

# 工银瑞信信息产业股票型证券投资基金 2014年第1季度报告

2014年3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：二〇一四年四月二十一日

## § 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 2014 年 4 月 16 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 2014 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

|            |  |
|------------|--|
| 基金简称       | 工银信息产业股票   |
| 交易代码       | 000263   |
| 基金运作方式     | 契约型开放式   |
| 基金合同生效日    | 2013 年 11 月 7 日  |
| 报告期末基金份额总额 | 188,480,035.29 份   |
| 投资目标       | 分析信息产业的变化趋势和新技术的发展方向，前瞻性地把握信息产业内通过研发不断创造出新的市场需求，并通过选择具有领先优势、创新能力及成长潜力良好的上市公司进行投资，在控制投资风险的同时，力争通过主动管理实现超越业绩基准的收益。 |
| 投资策略       | 本基金的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，规避系统性风险。                            |
| 业绩比较基准     | 80%×中证 TMT 产业主题指数收益率+20%×上证国债指数收益率   |
| 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。本基金主要投资于信息产业股票，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（2014年1月1日—2014年3月31日） |
|-----------------|---------------------------|
| 1. 本期已实现收益      | 12,602,409.73             |
| 2. 本期利润         | 5,878,834.01              |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0380                    |
| 4. 期末基金资产净值     | 202,983,397.85            |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.077                     |

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 2014 年 3 月 31 日。

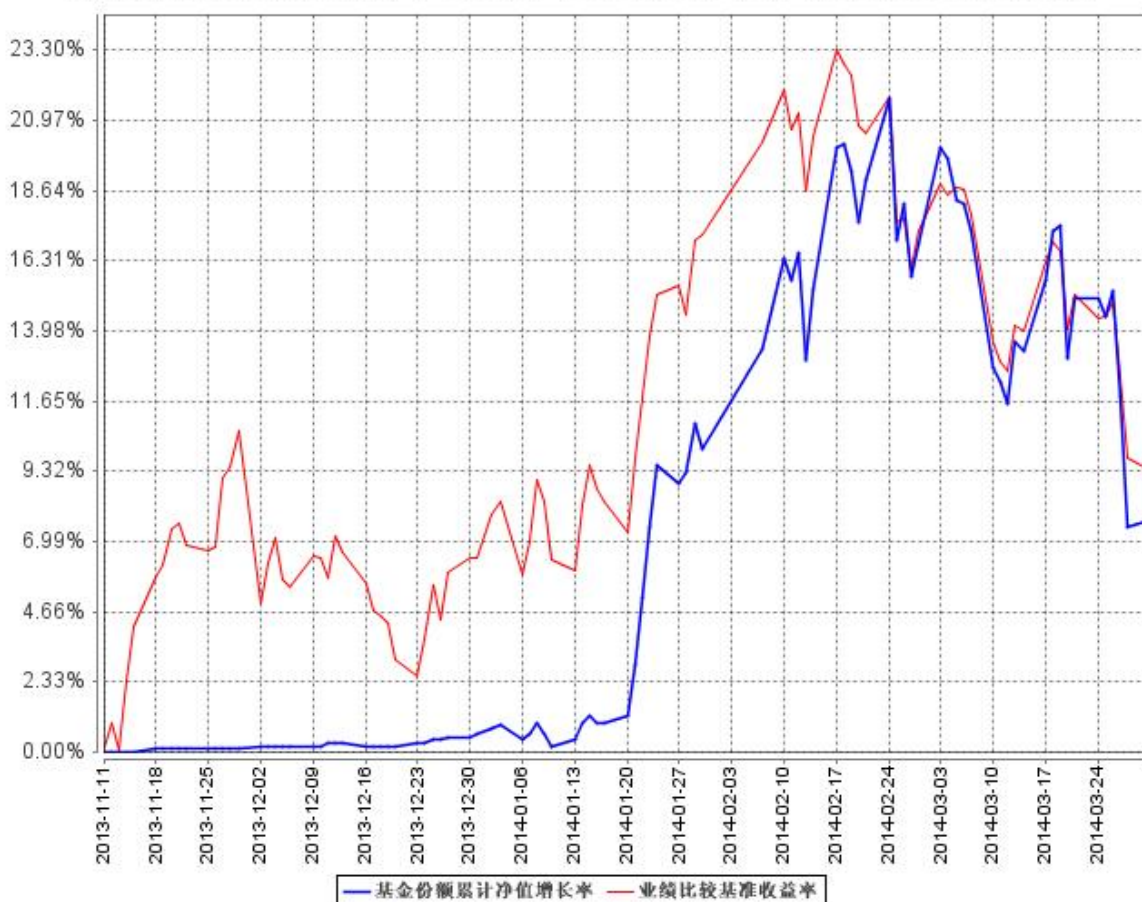
#### 3.2 基金净值表现

##### 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

| 阶段    | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基准<br>收益率标准差<br>④ | ①—③   | ②—④   |
|-------|------------|---------------|----------------|-----------------------|-------|-------|
| 过去三个月 | 7.06%      | 1.75%         | 2.70%          | 1.46%                 | 4.36% | 0.29% |

### 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 2013 年 11 月 11 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应符合基金合同关于投资范围及投资限制的规定：股票资产占基金资产的比例不低于 60%，债券等固定收益类资产占基金资产的比例为 5%-40%。其中，本基金投资于基金合同界定的信息产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 | 职务 | 任本基金的基 | 证券从 | 说明 |
|---|----|--------|-----|----|
|---|----|--------|-----|----|

| 名   |                   | 金经理期限       |      | 业年限 |  |
|-----|-------------------|-------------|------|-----|--|
|     |                   | 任职日期        | 离任日期 |     |  |
| 刘天任 | 本基金的基金经理          | 2013年11月11日 | -    | 6   | 曾任埃森哲咨询公司资深分析员。2008 年加入工银瑞信，曾任研究部高级研究员。2013 年 11 月 11 日至今，担任工银瑞信信息产业股票型基金基金经理。   |
| 曹冠业 | 权益投资部总监，本基金的基金经理。 | 2013年11月11日 | -    | 13  | CFA、FRM；先后在东方汇理担任结构基金和亚太股票基金经理，香港恒生投资管理公司担任香港中国股票和 QFII 基金投资经理；<br>2007 年加入工银瑞信，现任权益投资部总监，兼任工银瑞信资产管理（国际）有限公司权益投资总监；2007 年 11 月 29 日至 2009 年 5 月 17 日，担任工银核心价值基金基金经理；2008 年 2 月 14 日至 2009 年 12 月 25 日，担任工银全球基金基金经理；2009 年 5 月 18 日至今，担任工银成长基金基金经理；2011 年 10 月 24 日至今，担任工银主题策略股票基金基金经理；2013 年 9 月 23 日至今担任工银瑞信中国机会全球配置基金基金经理；2013 年 11 月 11 日至今担任工银瑞信信息产业股票型基金基金经理。 |

## 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，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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2014 年一季度，上证指数呈现窄幅波动的走势，创业板指数则是先高后低大幅震荡，3 月出现了一定程度的风格切换，大盘蓝筹表现较好而创业板整体回落较大，回吐了 1-2 月以来的大部分涨幅。

目前来看，我们认为，大盘蓝筹等价值股的走强目前只能定义为估值修复下的超跌反弹，经济下行已成定局，而宏观面的巨大不确定性导致相关传统行业和个股的业绩具有较大的不确定性，需要时间来逐步验证。反之新兴产业为代表的创业板指数经过了大幅下跌后部分行业和个股具备了较强的投资价值。而从目前掌握的一季报业绩预告情况看，创业板公司的整体增速季度环比出现了加速。因此我们仍然坚持重点配置受益于我国经济长期转型的创新型产业和国家政策鼓励的新兴产业，比较看好的领域主要包括智慧城市，信息安全，移动互联网，医疗服务，互联网金融，新能源汽车等。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值增长率为 7.06%，业绩比较基准收益率为 2.7%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济的前景依然不乐观，目前市场普遍预期 2014 年 GDP 维持在 7.5% 左右的增长，CPI 在 2.5% 左右，流动性适度，而利率水平仍较高。总体而言，宏观经济层面对股票市场的影响偏于负面。

从证券市场看，IPO 重启增加了供给，也可能导致中小股票的估值收敛，同时还会分流资金，这对存量的市场而言，带来了下跌的压力；同时存量市场中的高估值的中小盘股票因业绩达不到预期有调整的要求；大盘股则因为业绩增长受到制约，要大幅提升估值有一定的难度，但同时必须注意到管理层对股市的长期低迷相当重视，相关活跃大盘蓝筹的各项措施正在筹备之中。综上所述，我们预期股票市场仍将维持宽幅震荡的走势。

从行业选择的角度分析，我们认为，经过三月份的大幅调整，有较高业绩增长且估值合理的成长类行业会有相对收益，智慧城市，信息安全，移动互联网，医疗服务，互联网金融，新能源汽车等，存在较大的投资机会。

## § 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              | 162,868,809.04 | 78.78        |
|    | 其中：股票             | 162,868,809.04 | 78.78        |
| 2  | 固定收益投资            | -              | -            |
|    | 其中：债券             | -              | -            |
|    | 资产支持证券            | -              | -            |
| 3  | 贵金属投资             | -              | -            |
| 4  | 金融衍生品投资           | -              | -            |
| 5  | 买入返售金融资产          | -              | -            |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -              | -            |
| 6  | 银行存款和结算备付金合计      | 36,130,651.18  | 17.48        |
| 7  | 其他资产              | 7,735,873.08   | 3.74         |
| 8  | 合计                | 206,735,333.30 | 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

| 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         | -             | -            |
| B  | 采矿业              | -             | -            |
| C  | 制造业              | 66,344,997.56 | 32.68        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 10,874,061.00 | 5.36         |
| E  | 建筑业              | -             | -            |
| F  | 批发和零售业           | 5,083,287.00  | 2.50         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 3,369,448.91  | 1.66         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 75,074,667.53 | 36.99        |
| J  | 金融业              | -             | -            |
| K  | 房地产业             | -             | -            |
| L  | 租赁和商务服务业         | 1,015,380.00  | 0.50         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | -             | -            |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 458,500.00    | 0.23         |
| 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 | 648,467.04     | 0.32  |
| S | 综合        | -              | -     |
|   | 合计        | 162,868,809.04 | 80.24 |

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。

### 5.3 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  | 300287 | 飞利信  | 190,850 | 11,069,300.00 | 5.45         |
| 2  | 002373 | 联信永益 | 716,855 | 10,967,881.50 | 5.40         |
| 3  | 000712 | 锦龙股份 | 405,900 | 10,874,061.00 | 5.36         |
| 4  | 300065 | 海兰信  | 512,112 | 9,689,159.04  | 4.77         |
| 5  | 300369 | 绿盟科技 | 105,169 | 8,844,712.90  | 4.36         |
| 6  | 300059 | 东方财富 | 492,000 | 8,649,360.00  | 4.26         |
| 7  | 300170 | 汉得信息 | 421,676 | 8,560,022.80  | 4.22         |
| 8  | 300379 | 东方通  | 156,178 | 8,472,656.50  | 4.17         |
| 9  | 600776 | 东方通信 | 731,200 | 8,408,800.00  | 4.14         |
| 10 | 002551 | 尚荣医疗 | 220,817 | 8,053,195.99  | 3.97         |

### 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投资。

### 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受到公开谴责、处罚的投资决策程序说明

2013 年 1 月 30 日，海兰信对外披露了 2012 年度业绩预告，预计 2012 年度净利润为 24.51 万元~490.22 万元，同比下降 80%~99%。2013 年 2 月 28 日，公司披露业绩快报，显示 2012 年净利润为亏损 1288.81 万元。2013 年 4 月 19 日，公司披露 2012 年年报，实际亏损 1329.68 万元。公司 2012 年业绩预告披露的业绩与实际业绩差异较大，且盈亏性质发生了变化。

公司的上述行为违反了深圳证券交易所《创业板股票上市规则（2012 年修订）》第 2.1 条、第 11.3.1 条、第 11.3.4 条的规定。给与公开批评处分。

上述事项对公司的生产经营活动基本无影响。

### 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   | 138,412.89   |
| 2  | 应收证券清算款 | 6,903,104.54 |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 9,446.28     |
| 5  | 应收申购款   | 684,909.37   |

|   |       |              |
|---|-------|--------------|
| 6 | 其他应收款 | -            |
| 7 | 待摊费用  | -            |
| 8 | 其他    | -            |
| 9 | 合计    | 7,735,873.08 |

#### 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  | 000712 | 锦龙股份 | 10,874,061.00  | 5.36         | 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               | 156,860,820.07 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 172,898,133.11 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 141,278,917.89 |
| 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               | 188,480,035.29 |

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

本基金的管理人在本报告期内运用固有资金投资本基金情况未有变化。

## § 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、中国证监会批准工银瑞信信息产业股票型证券投资基金设立的文件；
- 2、《工银瑞信信息产业股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《工银瑞信信息产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和营业执照；
- 5、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 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。