

基金管理人：工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司
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、监事、高级管理人员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的法律责任。
基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司承诺以本基金的基金合同为准，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，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人声明以诚实信用、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未来表现。投资人认购基金后，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2017年1月26日至基金合同生效日止起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	工银瑞信半年定期开放式基金
交易代码	000363
基金运作方式	契约型开放式
报告期末基金份额总额	621,067,381.05份
投资目标	本基金主要在控制风险的基础上，合理配置股债比例，精选个股，追求基金资产的长期稳定增值。

投资策略
本基金主要投资于股票、债券、货币市场工具等金融工具，根据宏观经济环境、行业景气度、公司基本面、估值水平、流动性等因素，综合分析判断，结合对宏观经济、行业政策、资金面、利率、汇率、海外市场等的跟踪研究，通过“自下而上”的资产配置及动态调整，精选基金资产的股票、债券、货币市场工具等金融工具进行投资，在严格控制风险的前提下，追求基金资产的长期稳定增值。

业绩比较基准
中证综合指数(收益率)×70%+深证300指数(收益率)×20%+银行存款利率(税后)(1%)

风险收益特征
本基金为中长期基金，属于风险较高基金，其长期平均风险和预期收益水平高于货币基金，高风险高收益。

基金管理人
工银瑞信基金管理有限公司

基金托管人
上海浦东发展银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

主要财务指标 报告期：2017年1月26日 - 2017年3月31日)

1.本期已实现收益 2,276,311.00

2.本期利润 2,668,463.00

3.期初基金份额总额 623,626,744.13

4.期末基金份额净值 1.0049

注：1.上述基金费用不包括持有人认购或申购基金的各项费用，计入费用后实际收益水平将低于所列数字。
2.本期利润是基金利息收入、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，本期利润为期初可供分配利润与本期利润之和。
3.净值增长率=到期赎回价/期初基金份额净值-1，无论是否为开放日或交易所的交易日。

3.2 基金净值增长率为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
过去三个月 0.49% 0.01% 0.41% 0.12% 0.08% -0.12%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

图示：基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较

注：1.本基金合同于2017年1月26日生效，截至报告期末，本基金尚未完成建仓。
2.本基金的建仓期为3个月，建仓完成后，本基金的各项指标均符合合同关于投资范围、投资比例的规定；投资于债券的比例不低于基金资产的90%，投资于权益类资产的比例不超过基金资产的20%，但为定期流动性需要，保留5%的现金，因此本基金的现金比例未达到法律法规规定的比例上限。
3.本基金的建仓期从2017年1月26日起至2017年4月25日止，开放期开始后本基金在每个交易日可在扣缴申购费的前提下向交易所申报卖出基金份额，本基金所持有的现金比例不低于基金资产净值的5%；在非开放期，本基金不受此项比例的限制。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵守行业规范的情况的说明

本公司恪守职业道德，投资人利益优先，避免出现不正当关联交易，利益输送等违法行规，由公司根据《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》、《证券投资基金销售行为公平原则指导意见》等法律法规和公司内部规章制度，拟定了《公平交易管理规定》、《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具体的规定，并规定对买卖股票、债券市场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，本公司对满足限售条件对同一证券有不同买卖需求的投资组，均采取了系统的公平交易规则执行操作，实现了公平交易；未出现影响不公平的状况。本基金及其基金管理人及其他投资组合之间未发生法律禁止的反向交易及内幕交易。

4.32 异常交易行为的专项说明

本基金不存在异常交易行为。

5.1 重要提示

基金管理人的董事、监事、高级管理人员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的法律责任。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司承诺以本基金的基金合同为准，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，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人声明以诚实信用、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未来表现。投资人认购基金后，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2017年1月26日至基金合同生效日止起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金名称 工银瑞信100指数分级

场内简称 100基

交易代码 160611

报告期末基金份额总额 25,995,303.00份

报告期末基金份额净值 1.0000

注：1.上述基金费用不包括持有人认购或申购基金的各项费用，计入费用后实际收益水平将低于所列数字。
2.本期利润是基金利息收入、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，本期利润为期初可供分配利润与本期利润之和。
3.净值增长率=到期赎回价/期初基金份额净值-1，无论是否为开放日或交易所的交易日。

5.2 基金净值增长率为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
过去三个月 0.49% 0.01% 0.41% 0.12% -0.12%

5.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

图示：基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较

注：由于四舍五入的原因，期初基金份额净值占基金总资产的比例分母之和与合计可能有尾差。

5.2.3 报告期未按行业分类的境内股票投资组合

序号 股票代码 股票名称 持有股数(股) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000001 格力电器 60,200 1,160,740.20 4.94

2 000003 美的集团 47,016 1,169,590.00 4.96

3 300008 丽珠集团 32,000 1,094,140.00 3.27

4 000725 东方电气 269,200 922,600.00 2.96

5 000002 万科A 3,100 893,802.30 2.77

6 000998 五粮液 19,498 827,964.00 2.03

7 000001 平安银行 88,940 815,633.16 2.53

8 002415 海康威视 20,623 664,263.70 2.06

9 000797 广发银行 31,023 646,564.07 1.69

10 002494 沃尔玛 6,621 600,630.00 1.58

注：由于四舍五入的原因，期初基金份额净值占基金总资产的比例分母之和与合计可能有尾差。

5.2.4 报告期未按行业分类的境内债券投资组合

序号 债券代码 债券名称 持有数量(手) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 100000 000000 1,000,000 1,000,000.00 100.00

2 11170006 1000000000 1,000,000 978,940.00 96.99

3 11161716 1000000000 1,000,000 96,710,000.00 18.47

4 11171034 1000000000 1,000,000 96,386,000.00 9.29

5 11170068 1000000000 600,000 49,940,000.00 9.29

6 11170064 1000000000 600,000 49,940,000.00 9.29

7 11170064 1000000000 600,000 49,940,000.00 9.29

8 11170064 1000000000 600,000 49,940,000.00 9.29

9 11170064 1000000000 600,000 49,940,000.00 9.29

10 11170064 1000000000 600,000 49,940,000.00 9.29

注：由于四舍五入的原因，期初基金份额净值占基金总资产的比例分母之和与合计可能有尾差。

5.2.5 报告期按行业分类的沪市股票投资组合

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 - -

B 制造业 3,402,981.00 3.40

C 制造业 66,210,290.04 67.69

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 - -

E 建筑业 2,647,314.04 2.71

F 批发、零售业 2,641,401.06 2.60

G 银行业 5,260,977.47 5.28

H 交通运输、仓储和邮政业 - -

I 信息技术业 2,681,980.02 2.74

J 住宿和餐饮业 - -

K 房地产业 6,122,430.08 6.24

L 科学、技术服务业 - -

M 生物产业 2,276,161.20 2.29

N 水利、环境和公共设施管理业 446,403.02 0.46

O 仪器仪表、机械、设备、家具、汽车和其他制造业 - -

P 教育 - -

Q 卫生和社会工作 230,168.40 0.24

R 文化、体育和娱乐业 1,269,646.00 1.29

S 综合 721,981.07 0.74

合计 2,366,369.00 100.00

注：由于四舍五入的原因，期初基金份额净值占基金总资产的比例分母之和与合计可能有尾差。

5.2.6 报告期未按行业分类的沪市债券投资组合

序号 债券代码 债券名称 持有数量(手) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000001 000000 1,000,000 1,000,000.00 100.00

2 11170064 1000000000 600,000 596,000.00 5.96

3 000001 000000 600,000 596,000.00 5.96

4 11170064 1000000000 600,000 596,000.00 5.96

5 11170064 1000000000 600,000 596,000.00 5.96

6 11170064 1000000000 600,000 596,000.00 5.96

7 11170064 1000000000 600,000 596,000.00 5.96

8 11170064 1000000000 600,000 596,000.00 5.96

9 11170064 1000000000 600,000 596,000.00 5.96

10 11170064 1000000000 600,000 596,000.00 5.96

注：由于四舍五入的原因，期初基金份额净值占基金总资产的比例分母之和与合计可能有尾差。

5.2.7 报告期按行业分类的深市股票投资组合