

## 工银瑞信国家战略主题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:中国农业银行股份有限公司  
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监事会在报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其实质的真实性、准确性和完整性承担责任个别及连带责任。

基金托管人中国农业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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2016年1月29日(基金合同生效日)起至3月31日止。

## § 2 基金产品概况

代码	名称	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	股票基金	-	54,306,296.10	20.06
B	债券基金	-	54,306,296.10	20.06
C	货币市场基金	-	-	-
D	混合型基金	-	-	-
E	商品基金	-	-	-
F	金融类基金	-	-	-
G	货币市场基金	-	-	-
H	其他基金	-	-	-
I	买入返售金融资产	-	-	-
J	其中：应收票据及应收账款	-	-	-
K	银行存款	-	-	-
L	定期存款	-	-	-
M	协议存款	-	-	-
N	拆借资金	-	-	-
O	回购资金	-	-	-
P	股票	-	-	-
Q	债券	-	-	-
R	货币市场基金	-	-	-
S	基金	-	-	-
合计			136,366,536.00	100.00

注:由于四舍五入的原因基金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	名称	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林牧渔业	-	25,168,760.00	10.01
B	采掘业	-	-	-
C	制造业	-	17,942,496.30	7.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-	-
E	建筑业	-	-	-
F	批发和零售业	-	-	-
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	-	-	-
J	金融业	-	-	-
K	房地产业	-	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-	-
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			64,905,296.10	40.06

§ 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29日-2016年3月31日)

1.本期实现收益	3,304,470.14
2.本期利润	12,404,129.02
3.加权平均基金份额本期利润	0.0923
4.期末基金资产净值	136,114,094.17
5.期末基金份额净值	1.0963

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将低于所列数字。

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(%) ① 净值增长标准差(%) ② 阶段净值增长偏离度(%) ③ 业绩比较基准 ④ 业绩比较基准偏离度(%) ⑤

过去一个月 6.30% 1.02% 10.44% -1.4% 0.17%

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变动的比较



注:1.本基金合同于2016年1月29日生效。截至报告期末,本基金尚处于建仓期。

2.按基金合同规定,本基金建仓期为6个月。建仓期间,本基金的各项投资比例应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的60%~95%,其中,投资于本基金界定的国家战略主题股票占非现金基金资产的比例不低于80%。每个交易日终在港股通股票折合港币缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。

3.3 其他指标

§ 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
黄安乐	权益投资部总监、本基金的基金经理	2016年1月29日	-	13

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

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

相关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取最大利益,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,保护各类型投资人利益,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》、《公开募集证券投资基金公平交易管理制度指导意见》等法律法规及公司内部

规章制度,对旗下所有投资组合实行公平交易监控,定期对所有投资组合的公平交易执行情况进行评价。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内未发现不公平交易的情况。

4.3.3 公平交易制度的执行情况

本基金自基金合同生效之日起至报告期末,未发现不公平交易和利益输送行为。

4.3.4 公平交易制度的执行情况

本基金自基金合同生效之日起至报告期末,未发现不公平交易和利益输送。

4.3.5 公平交易制度的执行情况

本基金自基金合同生效之日起至报告期末,未发现不公平交易和利益输送。

4.3.6 公平交易制度的执行情况

本基金自基金合同生效之日起至报告期末,未发现不公平交易和利益输送。

4.3.7 公平交易制度的执行情况

本基金自基金合同生效之日起至报告期末,未发现不公平交易和利益输送。

4.3.8 公平交易制度的执行情况

本基金自基金合同生效之日起至报告期末,未发现不公平交易和利益输送。

4.3.9 公平交易制度的执行情况

本基金自基金合同生效之日起至报告期末,未发现不公平交易和利益输送。

4.3.10 公平交易制度的执行情况

本基金自基金合同生效之日起至报告期末,未发现不公平交易和利益输送。

4.3.11 公平交易制度的执行情况

本基金自基金合同生效之日起至报告期末,未发现不公平交易和利益输送。

4.3.12 公平交易制度的执行情况

本基金自基金合同生效之日起至报告期末,未发现不公平交易和利益输送。

4.3.13 公平交易制度的执行情况

本基金自基金合同生效之日起至报告期末,未发现不公平交易和利益输送。

4.3.14 公平交易制度的执行情况

本基金自基金合同生效之日起至报告期末,未发现不公平交易和利益输送。

4.3.15 公平交易制度的执行情况

本基金自基金合同生效之日起至报告期末,未发现不公平交易和利益输送。

4.3.16 公平交易制度的执行情况

本基金自基金合同生效之日起至报告期末,未发现不公平交易和利益输送。

4.3.17 公平交易制度的执行情况

本基金自基金合同生效之日起至报告期末,未发现不公平交易和利益输送。

4.3.18 公平交易制度的执行情况

本基金自基金合同生效之日起至报告期末,未发现不公平交易和利益输送。

4.3.19 公平交易制度的执行情况

本基金自基金合同生效之日起至报告期末,未发现不公平交易和利益输送。

4.3.20 公平交易制度的执行情况

本基金自基金合同生效之日起至报告期末,未发现不公平交易和利益输送。

4.3.21 公平交易制度的执行情况

本基金自基金合同生效之日起至报告期末,未发现不公平交易和利益输送。

4.3.22 公平交易制度的执行情况

本基金自基金合同生效之日起至报告期末,未发现不公平交易和利益输送。

4.3.23 公平交易制度的执行情况

本基金自基金合同生效之日起至报告期末,未发现不公平交易和利益输送。

4.3.24 公平交易制度的执行情况

本基金自基金合同生效之日起至报告期末,未发现不公平交易和利益输送。

4.3.25 公平交易制度的执行情况

本基金自基金合同生效之日起至报告期末,未发现不公平交易和利益输送。

4.3.26 公平交易制度的执行情况

本基金自基金合同生效之日起至报告期末,未发现不公平交易和利益输送。

4.3.27 公平交易制度的执行情况

本基金自基金合同生效之日起至报告期末,未发现不公平交易和利益输送。

4.3.28 公平交易制度的执行情况

本基金自基金合同生效之日起至报告期末,未发现不公平交易和利益输送。

4.3.29 公平交易制度的执行情况

本基金自基金合同生效之日起至报告期末,未发现不公平交易和利益输送。

4.3.30 公平交易制度的执行情况

本基金自基金合同生效之日起至报告期末,未发现不公平交易和利益输送。

4.3.31 公平交易制度的执行情况