

工银瑞信新蓝筹股票型证券投资基金

2017年第四季度报告

10月31日召开重要会议之后,金融去杠杆工作再度上议事日程。受到资金面重新趋紧影响,股票市场的风险偏好降低,风格重新回到龙头和白马队。回顾我们上个季度报告中的展望,当时我们认为经济增速将呈现较低幅度的回落,之前出台的金融去杠杆的管理细则也将陆续出台,市场投资风格大概率趋于谨慎。这一判断事后看来是正确的。

展望2018年1季度,我们认为经济增速回落幅度有限,全球经济持续复苏对我国形成较好的支撑。经过2017年的房地产调控,一二线房地产市场得到较好的控制,由于库存较低,房地产开工有可能超预期,也对经济形成较好支撑。

本基金在4季度没有进行大的行业配置调整。

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14%,业绩比较基准收益率为3.98%。

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《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	327,034,770.61	81.24
2	基金投资	327,034,770.61	81.24
3	固定收益投资	20,796,700.00	5.14
4	资产支持证券	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	银行承兑票据及应付票据合计	1,509,211.88	0.38
8	其他资产	62,106,101.05	15.54
9	合计	402,231,844.02	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

A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	28,440,000.00	6.09
C	制造业	117,055,225.98	28.12
D	电力、热力、燃气及生产供应业	16,143.20	0.00
E	建筑业	6,000,304.00	1.52
F	批发和零售业	22,821,843.33	5.69
G	信息传输、计算机服务和软件业	19,159,546.06	4.79
H	住宿和餐饮业	-	-
I	金融业	34,112.06	0.01
J	房地产业	102,751,483.12	25.05
K	租赁和商务服务业	25,791,169.97	6.42
L	科学研究和技术服务业	9,869,243.23	2.44
M	教育、文化、体育和娱乐业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	32,322.30	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	公共事业管理	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	327,034,770.61	81.25

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。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合

5.2.3 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	18,599,159.17	30.76
2	基金投资	18,599,159.17	30.76
3	固定收益投资	330,010,960.74	72.24
4	资产支持证券	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	银行承兑票据及应付票据合计	3,109,696.06	0.73
8	其他资产	4,999,444.60	0.91
9	合计	402,719,280.06	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。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合

5.2.3 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	18,599,159.17	30.76
2	基金投资	18,599,159.17	30.76
3	固定收益投资	330,010,960.74	72.24
4	资产支持证券	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	银行承兑票据及应付票据合计	3,109,696.06	0.73
8	其他资产	4,999,444.60	0.91
9	合计	402,719,280.06	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。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合

5.2.3 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	18,599,159.17	30.76
2	基金投资	18,599,159.17	30.76
3	固定收益投资	330,010,960.74	72.24
4	资产支持证券	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	银行承兑票据及应付票据合计	3,109,696.06	0.73
8	其他资产	4,999,444.60	0.91
9	合计	402,719,280.06	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。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合

5.2.3 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	18,599,159.17	30.76
2	基金投资	18,599,159.17	30.76
3	固定收益投资	330,010,960.74	72.24
4	资产支持证券	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	银行承兑票据及应付票据合计	3,109,696.06	0.73
8	其他资产	4,999,444.60	0.91
9	合计	402,719,280.06	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。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合

5.2.3 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	18,599,159.17	30.76
2	基金投资	18,599,159.17	30.76
3	固定收益投资	330,010,960.74	72.24
4	资产支持证券	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	银行承兑票据及应付票据合计	3,109,696.06	0.73
8	其他资产	4,999,444.60	0.91
9	合计	402,719,280.06	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。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合

5.2.3 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	18,599,159.17	30.76
2	基金投资	18,599,159.17	30.76
3	固定收益投资	330,010,960.74	72.24
4	资产支持证券	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	银行承兑票据及应付票据合计	3,109,696.06	0.73
8	其他资产	4,999,444.60	0.91
9	合计	402,719,280.06	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。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合

5.2.3 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	18,599,159.17	30.76
2	基金投资	18,599,159.17	30.76
3	固定收益投资	330,010,960.74	72.24
4	资产支持证券	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	银行承兑票据及应付票据合计	3,109,696.06	0.73
8	其他资产	4,999,444.60	0.91
9	合计	402,719,280.06	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。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合

5.2.3 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	18,599,159.17	30.76
2	基金投资	18,599,159.17	30.76
3	固定收益投资	330,010,960.74	72.24
4	资产支持证券	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	银行承兑票据及应付票据合计	3,109,696.06	0.73
8	其他资产	4,999,444.60	0.91
9	合计	402,719,280.06	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。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合

5.2.3 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	18,599,159.17	30.76
2	基金投资	18,599,159.17	30.76
3	固定收益投资	330,010,960.74	72.24
4	资产支持证券	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	银行承兑票据及应付票据合计	3,109,696.06	0.73
8	其他资产	4,999,444.60	0.91
9	合计	402,719,280.06	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。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合

5.2.3 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	18,599,159.17	30.76
2	基金投资	18,599,159.17	30.76
3	固定收益投资	330,010,960.74	72.24
4	资产支持证券	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	银行承兑票据及应付票据合计	3,109,696.06	0.73
8	其他资产	4,999,444.60	0.91
9	合计	402,719,280.06	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。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合

5.2.3 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	18,599,159.17	30.76
2	基金投资	18,599,159.17	30.76
3	固定收益投资	330,010,960.74	72.24
4	资产支持证券	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	银行承兑票据及应付票据合计	3,109,696.06	0.73
8	其他资产	4,999,444.60	0.91
9	合计	402,719,280.06	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。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合

5.2.3 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	18,599,159.17	30.76
2	基金投资	18,599,159.17	30.76
3	固定收益投资	330,010,960.74	72.24
4	资产支持证券	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	银行承兑票据及应付票据合计	3,109,696.06	0.73
8	其他资产	4,999,444.60	0.91
9	合计	402,719,280.06	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。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合

5.2.3 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	18,599,159.17	30.76
2	基金投资	18,599,159.17	30.76
3	固定收益投资	330,010,960.74	72.24
4	资产支持证券	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	银行承兑票据及应付票据合计	3,109,696.06	0.73
8	其他资产	4,999,444.60	0.91
9	合计	402,719,280.06	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。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合

5.2.3 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	18,599,159.17	30.76
2	基金投资	18,599,159.17	30.76
3	固定收益投资	330,010,960.74	72.24
4	资产支持证券	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	银行承兑票据及应付票据合计	3,109,696.06	0.73
8	其他资产	4,999,444.60	0.91
9	合计	402,719,280.06	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。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合

5.2.3 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	18,599,159.17	30.76
2	基金投资	18,599,159.17	30.76
3	固定收益投资	330,010,960.74	72.24
4	资产支持证券	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	银行承兑票据及应付票据合计	3,109,696.06	0.73
8	其他资产	4,999,444.60	0.91
9	合计	402,719,280.06	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。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合

5.2.3 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	18,599,159.17	30.76
2	基金投资	18,599,159.17	30.76
3	固定收益投资	330,010,960.74	72.24
4	资产支持证券	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	银行承兑票据及应付票据合计	3,109,696.06	0.73
8	其他资产	4,999,444.60	0.91
9	合计	402,719,280.06	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。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合

5.2.3 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	18,599,159.17	30.76
2	基金投资	18,599,159.17	30.76
3	固定收益投资	330,010,960.74	