

B560信息披露disclosure

中银智能制造股票型证券投资基金

2018年年度报告摘要

注:除上表列示的金额外,本基金的证券交易资金通过托管银行备付金账户存于中国证券登记结算有限责任公司,2018年度获得的利息收入为人民币547,722.50元(2017年度:人民币61,704.51元),2018年末结算备付金余额为人民币1,307,511.26元(2017年末:人民币651,026.05元)。

7.4.8.6 本基金在承销期间参与关联方承销证券的情况:

7.4.9 期末(2018年12月31日)本基金持有的流通受限证券:

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券:

金额单位:人民币元									
证券代码	证券名称	报告期初买入/增购数量	报告期初买入/增购成本	报告期期末持有数量	报告期期末持有成本	报告期期末公允价值	账面价值	公允价值变动额	公允价值变动率(%)
601080	紫金矿业	2018-12-20	2019-1-10	314	314	15	970	50,140.00	-

7.4.9.2 交易对手市场债券正回购									
证券代码	证券名称	报告期初买入/增购数量	报告期初买入/增购成本	报告期期末持有数量	报告期期末持有成本	报告期期末公允价值	账面价值	公允价值变动额	公允价值变动率(%)
110049	德邦转债	2018-12-20	2019-1-10	100.00	100.00	3,720	372,000.00	372,000.00	-

7.4.9.2 期末证券正回购交易情况:
7.4.9.2.1 银行间市场债券正回购
截至本报告期末2018年12月31日止,本基金未持有银行间市场债券正回购交易作为质押的债券。

7.4.9.2.2 交易所市场债券正回购
截至本报告期末2018年12月31日止,本基金未持有交易所市场债券正回购交易作为质押的债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 公允价值
7.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具
不以公允价值计量的金融资产负债主要包括银行存款、结算备付金、存出保证金、应收购款、应收利息以及其他金融负债,因其剩余期限不长,公允价值与账面价值相若。

7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具
于2018年12月31日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的金额为人民币1,070,918,090.72元,属于第二层次的金额为人民币1,701,146.09元,无划分为第三层次余额(于2017年12月31日,属于第一层次的金额为人民币1,026,089,086.14元,属于第二层次的余额为人民币164,527,492.12元,无划分为第三层次余额)。

7.4.14.1.2.2 公允价值所属层次的重大变动
对于证券交易所上市的股票和可转换债券等,若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况,本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次;并根据估值技术对公允价值计量结果做出修正,将其归入公允价值所属的最低层次,确定相关金融资产可转换债券公允价值所属的层次。

7.4.14.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额
本基金于本报告期末未持有公允价值归属于第三层次的金融工具,本基金本报告期及上年度均未发生第三层次公允价值转入转出情况。

7.4.14.2 承诺事项
截至资产负债表日,本基金无需要披露的重大承诺事项。

7.4.14.3 其他事项
截至资产负债表日,本基金无需要披露的其他重要事项。

7.4.14 财务报表的披露
本财务报表已于2019年3月27日经本基金的基金管理人批准。

7.4.14.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金于本报告期初未持有公允价值归属于第三层次的金融工具，本基金本报告期及上年度可比期间未发生第三层次公允价值转入转出情况。

7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日,本基金无需要披露的重大承诺事项。

7.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日,本基金无需要披露的其他重要事项。

7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于2019年3月27日经本基金的基金管理人批准。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,070,988,236.62	86.06
2	固定收益投资	1,070,988,236.62	86.06
3	金融衍生品投资	-	-
4	银行存款和结算备付金合计	100,761,816.00	8.10
5	其他资产	2,009,956.61	0.17
8.2 期末按行业分类的股票投资组合			
8.2.1 期末按行业分类的境内股票投资组合			

	其中：债券	70,661,000.00	5.68
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	100,761,813.69	8.10
7	其他各项资产	2,088,968.51	0.17
	合计	1,244,470,008.72	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A 农、林、牧、渔业	19,583,634.84	1.59
B 采矿业	29,713,761.11	2.42
C 制造业	726,023,812.29	58.69
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,772,287.27	1.36
E 建筑业	—	—
F 批发和零售业	37,367,471.62	3.06
G 交通运输、仓储和邮政业	21,069,388.60	1.75
H 住宿和餐饮业	—	—
I 信息传输、软件和信息技术服务业	99,139,040.79	8.01
J 金融业	26,131,468.44	2.14
K 房地产业	21,679,209.69	1.76
L 租赁和商务服务业	10,267,446.88	0.84
M 其他行业	2,432,950.00	0.20
N 水利、环境和公共设施管理业	—	—
O 医疗保健、医药制造业	1,466,000	0.12
P 教育	—	—
Q 卫生健康工作	8,267,443.00	0.68
R 文化、体育和娱乐业	32,000,931.36	2.59
S 软件	—	—
合计	1,070,988,236.62	86.06

8.2 期末按行业分类的股票投资组合
8.2.1 期末按行业分类的境内股票投资组合

A	农、林、牧、渔业	19,583,634.84	1.59
B	采矿业	29,913,761.11	2.42
C	制造业	726,023,812.29	58.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,772,287.27	1.36
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	37,367,471.62	3.06
G	交通运输、仓储和邮政业	21,069,388.60	1.75
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	99,139,040.79	8.01
J	金融业	26,131,468.44	2.14
K	房地产业	21,679,209.69	1.76
L	租赁和商务服务业	10,267,446.88	0.84
M	科学研究和技术服务业	2,432,950.00	0.20
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	医药制造业、医药批发和零售业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	8,267,443.00	0.68
R	文化、体育和娱乐业	32,000,931.36	2.59
S	综合	-	-

8.2.2 期末按行业分类的港股投资股票投资组合
本基金本报告期末未持有港股投资股票

8.3 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组合

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	200940	中国神华	2,341,5076	64,371,190.98	5.24
2	601766	中国铝业	6,113,610	64,124,762.20	5.24
3	600406	中国石化	2,194,061	40,470,650.33	3.27
4	300750	宁德时代	534,620	38,464,066.02	3.19
5	601012	隆基股份	2,096,333	36,194,027.62	2.98
6	600486	烽火通信	1,124,170	32,005,119.00	2.65
7	601899	中国国航	37,328,305	31,826,465.60	2.57
8	000031	深赛格A	4,070,542	31,343,174.40	2.53
9	600028	三一重工	3,698,000	30,941,320.00	2.49
10	300164	江川智能	1,466,000	29,537,324.00	2.39

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动
8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元									
序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)	序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002232	金利科技	107,001,100.17	4.59	11	000016	民生银行	97,896,000.00	4.04
2	000063	中国联通	101,266,200.64	4.24	12	600048	海南橡胶	99,765,728.74	4.38
3	600048	海南橡胶	99,765,728.74	4.38	13	600019	宝钢股份	87,721,436.81	3.75
4	600048	海南橡胶	99,961,906.30	3.47	14	600658	伟创软件	85,115,463.61	3.54
5	000063	中国联通	68,946,000.00	2.89	15	601008	中信特钢	68,946,000.00	2.89
6	000087	伊利股份	66,829,164.64	2.82	16	601088	中信银行	66,151,918.00	2.74
7	601088	中信银行	66,151,918.00	2.74	17	601016	同洲信息	63,568,766.68	2.68
8	000031	深赛格A	4,070,542	0.31	18	601388	工商银行	63,179,825.51	2.61
9	000028	三一重工	3,698,000	0.30	19	002036	华测检测	62,400,208.69	2.57
10	601016	同洲信息	63,568,766.68	2.68	20	601636	能源国际	60,034,622.81	2.57
11	000028	三一重工	3,698,000	0.30	21	300023	宁波健盛	58,121,300.81	2.42
12	600048	海南橡胶	99,961,906.30	3.47	22	600426	世纪华联	58,004,682.23	2.40
13	600016	民生银行	97,896,000.00	4.04	23	601012	隆基股份	57,836,000.00	2.38
14	000016	民生银行	97,896,000.00	4.04	24	002071	广弘安捷	57,374,690.07	2.36
15	002668	万润新材	58,462,251.24	2.38	25	002466	华测检测	56,462,251.24	2.36
16	300060	先施股份	53,101,581.34	2.28	26	000048	海南橡胶	53,101,581.34	2.28
17	300014	亿华通	53,100,494.70	2.28	27	600014	亿华通	53,100,494.70	2.28
18	601933	华米科技	50,101,933.88	2.15	28	600076	中国铁发	49,917,289.23	2.14
19	002076	华测检测	49,917,289.23	2.14	29	600076	中国铁发	49,026,378.00	2.10
20	600048	海南橡胶	48,984,881.21	2.10	30	600048	海南橡胶	48,984,881.21	2.10

金额单位:人民币元									
序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)	序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000610	顺丰控股	187,487,158.78	8.04	11	002060	圣农发展	142,328,420.05	6.11
2	002060	圣农发展	142,328,420.05	6.11	12	002966	广联达	123,942,289.06	5.32
3	002966	广联达	123,942,289.06	5.32	13	002460	赣锋锂业	113,968,161.27	4.89
4	600048	海南橡胶	94,261,822.76	4.04	14	600048	海南橡胶	94,261,822.76	4.04
5	300016	华测检测	91,061,092.10	3.91	15	300136	信创医疗	89,644,101.64	3.86
6	300136	信创医疗	89,644,101.64	3.86	16	000739	华鲁恒升	83,563,483.94	3.58
7	000739	华鲁恒升	83,563,483.94	3.58	17	000739	华鲁恒升	83,563,483.94	3.58
8	000739	华鲁恒升	83,563,483.94	3.58	18	000739	华鲁恒升	83,563,483.94	3.58
9	000739	华鲁恒升	83,563,483.94	3.58	19	000739	华鲁恒升	83,563,483.94	3.58
10	000739	华鲁恒升	83,563,483.94	3.58	20	000739	华鲁恒升	83,563,483.94	3.58

注:注:基金管理人每日计提,按月支付。基金托管费按前一日基金资产净值H×E×1.5%÷当年天数H为每日计提的基金管理费

注:注:基金管理人每日计提,按月支付。基金托管费按前一日基金资产净值H×E×1.5%÷当年天数H为每日计提的基金管理费

注:注:基金管理人每日计提,按月支付。基金托管费按前一日基金资产净值H×E×1.5%÷当年天数H为每日计提的基金管理费

注:注:基金管理人每日计提,按月支付。基金托管费按前一日基金资产净值H×E×1.5%÷当年天数H为每日计提的基金管理费

注:注:基金管理人每日计提,按月支付。基金托管费按前一日基金资产净值H×E×1.5%÷当年天数H为每日计提的基金管理费

注:注:基金管理人每日计提,按月支付。基金托管费按前一日基金资产净值H×E×1.5%÷当年天数H为每日计提的基金管理费

注:注:基金管理人每日计提,按月支付。基金托管费按前一日基金资产净值H×E×1.5%÷当年天数H为每日计提的基金管理费

注:注:基金管理人每日计提,按月支付。基金托管费按前一日基金资产净值H×E×1.5%÷当年天数H为每日计提的基金管理费

注:注:基金管理人每日计提,按月支付。基金托管费按前一日基金资产净值H×E×1.5%÷当年天数H为每日计提的基金管理费

注:注:基金管理人每日计提,按月支付。基金托管费按前一日基金资产净值H×E×1.5%÷当年天数H为每日计提的基金管理费

注:注:基金管理人每日计提,按月支付。基金托管费按前一日基金资产净值H×E×1.5%÷当年天数H为每日计提的基金管理费

注:注:基金管理人每日计提,按月支付。基金托管费按前一日基金资产净值H×E×1.5%÷当年天数H为每日计提的基金管理费

注:注:基金管理人每日计提,按月支付。基金托管费按前一日基金资产净值H×E×1.5%÷当年天数H为每日计提的基金管理费

注:注:基金管理人每日计提,按月支付。基金托管费按前一日基金资产净值H×E×1.5%÷当年天数H为每日计提的基金管理费

注:注:基金管理人每日计提,按月支付。基金托管费按前一日基金资产净值H×E×1.5%÷当年天数H为每日计提的基金管理费

注:注:基金管理人每日计提,按月支付。基金托管费按前一日基金资产净值H×E×1.5%÷当年天数H为每日计提的基金管理费

6.6%,较2017年下降0.3个百分点,通胀总体处于低位,CPI同比增长1.9%,PPI从年初2.4%大幅回落至年末0.9%。从经济周期方向来看,制造业投资对经济增长贡献较大,房地产投资维持较高水平,而基建投资持续萎缩。政策方面,央行货币政策调紧,在“平”中“稳健”转为“稳健”,增加“松紧适度”的提法,实际操作中性偏松,保持流动性合理充裕,但资管新规的白热化对外资形成较大限制,全年M2同比增长1.1%,社会融资规模同比增长19.8%,新增人民币贷款16.2万亿元。

2. 市场回顾
2018年,债券收益率全年大幅下降,债券指数普遍上涨。股票市场方面,整体震荡下行,其中,上半年上证综指下跌13.9%,代表大盘股表现的沪深300指数下跌12.9%,创业板综合指数下跌10.67%;下半年,上证综指下跌12.42%,代表大盘股表现的沪深300指数下跌14.25%,创业板综合指数下跌28.65%。