

工银瑞信中国机会全球配置股票型证券投资 基金 2017 年半年度报告 摘要

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：工银瑞信基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：二〇一七年八月二十五日

§ 1 重要提示

1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 23 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

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	338,005,967.42 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	为中国国内投资者提供投资全球范围内受益于中国经济持续增长的公司的机会，通过在全球范围内分散投资，控制投资组合风险，追求基金长期资产增值，并争取实现超越业绩比较基准的业绩表现。
投资策略	本基金主要投资于在香港等境外证券市场上市的中国公司股票，以及全球范围内受惠于中国经济增长的境外公司股票，为中国国内投资者提供全球范围内分散投资路径。本基金在选择股票时，重点从中国国内消费、中国进口需求、中国出口优势三个主题识别直接受益于中国经济增长的公司。
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

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合伙制公司	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

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

2.5 信息披露方式

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

§ 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(2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	12,205,062.06
本期利润	53,754,106.98
加权平均基金份额本期利润	0.1766
本期基金份额净值增长率	16.77%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	0.2531
期末基金资产净值	423,571,260.63
期末基金份额净值	1.253

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

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除

相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

3、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 2008 年 2 月 14 日。

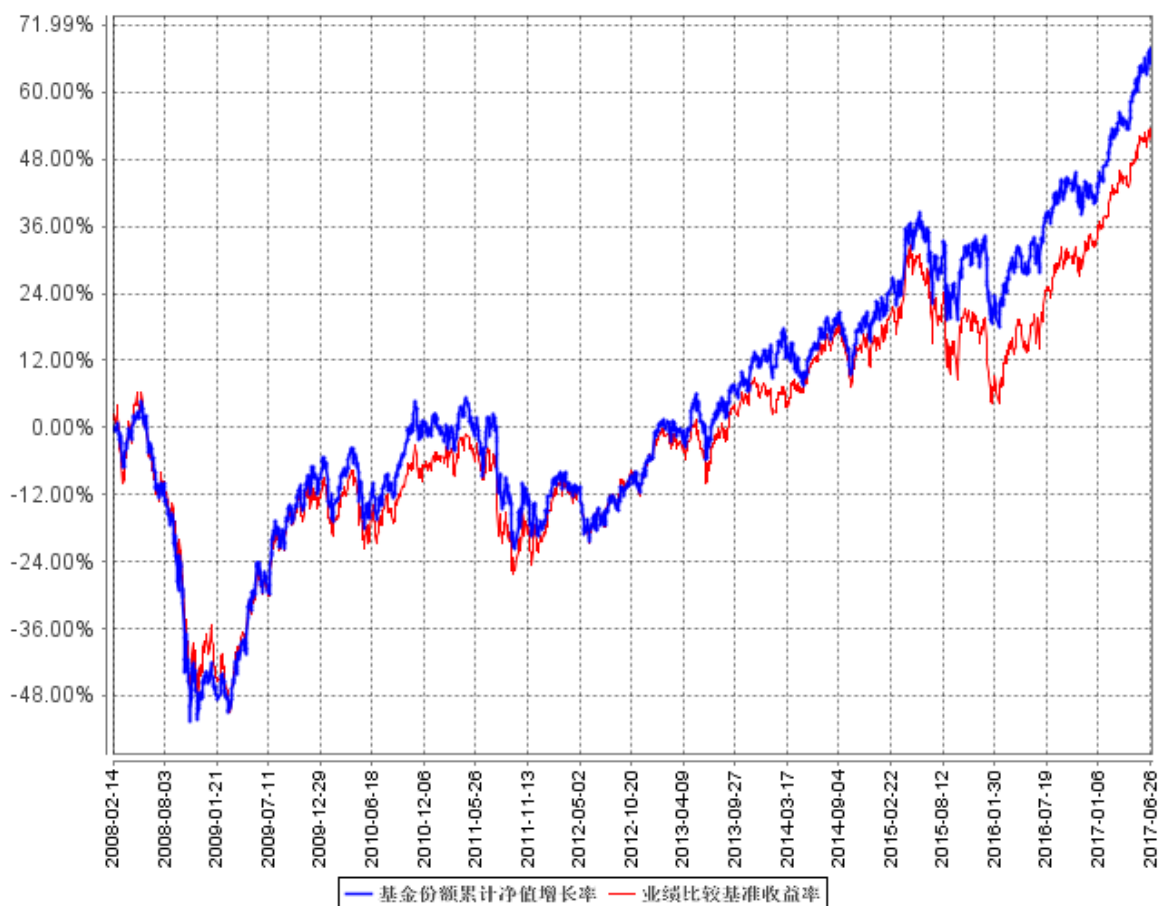
3.2 基金净值表现

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
过去一个月	0.64%	0.55%	-0.15%	0.50%	0.79%	0.05%
过去三个月	6.46%	0.54%	4.70%	0.51%	1.76%	0.03%
过去六个月	16.77%	0.48%	13.50%	0.49%	3.27%	-0.01%
过去一年	23.69%	0.53%	26.52%	0.55%	-2.83%	-0.02%
过去三年	42.92%	0.82%	34.00%	0.86%	8.92%	-0.04%
自基金合同生效起至今	64.57%	1.14%	51.15%	1.22%	13.42%	-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%。

§ 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，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。公司目前在北京、上海、深圳设有分公司，在香港和上海设有全资子公司——工银瑞信资产管理（国际）有限公司、工银瑞信投资管理有限公司。

公司（含子公司）拥有公募基金、特定资产管理、企业年金基金投资管理、全国社会保障基

金境内外投资管理、基本养老保险基金证券投资管理、保险资产管理、企业年金养老金产品投资管理、QDII、QFII、RQFII 等多项业务资格。

截至 2017 年 6 月 30 日，公司旗下管理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 7 天理财债券型证券投资基金、工银瑞信增强收益债券型证券投资基金、工银瑞信金融地产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、工银瑞信沪港深股票型证券投资基金、工银瑞信中国机会全球配置股票型证券投资基金、工银瑞信沪深 300 指数证券投资基金、深证红利交易型开放式指数证券投资基金、上证中央企业 50 交易型开放式指数证券投资基金等 110 只公募基金。

公司始终坚持“以稳健的投资管理，为客户提供卓越的理财服务”为使命，依托强大的股东背景、稳健的经营理念、科学的投研体系、严密的风控机制和资深的管理团队，立足市场化、专业化、规范化和国际化，坚持“稳健投资、价值投资、长期投资”，致力于为广大投资者提供一流的投资管理服务。

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	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

					<p>瑞信基本面量化策略混合型证券投资基金基金经理；</p> <p>2014 年 6 月 26 日至今，担任工银瑞信绝对收益混合型基金经理；</p> <p>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经理；</p> <p>2016 年 3 月 9 日至今，担任工银瑞信香港中小盘股票型基金经理；</p> <p>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；</p> <p>2017 年 4 月 14 日至今，担任工银瑞信新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金经理；</p> <p>2017 年 4 月 27 日至今，担任工银瑞信新价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理。</p>
--	--	--	--	--	--

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	32	<p>威灵顿管理有限合伙制公司合伙人，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。</p> <p>曾在《路透》评选的“企业二十佳基金经理人”中排名第十一。</p> <p>此外，在《巴伦周刊》2011 年的“超级人才”报道中，John A.</p>

			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	23	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。

4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.4 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, 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 2 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，中国组合回报为 31.42%，优于摩根士丹利资本国际中国指数的回报 24.96%。2017 年上半年，本基金在信息技术、金融、能源、工业和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、医疗、通讯和公用事业板块的选股，造成了主要正面影响。板块方面，信息技术、工业和金融板块带来的贡献最大。

6 月份，亚洲股市表现抢眼；新兴市场表现优于发达市场，未受美联储加息以及欧洲央行和英国央行言辞强硬影响。尽管通胀水平温和，但美联储和欧洲央行均表现出货币政策正常化以体现经济展望更为稳定的前景。在英国，保守党在首相特蕾莎·梅宣布的提前大选中失去了议会的多数席位。这一结果削弱了英国政府的力量，并带来了更多有关英国脱欧结局的问题。在美国，联邦公开市场委员会暗示，如果经济增长按其预期加快，那么从 2017 年开始将缩减资产负债表规模。美联储继续支持逐步紧缩，因为核心通胀保持良好水平并接近其目标。在欧洲大陆，增长指标显示地区势头强劲。6 月份，日本央行维持宽松立场，并保持政策利率不变。6 月份对于中国资本市场来说也是一个重要里程碑：全球投资者为定于 7 月初启动的“债券通”机制做好准备；摩根士丹利资本国际宣布决定将中国 A 股纳入其新兴市场指数。基于 5% 的部分纳入因子，这些 A 股的初始权重很小，（例如）占摩根士丹利资本国际新兴市场指数的 0.73%。但按全部纳入计算，摩根士丹利资本国际预计 A 股将占指数约 18% 的权重。

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，并且我们寻求长期建仓持仓。

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。上半年中，我们增持了转向盈利状况更优、更具吸引力的投资。投资组合加大了在信息技术板块的超配幅度和在金融板块的低配幅度。

全球组合今年上半年回报为 15.8%，摩根士丹利资本国际全球发达国家指数的回报 11.0%，基金绩效优于基准。2017 年上半年度，本基金在信息技术、医疗、能源和通讯板块的有利部署，令板块配置实现了增值。此外，在医疗、通讯、工业和非核心消费板块的选股，造成了主要正面影响。板块方面，能源、信息技术和医疗板块带来的贡献最大。

全球经济周期向好，全球各个地区基本面普遍强劲。欧元区经济增长步伐继续加快，受内部需求增强、失业水平下降以及货币政策宽松推动，预计 GDP 增长率将达到 10 年高点，同时消费者和投资者信心高涨。英国脱欧给这个国家带来了挑战，因为币值走软引发的通胀在高负债水平的环境中降低了消费者的实际工资，同时不确定性也影响着英国投资。

从地区来看，美国仍是投资组合第一大超配国家。制造业活动强劲，出口订单增加，申请失业救济人数和失业率均接近历史低点。企业和消费者信心高涨，核心通胀依旧低迷。虽然美联储预计今年会加息 2-3 次，但金融环境具支撑力，银行资本充足并有可能增加股息和股票回购。

从板块角度看，信息技术仍是第一大超配板块，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。那些为企业客户通过外包非核心业务职能来提高生产率提供可能的软件和服务公司中仍有投资机会。板块部署保持稳定，年中变化不大。投资组合维持超配信息技术、非核心消费、金融和医疗板块股票。低配部署仍然集中在工业、能源、原材料以及公用事业和房地产板块。

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 16.77%，业绩比较基准增长率为 13.50%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

全球股市连续第 5 个季度走高，上半年累计涨幅为 9.3%。尽管地缘政治风险以及欧洲政治不确定性加剧，但风险资产依旧抗跌，因为全球经济数据稳健以及公司盈利较上年同期大幅增长，助长了投资者的乐观情绪。5 月份，中间派独立候选人埃马纽埃尔·马克龙以明显优势赢得法国总统大选，令市场参与人士松了一口气，因为市场普遍认为他的当选将有利于欧盟稳定。全球经济增长继续呈现上升迹象，有助于保持市场的乐观情绪。欧洲增长指标显示地区势头强劲。中国制造业和服务业数据均好于预期。与此同时，临近 6 月底时，由于未获得参议院共和党人足够支持，国会推迟对医改方案的表决，令美国实施财政刺激的希望消退。

大宗商品(-5.5%)6 月底收盘时回落，其中能源板块(-10.2%)再次领跌，归因于石油类商品

全线走低。农牧商品(+3.3%)是 4 个板块中唯一走高的板块。

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

本报告期内，本基金共进行一次利润分配，情况如下：

于 2017 年 1 月 11 日发布分红公告，每 10 份基金份额派发红利 0.730 元，本次分红总金额为 20,058,779.10 元，权益登记日为 2017 年 1 月 17 日。

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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：工银瑞信中国机会全球配置股票型证券投资基金
报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款		44,631,166.81	25,692,118.96

结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产		384,035,137.34	291,408,801.06
其中：股票投资		384,035,137.34	291,408,801.06
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		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息		9,441.21	3,713.24
应收股利		1,214,672.57	114,308.01
应收申购款		2,315,299.83	145,664.37
递延所得税资产		-	-
其他资产		1,138.91	-
资产总计		432,206,856.67	317,364,605.64
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
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		2,819,188.78	88,025.54
应付赎回款		4,901,137.02	1,043,418.84
应付管理人报酬		619,467.31	485,101.93
应付托管费		103,244.59	80,850.27
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		192,558.34	256,574.78
负债合计		8,635,596.04	1,953,971.36
所有者权益：			
实收基金		338,005,967.42	275,677,730.41
未分配利润		85,565,293.21	39,732,903.87
所有者权益合计		423,571,260.63	315,410,634.28
负债和所有者权益总计		432,206,856.67	317,364,605.64

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.253 元，基金份额总额 338,005,967.42 份。

6.2 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		57,995,331.81	2,267,924.54
1. 利息收入		100,812.96	54,259.19
其中：存款利息收入		100,812.96	54,259.19
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）		16,804,771.64	-780,624.64
其中：股票投资收益		14,076,655.16	-3,683,762.61
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		18,123.74	-
股利收益		2,709,992.74	2,903,137.97
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		41,549,044.92	2,830,146.06
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-522,079.58	155,907.26
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		62,781.87	8,236.67
减：二、费用		4,241,224.83	3,445,017.38
1. 管理人报酬		3,221,140.42	2,627,923.91
2. 托管费		536,856.73	437,987.34
3. 销售服务费	6.4.8.2.3	-	-
4. 交易费用		294,640.99	189,379.98
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		188,586.69	189,726.15
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		53,754,106.98	-1,177,092.84
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		53,754,106.98	-1,177,092.84

6.3 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 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)	275,677,730.41	39,732,903.87	315,410,634.28
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期净利润)	-	53,754,106.98	53,754,106.98
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)	62,328,237.01	12,137,061.46	74,465,298.47
其中：1.基金申购款	124,661,435.19	24,462,181.01	149,123,616.20
2.基金赎回款	-62,333,198.18	-12,325,119.55	-74,658,317.73
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)	-	-20,058,779.10	-20,058,779.10
五、期末所有者权益 (基金净值)	338,005,967.42	85,565,293.21	423,571,260.63
项目	上年度可比期间 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)	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)	-	-1,177,092.84	-1,177,092.84
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)	2,260,979.40	-815,063.23	1,445,916.17

其中：1.基金申购款	22,490,878.20	261,781.50	22,752,659.70
2.基金赎回款	-20,229,898.80	-1,076,844.73	-21,306,743.53
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）	277,754,367.74	22,109,173.23	299,863,540.97

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 郭特华	_____ 郝炜	_____ 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

6.4 报表附注

6.4.1 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》批准，由工银瑞信基金管理有限公司作为发起人依照《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》于2008年1月3日至2008年2月1日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所验证并出具安永华明（2008）验字第60438506_A01号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。《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》于2008年2月14日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币3,154,809,691.49元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币1,006,944.51元，以上实收基金（本息）合计为人民币3,155,816,636.00元，折合3,155,816,636.00份基金份额。本基金的基金管理人为工银瑞信基金管理有限公司，注册登记机构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）。

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%。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。

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 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会颁布的相关规定而编制。

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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年上半年的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.4.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.4.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.4.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.5 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]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》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) 自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 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。

6.4.6 关联方关系

6.4.6.1 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。

6.4.6.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

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。

6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.7.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016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	23,666,400.12	7.31%	17,645,650.41	7.95%
美国花旗银行 有限公司	16,271,893.15	5.03%	6,043,132.51	2.72%

6.4.7.1.5 权证交易

本基金本报告期末与关联方进行权证交易。

6.4.7.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017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	11,158.18	7.74%	-	-
美国花旗银行 有限公司	6,038.37	4.19%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 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	3,830.82	4.66%	-	-
美国花旗银行 有限公司	4,945.27	6.02%	-	-

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。

6.4.7.2 关联方报酬

6.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,221,140.42	2,627,923.91
其中：支付销售机构的客户维护费	768,343.58	610,533.28

注：1、基金管理费按前一估值日基金资产净值的 1.8% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 1.8\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一估值日基金资产净值

2、基金管理费每日计提，按月支付。

6.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	536,856.73	437,987.34

注：1、基金托管费按前一估值日基金资产净值的 0.3% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.3\% / \text{当年天数}$$

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。

6.4.7.2.3 销售服务费

无

6.4.7.3 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。

6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.7.4.1 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及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.7.4.2 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。

6.4.7.5 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 2017年1月1日至2017年6月 30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	35,525,792.97	95,103.14	13,955,486.78	54,222.28
美国花旗银行有限公司	9,105,373.84	5,709.82	7,452,096.66	8.01

注：1、本报告期末余额仅为活期存款，利息收入（本期）仅为活期存款利息收入；

2、上年度可比期间报告期末余额仅为活期存款，利息收入（上年度可比期间）仅为活期存款利息收入；

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

6.4.7.6 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。

6.4.7.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.8 期末（2017年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 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。

6.4.8.3 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。

6.4.9 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	384,035,137.34	88.85
	其中:普通股	326,858,421.77	75.63
	存托凭证	57,176,715.57	13.23
	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	44,631,166.81	10.33
8	其他各项资产	3,540,552.52	0.82
9	合计	432,206,856.67	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。

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	221,259,253.57	52.24
中国香港	117,685,237.01	27.78
英国	14,965,119.08	3.53
瑞士	8,709,173.14	2.06
荷兰	6,097,056.23	1.44
法国	5,818,246.31	1.37
澳大利亚	3,223,759.42	0.76
韩国	2,422,779.26	0.57

印度尼西亚	2,050,146.19	0.48
卢森堡	1,804,367.13	0.43
合计	384,035,137.34	90.67

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。

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	56,887,158.11	13.43
必需消费品 Consumer Staples	14,782,059.96	3.49
电信服务 Telecommunication Services	15,265,971.19	3.60
房地产 Real Estate	3,818,447.89	0.90
非必需消费品 Consumer Discretionary	43,928,717.17	10.37
工业 Industrials	14,982,528.53	3.54
公共事业 Utilities	4,562,508.76	1.08
金融 Financials	66,401,758.03	15.68
能源 Energy	2,435,476.91	0.57
信息技术 Information Technology	160,970,510.79	38.00
合计	384,035,137.34	90.67

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。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细

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	腾讯控股有限公司	KYG875721634	香港证券交易所	中国香港	155,890	37,775,773.62	8.92
2	Alibaba Group	阿里	US01609W1027	纽约	美国	27,658	26,399,919.45	6.23

	Holding Ltd	巴巴集团控股有限公司		证券交易所				
3	China Construction Bank Corp	建设银行	CNE1000002H1	香港证券交易所	中国香港	2,331,000	12,239,885.20	2.89
4	China Mobile Ltd	中国移动	HK0941009539	香港证券交易所	中国香港	99,325	7,142,179.86	1.69
5	Sunny Optical Technology Group Co Ltd	舜宇光学科技	KYG8586D1097	香港证券交易所	中国香港	100,660	6,115,537.90	1.44
6	China Unicom Hong Kong Ltd	中国联通	HK0000049939	香港证券交易所	中国香港	603,270	6,073,645.14	1.43
7	Ctrip.com International Ltd	-	US22943F1003	纳斯达克证券交易所	美国	16,030	5,848,853.02	1.38
8	Alphabet Inc	-	US02079K1079	纳斯达克证券交易所	美国	918	5,651,300.27	1.33
9	Microsoft Corp	微软	US5949181045	纳斯达克证券交易所	美国	11,073	5,170,641.35	1.22
10	NetEase Inc	网易公司	US64110W1027	纳斯达克证券交易所	美国	2,488	5,067,030.63	1.20

注：上表所用证券代码采用 ISIN 代码。

投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于公司网站的半年度报告正文。

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	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	CNE1000002H1	13,000,922.29	4.12
2	CHINA MOBILE LTD	HK0941009539	9,633,894.93	3.05
3	TENCENT HOLDINGS LTD	KYG875721634	4,849,633.87	1.54
4	NETEASE INC-ADR	US64110W1027	4,546,777.08	1.44
5	JPMORGAN CHASE & CO	US46625H1005	4,110,298.86	1.30
6	WELLS FARGO & CO	US9497461015	3,775,370.98	1.20
7	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	US7181721090	3,628,471.75	1.15
8	UNILEVER NV-CVA	NL0000009355	3,450,355.82	1.09
9	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	US1101221083	3,257,949.32	1.03
10	ALLERGAN PLC	IE00BY9D5467	3,250,747.37	1.03
11	EBAY INC	US2786421030	3,046,104.60	0.97
12	AMERICAN EXPRESS CO	US0258161092	2,867,765.75	0.91
13	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	US01609W1027	2,831,889.49	0.90
14	CELGENE CORP	US1510201049	2,818,143.78	0.89
15	MCKESSON CORP	US58155Q1031	2,813,673.29	0.89
16	HDFC BANK LTD-ADR	US40415F1012	2,784,591.79	0.88
17	TJX COMPANIES INC	US8725401090	2,732,134.32	0.87
18	ALLISON TRANSMISSION HOLDING	US01973R1014	2,727,708.07	0.86
19	WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	US9314271084	2,703,586.82	0.86
20	CIGNA CORP	US1255091092	2,659,068.06	0.84

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	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	HK0388045442	6,742,106.36	2.14
2	TENCENT HOLDINGS LTD	KYG875721634	6,320,104.18	2.00
3	CNOOC LTD	HK0883013259	4,354,204.12	1.38
4	PEPSICO INC	US7134481081	4,108,763.11	1.30
5	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	GB00B24CGK77	3,965,855.47	1.26
6	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	CNE1000002L3	3,926,939.93	1.25
7	CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	CNE1000009Q7	3,710,549.95	1.18
8	ACCENTURE PLC-CL A	IE00B4BNMY34	3,683,467.97	1.17
9	Medtronic PLC	IE00BTN1Y115	3,234,565.87	1.03
10	RECRUIT HOLDINGS CO LTD	JP3970300004	3,139,834.74	1.00
11	CHINA TELECOM CORP LTD-H	CNE1000002V2	3,085,236.52	0.98
12	CISCO SYSTEMS INC	US17275R1023	3,032,902.56	0.96
13	EXPERIAN PLC	GB00B19NLV48	3,008,811.40	0.95
14	LEGRAND SA	FRO010307819	2,740,158.50	0.87
15	COMCAST CORP-CLASS A	US20030N1019	2,725,178.51	0.86
16	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	US8835561023	2,703,492.44	0.86
17	HDFC BANK LIMITED	INE040A01026	2,698,043.55	0.86
18	AUTOZONE INC	US0533321024	2,691,277.23	0.85
19	AON PLC	GB00B5BTOK07	2,662,001.21	0.84
20	EQUIFAX INC	US2944291051	2,656,102.27	0.84

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	180,309,374.11
卖出收入（成交）总额	143,308,737.91

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前十名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

基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.11.3 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	1,214,672.57
4	应收利息	9,441.21
5	应收申购款	2,315,299.83
6	其他应收款	1,138.91
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,540,552.52

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
41,080	8,227.99	14,645,344.43	4.33%	323,360,622.99	95.67%

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	317,551.80	0.09%

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	10~50
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（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	275,677,730.41
本报告期基金总申购份额	124,661,435.19
减：本报告期基金总赎回份额	62,333,198.18
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	338,005,967.42

§ 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 2017 年 2 月 8 日发布《工银瑞信基金管理有限公司董事长变更公告》，经基金管理人第六十一次股东会和第四届董事会第二十六次会议审议通过，沈立强先生辞去公司董事长职务，董事长变更为尚军先生。

基金管理人于 2017 年 4 月 25 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》，郝炜先生自 2017 年 4 月 19 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

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	
Morgan Stanley	-	29,809,830.39	9.21%	17,585.53	12.20%	-
J. P. Morgan	-	45,744,506.59	14.13%	17,001.27	11.80%	-
Merrill Lynch	-	22,552,138.22	6.97%	16,354.58	11.35%	-
Credit Suisse	-	23,666,400.12	7.31%	11,158.18	7.74%	-
UBS Securities	-	27,517,223.63	8.50%	9,433.83	6.55%	-
Barclays Capital	-	36,805,755.31	11.37%	8,769.32	6.08%	-
Macquarie	-	5,386,388.99	1.66%	8,094.98	5.62%	-

Deutsche Bank	-	12,410,986.01	3.83%	7,432.84	5.16%	-
Citigroup	-	16,271,893.15	5.03%	6,038.37	4.19%	-
CLSA Ltd.	-	3,255,850.15	1.01%	5,270.01	3.66%	-
Sanford C Bernstein	-	22,120,526.69	6.83%	5,061.47	3.51%	-
Goldman Sachs	-	17,281,313.31	5.34%	5,027.54	3.49%	-
Bradesco	-	1,989,856.94	0.61%	3,780.72	2.62%	新增
Investment Technolog	-	11,401,452.83	3.52%	3,736.29	2.59%	-
OPCO	-	4,120,686.08	1.27%	3,597.53	2.50%	新增
ITAU Securities	-	1,763,591.61	0.54%	3,350.82	2.33%	-
RBC Capital Markets	-	4,539,294.05	1.40%	1,886.77	1.31%	-
Jefferies & Company	-	6,268,620.78	1.94%	1,825.14	1.27%	-
Societe Generale	-	5,029,933.03	1.55%	1,508.74	1.05%	-
TD Securities	-	2,110,469.18	0.65%	1,133.21	0.79%	-
Liquidnet, Inc.	-	6,860,848.45	2.12%	1,041.79	0.72%	-
Canaccord Genuity	-	2,318,324.13	0.72%	920.30	0.64%	-
Wells Fargo Securiti	-	1,901,511.36	0.59%	808.68	0.56%	-
R W Baird	-	2,755,062.98	0.85%	803.56	0.56%	-
SMBC	-	569,610.77	0.18%	683.46	0.47%	-
ISI Group	-	3,920,480.92	1.21%	668.31	0.46%	-
Instinet	-	2,000,576.30	0.62%	486.26	0.34%	-
BNP Paribas	-	198,766.27	0.06%	238.48	0.17%	-
Guggenheim	-	425,162.81	0.13%	192.42	0.13%	-
Needham & Co Inc	-	350,219.77	0.11%	145.99	0.10%	-
BTIG LLC	-	102,552.10	0.03%	34.12	0.02%	-
Cantor Fitzgerald	-	30,108.98	0.01%	23.87	0.02%	-
Pulse Trading	-	167,164.57	0.05%	13.79	0.01%	-
WSAccess	-	1,971,005.68	0.61%	6.14	0.00%	-
JMP Securities	-	-	-	-	-	-
Santander Investment	-	-	-	-	-	-

Lazard Capital	-	-	-	-	-	-
SIDOTI	-	-	-	-	-	-
Stephens Inc	-	-	-	-	-	-
ReMacro	-	-	-	-	-	-
Piper Jaffray Co	-	-	-	-	-	-
Exane	-	-	-	-	-	-
B. Riley & Co.	-	-	-	-	-	-
LEER	-	-	-	-	-	-
BOM	-	-	-	-	-	-
Mizuho Securities	-	-	-	-	-	-
Luminex	-	-	-	-	-	-
CREDIT AGRICOLE	-	-	-	-	-	-
WEDMOR	-	-	-	-	-	-
CIMB Securities	-	-	-	-	-	-
CAI/Chevroux	-	-	-	-	-	-
Mitsubishi UFJ	-	-	-	-	-	-
Keefe Bruyette	-	-	-	-	-	-
Enam Securities	-	-	-	-	-	-
Kim Eng Securities	-	-	-	-	-	-
Citigroup GM Inc	-	-	-	-	-	-
Execution Noble Ltd	-	-	-	-	-	-
NATIX	-	-	-	-	-	-
Green Street	-	-	-	-	-	-
Berenberg Bank	-	-	-	-	-	-
Evercore Group LLC	-	-	-	-	-	-
J&A	-	-	-	-	-	-
HSBC Securities	-	-	-	-	-	-
ING Financial	-	-	-	-	-	-
Nomura international	-	-	-	-	-	-
BOCI	-	-	-	-	-	-

SECURITIES LTD						
MKM Partners	-	-	-	-	-	-
Stifel Nicolaus & Co	-	-	-	-	-	-
Blair, W&C	-	-	-	-	-	-
Longbow Research	-	-	-	-	-	-
Craig-Hallum Capital	-	-	-	-	-	-
BMO Capital Markets	-	-	-	-	-	-
Hai Tong	-	-	-	-	-	-
Daiwa Securities	-	-	-	-	-	-
ICBC International	-	-	-	-	-	-
STRH	-	-	-	-	-	-
State Street	-	-	-	-	-	-
Pacific Crest	-	-	-	-	-	-
Weeden & Company	-	-	-	-	-	-
Standard Bank	-	-	-	-	-	-
BNY Brokerage	-	-	-	-	-	-
Standard Chartered B	-	-	-	-	-	-
Cowen & Co	-	-	-	-	-	-
CICC	-	-	-	-	-	-
IXIS Securities	-	-	-	-	-	-
CITIC Securities	-	-	-	-	-	-
Height Securities LL	-	-	-	-	-	-

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。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。