

## 工银瑞信研究精选股票型证券投资基金

[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:招商银行股份有限公司  
报告期截止日期: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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据基金合同规定，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:工银瑞信研究精选股票基金

交易代码:000003

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2014年10月23日

报告期末基金份额总额:562,965,040.64份

报告期未发生巨额赎回情况。

投资目标:通过深入研究,深入分析,把握具有长期投资价值和估值优势的上市公司,实现基金资产的长期稳定增值。

本基金将充分把握基金经理人的投资优势,将基本面研究、系统、挑剔的行业研究及股票配置相结合,采取自下而上精选个股的策略,在有效控制风险的前提下,实现基金资产的长期稳定增值。

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。

§ 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10月1日 - 2015年12月31日) 9,006,932.86

2.本期利润 69,320,000.54

3.期末可供分配基金份额利润 0.07670

4.期末基金资产净值 240,557,069.73

5.期末基金份额总额 562,965,040.64

注:1)本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不计费用的。

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”为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3)所列数据截至2015年12月31日。

4.2.1 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变动的比较

注:由于四舍五入的原因,基金净值增长率的百分比之和与合计可能有尾差。

5.3 报告期未按公允价值分项核算的基金资产的账面价值(单位:人民币元)

A. 权益投资 236,906,861.68 94.09

B. 货币市场基金 - -

C. 固定收益投资 - -

其中:债券 - -

资产支持证券 - -

D. 货币市场基金 - -

E. 金融衍生品投资 - -

F. 其他 - -

G. 买入返售金融资产 - -

H. 银行存款和结算备付金合计 10,186,370.24 4.06

I. 其他资产 4,699,912.40 1.57

J. 合计 261,793,144.52 100.00

注:由于四舍五入的原因,基金资产的百分比之和与合计可能有尾差。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

注:由于四舍五入的原因,基金资产的百分比之和与合计可能有尾差。

5.3 行业分类

报告期(2015年10月1日 - 2015年12月31日) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

A. 农、林、牧、渔业 24,019,364.58 10.03

B. 采矿业 9,710,738.00 3.91

C. 制造业 36,267,551.37 14.60

D. 电力、热力、燃气及水生产和供应业 12,730,128.00 5.12

E. 建筑业 5,653,963.36 2.27

F. 批发和零售业 - -

G. 交通运输、仓储和邮政业 14,407,836.37 5.80

H. 住宿和餐饮业 - -

I. 信息传输、软件和信息技术服务业 27,044,963.00 11.24

J. 金融业 37,822,770.00 11.19

K. 房地产业 37,978,792.00 15.28

L. 租赁和商务服务业 12,465,100.00 5.01

M. 科学研究和技术服务业 - -

N. 水利、环境和公共设施管理业 - -

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 27,014,668.00 10.07

S. 纳税 - -

合计 236,906,861.68 95.31

注:由于四舍五入的原因,基金资产的百分比之和与合计可能有尾差。

5.3.1 本报告期未按公允价值分项核算的基金资产的账面价值(单位:人民币元)

A. 权益投资 236,906,861.68 94.09

B. 货币市场基金 - -

C. 固定收益投资 - -

D. 货币市场基金 - -

E. 金融衍生品投资 - -

F. 其他 - -

G. 买入返售金融资产 - -

H. 银行存款和结算备付金合计 10,186,370.24 4.06

I. 其他资产 4,699,912.40 1.57

J. 合计 261,793,144.52 100.00

注:由于四舍五入的原因,基金资产的百分比之和与合计可能有尾差。

5.3.2 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变动的比较

注:由于四舍五入的原因,基金资产的百分比之和与合计可能有尾差。

5.3.3 本报告期未按公允价值分项核算的基金资产的账面价值(单位:人民币元)

A. 权益投资 236,906,861.68 94.09

B. 货币市场基金 - -

C. 固定收益投资 - -

D. 货币市场基金 - -

E. 金融衍生品投资 - -

F. 其他 - -

G. 买入返售金融资产 - -

H. 银行存款和结算备付金合计 10,186,370.24 4.06

I. 其他资产 4,699,912.40 1.57

J. 合计 261,793,144.52 100.00

注:由于四舍五入的原因,基金资产的百分比之和与合计可能有尾差。

5.3.4 本报告期未按公允价值分项核算的基金资产的账面价值(单位:人民币元)

A. 权益投资 236,906,861.68 94.09

B. 货币市场基金 - -

C. 固定收益投资 - -

D. 货币市场基金 - -

E. 金融衍生品投资 - -

F. 其他 - -

G. 买入返售金融资产 - -

H. 银行存款和结算备付金合计 10,186,370.24 4.06

I. 其他资产 4,699,912.40 1.57

J. 合计 261,793,144.52 100.00

注:由于四舍五入的原因,基金资产的百分比之和与合计可能有尾差。

5.3.5 本报告期未按公允价值分项核算的基金资产的账面价值(单位:人民币元)

A. 权益投资 236,906,861.68 94.09

B. 货币市场基金 - -

C. 固定收益投资 - -

D. 货币市场基金 - -

E. 金融衍生品投资 - -

F. 其他 - -

G. 买入返售金融资产 - -

H. 银行存款和结算备付金合计 10,186,370.24 4.06

I. 其他资产 4,699,912.40 1.57

J. 合计 261,793,144.52 100.00

注:由于四舍五入的原因,基金资产的百分比之和与合计可能有尾差。

5.3.6 本报告期未按公允价值分项核算的基金资产的账面价值(单位:人民币元)

A. 权益投资 236,906,861.68 94.09

B. 货币市场基金 - -

C. 固定收益投资 - -

D. 货币市场基金 - -

E. 金融衍生品投资 - -

F. 其他 - -

G. 买入返售金融资产 - -

H. 银行存款和结算备付金合计 10,186,370.24 4.06

I. 其他资产 4,699,912.40 1.57

J. 合计 261,793,144.52 100.00

注:由于四舍五入的原因,基金资产的百分比之和与合计可能有尾差。

5.3.7 本报告期未按公允价值分项核算的基金资产的账面价值(单位:人民币元)

A. 权益投资 236,906,861.68 94.09

B. 货币市场基金 - -

C. 固定收益投资 - -

D. 货币市场基金 - -

E. 金融衍生品投资 - -

F. 其他 - -

G. 买入返售金融资产 - -

H. 银行存款和结算备付金合计 10,186,370.24 4.06

I. 其他资产 4,699,912.40 1.57

J. 合计 261,793,144.52 100.00

注:由于四舍五入的原因,基金资产的百分比之和与合计可能有尾差。

5.3.8 本报告期未按公允价值分项核算的基金资产的账面价值(单位:人民币元)

A. 权益投资 236,906,861.68 94.09

B. 货币市场基金 - -

C. 固定收益投资 - -

D. 货币市场基金 - -

E. 金融衍生品投资 - -

F. 其他 - -

G. 买入返售金融资产 - -

H. 银行存款和结算备付金合计 10,186,370.24 4.06

I. 其他资产 4,699,912.40 1.57

J. 合计 261,793,144.52 100.00

注:由于四舍五入的原因,基金资产的百分比之和与合计可能有尾差。

5.3.9 本报告期未按公允价值分项核算的基金资产的账面价值(单位:人民币元)

A. 权益投资 236,906,861.68 94.09

B. 货币市场基金 - -

C. 固定收益投资 - -

D. 货币市场基金 - -