# 工银瑞信中证新能源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:中国银河证券股份有限公司
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。

基金托管人中国银河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 | 工银中证新能源指数分级 |
| 场内简称 | 新能母基 |
| 交易代码 | 164821 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2015年7月9日 |
| 报告期末基金份额总额 | 38,239,508.97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,围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 | 中证新能源指数收益率×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。工银新能源A份额具有低风险、低预期收益的特征;工银新能源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 | 中国银河证券股份有限公司 |
| 下属分级基金的基金简称 | 新能A级 / 新能B级 / 新能母基 |
| 下属分级基金的交易代码 | 150327 / 150328 / 164821 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 7,170,172.00份 / 7,170,172.00份 / 23,899,164.97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 | -170,318.05 |
| 2.本期利润 | 1,987,185.13 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0487 |
| 4.期末基金资产净值 | 44,980,495.05 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.1763 |

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。

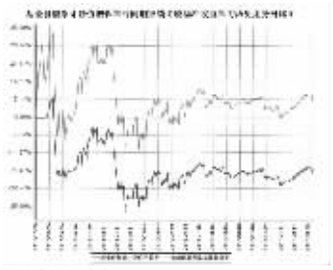
3、所列数据截止到报告期最后一日,无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

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 | 4.19% | 0.73% | 4.84% | 0.71% | -0.65% | 0.02% |

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9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%,其中投资于中证新能源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 | | |
| 赵栩 | 指数投资部副总监,本基金的基金经理 | 2015年7月9日 | - | 9 | 2008年加入工银瑞信,曾任风险管理部金融工程分析师,现任指数投资部副总监,2011年10月18日至今担任工银上证央企ETF基金基金经理;2012年10月9日至今担任工银深证红利ETF连接基金基金经理;2012年10月9日至今担任工银深证红利ETF发起式基金基金经理,2013年5月28日至今担任工银标普全球自然指数基金(自2016年12月6日起,变更为工银瑞信国际原油证券投资基金(LOF))基金经理,2015年7月9日至今担任工银瑞信中证环保产业指数分级基金基金经理,2015年7月9日至今担任工银瑞信中证新能源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4.19%,业绩比较基准收益率为4.84%。

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二十个工作日基金资产净值低于5000万元的情形。

§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 | 41,980,823.08 | 92.87 |
| | 其中:股票 | 41,980,823.08 | 92.87 |
| 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 | 2,620,300.57 | 5.80 |
| 8 | 其他资产 | 605,018.49 | 1.34 |
| 9 | 合计 | 45,206,142.14 | 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 | 353,080.00 | 0.78 |
| C | 制造业 | 34,972,039.08 | 77.75 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 3,227,956.00 | 7.18 |
| E | 建筑业 | 419,930.00 | 0.93 |
| 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 | 2,492,091.00 | 5.54 |
| 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 | 337,792.00 | 0.75 |
| | 合计 | 41,802,888.08 | 92.94 |

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 | 177,935.00 | 0.40 |
| 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 | 177,935.00 | 0.40 |

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

| 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 | 600089 | 特变电工 | 151,400 | 1,694,166.00 | 3.77 |
| 2 | 601985 | 中国核电 | 218,000 | 1,582,680.00 | 3.52 |
| 3 | 600703 | 三安光电 | 95,162 | 1,521,640.38 | 3.38 |
| 4 | 601727 | 上海电气 | 171,700 | 1,445,714.00 | 3.21 |
| 5 | 000839 | 中信国安 | 128,050 | 1,308,671.00 | 2.91 |
| 6 | 002594 | 比亚迪 | 25,400 | 1,219,708.00 | 2.71 |
| 7 | 002466 | 天齐锂业 | 27,860 | 1,203,552.00 | 2.68 |
| 8 | 600406 | 国电南瑞 | 74,900 | 1,183,420.00 | 2.63 |
| 9 | 002202 | 金风科技 | 73,001 | 1,172,396.06 | 2.61 |
| 10 | 002460 | 赣锋锂业 | 24,600 | 1,016,718.00 | 2.26 |

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 | 603308 | 应流股份 | 9,500 | 177,935.00 | 0.40 |

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 | 8,241.06 |
| 2 | 应收证券清算款 | 578,681.31 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 532.04 |
| 5 | 应收申购款 | 17,564.08 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 605,018.49 |

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 | 601727 | 上海电气 | 1,445,714.00 | 3.21 | 重大事项 |
| 2 | 600406 | 国电南瑞 | 1,183,420.00 | 2.63 | 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 | 新能A级 | 新能B级 | 新能母基 |
|---|---|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 7,640,861.00 | 7,640,861.00 | 29,385,077.21 |
| 报告期期间基金总申购份额 | - | - | 1,420,469.19 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | - | - | 8,852,220.89 |
| 报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列) | -470,689.00 | -470,689.00 | 1,945,839.46 |
| 报告期期末基金份额总额 | 7,170,172.00 | 7,170,172.00 | 23,899,164.97 |

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《工银瑞信中证新能源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,工银瑞信中证新能源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《关于工银瑞信中证新能源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新能源指数分级证券投资基金募集申请的注册文件;

2、《工银瑞信中证新能源指数分级证券投资基金基金合同》;

3、《工银瑞信中证新能源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。

# 工银瑞信总回报灵活配置混合型证券投资基金

## 【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:中国建设银行股份有限公司
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。

基金托管人中国建设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 | 工银总回报灵活配置混合 |
| 交易代码 | 001140 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2015年4月17日 |
| 报告期末基金份额总额 | 2,179,433,580.37份 |
| 投资目标 | 通过识别宏观经济周期与资本市场轮动的行为模式,深入研究不同周期与市场背景下各类型资产的价值与回报,通过"自上而下"的大类资产配置与"自下而上"的个券选择,在风险可控的范围内追求组合收益的最大化。 |
| 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,根据对国际及国内宏观经济运行态势、宏观经济政策变化、证券市场运行状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、公司价值性和成长性分析,综合评价各类资产的风险收益水平。在充分的宏观形势判断和策略分析的基础上,通过"自上而下"的资产配置及动态调整策略,将基金资产在各类型证券上进行灵活配置。在市场上涨阶段中,增加收益类资产配置比例;在市场下行周期中,增加固定收益类资产配置比例,最终力求实现基金资产组合收益的最大化,从而有效提高不同市场状况下基金资产的整体收益水平。 |
| 业绩比较基准 | 55%×沪深300指数收益率+45%×中债综合指数收益率。 |
| 风险收益特征 | 本基金为灵活配置混合型基金,预期收益和风险水平低于股票型基金,高于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 | 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(2017年1月1日 - 2017年3月31日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | -2,412,254.73 |
| 2.本期利润 | 1,775,114.51 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0008 |
| 4.期末基金资产净值 | 2,071,482,640.93 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.950 |

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。

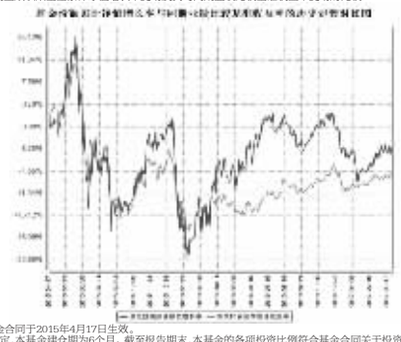
3、所列数据截止到报告期最后一日,无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

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 | 0.00% | 0.69% | 2.27% | 0.29% | -2.27% | 0.40% |

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4月17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:股票资产占基金资产的比例为90%-95%,每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债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 | | |
| 杜海涛 | 副总经理,本基金的基金经理 | 2015年4月17日 | - | 20 | 先后在宝盈基金管理有限公司担任基金经理助理,招商基金管理有限公司担任招商竞争增值基金基金经理;2006年加入工银瑞信,现任副总经理,兼任工银瑞信资产管理(国际)有限公司董事;2006年9月21日至2011年4月21日,担任工银货币市场基金基金经理;2010年8月16日至2012年1月10日,担任工银双利债券型基金基金经理;2007年5月11日至今,担任工银瑞信强收益债券型基金基金经理;2011年8月10日至今,担任工银瑞信添颐债券型证券投资基金基金经理;2012年6月21日至今,担任工银纯债定期开放基金基金经理;2013年1月7日至今,担任工银货币市场基金基金经理;2013年8月14日至2015年11月11日,担任工银月月新定期支付债券型基金基金经理;2013年10月31日至今,担任工银瑞信添福债券基金基金经理;2014年1月27日至今,担任工银新金货币市场基金基金经理;2015年4月17日至今,担任工银总回报灵活配置混合型基金基金经理。 |
| 邵耀 | 权益投资部副总监,本基金的基金经理 | 2015年4月17日 | - | 9 | 先后在德勤华永会计师事务所有限公司担任高级审计员,中国国际金融有限公司担任分析员,2010年加入工银瑞信,现任权益投资部副总监。2013年8月26日至今,担任工银瑞信金融地产行业混合型证券投资基金基金经理;2014年1月20日至今,担任工银添福债券基金基金经理;2014年1月20日至2015年11月11日,担任工银月月新定期支付债券基金基金经理;2014年9月10日起至今,担任工银新研富灵活配置混合型基金基金经理;2015年3月19日至今,担任工银瑞信新金融股票型基金基金经理;2015年3月26日至今,担任工银瑞信美丽城镇主题股票型基金基金经理;2015年4月17日至今,担任工银总回报灵活配置混合型基金基金经理。 |

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

2017年一季度国内经济延续了去年下半年企稳回升的态势,以美欧日为代表的全球经济亦有复苏,美联储如期加息,世界各国央行都有边际上收紧货币政策的想法。

国内债券市场在经济企稳回升,流动性边际向紧情况下,收益率高位震荡。而股票市场受经济向好企业盈利复苏影响表现较好,特别是各个行业实际经营能力较强的龙头企业超额收益明显。兼具股债特性的可转债市场受大盘转债供给冲击影响出现回调,但在股强债稳的大背景下未来成长性可期。

本基金在报告期内根据对于市场变化的判断积极调整仓位,同时积极参与新股申购,以及新发可转债申购。

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0.00%,业绩比较基准收益率为2.27%。

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 | 1,648,633,577.63 | 78.79 |
| | 其中:股票 | 1,648,633,577.63 | 78.79 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 117,264,515.00 | 5.60 |
| | 其中:债券 | 117,264,515.00 | 5.60 |
| | 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 | 316,126,328.63 | 15.11 |
| 8 | 其他资产 | 10,533,682.90 | 0.50 |
| 9 | 合计 | 2,092,558,105.16 | 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 | 16,752,000.00 | 0.81 |
| B | 采矿业 | 46,483,161.00 | 2.24 |
| C | 制造业 | 763,513,243.24 | 36.86 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 62,337,061.57 | 3.01 |
| F | 批发和零售业 | 49,540,984.00 | 2.39 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 10,150,909.08 | 0.49 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 8,438,375.39 | 0.41 |
| J | 金融业 | 394,777,216.70 | 19.06 |
| K | 房地产业 | 270,203,157.10 | 13.04 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 16,930.16 | 0.00 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 46,724.92 | 0.00 |
| 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 | 26,373,814.47 | 1.27 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 1,648,633,577.63 | 79.59 |

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 | 002142 | 宁波银行 | 8,000,193 | 147,363,555.06 | 7.11 |
| 2 | 300285 | 国瓷材料 | 3,448,366 | 138,038,090.98 | 6.66 |
| 3 | 000567 | 海德股份 | 3,839,839 | 117,422,276.62 | 5.67 |
| 4 | 300429 | 强力新材 | 3,475,875 | 104,450,043.75 | 5.04 |
| 5 | 600643 | 爱建集团 | 7,399,676 | 99,081,661.64 | 4.78 |
| 6 | 600266 | 北京城建 | 6,499,905 | 95,158,609.20 | 4.59 |
| 7 | 000858 | 五粮液 | 1,600,000 | 68,800,000.00 | 3.32 |
| 8 | 601009 | 南京银行 | 5,000,000 | 60,100,000.00 | 2.90 |
| 9 | 000002 | 万科A | 2,799,916 | 57,622,271.28 | 2.78 |
| 10 | 600030 | 中信证券 | 3,200,000 | 51,552,000.00 | 2.49 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中:政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债(可交换债) | 117,264,515.00 | 5.66 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 117,264,515.00 | 5.66 |

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。

5.5 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

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 132004 | 15国盛EB | 606,510 | 58,746,558.60 | 2.84 |
| 2 | 132006 | 15国资EB | 167,470 | 17,714,976.60 | 0.86 |
| 3 | 110032 | 三一转债 | 100,000 | 11,106,000.00 | 0.54 |
| 4 | 128012 | 辉丰转债 | 100,000 | 10,372,000.00 | 0.50 |
| 5 | 113011 | 光大转债 | 74,990 | 7,499,000.00 | 0.36 |

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 | 447,026.25 |
| 2 | 应收证券清算款 | 9,629,669.51 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 430,241.69 |
| 5 | 应收申购款 | 26,745.45 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 10,533,682.90 |

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

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

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 2,277,349,260.64 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 4,317,289.27 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 102,232,969.54 |
| 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 | 2,179,433,580.37 |

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 | 56,554,077.24 |
| 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 | 56,554,077.24 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%) | 2.59 |

注:报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额;

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

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

无。

§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总回报灵活配置混合型证券投资基金募集申请的注册文件;

2、《工银瑞信总回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

3、《工银瑞信总回报灵活配置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、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。

# 工银瑞信主题策略混合型证券投资基金

## 【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:交通银行股份有限公司
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