

工银瑞信核心价值股票型证券投资基金

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 重要提示

基金管理人和基金托管人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。

基金托管人中行银行股份有限公司根据本基金合同规定，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等内容，复核结果表明：不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对本基金的内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金投资运作秉承以诚实信用、勤勉尽责的原则运用基金资产，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。

本报告期无内幕资料未公开。

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

基金简称 工银瑞信核心价值股票型证券投资基金

交易代码 481009

基金运作方式 契约型开放式

报告期末基金资产总额 2065.78亿元

报告期末基金份额总额 12,988,562,788.34份

投资目标 有效控制资产风险，追求本基金的长期稳定增值。

投资策略 本基金将充分考虑宏观经济、行业趋势、公司基本面、估值水平、资金面等多方面的因素，通过自下而上、自上而下的投资策略，精选具有核心竞争力、估值合理、成长性突出的股票进行投资，追求基金资产的长期稳定增值。

业绩比较基准 上证综指×30%+深证综指×28%+中证贵金属指数×20%+债券指数×12%+货币市场指数×10%

风险收益特征 本基金的过往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。

本报告期无内幕资料未公开。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

报告期(2015年1月1日-2015年3月31日)

1.本期实现收益 954,183,674.65

2.本期利润 1,499,513,918.60

3.加权平均基金份额本期利润 0.1087

4.期末基金资产净值 7,031,676,838.78

5.期末基金份额净值 0.5414

注:1.上述基金的利润指根据《基金合同》规定，计入费用后实际收益水平低于所列数字。

(2)本期利润指基金利润扣除管理费、托管费后的余额，即为可供分配给基金份额持有人的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期可供分配的金额。

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

报告期(2015年1月1日-2015年3月31日)

1.本期实现收益 954,183,674.65

2.本期利润 1,499,513,918.60

3.加权平均基金份额本期利润 0.1087

4.期末基金资产净值 7,031,676,838.78

5.期末基金份额净值 0.5414

注:1.上述基金的利润指根据《基金合同》规定，计入费用后实际收益水平低于所列数字。

(2)本期利润指基金利润扣除管理费、托管费后的余额，即为可供分配给基金份额持有人的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期可供分配的金额。

3.3 列表所列数据截止到2015年3月31日。

3.2 基金的基本情况

3.2.1 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 (%) 净值增长标准差② (%) 业绩比较基准收益率③ (%) 业绩比较基准收益率④ (%) ①-③ (%) ②-④ (%)

过去三个月 25.61% 1.50% 11.07% 1.37% 14.54% 0.13%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

日期 2014年1月1日至2015年3月31日

净值增长率 13.97% 1.71% 13.92% 1.74% 0.05% -0.03%

注:由于四舍五入的原因公允价值占基金资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

3.3 报告期末未按基金资产类别分项披露的资产配置情况

序号 股票代码 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值的比例(%)

1 农林、牧、渔业 - -

2 采矿业 20,229,026.96 0.29

3 制造业 2,101,738,419.01 29.89

4 电力、热力、燃气及水生产和供应业 341,498,016.99 4.86

5 建筑业 39,637,147.00 0.56

6 批发零售业 332,102,849.90 4.72

7 交通运输、仓储和邮政业 144,794,055.82 2.05

8 住宿和餐饮业 - -

9 信息传输、软件和信息技术服务业 825,324,827.15 11.74

10 公用事业 140,626,531.98 20.89

11 房地产业 688,712,048.28 9.79

12 租赁、批发和商务服务业 - -

13 科学、技术服务业 - -

14 水利、环境和公共设施管理业 24,760,216.65 0.35

15 居民服务、修理和其他服务业 - -

16 教育 - -

17 卫生和社会工作 - -

18 文化、体育和娱乐业 449,439,905.88 6.39

19 其他 - -

20 合计 6,436,664,498.62 91.54

注:由于四舍五入的原因公允价值占基金资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

3.4 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) 占基金资产净值的比例(%)

1 采矿业 - -

2 制造业 340,000,000.00 4.72

3 交通运输、仓储和邮政业 - -

4 住宿和餐饮业 - -

5 信息传输、软件和信息技术服务业 200,000,000.00 2.78

6 电力、热力、燃气及水生产和供应业 158,664,769.61 2.20

7 其他 66,546,993.12 0.92

8 合计 7,301,876,261.35 100.00

注:由于四舍五入的原因公允价值占基金资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

3.5 报告期末按行业分类的债券投资组合

序号 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值的比例(%)

1 农林、牧、渔业 - -

2 采矿业 20,229,026.96 0.29

3 制造业 2,101,738,419.01 29.89

4 电力、热力、燃气及水生产和供应业 341,498,016.99 4.86

5 建筑业 39,637,147.00 0.56

6 批发零售业 332,102,849.90 4.72

7 交通运输、仓储和邮政业 144,794,055.82 2.05

8 住宿和餐饮业 - -

9 信息传输、软件和信息技术服务业 825,324,827.15 11.74

10 公用事业 140,626,531.98 20.89

11 房地产业 688,712,048.28 9.79

12 租赁、批发和商务服务业 - -

13 科学、技术服务业 - -

14 水利、环境和公共设施管理业 24,760,216.65 0.35

15 居民服务、修理和其他服务业 - -

16 教育 - -

17 卫生和社会工作 - -

18 文化、体育和娱乐业 449,439,905.88 6.39

19 其他 - -

20 合计 158,664,769.61 2.20

注:由于四舍五入的原因公允价值占基金资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

3.6 报告期末按行业分类的贵金属投资

序号 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值的比例(%)

1 采矿业 - -

2 制造业 - -

3 交通运输、仓储和邮政业 - -

4 住宿和餐饮业 - -

5 信息传输、软件和信息技术服务业 - -

6 电力、热力、燃气及水生产和供应业 - -

7 其他 - -

8 合计 - -

注:由于四舍五入的原因公允价值占基金资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

3.7 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) 占基金资产净值的比例(%)

1 采矿业 - -

2 制造业 340,000,000.00 4.72

3 交通运输、仓储和邮政业 - -

4 住宿和餐饮业 - -

5 信息传输、软件和信息技术服务业 - -

6 电力、热力、燃气及水生产和供应业 - -

7 其他 - -

8 合计 340,000,000.00 4.72

注:由于四舍五入的原因公允价值占基金资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

3.8 报告期末按行业分类的债券投资

序号 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值的比例(%)

1 采矿业 - -

2 制造业 - -

3 交通运输、仓储和邮政业 - -

4 住宿和餐饮业 - -

5 信息传输、软件和信息技术服务业 - -

6 电力、热力、燃气及水生产和供应业 - -

7 其他 - -

8 合计 - -

注:由于四舍五入的原因公允价值占基金资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

3.9 其他指标

注:1.本基金合同于2009年3月31日生效，截至报告期末，本基金的投资组合比例不存在股票、债券、基金资产占总资产的比例低于50%的情况，但因法律法规或合同规定导致的股票、债券、基金资产占总资产的比例低于50%的情况除外。

2.本基金合同规定，本基金投资于股票的比例为90%—95%，投资于债券的比例为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的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的5%—10%。

3.所列数据截至2015年3月31日止。

3.2.1 报告期末基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

</div