

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：二〇一九年一月十九日

§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2019年1月17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。

本报告自2018年10月1日起至12月31日止。

基金名称		工银上证央企50ETF
场内简称	央企50ETF	
交易代码	510000	
基金运作方式	交易型开放式	
基金合同生效日	2006年8月04日	
报告期末基金份额总额	100,959,218,000份	
投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，实现与标的指数收益相近的长期投资回报。	
投资策略	本基金主要采用完全复制策略，跟踪标的指数的表现，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金投资组合，并根据标的指数成份股组成及其权重进行动态调整。在正常情况下的，本基金对标的指数的跟踪目标是：力争使基金日均收益率与标的指数基准日收益偏离幅度的年度平均值不超过0.25%，跟踪误差化标准差不超过2%。	
业绩比较基准	上证中央企业50指数收益率。	
风险收益特征	本基金属于股票型基金，风险与收益高于混合基金、债券基金和货币市场基金。本基金跟踪基金，主要采用完全复制策略，跟踪标的指数的表现，本基金与本基金中、收益与目标市场的水平大致相近的产品。	
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	

3.1 主要财务指标		§3 主要财务指标和基金净值表现		单位：人民币元	
主要财务指标		报告期：2018年10月1日 - 2018年12月31日			
1.本期已实现收益	-609,764,761				
2.本期公允价值变动收益	-14,901,761,286				
3.本期平均基金份额本期利润	-0.1475				
4.期末基金资产净值	163,743,797,288				
5.期末基金份额净值	1.6219				

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、所列数据截止至报告期末最后一日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

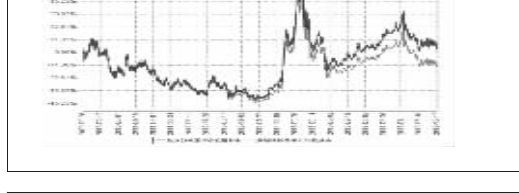
4、本基金本报告期末无H类份额。

5.2.1 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	-8.21%	1.46%	-8.51%	1.46%	0.20%	-0.01%

§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

本基金合同生效以来，本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如下：



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：二〇一九年一月十九日

§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2019年1月17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。

本报告自2018年10月1日起至12月31日止。

基金名称		工银沪深300指数
场内简称	沪深300	
交易代码	481000	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2006年3月2日	
报告期末基金份额总额	4,227,446,380,019份	
投资目标	采用指数化投资，通过跟踪标的指数实现对标的指数的紧密跟踪，实现与标的指数的收益相匹配，谋求基金资产的长期增值。	
投资策略	本基金跟踪上证380指数，跟踪标的指数的成份股构成及其权重构建基金投资组合，并跟踪标的指数的表现及跟踪误差的变动进行动态调整。在正常情况下的，本基金对标的指数的跟踪目标是：力争使基金日均收益率与标的指数基准日收益偏离幅度的年度平均值不超过0.25%，跟踪误差化标准差不超过2%。	
业绩比较基准	沪深300指数收益率+0.95%。	
风险收益特征	本基金属于股票型基金，风险与收益高于混合基金、债券基金和货币市场基金。本基金跟踪基金，主要采用完全复制策略，跟踪标的指数的表现，本基金与本基金中、收益与目标市场的水平大致相近的产品。	
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	

3.1 主要财务指标		§3 主要财务指标和基金净值表现		单位：人民币元	
主要财务指标		报告期：2018年10月1日 - 2018年12月31日			
1.本期已实现收益	-43,141,439,004				
2.本期公允价值变动收益	-410,420,324.67				
3.本期平均基金份额本期利润	-0.1033				
4.期末基金资产净值	3,627,865,863.32				
5.期末基金份额净值	0.8661				

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、所列数据截止至报告期末最后一日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

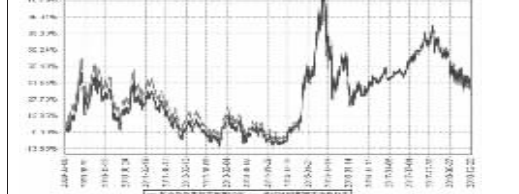
4、本基金本报告期末无H类份额。

5.2.1 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	-11.56%	1.54%	-11.33%	1.56%	0.27%	-0.02%

§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

本基金合同生效以来，本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如下：



1、本基金合同于2006年3月6日生效。截至本报告期末，本基金的投资组合比例符合基金合同有关规定，投资组合符合基金合同的规定：本基金投资于股票资产占基金资产的比例为90%-95%，投资于标的指数的成份股，备选证券范围的资产占基金资产的比例不低于90%。本基金对标的指数的跟踪目标是：力争使基金日均收益率与标的指数基准日收益偏离幅度的年度平均值不超过0.25%，跟踪误差化标准差不超过2%。

2、本基金对标的指数的跟踪目标是：力争使基金日均收益率与标的指数基准日收益偏离幅度的年度平均值不超过0.25%，跟踪误差化标准差不超过2%。

3、本基金对标的指数的跟踪目标是：力争使基金日均收益率与标的指数基准日收益偏离幅度的年度平均值不超过0.25%，跟踪误差化标准差不超过2%。

4、本基金对标的指数的跟踪目标是：力争使基金日均收益率与标的指数基准日收益偏离幅度的年度平均值不超过0.25%，跟踪误差化标准差不超过2%。

5、本基金对标的指数的跟踪目标是：力争使基金日均收益率与标的指数基准日收益偏离幅度的年度平均值不超过0.25%，跟踪误差化标准差不超过2%。

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：二〇一九年一月十九日			
§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2019年1月17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。			
本报告自2018年10月1日起至12月31日止。			

基金名称		工银稳健成长混合
场内简称	稳健成长	
交易代码	481004	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2006年12月29日	
报告期末基金份额总额	769,767,625.63份	
投资目标	有效控制投资组合风险，追求基金长期资本增值。	
投资策略	专注基本面研究，采取“自下而上”的策略，运用工银瑞信上市公司成长性评价体系选择具有长期持续增长潜力的上市公司股票，通过长期投资，以合理价格买入并持有中长期股票资产，力争实现超越业绩比较基准与平均水平的长期投资回报。	
业绩比较基准	80%×沪深300指数收益率+20%×上证国债指数收益率。	
风险收益特征	本基金属于混合基金，跟踪期收益及风险水平高于货币基金和债券基金，低于股票基金。	
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	
本基金投资的基金名称	工银稳健成长混合A	
本基金投资的基金代码	481002	
报告期末下阶段基金的分红总额	769,767,625.63份	

3.1 主要财务指标		§3 主要财务指标和基金净值表现		单位：人民币元	
主要财务指标		报告期：2018年10月1日 - 2018年12月31日			
1.本期已实现收益	-69,643,961.24				
2.本期公允价值变动收益	-57,096,902.94				
3.本期平均基金份额本期利润	-0.1140				
4.期末基金资产净值	692,092,150.43				
5.期末基金份额净值	0.9091				

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、所列数据截止至报告期末最后一日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

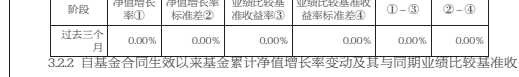
4、本基金本报告期末无H类份额。

5.2.1 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	-11.28%	1.51%	-6.05%	1.31%	-1.61%	0.20%

§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

本基金合同生效以来，本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如下：



信息披露

上证中央企业50交易型开放式指数证券投资基金

2018年第四季度报告

注：1、本基金基金合同于2006年8月26日生效。截至本报告期末，本基金的各项投资比例符合基金合同的规定：本基金投资于股票资产占基金资产的比例为90%-95%，投资于标的指数的成份股，备选证券范围的资产占基金资产的比例不低于90%。

2、本基金对标的指数的跟踪目标是：力争使基金日均收益率与标的指数基准日收益偏离幅度的年度平均值不超过0.25%，跟踪误差化标准差不超过2%。

3、本基金对标的指数的跟踪目标是：力争使基金日均收益率与标的指数基准日收益偏离幅度的年度平均值不超过0.25%，跟踪误差化标准差不超过2%。

4、本基金对标的指数的跟踪目标是：力争使基金日均收益率与标的指数基准日收益偏离幅度的年度平均值不超过0.25%，跟踪误差化标准差不超过2%。

5、本基金对标的指数的跟踪目标是：力争使基金日均收益率与标的指数基准日收益偏离幅度的年度平均值不超过0.25%，跟踪误差化标准差不超过2%。

基金名称		工银上证央企50ETF
场内简称	央企50ETF	
交易代码	510000	
基金运作方式	交易型开放式	
基金合同生效日	2006年8月04日	
报告期末基金份额总额	100,959,218,000份	
投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，实现与标的指数收益相近的长期投资回报。	
投资策略	本基金主要采用完全复制策略，跟踪标的指数的表现，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金投资组合，并根据标的指数成份股组成及其权重进行动态调整。在正常情况下的，本基金对标的指数的跟踪目标是：力争使基金日均收益率与标的指数基准日收益偏离幅度的年度平均值不超过0.25%，跟踪误差化标准差不超过2%。	
业绩比较基准	上证中央企业50指数收益率。	
风险收益特征	本基金属于股票型基金，风险与收益高于混合基金、债券基金和货币市场基金。本基金跟踪基金，主要采用完全复制策略，跟踪标的指数的表现，本基金与本基金中、收益与目标市场的水平大致相近的产品。	
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	

3.1 主要财务指标		§3 主要财务指标和基金净值表现		单位：人民币元	
主要财务指标		报告期：2018年10月1日 - 2018年12月31日			
1.本期已实现收益	-609,764,761				
2.本期公允价值变动收益	-14,901,761,286				
3.本期平均基金份额本期利润	-0.1475				
4.期末基金资产净值	163,743,797,288				
5.期末基金份额净值	1.6219				

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、所列数据截止至报告期末最后一日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

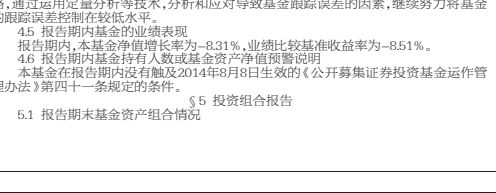
4、本基金本报告期末无H类份额。

5.2.1 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	-8.21%	1.46%	-8.51%	1.46%	0.20%	-0.01%

§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

本基金合同生效以来，本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如下：



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：二〇一九年一月十九日

§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2019年1月17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。

本报告自2018年10月1日起至12月31日止。

基金名称		工银沪深300指数
场内简称	沪深300	
交易代码	481000	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2006年3月2日	
报告期末基金份额总额	4,227,446,380,019份	
投资目标	采用指数化投资，通过跟踪标的指数实现对标的指数的紧密跟踪，实现与标的指数的收益相匹配，谋求基金资产的长期增值。	
投资策略	本基金跟踪上证380指数，跟踪标的指数的成份股构成及其权重构建基金投资组合，并跟踪标的指数的表现及跟踪误差的变动进行动态调整。在正常情况下的，本基金对标的指数的跟踪目标是：力争使基金日均收益率与标的指数基准日收益偏离幅度的年度平均值不超过0.25%，跟踪误差化标准差不超过2%。	
业绩比较基准	沪深300指数收益率+0.95%。	
风险收益特征	本基金属于股票型基金，风险与收益高于混合基金、债券基金和货币市场基金。本基金跟踪基金，主要采用完全复制策略，跟踪标的指数的表现，本基金与本基金中、收益与目标市场的水平大致相近的产品。	
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	

3.1 主要财务指标		§3 主要财务指标和基金净值表现		单位：人民币元	
主要财务指标		报告期：2018年10月1日 - 2018年12月31日			
1.本期已实现收益	-43,141,439,004				
2.本期公允价值变动收益	-410,420,324.67				
3.本期平均基金份额本期利润	-0.1033				
4.期末基金资产净值	3,627,865,863.32				
5.期末基金份额净值	0.8661				

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、所列数据截止至报告期末最后一日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

4、本基金本报告期末无H类份额。

5.2.1 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	-11.56%	1.54%	-11.33%	1.56%	0.27%	-0.02%

§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

本基金合同生效以来，本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如下：



1、本基金合同于2006年3月6日生效。截至本报告期末，本基金的投资组合比例符合基金合同有关规定，投资组合符合基金合同的规定：本基金投资于股票资产占基金资产的比例为90%-95%，投资于标的指数的成份股，备选证券范围的资产占基金资产的比例不低于90%。本基金对标的指数的跟踪目标是：力争使基金日均收益率与标的指数基准日收益偏离幅度的年度平均值不超过0.25%，跟踪误差化标准差不超过2%。

2、本基金对标的指数的跟踪目标是：力争使基金日均收益率与标的指数基准日收益偏离幅度的年度平均值不超过0.25%，跟踪误差化标准差不超过2%。

3、本基金对标的指数的跟踪目标是：力争使基金日均收益率与标的指数基准日收益偏离幅度的年度平均值不超过0.25%，跟踪误差化标准差不超过2%。

4、本基金对标的指数的跟踪目标是：力争使基金日均收益率与标的指数基准日收益偏离幅度的年度平均值不超过0.25%，跟踪误差化标准差不超过2%。

5、本基金对标的指数的跟踪目标是：力争使基金日均收益率与标的指数基准日收益偏离幅度的年度平均值不超过0.25%，跟踪误差化标准差不超过2%。

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：二〇一九年一月十九日		
§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2019年1月17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。					
本报告自2018年10月1日起至12月31日止。					

基金名称		工银稳健成长混合
场内简称	稳健成长	
交易代码	481004	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2006年12月29日	
报告期末基金份额总额	769,767,625.63份	
投资目标	有效控制投资组合风险，追求基金长期资本增值。	
投资策略	专注基本面研究，采取“自下而上”的策略，运用工银瑞信上市公司成长性评价体系选择具有长期持续增长潜力的上市公司股票，通过长期投资，以合理价格买入并持有中长期股票资产，力争实现超越业绩比较基准与平均水平的长期投资回报。	
业绩比较基准	80%×沪深300指数收益率+20%×上证国债指数收益率。	
风险收益特征	本基金属于混合基金，跟踪期收益及风险水平高于货币基金和债券基金，低于股票基金。	
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	
本基金投资的基金名称	工银稳健成长混合A	
本基金投资的基金代码	481002	
报告期末下阶段基金的分红总额	769,767,625.63份	

3.1 主要财务指标		§3 主要财务指标和基金净值表现		单位：人民币元	
主要财务指标		报告期：2018年10月1日 - 2018年12月31日			
1.本期已实现收益	-69,643,961.24				
2.本期公允价值变动收益	-57,096,902.94				
3.本期平均基金份额本期利润	-0.1140				
4.期末基金资产净值	692,092,150.43				
5.期末基金份额净值	0.9091				

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、所列数据截止至报告期末最后一日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

4、本基金本报告期末无H类份额。

5.2.1 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	-11.28%	1.51%	-6.05%	1.31%	-1.61%	0.20%

§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

本基金合同生效以来，本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如下：

