

信息披露 Disclosure

(上接B20版)

注册地址:湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦4楼
办公地址:湖北省武汉市江汉区唐家墩路32号国资大厦B座4楼
法定代表人:余剑
客服电话:(027)87618888
公司网址:<http://www.tzfx.com>

基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《本基金基金合同》等的规定,选择其他符合规定的机构办理销售本基金,并及时履行公告义务。

(二)基金注册登记机构

名称:工银瑞信基金管理有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街丙17号北京银行大厦

登记注册地办公地址:北京市西城区金融大街丙17号北京银行大厦7层

法定代表人:郭树华

全国统一客户服务电话:400-811-9999

传真:010-66583100

联系人:朱辉毅

(三)律师事务所及经办注册会计师

名称:安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)

住所:北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城,东三办公楼16层

办公地址:北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城,东三办公楼16层

法定代表人:葛海

办公地址会计师:王静,王珊珊

联系电话:(010)58152145

传真:(010)58114645

联系人:王珊珊

四、基金的名称

本基金名称:工银瑞信消费行业股票型证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型:股票型

六、基金的投资目标

通过投资消费服务业行业股票,追求基金资产长期稳定增值,在合理风险限度内,力争持续实现超越业绩基准的超额回报。

七、基金的投资方向

本基金的投资范围限于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括创业板股票、中小板股票以及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、央行票据、短期融资券、企业债等固定收益类证券以及可转换债券的股票。债券投资策略包括利率策略、信用策略等,主要服务于流动性管理,着力于短期投资。

本基金还将在其法规允许的范围内,基于谨慎原则利用权证以及其他金融工具进行套利或风险管理,为基金收益提供增加价值。本基金进行权证投资时,将在对标的证券进行基本面研究及估值的基础上,结合股价波动率等参数,运用数量化定价模型,确定其合理内在价值,从而构建套利或避险交易组合。

八、投资管理程序

本基金专注基本面研究,遵循系统化、程序化的投资流程以保证投资决策的科学性与一致性。
(1) 投资决策依据
① 根据投资研究人员关于宏观经济、金融市场、行业及上市公司等方面的数据、客观数字形成投资决策;
② 遵守有关法律法规和基金合同的规定;
③ 以维护基金份额持有人利益为基金投资决策的准则。

九、投资程序

本基金管理人建立了规范的投资管理流程和严格的风险管理体系,贯穿于投资研究、投资决策、组合构建、交易执行、风险管理及绩效评估的全过程。

十、基金的投资策略

1. 类别资产配置策略

本基金运用国际化的视野审视中国经济和资本市场,依据定量和定性相结合的方法,考虑经济前景、类别资产收益风险预期等因素,在股票与债券等资产类别之间合理地分配资产配置。

(1) 经济基本面分析

本基金定期评估宏观经济和投资环境,确定未来市场发展的主要推动因素,预测关键数据,从而对未来宏观经济的三个可能的情景(正面、中性、负面),并给出每个情景发生的概率。

(2) 类别资产收益风险预期

针对宏观经济未来的三种可能的预期情景,分别预测股票和债券类资产未来的收益和风险,并对每类资产未来的稳定性进行评估。将每类资产的预期收益与目前的市场情况对比,揭示未来收益可能发生的结构性变化,并对这一变化进行评价。

结合上述分析的结果,拟订基金资产在股票及债券等资产类别之间的配置方案。

2. 选股选择策略

本基金建立系统化、标准化的投资流程,遵循初选投资对象、公司治理评估、行业地位与竞争优势评估、公司财务分析、投资吸引力评估、组合构建及优化等过程,选择具有投资价值的股票,构造投资组合。

(1) 初选投资对象

本基金的股票投资对象为国内依法发行上市的股票,其中投资于消费服务业股票占基金资产的比例不低于80%。

本基金所指的消费服务业行业包括全球行业分类标准(GICS)界定的日常消费品业、医疗保健及金融四个行业板块。日常消费服务包括食品与用品零售业、家庭与个人用品行业、食品与饮料行业;可选消费品行业包括汽车行业、汽车零部件行业、耐用消费品与服饰行业、酒店、餐饮与休闲行业、媒体行业和零售业;医疗保健行业包括医疗保健设备与服务行业、制药与生物科学行业;金融行业包括银行、多元金融、保险和地产。本基金基于上述日常消费行业,可选消费行业、医疗保健行业和金融行业的比例不低于股票资产的80%。

如果GICS行业分类标准调整,或者基金经理人认为有更适当的消费服务行业划分标准,基金经理人在履行适当程序后有权对消费服务行业的界定方法进行调整并及时公告。

如果基金经理人界定消费服务行业的方法调整或者上市公司经营发生变化等,本基金将有消费服务行业股票的比例低于股票资产的80%,本基金将在三十个工作日内进行调整。

图1 投资管理流程

注:由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有误差。

本基金是股票型基金,基金在运作过程中将维持60%-95%比例的股票资产,其余资金投资于债券及其他具有高流动性的短期金融工具,从长期看,股票资产平均配置比例约60%,债券资产的配置比例约20%,因此本基金将业绩比较基准中股票指数与债券指数的权重确定为80%与20%,并用上证国债指数收益率代表债券及货币资产的收益率。

随着市场环境的变化,如上述业绩比较基准不适用本基金时,本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则,根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准应经托管人同意,报中国证监会备案,基金管理人应在调整前3个工作日在中国证监会指定的信息披露媒体上刊登公告。

十一、基金的风险收益特征

本基金是股票型基金,其预期收益及风险水平高于债券型基金与混合型基金,属于风险水平较高的基金。本基金主要投资于消费服务业股票,在股票型基金中属于中等偏高风险水平的股票产品。

十二、基金的投资组合报告

本投资组合报告所载数据截至2014年9月30日。(本报告中的财务资料未经审计。)

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	741,386,240.67	88.23
其中:股票		741,386,240.67	88.23
2	固定收益投资	55,921,600.00	6.66
其中:债券		55,921,600.00	6.66
3	货币市场基金	-	-
4	理财产品	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	衍生工具	-	-
7	其他资产	33,781,946.29	4.02
8	合计	840,287,016.91	100.00

注:由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有误差。

十三、基金的费用报告

本报告期内未发生费用。

十四、基金的收益与分配

本报告期内未发生费用。

十五、基金的财产清算

本报告期内未发生费用。

十六、基金信息披露费

本报告期内未发生费用。

十七、基金的纳税

本报告期内未发生费用。

十八、基金的账户

本报告期内未发生费用。

十九、基金的托管费

本报告期内未发生费用。

二十、基金的审计

本报告期内未发生费用。

二十一、基金的名称

本基金名称:工银瑞信消费行业股票型证券投资基金

二十二、基金的运作方式

本基金为契约型开放式基金,不设封闭期。

二十三、基金的募集

本基金的募集期限自2014年12月11日起至2014年12月15日止。

二十四、基金的发售

本基金的发售时间为2014年12月11日至2014年12月15日。

二十五、基金的申购与赎回

本基金的申购与赎回时间为2014年12月11日至2014年12月15日。

二十六、基金的登记

本基金的登记机构为中国证券登记结算有限责任公司。

二十七、基金的转换

本基金的转换业务将根据中国证监会的有关规定办理。

二十八、基金的定期定额投资

本基金的定期定额投资业务将根据中国证监会的有关规定办理。

二十九、基金的上市

本基金的上市交易将根据中国证监会的有关规定办理。

三十、基金的复权

本基金的复权方式将根据中国证监会的有关规定办理。

三十一、基金的分红

本基金的分红将根据中国证监会的有关规定办理。

三十二、基金的参阅价

本基金的参阅价将根据中国证监会的有关规定办理。

三十三、基金的客户服务

本基金的客户服务将根据中国证监会的有关规定办理。

三十四、基金的销售

本基金的销售将根据中国证监会的有关规定办理。

三十五、基金的销售机构

本基金的销售机构将根据中国证监会的有关规定办理。

三十六、基金的估值

本基金的估值将根据中国证监会的有关规定办理。

三十七、基金的开放

本基金的开放将根据中国证监会的有关规定办理。

三十八、基金的交易

本基金的交易将根据中国证监会的有关规定办理。

三十九、基金的转托管

本基金的转托管将根据中国证监会的有关规定办理。

四十、基金的转托管费

本基金的转托管费将根据中国证监会的有关规定办理。

四十一、基金的非交易过户

本基金的非交易过户将根据中国证监会的有关规定办理。

四十二、基金的冻结与解冻

本基金的冻结与解冻将根据中国证监会的有关规定办理。

四十三、基金的质押

本基金的质押将根据中国证监会的有关规定办理。

四十四、基金的冻结

本基金的冻结将根据中国证监会的有关规定办理。

四十五、基金的冻结扣划

本基金的冻结扣划将根据中国证监会的有关规定办理。

四十六、基金的冻结扣划

本基金的冻结扣划将根据中国证监会的有关规定办理。

四十七、基金的冻结扣划

本基金的冻结扣划将根据中国证监会的有关规定办理。

四十八、基金的冻结扣划

本基金的冻结扣划将根据中国证监会的有关规定办理。

四十九、基金的冻结扣划