

工银瑞信高端制造行业股票型证券投资基金

[2015] 第三季度报告

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司

基金托管人:中国农业银行股份有限公司

报告送出日期:二〇一五年十月二十六日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事、监事及高级管理人员不存在虚假记载、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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司,于2015年10月22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。

本报告书中的财务数据未经审计。

本报告书自2015年7月1日起至9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	工银瑞信高端制造股票
交易代码	000795
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年10月22日
报告期末基金资产总额	2,641,406,203.00

通过深入、深入的全面的综合行业研究,积极把握具有长期持续盈利能力及估值优势的高端制造行业中的投资机会。

本基金的资产配置策略主要是通过宏观经济运行规律的分析,基于对行业属性的综合分析及市场分析,确定组合中不同行业资产配置的比例,从而在一定程度上规避系统性风险。

业绩比较基准 95%×中证细分高端设备指数+5%×中证细分消费电子指数。

风险收益特征 本基金为股票型基金,其预期收益及风险水平高于货币市场基金,本基金主要投资于高端制造行业股票,其风险水平高于市场范围内投资的股票型基金。

基金管理人 工银瑞信基金管理有限公司

基金托管人 中国农业银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2015年7月1日 - 2015年9月30日)	单位:人民币元
1.本期实现收益	-909,729,192.06	
2.本期利润	-1,518,834,971.02	
3.加权平均基金份额本期利润	-0.5834	
4.期末基金份额净值	2,769,078,774.56	
5.期末基金份额净值	1.048	

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。

注: 截至2015年9月30日, 本期利润未扣除应交未交的所得税。

3.2.2 日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

基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注: 本基金管理人对本基金的定期报告、半年报、年报等定期报告以及基金招募说明书、基金产品资料概要等基金信息披露文件中“基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较”部分, 采用“最近三个季度”、“最近一年”、“最近三年”、“最近五年”、“最近六年”等表述。

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2015年7月1日 - 2015年9月30日)

1.本期实现收益 -909,729,192.06

2.本期利润 -1,518,834,971.02

3.加权平均基金份额本期利润 -0.5834

4.期末基金份额净值 2,769,078,774.56

5.期末基金份额净值 1.048

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。

注: 截至2015年9月30日, 本期利润未扣除应交未交的所得税。

3.2.2 日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

基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注: 本基金管理人对本基金的定期报告、半年报、年报等定期报告以及基金招募说明书、基金产品资料概要等基金信息披露文件中“基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较”部分, 采用“最近三个季度”、“最近一年”、“最近三年”、“最近五年”、“最近六年”等表述。

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2015年7月1日 - 2015年9月30日)

1.本期实现收益 -333,393

2.本期利润 -1,518,834,971.02

3.加权平均基金份额本期利润 -0.5834

4.期末基金份额净值 2,769,078,774.56

5.期末基金份额净值 1.048

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。

注: 截至2015年9月30日, 本期利润未扣除应交未交的所得税。

3.2.2 日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

基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注: 本基金管理人对本基金的定期报告、半年报、年报等定期报告以及基金招募说明书、基金产品资料概要等基金信息披露文件中“基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较”部分, 采用“最近三个季度”、“最近一年”、“最近三年”、“最近五年”、“最近六年”等表述。

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2015年7月1日 - 2015年9月30日)

1.本期实现收益 -333,393

2.本期利润 -1,518,834,971.02

3.加权平均基金份额本期利润 -0.5834

4.期末基金份额净值 2,769,078,774.56

5.期末基金份额净值 1.048

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。

注: 截至2015年9月30日, 本期利润未扣除应交未交的所得税。

3.2.2 日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

基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注: 本基金管理人对本基金的定期报告、半年报、年报等定期报告以及基金招募说明书、基金产品资料概要等基金信息披露文件中“基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较”部分, 采用“最近三个季度”、“最近一年”、“最近三年”、“最近五年”、“最近六年”等表述。

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2015年7月1日 - 2015年9月30日)

1.本期实现收益 -333,393

2.本期利润 -1,518,834,971.02

3.加权平均基金份额本期利润 -0.5834

4.期末基金份额净值 2,769,078,774.56

5.期末基金份额净值 1.048

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。

注: 截至2015年9月30日, 本期利润未扣除应交未交的所得税。

3.2.2 日基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

基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注: 本基金管理人对本基金的定期报告、半年报、年报等定期报告以及基金招募说明书、基金产品资料概要等基金信息披露文件中“基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较”部分, 采用“最近三个季度”、“最近一年”、“最近三年”、“最近五年”、“最近六年”等表述。

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2015年7月1日 - 2015年9月30日)

1.本期实现收益 -333,393

2.本期利润 -1,518,834,971.02

3.加权平均基金份额本期利润 -0.5834

4.期末基金份额净值 2,769,078,774.56

5.期末基金份额净值 1.048

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。

注: 截至2015年9月30日, 本期利润未扣除应交未交的所得税。

3.2.2 日基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

基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注: 本基金管理人对本基金的定期报告、半年报、年报等定期报告以及基金招募说明书、基金产品资料概要等基金信息披露文件中“基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较”部分, 采用“最近三个季度”、“最近一年”、“最近三年”、“最近五年”、“最近六年”等表述。

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2015年7月1日 - 2015年9月30日)

1.本期实现收益 -333,393

2.本期利润 -1,518,834,971.02

3.加权平均基金份额本期利润 -0.5834

4.期末基金份额净值 2,769,078,774.56

5.期末基金份额净值 1.048

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。

注: 截至2015年9月30日, 本期利润未扣除应交未交的所得税。

3.2.2 日基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

基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注: 本基金管理人对本基金的定期报告、半年报、年报等定期报告以及基金招募说明书、基金产品资料概要等基金信息披露文件中“基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较”部分, 采用“最近三个季度”、“最近一年”、“最近三年”、“最近五年”、“最近六年”等表述。

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2015年7月1日 - 2015年9月30日)

1.本期实现收益 -333,393

2.本期利润 -1,518,834,971.02

3.加权平均基金份额本期利润 -0.5834

4.期末基金份额净值 2,769,078,774.56

5.期末基金份额净值 1.048

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。

注: 截至2015年9月30日, 本期利润未扣除应交未交的所得税。

3.2.2 日基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

基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注: 本基金管理人对本基金的定期报告、半年报、年报等定期报告以及基金招募说明书、基金产品资料概要等基金信息披露文件中“基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较”部分, 采用“最近三个季度”、“最近一年”、“最近三年”、“最近五年”、“最近六年”等表述。

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2015年7月1日 - 2015年9月30