

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：二〇一八年一月二十日

§ 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。

基金托管人中行银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年1月18日对本基金报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，进行复核。内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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。

本报告期自2017年10月1日起至2017年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金名称	工银瑞信得利混合
交易代码	000206
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年9月21日
报告期末基金资产总额	418,269,206.99
投资目标	在严格控制风险的前提下实现资产的持续增值。通过资产配置，力求实现资产的持续稳健增长。

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，计价费用后实际收益水平将低于列示。

2. 本期每十份收益是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。

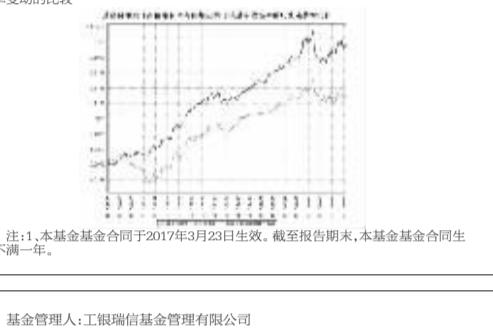
3. 所列数据截止到报告期最后一日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

3.2 基金净值增长率净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

新阶段 净值增长率(%) 究明长短期债券型基金净值增长率(%) 比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 2.24% 0.36% 1.23% 0.26% 0.26% 0.06%

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折线图



注：1. 本基金基金合同于2017年3月23日生效。截至报告期末，本基金基金合同尚未满一年。

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：二〇一八年一月二十日

§ 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。

基金托管人中行银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年1月18日对本基金报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，进行复核。内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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。

本报告期自2017年10月1日起至2017年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金名称	工银瑞信得利混合
交易代码	000206
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年9月21日
报告期末基金资产总额	62,000,000.00
投资目标	本基金通过对宏观经济、行业政策、市场环境等的深入分析，结合定量和定性的方法，精选具有投资价值的股票，同时适当配置债券类资产，力争在严格控制风险的前提下，通过资产配置，实现资产的持续稳健增长。

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，计价费用后实际收益水平将低于列示。

2. 本期每十份收益是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. 所列数据截止到报告期最后一日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

3.2 本基金净值增长率净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

新阶段 净值增长率(%) 究明长短期债券型基金净值增长率(%) 比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -1.00% 1.11% -0.26% 0.21% -0.26% 0.06%

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折线图



注：1. 本基金基金合同于2017年4月12日生效。截至报告期末，本基金基金合同尚未满一年。

2. 在基金合同约定的范围内，本基金将持有不低于基金资产净值的5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。

3.3 其他指标

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理助理)简介

姓名 职务 任本基金的基金经理(或基金经理助理)时间 说明

宋钢峰 权益投资总监、本基金的基金经理 2017年4月12日 -

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，计价费用后实际收益水平将低于列示。

2. 本期每十份收益是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。

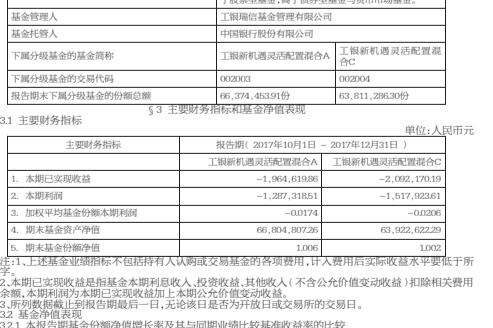
3. 所列数据截止到报告期最后一日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

3.2 本基金净值增长率净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

新阶段 净值增长率(%) 究明长短期债券型基金净值增长率(%) 比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -1.00% 1.11% -0.26% 0.21% -0.26% 0.06%

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折线图



注：1. 本基金基金合同于2017年4月12日生效。截至报告期末，本基金基金合同尚未满一年。

2. 在基金合同约定的范围内，本基金将持有不低于基金资产净值的5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。

3.3 其他指标

§ 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) 占基金资产的比例(%)

1 权益投资 112,967,690.00 94.00

2 债券 112,967,690.00 94.00

3 货币市场基金 600,669.00 0.49

4 其他资产 600,669.00 0.49

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号 行业类别 金额(元) 占基金资产的比例(%)

1 农、林、牧、渔业 - -

2 制造业 3,531,572.00 3.17

3 制造业 43,081,656.18 39.26

4 电力、热力、燃气及水生产和供应业 - -

5 建筑业 1,169,600.00 1.03

6 银行业 2,436,403.04 2.14

7 其他行业 10,431,462.00 9.00

5.3 报告期末按行业分类的债券投资组合

序号 行业类别 金额(元) 占基金资产的比例(%)

1 国债 - -

2 其他债券 1,169,600.00 1.03

5.4 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 002050 江特电机 106,500 8,106,360.00 7.18

2 001318 中航重机 107,168 7,494,710.04 6.56

3 000039 中航高科 261,570 6,976,074.50 6.13

4 000340 皇氏集团 171,100 5,370,028.00 4.68

5 000643 爱康科技 477,542 5,291,168.36 4.56

6 000703 金固股份 193,400 4,992,180.00 4.37

7 002438 丹东港 264,600 4,854,600.00 4.22

8 000972 中航黑豹 299,627 4,807,538.62 4.12

9 002675 酒钢环境 266,700 4,676,561.00 4.03

10 000374 通化东宝 307,900 4,626,521.00 4.02

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十名债券投资明细

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 100009 10国债 106,500 8,106,360.00 7.18

2 101318 18中航重机平 107,168 7,494,710.04 6.56

3 100039 18中航高科平 261,570 6,976,074.50 6.13

4 100340 18爱康科技平 477,542 5,291,168.36 4.56

5 100703 18金固股份平 193,400 4,992,180.00 4.37

6 100243 18丹东港平 264,600 4,854,600.00 4.22

7 100097 18中航黑豹平 299,627 4,807,538.62 4.12

8 100267 18酒钢环评平 266,700 4,676,561.00 4.03

9 100037 18通化东宝平 307,900 4,626,521.00 4.02

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

序号 项目 金额(元) 占基金资产的比例(%)

1 002050 江特电机 106,500 8.74

2 001318 中航重机 107,168 8.59

3 000039 中航高科 261,570 8.59

4 000340 爱康科技 477,542 8.59

5 000703 金固股份 193,400 8.59

6 000243 丹东港 264,600 8.59

7 000972 中航黑豹 299,627 8.59

8 000267 酒钢环境 266,700 8.59

9 000374 通化东宝 307,900 8.59

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权证投资明细

序号 项目 金额(元) 占基金资产的比例(%)