

工银瑞信新蓝筹股票型证券投资基金

2017年第四季度报告

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一八年一月二十日

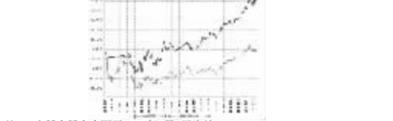
Table with 2 columns: 基金概况, 基金投资组合. Includes fund name, manager, and asset allocation details.

3.1 主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期: 2017年10月1日至2017年12月31日. Lists financial metrics like net assets and income.

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。

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



注:1、本基金合同于2015年10月16日生效。
2、按基金合同约定,本基金建仓期为6个月。截至报告期末,本基金的各项投

4.1 基金经理 (或基金经理小组)简介

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期. Lists fund managers and their terms.

4.2 管理人对于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》、《基金管理人公平交易管理办法》等法律法规和公司内控制度,制定了《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未超过该证券当日成交量的5%。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析
2017年4季度沪深300指数上涨1.86%,创业板指数下跌6.3%,分行业看,以食品饮料、家电、医药为代表的消费行业表现较好,IT、计算机、有色金属、纺织服装等行业表现较弱。从风格上看,高价股、绩优股、大市值股表现较好,小微股、微利股、高市盈率股表现较差。市场延续了上半年的风格,白马股、龙头股表现较好。

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 3 columns: 序号, 行业, 金额(元), 占基金总资产比例(%). Lists industry allocations and percentages.

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 3 columns: 代码, 行业名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Lists stock holdings by industry.

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

Table with 5 columns: 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(%). Lists top 10 stock holdings.

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 3 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Lists bond holdings by type.

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

Table with 5 columns: 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(%). Lists top 5 bond holdings.

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

Table with 3 columns: 序号, 名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Lists asset-backed securities.

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

Table with 3 columns: 序号, 贵金属名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Lists precious metal investments.

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

Table with 3 columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Lists warrant investments.

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有股指期货投资,也无期间损益。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策
本报告期末,本基金未运用国债期货进行投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

工银瑞信丰收回报灵活配置混合型证券投资基金

2017年第四季度报告

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:广发银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一八年一月二十日

Table with 2 columns: 基金概况, 基金投资组合. Includes fund name, manager, and asset allocation details.

3.1 主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期: 2017年10月1日至2017年12月31日. Lists financial metrics like net assets and income.

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。

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



注:1、本基金合同于2015年10月27日生效。
2、按基金合同约定,本基金建仓期为6个月。截至报告期末,本基金的各项投

4.1 基金经理 (或基金经理小组)简介

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期. Lists fund managers and their terms.

4.2 管理人对于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》、《基金管理人公平交易管理办法》等法律法规和公司内控制度,制定了《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未超过该证券当日成交量的5%。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析
海外方面,四季度发达国家经济继续改善态势,其中欧元区表现较为强劲,美国国内生产总值同比增长1.9%,12月消费者信心指数上升,均反映了经济企稳复苏的态势。欧洲经济在贸易出口带动下持续改善,美元指数呈现

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 3 columns: 序号, 行业, 金额(元), 占基金总资产比例(%). Lists industry allocations and percentages.

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 3 columns: 代码, 行业名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Lists stock holdings by industry.

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

Table with 5 columns: 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(%). Lists top 10 stock holdings.

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 3 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Lists bond holdings by type.

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

Table with 5 columns: 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(%). Lists top 5 bond holdings.

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

Table with 3 columns: 序号, 名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Lists asset-backed securities.

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

Table with 3 columns: 序号, 贵金属名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Lists precious metal investments.

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

Table with 3 columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Lists warrant investments.

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有股指期货投资,也无期间损益。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策
本报告期末,本基金未运用国债期货进行投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

工银瑞信中高等级信用债债券型证券投资基金

2017年第四季度报告

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:二〇一八年一月二十日

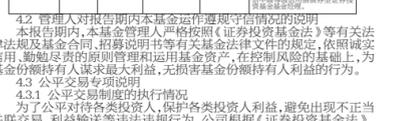
Table with 2 columns: 基金概况, 基金投资组合. Includes fund name, manager, and asset allocation details.

3.1 主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期: 2017年10月1日至2017年12月31日. Lists financial metrics like net assets and income.

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。

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



注:1、本基金合同于2015年12月2日生效。
2、按基金合同约定,本基金建仓期为6个月。截至报告期末,本基金的各项投

4.1 基金经理 (或基金经理小组)简介

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期. Lists fund managers and their terms.

4.2 管理人对于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》、《基金管理人公平交易管理办法》等法律法规和公司内控制度,制定了《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未超过该证券当日成交量的5%。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析
国内方面,2017年四季度经济保持平稳增长,进出口增速较快增长;消费需求增长保持强劲;投资增速稳中趋缓,固定资产投资资金来源有所改善;企业利润增长保持良好态势;PMI指数总体向好;信贷投放保持稳健,对实体经济支持力度增强。物价形势总体较为稳定,CPI同比有所回升,但未来仍然面临一定下行压力,不具备持续上行的基础;PPI受基数影响,同比有所回落,央行的货币政策保持中性;货币政策,在多个领域加强了风险防范和防范,协同有关部门出台了若干监管新规。这些规范性的规定对金融机构的行为起到了较为明显的约束作用。四季度的银行间流动性总体适度,同时存在着结构性不平衡的状况。资金利率有一定幅度上行。四季度全球经济继续复苏态势,经济持续扩张,通胀总体温和。

4.5 报告期末基金资产组合情况

Table with 3 columns: 序号, 行业, 金额(元), 占基金总资产比例(%). Lists industry allocations and percentages.

5.1 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 3 columns: 代码, 行业名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Lists stock holdings by industry.

5.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

Table with 3 columns: 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(%). Lists Hong Kong stock holdings.

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

Table with 5 columns: 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(%). Lists top 10 stock holdings.

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 3 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Lists bond holdings by type.

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

Table with 5 columns: 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(%). Lists top 5 bond holdings.

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

Table with 3 columns: 序号, 名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Lists asset-backed securities.

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

Table with 3 columns: 序号, 贵金属名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Lists precious metal investments.

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

Table with 3 columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Lists warrant investments.

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有股指期货投资,也无期间损益。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策
本报告期末,本基金未运用国债期货进行投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的投资决策程序说明:

本报告期,本基金持仓中证券,其发行主体(以下简称“该公司”)在度(上海)贸易有限公司从事证券业务期间连续不足半年的情况下,为其提供融资融券服务,涉嫌违反《证券公司融资融券业务管理办法》第十一条的规定,构成《证券公司监督管理条例》第八十四条第(七)项“未按照规定与客户签订业务合同”的行为。中国证监会决定对该公司予以警告,没收违法所得,并处以罚款。

该公因为不符合合同约定的投资者资产门槛系统合格投资者资格,且未如实上报资产证明,全国中小企业股份转让系统对该公采取责令改正的自律监管措施。
该公在定向发行过程中未经审批同意擅自发布宣传推介材料,宣传推介材料内容与实际不符,违反了《关于加强对证券经纪业务采取定向发行、第二、第三、第四、第五、第六、第七、第八、第九、第十、第十一、第十二、第十三、第十四、第十五、第十六、第十七、第十八、第十九、第二十、第二十一、第二十二、第二十三、第二十四、第二十五、第二十六、第二十七、第二十八、第二十九、第三十、第三十一、第三十二、第三十三、第三十四、第三十五、第三十六、第三十七、第三十八、第三十九、第四十、第四十一、第四十二、第四十三、第四十四、第四十五、第四十六、第四十七、第四十八、第四十九、第五十、第五十一、第五十二、第五十三、第五十四、第五十五、第五十六、第五十七、第五十八、第五十九、第六十、第六十一、第六十二、第六十三、第六十四、第六十五、第六十六、第六十七、第六十八、第六十九、第七十、第七十一、第七十二、第七十三、第七十四、第七十五、第七十六、第七十七、第七十八、第七十九、第八十、第八十一、第八十二、第八十三、第八十四、第八十五、第八十六、第八十七、第八十八、第八十九、第九十、第九十一、第九十二、第九十三、第九十四、第九十五、第九十六、第九十七、第九十八、第九十九、第一百条》的规定,深圳证券交易所对该公予以警告,并处以罚款。

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元). Lists top 10 stock holdings.

5.11.2 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.6 开放式基金份额变动

Table with 2 columns: 基金份额变动, 单位:份. Lists fund share changes.

注:1、本报告期间内基金总申购份额含红利再投、转换入份额;
2、本报告期间内基金总赎回份额含转换转出份额;

5.7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
本基金本报告期基金管理人未有运用固有资金投资本基金的情况。

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 备查文件目录

1、中国证监会准予工银瑞信新蓝筹股票型证券投资基金募集申请的注册文件;
2、《工银瑞信新蓝筹股票型证券投资基金基金合同》;

3、《工银瑞信新蓝筹股票型证券投资基金托管协议》;
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及托管人披露的各项公告;
9.2 存放地点
基金管理人或基金托管人的住所。
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。

5.11.2 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。

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元). Lists top 10 stock holdings.

5.11.3 其他资产构成

Table with 2 columns: 项目, 金额(元). Lists other assets.

注:1、本报告期间内基金总申购份额含红利再投、转换入份额;
2、本报告期间内基金总赎回份额含转换转出份额;

5.7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
本基金本报告期基金管理人未有运用固有资金投资本基金的情况。

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 备查文件目录

1、中国证监会准予工银瑞信丰收回报灵活配置混合型证券投资基金募集申请的注册文件;
2、《工银瑞信丰收回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

3、《工银瑞信丰收回报灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;
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及托管人披露的各项公告;
9.2 存放地点
基金管理人或基金托管人的住所。
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。

5.11.2 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。

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元). Lists top 10 stock holdings.

5.11.3 其他资产构成

Table with 2 columns: 项目, 金额(元). Lists other assets.

注:1、本报告期间内基金总申购份额含红利再投、转换入份额;
2、本报告期间内基金总赎回份额含转换转出份额;

5.7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
本基金本报告期基金管理人未有运用固有资金投资本基金的情况。

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 备查文件目录

1、中国证监会准予工银瑞信中高等级信用债债券型证券投资基金募集申请的注册文件;
2、《工银瑞信中高等级信用债债券型证券投资基金基金合同》;

3、《工银瑞信中高等级信用债债券型证券投资基金托管协议》;
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及托管人披露的各项公告;
9.2 存放地点
基金管理人或基金托管人的住所。
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。