

# 工银瑞信中国机会全球配置股票型证券投资 基金 2016 年年度报告

2016 年 12 月 31 日

基金管理人：工银瑞信基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：二〇一七年三月二十八日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 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
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	9
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
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.....	12
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	17
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	19
4.7 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	19
4.8 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	20
4.9 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	21
4.10 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.....	21
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>21</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	21
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.....	21
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	21
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>21</b>
6.1 审计报告基本信息.....	21
6.2 审计报告的基本内容.....	22
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>22</b>
7.1 资产负债表.....	22
7.2 利润表.....	24
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	25
7.4 报表附注.....	26
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>48</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	48
8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	49
8.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	49
8.4 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.....	50

8.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	60
8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合 .....	62
8.7 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.....	62
8.8 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.....	62
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资明细.....	62
8.10 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.....	62
8.11 投资组合报告附注.....	62
<b>§9 基金份额持有人信息.....</b>	<b>63</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	63
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	63
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	64
<b>§10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>64</b>
<b>§11 重大事件揭示.....</b>	<b>64</b>
11.1 基金份额持有人大会决议.....	64
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	64
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	65
11.4 基金投资策略的改变.....	65
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	65
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	65
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	65
11.8 其他重大事件.....	69
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>73</b>
<b>§13 备查文件目录.....</b>	<b>73</b>
13.1 备查文件目录.....	73
13.2 存放地点.....	73
13.3 查阅方式.....	73

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	工银瑞信中国机会全球配置股票型证券投资基金
基金简称	工银全球股票（QDII）
基金主代码	486001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008 年 2 月 14 日
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	275,677,730.41 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制基金资产风险的基础上，实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	通过在全球范围内分散投资，围绕着控制投资组合风险，追求基金长期资产增值并战胜业绩基准
业绩比较基准	40%×MSCI 中国指数收益率+60%×MSCI 全球股票指数收益率。
风险收益特征	本基金属于全球股票型基金，在一般情况下，其风险与预期收益高于债券型基金，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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	朱碧艳	王永民
	联系电话	400-811-9999	010-66594896
	电子邮箱	customerservice@icbccs.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-811-9999	95566
传真		010-66583158	010-66594942
注册地址		北京市西城区金融大街 5 号、甲 5 号 6 层甲 5 号 601、甲 5 号 7 层甲 5 号 701、甲 5 号 8 层甲 5 号 801、甲 5 号 9 层甲 5 号 901	北京市西城区复兴门内大街 1 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	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		100033	100818
法定代表人		郭特华	田国立

## 2.4 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	Citibank N.A.
	中文	威灵顿管理有限责任公司	美国花旗银行有限公司
注册地址		280 Congress Street, Boston, MA, USA	701 East 60th Street North, Sioux Falls, South Dakota 57104, County of Minnehaha, USA
办公地址		280 Congress Street, Boston, MA, USA	399 Park Avenue, New York, NY10022, USA
邮政编码		2210	10022

## 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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.icbccs.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

## 2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼16层
注册登记机构	工银瑞信基金管理有限公司	北京市西城区金融大街5号新盛大厦A座6-9层

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016 年	2015 年	2014 年
本期已实现收益	11,521,588.22	103,302,007.84	93,597,230.94
本期利润	16,602,745.64	51,283,671.03	36,946,511.77
加权平均基金份额本期利润	0.0593	0.1424	0.0580
本期加权平均净值利润率	5.43%	12.49%	5.28%
本期基金份额净值增长率	6.03%	10.30%	5.91%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末

期末可供分配利润	39,732,903.87	48,190,823.99	75,057,208.40
期末可供分配基金份额利润	0.1441	0.1749	0.1472
期末基金资产净值	315,410,634.28	323,684,212.33	584,838,780.13
期末基金份额净值	1.144	1.175	1.147
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>2016 年末</b>	<b>2015 年末</b>	<b>2014 年末</b>
基金份额累计净值增长率	40.93%	32.92%	20.50%

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、本基金基金合同生效日为 2008 年 2 月 14 日。

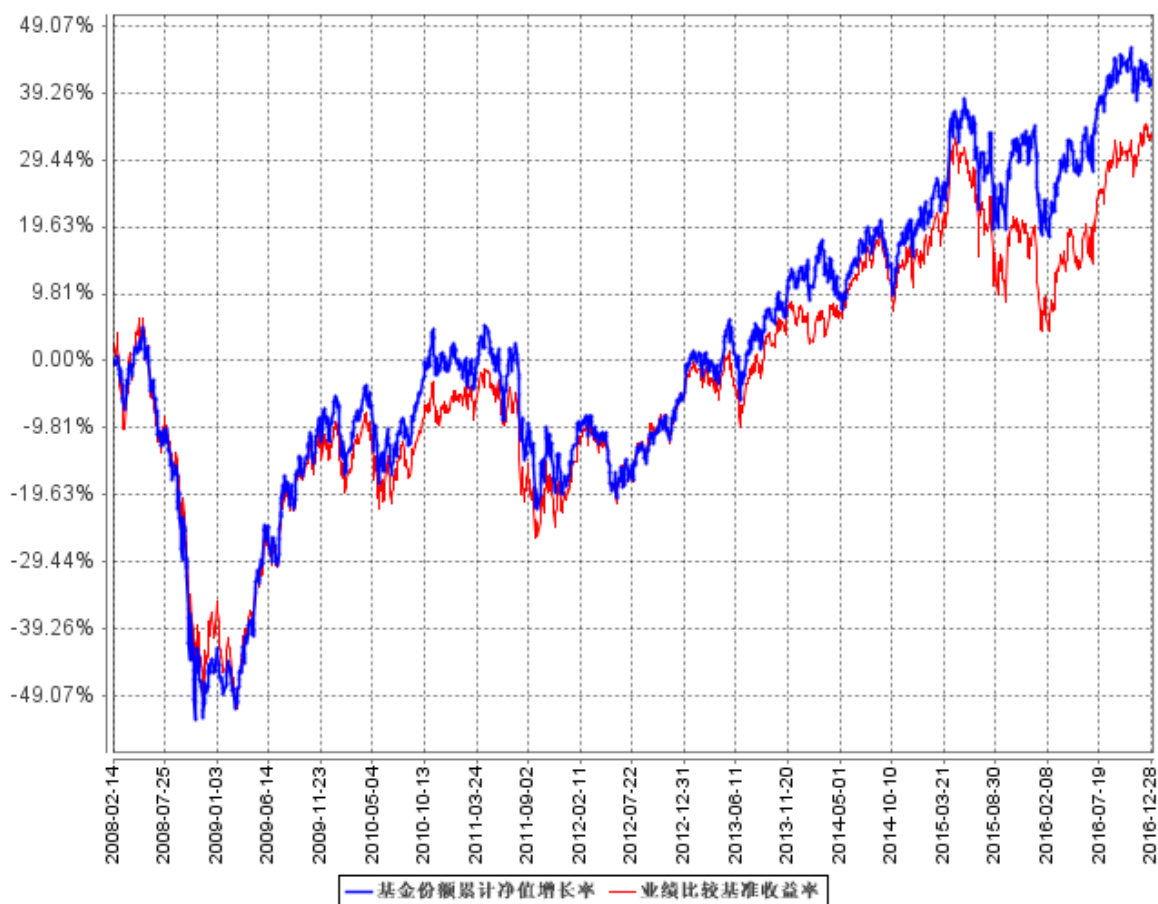
## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-1.80%	0.61%	2.05%	0.57%	-3.85%	0.04%
过去六个月	5.93%	0.58%	11.47%	0.60%	-5.54%	-0.02%
过去一年	6.03%	0.77%	12.32%	0.87%	-6.29%	-0.10%
过去三年	23.86%	0.85%	23.35%	0.86%	0.51%	-0.01%
过去五年	72.29%	0.82%	66.59%	0.82%	5.70%	0.00%
自基金合同生效起至今	40.93%	1.16%	33.17%	1.24%	7.76%	-0.08%

### 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



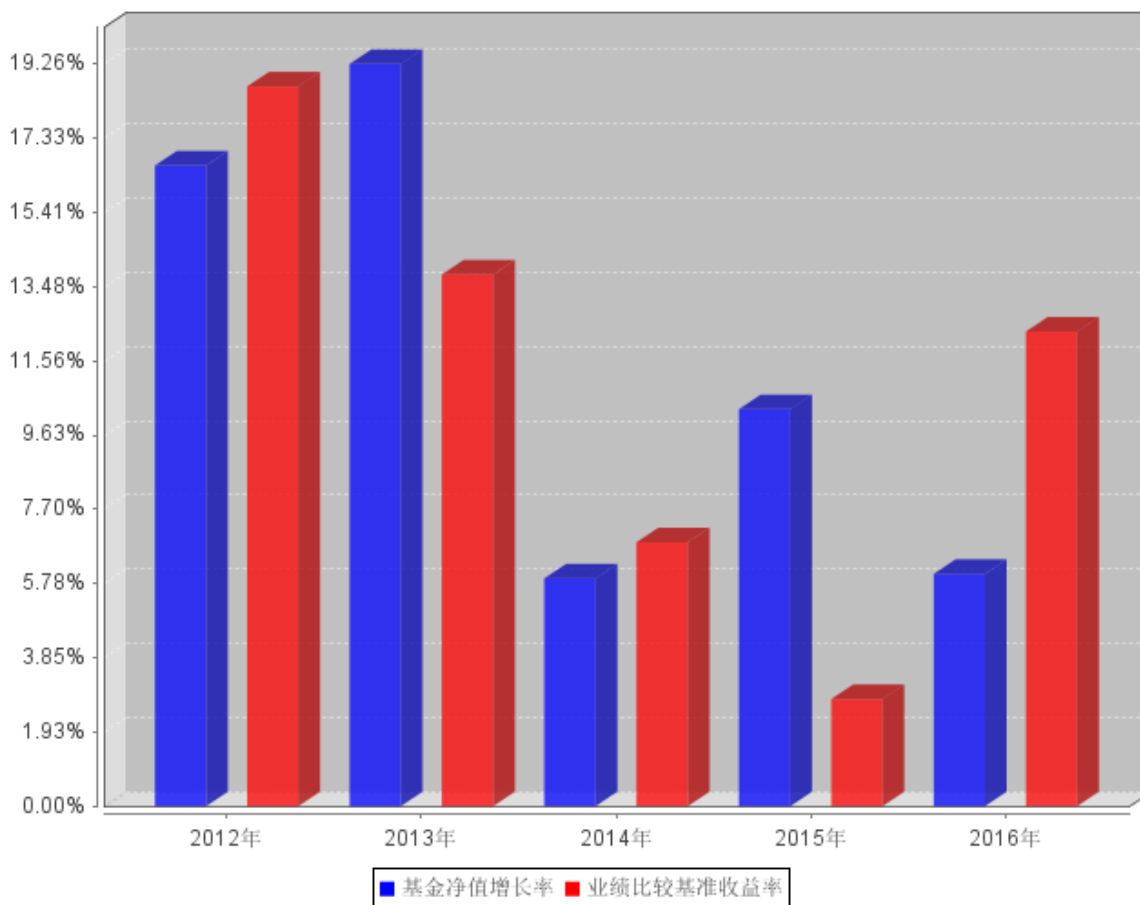
注：1、本基金合同于 2008 年 2 月 14 日生效。

2、按照本基金基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内为建仓期，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中的规定：本基金投资中国公司组合占基金资产的比例为 30%-50%，全球公司组合占基金资产的比例为 50%-70%；本基金持有的股票资产占基金资产的比例不低于 60%，政府债券、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占基金资产的比例不高于 40%。



### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：1、本基金基金合同生效日为 2008 年 02 月 14 日。

2、合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 其他指标

无。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额 分红数	现金形式发放 总额	再投资形式发 放总额	年度利润分配合 计	备注
2014	0.2800	11,272,948.38	8,128,497.92	19,401,446.30	
2015	0.8150	22,709,930.94	17,069,088.28	39,779,019.22	
2016	0.8750	13,367,129.08	10,722,365.61	24,089,494.69	
合计	1.9700	47,350,008.40	35,919,951.81	83,269,960.21	

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 2016 年 12 月 31 日，公司旗下管理 99 只公募基金——工银瑞信核心价值混合型证券投资基金、工银瑞信货币市场基金、工银瑞信精选平衡混合型证券投资基金、工银瑞信稳健成长混合型证券投资基金、工银瑞信增强收益债券型证券投资基金、工银瑞信红利混合型证券投资基金、工银瑞信中国机会全球配置股票证券投资基金、工银瑞信信用添利债券型证券投资基金、工银瑞信大盘蓝筹混合型证券投资基金、工银瑞信沪深 300 指数证券投资基金、上证中央企业 50 交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信中小盘成长混合型证券投资基金、工银瑞信全球精选股票型证券投资基金、工银瑞信双利债券型证券投资基金、深证红利交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信深证红利 ETF 联接基金、工银瑞信四季收益债券型证券投资基金、工银瑞信消费服务行业混合型证券投资基金、工银瑞信添颐债券型证券投资基金、工银瑞信主题策略混合型证券投资基金、工银瑞信保本混合型证券投资基金、工银瑞信睿智中证 500 指数分级证券投资基金、工银瑞信基本面量化策略混合型证券投资基金、工银瑞信纯债定期开放债券型证券投资基金、工银瑞信 7 天理财债券型证券投资基金、工银瑞信睿智深证 100 指数分级证券投资基金、工银瑞信 14 天理财债券型发起式证券投资基金、工银瑞信信用纯债债券型证券投资基金、工银瑞信 60 天理财债券型证券投资基金、工银瑞信优质精选混合型证券投资基金、工银瑞信政府债纯债债券型证券投资基金（LOF）、工银瑞信产业债债券型证券投资基金、工银瑞信信用纯债一年定期开放债券型证券投资基金、工银瑞信信用纯债两年定期开放债券型证券投资基金、工银瑞信国际原油证券投资基金（LOF）、工银瑞信保本 3 号混合型证券投资基金、工银瑞信月月薪定期支付债券型证券投资基金、工银瑞信金融地产行业混合型证券投资基金、工银瑞信双债增强债券型证券投资基金（LOF）、工银瑞信添福债券型证券投资基金、工银瑞信信息产业混合型证券投资基金、工银瑞信薪金货币市场基金、工银瑞信纯债债券型证券投资基金、工银瑞信绝对收益策略混合型发起式证券投资基金、工银瑞信目标收益一年定期开放债券型投资基金、工银瑞信新财富灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信现金快线货币市场基金、工银瑞信添益快线货币市场基金、工银瑞信高

端制造行业股票型证券投资基金、工银瑞信研究精选股票型证券投资基金、工银瑞信医疗保健行业股票型证券投资基金、工银瑞信创新动力股票型证券投资基金、工银瑞信国企改革主题股票型证券投资基金、工银瑞信战略转型主题股票型证券投资基金、工银瑞信新金融股票型证券投资基金、工银瑞信美丽城镇主题股票型证券投资基金、工银瑞信总回报灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信新材料新能源行业股票型证券投资基金、工银瑞信养老产业股票型证券投资基金、工银瑞信丰盈回报灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金、工银瑞信农业产业股票型证券投资基金、工银瑞信生态环境行业股票型证券投资基金、工银瑞信互联网加股票型证券投资基金、工银瑞信财富快线货币市场基金、工银瑞信聚焦 30 股票型证券投资基金、工银瑞信中证新能源指数分级证券投资基金、工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金、工银瑞信中证高铁产业指数分级证券投资基金、工银瑞信新蓝筹股票型证券投资基金、工银瑞信丰收回报灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信中高等级信用债债券型证券投资基金、工银瑞信新趋势灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信文体产业股票型证券投资基金、工银瑞信物流产业股票型证券投资基金、工银瑞信前沿医疗股票型证券投资基金、工银瑞信国家战略主题股票型证券投资基金、工银瑞信香港中小盘股票型证券投资基金、工银瑞信沪港深股票型证券投资基金、工银瑞信瑞丰纯债半年定期开放债券型证券投资基金、工银瑞信泰享三年理财债券型证券投资基金、工银瑞信安盈货币市场基金、工银瑞信恒享纯债债券型证券投资基金、工银瑞信新焦点灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信现代服务业灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信新得益混合型证券投资基金、工银瑞信新得润混合型证券投资基金、工银瑞信新增利混合型证券投资基金、工银瑞信新生利混合型证券投资基金、工银瑞信新增益混合型证券投资基金、工银瑞信银和利混合型证券投资基金、工银瑞信瑞享纯债债券型证券投资基金、工银瑞信瑞盈 18 个月定期开放债券型证券投资基金、工银瑞信恒丰纯债债券型证券投资基金、工银瑞信恒泰纯债债券型证券投资基金、工银瑞信国债纯债债券型证券投资基金、工银瑞信可转债债券型证券投资基金、工银瑞信丰益一年定期开放债券型证券投资基金、工银瑞信如意货币市场基金，证券投资基金管理规模逾 4600 亿元人民币。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
游凇峰	本基金的基金经理	2009 年 12 月 25 日	-	21	斯坦福大学统计学专业博士；先后在 Merrill Lynch Investment Managers 担任美林集中

				基金和美林保本基金基金经理, Fore Research & Management 担任 Fore Equity Market Neutral 组合基金经理, Jasper Asset Management 担任 Jasper Gemini Fund 基金经理; 2009 年加入工银瑞信基金管理有限公司, 现任基金经理; 2009 年 12 月 25 日至今, 担任工银瑞信中国机会全球配置股票基金的基金经理; 2010 年 5 月 25 日至今, 担任工银全球精选股票基金的基金经理; 2012 年 4 月 26 日至今担任工银瑞信基本面量化策略混合型证券投资基金基金经理; 2014 年 6 月 26 日至今, 担任工银瑞信绝对收益混合型基金基金经理; 2015 年 12 月 15 日至今, 担任工银瑞信新趋势灵活配置混合型基金基金经理; 2016 年 3 月 9 日至今, 担任工银瑞信香港中小盘股票型基金基金经理; 2016 年 10 月 10 日至今, 担任工银瑞信新焦点灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	---

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 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。
Bo Z. Meunier (张博女士), CFA	投资组合经理	20	威灵顿管理有限责任公司合伙人，工商管理硕士，她同时也是一名股票研究分析师，专门研究新兴市场，并主要负责中国。她对其负责行业内的企业进行基本面分析并根据分析结果和市场条件做出买入/卖出建议。张博女士于 1998 年获得巴布森学院奥林商学院工商管理硕士学位，以优异成绩毕业并获得巴布森奖学金。1992 年，她以优异成绩获得中国哈尔滨理工大学科技英语学士学位。此外，她还是特许金融分析师。

注：威灵顿管理有限责任公司自 2012 年 7 月 10 日起，担任本基金的境外投资顾问。

#### 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 公平交易制度和控制方法

#### 1、公平交易原则

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，为公平对待不同基金份额持有人，公平对待基金持有人和其他资产委托人，在投资管理活动中公平对待公司所管理的不同基金财产和客户资产，不得直接或通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

#### 2、适用范围

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

#### 3、公平交易的具体措施

##### 3.1 在研究和投资决策环节：

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

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

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

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

##### 3.2 在交易执行环节：

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

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

##### 3.2.3 公平交易执行方法：

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

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

公平交易模块执行原理如下：

1) 同向交易指令：

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

2) 反向交易指令

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

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

3.2.5 对于非公开发行股票申购，各基金/投资经理在申购前参照《投资流通受限证券工作流程》，独立确定申购价格和数量，中央交易室按照价格优先、比例分配的原则进行分配。

3.2.6 对于由于特殊原因不能参与公平交易程序的交易指令，中央交易室填写《公平交易审批单》，经公司内部审批后执行。

### 3.2.7 公平交易争议处理

在公平交易执行过程中若发生争议，或出现基金/投资经理对交易员执行公平交易结果不满情况，交易主管将具体情况报告公司主管领导，公司主管领导与相关基金/投资经理、交易主管就争议内容进行协调处理。

## 3.3 公平交易的检查和价格监控

3.3.1 法律合规部可通过投资交易系统对于公平交易的执行情况进行稽核，并定期向督察长报告。如发现有疑问的交易情况，就交易时间、交易价格、交易数量、交易理由等提出疑问，由基金/投资经理作出合理解释。

3.3.2 风险管理部根据市场公认的第三方信息，对于投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，如发现异常情况的，基金/投资经理应对交易价格的异常情况进行合理性解释。

3.3.3 法律合规部应对不同投资组合在交易所公开竞价交易中同日同向交易的交易时机和交易价差进行监控，同时对不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析，如发现异常应向基金/投资经理提出，相关基金/投资经理应对异常交易情况进行合理性解释。风险管理部和法律合规部应对其他可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，对于异常交易发生前后不同投资组合买卖该异常交易证券的情况进行分析。相关基金/投资经理应对异常交易情况进行合理性解释。

## 3.4 评估和分析

3.4.1 风险管理部应分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3日内、5日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，由投资组合经理、督察长、总经理签署后，妥善保存分析报告备查。如果在上述分析期间内，公司管理的所有投资组合同向交易价差出现异常情况，应重新核查公司投资决策和交易执行环节的内部控制，针对潜在问题完善公平交易制度，进行专项说明，提交法律合规部，法律合规部应将此说明载入监察稽核季度报告和年度报告中对此做专项说明。

3.4.2 中央交易室负责在各投资组合的定期报告中披露公司整体公平交易制度执行情况。风险管理部负责在各投资组合的定期报告中对异常交易行为进行专项说明，其中，如果报告期内所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的



5%，应说明该类交易的次数及原因。各投资组合的年度报告中，除上述内容外，还应披露公平交易制度和控制方法，并在公司整体公平交易制度执行情况中，对当年度同向交易价差做专项分析。

#### 4. 报告

公司相关部门如果发现涉嫌违背公平交易原则的行为，应及时向公司管理层汇报并采取相关控制和改进措施。

#### 4.4.2 公平交易制度的执行情况

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

公司于每季度和年度对公司管理的不同投资组合进行了同向交易价差分析，采用了日内、3日内、5日内的时间窗口，假设不同组合间价差为零，进行了T分布检验。对于没有通过检验的交易，公司根据交易价格、交易频率、交易数量、交易时间进行了具体分析。经分析，本报告期未出现公司管理的不同投资组合间有同向交易价差异常的情况。

#### 4.4.3 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况有11次。投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易，未导致不公平交易和利益输送。

### 4.5 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

中国组合 2016 年回报为 1.25%，绩效优于摩根士丹利资本国际中国指数 1.11% 的回报。在 2016 年，信息技术、非核心消费和房地产板块的选股为相对绩效带来了主要贡献。但在金融和医疗板块的选股表现不佳。板块方面，超配信息技术和低配工业板块带来的贡献最大。

2016 年第四季中，中国股市收盘走低，因为流动性紧缩令债券收益率上涨，同时人民币贬

值和资本流出势头没有减弱的迹象。对资本控制从严以及中国住宅销售放缓的担忧，进一步影响着市场情绪。对于 2016 年大部分时间来说，住宅销售曾是一个受到密切关注的利好宏观指标。深港通如期于 2016 年 12 月 5 日正式开通，这是对 2014 年 11 月开通的沪港通的有益补充。

投资组合的板块部署，是我们在个股层面所发现的投资机会的结果，而不是自上而下或宏观经济观点的折射。在金融板块的选股拖累了绩效，主要归因于减值保险和非银行金融类股，该板块是投资组合主要低配部位及维持低配通信、工业和核心消费相关板块。

在整体层面，我们关注的重点是发掘内生增长前景好于平均水平、资本回报率较高并可持续，以及公司治理和管理层素质良好的公司——并且在具吸引力的估值水平买入这些公司。我们的投资期限是长期的，并且以建仓持仓符合我们长期投资的理念。

全球组合 2016 年回报为 1.88%，低于摩根士丹利资本国际全球指数 8.15% 的回报，归因于选股和板块配置表现不佳。在金融、信息技术和非核心消费板块的选股表现最差。但在核心消费和房地产板块的选股表现出色，抵销了部分前述负面影响。投资组合超配非核心消费和低配能源的板块配置造成了拖累，但低配核心消费和房地产板块抵销了部分负面影响。

展望 2017 年，我们预计全球各经济体和美元上行势头将持续。总统特朗普就职后，新政府可能会减轻监管负担和降低税率，从而改善企业和消费者情绪。金融行业监管限制减少是最明显和持久的趋势，这应带来质量改善和信贷增长。如果收益率曲线继续变陡，则利差房贷企业将受益匪浅。因此，我们通过买入美国优质业务，增加了投资组合的金融服务板块比重。信息技术仍是投资组合第一大超配板块，因为在我们的股票排名流程中，这些公司的增长和估值综合表现最优。我们低配幅度最大的包括公司质量通常较低的能源和原材料板块，以及我们认为估值上升空间不大的必需消费品类股。我们低配医疗板块是盈利预期下调的体现，因为制药和非专利药定价仍面临压力。

基于自下而上的选股，从地区来看，我们维持超配北美洲和新兴市场，因为我们预计这些地区经济增长状况最优。欧洲和日本维持低配，因为监管和人口问题仍在限制着这些地区的经济增长。2016 年全年，我们因为经济活动缓慢和估值水平偏高，一直低配欧洲。然而，欧洲经济增速已经开始加快，2017 年政治不确定性可能下降，因此我们已开始买入估值水平低的优质公司，来结束对该地区的低配，如我们新买入的法国电气和信息系统基础设施供应商罗格朗。美国消费者信心正在增强、债务水平保持低位，家庭组建数量增加，同时企业乐观情绪呈现自 2007 年以来的首次上升。我们知道美元坚挺可能不利于一些在美国注册的跨国公司，因为外国竞争对手将受惠于较低的相对价格，尤其是在制造出口领域。

我们将继续秉承所述投资理念和流程，投资于在质量、增长、估值上升空间、股息收益率和

股票回购及盈利预期上调等方面综合表现最优的公司。我们相信这种投资方法能够长期跑赢基准，并仍然对我们的投资流程充满信心。

#### 4.5.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金净值增长率为 6.03%，业绩比较基准收益率为 12.32%。

#### 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

全球股市(+4.2%)连续第 3 个季度走高，2016 年全年累计上涨 9.7%。股市在唐纳德·特朗普赢得美国总统大选后上扬。这一选举结果被一些权威人士视为美国历史上最大的政治冷门。标普 500 指数在 11 月和 12 月屡创新高，因为市场预计特朗普将减少监管限制并加大财政刺激，包括减轻企业和个人税负，以及增加基础设施支出。但板块和地区间表现差距明显。例如，新兴市场股市下跌 1.4%，因为投资者担心特朗普政府将带来贸易保护主义、通胀升温以及美元升值。虽然全球并购交易金额较 2015 年的最高纪录下降 16.6%，但 2016 年 3.6 万亿美元的已宣布交易额仍创历史第三高(仅次于 2015 年和 2007 年)。货币政策方面，美联储加息 25 个基点。此举前期铺垫充分，并且是美联储过去十年来第二次加息。

2016 年第 4 季度，固定收益市场录得有史以来最大季度跌幅之一。全球主权债券收益率走高，其中美国国债收益率领涨，因为市场对特朗普将推行扩张性财政政策的预期令通胀预期升温。投资者对美国新一届政府和国会的政策将着重于税改和放松管制的乐观预期，提振了信用市场，利差收债。大多数货币兑美元走软，因为市场担心保护主义政策将不利于美国的贸易伙伴，同时预计美联储将打开全球央行收紧货币政策的局面。大宗商品(+5.8%)季中走高，12 月底收盘时全年涨幅为 11.4%。4 个商品板块中有 3 个走高，其中能源商品(+8.7%)涨幅最大。

#### 4.7 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人持续加强法律合规风险管理和监察稽核工作，使得法律合规风险被及时识别并得到控制，保障公司各项业务的合法合规。

合规管理方面，一是积极跟踪法律法规的变化和监管动态，及时向业务部门解读、传达最新法规和监管要求及其对公司业务的影响，落实各项要求的责任部门，使得公司从业人员知法、守法；二是严格事前的监督审查和控制机制，保障业务开展的合法合规性。事前合法合规审核全面覆盖公司的新产品设计、基金募集和持续营销、宣传推介、基金等各受托资产的投资交易管理、基金信息披露等业务，并利用系统对相关投资组合的投资合规风险实现事前控制。三是严格的事中指标监控机制，保证投资过程的合规性：公司设置专人专岗监控投资指标，利用系统和人工相结合的方式，实现重点监控环节的刚性控制，系统无法实现控制的环节进行人工审核与复核。四是

及时的事后风险管理机制，保证潜在合规风险得到及时解决：通过系统事后监测并提示各投资组合的被动超标情况，跟踪其限期回归到合规范围之内；五是继续开展合规培训，不断增强公司员工合规意识，促进公司合规文化的建设。公司通过对新员工的合规培训、对全体人员的年度合规培训、对投研人员、销售人员等的专项培训等多种形式，结合新出台的法律法规和行业风险事件，加深员工对法律法规和风险的理解，从而使得相关法规、政策、制度在公司内部更有效的得到落实。

监察稽核方面，一是定期对本基金投研交易、销售和后台运营等各项业务开展情况、内部规章制度执行情况、合规控制和风险控制情况进行系统全面的检查和评价，跟进后续改进情况，向监管机构报送监察稽核季报。同时，按照年度监察稽核计划开展有针对性的专项稽核工作。二是持续完善制度流程和监控模型，采用有效手段，日常监控投资管理人员的个人行为，利用公平交易、异常交易监控模型分析投资人员的投资行为，防范出现违反“三条底线”的情形。三是关注内部控制的健全性和有效性，全面梳理各项业务的工作流程，对其中的各项风险进行识别、评估，并对现有的控制手段提出改进性建议。同时，结合出台的法律法规和行业的新要求，督促公司及时制定、更新规章制度和完善业务流程。

#### 4.8 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

##### 4.8.1 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

###### 4.8.1.1 职责分工

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

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

###### 4.8.1.2 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。

##### 4.8.2 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。

##### 4.8.3 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。

##### 4.8.4 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。

#### 4.9 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金共进行一次利润分配，情况如下：

于 2016 年 1 月 12 日发布分红公告，每 10 份派发红利 0.875 元，本次分红总金额为 24,089,494.69 元，权益登记日为 2016 年 01 月 19 日。

#### 4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

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

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

## §6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见

审计报告编号	安永华明（2017）审字第 60802052_A06 号
--------	------------------------------

## 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告	
审计报告收件人	工银瑞信中国机会全球配置股票型证券投资基金全体基金份额持有人	
引言段	我们审计了后附的工银瑞信中国机会全球配置股票型证券投资基金财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表，2016 年度的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。	
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是基金管理人工银瑞信基金管理有限公司的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。	
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>	
审计意见段	我们认为，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了工银瑞信中国机会全球配置股票型证券投资基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和净值变动情况。	
注册会计师的姓名	汤骏	贺耀
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
会计师事务所的地址	中国 北京	
审计报告日期	2017 年 3 月 23 日	

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：工银瑞信中国机会全球配置股票型证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	25,692,118.96	22,526,898.30
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	291,408,801.06	304,552,810.67
其中：股票投资		291,408,801.06	304,552,810.67
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	2,493,722.40
应收利息	7.4.7.5	3,713.24	4,072.49
应收股利		114,308.01	145,773.30
应收申购款		145,664.37	381,964.25
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		317,364,605.64	330,105,241.41
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2015 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		88,025.54	2,899,335.91
应付赎回款		1,043,418.84	2,685,451.34
应付管理人报酬		485,101.93	496,886.13
应付托管费		80,850.27	82,814.35
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	-	-
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	256,574.78	256,541.35
负债合计		1,953,971.36	6,421,029.08
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	275,677,730.41	275,493,388.34
未分配利润	7.4.7.10	39,732,903.87	48,190,823.99
所有者权益合计		315,410,634.28	323,684,212.33
负债和所有者权益总计		317,364,605.64	330,105,241.41

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值为人民币 1.144 元，基金份额总额为 275,677,730.41 份。

## 7.2 利润表

会计主体：工银瑞信中国机会全球配置股票型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		23,839,285.53	62,054,570.92
1. 利息收入		121,639.02	107,975.60
其中：存款利息收入	7.4.7.11	121,639.02	107,975.60
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）		18,138,926.58	109,306,395.43
其中：股票投资收益	7.4.7.12	13,827,973.88	102,537,843.25
基金投资收益	7.4.7.13	-	-
债券投资收益	7.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-	-
股利收益	7.4.7.17	4,310,952.70	6,768,552.18
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	5,081,157.42	-52,018,336.81
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		469,061.99	4,591,902.48
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	28,500.52	66,634.22



<b>减：二、费用</b>		7,236,539.89	10,770,899.89
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	5,502,016.66	7,424,519.81
2. 托管费	7.4.10.2.2	917,002.88	1,237,420.02
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.20	447,982.00	1,349,020.05
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.21	369,538.35	759,940.01
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		16,602,745.64	51,283,671.03
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		16,602,745.64	51,283,671.03

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：工银瑞信中国机会全球配置股票型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	275,493,388.34	48,190,823.99	323,684,212.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	16,602,745.64	16,602,745.64
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）	184,342.07	-971,171.07	-786,829.00
其中：1. 基金申购款	49,764,928.29	4,368,979.52	54,133,907.81
2. 基金赎回款	-49,580,586.22	-5,340,150.59	-54,920,736.81
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）	-	-24,089,494.69	-24,089,494.69
五、期末所有者权益（基金净值）	275,677,730.41	39,732,903.87	315,410,634.28
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计

一、期初所有者权益 (基金净值)	509,781,571.73	75,057,208.40	584,838,780.13
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	51,283,671.03	51,283,671.03
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)	-234,288,183.39	-38,371,036.22	-272,659,219.61
其中：1. 基金申购款	55,503,594.61	7,661,333.23	63,164,927.84
2. 基金赎回款	-289,791,778.00	-46,032,369.45	-335,824,147.45
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)	-	-39,779,019.22	-39,779,019.22
五、期末所有者权益 (基金净值)	275,493,388.34	48,190,823.99	323,684,212.33

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

\_\_\_\_\_  
郭特华                                  朱碧艳                                  朱辉毅  
基金管理人负责人                  主管会计工作负责人                  会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

工银瑞信中国机会全球配置股票型证券投资基金（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”）证监基金字[2007]325号文《关于同意工银瑞信中国机会全球配置股票型证券投资基金募集的批复》的批准，由基金管理人工银瑞信基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于2008年2月14日正式生效，首次设立募集规模为3,155,816,636.00份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构均为工银瑞信基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司，境外资产托管人为美国花旗银行有限公司（Citibank N.A），境外投资顾问为威灵顿管理有限责任合伙制公司。

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《工银瑞信中国机会全球配置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：在香港等境外证券市场上市的中国公司股票，全球范围内受惠于中国经济增长的境外公司股票，以及政府债券、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。其中，投资于香港等境外证券市场上市

的中国公司股票资产为中国公司组合，投资于全球范围内受惠于中国经济增长的境外公司股票的资产为全球公司组合，中国公司组合占基金资产的比例为 30%-50%，全球公司组合占基金资产的比例为 50%-70%。本基金持有的股票资产占基金资产的比例不低于 60%，政府债券、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占基金资产的比例不高于 40%。本基金的业绩比较基准为：40%×MSCI 中国指数收益率+60%×MSCI 全球股票指数收益率。

## 7.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报

## 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和净值变动情况。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

### 7.4.4.1 会计年度

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

### 7.4.4.2 记账本位币

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

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或

权益工具的合同。

#### (1) 金融资产分类

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

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

#### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认，即从本基金账户和资产负债表内予以转销；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的

有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票投资、权证投资等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的市价作为公允价值；估值日无市价，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易市价确定公允价值；如估值日无市价，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定公允价值。本基金采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术，优先使用相关可观察输入值，只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融资产公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### **7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### **7.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变

动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(3) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(4) 衍生工具收益/（损失）于卖出成交日确认，并按卖出成交金额与其成本的差额入账；

(5) 股利收益于除息日确认，并按宣告的分红派息比例计算的金额扣除股票所在地适用的预缴所得税后的净额入账；

(6) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.80%的年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.30%的年费率逐日计提；

(3) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果

影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式，基金份额持有人可自行选择收益分配方式；基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金红利；

(2) 每一基金份额享有同等分配权；

(3) 本基金当期收益先弥补前期亏损后，方可进行当期收益分配；

(4) 本基金收益分配后每份基金份额的净值不能低于首次募集初始面值；

(5) 如果本基金当期出现亏损，则不进行收益分配；

(6) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配不少于一次，每年收益分配至多 4 次；

(7) 全年基金收益分配比例不得低于年度基金已实现净收益的 50%。基金合同生效不满三个月，收益可不分配；

(8) 法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，与所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 7.4.4.13 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；

(2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；

(3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

## 7.4.6 税项

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》、财税[2016]140 号《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》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) 2017 年 7 月 1 日（含）以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；
- (3) 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，在境内暂免征收营业税或增值税和企业所得税；
- (4) 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。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元



项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	25,692,118.96	22,526,898.30
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	25,692,118.96	22,526,898.30

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	257,635,269.02	291,408,801.06	33,773,532.04
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	257,635,269.02	291,408,801.06	33,773,532.04
项目	上年度末 2015 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	275,860,436.05	304,552,810.67	28,692,374.62
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	275,860,436.05	304,552,810.67	28,692,374.62

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

**7.4.7.4 买入返售金融资产**

本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

**7.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	3,713.24	4,072.49
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	3,713.24	4,072.49

**7.4.7.6 其他资产**

本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

**7.4.7.7 应付交易费用**

本基金本报告期末及上年度末均无应付交易费用。

**7.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	1,574.78	1,541.35
预提审计费	55,000.00	55,000.00
预提信息披露费	200,000.00	200,000.00
合计	256,574.78	256,541.35

**7.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	275,493,388.34	275,493,388.34
本期申购	49,764,928.29	49,764,928.29
本期赎回（以“-”号填列）	-49,580,586.22	-49,580,586.22
- 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	275,677,730.41	275,677,730.41

注：申购含红利再投、转换入份额及金额；赎回含转换出份额及金额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	101,981,223.22	-53,790,399.23	48,190,823.99
本期利润	11,521,588.22	5,081,157.42	16,602,745.64
本期基金份额交易产生的变动数	124,915.06	-1,096,086.13	-971,171.07
其中：基金申购款	14,465,854.02	-10,096,874.50	4,368,979.52
基金赎回款	-14,340,938.96	9,000,788.37	-5,340,150.59
本期已分配利润	-24,089,494.69	-	-24,089,494.69
本期末	89,538,231.81	-49,805,327.94	39,732,903.87

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
活期存款利息收入	121,610.12	107,756.63
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	28.90	218.97
合计	121,639.02	107,975.60

#### 7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日

卖出股票成交总额	259,573,064.53	835,399,063.18
减：卖出股票成本总额	245,745,090.65	732,861,219.93
买卖股票差价收入	13,827,973.88	102,537,843.25

#### 7.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无基金投资收益。

#### 7.4.7.14 债券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益。

#### 7.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

#### 7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12 月31日
股票投资产生的股利收益	4,310,952.70	6,768,552.18
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	4,310,952.70	6,768,552.18

#### 7.4.7.18 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12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015 年12月31日
1. 交易性金融资产	5,081,157.42	-52,018,336.81
——股票投资	5,081,157.42	-52,018,336.81
——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	-	-

——外汇远期协议	-	-
3. 其他	-	-
合计	5,081,157.42	-52,018,336.81

#### 7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016 年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015 年12月31日
基金赎回费收入	28,500.52	66,555.90
其他	-	78.32
合计	28,500.52	66,634.22

#### 7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016 年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015 年12月31日
交易所市场交易费用	447,982.00	1,349,020.05
银行间市场交易费用	-	-
合计	447,982.00	1,349,020.05

#### 7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016 年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015 年12月31日
审计费用	55,000.00	55,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
税务咨询费	11,210.70	18,310.80
其他	756.17	1,062.49
税费	-	377,850.06
银行费用	2,571.48	7,716.66
合计	369,538.35	759,940.01

## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金管理人于 2017 年 1 月 11 日发布分红公告，向截至 2017 年 1 月 17 日止本基金登记注册的份额持有人，按每 10 份基金份额分配红利人民币 0.7300 元，实际分配收益为 20,058,779.10 元。

截至财务报表批准日，除上述利润分配事项及在 7.4.6 税项中披露的事项外，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

## 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
工银瑞信基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金管理人股东、基金销售机构
瑞士信贷银行股份有限公司	基金管理人股东
威灵顿管理有限责任合伙制公司	境外投资顾问
美国花旗银行有限公司	境外资产托管人
工银瑞信资产管理（国际）有限公司	基金管理人的子公司
工银瑞信投资管理有限公司	基金管理人的子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.10.1.1 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 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
美国花旗银行有限公司	27,283,129.50	5.60%	62,296,578.06	4.60%
瑞士信贷银行股份有限公司	30,530,184.10	6.27%	137,165,461.96	10.12%

### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金于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权证交易。

### 7.4.10.1.3 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12月31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
美国花旗银行 有限公司	22,085.39	9.77%	-	-
瑞士信贷银行 股份有限公司	13,558.93	6.00%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31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
美国花旗银行 有限公司	32,023.07	6.67%	-	-
瑞士信贷银行 股份有限公司	42,341.34	8.81%	-	-

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。

### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	5,502,016.66	7,424,519.81
其中：支付销售机构的客户维护费	1,278,182.68	1,739,024.36

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 为每日应支付的基金管理费

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，逐日累计至每个月月末，按月支付。基金管理人应于次月首日起 5 个工作日内将上月基金管理费的计算结果通知基金托管人并做出划付指令，基金托管人应在次月首日起 10 个工作日内完成复核，并从基金财产中一次性支付基金管理费给基金管理人。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	917,002.88	1,237,420.02

注：1、基金托管费按前一估值日的基金资产净值的 0.30% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一估值日的基金资产净值

2、基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。基金管理人应于次月首日起 5 个工作日内将上月基金托管费的计算结果书面通知基金托管人并做出划付指令，基金托管人应在次月首日起 10 个工作日内完成复核，并从基金财产中一次性支付基金托管费给基金托管人。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用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。

##### 7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末与上年度末均未持有本基金。

#### 7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	16,335,382.06	121,598.45	17,132,655.60	107,726.56



美国花旗银行 有限公司	9,356,736.90	11.67	5,394,242.70	30.07
----------------	--------------	-------	--------------	-------

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间内均未有在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

##### 7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

金额单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日		每 10 份 基金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分 配 合计	备注
		场内	场外					
1	2016 年 1 月 19 日	-	2016 年 1 月 18 日	0.8750	13,367,129.08	10,722,365.61	24,089,494.69	

注：本基金于资产负债表日之后、财务报表批准报出日之前批准、公告或实施的利润分配情况请参见“资产负债表日后事项”（附注 7.4.8.2）。

#### 7.4.12 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

##### 7.4.12.2 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。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金管理人的风险管理机构由董事会下属的公司治理与风险控制委员会、督察长、公司风

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，将风险控制可在可承受的范围内。

#### **7.4.13.2 信用风险**

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于远期合约、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%。

##### **7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

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

### 7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

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

### 7.4.13.3 流动性风险

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

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。

### 7.4.13.4 市场风险

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

#### 7.4.13.4.1 利率风险

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

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 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	25,692,118.96	-	-	-	-	-	25,692,118.96
交易性金融资产	-	-	-	-	-	291,408,801.06	291,408,801.06
应收利息	-	-	-	-	-	3,713.24	3,713.24
应收股利	-	-	-	-	-	114,308.01	114,308.01
应收申购款	2,741.68	-	-	-	-	142,922.69	145,664.37
资产总计	25,694,860.64	-	-	-	-	291,669,745.00	317,364,605.64
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	88,025.54	88,025.54
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,043,418.84	1,043,418.84

应付管理人报酬	-	-	-	-	-	485,101.93	485,101.93
应付托管费	-	-	-	-	-	80,850.27	80,850.27
其他负债	-	-	-	-	-	256,574.78	256,574.78
负债总计	-	-	-	-	-	1,953,971.36	1,953,971.36
利率敏感度缺口	25,694,860.64	-	-	-	-	-289,715,773.64	315,410,634.28
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	22,526,898.30	-	-	-	-	-	22,526,898.30
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-304,552,810.67	304,552,810.67
应收证券清算款	-	-	-	-	-	2,493,722.40	2,493,722.40
应收利息	-	-	-	-	-	4,072.49	4,072.49
应收股利	-	-	-	-	-	145,773.30	145,773.30
应收申购款	675.97	-	-	-	-	381,288.28	381,964.25
资产总计	22,527,574.27	-	-	-	-	-307,577,667.14	330,105,241.41
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	2,899,335.91	2,899,335.91
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,685,451.34	2,685,451.34
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	496,886.13	496,886.13
应付托管费	-	-	-	-	-	82,814.35	82,814.35
其他负债	-	-	-	-	-	256,541.35	256,541.35
负债总计	-	-	-	-	-	6,421,029.08	6,421,029.08
利率敏感度缺口	22,527,574.27	-	-	-	-	-301,156,638.06	323,684,212.33

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2015 年 12 月 31 日和 2016 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。

#### 7.4.13.4.2 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。

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日						合计
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	英镑折合人民 币	印度卢比折合 人民币	瑞士法郎折合 人民币	其他币种 折合人民币	

以外币计价的资产							
银行存款	9,356,756.99	4,489.45	-	-	-	1,090.91	9,362,337.35
交易性金融资产	154,659,813.64	93,063,665.25	17,629,938.71	5,563,305.69	4,531,505.20	15,960,572.57	291,408,801.06
应收利息	-	-	-	-	-	1.55	1.55
应收股利	113,408.30	-	-	-	-	899.71	114,308.01
资产合计	164,129,978.93	93,068,154.70	17,629,938.71	5,563,305.69	4,531,505.20	15,962,564.74	300,885,447.97
以外币计价的负债							
应付证券清算款	88,025.54	-	-	-	-	-	88,025.54
负债合计	88,025.54	-	-	-	-	-	88,025.54
资产负债表外汇风险敞口净额	164,041,953.39	93,068,154.70	17,629,938.71	5,563,305.69	4,531,505.20	15,962,564.74	300,797,422.43
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	瑞士法郎折合人民币	日元折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产							
银行存款	5,394,195.07	222.17	-	-	-	1,028.26	5,395,445.50
交易性金融资产	164,113,676.08	97,247,944.04	19,922,582.40	9,080,923.91	6,761,888.97	7,425,795.27	304,552,810.67
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	0.00
应收证券清算款	2,493,722.40	-	-	-	-	-	2,493,722.40
应收利息	-	-	-	-	-	1.47	1.47
应收股利	131,421.76	-	14,351.54	-	-	-	145,773.30
其他应收款	-	-	-	-	-	-	0.00
资产合计	172,133,015.31	97,248,166.21	19,936,933.94	9,080,923.91	6,761,888.97	7,426,825.00	312,587,753.34
以外币计价的负债							
应付证券清算款	2,899,335.91	-	-	-	-	-	2,899,335.91
负债合计	2,899,335.91	-	-	-	-	-	2,899,335.91
资产负债表外汇风险敞口净额	169,233,679.40	97,248,166.21	19,936,933.94	9,080,923.91	6,761,888.97	7,426,825.00	309,688,417.43

## 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除本基金的单一外币汇率变化 5%以外的其他市场变量保持不变，且未考虑基金管理人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 12 月 31 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	美元相对人民币升值 5%	8,202,097.67	8,461,683.97
	美元相对人民币贬值 5%	-8,202,097.67	-8,461,683.97
	港币相对人民币升值 5%	4,653,407.74	4,862,408.31
	港币相对人民币贬值 5%	-4,653,407.74	-4,862,408.31
	英镑相对人民币升值 5%	881,496.94	996,846.70
	英镑相对人民币贬值 5%	-881,496.94	-996,846.70
	印度卢比相对人民币升值 5%	278,165.28	-
	印度卢比相对人民币贬值 5%	-278,165.28	-
	瑞士法郎相对人民币升值 5%	226,575.26	454,046.20
	瑞士法郎相对人民币贬值 5%	-226,575.26	-454,046.20
	日元相对人民币升值 5%	-	338,094.45
	日元相对人民币贬值 5%	-	-338,094.45

注：1、表中列示了当年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。

## 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的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：在香港等境外证券市场上市的中国公司股票，全球范围内受惠于中国经济增长的境外公司股票，以及政府债券、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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日		上年度末 2015年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	291,408,801.06	92.39	304,552,810.67	94.09
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	291,408,801.06	92.39	304,552,810.67	94.09

注：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%。其中，投资于香港等境外证券市场上市的中国公司股票的资产为中国公司组合，投资于全球范围内受惠于中国经济增长的境外公司股票的资产为全球公司组合，中国公司组合占基金资产的比例为 30%-50%，全球公司组合占基金资产的比例为 50%-70%。

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；		
	用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；		
	Beta 系数是根据组合的净值数据和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016年12月31日）	上年度末（2015年12月31日）
	业绩比较基准增加 5%	13,447,240.84	15,266,466.75
业绩比较基准减少 5%	-13,447,240.84	-15,266,466.75	

注：本基金管理人运用定量分析等方法对本基金的其他价格风险进行分析。上表为其他价格风险

的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

银行存款、应收证券清算款、其他资产、应付赎回款、其他负债等，因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

##### (a) 各层次金融工具公允价值

本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 291,408,801.06 元，无属于第二层次及第三层次的余额（2015 年 12 月 31 日：第一层次人民币 297,237,700.25 元，第二层次人民币：7,315,110.42 元，无属于第三层次的余额）。

##### (b) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具，在第一层次和第二层次之间无重大转移（2015 年度：无）。

本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具未发生转入或转出第三层次公允价值的情况（2015 年度：无）。

##### (2) 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

##### (3) 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## §8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	291,408,801.06	91.82
	其中：普通股	264,550,877.55	83.36
	存托凭证	26,857,923.51	8.46
	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	25,692,118.96	8.10
8	其他各项资产	263,685.62	0.08
9	合计	317,364,605.64	100.00

注：由于四舍五入的原因市值占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

## 8.2 期末在各个国家（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	153,572,614.12	48.69
中国香港	93,063,665.25	29.51
英国	17,629,938.71	5.59
印度	5,563,305.69	1.76
瑞士	4,531,505.20	1.44
日本	4,470,814.78	1.42
法国	4,025,421.78	1.28
印度尼西亚	3,821,741.25	1.21
澳大利亚	1,942,778.98	0.62
韩国	1,699,815.78	0.54
卢森堡	1,087,199.52	0.34
合计	291,408,801.06	92.39

注：1、权益投资的国家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。

## 8.3 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	28,516,324.93	9.04
必需消费品 Consumer Staples	10,329,836.62	3.28
材料 Materials	1,942,778.98	0.62
电信服务	9,103,233.18	2.89

Telecommunication Services		
房地产 Real Estate	4,825,708.65	1.53
非必需消费品 Consumer Discretionary	34,429,399.38	10.92
工业 Industrials	14,116,637.35	4.48
公共事业 Utilities	4,309,104.24	1.37
金融 Financials	62,125,498.35	19.70
能源 Energy	7,023,702.36	2.23
信息技术 Information Technology	114,686,577.02	36.36
合计	291,408,801.06	92.39

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市值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差

#### 8.4 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	TENCENT HOLDINGS LTD	腾讯控股	KYG875721634	香港证券交易所	中国香港	168,240	28,548,401.15	9.05
2	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	阿里巴巴集团控股有限公司	US01609W1027	纽约证券交易所	美国	24,748	15,074,946.48	4.78
3	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	中国人寿	CNE1000002L3	香港证券交易所	中国香港	340,000	6,143,494.68	1.95
4	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	香港交易所	HK0388045442	香港证券交易所	中国香港	35,290	5,783,121.65	1.83
5	ALPHABET INC-CL C	-	US02079K1079	纳斯达克证券交易所	美国	931	4,984,681.38	1.58

6	MICROSOFT CORP	微软	US5949181045	纳斯达克 证券 交易 所	美国	10,817	4,662,832.05	1.48
7	CNOOC LTD	中国海 洋石油	HK0883013259	香港 证 券 交 易 所	中国香 港	513,870	4,458,719.98	1.41
8	CHINA UNICOM HONG KONG LTD	中国联 通	HK0000049939	香港 证 券 交 易 所	中国香 港	541,270	4,372,067.99	1.39
9	CTrip.COM INTERNATIONAL-ADR	-	US22943F1003	纳斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	14,373	3,988,220.04	1.26
10	PICC PROPERTY & CASUALTY -H	中国财 险	CNE100000593	香港 证 券 交 易 所	中国香 港	357,720	3,865,408.14	1.23
11	UNITEDHEALTH GROUP INC	联合健 康	US91324P1021	纽 约 证 券 交 易 所	美国	3,447	3,826,850.71	1.21
12	BANK OF AMERICA CORP	美国银 行	US0605051046	纽 约 证 券 交 易 所	美国	24,931	3,822,114.27	1.21
13	AMAZON.COM INC	亚马 逊 公 司	US0231351067	纳斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	713	3,708,917.76	1.18
14	CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	中国太 保	CNE1000009Q7	香港 证 券 交 易 所	中国香 港	151,680	3,670,124.44	1.16
15	HOME DEPOT INC	家得宝	US4370761029	纽 约 证 券 交 易 所	美国	3,920	3,646,042.80	1.16
16	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	英美烟 草	GB0002875804	伦 敦 证 券	英国	8,985	3,533,458.40	1.12

				交易所				
17	FACEBOOK INC-A	-	US30303M1027	纳斯达克 证券交易所	美国	4,418	3,526,013.97	1.12
18	PEPSICO INC	百事可 乐	US7134481081	纽约 证券交 易所	美国	4,817	3,496,266.80	1.11
19	MASTERCARD INC- CLASS A	万事达 股份有 限公司	US57636Q1040	纽约 证券交 易所	美国	4,804	3,440,842.18	1.09
20	ACCENTURE PLC-CL A	埃森哲 公司	IE00B4BNMY34	纽约 证券交 易所	美国	4,115	3,343,564.28	1.06
21	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	利洁时	GB00B24CGK77	伦敦 证券交 易所	英国	5,632	3,300,111.42	1.05
22	VISA INC-CLASS A SHARES	维萨公 司	US92826C8394	纽约 证券交 易所	美国	5,989	3,241,394.97	1.03
23	AUTOMATIC DATA PROCESSING	-	US0530151036	纳斯 达克 证券交 易所	美国	4,432	3,159,948.90	1.00
24	CHINA TELECOM CORP LTD-H	中国电 信	CNE1000002V2	香港 证券交 易所	中国香 港	936,260	2,998,228.28	0.95
25	ASSURED GUARANTY LTD	美国保 证担保 有限公 司	BMG0585R1060	纽约 证券交 易所	美国	11,228	2,941,853.78	0.93
26	GARTNER INC	高德纳 咨询公 司	US3666511072	纽约 证券交 易所	美国	4,186	2,934,899.16	0.93
27	VANTIV INC - CL A	-	US92210H1059	纽约	美国	6,979	2,886,402.32	0.92

				证券交易所				
28	COMPASS GROUP PLC	金巴斯集团	GB00BLNN3L44	伦敦证券交易所	英国	22,541	2,879,073.88	0.91
29	AUTOZONE INC	-	US0533321024	纽约证券交易所	美国	524	2,870,877.17	0.91
30	Medtronic PLC	美敦力	IE00BTN1Y115	纽约证券交易所	美国	5,669	2,801,180.51	0.89
31	ANALOG DEVICES INC	模拟器件	US0326541051	纳斯达克证券交易所	美国	5,538	2,789,850.24	0.88
32	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	新奥能源	KYG3066L1014	香港证券交易所	中国香港	97,610	2,785,288.56	0.88
33	GLOBAL PAYMENTS INC	环汇公司	US37940X1028	纽约证券交易所	美国	5,719	2,753,682.32	0.87
34	SINO BIOPHARMACEUTICAL	中国生物制药	KYG8167W1380	香港证券交易所	中国香港	561,315	2,741,476.27	0.87
35	CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	中国海外发展	HK0688002218	香港证券交易所	中国香港	148,540	2,730,489.09	0.87
36	CISCO SYSTEMS INC	思科	US17275R1023	纳斯达克证券交易所	美国	12,956	2,716,045.83	0.86
37	SUNNY OPTICAL TECH	舜宇光学科技	KYG8586D1097	香港证券交易所	中国香港	88,660	2,692,481.36	0.85

38	ICON PLC	-	IE0005711209	纳斯达克 证券 交易 所	美国	5,140	2,681,344.74	0.85
39	INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	-	US45866F1049	纽约 证券 交易 所	美国	6,848	2,680,208.18	0.85
40	BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	华晨中 国汽车	BMG1368B1028	香港 证券 交易 所	中国香 港	280,000	2,674,942.70	0.85
41	AON PLC	怡安保 险	GB00B5BT0K07	纽约 证券 交易 所	美国	3,428	2,652,187.42	0.84
42	PARTNERS GROUP HOLDING AG	-	CH0024608827	瑞士 证券 交易 所	瑞士	812	2,634,757.32	0.84
43	COMCAST CORP- CLASS A	康卡斯 特	US20030N1019	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	5,469	2,619,650.18	0.83
44	CHINA OILFIELD SERVICES-H	中海油 服	CNE1000002P4	香港 证券 交易 所	中国香 港	398,260	2,564,982.38	0.81
45	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	-	US6934751057	纽约 证券 交易 所	美国	3,137	2,545,209.72	0.81
46	BOSTON SCIENTIFIC CORP	波士顿 科学	US1011371077	纽约 证券 交易 所	美国	16,934	2,540,901.15	0.81
47	PRICELINE GROUP INC/THE	-	US7415034039	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	249	2,532,344.50	0.80
48	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	-	US8835561023	纽约 证券	美国	2,582	2,527,289.23	0.80

				交易 所				
49	ROSS STORES INC	-	US7782961038	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	5,493	2,499,684.13	0.79
50	STRYKER CORP	史赛克	US8636671013	纽约 证券 交易 所	美国	3,007	2,499,183.76	0.79
51	QUALCOMM INC	高通公 司	US7475251036	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	5,430	2,455,947.73	0.78
52	HAITONG SECURITIES CO LTD- H	海通证 券	CNE1000019K9	香港 证券 交易 所	中国香 港	201,530	2,397,598.98	0.76
53	ADOBE SYSTEMS INC	奥多比	US00724F1012	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	3,327	2,376,024.13	0.75
54	RECRUIT HOLDINGS CO LTD	-	JP3970300004	东京 证券 交易 所	日本	8,500	2,375,595.22	0.75
55	ALIGN TECHNOLOGY INC	-	US0162551016	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	3,544	2,363,329.90	0.75
56	DISCOVER FINANCIAL SERVICES	-	US2547091080	纽约 证券 交易 所	美国	4,643	2,321,910.12	0.74
57	EQUIFAX INC	-	US2944291051	纽约 证券 交易 所	美国	2,788	2,286,610.29	0.73
58	HCA HOLDINGS INC	-	US40412C1018	纽约 证券 交易	美国	4,355	2,236,191.20	0.71

				所				
59	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	第一资 本金融	US14040H1059	纽约 证券 交易 所	美国	3,680	2,227,076.68	0.71
60	ALLSTATE CORP	全州保 险	US0200021014	纽约 证券 交易 所	美国	4,309	2,215,560.43	0.70
61	ELECTRONIC ARTS INC	电子艺 界	US2855121099	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	4,043	2,208,925.88	0.70
62	EXPERIAN PLC	益佰利 有限公 司	GB00B19NLV48	伦敦 证券 交易 所	英国	16,363	2,191,626.77	0.69
63	BROADCOM LTD	-	SG9999014823	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	1,780	2,182,731.21	0.69
64	IHS MARKIT LTD	-	BMG475671050	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	8,631	2,120,111.68	0.67
65	DAITO TRUST CONSTRUCT CO LTD	大东建 托株式 会社	JP3486800000	东京 证券 交易 所	日本	2,000	2,095,219.56	0.66
66	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	中亚银 行股份 有限公 司	ID1000109507	印尼 证券 交易 所	印度尼 西亚	261,500	2,088,804.34	0.66
67	LEGRAND SA	-	FR0010307819	巴黎 证券 交易 所	法国	5,245	2,067,588.76	0.66
68	TONGDA GROUP HOLDINGS LTD	通达集 团	KYG8917X1218	香港 证券 交易 所	中国香 港	1,152,810	2,062,400.15	0.65
69	SYNCHRONY	同步金	US87165B1035	纽约	美国	7,902	1,988,182.63	0.63



	FINANCIAL	融公司		证券交易所				
70	JUST EAT PLC	-	GB00BKX5CN86	伦敦证券交易所	英国	39,777	1,975,021.53	0.63
71	EDENRED	-	FR0010908533	巴黎证券交易所	法国	14,226	1,957,833.02	0.62
72	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	石药集团	HK1093012172	香港证券交易所	中国香港	263,720	1,953,253.47	0.62
73	S&P GLOBAL INC	标普全球	US78409V1044	纽约证券交易所	美国	2,616	1,951,549.03	0.62
74	ADMIRAL GROUP PLC	-	GB00B02J6398	伦敦证券交易所	英国	12,547	1,950,641.16	0.62
75	AMCOR LIMITED	-	AU000000AMC4	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	25,909	1,942,778.98	0.62
76	MARUTI SUZUKI INDIA LTD	-	INE585B01010	印度证券交易所	印度	3,575	1,941,784.05	0.62
77	INTUIT INC	-	US4612021034	纳斯达克证券交易所	美国	2,415	1,920,044.71	0.61
78	JULIUS BAER GROUP LTD	瑞士宝盛集团有限公司	CH0102484968	瑞士证券交易所	瑞士	6,168	1,896,747.88	0.60
79	MSCI INC	-	US55354G1004	纽约证券交易所	美国	3,462	1,891,972.13	0.60

80	JD.COM INC-ADR	京东	US47215P1066	纳斯达克 证券 交易 所	美国	10,637	1,877,188.83	0.60
81	HDFC BANK LIMITED	-	INE040A01026	印度 证券 交易 所	印度	15,016	1,849,368.99	0.59
82	WORLDPAY GROUP PLC	-	GB00BYK2V80	伦敦 证券 交易 所	英国	78,374	1,800,005.55	0.57
83	ICICI BANK LTD	-	INE090A01021	印度 证券 交易 所	印度	67,983	1,772,152.65	0.56
84	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	瑞声科 技	KYG2953R1149	香港 证券 交易 所	中国香 港	27,500	1,733,001.31	0.55
85	TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER	印尼电 信股份 有限公 司	ID1000129000	印尼 证券 交易 所	印度尼 西亚	844,900	1,732,936.91	0.55
86	SERVICENOW INC	-	US81762P1021	纽约 证券 交易 所	美国	3,342	1,723,457.97	0.55
87	NAVER CORP	-	KR7035420009	韩国 证券 交易 所	韩国	381	1,699,815.78	0.54
88	BEIGENE LTD-ADR	-	US07725L1026	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	8,010	1,686,964.63	0.53
89	YY INC-ADR	欢聚时 代	US98426T1060	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	5,756	1,574,015.84	0.50
90	HUANENG RENEWABLES CORP-H	华能新 能源	CNE10000WS1	香港 证券 交易 所	中国香 港	676,000	1,523,815.68	0.48

				交易所				
91	REGINA MIRACLE INTERNATIONAL	维珍妮	KYG748071019	香港证券交易所	中国香港	242,000	1,391,911.23	0.44
92	BEIJING ENTERPRISES HLDGS	北京控股	HK0392044647	香港证券交易所	中国香港	34,080	1,117,271.61	0.35
93	CATCHER TECHNOLOGY-GDR REGS	可成科技	US14912K2024	卢森堡证券交易所	卢森堡	4,527	1,087,199.52	0.34
94	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	中芯国际	KYG8020E1199	香港证券交易所	中国香港	92,569	1,008,551.46	0.32
95	HAIER ELECTRONICS GROUP CO	海尔电器	BMG423131256	香港证券交易所	中国香港	90,380	986,318.93	0.31
96	58.COM INC-ADR	58同城网	US31680Q1040	纽约证券交易所	美国	4,519	877,752.48	0.28
97	VALUE PARTNERS GROUP LTD	惠理集团	KYG931751005	香港证券交易所	中国香港	151,620	835,453.73	0.26
98	LI NING CO LTD	李宁	KYG5496K1242	香港证券交易所	中国香港	186,500	812,443.18	0.26
99	NETEASE INC-ADR	网易公司	US64110W1027	纳斯达克证券交易所	美国	463	691,635.69	0.22
100	LUYE PHARMA GROUP LTD	绿叶制药	BMG570071099	香港证券交易所	中国香港	160,000	658,359.36	0.21
101	TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	中国民航信息	CNE1000004J3	香港证券交易所	中国香港	38,000	554,059.49	0.18

		网络		交易所				
102	CHINA METAL RECYCLING	中国金属再生资源	KYG211311009	场外	中国香港	799,600	0.00	0.00

注：上表所用证券代码采用 ISIN 代码。

## 8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

### 8.5.1 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	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	US01609W1027	10,024,025.66	3.10
2	TENCENT HOLDINGS LTD	KYG875721634	4,187,519.85	1.29
3	FACEBOOK INC-A	US30303M1027	3,803,761.55	1.18
4	AMAZON.COM INC	US0231351067	3,652,858.29	1.13
5	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	GB00B24CGK77	3,449,817.06	1.07
6	BANK OF AMERICA CORP	US0605051046	3,441,147.25	1.06
7	CTRIP.COM INTERNATIONAL-ADR	US22943F1003	3,428,110.44	1.06
8	PEPSICO INC	US7134481081	3,275,413.59	1.01
9	JOHNSON & JOHNSON	US4781601046	3,160,512.48	0.98
10	ALLERGAN PLC	IE00BY9D5467	3,137,885.75	0.97
11	HCA HOLDINGS INC	US40412C1018	2,821,385.59	0.87
12	PRICELINE GROUP INC/THE	US7415034039	2,773,890.69	0.86
13	COMPASS GROUP PLC	GB00BLNN3L44	2,699,506.90	0.83
14	MCKESSON CORP	US58155Q1031	2,594,955.08	0.80
15	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	CNE1000002L3	2,575,651.73	0.80
16	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	US8835561023	2,562,402.40	0.79
17	ASTRAZENECA PLC	GB0009895292	2,554,009.72	0.79
18	AUTOZONE INC	US0533321024	2,545,829.65	0.79
19	NIKE INC -CL B	US6541061031	2,512,510.98	0.78
20	ONO PHARMACEUTICAL CO	JP3197600004	2,512,052.59	0.78

	LTD		
--	-----	--	--

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

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

### 8.5.2 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	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	CNE1000002H1	10,762,534.55	3.33
2	CHINA VANKE CO LTD-H	CNE100001SR9	9,058,264.36	2.80
3	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	CNE1000003X6	5,878,221.23	1.82
4	FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	US3030751057	5,197,043.53	1.61
5	NTT DOCOMO INC	JP3165650007	4,522,325.12	1.40
6	ALTRIA GROUP INC	US02209S1033	4,335,968.00	1.34
7	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	US7181721090	4,079,538.70	1.26
8	AMAZON.COM INC	US0231351067	3,952,839.49	1.22
9	JOHNSON & JOHNSON	US4781601046	3,905,926.85	1.21
10	EXPEDIA INC	US30212P3038	3,902,498.81	1.21
11	JACK HENRY & ASSOCIATES INC	US4262811015	3,713,566.59	1.15
12	PRICELINE GROUP INC/THE	US7415034039	3,702,910.92	1.14
13	WELLS FARGO & CO	US9497461015	3,702,596.46	1.14
14	FISERV INC	US3377381088	3,690,800.31	1.14
15	LOWES COS INC	US5486611073	3,650,329.08	1.13
16	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	US0268747849	3,567,184.11	1.10
17	NOVARTIS AG-REG	CH0012005267	3,344,417.54	1.03
18	AMGEN INC	US0311621009	3,237,772.03	1.00
19	ESTEE LAUDER	US5184391044	3,200,104.47	0.99

	COMPANIES-CL A			
20	UNITED PARCEL SERVICE-CL B	US9113121068	3,100,863.69	0.96

注：1、卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票；

2、卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 8.5.3 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	227,519,923.62
卖出收入（成交）总额	259,573,064.53

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

### 8.6 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。

### 8.7 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。

### 8.8 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。

### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名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。

### 8.10 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。

### 8.11 投资组合报告附注

#### 8.11.1

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

#### 8.11.2

基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

#### 8.11.3 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	114,308.01
4	应收利息	3,713.24
5	应收申购款	145,664.37
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	263,685.62

#### 8.11.4 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可转换债券。

#### 8.11.5 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。

#### 8.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
21,561	12,785.94	14,724,796.35	5.34%	260,952,934.06	94.66%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	277,166.50	0.10%

**9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况**

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0

**§10 开放式基金份额变动**

单位：份

基金合同生效日（2008年2月14日）基金份额总额	3,155,816,636.00
本报告期期初基金份额总额	275,493,388.34
本报告期基金总申购份额	49,764,928.29
减：本报告期基金总赎回份额	49,580,586.22
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	275,677,730.41

**§11 重大事件揭示****11.1 基金份额持有人大会决议**

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

**11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动****1、基金管理人：**

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

**2、基金托管人托管部门：**

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

**11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼**

本报告期内，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。



#### 11.4 基金投资策略的改变

无。

#### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内应支付给安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用伍万伍仟元整，该审计机构自基金合同生效日起向本基金提供审计服务。

#### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

#### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

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	
Merrill Lynch	-	54,410,034.89	11.17%	20,503.53	9.07%	-
UBS Securities	-	53,178,170.33	10.92%	22,666.36	10.02%	-
Goldman Sachs	-	39,370,302.53	8.08%	21,794.89	9.64%	-
Deutsche Bank	-	35,254,822.98	7.24%	14,146.51	6.26%	-
Investment Technolog	-	34,431,153.76	7.07%	6,578.95	2.91%	-
Morgan Stanley	-	30,561,320.55	6.27%	17,746.73	7.85%	-
Credit Suisse	-	30,530,184.10	6.27%	13,558.93	6.00%	-
Sanford C Bernstein	-	30,177,410.90	6.20%	5,033.81	2.23%	-
Citigroup	-	27,283,129.50	5.60%	22,085.39	9.77%	-
J.P.Morgan	-	23,504,109.61	4.83%	19,548.16	8.65%	-
Barclays Capital	-	22,343,879.41	4.59%	6,879.16	3.04%	-
Liquidnet, Inc.	-	14,390,521.27	2.95%	5,408.88	2.39%	-
Jefferies & Company	-	13,799,118.21	2.83%	3,412.29	1.51%	-
WSAccess	-	10,554,719.46	2.17%	951.45	0.42%	新增
Guggenheim	-	6,542,117.56	1.34%	2,399.23	1.06%	新增
CLSA Ltd.	-	5,728,514.21	1.18%	6,990.78	3.09%	-

ISI Group	-	5,169,686.95	1.06%	714.25	0.32%	-
Mizuho Securities	-	4,738,336.15	0.97%	1,565.76	0.69%	-
Instinet	-	4,549,253.66	0.93%	480.74	0.21%	-
RBC Capital Markets	-	4,311,888.87	0.89%	451.39	0.20%	-
BTIG LLC	-	4,228,529.29	0.87%	6,613.60	2.93%	-
Luminex	-	2,573,823.93	0.53%	226.95	0.10%	新增
ReMacro	-	2,550,105.38	0.52%	377.03	0.17%	新增
SMBC	-	2,510,404.21	0.52%	2,510.33	1.11%	-
BMO Capital Markets	-	2,320,348.51	0.48%	1,092.47	0.48%	-
Canaccord Genuity	-	2,159,178.54	0.44%	1,211.94	0.54%	-
Macquarie	-	2,157,036.78	0.44%	2,316.49	1.02%	-
BOM	-	2,095,767.34	0.43%	1,174.76	0.52%	新增
WEDMOR	-	1,895,008.33	0.39%	3,240.88	1.43%	新增
Nomura international	-	1,715,112.00	0.35%	2,058.13	0.91%	-
NATIX	-	1,671,544.12	0.34%	2,406.99	1.06%	新增
Pulse Trading	-	1,624,847.94	0.33%	214.33	0.09%	-
Exane	-	1,505,903.85	0.31%	2,171.31	0.96%	新增
HSBC Securities	-	904,204.68	0.19%	1,451.00	0.64%	-
Societe Generale	-	736,247.51	0.15%	364.32	0.16%	-
Height Securities LL	-	710,364.42	0.15%	390.09	0.17%	-
Berenberg Bank	-	697,356.21	0.14%	231.50	0.10%	-
CIMB Securities	-	679,935.18	0.14%	1,248.34	0.55%	-
Santander Investment	-	559,260.36	0.11%	1,140.98	0.50%	新增
SIDOTI	-	535,637.75	0.11%	177.54	0.08%	新增
ITAU Securities	-	515,543.57	0.11%	1,108.43	0.49%	-
R W Baird	-	343,848.79	0.07%	260.89	0.12%	-
Stifel Nicolaus & Co	-	335,194.46	0.07%	77.45	0.03%	-
Wells Fargo	-	242,284.59	0.05%	70.51	0.03%	-

Securiti						
Daiwa Securities	-	219,192.78	0.05%	438.39	0.19%	新增
J&A	-	219,065.44	0.04%	117.92	0.05%	新增
JMP Securities	-	171,425.09	0.04%	172.09	0.08%	-
STRH	-	150,882.37	0.03%	91.71	0.04%	-
State Street	-	147,519.58	0.03%	141.50	0.06%	-
Mitsubishi UFJ	-	88,740.18	0.02%	88.70	0.04%	新增
Evercore Group LLC	-	-	-	-	-	-
ING Financial	-	-	-	-	-	-
BOCI SECURITIES LTD	-	-	-	-	-	-
MKM Partners	-	-	-	-	-	-
Blair, W&C	-	-	-	-	-	-
Longbow Research	-	-	-	-	-	-
Craig-Hallum Capital	-	-	-	-	-	-
Hai Tong	-	-	-	-	-	-
ICBC International	-	-	-	-	-	-
Pacific Crest	-	-	-	-	-	-
Weeden & Company	-	-	-	-	-	-
Standard Bank	-	-	-	-	-	-
BNY Brokerage	-	-	-	-	-	-
Standard Chartered B	-	-	-	-	-	-
TD Securities	-	-	-	-	-	-
Cowen & Co	-	-	-	-	-	-
CICC	-	-	-	-	-	-
IXIS Securities	-	-	-	-	-	-
CITIC Securities	-	-	-	-	-	-
Cantor Fitzgerald	-	-	-	-	-	-
Green Street	-	-	-	-	-	-

Execution Noble Ltd	-	-	-	-	-	-
Citigroup GM Inc	-	-	-	-	-	-
Kim Eng Securities	-	-	-	-	-	-
Enam Securities	-	-	-	-	-	-
Keefe Bruyette	-	-	-	-	-	-
CAI/Chevroux	-	-	-	-	-	-
CREDIT AGRICOLE	-	-	-	-	-	-
Needham & Co Inc	-	-	-	-	-	-
B. Riley & Co.	-	-	-	-	-	-
Piper Jaffray Co	-	-	-	-	-	-
Stephens Inc	-	-	-	-	-	-
Lazard Capital	-	-	-	-	-	-
BNP Paribas	-	-	-	-	-	-

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。委托代理协议一式五份，协议双方及证券主管

机关各留存一份，我方协议由研究部和战略发展部存档，并报相关证券主管机关留存报备。

## 2、券商的评估，保留和更换程序

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

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

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

## 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	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	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
8	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
9	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	中国证监会指定的媒介	2016 年 4 月 22 日

	费率优惠的公告		
10	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
11	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
12	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
13	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
14	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
15	工银瑞信基金管理有限公司关于增加珠海盈米财富管理有限公司为旗下基金销售机构并进行费率调整的公告	中国证监会指定的媒介	2016年6月2日
16	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
17	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
18	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
19	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
20	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
21	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
22	关于增加第一创业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7月1日
23	工银瑞信基金管理有限公司关于增加深圳前海京西票号基金销售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7月1日

24	工银瑞信基金管理有限公司关于增加天津银行股份有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证监会指定的媒介	2016年7月6日
25	工银瑞信基金管理有限公司关于增加上海基煜基金销售有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证监会指定的媒介	2016年7月20日
26	关于直销渠道继续开展 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7月22日
27	工银瑞信基金管理有限公司关于增加南京途牛金融信息服务有限公司为旗下基金销售机构并进行费率调整的公告	中国证监会指定的媒介	2016年8月8日
28	工银瑞信中国机会全球配置股票型证券投资基金关于 2016 年 8 月 2 日暂停申购、赎回等业务的公告	中国证监会指定的媒介	2016年8月3日
29	工银瑞信基金管理有限公司关于增加北京汇成基金销售有限公司为旗下基金销售机构并进行费率调整的公告	中国证监会指定的媒介	2016年8月11日
30	工银瑞信基金管理有限公司关于增加北京广源达信投资管理有限公司为旗下基金销售机构并实行费率优惠的公告	中国证监会指定的媒介	2016年8月25日
31	工银瑞信基金管理有限公司关于增加上海万得投资顾问有限公司为旗下基金销售机构并进行费率调整的公告	中国证监会指定的媒介	2016年8月26日
32	工银瑞信基金管理有限公司关于增加云南红塔银行股份有限公司为旗下基金销售机构并实行费率优惠的公告	中国证监会指定的媒介	2016年9月5日
33	工银瑞信基金管理有限公司关于增加北京恒天明泽基金销售有限公司为旗下基金销售机构并进行费率优惠的公告	中国证监会指定的媒介	2016年9月9日
34	工银瑞信基金管理有限公司关于增加江苏紫金农村商业银行股份有限公司为旗下基金销售机构并实行费率优惠的公告	中国证监会指定的媒介	2016年9月12日
35	工银瑞信基金管理有限公司关于增加天津国美基金销售有限公司为旗下基金销售机构并实行费率优惠的公告	中国证监会指定的媒介	2016年9月28日
36	工银瑞信基金管理有限公司关于	中国证监会指定的	2016年9月28日

	增加苏州银行股份有限公司为旗下基金销售机构并实行费率优惠的公告	媒介	
37	工银瑞信基金管理有限公司关于工银瑞信资产管理（国际）有限公司增加注册资本的公告	中国证监会指定的媒介	2016 年 10 月 14 日
38	工银瑞信基金管理有限公司关于增加泰诚财富基金销售（大连）有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证监会指定的媒介	2016 年 10 月 20 日
39	工银瑞信中国机会全球配置股票型证券投资基金关于 2016 年 10 月 21 日暂停申购、赎回等业务的公告	中国证监会指定的媒介	2016 年 10 月 22 日
40	关于工银瑞信中国机会全球配置股票型证券投资基金暂停大额申购、定期定额投资业务的公告	中国证监会指定的媒介	2016 年 10 月 28 日
41	上海凯石财富基金销售有限公司基金销售费率调整的公告	中国证监会指定的媒介	2016 年 11 月 4 日
42	关于增加华西证券股份有限公司为工银瑞信基金管理有限公司旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会指定的媒介	2016 年 11 月 7 日
43	工银瑞信基金管理有限公司关于北京广源达信投资管理有限公司基金销售费率调整的公告	中国证监会指定的媒介	2016 年 11 月 11 日
44	工银瑞信基金管理有限公司关于和讯信息科技有限公司基金销售费率调整的公告	中国证监会指定的媒介	2016 年 11 月 11 日
45	工银瑞信基金管理有限公司关于增加金惠家保险代理有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证监会指定的媒介	2016 年 11 月 14 日
46	工银瑞信基金管理有限公司关于增加富滇银行股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会指定的媒介	2016 年 11 月 16 日
47	工银瑞信基金管理有限公司关于增加北京新浪仓石基金销售有限公司为旗下基金销售机构并进行费率调整的公告	中国证监会指定的媒介	2016 年 12 月 16 日
48	工银瑞信基金管理有限公司关于旗下基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	中国证监会指定的媒介	2016 年 12 月 22 日



## §12 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准工银瑞信中国机会全球配置股票型证券投资基金募集的文件
- 2、《工银瑞信中国机会全球配置股票型证券投资基金基金合同》
- 3、《工银瑞信中国机会全球配置股票型证券投资基金托管协议》
- 4、《工银瑞信中国机会全球配置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

### 13.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所。

### 13.3 查阅方式

投资者可于营业时间免费查阅，或登录基金管理人网站查阅。也可在支付工本费后，在合理时间内取得上述文件的复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人——工银瑞信基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-811-9999

网址：[www.icbccs.com.cn](http://www.icbccs.com.cn)