# 工银瑞信新材料新能源行业股票型证券投资基金

## 2018年第三季度报告

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:兴业银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一八年十月二十五日

§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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月23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应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 工银新材料新能源股票 |
| 交易代码 | 001158 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2015年4月28日 |
| 报告期末基金份额总额 | 3,062,534,834.77份 |
| 投资目标 | 在我国节能减排和产业升级的背景下,以新能源、新材料行业为投资主题,重点关注具备竞争优势的企业,精选个股,在控制投资风险的同时,力争通过主动管理实现超越业绩基准的收益。 |
| 投资策略 | 本基金的资产配置策略主要是通过对宏观经济周期运行规律的研究,基于定量与定性相结合的宏观及市场分析,确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例,规避系统性风险。在资产配置中,本基金主要考虑宏观经济指标,包括PMI水平、GDP增长率、M2增长率及趋势、PPI、CPI、利率水平与变化趋势、宏观经济政策等,来判断经济周期目前的位置以及未来将发展的方向,在经济周期各阶段,综合对所跟踪的宏观经济指标和市场指标的分析,本基金对大类资产进行配置的策略为:在经济的复苏和繁荣期超配股票资产;在经济的衰退和政策刺激阶段,超配债券等固定收益类资产,力争通过资产配置获得部分超额收益。 |
| 业绩比较基准 | 中证全指一级行业能源指数收益率×40%+中证全指一级行业材料指数收益率×40%+中债综合指数收益率×20%。 |
| 风险收益特征 | 基金是股票型基金,其预期收益及风险水平高于货币市场基金、债券型基金与混合型基金。本基金主要投资于新能源与新材料行业股票,其风险高于全市场范围内投资的股票型基金。 |
| 基金管理人 | 工银瑞信基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 兴业银行股份有限公司 |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

| 主要财务指标 | 报告期(2018年7月1日 - 2018年9月30日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | -59,180,015.00 |
| 2.本期利润 | -33,765,825.62 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0110 |
| 4.期末基金资产净值 | 1,897,658,723.38 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.620 |

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,计入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。

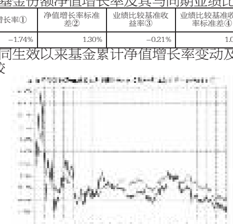
3、所列数据截止到报告期最后一日,无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

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 | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | -1.74% | 1.30% | -0.21% | 1.00% | -1.53% | 0.30% |

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2015年4月28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:股票投资占基金资产的比例为80%-95%。其中,本基金投资于本基金界定的新材料新能源行业股票占非现金基金资产的比例不低于80%。任何交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

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 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 张剑峰 | 本基金的基金经理 | 2016年9月19日 | - | 13 | 曾在国信证券经济研究所担任化工行业研究员;2008年加入工银瑞信,现任研究部大宗商品研究团队负责人、基金经理;2016年9月19日至今,担任工银瑞信新材料新能源行业股票型证券投资基金基金经理。 |
| 陈小鹭 | 本基金的基金经理 | 2016年9月22日 | - | 9 | 曾在华泰联合证券担任研究员;2011年加入工银瑞信基金管理有限公司,现任研究部高级研究员、基金经理;2016年9月22日至今,担任工银瑞信新材料新能源行业股票型证券投资基金基金经理。 |
| 孙楠 | 本基金的基金经理 | 2016年9月19日 | - | 10 | 先后在华安基金担任研究员,银华基金担任研究员;2012年加入工银瑞信,现任研究部有色金属高级研究员、基金经理;2016年9月19日至今,担任工银瑞信新材料新能源行业股票型证券投资基金基金经理。 |

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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、招募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。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了公平对待各类投资人,保护各类投资人利益,避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为,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》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部规章,拟定了《公平交易管理办法》、《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明确具体的规定,并规定对买卖股票、债券时候的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进行监控。本报告期,按照时间优先、价格优先的原则,本公司对满足限价条件且对同一证券有相同交易需求的基金等投资组合,均采用了系统中的公平交易模块进行操作,实现了公平交易;未出现清算不到位的情况,且本基金及本基金与本基金管理人管理的其他投资组合之间未发生法律法规禁止的反向交易及交叉交易。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内,本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的5%。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

3季度,受国内经济下行预期和贸易战影响,市场难以找到比较明确的主线,整体波动幅度较大。而油气价格上涨相对比较明确,因此我们配置上整体比较均衡,但加大了对于油气资源行业的配置。市场情绪波动大,因此阶段性配置了部分科技股和军工。

新能源整体看仍没有太大的起色,我们对新能源仓位也进行了适当的控制。

环保受到关注,我们认为环保仍是大方向,仍看好受益于环保的农药及部分材料。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金净值增长率为-1.74%,业绩比较基准收益率为-0.21%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金在报告期内没有触及2014年8月8日生效的《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条规定的条件。

§5 投资组合报告

5.1 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 | 权益投资 | 1,630,858,535.89 | 85.67 |
| | 其中:股票 | 1,630,858,535.89 | 85.67 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 670,914.09 | 0.04 |
| | 其中:债券 | 670,914.09 | 0.04 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | 80,000,000.00 | 4.20 |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 191,712,726.97 | 10.07 |
| 8 | 其他资产 | 495,248.02 | 0.03 |
| 9 | 合计 | 1,903,737,424.97 | 100.00 |

注:由于四舍五入的原因金额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 | 采矿业 | 365,496,928.60 | 19.26 |
| C | 制造业 | 1,054,128,237.41 | 55.55 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 104,655,643.20 | 5.51 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 44,036,000.00 | 2.32 |
| J | 金融业 | 62,541,726.68 | 3.30 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、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 | 1,630,858,535.89 | 85.94 |

注:由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值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港股通投资股票投资组合

无。

5.3 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明细

| 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 | 000703 | 恒逸石化 | 6,400,020 | 108,480,339.00 | 5.72 |
| 2 | 600309 | 万华化学 | 2,400,000 | 101,928,000.00 | 5.37 |
| 3 | 600028 | 中国石化 | 13,000,000 | 92,560,000.00 | 4.88 |
| 4 | 601857 | 中国石油 | 9,500,000 | 87,115,000.00 | 4.59 |
| 5 | 601088 | 中国神华 | 2,800,000 | 57,092,000.00 | 3.01 |
| 6 | 600346 | 恒力股份 | 3,500,000 | 56,140,000.00 | 2.96 |
| 7 | 600585 | 海螺水泥 | 1,499,947 | 55,183,050.13 | 2.91 |
| 8 | 600486 | 扬农化工 | 999,983 | 46,359,211.88 | 2.44 |
| 9 | 600352 | 浙江龙盛 | 4,700,000 | 45,872,000.00 | 2.42 |
| 10 | 300398 | 飞凯材料 | 2,400,000 | 43,080,000.00 | 2.27 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中:政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债(可交换债) | 670,914.09 | 0.04 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 670,914.09 | 0.04 |

注:由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 128045 | 机电转债 | 5,859 | 670,914.09 | 0.04 |

5.6 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资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货投资,也无期间损益。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期内,本基金未运用股指期货进行投资。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本报告期内,本基金未运用国债期货进行投资。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货投资,也无期间损益。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本报告期内,本基金未运用国债期货进行投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 314,724.68 |
| 2 | 应收证券清算款 | 74,520.55 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 31,215.14 |
| 5 | 应收申购款 | 74,787.65 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 495,248.02 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 3,096,139,194.79 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 43,046,083.55 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 76,650,443.57 |
| 报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列) | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 3,062,534,834.77 |

注:1、报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额;

2、报告期期间基金总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

无。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会准予工银瑞信新材料新能源行业股票型证券投资基金募集申请的注册文件;

2、《工银瑞信新材料新能源行业股票型证券投资基金基金合同》;

3、《工银瑞信新材料新能源行业股票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、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

9.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所。

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。

# 工银瑞信新焦点灵活配置混合型证券投资基金

## 2018年第三季度报告

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一八年十月二十五日

§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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月23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应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

| | | |
|---|---|---|
| 基金简称 | 工银新焦点灵活配置混合 | |
| 交易代码 | 001715 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2016年10月10日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 671,574,673.93份 | |
| 投资目标 | 通过识别宏观经济周期与资本市场轮动的行为模式,深入研究不同周期与市场背景下各类型资产的价值与回报,通过"自上而下"的大类资产配置与"自下而上"的个券选择,在风险可控的范围内追求组合收益的最大化。 | |
| 投资策略 | 本基金将由投资研究团队及时跟踪市场环境变化,根据对国际及国内宏观经济运行态势、宏观经济政策变化、证券市场运行状况等因素的深入研究,判断证券市场的发展趋势,结合行业状况、公司价值性和成长性分析,综合评价各类资产的风险收益水平。在充分的宏观形势判断和行业分析的基础上,通过"自上而下"的资产配置及动态调整策略,将基金资产在各类型证券上进行灵活配置。在市场上涨阶段中,增加权益类资产配置比例;在市场下行周期中,增加固定收益类资产配置比例,最终力求实现基金资产组合收益的最大化,从而有效提高不同市场状况下基金资产的整体收益水平。本基金采取"自上而下"与"自下而上"相结合的分析方法进行股票投资。基金管理人在行业分析的基础上,选择治理结构完善、经营稳健、业绩优良、具有可持续增长前景或价值被低估的上市公司股票,以合理价格买入并进行中长期投资。本基金股票投资具体包括行业分析与配置、公司财务状况评价、价值评估及股票选择与组合优化等过程。 | |
| 业绩比较基准 | 30%×中证800指数收益率+70%×一年期人民币定期存款基准利率(税后)。 | |
| 风险收益特征 | 本基金为灵活配置混合型基金,预期收益和风险水平低于股票型基金,高于债券型基金与货币市场基金。 | |
| 基金管理人 | 工银瑞信基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 招商银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 工银新焦点灵活配置混合A | 工银新焦点灵活配置混合C |
| 下属分级基金的交易代码 | 001715 | 001998 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 53,815,527.46份 | 617,759,146.47份 |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

| 主要财务指标 | 报告期(2018年7月1日 - 2018年9月30日) | |
|---|---|---|
| | 工银新焦点灵活配置混合A | 工银新焦点灵活配置混合C |
| 1. 本期已实现收益 | 140,886.70 | 808,292.89 |
| 2. 本期利润 | 131,960.04 | 546,833.54 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0023 | 0.0020 |
| 4. 期末基金资产净值 | 55,223,522.15 | 625,516,248.09 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.026 | 1.013 |

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,计入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

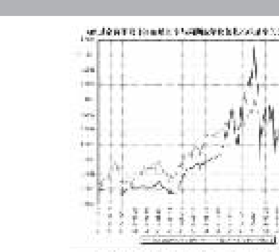
工银新焦点灵活配置混合A

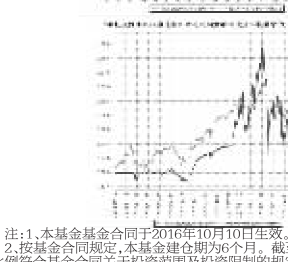
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 0.20% | 0.06% | -0.70% | 0.40% | 0.90% | -0.34% |

工银新焦点灵活配置混合C

| 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 | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 0.20% | 0.06% | -0.70% | 0.40% | 0.90% | -0.34% |

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10月10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:股票资产占基金资产的比例为0% - 95%,每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值的5%的现金或到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

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 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 刘琦 | 本基金的基金经理 | 2016年10月14日 | - | 10 | 北京大学概率统计专业博士;曾先后在嘉实基金管理有限公司担任基金经理助理、研究员,在嘉实国际担任助理副总裁,在易方达基金担任基金经理。2015年加入工银瑞信,现任固定收益部基金经理。2015年11月10日至今,担任工银月月薪定期支付债券型基金基金经理;2016年10月14日至今,担任工银瑞信新焦点灵活配置混合型证券投资基金基金经理;2016年11月2日至今,担任工银瑞信瑞盈18个月定期开放债券型证券投资基金基金经理;2017年1月4日至今,担任工银瑞信中债-国债(7-10年)总指数证券投资基金基金经理;2017年1月23日至今,担任工银瑞信全球美元债债券型证券投资基金(QDII)基金经理;2018年9月21日,担任工银瑞信聚福混合型证券投资基金基金经理。 |
| 李昱 | 本基金的基金经理 | 2018年1月23日 | - | 11 | 曾先后在中投证券担任研究员,在华安基金担任高级研究员、小组负责人,在中信产业基金从事二级市场投研;2017年加入工银瑞信,现任固定收益部基金经理。2018年1月23日至今,担任工银瑞信添福债券型证券投资基金基金经理;2018年1月23日至今,担任工银瑞信新财富灵活配置混合型证券投资基金基金经理;2018年1月23日至今,担任工银瑞信新焦点灵活配置混合型证券投资基金基金经理;2018年2月23日至今,担任工银瑞信双债增强债券型证券投资基金(LOF)基金经理;2018年2月23日至今,担任工银瑞信新增益混合型证券投资基金基金经理;2018年2月23日至今,担任工银瑞信新生利混合型证券投资基金基金经理;2018年2月23日至今,担任工银瑞信新得润混合型证券投资基金基金经理;2018年3月6日至今,担任工银瑞信灵活配置混合型证券投资基金基金经理。 |

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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、招募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。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了公平对待各类投资人,保护各类投资人利益,避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为,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》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部规章,拟定了《公平交易管理办法》、《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明确具体的规定,并规定对买卖股票、债券时候的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进行监控。本报告期,按照时间优先、价格优先的原则,本公司对满足限价条件且对同一证券有相同交易需求的基金等投资组合,均采用了系统中的公平交易模块进行操作,实现了公平交易;未出现清算不到位的情况,且本基金及本基金与本基金管理人管理的其他投资组合之间未发生法律法规禁止的反向交易及交叉交易。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内,本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的5%。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年三季度,经济方面,经济增长动能相对上期进一步趋缓。基建、制造业投资继续疲弱,房地产投资和出口依旧坚挺,经济总需求显现一定疲态,主要是消费、政府支出增速放缓。物价方面,消费品价格上涨略有超预期,CPI同比走势略有超预期回升,生产资料价格PPI同比保持高位。重点城市房价环比有所回升,一线城市房价略有疲弱,股票市场主要指数震荡,债券市场主要品种价格小幅下跌,信用违约依旧存在,人民币汇率承受贬值压力。政策方面,货币政策进一步宽松,银行间资金宽松。财政政策基调有改善,结构性去杠杆继续推进,市场感受到去杠杆压力有所舒缓,但是债务扩张艰难。海外方面,发达国家经济继续分化,美国经济增长趋势稳健,物价温和,美联储9月如期加息;欧洲日本经济继续走弱,货币政策保持宽松;新兴市场国家经济分化,资本流出压力依旧存在。

本基金本季度重点配置货币市场工具,保持充裕的流动性。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内,工银新焦点灵活配置混合A份额净值增长率为0.20%,工银新焦点灵活配置混合C份额净值增长率为0.20%,业绩比较基准收益率为-0.70%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金在报告期内没有触及2014年8月8日生效的《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条规定的条件。

§5 投资组合报告

5.1 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 | 权益投资 | 667.00 | 0.00 |
| | 其中:股票 | 667.00 | 0.00 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 367,954,948.70 | 53.60 |
| | 其中:债券 | 367,954,948.70 | 53.60 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | 270,000,000.00 | 39.33 |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 39,421,136.26 | 5.74 |
| 8 | 其他资产 | 9,139,459.01 | 1.33 |
| 9 | 合计 | 686,516,210.97 | 100.00 |

注:由于四舍五入的原因金额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 | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | - | - |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | - | - |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 667.00 | 0.00 |
| O | 居民服务、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 | 667.00 | 0.00 |

注:由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值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港股通投资股票投资组合

无。

5.3 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明细

| 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 | 000888 | 峨眉山A | 100 | 667.00 | 0.00 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 29,678,522.00 | 4.36 |
| | 其中:政策性金融债 | 29,678,522.00 | 4.36 |
| 4 | 企业债券 | 10,525,600.00 | 1.55 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债(可交换债) | 1,549,826.70 | 0.23 |
| 8 | 同业存单 | 326,201,000.00 | 47.92 |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 367,954,948.70 | 54.06 |

注:由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 111811236 | 18平安银行CD236 | 800,000 | 79,416,000.00 | 11.67 |
| 2 | 111815378 | 18民生银行CD378 | 500,000 | 49,655,000.00 | 7.29 |
| 3 | 111815369 | 18民生银行CD369 | 500,000 | 49,635,000.00 | 7.29 |
| 4 | 111809223 | 18浦发银行CD223 | 500,000 | 49,590,000.00 | 7.28 |
| 5 | 111818206 | 18华夏银行CD206 | 500,000 | 49,590,000.00 | 7.28 |

5.6 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资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货投资,也无期间损益。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期内,本基金未运用股指期货进行投资。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本报告期内,本基金未运用国债期货进行投资。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货投资,也无期间损益。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本报告期内,本基金未运用国债期货进行投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 26,189.18 |
| 2 | 应收证券清算款 | 6,082.19 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 3,606,779.73 |
| 5 | 应收申购款 | 5,500,407.91 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 9,139,459.01 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 120001 | 16以岭EB | 710,389.20 | 0.10 |
| 2 | 132012 | 17巨化EB | 368,172.00 | 0.05 |
| 3 | 132005 | 15国资EB | 345,759.80 | 0.05 |
| 4 | 113014 | 林洋转债 | 125,505.70 | 0.02 |

注:上表包含期末持有的处于转股期的可转换债券和可交换债券明细。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

| 项目 | 工银新焦点灵活配置混合A | 工银新焦点灵活配置混合C |
|---|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 59,659,093.86 | 19,294,381.03 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 38,154.44 | 615,888,270.60 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 5,881,720.84 | 17,423,505.16 |
| 报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列) | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 53,815,527.46 | 617,759,146.47 |

注:1、报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额;

2、报告期期间基金总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

无。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会准予工银瑞信新焦点灵活配置混合型证券投资基金募集申请的注册文件;

2、《工银瑞信新焦点灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

3、《工银瑞信新焦点灵活配置混合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、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

9.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所。

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。

# 工银瑞信新机遇灵活配置混合型证券投资基金

## 2018年第三季度报告

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一八年十月二十五日

§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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月23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应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

| | | |
|---|---|---|
| 基金简称 | 工银新机遇灵活配置混合 | |
| 交易代码 | 002003 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2017年4月14日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 76,613,820.51份 | |
| 投资目标 | 通过识别宏观经济周期与资本市场轮动的行为模式,深入研究不同周期与市场背景下各类型资产的价值与回报,通过"自上而下"的大类资产配置与"自下而上"的个券选择,在风险可控的范围内追求组合收益的最大化。 | |
| 投资策略 | 本基金将由投资研究团队及时跟踪市场环境变化,根据对国际及国内宏观经济运行态势、宏观经济政策变化、证券市场运行状况等因素的深入研究,判断证券市场的发展趋势,结合行业状况、公司价值性和成长性分析,综合评价各类资产的风险收益水平。在充分的宏观形势判断和行业分析的基础上,通过"自上而下"的资产配置及动态调整策略,将基金资产在各类型证券上进行灵活配置。在市场上涨阶段中,增加权益类资产配置比例;在市场下行周期中,增加固定收益类资产配置比例,最终力求实现基金资产组合收益的最大化,从而有效提高不同市场状况下基金资产的整体收益水平。本基金采取"自上而下"与"自下而上"相结合的分析方法进行股票投资。基金管理人在行业分析的基础上,选择治理结构完善、经营稳健、业绩优良、具有可持续增长前景或价值被低估的上市公司股票,以合理价格买入并进行中长期投资。本基金股票投资具体包括行业分析与配置、公司财务状况评价、价值评估及股票选择与组合优化等过程。 | |
| 业绩比较基准 | 40%×中证800指数收益率+60%×一年期人民币定期存款基准利率(税后)。 | |
| 风险收益特征 | 本基金为灵活配置混合型基金,预期收益和风险水平低于股票型基金,高于债券型基金与货币市场基金。 | |
| 基金管理人 | 工银瑞信基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 工银新机遇灵活配置混合A | 工银新机遇灵活配置混合C |
| 下属分级基金的交易代码 | 002003 | 002004 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 37,759,049.84份 | 38,854,770.67份 |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

| 主要财务指标 | 报告期(2018年7月1日 - 2018年9月30日) | |
|---|---|---|
| | 工银新机遇灵活配置混合A | 工银新机遇灵活配置混合C |
| 1. 本期已实现收益 | -486,131.57 | -514,853.14 |
| 2. 本期利润 | -976,882.34 | -986,709.49 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0240 | -0.0248 |
| 4. 期末基金资产净值 | 33,368,930.76 | 34,000,286.21 |
| 5. 期末基金份额净值 | 0.884 | 0.875 |

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,计入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

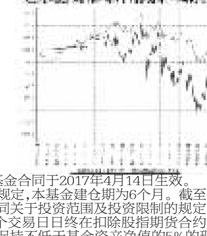
工银新机遇灵活配置混合A

| 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 | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | -2.64% | 1.14% | -1.07% | 0.53% | -1.57% | 0.61% |

工银新机遇灵活配置混合C

| 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 | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | -2.78% | 1.13% | -1.07% | 0.53% | -1.71% | 0.60% |

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2017年4月14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:股票资产占基金资产的比例为0% - 95%,每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值的5%的现金或到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

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 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 游凛峰 | 本基金的基金经理 | 2017年4月14日 | - | 22 | 斯坦福大学统计学专业博士;先后在Merrill Lynch Investment Managers担任美林集中基金和美林保本基金基金经理,Fore Research & Management担任Fore Equity Market Neutral组合基金经理,Jasper Asset Management担任Jasper Gemini Fund基金基金经理;2009年加入工银瑞信基金管理有限公司,现任权益投资部量化投资团队负责人;2009年12月25日至今,担任工银瑞信中国机会全球配置股票基金的基金经理;2010年5月25日至今,担任工银全球精选股票基金的基金经理;2012年4月26日至今担任工银瑞信基本面量化策略混合型证券投资基金基金经理;2014年6月26日至今,担任工银瑞信绝对收益混合型基金基金经理;2015年12月15日至2017年12月22日,担任工银瑞信新趋势灵活配置混合型基金基金经理;2016年3月9日至2017年10月9日,担任工银瑞信香港中小盘股票型基金基金经理;2016年10月10日至2018年2月23日,担任工银瑞信新焦点灵活配置混合型证券投资基金基金经理;2017年4月14日至今,担任工银瑞信新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金经理;2017年4月27日至今,担任工银瑞信新价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理。 |

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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、招募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。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了公平对待各类投资人,保护各类投资人利益,避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为,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》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部规章,拟定了《公平交易管理办法》、《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明确具体的规定,并规定对买卖股票、债券时候的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进行监控。本报告期,按照时间优先、价格优先的原则,本公司对满足限价条件且对同一证券有相同交易需求的基金等投资组合,均采用了系统中的公平交易模块进行操作,实现了公平交易;未出现清算不到位的情况,且本基金及本基金与本基金管理人管理的其他投资组合之间未发生法律法规禁止的反向交易及交叉交易。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内,本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的5%。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度经济数据略显乏力,工业增加值和固定资产投资数据均有所下滑。8月份,工业增加值增速6.1%,环比略有提升,但比二季度下滑明显。8月份固定资产投资增速5.3%,环比进一步下滑。8月社会消费品零售总额同比增速9%,基本持平。领先指标方面,9月份中国制造业物流与采购经理人指数(PMI)报50.8,显示企业信心有所减弱。通胀方面,8月居民消费价格总水平(CPI)同比增速2.3%,与前期持平,全国工业生产者出厂价格(PPI)同比增长4.1%,比前期进一步下滑。

流动性方面,8月份人民币贷款增加12800亿元,社融新增15215亿元,人民币贷款规模小幅下滑,社融规模有所上升。M2同比增速8.2%,M1同比增速3.9%,M2增速基本保持稳定,M1数据大幅下降。

股市方面,三季度,从指数表现看,各指数涨跌不一,其中上证综指下跌0.92%,沪深300指数下跌2.05%,深证成指收益率为-10.43%。从风格来看,代表大盘股的中证100指数和代表中盘指数的中证200回报分别为1.12%和-8.44%,中小板指和创业板指回报分别为-11.22%和-12.16%。分行业来看,银行、石油石化、非银金融表现排名前三,收益率分别为12.41%、11.60%和5.46%,家电、纺织服装、电子元器件回报列最后三位,分别为-17.34%、-15.34%和-14.91%。

在基金操作上,本基金一直坚持基本面量化的选股逻辑,从多个维度定义并寻找优质成长型公司。在三季度基金操作中,本基金根据市场风格对持仓进行了调整,基金重点配置了消费服务类板块和政策鼓励的科技板块。9月以来,由于市场风格的影响,受科技股大幅下跌的拖累,本基金本季度跑输基准。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内,工银新机遇灵活配置混合A份额净值增长率为-2.64%,工银新机遇灵活配置混合C份额净值增长率为-2.78%,业绩比较基准收益率为-1.07%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金在报告期内没有触及2014年8月8日生效的《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条规定的条件。

§5 投资组合报告

5.1 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 | 权益投资 | 55,039,179.32 | 81.15 |
| | 其中:股票 | 55,039,179.32 | 81.15 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 3,686,654.00 | 5.44 |
| | 其中:债券 | 3,686,654.00 | 5.44 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | 3,800,000.00 | 5.60 |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 4,863,253.60 | 7.17 |
| 8 | 其他资产 | 437,253.47 | 0.64 |
| 9 | 合计 | 67,826,340.39 | 100.00 |

注:由于四舍五入的原因金额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 | 271,410.00 | 0.40 |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 36,524,079.91 | 54.21 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 1,645,965.76 | 2.44 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 442,282.00 | 0.66 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 5,040,625.73 | 7.48 |
| J | 金融业 | 6,396,601.45 | 9.49 |
| K | 房地产业 | 1,959,867.90 | 2.91 |
| L | 租赁和商务服务业 | 2,151,430.12 | 3.19 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 190,275.00 | 0.28 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 416,641.45 | 0.62 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 55,039,179.32 | 81.70 |

注:由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值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港股通投资股票投资组合

无。

5.3 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明细

| 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 | 600887 | 伊利股份 | 137,538 | 3,531,975.84 | 5.24 |
| 2 | 300373 | 扬杰科技 | 131,594 | 2,787,160.92 | 4.14 |
| 3 | 600085 | 同仁堂 | 86,472 | 2,745,486.00 | 4.08 |
| 4 | 600570 | 恒生电子 | 42,701 | 2,357,522.21 | 3.50 |
| 5 | 601601 | 中国太保 | 66,335 | 2,355,555.85 | 3.50 |
| 6 | 002027 | 分众传媒 | 252,812 | 2,151,430.12 | 3.19 |
| 7 | 600197 | 伊力特 | 110,030 | 2,035,555.00 | 3.02 |
| 8 | 002179 | 中航光电 | 45,406 | 1,997,864.00 | 2.97 |
| 9 | 600019 | 宝钢股份 | 252,927 | 1,985,476.95 | 2.95 |
| 10 | 300661 | 圣邦股份 | 20,796 | 1,971,460.80 | 2.93 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 3,593,432.00 | 5.33 |
| | 其中:政策性金融债 | 3,593,432.00 | 5.33 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债(可交换债) | 93,222.00 | 0.14 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 3,686,654.00 | 5.47 |

注:由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 018005 | 国开1701 | 35,720 | 3,593,432.00 | 5.33 |
| 2 | 123002 | 国祯转债 | 900 | 93,222.00 | 0.14 |

5.6 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资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

| | |
|---|---|
| 股指期货投资本期收益(元) | 401,097.00 |
| 股指期货投资本期公允价值变动(元) | 80,160.00 |

注:本基金本报告期末未持有股指期货投资。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金股指期货投资是为了对冲股权买入方的投资。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本报告期内,本基金未运用国债期货进行投资。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货投资,也无期间损益。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本报告期内,本基金未运用国债期货进行投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 29,104.25 |
| 2 | 应收证券清算款 | 340,049.86 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 65,543.36 |
| 5 | 应收申购款 | 2,556.00 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 437,253.47 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 123002 | 国祯转债 | 93,222.00 | 0.14 |

注:上表包含期末持有的处于转股期的可转换债券和可交换债券明细。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

| 项目 | 工银新机遇灵活配置混合A | 工银新机遇灵活配置混合C |
|---|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 41,356,349.73 | 40,579,952.09 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 152,939.24 | 218,746.58 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 3,750,239.13 | 1,943,928.00 |
| 报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列) | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 37,759,049.84 | 38,854,770.67 |

注:1、报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额;

2、报告期期间基金总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

无。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会准予工银瑞信新机遇灵活配置混合型证券投资基金募集申请的注册文件;

2、《工银瑞信新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

3、《工银瑞信新机遇灵活配置混合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、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

9.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所。

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。