工银瑞信7天理财债券型证券投资基金

【2015】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。
基金托管人中国建设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7天理财债券	
交易代码	485118	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年8月22日	
报告期末基金份额总额	22,693,303,471.31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	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	人民币七天通知存款税后利率。	
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	中国建设银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	工银7天理财债券A	工银7天理财债券B
下属分级基金的交易代码	485118	485018
报告期末下属分级基金的份额总额	17,031,123,360.34份	5,662,180,110.97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7天理财债券A	工银7天理财债券B
1. 本期已实现收益	216,321,895.66	60,807,370.54
2.本期利润	216,321,895.66	60,807,370.54
3.期末基金资产净值	17,031,123,360.34	5,662,180,110.97

注:(1)本基金收益分配是按日结转份额。
(2)所列数据截止到2015年6月30日。
(3)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。
(4)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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

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

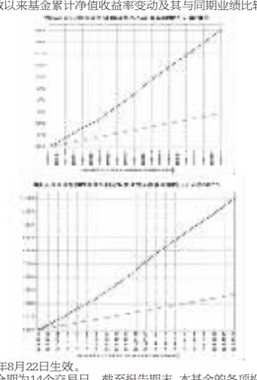
工银7天理财债券A

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	1.1126%	0.0025%	0.3366%	0.0000%	0.7760%	0.0025%

工银7天理财债券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	1.1859%	0.0025%	0.3366%	0.0000%	0.8493%	0.0025%

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2012年8月22日生效。
2、按基金合同规定,本基金建仓期为14个交易日。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;本基金不直接在二级市场上买入股票、权证等权益类资产,也不参与一级市场新股申购和新股增发。

§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		
魏欣	固定收益部副总监,本基金的基金经理	2012年8月22日	-	10	2005年加入工银瑞信,现任固定收益部副总监;2011年4月20日至今,担任工银货币市场基金基金经理,2012年8月22日至今,担任工银瑞信7天理财债券型基金基金经理;2012年10月26日至今,担任工银14天理财债券型基金的基金经理;2014年9月23日至今,担任工银瑞信现金快线货币市场基金基金经理;2014年10月22日至今,担任工银添益快线货币市场基金基金经理;2015年5月26日起至今,担任工银新财富灵活配置混合型基金基金经理;2015年5月26日起至今,担任工银双利债券型基金基金经理;2015年5月29日起至今,担任工银丰盈回报灵活配置混合型基金基金经理;2015年6月19日至今,担任工银财富快线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,货币政策放松虽继续加码,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(含定向降准)操作,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,工银瑞信7天理财A净值收益率1.1126%,工银瑞信7天理财B净值收益率1.1859%,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低位,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和短期债券的投资机会。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	11,961,700,861.89	44.05
	其中:债券	11,931,700,861.89	43.94
	资产支持证券	30,000,000.00	0.11
2	买入返售金融资产	2,191,405,087.10	8.07
	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	12,522,344,143.25	46.12
4	其他资产	476,374,963.17	1.75
5	合计	27,151,825,055.41	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	13.63	
	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	4,439,052,244.21	19.56
	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40%的说明
本报告期内本基金债券正回购的资金余额未超过基金资产净值的40%。

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	120
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	126
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	102

报告期内投资组合平均剩余期限超过127天情况说明
本报告期内无投资组合平均剩余期限超过127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	18.66	19.56
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	14.94	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	28.38	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	27.50	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	28.06	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		117.55	19.56

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	1,303,597,237.74	5.74
	其中:政策性金融债	1,303,597,237.74	5.74
4	企业债券	9,948,332,752.45	43.84
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	679,770,871.70	3.00
7	其他	-	-
8	合计	11,931,700,861.89	52.58
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

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	130211	13国开11	3,000,000	301,142,339.30	1.33
2	100236	10国开36	3,000,000	300,758,314.05	1.33
3	1282302	12武钢MTN3	2,000,000	200,010,280.34	0.88
4	130306	13进出06	1,900,000	190,367,457.94	0.84
5	130215	13国开15	1,700,000	170,325,378.09	0.75
6	041563008	15首钢CP002	1,500,000	150,000,127.72	0.66
7	041453118	14酒钢CP002	1,500,000	149,975,337.86	0.66
8	011474007	14陕煤化SCP007	1,500,000	149,956,333.35	0.66
9	011520001	15中铝SCP001	1,500,000	149,903,062.33	0.66
10	011599153	15山钢SCP004	1,300,000	130,124,011.56	0.57

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	33
报告期内偏离度的最高值	0.3771%
报告期内偏离度的最低值	0.0635%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.2522%

注:上表中"偏离情况"根据报告期内各工作日数据计算。

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

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1589085	15德宝天元1A1(总价)	300,000	29,940,000.00	0.13

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天的浮动利率债券未超过当日基金资产净值的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	285,993,465.07
4	应收申购款	190,319,298.10
5	其他应收款	62,200.00
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	476,374,963.17

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7天理财债券A	工银7天理财债券B
报告期期初基金份额总额	19,964,088,717.63	3,766,510,991.18
报告期期间基金总申购份额	19,113,129,402.36	8,929,811,230.77
减:报告期期间基金总赎回份额	22,046,094,759.65	7,034,142,110.98
报告期期末基金份额总额	17,031,123,360.34	5,662,180,110.97

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7天理财债券型证券投资基金设立的文件;
2、《工银瑞信7天理财债券型证券投资基金合同》;
3、《工银瑞信7天理财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的办公场所。

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。

工银瑞信标普全球自然资源指数证券投资基金(LOF)

【2015】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	45,501,549.04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,即按照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4月1日 - 2015年6月30日)
1.本期已实现收益	2,300,986.97
2.本期利润	1,090,688.03
3.加权平均基金份额本期利润	0.0137
4.期末基金资产净值	38,623,954.19
5.期末基金份额净值	0.849

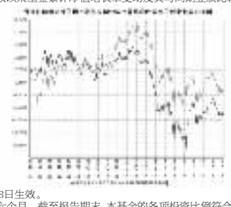
注:(1)上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
(2)"本期已实现收益"指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额;"本期利润"为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
(3)所列数据截止到2015年6月30日。

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	-0.93%	0.76%	-0.53%	0.80%	-0.40%	-0.04%

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		
赵栩	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联接基金基金经理,2013年5月28日至今担任工银标普全球自然指数基金基金经理。

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,并在买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买方交易员,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 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-0.93%,业绩比较基准收益率为-0.53%。

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

本基金在报告期内从2015年5月22日到6月30日连续出现二十八天规模低于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,予以披露。

§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	35,699,826.59	77.81
	其中:普通股	32,915,553.45	71.74
	优先股	-	-
	存托凭证	2,170,901.40	4.73
	房地产信托凭证	613,371.74	1.34
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	5,322.04	0.01
	其中:远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	5,322.04	0.01
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	4,855,354.53	10.58
8	其他资产	5,318,252.32	11.59
9	合计	45,878,755.48	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

序号	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
美国	14,146,942.53	36.63
英国	6,400,536.44	16.57
澳大利亚	3,484,170.73	9.02
加拿大	2,528,895.03	6.55
瑞士	1,723,809.04	4.46
日本	1,642,055.37	4.25
法国	1,096,115.49	2.84
挪威	798,154.09	2.07
芬兰	736,668.93	1.91
德国	693,470.65	1.80
韩国	522,970.60	1.35
中国香港	471,087.54	1.22
意大利	453,005.60	1.17
新加坡	394,140.65	1.02
荷兰	295,294.61	0.76
西班牙	166,629.42	0.43
以色列	145,879.87	0.38
合计	35,699,826.59	92.43

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 报告期末指数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	21,614,981.09	55.96
能源 Energy	11,982,862.32	31.02
必需消费品 Consumer Staples	1,488,611.44	3.85
金融 Financials	613,371.74	1.59
合计	35,699,826.59	92.43

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 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

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	3,624	1,843,353.11	4.77
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	14,060	1,787,251.87	4.63
3	SYNGENTA AG-REG	先正达股份公司	CH0011037469	瑞士证券交易所	瑞士	694	1,723,809.04	4.46
4	GLENCORE XSTRATA PLC	嘉能可公司	JE00B4T3BW64	伦敦证券交易所	英国	54,083	1,331,336.16	3.45
5	POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	萨斯喀彻温省钾肥股份有限公司	CA73755L1076	纽约证券交易所	美国	6,562	1,242,437.22	3.22
6	MONSANTO CO	孟山都	US61166W1018	纽约证券交易所	美国	1,809	1,178,832.36	3.05
7	BP PLC	BP公司	GB0007980591	伦敦证券交易所	英国	28,082	1,137,649.62	2.95
8	CHEVRON CORP	雪佛龙德士古	US1667641005	纽约证券交易所	美国	1,910	1,126,477.87	2.92
9	TOTAL SA	道达尔	FR0000120271	巴黎证券交易所	法国	3,662	1,096,115.49	2.84
10	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	荷兰皇家壳牌	GB00B03MLX29	伦敦证券交易所	英国	6,003	1,034,064.24	2.68

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

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	权证投资	REPSOL SA-RTS	5,322.04	0.01

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	3,565,762.19
3	应收股利	33,586.68
4	应收利息	541.55
5	应收申购款	9,731.50
6	其他应收款	1,708,630.40
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,318,252.32

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

5.10.5.1 报告期末指数投资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	28,837,532.32
报告期期间基金总申购份额	198,638,883.52
减:报告期期间基金总赎回份额	181,974,866.80
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	45,501,549.04

§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

深圳证券交易所2015年1月9日发布了《关于修改<深圳证券交易所交易规则>第3.1.4条的通知》,本基金自2015年1月19日起实施当日回转交易。

§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。

工银瑞信美丽城镇主题股票型证券投资基金

【2015】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。
基金托管人中国建设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	工银美丽城镇股票
交易代码	001043
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年3月26日
报告期末基金份额总额	1,238,202,922.99份
投资目标	在全面推进新型城镇化发展的背景下,积极选择深度受益于此类主题的股票