

工银瑞信全球精选股票型证券投资基金 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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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 1 月 1 日起至 6 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 境外投资顾问和境外资产托管人.....	6
2.5 信息披露方式.....	6
2.6 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	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介.....	11
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	38
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	38
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细.....	39
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	45
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	47
7.7 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.....	47
7.8 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.....	47
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金融衍生品投资明细.....	47

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细	47
7.11 投资组合报告附注	47
§8 基金份额持有人信息.....	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	48
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	49
§9 开放式基金份额变动.....	49
§10 重大事件揭示.....	49
10.1 基金份额持有人大会决议	49
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	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	49
10.4 基金投资策略的改变	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	50
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	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	50
10.8 其他重大事件	53
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	55
§12 备查文件目录.....	55
12.1 备查文件目录	55
12.2 存放地点	56
12.3 查阅方式	56

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	工银瑞信全球精选股票型证券投资基金
基金简称	工银全球精选股票(QDII)
基金主代码	486002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年5月25日
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	73,159,598.37份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	全球范围内具有竞争优势且成长性良好的上市公司。
投资策略	通过在全球范围内采用“自上而下”方法进行国家及地区的资产配置，综合运用定性和定量分析方法精选全球股票，并且在全球范围内进行投资组合风险收益优化，追求基金资产的长期稳健增值。
业绩比较基准	MSCI 世界指数总收益。
风险收益特征	本基金是投资于全球资本市场的股票型基金，属于风险水平较高的基金品种，其预期收益及风险水平高于债券型基金，亦高于混合型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		工银瑞信基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	朱碧艳	田青
	联系电话	400-811-9999	010-67595096
	电子邮箱	customerservice@icbccs.com.cn	tianqing1.zh@ccb.cn
客户服务电话		400-811-9999	010-67595096
传真		010-66583158	010-66275853
注册地址		北京市西城区金融大街5号、甲5号6层甲5号601、甲5号7层甲5号701、甲5号8层甲5号801、甲5号9层甲5号901	北京市西城区金融大街25号
办公地址		北京市西城区金融大街5号新盛大厦A座6-9层	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		100033	100033
法定代表人		郭特华	王洪章

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	Wellington Management Company, LLP	The Bank of New York Mellon Corporation
	中文	威灵顿管理有限责任公司	纽约梅隆银行股份有限公司
注册地址		280 Congress Street, Boston, MA, USA	225 Liberty St, New York, New York 10286 USA
办公地址		280 Congress Street, Boston, MA, USA	225 Liberty St, New York, New York 10286 USA
邮政编码		2210	NY 10286

注：威灵顿管理有限责任公司自 2012 年 9 月 7 日起，担任本基金的境外投资顾问。

2.5 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

2.6 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	355,547.54
本期利润	3,315,181.41
加权平均基金份额本期利润	0.0478
本期加权平均净值利润率	3.18%
本期基金份额净值增长率	2.96%
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	36,173,505.41
期末可供分配基金份额利润	0.4944

期末基金资产净值	114,586,511.14
期末基金份额净值	1.566
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	56.60%

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、期末可供分配利润为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；

4、本基金基金合同生效日为2010年5月25日。

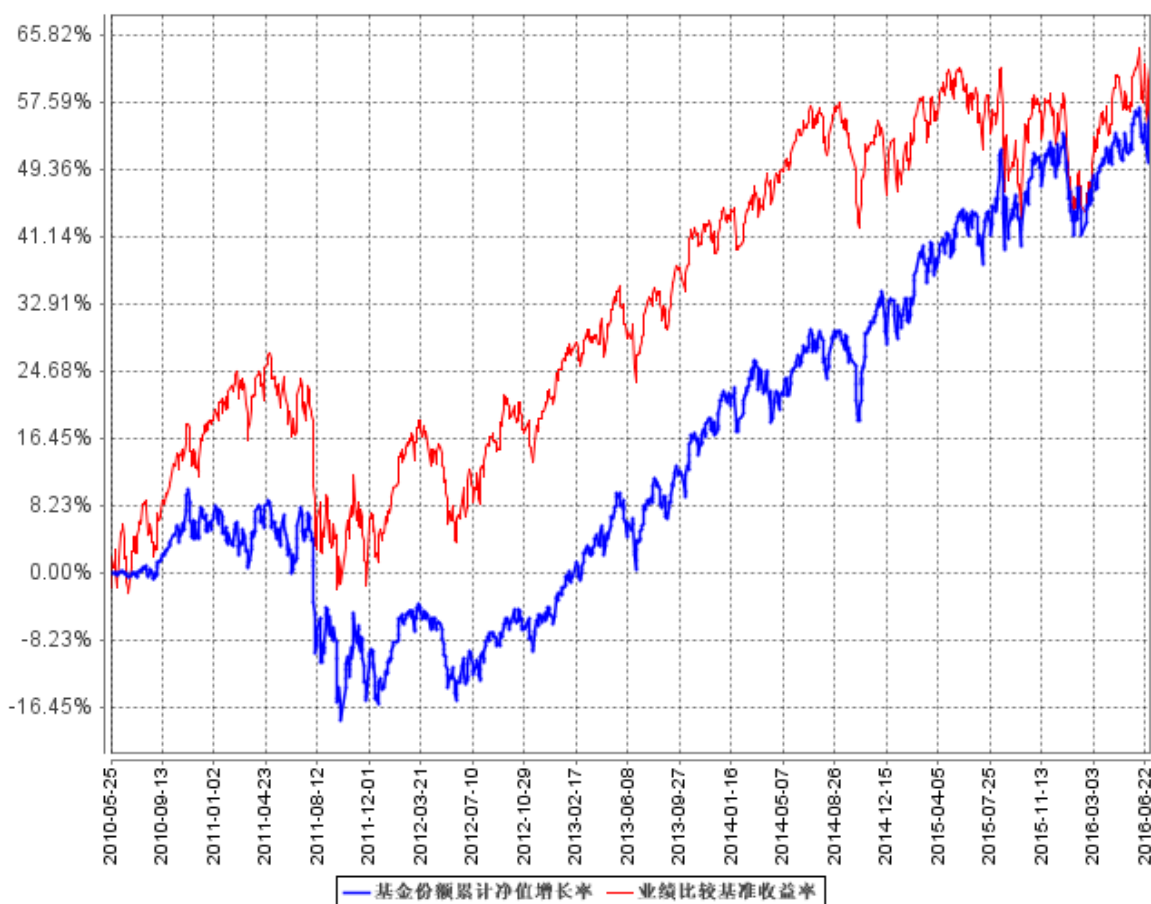
3.2 基金净值表现

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	0.13%	0.95%	0.18%	1.46%	-0.05%	-0.51%
过去三个月	3.43%	0.72%	3.65%	0.98%	-0.22%	-0.26%
过去六个月	2.96%	0.82%	3.37%	0.99%	-0.41%	-0.17%
过去一年	11.54%	0.88%	4.42%	1.03%	7.12%	-0.15%
过去三年	51.01%	0.77%	27.94%	0.77%	23.07%	0.00%
自基金合同生效起至今	56.60%	0.87%	62.12%	0.93%	-5.52%	-0.06%

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 2010 年 5 月 25 日生效。

2、按照基金合同规定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期。截至报告期末，本基金投资符合基金合同关于投资范围及投资限制的规定：股票资产占基金资产的比例为 60%-95%，债券、现金等金融工具占基金资产的比例为 5%-40%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

3.3 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、工银瑞信增利分级债券型证券投资基金、工银瑞信产业债债券型证券投资基金、工银瑞信信用纯债一年定期开放债券型证券投资基金、工银瑞信信用纯债两年定期开放债券型证券投资基金、工银瑞信标普全球自然资源指数证券投资基金、工银瑞信保本 3 号混合型证券投资基金、工银瑞信月月薪定期支付债券型证券投资基金、工银瑞信金融地产行业混合型证券投资基金、工银瑞信双债增强债券型证券投资基金、工银瑞信添福债券型证券投资基金、工银瑞信信息产业混合型证券投资基金、工银瑞信薪金货币市场基金、工银瑞信纯债债券型证券投资基金、工银瑞信绝对收益策略混合型发起式证券投资基金、工银瑞信目标收益一年定期开放债券型投资基金、工银瑞信新财富灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信现金快线货币市场基金、工银瑞信添益快线货币市场基金、工银瑞信高端制造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		
游凜峰	本基金的基金经理	2010 年 5 月 25 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。
--	--	--	--	--	--

注：1、任职日期说明：游凇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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

姓名	在境外投资顾问 所任职位	证券从业年限	说明
John A. Boselli, CFA	投资组合经理	28	威灵顿管理有限责任公司合伙制公司合伙人，工商管理硕士，在管理美国、国际和全球股票投资组合方面均有丰富的投资经验。曾在《路透》评选的“企业二十佳基金经理人”中排名第十一。此外，在《巴伦周刊》2011年的“超级人才”报道中，John A. Boselli 先生亦被评为全球顶尖的股票分析师之一。

4.3 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。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 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。

4.4.2 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。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

今年上半年，全球精选组合回报为 1.0%，低于摩根士丹利资本国际全球指数的回报 1.6%。2016 年上半年，本基金在核心消费板块的有利部署，令板块配置实现了增值。在信息技术、核心消费和金融板块的选股，造成了主要正面影响。板块方面，信息技术、核心消费和金融板块带来的贡献最大。

全球经济增速将放慢且时间将延长，因为中国增长乏力、日本复苏态势不佳、欧洲产能过剩，而且英国在脱欧公投后面临衰退风险。但我们看到，受中国和欧洲央行刺激性货币政策推动，我们监控的一些全球宏观经济指标近期有所回升。在这种环境中，我们在股票排名流程中对质量、增长、估值和总资本回报特征持中性比重。

美国经济强劲，并且仍是投资组合第一大超配国家。美国消费者处于良好状态已有一段时间。收入增长稳健、消费者信心增强、债务增长有限，储蓄率较高。住宅市场也呈上升趋势，因为房贷利率下降。6 月中，我们增持了一些美国公司股票，包括运动服装零售商内科、医院公司，以及电子商务和云服务巨头亚马逊。

投资组合维持低配欧洲。英国公投决定退出欧盟，在整个欧洲制造了政治和经济不确定性，那里的商业法规仍阻碍着增长。在英国，我们预计经济增长将放缓，因为工业和消费支出减速。投资组合对英国的相对配置为中性，因为第二季中在英国脱欧公投前，我们对那些大量收入来自英国或特别容易受到英国市场波动影响的股票进行了清仓处理。投资组合继续持有的英国上市公司，是那些收入来自全球以及股票估值低于市场水平的优质跨国公司。

投资组合维持低配新兴市场和亚洲，但我们通过买入新东方教育增加了对中国的部署。投资组合维持低配日本，因为我们没有看到经济活动好转迹象。板块部署保持稳定。投资组合维持超配信息技术、非核心消费和医疗板块股票。低配部署仍然集中在工业、能源、原材料以及公用事业和通信板块。

股市回报均以美元衡量，而非本币，以便横向比较。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值增长率为 2.96%，业绩比较基准增长率为 3.37%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

摩根士丹利资本国际全球指数上半年涨幅达 1.6%。尽管全球经济增长前景不确定，同时英国脱欧公投结果出人意料，风险资产却富有弹性。经过漫长且时而激烈的公投，英国选民做出退出欧盟的决定。在经历了几十年紧密的经济和社会融合之后，这一历史性事件标志着英国与欧洲其他国家开展业务和贸易的方式将发生深刻变化。虽然与公投相关的不确定性已不复存在，但就英国脱欧时间表及最终实施而言，我们正在进入一个新的不安全时期，由此可能会在短期加剧市场波动。遗憾的是，英国脱欧公投令前景乐观的欧洲经济大环境以及欧洲央行对其温和政策立场的重申黯然失色。美国经济数据稳健，使得投资者未去理会美联储 5 月份愈加强硬的言辞。此外，中国发布的经济数据呈现好转迹象，以及中国政府日益重视币值稳定，也令市场人士受到鼓舞。

全球固定收益市场第二季度走高，因为央行政策和英国脱欧问题将政府债券收益率推至新低。信用价差普遍收窄，美元兑主要货币收盘时涨跌互见。

大宗商品 6 月底收盘时年初至今累计涨幅为 9.9%。4 个板块全线走高，其中贵金属板块 (+25.4%) 从 2016 年头起继续领涨。

一如既往，我们的投资流程继续重点关注资产负债质量高、盈利增速高、估值低于市场水平、股东资本回报率高且正在上调盈利预估的公司。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.7.1.1 职责分工

4.7.1.1.1 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。

4.7.1.1.2 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。

4.7.1.2 专业胜任能力及相关工作经历

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

4.7.2 基金经理参与或决定估值的程度

本公司基金经理参与讨论估值原则及方法，但不参与最终估值决策。

4.7.3 参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.7.4 已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监

督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本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

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：工银瑞信全球精选股票型证券投资基金

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	16,563,000.31	23,025,697.10
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	99,233,660.12	76,570,189.75
其中：股票投资		99,233,660.12	76,570,189.75
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	946,871.10
应收利息	6.4.7.5	2,954.92	4,957.51
应收股利		77,225.61	54,513.99
应收申购款		1,335,132.41	1,024,506.04
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	31,434.81	908,184.00
资产总计		117,243,408.18	102,534,919.49
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		280,788.68	891,131.94
应付赎回款		2,062,951.05	1,179,151.41
应付管理人报酬		165,659.89	146,919.63
应付托管费		32,211.60	28,567.72
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
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	115,285.82	1,063,418.15
负债合计		2,656,897.04	3,309,188.85
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	73,159,598.37	65,230,061.80
未分配利润	6.4.7.10	41,426,912.77	33,995,668.84
所有者权益合计		114,586,511.14	99,225,730.64
负债和所有者权益总计		117,243,408.18	102,534,919.49

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值为人民币 1.566 元，基金份额总额为 73,159,598.37 份。

6.2 利润表

会计主体：工银瑞信全球精选股票型证券投资基金

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		4,580,037.28	7,404,594.64
1.利息收入		39,209.26	18,927.25
其中：存款利息收入	6.4.7.11	39,209.26	18,927.25
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,617,650.22	9,680,328.58
其中：股票投资收益	6.4.7.12	682,716.76	8,952,843.82
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	934,933.46	727,484.76
3.公允价值变动收益（损失以“-”	6.4.7.18	2,959,633.87	-2,673,375.95

号填列)			
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-64,076.75	328,726.04
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.19	27,620.68	49,988.72
减:二、费用		1,264,855.87	1,120,363.49
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	929,605.36	803,473.94
2. 托管费	6.4.10.2.2	180,756.51	156,231.10
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	76,665.23	54,025.93
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.21	77,828.77	106,632.52
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		3,315,181.41	6,284,231.15
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		3,315,181.41	6,284,231.15

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 工银瑞信全球精选股票型证券投资基金

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)	65,230,061.80	33,995,668.84	99,225,730.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	3,315,181.41	3,315,181.41
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)	7,929,536.57	4,116,062.52	12,045,599.09
其中: 1.基金申购款	23,858,365.51	12,020,965.57	35,879,331.08
2. 基金赎回款	-15,928,828.94	-7,904,903.05	-23,833,731.99
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)	73,159,598.37	41,426,912.77	114,586,511.14

折合 585,845,814.67 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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司，境外资产托管人为纽约梅隆银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《工银瑞信全球精选股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括：国际资本市场股票、债券、回购、股票指数期货、外汇远期合约、外汇互换及其它用于组合避险或有效管理的金融衍生工具。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 MSCI 世界指数总收益。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（统称“企业会计准则”）、中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会颁布的相关规定而编制。

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 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日止会计期间的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计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

无。

6.4.6 税项

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。

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》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》、财税[2016]46号《财政部、国家税务总局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》、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》及其他境内外相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

- (1) 以发行基金方式募集资金，不属于营业税或增值税征收范围，不征收营业税或增值税；
- (2) 基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂免征营业税或增值税和企业所得税；
- (3) 基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂未征收个人所得税和企业所得税。

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	16,563,000.31
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	16,563,000.31

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	82,850,061.22	99,233,660.12	16,383,598.90
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	-	-	-
交易所市场	-	-	-

	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
	资产支持证券	-	-	-
	基金	-	-	-
	其他	-	-	-
	合计	82,850,061.22	99,233,660.12	16,383,598.90

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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

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	2,954.92
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	-
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	2,954.92

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
其他应收款	31,434.81
待摊费用	-
合计	31,434.81

6.4.7.7 应付交易费用

本基金本报告期末未有应付交易费用。

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	6,931.83
预提信息披露费	54,700.10
审计费	22,376.90
其他应付款	31,276.99
合计	115,285.82

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	65,230,061.80	65,230,061.80
本期申购	23,858,365.51	23,858,365.51
本期赎回(以“-”号填列)	-15,928,828.94	-15,928,828.94
本期末	73,159,598.37	73,159,598.37

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	31,940,565.92	2,055,102.92	33,995,668.84
本期利润	355,547.54	2,959,633.87	3,315,181.41
本期基金份额交易产生的变动数	3,877,391.95	238,670.57	4,116,062.52
其中：基金申购款	11,662,199.95	358,765.62	12,020,965.57
基金赎回款	-7,784,808.00	-120,095.05	-7,904,903.05
本期已分配利润	-	-	-
本期末	36,173,505.41	5,253,407.36	41,426,912.77

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	39,138.28

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	-
其他	70.98
合计	39,209.26

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	42,732,479.46
减：卖出股票成本总额	42,049,762.70
买卖股票差价收入	682,716.76

注：“买卖股票差价收入”包含认沽权证行权产生的买卖股票差价收入。

6.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.14 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.17 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	934,933.46
基金投资产生的股利收益	-
合计	934,933.46

6.4.7.18 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	2,959,633.87
——股票投资	2,959,633.87
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	2,959,633.87

6.4.7.19 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	26,499.20
其他	1,121.48
合计	27,620.68

6.4.7.20 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	76,665.23
银行间市场交易费用	-
合计	76,665.23

6.4.7.21 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	22,376.90
信息披露费	54,700.10
银行费用	720.00
其他	31.77
合计	77,828.77

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，本基金无需要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
中国建设银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金管理人股东、基金销售机构
瑞士信贷银行股份有限公司	基金管理人股东
威灵顿管理有限责任合伙制公司	境外投资顾问
纽约梅隆银行股份有限公司	境外资产托管人

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

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：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	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
瑞士信贷银行股份有限 公司	6,072,834.64	5.81%	5,262,330.78	7.43%

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
瑞士信贷银行股份有限公司	4,438.39	9.63%	-	-
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 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
瑞士信贷银行股份有限公司	780.16	2.59%	-	-

注：1、上述佣金按市场佣金率计算。

2、该类佣金协议的范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

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 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
	当期发生的基金应支付的管理费	929,605.36
其中：支付销售机构的客户维护费	336,158.45	317,464.19

注：1、基金管理费按前一估值日的基金资产净值的1.80%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.80\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一估值日的基金资产净值

2、基金管理人的管理费每日计提，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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

当期发生的基金应支付的托管费	180,756.51	156,231.10
----------------	------------	------------

注：1、基金托管费按前一估值日的基金资产净值的 0.35% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.35\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一估值日的基金资产净值

2、基金托管费每日计提，按月支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

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度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
纽约梅隆银行股份有限公司	1,953,087.35	-	172,377.52	-
中国建设银行股份有限公司	14,609,912.96	39,138.28	3,758,895.06	18,828.05

注：本年度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

上年度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

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

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

本基金在 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日止会计期间未进行利润分配。

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

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无正回购余额，因此没有作为抵押的债券。

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和公司治理与风险控制委员会构成，公司治理与风险控制委员会通过督察长和监察稽核人员的工作，掌握整体风险状况并进行决策。公司治理与风险控制委员会负责检查公司业务的内控制度的实施情况，监督公司对相关法律法规和公司制度的执行。

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

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。本基金投资于远期合约、互换等柜台交易金融衍生品时，要求所有参与交易对手方（中资商业银行除外）应当具有不低于中国证监会认可的信用评级机构评级，并且任一交易对手方的市值计价敞口不得超过基金资产净值的 20%。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

于 2016 年 6 月 30 日和 2015 年 12 月 31 日，本基金未持有按短期信用评级的债券投资。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

于 2016 年 6 月 30 日和 2015 年 12 月 31 日，本基金未持有按长期信用评级的债券投资。

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。

由于流动性管理及策略性投资的需要，本基金将持有一些期限在一年以内的政府债券、回购等货币市场工具。

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	16,563,000.31	-	-	-	-	-	16,563,000.31
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	-	-	99,233,660.12	99,233,660.12
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	2,954.92	2,954.92
应收股利	-	-	-	-	-	77,225.61	77,225.61
应收申购款	-	-	-	-	-	1,335,132.41	1,335,132.41
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	31,434.81	31,434.81
资产总计	16,563,000.31	-	-	-	-	100,680,407.87	117,243,408.18
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	280,788.68	280,788.68
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,062,951.05	2,062,951.05
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	165,659.89	165,659.89
应付托管费	-	-	-	-	-	32,211.60	32,211.60

应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	115,285.82	115,285.82
负债总计	-	-	-	-	-	2,656,897.04	2,656,897.04
利率敏感度缺口	16,563,000.31	-	-	-	-	98,023,510.83	114,586,511.14
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	23,025,697.10	-	-	-	-	-	23,025,697.10
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	-	-	76,570,189.75	76,570,189.75
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	946,871.10	946,871.10
应收利息	-	-	-	-	-	4,957.51	4,957.51
应收股利	-	-	-	-	-	54,513.99	54,513.99
应收申购款	103,892.55	-	-	-	-	920,613.49	1,024,506.04
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	908,184.00	908,184.00
资产总计	23,129,589.65	-	-	-	-	79,405,329.84	102,534,919.49
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	891,131.94	891,131.94
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,179,151.41	1,179,151.41
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	146,919.63	146,919.63
应付托管费	-	-	-	-	-	28,567.72	28,567.72
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	1,063,418.15	1,063,418.15
负债总计	-	-	-	-	-	3,309,188.85	3,309,188.85
利率敏感度缺口	23,129,589.65	-	-	-	-	76,096,140.99	99,225,730.64

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

注：于 2016 年 6 月 30 日和 2015 年 12 月 31 日，本基金未持有债券投资，因此市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日						
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	英镑折合人民 币	日元折合人民 币	瑞士法郎折合 人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产							
银行存款	1,925,119.85	4.52	7,287.37	23,989.62	-	17.70	1,956,419.06
交易性金融资产	78,834,650.72	4,330,971.84	6,846,891.10	3,505,874.83	3,505,500.25	2,209,771.38	99,233,660.12
应收股利	57,502.84	-	11,088.69	-	-	8,634.08	77,225.61

其他应收款	31,434.81	-	-	-	-	-	31,434.81
资产合计	80,848,708.22	4,330,976.36	6,865,267.16	3,529,864.45	3,505,500.25	2,218,423.16	101,298,739.60
以外币计价的负债							
应付证券清算款	280,788.68	-	-	-	-	-	280,788.68
其他应付款	-	-	7,287.37	23,989.62	-	-	31,276.99
负债合计	280,788.68	-	7,287.37	23,989.62	-	-	312,065.67
资产负债表外汇风险敞口	80,567,919.54	4,330,976.36	6,857,979.79	3,505,874.83	3,505,500.25	2,218,423.16	100,986,673.93

净额							
项目	上年度末 2015 年 12 月 31 日						
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	英镑折合人民 币	日元折合人民 币	瑞士法郎折合 人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产							
银行存款	83,502.89	4.43	17,039.57	-	-	17.01	100,563.90
交易性金融资产	56,731,712.21	1,865,594.64	9,888,997.35	2,770,418.49	3,555,218.75	1,758,248.31	76,570,189.75
应收证券清算款	946,871.10	-	-	-	-	-	946,871.10
应收股利	48,969.08	-	5,544.91	-	-	-	54,513.99
其他应收款	17,052.06	-	-	891,131.94	-	-	908,184.00

资产合计	57,828,107.34	1,865,599.07	9,911,581.83	3,661,550.43	3,555,218.75	1,758,265.32	78,580,322.74
以外币计价的负债							
应付证券清算款	-	-	-	891,131.94	-	-	891,131.94
其他应付款	892,919.29	-	17,039.57	-	-	-	909,958.86
负债合计	892,919.29	-	17,039.57	891,131.94	-	-	1,801,090.80
资产负债表外汇风险敞口净额	56,935,188.05	1,865,599.07	9,894,542.26	2,770,418.49	3,555,218.75	1,758,265.32	76,779,231.94

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变，且未考虑基金管理人为降低汇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）
	美元相对人民币升值 5%	4,028,395.98	2,846,759.40
	美元相对人民币贬值 5%	-4,028,395.98	-2,846,759.40
	英镑相对人民币升值 5%	342,898.99	494,727.11
	英镑相对人民币贬值 5%	-342,898.99	-494,727.11
	港币相对人民币升值 5%	216,548.82	93,279.95
	港币相对人民币贬值 5%	-216,548.82	-93,279.95
	日元相对人民币升值 5%	175,293.74	138,520.92
	日元相对人民币贬值 5%	-175,293.74	-138,520.92
	瑞士法郎相对人民币 升值 5%	175,275.01	177,760.94
	瑞士法郎相对人民币 贬值 5%	-175,275.01	-177,760.94

注：1、表中列示了以外币计价的资产中前五大币种的汇率变动对基金资产净值的影响。

2、标记“-”处，表示当年该币种的汇率风险较小。

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其他价格因素变动而发生波动的风险。本基金的投资范围包括：国际资本市场股票、债券、回购、股票指数期货、外汇远期合约、外汇互换及其他用于组合避险或有效管理的金融衍生工具。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其他价格风险，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	99,233,660.12	86.60	76,570,189.75	77.17
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	99,233,660.12	86.60	76,570,189.75	77.17

注：1、本基金持有的股票等权益类资产占基金资产的比例不低于 60%，投资于全球范围内具有竞争优势且成长性良好的上市公司。

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%	4,174,250.99	4,266,535.58
	业绩比较基准减少 5%	-4,174,250.99	-4,266,535.58

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	99,233,660.12	84.64
	其中：普通股	98,174,178.71	83.74
	存托凭证	1,059,481.41	0.90
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	16,563,000.31	14.13
8	其他各项资产	1,446,747.75	1.23
9	合计	117,243,408.18	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 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家(地区)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
美国	78,834,650.72	68.80
英国	6,846,891.10	5.98
中国香港	4,330,971.84	3.78
日本	3,505,874.83	3.06
瑞士	3,505,500.25	3.06
澳大利亚	1,140,554.20	1.00
印度	1,069,217.18	0.93
合计	99,233,660.12	86.60

注：1、权益投资的国家或地区类别根据其所在证券交易所确定；

2、由于四舍五入的原因市值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
保健 Health Care	16,292,709.19	14.22
必需消费品 Consumer	11,024,448.47	9.62

Staples		
材料 Materials	1,140,554.20	1.00
非必需消费品 Consumer Discretionary	19,087,621.46	16.66
工业 Industrials	3,221,285.50	2.81
金融 financials	20,615,559.38	17.99
信息技术 Information Technology	27,851,481.92	24.31
合计	99,233,660.12	86.60

注：1、以上分类采用全球行业分类标准（GICS）；

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

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	Microsoft Corp	微软	US5949181045	纳斯达克证券交易所	美国	7,447	2,526,904.90	2.21
2	Amazon.com Inc	亚马逊公司	US0231351067	纳斯达克证券交易所	美国	466	2,211,365.41	1.93
3	Home Depot Inc/The	家得宝	US4370761029	纽约证券交易所	美国	2,574	2,179,503.43	1.90
4	Bristol-Myers Squibb Co	百时美施贵宝	US1101221083	纽约证券交易所	美国	4,385	2,138,673.07	1.87
5	Visa Inc	维萨公司	US92826C8394	纽约证券交易所	美国	4,043	1,988,493.37	1.74
6	Philip Morris International Inc	菲利普莫里斯国际集	US7181721090	纽约证券交易所	美国	2,892	1,950,728.22	1.70

		团公司		所				
7	Altria Group Inc	高特利	US02209S1033	纽约 证券 交易 所	美国	4,220	1,929,753.47	1.68
8	Accenture PLC	埃森哲 公司	IE00B4BNMY34	纽约 证券 交易 所	美国	2,561	1,923,947.79	1.68
9	Wells Fargo & Co	富国银 行	US9497461015	纽约 证券 交易 所	美国	5,944	1,865,552.31	1.63
10	Intuit Inc	-	US4612021034	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	2,504	1,853,231.01	1.62
11	MSCI Inc	-	US55354G1004	纽约 证券 交易 所	美国	3,591	1,836,430.74	1.60
12	Tencent Holdings Ltd	腾讯控 股	KYG875721634	香港 证券 交易 所	中国香 港	12,000	1,806,088.64	1.58
13	Alphabet Inc	-	US02079K1079	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	393	1,803,655.23	1.57
14	Actelion Ltd	爱可泰 隆有限 公司	CH0010532478	瑞士 证券 交易 所	瑞士	1,629	1,800,621.01	1.57
15	United Parcel Service Inc	联合包 裹服务 股份有 限公司	US9113121068	纽约 证券 交易 所	美国	2,463	1,759,352.58	1.54
16	Jack Henry & Associates Inc	-	US4262811015	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	3,039	1,758,683.96	1.53
17	Comcast Corp	康卡斯	US20030N1019	纳斯	美国	4,058	1,754,224.41	1.53

		特		达克 证券 交易 所				
18	VeriSign Inc	威瑞信 公司	US92343E1029	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	2,995	1,717,133.99	1.50
19	Partners Group Holding AG	-	CH0024608827	瑞士 证券 交易 所	瑞士	604	1,704,879.24	1.49
20	Cisco Systems Inc	思科	US17275R1023	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	8,596	1,635,381.50	1.43
21	Medtronic PLC	美敦力	IE00BTN1Y115	纽约 证券 交易 所	美国	2,838	1,632,954.62	1.43
22	Allergan plc	艾尔建 有限公 司	IE00BY9D5467	纽约 证券 交易 所	美国	1,060	1,624,348.25	1.42
23	Automatic Data Processing Inc	-	US0530151036	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	2,629	1,601,608.74	1.40
24	PepsiCo Inc	百事可 乐	US7134481081	纽约 证券 交易 所	美国	2,236	1,570,810.86	1.37
25	UnitedHealth Group Inc	联合健 康	US91324P1021	纽约 证券 交易 所	美国	1,665	1,558,981.86	1.36
26	Estee Lauder Cos Inc/The	雅诗兰 黛	US5184391044	纽约 证券 交易 所	美国	2,517	1,519,190.28	1.33
27	British American Tobacco PLC	英美烟 草	GB0002875804	伦敦 证券	英国	3,512	1,517,372.65	1.32

				交易 所				
28	Lowes Cos Inc	劳氏	US5486611073	纽约 证券 交易 所	美国	2,854	1,498,327.46	1.31
29	Assured Guaranty Ltd	美国保 证担保 有限公 司	BMG0585R1060	纽约 证券 交易 所	美国	8,903	1,497,783.24	1.31
30	Compass Group PLC	金巴斯 集团	GB00BLNN3L44	伦敦 证券 交易 所	英国	11,726	1,487,554.07	1.30
31	NIKE Inc	耐克公 司	US6541061031	纽约 证券 交易 所	美国	4,029	1,474,784.18	1.29
32	Equifax Inc	-	US2944291051	纽约 证券 交易 所	美国	1,717	1,461,932.92	1.28
33	American International Group Inc	美国国 际集团	US0268747849	纽约 证券 交易 所	美国	4,081	1,431,305.33	1.25
34	Fiserv Inc	-	US3377381088	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	1,978	1,426,158.52	1.24
35	Ross Stores Inc	-	US7782961038	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	3,785	1,422,867.53	1.24
36	Vantiv Inc	-	US92210H1059	纽约 证券 交易 所	美国	3,755	1,409,348.83	1.23
37	Stryker Corp	史赛克	US8636671013	纽约 证券 交易 所	美国	1,725	1,370,713.80	1.20
38	Gartner Inc	高德纳	US3666511072	纽约	美国	2,118	1,368,111.92	1.19

		咨询公司		证券交易所				
39	AIA Group Ltd	友邦保险	HK0000069689	香港证券交易所	中国香港	34,400	1,362,720.03	1.19
40	Amgen Inc	安进	US0311621009	纳斯达克证券交易所	美国	1,330	1,341,886.32	1.17
41	Intercontinental Exchange Inc	-	US45866F1049	纽约证券交易所	美国	788	1,337,489.70	1.17
42	Ono Pharmaceutical Co Ltd	小野药品工业	JP3197600004	东京证券交易所	日本	4,650	1,329,082.12	1.16
43	Global Payments Inc	环汇公司	US37940X1028	纽约证券交易所	美国	2,802	1,326,284.83	1.16
44	Dollar General Corp	达乐公司	US2566771059	纽约证券交易所	美国	2,126	1,325,205.53	1.16
45	Marsh & McLennan Cos Inc	-	US5717481023	纽约证券交易所	美国	2,908	1,320,150.44	1.15
46	Admiral Group PLC	-	GB00B02J6398	伦敦证券交易所	英国	7,208	1,305,371.39	1.14
47	Adobe Systems Inc	奥多比	US00724F1012	纳斯达克证券交易所	美国	2,055	1,305,341.44	1.14
48	MasterCard Inc	万事达股份有限公司	US57636Q1040	纽约证券交易所	美国	2,221	1,296,938.45	1.13

49	Reckitt Benckiser Group PLC	利洁时	GB00B24CGK77	伦敦 证券 交易 所	英国	1,915	1,279,598.94	1.12
50	Aon PLC	怡安保 险	GB00B5BT0K07	纽约 证券 交易 所	美国	1,765	1,278,435.35	1.12
51	Imperial Brands PLC	帝国品 牌公共 有限公 司	GB0004544929	伦敦 证券 交易 所	英国	3,476	1,256,994.05	1.10
52	ICON PLC	-	IE0005711209	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	2,666	1,237,691.33	1.08
53	MarketAxess Holdings Inc	-	US57060D1081	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	1,275	1,229,325.01	1.07
54	TJX Cos Inc/The	-	US8725401090	纽约 证券 交易 所	美国	2,354	1,205,548.31	1.05
55	HCA Holdings Inc	-	US40412C1018	纽约 证券 交易 所	美国	2,356	1,203,135.49	1.05
56	AutoZone Inc	-	US0533321024	纽约 证券 交易 所	美国	225	1,184,425.16	1.03
57	Sands China Ltd	金沙中 国有限 公司	KYG7800X1079	香港 证券 交易 所	中国香 港	52,400	1,162,163.17	1.01
58	S&P Global Inc	麦格希	US78409V1044	纽约 证券 交易 所	美国	1,631	1,160,069.16	1.01
59	Amcor Ltd/Australia	-	AU000000AMC4	澳大 利亚 证券	澳大利 亚	15,448	1,140,554.20	1.00

				交易所				
60	FactSet Research Systems Inc	-	US3030751057	纽约证券交易所	美国	1,052	1,126,069.54	0.98
61	Fuji Heavy Industries Ltd	富士重工	JP3814800003	东京证券交易所	日本	5,003	1,122,171.39	0.98
62	Cognizant Technology Solutions Corp	高知特科技公司	US1924461023	纳斯达克证券交易所	美国	2,909	1,104,168.80	0.96
63	PNC Financial Services Group Inc/The	-	US6934751057	纽约证券交易所	美国	2,021	1,090,760.72	0.95
64	HDFC Bank Ltd	-	INE040A01026	印度证券交易所	印度	9,252	1,069,217.18	0.93
65	New Oriental Education & Technology Group Inc	新东方教育科技集团	US6475811070	纽约证券交易所	美国	3,815	1,059,481.41	0.92
66	Hoya Corp	-	JP3837800006	东京证券交易所	日本	4,500	1,054,621.32	0.92

注：上表所用证券代码采用 ISIN 代码。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	AMAZON.COM INC	US0231351067	2,649,958.29	2.67
2	AIA GROUP LTD	HK0000069689	2,184,736.52	2.20
3	ALLERGAN PLC	IE00BY9D5467	1,859,259.28	1.87
4	JOHNSON & JOHNSON	US4781601046	1,831,702.81	1.85

5	NIKE INC -CL B	US6541061031	1,556,068.63	1.57
6	UNITED PARCEL SERVICE-CL B	US9113121068	1,521,396.08	1.53
7	COMCAST CORP-CLASS A	US20030N1019	1,450,907.86	1.46
8	PEPSICO INC	US7134481081	1,427,846.79	1.44
9	ACTELION LTD-REG	CH0010532478	1,415,601.37	1.43
10	SANDS CHINA LTD	KYG7800X1079	1,337,565.78	1.35
11	HDFC BANK LIMITED	INE040A01026	1,253,670.08	1.26
12	ADMIRAL GROUP PLC	GB00B02J6398	1,220,623.16	1.23
13	ONO PHARMACEUTICAL CO LTD	JP3197600004	1,205,949.51	1.22
14	HCA HOLDINGS INC	US40412C1018	1,187,806.41	1.20
15	COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	US1924461023	1,180,173.12	1.19
16	S&P GLOBAL INC	US78409V1044	1,125,828.06	1.13
17	JAPAN TOBACCO INC	JP3726800000	1,125,614.25	1.13
18	WYNDHAM WORLDWIDE CORP	US98310W1080	1,103,489.68	1.11
19	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	US57772K1016	1,086,162.76	1.09
20	TJX COMPANIES INC	US8725401090	1,068,657.95	1.08

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。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	JOHNSON & JOHNSON	US4781601046	2,118,849.01	2.14
2	AMAZON.COM INC	US0231351067	1,706,633.52	1.72
3	PRICELINE.COM INC	US7415034039	1,683,091.74	1.70
4	NOVARTIS AG-REG	CH0012005267	1,566,870.53	1.58
5	CHECK POINT SOFTWARE TECH	IL0010824113	1,503,074.01	1.51
6	CVS CAREMARK CORP	US1266501006	1,449,628.45	1.46
7	MOODYS CORP	US6153691059	1,382,909.03	1.39
8	NTT DOCOMO INC	JP3165650007	1,377,746.81	1.39
9	UBS GROUP AG	CH0244767585	1,233,628.10	1.24
10	JAPAN TOBACCO INC	JP3726800000	1,220,226.16	1.23
11	NIELSEN HOLDINGS PLC	GB00BWFY5505	1,186,067.75	1.20
12	ASTRAZENECA PLC	GB0009895292	1,175,168.87	1.18
13	LOREAL	FR0000120321	1,164,720.94	1.17
14	IG GROUP HOLDINGS PLC	GB00B06QFB75	1,113,698.88	1.12
15	CARDINAL HEALTH INC	US14149Y1082	1,107,094.37	1.12
16	PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-REG	DE000PSM7770	1,098,336.49	1.11

17	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	US57772K1016	1,074,640.66	1.08
18	F5 NETWORKS INC	US3156161024	1,071,429.75	1.08
19	ST JAMESS PLACE PLC	GB0007669376	1,069,253.63	1.08
20	CELGENE CORP	US1510201049	1,043,409.30	1.05

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。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	61,753,599.2
卖出收入（成交）总额	42,732,479.46

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。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.8 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。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1

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。

7.11.2

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。

7.11.3 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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	77,225.61
4	应收利息	2,954.92
5	应收申购款	1,335,132.41
6	其他应收款	31,434.81
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,446,747.75

7.11.4 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。

7.11.5 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。

7.11.6 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
7,929	9,226.84	492,610.84	0.67%	72,666,987.53	99.33%

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	19,238.42	0.03%

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（2010年5月25日）基金份额总额	585,845,814.67
本报告期期初基金份额总额	65,230,061.80
本报告期基金总申购份额	23,858,365.51
减：本报告期基金总赎回份额	15,928,828.94
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	73,159,598.37

§ 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：

无。

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

无

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	
Barclays Capital	-	21,931,356.30	20.99%	3,721.10	8.08%	-
Merrill Lynch	-	12,046,026.15	11.53%	7,928.88	17.21%	-
Goldman Sachs	-	10,362,219.69	9.92%	3,525.96	7.65%	-
Investment Tech	-	7,721,545.80	7.39%	1,480.98	3.21%	-
Citigroup Global	-	6,920,371.20	6.62%	3,645.31	7.91%	-
Credit Suisse	-	6,072,834.64	5.81%	4,438.39	9.63%	-
Deutsche Bank Sec	-	6,037,730.84	5.78%	2,127.31	4.62%	-
Sanford C Bernstein	-	4,567,535.03	4.37%	368.66	0.80%	-
UBS	-	4,404,537.79	4.22%	3,774.35	8.19%	-
Morgan Stanley	-	4,292,070.68	4.11%	1,716.82	3.73%	-
Macquarie	-	2,850,623.67	2.73%	5,179.30	11.24%	-
JP Morgan Chase	-	2,500,691.33	2.39%	2,536.30	5.50%	-
Mizuho Securities	-	2,473,623.62	2.37%	968.49	2.10%	新增
Liquidnet, Inc.	-	2,410,572.10	2.31%	580.13	1.26%	-

ISI Group	-	2,151,456.40	2.06%	379.09	0.82%	-
Instinet	-	1,632,355.50	1.56%	175.59	0.38%	-
Daiwa Securities	-	1,220,226.17	1.17%	366.04	0.79%	新增
Calyon Securities	-	1,037,724.83	0.99%	903.84	1.96%	-
RBC Capital Markets	-	1,004,634.21	0.96%	11.50	0.02%	-
Canaccord Genuity	-	779,130.00	0.75%	471.21	1.02%	-
Pulse Trading	-	664,349.04	0.64%	116.03	0.25%	-
SunTrust Robinson H	-	609,501.79	0.58%	236.36	0.51%	-
BNP-Paribas	-	291,690.55	0.28%	729.23	1.58%	新增
Credit Agricole/CLSA	-	235,021.99	0.22%	587.56	1.28%	-
Jefferies & Company	-	221,304.11	0.21%	25.63	0.06%	-
Kim Eng Securities	-	46,945.31	0.04%	84.50	0.18%	-
Piper Jaffray Co	-	-	-	-	-	-
Wells Fargo	-	-	-	-	-	-
Oppenheimer & Co	-	-	-	-	-	-
BTIG LLC	-	-	-	-	-	-
BMO Capital Markets	-	-	-	-	-	-
Berenberg Bank	-	-	-	-	-	-
CIBC World Markets	-	-	-	-	-	-
Weeden & Company	-	-	-	-	-	-
Height Securities	-	-	-	-	-	-
Raymond James & Asso	-	-	-	-	-	-
Stifel Nicolaus	-	-	-	-	-	-
MKM Partners	-	-	-	-	-	-
JMP Securities	-	-	-	-	-	-
SMBC Nikko	-	-	-	-	-	-

Capital						
HSBC Securities	-	-	-	-	-	-
Green Street Ad	-	-	-	-	-	-
Keefe Bruyette	-	-	-	-	-	-
Societe Generale	-	-	-	-	-	-
B. Riley & Co.	-	-	-	-	-	-
Needham & Co Inc	-	-	-	-	-	-
R W Baird	-	-	-	-	-	-
China Intl Capital	-	-	-	-	-	-
Dowling & Partners	-	-	-	-	-	-
Bradesco	-	-	-	-	-	-
Pacific Crest	-	-	-	-	-	-
Cantor Fitzgerald	-	-	-	-	-	-
Itau Securities Inc	-	-	-	-	-	-
BNP	-	-	-	-	-	-
Lazard Capital	-	-	-	-	-	-
State Street Global	-	-	-	-	-	-
Liberum Capital	-	-	-	-	-	-
CIMB Securities	-	-	-	-	-	-
Evercore Group LLC	-	-	-	-	-	-
Longbow Research	-	-	-	-	-	-
Craig-Hallum Capital	-	-	-	-	-	-
Standard Bank	-	-	-	-	-	-
BNY Brokerage	-	-	-	-	-	-
Standard Chartered B	-	-	-	-	-	-
CLSA	-	-	-	-	-	-
ING Financial Mkt	-	-	-	-	-	-

BTG Pactual Capital	-	-	-	-	-	-
------------------------	---	---	---	---	---	---

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。

10.8 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	关于直销渠道开展 QDII 类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 1 月 4 日
2	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

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
5	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
6	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
7	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
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	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
10	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
11	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
12	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
13	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
14	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
15	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
16	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部分基金销售机构的公告	中国证监会指定的媒介	2016 年 5 月 12 日

17	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
18	关于直销渠道开展 QDII 类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 18 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
23	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全球精选股票型证券投资基金募集的文件
- 2、《工银瑞信全球精选股票型证券投资基金基金合同》
- 3、《工银瑞信全球精选股票型证券投资基金托管协议》
- 4、《工银瑞信全球精选股票型证券投资基金招募说明书》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照
- 7、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告

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