

工银瑞信新财富灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

本报告期,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、招募说明书持有本基金法律文件的约定,恪尽职守,勤勉尽责,...

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规章制度,制定了《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,并定期对买卖股票、债券时的价格和市场价格差较大、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,且本基金及本基金管理人管理的其他投资组合之间未发生法律法规禁止的关联交易及交叉交易。

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
三季度宏观经济稳中趋弱,需求端出现了一些钝化迹象。在房地产调控持续从紧的情况下,三四线城市“棚改”带动制造业投资的部分动能消退,居民消费收入端出现一定收缩,出口向下的拐点初显现。根据我国经济形势变化,政策取向也出现了一些调整,主要是通过适度宽松货币政策支持稳增长。同时,政府将注重稳增长和防风险的平衡,保持地方债务整体和地区金融风险可控。全球范围内的增长动能也在走弱,贸易摩擦和不确定性因素导致全球的前途面临一定压力。

三季度债券市场的波动有所加大,收益率曲线明显趋陡,10年期国债收益率率下后上,国债收益率曲线大致在二季度末水平位置,相比之下三四年期国债收益率下行之反弹幅度较小,使得10年-3年期期限利差从24bp大幅扩张至55bp的水平,另外受稳增长政策影响,市场对宽信用和宽松货币政策有一定预期,债券市场的信用利差整体小幅收窄,3年期AA-AAA利差的等级利差从49bp收窄至42bp水平。

三季度股票市场整体继续下挫,沪深300指数下跌0.92%,创业板下跌12.16%,Wind全A指数下跌4.81%,从行业表现看,银行板块表现较好,军工、钢铁、采掘、非银也录得正收益,其他板块全面下跌。

本基金三季度增持了部分高等级信用债,总体久期保持平稳;维持了偏低的权益仓位,行业配置仍以消费和金融为主,小幅增加了军工和TMT等制造业个股。

4.5 报告期内基金的投资组合报告
本报告期末,本基金净资产增长率为-0.06%,业绩比较基准收益率为-0.33%。

4.6 报告期内基金持有人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。

5.1 报告期末基金资产组合情况
5.1.1 报告期末基金资产组合情况
5.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.1.3 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

5.1.4 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债券投资明细

5.1.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资明细

5.1.6 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权证投资明细

5.1.7 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股指期货投资明细

5.1.8 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国债期货投资明细

5.1.9 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资产支持证券投资明细

5.1.10 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

5.1.11 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

5.1.12 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股指期货投资明细

5.1.13 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国债期货投资明细

5.1.14 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资产支持证券投资明细

5.1.15 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

5.1.16 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股指期货投资明细

5.1.17 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国债期货投资明细

5.1.18 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资产支持证券投资明细

5.1.19 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

5.1.20 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股指期货投资明细

5.1.21 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国债期货投资明细

5.1.22 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资产支持证券投资明细

5.1.23 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

5.1.24 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股指期货投资明细

5.1.25 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国债期货投资明细

5.1.26 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资产支持证券投资明细

5.1.27 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

5.1.28 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股指期货投资明细

5.1.29 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国债期货投资明细

5.1.30 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资产支持证券投资明细

5.1.31 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

5.1.32 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股指期货投资明细

5.1.33 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国债期货投资明细

5.1.34 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资产支持证券投资明细

5.1.35 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

5.1.36 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股指期货投资明细

5.1.37 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国债期货投资明细

5.1.38 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资产支持证券投资明细

5.1.39 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

5.1.40 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股指期货投资明细

5.1.41 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国债期货投资明细

5.1.42 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资产支持证券投资明细

5.1.43 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

5.1.44 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股指期货投资明细

5.1.45 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国债期货投资明细

5.1.46 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资产支持证券投资明细

5.1.47 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

5.1.48 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股指期货投资明细

5.1.49 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国债期货投资明细

5.1.50 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资产支持证券投资明细

5.1.51 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

5.1.52 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股指期货投资明细

5.1.53 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国债期货投资明细

5.1.54 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资产支持证券投资明细

5.1.55 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

5.1.56 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股指期货投资明细

5.1.57 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国债期货投资明细

5.1.58 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资产支持证券投资明细

5.1.59 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

5.1.60 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股指期货投资明细

5.1.61 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国债期货投资明细

5.1.62 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资产支持证券投资明细

5.1.63 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

5.1.64 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股指期货投资明细

5.1.65 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国债期货投资明细

5.1.66 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资产支持证券投资明细

5.1.67 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

5.1.68 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股指期货投资明细

5.1.69 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国债期货投资明细

5.1.70 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资产支持证券投资明细

5.1.71 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

5.1.72 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股指期货投资明细

5.1.73 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国债期货投资明细

5.1.74 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资产支持证券投资明细

5.1.75 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

5.1.76 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股指期货投资明细

5.1.77 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国债期货投资明细

5.1.78 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资产支持证券投资明细

5.1.79 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

5.1.80 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股指期货投资明细

5.1.81 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国债期货投资明细

5.1.82 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资产支持证券投资明细

5.1.83 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

5.1.84 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股指期货投资明细

5.1.85 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国债期货投资明细

5.1.86 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资产支持证券投资明细

5.1.87 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

5.1.88 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股指期货投资明细

5.1.89 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国债期货投资明细

5.1.90 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资产支持证券投资明细

5.1.91 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

5.1.92 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股指期货投资明细

5.1.93 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国债期货投资明细

5.1.94 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资产支持证券投资明细

5.1.95 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

5.1.96 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股指期货投资明细

5.1.97 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国债期货投资明细

5.1.98 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资产支持证券投资明细

5.1.99 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

5.1.100 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股指期货投资明细

5.1.101 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国债期货投资明细

5.1.102 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资产支持证券投资明细

5.1.103 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

5.1.104 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股指期货投资明细

5.1.105 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国债期货投资明细

5.1.106 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资产支持证券投资明细

5.1.107 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

5.1.108 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股指期货投资明细

5.1.109 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国债期货投资明细

5.1.110 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资产支持证券投资明细

5.1.111 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

5.1.112 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股指期货投资明细

5.1.113 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国债期货投资明细

5.1.114 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资产支持证券投资明细

5.1.115 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

5.1.116 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股指期货投资明细

5.1.117 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国债期货投资明细

5.1.118 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资产支持证券投资明细

5.1.119 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

5.1.120 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股指期货投资明细

5.1.121 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国债期货投资明细

5.1.122 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资产支持证券投资明细

5.1.123 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

5.1.124 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股指期货投资明细

5.1.125 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国债期货投资明细

5.1.126 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资产支持证券投资明细

5.1.127 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

5.1.128 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股指期货投资明细

5.1.129 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国债期货投资明细

5.1.130 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资产支持证券投资明细

5.1.131 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

5.1.132 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股指期货投资明细

5.1.133 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国债期货投资明细

5.1.134 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资产支持证券投资明细

5.1.135 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

5.1.136 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股指期货投资明细

5.1.137 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国债期货投资明细

5.1.138 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资产支持证券投资明细

5.1.139 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

5.1.140 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股指期货投资明细

5.1.141 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国债期货投资明细

5.1.142 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资产支持证券投资明细

5.1.143 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

5.1.144 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股指期货投资明细

5.1.145 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国债期货投资明细

5.1.146 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资产支持证券投资明细

5.1.147 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

5.1.148 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股指期货投资明细

5.1.149 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国债期货投资明细

5.1.150 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资产支持证券投资明细

5.1.151 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

5.1.152 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股指期货投资明细

5.1.153 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国债期货投资明细

5.1.154 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资产支持证券投资明细

5.1.155 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

5.1.156 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股指期货投资明细

5.1.157 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国债期货投资明细

5.1.158 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资产支持证券投资明细

5.1.159 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

5.1.160 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股指期货投资明细

5.1.161 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国债期货投资明细

5.1.162 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资产支持证券投资明细

5.1.163 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

5.1.164 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股指期货投资明细

5.1.165 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国债期货投资明细

5.1.166 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资产支持证券投资明细

5.1.167 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

5.1.168 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股指期货投资明细

5.1.169 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国债期货投资明细

5.1.170 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资产支持证券投资明细

5.1.171 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

5.1.172 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股指期货投资明细

5.1.173 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国债期货投资明细

5.1.174 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资产支持证券投资明细

5.1.175 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

5.1.176 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股指期货投资明细

5.1.177 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国债期货投资明细

5.1.178 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资产支持证券投资明细

5.1.179 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

5.1.180 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股指期货投资明细

5.1.181 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国债期货投资明细

5.1.182 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资产支持证券投资明细

5.1.183 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

5.1.184 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股指期货投资明细

5.1.185 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国债期货投资明细

5.1.186 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资产支持证券投资明细