工银瑞信中证高铁产业指数分级证券投资基金之高铁A端与高铁B端上市交易公告书

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
注册登记人：中国证券登记结算有限责任公司
上市地点：深圳证券交易所
上市时间：2015年8月5日
公告日期：2015年7月31日

一、重要声明与提示

工银瑞信中证高铁产业指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）之高铁A端份额与高铁B端份额上市交易公告书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号＜上市交易公告书的内容与格式＞》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，本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、误导性陈述或者重大遗漏，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。

本基金托管人中国银行股份有限公司保证本报告书中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、深圳证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。

凡本上市交易公告书未涉及的有关内容，请投资者详细查阅刊登在2015年6月12日《中国证券报》以及工银瑞信基金管理有限公司网站（www.icbccs.com.cn）上的《工银瑞信中证高铁产业指数分级证券投资基金招募说明书》。

二、基金概览

1、基金名称：工银瑞信中证高铁产业指数分级证券投资基金（基金份额场内简称：高铁母基）
2、基金类型：股票型
3、基金运作方式：契约型开放式
4、基金份额分级：

本基金的基金份额包括工银瑞信中证高铁产业指数分级证券投资基金之工银高铁份额（场内简称“高铁母基”，基金代码：164820）、工银瑞信中证高铁产业指数分级证券投资基金之工银高铁A份额（场内简称“高铁A端”，基金代码：150325）与工银瑞信中证高铁产业指数分级证券投资基金之工银高铁B份额（场内简称“高铁B端”，基金代码：150326）。其中，工银高铁A份额和工银高铁B份额的基金份额配比始终保持1：1的比例不变。

5、本基金的存续期为不定期。
6、高铁A端、高铁B端与高铁母基的资产合并运作。
7、工银瑞信中证高铁产业指数分级证券投资基金之基础份额的申购与赎回：投资者可通过场外或场内两种方式对本基金进行申购与赎回。场外申购和赎回业务的场所为基金管理人直销机构和其他场外销售机构。场内申购和赎回业务的场所为具有基金销售业务资格且符合深圳证券交易所风险控制要求的深圳证券交易所会员单位，具体销售网点和会员单位的名单由基金管理人在招募说明书或其他公告中列明。高铁A端份额与高铁B端份额只上市交易，不接受申购和赎回。
8、场内份额配对转换：场内份额配对转换是指本基金场内的基础份额与分级份额之间进行转换的行为，包括分拆与合并。分拆指场内的基础份额按照1：1的基金份额配比分拆成高铁A端和高铁B端的行为。合并指高铁A端和高铁B端按照1：1的基金份额配比合并成基础份额的行为。
9、基金份额折算：基金份额定期折算的频率为每年折算1次。基金份额不定期折算的条件是基础份额的基金份额净值高至1.5000元或以上，或高铁B端的基金份额参考净值低至0.2500元或以下。有关基金份额折算的约定，参见基金合同“二十二、基金份额折算”。定期折算基准日或不定期折算基准日的具体日期，详见基金管理人届时发布的公告。
10、基金份额总额：截至2015年7月29日，本基金的份额总额为241,362,144.49份；其中，基础份额为113,388,640.49份；高铁A端为63,986,752.00份；高铁B端为63,986,752.00份。
11、基金份额净值：截至2015年7月29日，基础份额的基金份额净值为1.0003元，高铁A端的基金份额净值为1.0012元，高铁B端的基金份额净值为0.9994元。
12、本次上市交易的基金份额简称及交易代码：份额简称：高铁A端，交易代码：150325；份额简称：高铁B端，交易代码：150326。
13、本次上市交易份额：高铁A端：63,986,752.00份；高铁B端：63,986,752.00份
14、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所
15、上市交易日期：2015年8月5日
16、基金管理人：工银瑞信基金管理有限公司
17、基金托管人：中国银行股份有限公司
18、本次上市交易的基金份额注册登记机构：中国证券登记结算有限责任公司

三、基金的募集与上市交易

（一）本基金上市前募集情况

1、本基金募集申请的注册机构和注册批复文号：中国证券监督管理委员会证监许可[2015]1105号。
2、基金运作方式：契约型开放式
3、基金存续期：不定期
4、发售日期：2015年6月15日至2015年7月17日
5、发售价格：1.00元人民币
6、发售方式：本基金通过场内、场外两种方式公开发售。
7、发售机构：

（1）场内发售机构

本基金的场内发售机构为具有基金销售业务资格、并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的、可通过深圳证券交易所交易系统办理本基金销售业务的会员单位，具体名单详见深圳证券交易所网站（www.szse.cn）。

（2）场外发售机构

1）直销机构：工银瑞信基金管理有限公司。

2）其他销售机构：

中国银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、北京农商银行股份有限公司、兴业银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、中国邮政储蓄银行股份有限公司、招商证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、天风证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、国都证券有限责任公司、国联证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、西南证券股份有限公司、新时代证券有限责任公司、华安证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、大通证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、德邦证券有限责任公司、齐鲁证券有限公司、长城证券股份有限公司、中航证券有限公司、中国国际金融有限公司、信达证券股份有限公司、广州证券股份有限公司、天相投资顾问有限公司、深圳众禄基金销售有限公司、北京展恒基金销售有限公司、上海天天基金销售有限公司、杭州数米基金销售有限公司、上海好买基金销售有限公司、和讯信息科技有限公司、上海天天基金销售有限公司、浙江同花顺基金销售有限公司、上海长量基金销售投资顾问有限公司、深圳市新兰德证券投资咨询有限公司、一路财富（北京）信息科技有限公司、海银基金销售有限公司、上海大智慧财富管理有限公司等。

基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并予以公告。

8、验资机构名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
9、认购资金总额及入账情况：本次认购总金额241,247,089.10元人民币，该资金已于2015年7月22日全额划入本基金在基金托管人中国银行股份有限公司开立的基金托管专户；认购资金的银行利息共115,167.03元，其中人民币115,055.30元折算为基金份额分别计入各基金份额持有人基金账户，另人民币111.64元归入基金资产。

本基金按照每份基金份额 1.00 元计算，募集期间募集资金及其利息结转的基金份额共计241,362,144.49份，其中场外认购的基金份额为113,388,640.49份；场内认购的基金份额为127,973,504.00份。

10、基金备案情况

本基金募集备案情况：根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等相关法律、法规的规定以及《工银瑞信中证高铁产业指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）的有关约定，本基金募集结果符合基金条件，工银瑞信基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）已向中国证监会办理完毕基金备案手续，并于2015年7月23日获中国证监会书面确认，本基金合同自该日起正式生效。基金合同生效之日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

11、基金合同生效日：2015年7月23日。
12、基金合同生效日的基金总份额：241,362,144.49份。

（二）本基金上市交易的主要内容

1、基金上市交易的核准机构和核准文号：深圳证券交易所深证上[2015]371号
2、上市交易日期：2015年8月5日
3、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所。投资者在具有基金销售业务资格的深圳证券交易所各会员单位证券营业部凭均可参与基金交易。
4、基础份额简称及代码：工银中证高铁产业指数分级，场内简称：高铁母基，基金代码：164820。
5、上市交易份额简称及代码：高铁A端，基金代码：150325；高铁B端，基金代码：150326。
6、本次上市交易份额：高铁A端 63,986,752.00份；高铁B端 63,986,752.00份。
7、基金资产净值的披露：开放式基金每日收市后对基金资产净值进行的估值

基金管理人每个开放日对基金资产估值。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人于每个工作日交易结束后将经过基金托管人复核的基金净值传给深交所，深交所于次日通过行情系统“市盈率Ⅰ”揭示。根据《基金法》，开放式基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此基金管理人对公布的基金净值负责。

8、本上市交易份额的流通规定：对于托管在场内的高铁母基份额，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，将其分拆为高铁A端份额和高铁B端份额即可上市流通；对于托管在场外的份额，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，将其跨系统转托管至深圳证券交易所场内后分拆为高铁A端份额和高铁B端份额即可上市流通。

9、本基金开通跨系统转托管业务日期：2015年8月5日，具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司的相关规定办理。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人情况

（一）本基金基金份额持有情况

截至2015年7月29日，工银瑞信中证高铁产业指数分级证券投资基金之高铁母基的持有人总户数为3,578户，其中场外持有人总户数为3,578户；高铁A端持有人总户数为237户，全部为场内持有人；高铁B端持有人总户数为237户，全部为场内持有人；高铁母基平均每户持有的场外基金份额为31,690.51份，高铁A端平均每户持有的场内基金份额为269,986.30份，高铁B端平均每户持有的场内基金份额为269,986.30份。

（二）场内基金份额持有人结构

高铁A端：场内机构投资者持有的基金份额44,007,067.00份，占比68.78%；场内个人投资者持有的基金份额19,979,685.00份，占比31.22%。

高铁B端：场内机构投资者持有的基金份额44,007,072.00份，占比68.78%；场内个人投资者持有的基金份额19,979,680.00份，占比31.22%。

（三）截至2015年7月29日，场内高铁A端基金份额前十名持有人情况

序号	持有人名称（全称）	持有高铁A端份额（份）	占场内基金总份额的比例（%）
1	深圳天风天成资产管理有限公司-天风天成天智5号资产管理计划	10,000,680.00	15.63%
2	招商证券股份有限公司	4,001,011.00	6.25%
3	中信证券股份有限公司	4,000,272.00	6.25%
4	申银万国证券股份有限公司	3,000,845.00	4.69%
5	光大证券股份有限公司	3,000,233.00	4.69%
6	兴业证券股份有限公司	3,000,204.00	4.69%
7	深圳平安大华汇通财富-平安银行-平安汇通-艾方多策略对冲增强8号特定客户资产管理计划	2,500,705.00	3.91%
8	北京千石创富-华泰证券-艾方多策略对冲增强1号资产管理计划	2,500,704.00	3.91%
9	北京千石创富-华泰证券-千石资本-艾方多策略对冲增强3号资产管理计划	2,500,704.00	3.91%
10	银河资本-中国银行-银河资本-艾方多策略对冲套利2号资产管理计划	2,500,704.00	3.91%
11	北京千石创富-华泰证券-千石资本-艾方多策略对冲增强6号资产管理计划	2,500,704.00	3.91%

截至2015年7月29日，场内高铁B端基金份额前十名持有人情况

序号	持有人名称（全称）	持有高铁B端份额（份）	占场内基金总份额的比例（%）
1	深圳天风天成资产管理有限公司-天风天成天智5号资产管理计划	10,000,681.00	15.63%
2	招商证券股份有限公司	4,001,011.00	6.25%
3	中信证券股份有限公司	4,000,272.00	6.25%
4	申银万国证券股份有限公司	3,000,846.00	4.69%
5	光大证券股份有限公司	3,000,233.00	4.69%
6	兴业证券股份有限公司	3,000,204.00	4.69%
7	北京千石创富-华泰证券-艾方多策略对冲增强1号资产管理计划	2,500,705.00	3.91%
8	北京千石创富-华泰证券-千石资本-艾方多策略对冲增强3号资产管理计划	2,500,705.00	3.91%
9	银河资本-中国银行-银河资本-艾方多策略对冲套利2号资产管理计划	2,500,705.00	3.91%
10	北京千石创富-华泰证券-千石资本-艾方多策略对冲增强6号资产管理计划	2,500,705.00	3.91%

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人

1、基本信息
名称：工银瑞信基金管理有限公司
住所：北京市西城区金融大街丙17号北京银行大厦
办公地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦A座
邮政编码：100033
法定代表人：郭特华
总经理：郭特华
成立日期：2005年6月21日
批准设立机关：中国证监会
批准设立文号：中国证监会证监基金字[2005]93号
中国银监会银监复[2005]105号
组织形式：有限责任公司
注册资本：贰亿元人民币
营业执照注册号：100000400011263
经营范围：基金募集，基金销售，资产管理，中国证监会许可的其他业务
信息披露联系人：朱碧艳
联系电话：400-811-9999
股权结构：中国工商银行股份有限公司占公司注册资本的80%；瑞士信贷银行股份有限公司占公司注册资本的20%。
存续期间：持续经营

2、经营概况

公司设立了三个专门机构：执行委员会、风险管理委员会和投资决策委员会。执行委员会负责公司日常经营管理活动中的重要决策，风险管理委员会负责公司整体运营风险的控制。投资决策委员会负责指导基金财产的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原则。

本公司下设十九个部门，分别是财务部、人力资源及行政部、权益投资部、固定收益部、专户投资部、中央交易室、研究部、战略发展部、产品开发部、机构产品部、战略客户部、营销管理部、养老金部、电子商务及客户服务部、法律合规部、指数投资部、风险管理部、信息科技部、运作部。

权益投资部在投资决策委员会授权范围内负责建立、完善权益投资部投资管理流程并负责权益投资组合日常管理工作。固定收益部在投资决策委员会授权范围内制定和完善固定收益投资管理制度和固定收益部工作流程，制定各固定收益类基金的投资方案并跟踪和评估投资方案的执行。专户投资部在投资决策委员会授权范围内负责建立、完善专户投资部投资管理制度和业务流程，并负责公司旗下除共同基金外其余资产组合的日常投资管理工作。指数投资部在投资决策委员会授权范围内负责建立、完善指数投资部投资管理制度和业务流程，并负责公司境内外指数投资管理工作。研究部负责对宏观经济、行业公司及市场的研究并提出决策意见。中央交易室负责投资指令的交易。战略发展部从事公司发展战略研究、品牌管理和媒体关系维护。产品开发部负责新产品创新与开发。机构产品部负责机构产品开发，组织机构产品审核，负责产品管理、销售支持与客户服务。战略客户部是公司战略客户业务的归口管理部门。营销管理部是公司银行渠道代销业务，以及除战略客户部负责客户外的机构客户直销业务的销售管理部门。风险管理部负责基金投资风险管理及数量研究、合规监控工作。养老金部是养老金业务的牵头部门，组织推动公司养老金业务发展。电子商务及客户服务部负责通过电子商务平台和网络营销渠道向客户提供基金金融服务和销售。法律合规部负责对公司管理和业务运作合规性进行全方位监察稽核，并向公司管理层和监管机关提供独立、客观、公正的法律监察稽核报告。运作部负责公司开放式基金的注册登记、清算、核算和会计工作。信息科技部负责公司的计算机设备维护、系统开发及网络运行和维护。人力资源及行政部负责公司人力资源招聘、薪酬、考核、培训及行政管理等工作。财务部负责公司财务管理及日常行政事务管理等工作。

截止到2015年6月30日，我公司共有员工430人，其中68%以上人员具有硕士以上学历。

3、本基金基金经理

刘伟琳女士，5年证券从业经验；中国人民大学金融工程博士；2010年加入工银瑞信，历任金融工程分析师、投资经理助理、投资经理，现任指数投资部基金经理。2014年10月17日至今，担任工银深证100指数分级基金基金经理；2014年10月17日至今，担任工银沪深300指数基金基金经理；2014年10月17日至今，担任工银中证500指数分级基金基金经理；2015年5月21日至今，担任工银瑞信中证传媒指数分级基金基金经理；2015年7月23日至今，担任工银中证高铁产业指数分级基金基金经理。

（二）基金托管人

1、基本情况
名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）
住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号
首次注册登记日期：1983年10月31日
注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾玖拾伍元整
法定代表人：田国立
基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号
托管业务部总经理：李爱华
托管部门信息披露联系人：王永民
客服电话：95566
传真：（010）66594942

2、基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年，现有员工110余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内，中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

3、基金托管业务经营情况

截至2015年3月31日，中国银行已托管328只证券投资基金，其中境内基金303只，QDII基金25只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

（三）基金验资机构

名　称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
住　所：北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城，东三办公楼16层
办公地址：北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城，东三办公楼16层
法定代表人：葛明
经办注册会计师：李慧明，王珊珊
联系电话：（010）58152145
传真：（010）58114645
联系人：王珊珊

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件。

七、基金财务状况

深圳证券交易所在工银瑞信中证高铁产业指数分级证券投资基金认购期间未收取任何费用，其他各基金销售机构根据本基金招募说明书设定的费率收取认购费。

本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

工银瑞信中证高铁产业指数分级证券投资基金截至2015年7月29日资产负债表如下：

单位：人民币元

资产	期末数	负债及持有人权益	期末数
资产：		负债：	
银行存款	41,265,783.83	应付证券清算款	21,055,135.79
清算备付金		应付赎回款	
交易保证金		应付赎回费	
应收证券清算款		应付管理人报酬	39,676.13
应收股利		应付托管费	7,935.23
应收利息	25,700.62	应付销售服务费	
应收申购款		应付交易费用	961.40
其他应收款	111,124.65	应付利息	
股票投资市值	1,132,011.00	应付收益	
其中：股票投资成本	1,062,404.71	未交税金	
债券投资市值		其他应付款	7,707.00
其中：债券投资成本		卖出回购证券款	
权证投资市值		短期借款	
其中：权证投资成本		其他负债	
配股权证		负债合计	21,111,415.55
买入返售证券	220,000,000.00	持有人权益：	241,423,204.55
待摊费用		实收基金	241,362,144.49
其它资产		未实现利得	
		未分配收益	61,060.06
		持有人权益合计	
资产合计：	262,534,620.10	负债与持有人权益总计：	262,534,620.10

八、基金投资组合

工银瑞信中证高铁产业指数分级证券投资基金的投资组合如下：

（一）截至 2015 年7 月29日，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		
	其中：股票	1,132,011.00	0.43
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	220,000,000.00	83.80
	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	41,265,783.83	15.72
7	其他各项资产	136,825.27	0.05
8	合计	262,534,620.10	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。

（二）按行业分类的股票投资组合

1、截至 2015 年7 月29日，指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	581,263.00	0.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	550,748.00	0.23
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
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	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,132,011.00	0.47

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。

2、积极投资按行业分类的股票投资组合

截至2015年7月29日，本基金未持有积极投资的股票。

（三）按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

1、指数投资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(人民币元)	占资产净值比例(%)
1	601186	中国铁建	12,200	203,496.00	0.08
2	601766	中国中车	9,400	150,870.00	0.06
3	601390	中国中铁	11,300	150,516.00	0.06
4	601800	中国交建	5,400	80,838.00	0.03
5	600820	隧道股份	5,600	78,120.00	0.03
6	000825	太钢不锈	8,100	41,553.00	0.02
7	600169	太原重工	6,000	40,140.00	0.02
8	600528	中铁二局	2,600	37,778.00	0.02
9	600495	晋西车轴	3,000	36,810.00	0.02
10	300001	特锐德	1,600	36,768.00	0.02

2、积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

截至2015年7月29日，本基金未持有积极投资的股票。

（四）截至2015年7月29日，按券种分类的债券投资组合

截至2015年7月29日，本基金未持有证券种分类的债券投资组合。

（五）截至 2015年7月29日，按公允价值占净值比例大小排序的前五名债券明细

截至2015年7月29日，本基金未持有债券投资组合。

（六）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

截至2015年7月29日，本基金未持有资产支持证券。

（七）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

截至2015年7月29日，本基金未持有权证。

（八）投资组合报告附注

1、声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查，无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

2、声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

3、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	应收股利	-
4	应收利息	25,700.62
5	应收申购款	-
6	其他应收款	111,124.65
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	136,825.27

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

截至2015年7月29日，本基金未持有债券。

5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

（1）期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

截至2015年7月29日，本基金持有的指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

（2）期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

截至2015年7月29日，本基金未持有积极投资股票。

九、重大事件揭示

本基金自合同生效至上市交易公告书公告前未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

十、基金管理人承诺

本基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、《基金合同》的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

（二）真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、深圳证券交易所的监督管理。

（三）在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后，将及时予以公开澄清。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就本基金上市交易后履行托管人职责做出如下承诺：

(一)严格遵守《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，设立专门的基金托管部，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员负责基金财产托管事宜。

(二)根据《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付等行为进行监督和核查。

(三)基金托管人发现基金管理人的行为违反《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，并在限期内，随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。

(四)基金托管人发现基金管理人有重大违规行为，将立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

十二、备查文件目录

下列文件存放在本基金管理人和托管人的办公场所，投资者可在办公时间免费查阅；也可按工本费购买本基金合同复制件或复印件，但应以基金合同正本为准。

（一）中国证监会准予工银瑞信中证高铁产业指数分级证券投资基金注册的批复；
（二）《工银瑞信中证高铁产业指数分级证券投资基金基金合同》；
（三）《工银瑞信中证高铁产业指数分级证券投资基金招募说明书》；
（四）《工银瑞信中证高铁产业指数分级证券投资基金托管协议》；
（五）法律意见书；
（六）基金管理人业务资格批件、营业执照；
（七）基金托管人业务资格批件、营业执照；
（八）中国证监会要求的其他文件。

附件：基金合同内容摘要

一、基金合同当事人简介

（一）基金管理人

名称：工银瑞信基金管理有限公司
住所：北京市西城区金融大街丙17号北京银行大厦
法定代表人：郭特华
成立日期：2005年6月21日
批准设立机关：中国证券监督管理委员会
批准设立文号：中国证监会证监基金字2005【93】号
经营范围：基金募集；基金销售；资产管理及中国证监会许可的其他业务
组织形式：有限责任公司
注册资本：贰亿元人民币
存续期间：持续经营

（二）基金托管人

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）
住所：北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码：100818
法定代表人：田国立
成立时间：1983年10月31日
基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号
组织形式：股份有限公司
注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整
存续期间：持续经营

（三）基金份额持有人

基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对基金合同的承认和接受，基金投资者自依据基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同当事人。基金份额持有人作为当事人并不以在基金合同上书面签章或签字为必要条件。

工银高铁份额、工银高铁A份额和工银高铁B份额的基金份额持有人持有的每一份基金份额按基金合同约定仅在其基台份额类别内拥有同等的权益。

二、基金合同当事人的权利及义务

（一）基金管理人的权利及义务

1、基金管理人的权利

（1）依法募集资金；
（2）自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
（3）依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
（4）销售基金份额；
（5）按照规定召集基金份额持有人大会；
（6）依据《基金合同》及有关法律规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
（7）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
（8）选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
（9）担任或委托其他符合条件的机构担任基金注册登记机构办理基金注册登记业务并获得《基金合同》规定的费用；
（10）依据《基金合同》及有关法律规定决定基金收益的分配方案；
（11）在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购、赎回或转换申请；
（12）依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
（13）以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
（14）选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券、期货经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；
（15）在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换等的业务规则；
（16）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、基金管理人的义务

（1）依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
（2）办理基金备案手续；
（3）自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；
（4）配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；
（5）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；
（6）除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；
（7）依法接受基金托管人的监督；

（下转B91版）

关于开通工银瑞信中证高铁产业指数分级证券投资基金转托管及份额配对转换业务的公告

根据《工银瑞信中证高铁产业指数分级证券投资基金》的约定，工银瑞信基金管理有限公司（以下简称“本公司”）决定自2015年8月5日起，开通工银瑞信中证高铁产业指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）的转托管业务和份额配对转换业务。具体事项公告如下：

一、转托管业务

为保证基金份额持有人的利益，本公司向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中登”）提出申请，自2015年8月5日起开通本基金（基金简称“工银中证高铁产业指数分级”，基金代码：164820，其中场内简称“高铁母基”）跨系统转托管和系统内转托管业务。

投资人自2015年8月5日起可以通过认购/申购本基金的销售机构办理本基金工银高铁份额跨系统转托管业务。跨系统转托管的具体业务按照深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关规定办理。

二、份额配对转换业务

（一）份额配对转换是指本基金的工银高铁份额与工银高铁A份额（场内简称“高铁A端”，基金代码：150325）、工银高铁B份额（场内简称“高铁B端”，基金代码：150326）之间的配对转换，包括以下两种方式：

1、分拆。基金份额持有人将其持有的每2份工银高铁份额的场内份额申请转换成1份工银高铁A份额与1份工银高铁B份额的行为。

2、合并。基金份额持有人将其持有的每1份工银高铁A份额与1份工银高铁B份额进行配对申请转换成2份工银高铁份额的场内份额的行为。

3、场外的工银高铁份额不进行份额配对转换。场外的工银高铁份额通过办理跨系统转托管业务转至场内后，可按照场内份额配对转换规则进行操作。但深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司、基金合同等另有规定的除外。

（二）业务办理机构

投资者可以通过依据中登有关规定获得业务办理资格的深圳证券交易所会员单位办理份额配对转换业务。截至2015年4月22日，具有配对转换业务资格的深圳证券交易所会员单位（证券公司）为：国泰君安证券、中信建投证券、国信证券、招商证券、广发证券、中信证券、银河证券、海通证券、华泰联合证券、申银万国证券、兴业证券、长江证券、安信证券、西南证券、中信证券（浙江）、湘财证券、万联证券、民生证券、国元证券、渤海证券、华泰证券、山西证券、中信万通证券、东兴证券、东吴证券、信达证券、东方证券、方正证券、长城证券、光大证券、广州证券、东北证券、南京证券、上海证券、新时代、大同证券、国联证券、浙商证券、平安证券、华安证券、国海证券、财富证券、东莞证券、中原证券、国都证券、东海证券、中银国际证券、恒泰证券、国盛证券、华西证券、宏源证券、齐鲁证券、世纪证券、第一创业、金元证券、中航证券、华林证券、德邦证券、西部证券、广发华福证券、华龙证券、中金公司、财通证券、上海华信证券、华鑫证券、瑞银证券、中投证券、中山证券、红塔证券、西藏同信证券、日信证券、联讯证券、江海证券、天源证券、银泰证券、国金证券、民族证券、华宝证券、厦门证券、爱建证券、英大证券、华融证券、财达证券、天风证券、中天证券、大通证券、万和证券、华创证券、首创证券、国开证券、宏信证券、太平洋证券、开源证券、诚浩证券、川财证券有限责任公司（排名不分先后）。

中登将对具备基金分拆转换及合并转换业务资格的证券公司名单进行更新，投资者可登陆中登网站（www.chinaclear.cn）查询最新名单，本公司对该名单的更新不再另行公告。

（三）业务办理时间

深圳证券交易所交易日交易时间内（上午9：30-11：30和下午13：00-15：00）可办理份额配对转换业务（基金管理人公告暂停份额配对转换业务时除外）。

若深圳证券交易所交易时间更改或实际情况需要，基金管理人可对份额配对转换业务的办理时间进行调整并公告。

（四）份额配对转换的原则

1、份额配对转换以份额申请。
2、申请进行“分拆”的工银高铁份额的场内份额必须是2的整数倍。
3、申请进行“合并”的工银高铁A份额与工银高铁B份额必须同时配对申请，且工银高铁A份额和工银高铁B份额必须为正整数且两者的比例为1:1。
4、工银高铁份额的场外份额如需申请进行“分拆”，须跨系统转托管为工银高铁份额的场内份额后方可进行。
5、正常情况下，中登深圳分公司在T日收市后对投资者T日交易时间内提交的份额配对转换业务申请进行有效性确认，自T+1日起（包括该日），投资者可查询份额配对转换的成交情况。
6、份额配对转换应遵循届时相关机构发布的相关业务规则。

基金管理人、基金注册登记机构或深圳证券交易所可视情况对上述规定作出调整，并在正式实施前在指定媒介