

工银瑞信基本面量化策略混合型证券投资 基金 2016 年半年度报告

2016 年 6 月 30 日

基金管理人：工银瑞信基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：二〇一六年八月二十六日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 25 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 2016 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.....	8
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	12
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.....	13
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.....	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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.....	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况.....	35
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	36
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.....	37
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.....	54
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.....	54
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.....	55
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.....	55
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.....	55
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	55

7.12 投资组合报告附注.....	56
§8 基金份额持有人信息.....	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	57
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.....	57
§9 开放式基金份额变动.....	57
§10 重大事件揭示.....	58
10.1 基金份额持有人大会决议.....	58
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.....	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	58
10.4 基金投资策略的改变.....	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	58
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.....	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	58
10.8 其他重大事件.....	60
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	63
§12 备查文件目录.....	63
12.1 备查文件目录.....	63
12.2 存放地点.....	63
12.3 查阅方式.....	63

§ 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	115,156,013.21 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	北京市西城区复兴门内大街 1 号

	5 号 701、甲 5 号 8 层甲 5 号 801、甲 5 号 9 层甲 5 号 901	
办公地址	北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 A 座 6-9 层	北京市西城区复兴门内大街 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
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.icbccs.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-36,537,870.13
本期利润	-33,324,659.81
加权平均基金份额本期利润	-0.2911
本期加权平均净值利润率	-16.34%
本期基金份额净值增长率	-15.67%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	104,807,561.04
期末可供分配基金份额利润	0.9101
期末基金资产净值	219,963,574.25
期末基金份额净值	1.910
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	91.00%

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

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

3、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）；

4、本基金基金合同生效日为 2012 年 4 月 26 日。

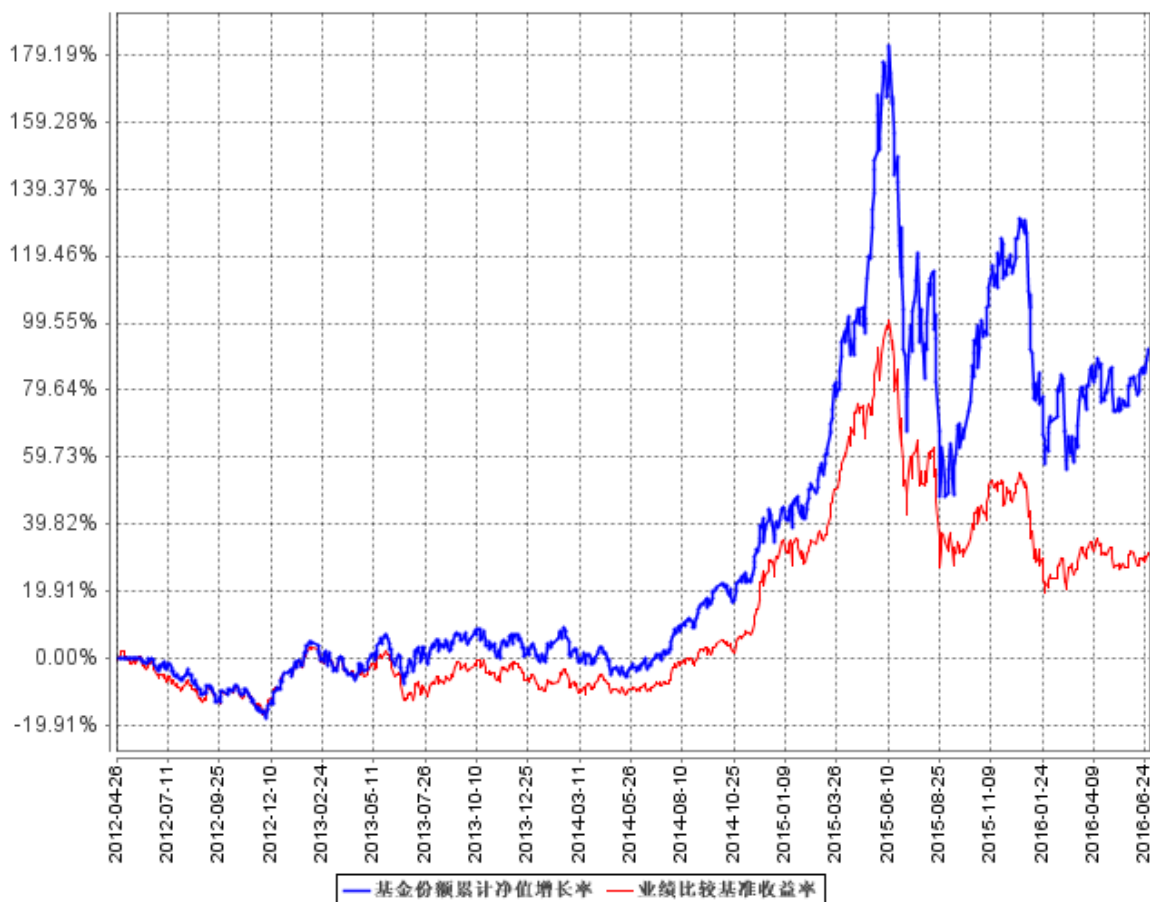
3.2 基金净值表现

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
过去一个月	5.70%	1.05%	0.50%	0.91%	5.20%	0.14%
过去三个月	5.52%	1.47%	-1.04%	0.94%	6.56%	0.53%
过去六个月	-15.67%	2.38%	-12.92%	1.62%	-2.75%	0.76%
过去一年	-16.19%	2.88%	-23.14%	1.93%	6.95%	0.95%
过去三年	99.58%	2.07%	48.53%	1.49%	51.05%	0.58%
自基金合同生效以来	91.00%	1.85%	31.44%	1.38%	59.56%	0.47%

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第十四条（二）投资范围、（八）投资禁止行为与限制中规定的各项比例：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%；法律法规、监管机构及本基金合同规定的其他比例限制。

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 2016 年 6 月 30 日，公司旗下管理 83 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、工银瑞信增利债券型证券投资基金、工银瑞信产业债债券型证券投资基金、工银瑞信信用纯债一年定期开放债券型证券投资基金、工银瑞信信用纯债两年定期开放债券型证券投资基金、工银瑞信标普全球自然资源指数证券投资基金、工银瑞信保本 3 号混合型证券投资基金、工银瑞信月月薪定期支付债券型证券投资基金、工银瑞信金融地产行业混合型证券投资基金、工银瑞信双债增强债券型证券投资基金、工银瑞信添福债券型证券投资基金、工银瑞信信息产业混合型证券投资基金、工银瑞信薪金货币市场基金、工银瑞信纯债债券型证券投资基金、工银瑞信绝对收益策略混合型发起式证券投资基金、工银瑞信目标收益一年定期开放债券型投资基金、工银瑞信新财富灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信现金快线货币市场基金、工银瑞信添益快线货币市场基金、工银瑞信高端制造行业股票型证

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，证券投资基金管理规模逾 4800 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	-	20	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型证券投资基金的

				<p>基金经理；2010 年 5 月 25 日至今，担任工银瑞信全球精选股票型证券投资基金的基金经理；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。</p>
--	--	--	--	---

注：

- 1、任职日期说明：游凛峰的任职日期为基金合同生效日期
- 2、离任日期说明：无
- 3、证券从业年限的计算标准：证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定等
- 4、本基金无基金经理助理

4.2 管理人对报告期内本基金运作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 9 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

2016 年初市场即剧烈波动，前 4 个交易日就经历了两天熔断，之后市场一路下探，二季度 A 股受纳入 MSCI 指数暂缓、并购重组新规发布业务趋严、英国脱欧等事件影响的影响，A 股市场情绪较为低迷，股指较长时间处于震荡波动中。全部 A 股成交金额仅 64 万亿，较 2015 年上半年减少了 54%，市场活跃程度明显降低，呈现出存量资金博弈的格局。

2016 年半年度，上证综指下跌 17.22%，创业板下跌 17.91%。从行业涨跌上来看，食品饮料、有色金属、银行分别以 2.23%、-5.14%、-6.16% 的涨幅位列前三；传媒、餐饮旅游、交通运输分别下跌 29.78%、27.25%、27.00% 位列跌幅榜前三。

本基金以量化选股为主，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。在基金操作过程中，受年初熔断影响，很多重仓股票被错杀，导致年初净值遭受巨大损失。随后基金及时调整策略，重仓大量绝对收益类型股票以控制下行风险，同时积极参与各类主题投资，成功把握了新能源、芯片国产化、黄金等主题性投资机会，收复了绝大部分负超额收益。

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-15.67%，业绩比较基准收益率为-12.92%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前来看国内宏观经济环境趋于稳定、资金面趋于平稳，但股指的向上突破还需要基本面的改善或实质性的政策措施。总体来看，第三季度的政策环境可能会更加温和，供给侧改革和 G20 会议有望推进市场风险偏好的进一步修复，主题机会将会持续。

在未来的操作中，本基金将保持低风险策略为主，兼顾主题投资机会操作思路，在风格配置方面兼顾新兴行业的成长性机会和低估值蓝筹的投资机会。同时将会重点关注有持续增长的大数

据、云计算、信息安全相关的计算机子行业；新能源、通胀相关的消费品等领域的阶段性投资机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.6.1.1 职责分工

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

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

4.6.1.2 专业胜任能力及相关工作经历

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

4.6.2 基金经理参与或决定估值的程度

本公司基金经理参与讨论估值原则及方法，但不参与最终估值决策。

4.6.3 参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.6.4 已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未实施利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对工银瑞信基本面量化策略混

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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：工银瑞信基本面量化策略混合型证券投资基金

报告截止日：2016年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	2,276,301.20	2,804,957.59
结算备付金		2,573,899.97	2,020,443.59
存出保证金		218,558.11	189,701.60
交易性金融资产	6.4.7.2	189,571,236.42	172,183,838.93
其中：股票投资		179,577,236.42	164,470,418.93
基金投资		-	-
债券投资		9,994,000.00	7,713,420.00
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	28,000,000.00	20,000,000.00
应收证券清算款		12,153,333.01	2,004,430.56
应收利息	6.4.7.5	85,766.84	67,464.96
应收股利		-	-
应收申购款		275,794.80	529,826.32

递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		235,154,890.35	199,800,663.55
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		12,159,431.28	-
应付赎回款		675,569.66	194,353.95
应付管理人报酬		261,667.37	216,057.41
应付托管费		43,611.24	36,009.59
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,940,007.19	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	6.4.7.8	111,029.36	175,139.74
负债合计		15,191,316.10	1,417,453.24
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	115,156,013.21	87,572,451.80
未分配利润	6.4.7.10	104,807,561.04	110,810,758.51
所有者权益合计		219,963,574.25	198,383,210.31
负债和所有者权益总计		235,154,890.35	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 6 月 30 日，基金份额净值为人民币 1.910 元，基金份额总额为 115,156,013.21 份。

6.2 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 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016年1月1日至 2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年6月30日
一、收入		-28,248,747.56	91,125,155.77
1.利息收入		241,485.01	212,004.24
其中：存款利息收入	6.4.7.11	58,298.29	29,929.80
债券利息收入		102,710.78	180,394.30

资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		80,475.94	1,680.14
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-31,728,072.25	104,603,155.83
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-32,679,227.01	104,034,996.50
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-390.00	16,244.38
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	951,544.76	551,914.95
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	3,213,210.32	-13,850,330.78
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	24,629.36	160,326.48
减：二、费用		5,075,912.25	4,616,839.37
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,520,177.12	1,340,791.80
2. 托管费	6.4.10.2.2	253,362.89	223,465.32
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	3,176,391.64	2,915,721.44
5. 利息支出		-	446.69
其中：卖出回购金融资产支出		-	446.69
6. 其他费用	6.4.7.20	125,980.60	136,414.12
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-33,324,659.81	86,508,316.40
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-33,324,659.81	86,508,316.40

注：本基金基金合同生效日为 2012 年 4 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 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	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	-	-33,324,659.81	-33,324,659.81

期利润)			
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)	27,583,561.41	27,321,462.34	54,905,023.75
其中: 1.基金申购款	40,840,253.54	38,054,944.44	78,895,197.98
2.基金赎回款	-13,256,692.13	-10,733,482.10	-23,990,174.23
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)	115,156,013.21	104,807,561.04	219,963,574.25
项目	上年度可比期间 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)	113,707,070.12	46,964,059.95	160,671,130.07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	86,508,316.40	86,508,316.40
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)	-41,359,862.43	-40,916,381.35	-82,276,243.78
其中: 1.基金申购款	69,658,433.24	60,281,871.69	129,940,304.93
2.基金赎回款	-111,018,295.67	-101,198,253.04	-212,216,548.71
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)	72,347,207.69	92,555,995.00	164,903,202.69

注: 本基金基金合同生效日为 2012 年 4 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:

郭特华

基金管理人负责人

朱碧艳

主管会计工作负责人

朱辉毅

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

工银瑞信基本面量化策略混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）（原名“工银瑞信基本面量化策略股票型证券投资基金”），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[2012]204 号文《关于核准工银瑞信基本面量化策略股票型证券投资基金募集的批复》的批准，由工银瑞信基金管理有限公司向社会公开募集，基金合同于 2012 年 4 月 26 日正式生效，首次设立规模为 2,433,435,148.52 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构均为工银瑞信基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《关于实施〈公开募集证券投资基金运作管理办法〉有关问题的规定》及《基金合同》的有关规定，为确保基金投资比例符合法律法规要求，2015 年 8 月 5 日，本基金名称由“工银瑞信基本面量化策略股票型证券投资基金”更名为“工银瑞信基本面量化策略混合型证券投资基金”。

本基金的投资范围限于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括创业板股票、中小板股票以及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、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： $80\% \times \text{中证 800 指数收益率} + 20\% \times \text{上证国债指数收益率}$ 。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年上半年的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。

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

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

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

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。

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、地方政府债券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, 质押式买入返售金融商品及持有政策性金融债券的利息收入免征增值税;

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, 买断式买入返售金融商品、同业存单以及持有金融债券的利息收入免征增值税。

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。

4. 个人所得税

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

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《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。

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 2016 年 6 月 30 日
活期存款	2,276,301.20
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	2,276,301.20

注：本基金本报告期末投资于定期存款。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	170,720,795.42	179,577,236.42	8,856,441.00	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	9,996,270.00	9,994,000.00	-2,270.00
	合计	9,996,270.00	9,994,000.00	-2,270.00
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	180,717,065.42	189,571,236.42	8,854,171.00	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

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 2016年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_交易所	28,000,000.00	-
合计	28,000,000.00	-

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 2016年6月30日
应收活期存款利息	2,134.73
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	1,158.77
应收债券利息	81,278.69
应收买入返售证券利息	1,096.25
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	98.40
合计	85,766.84

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 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,940,007.19
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,940,007.19

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2,105.04
预提信息披露费	79,561.30
预提审计费	24,863.02
预提账户维护费	4,500.00
合计	111,029.36

6.4.7.9 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6月30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	40,840,253.54	40,840,253.54
本期赎回(以“-”号填列)	-13,256,692.13	-13,256,692.13
本期末	115,156,013.21	115,156,013.21

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

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	-36,537,870.13	3,213,210.32	-33,324,659.81
本期基金份额交易产生的变动数	37,422,724.88	-10,101,262.54	27,321,462.34
其中：基金申购款	51,593,803.62	-13,538,859.18	38,054,944.44
基金赎回款	-14,171,078.74	3,437,596.64	-10,733,482.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	125,350,164.66	-20,542,603.62	104,807,561.04

6.4.7.11 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6月30日
活期存款利息收入	38,635.33
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	17,934.64
其他	1,728.32
合计	58,298.29

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 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	1,046,650,793.52
减：卖出股票成本总额	1,079,330,020.53
买卖股票差价收入	-32,679,227.01

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-390.00
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	-390.00

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	7,800,000.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	7,712,640.00
减：应收利息总额	87,750.00
买卖债券差价收入	-390.00

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期间无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期间无贵金属投资收益。

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

本基金本报告期无买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无其他衍生工具投资收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	951,544.76
基金投资产生的股利收益	-
合计	951,544.76

6.4.7.17 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6月30日
1. 交易性金融资产	3,213,210.32
——股票投资	3,216,260.32
——债券投资	-3,050.00
——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	-
合计	3,213,210.32

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	13,021.07
基金转换费收入	11,608.29

合计	24,629.36
----	-----------

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	3,176,216.64
银行间市场交易费用	175.00
合计	3,176,391.64

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	24,863.02
信息披露费	79,561.30
账户维护费	9,000.00
银行费用	12,556.28
合计	125,980.60

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金并无须作披露的重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
工银瑞信基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金管理人股东、基金销售机构

注：1、本报告期本基金关联方未发生变化。

2、以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期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	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,520,177.12	1,340,791.80
其中：支付销售机构的客户维护费	355,281.77	515,915.38

注：1、在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$ ，本基金年管理费率为 1.50%

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

2、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	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	253,362.89	223,465.32

注：1、在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ ，本基金年托管费率为 0.25%

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

2、基金托管费每日计提，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

本基金本报告期及上年可比期间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

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固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末与上年度末均未投资本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015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
中国银行股份有限公司	2,276,301.20	38,635.33	4,662,481.43	15,972.98

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。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期和上年度可比期间内均未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末进行利润分配。

6.4.12 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	------	------	------	--------	------	--------	-------	--------	--------	----

002567	唐人神	2016年5月16日	重大事项	13.98	2016年7月29日	13.23	380,000	4,503,508.00	5,312,400.00	-
000975	银泰资源	2016年4月19日	重大事项	15.00	-	-	266,820	3,583,125.90	4,002,300.00	-
002071	长城影视	2016年6月16日	重大事项	13.64	-	-	182,280	2,735,699.45	2,486,299.20	-
600455	博通股份	2016年5月5日	重大事项	49.14	-	-	40,089	1,842,570.51	1,969,973.46	-
600768	宁波富邦	2016年3月31日	重大事项	24.42	-	-	21,848	420,906.57	533,528.16	-
002057	中钢天源	2016年6月13日	重大事项	15.05	-	-	34,630	435,209.36	521,181.50	-
000923	河北宣工	2016年4月6日	重大事项	15.80	-	-	31,599	424,922.36	499,264.20	-
000004	国农科技	2016年3月24日	重大事项	36.83	-	-	12,394	415,104.35	456,471.02	-
000002	万科A	2015年12月21日	重大事项	18.20	2016年7月4日	21.99	19,102	262,884.90	347,656.40	指数法估值
600019	宝钢股份	2016年6月27日	重大事项	4.90	-	-	58,309	298,652.61	285,714.10	-
600005	武钢股份	2016年6月27日	重大事项	2.76	-	-	65,911	228,343.24	181,914.36	-
000651	格力电器	2016年2月22日	重大事项	22.07	-	-	7,301	142,710.24	161,133.07	指数法估值
000802	北京文化	2016年6月1日	重大事项	23.52	2016年8月22日	21.86	5,999	145,933.51	141,096.48	-
601611	中国核建	2016年6月30日	临时停牌	20.92	2016年7月1日	23.01	5,445	18,894.15	113,909.40	-
000818	方大	2016	重大	6.57	2016	7.23	16,845	110,360.81	110,671.65	-

	化工	年 2 月 15 日	事项		年 8 月 23 日						
603919	金徽酒	2016 年 6 月 6 日	重大 事项	30.90	2016 年 7 月 5 日	33.99	2,908	31,813.52	89,857.20	-	
600149	廊坊发展	2016 年 4 月 13 日	重大 事项	16.64	2016 年 7 月 21 日	14.98	5,195	65,487.52	86,444.80	-	
601900	南方传媒	2016 年 6 月 6 日	重大 事项	17.67	-	-	4,823	29,564.99	85,222.41	-	
300351	永贵电器	2016 年 6 月 29 日	重大 事项	33.93	2016 年 7 月 4 日	33.30	1,897	45,865.39	64,365.21	-	
002046	轴研科技	2016 年 5 月 9 日	重大 事项	10.33	2016 年 8 月 22 日	11.36	4,862	62,985.43	50,224.46	-	
300508	维宏股份	2016 年 6 月 30 日	重大 事项	254.50	2016 年 7 月 6 日	242.00	113	2,269.04	28,758.50	-	
000617	*ST 济柴	2016 年 4 月 20 日	重大 事项	12.91	-	-	943	13,139.97	12,174.13	-	
300450	先导智能	2016 年 3 月 30 日	重大 事项	37.81	2016 年 7 月 20 日	41.59	288	7,862.61	10,889.28	-	
000638	万方发展	2016 年 1 月 5 日	重大 事项	27.50	2016 年 7 月 25 日	24.75	4	63.60	110.00	-	

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 2016 年 6 月 30 日对资产净值和本期净利润的影响均为人民币-98,197.61 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

本基金本报告期末在银行间市场未持有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

本基金本报告期末在交易所市场未持有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 2015 年 12 月 31 日和 2016 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 2015 年 12 月 31 日和 2016 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。本基金主要投资于债券市场，因此本基金的收入及经营活动的现金流量受到市场利率变化的影响。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 2016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	2,276,301.20	-	-	-	-	-	2,276,301.20
结算备付金	2,573,899.97	-	-	-	-	-	2,573,899.97
存出保证金	218,558.11	-	-	-	-	-	218,558.11
交易性金融资产	-	-	-9,994,000.00	-	-	-179,577,236.42	189,571,236.42
买入返售金融资产	28,000,000.00	-	-	-	-	-	28,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	12,153,333.01	12,153,333.01
应收利息	-	-	-	-	-	85,766.84	85,766.84
应收申购款	-	-	-	-	-	275,794.80	275,794.80
资产总计	33,068,759.28	-	-9,994,000.00	-	-	-192,092,131.07	235,154,890.35
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	12,159,431.28	12,159,431.28
应付赎回款	-	-	-	-	-	675,569.66	675,569.66
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	261,667.37	261,667.37
应付托管费	-	-	-	-	-	43,611.24	43,611.24
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,940,007.19	1,940,007.19
其他负债	-	-	-	-	-	111,029.36	111,029.36
负债总计	-	-	-	-	-	15,191,316.10	15,191,316.10
利率敏感度缺口	33,068,759.28	-	-9,994,000.00	-	-	-176,900,814.97	219,963,574.25
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。

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（2016 年 6 月 30 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	利率增加 25 基准点	-15,778.29	-2,804.21
	利率减少 25 基准点	15,827.86	2,806.24

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 2016 年 6 月 30 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	179,577,236.42	81.64	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	9,994,000.00	4.54	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	189,571,236.42	86.18	172,183,838.93	86.79

注：1、本基金投资组合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%。

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（2016 年 6 月 30 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准增加 5%	15,188,073.72	12,689,027.81
业绩比较基准减少 5%	-15,188,073.72	-12,689,027.81	

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	179,577,236.42	76.37
	其中：股票	179,577,236.42	76.37
2	固定收益投资	9,994,000.00	4.25
	其中：债券	9,994,000.00	4.25
	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	28,000,000.00	11.91
	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	4,850,201.17	2.06
7	其他各项资产	12,733,452.76	5.41
8	合计	235,154,890.35	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。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	552,593.49	0.25
B	采矿业	14,766,112.53	6.71
C	制造业	100,405,457.24	45.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,238,706.41	1.93
E	建筑业	1,974,344.22	0.90
F	批发和零售业	3,915,103.40	1.78
G	交通运输、仓储和邮政业	3,428,959.12	1.56
H	住宿和餐饮业	28,574.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,632,616.96	8.02
J	金融业	19,774,343.32	8.99
K	房地产业	4,852,947.22	2.21
L	租赁和商务服务业	441,799.58	0.20
M	科学研究和技术服务业	37,150.00	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	1,019,921.81	0.46
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	19,970.11	0.01

Q	卫生和社会工作	34,235.64	0.02
R	文化、体育和娱乐业	3,922,328.69	1.78
S	综合	2,532,072.68	1.15
	合计	179,577,236.42	81.64

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

7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

无。

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	600060	海信电器	440,794	7,793,237.92	3.54
2	002329	皇氏集团	501,360	7,515,386.40	3.42
3	300302	同有科技	211,588	6,870,262.36	3.12
4	600085	同仁堂	196,458	5,852,483.82	2.66
5	002567	唐人神	380,000	5,312,400.00	2.42
6	000975	银泰资源	266,820	4,002,300.00	1.82
7	600056	中国医药	247,770	3,929,632.20	1.79
8	002439	启明星辰	143,521	3,707,147.43	1.69
9	000538	云南白药	56,615	3,640,344.50	1.65
10	002626	金达威	210,000	3,538,500.00	1.61
11	000423	东阿阿胶	61,619	3,255,331.77	1.48
12	000568	泸州老窖	105,523	3,134,033.10	1.42
13	600978	宜华生活	251,800	2,805,052.00	1.28
14	600436	片仔癀	57,928	2,607,339.28	1.19
15	002071	长城影视	182,280	2,486,299.20	1.13
16	002635	安洁科技	60,943	2,338,992.34	1.06
17	002410	广联达	157,123	2,246,858.90	1.02
18	002268	卫士通	58,005	2,073,098.70	0.94
19	002716	金贵银业	109,571	2,038,020.60	0.93
20	601058	赛轮金宇	602,015	2,010,730.10	0.91
21	601069	西部黄金	85,395	1,982,017.95	0.90
22	600455	博通股份	40,089	1,969,973.46	0.90
23	300101	振芯科技	70,377	1,965,629.61	0.89
24	002155	湖南黄金	145,291	1,913,482.47	0.87
25	601318	中国平安	59,412	1,903,560.48	0.87

26	600988	赤峰黄金	101,929	1,900,975.85	0.86
27	300375	鹏翎股份	68,387	1,848,500.61	0.84
28	300092	科新机电	113,900	1,742,670.00	0.79
29	601288	农业银行	542,156	1,734,899.20	0.79
30	601166	兴业银行	113,037	1,722,683.88	0.78
31	600489	中金黄金	150,250	1,688,810.00	0.77
32	300483	沃施股份	25,942	1,563,264.92	0.71
33	601169	北京银行	128,114	1,328,542.18	0.60
34	300340	科恒股份	14,789	1,171,732.47	0.53
35	600016	民生银行	130,144	1,162,185.92	0.53
36	000001	平安银行	126,904	1,104,064.80	0.50
37	600597	光明乳业	86,849	1,101,245.32	0.50
38	601009	南京银行	104,454	980,823.06	0.45
39	002142	宁波银行	65,593	969,464.54	0.44
40	600000	浦发银行	57,419	894,013.83	0.41
41	600030	中信证券	53,403	866,730.69	0.39
42	600837	海通证券	50,375	776,782.50	0.35
43	601601	中国太保	27,548	744,897.92	0.34
44	601766	中国中车	73,795	676,700.15	0.31
45	601818	光大银行	156,044	586,725.44	0.27
46	000858	五粮液	17,671	574,837.63	0.26
47	300405	科隆精化	11,953	549,957.53	0.25
48	300022	吉峰农机	65,318	534,954.42	0.24
49	600768	宁波富邦	21,848	533,528.16	0.24
50	002205	国统股份	22,259	530,654.56	0.24
51	300062	中能电气	21,682	525,354.86	0.24
52	600213	亚星客车	41,026	523,491.76	0.24
53	300330	华虹计通	29,284	521,548.04	0.24
54	002057	中钢天源	34,630	521,181.50	0.24
55	002627	宜昌交运	24,541	519,287.56	0.24
56	000785	武汉中商	46,523	518,731.45	0.24
57	600985	雷鸣科化	46,642	513,994.84	0.23
58	600099	林海股份	43,602	513,195.54	0.23
59	002193	山东如意	31,207	512,106.87	0.23
60	300373	扬杰科技	21,200	511,132.00	0.23
61	600561	江西长运	41,790	510,673.80	0.23
62	300344	太空板业	42,939	507,538.98	0.23
63	601628	中国人寿	24,210	504,052.20	0.23
64	300017	网宿科技	7,451	500,707.20	0.23

65	002341	新纶科技	23,200	499,496.00	0.23
66	000923	河北宣工	31,599	499,264.20	0.23
67	600028	中国石化	103,829	490,072.88	0.22
68	600731	湖南海利	48,669	489,123.45	0.22
69	300088	长信科技	32,686	486,040.82	0.22
70	000776	广发证券	28,834	483,257.84	0.22
71	600603	*ST 兴业	41,651	475,654.42	0.22
72	600690	青岛海尔	53,136	471,847.68	0.21
73	601006	大秦铁路	72,613	467,627.72	0.21
74	000004	国农科技	12,394	456,471.02	0.21
75	000563	陕国投 A	82,820	454,681.80	0.21
76	000692	惠天热电	80,000	446,400.00	0.20
77	000069	华侨城 A	69,672	445,900.80	0.20
78	600352	浙江龙盛	51,624	444,998.88	0.20
79	601117	中国化学	78,482	434,005.46	0.20
80	000985	大庆华科	17,502	432,824.46	0.20
81	601998	中信银行	75,851	430,075.17	0.20
82	300458	全志科技	4,016	429,631.68	0.20
83	601669	中国电建	75,140	429,049.40	0.20
84	601899	紫金矿业	125,878	424,208.86	0.19
85	601939	建设银行	87,815	417,121.25	0.19
86	601901	方正证券	54,431	416,941.46	0.19
87	600637	东方明珠	16,790	407,493.30	0.19
88	601600	中国铝业	105,252	396,800.04	0.18
89	600585	海螺水泥	27,215	395,706.10	0.18
90	002146	荣盛发展	58,422	392,595.84	0.18
91	601888	中国国旅	8,677	381,614.46	0.17
92	600011	华能国际	50,571	380,293.92	0.17
93	601727	上海电气	50,232	379,753.92	0.17
94	600177	雅戈尔	27,343	377,059.97	0.17
95	600271	航天信息	15,800	376,040.00	0.17
96	600383	金地集团	36,087	373,861.32	0.17
97	601800	中国交建	35,355	372,288.15	0.17
98	000876	新希望	44,626	371,288.32	0.17
99	601992	金隅股份	47,751	370,070.25	0.17
100	600688	上海石化	60,498	369,037.80	0.17
101	300200	高盟新材	22,554	367,630.20	0.17
102	600027	华电国际	74,228	367,428.60	0.17
103	000686	东北证券	28,444	367,212.04	0.17

104	601088	中国神华	26,000	365,820.00	0.17
105	601099	太平洋	59,500	364,735.00	0.17
106	600583	海油工程	52,465	362,533.15	0.16
107	000895	双汇发展	17,324	361,725.12	0.16
108	600705	中航资本	61,500	361,620.00	0.16
109	600100	同方股份	24,000	359,040.00	0.16
110	000338	潍柴动力	45,738	357,213.78	0.16
111	600153	建发股份	29,700	356,400.00	0.16
112	300496	中科创达	5,226	353,904.72	0.16
113	600816	安信信托	20,849	351,722.63	0.16
114	002236	大华股份	26,800	351,080.00	0.16
115	000002	万科A	19,102	347,656.40	0.16
116	000598	兴蓉环境	64,839	342,349.92	0.16
117	601098	中南传媒	18,823	340,884.53	0.15
118	600704	物产中大	36,236	339,168.96	0.15
119	600170	上海建工	87,834	336,404.22	0.15
120	601898	中煤能源	64,790	334,316.40	0.15
121	600021	上海电力	32,340	332,131.80	0.15
122	600240	华业资本	33,140	332,062.80	0.15
123	600183	生益科技	35,808	331,940.16	0.15
124	600827	百联股份	27,320	330,025.60	0.15
125	600309	万华化学	19,000	328,700.00	0.15
126	601633	长城汽车	38,841	327,818.04	0.15
127	601111	中国国航	47,900	323,804.00	0.15
128	600578	京能电力	75,367	322,570.76	0.15
129	600808	马钢股份	132,938	320,380.58	0.15
130	600188	兖州煤业	29,241	319,896.54	0.15
131	000999	华润三九	13,194	319,558.68	0.15
132	600018	上港集团	62,503	318,765.30	0.14
133	600743	华远地产	67,235	318,021.55	0.14
134	000667	美好集团	88,216	314,931.12	0.14
135	601179	中国西电	62,086	314,776.02	0.14
136	600380	健康元	34,231	314,240.58	0.14
137	300287	飞利信	23,400	313,560.00	0.14
138	000027	深圳能源	48,964	312,390.32	0.14
139	600062	华润双鹤	17,038	310,432.36	0.14
140	300260	新莱应材	8,637	309,722.82	0.14
141	600970	中材国际	49,073	309,159.90	0.14
142	600366	宁波韵升	12,900	307,923.00	0.14

143	300115	长盈精密	14,900	306,940.00	0.14
144	600466	蓝光发展	35,435	303,323.60	0.14
145	600582	天地科技	67,318	302,931.00	0.14
146	600664	哈药股份	36,444	302,120.76	0.14
147	600483	福能股份	26,573	301,603.55	0.14
148	000900	现代投资	44,744	301,574.56	0.14
149	600889	南京化纤	27,900	300,762.00	0.14
150	600297	广汇汽车	34,279	298,570.09	0.14
151	601000	唐山港	76,816	298,046.08	0.14
152	603288	海天味业	9,796	297,798.40	0.14
153	000539	粤电力 A	59,116	296,762.32	0.13
154	603001	奥康国际	13,861	294,684.86	0.13
155	000910	大亚科技	18,849	291,217.05	0.13
156	600826	兰生股份	11,100	290,598.00	0.13
157	600835	上海机电	15,133	290,402.27	0.13
158	600269	赣粤高速	66,746	290,345.10	0.13
159	600811	东方集团	43,500	289,710.00	0.13
160	000712	锦龙股份	13,900	288,564.00	0.13
161	002565	上海绿新	38,892	288,189.72	0.13
162	002302	西部建设	39,836	287,615.92	0.13
163	000429	粤高速 A	52,240	287,320.00	0.13
164	601225	陕西煤业	55,549	287,188.33	0.13
165	600566	济川药业	11,133	286,563.42	0.13
166	002641	永高股份	34,708	285,993.92	0.13
167	600019	宝钢股份	58,309	285,714.10	0.13
168	600684	珠江实业	37,957	285,057.07	0.13
169	601877	正泰电器	15,117	284,955.45	0.13
170	000719	大地传媒	26,965	284,750.40	0.13
171	601928	凤凰传媒	26,998	284,558.92	0.13
172	002083	孚日股份	45,130	284,319.00	0.13
173	300214	日科化学	36,888	284,037.60	0.13
174	601139	深圳燃气	35,484	283,872.00	0.13
175	600708	光明地产	33,806	283,632.34	0.13
176	000156	华数传媒	15,285	283,536.75	0.13
177	603366	日出东方	33,728	283,315.20	0.13
178	002603	以岭药业	17,799	283,182.09	0.13
179	600658	电子城	27,388	282,918.04	0.13
180	601566	九牧王	18,310	282,706.40	0.13
181	002563	森马服饰	25,930	280,821.90	0.13

182	600409	三友化工	41,100	277,014.00	0.13
183	600823	世茂股份	40,337	273,888.23	0.12
184	600251	冠农股份	34,171	273,368.00	0.12
185	002333	罗普斯金	27,900	271,746.00	0.12
186	600606	绿地控股	24,963	270,099.66	0.12
187	600861	北京城乡	20,100	269,139.00	0.12
188	600748	上实发展	27,888	268,840.32	0.12
189	600600	青岛啤酒	9,225	268,170.75	0.12
190	300119	瑞普生物	16,600	266,430.00	0.12
191	002493	荣盛石化	21,865	265,003.80	0.12
192	600167	联美控股	16,000	262,560.00	0.12
193	600598	北大荒	24,200	254,826.00	0.12
194	601158	重庆水务	39,400	253,342.00	0.12
195	002543	万和电气	13,673	252,813.77	0.11
196	000698	沈阳化工	38,600	252,444.00	0.11
197	600987	航民股份	20,700	250,884.00	0.11
198	000430	张家界	22,100	250,835.00	0.11
199	300090	盛运环保	31,000	250,790.00	0.11
200	600327	大东方	28,100	250,652.00	0.11
201	000888	峨眉山 A	20,800	250,432.00	0.11
202	600791	京能置业	36,000	250,200.00	0.11
203	000716	黑芝麻	37,000	250,120.00	0.11
204	603008	喜临门	14,335	246,418.65	0.11
205	000709	河钢股份	86,454	239,477.58	0.11
206	600050	中国联通	54,930	209,283.30	0.10
207	600236	桂冠电力	29,488	198,159.36	0.09
208	600109	国金证券	13,837	186,522.76	0.08
209	600005	武钢股份	65,911	181,914.36	0.08
210	002437	誉衡药业	19,600	170,520.00	0.08
211	600348	阳泉煤业	26,579	169,308.23	0.08
212	002108	沧州明珠	6,515	168,738.50	0.08
213	000413	东旭光电	18,935	162,651.65	0.07
214	000959	首钢股份	43,946	162,600.20	0.07
215	000651	格力电器	7,301	161,133.07	0.07
216	601231	环旭电子	13,987	149,660.90	0.07
217	002294	信立泰	5,500	149,600.00	0.07
218	002368	太极股份	4,131	146,774.43	0.07
219	000587	金洲慈航	9,284	143,252.12	0.07
220	000802	北京文化	5,999	141,096.48	0.06

221	300213	佳讯飞鸿	4,277	120,782.48	0.05
222	300127	银河磁体	4,636	118,125.28	0.05
223	002317	众生药业	9,546	114,456.54	0.05
224	601611	中国核建	5,445	113,909.40	0.05
225	000983	西山煤电	13,814	112,584.10	0.05
226	000818	方大化工	16,845	110,671.65	0.05
227	300207	欣旺达	4,290	110,124.30	0.05
228	000513	丽珠集团	2,376	109,557.36	0.05
229	600975	新五丰	11,794	107,915.10	0.05
230	300285	国瓷材料	2,569	102,477.41	0.05
231	600885	宏发股份	3,300	101,343.00	0.05
232	000937	冀中能源	18,918	100,643.76	0.05
233	300398	飞凯材料	1,254	93,799.20	0.04
234	603339	四方冷链	1,693	92,133.06	0.04
235	603919	金徽酒	2,908	89,857.20	0.04
236	603027	千禾味业	2,541	89,621.07	0.04
237	600395	盘江股份	10,719	88,538.94	0.04
238	601020	华钰矿业	3,078	88,215.48	0.04
239	000807	云铝股份	13,448	88,084.40	0.04
240	600149	廊坊发展	5,195	86,444.80	0.04
241	601900	南方传媒	4,823	85,222.41	0.04
242	601788	光大证券	4,962	84,056.28	0.04
243	600999	招商证券	5,044	83,226.00	0.04
244	603608	天创时尚	3,426	82,121.22	0.04
245	300084	海默科技	6,590	80,529.80	0.04
246	002789	建艺集团	1,103	79,063.04	0.04
247	600887	伊利股份	4,701	78,365.67	0.04
248	603131	上海沪工	1,263	76,664.10	0.03
249	002136	安纳达	4,759	74,811.48	0.03
250	600036	招商银行	4,155	72,712.50	0.03
251	600980	北矿科技	2,512	72,596.80	0.03
252	002790	瑞尔特	1,498	71,080.10	0.03
253	002026	山东威达	5,620	70,643.40	0.03
254	601127	小康股份	2,800	66,836.00	0.03
255	300457	赢合科技	852	65,953.32	0.03
256	300329	海伦钢琴	3,296	65,887.04	0.03
257	002100	天康生物	7,262	65,285.38	0.03
258	300351	永贵电器	1,897	64,365.21	0.03
259	300515	三德科技	1,355	63,508.85	0.03

260	000100	TCL 集团	18,800	61,852.00	0.03
261	002793	东音股份	951	61,824.51	0.03
262	000977	浪潮信息	2,627	61,603.15	0.03
263	600415	小商品城	9,680	59,822.40	0.03
264	000635	英力特	4,862	58,538.48	0.03
265	600560	金白天正	3,252	53,560.44	0.02
266	000032	深桑达 A	3,415	52,215.35	0.02
267	600894	广日股份	3,909	52,106.97	0.02
268	000798	中水渔业	4,263	51,028.11	0.02
269	002643	万润股份	1,000	50,880.00	0.02
270	000737	南风化工	9,336	50,414.40	0.02
271	300474	景嘉微	334	50,390.58	0.02
272	002046	轴研科技	4,862	50,224.46	0.02
273	600491	龙元建设	5,800	49,764.00	0.02
274	601886	江河集团	4,820	49,501.40	0.02
275	002164	宁波东力	4,220	48,065.80	0.02
276	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.02
277	002422	科伦药业	2,872	44,257.52	0.02
278	600863	内蒙华电	14,514	43,832.28	0.02
279	002583	海能达	3,558	42,838.32	0.02
280	600536	中国软件	1,690	42,114.80	0.02
281	000650	仁和药业	5,100	41,616.00	0.02
282	000656	金科股份	10,712	40,919.84	0.02
283	002200	云投生态	2,157	40,681.02	0.02
284	000883	湖北能源	8,566	39,660.58	0.02
285	600039	四川路桥	10,039	39,553.66	0.02
286	002662	京威股份	2,600	39,286.00	0.02
287	600015	华夏银行	3,829	37,868.81	0.02
288	002116	中国海诚	2,500	37,150.00	0.02
289	300194	福安药业	1,700	36,805.00	0.02
290	600517	置信电气	3,866	36,765.66	0.02
291	002104	恒宝股份	2,212	36,365.28	0.02
292	002003	伟星股份	2,300	35,949.00	0.02
293	300289	利德曼	2,400	35,904.00	0.02
294	300301	长方集团	4,200	35,574.00	0.02
295	002531	天顺风能	5,500	35,255.00	0.02
296	600872	中炬高新	2,837	35,008.58	0.02
297	600470	六国化工	4,639	34,838.89	0.02
298	002025	航天电器	1,400	34,566.00	0.02

299	002532	新界泵业	2,300	34,500.00	0.02
300	603528	多伦科技	350	34,296.50	0.02
301	600763	通策医疗	1,098	34,235.64	0.02
302	002004	华邦健康	3,717	33,936.21	0.02
303	601377	兴业证券	4,577	33,824.03	0.02
304	600865	百大集团	2,850	33,658.50	0.02
305	002255	海陆重工	3,900	33,579.00	0.02
306	600104	上汽集团	1,653	33,539.37	0.02
307	601216	君正集团	4,425	33,054.75	0.02
308	600337	美克家居	2,534	32,967.34	0.01
309	600261	阳光照明	4,582	32,348.92	0.01
310	002080	中材科技	1,600	32,128.00	0.01
311	000422	湖北宜化	5,200	31,772.00	0.01
312	600268	国电南自	4,179	31,676.82	0.01
313	600830	香溢融通	3,335	31,282.30	0.01
314	600388	龙净环保	2,465	30,960.40	0.01
315	002028	思源电气	2,800	30,660.00	0.01
316	600162	香江控股	7,248	30,369.12	0.01
317	601390	中国中铁	4,200	29,274.00	0.01
318	002558	世纪游轮	186	29,241.06	0.01
319	300113	顺网科技	763	28,963.48	0.01
320	300508	维宏股份	113	28,758.50	0.01
321	002202	金风科技	1,900	28,747.00	0.01
322	002014	永新股份	1,800	28,710.00	0.01
323	601186	中国铁建	2,764	27,529.44	0.01
324	000625	长安汽车	1,900	25,973.00	0.01
325	002234	民和股份	883	25,969.03	0.01
326	002458	益生股份	590	25,847.90	0.01
327	002441	众业达	1,539	24,916.41	0.01
328	300070	碧水源	1,600	23,808.00	0.01
329	601607	上海医药	1,278	23,067.90	0.01
330	600089	特变电工	2,700	23,004.00	0.01
331	000066	长城电脑	1,800	22,950.00	0.01
332	601018	宁波港	4,600	22,770.00	0.01
333	600406	国电南瑞	1,700	22,729.00	0.01
334	300097	智云股份	448	22,422.40	0.01
335	600547	山东黄金	569	22,139.79	0.01
336	600839	四川长虹	5,000	22,100.00	0.01
337	600703	三安光电	1,100	21,967.00	0.01

338	601333	广深铁路	5,600	21,896.00	0.01
339	600804	鹏博士	1,200	21,876.00	0.01
340	300202	聚龙股份	900	21,789.00	0.01
341	601258	庞大集团	7,800	21,450.00	0.01
342	300511	雪榕生物	319	21,254.97	0.01
343	300104	乐视网	400	21,164.00	0.01
344	600008	首创股份	5,400	21,006.00	0.01
345	300303	聚飞光电	2,200	20,922.00	0.01
346	600881	亚泰集团	4,300	20,726.00	0.01
347	002085	万丰奥威	1,200	20,628.00	0.01
348	300219	鸿利光电	1,319	20,550.02	0.01
349	600643	爱建集团	2,100	20,517.00	0.01
350	600873	梅花生物	3,300	20,493.00	0.01
351	000402	金融街	2,100	20,412.00	0.01
352	603868	飞科电器	345	20,406.75	0.01
353	300146	汤臣倍健	1,500	20,310.00	0.01
354	600199	金种子酒	1,825	20,257.50	0.01
355	601336	新华保险	500	20,200.00	0.01
356	600079	人福医药	1,200	20,124.00	0.01
357	000078	海王生物	2,700	20,061.00	0.01
358	000786	北新建材	2,200	19,976.00	0.01
359	603377	东方时尚	439	19,970.11	0.01
360	002510	天汽模	2,400	19,968.00	0.01
361	000488	晨鸣纸业	2,500	19,850.00	0.01
362	002195	二三四五	1,600	19,664.00	0.01
363	000919	金陵药业	1,495	19,569.55	0.01
364	600320	振华重工	4,600	19,550.00	0.01
365	000778	新兴铸管	4,200	19,488.00	0.01
366	600481	双良节能	3,400	19,482.00	0.01
367	002078	太阳纸业	3,971	19,378.48	0.01
368	600998	九州通	1,100	19,261.00	0.01
369	000830	鲁西化工	4,218	19,065.36	0.01
370	300018	中元股份	1,500	19,065.00	0.01
371	000736	中房地产	1,300	18,967.00	0.01
372	000729	燕京啤酒	2,496	18,944.64	0.01
373	600362	江西铜业	1,400	18,872.00	0.01
374	000050	深天马A	900	18,783.00	0.01
375	000703	恒逸石化	1,900	18,753.00	0.01
376	000680	山推股份	3,800	18,734.00	0.01

377	600122	宏图高科	1,400	18,732.00	0.01
378	600875	东方电气	1,900	18,658.00	0.01
379	600850	华东电脑	650	18,648.50	0.01
380	300267	尔康制药	1,300	18,616.00	0.01
381	600073	上海梅林	1,600	18,320.00	0.01
382	300240	飞力达	1,700	18,156.00	0.01
383	002797	第一创业	448	18,103.68	0.01
384	600185	格力地产	2,900	18,009.00	0.01
385	000958	东方能源	1,300	18,005.00	0.01
386	600335	国机汽车	1,600	17,936.00	0.01
387	002440	闰土股份	1,200	17,820.00	0.01
388	600401	海润光伏	7,300	17,812.00	0.01
389	600231	凌钢股份	7,500	17,775.00	0.01
390	002396	星网锐捷	900	17,730.00	0.01
391	600063	皖维高新	4,000	17,720.00	0.01
392	002144	宏达高科	900	17,694.00	0.01
393	000059	华锦股份	1,900	17,670.00	0.01
394	002215	诺普信	1,700	17,578.00	0.01
395	000683	远兴能源	6,700	17,554.00	0.01
396	002496	辉丰股份	3,000	17,550.00	0.01
397	002110	三钢闽光	2,900	17,516.00	0.01
398	600747	大连控股	4,000	17,480.00	0.01
399	002463	沪电股份	3,300	17,424.00	0.01
399	601918	*ST 新集	4,800	17,424.00	0.01
400	002701	奥瑞金	1,971	17,403.93	0.01
401	600126	杭钢股份	2,900	17,400.00	0.01
402	601233	桐昆股份	1,600	17,376.00	0.01
403	002588	史丹利	1,400	17,290.00	0.01
404	600285	羚锐制药	1,600	17,264.00	0.01
405	600227	赤天化	3,000	17,250.00	0.01
406	002228	合兴包装	3,100	17,236.00	0.01
407	002124	天邦股份	1,600	17,040.00	0.01
408	600801	华新水泥	2,700	17,037.00	0.01
409	002511	中顺洁柔	1,000	17,030.00	0.01
410	300118	东方日升	900	16,974.00	0.01
411	600322	天房发展	3,800	16,948.00	0.01
412	002233	塔牌集团	2,100	16,863.00	0.01
413	600754	锦江股份	500	16,730.00	0.01
414	002508	老板电器	453	16,656.81	0.01

415	000921	海信科龙	2,100	16,653.00	0.01
416	000411	英特集团	900	16,641.00	0.01
417	002536	西泵股份	1,100	16,599.00	0.01
418	600438	通威股份	2,600	16,536.00	0.01
419	300083	劲胜精密	2,000	16,520.00	0.01
420	601238	广汽集团	700	16,443.00	0.01
421	002242	九阳股份	900	16,362.00	0.01
422	000828	东莞控股	1,800	16,344.00	0.01
423	601199	江南水务	2,100	16,338.00	0.01
424	603939	益丰药房	500	16,310.00	0.01
425	000557	西部创业	3,100	16,275.00	0.01
426	002559	亚威股份	1,100	16,225.00	0.01
427	002169	智光电气	710	16,152.50	0.01
428	600983	惠而浦	1,300	16,120.00	0.01
429	600676	交运股份	1,800	16,074.00	0.01
430	000912	泸天化	2,700	16,065.00	0.01
431	600249	两面针	2,300	16,054.00	0.01
432	601677	明泰铝业	1,200	16,008.00	0.01
433	002739	万达院线	200	15,980.00	0.01
434	600713	南京医药	1,869	15,736.98	0.01
435	002016	世荣兆业	1,900	15,694.00	0.01
436	000501	鄂武商 A	1,000	15,690.00	0.01
437	600570	恒生电子	234	15,624.18	0.01
438	002279	久其软件	700	15,526.00	0.01
439	002367	康力电梯	1,000	15,400.00	0.01
440	002589	瑞康医药	500	15,355.00	0.01
441	002674	兴业科技	1,000	15,330.00	0.01
442	002714	牧原股份	300	15,159.00	0.01
443	300271	华宇软件	800	15,136.00	0.01
444	300157	恒泰艾普	1,400	15,106.00	0.01
445	000902	新洋丰	1,200	15,012.00	0.01
446	603883	老百姓	300	14,922.00	0.01
447	002139	拓邦股份	1,028	14,864.88	0.01
448	600803	新奥股份	1,266	14,786.88	0.01
449	601567	三星医疗	1,000	14,750.00	0.01
450	600195	中牧股份	800	14,640.00	0.01
451	002419	天虹商场	1,200	14,352.00	0.01
452	300510	金冠电气	208	14,052.48	0.01
453	002781	奇信股份	323	14,002.05	0.01

454	002416	爱施德	700	13,902.00	0.01
455	300392	腾信股份	500	13,540.00	0.01
456	002661	克明面业	800	13,128.00	0.01
457	002475	立讯精密	659	12,949.35	0.01
458	600867	通化东宝	611	12,641.59	0.01
459	000617	*ST 济柴	943	12,174.13	0.01
460	603101	汇嘉时代	405	12,077.10	0.01
461	600258	首旅酒店	600	11,844.00	0.01
462	000911	南宁糖业	437	10,959.96	0.00
463	300450	先导智能	288	10,889.28	0.00
464	300137	先河环保	708	10,471.32	0.00
465	300212	易华录	343	10,211.11	0.00
466	000826	启迪桑德	329	10,050.95	0.00
467	300321	同大股份	300	9,957.00	0.00
468	000592	平潭发展	1,462	9,912.36	0.00
469	600054	黄山旅游	600	9,654.00	0.00
470	603726	朗迪集团	190	9,604.50	0.00
471	300073	当升科技	130	8,702.20	0.00
472	600584	长电科技	350	7,101.50	0.00
473	000028	国药一致	100	6,510.00	0.00
474	002668	奥马电器	100	6,087.00	0.00
475	600179	*ST 黑化	493	5,245.52	0.00
476	300224	正海磁材	207	4,692.69	0.00
477	002138	顺络电子	180	3,263.40	0.00
478	300452	山河药辅	62	3,020.64	0.00
479	300465	高伟达	39	2,930.46	0.00
480	300274	阳光电源	94	2,293.60	0.00
481	002230	科大讯飞	69	2,266.65	0.00
482	300369	绿盟科技	50	2,115.50	0.00
483	300443	金雷风电	20	1,334.20	0.00
484	300174	元力股份	44	1,066.56	0.00
485	002709	天赐材料	15	1,049.10	0.00
486	601328	交通银行	166	934.58	0.00
487	300014	亿纬锂能	21	906.99	0.00
488	300065	海兰信	20	773.60	0.00
489	300059	东方财富	32	710.40	0.00
490	000783	长江证券	52	603.20	0.00
491	600351	亚宝药业	53	531.59	0.00
492	002769	普路通	4	362.72	0.00

493	000750	国海证券	45	332.55	0.00
494	000638	万方发展	4	110.00	0.00
495	000166	申万宏源	10	84.10	0.00
496	000666	经纬纺机	2	39.00	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	002329	皇氏集团	38,966,410.33	19.64
2	300302	同有科技	31,523,358.10	15.89
3	600536	中国软件	25,147,047.46	12.68
4	300213	佳讯飞鸿	23,984,910.31	12.09
5	000423	东阿阿胶	16,847,475.91	8.49
6	300274	阳光电源	15,658,498.00	7.89
7	300458	全志科技	15,578,331.78	7.85
8	600179	*ST 黑化	14,099,970.26	7.11
9	300285	国瓷材料	13,865,494.70	6.99
10	000538	云南白药	13,163,821.10	6.64
11	300224	正海磁材	13,127,542.78	6.62
12	300207	欣旺达	12,922,189.01	6.51
13	002635	安洁科技	12,850,478.77	6.48
14	300340	科恒股份	11,423,833.86	5.76
15	002458	益生股份	11,295,708.00	5.69
16	000651	格力电器	11,285,184.98	5.69
17	600085	同仁堂	11,197,851.10	5.64
18	600988	赤峰黄金	10,611,164.76	5.35
19	600436	片仔癀	10,542,338.35	5.31
20	002155	湖南黄金	10,178,041.20	5.13
21	601058	赛轮金宇	9,946,270.34	5.01
22	002268	卫士通	9,737,222.60	4.91
23	600793	ST 宜纸	9,554,286.42	4.82
24	601069	西部黄金	9,136,545.24	4.61
25	000975	银泰资源	8,604,626.38	4.34

26	000697	炼石有色	8,334,473.00	4.20
27	300101	振芯科技	8,265,236.00	4.17
28	601166	兴业银行	8,028,319.00	4.05
29	002716	金贵银业	8,009,740.75	4.04
30	002368	太极股份	7,996,351.20	4.03
31	002193	山东如意	7,902,554.68	3.98
32	300230	永利股份	7,823,909.00	3.94
33	300496	中科创达	7,809,216.68	3.94
34	600060	海信电器	7,710,768.76	3.89
35	300398	飞凯材料	7,100,289.50	3.58
36	300113	顺网科技	6,777,851.43	3.42
37	002057	中钢天源	6,619,223.96	3.34
38	300092	科新机电	6,472,635.29	3.26
39	600489	中金黄金	6,434,550.60	3.24
40	600975	新五丰	6,421,408.00	3.24
41	300029	天龙光电	6,411,783.44	3.23
42	601318	中国平安	6,390,762.48	3.22
43	002410	广联达	6,379,521.01	3.22
44	300065	海兰信	6,172,696.04	3.11
45	000001	平安银行	5,849,628.10	2.95
46	300329	海伦钢琴	5,766,920.50	2.91
47	300268	万福生科	5,712,936.50	2.88
48	300088	长信科技	5,596,607.00	2.82
49	600689	上海三毛	5,508,508.00	2.78
50	600099	林海股份	5,487,495.12	2.77
51	600597	光明乳业	5,458,415.28	2.75
52	000856	*ST 冀装	5,365,464.05	2.70
53	601169	北京银行	5,294,522.20	2.67
54	002109	*ST 兴化	5,131,714.28	2.59
55	600213	亚星客车	4,926,306.04	2.48
56	000568	泸州老窖	4,811,479.00	2.43
57	000802	北京文化	4,768,430.00	2.40
58	300375	鹏翎股份	4,613,134.86	2.33
59	601009	南京银行	4,554,225.79	2.30
60	002567	唐人神	4,503,508.00	2.27
61	600603	*ST 兴业	4,495,128.98	2.27

62	601098	中南传媒	4,448,234.80	2.24
63	600056	中国医药	4,378,937.27	2.21
64	601288	农业银行	4,342,588.00	2.19
65	000801	四川九洲	4,276,940.68	2.16
66	002142	宁波银行	4,194,505.01	2.11
67	600547	山东黄金	4,143,800.90	2.09
68	600637	东方明珠	4,116,013.00	2.07
69	000915	山大华特	4,015,724.72	2.02
70	300097	智云股份	4,007,958.00	2.02
71	300084	海默科技	3,982,404.00	2.01
72	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。

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	300302	同有科技	32,925,152.29	16.60
2	002329	皇氏集团	31,843,418.42	16.05
3	600536	中国软件	29,839,657.26	15.04
4	300213	佳讯飞鸿	25,900,324.56	13.06
5	300458	全志科技	19,694,294.81	9.93
6	300285	国瓷材料	17,777,408.78	8.96
7	300274	阳光电源	16,609,294.11	8.37
8	000423	东阿阿胶	16,007,267.88	8.07
9	002458	益生股份	15,446,174.61	7.79
10	300207	欣旺达	14,162,311.93	7.14
11	300224	正海磁材	13,841,700.99	6.98
12	000651	格力电器	13,825,566.23	6.97
13	600179	*ST 黑化	13,545,239.28	6.83
14	000538	云南白药	12,113,367.81	6.11
15	601058	赛轮金宇	11,903,532.83	6.00
16	300340	科恒股份	11,897,026.53	6.00
17	002635	安洁科技	11,274,474.99	5.68
18	000697	炼石有色	10,152,768.82	5.12
19	600793	ST 宜纸	9,797,692.36	4.94

20	600988	赤峰黄金	9,308,860.85	4.69
21	002155	湖南黄金	8,985,751.92	4.53
22	600436	片仔癀	8,932,187.93	4.50
23	601166	兴业银行	8,463,737.74	4.27
24	002268	卫士通	8,255,147.61	4.16
25	300230	永利股份	8,144,969.49	4.11
26	300496	中科创达	7,882,553.28	3.97
27	300398	飞凯材料	7,863,440.58	3.96
28	002410	广联达	7,248,372.87	3.65
29	002193	山东如意	7,027,872.84	3.54
30	300065	海兰信	7,013,823.95	3.54
31	002368	太极股份	6,914,604.80	3.49
32	600689	上海三毛	6,877,768.87	3.47
33	601069	西部黄金	6,617,257.78	3.34
34	300029	天龙光电	6,504,537.58	3.28
35	600085	同仁堂	6,458,688.53	3.26
36	002716	金贵银业	6,409,507.69	3.23
37	600975	新五丰	6,393,394.77	3.22
38	300101	振芯科技	6,375,683.58	3.21
39	000001	平安银行	6,356,734.87	3.20
40	300113	顺网科技	6,339,785.85	3.20
41	300329	海伦钢琴	6,301,373.96	3.18
42	600637	东方明珠	6,288,160.68	3.17
43	000975	银泰资源	6,000,261.17	3.02
44	002057	中钢天源	5,976,427.25	3.01
45	000856	*ST 冀装	5,947,250.90	3.00
46	300088	长信科技	5,574,509.36	2.81
47	600597	光明乳业	5,432,461.81	2.74
48	300268	万福生科	5,431,634.36	2.74
49	601169	北京银行	5,406,329.16	2.73
50	000802	北京文化	5,174,658.13	2.61
51	002109	*ST 兴化	5,117,868.98	2.58
52	601318	中国平安	5,069,412.49	2.56
53	600489	中金黄金	4,731,605.53	2.39
54	600099	林海股份	4,719,885.75	2.38
55	300069	金利华电	4,609,410.86	2.32
56	300097	智云股份	4,532,637.76	2.28
57	000776	广发证券	4,517,618.92	2.28

58	300092	科新机电	4,447,908.15	2.24
59	002003	伟星股份	4,356,215.15	2.20
60	002372	伟星新材	4,347,866.21	2.19
61	300351	永贵电器	4,307,131.70	2.17
62	600603	*ST 兴业	4,295,105.88	2.17
63	600213	亚星客车	4,253,965.48	2.14
64	600547	山东黄金	4,158,530.51	2.10
65	002142	宁波银行	4,078,980.73	2.06
66	000915	山大华特	4,040,604.59	2.04
67	601009	南京银行	4,020,800.92	2.03
68	300084	海默科技	3,985,283.71	2.01

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,091,100,823.52
卖出股票收入（成交）总额	1,046,650,793.52

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	9,994,000.00	4.54
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	9,994,000.00	4.54

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

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	160005	16 付息国债 05	100,000	9,994,000.00	4.54

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货投资，也无期间损益。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期内，本基金未运用股指期货进行投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本报告期内，本基金未运用国债期货进行投资。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货投资，也无期间损益。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本报告期内，本基金未运用国债期货进行投资。

7.12 投资组合报告附注

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

7.12.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

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	218,558.11
2	应收证券清算款	12,153,333.01
3	应收股利	-
4	应收利息	85,766.84
5	应收申购款	275,794.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,733,452.76

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	002567	唐人神	5,312,400.00	2.42	重大事项
2	000975	银泰资源	4,002,300.00	1.82	重大事项

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
4,629	24,877.08	42,901,992.12	37.26%	72,254,021.09	62.74%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	562,078.90	0.49%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (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	40,840,253.54
减:本报告期基金总赎回份额	13,256,692.13
本报告期基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-
本报告期期末基金份额总额	115,156,013.21

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

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

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：

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：

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略没有明显改变。

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

本报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	

银河证券	2	755,798,905.33	35.37%	692,662.89	35.70%	-
招商证券	1	412,909,873.80	19.32%	376,285.41	19.40%	-
中金	1	271,101,342.19	12.69%	247,056.37	12.73%	-
民生证券	1	202,462,490.52	9.48%	184,504.58	9.51%	-
兴业证券	1	150,336,555.64	7.04%	140,007.90	7.22%	-
中信证券	2	125,165,089.27	5.86%	114,062.26	5.88%	-
瑞银证券	1	74,557,155.43	3.49%	53,032.96	2.73%	-
国信证券	1	61,744,145.72	2.89%	56,268.05	2.90%	-
光大证券	1	43,691,873.02	2.04%	39,816.54	2.05%	-
申万宏源	1	38,992,039.50	1.82%	36,310.23	1.87%	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
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。

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
银河证券	-	-	201,000,000.00	37.18%	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金	-	-	195,600,000.00	36.18%	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	105,000,000.00	19.42%	-	-
中信证券	-	-	24,000,000.00	4.44%	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	15,000,000.00	2.77%	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	工银瑞信基金管理有限公司关于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	中国证监会指定的媒介	2016年1月29日

	费率优惠的公告		
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调整的公告	中国证监会指定的媒介	2016 年 2 月 24 日
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	中国证监会指定的	2016 年 5 月 4 日

	增加徽商银行股份有限公司为旗下基金销售机构的公告	媒介	
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调整的公告	中国证监会指定的媒介	2016年6月2日
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

§ 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基本面量化策略混合型证券投资基金设立的文件
- 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和营业执照
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 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住所。

12.3 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