

(2016年第1号)

注：由于部分企业的因股价公允价值与账面价值的百分比之和与合计可能有误差，故将期末按公允价值公允价值与账面价值比例大小排序的10家企业单独列示。

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	账面价值	公允价值与账面价值的比例
1	600701	上海医药	698,961	36,760,066.72	3,689	0.689
2	300429	强生新材	100,000	13,900,000.00	0.07	0.07
3	000725	光大证券	600,000	61,470,000.00	0.07	0.07
4	603000	人民网	500,000	11,960,000.00	0.47	0.47
5	600957	华联控股	200,013	13,760,703.67	0.47	0.47
6	600548	广汇能源	400,000	10,400,000.00	0.26	0.26
7	600567	山东黄金	490,918	30,480,270.00	0.43	0.43
8	001101	华鲁恒升	300,000	10,400,500.00	0.63	0.63
9	001019	恒润科技	600,000	10,400,000.00	0.41	0.41
10	600493	中金黄金	1,000,000	9,930,000.00	0.41	0.41

序号	资产名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	503,460,400.00	7.97
2	央行票据	-	-
3	金融债券	713,431,000.00	29.40
4	企业短期融资券	713,431,000.00	29.40
5	企业债券	280,070,548.60	11.01
6	企业中期融资券	310,821,000.00	12.28
7	中期票据	427,070,000.00	17.00
8	可转债(可交换债)	50,593,767.20	2.03
9	资产支持证券	-	-
10	其他	-	-
101	合计	1,986,066,316.70	81.00

注：由于部分员工的股权激励基金资产净值占基金资产净值的比例不同和合计占比不同导致尾差。

6.报告期内股权激励基金资产净值占基金资产净值的比例排名前六的持有人所持证券投资明细

序号	股权激励基金资产净值占比	持仓证券名称	数量 (股)	持仓公允价值 (元)	基金资产净值占比 (%)
1	14.92229	14.92229	1,500,000	361,040.0000	6.64
2	0.11679703	19.11679703	1,500,000	150,360.0000	6.20
3	0.11595886	15.11595886	1,500,000	150,346.0000	6.20
4	14.92228	14.92228	1,000,000	104,040.0000	4.52

7.报告期内股权激励基金资产净值占基金资产净值的比例排名前六的持有人所持证券投资明细

本基金本报告期末未持有证券支持证券。

8.报告期内股权激励基金资产净值占基金资产净值的比例排名前五的基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

9.报告期内股权激励基金资产净值占基金资产净值的比例排名前五的权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9.1本期国债期货投资情况

本报告期内,本基金未运用国债期货进行投资。

9.2报告期末,本基金持仓国债期货合约和持仓国债基金本报告期末未有持仓国债期货合约,也无国债期货持仓。

9.3本期国债期货投资情况

本报告期内,本基金未运用国债期货进行投资。

10.投资资产组合附注

10.1 本基金投资组合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。

10.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存保证金	189,738.04
2	应收证券清算款	63,916,701.97
3	应收股利	-
4	应收利息	36,359,814.66

6	其他投资收益				
7	待摊费用				
8	其他				
9	合计				110,142,925.50

10.6 报告期内发生的处于转股期的可转换债券明细

债券简称	债券代码	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
11	113000B	4,781,386.60	0.30

10.6.5 报告期内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。

10.6.6 报告期内权益类资产公允价值变动的说明

无。

11、基金的投资

基金管理人以诚实信用原则，遵守法律，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，也不对投资收益最低收益做担保。基金的投资运作并不代表其未来表现。投资有风险，投资者应在作出投资决策前咨询专业意见。

本基金的投资组合为：截至2013年12月31日，基金总资产为：截至2013年12月31日的投资

与同期基金业绩的比较如下表所示:						
②跟踪标的基金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)
2018.10.01-2019.12.31	14.00%	0.28%	2.78%	0.62%	2.04%	0.26%
2019年	14.09%	0.30%	0.62%	0.54%	8.07%	0.28%
2019年3月	2.33%	0.22%	0.25%	0.02%	-3.02%	0.03%
2019年4月	64.36%	0.67%	0.25%	0.02%	38.14%	0.01%
2019年6月	14.92%	0.15%	0.25%	0.02%	8.67%	0.01%
自基金合同生效至今	104.01%	0.44%	28.14%	0.62%	75.96%	0.42%
③跟踪标的基金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)

	(1)	(2)	(3)	非标准态		
2011.10.10-2011.12.31	4.40%	0.28%	2.76%	0.02%	1.66%	0.26%
2012年	12.08%	0.39%	0.62%	0.02%	7.30%	0.28%
2013年	1.60%	0.22%	0.26%	0.02%	-4.06%	0.01%
2014年	43.00%	0.63%	0.26%	0.02%	36.94%	0.61%
2015年	14.10%	0.53%	0.26%	0.02%	7.88%	0.51%
自基金合同生效至今	99.87%	0.43%	2.14%	0.02%	60.26%	1.42%

2. 本基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期比较基准收益率变动的比较：
(2011年8月10日至2015年12月31日)

Time Period	Fund Cumulative Net Value Growth Rate (%)	Benchmark Return Rate (%)
2011.08.10	0.00	0.00
2011.12.31	1.66	1.66
2012.12.31	8.96	8.96
2013.12.31	4.90	4.90
2014.12.31	41.84	41.84
2015.12.31	60.26	58.84

注：1、本基金基金合同于2011年8月10日生效；

2、按基金合同规定，本基金合同生效六个月后，截至报告期末，本基金的投资符合基金合同的相关规定；本基金投资债券等固定收益类资产占基金资产的比例不低于80%；股票等权益类资产占基金资产的比例不超过20%，现金及到期日在一年以内的政府债券等占基金资产净值的比例不低

十三、费用概述

1. 与基金运作有关的费用

1.1 基金费用的种类

- (1) 基金管理人管理费；
- (2) 基金托管人的托管费；
- (3) 基金申购、赎回支付的手续费；
- (4) 基金合同生效后的信息披露费；
- (5) 基金中的销售服务费；
- (6) 基金合同生效日与基金有关的会计师费和律师费；
- (7) 基金的证券交易费用；
- (8) 本基金在基金合同约定的财产中承担担保赔偿责任；
- (9) 依法可以在基金财产中支付的其他费用。

2. 上述基金费用由基金管理人按法律法规规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定的从其规定。

2.1 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

基金管理费按基金资产净值的前一日基金资产净值的0.70%年费率计提。计算方法如下：
$$H = E \times 0.70\% = \text{当天应计}$$

为同一基金资产净值。

基金管理人应于每月10日,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,经基金托管人复核无误后,于每月10日按照前一个月工作日从基金财产中一次性支付给基金管理人,遇法定节假日(休息日、非工作日)顺延。

(3) 基金托管人的管理费

基金托管人管理费按前一日基金资产净值的0.20%年费率计提。计算方法如下:

$$H = E \times 0.20\% \times \text{当天天数}$$

其中H为每日应计提的基金托管人管理费

基金管理人应于每月10日,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,经基金托管人复核无误后,于每月10日按照前一个月工作日从基金财产中一次性支付给基金托管人,遇法定节假日(休息日、非工作日)顺延。

(4) 管理费和托管费之外的基金费用,由基金托管人根据其相关法规及协议规定的规定,按费用支出金额支付,列入或当期损益。

(5) 与诉讼有关的费用

基金管理人基金资产为人民币或发生需支付人民币费用的支出或造成基金财产的损失,以及追索基金财产为无条件的或延期支付的损害赔偿金。基金合同生效后前发的信息

(5) 基金管理人基金托管人可以根据基金发展情况调整基金管理费率 and 基金托管费率, 基金管理人必须于前次调整前 21 日前在指定报刊上刊登公告。

二、与基金运作有关的费用

1、管理费

本基金的管理费由基金管理人收取, 费率如下:

本基金的最高管理费不超过基金净值的 1.5%

本基金的管理费由基金管理人向基金持有人收取, 其中不低于赎回费总额的 25% 归入基金财产, 其余部分用于支付注册登记费及有关手续费。

在运作期间和赎回时, 本基金不采用方式收取赎回费。

(1) 运作期间的赎回费

运作期间内, 本基金基金份额的赎回费按赎回基金份额持有人在认购/申购运作期间的持有期限, 即按其认购/申购运作期间的持有期限计算, 其费率如下:

本基金只计算持有期限, 本基金赎回费按持有期限在 1 年以内期间的持有期限计算, 对于基金赎回费持有在当期运作期间以外时, 其赎回费按持有期限的持有期限累计计算。具体赎回费率如下表所示:

费用种类	基金认购/申购持有期限	费率	基金赎回持有期限
		15.00%	

赎回费	7天<Y≤10天	1.00%	Y < 7	1.00%
	10天<Y≤180天	1.00%		
	180天<Y≤365天	0.00%		
	365天<Y≤730天	0.00%	7天<Y≤365天	0.75%
	730天<Y≤1460天	0.00%		
	满1460天, 本基金自动将当期应计未计期间利息(含赎回费)计入赎回款	0.00%	Y≥365天	0%

注：1. 年费按365天计算；赎回10天以内(含)赎回费按赎回持有时间按基金类别基金合同的约定执行，其持有期不满7天的，需按其赎回金额的1.5%来收取赎回费，其持有期满7天，但是不满30天的，需按其赎回金额的1.25%来收取赎回费；

2. 赎回10天以上(含)赎回费按照赎回费按赎回持有时间按基金类别基金合同的约定执行，其持有期不满7天的，需按其赎回金额的1.5%来收取赎回费，其持有期满7天，但是不满30天的，需按其赎回金额的1.25%来收取赎回费，其持有期满30天，但是不满90天的，需按其赎回金额的1.5%来收取赎回费，其持有期满90天，但是不满180天的，需按其赎回金额的1.25%来收取赎回费，其持有期满180天，但是不满365天的，需按其赎回金额的1.5%来收取赎回费，其持有期满365天，但是不满730天的，需按其赎回金额的1.25%来收取赎回费，其持有期满730天，但是不满1460天的，需按其赎回金额的1.5%来收取赎回费，其持有期满1460天，但是不满2920天的，需按其赎回金额的1.25%来收取赎回费，其持有期满2920天，但是不满5840天的，需按其赎回金额的1.5%来收取赎回费，其持有期满5840天，但是不满11680天的，需按其赎回金额的1.25%来收取赎回费，其持有期满11680天，但是不满23360天的，需按其赎回金额的1.5%来收取赎回费，其持有期满23360天，但是不满46720天的，需按其赎回金额的1.25%来收取赎回费，其持有期满46720天，但是不满93440天的，需按其赎回金额的1.5%来收取赎回费，其持有期满93440天，但是不满186880天的，需按其赎回金额的1.25%来收取赎回费，其持有期满186880天，但是不满373760天的，需按其赎回金额的1.5%来收取赎回费，其持有期满373760天，但是不满747520天的，需按其赎回金额的1.25%来收取赎回费，其持有期满747520天，但是不满1495040天的，需按其赎回金额的1.5%来收取赎回费，其持有期满1495040天，但是不满2990080天的，需按其赎回金额的1.25%来收取赎回费，其持有期满2990080天，但是不满5980160天的，需按其赎回金额的1.5%来收取赎回费，其持有期满5980160天，但是不满11960320天的，需按其赎回金额的1.25%来收取赎回费，其持有期满11960320天，但是不满23920640天的，需按其赎回金额的1.5%来收取赎回费，其持有期满23920640天，但是不满47841280天的，需按其赎回金额的1.25%来收取赎回费，其持有期满47841280天，但是不满95682560天的，需按其赎回金额的1.5%来收取赎回费，其持有期满95682560天，但是不满191365120天的，需按其赎回金额的1.25%来收取赎回费，其持有期满191365120天，但是不满382730240天的，需按其赎回金额的1.5%来收取赎回费，其持有期满382730240天，但是不满765460480天的，需按其赎回金额的1.25%来收取赎回费，其持有期满765460480天，但是不满1530920960天的，需按其赎回金额的1.5%来收取赎回费，其持有期满1530920960天，但是不满3061841920天的，需按其赎回金额的1.25%来收取赎回费，其持有期满3061841920天，但是不满6123683840天的，需按其赎回金额的1.5%来收取赎回费，其持有期满6123683840天，但是不满12247367680天的，需按其赎回金额的1.25%来收取赎回费，其持有期满12247367680天，但是不满24494735360天的，需按其赎回金额的1.5%来收取赎回费，其持有期满24494735360天，但是不满48989470720天的，需按其赎回金额的1.25%来收取赎回费，其持有期满48989470720天，但是不满97978941440天的，需按其赎回金额的1.5%来收取赎回费，其持有期满97978941440天，但是不满195957882880天的，需按其赎回金额的1.25%来收取赎回费，其持有期满195957882880天，但是不满391915765760天的，需按其赎回金额的1.5%来收取赎回费，其持有期满391915765760天，但是不满783831531520天的，需按其赎回金额的1.25%来收取赎回费，其持有期满783831531520天，但是不满1567663063040天的，需按其赎回金额的1.5%来收取赎回费，其持有期满1567663063040天，但是不满3135326126080天的，需按其赎回金额的1.25%来收取赎回费，其持有期满3135326126080天，但是不满6270652252160天的，需按其赎回金额的1.5%来收取赎回费，其持有期满6270652252160天，但是不满12541304504320天的，需按其赎回金额的1.25%来收取赎回费，其持有期满12541304504320天，但是不满25082609008640天的，需按其赎回金额的1.5%来收取赎回费，其持有期满25082609008640天，但是不满50165218017280天的，需按其赎回金额的1.25%来收取赎回费，其持有期满50165218017280天，但是不满100330436034560天的，需按其赎回金额的1.5%来收取赎回费，其持有期满100330436034560天，但是不满200660872069120天的，需按其赎回金额的1.25%来收取赎回费，其持有期满200660872069120天，但是不满401321744138240天的，需按其赎回金额的1.5%来收取赎回费，其持有期满401321744138240天，但是不满802643488276480天的，需按其赎回金额的1.25%来收取赎回费，其持有期满802643488276480天，但是不满1605286976552960天的，需按其赎回金额的1.5%来收取赎回费，其持有期满1605286976552960天，但是不满3210573953105920天的，需按其赎回金额的1.25%来收取赎回费，其持有期满3210573953105920天，但是不满6421147906211840天的，需按其赎回金额的1.5%来收取赎回费，其持有期满6421147906211840天，但是不满12842295812423680天的，需按其赎回金额的1.25%来收取赎回费，其持有期满12842295812423680天，但是不满25684591624847360天的，需按其赎回金额的1.5%来收取赎回费，其持有期满25684591624847360天，但是不满51369183249694720天的，需按其赎回金额的1.25%来收取赎回费，其持有期满51369183249694720天，但是不满102738366499389440天的，需按其赎回金额的1.5%来收取赎回费，其持有期满102738366499389440天，但是不满205476732998778880天的，需按其赎回金额的1.25%来收取赎回费，其持有期满205476732998778880天，但是不满410953465997557760天的，需按其赎回金额的1.5%来收取赎回费，其持有期满410953465997557760天，但是不满821906931995115520天的，需按其赎回金额的1.25%来收取赎回费，其持有期满821906931995115520天，但是不满1643813863990231040天的，需按其赎回金额的1.5%来收取赎回费，其持有期满1643813863990231040天，但是不满3287627727980462080天的，需按其赎回金额的1.25%来收取赎回费，其持有期满3287627727980462080天，但是不满6575255455960924160天的，需按其赎回金额的1.5%来收取赎回费，其持有期满6575255455960924160天，但是不满13150510911921848320天的，需按其赎回金额的1.25%来收取赎回费，其持有期满13150510911921848320天，但是不满26301021823843696640天的，需按其赎回金额的1.5%来收取赎回费，其持有期满26301021823843696640天，但是不满52602043647687393280天的，需按其赎回金额的1.25%来收取赎回费，其持有期满52602043647687393280天，但是不满105204087295374786560天的，需按其赎回金额的1.5%来收取赎回费，其持有期满105204087295374786560天，但是不满210408174590749573120天的，需按其赎回金额的1.25%来收取赎回费，其持有期满210408174590749573120天，但是不满420816349181499146240天的，需按其赎回金额的1.5%来收取赎回费，其持有期满420816349181499146240天，但是不满841632698362998292480天的，需按其赎回金额的1.25%来收取赎回费，其持有期满841632698362998292480天，但是不满1683265396725996584960天的，需按其赎回金额的1.5%来收取赎回费，其持有期满1683265396725996584960天，但是不满3366530793511993169920天的，需按其赎回金额的1.25%来收取赎回费，其持有期满3366530793511993169920天，但是不满6733061587023986339840天的，需按其赎回金额的1.5%来收取赎回费，其持有期满6733061587023986339840天，但是不满13466123174047972679680天的，需按其赎回金额的1.25%来收取赎回费，其持有期满13466123174047972679680天，但是不满26932246348095945359360天的，需按其赎回金额的1.5%来收取赎回费，其持有期满26932246348095945359360天，但是不满53864492696191890718720天的，需按其赎回金额的1.25%来收取赎回费，其持有期满53864492696191890718720天，但是不满107728985392383781437440天的，需按其赎回金额的1.5%来收取赎回费，其持有期满10772898539238378143744

2. 在过渡期内,本基金A类基金份额的赎回费率为零。

3. 本基金B类的赎回费率如下:

持有基金份额的时间	B类基金份额的赎回费率
7天<天≤30天	1.5%
天>30天	0%

在基金份额持有期过渡期结束后,本基金赎回费率为基金份额持有人的持有期限,且其持有期大于或等于其赎回基金份额的1.5%和赎回费率。根据《开放式证券投资基金销售费用管理规定》,本基金A类基金份额赎回费全部归入基金财产,本基金B类基金份额赎回费归入基金财产。

3. 转换费

本基金A类基金份额的转换费率,以计算公积金,或支付方式详见本公司官方网站。

4. 赎回费

本基金A类基金份额不收取赎回服务费,B类基金份额的赎回服务费率暂为0.4%。本基金赎回服务费用于1)用于本基金的赎回与基金份额持有人服务,基金管理人将在基金年度报告中对此项费用的列支情况进行披露。

赎回服务费按每一日本基金基金份额的90.40%费率计提,计算方法如下:

赎回服务费=赎回当日基金份额净值×赎回份额×0.40%

注:本基金赎回费扣除赎回服务费用后的余额归基金份额持有人所有。

[illegible]

8、在“二十二、其他应披露的事项”部分,增加了本次更新内容与基金相关的公告。
上述内容仅为更新招募说明书的摘要,投资人欲查询本次更新招募说明书正文,可登陆工银瑞信基金管理有限公司网站www.icbccs.com.cn。

工银瑞信基金管理有限公司
二〇一六年三月二十五日