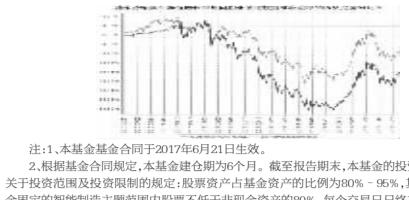


工银瑞信智能制造股票型证券投资基金

2019年第二季度报告



注:1.本基金基金合同于2017年5月10日生效。

2.根据基金合同规定,本基金建仓期为6个月。截至报告期末,本基金的投资符合基金合同关于投资范围及限制的规定:股票资产占基金资产的比例为80%~95%,其中投资于本基金界定的智能制造主题范畴内股票不低于非现金资产的90%。每个交易日仍在扣除股指期货合约的缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内(含一年)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.基金管理人以诚实信用、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。

4.本基金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。

5.本报告期内财务资料未经审计。

6.报告期自2019年4月1日起至6月30日止。

7.基金管理人对本基金产品概况

8.其他指标

9.单位:人民币元

10.序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1.本期已实现收益 604,420.00

2.本期利润 -926,136.10

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0272

4.期末基金资产净值 26,788,038.00

5.期末基金份额净值 0.8000

11.上一报告期基金指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计价用后实际收益水平低于所列示。

12.本公司已实行收益分配政策,本期利润收入、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。

13.所有数据截止到报告期最后一日,无论该日是否开放或交易所的交易日。

14.基金净值表现

15.2.1 本报告期基金份额净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

16.阶段 净值增长 率(%) 净值增 长率 标准差(%) 业绩比 较基 准 收益率差(%) ①-③ ②-④

17.过去三个月 -20% 1.78% -22% 1.38% 4.31% 0.46%

18.3.2 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

19.阶段 净值增 长率(%) 净值增 长率 标准差(%) 业绩比 较基 准 收益率差(%) ①-③ ②-④

20.过去三个月 -1.02% 0.03% 0.02% 0.03% 0.10% 0.00%

21.工银瑞信智能制造股票型证券投资基金

22.下级基金的交易代码 000169 000170

23.报告期末基金总份额 119,077,006.94 291,999,317.99

24.3 主要财务指标和基金净值表现

25.单位:人民币元

26.序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

27.1.本期已实现收益 604,420.00

28.2.本期利润 -926,136.10

29.3.加权平均基金份额本期利润 -0.0272

30.4.期末基金资产净值 26,788,038.00

31.5.期末基金份额净值 0.8000

32.上一报告期基金指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计价用后实际收益水平低于所列示。

33.本公司已实行收益分配政策,本期利润收入、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。

34.所有数据截止到报告期最后一日,无论该日是否开放或交易所的交易日。

35.基金净值表现

36.2.1 本报告期基金份额净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

37.阶段 净值增 长率(%) 净值增 长率 标准差(%) 业绩比 较基 准 收益率差(%) ①-③ ②-④

38.过去三个月 -1.02% 0.03% 0.02% 0.03% 0.10% 0.00%

39.工银瑞信智能制造股票型证券投资基金

40.下级基金的交易代码 000169 000170

41.报告期末基金总份额 119,077,006.94 291,999,317.99

42.3.1 主要财务指标

43.单位:人民币元

44.序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

45.1.本期已实现收益 604,420.00

46.2.本期利润 -926,136.10

47.3.加权平均基金份额本期利润 -0.0272

48.4.期末基金资产净值 26,788,038.00

49.5.期末基金份额净值 0.8000

50.上一报告期基金指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计价用后实际收益水平低于所列示。

51.本公司已实行收益分配政策,本期利润收入、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。

52.所有数据截止到报告期最后一日,无论该日是否开放或交易所的交易日。

53.基金净值表现

54.2.1 本报告期基金份额净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

55.阶段 净值增 长率(%) 净值增 长率 标准差(%) 业绩比 较基 准 收益率差(%) ①-③ ②-④

56.过去三个月 -1.02% 0.03% 0.02% 0.03% 0.10% 0.00%

57.工银瑞信智能制造股票型证券投资基金

58.下级基金的交易代码 000169 000170

59.报告期末基金总份额 119,077,006.94 291,999,317.99

60.3.2 主要财务指标

61.单位:人民币元

62.序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

63.1.本期已实现收益 604,420.00

64.2.本期利润 -926,136.10

65.3.加权平均基金份额本期利润 -0.0272

66.4.期末基金资产净值 26,788,038.00

67.5.期末基金份额净值 0.8000

68.上一报告期基金指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计价用后实际收益水平低于所列示。

69.本公司已实行收益分配政策,本期利润收入、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。

70.所有数据截止到报告期最后一日,无论该日是否开放或交易所的交易日。

71.基金净值表现

72.2.1 本报告期基金份额净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

73.阶段 净值增 长率(%) 净值增 长率 标准差(%) 业绩比 较基 准 收益率差(%) ①-③ ②-④

74.过去三个月 -1.02% 0.03% 0.02% 0.03% 0.10% 0.00%

75.工银瑞信智能制造股票型证券投资基金

76.下级基金的交易代码 000169 000170

77.报告期末基金总份额 119,077,006.94 291,999,317.99

78.3.1 主要财务指标

79.单位:人民币元

80.序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

81.1.本期已实现收益 604,420.00

82.2.本期利润 -926,136.10

83.3.加权平均基金份额本期利润 -0.0272

84.4.期末基金资产净值 26,788,038.00

85.5.期末基金份额净值 0.8000

86.上一报告期基金指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计价用后实际收益水平低于所列示。

87.本公司已实行收益分配政策,本期利润收入、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。

88.所有数据截止到报告期最后一日,无论该日是否开放或交易所的交易日。

89.基金净值表现

90.2.1 本报告期基金份额净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

91.阶段 净值增 长率(%) 净值增 长率 标准差(%) 业绩比 较基 准 收益率差(%) ①-③ ②-④

92.过去三个月 -1.02% 0.03% 0.02% 0.03% 0.10% 0.00%

93.工银瑞信智能制造股票型证券投资基金

94.下级基金的交易代码 000169 000170

95.报告期末基金总份额 119,077,006.94 291,999,317.99

96.3.主要财务指标

97.单位:人民币元

98.序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

99.1.本期已实现收益 604,420.00

100.2.本期利润 -926,136.10

101.3.加权平均基金份额本期利润 -0.0272

102.4.期末基金资产净值 26,788,038.00

103.5.期末基金份额净值 0.8000

104.上一报告期基金指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计价用后实际收益水平低于所列示。

105.本公司已实行收益分配政策,本期利润收入、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。

106.所有数据截止到报告期最后一日,无论该日是否开放或交易所的交易日。

107.基金净值表现

108.2.1 本报告期基金份额净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

109.阶段 净值增 长率(%) 净值增 长率 标准差(%) 业绩比 较基 准 收益率差(%) ①-③ ②-④

110.过去三个月 -1.02% 0.03% 0.02% 0.03% 0.10% 0.00%

111.工银瑞信智能制造股票型证券投资基金

112.下级基金的交易代码 000169 000170

113.报告期末基金总份额 119,077,006.94 291,999,317.99

114.3.主要财务指标

115.单位:人民币元

116.序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

117.1.本期已实现收益 604,420.00

118.2.本期利润 -926,136.10

119.3.加权平均基金份额本期利润 -0.0272

120.4.期末基金资产净值 26,788,038.00

121.5.期末基金份额净值 0.8000

122.上一报告期基金指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计价用后实际收益水平低于所列示。

123.本公司已实行收益分配政策,本期利润收入、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