东方红中国优势灵活配置混合型证券投资基金

【2015】第四季度报告

基金管理人:上海东方证券资产管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2016年1月20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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月18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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	东方红中国优势混合
场内简称	-
基金主代码	001112
前端交易代码	001112
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年4月7日
报告期末基金份额总额	5,817,608,319.09份
投资目标	本基金在国家深化改革、经济结构转型的背景下,积极挖掘符合改革方向,有国际竞争力的行业和企业,严控风险,力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金通过定性与定量研究相结合的方法,确定投资组合中权益类资产和固定收益类资产的配置比例。通过动态跟踪海内外主要经济体的GDP、CPI、利率等宏观经济指标,以及估值水平、盈利预期、流动性、投资者心态等市场指标,确定未来市场变动趋势,通过全面评估上述各种关键指标的变动趋势,对股票、债券等大类资产的风险和收益特征进行预测。根据上述定性和定量指标的分析结果,运用资产配置优化模型,在目标收益条件下,追求风险最小化目标,最终确定大类资产投资权重,实现资产合理配置。
业绩比较基准	中证800指数收益率*70%+中国债券总指数收益率*30%
风险收益特征	本基金是一只混合型基金,属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种,其预期风险与收益高于债券型基金与货币市场基金,低于股票型基金。
基金管理人	上海东方证券资产管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§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10月1日 - 2015年12月31日)
1.本期已实现收益	668,899.40
2.本期利润	1,185,019,846.88
3.加权平均基金份额本期利润	0.1666
4.期末基金资产净值	6,203,834,366.01
5.期末基金份额净值	1.066

注:(1)所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。

3.2 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	17.53%	1.28%	13.81%	1.20%	3.72%	0.08%

注:本基金合同于2015年4月7日生效,过去三个月指2015年10月1日-2015年12月31日。

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)截止日期为2015年12月31日。

(2)本基金合同于2015年4月7日生效,自合同生效日起至本报告期末不足一年。

(3)本基金建仓期6个月,即从2015年4月7日起至2015年10月6日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

§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		
杨达冶	本基金基金经理,兼任公司董事总经理、公募权益投资部总监、权益研究部总监、东方红睿元三年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红京东大数据灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2015年4月7日	-	14年	硕士,曾任东方证券股份有限公司证券投资业务总部研究员;东方基金有限责任公司研究部研究员;东方证券股份有限公司资产管理业务总部投资经理;上海东方证券资产管理有限公司投资部投资经理、研究部副总监兼投资经理、执行董事;现任公司董事总经理、公募权益投资部总监、权益研究部总监兼东方红中国优势混合、东方红睿元混合、东方红京东大数据混合基金经理。具有基金从业资格,中国国籍。
王延飞	本基金基金经理,兼任东方红产业升级灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2015年6月8日	-	6年	曾任东方证券股份有限公司资产管理业务总部研究员、上海东方证券资产管理有限公司研究部研究员、研究部高级研究员,现任东方红产业升级混合、东方红中国优势混合基金经理。具有基金从业资格,中国国籍。

注:(1)上述表格内基金首任基金经理"任职日期"指基金合同生效日,"离任日期"指根据公司决定确定的解聘日期;对此后非首任基金经理,基金经理的"任职日期"和"离任日期"均指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

(2)证券从业的涵义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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,上海东方证券资产管理有限公司作为本基金管理人,严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、基金合同以及其它有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金持有人利益的行为,本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合,制定并严格遵守相应的制度和流程,通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内,本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《上海东方证券资产管理有限公司公平交易制度》的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内,未出现涉及本基金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5%的情况。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年4季度,实体经济的表现一如既往的疲软,仍看不到企稳的迹象;利率继续下行,10年期国债收益率跌破3%。A股市场在股灾情绪平复后,各类指数均有所反弹,四季度沪深300指数上涨16.49%,创业板指数上涨30.32%。其中计算机(54.99%),基础化工(45.94%),房地产(45.84%)涨幅较大,钢铁(6.54%)银行(11.52%)交通运输(12.02%)涨幅较小。本产品坚持个股精选的策略,跑赢沪深300指数,取得了一定的相对收益。

展望16年,我们认为经济层面将极其复杂:首先,经济周期叠加了政治周期,导致财政政策一定程度上的失效,只有依赖货币政策,但若监管不到位或者引导不够,很多资金到不了实体经济层面;其次,旧经济模式出清不够,依然占用了大量社会资源,新兴板块还很难接过接力棒;再次,外部需求不确定性也很高,需要密切关注货币贬值带来的风险和机遇。在此经济背景下,结合资本市场本身的供需,我们认为A股市场上下波动幅度可能非常巨大:一方面流动性宽松,实体经济不好的局面依然会维持,资本市场大概率还会比较活跃;另一方面以创业板为代表的大部分股票估值高企,注册制推出后股票供给也可能超预期。

操作上,我们坚信精选个股的重要性,仍将坚持"幸运的行业,能干的管理层,合理的估值"的投资理念,优选消费升级、人口老龄化、新能源相关以及那些供给侧出清的周期类行业的龙头公司进行布局,力争以合理的价格买入,给投资者带来绝对回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2015年12月31日,本基金份额净值为1.066元,份额累计净值为1.066元。报告期内,本基金份额净值增长率为17.53%,同期业绩比较基准收益率为13.81%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内,本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§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	5,579,313,231.82	88.99
	其中:股票	5,579,313,231.82	88.99
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	668,745,731.54	10.67
8	其他资产	21,790,509.37	0.35
9	合计	6,269,849,472.73	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	68,614,299.56	1.11
B	采矿业	-	-
C	制造业	4,265,923,620.46	68.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	123,128,830.00	1.98
E	建筑业	85,007,960.00	1.37
F	批发和零售业	9,276,186.00	0.15
G	交通运输、仓储和邮政业	8,924,300.00	0.14
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,432,359.68	0.18
J	金融业	414,091,935.91	6.67
K	房地产业	513,030,000.00	8.27
L	租赁和商务服务业	76,923,000.00	1.24
M	科学研究和技术服务业	109,392.21	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	2,851,348.00	0.05
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	5,579,313,231.82	89.93

5.2 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	000002	万 科A	21,000,000	513,030,000.00	8.27
2	002304	洋河股份	7,402,120	507,341,304.80	8.18
3	002415	海康威视	13,000,000	447,070,000.00	7.21
4	600887	伊利股份	26,273,601	431,675,264.43	6.96
5	600066	宇通客车	18,632,842	419,052,616.58	6.75
6	600557	康缘药业	16,134,700	403,690,194.00	6.51
7	600703	三安光电	12,949,419	314,411,893.32	5.07
8	002157	正邦科技	13,711,798	275,607,139.80	4.44
9	600271	航天信息	2,941,983	210,234,105.18	3.39
10	000538	云南白药	2,489,800	180,809,276.00	2.91

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

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

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
公允价值变动总额合计(元)					0
股指期货投资本期收益(元)					5,911,240.00
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-2,662,000

注:本基金本报告期末无股指期货持仓。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货以套期保值为目的,以回避市场风险。故股指期货空头的合约价值主要与股票组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理股指期货合约数量,以萝取相应股票组合的超额收益。

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

本基金投资国债期货以套期保值为目的,以回避市场风险。故国债期货空头的合约价值主要与债券组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理国债期货合约数量,以萝取相应债券组合的超额收益。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末进行国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末进行国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

本基金持有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。

5.11.2

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	3,852,128.85
2	应收证券清算款	17,097,981.13
3	应收股利	-
4	应收利息	173,510.26
5	应收申购款	666,889.13
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	21,790,509.37

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债。

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	000002	万 科A	513,030,000.00	8.27	重大事项停牌
2	600271	航天信息	210,234,105.18	3.39	重大事项停牌

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	7,864,983,184.39
报告期期间基金总申购份额	34,105,917.23
减:报告期期间基金总赎回份额	2,081,480,782.53
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	5,817,608,319.09

注:(1)本基金合同于2015年4月7日生效。

(2)总申购份额含红利再投份额(本基金暂未开通基金转换业务)。

§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

本报告期,本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期,本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立东方红中国优势灵活配置混合型证券投资基金的文件;

2、《东方红中国优势灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

3、《东方红中国优势灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

4、报告期内在指定报刊上披露的各项公告;

5、基金管理人业务资格批件、营业执照;

6、中国证监会要求的其他文件。

8.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所:上海市中山南路318号2号楼31层。

8.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公场所免费查阅备查文件,亦可通过公司网站查阅,公司网址为:www.dfham.com。

上海东方证券资产管理有限公司
2016年1月20日

工银瑞信标普全球自然资源指数证券投资基金(LOF)

【2015】第四季度报告

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:二〇一六年一月二十日

§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2016年1月18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10月1日起至12月31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	23,716,860.93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10月1日 - 2015年12月31日)
1.本期已实现收益	-453,721.83
2.本期利润	403,381.61
3.加权平均基金份额本期利润	0.0179
4.期末基金资产净值	16,795,084.69
5.期末基金份额净值	0.708

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12月31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	1.29%	1.80%	2.46%	1.89%	-1.17%	-0.09%

3.2.2 目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

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		
赵栩	本基金的基金经理	2013年5月28日	-	8	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指数基金基金经理,2015年7月9日至今担任工银瑞信中证500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;未出现请算不到位的情况,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

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基金申购赎回等因素的影响。

本报告期本基金净值增长率为1.29%,业绩比较基准收益率为2.46%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金在报告期内出现连续六十天规模低于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	15,221,070.96	88.70
	其中:普通股	14,092,382.57	82.12
	优先股	-	-
	存托凭证	806,093.49	4.70
	房地产信托凭证	322,594.90	1.88
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	9,851.89	0.06
	其中:远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	9,851.89	0.06
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	1,688,175.02	9.84
8	其他资产	241,593.89	1.41
9	合计	17,160,691.76	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	5,863,321.16	34.91
英国	2,364,631.01	14.08
澳大利亚	1,575,256.89	9.38
加拿大	976,419.97	5.81
瑞士	831,282.06	4.95
日本	812,579.59	4.84
法国	521,740.07	3.11
芬兰	352,009.05	2.10
挪威	351,417.33	2.09
韩国	339,822.65	2.02
德国	289,928.03	1.73
意大利	206,108.46	1.23
新加坡	162,187.85	0.97
中国香港	144,103.87	0.86
爱尔兰	137,969.35	0.82
荷兰	125,637.69	0.75
奥地利	66,166.36	0.39
西班牙	53,134.53	0.32
以色列	47,365.05	0.28
合计	15,221,070.96	90.63

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	9,275,686.16	55.23
能源 Energy	4,985,156.25	29.68
必需消费品 Consumer Staples	637,633.65	3.80
金融 Financials	322,594.90	1.92
合计	15,221,070.96	90.63

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	SYNGENTA AG-REG	先正达股份公司	CH0011037469	瑞士证券交易所	瑞士	331	831,282.05	4.95
2	EXXON MOBIL CORP	埃克森美孚石油	US30231G1022	纽约证券交易所	美国	1,546	782,548.28	4.66
3	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	8,648	730,193.33	4.35
4	MONSANTO CO	孟山都	US61166W1018	纽约证券交易所	美国	831	531,631.81	3.17
5	TOTAL SA	道达尔	FR0000120271	巴黎证券交易所	法国	1,782	521,740.07	3.11
6	BP PLC	BP公司	GB0007980591	伦敦证券交易所	英国	13,430	457,161.04	2.72
7	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	荷兰皇家壳牌	GB00B03MLX29	伦敦证券交易所	英国	2,872	421,433.36	2.51
8	CHEVRON CORP	雪佛龙雪士古	US1667641005	纽约证券交易所	美国	696	406,578.32	2.42
9	NIPPON STEEL & SUMITOMO META	新日铁住金	JP3381000003	东京证券交易所	日本	3,002	390,746.32	2.33
10	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	2,963	329,397.99	1.96

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	TOTAL SA-SCRIP	7,487.56	0.04
2	权证投资	REPSOL SA-RTS	2,364.33	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	应收股利	16,431.13
4	应收利息	327.27
5	应收申购款	224,176.00
6	其他应收款	659.49
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	241,593.89

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	24,544,851.50
报告期期间基金总申购份额	3,672,043.49
减:报告期期间基金总赎回份额	4,500,034.06
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	23,716,860.93

§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。

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一六年一月二十日

工银瑞信财富快线货币市场基金

【2015】第四季度报告

§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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月18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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	工银财富货币
交易代码	000760
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年6月19日
报告期末基金份额总额	1,384,863,907.42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	本基金将采取利率策略、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	中国人民银行公布的七天通知存款税后利率。
风险收益特征	本基金为货币市场基金,在所有证券投资基金中,是风险相对较低的基金产品。在一般情况下,其风险与预期收益均低于一般债券型基金,也低于混合型基金与股票型基金。
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司

§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