工银瑞信聚焦30股票型证券投资基金

2018年第三季度报告

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一八年十月二十五日

§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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年10月23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2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	工银聚焦30股票
交易代码	001496
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年6月25日
报告期末基金份额总额	307,358,276.08份
投资目标	本基金通过持续、系统、深入、全面的基本面研究精选个股，在科学的风险管理体系下，集中投资于具有长期发展潜力和估值优势的上市公司股票，实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势,将科学、系统、规范的行业研究及选股方法与积极主动的投资风格相结合，采用自下而上精选个股并集中投资的策略，同时辅以自上而下资产配置和行业配置策略,在有效控制风险的前提下，实现超越业绩基准的收益。
业绩比较基准	80%×中证800指数收益率+20%×中债综合财富指数收益率。
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。
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

§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(2018年7月1日 – 2018年9月30日)
1.本期已实现收益	–9,239,207.20
2.本期利润	–5,431,771.07
3.加权平均基金份额本期利润	–0.0162
4.期末基金资产净值	199,482,570.04
5.期末基金份额净值	0.649

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。

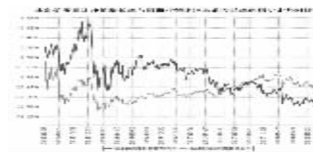
3、所列数据截止到报告期最后一日,无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

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	–2.26%	1.22%	–2.47%	1.05%	0.21%	0.17%

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



注:1、本基金基金合同于2015年6月25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:股票资产占基金资产的比例为80%–95%。其中投资于基金持仓比例最高的前30只股票的资产不低于非现金基金资产的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%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

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		
王筱苓	权益投资部副总监,本基金的基金经理	2018年1月23日	–	21	曾任中国银行全球金融市场部首席交易员;2005年加入工银瑞信,曾任工银核心价值混合基金、工银精选平衡混合型基金、工银稳健成长混合基金基金经理、专户投资部专户投资经理,现任权益投资部副总监,2011年10月11日至2017年7月19日,担任工银瑞信中小盘成长混合型证券投资基金基金经理;2012年12月5日至今,担任工银瑞信大盘蓝筹混合型证券投资基金基金经理;2014年6月26日至2017年8月8日,担任工银瑞信绝对收益混合型基金基金经理;2014年12月30日至今,担任工银瑞信消费服务行业混合型证券投资基金基金经理;2015年8月6日至今,担任工银瑞信新蓝筹股票型基金基金经理;2016年4月20日至2017年8月8日,担任工银瑞信沪港深股票型证券投资基金基金经理;2016年10月27日至今,担任工银瑞信现代服务业灵活配置混合型证券投资基金基金经理;2018年1月23日至今,担任工银瑞信聚焦30股票型证券投资基金基金经理。

4.2 管理人对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

2018年3季度沪深300指数下跌约2%,创业板指下跌约12%。主要指数均告下跌。分行业来看,中信一级行业指数中,银行、非银行金融、石油石化等行业涨幅较大,家电、纺织服装、电子元器件等行业跌幅居前。从风格上看,低市盈率、低市净率指数跌幅较少,新股、高市盈率、高市净率指数跌幅较大。市场风格偏向价值。

本基金在3季度基本维持了上半年的配置,行业上没有大调整,持仓以银行、电力、食品饮料、非银行金融等行业为主。

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–2.26%,业绩比较基准收益率为–2.47%。

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	173,746,086.04	80.10
	其中:股票	173,746,086.04	80.10
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	43,084,525.04	19.86
8	其他资产	67,466.22	0.03
9	合计	216,898,077.30	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

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	–	–
B	采矿业	6,242,790.66	3.13
C	制造业	54,413,136.56	27.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	14,959,311.00	7.50
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	20,650,131.55	10.35
G	交通运输、仓储和邮政业	–	–
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,666,643.00	1.34
J	金融业	53,130,706.27	26.63
K	房地产业	14,895,500.00	7.47
L	租赁和商务服务业	5,231,097.00	2.62
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	1,556,770.00	0.78
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	–	–
S	综合	–	–
	合计	173,746,086.04	87.10

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港股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	002142	宁波银行	720,000	12,787,200.00	6.41
2	601939	建设银行	1,564,400	11,326,256.00	5.68
3	601318	中国平安	147,100	10,076,350.00	5.05
4	000895	双汇发展	371,900	9,725,185.00	4.88
5	601601	中国太保	267,492	9,498,640.92	4.76
6	002024	苏宁易购	638,400	8,605,632.00	4.31
7	002419	天虹股份	605,250	6,827,220.00	3.42
8	600519	贵州茅台	7,700	5,621,000.00	2.82
9	000338	潍柴动力	650,000	5,557,500.00	2.79
10	600011	华能国际	709,600	5,471,016.00	2.74

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。

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	51,354.31
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	8,384.49
5	应收申购款	7,727.42
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	67,466.22

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

无。

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	340,216,232.56
报告期期间基金总申购份额	1,888,146.40
减:报告期期间基金总赎回份额	34,746,102.88
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	307,358,276.08

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	25,939,040.21
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	25,939,040.21
报告期期末管理人持有的本基金份额	0.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.00

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

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	赎回	2018年8月28日	25,939,040.21	16,543,790.15	0.50%
合计			25,939,040.21	16,543,790.15	

§8 影响投资者决策的其他重要信息

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

无。

8.2 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聚焦30股票型证券投资基金募集申请的注册文件;

2、《工银瑞信聚焦30股票型证券投资基金基金合同》;

3、《工银瑞信聚焦30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。

工银瑞信美丽城镇主题股票型证券投资基金

2018年第三季度报告

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一八年十月二十五日

§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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年10月23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2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	工银美丽城镇股票
交易代码	001043
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年3月26日
报告期末基金份额总额	438,183,074.61份
投资目标	在全面推进新型城镇化发展的背景下，积极选择深度受益于此类主题的股票进行投资，并通过积极有效的风险防范措施，力争获取超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金将由投资研究团队及时跟踪市场环境变化，根据宏观经济运行态势、宏观经济政策变化、证券市场运行状况、国际市场变化情况等因素的深入研究，判断证券市场的发展趋势,结合行业状况、公司价值性和成长性分析,综合评价各类资产的风险收益水平。在充分的宏观形势判断和策略分析的基础上,采用动态调整策略,在市场上涨阶段中,适当增加权益类资产配置比例,在市场下行周期中,适当降低权益类资产配置比例，力求实现基金财产的长期稳定增值，从而有效拥有不同市场状况下基金资产的整体收益水平。
业绩比较基准	80%×沪深300指数收益率+20%×中债综合指数收益率。
风险收益特征	本基金为股票型基金，预期收益和风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§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(2018年7月1日 – 2018年9月30日)
1.本期已实现收益	–23,492,226.01
2.本期利润	–18,900,980.08
3.加权平均基金份额本期利润	–0.0428
4.期末基金资产净值	431,431,632.45
5.期末基金份额净值	0.985

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。

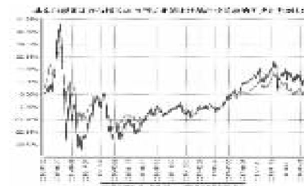
3、所列数据截止到报告期最后一日,无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

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	–4.09%	1.35%	–1.26%	1.09%	–2.83%	0.26%

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



注:1、本基金基金合同于2015年3月26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:股票占基金资产的比例为80%–95%,其中投资于本基金界定的美丽城镇主题范围内股票不低于非现金资产的80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值的5%的现金或到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

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		
王君正	研究部副总监,本基金的基金经理	2015年3月26日	–	10	曾任泰达宏利基金管理有限公司研究员;2011年加入工银瑞信,现任研究部副总监。2013年8月26日至今,担任工银瑞信金融地产行业混合型证券投资基金基金经理;2015年1月27日至2018年2月27日,担任工银国企改革主题股票型基金基金经理;2015年3月19日至2017年10月9日,担任工银瑞信新金融股票型基金基金经理;2015年3月26日至今,担任工银瑞信美丽城镇主题股票型基金基金经理;2015年5月22日至今,担任工银丰盈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

三季度经济数据略显乏力,工业增加值和固定资产投资数据均有所下滑。8月份,工业增加值增速6.1%,环比略有提升,但比二季度下滑明显。8月份固定资产投资增速5.3%,环比进一步下滑。8月社会消费品零售总额同比增速9%,基本持平。领先指标方面,9月份中国制造业物流与采购经理人指数(PMI)报50.8,显示企业信心有所减弱。通胀方面,8月居民消费价格总水平(CPI)同比增速2.3%,与前期持平,全国工业生产者出厂价格(PPI)同比增长4.1%,比前期进一步下滑。

流动性方面,8月份人民币贷款增加12800亿元,社融新增15215亿元,人民币贷款规模小幅下滑,社融规模有所上升。M2同比增速8.2%,M1同比增速3.9%,M2增速基本保持稳定,M1数据大幅下降。

股市方面,三季度,从指数表现看,各指数涨跌不一,其中上证综指下跌0.92%,沪深300指数下跌2.05%,深证成指收益率为–10.43%。从风格来看,代表大盘股的中证100指数和代表中盘指数的中证200回报分别为1.12%和–8.44%,中小板指和创业板指回报分别为–11.22%和–12.16%。分行业来看,银行、石油石化、非银金融表现排名前三,收益率分别为12.41%、11.60%和5.46%,家电、纺织服装、电子元器件回报列最后三位,分别为–17.34%、–15.34%和–14.91%。

操作方面,增持地产、银行、非银金融,减持家电、食品饮料、电子元器件。

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–4.09%,业绩比较基准收益率为–1.26%。

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	366,539,396.57	84.08
	其中:股票	366,539,396.57	84.08
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	132,399.00	0.03
	其中:债券	132,399.00	0.03
	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	68,136,622.62	15.63
8	其他资产	1,132,075.86	0.26
9	合计	435,940,494.05	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	1,230,229.00	0.29
B	采矿业	7,091,658.65	1.64
C	制造业	163,537,052.11	37.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	4,704,185.00	1.09
F	批发和零售业	3,683,184.67	0.85
G	交通运输、仓储和邮政业	3,132,036.29	0.73
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	482,040.00	0.11
J	金融业	97,567,213.62	22.61
K	房地产业	67,944,070.45	15.75
L	租赁和商务服务业	4,302,358.15	1.00
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	–	–
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	9,576,852.00	2.22
R	文化、体育和娱乐业	3,288,516.63	0.76
S	综合	–	–
	合计	366,539,396.57	84.96

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港股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	002142	宁波银行	1,593,367	28,298,197.92	6.56
2	601318	中国平安	355,478	24,350,243.00	5.64
3	601155	新城控股	891,660	23,352,575.40	5.41
4	600519	贵州茅台	27,990	20,432,700.00	4.74
5	600271	航天信息	668,014	18,590,829.62	4.31
6	000961	中南建设	2,741,775	16,944,169.50	3.93
7	600036	招商银行	467,509	14,347,851.21	3.33
8	300003	乐普医疗	371,064	11,261,792.40	2.61
9	601288	农业银行	2,472,890	9,619,542.10	2.23
10	002044	美年健康	512,400	8,828,652.00	2.05

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	–	–
2	央行票据	–	–
3	金融债券	–	–
	其中:政策性金融债	–	–
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债(可交换债)	132,399.00	0.03
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	132,399.00	0.03

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。

5.5 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

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(%)
1	113513	安井转债	1,110	122,177.70	0.03
2	128024	宁行转债	90	10,221.30	0.00

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:

1、招商银行

本报告期,本基金持有招商银行,其发行主体因内控管理严重违反审慎经营规则等违规行为,被中国银保监会处以罚款并没收违法所得。

上述情形对上市公司的财务和经营状况无重大影响,投资决策流程符合基金管理人的制度要求。

2、新城控股

本报告期,本基金持有新城控股,其发行主体因未及时履行信息披露义务,被中国证监会江苏监管局采取出具警示函的监管措施。

上述情形对上市公司的财务和经营状况无重大影响,投资决策流程符合基金管理人的制度要求。

3、中南建设

本报告期,本基金持有中南建设,其发行主体因未及时履行信息披露义务,被中国证监会江苏监管局采取出具警示函的监管措施。

上述情形对上市公司的财务和经营状况无重大影响,投资决策流程符合基金管理人的制度要求。

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	204,084.43
2	应收证券清算款	857,589.26
3	应收股利	–
4	应收利息	14,723.61
5	应收申购款	55,678.56
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	1,132,075.86

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	128024	宁行转债	10,221.30	0.00

注:上表包含期末持有的处于转股期的可转换债券和可交换债券明细。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

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	445,482,934.94
报告期期间基金总申购份额	4,202,993.49
减:报告期期间基金总赎回份额	11,502,853.82
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	438,183,074.61

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

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

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

无。

8.2 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美丽城镇主题股票型证券投资基金募集申请的注册文件;

2、《工银瑞信美丽城镇主题股票型证券投资基金基金合同》;

3、《工银瑞信美丽城镇主题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。

工银瑞信绝对收益策略混合型发起式证券投资基金

2018年第三季度报告

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一八年十月二十五日

§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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年10月23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2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	工银绝对收益混合发起	
交易代码	000667	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014年6月26日	
报告期末基金份额总额	128,050,025.24份	
投资目标	合理地灵活配置股票和债券等各类资产的比例，优选数量化投资策略进行投资,在有效控制风险的基础上,运用股指期货对冲市场波动风险，追求稳定的长期正投资回报。	
投资策略	本基金借助于数量化投研团队在模型计算、组合构建、风险管理的专业能力,相机使用组合Alpha对冲策略、个股Alpha策略、事件驱动策略等多个量化策略，通过合理匹配收益与风险水平构建投资组合。	
业绩比较基准	中国人民银行公布的一年期定期存款基准利率(税后)+3%(如遇中国人民银行就该等基准利率进行调整则作相应调整)。	
风险收益特征	本基金具有低波动率、低下方风险的特点,并且运用股指期货对冲投资组合的系统性风险，其预期收益及风险水平低于股票型基金,但高于债券型基金。	
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	工银绝对收益混合发起A	工银绝对收益混合发起B
下属分级基金的交易代码	000667	000672
报告期末下属分级基金的份额总额	95,753,103.36份	32,296,921.88份

§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(2018年7月1日 – 2018年9月30日)	
	工银绝对收益混合发起A	工银绝对收益混合发起B
1. 本期已实现收益	–551,559.09	–244,930.72
2. 本期利润	–388,663.70	–201,235.80
3. 加权平均基金份额本期利润	–0.0040	–0.0064
4. 期末基金资产净值	105,587,484.28	34,161,503.31
5. 期末基金份额净值	1.103	1.058

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

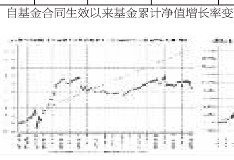
工银绝对收益混合发起A

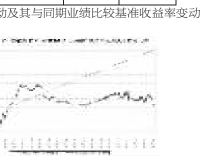
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①–③	②–④
过去三个月	–0.36%	0.22%	1.13%	0.01%	–1.49%	0.21%

工银绝对收益混合发起B

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	–0.56%	0.22%	1.13%	0.01%	–1.69%	0.21%

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





注:1、本基金基金合同于2014年6月26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:本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、权证、中央银行票据、中期票据、银行存款、债券回购、资产支持证券、股指期货,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定);本基金权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值的比例范围在80%—120%之间;每个交易日日终,持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的95%;在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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		
游凛峰	本基金的基金经理	2014年6月26日	–	22	斯坦福大学统计学专业博士;先后在Merrill Lynch Investment Managers担任美林集中基金和美林保本基金基金经理,Fore Research & Management担任Fore Equity Market Neutral组合基金经理,Jasper Asset Management担任Jasper Gemini Fund基金基金经理;2009年加入工银瑞信基金管理有限公司,现任权益投资部量化投资团队负责人;2009年12月25日至今,担任工银瑞信中国机会全球配置股票基金的基金经理;2010年5月25日至今,担任工银全球精选股票基金的基金经理;2012年4月26日至今担任工银瑞信基本面量化策略混合型证券投资基金基金经理;2014年6月26日至今,担任工银瑞信绝对收益混合型基金基金经理;2015年12月15日至2017年12月22日,担任工银瑞信新趋势灵活配置混合型基金基金经理;2016年3月9日至2017年10月9日,担任工银瑞信香港中小盘股票型基金基金经理;2016年10月10日至2018年2月23日,担任工银瑞信新焦点灵活配置混合型证券投资基金基金经理;2017年4月14日至今,担任工银瑞信新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金经理;2017年4月27日至今,担任工银瑞信新价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

4.2 管理人对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

三季度经济数据略显乏力,工业增加值和固定资产投资数据均有所下滑。8月份,工业增加值增速6.1%,环比略有提升,但比二季度下滑明显。8月份固定资产投资增速5.3%,环比进一步下滑。8月社会消费品零售总额同比增速9%,基本持平。领先指标方面,9月份中国制造业物流与采购经理人指数(PMI)报50.8,显示企业信心有所减弱。通胀方面,8月居民消费价格总水平(CPI)同比增速2.3%,与前期持平,全国工业生产者出厂价格(PPI)同比增长4.1%,比前期进一步下滑。

流动性方面,8月份人民币贷款增加12800亿元,社融新增15215亿元,人民币贷款规模小幅下滑,社融规模有所上升。M2同比增速8.2%,M1同比增速3.9%,M2增速基本保持稳定,M1数据大幅下降。

股市方面,三季度,从指数表现看,各指数涨跌不一,其中上证综指下跌0.92%,沪深300指数下跌2.05%,深证成指收益率为–10.43%。从风格来看,代表大盘股的中证100指数和代表中盘指数的中证200回报分别为1.12%和–8.44%,中小板指和创业板指回报分别为–11.22%和–12.16%。分行业来看,银行、石油石化、非银金融表现排名前三,收益率分别为12.41%、11.60%和5.46%,家电、纺织服装、电子元器件回报列最后三位,分别为–17.34%、–15.34%和–14.91%。

本基金受交易规则以及市场情绪的影响,股指期货与现货处于长期贴水状态,不利于进行对冲操作。本基金进行了积极的策略调整,一直保持低仓位来避免极端负基差对基金带来的影响,采用更为集中的策略并同时采用时间分散的策略来防范风险;投资期限不跨交割日以及长期Alpha并存的状态。闲置资金主要用于新股申购以及现金管理,积极参与可转债申购、协议存款、隔夜回购等稳健收益类标的。9月以来,由于市场风格的影响,受科技股大幅下跌的拖累,三季度净值增长为负。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内,工银绝对收益混合发起A份额净值增长率为–0.36%,工银绝对收益混合发起B份额净值增长率为–0.56%,业绩比较基准收益率为1.13%。

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	63,202,463.67	44.13
	其中:股票	63,202,463.67	44.13
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	27,328,652.00	19.08
	其中:债券	27,328,652.00	19.08
	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	22,300,000.00	15.57
	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	20,791,836.20	14.52
8	其他资产	9,603,326.43	6.71
9	合计	143,226,278.30	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

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	–	–
B	采矿业	–	–
C	制造业	43,073,503.96	30.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	544,446.00	0.39
E	建筑业	604,449.00	0.43
F	批发和零售业	1,143,784.00	0.82
G	交通运输、仓储和邮政业	539,352.00	0.39
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,820,730.00	2.02
J	金融业	7,080,800.00	5.07
K	房地产业	751,482.00	0.54
L	租赁和商务服务业	4,923,105.71	3.52
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	–	–
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	1,720,811.00	1.23
S	综合	–	–
	合计	63,202,463.67	45.23

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港股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	600887	伊利股份	216,755	5,566,268.40	3.98
2	300124	汇川技术	185,200	5,130,040.00	3.67
3	600519	贵州茅台	6,999	5,109,270.00	3.66
4	002027	分众传媒	564,121	4,800,669.71	3.44
5	600085	同仁堂	150,900	4,791,075.00	3.43
6	300661	圣邦股份	38,736	3,672,172.80	2.63
7	300373	扬杰科技	169,289	3,585,541.02	2.57
8	600741	华域汽车	139,538	3,139,605.00	2.25
9	002410	广联达	80,600	2,158,468.00	1.54
10	000895	双汇发展	80,969	2,117,339.35	1.52

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	–	–
2	央行票据	–	–
3	金融债券	7,486,652.00	5.36
	其中:政策性金融债	7,486,652.00	5.36
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债(可交换债)	–	–
8	同业存单	19,842,000.00	14.20
9	其他	–	–
10	合计	27,328,652.00	19.56

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。

5.5 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

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(%)
1	111818207	18华夏银行CD207	200,000	19,842,000.00	14.20
2	018005	国开1701	74,420	7,486,652.00	5.36

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

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IC1810	IC1810	–4	–3,842,400.00	2,960.00	–
IF1810	IF1810	–43	–44,368,260.00	–879,780.00	–
IH1810	IH1810	–1	–781,380.00	–6,480.00	–
IH1811	IH1811	–2	–1,566,960.00	–10,860.00	–
公允价值变动总额合计(元)					–894,160.00
股指期货投资本期收益(元)					2,700,678.97
股指期货投资本期公允价值变动(元)					–808,233.33

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金股指期货投资是为了对冲股权买入方的投资。

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。

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	7,892,653.88
2	应收证券清算款	1,289,423.07
3	应收股利	–
4	应收利息	278,518.97
5	应收申购款	142,730.51
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	9,603,326.43

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

无。

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

项目	工银绝对收益混合发起A	工银绝对收益混合发起B
报告期期初基金份额总额	99,199,769.79	32,018,180.55
报告期期间基金总申购份额	2,692,916.83	2,326,508.61
减:报告期期间基金总赎回份额	6,139,583.26	2,047,767.28
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	95,753,103.36	32,296,921.88

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

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

本基金2014年6月26日成立后,工银瑞信基金管理有限公司运用固有资金作为发起资金认购的本基金份额为9,002,960.00份,发起份额持有期限不少于3年。自2017年6月27日起发起份额持有期限届满,发起份额已赎回退出。

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20180701–20180930	52,230,347.35	0.00	0.00	52,230,347.35	40.79%
个人	–	–	–	–	–	–	–
产品特有风险							
本基金份额持有人较为集中,存在基金规模大幅波动的风险,以及由此导致基金收益较大波动的风险。							

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

1、中国证监会核准工银瑞信绝对收益策略混合型发起式证券投资基金募集的文件;

2、《工银瑞信绝对收益策略混合型发起式证券投资基金基金合同》;

3、《工银瑞信绝对收益策略混合型发起式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。

10.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所。

10.3 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。