鸿利智汇	1,319	14,311.15	0.01
338	603035	常熟汽饰	1,334	13,926.96	0.01
339	002040	南京港	674	13,877.66	0.01
340	300508	维宏股份	113	13,728.37	0.01
341	603228	景旺电子	561	12,992.76	0.01
342	600079	人福医药	607	12,109.65	0.01
343	002840	华统股份	1,814	11,881.70	0.01
344	600704	物产中大	1,137	11,745.21	0.01
345	600104	上汽集团	499	11,701.55	0.01
346	000912	泸天化	885	11,699.70	0.01
347	300212	易华录	343	11,662.00	0.01
348	600491	龙元建设	993	11,459.22	0.01
349	002050	三花智控	1,000	11,040.00	0.01
350	000678	襄阳轴承	834	10,975.44	0.01
351	600276	恒瑞医药	241	10,965.50	0.01
352	300331	苏大维格	327	10,738.68	0.01
353	603611	诺力股份	281	10,728.58	0.01
354	300210	森远股份	490	10,696.70	0.01
355	600857	宁波中百	526	10,535.78	0.01
356	601818	光大银行	2,692	10,525.72	0.01
357	000637	茂化实华	1,356	10,481.88	0.01
358	002748	世龙实业	519	10,447.47	0.01

359	002838	道恩股份	682	10,420.96	0.01
360	002781	奇信股份	323	10,416.75	0.01
361	300107	建新股份	1,407	10,397.73	0.01
362	000858	五粮液	301	10,378.48	0.01
363	603101	汇嘉时代	405	10,201.95	0.01
364	603186	华正新材	1,874	10,063.38	0.01
365	002333	罗普斯金	686	10,001.88	0.01
366	000605	渤海股份	473	9,947.19	0.01
367	600248	延长化建	1,401	9,933.09	0.01
368	002115	三维通信	932	9,813.96	0.01
369	300450	先导智能	288	9,789.12	0.01
370	603726	朗迪集团	190	9,733.70	0.01
371	002687	乔治白	814	9,727.30	0.01
372	600671	天目药业	314	9,674.34	0.01
373	601688	华泰证券	539	9,626.54	0.01
374	002357	富临运业	631	9,603.82	0.01
375	603032	德新交运	1,628	9,458.68	0.01
376	603029	天鹅股份	194	9,422.58	0.01
377	300586	美联新材	1,006	9,355.80	0.01
378	002104	恒宝股份	782	9,219.78	0.01
379	000776	广发证券	527	8,885.22	0.01
380	600703	三安光电	625	8,368.75	0.01
381	601985	中国核电	1,167	8,239.02	0.01
382	002583	海能达	618	8,163.78	0.01
383	601377	兴业证券	1,048	8,017.20	0.01
384	000625	长安汽车	522	7,798.68	0.01
385	300591	万里马	2,397	7,358.79	0.01
386	601336	新华保险	166	7,267.48	0.01
387	600820	隧道股份	660	7,266.60	0.01
388	300097	智云股份	130	7,125.30	0.01
389	600100	同方股份	510	7,063.50	0.01
390	600029	南方航空	988	6,935.76	0.00
391	002220	天宝股份	509	6,866.41	0.00
392	000488	晨鸣纸业	660	6,837.60	0.00
393	000661	长春高新	61	6,822.85	0.00
394	300588	熙菱信息	1,380	6,817.20	0.00
395	600886	国投电力	1,018	6,790.06	0.00
396	002008	大族激光	300	6,780.00	0.00
397	601633	长城汽车	600	6,636.00	0.00

398	600583	海油工程	898	6,627.24	0.00
399	000963	华东医药	91	6,558.37	0.00
400	600804	鹏博士	292	6,403.56	0.00
401	000778	新兴铸管	1,238	6,400.46	0.00
402	600572	康恩贝	868	6,345.08	0.00
403	600779	水井坊	330	6,306.30	0.00
404	000686	东北证券	510	6,303.60	0.00
405	603883	老百姓	135	6,297.75	0.00
406	600271	航天信息	315	6,284.25	0.00
407	600177	雅戈尔	449	6,277.02	0.00
408	000673	当代东方	449	6,223.14	0.00
409	600449	宁夏建材	510	6,206.70	0.00
410	601918	*ST 新集	1,302	6,145.44	0.00
411	600320	振华重工	1,197	6,104.70	0.00
412	002400	省广股份	439	6,053.81	0.00
413	002594	比亚迪	121	6,011.28	0.00
414	002440	闰土股份	365	5,964.10	0.00
415	000066	长城电脑	479	5,958.76	0.00
416	002441	众业达	444	5,940.72	0.00
417	000860	顺鑫农业	270	5,940.00	0.00
418	002470	金正大	750	5,925.00	0.00
419	002556	辉隆股份	570	5,922.30	0.00
420	600418	江淮汽车	509	5,884.04	0.00
421	002458	益生股份	171	5,882.40	0.00
422	002126	银轮股份	600	5,814.00	0.00
423	600863	内蒙华电	1,884	5,802.72	0.00
424	600635	大众公用	959	5,763.59	0.00
425	002385	大北农	809	5,743.90	0.00
426	600258	首旅酒店	251	5,737.86	0.00
427	000848	承德露露	509	5,695.71	0.00
428	000755	山西三维	690	5,692.50	0.00
429	000917	电广传媒	391	5,626.49	0.00
430	600260	凯乐科技	360	5,572.80	0.00
431	600801	华新水泥	718	5,564.50	0.00
432	002508	老板电器	151	5,556.80	0.00
433	600467	好当家	1,227	5,533.77	0.00
434	002183	怡亚通	509	5,527.74	0.00
435	002234	民和股份	256	5,524.48	0.00
436	000090	天健集团	570	5,506.20	0.00

437	002179	中航光电	151	5,479.79	0.00
438	600830	香溢融通	481	5,459.35	0.00
439	600239	云南城投	958	5,422.28	0.00
440	002332	仙琚制药	419	5,392.53	0.00
441	000521	美菱电器	778	5,383.76	0.00
442	300015	爱尔眼科	180	5,382.00	0.00
443	002016	世荣兆业	562	5,378.34	0.00
444	002462	嘉事堂	126	5,358.78	0.00
445	001696	宗申动力	570	5,358.00	0.00
446	000708	大冶特钢	420	5,350.80	0.00
447	600894	广日股份	391	5,344.97	0.00
448	601566	九牧王	301	5,324.69	0.00
449	600611	大众交通	809	5,315.13	0.00
450	300150	世纪瑞尔	533	5,314.01	0.00
451	600176	中国巨石	540	5,313.60	0.00
452	600216	浙江医药	419	5,312.92	0.00
453	002186	全聚德	241	5,302.00	0.00
454	600780	通宝能源	958	5,297.74	0.00
455	002398	建研集团	390	5,296.20	0.00
456	600422	昆药集团	391	5,282.41	0.00
457	002477	雏鹰农牧	1,047	5,255.94	0.00
458	000539	粤电力A	987	5,250.84	0.00
459	600020	中原高速	1,167	5,239.83	0.00
460	601225	陕西煤业	1,078	5,228.30	0.00
461	002215	诺普信	471	5,218.68	0.00
462	002614	蒙发利	391	5,215.94	0.00
463	002426	胜利精密	629	5,201.83	0.00
464	300183	东软载波	210	5,191.20	0.00
465	600826	兰生股份	190	5,190.80	0.00
466	600312	平高电气	331	5,170.22	0.00
467	600537	亿晶光电	690	5,126.70	0.00
468	600295	鄂尔多斯	540	5,124.60	0.00
469	002714	牧原股份	220	5,121.60	0.00
470	300064	豫金刚石	449	5,096.15	0.00
471	600058	五矿发展	331	5,041.13	0.00
472	002393	力生制药	122	5,038.60	0.00
473	002228	合兴包装	956	5,019.00	0.00
474	002285	世联行	659	5,008.40	0.00
475	603368	柳州医药	62	4,997.82	0.00

476	000965	天保基建	749	4,995.83	0.00
477	600684	珠江实业	628	4,936.08	0.00
478	000799	酒鬼酒	240	4,924.80	0.00
479	600203	福日电子	419	4,919.06	0.00
480	300267	尔康制药	374	4,880.70	0.00
481	600358	国旅联合	481	4,848.48	0.00
482	300241	瑞丰光电	300	4,839.00	0.00
483	600697	欧亚集团	151	4,836.53	0.00
484	600694	大商股份	121	4,831.53	0.00
485	603808	歌力思	150	4,813.50	0.00
486	002116	中国海诚	359	4,810.60	0.00
487	000021	深科技	509	4,799.87	0.00
488	002325	洪涛股份	599	4,797.99	0.00
489	002009	天奇股份	331	4,789.57	0.00
490	600197	伊力特	330	4,781.70	0.00
491	600198	大唐电信	301	4,776.87	0.00
492	600683	京投发展	539	4,770.15	0.00
493	002139	拓邦股份	359	4,735.21	0.00
494	600713	南京医药	592	4,706.40	0.00
495	600101	明星电力	390	4,699.50	0.00
496	000966	长源电力	778	4,699.12	0.00
497	002588	史丹利	414	4,698.90	0.00
498	002302	西部建设	628	4,672.32	0.00
499	600869	智慧能源	599	4,636.26	0.00
500	002372	伟星新材	300	4,629.00	0.00
501	600531	豫光金铅	539	4,624.62	0.00
502	601238	广汽集团	199	4,610.83	0.00
503	601313	江南嘉捷	390	4,609.80	0.00
504	300239	东宝生物	570	4,605.60	0.00
505	000921	海信科龙	450	4,594.50	0.00
506	002218	拓日新能	510	4,584.90	0.00
507	000089	深圳机场	569	4,552.00	0.00
508	600612	老凤祥	122	4,542.06	0.00
509	000973	佛塑科技	599	4,492.50	0.00
510	002686	亿利达	300	4,446.00	0.00
511	300037	新宙邦	90	4,437.00	0.00
512	002039	黔源电力	270	4,428.00	0.00
513	000958	东方能源	301	4,373.53	0.00
514	300298	三诺生物	240	4,353.60	0.00



515	002533	金杯电工	420	4,317.60	0.00
516	002712	思美传媒	150	4,290.00	0.00
517	603609	禾丰牧业	330	4,266.90	0.00
518	002032	苏泊尔	122	4,260.24	0.00
519	600360	华微电子	480	4,252.80	0.00
520	000851	高鸿股份	359	4,185.94	0.00
521	300048	合康新能	509	4,183.98	0.00
522	600129	太极集团	240	4,116.00	0.00
523	002737	葵花药业	121	4,076.49	0.00
524	300068	南都电源	211	4,065.97	0.00
525	300319	麦捷科技	100	3,929.00	0.00
526	002769	普路通	191	3,909.77	0.00
527	000948	南天信息	211	3,734.70	0.00
528	300452	山河药辅	62	2,711.88	0.00
529	300465	高伟达	125	2,265.00	0.00
530	002230	科大讯飞	45	1,219.05	0.00
531	300274	阳光电源	110	1,159.40	0.00
532	300369	绿盟科技	34	1,154.98	0.00
533	300443	金雷风电	20	1,135.60	0.00
534	002475	立讯精密	29	601.75	0.00
535	600570	恒生电子	1	47.14	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002329	皇氏集团	59,690,355.17	30.09
2	300302	同有科技	51,960,343.10	26.19
3	300458	全志科技	26,408,192.87	13.31
4	300213	佳讯飞鸿	25,734,071.31	12.97
5	600536	中国软件	25,620,858.46	12.91
6	002635	安洁科技	21,596,233.64	10.89
7	000423	东阿阿胶	18,339,410.91	9.24
8	002268	卫士通	17,082,430.79	8.61
9	300274	阳光电源	15,658,498.00	7.89
10	300285	国瓷材料	15,119,497.70	7.62

11	002458	益生股份	14,869,083.00	7.50
12	000538	云南白药	14,661,625.10	7.39
13	600179	安通控股	14,099,970.26	7.11
14	002368	太极股份	13,741,366.98	6.93
15	600988	赤峰黄金	13,636,675.43	6.87
16	002410	广联达	13,601,587.85	6.86
17	300207	欣旺达	13,514,806.01	6.81
18	300224	正海磁材	13,127,542.78	6.62
19	000651	格力电器	12,915,185.20	6.51
20	002155	湖南黄金	12,667,380.34	6.39
21	601058	赛轮金宇	12,614,367.34	6.36
22	002567	唐人神	12,420,194.44	6.26
23	300340	科恒股份	11,423,833.86	5.76
24	600085	同仁堂	11,197,851.10	5.64
25	600436	片仔癀	10,542,338.35	5.31
26	601166	兴业银行	10,456,666.45	5.27
27	601069	西部黄金	10,132,419.24	5.11
28	300483	沃施股份	9,969,345.00	5.03
29	600793	宜宾纸业	9,554,286.42	4.82
30	300101	振芯科技	9,537,353.52	4.81
31	002439	启明星辰	9,120,380.91	4.60
32	002716	金贵银业	9,008,290.75	4.54
33	601169	北京银行	8,866,353.55	4.47
34	600643	爱建集团	8,786,277.59	4.43
35	300398	飞凯材料	8,686,173.15	4.38
36	000975	银泰资源	8,604,626.38	4.34
37	300092	科新机电	8,392,418.29	4.23
38	601318	中国平安	8,379,857.48	4.22
39	000697	炼石有色	8,334,473.00	4.20
40	002193	山东如意	8,211,434.68	4.14
41	002456	欧菲光	8,152,685.00	4.11
42	300088	长信科技	7,827,881.60	3.95
43	300230	永利股份	7,823,909.00	3.94
44	300496	中科创达	7,809,216.68	3.94
45	601009	南京银行	7,784,234.27	3.92
46	600060	海信电器	7,746,389.76	3.90

47	601288	农业银行	7,654,268.00	3.86
48	002057	中钢天源	7,603,928.28	3.83
49	002142	宁波银行	7,518,959.01	3.79
50	600978	宜华生活	7,501,344.00	3.78
51	601098	中南传媒	7,498,579.96	3.78
52	600489	中金黄金	7,431,662.60	3.75
53	000001	平安银行	7,323,457.75	3.69
54	300017	网宿科技	7,063,069.50	3.56
55	600155	宝硕股份	7,013,134.89	3.54
56	600099	林海股份	6,996,602.84	3.53
57	300029	天龙光电	6,985,795.48	3.52
58	600975	新五丰	6,915,585.00	3.49
59	600373	中文传媒	6,891,825.63	3.47
60	600213	亚星客车	6,881,563.04	3.47
61	300113	顺网科技	6,785,627.43	3.42
62	600547	山东黄金	6,629,860.90	3.34
63	600056	中国医药	6,442,367.27	3.25
64	000630	铜陵有色	6,223,051.00	3.14
65	300375	鹏翎股份	6,179,946.34	3.12
66	300065	海兰信	6,172,696.04	3.11
67	600030	中信证券	6,049,455.08	3.05
68	300031	宝通科技	5,862,284.00	2.96
69	300329	海伦钢琴	5,766,920.50	2.91
70	300268	万福生科	5,712,936.50	2.88
71	600689	上海三毛	5,508,508.00	2.78
72	600597	光明乳业	5,458,415.28	2.75
73	000856	*ST 冀装	5,365,464.05	2.70
74	000970	中科三环	5,305,493.00	2.67
75	002109	*ST 兴化	5,131,714.28	2.59
76	600603	*ST 兴业	5,083,581.98	2.56
77	601668	中国建筑	5,029,909.00	2.54
78	002205	国统股份	5,023,043.22	2.53
79	300062	中能电气	4,975,395.64	2.51
80	300260	新莱应材	4,929,530.12	2.48
81	300127	银河磁体	4,902,199.00	2.47
82	000568	泸州老窖	4,811,479.00	2.43

83	000802	北京文化	4,768,430.00	2.40
84	600016	民生银行	4,626,402.89	2.33
85	600000	浦发银行	4,625,189.00	2.33
86	002627	宜昌交运	4,564,483.89	2.30
87	601939	建设银行	4,467,925.00	2.25
88	002303	美盈森	4,460,961.00	2.25
89	000985	大庆华科	4,374,192.00	2.20
90	600637	东方明珠	4,371,580.00	2.20
91	000801	四川九洲	4,276,940.68	2.16
92	601669	中国电建	4,136,991.67	2.09
93	002626	金达威	4,068,391.48	2.05
94	000938	紫光股份	4,048,243.00	2.04
95	002426	胜利精密	4,032,974.62	2.03
96	000915	山大华特	4,015,724.72	2.02
97	300097	智云股份	4,007,958.00	2.02
98	300084	海默科技	3,982,404.00	2.01
99	600015	华夏银行	3,981,014.00	2.01
100	603669	灵康药业	3,979,920.22	2.01

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

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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002329	皇氏集团	60,856,048.24	30.68
2	300302	同有科技	54,751,957.47	27.60
3	600536	中国软件	29,869,781.51	15.06
4	300458	全志科技	27,822,206.85	14.02
5	300213	佳讯飞鸿	27,795,998.73	14.01
6	000423	东阿阿胶	20,800,614.00	10.49
7	002635	安洁科技	19,074,137.68	9.61
8	002458	益生股份	18,950,961.47	9.55
9	300285	国瓷材料	18,311,512.21	9.23
10	002410	广联达	16,832,880.34	8.49

11	300274	阳光电源	16,610,101.62	8.37
12	601058	赛轮金宇	15,396,509.28	7.76
13	002268	卫士通	15,169,560.76	7.65
14	300207	欣旺达	14,828,761.46	7.47
15	600988	赤峰黄金	14,206,119.28	7.16
16	000651	格力电器	14,166,578.46	7.14
17	300224	正海磁材	13,846,321.68	6.98
18	600179	安通控股	13,551,935.18	6.83
19	002155	湖南黄金	13,436,489.55	6.77
20	300340	科恒股份	13,014,225.01	6.56
21	600085	同仁堂	12,659,260.70	6.38
22	601166	兴业银行	12,140,332.69	6.12
23	000538	云南白药	12,113,367.81	6.11
24	600436	片仔癀	10,996,291.36	5.54
25	002368	太极股份	10,661,646.77	5.37
26	000697	炼石有色	10,152,768.82	5.12
27	002716	金贵银业	10,137,594.61	5.11
28	002567	唐人神	9,928,055.83	5.00
29	601069	西部黄金	9,827,779.67	4.95
30	600793	宜宾纸业	9,797,692.36	4.94
31	300483	沃施股份	9,533,129.26	4.81
32	000001	平安银行	8,929,661.20	4.50
33	601169	北京银行	8,869,187.62	4.47
34	601318	中国平安	8,623,022.88	4.35
35	300092	科新机电	8,405,941.39	4.24
36	300088	长信科技	8,145,794.01	4.11
37	300230	永利股份	8,144,969.49	4.11
38	300496	中科创达	8,083,383.75	4.07
39	002193	山东如意	7,919,452.58	3.99
40	300398	飞凯材料	7,893,487.17	3.98
41	300101	振芯科技	7,851,444.56	3.96
42	600060	海信电器	7,793,038.53	3.93
43	600489	中金黄金	7,771,289.64	3.92
44	000975	银泰资源	7,493,742.77	3.78
45	600978	宜华生活	7,338,613.56	3.70
46	601098	中南传媒	7,032,701.97	3.55
47	002439	启明星辰	7,030,678.76	3.54
48	600643	爱建集团	7,020,247.16	3.54

49	300065	海兰信	7,014,584.44	3.54
50	600637	东方明珠	6,970,244.50	3.51
51	600975	新五丰	6,953,954.39	3.51
52	600373	中文传媒	6,921,183.90	3.49
53	002142	宁波银行	6,879,817.63	3.47
54	600689	上海三毛	6,877,768.87	3.47
55	601288	农业银行	6,866,424.47	3.46
56	601009	南京银行	6,851,760.58	3.45
57	002057	中钢天源	6,628,206.75	3.34
58	300029	天龙光电	6,625,417.99	3.34
59	600547	山东黄金	6,621,636.96	3.34
60	600597	光明乳业	6,617,588.33	3.34
61	300017	网宿科技	6,560,313.53	3.31
62	300113	顺网科技	6,373,629.25	3.21
63	300375	鹏翎股份	6,344,228.30	3.20
64	300329	海伦钢琴	6,342,366.24	3.20
65	600099	林海股份	6,293,237.97	3.17
66	000630	铜陵有色	5,974,278.44	3.01
67	000856	*ST 冀装	5,947,250.90	3.00
68	600213	亚星客车	5,895,556.60	2.97
69	300031	宝通科技	5,680,546.88	2.86
70	600030	中信证券	5,566,684.93	2.81
71	300268	万福生科	5,431,634.36	2.74
72	000568	泸州老窖	5,389,379.79	2.72
73	000776	广发证券	5,321,439.58	2.68
74	300062	中能电气	5,285,967.46	2.66
75	000802	北京文化	5,228,850.90	2.64
76	002109	*ST 兴化	5,117,868.98	2.58
77	300260	新莱应材	5,017,256.74	2.53
78	600603	*ST 兴业	4,996,069.30	2.52
79	002456	欧菲光	4,824,452.88	2.43
80	601939	建设银行	4,731,622.12	2.39
81	600016	民生银行	4,655,984.58	2.35
82	002104	恒宝股份	4,651,362.80	2.34
83	600056	中国医药	4,642,320.20	2.34
84	300069	金利华电	4,609,410.86	2.32
85	300097	智云股份	4,546,891.28	2.29
86	002303	美盈森	4,455,086.24	2.25

87	002003	伟星股份	4,419,654.90	2.23
88	600455	博通股份	4,418,651.43	2.23
89	300127	银河磁体	4,397,328.62	2.22
90	601601	中国太保	4,386,918.53	2.21
91	002372	伟星新材	4,359,241.21	2.20
92	300351	永贵电器	4,342,627.20	2.19
93	600000	浦发银行	4,319,081.64	2.18
94	600015	华夏银行	4,271,597.00	2.15
95	002626	金达威	4,228,522.92	2.13
96	002205	国统股份	4,223,991.94	2.13
97	002026	山东威达	4,127,596.33	2.08
98	601818	光大银行	4,120,548.01	2.08
99	000970	中科三环	4,101,358.47	2.07
100	000938	紫光股份	4,094,864.00	2.06
101	300084	海默科技	4,066,218.91	2.05
102	000915	山大华特	4,040,604.59	2.04
103	601668	中国建筑	4,029,723.95	2.03

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	1,561,510,714.25
卖出股票收入（成交）总额	1,574,553,884.73

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 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。**

**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	106,821.11
2	应收证券清算款	5,000,769.86
3	应收股利	-
4	应收利息	2,555.39
5	应收申购款	15,162.86
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-



9	合计	5,125,309.22
---	----	--------------

#### 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处于转股期的可转换债券。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002635	安洁科技	2,918,515.60	2.10	重大事项
2	002071	长城影视	2,486,299.20	1.79	重大事项
3	002567	唐人神	2,480,157.60	1.78	重大事项

#### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
4,881	14,827.84	371,995.98	0.51%	72,002,697.55	99.49%

### 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	268,383.23	0.37%

### 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	0
-----------------	---

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2012年4月26日）基金份额总额	2,433,435,148.52
本报告期期初基金份额总额	87,572,451.80
本报告期基金总申购份额	55,064,366.23
减：本报告期基金总赎回份额	70,262,124.50
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	72,374,693.53

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2016年1月30日发布《工银瑞信基金管理有限公司关于副总经理变更的公告》，江明波先生、杜海涛先生、赵紫英女士自2016年1月29日起担任工银瑞信基金管理有限公司副总经理。

#### 2、基金托管人托管部门：

2016年12月，郭德秋先生担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 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

本基金本报告期无投资策略的改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内应支付给安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用肆万元整，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	
银河证券	2	779,944,793.11	24.88%	715,149.96	25.07%	-
招商证券	1	707,829,059.01	22.58%	645,046.31	22.61%	-
中金	1	465,951,908.54	14.87%	424,627.18	14.88%	-
民生证券	1	433,950,066.28	13.84%	395,459.15	13.86%	-
兴业证券	1	270,953,658.86	8.64%	252,338.63	8.85%	-
中信证券	2	146,834,613.38	4.68%	133,809.94	4.69%	-
国信证券	1	112,819,516.89	3.60%	102,813.15	3.60%	-
瑞银证券	1	74,557,155.43	2.38%	53,032.96	1.86%	-
光大证券	1	62,820,008.44	2.00%	57,248.13	2.01%	-
国泰君安	1	39,721,813.46	1.27%	36,992.97	1.30%	-
申万宏源	1	38,992,039.50	1.24%	36,310.23	1.27%	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-

注：1. 券商的选择标准和程序

(1) 选择标准：注重综合服务能力

- a) 券商财务状况良好、经营行为规范、风险管理先进、投资风格与工银瑞信有互补性、在最近一年内无重大违规行为。
- b) 券商具有较强的综合研究能力：能及时、全面、定期提供高质量的关于宏观、行业、资本市场、个股分析报告及其他丰富全面的信息咨询服务；有很强的分析能力，能根据工银瑞信所管理基金的特定要求，提供专门研究报告；具有开发量化投资组合模型的能力以及其他综合服务能力。
- c) 与其他券商相比，该券商能够提供最佳交易执行和优惠合理的佣金率。

## (2) 选择程序

- a) 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。

## 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
银河证券	-	-	246,500,000.00	21.41%	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金	-	-	523,500,000.00	45.46%	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-

兴业证券	-	-	269,000,000.00	23.36%	-	-
中信证券	-	-	24,000,000.00	2.08%	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	73,500,000.00	6.38%	-	-
申万宏源	-	-	15,000,000.00	1.30%	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-

### 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	工银瑞信基金管理有限公司关于浙江金观诚财富管理有限公司费率调整的公告	中国证监会指定的媒介	2016年1月12日
2	工银瑞信基金管理有限公司关于增加北京创金启富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	2016年1月29日
3	工银瑞信基金管理有限公司关于增加中证金牛（北京）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	2016年1月29日
4	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	2016年1月30日
5	工银瑞信基金管理有限公司关于增加和耕传承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	中国证监会指定的媒介	2016年2月3日
6	工银瑞信基金管理有限公司关于中国银河证券股份有限公司费率	中国证监会指定的媒介	2016年2月24日

	调整的公告		
7	工银瑞信基金管理有限公司关于增加北京钱景财富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	2016年3月17日
8	关于增加太平洋证券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	2016年3月22日
9	工银瑞信基金管理有限公司关于深圳市新兰德证券投资咨询有限公司费率调整的公告	中国证监会指定的媒介	2016年4月5日
10	工银瑞信基金管理有限公司关于增加奕丰金融服务（深圳）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	2016年4月22日
11	工银瑞信基金管理有限公司关于增加徽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	2016年5月4日
12	工银瑞信基金管理有限公司关于中证金牛（北京）投资咨询有限公司费率调整的公告	中国证监会指定的媒介	2016年5月7日
13	关于工银瑞信基金管理有限公司网上交易支付宝渠道关闭基金支付服务的公告	中国证监会指定的媒介	2016年5月11日
14	关于工银瑞信基金管理有限公司淘宝基金店关闭申购服务的公告	中国证监会指定的媒介	2016年5月11日
15	工银瑞信基金管理有限公司关于增加珠海盈米财富管理有限公司为旗下基金销售机构并进行费率	中国证监会指定的媒介	2016年6月2日

	调整的公告		
16	工银瑞信基金管理有限公司关于上海联泰资产管理有限公司费率调整的公告	中国证监会指定的媒介	2016年6月20日
17	工银瑞信基金管理有限公司关于增加北京晟视天下投资管理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	2016年6月23日
18	关于直销电子自助交易系统继续开展基金转换费率优惠活动的公告	中国证监会指定的媒介	2016年6月28日
19	工银瑞信基金管理有限公司关于直销渠道招商银行网银支付方式基金申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定的媒介	2016年6月30日
20	工银瑞信基金管理有限公司关于调整京东金融平台基金申购费率优惠的公告	中国证监会指定的媒介	2016年6月30日
21	工银瑞信基金管理有限公司关于增加天津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	2016年7月6日
22	工银瑞信基金管理有限公司关于增加上海基煜基金销售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	2016年7月20日
23	工银瑞信基金管理有限公司关于增加南京途牛金融信息服务有限公司为旗下基金销售机构并进行费率调整的公告	中国证监会指定的媒介	2016年8月8日
24	工银瑞信基金管理有限公司关于增加北京汇成基金销售有限公司为旗下基金销售机构并进行费率	中国证监会指定的媒介	2016年8月11日

	调整的公告		
25	工银瑞信基金管理有限公司关于增加北京格上富信投资顾问有限公司为旗下基金销售机构并进行费率调整的公告	中国证监会指定的媒介	2016年8月17日
26	工银瑞信基金管理有限公司关于增加北京广源达信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	2016年8月25日
27	工银瑞信基金管理有限公司关于增加上海万得投资顾问有限公司为旗下基金销售机构并进行费率调整的公告	中国证监会指定的媒介	2016年8月26日
28	工银瑞信基金管理有限公司关于增加云南红塔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	2016年9月5日
29	工银瑞信基金管理有限公司关于增加北京恒天明泽基金销售有限公司为旗下基金销售机构并进行费率优惠的公告	中国证监会指定的媒介	2016年9月9日
30	工银瑞信基金管理有限公司关于增加江苏紫金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	2016年9月12日
31	工银瑞信基金管理有限公司关于增加天津国美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	中国证监会指定的媒介	2016年9月28日



32	工银瑞信基金管理有限公司关于增加苏州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	2016 年 9 月 28 日
33	工银瑞信基金管理有限公司关于工银瑞信资产管理（国际）有限公司增加注册资本的公告	中国证监会指定的媒介	2016 年 10 月 14 日
34	工银瑞信基金管理有限公司关于增加泰诚财富基金销售（大连）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	2016 年 10 月 20 日
35	工银瑞信基金管理有限公司关于增加富滇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	2016 年 10 月 24 日
36	工银瑞信基金管理有限公司关于北京钱景财富投资管理有限公司基金销售费率调整的公告	中国证监会指定的媒介	2016 年 10 月 27 日
37	关于增加华西证券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	2016 年 11 月 7 日
38	工银瑞信基金管理有限公司关于北京广源达信投资管理有限公司基金销售费率调整的公告	中国证监会指定的媒介	2016 年 11 月 11 日
39	工银瑞信基金管理有限公司关于增加金惠家保险代理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	2016 年 11 月 14 日
40	工银瑞信基金管理有限公司关于	中国证监会指定的	2016 年 12 月 16 日

	增加北京新浪仓石基金销售有限公司为旗下基金销售机构并进行费率调整的公告	媒介	
41	工银瑞信基金管理有限公司关于旗下基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	中国证监会指定的媒介	2016 年 12 月 22 日
42	关于直销电子自助交易系统开展基金转换费率优惠活动的公告	中国证监会指定的媒介	2016 年 12 月 28 日

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准工银瑞信基本面量化策略混合型证券投资基金募集的文件
- 2、《工银瑞信基本面量化策略混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《工银瑞信基本面量化策略混合型证券投资基金托管协议》
- 4、《工银瑞信基本面量化策略混合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住所。

### 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](http://www.icbccs.com.cn)