

## 工银瑞信精选平衡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

## 1.1 重要提示

基金管理人的董事会及高级管理人员保证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基金合同规定,对本报告中的财务指标、净值表现、投资组合报告和投资收益分配政策等信息进行复核,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。

本报告期自2016年1月1日起至3月31日止。

5.1 基金产品概况

基金简称 工银瑞信精选平衡

交易代码 480003

基金运作方式 灵活配置型开放式

基金合同生效日 2006年7月13日

报告期末基金份额总额 4,090,090,728.08份

投资目标 有效控制投资组合的风险,追求稳定收益与长期资本增值。

投资策略 本基金将基本面研究、数据系统化、程序化的投资过程以保证投资决策的科学性与一致性。

业绩比较基准 60%×沪深300指数收益率+40%×中债-综合指数(财富)收益率

风险收益特征 本基金为平衡型基金,其预期收益及风险水平介于股票型基金与债券型基金之间,属于中等风险水平基金。

基金管理人 中国建设银行股份有限公司

基金托管人 中国建设银行股份有限公司

5.3 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.本期初次收入 -160,989,479.77

2.本期利润 -624,069,066.62

3.期末可供分配基金份额利润 2,064,283,724.79

4.期末可供分配基金份额净值 0.5047

5.期末基金份额余额 2,064,283,724.79

注:1. 上述基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金产生的各项费用,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)扣除相应回购的余额;

“本期利润”为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

“期末可供分配利润”为截至期末可供分配的利润,采用去向法计算。

“期末可供分配基金份额净值”为截至期末可供分配利润除以期末基金份额余额。

“期末基金份额余额”为截至期末的基金份额数。

6.1.3 本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:百分比(净值增长率为年化收益率,业绩比较基准收益率为年化收益率)

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)

过去三个月 -22.29% 3.02% -17.86% 1.46% -15.55% 1.57%

3.2.2 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较

单位:百分比(净值增长率为年化收益率,业绩比较基准收益率为年化收益率)

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)

过去三个月 -22.29% 3.02% -17.86% 1.46% -15.55% 1.57%

3.2.3 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

单位:百分比(净值增长率为年化收益率,业绩比较基准收益率为年化收益率)

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)

过去三个月 -22.29% 3.02% -17.86% 1.46% -15.55% 1.57%

3.3 其他指标

5.4 管理人报告

5.4.1 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 任职日期 离任日期 说明

胡文魁 本基金的基金经理 2013年11月12日 - 14

注:自2013年11月12日起,胡文魁先生担任本基金基金经理,林华峰先生担任本基金的基金经理。

5.4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金报告期内,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,勤勉尽责地履行了基金管理职责,没有损害基金份额持有人的利益。

5.4.3 公平交易制度的执行情况

5.4.4 小公司交易制度的执行情况

5.4.5 公平交易制度的执行情况

5.4.6 公平交易制度的执行情况

5.4.7 公平交易制度的执行情况

5.4.8 公平交易制度的执行情况

5.4.9 公平交易制度的执行情况

5.4.10 公平交易制度的执行情况

5.4.11 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.5 报告期内基金投资组合情况

序号 报告期内基金资产项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资 1,472,410,685.62 71.08

2 固定收益投资 1,472,410,685.62 71.08

3 货币市场基金 - -

4 固定收益投资 403,312,796.50 19.47

5 其他资产 403,312,796.50 19.47

6 衍生工具及权证 10,570,760.90 0.61

9 合计 2,071,569,770.01 100.00

注:1. 上述基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金产生的各项费用,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)扣除相应回购的余额;

“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. 所列数据不包含持有人认购或申购基金产生的利息收入。

3.2.1 本期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:百分比(净值增长率为年化收益率,业绩比较基准收益率为年化收益率)

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)

过去三个月 -2.58% 0.39% -1.12% 0.02% -3.70% 0.27%

5.2.2 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较

单位:百分比(净值增长率为年化收益率,业绩比较基准收益率为年化收益率)

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)

过去三个月 -2.58% 0.39% -1.12% 0.02% -3.70% 0.27%

5.3 报告期内基金资产组合情况

序号 报告期内基金资产项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资 1,472,405,657.87 87.27

2 基金投资 1,472,405,657.87 87.27

3 固定收益投资 340,941,000.00 5.91

4 货币市场基金 - -

5 衍生工具及权证 2,900,286,055.52 50.23

6 大宗商品投资 - -

7 货币存款和结算备付金合计 1,796,223,496.11 31.11

8 其他资产 322,613,872.00 4.60

9 合计 5,773,765,920.20 100.00

注:1. 本报告期基金合同于2016年3月31日止。

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)扣除相应回购的余额;

“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. 所列数据不包含持有人认购或申购基金产生的利息收入。

3.2.2 本期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:百分比(净值增长率为年化收益率,业绩比较基准收益率为年化收益率)

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)

过去三个月 -2.58% 0.39% -1.12% 0.02% -3.70% 0.27%

3.2.3 本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较

单位:百分比(净值增长率为年化收益率,业绩比较基准收益率为年化收益率)

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)

过去三个月 -2.58% 0.39% -1.12% 0.02% -3.70% 0.27%

5.4 管理人报告

5.4.1 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 任职日期 离任日期 说明

胡文魁 本基金的基金经理 2013年11月12日 - 14

注:自2013年11月12日起,胡文魁先生担任本基金基金经理,林华峰先生担任本基金的基金经理。

5.4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金报告期内,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,勤勉尽责地履行了基金管理职责,没有损害基金份额持有人的利益。

5.4.3 公平交易制度的执行情况

5.4.4 小公司交易制度的执行情况

5.4.5 公平交易制度的执行情况

5.4.6 公平交易制度的执行情况

5.4.7 公平交易制度的执行情况

5.4.8 公平交易制度的执行情况

5.4.9 公平交易制度的执行情况

5.4.10 公平交易制度的执行情况

5.4.11 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.5 报告期内基金投资组合情况

序号 报告期内基金资产项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资 1,472,405,657.87 87.27

2 基金投资 1,472,405,657.87 87.27

3 固定收益投资 340,941,000.00 5.91

4 货币市场基金 - -

5 衍生工具及权证 2,900,286,055.52 50.23

6 大宗商品投资 - -

7 货币存款和结算备付金合计 1,796,223,496.11 31.11

8 其他资产 322,613,872.00 4.60

9 合计 5,773,765,920.20 100.00

注:1. 本报告期基金合同于2016年3月31日止。

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)扣除相应回购的余额;

“本期利润”为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。</