

工银瑞信精选平衡混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

受波及,尤其是与中美贸易摩擦相关的科技板块以及新能源汽车产业,回调幅度较大,使得组合净值受损。从目前看,中美贸易摩擦以及国内经济下行压力,仍压制国内股票市场发展的主要因素,我们对A股市场维持谨慎的观点。

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-9.71%,业绩比较基准收益率为-0.51%。

4.6 报告期内基金持有的人数或基金份额净值预警说明
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)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	974,522,896.15	71.84
	其中:股票	974,522,896.15	71.84
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	204,136,000.00	20.83
	其中:债券	204,136,000.00	20.83
	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	-	-
	其中:买入返售金融资产-回购	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	100,128,000.22	7.34
8	其他资产	5,204,434.66	0.39
9	合计	1,284,191,331.03	100.00

注:由于四舍五入的原因,基金总资产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

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	22,174,547.69	1.62
B	采矿业	-	-
C	制造业	727,721,280.67	54.27
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	20,480,527.09	1.57
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	信息技术业	69,866,000.00	5.36
I	金融业	-	-
J	房地产业	-	-
K	医药制造业	119,140,746.88	9.09
L	科学研究和技术服务业	-	-
M	教育、文化和体育服务业	-	-
N	综合	-	-
O	国防军工	-	-
P	其他	-	-
Q	合计	974,522,896.15	71.89

注:由于四舍五入的原因,基金总资产占基金总资产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投资股票投资组合

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	000322	天孚通信	2,260,202	49,804,000.00	2.94
2	000036	招商银行	1,197,790	39,797,698.21	4.09
3	001218	中顺洁柔	472,200	32,346,600.00	3.14
4	001222	林德电气	6,594,300	30,381,600.00	3.03
5	600848	保利地产	2,251,476	27,107,665.36	3.47
6	000033	荣信股份	790,200	24,286,720.00	3.00
7	000061	中国铝业	3,598,420	22,228,112.00	2.18
8	000019	浦发银行	20,500	20,000,000.00	2.06
9	001088	中国国旅	297,187	20,263,963.04	2.03
10	000269	恒顺醋业	316,000	20,000,000.00	2.06

注:由于四舍五入的原因,基金总资产占基金总资产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投资股票投资组合

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	000322	天孚通信	2,260,202	49,804,000.00	5.30
2	000036	招商银行	1,197,790	39,797,698.21	4.09
3	001218	中顺洁柔	472,200	32,346,600.00	3.14
4	001222	林德电气	6,594,300	30,381,600.00	3.03
5	600848	保利地产	2,251,476	27,107,665.36	3.47
6	000033	荣信股份	790,200	24,286,720.00	3.00
7	000061	中国铝业	3,598,420	22,228,112.00	2.18
8	000019	浦发银行	20,500	20,000,000.00	2.06
9	001088	中国国旅	297,187	20,263,963.04	2.03
10	000269	恒顺醋业	316,000	20,000,000.00	2.06

注:由于四舍五入的原因,基金总资产占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

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	国债投资	50,120,000.00	6.80
2	金融债投资	50,120,000.00	6.80
3	企业债投资	-	-
4	可转债投资	-	-
5	资产支持证券	1,000,497.00	0.13
6	其他固定收益品种	-	-
7	合计	1,100,497.00	0.13

注:由于四舍五入的原因,基金总资产占基金总资产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	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	183037	18国债07	500,000	0.63
2	183059	18国债09	500,000	0.63

注:由于四舍五入的原因,基金总资产占基金总资产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投资股票投资组合

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	600488	华泰证券	31,200,000	3,202,100.00	6.01
2	600029	招商银行	118,000	3,200,200.00	6.00
3	000176	中航光电	67,200	2,866,800.00	5.46
4	600028	中国石化	244,000	2,862,160.00	5.44
5	600166	中国铝业	51,800	1,758,214.00	3.30
6	600196	中国国贸	69,000	4,278,100.00	8.08
7	601288	农业银行	446,700	1,752,770.00	3.30
8	600033	荣信股份	114,000	1,730,204.00	3.30
9	600030	万华化学	39,511	1,696,030.17	3.17
10	600962	国瓷材料	108,000	1,679,340.00	3.04

注:由于四舍五入的原因,基金总资产占基金总资产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投资股票投资组合

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	600488	华泰证券	31,200,000	3,202,100.00	6.01
2	600029	招商银行	118,000	3,200,200.00	6.00
3	000176	中航光电	67,200	2,866,800.00	5.46
4	600028	中国石化	244,000	2,862,160.00	5.44
5	600166	中国铝业	51,800	1,758,214.00	3.30
6	600196	中国国贸	69,000	4,278,100.00	8.08
7	601288	农业银行	446,700	1,752,770.00	3.30
8	600033	荣信股份	114,000	1,730,204.00	3.30
9	600030	万华化学	39,511	1,696,030.17	3.17
10	600962	国瓷材料	108,000	1,679,340.00	3.04

注:由于四舍五入的原因,基金总资产占基金总资产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投资股票投资组合

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	600488	华泰证券	31,200,000	3,202,100.00	6.01
2	600029	招商银行	118,000	3,200,200.00	6.00
3	000176	中航光电	67,200	2,866,800.00	5.46
4	600028	中国石化	244,000	2,862,160.00	5.44
5	600166	中国铝业	51,800	1,758,214.00	3.30
6	600196	中国国贸	69,000	4,278,100.00	8.08
7	601288	农业银行	446,700	1,752,770.00	3.30
8	600033	荣信股份	114,000	1,730,204.00	3.30
9	600030	万华化学	39,511	1,696,030.17	3.17
10	600962	国瓷材料	108,000	1,679,340.00	3.04

注:由于四舍五入的原因,基金总资产占基金总资产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投资股票投资组合

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	600488	华泰证券	31,200,000	3,202,100.00	6.01
2	600029	招商银行	118,000	3,200,200.00	6.00
3	000176	中航光电	67,200	2,866,800.00	5.46
4	600028	中国石化	244,000	2,862,160.00	5.44
5	600166	中国铝业	51,800	1,758,214.00	3.30
6	600196	中国国贸	69,000	4,278,100.00	8.08
7	601288	农业银行	446,700	1,752,770.00	3.30
8	600033	荣信股份	114,000	1,730,204.00	3.30
9	600030	万华化学	39,511	1,696,030.17	3.17
10	600962	国瓷材料	108,000	1,679,340.00	3.04

注:由于四舍五入的原因,基金总资产占基金总资产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投资股票投资组合

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	600488	华泰证券	31,200,000	3,202,100.00	6.01
2	600029	招商银行	118,000	3,200,200.00	6.00
3	000176	中航光电	67,200	2,866,800.00	5.46
4	600028	中国石化	244,000	2,862,160.00	5.44
5	600166	中国铝业	51,800	1,758,214.00	3.30
6	600196	中国国贸	69,000	4,278,100.00	8.08
7	601288	农业银行	446,700	1,752,770.00	3.30
8	600033	荣信股份	114,000	1,730,204.00	3.30
9	600030	万华化学	39,511	1,696,030.17	3.17
10	600962	国瓷材料	108,000	1,679,340.00	3.04

注:由于四舍五入的原因,基金总资产占基金总资产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投资股票投资组合

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	600488	华泰证券	31,200,000	3,202,100.00	6.01
2	600029	招商银行	118,000	3,200,200.00	6.00
3	000176	中航光电	67,200	2,866,800.00	5.46
4	600028	中国石化	244,000	2,862,160.00	5.44
5	600166	中国铝业	51,800	1,758,214.00	3.30
6	600196	中国国贸	69,000	4,278,100.00	8.08
7	601288	农业银行	446,700	1,752,770.00	3.30
8	600033	荣信股份	114,000	1,730,204.00	3.30
9	600030	万华化学	39,511	1,696,030.17	3.17
10	600962	国瓷材料	108,000	1,679,340.00	3.04

注:由于四舍五入的原因,基金总资产占基金总资产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投资股票投资组合

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	600488	华泰证券	31,200,000	3,202,100.00	6.01
2	600029	招商银行	118,000	3,200,200.00	6.00
3	000176	中航光电	67,200	2,866,800.00	5.46
4	600028	中国石化	244,000	2,862,160.00	5.44
5	600166	中国铝业	51,800	1,758,214.00	3.30
6	600196	中国国贸	69,000	4,278,100.00	8.08
7	601288	农业银行	446,700	1,752,770.00	3.30
8	600033	荣信股份	114,000	1,730,204.00	3.30
9	600030	万华化学	39,511	1,696,030.17	3.17
10	600962	国瓷材料	108,000	1,6	