

工银瑞信精选平衡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

基金管理人的董事会及董事声明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对本基金合同约定,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、谨慎勤勉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。

本报告期自2017年1月1日起至3月31日止。

§ 1 基本产品概况

基金简称 工银瑞信精选平衡混合型证券投资基金

交易代码 400003

基金份额净值 0.997

货币市场基金 0.997

定期开放式

2009年7月13日

报告期末基金份额总额 3,031,969,676.06份

投资目标 有效控制风险,追求长期资本增值。

投资策略 本基金在充分研究、遵循系统化、程序化的投资流程以保证投资决策的科学性与一致性。

业绩比较基准 60%×沪深300指数收益率+40%×中债国债综合指数(财富)收益率。

风险收益特征 本基金为混合型基金,风险水平介于股票型基金与债券型基金之间。

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

基金代销机构 工银瑞信基金管理有限公司

§ 2 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 -41,079,470.00元

2.本期利润 44,382,000.00元

3.期末可供分配利润 1,026,962,340.00元

4.期末基金资产净值 1,026,962,340.00元

5.期末基金份额净值 0.997元

注:1.由于舍弃五入的原因基金资产净值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 - -

B 制造业 53,620,389.72 2.00%

C 制造业 864,969,304.70 40.00%

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 101,367,481.05 5.60%

E 建筑业 197,066,034.66 9.07%

F 批发和零售业 130,384.90 0.01%

G 交通运输、仓储和邮政业 131,314.09 0.01%

H 住宿和餐饮业 - -

I 信息传输、软件和信息技术服务业 128,502,000.00 6.05%

J 金融、房地产 1,026,962,340.00 -

K 房地产业 - -

L 租赁和商务服务业 - -

M 科学技术服务业 16,500.00 0.00%

N 水利、环境和公共设施管理业 - -

O 国防废物、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 1,386,745,288.06 71.17%

注:由于舍弃五入的原因基金资产净值占基金总资产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债券投资组合

5.2.3 报告期末按行业分类的资产支持证券投资组合

5.2.4 报告期末按行业分类的贵金属及其它投资组合

5.3 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 -41,079,470.00元

2.本期利润 44,382,000.00元

3.期末可供分配利润 1,026,962,340.00元

4.期末基金资产净值 1,026,962,340.00元

5.期末基金份额净值 0.997元

注:1.由于舍弃五入的原因基金资产净值占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

2.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组合

序号 股票代码 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 农林、牧、渔业 175,750,000.00 7.80%

2 制造业 143,662,304.65 6.00%

3 电子 108,400,000.00 4.60%

4 电力、热力、燃气及水生产和供应业 101,367,481.05 5.60%

5 建筑业 197,066,034.66 9.07%

6 批发和零售业 130,384.90 0.01%

7 交通运输、仓储和邮政业 131,314.09 0.01%

8 信息传输、软件和信息技术服务业 128,502,000.00 6.05%

9 金融、房地产 1,026,962,340.00 -

10 其他行业 - -

合计 1,386,745,288.06 71.17%

注:由于舍弃五入的原因基金资产净值占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

5.2.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的小额定期存款

序号 项目 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 银行 100,000.00 0.01%

2 其他 - -

合计 100,000.00 0.01%

注:由于舍弃五入的原因基金资产净值占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

5.2.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的债券投资

序号 项目 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 国库券 99,740,000.00 9.31%

2 中央票据 - -

3 企业债 500,000.00 0.00%

4 短期融资券 500,000.00 0.00%

5 资产支持证券 500,000.00 0.00%

6 其他 - -

合计 1,026,962,340.00 100.00%

注:由于舍弃五入的原因基金资产净值占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

5.2.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的资产支持证券投资

序号 项目 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 资产支持证券 500,000.00 0.00%

2 其他 - -

合计 500,000.00 0.00%

注:由于舍弃五入的原因基金资产净值占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

5.2.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的贵金属及其它投资

序号 项目 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 其他 - -

合计 0.00 0.00%

注:由于舍弃五入的原因基金资产净值占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

5.2.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的资产支持证券投资基金

序号 项目 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 资产支持证券 0.00 0.00%

2 其他 - -

合计 0.00 0.00%

注:由于舍弃五入的原因基金资产净值占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

5.2.10 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票型基金

序号 项目 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 股票型基金 0.00 0.00%

2 其他 - -

合计 0.00 0.00%

注:由于舍弃五入的原因基金资产净值占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

5.2.11 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的债券型基金

序号 项目 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 债券型基金 0.00 0.00%

2 其他 - -

合计 0.00 0.00%

注:由于舍弃五入的原因基金资产净值占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

5.2.12 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的货币型基金

序号 项目 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 货币型基金 1,026,962,340.00 100.00%

2 其他 - -

合计 1,026,962,340.00 100.00%

注:由于舍弃五入的原因基金资产净值占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

5.2.13 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他基金

序号 项目 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 其他 0.00 0.00%

2 其他 - -

3 其他 - -

4 其他 - -

5 其他 - -

6 其他 - -

7 其他 - -

8 其他 - -

9 其他 - -

10 其他 - -

11 其他 - -

12 其他 - -

13 其他 - -