工银瑞信薪金货币市场基金

2015 第二季度 报告

2015年6月30日

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年七月二十一日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。
基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年7月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。
本报告中财务资料未经审计。
本报告期自2015年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	工银薪金货币
交易代码	000528
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年1月27日
报告期末基金份额总额	14,556,471,881.85份
投资目标	在控制风险并保持资产流动性的基础上,力争实现超过业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金将采取利率策略、信用策略、相对价值策略等积极投资策略,在严格控制风险的前提下,发掘和利用市场失衡提供的投资机会,实现组合增值。
业绩比较基准	中国人民银行公布的七天通知存款税后利率。
风险收益特征	本基金为货币市场基金,在所有证券投资基金中,是风险相对较低的基金产品。在一般情况下,其风险与预期收益均低于一般债券基金,也低于混合型基金与股票型基金。
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	工银薪金货币A / 工银薪金货币B
下属分级基金的交易代码	000528 / 000716
报告期末下属分级基金的份额总额	8,883,278,117.62份 / 5,673,193,764.23份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年4月1日 - 2015年6月30日)	
	工银薪金货币A	工银薪金货币B
1. 本期已实现收益	117,211,950.75	43,333,418.12
2.本期利润	117,211,950.75	43,333,418.12
3.期末基金资产净值	8,883,278,117.62	5,673,193,764.23

注:①本基金收益分配是按日结转份额。
②上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。
③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。
④所列数据截止到2015年6月30日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

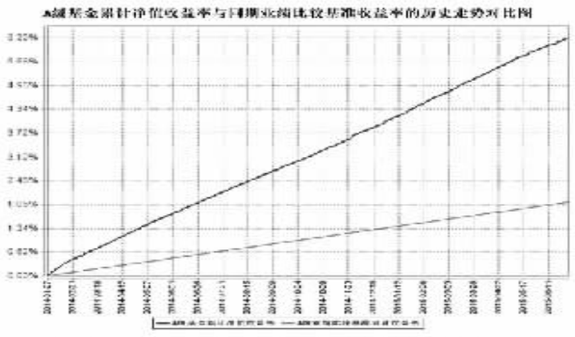
工银薪金货币A

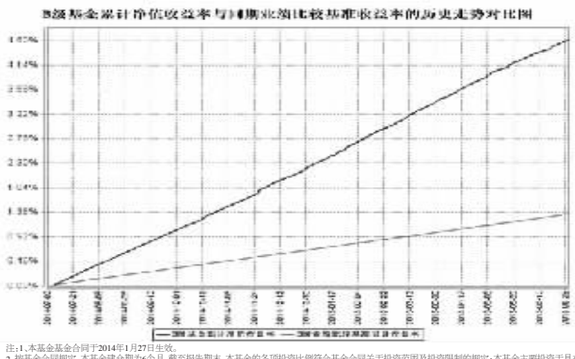
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.9738%	0.0048%	0.3366%	0.0000%	0.6372%	0.0048%

工银薪金货币B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	1.1001%	0.0048%	0.3366%	0.0000%	0.7635%	0.0048%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较





注:1.本基金基金合同于2014年1月27日生效。
2.按基金合同规定,本基金建仓期为6个月,截至报告期末,本基金的各项投资比例符合基金合同关于投资范围及投资限制的规定;本基金主要投资于具有良好流动性的工具,包括现金、通知存款、一年以内(含一年)的银行定期存款和大额存单、剩余期限(或回售期限)在397天以内(含397天)的债券、资产支持证券、中期票据、期限在一年以内(含一年)的债券回购、期限在一年以内(含一年)的中央银行票据、短期融资券、及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他固定收益类金融工具。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杜海涛	投资总监兼固定收益部总监,本基金的基金经理。	2014年1月27日	-	18	先后在宝盈基金管理有限公司担任基金经理助理,招商基金管理有限公司担任招商现金增值基金基金经理;2006年加入工银瑞信,现任投资总监兼固定收益部总监;2006年9月21日至2011年4月21日,担任工银货币市场基金基金经理;2010年8月16日至2012年1月10日,担任工银双利债券型基金基金经理;2007年5月11日至今,担任工银增强收益债券型基金基金经理;2011年8月10日至今,担任工银瑞信添颐债券型证券投资基金基金经理;2012年6月21日至今,担任工银纯债定期开放基金基金经理;2013年1月7日至今,担任工银货币基金基金经理;2013年8月14日至今,担任工银月月薪定期支付债券型基金基金经理;2013年10月31日至今,担任工银瑞信添福债券基金基金经理;2014年1月27日至今,担任工银薪金货币市场基金基金经理;2015年4月17日至今,担任工银总回报灵活配置混合型基金基金经理。
王明	本基金的基金经理	2014年1月27日	-	5	2010年加入工银瑞信,曾任研究部研究员,固定收益部研究员,现任固定收益部基金经理兼宏观货币市场研究员,2013年11月11日至今,担任工银货币市场基金基金经理;2014年1月27日至今,担任工银薪金货币市场基金基金经理;2015年4月17日至今,担任工银总回报灵活配置混合型基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定,依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。
4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
为了公平对待各类投资人,保护各类投资人利益,避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为,公司根据《证券投资基金法》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部规章,拟定了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》,对公司管理的各类资产的公平对待做了明确具体的规定,并规定对买卖股票、债券时候的价格和市场价格差距较大,可能存在操纵股价、利益输送等违法违规情况进行监控。本报告期,按照时间优先、价格优先的原则,本公司对满足限价条件且对同一证券有相同交易需求的基金等投资组合,均采用了系统中的公平交易模块进行操作,实现了公平交易;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。
4.3.2 异常交易行为的专项说明
本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内,本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况有3次,投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易,未导致不公平交易和利益输送。
4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析
二季度,货币政策效应继续加码,实体经济也在5月下旬出现企稳迹象,但季末股票市场的下跌为实体经济的后续回升蒙上了一层阴影。
本季度央行分别进行了两次降息和两次降准(定向降准 规作,期间银行间回购利率、同业存款利率和短期限债券收益率也随之继续下行。至季末,7天回购利率回落117bp至2.80%;AAA短融收益率回落140bp至3.43%。
二季度,本基金通过对客户需求和货币市场情况的判断,积极应对客户对于新股发行的流动性要求,合理安排组合现金流,基金组合继续维持相对较长的久期,并严格控制债券配置的信用等级。
4.4.2 报告期内基金的业绩表现
报告期内,工银薪金货币A净值收益率0.9738%,工银薪金货币B净值收益率1.1001%,业绩比较基准收益率为0.3366%。
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
展望三季度,当前股票市场的剧烈调整将会以财富效应的方式对经济基本面造成一定负面冲击,但参考历史经验,本次冲击的持续时间可能相对短暂,冲击过后,在基建和房地产的带动下,经济有望在三季度中后期或四季度初逐步企稳。在这一宏观背景下,我们认为三季度货币政策将继续维持宽松,货币市场利率中枢水平也将继续保持较低,同业存款和短融收益率也存在进一步下行空间。
本基金将继续保持较高的久期水平,严格控制低评级信用产品的持仓比例,努力做好组合内生现金流的安排,并进行适当的期限管理,把握好关键时点的存款投资机会,在保证组合安全性的前提下,获取稳定、合理的收益。
4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明
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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	8,036,923,350.34	47.94
	其中:债券	8,036,923,350.34	47.94
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,210,002,815.00	7.22
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	7,326,731,945.70	43.70
4	其他资产	190,429,718.87	1.14
5	合计	16,764,087,829.91	100.00

注:由于四舍五入的原因金额占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	10.23
	其中:买断式回购融资	0.00
序号	项目	金额 / 占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	2,195,595,862.80 / 15.08
	其中:买断式回购融资	- / -

注:报告期内债券融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产余额比例的简单平均值。
债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明
本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过基金资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	118
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	120
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	96

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明
本报告期内无投资组合平均剩余期限超过120天情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	24.09	15.08
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	19.72	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	14.85	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	24.27	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	30.93	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	2.42	-
合计		113.86	15.08

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,031,565,065.02	7.09
	其中:政策性金融债	811,600,737.22	5.58
4	企业债券	101,350,848.06	0.70
5	企业短期融资券	6,523,207,560.80	44.81
6	中期票据	380,799,876.46	2.62
7	其他	-	-
8	合计	8,036,923,350.34	55.21
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	351,832,629.96	2.42

注:上表中,债券的成本包括债券面值和折溢价。

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	130215	13国开15	2,000,000	199,901,739.54	1.37
2	150403	15农发03	1,900,000	189,837,374.62	1.30
3	140305	14进出05	1,500,000	151,450,093.14	1.04
4	1082160	10可钢MTN2	1,500,000	149,868,265.64	1.03
5	011599010	15陕能源SCP001	1,400,000	140,089,353.65	0.96
6	041553017	15兖州煤业CP001	1,200,000	120,211,339.74	0.83
7	011581001	15淮南矿SCP001	1,100,000	110,071,415.16	0.76
8	1182082	11中铁股MTN1	1,000,000	100,613,516.26	0.69
9	041451059	14本钢CP001	1,000,000	100,325,114.89	0.69
10	041453118	14酒钢CP002	1,000,000	100,254,018.02	0.69

注:上表中,债券的成本包括债券面值和折溢价。

5.6 影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	39
报告期内偏离度的最高值	0.4174%
报告期内偏离度的最低值	0.0173%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.2513%

5.7 报告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。
5.8 投资组合报告附注
5.8.1 本基金采用固定份额净值,基金账面份额净值始终保持为人民币1.00元。本基金估值采用摊余成本法,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内按实际利率法进行摊销,每日计提收益或损失。
5.8.2 本报告期内,本基金持有的剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本总计在每个交易日均未超过日基金资产净值20%。
5.8.3 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。
5.8.4 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	190,366,627.17
4	应收申购款	-
5	其他应收款	63,091.70
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	190,429,718.87

5.8.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分
无。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	工银薪金货币A	工银薪金货币B
报告期期初基金份额总额	10,433,133,978.99	1,973,219,756.95
报告期期间基金总申购份额	27,564,858,010.60	12,755,370,202.60
减:报告期期间基金总赎回份额	29,114,713,871.97	9,055,396,195.32
报告期期末基金份额总额	8,883,278,117.62	5,673,193,764.23

注:1.报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额;
2.报告期期间基金总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
本基金本报告期基金管理人未有运用固有资金投资本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息
无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录
1.中国证监会批准工银瑞信货币市场基金设立的文件;
2.《工银瑞信货币市场基金基金合同》;
3.《工银瑞信薪金货币市场基金托管协议》;
4.基金管理人业务资格批件和营业执照;
5.基金托管人业务资格批件和营业执照;
6.报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

9.2 存放地点
基金管理人或基金托管人住所。

9.3 查阅方式
投资者可在营业时间免费查阅,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。

工银瑞信中国机会全球配置股票型证券投资基金

2015 第二季度 报告

2015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
报告送出日期:二〇一五年七月二十一日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。
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2015年7月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。
本报告中财务资料未经审计。
本报告期自2015年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	工银全球股票(QDII)
交易代码	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
报告期末基金份额总额	314,011,188.62份
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
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

2.2 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	3900 Paradise Road, Suite 127, Las Vegas, Nevada 89109, USA
办公地址		280 Congress Street, Boston, MA, USA	399 Park Avenue, New York, NY10022, USA
邮政编码		2210	10022

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年4月1日 - 2015年6月30日)
1.本期已实现收益	35,978,799.30
2.本期利润	26,937,392.77
3.加权平均基金份额本期利润	0.0708
4.期末基金资产净值	363,536,230.97
5.期末基金份额净值	1.158

注:①上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所列数据截止到2015年6月30日。

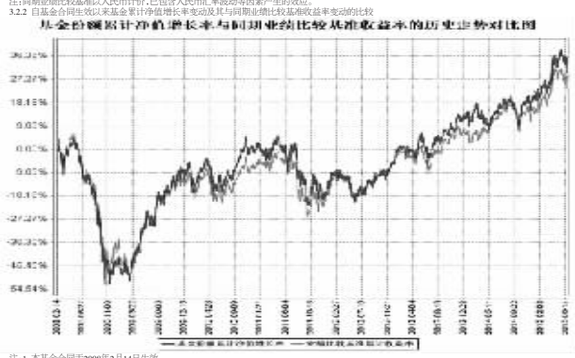
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	4.51%	0.96%	2.29%	0.89%	2.22%	0.07%

注:同期业绩比较基准以人民币计价,已包含人民币汇率波动等因素产生的收益。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



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 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
游源峰	本基金的基金经理	2009年12月25日	-	19	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;2009年12月25日至今,担任工银全球基金的基金经理;2010年5月25日至今,担任工银全球精选基金的基金经理;2012年4月26日至今担任工银基本面量化策略股票基金基金经理;2014年6月26日至今,担任工银绝对收益策略混合型发起式基金基金经理。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

姓名	在境外投资顾问所任职务	证券从业年限	说明
John A. Boselli, CFA	投资组合经理	27	威灵顿管理有限责任合伙制公司合伙人,工商管理硕士,在管理美国、国际和全球股票投资组合方面均有丰富的投资经验。曾在《路透》评选的"企业二十佳基金经理人"中排名第十一,此外,在《巴伦周刊》2011年的"超级人才"报道中,John A. Boselli先生亦被评为全球顶尖的股票分析师之一。
Bo Z. Meumier(依博女士), CFA	投资组合经理	19	威灵顿管理有限责任合伙制公司合伙人,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。

4.3 报告期内本基金运作遵规守信情况说明
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 公平交易专项说明
4.4.1 公平交易制度的执行情况
为了公平对待各类投资人,保护各类投资人利益,避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为,公司根据《证券投资基金法》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部规章,拟定了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》,对公司管理的各类资产的公平对待做了明确具体的规定,并规定对买卖股票、债券时候的价格和市场价格差距较大,可能存在操纵股价、利益输送等违法违规情况进行监控。本报告期,按照时间优先、价格优先的原则,本公司对满足限价条件且对同一证券有相同交易需求的基金等投资组合,均采用了系统中的公平交易模块进行操作,实现了公平交易;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。
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3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 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
未来一个季度,经济增长内生性动能仍弱,因此货币政策和财政政策将持续宽松。宏观需求面将持续改善。但决定市场系统性风险最关键的因素是国内资本市场在去杠杆过程中流动性危机的解决。近期,政府及监管机构不断推出救市政策,市场也正在经历疯狂的去杠杆阶段。
展望三季度,随着上市公司中报的公布,上市公司的投资价值将经历一个去伪存真的过程,我们将重点基于个股的安全边际以及其在各个新兴子行业竞争优势的可持续性,精选个股,度过危机。目前市场恐慌气氛蔓延,这为我们择机市场优质成长股带来了难得的机遇。子行业方面,我们看好政府重点扶持及行业趋势确定性向好的互联网娱乐、互联网医疗、车联网、自主可控大范围下的信息安全、半导体、基础铁硬件、军工信息化等等行业的投资机会。
4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明
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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,893,088,102.89	89.24
	其中:股票	2,893,088,102.89	89.24
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	277,622,083.51	8.56
7	其他资产	71,383,802.27	2.20
8	合计	3,242,093,988.67	100.00

注:由于四舍五入的原因金额占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	357,860.14	0.01
B	采矿业	1,369,332.01	0.05
C	制造业	2,101,279,214.76	70.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	541,350.76	0.02
E	建筑业	28,031.88	0.00
F	批发和零售业	210,810.60	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	59,751,626.07	1.99
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	727,890,990.35	24.29
J	金融业	174,300.00	0.01
K	房地产业	1,336,034.32	0.04
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	25,720.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	122,832.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,893,088,102.89	96.53

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

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002329	皇氏集团	6,332,722	365,778,022.72	12.20
2	300213	佳讯飞鸿	7,898,102	322,163,580.58	10.75
3	300059	东方财富	4,650,078	293,373,421.02	9.79
4	002312	三泰控股	6,603,648	247,372,654.08	8.25
5	300252	金信诺	5,424,158	215,176,347.86	7.18
6	002439	启明星辰	5,968,951	204,735,019.30	6.83
7	300131	英唐智控	7,186,842	204,537,523.32	6.82
8	002298	鑫龙电器	6,891,163	171,314,312.18	5.72
9	600179	黑化股份	9,878,081	163,383,459.74	5.45
10	300377	赢时胜	1,090,854	158,730,165.54	5.30

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002329	皇氏集团	365,778,022.72	12.20	重大事项
2	002298	鑫龙电器	171,314,312.18	5.72	重大事项
3	300377	赢时胜	158,730,165.54	5.30	重大事项

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分
无。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	451,545,540.20
报告期期间基金总申购份额	24,784,660.35
减:报告期期间基金总赎回份额	162,319,011.93
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	314,011,188.62

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
本基金本报告期基金管理人未有运用固有资金投资本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息
无。

§9 备查文件目录

9.1 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.基金管理人业务资格批件、营业执照;
5.基金托管人业务资格批件、营业执照;
6.报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

9.2 存放地点
基金管理人或基金托管人住所。

9.3 查阅方式
投资者可在营业时间免费查阅。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。

工银瑞信信息产业股票型证券投资基金

2015 第二季度 报告

2015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:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年七月二十一日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。
基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年7月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。
本报告中财务资料未经审计。
本报告期自2015年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	工银信息产业股票
交易代码	000263
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年11月11日
报告期末基金份额总额	990,496,893.50份
投资目标	分析信息产业的变化趋势和新技术的发展方向,前瞻性地把握信息产业内通过研发不断创造出新的市场需求,并通过选择具有领先优势、创新能力及成长潜力良好的上市公司进行投资,在控制投资风险的同时,力争通过主动管理实现超越业绩基准的收益。
投资策略	本基金的资产配置策略主要是通过对宏观经济周期运行规律的研究,基于定量与定性相结合的宏观及市场分析,确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例,规避系统性风险。
业绩比较基准	80%×中证TMT产业主题指数收益率+20%×上证国债指数收益率
风险收益特征	本基金是股票型基金,其预期收益及风险水平高于货币市场基金、债券型基金与混合型基金,属于风险水平较高的基金。本基金主要投资于信息产业股票,其风险高于全市场范围内投资的股票型基金。
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年4月1日 - 2015年6月30日)
1.本期已实现收益	1,399,134,355.85
2.本期利润	879,746,701.16
3.加权平均基金份额本期利润	0.7308
4.期末基金资产净值	2,997,133,075.32
5.期末基金份额净值	3.026

注:1.上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.所列数据截止到2015年6月30日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	27.04%	3.69%	13.24%	2.63%	13.80%	1.06%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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