

工银瑞信双债增强债券型证券投资基金

[2015] 第一季度报告

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:二〇一五年四月二十日§ 1 要点提示
基金管理人的董事、监事、经理及其他高级管理人员声明: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、完整性、及时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,于2015年4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,复核结果表明,不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。
基金管理人过往经营业绩并不代表未来表现,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1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金名称	工银瑞信双债增强债券型证券投资基金
交易代码	164040
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年5月21日
报告期末基金份额总额	412,116,928.75份
投资目标	本基金将在货币型基金的基础上,通过积极主动的可转债、信用债投资管理,追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金将在货币型基金的基础上,通过积极主动的可转债、信用债投资管理,追求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:天相可转债指数收益率+4%+中债企业债全价指数收益率*60%。
风险收益特征	本基金为债券型基金,风险收益特征低于股票型基金,风险收益特征高于货币型基金,风险收益特征介于货币型基金与债券型基金之间。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年1月1日-2015年3月31日)
1.本期已实现收益	31,851,161.79
2.期利润	27,336,829.56
3.期利润/期初基金份额总额	0.0963
4.期末基金资产净值	488,104,764.87
5.期末基金份额净值	1.184

注:(1)本基金的业绩报酬不包括持有人认购或交易本基金的各项费用,计入收益后实际收益水平要低于所列示的。

(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;

本期利润为本期利润收入加上本期期初至价值变动收益。

注:(3)本基金的利润分配方式为现金分红。

3.2 基金份额净值

3.2.1 本期基金份额净值增长率为及其同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长百分比 净值增长标准差(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准标准差(%) (1)-(3) (2)-(4)

过去三个月 5.77% 0.38% 0.23% 0.78% 5.54% -0.40%

3.2.2 基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其同期业绩比较基准收益率变动的比较

图:3.2.2 基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:由于份额五入的原则,原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

单位:人民币元

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	000289	新嘉宜	179,950	3,269,691.50	0.67
2	600892	南玻股份	600,000	3,000,000.00	0.61
3	600031	三一重工	250,000	2,332,500.00	0.52
4	000307	久其股份	119,960	2,358,413.60	0.49
5	601588	北京君正	400,000	2,264,000.00	0.46
6	600375	中交传媒	120,000	2,263,200.00	0.46
7	600643	爱建股份	120,000	2,256,000.00	0.46
8	002226	高利得	200,000	2,218,000.00	0.45
9	600783	晋亿物资	60,000	2,145,600.00	0.44
10	002478	常宝股份	149,977	2,140,171.79	0.44

注:(1)本基金的业绩报酬不包括持有人认购或交易本基金的各项费用,计入收益后实际收益水平要低于所列示的。

(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;

本期利润为本期利润收入加上本期期初至价值变动收益。

注:(3)本基金的利润分配方式为现金分红。

3.3 其他指标

5.6 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名 职务 从本基金的基金经 管理人

王佳 本基金的基 金经理 2013年9月25 日 - 9

4.2 基金经理的任本基金运作期间遵守信义原则的情况

本报告期内,本基金的基金经理按照《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同,勤勉尽责地履行基金合同规定的职责,但未发生任何损害基金利益、损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公司高级管理人员及基金经理等人的过往从业情况

4.4 公司高级管理人员及基金经理等人的过往从业情况

4.5 基金投资组合的定期报告

4.6 投资组合报告

4.7 基金投资组合的定期报告

4.8 影响投资者决策的其他重要信息

4.9 备查文件目录

4.10 基金投资组合的定期报告

4.11 基金投资组合的定期报告

4.12 基金投资组合的定期报告

4.13 基金投资组合的定期报告

4.14 基金投资组合的定期报告

4.15 基金投资组合的定期报告

4.16 基金投资组合的定期报告

4.17 基金投资组合的定期报告

4.18 基金投资组合的定期报告

4.19 基金投资组合的定期报告

4.20 基金投资组合的定期报告

4.21 基金投资组合的定期报告

4.22 基金投资组合的定期报告

4.23 基金投资组合的定期报告

4.24 基金投资组合的定期报告

4.25 基金投资组合的定期报告

4.26 基金投资组合的定期报告

4.27 基金投资组合的定期报告

4.28 基金投资组合的定期报告

4.29 基金投资组合的定期报告

4.30 基金投资组合的定期报告

4.31 基金投资组合的定期报告

4.32 基金投资组合的定期报告

4.33 基金投资组合的定期报告

4.34 基金投资组合的定期报告

4.35 基金投资组合的定期报告

4.36 基金投资组合的定期报告

4.37 基金投资组合的定期报告

4.38 基金投资组合的定期报告

4.39 基金投资组合的定期报告

4.40 基金投资组合的定期报告

4.41 基金投资组合的定期报告

4.42 基金投资组合的定期报告

4.43 基金投资组合的定期报告

4.44 基金投资组合的定期报告

4.45 基金投资组合的定期报告

4.46 基金投资组合的定期报告

4.47 基金投资组合的定期报告

4.48 基金投资组合的定期报告

4.49 基金投资组合的定期报告

4.50 基金投资组合的定期报告

4.51 基金投资组合的定期报告

4.52 基金投资组合的定期报告

4.53 基金投资组合的定期报告

4.54 基金投资组合的定期报告

4.55 基金投资组合的定期报告

4.56 基金投资组合的定期报告

4.57 基金投资组合的定期报告

4.58 基金投资组合的定期报告

4.59 基金投资组合的定期报告

4.60 基金投资组合的定期报告

4.61 基金投资组合的定期报告

4.62 基金投资组合的定期报告

4.63 基金投资组合的定期报告

4.64 基金投资组合的定期报告

4.65 基金投资组合的定期报告

4.66 基金投资组合的定期报告

4.67 基金投资组合的定期报告

4.68 基金投资组合的定期报告

4.69 基金投资组合的定期报告

4.70 基金投资组合的定期报告

4.71 基金投资组合的定期报告

4.72 基金投资组合的定期报告

4.73 基金投资组合的定期报告

4.74 基金投资组合的定期报告

4.75 基金投资组合的定期报告

4.76 基金投资组合的定期报告

4.77 基金投资组合的定期报告

4.78 基金投资组合的定期报告

4.79 基金投资组合的定期报告

4.80 基金投资组合的定期报告

4.81 基金投资组合的定期报告

4.82 基金投资组合的定期报告

4.83 基金投资组合的定期报告

4.84 基金投资组合的定期报告

4.85 基金投资组合的定期报告

4.86 基金投资组合的定期报告

4.87 基金投资组合的定期报告

4.88 基金投资组合的定期报告

4.89 基金投资组合的定期报告

4.90 基金投资组合的定期报告

4.91 基金投资组合的定期报告

4.92 基金投资组合的定期报告

4.93 基金投资组合的定期报告

4.94 基金投资组合的定期报告

4.95 基金投资组合的定期报告

4.96 基金投资组合的定期报告

4.97 基金投资组合的定期报告

4.98 基金投资组合的定期报告