工银瑞信全球精选股票型证券投资基金

【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。

本报告中财务资料未经审计。

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

2.1 基金基本情况

基金简称	工银全球精选股票(QDII)
交易代码	486002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年5月25日
报告期末基金份额总额	69,322,825.74份
投资目标	全球范围内具有竞争优势且成长性良好的上市公司。
投资策略	通过在全球范围内采用"自上而下"方法进行国家及地区的资产配置,综合运用定性和定量分析方法精选全球股票,并且在全球范围内进行投资组合风险收益优化,追求基金资产的长期稳健增值。
业绩比较基准	MSCI世界指数总收益。
风险收益特征	本基金是投资于全球资本市场的股票型基金,属于风险水平较高的基金品种,其预期收益及风险水平高于债券型基金,亦高于混合型基金。
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

2.2 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	Wellington Management Company, LLP	The Bank of New York Mellon Corporation
	中文	威灵顿管理有限责任合伙制公司	纽约梅隆银行股份有限公司
注册地址		280 Congress Street, Boston, MA, USA	225 Liberty St, New York, New York 10286 USA
办公地址		280 Congress Street, Boston, MA, USA	225 Liberty St, New York, New York 10286 USA
邮政编码		2210	NY 10286

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2016年1月1日 - 2016年3月31日)
1.本期已实现收益	-214,466.99
2.本期利润	-414,576.24
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0061
4.期末基金资产净值	104,938,604.80
5.期末基金份额净值	1.514

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)所列数据截止到2016年3月31日。

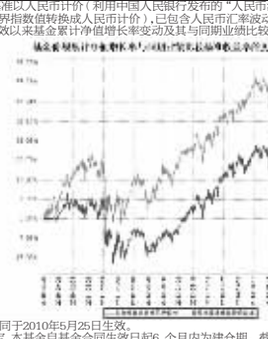
3.2 基金净值表现

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

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.46%	0.92%	-0.26%	1.01%	-0.20%	-0.09%

注:同期业绩比较基准以人民币计价(利用中国人民银行发布的"人民币汇率中间价对美元"将以美元计价的MSCI世界指数值转换成人民币计价),已包含人民币汇率波动等因素产生的效应。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计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



注:1、本基金基金合同于2010年5月25日生效。

2、按照基金合同规定,本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期。截至本报告期末,本基金投资符合基金合同关于投资范围及投资限制的规定:股票资产占基金资产的比例为60%-95%,债券、现金等金融工具占基金资产的比例为5%-40%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
游凛峰	本基金的基金经理	2010年5月25日	-	20	先后在Merrill Lynch Investment Managers担任美林集中基金和美林保本基金基金经理,Fore Research & Management担任Fore Equity Market Neutral组合基金经理,Jasper Asset Management担任Jasper Gemini Fund基金基金经理;2009年加入工银瑞信基金管理有限公司,现任基金经理;2009年12月25日至今,担任工银全球基金的基金经理;2010年5月25日至今,担任工银全球精选基金的基金经理;2012年4月26日至今担任工银瑞信基本面量化策略混合型证券投资基金基金经理;2014年6月26日至今,担任工银瑞信绝对收益混合型基金基金经理;2015年12月15日至今,担任工银瑞信新趋势灵活配置混合型基金基金经理;2016年3月9日至今,担任工银瑞信香港中小盘股票型基金基金经理。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

姓名	在境外投资顾问所任职务	证券从业年限	说明
John A. Boselli, CFA@	投资组合经理@	28	威灵顿管理有限责任合伙制公司合伙人,工商管理硕士,在管理美国、国际和全球股票投资组合方面均有丰富的投资经验。曾在《路透》评选的"企业二十佳基金经理人"中排名第十一。此外,在《巴伦周刊》2011年的"超级人才"报道中,John A. Boselli先生亦被评为全球顶尖的股票分析师之一。

注:威灵顿管理有限责任合伙制公司自2012年9月7日起,担任本基金的境外投资顾问。

4.3 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定,依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.4 公平交易专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

为了公平对待各类投资人,保护各类投资人利益,避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为,公司根据《证券投资基金法》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部规章,拟定了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》,对公司管理的各类资产的公平对待做了明确具体的规定,并规定对买卖股票、债券时候的价格和市场价格差距较大,可能存在操纵股价、利益输送等违法违规情况进行监控。本报告期,按照时间优先、价格优先的原则,本公司对满足限价条件且对同一证券有相同交易需求的基金等投资组合,均采用了系统中的公平交易模块进行操作,实现了公平交易;未出现调算不到位的情况,且本基金及本基金与本基金管理人管理的其他投资组合之间未发生法律法规禁止的反向交易及交叉交易。

4.4.2 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内,本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况有4次。投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易,未导致不公平交易和利益输送。

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.5.1 报告期内基金的投资策略和运作分析

全球精选组合第一季度回报为-0.8%,低于基准摩根士丹利资本国际全球指数的回报0.4%,因为三月中低品质公司上扬。汇率影响造成的拖累最大,其次为板块配置不佳。在非核心消费和金融板块的选股表现最差。但我们在信息技术和核心消费板块的持股表现较为出色,抵销了部分前述负面影响。投资组合超配医疗板块以及低配原材料和能源板块,也拖累了绩效;但超配信息技术板块为相对绩效带来了正面贡献。

我们的展望变化不大。我们跟踪的各种全球宏观经济指标继续下降,显示经济增长缓慢。日本、欧洲和中国的央行正在降息或刺激货币政策,以推动增长。在这种环境中,我们在对股票进行排名时继续强调相对质量和总资本回报特征。

地区方面,美国仍是最为强劲的经济体以及投资组合第一大超配国家。三月中,我们首次买入美国运动服装公司耐克。这家优质公司正在大举回购股票和增派股息。我们预计随将举行的奥运会以及公司在产品方面受科技和外部合作伙伴支撑的竞争优势,将推动公司收入实现强劲的内生增长。

投资组合在英国的部署为适度超配。导致英国六月份为退出欧盟举行全民公投的政治不确定性可能会引发波动。但我们相信"退出欧盟"获得通过的可能性不大,对投资组合持股的实际影响有限,因为投资组合持有的主要是在全球运作而非只专注于英国市场的跨国公司。

投资组合虽然维持低配日本,但首次买入了日本的小野药品工业。该公司与肿瘤免疫治疗领域知名公司百时美施贵宝成立有合资企业,并经由该企业合作开发了肺癌疗法。该疗法于近日获批准后在日本需求强劲。投资组合维持低配新兴市场,并对与中国银行系统相关的持续的风险及其可能对亚洲造成的负面影响保持特别谨慎。季中,我们前往拉丁美洲与一些公司会面,尽管我们目前并不持有这些公司。巴西经济衰退尚未见底,但我们预期新任总统会实施支持性市场改革以便吸引外国投资。我们正在密切关注那些当市场开始复苏时具有良好价值的优质增长型公司。

板块方面,投资组合维持超配信息技术、非核心消费和医疗板块。低配部署仍然集中在工业、能源、原材料以及公用事业和通信板块。

股市回报均以美元衡量,而非本币,以便横向比较。

工银瑞信睿智深证100指数分级证券投资基金

【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:中国民生银行股份有限公司
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。

基金托管人中国民生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。

本报告中财务资料未经审计。

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

基金简称	工银深证100指数分级		
场内简称	100母基		
交易代码	164811		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2012年10月25日		
报告期末基金份额总额	28,513,054.61份		
投资目标	采用指数化投资,通过控制基金投资组合相对于标的指数的偏离度,实现对标的指数的有效跟踪。通过产品分级设置,为不同份额投资者提供具有差异化收益和风险特征的投资工具。		
投资策略	本基金采取完全复制策略,即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但因特殊情况(如市场流动性不足,成分股被限制投资等)导致基金无法获得足够数量的股票时,基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合,追求尽可能贴近目标指数的表现。本基金对标的指数的跟踪目标是:力争使得基金日收益率与业绩比较基准日收益率偏离度的年度平均值不超过0.35%,偏离度年化标准差不超过4%。		
业绩比较基准	深证100指数收益率×95%+商业银行税后活期存款利率×5%。		
风险收益特征	本基金属于股票型基金,其风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。此外,本基金作为指数型基金,采用完全复制策略,跟踪标的指数市场表现,目标为获取市场平均收益,是股票基金中处于中等风险水平的基金产品。本基金的分级设定则决定了不同份额具有不同的风险和收益特征。深证100A份额具有低风险、低预期收益的特征;深证100B份额具有高风险、高预期收益的特征。		
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司		
基金托管人	中国民生银行股份有限公司		
下属分级基金简称	深100A	深100B	100母基
下属分级基金交易代码	150112	150113	164811
下属分级基金报告期末基金份额总额	11,138,778.00份	11,138,779.00份	6,235,497.61份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2016年1月1日 - 2016年3月31日)
1.本期已实现收益	-805,658.51
2.本期利润	-6,440,481.80
3.加权平均基金份额本期利润	-0.2280
4.期末基金资产净值	34,470,287.05
5.期末基金份额净值	1.2089

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、本基金在存续期内的每个会计年度(基金合同生效日所在会计年度除外)7月份的第一个工作日对登记在册的睿智深证100份额、深证100A份额进行基金的定期份额折算。

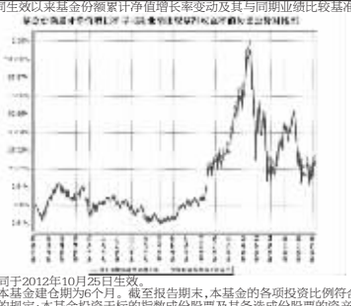
4、所列数据截止到2016年3月31日。

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

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-16.62%	2.95%	-14.64%	2.66%	-1.98%	0.29%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计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



注:1、本基金基金合同于2012年10月25日生效。

2、按基金合同规定,本基金建仓期为6个月。截至报告期末,本基金的各项投资比例符合基金合同关于投资范围、投资禁止行为与限制的规定:本基金投资于标的指数成份股票及其备选成份股票的资产比例不低于基金资产净值的90%;任何交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

3.3 其他指标

无。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘伟琳	本基金的基金经理	2014年10月17日	-	6	中国人民大学金融工程博士;2010年加入工银瑞信,历任金融工程分析师、投资经理助理、投资经理,现任指数投资部基金经理;2014年10月17日至今,担任工银深证100指数分级基金基金经理;2014年10月17日至今,担任工银沪深300指数基金基金经理;2014年10月17日至今,担任工银中证500指数分级基金基金经理;2015年5月21日至今,担任工银瑞信中证传媒指数分级基金基金经理;2015年7月23日至今,担任工银中证高铁产业指数分级基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定,依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了公平对待各类投资人,保护各类投资人利益,避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为,公司根据《证券投资基金法》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部规章,拟定了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》,对公司管理的各类资产的公平对待做了明确具体的规定,并规定对买卖股票、债券时候的价格和市场价格差距较大,可能存在操纵股价、利益输送等违法违规情况进行监控。本报告期,按照时间优先、价格优先的原则,本公司对满足限价条件且对同一证券有相同交易需求的基金等投资组合,均采用了系统中的公平交易模块进行操作,实现了公平交易;未出现调算不到位的情况,且本基金及本基金与本基金管理人管理的其他投资组合之间未发生法律法规禁止的反向交易及交叉交易。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内,本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况有4次。投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易,未导致不公平交易和利益输送。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内,本基金跟踪误差产生的主要来源是:1)申购赎回的影响;2)成份股票的停牌;3)指数中成份股票的调整等。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金净值增长率为-16.62%,业绩比较基准收益率为-14.64%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金在报告期内出现连续六十天规模低于5000万,根据2014年8月8日生效的《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条规定的条件,我司已向证监会递交解决方案,并说明有关情况。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	31,531,726.36	88.69
	其中:股票	31,531,726.36	88.69
2	基金投资	-	-
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	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,997,058.39	11.24
8	其他资产	22,185.20	0.06
9	合计	35,550,969.95	100.00

注:由于四舍五入的原因金额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 报告期末按投资按行业分类的境内股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	185,220.00	0.54
B	采矿业	157,589.20	0.46
C	制造业	15,716,338.85	45.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	261,621.00	0.76
E	建筑业	196,761.60	0.57
F	批发和零售业	634,261.30	1.84
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	3,935,740.42	11.42
J	金融业	4,441,806.52	12.89
K	房地产业	3,788,332.55	10.99
L	租赁和商务服务业	394,559.02	1.14
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	826,477.15	2.40
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	758,579.00	2.20
S	综合	234,439.75	0.68
	合计	31,531,726.36	91.48

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 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

无。

5.2.3 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

无。

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明细

5.3.1 报告期末指数投资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	000002	万 科A	130,335	2,451,601.35	7.11
2	000651	格力电器	60,176	1,226,988.64	3.56
3	000001	平安银行	83,723	890,812.72	2.58
4	000333	美的集团	27,177	838,410.45	2.43
5	000725	京东方A	312,900	797,895.00	2.31
6	300104	乐视网	14,960	694,293.60	2.01
7	300059	东方财富	14,847	657,722.10	1.91
8	000858	五 粮 液	23,388	657,436.68	1.91
9	000776	广发证券	38,323	640,760.56	1.86
10	002024	苏宁云商	55,394	634,261.30	1.84

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

无。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

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股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货投资。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期内,本基金未运用股指期货进行投资。

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 本期国债期货投资政策

本报告期内,本基金未运用国债期货进行投资。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

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 本期国债期货投资评价

本报告期内,本基金未运用国债期货进行投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的投资决策程序说明:

广发证券:

违规行为:

2014年9月,广发证券对杭州恒生网络技术服务有限责任公司HOMS系统(以下简称HOMS系统)开放接入。同年12月,广发证券上海分公司对该系统开放专线接入,2015年5月19日,专线连通。2015年3月30日,广发证券上海分公司为上海铭创软件技术有限公司系统(以下简称铭创系统)安装第三个交易网关。对于上述外部接入的第三方交易终端软件,广发证券未进行软件认证许可,未对外部系统接入实施有效管理,对相关客户身份情况缺乏了解。截止调查日,广发证券客户中有123个使用HOMS系统、铭创系统接入的主账户。对上述客户,广发证券未采集客户交易终端信息,未能确保客户交易终端信息的真实性、准确性、完整性、一致性、可读性,未采取可靠措施采集、记录与客户身份识别有关的信息。2015年5月25日,广发证券已知悉并关注HOMS系统等系统存在引发违规配资及违反账户实名制管理有关规定等问题,广发证券在未采集上述客户身份识别信息的情况下,未实施有效的了解客户身份的回访、检查等程序。

处分类型:

依据《证券公司监督管理条例》第八十四条的规定,证监会拟决定:对广发证券责令整改,给予警告,没收违法所得6805135.75元,并处以20415407.25元罚款。

投资决策流程符合公司的制度要求,目前公司经营状况良好,业绩稳定,对投资无重大影响。

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	20,664.30
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,123.51
5	应收申购款	397.39
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	22,185.20

5.11.4 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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000002	万 科A	2,451,601.35	7.11	重大事项
2	000651	格力电器	1,226,988.64	3.56	重大事项
3	300104	乐视网	694,293.60	2.01	重大事项

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	深100A	深100B	100母基
报告期期初基金份额总额	10,872,969.00	10,872,970.00	5,482,820.14
报告期期间基金总申购份额	-	-	4,288,491.82
减:报告期期间基金总赎回份额	-	-	3,004,196.35
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	265,809.00	265,809.00	-531,618.00
报告期期末基金份额总额	11,138,778.00	11,138,779.00	6,235,497.61

注:1.拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额,报告期末基金份额总额为三级份额之和。

2.报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额;

3.报告期期间基金总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

7.2 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有运用固有资金投资本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准工银瑞信睿智深证100指数分级证券投资基金设立的文件;

2、《工银瑞信睿智深证100指数分级证券投资基金基金合同》;

3、《工银瑞信睿智深证100指数分级证券投资基金托管协议》;

4、基金管理人业务资格批件和营业执照;

5、基金托管人业务资格批件和营业执照;

6、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

9.2 存放地点

基金管理人或基金托管人办公场所。

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。也可在支付工本费后,在合理时间内取得上述文件的复印件。

工银瑞信中国机会全球配置股票型证券投资基金

【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。

基金托管人中国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。

本报告中财务资料未经审计。

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

2.1 基金基本情况

基金简称	工银全球股票(QDII)
交易代码	486001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年2月14日
报告期末基金份额总额	283,562,734.33份
投资目标	为中国国内投资者提供投资全球范围内受益于中国经济持续增长的公司的机会,通过在全球范围内分散投资,控制投资组合风险,追求基金长期资产增值,并争取实现超越业绩比较基准的业绩表现。
投资策略	本基金主要投资于在香港等境外证券市场上市的中国公司股票,以及全球范围内受惠于中国经济增长的境外公司股票,为中国国内投资者提供全球范围内分散投资路径。本基金在选择股票时,重点从中国国内消费、中国进口需求、中国出口优势三个主题识别直接受益于中国经济增长的公司。
业绩比较基准	40%×MSCI中国指数收益率+60%×MSCI全球股票指数收益率。
风险收益特征	本基金属于全球股票型基金,在一般情况下,其风险与预期收益高于债券型基金,亦高于混合型基金。
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

2.2 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	Wellington Management Company, LLP	Citibank N.A.
	中文	威灵顿管理有限责任合伙制公司	美国花旗银行有限公司
注册地址		280 Congress Street, Boston, MA, USA	701 East 60th Street North @Sioux Falls, South Dakota 57104 @County of Minnehaha @USA
办公地址		280 Congress Street, Boston, MA, USA	399 Park Avenue, New York, NY10022, USA
邮政编码		2210	10022

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2016年1月1日 - 2016年3月31日)
1.本期已实现收益	-4,134,020.79
2.本期利润	-8,832,088.15
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0311
4.期末基金资产净值	298,400,852.33
5.期末基金份额净值	1.052

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)所列数据截止到2016年3月31日。

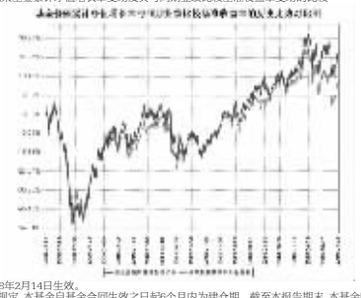
3.2 基金净值表现

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

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-2.49%	1.04%	-2.51%	1.14%	0.02%	-0.10%

注:同期业绩比较基准以人民币计价(利用中国人民银行发布的"人民币汇率中间价对美元"将以美元计价的MSCI中国指数和MSCI全球股票指数值转换成人民币计价),已包含人民币汇率波动等因素产生的效应。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计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



注:1、本基金合同于2008年2月14日生效。

2、按照本基金基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起6个月内为建仓期。截至本报告期末,本基金的各项投资比例符合基金合同关于投资范围及投资限制的规定:本基金投资中国公司组合占基金资产的比例为30%-50%,全球公司组合占基金资产的比例为50%-70%;本基金持有的股票资产占基金资产的比例不低于60%,政府债券、回购、股票指数期货、外汇远期合约、外汇互换及其他用于组合避险或有效管理的金融衍生工具占基金资产的比例不高于40%。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
游凛峰	本基金的基金经理	2009年12月25日	-	20	先后在Merrill Lynch Investment Managers担任美林集中基金和美林保本基金基金经理,Fore Research & Management担任Fore Equity Market Neutral组合基金基金经理,Jasper Asset Management担任Jasper Gemini Fund基金基金经理;2009年加入工银瑞信基金管理有限公司,现任基金经理;2009年12月25日至今,担任工银全球基金的基金经理;2010年5月25日至今,担任工银全球精选基金的基金经理;2012年4月26日至今担任工银瑞信基本面量化策略混合型证券投资基金基金经理;2014年6月26日至今,担任工银瑞信绝对收益混合型基金基金经理;2015年12月15日至今,担任工银瑞信新趋势灵活配置混合型基金基金经理;2016年3月9日至今,担任工银瑞信香港中小盘股票型基金基金经理。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

姓名	在境外投资顾问所任职务	证券从业年限	说明
John A. Boselli, CFA	投资组合经理	28	威灵顿管理有限责任合伙制公司合伙人,工商管理硕士,在管理美国、国际和全球股票投资组合方面均有丰富的投资经验。曾在《路透》评选的"企业二十佳基金经理人"中排名第十一。此外,在《巴伦周刊》2011年的"超级人才"报道中,John A. Boselli先生亦被评为全球顶尖的股票分析师之一。
Bo Z. Meunier(张博女士), CFA	投资组合经理	20	威灵顿管理有限责任合伙制公司合伙人,工商管理硕士,她同时也是一名股票研究分析师,专门研究新兴市场,并主要负责中国。她对其负责行业内的企业进行基本面分析并根据分析结果和市场条件做出买入/卖出建议。张博女士于1998获得巴布森学院奥林福学院工商管理硕士学位,以优异成绩毕业并获得巴布森奖学金。1992年,她以优异成绩获得中国哈尔滨理工大学科技英语学士学位。此外,她还是特许金融分析师。

注:威灵顿管理有限责任合伙制公司自2012年7月10日起,担任本基金的境外投资顾问。

4.3 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定,依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.4 公平交易专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

为了公平对待各类投资人,保护各类投资人利益,避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为,公司根据《证券投资基金法》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部规章,拟定了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》,对公司管理的各类资产的公平对待做了明确具体的规定,并规定对买卖股票、债券时候的价格和市场价格差距较大,可能存在操纵股价、利益输送等违法违规情况进行监控。本报告期,按照时间优先、价格优先的原则,本公司对满足限价条件且对同一证券有相同交易需求的基金等投资组合,均采用了系统中的公平交易模块进行操作,实现了公平交易;未出现调算不到位的情况,且本基金及本基金与本基金管理人管理的其他投资组合之间未发生法律法规禁止的反向交易及交叉交易。

4.4.2 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内,本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况有4次。投资组合经