工银瑞信精选平衡混合型证券投资基金

2014 第二季度报告

基金管理人：工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一四年七月十七日

§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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年7月14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2014年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	工银精选平衡混合
交易代码	483003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年7月13日
报告期末基金份额总额	7,446,814,180.43份
投资目标	有效控制投资组合风险，追求稳定收益与长期资本增值。
投资策略	本基金专注基本面研究，遵循系统化、程序化的投资流程以保证投资决策的科学性与一致性。
业绩比较基准	60%×沪深300指数收益率+40%×中债-新综合指数(财富)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介于股票型基金与债券型基金之间，属于中等风险水平基金
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§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（2014年4月1日 - 2014年6月30日）
1.本期已实现收益	-46,047,695.24
2.本期利润	211,750,006.17
3.加权平均基金份额本期利润	0.0280
4.期末基金资产净值	3,392,395,376.41
5.期末基金份额净值	0.4555

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。

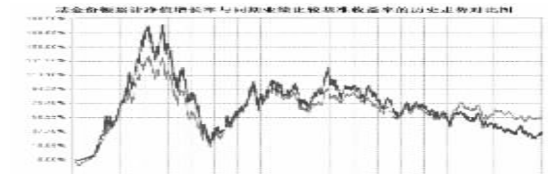
3、所列数据截止到2014年6月30日。

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	6.57%	0.76%	1.89%	0.52%	4.68%	0.24%

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2006年7月13日。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效起六个月内为建仓期。截至报告期末本基金的各项投资符合基金合同关于投资范围、投资组合限制与禁止行为的规定：本基金股票资产占基金资产净值的比例为40%-80%，债券及其它短期金融工具占基金资产净值的比例为20%-60%，本基金持有的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百分之五，持有的可转换债券不超过基金资产净值的20%，持有的权证总市值不超过基金资产净值的3%。

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		
黄安乐	本基金的基金经理	2013年9月23日	–	11	先后在天相投资顾问有限公司担任研究员，国信证券经济研究所担任资深分析师，国信证券资产管理总部担任投资经理、研究员；2010年加入工银瑞信，曾任高级研究员兼专户投资顾问，2011年11月23日至今担任工银主题策略股票基金基金经理，2013年9月23日至今担任工银瑞信精选平衡基金基金经理。
胡文彪	本基金的基金经理	2013年11月12日	–	13	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，担任工银中小盘基金基金经理；2011年2月10日2013年1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，担任工银大盘蓝筹基金基金经理；2012年11月20日至今担任工银中小盘基金基金经理；2013年11月12日至今，担任工银瑞信精选平衡基金基金经理。
高喜阳	本基金的基金经理	2013年10月18日	–	8	先后在中原证券担任机构部副总经理、研究员，在东吴基金担任研究员，在天弘基金担任投资部总经理助理、基金经理。2013年加入工银瑞信，现任权益投资部基金经理。2013年10月18日至今，担任工银瑞信精选平衡基金基金经理。

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未超过该证券当日成交量的5%。

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

由于2季度，中小盘成长股延续了1季度2月中旬以来的下跌，直至5月中才开始反弹，因此，风格偏向于中小盘成长的精选平衡基金，其净值也经历了相似的波动情况，即4月份损失较多，5月份平稳，而6月份反弹较多。总体上看，尽管存在一定的波动，本基金2季度还是获得了良好的投资收益。

2季度，本基金按照投资计划进行了一定的仓位管理，即2季度初主动下降了股票的仓位以规避系统性风险；在5月底及6月初，逐步提升了股票仓位。

在行业配置上，因为经过基金管理团队的不断调整，偏离度已经大幅度下降，总体而言比较均匀，目前配置权重靠前的行业为医药、通信、计算机、环保、国防军工、机械、电子、建筑等；其余行业也均有不同程度的配置。行业配置上，本基金偏向快速成长的行业；业绩归因分析的结果则表明，本基金超额收益，主要来源于个股的选择。

根据我们对宏观经济和市场走势的判断，下一季度，本基金行业配置的方向没有大的变动，仍偏向中小盘的快速成长行业，但在操作层面，我们将更加严格地评估当前组合中的个股，以免在3季度的上市公司中报披露期因业绩低于预期而遭受风险；另外，我们也将适度关注部分有可能走出行业底部包括基础化工、农业养殖及大宗商品等在内的周期性行业，寻找其间的趋势性投资机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值增长率为6.57%，业绩比较基准收益率为1.89%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年以来，政府不断出台微刺激政策，但我们认为，我国宏观经济内生增速下降的趋势并未因为政策上的微刺激而发生改变，但微刺激的意义在于为将来的改革和转型营造相对宽松的环境和条件，因此，市场并未因为政策刺激的托底，而青睐传统的低估值的行业，反而更加聚焦产业的升级和结构的转型，同时各类主题概念板块非常活跃。

因为政策刺激预期的存在以及相对宽松的流动性，加上新股发行抽血的负面因素逐步为市场所消化，同时打新行为趋于理性，因此，我们认为，未来2个季度，股票市场环境相对较好，4季度可能更好；需要担忧的短期风险是，上市公司2季报和半年报的业绩披露，有可能成为真假成长的分界点，也可能促使下一阶段的估值切换，因此对创业板和中小板中的成长股，未来业绩增长速度的确认显得非常重要。

从中长线看，代表产业升级和结构转型的新兴产业，仍是未来的投资主战场，我们仍将维持现有组合中的行业配置大方向，即主要配置向高成长的新兴产业；需要规避的是上述行业的中报业绩低于预期的风险，同时，因为这些板块的估值已经较高，应充分考量如何实现估值和业绩增速方面的匹配，因此个股的选择尤为重要；传统行业方面，我们认为，通过分析其供给、需求、产能和库存等方面的积极变化，可以逐步关注一些有可能走出行业底部的周期性行业，包括但不限于基础化工部分细分行业、农业养殖、大宗商品等板块，如果确认拐点出现，这类行业将存在较大的趋势性投资机会，本基金将择机进行配置。

§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	2,388,311,794.82	69.56
	其中：股票	2,388,311,794.82	69.56
2	固定收益投资	755,831,097.68	22.01
	其中：债券	755,831,097.68	22.01
	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	160,000,000.00	4.66
	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	42,058,629.05	1.22
7	其他资产	87,361,259.96	2.54
8	合计	3,433,562,781.51	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	28,963,484.00	0.85
B	采矿业	54,081,965.32	1.59
C	制造业	1,452,123,275.81	42.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,878,117.60	0.06
E	建筑业	4,206,658.50	0.12
F	批发和零售业	47,971,165.05	1.41
G	交通运输、仓储和邮政业	6,643,287.28	0.20
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	427,407,233.91	12.60
J	金融业	144,476,496.35	4.26
K	房地产业	70,199,311.57	2.07
L	租赁和商务服务业	1,185,607.36	0.03
M	科学研究和技术服务业	3,174,209.92	0.09
N	水利、环境和公共设施管理业	130,235,877.10	3.84
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	6,123,000.00	0.18
R	文化、体育和娱乐业	9,642,105.05	0.28
S	综合	–	–
	合计	2,388,311,794.82	70.40

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	300113	顺网科技	4,039,515	97,756,263.00	2.88
2	300016	北陆药业	7,820,304	97,284,581.76	2.87
3	300086	康芝药业	6,696,967	90,476,024.17	2.67
4	300213	佳讯飞鸿	5,379,873	85,755,175.62	2.53
5	002421	达实智能	3,099,687	78,980,024.76	2.33
6	002649	博彦科技	2,200,069	73,042,290.80	2.15
7	600776	东方通信	5,000,045	66,750,600.75	1.97
8	300090	盛运股份	4,049,414	63,778,270.50	1.88
9	300137	先河环保	3,009,856	62,785,596.16	1.85
10	300190	维尔利	1,899,901	52,095,285.42	1.54

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	公允价值（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	149,870,000.00	4.42
	其中：政策性金融债	149,870,000.00	4.42
4	企业债券	336,786,097.68	9.93
5	企业短期融资券	20,198,000.00	0.60
6	中期票据	248,977,000.00	7.34
7	可转债	–	–
8	其他	–	–
9	合计	755,831,097.68	22.28

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。

5.5 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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
1	140213	14国开13	1,100,000	109,802,000.00	3.24
2	1080095	10云投债	800,000	79,408,000.00	2.34
3	112100	12盾安债	733,330	72,966,335.00	2.15
4	1282207	12广汇MTN1	500,000	49,675,000.00	1.46
5	1082017	10云天化MTN2	400,000	40,144,000.00	1.18

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。
5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。
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权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有股指期货投资，也无期间损益。
5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策
本报告期内，本基金未运用股指期货进行投资。
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.10.1 本期国债期货投资政策
本报告期内，本基金未运用国债期货进行投资。
5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货投资，也无期间损益。
5.10.3 本期国债期货投资评价
本报告期内，本基金未运用国债期货进行投资。
5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的投资决策程序说明：

根据康芝药业2013年3月19日披露的《关于公司2011年半年度及2011年第三季度财务信息更正的公告》显示，公司2011年半年报告及2011年第三季度报告存在重大会计差错。更正后，2011年半年度报告归属于母公司股东的净利润减少了953.85万元，与更正前相比下降了43.10%；2011年第三季度报告归属于母公司股东的净利润减少530.51万元，与更正前相比下降了36.99%。

上述行为违反了深圳证券交易所《创业板股票上市规则（2012年修订）》第2.1条的相关规定。康芝药业董事长兼总裁洪江游、董事兼副总裁洪江涛、时任董事会秘书李幽泉、财务总监刘会良未能恪尽职守、履行诚信勤勉义务，给与公开批评处分。

上述事项对公司的生产经营活动基本无影响。

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	749,842.67
2	应收证券清算款	69,325,157.36
3	应收股利	–
4	应收利息	17,253,974.31
5	应收申购款	32,285.62
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	87,361,259.96

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处于转股期的可转换债券。
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	300137	先河环保	62,785,596.16	1.85	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	7,694,028,290.71
报告期期间基金总申购份额	12,462,005.80
减:报告期期间基金总赎回份额	259,676,116.08
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	7,446,814,180.43

§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
无。
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
本基金本报告期无基金管理人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精选平衡混合型证券投资基金设立的文件；
2、《工银瑞信精选平衡混合型证券投资基金基金合同》；
3、《工银瑞信精选平衡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，在合理时间内取得上述文件的复印件。

工银瑞信增强收益债券型证券投资基金

2014 第二季度报告

基金管理人：工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一四年七月十七日

§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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年7月14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2014年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	工银增强收益债券	
交易代码	485105	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2007年5月11日	
报告期末基金份额总额	2,404,342,784.57份	
投资目标	在控制风险与保持资产流动性的基础上，力争基金资产波动性低于业绩比较基准，追求资产的长期稳定增值，获得超过基金业绩比较基准的投资业绩。	
投资策略	在确定的利率策略和期限结构、类属配置策略下，通过固定收益产品的投资来获取稳定的收益。同时适当参与新股发行申购及增发新股申购等风险较低的投资品种，为基金持有人增加收益，实现基金资产的长期稳定增值。	
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为中债-新综合指数(财富)收益率	
风险收益特征	本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金，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	中国建设银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	工银增强收益债券A	工银增强收益债券B
下属两级基金的交易代码	485105	485005
报告期末下属两级基金的份额总额	1,628,371,083.02份	775,971,701.55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（2014年4月1日 - 2014年6月30日）	
	工银增强收益债券A	工银增强收益债券B
1.本期已实现收益	22,657,255.61	10,135,152.07
2.本期利润	80,026,289.58	37,386,045.34
3.加权平均基金份额本期利润	0.0525	0.0513
4.期末基金资产净值	1,758,104,828.88	835,021,052.60
5.期末基金份额净值	1.0797	1.0761

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2014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

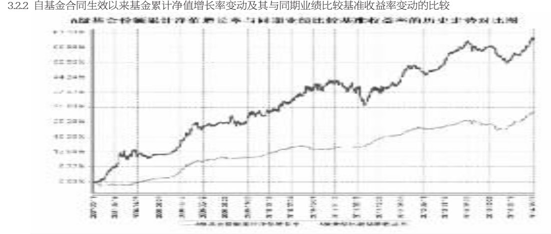
工银增强收益债券A

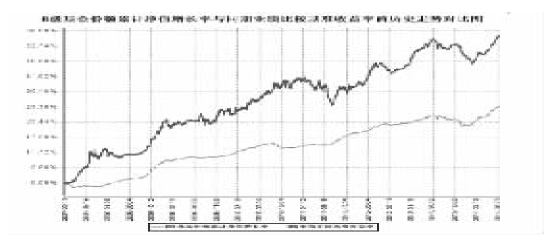
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	5.11%	0.11%	3.27%	0.08%	1.84%	0.03%

工银增强收益债券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	5.02%	0.11%	3.27%	0.08%	1.75%	0.03%

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2007年5月11日生效。

2、根据基金合同，本基金建仓期为3个月。截至报告期末，本基金各项投资符合基金合同关于投资范围及投资限制的规定：本基金投资于债券类资产（含可转换债券）的比例不低于基金资产的80%，投资于股票等权益类证券的比例不超过基金资产的20%，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%，投资于可转换债券的比例不超过基金资产净值的30%，本基金股票资产投资只进行首次发行及增发新股投资，不直接从二级市场买入股票。

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		
杜海涛	固定收益投资总监，本基金的基金经理。	2007年5月11日	–	17	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，现任固定收益投资总监；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。

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未超过该证券当日成交量的5%。

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

国内经济基本面在2季度出现了小幅回升。一方面，发达经济体在经历了极寒天气、消费税上调等不利因素的冲击之后重回复苏轨道；另一方面，前期经济的疲软促使国内的货币政策逐步转向宽松，货币政策放松配合基建项目的陆续出台带动内需转暖。由于经济复苏的幅度相对有限，物价压力依旧温和，尚未表现出明显的上行压力。二季度在经济小幅回暖、通胀压力可控、货币政策放松的背景下，收益率曲线平行下移，其中国开债、城投债和可转债的表现最佳，具体来看：

4-5月，央行采取了定向降准、再贷款等一系列措施增加资金供应，再加上对非标的管制抑制了资金需求，市场对资金面的预期明显改善，债券收益率持续下行。分品种来看，国开债和城投债的回报最高。前者受益于再贷款带来的供给收缩，后者受益于银行理财对城投债的配置需求在非标受限后开始回升。6月份开始，一方面新股发行导致交易所回购利率跳升，另一方面经济数据的转暖对市场情绪造成冲击，债券收益率停止下降甚至在月末出现了一定幅度的上行。报告期内，转债受益于纯债价值的抬升，涨幅较大。

工银强债本报告期内根据宏观经济和通胀形势的变化，适时调整组合久期，逐步降低低资质债券的持仓比重，增持了可转债。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，工银强债A净值增长率5.11%，工银强债B净值增长率5.02%，业绩比较基准收益率为3.27%。

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2014年3季度，宏观经济增速存在进一步上行可能。首先，在货币政策持续趋松的大背景下，国内库存周期和房地产周期存在上行动力；其次，海外发达经济需求的改善也会带动国内生产持续回升。虽然经济底部温和回升，但由于我们判断货币政策一般会相对滞后，因此整体货币市场利率水平中枢有望继续维持低位。经济回升导致期限利差难以进一步压缩，但资金面的平稳和基本面的改善有利于信用利差的收窄，中短久期信用债的性价比相对较好。在经济回升、流动性平稳的推动下，可转债有一定的上涨空间。

2014年3季度，本基金将适时调整久期，继续提高组合的信用资质，可转债方面保持现有仓位并努力做好波段操作与结构调整。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

姓名	项目	金额（元）	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	–	–
	其中：股票	–	–
2	固定收益投资	3,891,358,798.00	96.58
	其中：债券	3,891,358,798.00	96.58
	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	39,648,979.62	0.98
7	其他资产	98,260,672.42	2.44
8	合计	4,029,268,450.04	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
本基金本报告期末未持有股票。
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
本基金本报告期末未持有股票。
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	公允价值（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	419,523,000.00	16.18
	其中：政策性金融债	253,077,000.00	9.76
4	企业债券	1,376,432,087.43	53.08
5	企业短期融资券	140,811,500.00	5.43
6	中期票据	1,269,359,500.00	48.95
7	可转债	685,232,710.57	26.42
8	其他	–	–
9	合计	3,891,358,798.00	150.06

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。

5.5 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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
1	110020	南山转债	1,632,040	155,109,081.60	5.98
2	113001	中行转债	1,458,850	148,496,341.50	5.73
3	140212	14国开12	1,300,000	130,221,000.00	5.02
4	110023	民生转债	1,225,230	113,701,344.00	4.38
5	1116001	11深发展01	1,000,000	105,990,000.00	4.09

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。
5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。
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权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.9.1 本期国债期货投资政策
本报告期内，本基金未运用国债期货进行投资。
5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货投资，也无期间损益。
5.9.3 本期国债期货投资评价
无
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（元）
1	存出保证金	95,991.92
2	应收证券清算款	11,440,454.73
3	应收股利	–
4	应收利息	85,509,262.83
5	应收申购款	1,214,962.94
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	98,260,672.42

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110020	南山转债	155,109,081.60	5.98
2	113001	中行转债	148,496,341.50	5.73
3	110023	民生转债	113,701,344.00	4.38
4	110015	石化转债	39,409,050.00	1.52
5	113005	平安转债	32,046,000.00	1.24
6	110017	中海转债	31,352,544.80	1.21
7	110018	国电转债	30,264,400.00	1.17
8	110012	海运转债	25,098,201.00	0.97
9	110011	歌华转债	20,276,000.00	0.78
10	110022	同仁转债	18,758,320.00	0.72
11	125089	深机转债	14,760,748.27	0.57

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末未持有股票。
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

项目	工银增强收益债券A	工银增强收益债券B
报告期期初基金份额总额	1,436,551,275.30	706,882,926.25
报告期期间基金总申购份额	281,534,640.78	192,135,318.55
减:报告期期间基金总赎回份额	89,714,833.06	123,046,543.25
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	1,628,371,083.02	775,971,701.55

§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

项目	77,763,160.20
报告期期间买入/申购总份额	0.00
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	77,763,160.20
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	3.23

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
本基金本报告期无基金管理人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增强收益债券型证券投资基金设立的文件；
2、《工银瑞信增强收益债券型证券投资基金基金合同》；
3、《工银瑞信增强收益债券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。

工银瑞信中国机会全球配置股票型证券投资基金

2014 第二季度报告

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：二〇一四年七月十七日

§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2014年7月16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2014年4月1日起至6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	647,888,715.17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（2014年4月1日 - 2014年6月30日）
1.本期已实现收益	19,335,934.42
2.本期利润	9,834,509.37
3.加权平均基金份额本期利润	0.0147
4.期末基金资产净值	710,348,129.49
5.期末基金份额净值	1.096

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2014年6月30日。

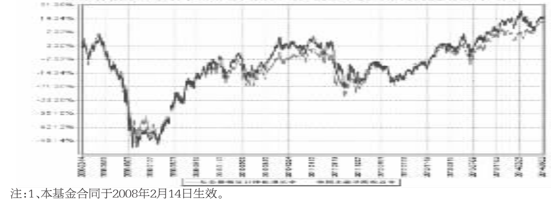
3.2 基金净值表现

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	1.48%	0.67%	5.19%	0.45%	-3.71%	0.22%

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效应。

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		
游凛峰	本基金的基金经理	2009年12月25日	–	21	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。
曹冠业	权益投资部总监	2013年9月23日	2014年6月12日	13	CFA、FRM；先后在东方汇理担任结构基金和亚太股票基金经理，香港恒生投资管理公司担任香港中国股票和QFII基金投资经理；2007年加入工银瑞信，现任权益投资部总监，兼任工银瑞信资产管理（国际）有限公司权益投资总监；2007年11月29日至2009年5月17日，担任工银核心价值基金基金经理；2008年2月14日至2009年12月25日，担任工银全球基金基金经理；2009年5月18日至2014年6月12日，担任工银成长基金基金经理；2011年10月24日至2014年6月12日，担任工银主题策略股票基金基金经理；2013年9月23日至2014年6月12日担任工银瑞信中国机会全球配置基金基金经理；2013年11月11日至2014年6月12日担任工银瑞信信息产业股票型基金基金经理。

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	26	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。

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未超过该证券当日成交量的5%。

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

2014年第二季度，全球股市表现良好。新兴市场股市的表现更好于成熟市场。基准指数MSCI Emerging Markets上涨6.7%，MSCI World Index扬升4.9%。美国经济的复苏势头更加明显。失业率已降到6.3%。个人消费支出与前月比保持增长。美国联邦储备银行继续其鸽派政策。五月制造业PMI恢复至56.4。同时，欧洲中央银行进一步加大释放流动性，甚至祭出了负利率。除了发达国家的经济恢复和超宽松流动性，印度令人鼓舞的大选结果，中国的定向经济刺激政策以及新兴市场相对较低的估值等因素都支持了新兴市场股市的反弹。本季度，大摩新兴市场的板块方面，信息技术、能源、公共事业和医疗等板块领涨。

发达国家的经济恢复和中国的微刺激政策的叠加效应使中国经济成长率下滑短期见底。6月PMI值由3月的50.3恢复至年初以来的高点51.0。央行通过公开市场操作和定向降准使资金成本相对缓和了一些。人民币的前期调整也在一定程度上帮助了出口企业。而海外中国股的估值更处于新兴市场股市中的低端，具有一定的吸引力。大摩中国指数在过去3个月里上涨3.4%。在过去一个季度中，信息技术、能源、公共事业和电信板块领先与指数。

股市回报均以美元衡量，而非本币，以便横向比较。

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1.48%，业绩比较基准收益率为5.19%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在史无前例的全球性超宽松货币政策的支持下，以美国为首的发达国家经济体在逐渐恢复之中。全球工业企业信心和产能利用率已经有所改善。随着房地产市场和股市的复苏，以及就业市场的改善，财富效应正在显现，消费支出也在增长。全球持续的量化宽松和各种经济刺激计划推动了固定收益信用板块利差收窄，并提振了经济活动。

改善中的发达国家经济状况和国内一系列的微刺激政策大大减少了中国经济的硬着陆风险，为今年中国的经济成长达标创造了良好的条件。我们相信今年GDP增长能够达到7.5%的目标。改革红利和经济转型虽然有波折但也会继续。最近提出的国企所有制改革证明了政府的改革决心。随之而来将有更多新的投资机会。2014年的外部挑战之一将是美国退出QE的影响。我们相信虽然退出引起的流动性收缩会影响全球的资产价格，但对股市的冲击相对会比较有限。中长期来看，美国经济的恢复所带来的持续性的正面影响将大大超过QE退出给股市带来的短期波动。海外中国股由于估值已处于历史低位，短期下降空间较有限，而受益于全球经济恢复和国内经济的软着陆，上升空间相对较大。在本季度中，本基金将重点着眼于近期经济刺激政策的效果和中长期新兴成长产业及改革受益板块，从中寻找投资机会，维持超配信息科技、公共事业和金融。同时低配估值较高的消费板块和逐渐失去市场优势的电信行业。

§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	676,863,856.04	92.76
	其中：普通股	657,853,026.89	90.15
	优先股	–	–
	存托凭证	19,010,829.15	2.61
	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	38,490,388.47	5.27
8	其他资产	14,374,307.74	1.97
9	合计	729,728,552.25	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(%)
中国香港	300,223,343.88	42.26
美国	296,177,145.95	41.69
英国	42,983,310.42	6.05
瑞士	13,633,375.91	1.92
德国	10,224,417.97	1.44
加拿大	5,499,425.59	0.77
瑞典	4,331,242.36	0.61
挪威	3,791,593.96	0.53
合计	676,863,856.04	95.29

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

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例(%)
保健 Health Care	81,292,637.70	11.44
必需消费品 Consumer Staples	15,905,354.85	2.24
材料 Materials	11,725,671.88	1.65
非必需消费品 Consumer Discretionary	65,394,772.90	9.21
工业 Industrials	54,293,005.65	7.64
公共事业 Utilities	29,683,868.75	4.18
金融 Financials	182,654,363.35	25.71
能源 Energy	53,829,278.10	7.58
信息技术 Information Technology	182,084,902.86	25.63
合计	676,863,856.04	95.29

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。

5.4 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	Tencent Holdings Ltd	腾讯	KYG875721634	香港证券交易所	中国香港	384,000	36,027,360.00	5.07
2	Agricultural Bank of China Ltd	农业银行	CNE100000Q43	香港证券交易所	中国香港	7,480,000	20,305,395.00	2.86
3	China Petroleum & Chemical Corp	中国石化	CNE1000002Q2	香港证券交易所	中国香港	3,020,000	17,714,753.75	2.49
4	China Merchants Bank Co Ltd	招商银行	CNE1000002M1	香港证券交易所	中国香港	1,400,000	16,979,900.00	2.39
5	China Minsheng Banking Corp Ltd	民生银行	CNE100000HF9	香港证券交易所	中国香港	3,000,000	16,716,375.00	2.35
6	Sunny Optical Technology Group Co Ltd	舜宇光学科技	KYG8586D1097	香港证券交易所	中国香港	1,906,000	16,581,247.00	2.33
7	PetroChina Co Ltd	中国石油	CNE1000003W8	香港证券交易所	中国香港	2,050,000	15,930,165.63	2.24
8	China CITIC Bank Corp Ltd	中信银行	CNE1000001Q4	香港证券交易所	中国香港	4,000,000	14,922,500.00	2.10
9	China Pacific Insurance Group Co Ltd	中国太保	CNE1000009Q7	香港证券交易所	中国香港	482,800	10,481,135.38	1.48
10	China State Construction International Holdings Ltd	中国建筑国际	KYG216771363	香港证券交易所	中国香港	800,000	8,636,000.00	1.22

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	5,465,448.42
3	应收股利	3,370,652.96
4	应收利息	4,125.79
5	应收申购款	94,959.78
6	其他应收款	5,439,120.79
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	14,374,307.74

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
本基金本报告期末前十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	690,730,418.50
报告期期间基金总申购份额	6,293,874.74
减:报告期期间基金总赎回份额	49,135,578.07
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	647,888,715.17

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8 影响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、中国证监会核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
备查文件存放于基金管理人或基金托管人住所。
9.3 查阅方式
投资者可到基金管理人或基金托管人的办公场所、营业场所及网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。