工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金

【2017】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:国信证券股份有限公司
报告送出日期:二〇一七年四月二十二日

§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。

基金托管人国信证券股份有限公司根据本基金合同规定,于2017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2017年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	工银中证传媒指数分级		
场内简称	传媒母基		
交易代码	164818		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015年5月21日		
报告期末基金份额总额	1,032,949,513.10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	中证传媒指数收益率×95%+金融机构人民币活期存款基准利率(税后)×5%。		
风险收益特征	本基金属于股票型基金,其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型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,跟踪标的指数表现,目标为获取指数的平均收益,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。工银传媒A份额具有低风险、低预期收益的特征;工银传媒B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	国信证券股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	传媒A级	传媒B级	传媒母基
下属分级基金的交易代码	150247	150248	164818
报告期末下属分级基金的份额总额	385,478,599.00份	385,478,599.00份	261,992,315.10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(2017年1月1日 - 2017年3月31日?)
1.本期已实现收益	-17,873,451.03
2.本期利润	-34,481,263.88
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0337
4.期末基金资产净值	687,093,821.68
5.期末基金份额净值	0.6652

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、本期已实现收益是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。

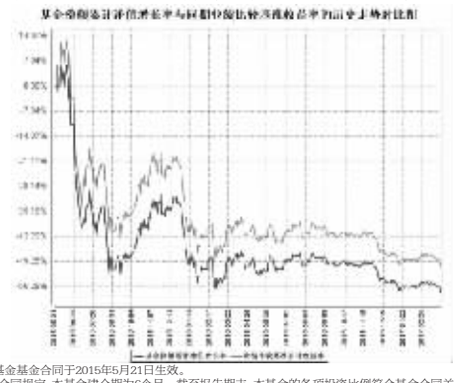
3、所列数据截止到报告期最后一日,无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

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	-4.79%	0.81%	-4.92%	0.86%	0.13%	-0.05%

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2015年5月21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及投资限制的规定:股票资产投资比例不低于基金资产的90%,其中投资于中证传媒指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的80%,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%。股指期货、权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

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	2015年5月21日	-	7	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。
周崟	本基金的基金经理	2016年7月8日	-	5	先后在特灵空调亚洲研发及采购中心担任助理工程师,在北京莱博智环球科技有限公司担任分析师,在北京万特新创科技有限公司担任职员,在中银基金管理有限公司担任高级分析员;2014年加入工银瑞信,曾任产品管理部产品经理,指数投资部量化研究员、投资经理,2016年7月8日至今,担任工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金基金经理。

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未超过该证券当日成交量的5%。

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)成份股票的停牌等。

本基金为指数型基金,基金管理人将继续按照基金合同的要求,坚持指数化投资策略,通过运用定量分析等技术,分析和应对导致基金跟踪误差的因素,继续努力将基金的跟踪误差控制在较低水平。

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-4.79%,业绩比较基准收益率为-4.92%。

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	626,932,848.55	87.31
	其中:股票	626,932,848.55	87.31
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	63,846,913.86	8.89
8	其他资产	27,291,385.91	3.80
9	合计	718,071,148.32	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 报告期末指数投资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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
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	412,342,166.49	60.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	30,467,548.89	4.43
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	184,123,133.17	26.80
S	综合	-	-
	合计	626,932,848.55	91.24

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	300104	乐视网	1,173,923	39,819,468.16	5.80
2	300059	东方财富	2,150,828	32,219,403.44	4.69
3	600637	东方明珠	1,323,053	29,821,614.62	4.34
4	000829	中信国安	2,764,097	28,249,071.34	4.11
5	002739	万达院线	473,223	26,746,563.96	3.89
6	000503	海虹控股	724,312	24,764,227.28	3.60
7	600804	鹏博士	1,139,920	22,490,621.60	3.27
8	000793	华闻传媒	2,032,806	22,055,945.10	3.21
9	300017	网宿科技	477,210	19,327,005.00	2.81
10	300315	掌趣科技	1,903,350	17,453,719.50	2.54

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,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:

东方明珠:

违规行为:

经查,公司在信息披露方面存在以下问题:

1、未及时披露流动资金购买理财产品

2、未及时披露对外担保

3、未及时披露关联关系和关联交易

4、2015 年年报披露不完整

处分类型:

公司上述行为违反了《 上市公司信息披露管理办法 》(证监会令第 40 号)第二条、第二十一条、第三十条、第四十八条的规定。 根据《 上市公司信息披露管理办法 》(证监会令第 40 号)第五十九条规定,现对公司予以警示。 公司董事、监事及高级管理人员应认真学习证券法律法规,提高规范运作水平,完善内部控制,切实依法履行信息披露义务,杜绝此类问题再次发生。

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	455,691.81
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	14,207.74
5	应收申购款	26,821,486.36
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	27,291,385.91

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处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.6 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	300315	掌趣科技	17,453,719.50	2.54	重大事项

5.11.7 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。

5.11.8 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	传媒A级	传媒B级	传媒母基
报告期期初基金份额总额	346,042,682.00	346,042,682.00	215,745,394.10
报告期期间基金总申购份额	-	-	197,786,518.50
减:报告期期间基金总赎回份额	-	-	108,505,288.69
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	39,435,917.00	39,435,917.00	-43,034,308.81
报告期期末基金份额总额	385,478,599.00	385,478,599.00	261,992,315.10

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及定期折算调整份额,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;

4.本基金于2017年1月3日进行了定期折算。

§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

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

无。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据《工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金基金合同》及深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定,工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金在2017年1月3日办理定期份额折算业务。详见基金管理人于2017年1月5日发布的《关于工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金定期份额折算结果及恢复交易的公告》。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会准予工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金募集申请的注册文件;

2、《工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金基金合同》;

3、《工银瑞信中证传媒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、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的住所。

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。

工银瑞信中证高铁产业指数分级证券投资基金

【2017】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:二〇一七年四月二十二日

§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2017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2017年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	工银中证高铁产业指数分级		
场内简称	高铁母基		
交易代码	164820		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015年7月23日		
报告期末基金份额总额	67,312,331.94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	中证高铁产业指数收益率×95%+金融机构人民币活期存款基准利率(税后)×5%。		
风险收益特征	本基金属于股票型基金,其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型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,跟踪标的指数表现,目标为获取指数的平均收益,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。工银高铁A份额具有低风险、低预期收益的特征;工银高铁B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	中国银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	高铁A端	高铁B端	高铁母基
下属分级基金的交易代码	150325	150326	164820
报告期末下属分级基金的份额总额	12,890,942.00份	12,890,942.00份	41,530,447.94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(2017年1月1日 - 2017年3月31日?)
1.本期已实现收益	-178,624.06
2.本期利润	159,554.66
3.加权平均基金份额本期利润	0.0024
4.期末基金资产净值	72,077,259.93
5.期末基金份额净值	1.0708

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、本期已实现收益是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。

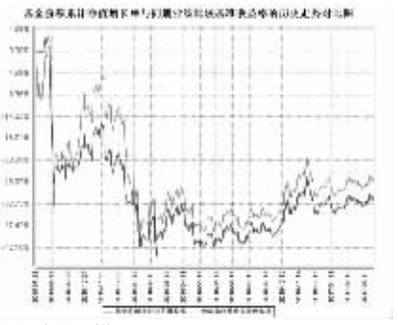
3、所列数据截止到报告期最后一日,无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

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	0.21%	0.73%	0.42%	0.74%	-0.21%	-0.01%

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2015年7月23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及投资限制的规定:股票资产投资比例不低于基金资产的90%,其中投资于中证高铁产业指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的80%,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%。股指期货、权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

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	2015年7月23日	-	7	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未超过该证券当日成交量的5%。

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)成份股票的停牌等。

本基金为指数型基金,基金管理人将继续按照基金合同的要求,坚持指数化投资策略,通过运用定量分析等技术,分析和应对导致基金跟踪误差的因素,继续努力将基金的跟踪误差控制在较低水平。

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0.21%,业绩比较基准收益率为0.42%。

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	67,308,950.88	92.50
	其中:股票	67,308,950.88	92.50
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	5,392,996.83	7.41
8	其他资产	61,670.56	0.08
9	合计	72,763,617.27	100.00

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 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	39,621,778.78	54.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	25,589,379.30	35.50
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	1,536,138.00	2.13
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	66,647,296.08	92.47

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

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	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	661,654.80	0.92
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	661,654.80	0.92

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 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	601186	中国铁建	810,859	10,533,058.41	14.61
2	601766	中国中车	1,014,778	10,391,326.72	14.42
3	601390	中国中铁	1,125,954	9,919,654.74	13.76
4	600820	隧道股份	491,547	5,136,666.15	7.13
5	600967	北方创业	176,090	2,664,241.70	3.70
6	002501	利源精制	189,982	2,467,866.18	3.42
7	600169	太原重工	467,606	2,066,814.10	2.87
8	000008	神州高铁	215,652	1,884,798.48	2.61
9	600495	晋西车轴	220,444	1,864,956.24	2.59
10	603111	康尼机电	121,300	1,783,110.00	2.47

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

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	002282	博深工具	47,946	661,654.80	0.92

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	11,643.67
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,014.38
5	应收申购款	49,012.51
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	61,670.56

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处于转股期的可转换债券。

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	603111	康尼机电	1,783,110.00	2.47	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

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	002282	博深工具	661,654.80	0.92	重大事项

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	高铁A端	高铁B端	高铁母基
报告期期初基金份额总额	10,896,928.00	10,896,928.00	44,382,433.17
报告期期间基金总申购份额	-	-	9,905,390.50
减:报告期期间基金总赎回份额	-	-	10,349,303.26
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	1,995,014.00	1,995,014.00	-2,408,072.47
报告期末基金份额总额	12,890,942.00	12,890,942.00	41,530,447.94

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及定期折算调整份额,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;

4.本基金于2017年1月3日进行了定期折算。

§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

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

无。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据《工银瑞信中证高铁产业指数分级证券投资基金基金合同》及深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定,工银瑞信中证高铁产业指数分级证券投资基金在2017年1月3日办理定期份额折算业务。详见基金管理人于2017年1月5日发布的《关于工银瑞信中证高铁产业指数分级证券投资基金定期份额折算结果及恢复交易的公告》。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会准予工银瑞信中证高铁产业指数分级证券投资基金募集申请的注册文件;

2、《工银瑞信中证高铁产业指数分级证券投资基金基金合同》;

3、《工银瑞信中证高铁产业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、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的住所。

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。

工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金

【2017】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:招商证券股份有限公司
报告送出日期: