

工银瑞信睿智深证100指数分级证券投资基金

2014 第一季度报告

2014年3月31日

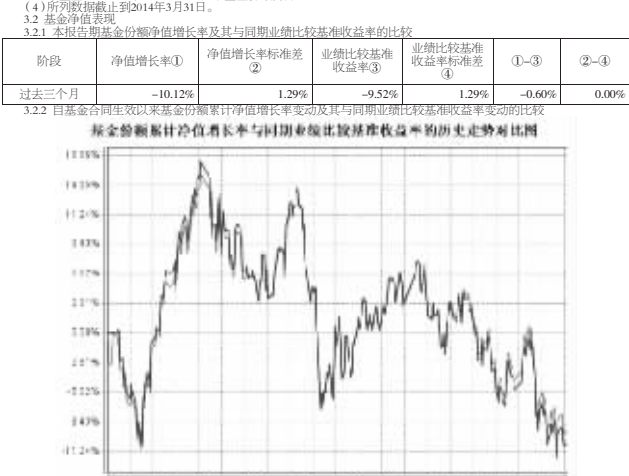
基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国光大银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一四年四月二十一日

5.1 重要提示
基金管理人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。

5.2 基金产品概况
基金简称:工银瑞信100指数分级 场内简称:工银100
基金代码:164811
基金运作方式:契约开放式

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
主要财务指标 报告期(2014年1月1日 - 2014年3月31日)
1.本期已实现收益 -218,952.09

5.3 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(2014年1月1日 - 2014年3月31日)
1.本期已实现收益 -218,952.09



注:1.本基金基金合同于2013年10月12日生效。
2.本基金基金合同于2013年10月12日生效。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、投资禁止行为及限制比例的规定。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介
姓名 职务 任职日期 离任日期 证券从业年限 说明

4.2 管理人及报告期内基金管理人遵守法律法规的情况
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约定,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。

5.1 报告期末基金资产组合情况
基金资产净值:1,708,985.63元
基金资产组合:股票投资 31,082,355.47 (93.83%)

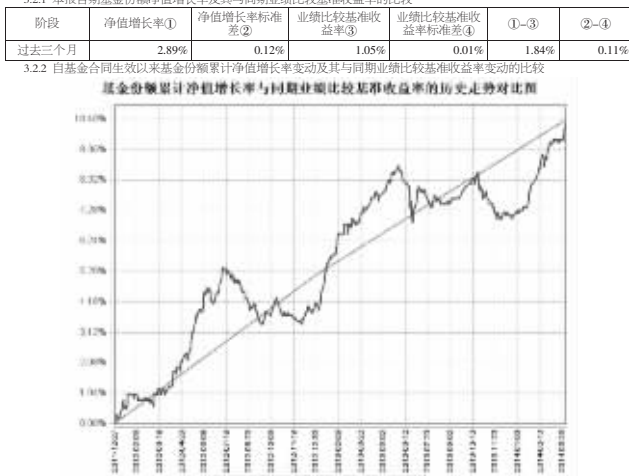
基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国光大银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一四年四月二十一日

5.1 重要提示
基金管理人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。

5.2 基金产品概况
基金简称:工银瑞信保本混合
基金代码:487016
基金运作方式:契约开放式

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
主要财务指标 报告期(2014年1月1日 - 2014年3月31日)
1.本期已实现收益 21,370,236.76

5.3 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(2014年1月1日 - 2014年3月31日)
1.本期已实现收益 21,370,236.76



注:1.本基金基金合同于2013年11月27日生效。
2.本基金基金合同于2013年11月27日生效。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。

Table with 5 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)
1 权益投资 31,082,355.47 93.83

注:1.由于本基金为股票型基金,基金资产的绝大部分均投资于股票。
2.本基金投资于权证资产的情况如下:
3.2.1 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 5 columns: 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 18,058.61 0.56

注:1.由于本基金为股票型基金,基金资产的绝大部分均投资于股票。
2.本基金投资于权证资产的情况如下:
3.2.1 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 5 columns: 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 000002 万科A 216,845 2,754,276.05 5.36

注:1.由于本基金为股票型基金,基金资产的绝大部分均投资于股票。
2.本基金投资于权证资产的情况如下:
3.2.1 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 5 columns: 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标准差③, 业绩比较基准收益率④, ①-③, ②-④
过去三个月 -0.12% 1.29% -0.52% 1.29% -0.60% 0.00%

注:1.本基金基金合同于2013年10月12日生效。
2.本基金基金合同于2013年10月12日生效。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、投资禁止行为及限制比例的规定。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介
姓名 职务 任职日期 离任日期 证券从业年限 说明

4.2 管理人及报告期内基金管理人遵守法律法规的情况
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约定,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。

5.1 报告期末基金资产组合情况
基金资产净值:1,708,985.63元
基金资产组合:股票投资 31,082,355.47 (93.83%)

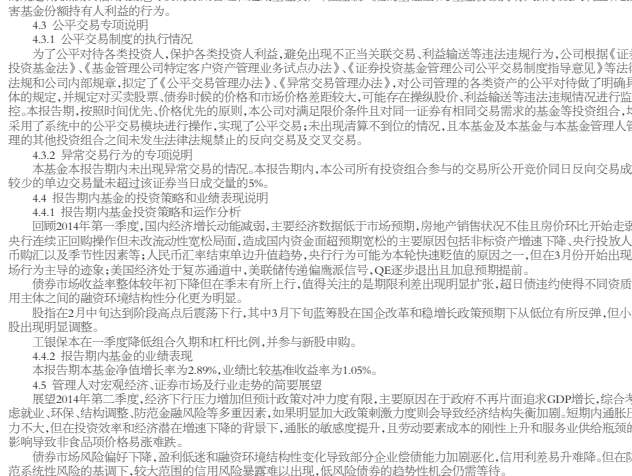
基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国光大银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一四年四月二十一日

5.1 重要提示
基金管理人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。

5.2 基金产品概况
基金简称:工银瑞信保本混合
基金代码:487016
基金运作方式:契约开放式

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
主要财务指标 报告期(2014年1月1日 - 2014年3月31日)
1.本期已实现收益 21,370,236.76

5.3 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(2014年1月1日 - 2014年3月31日)
1.本期已实现收益 21,370,236.76



注:1.本基金基金合同于2013年11月27日生效。
2.本基金基金合同于2013年11月27日生效。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。

工银瑞信基本面量化策略股票型证券投资基金

2014 第一季度报告

2014年3月31日

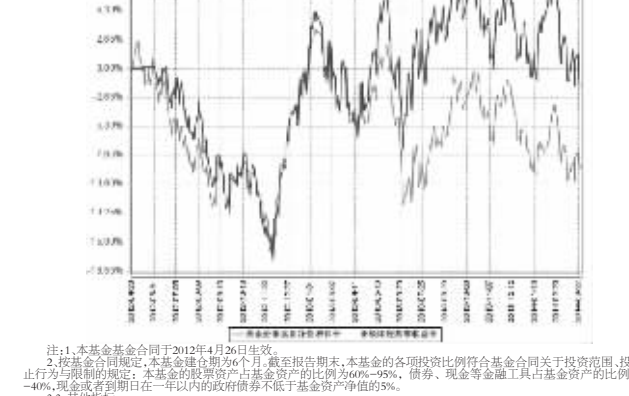
基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国光大银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一四年四月二十一日

5.1 重要提示
基金管理人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。

5.2 基金产品概况
基金简称:工银瑞信策略股票
基金代码:481017
基金运作方式:契约开放式

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
主要财务指标 报告期(2014年1月1日 - 2014年3月31日)
1.本期已实现收益 -1,439,807.73

5.3 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(2014年1月1日 - 2014年3月31日)
1.本期已实现收益 -1,439,807.73



注:1.本基金基金合同于2013年2月6日生效。
2.本基金基金合同于2013年2月6日生效。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、投资禁止行为及限制比例的规定。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介
姓名 职务 任职日期 离任日期 证券从业年限 说明

4.2 管理人及报告期内基金管理人遵守法律法规的情况
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约定,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。

5.1 报告期末基金资产组合情况
基金资产净值:1,708,985.63元
基金资产组合:股票投资 31,082,355.47 (93.83%)

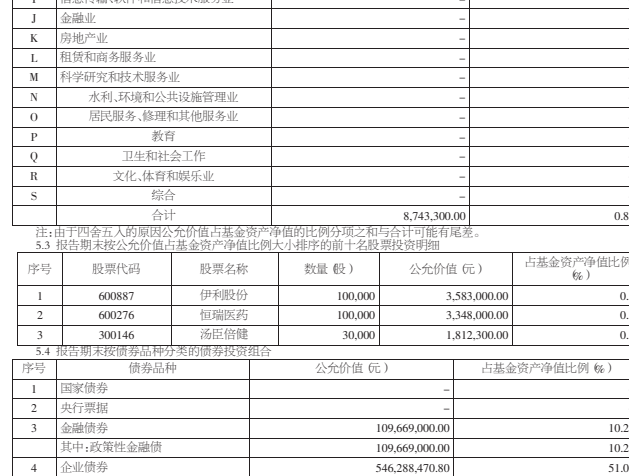
基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国光大银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一四年四月二十一日

5.1 重要提示
基金管理人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。

5.2 基金产品概况
基金简称:工银瑞信保本混合
基金代码:487016
基金运作方式:契约开放式

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
主要财务指标 报告期(2014年1月1日 - 2014年3月31日)
1.本期已实现收益 21,370,236.76

5.3 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(2014年1月1日 - 2014年3月31日)
1.本期已实现收益 21,370,236.76



注:1.本基金基金合同于2013年11月27日生效。
2.本基金基金合同于2013年11月27日生效。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。

Table with 5 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)
3 贵金属投资 - - -

注:1.由于本基金为股票型基金,基金资产的绝大部分均投资于股票。
2.本基金投资于权证资产的情况如下:
3.2.1 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 5 columns: 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 981,218.68 0.67

注:1.由于本基金为股票型基金,基金资产的绝大部分均投资于股票。
2.本基金投资于权证资产的情况如下:
3.2.1 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 5 columns: 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 300015 掌趣科技 223,440 6,016,236.60 2.83

注:1.由于本基金为股票型基金,基金资产的绝大部分均投资于股票。
2.本基金投资于权证资产的情况如下:
3.2.1 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 5 columns: 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标准差③, 业绩比较基准收益率④, ①-③, ②-④
过去三个月 1.30% 1.95% -0.52% 1.95% -0.60% 0.00%

注:1.本基金基金合同于2013年2月6日生效。
2.本基金基金合同于2013年2月6日生效。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、投资禁止行为及限制比例的规定。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介
姓名 职务 任职日期 离任日期 证券从业年限 说明

4.2 管理人及报告期内基金管理人遵守法律法规的情况
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约定,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。

5.1 报告期末基金资产组合情况
基金资产净值:1,708,985.63元
基金资产组合:股票投资 31,082,355.47 (93.83%)

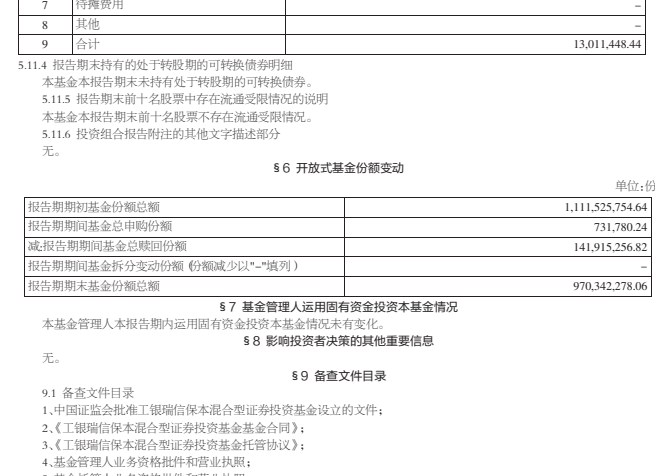
基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国光大银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一四年四月二十一日

5.1 重要提示
基金管理人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。

5.2 基金产品概况
基金简称:工银瑞信保本混合
基金代码:487016
基金运作方式:契约开放式

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
主要财务指标 报告期(2014年1月1日 - 2014年3月31日)
1.本期已实现收益 21,370,236.76

5.3 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(2014年1月1日 - 2014年3月31日)
1.本期已实现收益 21,370,236.76



注:1.本基金基金合同于2013年11月27日生效。
2.本基金基金合同于2013年11月27日生效。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。