工银瑞信大盘蓝筹混合型证券投资基金

2015 第三季度 报告

2015年9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：二〇一五年十月二十六日

§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10月22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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	工银大盘蓝筹混合
交易代码	481008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年8月4日
报告期末基金份额总额	239,366,819.40份
投资目标	通过投资大盘蓝筹型股票，追求基金资产长期稳定的增值和收益，在合理风险限度内，力争持续实现超越业绩基准的超额收益。
投资策略	本基金的股票资产主要投资于大盘蓝筹型股票，投资于大盘蓝筹股票的资产占股票投资资产的比例不低于80%。蓝筹股票是指那些经营稳健，财务状况良好，公司在所属行业处于领导地位的公司股票。蓝筹股票一般具有较好的分红记录，在投资者心中形象良好。本基金建立系统化、纪律化的投资流程，遵循初选投资对象、公司治理评估、行业地位与竞争优势评估、公司财务分析、投资吸引力评估、组合构建及优化等过程，选择具有投资价值的大盘蓝筹股票，构造投资组合。
业绩比较基准	80%×沪深300指数收益率+20%×上证国债指数收益率。
风险收益特征	本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平高于债券型基金，低于股票型基金，属于风险水平中高的基金。本基金主要投资于大盘蓝筹股票，在混合型基金中属于较高风险水平的投资产品。
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

§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7月1日 - 2015年9月30日）
1.本期已实现收益	-17,136,122.79
2.本期利润	-107,496,223.97
3.加权平均基金份额本期利润	-0.4199
4.期末基金资产净值	256,654,653.32
5.期末基金份额净值	1.072

注：（1）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。

（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）所列数据截止到2015年9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	-27.81%	3.49%	-22.79%	2.67%	-5.02%	0.82%

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、本基金基金合同生效日为2008年8月4日。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效起6个月内为建仓期。截至本报告期末，本基金的各项投资符合基金合同关于投资范围、投资禁止行为与限制的规定；股票资产占基金资产净值的比例为60%-95%，债券及现金资产占基金资产净值的比例为5%-40%。

3.3 其他指标

无。

§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		
胡文彪	本基金的基金经理	2011年3月16日	-	14	先后在国泰君安证券股份有限公司担任研究员，华林证券有限公司担任研究员；2006年加入工银瑞信基金管理有限公司，历任产品开发部高级经理和权益投资部高级经理；2009年3月5日至2011年2月10日，担任工银沪深300基金基金经理；2009年8月26日至2011年2月10日，担任工银上证央企ETF基金基金经理；2010年2月10日至2011年3月16日，担任工银瑞信中小盘成长混合型证券投资基金基金经理；2011年2月10日至2013年5月18日，担任工银双利债券基金基金经理；2011年3月16日至今，担任工银瑞信大盘蓝筹混合型证券投资基金基金经理；2012年11月20日至今，担任工银瑞信中小盘成长混合型证券投资基金基金经理；2013年11月12日至今，担任工银瑞信精选平衡基金基金经理；2015年4月28日至今，担任工银瑞信养老产业股票型基金基金经理；2015年6月25日至今，担任工银聚焦30股票型基金基金经理。
王筱岑	权益投资部副总监；本基金的基金经理	2012年12月5日	-	18	曾任中国银行全球金融市场部首席交易员。2005年加入工银瑞信，曾任工银核心价值混合基金、工银精选平衡混合型基金、工银稳健成长混合基金经理，专户投资组合、产品经理，现任权益投资部副总监。2011年10月11日至今，担任工银瑞信中小盘成长混合型证券投资基金基金经理；2012年12月5日至今，担任工银瑞信大盘蓝筹混合型证券投资基金基金经理；2014年6月26日至今，担任工银瑞信信息产业混合型基金基金经理；2014年12月30日至今，担任工银瑞信消费服务行业混合型证券投资基金基金经理；2015年8月6日至今，担任工银瑞信新蓝筹股票型基金基金经理。

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，并规定对实时投资、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 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

冷水团对公司生产经营具有重大影响，应在定期报告中予以披露。但公司从2012年半年度报告开始，在定期报告中仅披露獐子岛南部深水区受控于北黄海冷水团，虾夷扇贝适温生长时间短，导致扇贝生长缓慢等，未完整披露冷水团可能导致公司底播养殖基本没有产出的重大风险。

2、未及时、完整披露公司生产经营重大变化经查明，公司2011年新增确权海域30.5万亩，当年底播面积为127.40万亩，其中45米以上深海底播区域为68万亩，占比53.38%。与浅海底播区域相比，深海底播区域情况复杂，公司生产养殖风险增加。对于前述生产环境发生重大变化事项，公司仅在定期报告中披露底播海域因海水深度的差异，导致虾夷扇贝规格小于预期，未以临时报告及时披露，且未完整披露相关风险。

处分类型：

根据深交所《股票上市规则（2012年修订）》第17.2条、第17.3条、第17.4条和第19.3条的规定，经深交所纪律处分委员会审议通过，作出如下处分决定：对公司给予通报批评的处分。

5.11.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	300,230.05
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	10,360.64
5	应收申购款	63,191.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	373,782.39

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	002475	立讯精密	8,413,177.50	3.28	非公开发行

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	261,737,178.71
报告期期间基金总申购份额	124,709,078.07
减：报告期期间基金总赎回份额	147,079,437.38
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	239,366,819.40

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

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	0.00
报告期期间买入/申购总份额	3,961,172.74
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	3,961,172.74
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	1.65

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额；

报告期期间基金总赎回份额含转换出份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额（份）	交易金额（元）	适用费率
1	申购	2015年7月13日	3,961,172.74	5,000,000.00	0.00%
合计			3,961,172.74	5,000,000.00	

注：适用费率为0，收取固定费用1000元。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

根据基金管理人2015年8月5日发布的《工银瑞信基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金更名的公告》，自2015年8月5日起，将旗下10只基金产品更名，其中原"工银瑞信大盘蓝筹股票型证券投资基金"更名为"工银瑞信大盘蓝筹混合型证券投资基金"，该基金简称同时更名为"工银大盘蓝筹混合"，风险收益特征变更为风险水平中高的混合型基金，其预期收益及风险水平高于债券型基金，低于股票型基金。

§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大盘蓝筹混合型证券投资基金设立的文件；

2.《工银瑞信大盘蓝筹混合型证券投资基金基金合同》；

3.《工银瑞信大盘蓝筹混合型证券投资基金托管协议》；

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，可在合理时间内取得上述文件的复印件。

工银瑞信标普全球自然资源指数证券投资基金（LOF）

2015 第三季度 报告

2015年9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：二〇一五年十月二十六日

§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10月22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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	工银标普全球自然资源指数（QDII-LOF）
场内简称	工银资源
交易代码	164815
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年5月28日
报告期末基金份额总额	24,544,851.50份
投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。
投资策略	本基金采取完全复制策略，跟踪标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整，力争使得基金的日均跟踪偏离度不超过0.5%，年化跟踪误差小于4%。
业绩比较基准	95%×人民币计价的标普全球自然资源税后总收益指数收益率+5%×人民币活期存款收益率（税后）。
风险收益特征	本基金作为投资于全球自然资源和大宗商品产业，被动指数化管理的股票型指数基金，属于风险水平较高的基金品种，其预期收益及风险水平高于货币市场基金、债券型基金及混合型基金。根据《工银瑞信基金管理公司基金风险等级评价体系》，本基金的风险评级为中高风险。
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	Credit Suisse AG	Brown Brothers Harriman & Co.
	中文	瑞士信贷银行股份有限公司	布朗兄弟哈里曼银行
注册地址		Paradeplatz 8, 8001 Zurich, Switzerland	140 Broadway New York
办公地址		Paradeplatz 8, 8001 Zurich, Switzerland	140 Broadway New York
邮政编码		8001	NY 10005

§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7月1日 - 2015年9月30日）
1.本期已实现收益	-1,732,111.61
2.本期利润	-4,437,570.43
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1536
4.期末基金资产净值	17,151,330.51
5.期末基金份额净值	0.699

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9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	-17.67%	1.40%	-18.59%	1.40%	0.92%	0.00%

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、本基金基金合同于2013年5月28日生效。

2、按基金合同规定，本基金建仓期为六个月，截至本报告期末，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：本基金投资于股票以及以标普全球自然资源指数为标的指数的指数型公募基金（包括ETF）占基金资产的比例为90%-95%，投资于标的指数成分股票、备选成分股票的资产占基金资产的比例不低于80%（但因法规限制原因，导致本基金不能投资相关股票，而致使本基金不能达到上述比例的情形除外）；现金、债券资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为5%-10%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值5%；其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

§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		
赵翱	本基金的基金经理	2013年5月28日	-	7	2008年加入工银瑞信，曾任风险管理部金融工程分析师，2011年10月18日至今担任工银上证央企ETF基金基金经理；2012年10月9日至今担任工银深证红利ETF基金基金经理；2012年10月9日至今担任工银深证红利ETF连接基金基金经理。2013年5月28日至今担任工银标普全球自然资源指数基金基金经理，2015年7月9日至今担任工银瑞信中证环保产业指数分级基金基金经理，2015年7月9日至今担任工银瑞信中证新能源指数分级基金基金经理。

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
Ulrich Roth	投资组合经理	27	Roth先生于1999年加入瑞信资产管理部，并在实方执行领域担任过数个管理职位。2006年1月至2007年10月，Ulrich Roth先生曾担任私人银行部基金执行部主管。他于2003年被任命为瑞信资产管理部证券执行部主管，他在瑞信资产管理部的首个职位是法方交易员，并于2000至2002年期间担任固定收益产品部主管。

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，并规定对实时投资、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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内，基金净值增长相对于业绩比较基准的偏离主要来自于申购赎回等因素的影响。

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-17.67%，业绩比较基准收益率为-18.59%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金为指数型基金，基金管理人将继续按照基金合同的要求，坚持指数化投资策略，通过运用定量分析等技术，分析和应对导致基金跟踪误差的因素，继续努力将基金的跟踪误差控制在较低水平。

4.7 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金在报告期内出现连续六个天规模低于5000万，根据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，我司已向证监会递交解决方案，并说明有关情况。

§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（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	15,540,445.25	89.33
	其中：普通股	14,345,383.57	82.46
	优先股	-	-
	存托凭证	912,858.38	5.25
	房地产信托凭证	282,203.30	1.62
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	1,718,857.53	9.88
8	其他资产	136,670.05	0.79
9	合计	17,395,972.83	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。

5.2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家（地区）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
美国	6,105,756.10	35.60
英国	2,614,826.20	15.25
澳大利亚	1,612,384.11	9.40
加拿大	994,634.13	5.80
日本	700,645.87	4.09
瑞士	697,081.66	4.06
法国	565,653.07	3.30
挪威	334,286.19	1.95
韩国	314,654.67	1.83
芬兰	289,554.04	1.69
德国	283,957.01	1.66
意大利	223,453.12	1.30
中国香港	166,616.04	0.97
爱尔兰	160,688.35	0.94
新加坡	142,647.94	0.83
荷兰	140,729.84	0.82
奥地利	79,361.00	0.46
西班牙	61,051.48	0.36
以色列	52,464.43	0.31
合计	15,540,445.25	90.61

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。

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

5.3.1 报告期末按投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
材料 Materials	9,116,812.19	53.16
能源 Energy	5,496,660.68	32.05
必需消费品 Consumer Staples	644,769.08	3.76
金融 Financials	282,203.30	1.65
合计	15,540,445.25	90.61

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。

5.3.2 报告期末积极投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

无。

5.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票及存托凭证投资明细

5.4.1 报告期末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及存托凭证投资明细

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（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	EXXON MOBIL CORP	埃克森美孚石油	US30231G1022	纽约证券交易所	美国	1,841	870,724.25	5.08
2	BHP BILLITON LTD	必和必拓有限公司	AU000000BHP4	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	7,787	771,545.32	4.50
3	SYNGENTA AG-REG	先正达股份公司	CH0011037469	瑞士证券交易所	瑞士	343	697,081.66	4.06
4	TOTAL SA	道达尔	FR0000120271	巴黎证券交易所	法国	1,965	565,653.07	3.30
5	BP PLC	BP公司	GB0007980591	伦敦证券交易所	英国	15,037	484,210.56	2.82
6	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	荷兰皇家壳牌	GB00B03MLX29	伦敦证券交易所	英国	3,220	482,429.07	2.81
7	MONSANTO CO	孟山都	US61166W1018	纽约证券交易所	美国	884	479,900.03	2.80
8	CHEVRON CORP	雪佛龙德士古	US1667641005	纽约证券交易所	美国	828	415,473.30	2.42
9	POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	萨斯喀彻温钾肥股份有限公司	CA73755L1076	纽约证券交易所	美国	3,073	401,717.05	2.34
10	NIPPON STEEL & SUMITOMO META	新日铁住金	JP3381000003	东京证券交易所	日本	2,913	335,064.17	1.95

5.4.2 报告期末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及存托凭证投资明细

无。

5.5 报告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。

5.6 报告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。

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 报告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。

5.9 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基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

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。

5.10.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（人民币元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	34,904.10
4	应收利息	286.58
5	应收申购款	50,713.44
6	其他应收款	50,765.93
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	136,670.05

5.10.4 报告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。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.10.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

5.10.6 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	45,501,549.04
报告期期间基金总申购份额	4,584,368.85
减：报告期期间基金总赎回份额	25,541,066.39
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	24,544,851.50

§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标普全球自然资源指数证券投资基金设立的文件；

2、《工银瑞信标普全球自然资源指数证券投资基金合同》；

3、《工银瑞信标普全球自然资源指数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处。

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，可在合理时间内取得上述文件的复印件。

工银瑞信纯债债券型证券投资基金

2015 第三季度 报告

2015年9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：兴业银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一五年十月二十六日

§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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年10月22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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	工银纯债债券	
交易代码	000402	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014年5月16日	
报告期末基金份额总额	7,373,919,118.65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	本产品的主要投资策略包括：久期策略、类属配置策略、期限结构策略及证券选择策略，在严格控制风险的前提下，发掘和利用市场失衡提供的投机会，实现组合资产的增值。	
业绩比较基准	中债综合（财富）指数。	
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和风险水平低于混合型基金、股票型基金，高于货币市场基金。	
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	工银纯债债券A	工银纯债债券B
下属分级基金的交易代码	000402	000403
报告期末下属分级基金的份额总额	3,195,117,417.89份	4,178,801,700.76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7月1日 - 2015年9月30日）	
	工银纯债债券A	工银纯债债券B
1.本期已实现收益	28,094,582.39	42,534,059.30
2.本期利润	59,239,500.04	90,964,884.89
3.加权平均基金份额本期利润	0.0319	0.0310
4.期末基金资产净值	3,819,136,336.50	4,967,413,964.72
5.期末基金份额净值	1.195	1.189

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9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

工银纯债债券A

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	3.11%	0.11%	2.10%	0.06%	1.01%	0.05%

工银纯债债券B

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	3.03%	0.11%	2.10%	0.06%	0.93%	0.05%

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、本基金基金合同于2014年5月16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：本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国债、地方政府债、金融债、央行票据、中期票据、次级债、企业债、公司债、可分离交易可转债的纯债部分、资产支持证券、短期融资券、银行存款、债券回购等固定收益类金融工具，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具；本基金不直接在二级市场买入股票、权证等权益类资产，也不参与一级市场新股申购和增发新股，可转债仅投资二级市场可分离交易可转债的纯债部分；本基金债券资产占基金资产的比例不低于80%，现金及到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于5%。

3.3 其他指标

无。

§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		
昌明	本基金的基金经理	2014年5月16日	-	12	先后在国家外汇管理局储备管理司担任投资经理，中国人民银行美洲代表处交易室担任副代表、交易员、国家外汇管理局中央外汇业务中心担任投资经理；2013年加入工银瑞信，现任固定收益部基金经理；2014年5月16日至今，担任工银纯债债券基金基金经理；2014年8月12日至今，担任工银目标收益一年定期开放债券型基金基金经理。
陆欣	固定收益部副总监；本基金的基金经理	2014年6月18日	-	9	先后在中国银行担任债券交易员，在光大保德信基金管理公司担任固定收益副总监兼基金经理，2014年加入工银瑞信，现任固定收益部副总监，2014年6月18日至今，担任工银纯债债券型基金基金经理，2015年4月17日至今，担任工银瑞信纯债定期开放债券型基金基金经理。

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