工银瑞信红利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

基金简称	工银红利混合
交易代码	481006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年7月18日
报告期末基金份额总额	775,448,531.44份
投资目标	在合理控制风险的基础上,追求基金资产的长期稳定增值,获得超过业绩比较基准的投资业绩。
投资策略	本基金采用定量和定性相结合的个股精选策略,通过红利股筛选、竞争优势评价和盈利预测的选股流程,精选出兼具稳定的高分红能力、较强竞争优势和持续盈利增长的上市公司股票作为主要投资对象,以增强本基金的股息收益和资本增值能力。
业绩比较基准	中证红利指数收益率。
风险收益特征	本基金属于混合型基金中的红利主题型基金,其风险与预期收益高于货币型基金和债券型基金,低于股票型基金。
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

§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	-39,729,644.98
2.本期利润	-94,098,367.20
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1216
4.期末基金资产净值	618,844,456.54
5.期末基金份额净值	0.7980

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。

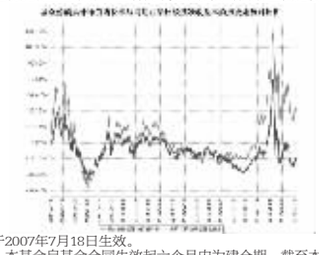
3、所列数据截止到2016年3月31日。

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	-13.31%	2.84%	-13.30%	2.48%	-0.01%	0.36%

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2007年7月18日生效。

2、按基金合同规定,本基金自基金合同生效起六个月内为建仓期。截至本报告期末,本基金的各项投资比例已达到基金合同关于投资范围及投资限制的规定:本基金投资股票等权益类资产占基金资产的比例为60%-95%,现金、债券资产、权证以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种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%,权证投资占基金资产净值的比例不超过3%。

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		
宋炳坤	权益投资总监兼研究部总监,本基金的基金经理	2014年1月20日	-	12	曾任中信建投证券有限公司研究员;2007年加入工银瑞信,现任权益投资总监兼研究部总监。2012年2月14日至今,担任工银瑞信添颐债券型证券投资基金基金经理;2013年1月18日至今,担任工银双利债券型基金基金经理;2013年1月28日至2014年12月5日,担任工银瑞信60天理财债券型基金基金经理;2014年1月20日至今,担任工银瑞信红利混合型证券投资基金基金经理;2014年1月20日至今,担任工银瑞信核心价值混合型证券投资基金基金经理;2014年10月23日至今,担任工银瑞信研究精选股票型基金基金经理;2014年11月18日至今,担任工银医疗保健行业股票型基金基金经理;2015年2月16日至今,担任工银战略转型主题股票基金基金经理。
杨柯	研究部副总监,本基金的基金经理	2014年1月20日	-	8	曾任中国国际金融有限公司研究员;2011年加入工银瑞信,现任研究部副总监。2013年4月16日至今,担任工银瑞信稳健成长混合型证券投资基金基金经理;2014年1月20日至今,担任工银瑞信红利混合型证券投资基金基金经理;2014年10月23日至今,担任工银瑞信研究精选股票型基金基金经理;2015年5月26日起至今,担任工银瑞信农业产业股票型基金基金经理;2016年3月11日起至今,担任工银瑞信物流产业股票型基金基金经理。

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;未出现清算不到位的情况,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

今年1月A股市场出现系统性下跌。虽然在此期间管理人进行了主动的仓位管理和结构调整,但受熔断和市场偏好短期急速恶化等市场环境影响,本基金在1月的下跌幅度依然较大,给投资者造成了较大损失,深感不安。2月市场延续高波动性特征,最后一周上证综指更再次出现单日跌幅超过6%的情形。这一系统性冲击令基金在2月中旬前取得的绝对和相对收益再被抹平。3月随着政策面和经济面积极信号的不断出现,市场温和企稳回升。本基金通过适度提升基金仓位,并坚持自上而下和自下而上相结合的投资策略,今年初以来红利混合基金的绝对收益和相对收益跌幅有所收窄。就整个季度来看,本基金关注股票仓位的把控,并延续之前"自上而下盯PMI、发电量、政策、货币流动性;自下而上根据自己编制的财务模型来挑选个股精选个股"的投资策略。

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-13.31%,业绩比较基准收益率为-13.30%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金在报告期内没有触及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。

§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	529,933,180.62	85.26
	其中:股票	529,933,180.62	85.26
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	91,186,300.53	14.67
8	其他资产	418,134.00	0.07
9	合计	621,537,615.15	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	11,473,246.00	1.85
B	采矿业	9,939,567.61	1.61
C	制造业	244,597,706.26	39.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	48,923,877.66	7.91
F	批发和零售业	9,544,424.00	1.54
G	交通运输、仓储和邮政业	13,926,000.00	2.25
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	19,514,000.00	3.15
J	金融业	66,539,673.46	10.75
K	房地产业	82,242,573.71	13.29
L	租赁和商务服务业	23,232,111.92	3.75
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	529,933,180.62	85.63

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

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	002273	水晶光电	949,996	34,095,356.44	5.51
2	002108	沧州明珠	1,865,568	33,580,224.00	5.43
3	600060	海信电器	1,893,998	31,516,126.72	5.09
4	002659	中泰桥梁	1,188,035	23,546,853.70	3.80
5	002707	众信旅游	501,016	23,232,111.92	3.75
6	002081	金 螳 螂	1,177,487	20,111,477.96	3.25
7	300113	顺网科技	220,000	19,514,000.00	3.15
8	601688	华泰证券	1,136,086	19,438,431.46	3.14
9	002241	歌尔声学	700,000	17,920,000.00	2.90
10	000563	陕国投A	1,246,000	17,805,340.00	2.88

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,也无期间损益。

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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期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、处罚的投资决策程序说明:

违规行为:

2013年7月 29日,华泰证券威宁路营业部应客户上海朝兴置业有限公司(以下简称朝兴置业) 的要求,与杭州恒生网络技术服务有限公司(以下简称恒生网络)共同测试HOMS系统接入华泰证券软件系统。系统连通后,在朝兴置业未使用的情况下,华泰证券并未切断其与HOMS系统的连接端口,也未对此专线设置相应监控。 2014年10月至12月期间, 华泰证券在对于自身交易系统没有采取预防措施的情况下,让浙江核新同花顺网络信息股份有限公司(以下简称同花顺)工程人员在华泰证券机房安装了资产管理模块。对于上述外部接入的第三方交易终端软件,华泰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。华泰证券未按要求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。综上,华泰证券未按照《关于加强证券期货经营机构客户交易终端信息等客户信息管理的规定》第六条、第八条、第十三条,《中国证券登记结算有限责任公司证券账户管理规则》第五十条的规定对客户的身份信息进行审查和了解,违反了《证券公司监督管理条例》第二十八条第一款的规定,构成《证券公司监督管理条例》第八十四条第(四)项所述的行为,获利18, 235, 275.00元。

处分类型:

根据当事人违法行为的事实、性质、情节和社会危害程度,依据《证券公司监督管理条例》第八十四条第(四)项的规定,证监会拟决定:对华泰证券责令改正,给予警告,没收违法所得18, 235, 275.00元,并处以54, 705, 825.00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	374,492.42
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	24,781.72
5	应收申购款	18,859.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	418,134.00

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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

报告期期初基金份额总额	771,179,165.61
报告期期间基金总申购份额	16,369,435.72
减:报告期期间基金总赎回份额	12,100,069.89
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	775,448,531.44

注:1、报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额;

2、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红利混合型证券投资基金设立的文件;

2.《工银瑞信红利混合型证券投资基金基金合同》;

3.《工银瑞信红利混合型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。

工银瑞信互联网加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:交通银行股份有限公司
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。

基金托管人交通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	工银互联网加股票
交易代码	001409
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年6月5日
报告期末基金份额总额	15,987,661,180.60份
投资目标	本基金通过重新认知互联网行业与传统行业的能力边界,在"互联网+"趋势的引领下,深入研究互联网行业的发展新机遇以及传统行业与互联网相融合的发展新空间,重点选择发展潜力巨大优质公司进行投资,在风险可控的前提下以期获得最大化的投资收益。
投资策略	本基金将由投资研究团队及时跟踪市场环境变化,根据宏观经济运行态势、宏观经济政策变化、证券市场运行状况、国际市场变化情况等因素的深入研究,判断证券市场的发展趋势,结合行业状况、公司价值情况及长性分析,综合评价各类资产的风险收益水平。在充足的宏观形势判断和策略分析的基础上,采用动态调整策略,在市场上涨阶段中,适当增加权益类资产配置比例,在市场下行周期中,适当降低权益类资产配置比例,力求实现基金资产的长期稳定增值。从而有效提高不同市场状况下基金资产的整体收益水平。在"互联网加"主题界定的基础上,本基金将通过定性分析和定量分析相结合的办法,重点关注能够运用互联网思维进行企业价值链塑造、产品供应链智能管理、品牌与营销渠道网络化机遇以及促进企业创新发展的其他优化的上市公司,通过进一步对估值水平的评估,最终选择优质且估值合理的上市公司的股票进行投资。
业绩比较基准	80%×中证800指数收益率+20%×中债综合指数收益率。
风险收益特征	本基金为股票型基金,预期收益和风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司

§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	-963,818,658.69
2.本期利润	-2,631,281,211.41
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1648
4.期末基金资产净值	8,613,674,685.82
5.期末基金份额净值	0.539

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。

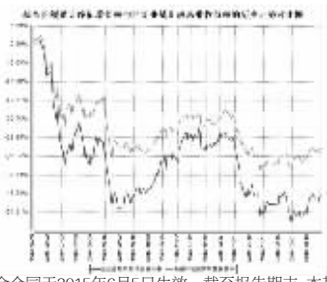
3、所列数据截止到2016年3月31日。

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	-23.55%	3.38%	-12.03%	2.11%	-11.52%	1.27%

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2015年6月5日生效。截至报告期末,本基金基金合同生效不满一年。

2、按基金合同规定,本基金建仓期为6个月。建仓期满,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:股票资产占基金资产的比例为80%-95%,其中投资于本基金界定的"互联网加"主题范围内股票不低于非现金资产的80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值的5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。

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		
刘天任	本基金的基金经理	2015年6月5日	-	8	曾任埃森哲咨询公司资深分析员。2008年加入工银瑞信,现任权益投资部基金经理。2013年11月11日至今,担任工银瑞信信息产业混合型证券投资基金基金经理;2014年6月5日至今,担任工银瑞信稳健成长混合型证券投资基金基金经理;2014年12月11日至今,担任工银瑞信创新动力股票型基金基金经理;2015年6月5日至今,担任工银瑞信互联网加股票型基金基金经理。
王栎杰	本基金的基金经理	2015年6月5日	-	6	先后在中国移动北京分公司担任行业分析经理,在中邮创业基金担任行业研究员;2011年加入工银瑞信,现任权益投资部基金经理。2014年4月28日至今,担任工银瑞信信息产业混合型证券投资基金基金经理;2014年12月11日至今,担任工银瑞信创新动力股票型基金基金经理;2015年6月5日至今,担任工银瑞信互联网加股票型基金基金经理。

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;未出现清算不到位的情况,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,本基金跟踪标的指数的日均偏离度为0.05%,偏离度年化标准差为1.09%。本基金跟踪误差产生的主要来源是:1)标的指数成份股中法律法规禁止本基金投资的股票的影响;2)申购赎回的影响;3)成份股票的停牌等。

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-13.50%,业绩比较基准收益率为-13.03%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金在报告期内没有触及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。

§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	8,049,204,951.51	93.20
	其中:股票	8,049,204,951.51	93.20
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	99,960,169.98	1.16
	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	482,561,058.32	5.59
8	其他资产	4,968,058.16	0.06
9	合计	8,636,694,237.97	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 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	143,485,923.52	1.67
B	采矿业	333,571,547.98	3.87
C	制造业	3,950,255,860.55	45.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	327,194,883.72	3.80
E	建筑业	437,466,344.56	5.08
F	批发和零售业	595,016.19	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	148,309,433.71	1.72
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,120,930,297.08	24.62
J	金融业	378,057,803.88	4.39
K	房地产业	205,587,902.83	2.39
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	35,300.00	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	3,364,106.91	0.04
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	350,530.58	0.00
S	综合	-	-
	合计	8,049,204,951.51	93.45

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

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	002439	启明星辰	32,412,605	775,633,637.65	9.00
2	300059	东方财富	16,608,479	735,755,619.70	8.54
3	002329	皇氏集团	41,508,471	694,436,719.83	8.06
4	002312	三泰控股	33,477,186	691,042,356.42	8.02
5	601985	中国核电	42,382,713	327,194,544.36	3.80
6	300213	佳讯飞鸿	11,202,972	293,293,806.96	3.40
7	002701	奥瑞金	11,648,406	284,221,106.40	3.30
8	300252	金信诺	9,737,853	274,412,697.54	3.19
9	300288	朗玛信息	6,545,586	247,030,415.64	2.87
10	002512	达华智能	10,247,678	230,367,801.44	2.67

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,也无期间损益。

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 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、处罚的情形。

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	2,775,820.22
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	326,794.68
5	应收申购款	1,865,443.26
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,968,058.16

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

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	002439	启明星辰	775,633,637.65	9.00	重大事项
2	002312	三泰控股	514,746,256.96	5.98	重大事项
3	002312	三泰控股	176,296,099.56	2.05	非公开发行

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

报告期期初基金份额总额	15,843,486,127.10
报告期期间基金总申购份额	626,214,026.57
减:报告期期间基金总赎回份额	482,038,973.07
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	15,987,661,180.60

注:1、报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额;

2、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

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	7,517,293.23
报告期期间买入/申购总份额	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	7,517,293.23
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.05

注:1.报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额;

2.报告期期间基金总赎回份额含转换出份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	红利发放	2016年1月20日	9,654.41	0.00	0.00%
合计			9,654.41	0.00	

注:1.本基金管理人本报告期内未运用固有资金投资本基金。

2.期间交易总份额为被动红利再投所得,非公司主动投资。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于2016年1月12日发布分红公告,以截至2015年12月31日的收益为基准,按每10份基金份额分配红利人民币0.005元,共计派发红利1,532,212.96元,权益登记日为2016年1月19日。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会核准工银瑞信互联网加股票型证券投资基金募集申请的注册文件;

2、《工银瑞信互联网加股票型证券投资基金基金合同》;

3、《工银瑞信互联网加股票型证券投资基金托管协议》;

4、基金管理人业务资格批件、营业执照;

5、基金托管人业务资格批件、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。

工银瑞信沪深300指数证券投资基金

【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

基金简称	工银沪深300指数
交易代码	481009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年3月5日
报告期末基金份额总额	3,075,513,797.26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,谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金原则上采取完全复制策略,按照相关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。但因持株情况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。
业绩比较基准	沪深300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,风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,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。
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

§3 主要财务指标和基