

# 工银瑞信高端制造行业股票型证券投资基金 2016 年第 4 季度报告

2016 年 12 月 31 日

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：二〇一七年一月二十一日

## §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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 1 月 19 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 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	工银高端制造股票
交易代码	000793
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
报告期末基金份额总额	1,767,946,155.23 份
投资目标	通过系统、深入、全面的挖掘符合高技术、高附加值且具有长期发展潜力和估值优势的高端制造行业上市公司股票，实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金的类别资产配置策略主要是通过对宏观经济周期运行规律的研究，基于定量与定性相结合的宏观及市场分析，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例，从而在一定程度上规避系统性风险。
业绩比较基准	85%×中证中游指数收益率+15%×中债综合指数收益率。
风险收益特征	本基金是股票型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金、债券型基金与混合型基金，属于风险水平较高的基金。本基金主要投资于高端制造行业股票，其风险高于全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10月1日—2016年12月31日）
1. 本期已实现收益	86,092,122.25
2. 本期利润	84,086,834.42
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0450
4. 期末基金资产净值	1,830,605,622.82
5. 期末基金份额净值	1.035

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。

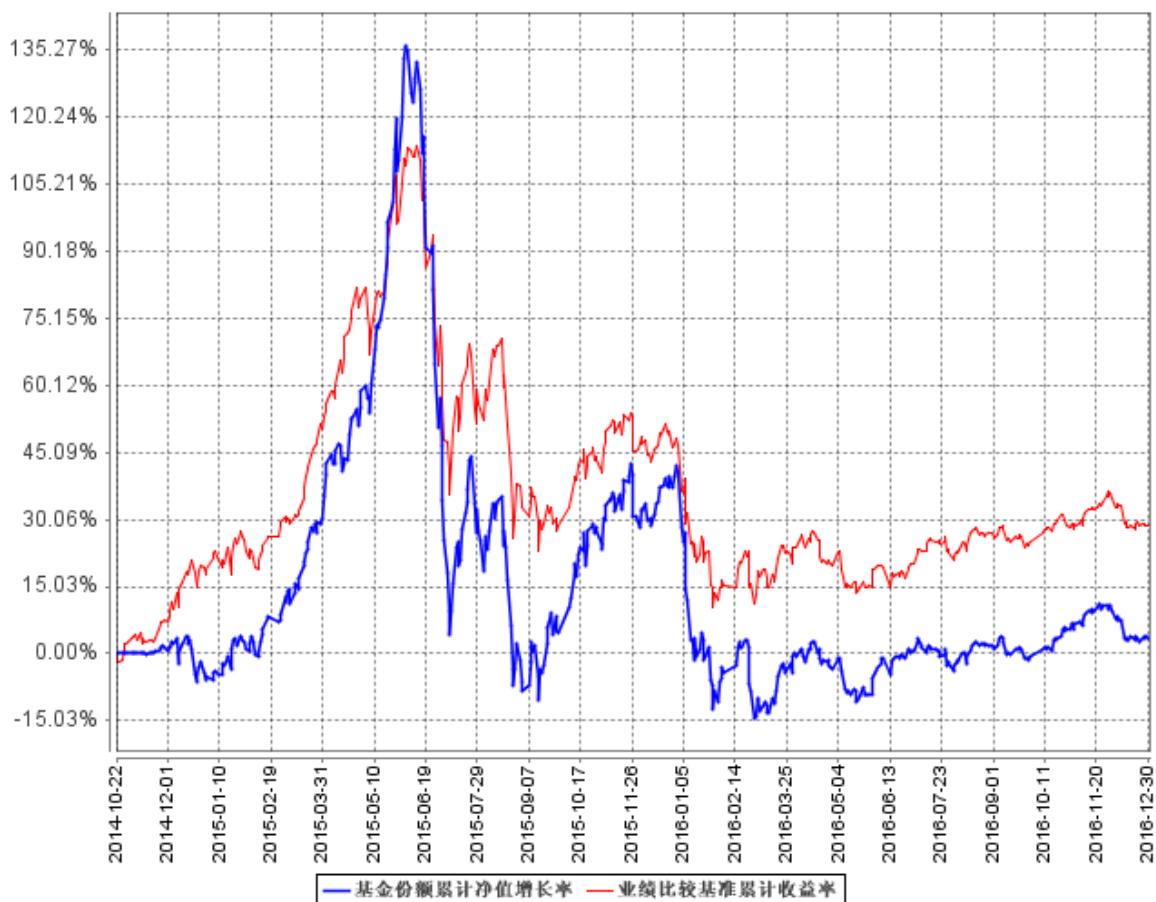
#### 3.2 基金净值表现

##### 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

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	4.02%	0.89%	2.84%	0.78%	1.18%	0.11%

### 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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2014 年 10 月 22 日生效。

2、按基金合同规定，本基金建仓期为 6 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：股票投资占基金资产的比例为 80%-95%。其中，本基金投资于本基金界定的高端制造行业股票资产占非现金基金资产的比例不低于 80%。任何交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 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		

黄安乐	权益投资部总监，本基金的基金经理	2014 年 10 月 22 日	-	14	先后在天相投资顾问有限公司担任研究员，国信证券经济研究所担任资深分析师，国信证券资产管理总部担任投资经理、研究员；2010 年加入工银瑞信，现任权益投资部总监。2011 年 11 月 23 日至今，担任工银瑞信主题策略混合型证券投资基金基金经理；2013 年 9 月 23 日至今，担任工银瑞信精选平衡基金基金经理；2014 年 10 月 22 日至今，担任工银高端制造行业股票型基金基金经理；2015 年 4 月 28 日至今，担任工银新材料新能源行业股票型基金基金经理；2016 年 1 月 29 日至今，担任工银瑞信国家战略主题股票型基金基金经理。
修世宇	本基金的基金经理	2014 年 10 月 22 日	-	10	清华大学会计学专业博士；先后在工银瑞信基金管理有限公司担任研究员，在民生人寿保险股份有限公司担任分析师；2012 年加入工银瑞信，现任高级研究员、基金经理。2014 年 10 月 22 日至今，担任工银高端制造行业股票型基金基金经理。
刘柯	本基金的基金经理	2014 年 11 月 18 日	-	9	先后在中投证券担任投行部 IPO 助理，在中材国际担任投资事务经理；2011 年加入工银瑞信，现任高级

					研究员、基金经理，2014 年 11 月 18 日至今，担任工银高端制造行业股票型基金基金经理；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合规守信情况的说明

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

2016 年四季度，A 股市场整体指数仍维持震荡格局，风格仍偏向价值蓝筹，以“一路一带”为代表的建筑板块在人民币持续贬值的背景下，四季度取得了不错的表现；成长股整体表现仍相对低迷。该基金在四季度的操作上，增配了建筑板块和军工板块，提高了组合的弹性，在单个

四季度取得了一定的收益，但由于年初熔断期间跌幅较大，全年整体业绩表现欠佳。

#### 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 4.02%，业绩比较基准收益率为 2.84%。

#### 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	1,689,048,875.96	91.71
	其中：股票	1,689,048,875.96	91.71
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	150,440,035.96	8.17
8	其他资产	2,322,313.36	0.13
9	合计	1,841,811,225.28	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	10,248,895.20	0.56
B	采矿业	-	-
C	制造业	884,790,158.83	48.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	536,775.29	0.03
E	建筑业	207,156,785.24	11.32
F	批发和零售业	2,010,730.36	0.11

G	交通运输、仓储和邮政业	29,442,579.58	1.61
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	245,583,793.00	13.42
J	金融业	103,486,631.76	5.65
K	房地产业	6,482,949.86	0.35
L	租赁和商务服务业	16,690.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	163,974,924.00	8.96
N	水利、环境和公共设施管理业	1,451,631.40	0.08
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	522,466.00	0.03
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	29,383,236.56	1.61
S	综合	3,960,628.88	0.22
	合计	1,689,048,875.96	92.27

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	300005	探路者	11,951,235	196,119,766.35	10.71
2	002659	中泰桥梁	7,815,363	180,378,578.04	9.85
3	603126	中材节能	13,664,577	163,974,924.00	8.96
4	002421	达实智能	24,765,618	162,957,766.44	8.90
5	603678	火炬电子	2,099,061	158,793,964.65	8.67
6	002383	合众思壮	1,735,774	85,920,813.00	4.69
7	002202	金风科技	2,955,175	50,563,044.25	2.76
8	300059	东方财富	2,482,500	42,028,725.00	2.30
9	600590	泰豪科技	2,149,848	40,245,154.56	2.20
10	300033	同花顺	550,900	37,890,902.00	2.07

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 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

本基金本报告期末未持有债券。



## 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。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期内，本基金未运用股指期货进行投资。

## 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

本报告期内，本基金未运用国债期货进行投资。

### 5.10.2 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。

### 5.10.3 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。

## 5.11 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、处罚的投资决策程序说明：

同花顺：

违规行为：

中国证券监督管理委员会认为：公司开发具有开立证券交易子账户、接受证券交易委托、查询证券交易信息、进行证券和资金的交易结算清算等多种证券业务属性功能的系统。通过该系统，投资者不履行实名开户程序即可进行证券交易。公司在明知客户的经营方式的情况下，仍向不具有经营证券业务资质的客户销售系统、提供相关服务。公司的上述行为违反了《证券法》第一百

二十二条的规定，构成《证券法》第一百九十七条所述非法经营证券业务的行为。

处分类型：

依据《证券法》第一百九十七条的规定，中国证监会拟决定对公司依法作出如下行政处罚：没收公司违法所得 2176997.22 元，并处以 6530991.66 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。

### 5.11.2 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。

#### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	2,087,391.81
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	37,047.84
5	应收申购款	197,873.71
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,322,313.36

#### 5.11.4 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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300005	探路者	196,119,766.35	10.71	重大事项
2	002659	中泰桥梁	180,378,578.04	9.85	重大事项

#### 5.11.6 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	1,931,467,508.53
报告期期间基金总申购份额	52,032,350.51
减：报告期期间基金总赎回份额	215,553,703.81
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	1,767,946,155.23

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情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	33,034,076.39
报告期期间买入/申购总份额	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	33,034,076.39
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	1.87

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额；

报告期期间基金总赎回份额含转换出份额。

### 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 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高端制造行业股票型证券投资基金募集申请的注册文件；
- 2、《工银瑞信高端制造行业股票型证券投资基金基金合同》；

- 3、《工银瑞信高端制造行业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。