

2016 第一季

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	3,310,578,368.32	82.82
	其中:股票	3,310,578,368.32	82.82
2	债券投资	--	--
3	固定收益投资	--	--
	其中:债券	--	--
	资产支持证券	--	--
4	贵金属投资	--	--
5	金融衍生品投资	--	--
6	买入返售金融资产	437,000,418.50	10.93
	其中:买入返售的买入返售金融资产	--	--
7	银行存款和结算备付金合计	246,172,613.01	6.13
8	其他资产	4,749,258.05	0.12
9	合计	3,997,503,048.88	100.00

注:由于四舍五入的原因,基金总资产占基金总资产的比例之和与合计可能有尾差。

6.2 报告期末按行业分类的境内权益投资情况

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	--	--
B	采矿业	--	--
C	制造业	2,547,628,823.92	64.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	--	--
E	建筑业	36,224.48	0.00
F	批发和零售业	428,560,000.00	10.84
G	交通运输、仓储和邮政业	--	--
H	住宿和餐饮业	--	--
I	信息传输、软件和信息技术服务业	148,984,960.02	3.76
J	金融业	--	--
K	房地产业	--	--
L	租赁和商务服务业	--	--
M	科学研究和技术服务业	--	--
N	水利、环境和公共设施管理业	23,518,800.00	0.59
O	居民服务、修理和其他服务业	--	--
P	教育	--	--
Q	卫生和社会工作	167,050,000.00	4.10

8	文化、教育和卫生业	合计	9,310,576,808.32	83.73
---	-----------	----	------------------	-------

注：由于报告期内本公司的公允价值计量金融资产净值的变化情况和持仓可能有所调整，5.2.2 报告期末按行业分类的公允价值计量投资资产情况如下：

5.3 报告期末按公允价值计量金融资产公允价值大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000566	海南橡胶	14,000,000	326,480,000.00	6.26
2	000078	北京科迪	18,000,000	226,230,000.00	4.37
3	002814	际华集团	20,000,000	271,000,000.00	5.18
4	300093	乐普医疗	6,500,000	241,085,000.00	4.55
5	002076	凯光电子	5,000,000	228,150,000.00	4.37
6	000087	通化东堡	9,000,000	217,440,000.00	4.10
7	000538	云南铜业	3,062,635	179,739,526.50	3.40
8	000423	振华重工	10,000,000	169,020,000.00	3.20
9	000763	通策医疗	5,000,000	162,060,000.00	3.10
10	000718	东联集团	7,946,874	148,844,960.02	2.76

5.4 报告期末按公允价值计量的前五大债券投资明细

5.4.1 报告期末本基金持有的公允价值计量前五名的债券投资组合明细

5.4.2 报告期末本基金持有的公允价值计量前五名的资产支持证券投资明细

5.4.3 报告期末本基金持有的公允价值计量前五名的权证投资组合明细

5.5 报告期末按公允价值计量金融资产公允价值大小排序的前十名资产支持证券投资明细

5.6 报告期末按公允价值计量金融资产公允价值大小排序的前五名权证投资明细

5.7 报告期末按公允价值计量金融资产公允价值大小排序的前五名股指期货投资明细

5.8 报告期末按公允价值计量金融资产公允价值大小排序的前五名国债期货投资明细

5.9 报告期末按公允价值计量金融资产公允价值大小排序的前五名商品期货投资明细

6 报告期末本基金投资组合报告附注

6.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况

6.2 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况

6.3 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况

6.4 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况

6.5 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况

6.6 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况

6.7 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况

6.8 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况

6.9 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况

6.10 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况

6.11 本报告期投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况

本基金本报告期末未持有国债期货投资,也无期间损益。

5.10.3 股指期货投资情况

报告期内,本基金未运用股指期货进行投资。

5.11 投资组合报告

5.11.1 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、处罚的情况。

5.11.2 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。

5.12 其他资产

序号	名称	金额(元)
1	应收国债正金	1,521,960.19
2	应收国债利息款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	165,912.66
5	应收申购款	3,077,388.19
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,749,258.88

5.12.1 报告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可转换债券。

5.12.2 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.12.3 报告期末前十名资产支持证券投资明细

5.12.4 报告期末按公允价值计量的金融资产公允价值变动明细

5.12.5 报告期末按公允价值计量的其他资产公允价值变动明细

报告期间期初基金资产总额	3,467,085,453.71
报告期间期末基金资产总额	412,796,663.98
减:报告期间基金总资产减少	653,306,527.40
报告期间基金资产变动额(份额减少以“-”填列)	-
报告期间未实现资产增值	3,216,763,570.29

注:1. 报告期间基金总资产增加系因公允价值变动,转入收入。
2. 报告期间基金总资产减少系因公允价值变动,转入支出。

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金的情况。

§ 8 报告期内基金管理人的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1. 中国证监会核准《国银国际证券(香港)有限公司证券交易及资产管理业务集中备案的注册文件》;
2. 中国证监会核准《国银国际证券(香港)有限公司证券投资资金管理业务合同》;
3. 中国证监会核准《国银国际证券(香港)有限公司证券投资资金管理信托协议》;
4. 基金管理人业务资格和条件、资质证明;
5. 基金管理人业务资格和条件、资质证明;
6. 香港金融服务管理局在《年报》及网站上披露的各项公告。

9.2 存放地

基金管理人或基金托管人住所。

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间可免费查阅,在支付工本费后,可在营业时间内的取得上述文件的复印件或复印件。

任职日期	职务及 从业年限	说明	序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值
		曾任中海基金管理有限公司基金经理;2010年加入工银瑞信,现任固定收益投资总监。2010年8月16日至今,担任工银双利债券型基金基金经理。2011年12月27日至今担任工银双利大货币型基金基金经理。2015年7月2日至今担任工银双利2号	1	600030	中信证券	1,000,000	17.00
			2	601688	华泰证券	999,943	17.00
			3	300059	东方财富	200,000	8.40

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	003277	东方海洋	6,336	239,460.88	0.04
2	000009	金城股份	16,362	215,763.50	0.04
3	600306	东方集团	7,994	112,796.34	0.02
4	002295	瀚蓝环保	3,683	98,388.18	0.02

5.4 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资产支持证券明细

序号	债券品种	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	国债逆回购	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
4	其中:政策性金融债	—	—
5	企业债券	—	—
6	企业短期融资券	—	—
7	可转债 (含可交换)	2,601,000.00	0.44
8	资产支持证券	—	—
9	其他	—	—
合计		2,601,000.00	0.44

注:报告期内买入的国债公允价值占基金资产净值的比例之和不超过10%;报告期内持有的可转债公允价值占基金资产净值的比例之和不超过3%。

5.5 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权证投资明细

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	129010	鹏华转债	26,010	2,601,000.00	0.44

5.6 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资产支持证券明细

本基金本报告期末持有资产支持证券。

5.7 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股指期货投资明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债逆回购交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的国债逆回购交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债逆回购交易,也无到期国债。

5.9.2 本报告期本基金投资的国债逆回购交易情况说明

本报告期间,本基金未进行国债逆回购进行投资。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本报告期国债期货投资情况说明

本报告期间,本基金未进行国债期货进行投资。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和交易明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约,也无到期国债。

5.10.3 本报告期国债期货投资情况说明

[illegible]