

## 工银瑞信丰益一年定期开放债券型证券投资基金

[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:中国光大银行股份有限公司  
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、误导性陈述或者重大遗漏，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:中国光大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、投资组合报告等内容，保证复核后的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2017年1月1日起至3月31日止。

**§ 2 基金产品概况**

基金简称	基金代码	份额(元)	占基金资产的比例(%)
工银瑞信丰益一年定期开放债券型证券投资基金	161901	-	-
基金运作方式	契约型开放式	-	-
基金合同生效日	2016年12月12日	-	-
报告期起始日	2017年1月1日	-	-
报告期终止日	2017年3月31日	-	-
报告期	2017年1月1日至2017年3月31日	-	-
报告期末基金资产净值	17,461,004,470.01	-	-
报告期末基金份额净值	1.0000	-	-
报告期末可供分配基金份额净值	0.0000	-	-
报告期末可供分配金额	17,461,004,470.01	-	-
报告期末可供分配利润	17,461,004,470.01	-	-
报告期末可供分配基金份额总额	17,461,004,470.01	-	-
报告期末可供分配金额	17,461,004,470.01	-	-
报告期末可供分配基金份额总额	17,461,004,470.01	-	-

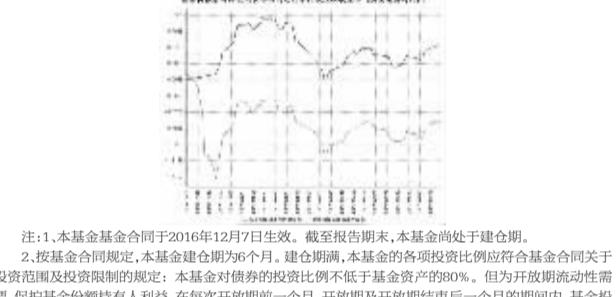
**§ 3 主要财务指标和基金净值表现**

单位:人民币元

主要财务指标		报告期(2017年1月1日 - 2017年3月31日)
1.本期已实现收益	-	-0.439,300.00
2.本期利润	-	-0.362,000.00
3.加权平均基金份额本期利润	-	-0.020,600.00
4.期末可供分配基金份额净值	-	1.0000
5.期末基金资产净值	-	17,461,004,470.01

注:1、上述基金绩效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示的数字。  
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、所列数据截止报告期最后一日, 无法判断该日是否为开放日或交易所的交易日。**3.2 基金的净值表现****3.2.1 本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(%)	净值增长标准差(%)	业绩比较基准收益率(%)	业绩比较基准收益率标准差(%)	①-③	②-④
过去三个月	-0.029%	-0.034%	0.007%	0.023%	0.01%	0.01%

**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2016年12月7日生效。截至报告期末,本基金尚处于建仓期。

2、按基金合同期定,本基金建仓期为6个月。建仓期间,本基金的各项资产比例应符合基金合同关于投资范围及投资限制的规定:本基金现金类资产的比例如不低于基金资产的90%。但为降低流动性需求,本基金的现金类资产比例可能在一定时期内低于90%。美国股票及消费增值服务不时出现,本基金不受上述比例限制。开放期内,本基金将持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例如合计不低于基金资产净值的5%;在非开放期,本基金不受该比例限制。

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	性别	本基金的基金经理	任本基金的基金经理	辞职日期	辞职原因
孙晓东	男	工银瑞信基金管理有限公司	孙晓东	2016年12月12日	2017年3月31日	辞职

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

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, 谨慎履行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, 严格控制基金价格波动对持有人利益的影响。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易执行的情况  
为了公平对待所有客户, 保护各类型投资人, 避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为, 本公司根据《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》, 《证券投资基金公平交易制度指导意见》等法律法规及公司内部规章制度, 拟定了《公平交易管理办法》。《公平交易管理办法》对公司的各项资产的公平对待原则进行了明确规定, 并规定对买卖证券、债券时候的价格和市场价差距较大, 可能存在操盘纠纷、利益输送等违法违规情形进行监控。本报告期内, 按照时间优先、价格优先的原

则, 本公司对具备资格的机构买卖对同一券种有相近需求的基金投资组合, 均采用了系统中的公平交易规则进行操作, 实现了公平交易; 出现显著不利时的情况, 且本基金及本基金与基金管理人之间的其他投资组合之间未发生法律规定的禁止的反向交易及交叉交易。

4.3.2 异常交易的专项说明

本基金本期内未发生异常交易的情况。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金管理人于2017年3月21日发布分红公告, 以截至2017年3月16日的可分配收益为基准, 每每10份基金份额派发红利0.030元, 共计派发红利2,503,283.47元, 收益登记日为2017年3月22日。

4.5 备查文件目录

1.中国证监会准予工银瑞信丰益一年定期开放债券型证券投资基金募集申请的注册文件;

2.《工银瑞信丰益一年定期开放债券型证券投资基金合同》;

3.《工银瑞信丰益一年定期开放债券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.报告期末基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

9.2 存款账户

基金管理人的基金托管人的住所。

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。

9.4 投资组合报告

9.5 投资组合报告

注:1、本基金基金合同于2016年12月22日生效。截至报告期末, 本基金尚未达到基金合同规定的基金资产净值5%的条件。

2、按基金合同期定, 本基金建仓期为6个月。截至报告期末, 本基金的各项资产比例符合基金合同关于投资范围及投资限制的规定:本基金现金类资产的比例如不低于基金资产的90%。其中, 本基金不受该比例限制。

3.3 其他指标  
无。**§ 6 开放式基金份额变动**

单位:份

报告期基金份额变动		报告期(2017年1月1日 - 2017年3月31日)
1.本期申购	-	-30,539,379.20
2.本期赎回	-	7,404,460.00
3.本期转换转入	-	0.0000
4.本期转换转出	-	1,347,161,761.12
5.期末基金资产净值	-	1,000.00

注:由于四舍五入的原因基金资产净值的分位数之和与合计可能有尾差。

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2016年12月22日生效。截至报告期末, 本基金尚未达到基金合同规定的基金资产净值5%的条件。

2、按基金合同期定, 本基金建仓期为6个月。截至报告期末, 本基金的各项资产比例符合基金合同关于投资范围及投资限制的规定:本基金现金类资产的比例如不低于基金资产的90%。其中, 本基金不受该比例限制。

3.3 其他指标  
无。**§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况**

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

7.1.1 本基金管理人运用固有资金投资的情况

7.1.2 本基金管理人运用固有资金投资的品种

7.1.3 本基金管理人运用固有资金投资的规模

7.1.4 本基金管理人运用固有资金投资的占比

7.1.5 本基金管理人运用固有资金投资的期限

7.1.6 本基金管理人运用固有资金投资的次数

7.1.7 本基金管理人运用固有资金投资的频率

7.1.8 本基金管理人运用固有资金投资的金额

7.1.9 本基金管理人运用固有资金投资的占比

7.1.10 本基金管理人运用固有资金投资的期限

7.1.11 本基金管理人运用固有资金投资的次数

7.1.12 本基金管理人运用固有资金投资的频率

7.1.13 本基金管理人运用固有资金投资的金额

7.1.14 本基金管理人运用固有资金投资的占比

7.1.15 本基金管理人运用固有资金投资的期限

7.1.16 本基金管理人运用固有资金投资的次数

7.1.17 本基金管理人运用固有资金投资的频率

7.1.18 本基金管理人运用固有资金投资的金额

7.1.19 本基金管理人运用固有资金投资的占比

7.1.20 本基金管理人运用固有资金投资的期限

7.1.21 本基金管理人运用固有资金投资的次数

7.1.22 本基金管理人运用固有资金投资的频率

7.1.23 本基金管理人运用固有资金投资的金额

7.1.24 本基金管理人运用固有资金投资的占比

7.1.25 本基金管理人运用固有资金投资的期限

7.1.26 本基金管理人运用固有资金投资的次数

7.1.27 本基金管理人运用固有资金投资的频率

7.1.28 本基金管理人运用固有资金投资的金额

7.1.29 本基金管理人运用固有资金投资的占比

7.1.30 本基金管理人运用固有资金投资的期限

7.1.31 本基金管理人运用固有资金投资的次数

7.1.32 本基金管理人运用固有资金投资的频率

7.1.33 本基金管理人运用固有资金投资的金额

7.1.34 本基金管理人运用固有资金投资的占比

7.1.35 本基金管理人运用固有资金投资的期限

7.1.36 本基金管理人运用固有资金投资的次数

7.1.37 本基金管理人运用固有资金投资的频率

7.1.38 本基金管理人运用固有资金投资的金额

7.1.39 本基金管理人运用固有资金投资的占比

7.1.40 本基金管理人运用固有资金投资的期限

7.1.41 本基金管理人运用固有资金投资的次数

7.1.42 本基金管理人运用固有资金投资的频率

7.1.43 本基金管理人运用固有资金投资的金额&lt;/