

基金管理人：工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人：中国光大银行股份有限公司
送出日期：二〇一四年三月三十一日

基金管理人：工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人：中国光大银行股份有限公司
送出日期：二〇一四年三月三十一日

工银瑞信保本混合型证券投资基金

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300137	先河环保	25,997,608.73	1.44

2	002296	辉壹科技	16,634,112.03	0.92
3	000631	西王食品	15,412,256.46	0.85
4	002311	海大集团	14,067,760.77	0.78
5	601311	骆驼股份	11,525,894.31	0.64

[illegible]

基金管理人是否涉及关联交易	
项目	基金管理人 基金管理人
4. 基金管理人与其关联方之间的关联交易是否按照有关规定进行披露且没有违反限制性规定	本基金管理人报告期内按照中国证监会《证券投资基金信息披露管理办法》及《证券投资基金信息披露内容与格式准则》等有关规定，及时、准确、完整地披露了关联交易事项，并严格按照基金合同、招募说明书等法律文件的规定，履行了必要的程序，不存在违反法律法规及基金合同、招募说明书等法律文件规定的行为。 本基金管理人报告期内按照中国证监会《证券投资基金信息披露管理办法》及《证券投资基金信息披露内容与格式准则》等有关规定，及时、准确、完整地披露了关联交易事项，并严格按照基金合同、招募说明书等法律文件的规定，履行了必要的程序，不存在违反法律法规及基金合同、招募说明书等法律文件规定的行为。

名称	工银信託基金管理有限公司		中国光大银行股份有限公司	
	姓名	朱善彪	姓名	石立平
信息披露负责人	联系电话	400-811-9999	010-63619100	
	电子邮箱	customer@icbc.com.cn	shiliping@icbk.com	
客户服务热线	400-811-9999	95595		
	010-66831158	010-63619332		
基金管理人网站	www.icbc.com.cn		www.cebs.com.cn	
基金年度审计会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)		普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	

基金管理人及基金托管人的住所		基金管理人及基金托管人的住所	
工银信託基金管理有限公司		中国光大银行股份有限公司	
北京市西城区金融大街15号		北京市西城区太平桥大街25号	
100140		100140	

基金管理人及基金托管人的住所		基金管理人及基金托管人的住所	
工银信託基金管理有限公司		中国光大银行股份有限公司	
北京市西城区金融大街15号		北京市西城区太平桥大街25号	
100140		100140	

基金管理人及基金托管人的住所		基金管理人及基金托管人的住所	
工银信託基金管理有限公司		中国光大银行股份有限公司	
北京市西城区金融大街15号		北京市西城区太平桥大街25号	
100140		100140	

基金管理人及基金托管人的住所		基金管理人及基金托管人的住所	
工银信託基金管理有限公司		中国光大银行股份有限公司	
北京市西城区金融大街15号		北京市西城区太平桥大街25号	
100140		100140	

基金管理人及基金托管人的住所		基金管理人及基金托管人的住所	
工银信託基金管理有限公司		中国光大银行股份有限公司	
北京市西城区金融大街15号		北京市西城区太平桥大街25号	
100140		100140	

基金管理人及基金托管人的住所		基金管理人及基金托管人的住所	
工银信託基金管理有限公司		中国光大银行股份有限公司	
北京市西城区金融大街15号		北京市西城区太平桥大街25号	
100140		100140	

基金管理人及基金托管人的住所		基金管理人及基金托管人的住所	
工银信託基金管理有限公司		中国光大银行股份有限公司	
北京市西城区金融大街15号		北京市西城区太平桥大街25号	
100140		100140	

基金管理人及基金托管人的住所		基金管理人及基金托管人的住所	
工银信託基金管理有限公司		中国光大银行股份有限公司	
北京市西城区金融大街15号		北京市西城区太平桥大街25号	
100140		100140	

基金管理人及基金托管人的住所		基金管理人及基金托管人的住所	
工银信託基金管理有限公司		中国光大银行股份有限公司	
北京市西城区金融大街15号		北京市西城区太平桥大街25号	
100140		100140	

基金管理人及基金托管人的住所		基金管理人及基金托管人的住所	
工银信託基金管理有限公司		中国光大银行股份有限公司	
北京市西城区金融大街15号		北京市西城区太平桥大街25号	
100140		100140	

基金管理人及基金托管人的住所		基金管理人及基金托管人的住所	
工银信託基金管理有限公司		中国光大银行股份有限公司	
北京市西城区金融大街15号		北京市西城区太平桥大街25号	
100140		100140	

基金管理人及基金托管人的住所		基金管理人及基金托管人的住所	
工银信託基金管理有限公司		中国光大银行股份有限公司	
北京市西城区金融大街15号		北京市西城区太平桥大街25号	
100140		100140	

基金管理人及基金托管人的住所		基金管理人及基金托管人的住所	
工银信託基金管理有限公司		中国光大银行股份有限公司	
北京市西城区金融大街15号		北京市西城区太平桥大街25号	
100140		100140	

基金管理人及基金托管人的住所		基金管理人及基金托管人的住所
----------------	--	----------------

[illegible]

3.1.1 薪酬考核标准	2013年	2012年	2011年12月29日(董事会公告生效日)至2011年12月31日	平视过去对政府经济调控的宏观程度、预期政策对行业的影响程度、行业幅度的环境下,通过超预期刺激政策带来的概率低,但预期风险不小,但为有效避免成本上升,我们计划了薪酬水平,同时结合行业调控下行业下滑的幅度,我们计划薪酬水平有所提高。	8	002080	中材科技	10,624,913.99	0.59
本期工资总额	99,107,799.81	88,012,481.43	74,725,231.21	报告期内,公司薪酬考核体系在薪酬水平上有所提高,同时结合行业调控下行业下滑的幅度,我们计划薪酬水平有所提高。	7.45%	报告更正说明			
本期计提工资	53,100,618.62	198,158,564.22	11,852,196.42	报告期内,公司薪酬考核体系在薪酬水平上有所提高,同时结合行业调控下行业下滑的幅度,我们计划薪酬水平有所提高。	6	300843	经纬科技	10,486,676.66	0.57
本期计提工资/期末基本薪酬	0.074	0.0430	0.0035	报告期内,公司薪酬考核体系在薪酬水平上有所提高,同时结合行业调控下行业下滑的幅度,我们计划薪酬水平有所提高。	10	600809	山西汾酒	10,207,843.84	0.56
本期基本薪酬/薪酬增长率	2.98%	3.79%	0.30%	报告期内,公司薪酬考核体系在薪酬水平上有所提高,同时结合行业调控下行业下滑的幅度,我们计划薪酬水平有所提高。	11	601607	上海医药	9,515,909.49	0.53
3.1.2 期末薪酬考核标准	2013年3月	2012年3月	2011年3月	报告期内,公司薪酬考核体系在薪酬水平上有所提高,同时结合行业调控下行业下滑的幅度,我们计划薪酬水平有所提高。	12	300351	永辉超市	9,417,670.78	0.52
本期计提工资/基本薪酬	0.0717	0.0363	0.0002	报告期内,公司薪酬考核体系在薪酬水平上有所提高,同时结合行业调控下行业下滑的幅度,我们计划薪酬水平有所提高。	13	000651	格力电器	7,939,117.57	0.44
期末基本薪酬/薪酬增长率	1,991,224,671.21	1,810,750,365.73	3,441,748,002.21	报告期内,公司薪酬考核体系在薪酬水平上有所提高,同时结合行业调控下行业下滑的幅度,我们计划薪酬水平有所提高。	14	600597	光力药业	7,867,632.73	0.43

1	1.00				
2					
3					
4					
5					
6					
7					
8					
9					
10					
11					
12					
13					
14					
15	0.00281	货币市场	7,860,459.22	0.43	
16	0.00285	债券类	7,699,939.43	0.43	
17					
18					
19					
20					
21					
22					
23					
24					
25					
26					
27					
28					
29					
30					
31					
32					
33					
34					
35					
36					
37					
38					
39					
40					
41					
42					
43					
44					
45					
46					
47					
48					
49					
50					
51					
52					
53					
54					
55					
56					
57					
58					
59					
60					
61					
62					
63					
64					
65					
66					
67					
68					
69					
70					
71					
72					
73					
74					
75					
76					
77					
78					
79					
80					
81					
82					
83					
84					
85					
86					
87					
88					
89					
90					
91					
92					
93					
94					
95					
96					
97					
98					
99					
100					

[illegible][illegible]

报告期开始	7.28%	0.11%	9.32%	0.01%	-2.12%	0.10%
注：本基金自基金合同生效日至2018年11月27日。						
3.2.2	自基金合同生效以来本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较					
2013年5月，中国光大银行股份有限公司在《服务报告》中公布本基金资产托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金托管协议》、《证券投资基金投资运作管理办法》及其他行业规范、相关法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对托管报告范围内本基金资产的投资运作进行了全面的会计核算和有效的监督，对发现的问题及时进行了意见和风险提示。同时，按照托管协议的规定及时执行了本基金资金划拨指令，全面执行了托管职责并积极配合了托管人对托管报告、托管报告附件的编制和编制工作，为基金份额持有人利益尽到了应有的义务。 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值增长、利润分配等情况的说明 2015年度，中国光大银行股份有限公司依据《证券投资基金法》、《证券投资基金托管协议》、《证券投资基金投资运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，安全保管了基金的全部资产，对托管报告范围内本基金资产的投资运作进行了全面的会计核算和有效的监督，对发现的问题及时进行了意见和风险提示。同时，按照托管协议的规定及时执行了本基金资金划拨指令，全面执行了托管职责并积极配合了托管人对托管报告、托管报告附件的编制和编制工作，为基金份额持有人利益尽到了应有的义务。 2016年度，中国光大银行股份有限公司在《服务报告》中公布本基金资产托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金托管协议》、《证券投资基金投资运作管理办法》及其他行业规范、相关法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对托管报告范围内本基金资产的投资运作进行了全面的会计核算和有效的监督，对发现的问题及时进行了意见和风险提示。同时，按照托管协议的规定及时执行了本基金资金划拨指令，全面执行了托管职责并积极配合了托管人对托管报告、托管报告附件的编制和编制工作，为基金份额持有人利益尽到了应有的义务。 2017年度，中国光大银行股份有限公司在《服务报告》中公布本基金资产托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金托管协议》、《证券投资基金投资运作管理办法》及其他行业规范、相关法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对托管报告范围内本基金资产的投资运作进行了全面的会计核算和有效的监督，对发现的问题及时进行了意见和风险提示。同时，按照托管协议的规定及时执行了本基金资金划拨指令，全面执行了托管职责并积极配合了托管人对托管报告、托管报告附件的编制和编制工作，为基金份额持有人利益尽到了应有的义务。 2018年度，中国光大银行股份有限公司在《服务报告》中公布本基金资产托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金托管协议》、《证券投资基金投资运作管理办法》及其他行业规范、相关法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对托管报告范围内本基金资产的投资运作进行了全面的会计核算和有效的监督，对发现的问题及时进行了意见和风险提示。同时，按照托管协议的规定及时执行了本基金资金划拨指令，全面执行了托管职责并积极配合了托管人对托管报告、托管报告附件的编制和编制工作，为基金份额持有人利益尽到了应有的义务。						

	为进行了解释、监督，本发现基金管理人已在投资运作、基金估值中贯彻对基金价格的计算、基金估值方法等方面存在瑕疵基金持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关证券法律的要求，亦遵守有关基金法律法规、基金估值办法等相关规定并履行了程序。		
	关联方名称	与本基金的关系	
1. 银信基金资产管理有限公司	基金管理人、基金受托机构、基金估值机构		3 金融债 108,736,000.00 9.13
			3 国债、政策性金融债 108,736,000.00 9.13
			3 央行票据 89.18

5.3 托管人对本年度报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见				
中国光大银行股份有限公司担任基金管理人——工银国际基金管理有限公司编制的“工银国际保本混合型证券投资基金2013年年度报告”进行了复核,认为报告与相关财务指标、净值表现、财务会计报告内容等真实、准确、完整。				
5.6 审计报告				
本年度报告编制了无保留意见的审计报告,且在审计报告中无保留事项,投资者查阅了详细内容和,可阅读年度报告全文查看审计报告全文。				

注:1、本基金基金合同于2011年12月27日生效。

2、按基金合同约定,本基金建仓期为六个月。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;

中国工商银行股份有限公司	基金管理人股东、基金销售机构	5	中银国际融资券	-
第七世纪传媒股份有限公司	基金管理人股东	6	企业债	405,845,000.00
工银国际资产管理(国际)有限公司	基金管理人子公司	7	可转债	-
工银国际投资管理(香港)有限公司	基金管理人子公司	8	其他	-
				1,169,789,489.26

[illegible]

资产	附注	本期末 2013年12月31日	上年年末 2012年12月31日
货币存款		6,279,456.59	4,295,385.00
银行存款		7,963,232.15	25,435,221.24

				注：1、本基金合同生效时间为2011年11月12日 2、2011年11月12日至2011年12月31日止期间		7.20
货币资金 交易性金融资产 应收账款 其他流动资产 长期股权投资 固定资产 无形资产 递延所得税资产 其他非流动资产				128,271.49 1,485,618.19 1,972.20 250,000.00 3,202,888.34 77.20 18,365,927.63 30,457,812.90 85,748,927.86		7.20

[illegible][illegible][illegible][illegible][illegible][illegible][illegible][illegible]

用续借一年定期开放式基金投资, 2013年6月24日截止止, 由长江信托用续借两年定期基金基金投资	应付利息	-	-	74.85 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入	单位: 人民币元
	应付短期融资借款	-	-		
	其他应付款	3,493,743.36	3,063,393.96		
管理上海基金管理有限公司基金业务, 2010年加入丁慧娟, 现任固定收益部副经理, 2004年加入本公司, 无其他对外投资情况	应付债券	3,493,743.36	3,063,393.96		
南京富春资产	应付合计	342,777,549.06	1,467,528,723.93		
	其他应付款	-	-		
	应付利息	-	-		
	应付短期融资借款	-	-		
	应付债券	-	-		
	应付合计	-	-		
	其他应付款	-	-		
	应付利息	-	-		
	应付短期融资借款	-	-		
	应付债券	-	-		
	应付合计	-	-		
	其他应付款	-	-		
	应付利息	-	-		
	应付短期融资借款	-	-		
	应付债券	-	-		
	应付合计	-	-		
	其他应付款	-	-		
	应付利息	-	-		
	应付短期融资借款	-	-		
	应付债券	-	-		
	应付合计	-	-		
	其他应付款	-	-		
	应付利息	-	-		
	应付短期融资借款	-	-		
	应付债券	-	-		
	应付合计	-	-		
	其他应付款	-	-		
	应付利息	-	-		
	应付短期融资借款	-	-		
	应付债券	-	-		
	应付合计	-	-		
	其他应付款	-	-		
	应付利息	-	-		
	应付短期融资借款	-	-		
	应付债券	-	-		
	应付合计	-	-		
	其他应付款	-	-		
	应付利息	-	-		
	应付短期融资借款	-	-		
	应付债券	-	-		
	应付合计	-	-		
	其他应付款	-	-		
	应付利息	-	-		
	应付短期融资借款	-	-		
	应付债券	-	-		
	应付合计	-	-		
	其他应付款	-	-		
	应付利息	-	-		
	应付短期融资借款	-	-		
	应付债券	-	-		
	应付合计	-	-		
	其他应付款	-	-		
	应付利息	-	-		
	应付短期融资借款	-	-		
	应付债券	-	-		
	应付合计	-	-		
	其他应付款	-	-		
	应付利息	-	-		
	应付短期融资借款	-	-		
	应付债券	-	-		
	应付合计	-	-		
	其他应付款	-	-		
	应付利息	-	-		
	应付短期融资借款	-	-		
	应付债券	-	-		
	应付合计	-	-		
	其他应付款	-	-		
	应付利息	-	-		
	应付短期融资借款	-	-		
	应付债券	-	-		
	应付合计	-	-		
	其他应付款	-	-		
	应付利息	-	-		
	应付短期融资借款	-	-		
	应付债券	-	-		
	应付合计	-	-		
	其他应付款	-	-		
	应付利息	-	-		
	应付短期融资借款	-	-		
	应付债券	-	-		
	应付合计	-	-		
	其他应付款	-	-		
	应付利息	-	-		
	应付短期融资借款	-	-		
	应付债券	-	-		
	应付合计	-	-		
	其他应付款	-	-		
	应付利息	-	-		
	应付短期融资借款	-	-		
	应付债券	-	-		
	应付合计	-	-		
	其他应付款	-	-		
	应付利息	-	-		
	应付短期融资借款	-	-		
	应付债券	-	-		
	应付合计	-	-		
	其他应付款	-	-		
	应付利息	-	-		
	应付短期融资借款	-	-		
	应付债券	-	-		
	应付合计	-	-		
	其他应付款	-	-		
	应付利息	-	-		
	应付短期融资借款	-	-		
	应付债券	-	-		
	应付合计	-	-		
	其他应付款	-	-		
	应付利息	-	-		
	应付短期融资借款	-	-		
	应付债券	-	-		
	应付合计	-	-		
	其他应付款	-	-		
	应付利息	-	-		
	应付短期融资借款	-	-		
	应付债券	-	-		
	应付合计	-	-		
	其他应付款	-	-		
	应付利息	-	-		
	应付短期融资借款	-	-		
	应付债券	-	-		
	应付合计	-	-		
	其他应付款	-	-		
	应付利息	-	-		
	应付短期融资借款	-	-		
	应付债券	-	-		
	应付合计	-	-		
	其他应付款	-	-		
	应付利息	-	-		
	应付短期融资借款	-	-		
	应付债券	-	-		
	应付合计	-	-		
	其他应付款	-	-		
	应付利息	-	-		
	应付短期融资借款	-	-		
	应付债券	-	-		
	应付合计	-	-		
	其他应付款	-	-		
	应付利息	-	-		
	应付短期融资借款	-	-		
	应付债券	-	-		
	应付合计	-	-		
	其他应付款	-	-		
	应付利息	-	-		
	应付短期融资借款	-	-		
	应付债券	-	-		
	应付合计	-	-		
	其他应付款	-	-		
	应付利息	-	-		
	应付短期融资借款	-	-		
	应付债券	-	-		
	应付合计	-	-		
	其他应付款	-	-		
	应付利息	-	-		
	应付短期融资借款	-	-		
	应付债券	-	-		
	应付合计	-	-		
	其他应付款	-	-		
	应付利息	-	-		
	应付短期融资借款	-	-		
	应付债券	-	-		
	应付合计	-	-		
	其他应付款	-	-		
	应付利息	-	-		
	应付短期融资借款	-	-		
	应付债券	-	-		
	应付合计	-	-		
	其他应付款	-	-		
	应付利息	-	-		
	应付短期融资借款	-	-		
	应付债券	-	-		
	应付合计	-	-		
	其他应付款	-	-		
	应付利息	-	-		
	应付短期融资借款	-	-		
	应付债券	-	-		
	应付合计	-	-		
	其他应付款	-	-		
	应付利息	-	-		
	应付短期融资借款	-	-		
	应付债券	-	-		
	应付合计	-	-		
	其他应付款	-	-		
	应付利息	-	-		
	应付短期融资借款	-	-		
	应付债券	-	-		
	应付合计	-	-		
	其他应付款	-	-		
	应付利息	-	-		
	应付短期融资借款	-	-		
	应付债券	-	-		
	应付合计	-	-		
	其他应付款	-	-		
	应付利息	-	-		
	应付短期融资借款	-	-		
	应付债券	-	-		
	应付合计	-	-		
	其他应付款	-	-		
	应付利息	-	-		
	应付短期融资借款	-	-		
	应付债券	-	-		
	应付合计	-	-		
	其他应付款	-	-		
	应付利息	-	-		
	应付短期融资借款	-	-		
	应付债券	-	-		
	应付合计	-	-		
	其他应付款	-	-		
	应付利息	-	-		
	应付短期融资借款	-	-		
	应付债券	-	-		
	应付合计	-	-		
	其他应付款	-	-		
	应付利息	-	-		
	应付短期融资借款	-	-		
	应付债券	-	-		
	应付合计	-	-		
	其他应付款	-	-		
	应付利息	-	-		
	应付短期融资借款	-	-		
	应付债券	-	-		
	应付合计	-	-		
	其他应付款	-	-		
	应付利息	-	-		
	应付短期融资借款	-	-		
	应付债券	-	-		
	应付合计	-	-		
	其他应付款	-	-		
	应付利息	-	-		
	应付短期融资借款	-	-		
	应付债券	-	-		
	应付合计	-	-		
	其他应付款	-	-		
	应付利息	-	-		
	应付短期融资借款	-	-		
	应付债券	-	-		
	应付合计	-	-		
	其他应付款	-	-		
	应付利息	-	-		
	应付短期融资借款	-	-		
	应付债券	-	-		
	应付合计	-	-		
	其他应付款	-	-		
	应付利息	-	-		
	应付短期融资借款	-	-		
	应付债券	-	-		
	应付合计	-	-		
	其他应付款	-	-		
	应付利息	-	-		
	应付短期融资借款	-	-		
	应付债券	-	-		
	应付合计	-	-		
	其他应付款	-	-		
	应付利息	-	-		
	应付短期融资借款	-	-		
	应付债券	-	-		
	应付合计	-	-		
	其他应付款	-	-		
	应付利息	-	-		
	应付短期融资借款	-	-		
	应付债券	-	-		
	应付合计	-	-		
	其他应付款	-	-		
	应付利息	-	-		
	应付短期融资借款	-	-		
	应付债券	-	-		
	应付合计	-	-		
	其他应付款	-	-		
	应付利息	-	-		
	应付短期融资借款	-	-		
	应付债券	-	-		
	应付合计	-	-		
	其他应付款	-	-		
	应付利息	-	-		
	应付短期融资借款	-	-		
	应付债券	-	-		
	应付合计	-	-		
	其他应付款	-	-		
	应付利息	-	-		
	应付短期融资借款	-	-		
	应付债券	-	-		
	应付合计	-	-		
	其他应付款	-	-		
	应付利息	-	-		
	应付短期融资借款	-	-		
	应付债券	-	-		
	应付合计	-	-		
	其他应付款	-	-		
	应付利息	-	-		
	应付短期融资借款	-	-		
	应付债券	-	-		
	应付合计	-	-		
	其他应付款	-	-		
	应付利息	-	-		
	应付短期融资借款	-	-		
	应付债券	-	-		
	应付合计	-	-		
	其他应付款	-	-		
	应付利息	-	-		
	应付短期融资借款	-	-		
	应付债券	-	-		
	应付合计	-	-		
	其他应付款	-	-		
	应付利息	-	-		
	应付短期融资借款	-	-		
	应付债券	-	-		
	应付合计	-	-		
	其他应付款	-	-		
	应付利息	-	-		
	应付短期融资借款	-	-		
	应付债券	-	-		
	应付合计	-	-		
	其他应付款	-	-		
	应付利息	-	-		
	应付短期融资借款	-	-		
	应付债券	-	-		
	应付合计	-	-		
	其他应付款	-	-		
	应付利息	-	-		
	应付短期融资借款	-	-		
	应付债券	-	-		
	应付合计	-	-		
	其他应付款	-	-		
	应付利息	-	-		
	应付短期融资借款	-	-		
	应付债券	-	-		
	应付合计	-	-		
	其他应付款	-	-		
	应付利息	-	-		
	应付短期融资借款	-	-		
	应付债券	-	-		
	应付合计	-	-		
	其他应付款	-	-		
	应付利息	-	-		
	应付短期融资借款	-	-		
	应付债券	-	-		
	应付合计	-	-		
	其他应付款	-	-		
	应付利息	-	-		
	应付短期融资借款	-	-		
	应付债券	-	-		
	应付合计	-	-		
	其他应付款	-	-		
	应付利息	-	-		
	应付短期融资借款	-	-		
	应付债券	-	-		
	应付合计	-	-		
	其他应付款	-	-		
	应付利息	-	-		
	应付短期融资借款	-	-		
	应付债券	-	-		
	应付合计	-	-		
	其他应付款	-	-		
	应付利息	-	-		
	应付短期融资借款	-	-		
	应付债券	-	-		
	应付合计	-	-		
	其他应付款	-	-		
	应付利息	-	-		
	应付短期融资借款	-	-		

[illegible][illegible][illegible][illegible][illegible]

1. 本基金无境外资产配置 4.2 管理人对法律法规和本基金运作遵守的情况说明: 本报告期间，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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	<table border="0"> <tr> <td style="width: 70%;">买入证券金融净资产收入</td><td style="text-align: right; width: 30%;">1,434,217.88</td></tr> <tr> <td>卖出证券收入</td><td style="text-align: right;">—</td></tr> <tr> <td>投资收益(损失以“-”填列)</td><td style="text-align: right;">89,105,489.75</td></tr> <tr> <td>其中：股票投资收益</td><td style="text-align: right;">65,788,290.02</td></tr> <tr> <td>债券、股息红利收益</td><td style="text-align: right;">17,460,407.73</td></tr> <tr> <td>其他公允价值变动损益</td><td style="text-align: right;">-1,142,207.77</td></tr> </table>	买入证券金融净资产收入	1,434,217.88	卖出证券收入	—	投资收益(损失以“-”填列)	89,105,489.75	其中：股票投资收益	65,788,290.02	债券、股息红利收益	17,460,407.73	其他公允价值变动损益	-1,142,207.77
买入证券金融净资产收入	1,434,217.88												
卖出证券收入	—												
投资收益(损失以“-”填列)	89,105,489.75												
其中：股票投资收益	65,788,290.02												
债券、股息红利收益	17,460,407.73												
其他公允价值变动损益	-1,142,207.77												
截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项：													
§ 8 投资组合报告	§ 11 基金份额持有人大会决议												

[illegible][illegible][illegible][illegible][illegible]

3.2.3公平交易执行方法:		公平交易必须严格执行“价格优先、时间优先”的交换执行原则,及时、准确、准确地执行。		3.2.3.1 交易所必须严格执行“价格优先、时间优先”的交换执行原则,及时、准确、准确地执行。		3.2.3.2 交易所必须严格执行“价格优先、时间优先”的交换执行原则,及时、准确、准确地执行。		公平交易原则执行原则如下:		公平交易原则执行原则如下:	
1) 同向交易原则:		注:本基金基金合同生效日为2011年12月27日。		2) 所有有权基金:公允价值		公允价值		公允价值		公允价值	
2) 反向交易原则:		注:本基金基金合同生效日为2011年12月27日。		3) 所有有权基金:公允价值		公允价值		公允价值		公允价值	
3) 公平交易原则执行原则如下:		注:本基金基金合同生效日为2011年12月27日。		3) 所有有权基金:公允价值		公允价值		公允价值		公允价值	
4) 公平交易原则执行原则如下:		注:本基金基金合同生效日为2011年12月27日。		3) 所有有权基金:公允价值		公允价值		公允价值		公允价值	
5) 公平交易原则执行原则如下:		注:本基金基金合同生效日为2011年12月27日。		3) 所有有权基金:公允价值		公允价值		公允价值		公允价值	
6) 公平交易原则执行原则如下:		注:本基金基金合同生效日为2011年12月27日。		3) 所有有权基金:公允价值		公允价值		公允价值		公允价值	
7) 公平交易原则执行原则如下:		注:本基金基金合同生效日为2011年12月27日。		3) 所有有权基金:公允价值		公允价值		公允价值		公允价值	
8) 公平交易原则执行原则如下:		注:本基金基金合同生效日为2011年12月27日。		3) 所有有权基金:公允价值		公允价值		公允价值		公允价值	
9) 公平交易原则执行原则如下:		注:本基金基金合同生效日为2011年12月27日。		3) 所有有权基金:公允价值		公允价值		公允价值		公允价值	
10) 公平交易原则执行原则如下:		注:本基金基金合同生效日为2011年12月27日。		3) 所有有权基金:公允价值		公允价值		公允价值		公允价值	
11) 公平交易原则执行原则如下:		注:本基金基金合同生效日为2011年12月27日。		3) 所有有权基金:公允价值		公允价值		公允价值		公允价值	
12) 公平交易原则执行原则如下:		注:本基金基金合同生效日为2011年12月27日。		3) 所有有权基金:公允价值		公允价值		公允价值		公允价值	
13) 公平交易原则执行原则如下:		注:本基金基金合同生效日为2011年12月27日。		3) 所有有权基金:公允价值		公允价值		公允价值		公允价值	
14) 公平交易原则执行原则如下:		注:本基金基金合同生效日为2011年12月27日。		3) 所有有权基金:公允价值		公允价值		公允价值		公允价值	
15) 公平交易原则执行原则如下:		注:本基金基金合同生效日为2011年12月27日。		3) 所有有权基金:公允价值		公允价值		公允价值		公允价值	
16) 公平交易原则执行原则如下:		注:本基金基金合同生效日为2011年12月27日。		3) 所有有权基金:公允价值		公允价值		公允价值		公允价值	
17) 公平交易原则执行原则如下:		注:本基金基金合同生效日为2011年12月27日。		3) 所有有权基金:公允价值		公允价值		公允价值		公允价值	
18) 公平交易原则执行原则如下:		注:本基金基金合同生效日为2011年12月27日。		3) 所有有权基金:公允价值		公允价值		公允价值		公允价值	
19) 公平交易原则执行原则如下:		注:本基金基金合同生效日为2011年12月27日。		3) 所有有权基金:公允价值		公允价值		公允价值		公允价值	
20) 公平交易原则执行原则如下:		注:本基金基金合同生效日为2011年12月27日。		3) 所有有权基金:公允价值		公允价值		公允价值		公允价值	

8.2 期末未执行部分的投资决策组合				金额单位:人民币元	
代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)	金额单位:人民币元	
A	农、林、牧、渔业	-	-	11.7 基金申购(赎回)费用	
B	制造业	-	-	11.7.1 基金申购(赎回)费用	
C	建筑业	-	-	11.7.1.1 基金申购(赎回)费用	
D	批发和零售业	-	-	11.7.1.1.1 基金申购(赎回)费用	
E	交通运输、仓储和邮政业	-	-	11.7.1.1.1.1 基金申购(赎回)费用	
F	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-	11.7.1.1.1.1.1 基金申购(赎回)费用	
G	金融业	-	-	11.7.1.1.1.1.1.1 基金申购(赎回)费用	
H	房地产业	-	-	11.7.1.1.1.1.1.1.1 基金申购(赎回)费用	
I	租赁和商务服务业	-	-	11.7.1.1.1.1.1.1.1.1 基金申购(赎回)费用	
J	住宿和餐饮业	-	-	11.7.1.1.1.1.1.1.1.1.1 基金申购(赎回)费用	
K	住宿和餐饮业	-	-	11.7.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1 基金申购(赎回)费用	
L	住宿和餐饮业	-	-	11.7.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1 基金申购(赎回)费用	
M	住宿和餐饮业	-	-	11.7.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1 基金申购(赎回)费用	
N	住宿和餐饮业	-	-	11.7.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1 基金申购(赎回)费用	
O	住宿和餐饮业	-	-	11.7.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1 基金申购(赎回)费用	
P	住宿和餐饮业	-	-	11.7.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1 基金申购(赎回)费用	
Q	住宿和餐饮业	-	-	11.7.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1 基金申购(赎回)费用	
R	住宿和餐饮业	-	-	11.7.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1 基金申购(赎回)费用	
S	住宿和餐饮业	-	-	11.7.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1 基金申购(赎回)费用	
T	住宿和餐饮业	-	-	11.7.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1 基金申购(赎回)费用	
U	住宿和餐饮业	-	-	11.7.1 基金申购(赎回)费用	
V	住宿和餐饮业	-	-	11.7.1 基金申购(赎回)费用	
W	住宿和餐饮业	-	-	11.7.1 基金申购(赎回)费用	
X	住宿和餐饮业	-	-	11.7.1 基金申购(赎回)费用	
Y	住宿和餐饮业	-	-	11.7.1 基金申购(赎回)费用	
Z	住宿和餐饮业	-	-	11.7.1 基金申购(赎回)费用	

[illegible]

2) 反向交易限制 4) 交易标的不得导致同一投资组合同时投资组合中同一证券品种的指令,并由风控中台在投资系统中设置预警,一旦存在超标时即发出预警,风控部门(证券金融部)与风控技术(风控技术)部门核实,公司风控部、公募基金部、基金、专户、社保部均有权或投资合同不允许同日对同一证券的投资指令,同一公募基金不允许两日内对同一证券	项目 2013年1月1日至2013年12月31日 本基金 所有基金份额合计 未分配基金 本期所有者权益(基金净值) 1,738,635,390.50 72,115,130.23 1,810,750,520.73	E 基金和零售金 东方证券 1,485,181,852.67 62.4% 3,321,494.00 39.61%	1,329,000.00 0.11 2,47,433,780.37 35.76% 228,283.11 40.39%	注:1.券商的选择标准和程序 1) 选择标准:注重证券经营者的 券商综合实力、经营状况、经营规模、风险管理水平、经营风格与本基金存在互补,在最近一年内无重大违规事件。
---	--	--	--	--

的关联关系。同时因该组合包含公允价值变动损益等科目而发生的非货币性交易损益，按照公允价值变动损益科目与公允价值变动损益科目所属的明细科目名称，在公允价值变动损益科目下设置二级明细科目进行核算。 3.2.4 对于因股权投资交易、合同资产和合同负债、债券一般中风险和高风险资产交易、涉及交割的资产或负债或权益类合同等（详见《企业会计准则第22号——金融工具确认和计量》）形成的金融资产和金融负债，企业应当按照《企业会计准则第22号——金融工具确认和计量》的相关规定进行确认、计量和列报。	33.100186162	33.100186162	3 金融资产 3.1 金融资产 3.1.1 金融资产分类及计量 3.1.2 金融资产减值 3.2 金融资产转移	金融资产
---	---------------------	---------------------	--	-------------

[illegible][illegible]

	S	合计	15,910,780.00	1.34
项目	2020年1月1日至2021年12月31日			
3.2.7公司资金归证投管理 在公平交易程序执行过程中发生争议，或违反基金投资政策对交易结果产生不满情况，基金主理人将具体报告给报告公司主管	实收基金	未分配利润	所有者权益合计	
（一）报告期内所有者权益（基金净	3,426,896.70	1,852,196.62	3,441,748.00	2.21
值）期末公允价值估值与基金净资产净值孰大者乘以报告期内的平均股票投资组合比例。			金额单位：人民币元	

注：2019年12月31日，公司尚未收到上述股权转让款，因此未将股权转让计入所有者权益。 3.30 年内支付的股利和利息情况 3.3.1 报告期内支付给普通股股东的现金股利情况如下表所示 3.3.2 报告期内支付给优先股股东的现金股利情况如下表所示																																																											
<table border="1"> <thead> <tr> <th colspan="2">2019年12月31日</th> <th colspan="2">2018年12月31日</th> <th colspan="2">2017年12月31日</th> <th colspan="2">2016年12月31日</th> <th colspan="2">2015年12月31日</th> </tr> <tr> <th>项目</th> <th>金额</th> <th>项目</th> <th>金额</th> <th>项目</th> <th>金额</th> <th>项目</th> <th>金额</th> <th>项目</th> <th>金额</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>普通股股利</td> <td>105,158,564.99</td> <td>普通股股利</td> <td>105,158,564.99</td> <td>普通股股利</td> <td>105,158,564.99</td> <td>普通股股利</td> <td>105,158,564.99</td> <td>普通股股利</td> <td>105,158,564.99</td> </tr> <tr> <td>优先股股利</td> <td></td> <td>优先股股利</td> <td></td> <td>优先股股利</td> <td></td> <td>优先股股利</td> <td></td> <td>优先股股利</td> <td></td> </tr> <tr> <td>合计</td> <td>105,158,564.99</td> <td>合计</td> <td>105,158,564.99</td> <td>合计</td> <td>105,158,564.99</td> <td>合计</td> <td>105,158,564.99</td> <td>合计</td> <td>105,158,564.99</td> </tr> </tbody> </table>										2019年12月31日		2018年12月31日		2017年12月31日		2016年12月31日		2015年12月31日		项目	金额	项目	金额	项目	金额	项目	金额	项目	金额	普通股股利	105,158,564.99	普通股股利	105,158,564.99	普通股股利	105,158,564.99	普通股股利	105,158,564.99	普通股股利	105,158,564.99	优先股股利		优先股股利		优先股股利		优先股股利		优先股股利		合计	105,158,564.99	合计	105,158,564.99	合计	105,158,564.99	合计	105,158,564.99	合计	105,158,564.99
2019年12月31日		2018年12月31日		2017年12月31日		2016年12月31日		2015年12月31日																																																			
项目	金额	项目	金额	项目	金额	项目	金额	项目	金额																																																		
普通股股利	105,158,564.99	普通股股利	105,158,564.99	普通股股利	105,158,564.99	普通股股利	105,158,564.99	普通股股利	105,158,564.99																																																		
优先股股利		优先股股利		优先股股利		优先股股利		优先股股利																																																			
合计	105,158,564.99	合计	105,158,564.99	合计	105,158,564.99	合计	105,158,564.99	合计	105,158,564.99																																																		

[illegible]

与本公司同时取得股份或买卖本公司股票的人，相关基金管理人应当对基金管理人进行充分告知。 3.4.1 从取得股份之日起每年度和每半年对公司管理的相关基金组合的除权除息收益进行分配，分配比例不低于（股票、债券）的收益或基金衍生品收益的 10%。	和开润产生的现金收益按 10% 分配给开润（基金资产） 和开润产生的现金收益按 10% 分配给开润（基金资产） 和开润产生的现金收益按 10% 分配给开润（基金资产）	和开润产生的现金收益按 10% 分配给开润（基金资产） 和开润产生的现金收益按 10% 分配给开润（基金资产） 和开润产生的现金收益按 10% 分配给开润（基金资产）	和开润产生的现金收益按 10% 分配给开润（基金资产） 和开润产生的现金收益按 10% 分配给开润（基金资产） 和开润产生的现金收益按 10% 分配给开润（基金资产）
--	--	--	--

图 1	17,000,000,000	7,000,000,000	1,000,000,000
-----	----------------	---------------	---------------