

工银瑞信双债增强债券型证券投资基金

[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

基金管理人的董事会及高级管理人员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。

基金托管人中银银行股份有限公司根据本基金合同的规定,于2016年4月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和资产配置等数据,确认报告的内容真实准确,并同意将本基金的定期报告予以披露。

基金的托管人承诺对本报告的内容承担法律责任,但不对报告内容的真实性、准确性和完整性承担连带责任。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。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。

报告书中财务数据未经审计。

本基金报告期自2016年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 工银瑞信双债增强

场内简称 工银双债

交易代码 164014

基金合同生效日 2013年3月1日

报告期末基金份额总额 412,116,026.07份

投资目标 在控制资产风险的前提下,通过积极主动的久期调整,信用债投资管理,追求基金资产的长期稳定增值。

投资策略 本基金在在货币市场基金的基础上,通过构建债券组合以获取相对稳定的收益,同时通过信用债投资,追求基金资产的长期稳定增值。

业绩比较基准 天天盈利债券型基金收益率+40%。中型企业债+平抑利率风险的股票型基金收益率。

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市场基金,风险收益特征低于债券型基金。

风险收益特征 分级债券的纯债部分的预期收益比纯债基金的预期收益高30%。而分级债券的纯债部分的预期收益比货币基金的预期收益高30%。而分级债券的纯债部分的预期收益比货币基金的预期收益高30%。而分级债券的纯债部分的预期收益比货币基金的预期收益高30%。而分级债券的纯债部分的预期收益比货币基金的预期收益高30%。而分级债券的纯债部分的预期收益比货币基金的预期收益高30%。而分级债券的纯债部分的预期收益比货币基金的预期收益高30%。而分级债券的纯债部分的预期收益比货币基金的预期收益高30%。

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

§ 3 主要财务指标

单位:人民币元

报告期(2016年1月1日~2016年3月31日)

1.本期实现收益 -2,439,589.11

2.本期利润 -1,624,946.63

3.报告期平均基金份额利润率 -0.0509

4.期末基金份额净值 430,138,943.23

5.期末基金资产净值 1,044

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据。

2.“本期已实现收益”指本期利润收入,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。

3.2016年3月31日,本基金合同生效以来基金资产净值的年平均增长率为-0.14%。

3.2.1.1 本基金合同生效以来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

注:由于四舍五入的原因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。

5.2.2 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。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资组合

注:由于四舍五入的原因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。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:由于四舍五入的原因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。

5.2.1.2 本基金合同生效以来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

注:由于四舍五入的原因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。

5.2.2.2 本基金合同生效以来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

注:由于四舍五入的原因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。

5.2.3 本基金合同生效以来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

注:由于四舍五入的原因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。

5.2.4 本基金合同生效以来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

注:由于四舍五入的原因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。

5.2.5 本基金合同生效以来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

注:由于四舍五入的原因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。

5.2.6 本基金合同生效以来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

注:由于四舍五入的原因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。

5.2.7 本基金合同生效以来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

注:由于四舍五入的原因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。

5.2.8 本基金合同生效以来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

注:由于四舍五入的原因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。

5.2.9 本基金合同生效以来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

注:由于四舍五入的原因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。

5.2.10 本基金合同生效以来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

注:由于四舍五入的原因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。

5.2.11 本基金合同生效以来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

注:由于四舍五入的原因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。

5.2.12 本基金合同生效以来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

注:由于四舍五入的原因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。

5.2.13 本基金合同生效以来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

注:由于四舍五入的原因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。

5.2.14 本基金合同生效以来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

注:由于四舍五入的原因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。

5.2.15 本基金合同生效以来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

注:由于四舍五入的原因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。

5.2.16 本基金合同生效以来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

注:由于四舍五入的原因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。

5.2.17 本基金合同生效以来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

注:由于四舍五入的原因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。

5.2.18 本基金合同生效以来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

注:由于四舍五入的原因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。

5.2.19 本基金合同生效以来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

注:由于四舍五入的原因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。

5.2.20 本基金合同生效以来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

注:由于四舍五入的原因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。

5.2.21 本基金合同生效以来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

注:由于四舍五入的原因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。

5.2.22 本基金合同生效以来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

注:由于四舍五入的原因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。

5.2.23 本基金合同生效以来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

注:由于四舍五入的原因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。

5.2.24 本基金合同生效以来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

注:由于四舍五入的原因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。

5.2.25 本基金合同生效以来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

注:由于四舍五入的原因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。

5.2.26 本基金合同生效以来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

注:由于四舍五入的原因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。

5.2.27 本基金合同生效以来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

注:由于四舍五入的原因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。

5.2.28 本基金合同生效以来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

注:由于四舍五入的原因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。

5.2.29 本基金合同生效以来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

注:由于四舍五入的原因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。

5.2.30 本基金合同生效以来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

注:由于四舍五入的原因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。

5.2.31 本基金合同生效以来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

注:由于四舍五入的原因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。

5.2.32 本基金合同生效以来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

注:由于四舍五入的原因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。

5.2.33 本基金合同生效以来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

注:由于四舍五入的原因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。

5.2.34 本基金合同生效以来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

注:由于四舍五入的原因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。

5.2.35 本基金合同生效以来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

注:由于四舍五入的原因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。

5.2.36 本基金合同生效以来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

注:由于四舍五入的原因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。

5.2.37 本基金合同生效以来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

注:由于四舍五入的原因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。

5.2.38 本基金合同生效以来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

注:由于四舍五入的原因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。

5.2.39 本基金合同生效以来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

注:由于四舍五入的原因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。

5.2.40 本基金合同生效以来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

注:由于四舍五入的原因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。

5.2.41 本基金合同生效以来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

注:由于四舍五入的原因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。

5.2.42 本基金合同生效以来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

注:由于四舍五入的原因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。

5.2.43 本基金合同生效以来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

注:由于四舍五入的原因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。

5.2.44 本基金合同生效以来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

注:由于四舍五入的原因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。

5.2.45 本基金合同生效以来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

注:由于四舍五入的原因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。

5.2.46 本基金合同生效以来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

注:由于四舍五入的原因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。

5.2.47 本基金合同生效以来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

注:由于四舍五入的原因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。

5.2.48 本基金合同生效以来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

注:由于四舍五入的原因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。

5.2.49 本基金合同生效以来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

注:由于四舍五入的原因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。