

## 信息披露 Disclosure

## 工银瑞信银和利混合型证券投资基金

## 2017年第四季度报告

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:二〇一八年一月二十日

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，并对其中内容的真实性、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2018年1月18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请仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告告期自2017年10月1日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 工银瑞信银和利混合

交易代码 000722

基金运作方式 阶段性开放式

基金合同生效日 2016年12月9日

报告期末基金份额总额 500,000,040.04份

投资目标 在严格控制风险的前提下保持资产流动性的基础上，通过资产配置策略在追求绝对收益的同时，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。

投资策略 本基金由银和利两个子账户组成，分别投资于不同的资产类别，在充分分析和评估不同资产类别的风险和收益特征的基础上，通过资产配置策略在追求绝对收益的同时，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。

业绩比较基准 20%×沪深300指数收益+70%×中债综合指数收益率。

风险收益特征 本基金为混合型基金，预期收益风险水平低于股票型基金，高于货币市场基金。

基金经理 陈晓东

中国银河证券股份有限公司

§ 3 主要财务指标

主要财务指标 报告期(2017年10月1日 - 2017年12月31日)

1.本期已实现收益 13,638,223.26

2.本期利润 9,340,096.77

3.期末可供分配基金份额利润 0.0397

4.期末基金资产净值 661,202,836.06

5.期末基金份额净值 1.03

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，计算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(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准差 (%) ①-③ ②-④

过去三个月 1.60% 0.26% 1.23% 0.24% -0.3% 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

图1:基金合同生效以来至2016年12月29日的净值走势图

注2:本基金合同约定，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；本基金投资组合中股票资

产比例在基金合同规定的范围内。

注3:本基金合同于2016年12月29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；本基金投资组合中股票资

产比例在基金合同规定的范围内。

注4: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 固定收益类 116,286,310.51 21.00

2 其他类 116,286,310.51 21.00

3 固定收益类 420,875,726.60 76.22

4 固定收益类 420,875,726.60 76.22

5 固定收益类 5,991,472,010.00 100.00

6 固定收益类 5,991,472,010.00 100.00

7 衍生工具 2,240,030.20 0.04

8 其他类 12,742,796.38 2.31

9 合计 162,161,403.09 100.00

注:由于四舍五入的原因因基金占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

5.4 管理人报告期内本基金运作遵循销售情况的说明

本基金报告期内严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同，履行披露义务，不存在损害基金份额持有人利益的情况。

本报告期内未发生诉讼。

本报告告期自2017年10月1日起至12月31日止。

§ 6 基金产品概况

基金简称 工银瑞信银和利混合

交易代码 000722

基金运作方式 阶段性开放式

基金合同生效日 2016年12月9日

报告期末基金份额总额 260,256,621份

投资目标 在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过资产配置策略，在控制风险和保持资产流动性的基础上，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。

投资策略 本基金由银和利两个子账户组成，分别投资于不同的资产类别，在充分分析和评估不同资产类别的风险和收益特征的基础上，通过资产配置策略在追求绝对收益的同时，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。

业绩比较基准 20%×沪深300指数收益+70%×中债综合指数收益率。

风险收益特征 本基金为混合型基金，预期收益风险水平低于股票型基金，高于货币市场基金。

基金经理 陈晓东

中国银河证券股份有限公司

§ 3 主要财务指标

主要财务指标 报告期(2017年10月1日 - 2017年12月31日)

1.本期已实现收益 -202,000.05

2.本期利润 -1,797,605.31

3.期末可供分配基金份额利润 -0.0074

4.期末基金资产净值 266,422,070.05

5.期末基金份额净值 1.0210

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，计算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(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准差 (%) ①-③ ②-④

过去三个月 -0.68% 0.19% 1.23% 0.24% -1.91% -0.06%

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

图2:基金合同生效以来至2016年12月29日的净值走势图

注2:本基金合同于2016年12月29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；本基金投资组合中股票资

产比例在基金合同规定的范围内。

注3:本基金合同于2016年12月29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；本基金投资组合中股票资

产比例在基金合同规定的范围内。

注4: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 固定收益类 466,300.00 1.42%

2 其他类 -466,471.72 -1.57%

3 衍生工具 0.03% -0.01%

4 固定收益类 52,985,831.20 186,980.00

5. 固定收益类 0.02% 0.0071

注:由于四舍五入的原因因基金占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

5.4 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时间 说明

陈晓东 基金经理 2016年12月9日 -

注:陈晓东先生，中国科学院大学硕士，具有基金从业资格，具备丰富的行业研究经验，具备良好的职业操守，具备较强的管理能力，能够独立履行职责。

3.其他指标

4.5 报告期内基金运作指标的执行情况

本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请仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告告期自2017年10月1日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 工银瑞信银和利混合

交易代码 000722

基金运作方式 阶段性开放式

基金合同生效日 2016年12月9日

报告期末基金份额总额 500,000,040.04份

投资目标 在严格控制风险的前提下保持资产流动性的基础上，通过资产配置策略在追求绝对收益的同时，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。

投资策略 本基金由银和利两个子账户组成，分别投资于不同的资产类别，在充分分析和评估不同资产类别的风险和收益特征的基础上，通过资产配置策略在追求绝对收益的同时，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。

业绩比较基准 20%×沪深300指数收益+70%×中债综合指数收益率。

风险收益特征 本基金为混合型基金，预期收益风险水平低于股票型基金，高于货币市场基金。

基金经理 陈晓东

中国银河证券股份有限公司

§ 3 主要财务指标

主要财务指标 报告期(2017年10月1日 - 2017年12月31日)

1.本期已实现收益 -202,000.05

2.本期利润 -1,797,605.31

3.期末可供分配基金份额利润 -0.0074

4.期末基金资产净值 266,422,070.05

5.期末基金份额净值 1.0210

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，计算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(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准差 (%) ①-③ ②-④

过去三个月 1.20% 0.15% -1.2% 0.15% -1.3% 0.00%

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

图3:基金合同生效以来至2016年12月29日的净值走势图

注2:本基金合同于2016年12月29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；本基金投资组合中股票资