

B030信息披露

Disclosure

工银瑞信稳健成长股票型证券投资基金

2014 第二季度报告

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：二〇一四年七月十七日

1.1 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。

基金管理人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年7月14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。

本报告中所称财务资料未经审计。

本报告期自2014年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况	
基金简称	工银瑞信成长股票
交易代码	481004
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年12月4日
报告期末基金份额总额	2,122,014,320.70份
投资目标	有效控制投资组合风险，追求基金长期资本增值。
投资策略	专注基本面研究，采取“自下而上”的策略，运用广覆盖的上上市公司成长性价比指标选择具有长期持续增长能力的上市公司股票进行配置。同时合理配置于固定收益类资产，力求实现超越市场平均水平的长期投资回报目标。
业绩比较基准	80%×沪深300指数收益率+20%×上证国债指数收益率
风险收益特征	本基金属成长型股票基金，预期风险和预期收益水平高于债券型基金和混合型基金，属于风险水平相对较高的基金。
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

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2014年4月1日—2014年6月30日)	单位:人民币元
1.本期已实现收益	31,021,109.82	
2.本期利润	66,146,961.30	
3.加权平均基金份额本期利润	0.0303	
4.期末基金资产净值	2,997,154,278.35	
5.期末基金份额净值	1.4124	

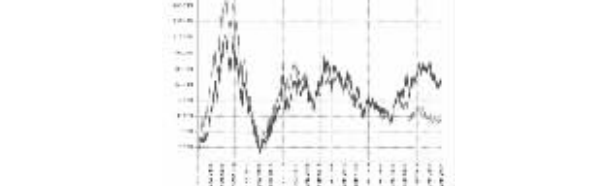
注：1.上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2.“本期已实现收益”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。

3.2 基金业绩评价

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	2.29%	0.84%	0.95%	0.76%	1.34%	0.14%

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2006年12月6日生效。

2.按基金合同约定，本基金自生效起6个月内为建仓期，截至报告期末本基金的各项投资符合基金合同关于投资范围和资产配置的相关规定。本基金股票资产占基金总资产的比例为56%，债券、现金等资产占基金总资产的比例为44%。或或截至到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

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任期	证券从业年限	说明
曹慧忠	权益投资部总监	2009年5月18日 2014年6月12日	13	CFA, FRM, 先后在东方证券、招商证券和泰达宏利基金从事基金研究和股票投资工作。曾任泰达宏利基金权益投资部副经理(QDII基金投资经理)。2007年11月至2009年5月担任泰达宏利基金权益投资部副经理，兼任泰达宏利基金权益投资部副经理。2009年5月18日至2014年6月12日担任工银瑞信成长股票基金基金经理。2014年6月12日担任工银瑞信成长股票基金基金经理。2014年6月12日担任工银瑞信成长股票基金基金经理。2014年6月12日担任工银瑞信成长股票基金基金经理。
杨树	本基金的首任基金经理	2013年5月4日	-	曾任中国银河基金有限公司研究员，2011年加入工银瑞信基金，现任研究部副经理。2013年5月4日至2014年6月12日担任工银瑞信成长股票基金基金经理。2014年6月12日担任工银瑞信成长股票基金基金经理。
刘天任	本基金的首任基金经理	2014年6月5日	-	曾任招商证券基金部研究员，2008年加入工银瑞信基金，曾任研究部副经理。2014年6月5日至2014年6月12日担任工银瑞信成长股票基金基金经理。2014年6月12日担任工银瑞信成长股票基金基金经理。

4.2 管理人对于报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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、招募说明书等有关基金法律文件的约定，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的利益的行为。

4.3 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控制度，制定了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》、《异常交易管理办法》、《异常交易管理办法》等制度，并定期对投资组合的持仓、交易行为、交易价格、交易时间、交易数量等方面进行监控，确保公平交易制度的执行。报告期内，未发现异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩变动情况

本基金本报告期投资策略符合基金合同的规定。报告期内，本基金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%。

4.5 报告期内基金资产组合情况

本基金本报告期资产配置情况如下：截至报告期末，本基金股票资产占基金总资产的比例为56%，债券、现金等资产占基金总资产的比例为44%。或或截至到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

4.6 管理人对于报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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、招募说明书等有关基金法律文件的约定，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的利益的行为。

4.7 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控制度，制定了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》、《异常交易管理办法》、《异常交易管理办法》等制度，并定期对投资组合的持仓、交易行为、交易价格、交易时间、交易数量等方面进行监控，确保公平交易制度的执行。报告期内，未发现异常交易行为。

4.8 报告期内基金的投资策略和业绩变动情况

本基金本报告期投资策略符合基金合同的规定。报告期内，本基金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%。

4.9 报告期内基金资产组合情况

本基金本报告期资产配置情况如下：截至报告期末，本基金股票资产占基金总资产的比例为56%，债券、现金等资产占基金总资产的比例为44%。或或截至到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,565,873,711.19	82.69
	其中:股票	2,565,873,711.19	82.69
2	固定收益投资	31,572,000.00	10.36
	其中:债券	31,572,000.00	10.36
3	贵金属投资	-	-
4	基金投资	-	-
5	买入返售金融资产	39,602,019.80	1.28
	其中:买入返售金融资产中的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	34,124,276.95	1.10
7	其他资产	141,996,123.22	4.58
8	合计	3,103,166,331.16	100.00

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	2,565,873,711.19	82.69
	其中:股票	2,565,873,711.19	82.69
2	固定收益投资	31,572,000.00	10.36
	其中:债券	31,572,000.00	10.36
3	贵金属投资	-	-
4	基金投资	-	-
5	买入返售金融资产	39,602,019.80	1.28
	其中:买入返售金融资产中的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	34,124,276.95	1.10
7	其他资产	141,996,123.22	4.58
8	合计	3,103,166,331.16	100.00

5.2 基金产品概况

基金简称	工银产业债
交易代码	000045
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年3月29日
报告期末基金份额总额	629,485,663.65份
投资目标	本基金在追求资产长期稳健增值的基础上，通过对产业债等固定收益类资产的投资，力争实现超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金依据宏观经济与金融市场的相互关系，以固定收益类资产和权益类资产组合的资产配置，以固定收益类资产投资为主，适当配置权益类资产，力求实现超越业绩比较基准的投资收益。
业绩比较基准	三年定期存款利率+1.00%
风险收益特征	本基金属固定收益类基金，预期风险和预期收益水平低于股票型基金和混合型基金，属于风险水平相对较低的基金。
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
下属两级基金的基金简称	工银产业债A
下属两级基金的交易代码	000045
报告期末下属两级基金的份额总额	175,873,480.91份

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2014年4月1日—2014年6月30日)	单位:人民币元
1.本期已实现收益	698,705.98	
2.本期利润	9,429,824.40	
3.加权平均基金份额本期利润	0.0397	
4.期末基金资产净值	182,571,290.24	
5.期末基金份额净值	1.038	

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。

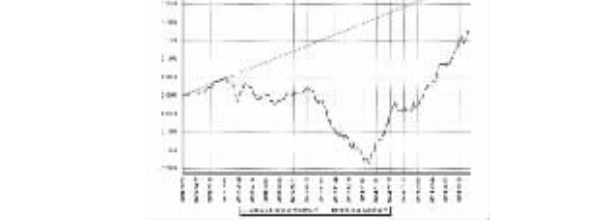
2.“本期已实现收益”指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额；“本期利润”为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.（3）报告期截至2014年6月30日。

3.2.1 本报告期基金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	4.22%	0.11%	1.31%	0.01%	2.91%	0.10%

3.2.2 自基金合同生效以来基金资产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：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

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔	-	-
B	采矿业	26,607,210.35	1.20
C	制造业	1,897,953,866.53	63.33
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	131,284.20	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	380,223,210.68	12.69
J	金融业	92,438,525.53	3.08
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	159,081,124.92	5.31
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		2,565,873,711.19	85.61

注：由于四舍五入的原因金额占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

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指期货投资明细

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	300257	开山股份	9,024,961	286,001,014.09	9.54
2	600099	青岛海尔	17,996,267	265,626,786.52	8.86
3	600566	海康威视	22,166,927	299,444,165.78	7.99
4	601299	中国宝安	47,000,000	215,380,000.00	7.12
5	600066	宇通客车	10,126,850	163,447,559.00	5.45
6	000888	峨边山A	8,636,326	159,081,124.92	5.31
7	002073	联信光电	6,278,641	148,176,399.60	4.94
8	600847	万里股份	6,474,960	109,873,286.40	3.67
9	300213	松发科技	5,072,838	80,861,037.72	2.70
10	300315	掌趣科技	4,141,440	70,404,480.00	2.35

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	159,910,000.00	5.34
4	其中:政策性金融债	159,910,000.00	5.34
5	企业债券	161,662,000.00	5.39
6	企业短期融资券	-	-
7	中期票据	-	-
8	其他	-	-
9	合计	321,572,000.00	10.73

注：由于四舍五入的原因金额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(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140213	14附息13	1,300,000	129,766,000.00	4.33
2	1182237	11附息国债MTN1	900,000	91,179,000.00	3.04
3	098216	09附息国债MTN1	700,000	70,483,000.00	2.35
4	140404	14付息04	300,000	30,144,000.00	1.01

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，也无期末损益。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

报告期内，本基金未运用股指期货进行投资。

5.9.3 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.3.1 本报告期国债期货持仓和损益明细

报告期内，本基金未运用国债期货进行投资。

5.9.3.2 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，也无期末损益。

5.9.3.3 本报告期国债期货投资评价

5.9.3.4 投资组合报告附注

5.9.3.4.1 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、处罚的情况。

5.9.3.4.2 本基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库。

序号	股票代码	名称	金额(元)
1	存出保证金	-	1,038,929.87
2	应收证券清算款	-	8,523,150.00
3	应收股利	-	133,752,532.77
4	应收利息	-	-
4	应收利息	-	7,156,361.76
6	其他应收款	-	48,278.82
7	待摊费用	-	-
8	其他	-	-
9	合计	-	141,996,123.22

5.9.3.4.3 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。

5.9.3.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300315	掌趣科技	70,404,480.00	2.35	非公开发行股票
2	600847	万里股份	47,880,000.00	1.60	非公开发行股票

5.9.3.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

6 开放式基金份额变动

报告期初基金份额总额	2,233,089,376.61
报告期内基金总申购份额	8,523,150.00
报告期内基金总赎回份额	119,569,287.91
报告期内基金净申购份额(份额减少以“-”填列)	-
报告期末基金份额总额	2,122,014,320.70

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人本报告期内运用固有资金投资本基金情况未有变化。

8 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 备查文件目录

1.中国证监会批准工银瑞信稳健成长股票型证券投资基金设立的文件；

2.《工银瑞信稳健成长股票型证券投资基金基金合同》；

3.《工银瑞信稳健成长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和营业执照；

5.基金托管人业务资格批件和营业执照；

6.报告期内基金管理人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处。

9.3 投资者可在营业时间免费查阅，也可在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复印件。

投资者可在营业时间免费查阅，也可在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复印件。

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	2,565,873,711.19	82.69
	其中:股票	2,565,873,711.19	82.69
2	固定收益投资	31,572,000.00	10.36
	其中:债券	31,572,000.00	10.36
3	贵金属投资	-	-
4	基金投资	-	-
5	买入返售金融资产	39,602,019.80	1.28
	其中:买入返售金融资产中的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	34,124,276.95	1.10
7	其他资产	141,996,123.22	4.58
8	合计	3,103,166,331.16	100.00

5.2 基金产品概况

2014

图 1.1 本基金基金合同于 2013 年 3 月 29 日生效

Time (Month)	NAV (RMB)
2013-03-29 (Inception)	1.00
2013-04-30	1.02
2013-05-31	1.05
2013-06-30	1.08
2013-07-31	1.05
2013-08-31	1.02
2013-09-30	1.00
2013-10-31	1.05
2013-11-30	1.08
2013-12-31	1.15

注:1、本基金基金合同于2013年3月29日生效。

图 1.1 本基金基金合同于 2013 年 3 月 29 日生效