

## 基金管理人的董事会及董事保证本报告所裁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,净值表现用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 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10月1日起至12月31日止 1,092,494,035,776 3、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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此公允价值变动收益为 零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。 4、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 3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较 效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基

## 工银瑞信14天理财债券型发起式证券投资基金 2018年第四季度报告

政策以进一步就通货币政策传导机制。 年底货币市场方面资金面出现一些波动,分层观象仍比较明显,但在总量流 对性合理充裕的境质下,四季度大部分时间里资金面表现相对平稳。货币资产收 益率较三季未进一步下行。至年末,7天回顺利率从301%小幅上行135p至3.14%, 年期国开收益率从308%继续下行335p到2.75%,一年期AAA知趣收益率从 3.68%继续下行105p至5.55%。 四季度、本基金通过对客户需求以及宏观经济和货币市场的判断,保险对 客户在月末和季末的流动性要求。合理安排组合的效益,并在确保流动性的前 提下,通过对存款和债券配置的时点安排,增厚组合收益率,同时本基金一直严控 债券配置的信用资质。 程:、地区以行為从他级养配量的的民文律,相序组合权量率,同的本基金一直产足债券配置的信用资质。
45 报告期内基金的业绩表现
报告期内,工银瑞信14天理财A份额净值增长率为0.3403%。
报告期内工银瑞信14天理财本份额净值增长率为0.3403%。
46 报告期内基金持有人数或基金资产单值预整识明
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

注:由于四金五人的原因金额占基金总资产的比例分项之和与合计可能有星 5.2 报告期债券回购融资情况 设告期内债券融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况 5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明 本报告期内,本基金正偏离度的绝对值未达到0.5% 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十名资产支持证 本基金估值采用摊余成本法,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或商定利

率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内按实际利率法进行摊销,每日

5.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的

上表中"偏离情况"根据报告期内各交易日数据计算

注:上秦中,债券的成本包括债券面值和折溢价。 5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明

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。 5.9.3 其他资产构成 《6 开放式基金份额变动 单位:份 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 招告期期间其全户時间份麵含转拖出份麵 §7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细 《8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况 持有份领总数 持有份额占基金 总份额比例(%) 注:本基金2012年10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10,000,200.00份,基金经理等人员作为发 起资金认购的本基金份额为0份,发起份额持有期限不少干3年。自2015年10月26 日起发起份额持有期限届满,发起份额已赎回退出 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 中期 107377 持有份額

9.2 影响投资者决策的其他重要信息 《10 备查文件目录 10.1 条查文件日录 1、中国证监会批准工银瑞信14天理财债券型发起式证券投资基金设立的文 2.《丁银瑞信14天理财债券型发起式证券投资基金基金合同》 3、《工银瑞信14天理财债券型发起式证券投资基金托管协议》;

3、《工报瑞昌14大理财债券型及起式证券 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媒介上披露的各项公告。 10.2 存放地占 基金管理人或基金托管人的住所。

基金托管人:中国农业银行股份有限公司 基金托管人:中国农业银行股份有限公司 报告送出日期:二〇一九年一月十九日 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、据他张知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2019年1月 7日复核 万本报告中的财务指标,净债表现和投资组合报告等内容,保证复核内 客不存在虚假记载。误导性陈述或者重大遗漏。 基金管型人承诺以诚实信用、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。 证证本一定盈利。 并设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。 本报告明自2018年10日;11年至2018

基金简称	工银信用纯债债券	工银信用纯债债券		
交易代码	486119			
基金运作方式	契约型开放式			
基金合同生效日	2012年11月14日	2012年11月14日		
限告期末基金份额总额	398,062,628.32()	398,062,628.32()		
投资目标	在控制风险并保持资产流动! 基准的投资收益。	在控制风险并保持资产流动性的基础上,力争实现超越业镇比较 基准的投资收益。		
投資額略	本基金的主要投资策略包括 配置策略、证券选择策略、短 略及资产支持证券等品种投 发掘和利用市场失衡提供的	本基金的主要投资策略包括: 網限配置策略, 網限結构策略、类組配置策略, 近岸选择策略, 規則和中长期的市场环境中的投资策略, 使更产业协业外等品种投资策略, 在严格控制风险的前提下, 发掘和利用市场失磷配供的投资机会, 发现机合资产的增值。		
业绩比较基准	90%×中债信用债(财富)总 券(1~3年)总财富指数收益	80%×中债信用债(财富)总指数收益率+20%×中债国开行债券(1~3年)总财富指数收益率。		
风险收益特征	本基金为债券型基金,預期的 那型基金,高于货币市场基金	本基金为债券型基金、預期收益和风险水平低于混合型基金、股票型基金、高于货币市场基金。		
基金管理人	工银塔信基金管理有限公司	工報環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	中国农业银行股份有限公司		
下周分级基金的基金简称	工银信用纯债债券A	工假信用纯债债券B		
下属分级基金的交易代码	485119	485019		
<b>复告期末下属分级基金的份额总额</b>	371,113,846.326)	26,938,683.00()		
3.1 主要财务指标 3.1 主要财务指标	财务指标和基金净值表	现 单位:人民		
主要财务指标	報告網(2018年10月1日 - 2018年12月31日)			
	工银信用纯债债券A 工银信用纯债债			

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,计人费用后实际设益水平要低于所创数字。

注:1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的含项效用,日人政用后实际设益水平硬低于所创数字。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)和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

责券A 业绩比较基准收益率 标准差④ 业绩比较基准收益率30 R信用纯债债券B 

## 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

工银瑞信信用纯债债券型证券投资基金

**《电影力量通报》,并有数据由于重新支援的线数。1984年1984年1984年** 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。 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超过该证券当日 成交量的5%的情况有5次。投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向

> 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析 海外方面,四季度发达国家经济延续放缓态势,欧洲景气度继续下滑,美国、 日本也有所回落。美国方面,受避险情绪及欧央行鸽派表态带动,美元指数小幅走 强,人民币贬值压力较大,兑美元汇率一度触及6.97的历史新高,12月美联储如期 加息25bp。国内方面,经济下行压力加剧,尽管基建投资企稳,制造业投资延续升 势,带动固定资产投资增速低位回升,但地产投资小幅回落,此外工业生产明显走 弱,消费增速也显著下滑,出口如期走弱,尤其加征关税的对美出口商品增速大幅 回落。往后看,预计基建投资继续改善,不过楼市降温之下地产销售仍将趋于回 落,从资金端制约地产投资,而出口受全球经济持续放缓与贸易磨擦的不确定性 拖累,仍面临下行压力,消费受制于居民收入增速放缓,叠加前期加杠杆透支短期 购买力,也不容乐观,整体上看短期经济仍将惯性下行。流动性方面,四季度货币 政策维持宽松,资金利率中枢保持低位。市场方面,受流动性宽松、经济弱势进一 步显现带动,债券迎来一波牛市行情,年末10年期国债收益率较9月末下行近 34bp,10年期国开收益率下行约51bp,信用利差整体小幅走扩,转债市场跟随股 市震荡,受债市强劲影响,整体表现好于股市。

工银信用纯债债券本报告期内以高等级信用债为主要持仓, 久期基本不变, 信用债进行结构调整,减持地方债。

4.5 报告期内基金的业绩表现 报告期内,工银信用纯债A份额净值增长率为1.90%,工银信用纯债B份额净 值增长率为1.80%、业绩比较基准收益率为1.85%。

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

注,由于四金五人的原因金额占基金总资产的比例分项之和与合计可能有星

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 本基金本报告期末未持有境内股票投资。 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

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

本基金本报告期末未持有股票。

643	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	64,709,600.00	13.38	
	其中:改策性金融债	64,709,600.00	13.38	
4	企业债券	359,852,720.90	74.43	
5	企业短期融资券	-	-	
6	中期票据	178,712,000.00	36.97	
7	可转債(可交換债)	-	-	
8	四业存单	-	-	
9	34(t):	-	-	
10	合计	603,274,320.90	124.78	

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

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

木其全木招告期末土持有资立支持证券

本基金本报告期末未持有贵金属.

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

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

本基金本报告期末未持有权证。 5.9.1 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, 5.9.2 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。

5.9.3 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。 5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况

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。 5.10.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明 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 5.10.3 其他资产构成

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

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。 5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分 《6 开放式基金份额变动

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 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

《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

《9 备查文件目录

1、中国证监会批准工银瑞信信用纯债债券型证券投资基金设立的文件; 2.《丁铜瑞信信用纯倩倩券刑证券投资基金基金合同》: 3、《工银瑞信信用纯债债券型证券投资基金托管协议》;

6、报告期内基金管理人在指定媒介上披露的各项公告

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

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

基金简称	工银保本3号混合	工银保本3号混合			
交易代码	000195	000195			
基金运作方式	契约型、定期开放式	契约型、定期开放式			
基金合同生效日	2013年6月26日	2013年6月26日			
报告婀末基金份额总额	2,481,035,969.936}	2,481,035,959.93()			
投资目标	依照保证合同,通过运用性 损失的风险,并在基金本金 值。	依照保证合同,通过运用恒定比例投资组合保险策略,控制本金 损失的风险,并在基金本金安全的基础上实现基金资产的稳定增 值。			
投资策略	本基金采用恒定比例投资 Portfolio Insurance,CPPI	本基金采用恒定比例投资组合保险策略(Constant-Proportion Portfolio Insurance, CPPI)来实现保本和增值的目标。			
业绩比较基准	人民市税后三年期級行定! 利率是指每年的第一个工期"金融机构人民市存款"	人民市税后三年期銀行定期存款利率+0.25%。三年期定期存款 利率是指每年的第一个工作日中国人民银行网站上发布的三年 期"金融机构人民市存款基准利率"。			
风险收益特征	本基金是一只保本混合型 者投资于保本基金并不等 金融机构,保本基金在极端	本基金是一只保本混合型基金。属于基金中的低风险品种,投资 者投资于保本基金并不等于将资金作为存款放在银行或存款类 金融机构,保本基金在极端情况下仍然存在本金损失的风险。			
基金管理人	工银瑞伯基金管理有限公	工银瑞伯基金管理有限公司			
基金托管人	招商银行股份有限公司	招商银行股份有限公司			
基金保证人	北京中关村科技融资担保	北京中关村科技融资担保有限公司			
下属分级基金的基金简称	工银保本3号混合A	工银保本3号混合B			
下属分级基金的交易代码	000195	000196			
报告期末下周分级基金的份额总额	2,328,010,899.53{}	153,025,060.40{}			

	王要财务指标	报告期(2018年10月1日	- 2018年12月31日 )	
		工银保本3号混合A	工银保本3号混合B	
	1. 本期已实现收益	-965,331.48	-302,949.15	
	2. 本期利润	1,043,083.41	-172,997.52	
	3. 加权平均基金份额本期利润	0.0004	-0.0011	
	4. 期末基金资产净值	2,457,495,71254	158,948,641.75	
	5. 期末基金份額净值	1.056	1.039	
			基金的各项费用,计/	入费
用后	5实际收益水平要低于所列数			
	2、本期已实现收益是指基金		益、其他收入(不含公分	允价
值型	『动收益 ) 扣除相关费用后的	余额, 本期利润为本期E	2.实现收益加上本期/	公分

恒文的发现。 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 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

			I	银保本3号	混合A		
Γ	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	(I) - (3)	2-4
Γ	过去三个月	0.09%	0.08%	0.76%	0.01%	-0.67%	0.07%
_			I	银保本3号	混合B		
ſ	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	10-30	2-4
Г	过去三个月	-0.10%	0.09%	0.76%	0.01%	-0.86%	0.08%
	3.2.2 目 益率变动	的比较			直增长率变动》	及其与同!	期业绩比较
			224-488-14-1	SECTION SEC	STREET, 18		
		- 7				-	
		44		- A	1.1		

# 工银瑞信保本3号混合型证券投资基金

注:1.本基金基金合同于2012年10月26日生效。
2.按基金合同规定。本基金建仓即为1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。本基金主要投资于具有良好流动性的工具。包括现金、通知存款、一年以内(含一年)的银行定期存款和大额产申期,积据在一年以内(含一年)的电外电影,中期票据,排服在一年以内(含一年)的中央银行票据,起到服验资外,及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他固定收益金融证具。本基金不直接在一级市场上买入股票、权证等权益类资产,也不参与一级市场游散申顺和新版增发。
4. 管理人报告

42 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的影响 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,依照城实信用,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。

无损害基金份鄉持者(利益的行为。
43 小平交易与頭的明
431 小平交易电视的明
431 小平交易电视的明
431 小平交易电视的明
431 小平交易电视的明
为了公平对待各类股份、保护等类投资人利益、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》、《证券明货经营机构私募资产管理业分管理办法》、《证券明货经营机构私募资产管理业分管理办法》、《对公司管理规》等法律法规和公司内部规章。规定了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》、《公司管理的会类资产的公平对持修了明确。集体的规定,并提定对实实股票,债券申债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滥控。本报告期,大按照时间优失,价格优产的原则,本公司对制定股份条件但对问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,来出现消息不起处的情况,是本基金及本基金专业基金宣准人管理的规一位,经营组合之间未发生法律法规禁止的反向交易及交交交易。
432 等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资的专项说明
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资价回日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况有6次。投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易、未导数不公平交易和利益输送。
44 报告期内基金投资策略和运作分析四季度出口,消费以及工业生产的表现较前几个季度有所下滑,需求曲线下移的情形下,经济的核心矛盾从供给罐物后来被减少数年的大多度有所下滑,需求曲线下移的情形下,经济的核心矛盾从供给罐的重要被前几个季度有所下滑,需求曲线下移的情形下,经济的核心矛盾从供给罐的束硬效的工作分析。

注:1、本基金基金合同于2012年11月14日生效。
2. 拉基金合同规定。本基金建仓调为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发产均资范围度投资限制的规定。债券等周定收益资产占基金资产净值的比例不低于90%,其中公司债企业债债,规则融资券,商业银行金融债与次级债资产支持证券,中期票期等企业机构发行的债券占基金固定收益类资产的比例不低于90%,其本是有现金及受到明日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于5%,其中现金不包括结算备付金,存出保证金、应收申购

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

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》、《证券期货经营机构私

募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规

定》、《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,

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

別定收益部副 2位,本基金的 10公司

注:1,本基金基金合同于2013年6月26日生效。
2.按基金合同规定,本基金建仓即为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;股票等风险资产占基金资产的比例不高于40%;债券,债券回购,银行存款等安全资产占基金资产的比例不低于60%;本基金在受限开放期、到期操作期,过渡期,每个交易日日终在110条份。 版了100%; (平基並任空限) 计成则,到则课作别、10渡别,每个父易日日终在出除股 捐期货会治需缴纳的交易保证金后,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; 在封闭期内, 本基金不受该比例的限制, 但每个交易 日日终在北除股捐期货合约需缴纳的交易保证金后, 应当保持不低于交易保证金 一倍的现金, 前述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

§ 4 管理人报告 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

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体历况以及金融企义子可决以市立处及基金合同、招募说明书等有关基金法律文体历规定。所服破实信用、勤勉是贡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。 43公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况 4.31 公平交易则限的从行间60 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》、《证券期货经营机构私 募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规 定》、《证券投资基金管理办法》、《国务制度指导意见,等法律法决照以司内密规 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 量、我走」《公平公》的目述为法》、开格公》的是现为法》,对公司目地的音交双广的公平对待做了明确具体的规定,并规定对主卖股票。 使养时核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词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。

## 2018年第四季度报告

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超过该证券当日 成交量的%的情况有6次。投资组合经期因投资组合的投资策略而发生同日反向 交易,未导致不公平交易用利益输送。 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析 2018年四季度全球经济不确定性继续加大,美联储加息,货币政策收紧叠加

美国政府开启"贸易战",对于全球风险偏好造成极大影响,带动全球权益资产出 考虑到国际宏观环境稳中有变的情况,国内政策层面对于经济的支持力度加强,货币政策和财政政策双管齐下,减税降费措施频出。在此背景下,国内债券市场四季度上涨明显,而股票市场受全球风险偏好调整影响波动性加大。

本基金在报告期内根据对于市场变化的判断积极调整仓位,同时积极参与新 股申购,以及新发可转债申购,

版年购,以及和及刊存版年购。 4.5 报告期内基金的业绩表现 报告期内,工银保本3号混合A份额净值增长率为0.09%,工银保本3号混合B 份额净值增长率为-0.10%,业绩比较基准收益率为0.76%。 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

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

注:由于四舍五人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 告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

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

一四舍五人的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合

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

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 

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 本基金本报告期末末持有股指期货投资,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 5.10.3 本期區原則項权政計可 本报告期內,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受到调查以及处罚的情况 。 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 报告编制目前一年内受到公开谴责。处罚的情形。 5.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明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 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券即约 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分 § 6 开放式基金份额变动 注:1.报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换人份额; 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 元。 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

§ 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

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

§ 9 备查文件目录

1、中国证监会批准工银瑞信保本3号混合型证券投资基金设立的文件;

1、中国证益云批准上限物目保本等等化了至证分及负差 《《工银瑞信保本等得合型证券投资基金基合同》; 3、《工银瑞信保本3号混合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

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

6、报告期内基金管理人在指定媒介上披露的各项公告。 3.2 存成地点 基金管理人或基金托管人的住所。 9.3 查阅方式