

工银瑞信绝对收益策略混合型发起式证券投资基金 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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 19 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.....	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.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	16
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.....	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	20
§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.....	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	50
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.....	51
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.....	51
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.....	51
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.....	51
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	52

7.12 投资组合报告附注.....	52
§8 基金份额持有人信息.....	53
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	53
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.....	54
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	54
§9 开放式基金份额变动.....	54
§10 重大事件揭示.....	55
10.1 基金份额持有人大会决议.....	55
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.....	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	55
10.4 基金投资策略的改变.....	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	55
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.....	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	56
10.8 其他重大事件.....	57
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	59
§12 备查文件目录.....	59
12.1 备查文件目录.....	59
12.2 存放地点.....	59
12.3 查阅方式.....	60

§ 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	契约型定期开放式	
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	5,005,718,285.94 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	4,413,912,924.74 份	591,805,361.20 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 5 号、甲 5 号 6 层甲 5 号 601、甲 5 号 7 层甲	上海市浦东新区银城中路 188 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	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办公场所

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(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-152,266,784.55	-20,977,358.83
本期利润	-222,153,003.04	-29,723,900.45
加权平均基金份额本期利润	-0.0435	-0.0439
本期加权平均净值利润率	-3.98%	-4.11%
本期基金份额净值增长率	-3.29%	-3.72%
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	312,558,224.60	25,865,917.30
期末可供分配基金份额利润	0.0708	0.0437
期末基金资产净值	4,799,593,417.95	627,522,650.82
期末基金份额净值	1.087	1.060
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	8.70%	6.00%

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

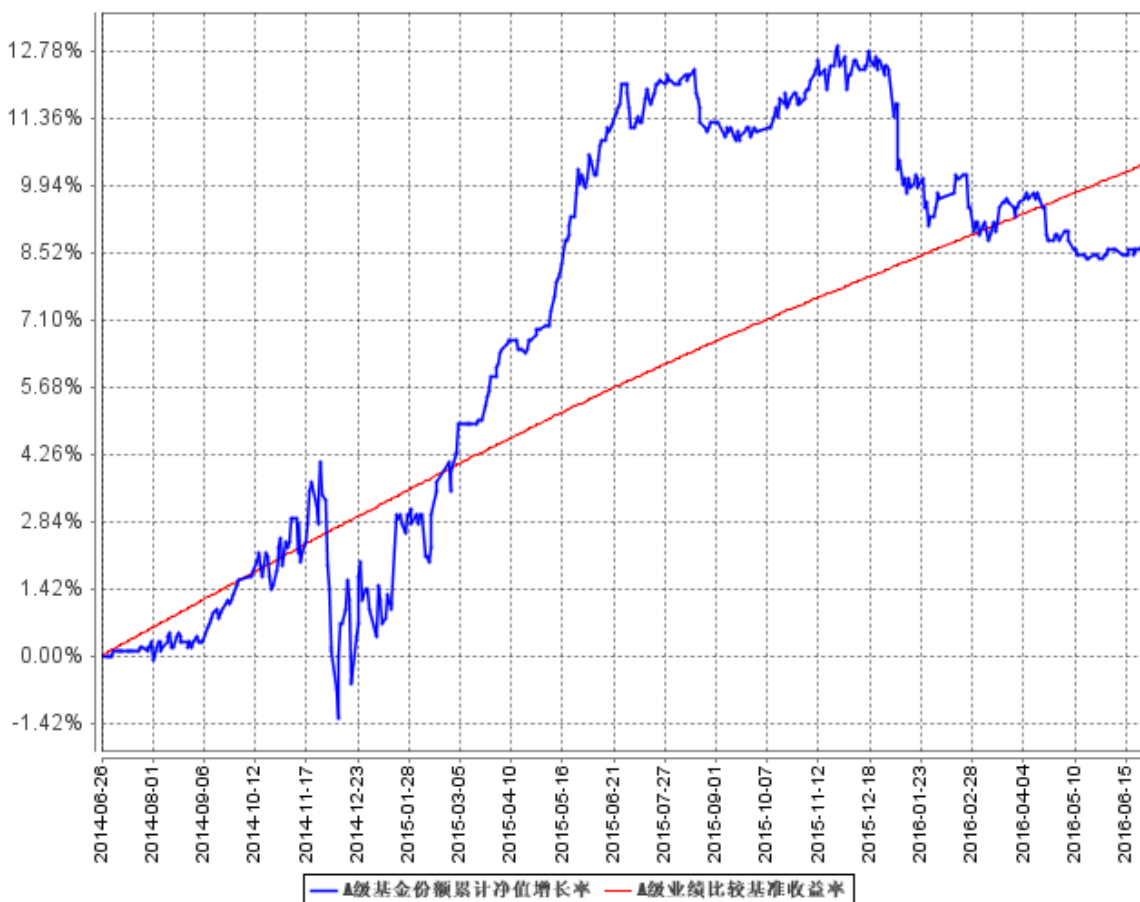
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.18%	0.06%	0.37%	0.01%	-0.19%	0.05%
过去三个月	-0.73%	0.10%	1.12%	0.01%	-1.85%	0.09%
过去六个月	-3.29%	0.21%	2.24%	0.01%	-5.53%	0.20%
过去一年	-3.03%	0.19%	4.62%	0.01%	-7.65%	0.18%
自基金合同生效以来	8.70%	0.28%	10.43%	0.02%	-1.73%	0.26%

工银绝对收益混合发起 B

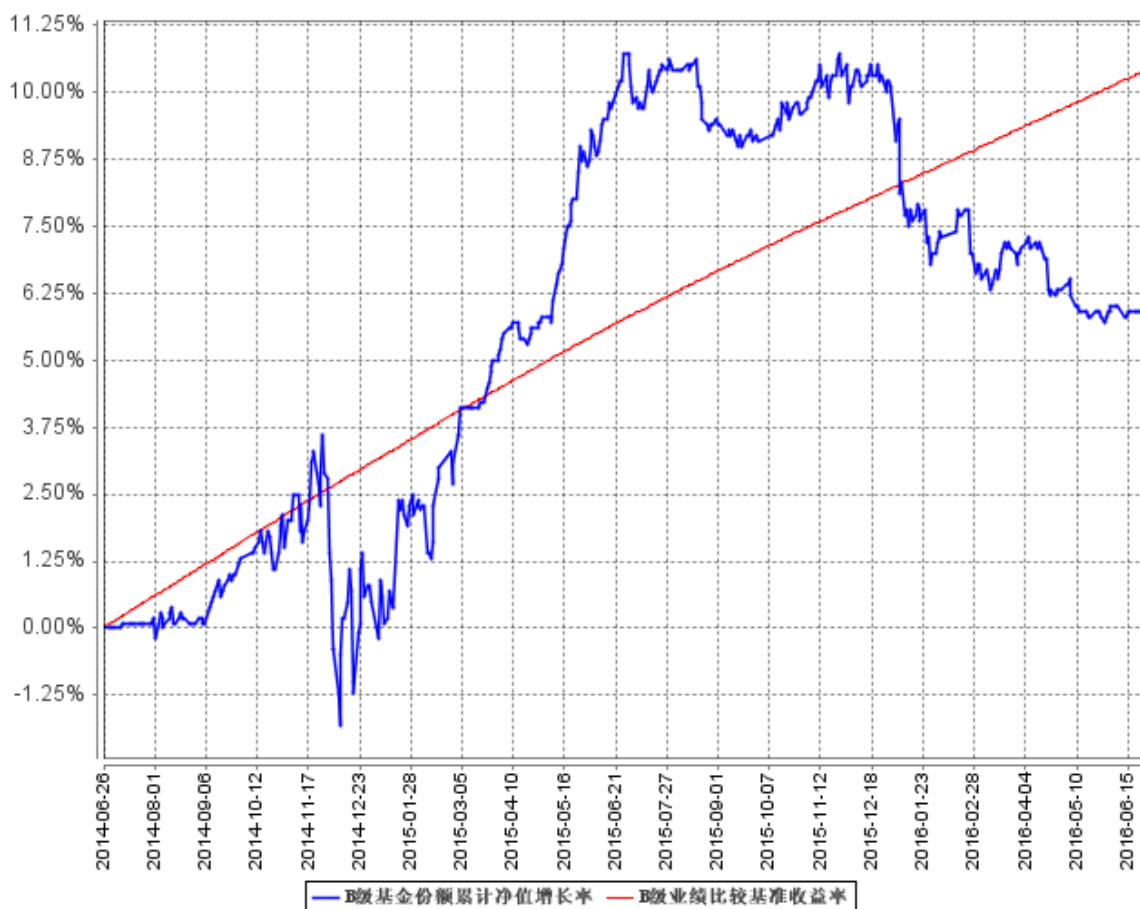
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.19%	0.07%	0.37%	0.01%	-0.18%	0.06%
过去三个月	-0.93%	0.11%	1.12%	0.01%	-2.05%	0.10%
过去六个月	-3.72%	0.22%	2.24%	0.01%	-5.96%	0.21%
过去一年	-4.25%	0.19%	4.62%	0.01%	-8.87%	0.18%
自基金合同生效以来	6.00%	0.29%	10.43%	0.02%	-4.43%	0.27%

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 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、工银瑞信中高信用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	2014 年 6 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。
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	-	19	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，曾任工银核心价值混合基金、工银精选平衡混合型基金、工银稳健成长混合型基金基金经理、专户投资部专户投资经理，现任权益投资部副总监，2011年10月11日至今，担任工银瑞信中小盘成长混合型证券投资基金基金经理；2012年12月5日至今，担任工银瑞信大盘蓝筹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；2014年12月30日至今，担任工银瑞信消费服务行业混合型证券投资基金基金经理；2015年8月6日至今，担任工银瑞信新蓝筹股票型基金基金经理；2016年4月20日，担任工银瑞信沪港深股票型证券投资基金基金经理。
胡志利	本基金的基金经理	2015年8月18日	-	4	2012年加入工银瑞信，现任权益投资部基金经理，2015年8月18日至今，

					担任工银瑞信绝对收益混合型基金基金经理。
--	--	--	--	--	----------------------

注：

1、任职日期说明：

- 1) 游凜峰的任职日期为基金合同生效的日期
- 2) 王筱苓的任职日期为基金合同生效的日期
- 3) 胡志利的任职日期为公司执委会决议正式生效日期

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遵规守信情况的说明

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

2016 年伊始，市场经过一波下跌，持续到 2 月底，随着稳增长的措施以及信贷的投放，市场走出一波行情，以新能源产业链、电子产业链股票、食品饮料为主的反弹行情，市场主要表现为区间震荡存量博弈的情况，本基金受交易规则以及市场情绪的影响，股指期货与现货处于长期贴水状态，不利于进行对冲操作，同时本基金进行了积极的策略调整，一直保持低仓位来避免极端负基差对基金带来的影响，策略调整包括三类对冲策略：量化组合 alpha 对冲、事件驱动、个股精选策略，采用更为集中的策略并同时采用时间分散的策略来防范风险；投资期限不跨交割日以及长期 Alpha 并存的状态，相较一季度，改观的是 6 月中旬非成分股的卖出给基金操作带来便利。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，工银绝对收益混合发起 A 份额净值增长率为-3.29%，工银绝对收益混合发起 B 份额净值增长率为-3.72%，业绩比较基准收益率为 2.24%。

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改革措施的持续推进，由于全年的经济目标 6.5%是个底线，预期季度的政策资金环境相对温和，随着供给侧、国企改革的持续推进，市场倾向于震荡结构性行情。这种状况给主题投资的提供了较好的市场环境。

我们预期下半年市场会以某种形式重复上半年的走势。相同点是在少数较为靠谱的主题内轮换；具体主题有至少一至二年盈利高增长预期的如资源（有色、稀土）、农业、新能源汽车、新一代手机更替、生活智能化等。三至五年的投资机会包含大数据、云计算、信息安全等在计算机中的个别子行业投资机会也会是我们关注的重点。这些机会也是我们事件驱动及个股精选策略跟踪的机会。从交易方法上我们会积极止损、严格风控来提高业绩的稳定性。

本基金将通过多因子策略、成长策略，价值策略、事件驱动及新股认购等多策略组合来最大限度的发掘经济转型带来的投资机会，在投资中严格控制行业风险和风格风险，使用股指期货来对冲系统性风险，实现绝对收益目的。

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

2016 年上半年度，基金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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2016 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

2016 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：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	5,344,275.60	100,400,338.98
结算备付金		183,261,383.61	826,166,397.96
存出保证金		85,538,459.76	249,469,152.94
交易性金融资产	6.4.7.2	785,527,434.81	2,123,551,340.97
其中：股票投资		504,901,320.91	1,482,850,142.17
基金投资		-	-
债券投资		280,626,113.90	640,701,198.80
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	4,382,440,723.66	4,359,674,964.50
应收证券清算款		8,146,472.57	-
应收利息	6.4.7.5	3,854,688.70	24,428,602.40
应收股利		-	-
应收申购款		212,700.79	457,431.93
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-

资产总计		5,454,326,139.50	7,684,148,229.68
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		-	5,603,422.62
应付赎回款		7,500,972.41	42,286,839.83
应付管理人报酬		6,792,172.98	10,162,958.22
应付托管费		4,818,393.76	11,341,798.32
应付销售服务费		414,911.70	722,079.65
应付交易费用	6.4.7.7	7,474,101.15	5,101,674.43
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	209,518.73	311,453.69
负债合计		27,210,070.73	75,530,226.76
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	5,005,718,285.94	6,788,423,106.78
未分配利润	6.4.7.10	421,397,782.83	820,194,896.14
所有者权益合计		5,427,116,068.77	7,608,618,002.92
负债和所有者权益总计		5,454,326,139.50	7,684,148,229.68

注：1、本基金基金合同生效日为2014年6月26日。

2、报告截止日2016年6月30日，基金份额总额为5,005,718,285.94份，其中A类基金份额净值为人民币1.087元，份额总额为4,413,912,924.74份；B类基金份额净值为人民币1.060元，份额总额为591,805,361.20份。

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：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		-177,074,329.95	817,759,412.37
1.利息收入		71,084,212.39	90,997,218.77
其中：存款利息收入	6.4.7.11	22,015,365.51	61,770,550.51
债券利息收入		5,348,325.40	8,152,622.97
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		43,720,521.48	21,074,045.29

其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-173,603,843.09	566,338,363.17
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-274,870,635.46	688,318,912.87
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-2,969,106.03	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	102,547,497.70	-127,770,514.53
股利收益	6.4.7.16	1,688,400.70	5,789,964.83
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-78,632,760.11	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	4,078,060.86	3,605,938.55
减：二、费用		74,802,573.54	107,066,053.93
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	47,126,259.92	57,058,609.21
2. 托管费	6.4.10.2.2	7,854,376.60	9,509,768.21
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	2,885,794.80	24,181,454.83
4. 交易费用	6.4.7.19	16,687,610.08	15,589,209.76
5. 利息支出		13,128.08	492,703.73
其中：卖出回购金融资产支出		13,128.08	492,703.73
6. 其他费用	6.4.7.20	235,404.06	234,308.19
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-251,876,903.49	710,693,358.44
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-251,876,903.49	710,693,358.44

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：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）	6,788,423,106.78	820,194,896.14	7,608,618,002.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本	-	-251,876,903.49	-251,876,903.49

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 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	5,344,275.60
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-

合计:	5,344,275.60
-----	--------------

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	488,014,999.47	504,901,320.91	16,886,321.44
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	778,113.90	109,113.90
	银行间市场	279,848,000.00	184,920.00
	合计	280,626,113.90	294,033.90
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	768,347,079.47	785,527,434.81	17,180,355.34

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 2016 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 2016 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 2016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	2,162,440,723.66	-
买入返售证券	2,220,000,000.00	-
合计	4,382,440,723.66	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易，也无在买断式逆回购交易中取得的债券。

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	248,206.13
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	339,392.99
应收债券利息	1,456,895.65
应收买入返售证券利息	1,808,954.73
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	1,239.20
合计	3,854,688.70

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	7,415,812.49
银行间市场应付交易费用	58,288.66
合计	7,474,101.15

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	1,314.57
预提信息披露费	149,178.12
预提审计费	49,726.04
预提账户维护费	9,300.00
合计	209,518.73

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 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	5,958,300,312.56	5,958,300,312.56

本期申购	1,208,261,483.49	1,208,261,483.49
本期赎回(以“-”号填列)	-2,752,648,871.31	-2,752,648,871.31
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	4,413,912,924.74	4,413,912,924.74

金额单位：人民币元

工银绝对收益混合发起 B		
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	830,122,794.22	830,122,794.22
本期申购	5,468,009.83	5,468,009.83
本期赎回(以“-”号填列)	-243,785,442.85	-243,785,442.85
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	591,805,361.20	591,805,361.20

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	566,404,669.82	170,169,185.97	736,573,855.79
本期利润	-152,266,784.55	-69,886,218.49	-222,153,003.04
本期基金份额交易产生的变动数	-101,579,660.67	-27,160,698.87	-128,740,359.54
其中：基金申购款	104,857,957.82	27,646,440.07	132,504,397.89
基金赎回款	-206,437,618.49	-54,807,138.94	-261,244,757.43
本期已分配利润	-	-	-
本期末	312,558,224.60	73,122,268.61	385,680,493.21

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	60,062,445.46	23,558,594.89	83,621,040.35
本期利润	-20,977,358.83	-8,746,541.62	-29,723,900.45
本期基金份额交易产生的变动数	-13,219,169.33	-4,960,680.95	-18,179,850.28

其中：基金申购款	266,159.09	118,491.85	384,650.94
基金赎回款	-13,485,328.42	-5,079,172.80	-18,564,501.22
本期已分配利润	-	-	-
本期末	25,865,917.30	9,851,372.32	35,717,289.62

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	2,670,832.14
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	19,317,377.74
其他	27,155.63
合计	22,015,365.51

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 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	6,291,170,808.64
减：卖出股票成本总额	6,566,041,444.10
买卖股票差价收入	-274,870,635.46

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	-2,969,106.03
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	-2,969,106.03

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	663,134,616.89
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	641,476,160.00
减：应收利息总额	24,627,562.92
买卖债券差价收入	-2,969,106.03

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

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

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 2016年1月1日至2016年6月30日
权证投资收益	-
股指期货-投资收益	102,547,497.70

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	1,688,400.70
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,688,400.70

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	-65,429,690.41
——股票投资	-66,498,685.51

——债券投资	1,068,995.10
——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	-13,203,069.70
合计	-78,632,760.11

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 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	1,553,003.72
基金转换费收入	2,525,057.14
合计	4,078,060.86

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	16,686,460.08
银行间市场交易费用	1,150.00
合计	16,687,610.08

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	49,726.04
信息披露费	149,178.12
账户维护费	18,600.00
其他	400.00
银行费用	17,499.90
合计	235,404.06

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

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	47,126,259.92	57,058,609.21
其中：支付销售机构的客户维护费	1,224,595.24	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	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	7,854,376.60	9,509,768.21

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 2016 年 1 月 1 日至 2016 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	-	2,349,310.97	2,349,310.97
中国工商银行股份有限公司	-	237,395.96	237,395.96
交通银行股份有限公司	-	47,694.51	47,694.51
合计	-	2,634,401.44	2,634,401.44
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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

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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2016年1月1日至2016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	28,818,443.80
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	28,818,443.80
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.18%	0.58%

项目	上年度可比期间 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	0.06%	-

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

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持有本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 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
交通银行股份有限公司	5,344,275.60	2,670,832.14	210,395,856.57	2,440,114.85

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交通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

无。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金本报告期末未进行利润分配。

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	818,600	11,285,514.00	11,444,028.00	-
000401	冀东水泥	2016年4月6日	重大事项	10.60	2016年7月14日	11.32	436,600	4,507,736.10	4,627,960.00	指数法估值

000923	河北宣工	2016年4月6日	重大事项	15.80	-	-	84,225	1,224,372.69	1,330,755.00	-
000610	西安旅游	2016年4月11日	重大事项	12.85	2016年7月25日	14.14	96,847	1,193,061.53	1,244,483.95	-
000651	格力电器	2016年2月22日	重大事项	22.07	-	-	42,897	903,528.21	946,736.79	指数法估值
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	37,059	128,594.73	775,274.28	-
000975	银泰资源	2016年4月19日	重大事项	15.00	-	-	33,378	459,609.86	500,670.00	-
002465	海格通信	2016年6月13日	重大事项	12.44	-	-	23,004	262,976.50	286,169.76	-
603919	金徽酒	2016年6月6日	重大事项	30.90	2016年7月5日	33.99	6,603	72,236.82	204,032.70	-
601900	南方传媒	2016年6月6日	重大事项	17.67	-	-	9,776	59,926.88	172,741.92	-
000617	*ST济柴	2016年4月20日	重大事项	12.91	-	-	7,900	123,866.00	101,989.00	-
600455	博通股份	2016年5月5日	重大事项	49.14	-	-	2,033	96,580.25	99,901.62	-
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	9,000	125,100.00	92,970.00	-
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	1,908	52,150.56	72,141.48	-
600649	城投控股	2016年6月20日	重大事项	14.36	-	-	3,723	52,437.01	53,462.28	-
600019	宝钢股份	2016年6月27日	重大事项	4.90	-	-	6,443	33,352.38	31,570.70	-
002057	中钢天源	2016年6月	重大事项	15.05	-	-	1,695	25,239.09	25,509.75	-

		13 日								
600005	武钢股份	2016 年 6 月 27 日	重大事项	2.76	-	-	7,524	21,558.70	20,766.24	-
600768	宁波富邦	2016 年 3 月 31 日	重大事项	24.42	-	-	717	15,269.35	17,509.14	-

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-8,723.55 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 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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
AAA	-	8,540,198.80
AAA 以下	778,113.90	652,000.00
未评级	-	-
合计	778,113.90	9,192,198.80

注：1、表中所列示的债券投资为除短期融资券以外的信用债券。

2、上述评级均取第三方评级机构的债项评级。

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 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	5,344,275.60	-	-	-	-	-	5,344,275.60

结算备付金	183,261,383.61	-	-	-	-	-	183,261,383.61
存出保证金	85,538,459.76	-	-	-	-	-	85,538,459.76
交易性金融资产	-	-279,848,000.00	-	-	778,113.90	504,901,320.91	785,527,434.81
买入返售金融资产	4,382,440,723.66	-	-	-	-	-	4,382,440,723.66
应收证券清算款	-	-	-	-	-	8,146,472.57	8,146,472.57
应收利息	-	-	-	-	-	3,854,688.70	3,854,688.70
应收申购款	-	-	-	-	-	212,700.79	212,700.79
资产总计	4,656,584,842.63	-279,848,000.00	-	-	778,113.90	517,115,182.97	5,454,326,139.50
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	7,500,972.41	7,500,972.41
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	6,792,172.98	6,792,172.98
应付托管费	-	-	-	-	-	4,818,393.76	4,818,393.76
应付销售服务费	-	-	-	-	-	414,911.70	414,911.70
应付交易费用	-	-	-	-	-	7,474,101.15	7,474,101.15
其他负债	-	-	-	-	-	209,518.73	209,518.73
负债总计	-	-	-	-	-	27,210,070.73	27,210,070.73
利率敏感度缺口	4,656,584,842.63	-279,848,000.00	-	-	778,113.90	489,905,112.24	5,427,116,068.77
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	100,400,338.98	-	-	-	-	-	100,400,338.98
结算备付金	826,166,397.96	-	-	-	-	-	826,166,397.96
存出保证金	249,469,152.94	-	-	-	-	-	249,469,152.94
交易性金融资产	200,130,000.00	150,555,000.00	280,824,000.00	2,008,001.80	7,184,197.00	1,482,850,142.17	2,123,551,340.97
买入返售金融资产	4,359,674,964.50	-	-	-	-	-	4,359,674,964.50
应收利息	-	-	-	-	-	24,428,602.40	24,428,602.40
应收申购款	-	-	-	-	-	457,431.93	457,431.93
资产总计	5,735,840,854.38	150,555,000.00	280,824,000.00	2,008,001.80	7,184,197.00	1,507,736,176.50	7,684,148,229.68
负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	0.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-	5,603,422.62	5,603,422.62
应付赎回款	-	-	-	-	-	42,286,839.83	42,286,839.83

应付管理人报酬	-	-	-	-	-	10,162,958.22	10,162,958.22
应付托管费	-	-	-	-	-	11,341,798.32	11,341,798.32
应付销售服务费	-	-	-	-	-	722,079.65	722,079.65
应付交易费用	-	-	-	-	-	5,101,674.43	5,101,674.43
其他负债	-	-	-	-	-	311,453.69	311,453.69
负债总计	-	-	-	-	-	75,530,226.76	75,530,226.76
利率敏感度缺口	5,735,840,854.38	150,555,000.00	280,824,000.00	2,008,001.80	7,184,197.00	1,432,205,949.74	7,608,618,002.92

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	-551,361.18	-326,645.62
	利率减少 25 基准点	553,651.73	327,126.37

6.4.13.4.2 外汇风险

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	公允价值	占基金资产净值比

		值比例 (%)		例 (%)
交易性金融资产-股票投资	504,901,320.91	9.30	1,482,850,142.17	19.49
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	280,626,113.90	5.17	640,701,198.80	8.42
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	785,527,434.81	14.47	2,123,551,340.97	27.91

注：1、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%。

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%	-39,744,568.05	425,001,632.27
业绩比较基准减少 5%	39,744,568.05	-425,001,632.27	

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	504,901,320.91	9.26
	其中：股票	504,901,320.91	9.26
2	固定收益投资	280,626,113.90	5.15
	其中：债券	280,626,113.90	5.15
	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	4,382,440,723.66	80.35
	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	188,605,659.21	3.46
7	其他各项资产	97,752,321.82	1.79
8	合计	5,454,326,139.50	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	14,557,310.95	0.27
B	采矿业	44,593,861.98	0.82
C	制造业	324,728,331.20	5.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,324,059.10	0.02
E	建筑业	1,510,723.98	0.03
F	批发和零售业	2,027,159.89	0.04
G	交通运输、仓储和邮政业	7,089,047.22	0.13
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	89,568,142.76	1.65
J	金融业	9,483,566.07	0.17
K	房地产业	230,997.45	0.00
L	租赁和商务服务业	928,686.04	0.02

M	科学研究和技术服务业	6,612.15	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	7,333,129.50	0.14
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	315,518.64	0.01
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	678,557.60	0.01
S	综合	525,616.38	0.01
	合计	504,901,320.91	9.30

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。

7.2.2 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	3,858,882	68,225,033.76	1.26
2	600056	中国医药	3,263,900	51,765,454.00	0.95
3	600085	同仁堂	821,278	24,465,871.62	0.45
4	300017	网宿科技	338,029	22,715,548.80	0.42
5	002410	广联达	1,159,109	16,575,258.70	0.31
6	600666	奥瑞德	464,200	16,135,592.00	0.30
7	300302	同有科技	462,608	15,020,881.76	0.28
8	002635	安洁科技	389,667	14,955,419.46	0.28
9	600489	中金黄金	1,312,974	14,757,827.76	0.27
10	601899	紫金矿业	4,231,179	14,259,073.23	0.26
11	002001	新和成	670,300	14,163,439.00	0.26
12	000592	平潭发展	2,004,470	13,590,306.60	0.25
13	600547	山东黄金	327,601	12,746,954.91	0.23
14	002329	皇氏集团	830,719	12,452,477.81	0.23
15	600519	贵州茅台	40,027	11,684,681.84	0.22
16	600637	东方明珠	473,543	11,492,888.61	0.21
17	002567	唐人神	818,600	11,444,028.00	0.21
18	000568	泸州老窖	316,543	9,401,327.10	0.17
19	002439	启明星辰	347,146	8,966,781.18	0.17

20	600251	冠农股份	1,104,657	8,837,256.00	0.16
21	002456	欧菲光	272,800	8,047,600.00	0.15
22	002368	太极股份	200,319	7,117,334.07	0.13
23	600298	安琪酵母	379,569	6,771,510.96	0.12
24	002179	中航光电	141,092	6,112,105.44	0.11
25	000826	启迪桑德	199,301	6,088,645.55	0.11
26	300287	飞利信	428,800	5,745,920.00	0.11
27	002025	航天电器	203,200	5,017,008.00	0.09
28	603885	吉祥航空	184,300	4,837,875.00	0.09
29	300092	科新机电	313,895	4,802,593.50	0.09
30	000401	冀东水泥	436,600	4,627,960.00	0.09
31	600978	宜华生活	391,100	4,356,854.00	0.08
32	002701	奥瑞金	377,000	3,328,910.00	0.06
33	300088	长信科技	223,000	3,316,010.00	0.06
34	601989	中国重工	501,000	3,171,330.00	0.06
35	601939	建设银行	573,400	2,723,650.00	0.05
36	600000	浦发银行	150,000	2,335,500.00	0.04
37	002193	山东如意	128,018	2,100,775.38	0.04
38	002385	大北农	247,500	1,994,850.00	0.04
39	000876	新希望	230,400	1,916,928.00	0.04
40	300483	沃施股份	27,810	1,675,830.60	0.03
41	000923	河北宣工	84,225	1,330,755.00	0.02
42	601688	华泰证券	70,000	1,324,400.00	0.02
43	000783	长江证券	113,000	1,310,800.00	0.02
44	000610	西安旅游	96,847	1,244,483.95	0.02
45	300260	新莱应材	32,608	1,169,322.88	0.02
46	600887	伊利股份	66,400	1,106,888.00	0.02
47	002292	奥飞娱乐	36,700	1,099,165.00	0.02
48	000985	大庆华科	41,398	1,023,772.54	0.02
49	600561	江西长运	81,324	993,779.28	0.02
50	002627	宜昌交运	46,896	992,319.36	0.02
51	000785	武汉中商	88,483	986,585.45	0.02
52	000692	惠天热电	176,039	982,297.62	0.02
53	000651	格力电器	42,897	946,736.79	0.02
54	002183	怡亚通	59,500	852,040.00	0.02
55	000860	顺鑫农业	34,670	824,452.60	0.02
56	300330	华虹计通	44,605	794,415.05	0.01
57	002299	圣农发展	30,100	779,590.00	0.01
58	601611	中国核建	37,059	775,274.28	0.01

59	300200	高盟新材	47,104	767,795.20	0.01
60	000566	海南海药	69,782	761,321.62	0.01
61	600985	雷鸣科化	65,574	722,625.48	0.01
62	002013	中航机电	53,586	722,339.28	0.01
63	600099	林海股份	60,164	708,130.28	0.01
64	603019	中科曙光	17,667	703,499.94	0.01
65	000697	炼石有色	30,516	697,290.60	0.01
66	600348	阳泉煤业	107,653	685,749.61	0.01
67	600395	盘江股份	81,736	675,139.36	0.01
68	300022	吉峰农机	81,966	671,301.54	0.01
69	300496	中科创达	9,897	670,224.84	0.01
70	000895	双汇发展	29,183	609,341.04	0.01
71	000975	银泰资源	33,378	500,670.00	0.01
72	300405	科隆精化	10,073	463,458.73	0.01
73	002205	国统股份	18,979	452,459.36	0.01
74	300371	汇中股份	12,295	442,374.10	0.01
75	600746	江苏索普	44,877	441,140.91	0.01
76	300207	欣旺达	17,141	440,009.47	0.01
77	600436	片仔癀	9,767	439,612.67	0.01
78	600213	亚星客车	34,082	434,886.32	0.01
79	300458	全志科技	4,019	429,952.62	0.01
80	600603	*ST 兴业	37,278	425,714.76	0.01
81	300218	安利股份	27,621	425,087.19	0.01
82	300174	元力股份	17,319	419,812.56	0.01
83	300062	中能电气	17,306	419,324.38	0.01
84	300344	太空板业	35,466	419,208.12	0.01
85	601628	中国人寿	19,699	410,133.18	0.01
86	603866	桃李面包	8,110	363,003.60	0.01
87	002164	宁波东力	30,600	348,534.00	0.01
88	600038	中直股份	7,867	326,323.16	0.01
89	603377	东方时尚	6,936	315,518.64	0.01
90	300065	海兰信	7,998	309,362.64	0.01
91	300495	美尚生态	6,366	305,695.32	0.01
92	603528	多伦科技	3,112	304,944.88	0.01
93	300113	顺网科技	7,864	298,517.44	0.01
94	300073	当升科技	4,450	297,883.00	0.01
95	002465	海格通信	23,004	286,169.76	0.01
96	600036	招商银行	15,319	268,082.50	0.00
97	600016	民生银行	28,724	256,505.32	0.00

98	603996	中新科技	8,322	253,904.22	0.00
99	002788	鹭燕医药	3,663	236,556.54	0.00
100	002791	坚朗五金	3,973	213,628.21	0.00
101	601127	小康股份	8,662	206,761.94	0.00
102	603999	读者传媒	6,632	205,127.76	0.00
103	603919	金徽酒	6,603	204,032.70	0.00
104	601098	中南传媒	10,984	198,920.24	0.00
105	603800	道森股份	6,245	192,033.75	0.00
106	601900	南方传媒	9,776	172,741.92	0.00
107	601988	中国银行	53,482	171,677.22	0.00
108	603737	三棵树	1,327	154,038.16	0.00
109	603030	全筑股份	5,549	151,820.64	0.00
110	600999	招商证券	8,567	141,355.50	0.00
111	000798	中水渔业	11,700	140,049.00	0.00
112	600980	北矿科技	4,600	132,940.00	0.00
113	300101	振芯科技	4,234	118,255.62	0.00
114	601336	新华保险	2,767	111,786.80	0.00
115	002594	比亚迪	1,767	107,804.67	0.00
116	000635	英力特	8,950	107,758.00	0.00
117	600867	通化东宝	5,053	104,546.57	0.00
118	002475	立讯精密	5,304	104,223.60	0.00
119	000617	*ST 济柴	7,900	101,989.00	0.00
120	600455	博通股份	2,033	99,901.62	0.00
121	600018	上港集团	18,976	96,777.60	0.00
122	600109	国金证券	6,976	94,036.48	0.00
123	002046	轴研科技	9,000	92,970.00	0.00
124	000737	南风化工	17,200	92,880.00	0.00
125	002500	山西证券	5,402	89,457.12	0.00
126	600383	金地集团	8,539	88,464.04	0.00
127	601669	中国电建	15,300	87,363.00	0.00
128	002230	科大讯飞	2,627	86,296.95	0.00
129	000858	五粮液	2,472	80,414.16	0.00
130	601788	光大证券	4,721	79,973.74	0.00
131	603131	上海沪工	1,263	76,664.10	0.00
132	000423	东阿阿胶	1,419	74,965.77	0.00
133	300450	先导智能	1,908	72,141.48	0.00
134	600739	辽宁成大	4,338	67,542.66	0.00
135	600170	上海建工	17,100	65,493.00	0.00
136	300251	光线传媒	5,522	63,834.32	0.00

137	300515	三德科技	1,355	63,508.85	0.00
138	000538	云南白药	925	59,477.50	0.00
139	601088	中国神华	4,214	59,290.98	0.00
140	600649	城投控股	3,723	53,462.28	0.00
141	601016	节能风电	5,219	51,824.67	0.00
142	601021	春秋航空	1,081	51,823.14	0.00
143	601901	方正证券	6,526	49,989.16	0.00
144	002136	安纳达	3,165	49,753.80	0.00
145	002365	永安药业	2,698	49,130.58	0.00
146	002169	智光电气	2,143	48,753.25	0.00
147	600309	万华化学	2,800	48,440.00	0.00
148	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.00
149	600028	中国石化	9,969	47,053.68	0.00
150	002081	金螳螂	4,651	46,603.02	0.00
151	600804	鹏博士	2,527	46,067.21	0.00
152	600196	复星医药	2,401	45,667.02	0.00
153	000581	威孚高科	2,220	44,755.20	0.00
154	600177	雅戈尔	3,239	44,665.81	0.00
155	000712	锦龙股份	2,145	44,530.20	0.00
156	600663	陆家嘴	1,942	44,180.50	0.00
157	601727	上海电气	5,807	43,900.92	0.00
158	601888	中国国旅	998	43,892.04	0.00
159	601985	中国核电	6,189	42,270.87	0.00
160	002437	誉衡药业	4,812	41,864.40	0.00
161	600975	新五丰	4,507	41,239.05	0.00
162	000977	浪潮信息	1,746	40,943.70	0.00
163	600352	浙江龙盛	4,646	40,048.52	0.00
164	600900	长江电力	3,203	40,005.47	0.00
165	000963	华东医药	575	38,755.00	0.00
166	600031	三一重工	7,600	38,152.00	0.00
167	000625	长安汽车	2,764	37,783.88	0.00
168	002202	金风科技	2,497	37,779.61	0.00
169	601111	中国国航	5,564	37,612.64	0.00
170	600089	特变电工	4,403	37,513.56	0.00
171	601928	凤凰传媒	3,538	37,290.52	0.00
172	600066	宇通客车	1,871	37,045.80	0.00
173	000686	东北证券	2,797	36,109.27	0.00
174	600188	兖州煤业	3,291	36,003.54	0.00
175	601117	中国化学	6,472	35,790.16	0.00

176	601800	中国交建	3,390	35,696.70	0.00
177	002399	海普瑞	2,027	35,391.42	0.00
178	002294	信立泰	1,298	35,305.60	0.00
179	300219	鸿利光电	2,250	35,055.00	0.00
180	601216	君正集团	4,614	34,466.58	0.00
181	601099	太平洋	5,613	34,407.69	0.00
182	002470	金正大	4,219	33,962.95	0.00
183	300137	先河环保	2,293	33,913.47	0.00
184	600688	上海石化	5,502	33,562.20	0.00
185	603288	海天味业	1,096	33,318.40	0.00
186	600415	小商品城	5,300	32,754.00	0.00
187	600050	中国联通	8,515	32,442.15	0.00
188	600023	浙能电力	6,338	32,260.42	0.00
189	600019	宝钢股份	6,443	31,570.70	0.00
190	000100	TCL 集团	9,374	30,840.46	0.00
191	601992	金隅股份	3,946	30,581.50	0.00
192	601600	中国铝业	7,964	30,024.28	0.00
193	000983	西山煤电	3,596	29,307.40	0.00
194	600717	天津港	3,280	28,503.20	0.00
195	600021	上海电力	2,768	28,427.36	0.00
196	000709	河钢股份	10,161	28,145.97	0.00
197	000027	深圳能源	4,278	27,293.64	0.00
198	000883	湖北能源	5,840	27,039.20	0.00
199	002057	中钢天源	1,695	25,509.75	0.00
200	601919	中国远洋	4,973	25,262.84	0.00
201	601872	招商轮船	5,362	25,094.16	0.00
202	601158	重庆水务	3,777	24,286.11	0.00
203	002716	金贵银业	1,300	24,180.00	0.00
204	600008	首创股份	6,160	23,962.40	0.00
205	601258	庞大集团	8,414	23,138.50	0.00
206	000539	粤电力A	4,597	23,076.94	0.00
207	300213	佳讯飞鸿	783	22,111.92	0.00
208	600988	赤峰黄金	1,164	21,708.60	0.00
209	601898	中煤能源	4,172	21,527.52	0.00
210	600578	京能电力	4,980	21,314.40	0.00
211	002155	湖南黄金	1,600	21,072.00	0.00
212	601069	西部黄金	900	20,889.00	0.00
213	600005	武钢股份	7,524	20,766.24	0.00
214	300457	赢合科技	243	18,810.63	0.00

215	600768	宁波富邦	717	17,509.14	0.00
216	300375	鹏翎股份	647	17,488.41	0.00
217	002582	好想你	353	13,950.56	0.00
218	300471	厚普股份	226	10,811.84	0.00
219	601808	中海油服	825	10,023.75	0.00
220	300516	久之洋	46	8,057.82	0.00
221	600179	*ST 黑化	733	7,799.12	0.00
222	300097	智云股份	123	6,156.15	0.00
223	603868	飞科电器	101	5,974.15	0.00
224	603608	天创时尚	245	5,872.65	0.00
225	300511	雪榕生物	88	5,863.44	0.00
226	300512	中亚股份	58	5,795.36	0.00
227	002783	凯龙股份	64	5,752.32	0.00
228	002777	久远银海	46	5,566.00	0.00
229	002787	华源包装	106	5,243.82	0.00
230	603339	四方冷链	86	4,680.12	0.00
231	002790	瑞尔特	93	4,412.85	0.00
232	603861	白云电器	125	4,145.00	0.00
233	601020	华钰矿业	135	3,869.10	0.00
234	603696	安记食品	92	3,836.40	0.00
235	603778	乾景园林	142	3,690.58	0.00
236	603779	威龙股份	87	3,650.52	0.00
237	603959	百利科技	87	3,606.15	0.00
238	002789	建艺集团	46	3,297.28	0.00
239	603101	汇嘉时代	110	3,280.20	0.00
240	603027	千禾味业	89	3,139.03	0.00
241	603798	康普顿	49	3,130.61	0.00
242	002795	永和智控	45	3,063.60	0.00
243	300492	山鼎设计	60	3,006.00	0.00
244	002798	帝王洁具	33	2,861.10	0.00
245	300510	金冠电气	42	2,837.52	0.00
246	300127	银河磁体	106	2,700.88	0.00
247	603726	朗迪集团	42	2,123.10	0.00
248	600520	*ST 中发	104	1,946.88	0.00
249	002026	山东威达	142	1,784.94	0.00
250	300463	迈克生物	63	1,705.41	0.00
251	002797	第一创业	29	1,171.89	0.00
252	002458	益生股份	6	262.86	0.00
253	300430	诚益通	5	243.50	0.00

254	600266	北京城建	18	224.82	0.00
255	300133	华策影视	14	217.98	0.00
256	000793	华闻传媒	22	217.36	0.00
257	600373	中文传媒	10	207.50	0.00
258	000937	冀中能源	37	196.84	0.00
259	601699	潞安环能	29	189.66	0.00
260	300084	海默科技	2	24.44	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	600637	东方明珠	148,444,489.64	1.95
2	300274	阳光电源	117,755,400.53	1.55
3	601318	中国平安	93,954,643.73	1.23
4	600060	海信电器	90,451,698.01	1.19
5	600536	中国软件	88,073,593.24	1.16
6	600038	中直股份	87,555,115.92	1.15
7	600489	中金黄金	84,612,780.09	1.11
8	300017	网宿科技	81,128,276.73	1.07
9	600547	山东黄金	74,954,143.35	0.99
10	002410	广联达	74,918,550.58	0.98
11	600085	同仁堂	73,069,500.32	0.96
12	300458	全志科技	62,042,481.21	0.82
13	000697	炼石有色	60,328,417.33	0.79
14	002329	皇氏集团	60,232,834.50	0.79
15	002475	立讯精密	60,070,008.47	0.79
16	300133	华策影视	59,586,575.75	0.78
17	600018	上港集团	58,057,887.80	0.76
18	600016	民生银行	55,441,786.40	0.73
19	300302	同有科技	53,649,520.64	0.71
20	000793	华闻传媒	53,028,113.87	0.70

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	600637	东方明珠	197,937,332.90	2.60
2	600038	中直股份	126,433,481.78	1.66
3	601318	中国平安	121,599,884.79	1.60
4	300274	阳光电源	121,497,134.66	1.60
5	300133	华策影视	114,830,940.93	1.51
6	000793	华闻传媒	108,753,131.76	1.43
7	300017	网宿科技	98,505,819.02	1.29
8	002410	广联达	98,222,104.64	1.29
9	600536	中国软件	97,771,706.99	1.29
10	601166	兴业银行	83,553,330.63	1.10
11	600018	上港集团	78,859,710.22	1.04
12	000651	格力电器	73,515,351.24	0.97
13	002475	立讯精密	72,092,928.75	0.95
14	600489	中金黄金	69,183,721.35	0.91
15	002292	奥飞娱乐	67,286,294.89	0.88
16	600547	山东黄金	63,571,192.87	0.84
17	300458	全志科技	62,382,380.52	0.82
18	600036	招商银行	61,996,276.94	0.81
19	000538	云南白药	61,959,558.78	0.81
20	601169	北京银行	61,083,851.67	0.80

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	5,654,591,308.35
卖出股票收入（成交）总额	6,291,170,808.64

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	59,964,000.00	1.10
2	央行票据	-	-
3	金融债券	219,884,000.00	4.05
	其中：政策性金融债	219,884,000.00	4.05
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）	778,113.90	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	280,626,113.90	5.17

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	160304	16 进出 04	1,200,000	119,904,000.00	2.21
2	160211	16 国开 11	1,000,000	99,980,000.00	1.84
3	160005	16 付息国债 05	600,000	59,964,000.00	1.10
4	113010	江南转债	6,690	778,113.90	0.01

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
IC1607	IC1607	-96	-116,033,280.00	-1,570,579.79	-
IC1609	IC1609	-45	-52,831,800.00	-1,013,320.00	-
IF1607	IF1607	-42	-39,228,840.00	-364,299.14	-

IF1609	IF1609	-205	-187,181,400.00	-3,034,980.00	-
IH1609	IH1609	-30	-18,648,000.00	-267,480.00	-
公允价值变动总额合计（元）					-6,250,658.93
股指期货投资本期收益（元）					102,547,497.70
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-13,203,069.70

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没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	85,538,459.76
2	应收证券清算款	8,146,472.57
3	应收股利	-
4	应收利息	3,854,688.70
5	应收申购款	212,700.79
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	97,752,321.82

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处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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	8,212	537,495.49	4,220,294,339.85	95.61%	193,618,584.89	4.39%
工银绝对收益混合发起 B	2,445	242,047.18	487,035,919.38	82.30%	104,769,441.82	17.70%
合计	10,657	469,711.77	4,707,330,259.23	94.04%	298,388,026.71	5.96%

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	46,189.41	0.00%
	工银绝对收益混合发起 B	30,919.20	0.01%

	合计	77,108.61	0.00%
--	----	-----------	-------

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
	合计	0

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	0.18	9,002,960.00	0.18	3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	992,523.49	0.02	992,523.49	0.02	3 年
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	9,995,483.49	0.20	9,995,483.49	0.20	-

§ 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	5,958,300,312.56	830,122,794.22

本报告期基金总申购份额	1,208,261,483.49	5,468,009.83
减:本报告期基金总赎回份额	2,752,648,871.31	243,785,442.85
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	4,413,912,924.74	591,805,361.20

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。

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	
中信证券	1	3,872,200,847.46	32.43%	2,754,271.65	31.68%	-
国信证券	2	995,455,541.88	8.34%	907,158.97	10.44%	-
新时代证券	2	1,899,046,641.85	15.90%	1,350,791.68	15.54%	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	2,336,741,969.17	19.57%	1,662,121.74	19.12%	-
东兴证券	1	1,042,413,177.96	8.73%	741,468.45	8.53%	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	1,795,227,315.69	15.03%	1,276,947.66	14.69%	-

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
中信证券	-	-	19,793,300,000.00	44.25%	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	711,069.89	8.36%	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	7,796,234.16	91.64%	24,937,100,000.00	55.75%	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
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费率优惠的公告	中国证监会指定的媒介	2016年1月29日
3	工银瑞信基金管理有限公司关于增加中证金牛(北京)投资咨询有限公司为旗下基金销售机构并实行费率优惠的公告	中国证监会指定的媒介	2016年1月29日
4	工银瑞信基金管理有限公司关于副总经理变更的公告	中国证监会指定的媒介	2016年1月30日
5	工银瑞信基金管理有限公司关于增加和耕传承基金销售有限公司为旗下基金销售机构并实行费率优惠的公告	中国证监会指定的媒介	2016年2月3日
6	工银瑞信基金管理有限公司关于中国银河证券股份有限公司费率调整的公告	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浙商银行股份有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证监会指定的媒介	2016年3月4日

8	工银瑞信基金管理有限公司北京分公司关于营业场所变更的公告	中国证监会指定的媒介	2016 年 3 月 15 日
9	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
10	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
11	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
12	关于增加中国民生银行股份有限公司为工银瑞信基金管理有限公司旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会指定的媒介	2016 年 4 月 11 日
13	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
14	工银瑞信基金管理有限公司关于增加徽商银行股份有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证监会指定的媒介	2016 年 5 月 4 日
15	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
16	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
17	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
18	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
19	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

20	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
21	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
22	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
23	工银瑞信基金管理有限公司关于直销电子自助交易系统开展部分基金赎回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

§ 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