

(上接B087版)

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票简称, 行业, 营业收入(万元), 净利润(万元). Lists various companies and their financial data.

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票简称, 行业, 营业收入(万元), 净利润(万元). Continuation of company list.

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票简称, 行业, 营业收入(万元), 净利润(万元). Continuation of company list.

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票简称, 行业, 营业收入(万元), 净利润(万元). Continuation of company list.

注: 1. 卖出主要指二级市场主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票; 2. 卖金额按卖出成交金额(成交单价乘以成交量)填列, 不考虑相关交易费用。

1.1.1 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位: 人民币元

Table with columns: 报告期, 买入股票成本总额, 卖出股票收入总额. Shows financial data for the reporting period.

注: 买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额(成交单价乘以成交量)填列, 不考虑相关交易费用。

1.2 期末按债券品种和分类的债券投资组合

本基金本报告期末持有债券。

1.3 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

本基金本报告期末持有债券。

1.4 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

本基金本报告期末持有资产支持证券。

1.5 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贵金属投资明细

本基金本报告期末持有贵金属。

1.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末持有权证。

1.7 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

1.7.1 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。

1.7.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期未投资股指期货。

1.8 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

1.8.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期未投资国债期货。

1.8.2 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。

1.8.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期未投资国债期货。

1.9 投资组合报告附注

1.9.1 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。

1.9.2 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。

1.9.3 期末其他各项资产构成

单位: 人民币元

Table with columns: 序号, 资产名称, 金额. Shows the composition of other assets at the end of the period.

1.9.4 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。

1.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位: 人民币元

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 流通受限的股票公允价值, 占基金资产净值比例, 流通受限原因. Shows details of restricted stocks.

1.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

单位: 份

Table with columns: 持有人户数(户), 户内持有基金份额, 机构投资者, 个人投资者. Shows the distribution of fund shares among holders.

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

Table with columns: 姓名, 持有基金份额(份), 占基金总份额比例. Shows if fund managers hold shares.

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金开放式基金份额总量的情况

Table with columns: 姓名, 持有基金份额(份), 占基金总份额比例. Shows the percentage of open-end fund shares held by staff.

§ 9 开放式基金份额变动

单位: 份

Table with columns: 项目, 基金份额. Shows the change in open-end fund shares.

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。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内, 本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内, 本基金未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内, 本基金未发生基金投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内, 本基金未发生会计师事务所变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内, 基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资和债券支付情况

金额单位: 人民币元

Table with columns: 序号, 券商名称, 交易金额, 占基金总资产比例, 佣金, 占基金总资产比例, 备注. Shows the use of brokerage units for stock and bond trading.

注: 1. 券商的选择标准和程序 (1) 选择标准: 注重综合服务实力 a) 券商财务状况良好, 经营行为规范, 风险管理先进, 投资风格与工银瑞信有互补性, 在最近一年内无重大违规行为。 b) 券商具有较雄厚的研究能力; 能及时、全面、定期提供高质量的关于宏观、行业、资本市场、个股分析的报告及其他丰富全面的信息咨询服务; 有很强的分析能力, 能提供准确、及时的市场信息; 能根据工银瑞信所管理基金的特定要求, 提供有针对性的研究报告; 具有开发量化投资组合模型的能力以及其他综合服务能力。 c) 与其他券商相比, 该券商能够提供最佳交易执行和优惠合理的佣金率。 (2) 选择程序 a) 确定券商名单: 根据以上标准对不同券商进行考察、选择和确定。投资研究部门(权益投资部、固定收益部、专户投资部、机构部和中央交易室)根据本基金规模和市场需求等因素确定合作券商的数量, 每年根据公司经营规模变化和券商评估结果决定是否需要新增或调整合作券商, 选定的名单经基金投资部总经理审批同意。 b) 签订委托协议: 与被选择的券商签订委托代理协议, 明确委托协议双方的公司名称、委托代理期限、佣金率、双方的权利和义务等, 经签署有效。委托代理协议一式五份, 协议双方及证券监管机构各留存一份, 工银瑞信法律合规部留存备案, 并报相关证券监管机构留存备案。 2. 券商的评估、保留和替换程序 (1) 岗位的租用期限固定为一年, 合同到期15日内, 投资研究部门将根据各券商在服务期间的综合服务绩效等情况, 进行评估。 (2) 对于符合标准的券商, 工银瑞信将与该券商续约; 对于不能达到标准的券商, 不与其续约, 并根据券商选择标准和程序, 重新选择其他已经稳健、研究能力强、综合服务绩效高的证券经营机构, 租用其交易席位。 (3) 若券商提供的综合证券服务不符合要求, 工银瑞信有权按照委托协议提前中止租用其交易席位。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位: 人民币元

Table with columns: 券商名称, 成交金额, 占基金总资产比例, 佣金, 占基金总资产比例. Shows the use of brokerage units for other securities.

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

Table with columns: 事项名称, 涉及金额, 占基金总资产比例, 备注. Shows other important information affecting investor decisions.

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票简称, 行业, 营业收入(万元), 净利润(万元). Continuation of company list.