工银瑞信财富快线货币市场基金

【2016】第一季度报告

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一六年四月二十二日

§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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年4月20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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	工银财富货币
交易代码	000760
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年6月19日
报告期末基金份额总额	540,189,128.18份
投资目标	在控制风险并保持资产流动性的基础上,力争实现超过业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金将采取利率策略、信用策略、相对价值策略等积极投资策略,在严格控制风险的前提下,发掘和利用市场失衡提供的投资机会,实现组合增值。
业绩比较基准	中国人民银行公布的七天通知存款税后利率。
风险收益特征	本基金为货币市场基金,在所有证券投资基金中,是风险相对较低的基金产品。在一般情况下,其风险与预期收益均低于一般债券型基金,也低于混合型基金与股票型基金。
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2016年1月1日 - 2016年3月31日)
1. 本期已实现收益	6,418,109.09
2. 本期利润	6,418,109.09
3. 期末基金资产净值	540,189,128.18

注:(1)本基金收益分配是按日结转份额。

(2)所列数据截止到2016年3月31日。

(3)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。

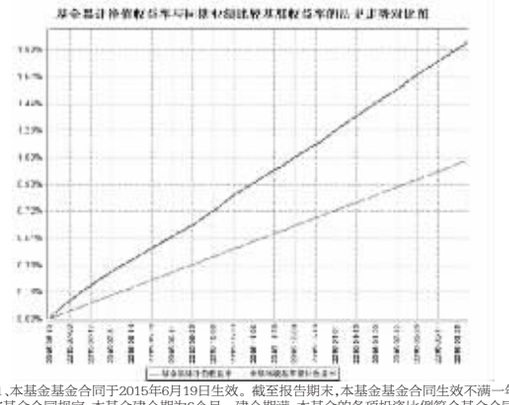
(4)本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.5841%	0.0010%	0.3357%	0.0000%	0.2484%	0.0010%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益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2015年6月19日生效。截至报告期末,本基金基金合同生效不满一年。

2、按基金合同规定,本基金建仓期为6个月。建仓期满,本基金的各项投资比例符合基金合同关于投资范围及投资限制的规定:本基金主要投资于具有良好流动性的工具,包括现金、通知存款、一年以内(含一年)的银行定期存款和大额存单、剩余期限(或回售期限)在397天以内(含397天)的债券、资产支持证券、中期票据;期限在一年以内(含一年)的债券回购、期限在一年以内(含一年)的中央银行票据、短期融资券,及法律法规或中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

§4 管理人报告

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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
魏欣	固定收益部副总监,本基金的基金经理	2015年6月19日	-	11	2006年加入工银瑞信,现任固定收益部副总监;2011年4月20日至今,担任工银货币市场基金基金经理;2012年8月22日至今,担任工银瑞信7天理财债券型基金基金经理;2012年10月26日至今,担任工银14天理财债券型基金的基金经理;2014年9月23日至今,担任工银瑞信现金快线货币市场基金基金经理;2014年10月22日至今,担任工银添益快线货币市场基金基金经理;2015年5月26日起至今,担任工银双利债券型基金基金经理;2015年5月29日起至今,担任工银丰盈回报灵活配置混合型基金基金经理;2015年6月26日起至今,担任工银双利债券型基金基金经理;2015年6月29日起至今,担任工银丰盈回报灵活配置混合型基金基金经理。
谷衡	固定收益部副总监,本基金的基金经理	2015年7月10日	-	11	先后在华夏银行总行担任交易员,在中信银行总行担任交易员;2012年加入工银瑞信,现任固定收益部副总监;2012年11月13日至今,担任工银瑞信14天理财债券型发起式证券投资基金;2013年1月28日至今,担任工银瑞信60天理财债券型基金基金经理;2013年3月28日至2015年1月19日,担任工银安心场内实时申赎货币基金基金经理;2014年9月30日至今,担任工银瑞信货币市场基金基金经理;2015年7月10日至今,担任工银瑞信财富快线货币市场基金基金经理;2015年12月14日至今,担任工银瑞信添福债券基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,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规定,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利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 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部规章,拟定了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》,对公司管理的各类资产的公平对待做了明确具体的规定,并规定对买卖股票、债券时候的价格和市场价格差距较大,可能存在操纵股价、利益输送等违法违规情况进行监控。本报告期,按照时间优先、价格优先的原则,本公司对满足限价条件且对同一证券有相同交易需求的基金等投资组合,均采用了系统中的公平交易模块进行操作,实现了公平交易;未出现清算不到位的情况,且本基金及本基金与本基金管理人管理的其他投资组合之间未发生法律法规禁止的反向交易及交叉交易。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内,本公司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超过该证券当日成交量的5%的情况有4次。投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易,未导致不公平交易和利益输送。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

一季度,整个经济出现了一些偷积极的因素,在地产销售较好的情况下带动新开工和投资相较2015年年底都有一定程度的回升,广义信用在一季度也强烈扩张,同时供给端的收缩和联储加息预期的弱化使得大宗商品价格在一季度出现了一定幅度的上涨,但在产能去化压力仍较大的情况下,实体经济仍然处于弱企稳的状态。二月底虽然出现了一次降准,但整体来看货币政策如四季度执行报告所述处于松紧适度的稳健态度、短端基准利率自去年10.23后也未继续下调。在一季度整个经济和货币政策走向出现一定变化的情况下,货币市场资产收益率整体体现的是一种震荡的走势,至一季度末,7天回购利率从2.39%上升46bp至2.85%,一年期AAA短融收益率从2.87%回落至2.75%,下行12bp。

一季度,本基金通过对客户需求以及宏观经济和货币市场的判断,积极应对客户在月末和季末的流动性要求,合理安排组合的现金流,并在确保流动性的前提下,通过对存款和债券配置的时点安排,增厚组合收益率。同时,在实体经济产能去化压力较大的情况下,本基金一直严控债券配置的信用资质。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金净值增长率为0.5841%,业绩比较基准收益率为0.3357%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金在报告期内没有触及2014年8月8日生效的《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条规定的条件。

§5 投资组合报告

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	固定收益投资	498,501,505.07	79.93
	其中:债券	498,501,505.07	79.93
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	123,388,407.11	19.79
4	其他资产	1,748,536.69	0.28
5	合计	623,638,448.87	100.00

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 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	4.18	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	82,799,838.60	15.33
	其中:买断式回购融资	-	

注:报告期内债券融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产余额比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本基金债券正回购的资金余额没有超过基金资产净值20%的情况

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	52
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	93
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	35

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

投资组合平均剩余期限没有超过120天的情况

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	28.40	15.33
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	77.47	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	5.56	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	3.70	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		115.12	15.33

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	摊余成本(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	30,012,093.68	5.56
	其中:政策性金融债	30,012,093.68	5.56
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	70,035,171.07	12.96
6	中期票据	-	-
7	同业存单	398,454,240.32	73.76
8	其他	-	-
9	合计	498,501,505.07	92.28
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

注:上表中,债券的成本包括债券面值和折溢价。

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111592353	15宁波银行CD118	1,000,000	99,661,733.97	18.45
2	111620001	16广发银行CD001	1,000,000	99,649,770.39	18.45
3	111617028	16光大CD028	1,000,000	99,589,081.25	18.44
4	111510408	15兴业CD408	1,000,000	99,553,654.71	18.43
5	011541002	15鞍钢SCP002	300,000	29,999,373.84	5.55
6	011505002	15凤通SCP002	200,000	20,043,608.03	3.71
7	150311	15进出11	200,000	20,004,697.26	3.70
8	041954072	15河钢CP003	200,000	19,992,189.20	3.70
9	150215	15国开15	100,000	10,007,396.42	1.85

注:上表中,债券的成本包括债券面值和折溢价。

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25%(含)-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.0895%
报告期内偏离度的最低值	0.0011%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0410%

注:上表中"偏离情况"根据报告期内各工作日数据计算。

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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 本基金采用固定份额净值,基金账面份额净值始终保持为人民币1.00元。 本基金估值采用摊余成本法,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内按实际利率法进行摊销,每日计提收益或损失。

5.8.2 本报告期内,本基金持有的剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本总计在每个交易日均未超过日基金资产净值20%。

5.8.3 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、处罚的情形。

5.8.4 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	1,748,536.69
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	1,748,536.69

5.8.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	1,384,863,907.42
报告期期间基金总申购份额	944,762,864.44
报告期期间基金总赎回份额	1,789,437,643.68
报告期末基金份额总额	540,189,128.18

注:1、报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额;

2、报告期期间基金总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	红利发放	2016年1月4日	580.03	0.00	0.00%
2	红利发放	2016年2月1日	483.52	0.00	0.00%
3	红利发放	2016年3月1日	508.34	0.00	0.00%
合计			1,571.89	0.00	

注:1.本基金管理人本报告期内未运用固有资金投资本基金。

2.期间交易总份额为被动红利再投所得,非公司主动投资。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会准予工银瑞信财富快线货币市场基金募集申请的注册文件;

2、《工银瑞信财富快线货币市场基金基金合同》;

3、《工银瑞信财富快线货币市场基金托管协议》;

4、基金管理人业务资格批件、营业执照;

5、基金托管人业务资格批件、营业执照;

6、报告期内基金管理人在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办公场所。

9.3 查阅方式

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

工银瑞信产业债债券型证券投资基金

【2016】第一季度报告

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一六年四月二十二日

§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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年4月20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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	工银产业债券	
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	762,959,757.24份	
投资目标	本基金在追求资产长期稳健增值的基础上,通过对产业债券积极主动的投资管理,力争创造超过业绩比较基准的投资收益。	
投资策略	本基金依据经济周期与金融市场的相互关系,以固定收益类品种构筑资产组合的平稳收益,以积极的权益类资产投资追求资产组合的增强回报。通过对股票资产与债券资产进行相对稳定的战略性配置,实现基金的风险收益目标。	
业绩比较基准	人民币税后三年期银行定期存款利率+1.00%。三年期定期存款利率是指每年的第一个工作日中国人民银行网站上发布的三年期"金融机构人民币存款基准利率"。	
风险收益特征	本基金为债券型基金,预期收益和风险水平高于货币市场基金,低于混合型基金与股票型基金;因为本基金可以配置二级市场股票,所以预期收益和风险水平高于投资范围不含二级市场股票的债券型基金。	
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	工银产业债券A	工银产业债券B
下属分级基金的交易代码	000045	000046
报告期末下属分级基金的份额总额	402,322,137.80份	360,637,619.44份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2016年1月1日 - 2016年3月31日)	
	工银产业债券A	工银产业债券B
1. 本期已实现收益	-1,317,021.79	-97,225.08
2. 本期利润	-2,959,869.85	-4,168,499.72
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0067	-0.0135
4. 期末基金资产净值	547,592,921.66	484,219,902.19
5. 期末基金份额净值	1.361	1.343

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、所列数据截止到2016年3月31日。

3.2 基金净值表现

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

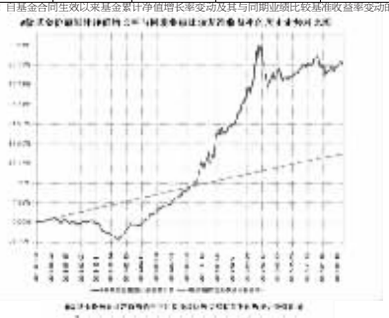
工银产业债券A

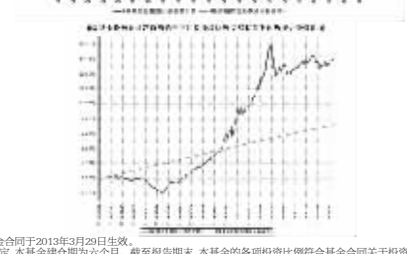
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.66%	0.28%	0.93%	0.01%	-1.59%	0.27%

工银产业债券B

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	-0.59%	0.28%	0.93%	0.01%	-1.52%	0.27%

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2013年3月29日生效。

2、按基金合同规定,本基金建仓期为六个月。截至报告期末,本基金的各项投资比例符合基金合同关于投资范围及投资限制的规定:本基金债券等固定收益类资产占基金资产的比例不低于80%;其中产业债的投资比例不低于固定收益类资产的80%;股票等权益类资产占基金资产的比例不超过20%;续金及到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于5%。

3.3 其他指标

无。

§4 管理人报告

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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
何秀红	固定收益部副总监,本基金的基金经理	2013年3月29日	-	9	曾任广发证券股份有限公司债券研究员;2009年加入工银瑞信,现任固定收益部副总监;2011年2月10日至今,担任工银四季收益债券型基金基金经理;2011年12月27日至2015年1月19日,担任工银保本混合基金基金经理;2012年11月14日至今,担任工银瑞信产业债债券基金基金经理;2013年5月22日至今,担任工银信用纯债一年定期开放基金基金经理;2013年6月24日起至今,担任工银信用纯债两年定期开放基金基金经理;2015年10月27日至今,担任工银丰收回报灵活配置混合型基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,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规定,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利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 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部规章,拟定了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》,对公司管理的各类资产的公平对待做了明确具体的规定,并规定对买卖股票、债券时候的价格和市场价格差距较大,可能存在操纵股价、利益输送等违法违规情况进行监控。本报告期,按照时间优先、价格优先的原则,本公司对满足限价条件且对同一证券有相同交易需求的基金等投资组合,均采用了系统中的公平交易模块进行操作,实现了公平交易;未出现清算不到位的情况,且本基金及本基金与本基金管理人管理的其他投资组合之间未发生法律法规禁止的反向交易及交叉交易。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内,本公司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超过该证券当日成交量的5%的情况有4次。投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易,未导致不公平交易和利益输送。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2016年一季度市场出现巨大波动,上证综指下跌15.12%,创业板指数下跌17.53%。1、2月份快速下跌,3月份市场企稳反弹。我们的组合以信息产业、互联网、消费、军工等行业为主要配置方向。展望未来,中国经济仍然在结构调整和改善的新常态之中。未来需要观察的主要因素包括:宏观经济短期企稳之后能否持续,通胀演化趋势,美国加息时点、频率,人民币汇率,供求关系变化等。这些因素在某一阶段都有可能成为主导因素。整体来看,在这个阶段,改革和创新仍将是我们关注的主线。结构来看,产业驱动和价格驱动是我们挖掘的两条主线。我们认为未来市场会回归更加均衡状态,大的分化也给我们精选个股提供了空间,我们将更严格选择能够兑现长期增长预期的优质公司,线索上偏向互联网、信息安全、虚拟现实、大数据、90后新消费新娱乐、车联网、军工、改革等方向。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金净值增长率为-26.20%,业绩比较基准收益率为-12.03%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金在报告期内没有触及2014年8月8日生效的《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条规定的条件。

§5 投资组合报告

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	2,538,341,884.69	88.50
	其中:股票	2,538,341,884.69	88.50
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	50,670,449.46	1.77
	其中:债券	50,670,449.46	1.77
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	150,675,221.09	5.25
8	其他资产	128,584,011.76	4.48
9	合计	2,868,271,567.00	100.00

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 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	2,151,200.00	0.21
B	采矿业	15,260,031.60	1.48
C	制造业	52,364,575.07	5.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,205,000.00	0.21
E	建筑业	2,031,000.00	0.20
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,435,800.00	0.14
J	金融业	11,722,800.00	1.14
K	房地产业	4,685,500.00	0.45
L	租赁和商务服务业	2,594,684.23	0.25
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	6,329,200.00	0.61
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	4,743,500.00	0.46
S	综合	-	-
	合计	105,523,290.90	10.23

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尾差。

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

无。

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票投资明细

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	600489	中金黄金	429,380	4,602,953.60	0.45
2	002701	奥瑞金	180,000	4,392,000.00	0.43
3	601788	光大证券	200,000	3,820,000.00	0.37
4	601069	西部黄金	150,000	3,532,500.00	0.34
5	601688	华泰证券	200,000	3,422,000.00	0.33
6	600585	海螺水泥	200,000	3,378,000.00	0.33
7	002508	老板电器	70,000	3,219,300.00	0.31
8	002236	大华股份	80,000	2,883,200.00	0.28
9	600837	海通证券	200,000	2,858,000.00	0.28
10	000858	五粮液	100,000	2,811,000.00	0.27

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	72,471,107.50	7.02
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,326,000.00	1.00
	其中:政策性金融债	10,326,000.00	1.00
4	企业债券	459,219,015.84	44.51
5	企业短期融资券	10,014,000.00	0.97
6	中期票据	431,246,000.00	41.79
7	可转债(可交换债)	23,663,700.00	2.29
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,006,939,823.34	97.59

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(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	101453009	14铁通MTN001	500,000	54,325,000.00	5.27
2	1382305	13招商局MTN2	500,000	53,525,000.00	5.19
3	019515	15国债15	500,000	50,060,000.00	4.85
4	101455004	14浙能源MTN001	300,000	32,325,000.00	3.13
5	1382152	13魏桥铝MTN1	300,000	31,341,000.00	3.04

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国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本报告期内,本基金未运用国债期货进行投资。

5.9.2 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,也无期间损益。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本报告期内,本基金未运用国债期货进行投资。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的投资决策程序说明:

华泰证券:

违规行为:

2013年7月29日,华泰证券威宁路营业部客户上海朝兴置业有限公司(以下简称朝兴置业)的要求,与杭州恒生网络技术服务有限公司(以下简称恒生网络)共同测试HOMS系统接入华泰证券软件系统。系统连通后,在朝兴置业未使用的情况下,华泰证券并未切断其与HOMS系统的连接端口,也未对此专线设置相应监控。2014年10月至12月期间,华泰证券在对于日身交易系统没有采取预防措施的情况下,让浙江核新同花顺网络信息股份有限公司(以下简称同花顺)工程人员在华泰证券机房安装了资产管理模块。对于上述外部接入的第三方交易终端软件,华泰证券未进行软件认证许可,未对外部系统接入实施有效管理,对相关客户身份情况缺乏了解。华泰证券未按要求采集客户交易终端信息,未能确保客户交易终端信息的真实性、准确性、完整性、一致性、可读性,未采取可靠措施采集、记录与客户身份识别有关的信息。综上,华泰证券未按照《关于加强证券期货经营机构客户交易终端信息等客户信息管理的规定》第六条、第八条、第十三条,《中国证券登记结算有限责任公司证券账户管理规则》第五十条的规定对客户的身份信息进行审查和了解,违反了《证券公司监督管理条例》第二十八条第一款的规定,构成《证券公司监督管理条例》第八十四条第(四)项所述的行为,获利18,235,275.00元。

处分类型:

根据当事人违法行为的事实、性质、情节和社会危害程度,依据《证券公司监督管理条例》第八十四条第(四)项的规定,证监会拟决定:对华泰证券责令改正,给予警告,没收违法所得18,235,275.00元,并处以54,705,825.00元罚款。

投资决策流程符合公司的制度要求,目前公司经营状况良好,业绩稳定,对投资无重大影响。

海通证券:

违规行为:

海通证券上海建国西路营业部和杭州解放路营业部对杭州恒生网络技术服务有限责任公司 HOMS系统(以下简称HOMS系统)开放专线接入,其中第一条专线于2014年3月由零售与网络金融部、信息技术管理部、合规与风险管理总部平行审核后接入上线。第二条专线于2015年2月由零售与网络金融部、合规与风险管理总部、信息技术管理部平行审核后接入上线。对于上述外部接入第三方交易终端软件,海通证券未进行软件认证许可,未对外部系统接入实施有效管理,对相关客户身份情况缺乏了解。截止调查日,海通证券客户中,有120个使用HOMS系统接入的主账户。对上述客户,海通证券未按要求采集客户交易终端信息,未能确保客户交易终端信息的真实性、准确性、完整性、一致性、可读性,未采取可靠措施采集、记录与客户身份识别有关的信息。海通证券通过添加白名单方式允许客户使用HOMS系统进行交易,缺少实质性审核。在客户回访方面,海通证券虽然对客户进行了回访,但在回访时没有对客户交易委托电话、IP、MAC等与客户进行全面核对,使用HOMS系统进行小额交易的账户由于操作子账户多,主账户的交易较为频繁,异常,明显不同于其他普通账户,但海通证券没有对该等账户重点关注,缺少有效监督。海通证券在未采集、上送客户身份识别信息的情况下,未实施有效的了解客户身份的回访、检查等程序。综上,海通证券未按照《证券登记结算管理办法》第二十四条、《关于加强证券期货经营机构客户交易终端信息等客户信息管理的规定》第六条、第八条、第十三条、《中国证监会关于加强证券经纪业务管理的规定》第三条第(四)款、《中国证券登记结算有限责任公司证券账户管理规则》第五十条涉及客户的身份信息进行审查和了解,违反了《证券公司监督管理条例》第二十八条第一款的规定,构成《证券公司监督管理条例》第八十四条第(四)项所述的行为,获利28653.37元。

处分类型:

根据当事人违法行为的事实、性质、清洁和社会危害程度,依据《证券公司监督管理条例》第八十四条的规定,中国证监会拟决定:对海通证券责令改正,给予警告,没收违法所得28,653.00元,并处以85,959.00元罚款。

投资决策流程符合公司的制度要求,目前公司经营状况良好,业绩稳定,对投资无重大影响。

5.10.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	264,316.28
2	应收证券清算款	4,124,297.50
3	应收股利	-
4	应收利息	25,121,335.57
5	应收申购款	40,930.56
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	29,550,879.90

5.10.4 报告期未持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期未持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分