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15号－上市交易公告书的内容与格式（＞3）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.icbocs.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配对：1份基金份额配比总分拆成高铁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15.0000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、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、齐鲁证券有限公司、广州证券股份有限公司、大和证券有限公司、中信证券（浙江）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、深圳众禄基金销售有限公司、上海大智慧财富管理有限公司、浙江金观诚财富管理有限公司、和讯信息科技有限公司、上海利得基金销售有限公司、浙江金观诚财富管理有限公司、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、深圳市前海排排网基金销售有限公司、上海天天基金销售有限公司、上海好买基金销售有限公司、杭州数米基金销售有限公司、上海陆金所资产管理有限公司、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、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115,055.39元折算为基础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备案条件，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.未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	中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－文方多策略对冲增强6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－文方多策略对冲增强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－文方多策略对冲增强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－文方多策略对冲套利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－文方多策略对冲增强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	中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－文方多策略对冲增强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－文方多策略对冲增强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－文方多策略对冲套利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－文方多策略对冲增强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：朱哲艳
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资产的运作、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业务服务和销售。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、公正的法律意见。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：人民币贰千柒佰玖拾壹亿肆千柒佰贰拾伍元整
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，且具有财务工作、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、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）期末指数投资的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：人民币贰千柒佰玖拾壹亿肆千柒佰贰拾伍元整
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：
（九）本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规的部分，如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人与基金托管人协商一致并提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

四、基金的收益与分配

（一）收益的构成
基金本期利润是指基金本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。基金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。
期末可供分配利润，采用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。
（二）收益分配原则
在存续期内，本基金（包括工银高铁份额、工银高铁A份额、工银高铁B份额）不进行收益分配。
在本基金工银高铁份额、工银高铁A份额、工银高铁B份额的运作期间内，基金管理人可根据实际情况，在履行适当程序后对基金收益分配原则进行调整。

五、基金的费用与税收

（一）基金费用的种类
1、基金管理人的管理费；
2、基金托管人的托管费；
3、标的指数许可使用费；
4、因基金的证券、期货交易或结算而产生的费用；
5、基金合同生效以后的信息披露费用；
6、基金份额持有人大会费用；
7、基金合同生效以后的会计师费和律师费；
8、基金资产的资金汇划费用；
9、基金上市费及年费；
10、按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用。
（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式
1、基金管理人的管理费
基金管理人的基金管理费按基金资产净值的1.0%年费率计提。
在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的1.0%年费率计提。计算方法如下：
H＝E×1.0%÷当年天数
H 为每日应计提的基金管理费
E 为前一日基金资产净值
基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起2-5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。
若遇法定节假日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日结束之日起3个工作日内或不可抗力情形消除之日起3个工作日内支付。
2.基金托管人的基金托管费
基金托管人的基金托管费按基金资产净值的0.2%年费率计提。
在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.2%年费率计算。计算方法如下：
H=E×0.2%÷当年天数
H 为每日应计提的基金托管费
E 为前一日的基金资产净值
基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起2-5个工作日内从基金财产中一次性支付。
若遇法定节假日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日结束之日起3个工作日内或不可抗力情形消除之日起3个工作日内支付。
3.基金合同生效后的标的指数许可使用费
本基金的标的指数使用许可费按前一日基金资产净值的0.02%的年费率计提，且收取下限为每季度人民币5万元（基金合同生效日所在季度除外）。计算方法如下：
H= E×0.02%÷当年天数
H为每日应计提的标的指数使用许可费
E为前一日的基金资产净值
标的指数使用许可费每日计算，逐日累计，按季支付。标的指数使用许可费的支付由基金管理人向基金托管人发送划付指令，经基金托管人复核后从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日结束之日起3个工作日内或不可抗力情形消除之日起3个工作日内支付。
基金管理人可根据指数使用许可协议，对上述计提标准和计提方式进行合理变更，此项变更无需召开基金份额持有人大会，基金管理人将在更新招募说明书或其他公告中披露基金最新适用的计提标准和计提方法。
4.本条第（一）款第4至第10项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入当期基金费用。
（三）不列入基金费用的项目
本条第（一）款约定以外的其他费用，以及基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失等不列入基金费用。
（四）基金管理费和基金托管费的调整
基金管理人和基金托管人可协商的情调低基金管理费和基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。
（五）税收
本基金运作过程中涉及的各纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

六、基金财产的投资范围和投资限制

（一）投资范围
本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具，包括中证高铁产业指数的成份股及其备选成份股、债券（包括但不限于国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、短期融资券（含超短期融资券））、资产支持证券、债券回购、股指期货、权证以及经中国证监会允许基金投资的其它金融工具，但需符合中国证监会的规定。法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。
本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的90%，其中投资于中证高铁产业指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的80%，任何交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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的5%。股指期货、权证及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。
（二）投资限制
基金投资组合比例限制
（1）股票资产投资市值占基金资产净值的比例不低于基金资产的90%，其中投资于中证高铁产业指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的80%；
（2）本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的10%，但标的指数成份股票及其备选成份股票不受此限；
（3）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%，但标的指数成份股票及其备选成份股票不受此限；
（4）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的3%；本基金持有的同一权证不超过该权证的10%；本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的10%；本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%；
（5）本基金应投资于信用级别评级为BBB以上（含BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出；
（6）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的10%；本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20%，中国证监会规定的特殊品种除外；本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10%；基金管理人管理的全部证券投资基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%；
（7）本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的140%；本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%；本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不得展期；
（8）本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的10%；
（9）本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有