

## 工银瑞信稳健成长混合型证券投资基金

[2016] 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:中国建设银行股份有限公司

报告送出日期:二〇一六年四月二十二日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事及董事会对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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年4月20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。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2016年1月1日起至3月31日止。

## § 2 基金产品概况

| 序号 | 项目           | 金额(元)            | 占基金总资产的比例(%) |
|----|--------------|------------------|--------------|
| 1  | 权益投资         | 2,183,109,440.36 | 93.47        |
| 2  | 固定收益类投资      | 2,183,109,440.36 | 93.47        |
| 3  | 货币市场类投资      | -                | -            |
| 4  | 银行存款         | -                | -            |
| 5  | 现金类投资        | -                | -            |
| 6  | 买入返售金融资产     | -                | -            |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计 | 119,097,534.06   | 0.69         |
| 8  | 其他资产         | 33,643,034.68    | 1.44         |
| 9  | 合计           | 2,326,640,073.00 | 100.00       |

注:由于四舍五入的原因基金资产占基金总资产的比例分项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

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业名称             | 公允价值(元)          | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------------------|------------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | 2,176,000        | 0.09         |
| B  | 煤炭开采             | 21,184,869.61    | 0.96         |
| C  | 制造业              | 1,403,940,610.40 | 60.74        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 23,304,701.18    | 1.01         |
| E  | 建筑业              | 72,736,369.04    | 3.16         |
| F  | 批发和零售业           | 45,195,060.20    | 1.98         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 6,335,155.18     | 0.27         |
| H  | 住宿和餐饮业           | 87,150           | 0.09         |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 262,309,516.61   | 1.04         |
| J  | 金融业              | 114,089,696.06   | 4.87         |
| K  | 房地产业             | 161,312,691.12   | 7.20         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 7,897,897.02     | 0.34         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | -                | -            |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 5,219,321.00     | 0.14         |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -                | -            |
| P  | 教育               | 62,273,003.00    | 2.63         |
| Q  | 卫生和社会工作          | 2,376,000        | 0.09         |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | 361,617.00       | 0.01         |
| S  | 其他               | 54,653           | 0.01         |
| 合计 |                  | 2,326,640,073.00 | 100.00       |

注:由于四舍五入的原因基金资产占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.3 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业名称  | 公允价值(元)          | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-------|------------------|--------------|
| 1  | 电子元件  | -89,038,724.48   | -            |
| 2  | 通信设备  | -607,543,970.46  | -            |
| 3  | 计算机应用 | -360.05          | -            |
| 4  | 医药生物  | -                | -            |
| 5  | 家用电器  | -                | -            |
| 6  | 食品饮料  | -                | -            |
| 7  | 机械设备  | -                | -            |
| 8  | 采掘业   | -                | -            |
| 9  | 轻工制造  | -                | -            |
| 10 | 汽车工业  | -                | -            |
| 11 | 综合类   | 2,311,569,891.52 | 100.00       |

注:1.上述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所列数字。

2.本期已实现收益”指本基金本期利息收入、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2016年3月31日。

## 3.2 基金净值表现

3.2.1 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的比较

单位:人民币元

报告期

净值增长率

净值增长率标准差

业绩比较基准收益率

业绩比较基准收益率标准差

① -0.25%

② -0.05%

③ -0.05%

④ -0.05%

⑤ -0.05%

⑥ -0.05%

⑦ -0.05%

⑧ -0.05%

⑨ -0.05%

⑩ -0.05%

⑪ -0.05%

⑫ -0.05%

⑬ -0.05%

⑭ -0.05%

⑮ -0.05%

⑯ -0.05%

⑰ -0.05%

⑱ -0.05%

⑲ -0.05%

⑳ -0.05%

㉑ -0.05%

㉒ -0.05%

㉓ -0.05%

㉔ -0.05%

㉕ -0.05%

㉖ -0.05%

㉗ -0.05%

㉘ -0.05%

㉙ -0.05%

㉚ -0.05%

㉛ -0.05%

㉜ -0.05%

㉝ -0.05%

㉞ -0.05%

㉟ -0.05%

㉟ -0.05%

㉟ -0.05%

㉟ -0.05%

㉟ -0.05%

㉟ -0.05%

㉟ -0.05%

㉟ -0.05%

㉟ -0.05%

㉟ -0.05%

㉟ -0.05%

㉟ -0.05%

㉟ -0.05%

㉟ -0.05%

㉟ -0.05%

㉟ -0.05%

㉟ -0.05%

㉟ -0.05%

㉟ -0.05%

㉟ -0.05%

㉟ -0.05%

㉟ -0.05%

㉟ -0.05%

㉟ -0.05%

㉟ -0.05%

㉟ -0.05%

㉟ -0.05%

㉟ -0.05%

㉟ -0.05%

㉟ -0.05%

㉟ -0.05%

㉟ -0.05%

㉟ -0.05%

㉟ -0.05%

㉟ -0.05%

㉟ -0.05%

㉟ -0.05%

㉟ -0.05%

㉟ -0.05%

㉟ -0.05%

㉟ -0.05%

㉟ -0.05%

㉟ -0.05%

㉟ -0.05%

㉟ -0.05%

㉟ -0.05%

㉟ -0.05%

㉟ -0.05%

㉟ -0.05%

㉟ -0.05%

㉟ -0.05%

㉟ -0.05%

㉟ -0.05%

㉟ -0.05%

㉟ -0.05%

㉟ -0.05%

㉟ -0.05%</