

工银瑞信绝对收益策略混合型发起式证券投资基金 2015 年半年度报告

2015 年 6 月 30 日

基金管理人：工银瑞信基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：二〇一五年八月二十八日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 8 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§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 主要财务指标和基金净值表现	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
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况.....	41
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	41
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	57
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	57
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	57
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	57
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	57
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	58
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	58

7.12 投资组合报告附注.....	58
§8 基金份额持有人信息.....	59
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	59
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	60
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	60
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	60
§9 开放式基金份额变动.....	61
§10 重大事件揭示.....	61
10.1 基金份额持有人大会决议.....	61
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	61
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	61
10.4 基金投资策略的改变.....	61
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	62
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	62
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	62
10.8 其他重大事件.....	63
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	65
§12 备查文件目录.....	65
12.1 备查文件目录.....	65
12.2 存放地点.....	65
12.3 查阅方式.....	65

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	工银瑞信绝对收益策略混合型发起式证券投资基金	
基金简称	工银绝对收益混合发起	
基金主代码	000667	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014 年 6 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	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	14,418,572,535.18 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	工银绝对收益混合发起 A	工银绝对收益混合发起 B
下属分级基金的交易代码:	000667	000672
报告期末下属分级基金的份额总额	8,104,821,519.20 份	6,313,751,015.98 份

2.2 基金产品说明

投资目标	合理地灵活配置股票和债券等各类资产的比例，优选数量化投资策略进行投资，在有效控制风险的基础上，运用股指期货对冲市场波动风险，追求稳定的长期正投资回报。
投资策略	本基金借助于数量化投研团队在模型计算、组合构建、风险管理的专业能力，相机使用组合 Alpha 对冲策略、个股 Alpha 策略、事件驱动策略等多个量化策略，通过合理匹配收益与风险水平构建投资组合。
业绩比较基准	中国人民银行公布的一年期定期存款基准利率（税后）+3%（如遇中国人民银行就该等基准利率进行调整则作相应调整）
风险收益特征	本基金具有低波动率、低下方风险的特点，并且运用股指期货对冲投资组合的系统性风险，其预期收益及风险水平低于股票型基金，但高于债券型基金，属于中低风险水平的基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	工银瑞信基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	朱碧艳
	联系电话	400-811-9999
	电子邮箱	customerservice@icbccs.com.cn
客户服务电话	400-811-9999	95559
传真	010-66583158	021-62701216
注册地址	北京市西城区金融大街丙 17 号北京银行大厦	上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址	北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 A 座 6-9 层	上海市浦东新区银城中路 188 号
邮政编码	100033	200120
法定代表人	郭特华	牛锡明

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、证券时报、上海证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.icbccs.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	工银绝对收益混合发起 A	工银绝对收益混合发起 B
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)	报告期(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	199,623,686.17	354,251,780.39
本期利润	179,556,161.08	531,137,197.36
加权平均基金份额本期利润	0.1225	0.0892
本期加权平均净值利润率	11.15%	8.40%
本期基金份额净值增长率	10.99%	10.15%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	721,984,323.42	473,425,315.47
期末可供分配基金份额利润	0.0891	0.0750
期末基金资产净值	9,084,571,503.78	6,986,923,127.20
期末基金份额净值	1.121	1.107
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	12.10%	10.70%

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 2014 年 6 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

工银绝对收益混合发起 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.72%	0.17%	0.46%	0.01%	1.26%	0.16%
过去三个月	5.66%	0.16%	1.33%	0.01%	4.33%	0.15%
过去六个月	10.99%	0.30%	2.73%	0.02%	8.26%	0.28%
过去一年	12.10%	0.35%	5.73%	0.02%	6.37%	0.33%
自基金合同生效起至今	12.10%	0.35%	5.81%	0.02%	6.29%	0.33%

工银绝对收益混合发起 B

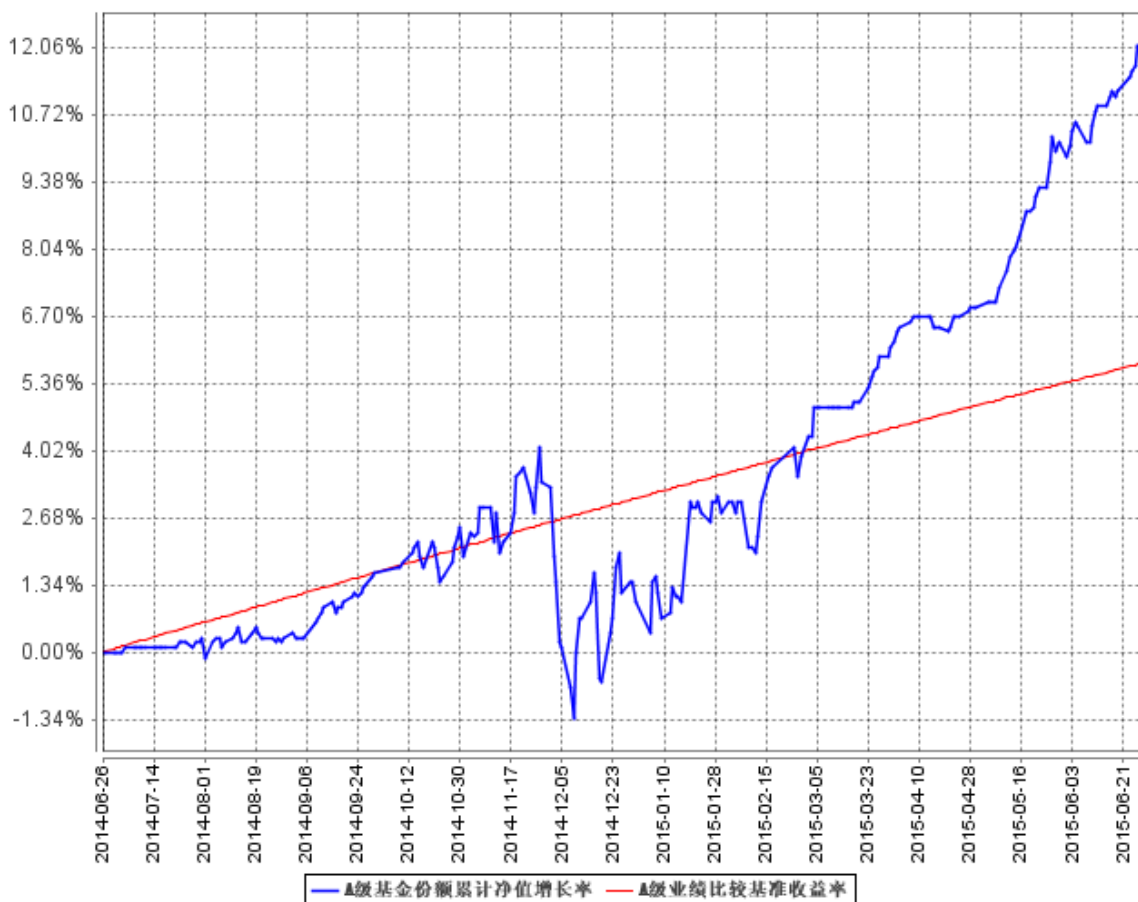
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.65%	0.19%	0.46%	0.01%	1.19%	0.18%
过去三个月	5.33%	0.17%	1.33%	0.01%	4.00%	0.16%
过去六个月	10.15%	0.30%	2.73%	0.02%	7.42%	0.28%
过去一年	10.70%	0.36%	5.73%	0.02%	4.97%	0.34%
自基金合同生效起至今	10.70%	0.35%	5.81%	0.02%	4.89%	0.33%

注：1、本基金的业绩比较基准为：中国人民银行公布的一年期定期存款基准利率（税后）+3%（如遇中国人民银行就该等基准利率进行调整则作相应调整）；

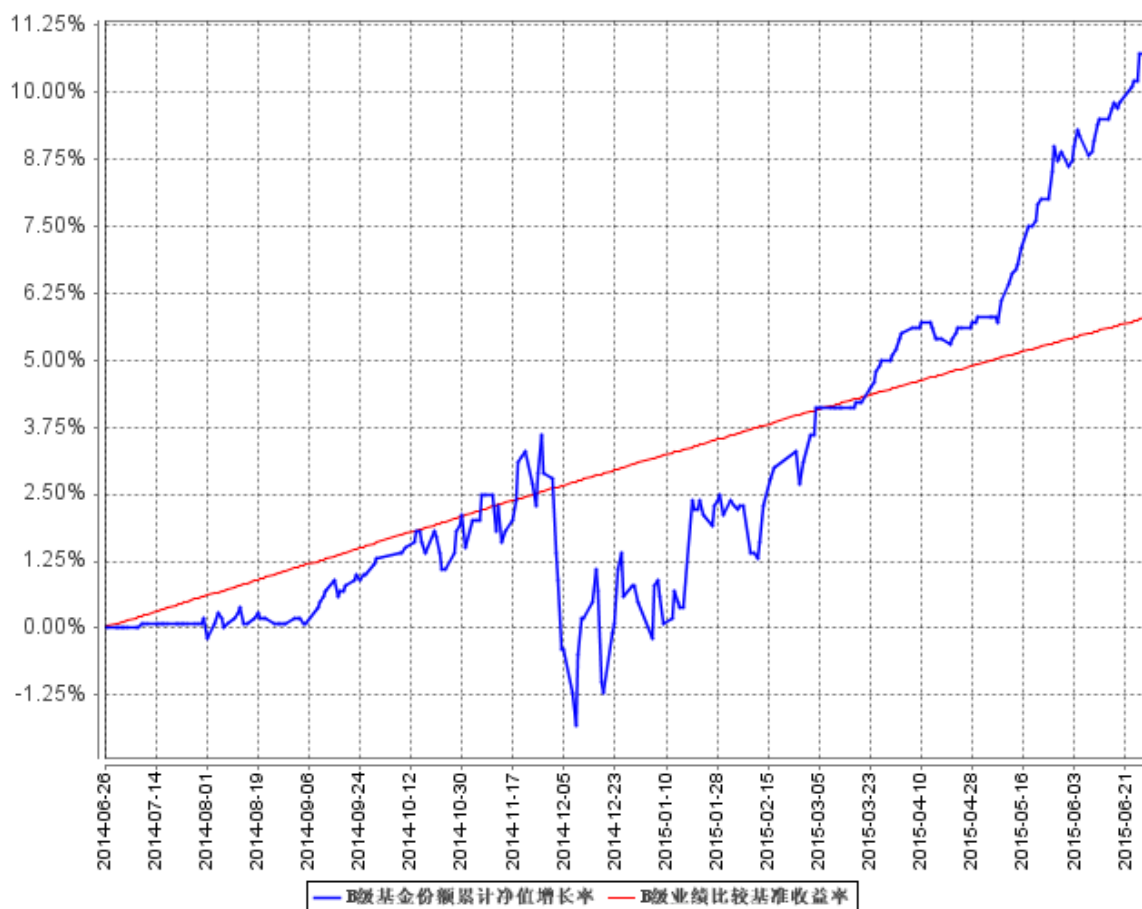
2、本基金基金合同生效日为 2014 年 6 月 26 日。

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

A级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



B级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2014 年 6 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及投资限制的规定：本基金权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值的比例范围在 80%—120%之间。其中：权益类空头头寸的价值是指融券卖出的股票市值、卖出股指期货的合约价值及卖出其他权益类衍生工具的合约价值的合计值；权益类多头头寸的价值是指买入持有的股票市值、买入股指期货的合约价值及买入其他权益类衍生工具的合约价值的合计值。每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值 95%。在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为工银瑞信基金管理有限公司，成立于 2005 年 6 月 21 日，是我国第一家由银行直接发起设立并控股的合资基金管理公司，注册资本为 2 亿元人民币，注册地在北京。公司目前拥有共同基金募集和管理资格、境外证券投资管理业务资格、企业年金基金投资管理人资格、特定客户资产管理业务资格、全国社保基金境内投资管理人资格。

截至 2015 年 6 月 30 日，公司旗下管理 66 只公募基金——工银瑞信核心价值股票型证券投资基金、工银瑞信货币市场基金、工银瑞信精选平衡混合型证券投资基金、工银瑞信稳健成长股票型证券投资基金、工银瑞信增强收益债券型证券投资基金、工银瑞信红利股票型证券投资基金、工银瑞信中国机会全球配置股票证券投资基金、工银瑞信信用添利债券型证券投资基金、工银瑞信大盘蓝筹股票型证券投资基金、工银瑞信沪深 300 指数证券投资基金、上证中央企业 50 交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信中小盘成长股票型证券投资基金、工银瑞信全球精选股票型证券投资基金、工银瑞信双利债券型证券投资基金、深证红利交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信深证红利 ETF 联接基金、工银瑞信四季收益债券型证券投资基金、工银瑞信消费服务行业股票型证券投资基金、工银瑞信添颐债券型证券投资基金、工银瑞信主题策略股票型证券投资基金、工银瑞信保本混合型证券投资基金、工银瑞信睿智中证 500 指数分级证券投资基金、工银瑞信基本面量化策略股票型证券投资基金、工银瑞信纯债定期开放债券型证券投资基金、工银瑞信 7 天理财债券型证券投资基金、工银瑞信睿智深证 100 指数分级证券投资基金、工银瑞信 14 天理财债券型发起式证券投资基金、工银瑞信信用纯债债券型证券投资基金、工银瑞信 60 天理财债券型证券投资基金、工银瑞信保本 2 号混合型发起式证券投资基金、工银瑞信增利分级债券型证券投资基金、工银瑞信产业债债券型证券投资基金、工银瑞信信用纯债一年定期开放债券型证券投资基金、工银瑞信信用纯债两年定期开放债券型证券投资基金、工银瑞信标普全球自然资源指数证券投资基金、工银瑞信保本 3 号混合型证券投资基金、工银瑞信月月薪定期支付债券型证券投资基金、工银瑞信金融地产行业股票型证券投资基金、工银瑞信双债增强债券型证券投资基金、工银瑞信添福债券型证券投资基金、工银瑞信信息产业股票型证券投资基金、工银瑞信薪金货币市场基金、工银瑞信纯债债券型证券投资基金、工银瑞信绝对收益策略混合型发起式证券投资基金、工银瑞信目标收益一年定期开放债券型投资基金、工银瑞信新财富灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信现金快线货币市场基金、工银瑞信添益快线货币市场基金、工银瑞信高端制造行业股票

型证券投资基金、工银瑞信研究精选股票型证券投资基金、工银瑞信医疗保健行业股票型证券投资基金、工银瑞信创新动力股票型证券投资基金、工银瑞信国企改革主题股票型证券投资基金、工银瑞信战略转型主题股票型证券投资基金、工银瑞信新金融股票型证券投资基金、工银瑞信美丽城镇主题股票型证券投资基金、工银瑞信总回报灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信新材料新能源行业股票型证券投资基金、工银瑞信养老产业股票型证券投资基金、工银瑞信丰盈回报灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金、工银瑞信农业产业股票型证券投资基金、工银瑞信生态环境行业股票型证券投资基金、工银瑞信互联网加股票型证券投资基金、工银瑞信财富快线货币市场基金、工银瑞信聚焦 30 股票型证券投资基金，证券投资基金管理规模逾 3500 亿元人民币。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
游凇峰	本基金的基金经理	2014年6月26日	-	19	先后在 Merrill Lynch Investment Managers 担任美林集中基金和美林保本基金经理，Fore Research & Management 担任 Fore Equity Market Neutral 组合基金经理，Jasper Asset Management 担任 Jasper Gemini Fund 基金经理；2009 年加入工银瑞信基金管理有限公司；2009 年 12 月 25 日至今，担任工银全球基金的基金经理；2010 年 5 月 25 日至今，担任工银全球精选基金的基金经理；2012 年 4 月 26 日至今担任工银基本面量化策略股票基金基金经理；2014 年 6 月 26 日至今，担任工银绝对收益策略混合型发起式基金基金经理。
王筱苓	权益投资部副总监，本基金的基金经理	2014年6月26日	-	18	曾任中国银行全球金融市场部首席交易员。2005 年加入工银瑞信，现任权益投资部副总监，2011 年 10 月 11 日至今，担任工银中小盘基金基金经理；2012 年 12 月 5 日至今，担任工银大盘蓝筹基金基金经理；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；2014 年 12 月 30 日至今，担任工银消费服务行业股票基金基金经理。

注：1、任职日期说明：游凇峰的任职日期为基金合同生效的日期。

王筱苓的任职日期为基金合同生效的日期。

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

3、本基金无基金经理助理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情况有 4 次。投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易，未导致不公平交易和利益输送。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015 年上半年以来，A 股市场迎来了“冰火两重天”：年初到 6 月中旬之间，上证指数在改革牛及稳增长的政策引领下突飞猛进，迅速突破 4000 点、5000 点整数关口，创业板更是在“大众创业，万众创新”的政策下由 2400 点突破 4000 点，牛市气氛火热。随后由于清理配资政策的出台市场开始了去杠杆过程，市场遇到了历史罕见的大幅下跌，两周时间上证指数下跌近 1000 点，创业板跌幅超过 25%。

本基金的常规策略是一个多策略优化配置的对冲策略，主要三类策略是量化 alpha 策略（包

括基差套利的子策略等)、时间驱动策略(包括新股申购的子策略等)、个股精选策略。若有任何策略满足波动低并且预期收益率足够高,本基金就会将投资倾斜于相应的策略。

本基金在今年上半年前两个月的投资着重于当时较为满足我们的风险收益比目标的多因子和技术模型进行量化选股。从三月份开始,新股认购以及期现套利已经明显成为最满足我们风险收益比目标的两个策略,本基金就适时地将投资倾斜于这两类策略。自始至终我们清醒的认识到,前期新股申购的巨额无风险收益率是维持不了很久的,即使在申购新股的间隙我们也在积极地参与基差套利的机会。与此同时,我们也在密切关注其他对冲子策略的表现,为将来可能的策略切换做准备。

因为六月份市场的剧烈波动,监管机构制定了一系列必要的稳定市场的监管措施,对基金的收益率有一定影响。随着市场的逐步稳定及监管政策恢复常态,我们预期本基金的操作也会恢复正常。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期绝对收益 A 净值增长率 10.99%,绝对收益 B 净值增长率 10.15%,业绩比较基准收益率为 2.73%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

通过六月份市场的剧烈震荡,我们对未来量化对冲策略的机会及前景更加充满了信心。中国股市的熊长牛短,长时间处于震荡行情的特性决定了量化对冲策略在 A 股市场中独特的优势地位。虽然市场在短时间内连续快速下跌近 30%,但本轮牛市处在中国经济转型期,建立在改革预期和资产配置转换的基础上,在政府不断出台稳定政策的情况下,市场将大概率趋于稳定,改革带来的牛市很大程度上还将继续。这意味着,股市中的行业,风格,个股的超基准相对收益空间巨大,这也是对冲策略投资机会出现的必要条件。

下半年还需注意的是市场还没完全企稳,流动性、监管等风险等可能再次出现,这对我们策略的实施还会产生负面影响。尽管如此,我们坚信,只要耐心观察等待,我们事先制定的量化 alpha 策略、事件驱动策略、个股精选这三类策略组合会给投资者带来稳定的超额收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.6.1 参与估值流程各方及人员(或小组)的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

4.6.1.1 职责分工

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

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

4.6.1.2 专业胜任能力及相关工作经历

小组由具有多年从事估值运作、证券行业研究、风险管理及熟悉业内法律法规的专家型人员组成。

4.6.2 基金经理参与或决定估值的程度

本公司基金经理参与讨论估值原则及方法, 但不参与最终估值决策。

4.6.3 参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.6.4 已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

尚无已签约的任何定价服务。本基金所采用的估值流程及估值结果均已经过会计师事务所鉴证, 并经托管银行复核确认。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内, 本基金未实施利润分配, 符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金在报告期内没有触及 2014 年 8 月 8 日生效的《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条规定的条件。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2015 年上半年度, 托管人在工银瑞信绝对收益策略混合型发起式证券投资基金的托管过程中, 严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议, 尽职尽责地履行了托管人应尽的义务, 不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2015 年上半年度, 工银瑞信基金管理有限公司在工银瑞信绝对收益策略混合型发起式证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上, 托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配, 符合基金合同的规定。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：工银瑞信绝对收益策略混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	9,110,395,856.57	13,925,971.99
结算备付金		924,140,759.66	12,310,177.21
存出保证金		121,774,491.23	33,716,258.68
交易性金融资产	6.4.7.2	2,051,549,290.31	424,557,068.76
其中：股票投资		1,446,889,290.31	384,522,068.76
基金投资		-	-
债券投资		604,660,000.00	40,035,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	4,038,127,028.18	52,000,000.00
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	21,435,814.63	756,675.71
应收股利		-	-
应收申购款		170,325,418.41	487,299.57
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		16,437,748,658.99	537,753,451.92
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-

卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		161,844,887.68	7,234,320.36
应付赎回款		174,829,585.07	10,569,772.61
应付管理人报酬		15,540,061.29	730,115.67
应付托管费		2,590,010.22	121,685.95
应付销售服务费		3,692,521.61	198,880.04
应付交易费用	6.4.7.7	7,535,301.90	3,304,703.92
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	221,660.24	55,042.63
负债合计		366,254,028.01	22,214,521.18
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	14,418,572,535.18	511,772,310.22
未分配利润	6.4.7.10	1,652,922,095.80	3,766,620.52
所有者权益合计		16,071,494,630.98	515,538,930.74
负债和所有者权益总计		16,437,748,658.99	537,753,451.92

注：1、报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额总额为 14,418,572,535.18 份，其中 A 类基金份额净值为人民币 1.121 元，份额总额为 8,104,821,519.20 份；B 类基金份额净值为人民币 1.107 元，份额总额为 6,313,751,015.98 份。

2、本基金基金合同生效日为 2014 年 6 月 26 日。

6.2 利润表

会计主体：工银瑞信绝对收益策略混合型发起式证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 6 月 26 日(基金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日
一、收入		817,759,412.37	476,841.14
1.利息收入		90,997,218.77	476,841.14
其中：存款利息收入	6.4.7.11	61,770,550.51	121,447.25
债券利息收入		8,152,622.97	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		21,074,045.29	355,393.89
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		566,338,363.17	-

其中：股票投资收益	6.4.7.12	688,318,912.87	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资 收益	6.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-127,770,514.53	-
股利收益	6.4.7.16	5,789,964.83	-
3.公允价值变动收益(损 失以“-”号填列)	6.4.7.17	156,817,891.88	-
4.汇兑收益(损失以“-” 号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-” 号填列)	6.4.7.18	3,605,938.55	-
减：二、费用		107,066,053.93	378,467.34
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	57,058,609.21	249,286.91
2. 托管费	6.4.10.2.2	9,509,768.21	41,547.83
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	24,181,454.83	87,632.60
4. 交易费用	6.4.7.19	15,589,209.76	-
5. 利息支出		492,703.73	-
其中：卖出回购金融资 产支出		492,703.73	-
6. 其他费用	6.4.7.20	234,308.19	-
三、利润总额（亏损总 额以“-”号填列）		710,693,358.44	98,373.80
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以 “-”号填列）		710,693,358.44	98,373.80

注：本基金基金合同生效日为 2014 年 6 月 26 日。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：工银瑞信绝对收益策略混合型发起式证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金 净值）	511,772,310.22	3,766,620.52	515,538,930.74
二、本期经营活动产生的基 金净值变动数（本期利润）	-	710,693,358.44	710,693,358.44

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)	13,906,800,224.96	938,462,116.84	14,845,262,341.80
其中：1.基金申购款	25,047,950,922.54	1,791,845,650.67	26,839,796,573.21
2.基金赎回款	-11,141,150,697.58	-853,383,533.83	-11,994,534,231.41
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)	14,418,572,535.18	1,652,922,095.80	16,071,494,630.98
项目	上年度可比期间 2014年6月26日(基金合同生效日)至2014年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,516,472,591.69	-	1,516,472,591.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	98,373.80	98,373.80
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)	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	1,516,472,591.69	98,373.80	1,516,570,965.49

注：本基金基金合同生效日为2014年6月26日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>郭特华</u>	<u>郭特华</u>	<u>朱辉毅</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

工银瑞信绝对收益策略混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监

督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2014]502号文《关于核准工银瑞信绝对收益策略混合型发起式证券投资基金募集的批复》的注册，由工银瑞信基金管理有限公司作为发起人于二零一四年五月三十日至二零一四年六月二十四日向社会公开募集，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（2014）验字第60802052_A03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2014年6月26日正式生效，本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金设立时，工银绝对收益混合发起A类基金份额收到首次募集扣除认购费后的有效净认购金额为人民币516,852,280.90元，折合516,852,280.90份工银绝对收益混合发起A类基金份额；有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币64,701.16元，折合64,701.16份工银绝对收益混合发起A类基金份额；以上收到的实收基金共计人民币516,916,982.06元，折合516,916,982.06份工银绝对收益混合发起A类基金份额。工银绝对收益混合发起B类基金份额收到首次募集（不含认购费）的有效净认购金额为人民币999,432,214.52元，折合999,432,214.52份工银绝对收益混合发起B类基金份额；有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币123,395.11元，折合123,395.11份工银绝对收益混合发起B类基金份额；以上收到的实收基金共计人民币999,555,609.63元，折合999,555,609.63份工银绝对收益混合发起B类基金份额。工银绝对收益混合发起A类及工银绝对收益混合发起B类收到的实收基金合计人民币1,516,472,591.69元，分别折合成工银绝对收益混合发起A类及工银绝对收益混合发起B类基金份额，合计折合1,516,472,591.69份基金份额。本基金的基金管理人和注册登记机构均为工银瑞信基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板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、股指期货，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金的投资组合比例为：本基金权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值的比例范围在80%-120%之间。其中：权益类空头头寸的价值是指融券卖出的股票市值、卖出股指期货的合约价值及卖出其他权益类衍生工具的合约价值的合计值；权益类多头头寸的价值是指买入持有的股票市值、买入股指期货的合约价值及买入其他权益类衍生工具的合约价值的合计值。每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的95%。在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为：中国人民银行公布的一年期定期存款基准利率（税后）+3%（如遇中国人民银行就该等基准利率进行调整则作相应调整）。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日止会计期间内的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。会计估计变更请详见 6.4.5.2 的说明。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

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

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的差错更正事项。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

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

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

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

6.4.6.2 营业税、企业所得税

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

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

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

6.4.6.3 个人所得税

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题

的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号《财政部国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
活期存款	210,395,856.57
定期存款	8,900,000,000.00
其中：存款期限 1-3 个月	8,900,000,000.00
其他存款	-
合计：	9,110,395,856.57

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	1,379,017,209.64	1,446,889,290.31	67,872,080.67	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	602,409,530.00	604,660,000.00	2,250,470.00
	合计	602,409,530.00	604,660,000.00	2,250,470.00
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	1,981,426,739.64	2,051,549,290.31	70,122,550.67	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

在当日无负债结算制度下，结算备付金已包括本基金于 2015 年 6 月 30 日所有的股指期货合约产生的持仓损益金额。因此衍生金融工具项下的股指期货投资按抵销后的净额列示，为人民币零元。于 2015 年 6 月 30 日，报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细请见 7.10.1 报告期

末本基金投资的股指期货持仓和损益明细。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	4,038,127,028.18	-
合计	4,038,127,028.18	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本期末无买断式逆回购交易，也无在买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应收活期存款利息	26,425.87
应收定期存款利息	7,733,333.36
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	951,627.50
应收债券利息	12,044,722.03
应收买入返售证券利息	678,836.27
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	869.60
合计	21,435,814.63

注：“其他”为应收结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
交易所市场应付交易费用	7,483,359.80
银行间市场应付交易费用	51,942.10
合计	7,535,301.90

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	24,222.95
预提信息披露费	148,765.71
预提审计费	39,671.58
预提账户维护费	9,000.00
合计	221,660.24

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

工银绝对收益混合发起 A		
项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	245,011,756.25	245,011,756.25
本期申购	8,354,438,181.56	8,354,438,181.56
本期赎回(以“-”号填列)	-494,628,418.61	-494,628,418.61
本期末	8,104,821,519.20	8,104,821,519.20

金额单位：人民币元

工银绝对收益混合发起 B		
项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	266,760,553.97	266,760,553.97
本期申购	16,693,512,740.98	16,693,512,740.98
本期赎回(以“-”号填列)	-10,646,522,278.97	-10,646,522,278.97
本期末	6,313,751,015.98	6,313,751,015.98

注：“本期申购”中包含红利再投、转入份额及金额，“本期赎回”中包含转出份额及金额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

工银绝对收益混合发起 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-13,614,467.67	16,176,209.81	2,561,742.14
本期利润	199,623,686.17	-20,067,525.09	179,556,161.08
本期基金份额交易产生的变动数	535,975,104.92	261,656,976.44	797,632,081.36

其中：基金申购款	554,654,022.91	274,855,146.94	829,509,169.85
基金赎回款	-18,678,917.99	-13,198,170.50	-31,877,088.49
本期已分配利润	-	-	-
本期末	721,984,323.42	257,765,661.16	979,749,984.58

单位：人民币元

工银绝对收益混合发起 B			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-16,319,854.60	17,524,732.98	1,204,878.38
本期利润	354,251,780.39	176,885,416.97	531,137,197.36
本期基金份额交易产生的变动数	135,493,389.68	5,336,645.80	140,830,035.48
其中：基金申购款	641,395,839.61	320,940,641.21	962,336,480.82
基金赎回款	-505,902,449.93	-315,603,995.41	-821,506,445.34
本期已分配利润	-	-	-
本期末	473,425,315.47	199,746,795.75	673,172,111.22

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	2,440,114.85
定期存款利息收入	50,329,150.03
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	8,992,015.21
其他	9,270.42
合计	61,770,550.51

注：“其他”为结算保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	5,360,182,177.93
减：卖出股票成本总额	4,671,863,265.06
买卖股票差价收入	688,318,912.87

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

本基金本报告期间无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期间无贵金属投资收益。

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

本基金本报告期无买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	-127,770,514.53

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	5,789,964.83
基金投资产生的股利收益	-
合计	5,789,964.83

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	4,876,017.35
——股票投资	2,573,017.35
——债券投资	2,303,000.00
——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	151,941,874.53
合计	156,817,891.88

注：“其他”为股指期货公允价值变动损益。

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	2,822,816.40
基金转换费收入	783,122.15
合计	3,605,938.55

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	15,586,309.76
银行间市场交易费用	2,900.00
合计	15,589,209.76

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
审计费用	39,671.58
信息披露费	148,765.71
账户维护费	13,500.00
其他	400.00
银行费用	31,970.90
合计	234,308.19

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
工银瑞信基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金管理人股东、基金销售机构
工银瑞信新瑞分级资产管理计划	基金管理人子公司控制的结构化主体

注：1、本报告期本基金关联方未发生变化。

2、以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易**

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6 月30日	上年度可比期间 2014年6月26日(基金合同生效日) 至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	57,058,609.21	249,286.91
其中：支付销售机构的客户维护费	2,039,285.63	-

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

基金管理费每日计提，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6 月30日	上年度可比期间 2014年6月26日(基金合同生效日) 至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	9,509,768.21	41,547.83

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

基金托管费每日计提，按月支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	工银绝对收益混合发起 A	工银绝对收益混合发起 B	合计
工银瑞信基金管理有限公司	-	22,677,619.91	22,677,619.91
中国工商银行股份有限公司	-	630,522.35	630,522.35
交通银行股份有限公司	-	163,365.37	163,365.37
合计	-	23,471,507.63	23,471,507.63
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2014 年 6 月 26 日(基金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	工银绝对收益混合发起 A	工银绝对收益混合发起 B	合计
合计	-	-	-

注：基金销售服务费每日计提，按月支付。本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，B 类基金份额的销售服务费年费率为 0.80%。计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% / \text{当年天数}$$

H 为 B 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 B 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，按月支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

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

	工银绝对收益混合发起 A	工银绝对收益混合发起 B
基金合同生效日（2014年6月26日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	9,002,960.00	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	9,002,960.00	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.11%	-

项目	上年度可比期间	
	2014年6月26日(基金合同生效日)至2014年6月30日	
	工银绝对收益混合发起 A	工银绝对收益混合发起 B
基金合同生效日（2014年6月26日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	9,002,960.00	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	9,002,960.00	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.74%	-

注：1、基金管理人持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付；
2、期间申购/买入总份额：含红利再投、转换入份额；期间赎回/卖出总份额：含转换出份额；
3、根据《工银瑞信绝对收益策略混合型发起式证券投资基金招募说明书》的规定，发起资金认购本基金的金额不少于人民币 1,000 万元，且发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。2014 年 6 月 26 日（基金合同生效日），工银瑞信基金管理有限公司运用自有资金作为发起资金认购的本基金份额为 9,002,960.00 份，占本基金份额总量的 0.59%；

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

新瑞分级资管计划在本报告期间持有基金份额 48,496,605.24 份，截止本报告期末，已全部赎回，不再持有本基金份额，相关费率适用市场公开费率。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2014 年 6 月 26 日 (基金合同生效日) 至 2014 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	210,395,856.57	2,440,114.85	6,472,591.69	121,447.25

注：1、本半年度末余额仅为活期存款，利息收入仅为活期存款利息收入。

2、上年度可比期末余额仅为活期存款，利息收入仅为活期存款利息收入。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 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
300471	厚普股份	2015 年 6 月 5 日	2016 年 6 月 13 日	网下新股自愿锁定	54.01	126.41	467,828	25,267,390.28	59,138,137.48	-
300463	迈克生物	2015 年 5 月 21 日	2016 年 5 月 30 日	网下新股自愿锁定	27.96	87.76	233,333	6,523,990.68	20,477,304.08	-
300406	九强生物	2014 年 10 月 27 日	2015 年 10 月 30 日	网下新股自愿锁定	14.32	46.82	432,682	3,098,003.12	20,258,171.24	-
300443	金雷风电	2015 年 4 月 16 日	2016 年 4 月 22 日	网下新股自愿锁定	31.94	145.98	65,566	2,094,178.04	9,571,324.68	-
300436	广生堂	2015 年 4 月 16 日	2016 年 4 月 22 日	网下新股自愿锁定	21.47	149.39	47,297	1,015,466.59	7,065,698.83	-
300489	中飞	2015 年 6 月 5 日	2015 年 6 月 5 日	新股流通受限	17.56	17.56	7,319	128,521.64	128,521.64	-

	股份	月 24 日	7 月 1 日	限						
--	----	--------	---------	---	--	--	--	--	--	--

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002329	皇氏集团	2015年6月12日	重大事项	57.76	2015年8月13日	62.53	624,867	32,287,699.26	36,092,317.92	指数法估值
601633	长城汽车	2015年6月19日	重大事项	42.76	2015年7月13日	38.05	808,056	41,031,502.17	34,552,474.56	-
300228	富瑞特装	2015年6月24日	重大事项	79.76	2015年7月30日	81.82	329,929	33,516,333.50	26,315,137.04	指数法估值
600410	华胜天成	2015年5月28日	重大事项	34.36	2015年7月22日	43.06	581,900	24,131,082.48	19,994,084.00	指数法估值
300353	东土科技	2015年6月3日	重大事项	57.79	-	-	179,800	10,645,688.60	10,390,642.00	指数法估值
002558	世纪游轮	2014年10月27日	重大事项	57.38	-	-	76,000	2,404,255.01	4,360,880.00	指数法估值
300056	三维丝	2015年6月5日	重大事项	35.79	-	-	100,000	3,086,923.98	3,579,000.00	指数法估值
300161	华中数控	2015年5月22日	重大事项	30.28	-	-	100,000	2,871,000.00	3,028,000.00	指数法估值
300377	赢时胜	2015年5月20日	重大事项	145.51	2015年7月15日	168.99	19,793	2,567,519.19	2,880,079.43	指数法估值
002353	杰瑞股份	2015年5月27日	重大事项	44.35	-	-	39,500	1,575,909.70	1,751,825.00	-
000672	上峰水泥	2015年6月3日	重大事项	12.05	-	-	128,700	1,396,288.74	1,550,835.00	-

000716	黑芝麻	2015年6月8日	重大事项	23.69	2015年8月3日	21.32	59,400	1,413,125.31	1,407,186.00	-
000917	电广传媒	2015年5月28日	重大事项	30.81	-	-	43,800	1,616,865.00	1,349,478.00	指数法估值
000793	华闻传媒	2015年5月26日	重大事项	20.75	-	-	59,100	1,216,027.00	1,226,325.00	-
002116	中国海诚	2015年4月23日	重大事项	19.21	2015年7月24日	21.13	60,970	1,103,121.07	1,171,233.70	-
000592	平潭发展	2015年6月30日	重大事项	29.76	2015年7月14日	30.00	39,045	844,869.77	1,161,979.20	-
300467	迅游科技	2015年6月25日	重大事项	297.30	2015年7月2日	267.57	3,726	125,752.50	1,107,739.80	-
002368	太极股份	2015年5月14日	重大事项	65.52	-	-	15,000	941,547.00	982,800.00	-
002416	爱施德	2015年5月5日	重大事项	20.67	2015年7月29日	18.60	39,300	777,549.00	812,331.00	-
600277	亿利能源	2015年6月1日	重大事项	14.62	-	-	52,600	679,219.00	769,012.00	-
002310	东方园林	2015年5月27日	重大事项	38.30	-	-	19,100	688,268.00	731,530.00	-
002649	博彦科技	2015年6月1日	重大事项	83.81	2015年8月18日	75.43	8,500	713,228.00	712,385.00	-
000024	招商地产	2015年4月3日	重大事项	36.51	-	-	18,390	521,785.06	671,418.90	指数法估值
002464	金利科技	2015年1月26日	重大事项	16.14	2015年7月28日	17.75	39,930	718,240.95	644,470.20	-
000878	云南铜业	2015年6月8日	重大事项	18.53	-	-	33,821	590,506.55	626,703.13	指数法估值
600461	洪城水业	2015年2月	重大事项	13.10	2015年8月	11.66	44,633	508,956.52	584,692.30	-

		26 日			26 日					
000708	大冶特钢	2015 年 5 月 13 日	重大事项	13.92	-	-	28,200	383,588.12	392,544.00	-
600886	国投电力	2015 年 6 月 24 日	重大事项	14.87	-	-	22,096	305,040.31	328,567.52	-
300195	长荣股份	2015 年 6 月 23 日	重大事项	31.96	2015 年 8 月 24 日	28.76	7,300	262,335.00	233,308.00	-
000429	粤高速 A	2015 年 4 月 8 日	重大事项	6.42	2015 年 7 月 22 日	7.06	33,787	161,964.36	216,912.54	-
600595	中孚实业	2015 年 5 月 22 日	重大事项	10.19	2015 年 7 月 23 日	9.17	16,300	149,082.00	166,097.00	-
000862	银星能源	2015 年 5 月 21 日	重大事项	11.81	2015 年 8 月 18 日	11.22	13,400	146,114.00	158,254.00	-
601111	中国国航	2015 年 6 月 30 日	重大事项	15.36	2015 年 7 月 29 日	13.78	7,678	96,449.78	117,934.08	-
002110	三钢闽光	2015 年 4 月 2 日	重大事项	9.61	-	-	10,500	85,815.00	100,905.00	-
002194	武汉凡谷	2015 年 6 月 18 日	重大事项	26.98	2015 年 7 月 24 日	24.28	3,475	66,698.53	93,755.50	-
002671	龙泉股份	2015 年 6 月 17 日	重大事项	23.89	-	-	3,662	57,085.37	87,485.18	-
002002	鸿达兴业	2015 年 6 月 18 日	重大事项	39.30	-	-	2,061	41,318.94	80,997.30	-
600335	国机汽车	2015 年 6 月 15 日	重大事项	37.93	2015 年 7 月 21 日	34.14	2,076	67,675.44	78,742.68	-
000963	华东医药	2015 年 6 月 26 日	重大事项	71.48	2015 年 8 月 5 日	69.20	1,057	77,139.09	75,554.36	-
600641	万业企业	2015 年 6 月 12 日	重大事项	11.23	-	-	6,664	66,113.22	74,836.72	-
000761	本钢	2015	重大	7.75	2015	6.93	8,678	65,906.21	67,254.50	-

	板材	年 6 月 23 日	事项		年 7 月 21 日					
002268	卫 士 通	2015 年 5 月 8 日	重大 事项	80.14	2015 年 8 月 4 日	76.32	661	43,822.17	52,972.54	指数法 估值
002557	洽洽 食品	2015 年 6 月 29 日	重大 事项	16.38	2015 年 8 月 24 日	14.74	3,060	63,802.93	50,122.80	-
300431	暴风 科技	2015 年 6 月 11 日	重大 事项	211.45	2015 年 7 月 13 日	276.80	205	1,463.70	43,347.25	指数法 估值
600395	盘江 股份	2015 年 6 月 9 日	重大 事项	15.71	2015 年 8 月 19 日	14.00	2,226	29,187.19	34,970.46	-
002662	京威 股份	2015 年 5 月 15 日	重大 事项	17.84	2015 年 8 月 13 日	16.06	82	1,528.56	1,462.88	-
300071	华谊 嘉信	2015 年 5 月 21 日	重大 事项	13.66	-	-	92	1,027.50	1,256.72	-
000932	华菱 钢铁	2015 年 5 月 14 日	重大 事项	4.71	2015 年 7 月 16 日	4.24	148	654.55	697.08	-
600900	长江 电力	2015 年 6 月 15 日	重大 事项	14.35	-	-	14	187.44	200.90	-

注：本基金因重大事项停牌的股票中包含按指数收益法确定公允价值的长期停牌股票，该类股票估值采用中国证券业协会基金估值小组提供的估值方法，并于 2015 年 6 月 30 日对资产净值和本期净利润的影响均为人民币-25,179,405.11 元。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

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

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，

因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

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

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

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

6.4.13.3 流动性风险

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

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

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

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015年6 月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年 以上	不计息	合计
资产							
银行存款	9,110,395,856.57	-	-	-	-	-	9,110,395,856.57
结算备付 金	924,140,759.66	-	-	-	-	-	924,140,759.66
存出保证 金	121,774,491.23	-	-	-	-	-	121,774,491.23
交易性金 融资产	30,015,000.00	10,037,000.00	564,608,000.00	-	-	-1,446,889,290.31	2,051,549,290.31
买入返售 金融资产	4,038,127,028.18	-	-	-	-	-	4,038,127,028.18
应收利息	-	-	-	-	-	21,435,814.63	21,435,814.63
应收申购 款	-	-	-	-	-	170,325,418.41	170,325,418.41
资产总计	14,224,453,135.64	10,037,000.00	564,608,000.00	-	-	-1,638,650,523.35	16,437,748,658.99
负债							
应付证券 清算款	-	-	-	-	-	161,844,887.68	161,844,887.68
应付赎回 款	-	-	-	-	-	174,829,585.07	174,829,585.07
应付管理 人报酬	-	-	-	-	-	15,540,061.29	15,540,061.29
应付托管 费	-	-	-	-	-	2,590,010.22	2,590,010.22
应付销售 服务费	-	-	-	-	-	3,692,521.61	3,692,521.61
应付交易 费用	-	-	-	-	-	7,535,301.90	7,535,301.90
其他负债	-	-	-	-	-	221,660.24	221,660.24
负债总计	-	-	-	-	-	366,254,028.01	366,254,028.01
利率敏感 度缺口	14,224,453,135.64	10,037,000.00	564,608,000.00	-	-	-1,272,396,495.34	16,071,494,630.98
上年度末 2014年12 月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年 以上	不计息	合计
资产							

银行存款	13,925,971.99	-	-	-	-	13,925,971.99
结算备付金	12,310,177.21	-	-	-	-	12,310,177.21
存出保证金	33,716,258.68	-	-	-	-	33,716,258.68
交易性金融资产	-	40,035,000.00	-	-	384,522,068.76	424,557,068.76
买入返售金融资产	52,000,000.00	-	-	-	-	52,000,000.00
应收利息	-	-	-	-	756,675.71	756,675.71
应收申购款	-	-	-	-	487,299.57	487,299.57
资产总计	111,952,407.88	40,035,000.00	-	-	385,766,044.04	537,753,451.92
负债	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	7,234,320.36	7,234,320.36
应付赎回款	-	-	-	-	10,569,772.61	10,569,772.61
应付管理人报酬	-	-	-	-	730,115.67	730,115.67
应付托管费	-	-	-	-	121,685.95	121,685.95
应付销售服务费	-	-	-	-	198,880.04	198,880.04
应付交易费用	-	-	-	-	3,304,703.92	3,304,703.92
其他负债	-	-	-	-	55,042.63	55,042.63
负债总计	-	-	-	-	22,214,521.18	22,214,521.18
利率敏感度缺口	111,952,407.88	40,035,000.00	-	-	363,551,522.86	515,538,930.74

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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）	
		本期末（2015 年 6 月 30 日）	上年度末（2014 年 12 月 31 日）
	利率增加 25 基准点	-780,479.45	-56,277.09
利率减少 25 基准点	782,630.33	56,435.37	

6.4.13.4.2 外汇风险

无。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日		上年度末 2014年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比 例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,446,889,290.31	9.00	384,522,068.76	74.59
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	604,660,000.00	3.76	40,035,000.00	7.77
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	2,051,549,290.31	12.77	424,557,068.76	82.35

注：1. 本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板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、股指期货，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

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

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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

		本期末（2015年6月30日）	上年度末（2014年12月31日）
	业绩比较基准增加 5%	335,543,169.01	-1,031,077.86
	业绩比较基准减少 5%	-335,543,169.01	1,031,077.86

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,446,889,290.31	8.80
	其中：股票	1,446,889,290.31	8.80
2	固定收益投资	604,660,000.00	3.68
	其中：债券	604,660,000.00	3.68
	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	4,038,127,028.18	24.57
	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	10,034,536,616.23	61.05
7	其他各项资产	313,535,724.27	1.91
8	合计	16,437,748,658.99	100.00

注：由于四舍五入的原因金额占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	5,127,030.72	0.03
B	采矿业	5,524,931.76	0.03
C	制造业	716,714,318.17	4.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	22,091,802.17	0.14

E	建筑业	8,719,417.70	0.05
F	批发和零售业	25,203,968.61	0.16
G	交通运输、仓储和邮政业	3,270,019.29	0.02
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	158,426,761.18	0.99
J	金融业	460,881,144.07	2.87
K	房地产业	2,902,185.18	0.02
L	租赁和商务服务业	1,623,585.83	0.01
M	科学研究和技术服务业	1,589,611.19	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	26,073,003.62	0.16
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	68,100.86	0.00
R	文化、体育和娱乐业	1,293,707.70	0.01
S	综合	7,379,702.26	0.05
	合计	1,446,889,290.31	9.00

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

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601211	国泰君安	4,553,927	156,381,853.18	0.97
2	300471	厚普股份	467,828	59,138,137.48	0.37
3	600015	华夏银行	3,560,341	54,152,786.61	0.34
4	601166	兴业银行	2,517,573	43,428,134.25	0.27
5	300059	东方财富	676,181	42,660,259.29	0.27
6	600761	安徽合力	2,549,659	42,655,795.07	0.27
7	300285	国瓷材料	1,186,348	42,352,623.60	0.26
8	601058	赛轮金宇	3,785,188	42,204,846.20	0.26
9	600597	光明乳业	1,696,101	39,010,323.00	0.24
10	000001	平安银行	2,621,078	38,110,474.12	0.24
11	601009	南京银行	1,609,600	36,698,880.00	0.23
12	002329	皇氏集团	624,867	36,092,317.92	0.22
13	603022	新通联	774,420	35,468,436.00	0.22
14	600536	中国软件	984,385	34,925,979.80	0.22

15	601633	长城汽车	808,056	34,552,474.56	0.21
16	300452	山河药辅	385,471	33,805,806.70	0.21
17	000750	国海证券	1,924,749	32,335,783.20	0.20
18	000538	云南白药	331,137	28,567,188.99	0.18
19	300228	富瑞特装	329,929	26,315,137.04	0.16
20	000568	泸州老窖	682,178	22,245,824.58	0.14
21	600694	大商股份	399,824	22,102,270.72	0.14
22	000605	渤海股份	800,000	20,640,000.00	0.13
23	300463	迈克生物	233,333	20,477,304.08	0.13
24	300406	九强生物	432,682	20,258,171.24	0.13
25	600410	华胜天成	581,900	19,994,084.00	0.12
26	600749	西藏旅游	1,036,532	19,683,742.68	0.12
27	300462	华铭智能	342,299	19,298,817.62	0.12
28	600030	中信证券	624,600	16,807,986.00	0.10
29	000423	东阿阿胶	249,200	13,581,400.00	0.08
30	600446	金证股份	100,465	12,403,408.90	0.08
31	000776	广发证券	534,249	12,100,739.85	0.08
32	600309	万华化学	500,037	12,090,894.66	0.08
33	600369	西南证券	614,158	12,068,204.70	0.08
34	600570	恒生电子	103,149	11,557,845.45	0.07
35	000858	五粮液	360,002	11,412,063.40	0.07
36	002185	华天科技	600,000	10,812,000.00	0.07
37	000895	双汇发展	503,732	10,744,603.56	0.07
38	002664	信质电机	291,650	10,502,316.50	0.07
39	601318	中国平安	128,004	10,488,647.76	0.07
40	300353	东土科技	179,800	10,390,642.00	0.06
41	600000	浦发银行	588,300	9,977,568.00	0.06
42	300443	金雷风电	67,577	9,864,890.46	0.06
43	300329	海伦钢琴	270,578	9,470,230.00	0.06
44	600276	恒瑞医药	202,338	9,012,134.52	0.06
45	600590	泰豪科技	500,000	8,685,000.00	0.05
46	300033	同花顺	100,000	8,599,000.00	0.05
47	600179	黑化股份	500,000	8,270,000.00	0.05
48	002439	启明星辰	226,436	7,766,754.80	0.05
49	600455	博通股份	149,933	7,379,702.26	0.05
50	600036	招商银行	392,189	7,341,778.08	0.05
51	600031	三一重工	741,481	7,184,950.89	0.04
52	300436	广生堂	47,297	7,065,698.83	0.04
53	002153	石基信息	54,253	7,052,347.47	0.04

54	601288	农业银行	1,462,003	5,424,031.13	0.03
55	600016	民生银行	523,633	5,204,912.02	0.03
56	600066	宇通客车	245,176	5,038,366.80	0.03
57	002139	拓邦股份	200,000	4,666,000.00	0.03
58	002558	世纪游轮	76,000	4,360,880.00	0.03
59	600837	海通证券	180,800	3,941,440.00	0.02
60	601766	中国中车	208,983	3,836,927.88	0.02
61	002582	好想你	129,949	3,789,312.84	0.02
62	002458	益生股份	144,575	3,779,190.50	0.02
63	300056	三维丝	100,000	3,579,000.00	0.02
64	300161	华中数控	100,000	3,028,000.00	0.02
65	002330	得利斯	250,000	3,002,500.00	0.02
66	300377	赢时胜	19,793	2,880,079.43	0.02
67	601668	中国建筑	340,600	2,830,386.00	0.02
68	601989	中国重工	172,600	2,554,480.00	0.02
69	600887	伊利股份	134,600	2,543,940.00	0.02
70	601169	北京银行	190,000	2,530,800.00	0.02
71	601988	中国银行	517,400	2,530,086.00	0.02
72	601818	光大银行	446,600	2,393,776.00	0.01
73	600519	贵州茅台	9,117	2,348,995.05	0.01
74	601601	中国太保	76,935	2,321,898.30	0.01
75	601390	中国中铁	152,600	2,089,094.00	0.01
76	601006	大秦铁路	148,065	2,078,832.60	0.01
77	603588	高能环境	25,000	1,881,750.00	0.01
78	600048	保利地产	157,724	1,801,208.08	0.01
79	002353	杰瑞股份	39,500	1,751,825.00	0.01
80	600028	中国石化	233,910	1,651,404.60	0.01
81	300430	诚益通	19,791	1,647,996.57	0.01
82	600104	上汽集团	71,600	1,618,160.00	0.01
83	300447	全信股份	19,471	1,616,093.00	0.01
84	000672	上峰水泥	128,700	1,550,835.00	0.01
85	600999	招商证券	54,800	1,450,008.00	0.01
86	000716	黑芝麻	59,400	1,407,186.00	0.01
87	600050	中国联通	189,600	1,389,768.00	0.01
88	000917	电广传媒	43,800	1,349,478.00	0.01
89	600518	康美药业	74,562	1,321,984.26	0.01
90	601628	中国人寿	41,480	1,299,153.60	0.01
91	601857	中国石油	114,000	1,291,620.00	0.01
92	601901	方正证券	105,453	1,253,836.17	0.01

93	603918	金桥信息	22,476	1,249,665.60	0.01
94	000793	华闻传媒	59,100	1,226,325.00	0.01
95	002116	中国海诚	60,970	1,171,233.70	0.01
96	601186	中国铁建	74,417	1,163,137.71	0.01
97	000592	平潭发展	39,045	1,161,979.20	0.01
98	600109	国金证券	46,400	1,132,160.00	0.01
99	600010	包钢股份	216,800	1,125,192.00	0.01
100	300467	迅游科技	3,726	1,107,739.80	0.01
101	600585	海螺水泥	50,885	1,091,483.25	0.01
102	300145	南方泵业	24,600	1,081,170.00	0.01
103	002056	横店东磁	34,500	1,079,160.00	0.01
104	600637	东方明珠	25,400	1,068,832.00	0.01
105	300468	四方精创	12,309	1,059,804.90	0.01
106	601088	中国神华	50,462	1,052,132.70	0.01
107	600582	天地科技	61,400	1,049,326.00	0.01
108	300037	新宙邦	26,804	1,025,789.08	0.01
109	600690	青岛海尔	33,400	1,013,022.00	0.01
110	002368	太极股份	15,000	982,800.00	0.01
111	002572	索菲亚	24,900	961,887.00	0.01
112	300428	四通新材	17,602	910,023.40	0.01
113	603338	浙江鼎力	6,524	900,246.76	0.01
114	603300	华铁科技	36,734	895,942.26	0.01
115	600150	中国船舶	17,200	885,800.00	0.01
116	600089	特变电工	59,200	876,752.00	0.01
117	603108	润达医疗	11,800	844,644.00	0.01
118	600111	北方稀土	46,400	841,696.00	0.01
119	002416	爱施德	39,300	812,331.00	0.01
120	603901	永创智能	17,857	803,565.00	0.00
121	600583	海油工程	47,400	789,684.00	0.00
122	002757	南兴装备	20,194	786,556.30	0.00
123	600277	亿利能源	52,600	769,012.00	0.00
124	300453	三鑫医疗	13,540	736,576.00	0.00
125	300342	天银机电	20,000	733,000.00	0.00
126	002310	东方园林	19,100	731,530.00	0.00
127	600958	东方证券	25,400	726,948.00	0.00
128	603598	引力传媒	12,955	726,386.85	0.00
129	603311	金海环境	27,720	720,165.60	0.00
130	002755	东方新星	18,240	719,932.80	0.00
131	002649	博彦科技	8,500	712,385.00	0.00

132	002759	天际股份	19,259	709,116.38	0.00
133	601800	中国交建	40,219	706,245.64	0.00
134	600256	广汇能源	67,800	705,120.00	0.00
135	600406	国电南瑞	33,800	699,322.00	0.00
136	000024	招商地产	18,390	671,418.90	0.00
137	600893	中航动力	12,600	669,690.00	0.00
138	300442	普丽盛	9,841	653,343.99	0.00
139	002464	金利科技	39,930	644,470.20	0.00
140	000878	云南铜业	33,821	626,703.13	0.00
141	002758	华通医药	8,694	625,968.00	0.00
142	603023	威帝股份	12,579	587,942.46	0.00
143	600461	洪城水业	44,633	584,692.30	0.00
144	300449	汉邦高科	5,823	580,553.10	0.00
145	601998	中信银行	75,200	579,792.00	0.00
146	603026	石大胜华	24,000	552,960.00	0.00
147	300466	赛摩电气	13,888	536,910.08	0.00
148	300429	强力新材	4,244	517,810.44	0.00
149	300438	鹏辉能源	7,118	491,853.80	0.00
150	600018	上港集团	60,000	474,600.00	0.00
151	300404	博济医药	4,031	418,377.49	0.00
152	002773	康弘药业	17,338	411,430.74	0.00
153	002081	金螳螂	14,399	405,907.81	0.00
154	000708	大冶特钢	28,200	392,544.00	0.00
155	300465	高伟达	4,000	365,200.00	0.00
156	600886	国投电力	22,096	328,567.52	0.00
157	300435	中泰股份	4,349	235,715.80	0.00
158	300195	长荣股份	7,300	233,308.00	0.00
159	000651	格力电器	3,641	232,659.90	0.00
160	300369	绿盟科技	4,299	219,249.00	0.00
161	000429	粤高速 A	33,787	216,912.54	0.00
162	300486	东杰智能	16,092	207,104.04	0.00
163	002264	新华都	20,599	192,600.65	0.00
164	300482	万孚生物	7,942	182,983.68	0.00
165	600595	中孚实业	16,300	166,097.00	0.00
166	000862	银星能源	13,400	158,254.00	0.00
167	601939	建设银行	19,975	142,421.75	0.00
168	300489	中飞股份	7,319	128,521.64	0.00
169	002771	真视通	6,251	126,520.24	0.00
170	600383	金地集团	9,866	124,804.90	0.00

171	000157	中联重科	15,145	122,825.95	0.00
172	601111	中国国航	7,678	117,934.08	0.00
173	600019	宝钢股份	12,835	112,177.90	0.00
174	600027	华电国际	9,592	106,663.04	0.00
175	000039	中集集团	3,215	103,844.50	0.00
176	002110	三钢闽光	10,500	100,905.00	0.00
177	600009	上海机场	3,137	99,442.90	0.00
178	600315	上海家化	2,200	95,480.00	0.00
179	002304	洋河股份	1,372	95,161.92	0.00
180	002194	武汉凡谷	3,475	93,755.50	0.00
181	600674	川投能源	7,416	92,774.16	0.00
182	300451	创业软件	483	91,760.34	0.00
183	002671	龙泉股份	3,662	87,485.18	0.00
184	600398	海澜之家	4,589	83,198.57	0.00
185	600271	航天信息	1,277	82,634.67	0.00
186	002002	鸿达兴业	2,061	80,997.30	0.00
187	600011	华能国际	5,699	79,956.97	0.00
188	600335	国机汽车	2,076	78,742.68	0.00
189	000966	长源电力	3,948	78,130.92	0.00
190	002129	中环股份	3,900	77,181.00	0.00
191	000963	华东医药	1,057	75,554.36	0.00
192	600325	华发股份	4,168	75,440.80	0.00
193	000957	中通客车	3,112	75,092.56	0.00
194	300446	乐凯新材	624	74,898.72	0.00
195	600641	万业企业	6,664	74,836.72	0.00
196	601607	上海医药	3,354	74,693.58	0.00
197	601117	中国化学	7,483	73,183.74	0.00
198	002234	民和股份	4,559	72,396.92	0.00
199	600298	安琪酵母	2,048	71,229.44	0.00
200	600826	兰生股份	1,764	68,143.32	0.00
201	300015	爱尔眼科	2,111	68,100.86	0.00
202	601801	皖新传媒	2,310	67,382.70	0.00
203	000761	本钢板材	8,678	67,254.50	0.00
204	000915	山大华特	1,198	67,088.00	0.00
205	600162	香江控股	5,712	67,001.76	0.00
206	002449	国星光电	3,004	66,088.00	0.00
207	002287	奇正藏药	1,695	65,613.45	0.00
208	002039	黔源电力	3,137	64,873.16	0.00
209	600723	首商股份	5,252	64,757.16	0.00

210	601000	唐山港	4,710	64,479.90	0.00
211	000550	江铃汽车	1,742	63,931.40	0.00
212	002068	黑猫股份	6,392	62,769.44	0.00
213	600488	天药股份	6,439	62,393.91	0.00
214	600054	黄山旅游	2,802	62,288.46	0.00
215	000521	美菱电器	6,879	62,048.58	0.00
216	002508	老板电器	1,615	61,951.40	0.00
217	600141	兴发集团	3,562	61,373.26	0.00
218	000822	山东海化	6,874	60,972.38	0.00
219	002126	银轮股份	3,021	60,903.36	0.00
220	002205	国统股份	2,209	60,482.42	0.00
221	600004	白云机场	3,555	60,079.50	0.00
222	000885	同力水泥	3,576	60,076.80	0.00
223	600354	敦煌种业	5,275	60,029.50	0.00
224	000888	峨眉山 A	4,007	59,824.51	0.00
225	002028	思源电气	3,243	59,671.20	0.00
226	600295	鄂尔多斯	4,959	59,508.00	0.00
227	002478	常宝股份	3,608	59,135.12	0.00
228	601678	滨化股份	6,569	58,923.93	0.00
229	000531	穗恒运 A	4,190	58,660.00	0.00
230	002032	苏泊尔	2,344	57,685.84	0.00
231	600323	瀚蓝环境	3,315	57,283.20	0.00
232	002484	江海股份	2,409	57,093.30	0.00
233	600791	京能置业	4,915	56,866.55	0.00
234	002350	北京科锐	2,474	56,852.52	0.00
235	002419	天虹商场	3,331	56,627.00	0.00
236	600697	欧亚集团	1,827	56,600.46	0.00
237	002324	普利特	1,607	55,762.90	0.00
238	600081	东风科技	2,629	55,761.09	0.00
239	601788	光大证券	2,041	55,004.95	0.00
240	601677	明泰铝业	3,359	54,986.83	0.00
241	002490	山东墨龙	4,564	54,813.64	0.00
242	600195	中牧股份	1,940	54,514.00	0.00
243	600897	厦门空港	1,772	54,240.92	0.00
244	600987	航民股份	3,984	54,023.04	0.00
245	000501	鄂武商 A	2,633	53,976.50	0.00
246	000713	丰乐种业	3,763	53,434.60	0.00
247	600717	天津港	3,536	53,004.64	0.00
248	002268	卫士通	661	52,972.54	0.00

249	600386	北巴传媒	3,143	51,105.18	0.00
250	002563	森马服饰	2,114	51,074.24	0.00
251	600708	海博股份	3,893	50,492.21	0.00
252	002408	齐翔腾达	2,925	50,134.50	0.00
253	002557	洽洽食品	3,060	50,122.80	0.00
254	600686	金龙汽车	1,945	50,064.30	0.00
255	600486	扬农化工	1,353	48,680.94	0.00
256	002580	圣阳股份	2,733	48,483.42	0.00
257	600750	江中药业	1,505	48,445.95	0.00
258	002521	齐峰新材	3,367	46,868.64	0.00
259	002035	华帝股份	2,934	46,503.90	0.00
260	600976	健民集团	1,350	45,954.00	0.00
261	300258	精锻科技	2,880	44,784.00	0.00
262	300431	暴风科技	205	43,347.25	0.00
263	300412	迦南科技	960	36,355.20	0.00
264	600395	盘江股份	2,226	34,970.46	0.00
265	002391	长青股份	1,573	31,397.08	0.00
266	300017	网宿科技	673	31,240.66	0.00
267	600823	世茂股份	2,349	30,607.47	0.00
268	300379	东方通	325	26,120.25	0.00
269	000826	桑德环境	349	13,572.61	0.00
270	000802	北京文化	376	10,945.36	0.00
271	002230	科大讯飞	309	10,796.46	0.00
272	600199	金种子酒	617	8,638.00	0.00
273	000060	中金岭南	437	8,123.83	0.00
274	002501	利源精制	449	7,175.02	0.00
275	000977	浪潮信息	184	5,437.20	0.00
276	300456	耐威科技	42	4,806.48	0.00
277	000333	美的集团	72	2,684.16	0.00
278	002662	京威股份	82	1,462.88	0.00
279	300071	华谊嘉信	92	1,256.72	0.00
280	000728	国元证券	28	1,063.44	0.00
281	601336	新华保险	16	976.96	0.00
282	000932	华菱钢铁	148	697.08	0.00
283	000050	深天马 A	28	657.16	0.00
284	000553	沙隆达 A	34	541.62	0.00
285	600742	一汽富维	16	487.68	0.00
286	600900	长江电力	14	200.90	0.00
287	000418	小天鹅 A	5	119.50	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300059	东方财富	140,572,557.58	27.27
2	601318	中国平安	113,150,367.02	21.95
3	600015	华夏银行	107,112,331.27	20.78
4	601166	兴业银行	104,986,050.72	20.36
5	600030	中信证券	96,681,779.91	18.75
6	601211	国泰君安	89,757,901.17	17.41
7	600016	民生银行	82,199,130.63	15.94
8	300285	国瓷材料	78,357,781.94	15.20
9	000001	平安银行	76,776,885.95	14.89
10	600036	招商银行	76,093,361.53	14.76
11	600536	中国软件	69,602,099.28	13.50
12	600958	东方证券	62,323,771.15	12.09
13	600000	浦发银行	58,048,532.15	11.26
14	000750	国海证券	57,904,794.34	11.23
15	002329	皇氏集团	57,827,909.43	11.22
16	300443	金雷风电	56,543,422.18	10.97
17	601288	农业银行	54,666,221.00	10.60
18	600037	歌华有线	52,816,418.08	10.24
19	601633	长城汽车	52,365,111.97	10.16
20	601058	赛轮金宇	52,351,694.96	10.15
21	603022	新通联	51,038,266.12	9.90
22	000568	泸州老窖	49,800,000.85	9.66
23	600761	安徽合力	49,326,327.92	9.57
24	300452	山河药辅	48,235,184.16	9.36
25	600837	海通证券	46,734,542.69	9.07
26	600446	金证股份	46,177,953.57	8.96
27	002439	启明星辰	42,776,561.94	8.30
28	600597	光明乳业	42,182,030.94	8.18
29	600570	恒生电子	42,120,161.40	8.17

30	601009	南京银行	40,586,329.79	7.87
31	601668	中国建筑	39,701,747.14	7.70
32	000538	云南白药	38,665,922.97	7.50
33	000776	广发证券	38,649,464.41	7.50
34	300037	新宙邦	35,211,667.89	6.83
35	000566	海南海药	34,700,283.18	6.73
36	601601	中国太保	34,630,744.22	6.72
37	600590	泰豪科技	34,581,327.46	6.71
38	300228	富瑞特装	33,760,141.11	6.55
39	300329	海伦钢琴	33,604,037.94	6.52
40	600031	三一重工	33,423,698.17	6.48
41	601985	中国核电	32,649,100.17	6.33
42	600519	贵州茅台	32,643,075.02	6.33
43	000157	中联重科	32,341,991.20	6.27
44	000651	格力电器	31,152,297.63	6.04
45	000002	万科A	31,087,513.49	6.03
46	000605	渤海股份	30,089,937.18	5.84
47	600694	大商股份	29,912,940.42	5.80
48	002153	石基信息	28,953,181.53	5.62
49	600887	伊利股份	28,608,832.59	5.55
50	002501	利源精制	27,592,389.93	5.35
51	600749	西藏旅游	27,556,921.88	5.35
52	601818	光大银行	27,346,208.00	5.30
53	603883	老百姓	27,079,096.45	5.25
54	600048	保利地产	26,823,038.79	5.20
55	600369	西南证券	25,975,235.81	5.04
56	300471	厚普股份	25,267,390.28	4.90
57	601006	大秦铁路	24,767,314.91	4.80
58	300379	东方通	24,659,399.00	4.78
59	300462	华铭智能	24,381,703.75	4.73
60	600410	华胜天成	24,131,082.48	4.68
61	000858	五粮液	23,659,668.24	4.59
62	601390	中国中铁	23,302,267.01	4.52
63	601169	北京银行	23,242,482.95	4.51
64	000826	桑德环境	23,181,438.46	4.50
65	600309	万华化学	23,161,173.74	4.49

66	600179	黑化股份	23,119,285.00	4.48
67	601628	中国人寿	22,930,215.43	4.45
68	601988	中国银行	22,043,417.20	4.28
69	601939	建设银行	22,007,671.28	4.27
70	002458	益生股份	21,519,017.40	4.17
71	002053	云南盐化	21,517,783.66	4.17
72	600104	上汽集团	21,199,684.74	4.11
73	000895	双汇发展	20,965,385.64	4.07
74	000977	浪潮信息	20,569,485.93	3.99
75	600050	中国联通	20,096,877.00	3.90
76	000333	美的集团	19,947,887.64	3.87
77	600276	恒瑞医药	19,703,144.93	3.82
78	000423	东阿阿胶	19,410,662.26	3.77
79	002268	卫士通	19,357,605.45	3.75
80	600280	中央商场	19,304,778.63	3.74
81	601857	中国石油	18,783,759.47	3.64
82	600999	招商证券	18,422,139.35	3.57
83	601989	中国重工	18,024,486.44	3.50
84	300369	绿盟科技	17,931,595.96	3.48
85	600900	长江电力	17,375,471.37	3.37
86	600028	中国石化	17,373,048.70	3.37
87	601088	中国神华	16,460,567.94	3.19
88	300428	四通新材	16,239,418.14	3.15
89	601186	中国铁建	16,134,235.47	3.13
90	002185	华天科技	15,986,747.98	3.10
91	600383	金地集团	15,828,773.33	3.07
92	600518	康美药业	15,670,470.59	3.04
93	002024	苏宁云商	15,657,340.18	3.04
94	600585	海螺水泥	15,062,604.38	2.92
95	603818	曲美股份	15,041,564.24	2.92
96	300440	运达科技	14,385,350.28	2.79
97	300444	双杰电气	13,885,918.22	2.69
98	002169	智光电气	13,797,312.00	2.68
99	000009	中国宝安	13,688,852.12	2.66
100	300429	强力新材	13,592,624.16	2.64
101	601901	方正证券	13,547,295.00	2.63

102	002664	信质电机	13,408,900.00	2.60
103	300161	华中数控	13,192,054.60	2.56
104	300377	赢时胜	13,138,877.19	2.55
105	600066	宇通客车	12,976,484.46	2.52
106	300016	北陆药业	12,810,117.64	2.48
107	002230	科大讯飞	12,666,689.80	2.46
108	601377	兴业证券	12,595,349.78	2.44
109	601336	新华保险	12,416,786.95	2.41
110	600886	国投电力	12,330,460.57	2.39
111	000783	长江证券	12,231,636.16	2.37
112	601618	中国中冶	11,844,396.69	2.30
113	600011	华能国际	11,623,029.59	2.25
114	601766	中国中车	11,300,494.88	2.19
115	000728	国元证券	11,279,405.50	2.19
116	000725	京东方A	11,232,429.00	2.18
117	601117	中国化学	11,219,455.40	2.18
118	600109	国金证券	11,188,136.97	2.17
119	600089	特变电工	10,835,425.00	2.10
120	300353	东土科技	10,645,688.60	2.06
121	601688	华泰证券	10,527,016.00	2.04
122	000063	中兴通讯	10,480,897.60	2.03

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600958	东方证券	163,837,608.70	31.78
2	601985	中国核电	127,162,161.90	24.67
3	601318	中国平安	115,945,130.23	22.49
4	300059	东方财富	104,261,979.16	20.22
5	600030	中信证券	91,631,806.50	17.77
6	600016	民生银行	83,883,322.11	16.27
7	600036	招商银行	81,827,613.66	15.87
8	300285	国瓷材料	72,495,852.17	14.06
9	601166	兴业银行	63,108,095.63	12.24

10	300444	双杰电气	57,918,248.62	11.23
11	600037	歌华有线	57,524,895.32	11.16
12	600015	华夏银行	55,848,769.23	10.83
13	600000	浦发银行	54,875,140.83	10.64
14	300443	金雷风电	52,200,453.04	10.13
15	601288	农业银行	51,765,851.62	10.04
16	600837	海通证券	46,191,877.86	8.96
17	000001	平安银行	40,729,609.76	7.90
18	601668	中国建筑	39,231,335.60	7.61
19	000568	泸州老窖	38,789,875.61	7.52
20	601601	中国太保	37,491,090.16	7.27
21	000651	格力电器	37,332,063.46	7.24
22	000566	海南海药	36,962,395.86	7.17
23	300037	新宙邦	36,187,469.81	7.02
24	600959	江苏有线	36,174,040.23	7.02
25	002439	启明星辰	34,880,714.45	6.77
26	603818	曲美股份	34,269,848.72	6.65
27	600570	恒生电子	33,926,180.70	6.58
28	000002	万科A	33,460,306.91	6.49
29	002501	利源精制	32,902,204.67	6.38
30	600446	金证股份	32,123,774.84	6.23
31	000157	中联重科	31,889,174.63	6.19
32	603883	老百姓	31,344,822.46	6.08
33	600519	贵州茅台	31,329,852.96	6.08
34	601818	光大银行	31,257,130.58	6.06
35	600887	伊利股份	29,981,441.48	5.82
36	002329	皇氏集团	29,450,725.90	5.71
37	600048	保利地产	28,747,660.20	5.58
38	000776	广发证券	28,136,964.60	5.46
39	300329	海伦钢琴	27,471,481.15	5.33
40	002230	科大讯飞	27,383,230.35	5.31
41	601006	大秦铁路	26,895,452.39	5.22
42	601169	北京银行	26,452,882.22	5.13
43	300429	强力新材	25,894,652.80	5.02
44	600031	三一重工	24,597,054.03	4.77
45	000750	国海证券	24,552,157.55	4.76
46	601628	中国人寿	24,505,088.97	4.75
47	000826	桑德环境	24,207,202.61	4.70

48	600590	泰豪科技	23,965,867.05	4.65
49	601390	中国中铁	23,573,609.21	4.57
50	002153	石基信息	23,557,405.62	4.57
51	000977	浪潮信息	23,345,679.25	4.53
52	601988	中国银行	23,320,365.53	4.52
53	601939	建设银行	22,903,444.31	4.44
54	600999	招商证券	22,297,928.68	4.33
55	002458	益生股份	22,109,161.28	4.29
56	300379	东方通	21,662,722.52	4.20
57	002268	卫士通	21,645,854.69	4.20
58	000333	美的集团	20,877,106.62	4.05
59	600050	中国联通	20,717,922.53	4.02
60	600104	上汽集团	20,468,356.22	3.97
61	601857	中国石油	20,189,204.76	3.92
62	300428	四通新材	20,186,203.71	3.92
63	601088	中国神华	19,263,838.07	3.74
64	600536	中国软件	19,159,228.40	3.72
65	600383	金地集团	19,143,268.34	3.71
66	600900	长江电力	19,090,700.10	3.70
67	600280	中央商场	19,074,275.15	3.70
68	002024	苏宁云商	18,746,226.28	3.64
69	600028	中国石化	18,363,567.13	3.56
70	002053	云南盐化	17,940,541.40	3.48
71	601989	中国重工	17,526,681.36	3.40
72	600518	康美药业	17,348,115.24	3.37
73	300440	运达科技	16,772,626.40	3.25
74	601186	中国铁建	16,224,165.90	3.15
75	300369	绿盟科技	16,211,150.68	3.14
76	600369	西南证券	16,065,319.68	3.12
77	601336	新华保险	16,021,528.61	3.11
78	300433	蓝思科技	15,746,896.32	3.05
79	603729	龙韵股份	15,704,918.51	3.05
80	300016	北陆药业	15,652,573.83	3.04
81	000858	五粮液	15,583,328.56	3.02
82	002169	智光电气	15,344,170.54	2.98
83	600585	海螺水泥	15,327,661.53	2.97
84	600011	华能国际	14,700,095.06	2.85
85	600886	国投电力	14,510,780.35	2.81

86	000783	长江证券	14,248,527.03	2.76
87	000009	中国宝安	14,068,644.72	2.73
88	000725	京东方 A	13,713,021.31	2.66
89	002002	鸿达兴业	13,688,665.43	2.66
90	601688	华泰证券	13,403,728.77	2.60
91	000728	国元证券	13,337,618.31	2.59
92	000538	云南白药	13,315,342.31	2.58
93	601901	方正证券	13,299,776.62	2.58
94	601377	兴业证券	13,236,740.21	2.57
95	601618	中国中冶	13,165,550.71	2.55
96	300432	富临精工	12,711,636.20	2.47
97	600179	黑化股份	12,360,280.00	2.40
98	603030	全筑股份	12,264,756.34	2.38
99	601117	中国化学	12,239,352.66	2.37
100	300377	赢时胜	12,183,907.67	2.36
101	000895	双汇发展	11,567,665.51	2.24
102	600276	恒瑞医药	11,456,849.59	2.22
103	600109	国金证券	11,440,314.74	2.22
104	000069	华侨城 A	11,323,485.01	2.20
105	601633	长城汽车	11,237,347.42	2.18
106	601766	中国中车	11,102,847.37	2.15
107	600089	特变电工	11,072,849.06	2.15
108	601058	赛轮金宇	11,006,442.53	2.13
109	000338	潍柴动力	10,964,332.22	2.13
110	600019	宝钢股份	10,895,472.81	2.11
111	000063	中兴通讯	10,868,856.74	2.11
112	600068	葛洲坝	10,824,345.55	2.10
113	000100	TCL 集团	10,793,799.84	2.09
114	002304	洋河股份	10,744,552.32	2.08
115	600309	万华化学	10,407,311.80	2.02

注：1、卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票；
2、卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	5,731,657,469.26
卖出股票收入（成交）总额	5,360,182,177.93

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

关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	604,660,000.00	3.76
	其中：政策性金融债	604,660,000.00	3.76
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	604,660,000.00	3.76

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

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	140230	14 国开 30	1,800,000	180,864,000.00	1.13
2	140305	14 进出 05	1,500,000	152,355,000.00	0.95
3	130202	13 国开 02	1,000,000	100,590,000.00	0.63
4	150301	15 进出 01	1,000,000	100,580,000.00	0.63
5	150307	15 进出 07	300,000	30,219,000.00	0.19

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IC1507	IC1507	-85	-141,841,200.00	26,370,440.00	-
IF1507	IF1507	-688	-903,371,520.00	105,914,945.36	-
IH1507	IH1507	-179	-153,206,100.00	-2,679,307.06	-
公允价值变动总额合计(元)					129,606,078.30
股指期货投资本期收益(元)					-127,770,514.53
股指期货投资本期公允价值变动(元)					129,606,078.30

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金股指期货投资是为了对冲股权买入方的投资

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本报告期内，本基金未运用国债期货进行投资。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货投资，也无期间损益。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本报告期内，本基金未运用国债期货进行投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	121,774,491.23
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	21,435,814.63
5	应收申购款	170,325,418.41
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	313,535,724.27

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	300471	厚普股份	59,138,137.48	0.37	网下新股自愿锁定

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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
工银绝对收益混合发起 A	10,513	770,933.27	7,194,749,879.70	88.77%	910,071,639.50	11.23%
工银绝对收益混合发起 B	9,057	697,112.84	5,102,475,930.80	80.82%	1,211,275,085.18	19.18%
合计	19,570	736,769.16	12,297,225,810.50	85.29%	2,121,346,724.68	14.71%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	工银绝对收益混合发起 A	1,169,073.21	0.01%
	工银绝对收益混合发起 B	1,628,289.74	0.03%
	合计	2,797,362.95	0.02%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	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	工银绝对收益混合发起 A	0
	工银绝对收益混合发起 B	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	工银绝对收益混合发起 A	0
	工银绝对收益混合发起 B	0~10
	合计	0~10

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例（%）	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例（%）	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	9,002,960.00	0.06	9,002,960.00	0.06	3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	1,089,847.67	0.01	992,523.49	0.01	3 年
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,092,807.67	0.07	9,995,483.49	0.07	-

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	工银绝对收益混合 发起 A	工银绝对收益混合 发起 B
基金合同生效日（2014 年 6 月 26 日）基金 份额总额	516,916,982.06	999,555,609.63
本报告期期初基金份额总额	245,011,756.25	266,760,553.97
本报告期基金总申购份额	8,354,438,181.56	16,693,512,740.98
减：本报告期基金总赎回份额	494,628,418.61	10,646,522,278.97
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以 “-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	8,104,821,519.20	6,313,751,015.98

注：1、报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额；
2、报告期期间基金总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期，本基金未召开持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人：

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

2、基金托管人托管部门：

本报告期，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期无投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，本基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或行政处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国信证券	2	6,335,388,252.30	58.55%	5,651,227.86	64.51%	-
中信证券	1	4,485,750,123.49	41.45%	3,109,405.36	35.49%	-

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、个股分析的报告及其他丰富全面的信息咨询服务；有很强的分析能力，能根据工银瑞信所管理基金的特定要求，提供专门研究报告；具有开发量化投资组合模型的能力以及其他综合服务能力。

c) 与其他券商相比，该券商能够提供最佳交易执行和优惠合理的佣金率。

(2) 选择程序

a) 确定券商数量：根据以上标准对不同券商进行考察、选择和确定。投资研究部门（权益投资部，固定收益部，专户投资部，研究部和中央交易室）根据公司基金规模和服务需求等因素确定对合作券商的数量，每年根据公司经营规模变化及券商评估结果决定是否新增或调整合作券商，选定的名单需经主管投资副总和总经理审批同意。

b) 签订委托协议：与被选择的券商签订委托代理协议，明确签定协议双方的公司名称、委托代理期限、佣金率、双方的权利义务等，经签章有效。委托代理协议一式五份，协议双方及证券主管机关各留存一份，工银瑞信法律合规部留存备案，并报相关证券主管机关留存报备。

2. 券商的评估，保留和更换程序

(1) 席位的租用期限暂定为一年，合同到期 15 天内，投资研究部门将根据各券商研究在服务期间的综合证券服务质量等情况，进行评估。

(2) 对于符合标准的券商，工银瑞信将与其续约；对于不能达到标准的券商，不与其续约，并根据券商选择标准和程序，重新选择其它经营稳健、研究能力强、综合服务质量高的证券经营机构，租用其交易席位。

(3) 若券商提供的综合证券服务不符合要求，工银瑞信有权按照委托协议规定，提前中止租用其

交易席位。

证券公司席位的变更情况

在报告期内本基金新增中信证券股份有限公司的 31248 上海交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国信证券	-	-	-9,729,200,000.00	58.70%	-	-
中信证券	-	-	-6,846,200,000.00	41.30%	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	工银瑞信基金管理有限公司关于增加北京唐鼎耀华投资咨询有限公司为旗下基金销售机构并实行费率优惠的公告	三大报、公司网站	2015 年 1 月 26 日
2	工银瑞信基金管理有限公司关于旗下部分基金参与上海好买基金销售有限公司费率优惠活动的公告	三大报、公司网站	2015 年 2 月 5 日
3	工银瑞信基金管理有限公司关于增加中国国际金融有限公司为旗下部分基金代销机构的公告	三大报、公司网站	2015 年 2 月 6 日
4	工银瑞信基金管理有限公司关于旗下部分基金参与杭州数米基金销售有限公司申购费率优惠活动的公告	三大报、公司网站	2015 年 3 月 6 日
5	关于工银瑞信绝对收益策略混合型发起式证券投资基金暂停大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	三大报、公司网站	2015 年 3 月 6 日
6	工银瑞信基金管理有限公司关于公司董事、监事、高级管理人员以及其他从业人员在子公司兼职情况变更的公告	三大报、公司网站	2015 年 3 月 14 日

7	工银瑞信基金管理有限公司关于增加北京增财基金销售有限公司为旗下基金销售机构并实行费率优惠的公告	三大报、公司网站	2015 年 3 月 16 日
8	工银瑞信基金管理有限公司关于增加海银基金销售有限公司为旗下基金销售机构并实行费率优惠的公告	三大报、公司网站	2015 年 3 月 16 日
9	关于增加南京银行股份有限公司为工银瑞信绝对收益策略混合型发起式证券投资基金销售机构的公告	三大报、公司网站	2015 年 3 月 23 日
10	工银瑞信基金管理有限公司关于直销渠道转换费率优惠活动的公示	三大报、公司网站	2015 年 3 月 27 日
11	工银瑞信基金管理有限公司关于基金直销电子自助交易业务开通中国银行和交通银行支付方式及部分费率优惠的公告	三大报、公司网站	2015 年 3 月 27 日
12	工银瑞信基金管理有限公司关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告	三大报、公司网站	2015 年 3 月 27 日
13	工银瑞信基金管理有限公司关于增加上海大智慧财富管理有限公司为旗下基金销售机构并实行费率优惠的公告	三大报、公司网站	2015 年 4 月 20 日
14	工银瑞信基金管理有限公司关于旗下基金参与深圳众禄基金销售有限公司认/申购费率优惠活动的公告	三大报、公司网站	2015 年 4 月 24 日
15	关于增加上海浦东发展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	三大报、公司网站	2015 年 4 月 24 日
16	工银瑞信基金管理有限公司关于副总经理变更的公告	三大报、公司网站	2015 年 4 月 28 日
17	工银瑞信基金管理有限公司关于公司董事、监事、高级管理人员以及其他从业人员在子公司兼职情况变更的公告	三大报、公司网站	2015 年 5 月 12 日
18	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	三大报、公司网站	2015 年 5 月 28 日

	司网上费率优惠活动的公告		
19	工银瑞信基金管理有限公司 关于副总经理变更的公告	三大报、公司网站	2015 年 6 月 2 日
20	工银瑞信基金管理有限公司 关于增加上海汇付金融服务 有限公司为旗下基金销售机 构并实行费率优惠的公告	三大报、公司网站	2015 年 6 月 30 日

注：三大报包括中国证券报、上海证券报、证券时报。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准工银瑞信绝对收益策略混合型发起式证券投资基金募集的文件
- 2、《工银瑞信绝对收益策略混合型发起式证券投资基金基金合同》
- 3、《工银瑞信绝对收益策略混合型发起式证券投资基金托管协议》
- 4、《工银瑞信绝对收益策略混合型发起式证券投资基金招募说明书》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照
- 7、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告

12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可于营业时间查阅，或登录基金管理人网站查阅。

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人——工银瑞信基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-811-9999

网址：www.icbccs.com.cn

