

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
140229	14国开29	2016年1月6日	107.36	300,000	32,208,000.00
150019	15附息国债19	2016年1月6日	102.01	700,000	71,407,000.00

合计	1,000,000	103,615,000.00
74.93.2 交易所市场债券正回购		
截至本资产负债表日2015年12月31日,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币400,000,000.00元,等于2016年1月1日至12月31日。该类交易要求本基金在回购期内持有的质押式回购下转入息质押的债券,分析会交易所规定的折扣率为标准质押,不低于债券回购利率的说明。		
74.10 有助于理解和评价会计报表需要说明的其他事项		
74.10.1公允价值		
银行存款、结算备付金、应收证券清算款、应收利息、卖出回购金融资产款等,因其剩余期限不长,公允价值与账面价值相若。		

(一) 本公司本期未有可引致公允价值计量的金融工具。截至本报告一次股利分配日人民币1,571,003.80元，属于第二次股利分配的金额为1,010,196.696元。人民币1,571,003.80元，属于第三次股利分配的金额为560,807.103元。2014年12月31日，第一大股东人元通170,520,700元，第二大股东人元通1680,126,000元。

(二) 公允价值计量属性的重大变动

截至本报告一次股利分配日，本公司公允价值计量的金融资产为：本公司持有的公允价值计量的金融资产为：1,010,196.696元，公允价值计量的金融负债为：0元。无公允价值计量的金融工具。

本公司本报告期集中竞价减持资金金会减持关联方元通1,014,024元（元通为元通基金金会减持关联方元通1,014,024元）2014年12月31日，元通基金金会减持关联方元通1,014,024元，2014年12月31日，元通基金金会减持关联方元通1,014,024元，2014年12月31日，元通基金金会减持关联方元通1,014,024元。

本公司本报告期公允价值计量的金融资产为：本公司持有的公允价值计量的金融资产为：1,010,196.696元，公允价值计量的金融负债为：0元。无公允价值计量的金融工具。

截至本报告一次股利分配日，本公司公允价值计量的金融资产为：本公司持有的公允价值计量的金融资产为：1,010,196.696元，公允价值计量的金融负债为：0元。无公允价值计量的金融工具。

74.10.3其他事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

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		-	-
2	固定收益投资	1,015,933,600.85	77.60	
	其中:债券	1,015,933,600.85	77.60	
	资产支持证券		-	-
3	非金融投资		-	-
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	109,984,643.25	8.38
7	其他各项资产	186,622,743.60	14.22
8	合计	1,312,540,987.73	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。

0.2 期末按行业分类的权益投资总额

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合
本基金本报告期末未持有股票。

8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合
无。

R.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前10名股票投资明细
本基金本报告期末未持有股票。
R.4 报告期内股票投资组合的重大变动
R.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细
本基金本报告期内未有股票买入交易。
R.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金报告期内未有股票买卖交易。

8.4.3 买入股票的成本已涵盖及卖出股票的收入总额

本基金报告期内未有股票买卖交易。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	193,031,722.40	26.38
2	央行票据	-	-

3	金融债券	85,451,397.80	11.68
	其中:政策性金融债	85,451,397.80	11.68
4	企业债券	629,360,476.85	86.00
5	企业短期融资券	60,066,000.00	8.21
6	中期票据	41,631,000.00	5.69

7	可转换(可交换)债	6,393,003.80	0.87
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,015,933,600.85	138.83

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误差。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名证券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019162	18国债12	1,200,000	120,588,000.00	16.48
2	156019	15国开债19	700,000	71,407,000.00	9.76
3	140229	14国开债29	400,000	42,944,000.00	5.87
4	137005	13国债05	300,000	30,090,000.00	4.07

4	122,269	142,971	387,000		36,606,000.00	535
5	112,212	142,038	300,000		30,633,000.00	419

8.7 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。

8.8 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贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.9 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。
8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
8.10.1 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。
8.10.2 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。

8.10.3 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。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 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

8.11.2 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。

序号	名称	金额
1	存出保证金	103,070.79
2	应收证券清算款	169,938,410.36

3	应收股利	—
4	应收利息	16,581,262.45
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—

8	其他	-
9	合计	186,622,743.60

8.11.4 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。

8.11.5 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。

持有人户数(户)		持有人结构	
		机构投资者	个人投资者

		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
5,342	123,209.58	53,583,135.60	8.14%	604,602,440.29	91.86%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金		

基金管理人所有从业人员持有本基金	109,239.62	0.02%
------------------	------------	-------

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本公司基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	
本公司基金经理持有本开放式基金	

本基金基金经理持有本开放式基金	0
§ 10 开放式基金份额变动	
基金合同生效日（2014年8月12日）基金份额总额	807,456,337.01
本报告期期初基金份额总额	807,456,337.01

单位：份

本报告期基金总申购份额	456,567,321.72
减:本报告期基金总赎回份额	606,829,082.94
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	--
本报告期期末基金份额总额	658,195,575.89

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

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内,本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1. 基金管理人

基金管理人于2015年6月28日在指定媒介上披露了《银禧信託基金管理有限公司关于副总经理变更的公告》，经基金管理人第四届董事会第四次会议审议并经过，卓万英先生不再担任副总经理职务。

基金管理人于2015年6月2日在指定媒介上披露了《银禧信託基金管理有限公司关于副总经理变更的公告》，经基金管理人第四届董事会第七次会议审议并经过，陈三七先生不再担任副总经理职务。

基金管理人于2015年9月16日在指定媒介上披露了《银禧信託基金管理有限公司董事长变更公告》，经基金管理人第五十七次股东会 and 第四届董事会第十次会议审议通过，陈健祥先生辞去公司董事职务，董长变更为叶立强先生。

2. 基金托管人

经基金托管人决定，邓从国同志自2015年4月1日起担任普华永道会计师事务所总经理职务。

	自2016年7月起,公开“新嘉坡交易所调整规则”名称,并针对上述信息为旗下七只基金进行披露。
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 本报告期内,无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。
11.4	基金投资策略的改变 本基金本报告期无投资策略的改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内应付给安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用捌万元整，该审计机构自基金合同生效日起向本基金提供审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总额的比例	

兴业证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-

注:1.券商的选择标准和程序
(1)选择标准:注重综合服务能力

(2) 选择程序

一起参与投资研究部门：权益投资部、固定收益部、专户投资部、研究部和中央交易室）两个季度对券商的研究服务评估。公司董事会将对券商研究服务评估结果认定是否作为新增合作券商。

②签订委托协议：与被选定的券商签订委托代理协议，明确签订协议双方的公司名称、委托代理期限、佣金率、双方的权利义务等，并签署有效。委托代理协议一式五份，协议双方及证券主管机构各留存一份，我方协议由研究部和战略发展部存档，并按规定转交证券主管机构留存报备。

(2) 对于符合标准的券商,工银瑞信将与其续约;对于不能达到标准的券商,不与其续约,并根据券商选择标准和程序,重新选择其它经营稳健、研究能力强、综合服务质量高的证券经营机构,租用其交易席位。

在报告期内本基金新增信用证证券份额的29933上海交易单元和396332深圳交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

基金名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	交易金额	交易次数	交易金额	占当期债券	交易金额	占当期权证
基金名称						

证券名称	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	回购成交总额的比例	成交金额	成交总额的比例
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	1,722,276,184.75	100.00%	71,073,006,000.00	100.00%	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

1. 根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》，自2015年3月26日起，本基金管理人旗下下海证券投资基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理原则另有规定除外），主要依据以下三个估值机构中提供数据的一方提供的价格数据进行估值。详情请参见2015年3月27日在中国证监会《上海证券报》、证券时报及公司网站发布的《工银瑞信基金管理有限公司关于旗下基金估值交易定价收益互换估值方法的公告》。

根据本基金会的《招募说明书》及《基金合同》约定，本基金会与中本基正达国际（限）公... (01)2015年06月11

1) 关于《委托理财期间理财产品公告》，详见请见《工银瑞信基金管理有限公司关于工银瑞信目标收益一年定期开放债券型证券投资基金计提管理费的公告》。

3) 根据基金管理人于2015年11月14日披露的《工银瑞信基金管理有限公司关于增聘基金经理的公告》，自2015年11月13日起，聘任陆欣先生担任工银瑞信目标收益一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。

4) 根据基金管理人于2015年11月26日披露的《工银瑞信基金管理有限公司关于变更基金经理的公告》，自2015年11月24日起，陆明先生不再担任工银瑞信目标收益一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。
