

工银瑞信瑞利两年封闭式债券型证券投资基金 2017年年度报告摘要

2017年12月31日
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

重要提示
基金管理人承诺: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约定,于2018年3月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失或收益不受保证。

本报告自2017年5月24日(基金合同生效日)起至2017年12月31日止。

2.1 基金基本情况
基金名称:工银瑞信两年封闭债
基金代码:004392

2.2 基金产品说明
在严格控制风险的基础上,通过买入持有策略以及持有回购,追求基金资产在存续期内的长期增值。

2.3 基金管理人及基金托管人
名称:工银瑞信基金管理有限责任公司
基金管理人:招商银行股份有限公司

2.4 信息披露方式
基金年度报告正文及摘要刊登于基金管理人网站www.icbc.com.cn

3 主要财务数据、基金净值表现及利润分配情况
3.1 主要会计数据和财务指标
单位:人民币元

Table with 2 columns: 3.1.1 期间数据和指标, 3.1.2 本期金额, 3.1.3 上年同期金额

注:1. 本期财务报表审计范围仅限于本基金管理人管理的基金资产,审计机构为毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)。

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,无论是否均为资产负债表日的交易。

3.2 基金净值表现
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益的比较

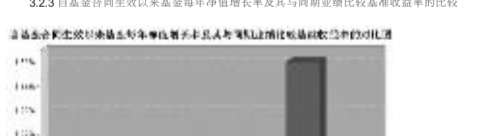
Table with 4 columns: 阶段, 净值增长率, 业绩比较基准收益, 超额收益

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,计入费用后实际投资水平要低于所列数字。

2. 本基金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,无论是否均为资产负债表日的交易。

3.2.2 基金净值表现
3.2.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益的比较



注:1. 本基金基金合同于2017年5月24日生效,截至报告期末,本基金基金合同生效不满一年。

2. 按基金合同约定,本基金建仓期为6个月,建仓期间,本基金的各项投资比例符合基金合同关于投资范围和比例限制的规定,债券资产占基金资产的比例不低于80%。

3. 2.2.2.1 基金净值表现
3.2.2.2 基金净值表现
3.2.2.3 基金净值表现

3.2.3 基金净值表现
3.2.3.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益的比较

注:1. 本基金基金合同于2017年5月24日生效,截至报告期末,本基金基金合同生效不满一年。

2. 按基金合同约定,本基金建仓期为6个月,建仓期间,本基金的各项投资比例符合基金合同关于投资范围和比例限制的规定,债券资产占基金资产的比例不低于80%。

3. 2.3.2.1 基金净值表现
3.2.3.2 基金净值表现
3.2.3.3 基金净值表现

3.2.4 基金净值表现
3.2.4.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益的比较

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期

基金管理人:工银瑞信基金管理有限责任公司
基金托管人:招商银行股份有限公司

基金管理人:工银瑞信基金管理有限责任公司
基金托管人:招商银行股份有限公司

基金管理人:工银瑞信基金管理有限责任公司
基金托管人:招商银行股份有限公司

基金管理人:工银瑞信基金管理有限责任公司
基金托管人:招商银行股份有限公司

基金管理人:工银瑞信基金管理有限责任公司
基金托管人:招商银行股份有限公司

基金管理人:工银瑞信基金管理有限责任公司
基金托管人:招商银行股份有限公司

基金管理人:工银瑞信基金管理有限责任公司
基金托管人:招商银行股份有限公司

基金管理人:工银瑞信基金管理有限责任公司
基金托管人:招商银行股份有限公司

基金管理人:工银瑞信基金管理有限责任公司
基金托管人:招商银行股份有限公司

基金管理人:工银瑞信基金管理有限责任公司
基金托管人:招商银行股份有限公司

基金管理人:工银瑞信基金管理有限责任公司
基金托管人:招商银行股份有限公司

基金管理人:工银瑞信基金管理有限责任公司
基金托管人:招商银行股份有限公司

基金管理人:工银瑞信基金管理有限责任公司
基金托管人:招商银行股份有限公司

基金管理人:工银瑞信基金管理有限责任公司
基金托管人:招商银行股份有限公司

基金管理人:工银瑞信基金管理有限责任公司
基金托管人:招商银行股份有限公司

基金管理人:工银瑞信基金管理有限责任公司
基金托管人:招商银行股份有限公司

基金管理人:工银瑞信基金管理有限责任公司
基金托管人:招商银行股份有限公司

基金管理人:工银瑞信基金管理有限责任公司
基金托管人:招商银行股份有限公司

基金管理人:工银瑞信基金管理有限责任公司
基金托管人:招商银行股份有限公司

基金管理人:工银瑞信基金管理有限责任公司
基金托管人:招商银行股份有限公司

基金管理人:工银瑞信基金管理有限责任公司
基金托管人:招商银行股份有限公司

基金管理人:工银瑞信基金管理有限责任公司
基金托管人:招商银行股份有限公司

基金管理人:工银瑞信基金管理有限责任公司
基金托管人:招商银行股份有限公司

审计报告标题:审计报告
审计对象:工银瑞信两年封闭式债券型证券投资基金基金份额持有人

审计意见:我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和财务报表编制基础的规定编制,在所有重大方面公允反映了工银瑞信两年封闭式债券型证券投资基金2017年12月31日的财务状况和所有者权益(净资产)变动及财务业绩。

形成审计意见的基础:我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作,审计师保持了应有的职业谨慎,获取了充分、适当的审计证据,为发表审计意见提供了合理的基础。

关键事项:无
其他事项:无

管理层的责任和财务报告的编制:管理层负责按照企业会计准则和财务报表编制基础的规定编制财务报表,并负责设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报或漏报。

注册会计师的责任:注册会计师的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。注册会计师不对财务报表的编制负责,也不对财务报表的编制提供任何保证。

注册会计师的独立性:本会计师事务所及注册会计师均符合中国注册会计师职业道德守则的要求,保持了独立性,并履行了职业道德守则规定的各项义务。

注册会计师的审计范围:本会计师事务所及注册会计师按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作,审计师保持了应有的职业谨慎,获取了充分、适当的审计证据,为发表审计意见提供了合理的基础。

注册会计师的审计意见:我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和财务报表编制基础的规定编制,在所有重大方面公允反映了工银瑞信两年封闭式债券型证券投资基金2017年12月31日的财务状况和所有者权益(净资产)变动及财务业绩。

注册会计师的审计意见:我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和财务报表编制基础的规定编制,在所有重大方面公允反映了工银瑞信两年封闭式债券型证券投资基金2017年12月31日的财务状况和所有者权益(净资产)变动及财务业绩。

注册会计师的审计意见:我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和财务报表编制基础的规定编制,在所有重大方面公允反映了工银瑞信两年封闭式债券型证券投资基金2017年12月31日的财务状况和所有者权益(净资产)变动及财务业绩。

注册会计师的审计意见:我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和财务报表编制基础的规定编制,在所有重大方面公允反映了工银瑞信两年封闭式债券型证券投资基金2017年12月31日的财务状况和所有者权益(净资产)变动及财务业绩。

注册会计师的审计意见:我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和财务报表编制基础的规定编制,在所有重大方面公允反映了工银瑞信两年封闭式债券型证券投资基金2017年12月31日的财务状况和所有者权益(净资产)变动及财务业绩。

注册会计师的审计意见:我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和财务报表编制基础的规定编制,在所有重大方面公允反映了工银瑞信两年封闭式债券型证券投资基金2017年12月31日的财务状况和所有者权益(净资产)变动及财务业绩。

注册会计师的审计意见:我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和财务报表编制基础的规定编制,在所有重大方面公允反映了工银瑞信两年封闭式债券型证券投资基金2017年12月31日的财务状况和所有者权益(净资产)变动及财务业绩。

注册会计师的审计意见:我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和财务报表编制基础的规定编制,在所有重大方面公允反映了工银瑞信两年封闭式债券型证券投资基金2017年12月31日的财务状况和所有者权益(净资产)变动及财务业绩。

注册会计师的审计意见:我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和财务报表编制基础的规定编制,在所有重大方面公允反映了工银瑞信两年封闭式债券型证券投资基金2017年12月31日的财务状况和所有者权益(净资产)变动及财务业绩。

注册会计师的审计意见:我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和财务报表编制基础的规定编制,在所有重大方面公允反映了工银瑞信两年封闭式债券型证券投资基金2017年12月31日的财务状况和所有者权益(净资产)变动及财务业绩。

注册会计师的审计意见:我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和财务报表编制基础的规定编制,在所有重大方面公允反映了工银瑞信两年封闭式债券型证券投资基金2017年12月31日的财务状况和所有者权益(净资产)变动及财务业绩。

注册会计师的审计意见:我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和财务报表编制基础的规定编制,在所有重大方面公允反映了工银瑞信两年封闭式债券型证券投资基金2017年12月31日的财务状况和所有者权益(净资产)变动及财务业绩。

注册会计师的审计意见:我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和财务报表编制基础的规定编制,在所有重大方面公允反映了工银瑞信两年封闭式债券型证券投资基金2017年12月31日的财务状况和所有者权益(净资产)变动及财务业绩。

注册会计师的审计意见:我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和财务报表编制基础的规定编制,在所有重大方面公允反映了工银瑞信两年封闭式债券型证券投资基金2017年12月31日的财务状况和所有者权益(净资产)变动及财务业绩。

注册会计师的审计意见:我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和财务报表编制基础的规定编制,在所有重大方面公允反映了工银瑞信两年封闭式债券型证券投资基金2017年12月31日的财务状况和所有者权益(净资产)变动及财务业绩。

注册会计师的审计意见:我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和财务报表编制基础的规定编制,在所有重大方面公允反映了工银瑞信两年封闭式债券型证券投资基金2017年12月31日的财务状况和所有者权益(净资产)变动及财务业绩。

注册会计师的审计意见:我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和财务报表编制基础的规定编制,在所有重大方面公允反映了工银瑞信两年封闭式债券型证券投资基金2017年12月31日的财务状况和所有者权益(净资产)变动及财务业绩。

注册会计师的审计意见:我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和财务报表编制基础的规定编制,在所有重大方面公允反映了工银瑞信两年封闭式债券型证券投资基金2017年12月31日的财务状况和所有者权益(净资产)变动及财务业绩。

注册会计师的审计意见:我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和财务报表编制基础的规定编制,在所有重大方面公允反映了工银瑞信两年封闭式债券型证券投资基金2017年12月31日的财务状况和所有者权益(净资产)变动及财务业绩。

注册会计师的审计意见:我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和财务报表编制基础的规定编制,在所有重大方面公允反映了工银瑞信两年封闭式债券型证券投资基金2017年12月31日的财务状况和所有者权益(净资产)变动及财务业绩。

注册会计师的审计意见:我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和财务报表编制基础的规定编制,在所有重大方面公允反映了工银瑞信两年封闭式债券型证券投资基金2017年12月31日的财务状况和所有者权益(净资产)变动及财务业绩。

注册会计师的审计意见:我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和财务报表编制基础的规定编制,在所有重大方面公允反映了工银瑞信两年封闭式债券型证券投资基金2017年12月31日的财务状况和所有者权益(净资产)变动及财务业绩。

注册会计师的审计意见:我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和财务报表编制基础的规定编制,在所有重大方面公允反映了工银瑞信两年封闭式债券型证券投资基金2017年12月31日的财务状况和所有者权益(净资产)变动及财务业绩。

(1) 金融资产的分
金融资产在初始确认时分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产和持有至到期投资。金融资产的分类取决于企业管理金融资产的目的和持有金融资产的能力。

(2) 金融负债的分
金融负债在初始确认时分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。金融负债的分类取决于企业管理金融负债的目的和持有金融负债的能力。

(3) 金融资产和金融负债的计量
金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中,出售一项资产或转移一项负债所能收到的价格。

(4) 金融资产和金融负债的减值
金融资产和金融负债在资产负债表日存在减值迹象的,应当进行减值测试。减值测试应当按照成本计量和公允价值计量的孰低原则进行。

(5) 金融资产和金融负债的终止确认
金融资产和金融负债在满足下列条件时应当终止确认:收取该金融资产现金流量的合同权利终止,或者该金融资产已转移,且企业已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方。

(6) 金融资产和金融负债的公允价值
公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中,出售一项资产或转移一项负债所能收到的价格。公允价值计量分为第一层次、第二层次和第三层次。

(7) 金融资产和金融负债的减值
金融资产和金融负债在资产负债表日存在减值迹象的,应当进行减值测试。减值测试应当按照成本计量和公允价值计量的孰低原则进行。

(8) 金融资产和金融负债的终止确认
金融资产和金融负债在满足下列条件时应当终止确认:收取该金融资产现金流量的合同权利终止,或者该金融资产已转移,且企业已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方。

(9) 金融资产和金融负债的公允价值
公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中,出售一项资产或转移一项负债所能收到的价格。公允价值计量分为第一层次、第二层次和第三层次。

(10) 金融资产和金融负债的减值
金融资产和金融负债在资产负债表日存在减值迹象的,应当进行减值测试。减值测试应当按照成本计量和公允价值计量的孰低原则进行。

(11) 金融资产和金融负债的终止确认
金融资产和金融负债在满足下列条件时应当终止确认:收取该金融资产现金流量的合同权利终止,或者该金融资产已转移,且企业已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方。

(12) 金融资产和金融负债的公允价值
公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中,出售一项资产或转移一项负债所能收到的价格。公允价值计量分为第一层次、第二层次和第三层次。

(13) 金融资产和金融负债的减值
金融资产和金融负债在资产负债表日存在减值迹象的,应当进行减值测试。减值测试应当按照成本计量和公允价值计量的孰低原则进行。

(14) 金融资产和金融负债的终止确认
金融资产和金融负债在满足下列条件时应当终止确认:收取该金融资产现金流量的合同权利终止,或者该金融资产已转移,且企业已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方。

(15) 金融资产和金融负债的公允价值
公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中,出售一项资产或转移一项负债所能收到的价格。公允价值计量分为第一层次、第二层次和第三层次。

(16) 金融资产和金融负债的减值
金融资产和金融负债在资产负债表日存在减值迹象的,应当进行减值测试。减值测试应当按照成本计量和公允价值计量的孰低原则进行。

(17) 金融资产和金融负债的终止确认
金融资产和金融负债在满足下列条件时应当终止确认:收取该金融资产现金流量的合同权利终止,或者该金融资产已转移,且企业已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方。

(18) 金融资产和金融负债的公允价值
公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中,出售一项资产或转移一项负债所能收到的价格。公允价值计量分为第一层次、第二层次和第三层次。

(19) 金融资产和金融负债的减值
金融资产和金融负债在资产负债表日存在减值迹象的,应当进行减值测试。减值测试应当按照成本计量和公允价值计量的孰低原则进行。

(20) 金融资产和金融负债的终止确认
金融资产和金融负债在满足下列条件时应当终止确认:收取该金融资产现金流量的合同权利终止,或者该金融资产已转移,且企业已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方。

(21) 金融资产和金融负债的公允价值
公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中,出售一项资产或转移一项负债所能收到的价格。公允价值计量分为第一层次、第二层次和第三层次。

(22) 金融资产和金融负债的减值
金融资产和金融负债在资产负债表日存在减值迹象的,应当进行减值测试。减值测试应当按照成本计量和公允价值计量的孰低原则进行。

(23) 金融资产和金融负债的终止确认
金融资产和金融负债在满足下列条件时应当终止确认:收取该金融资产现金流量的合同权利终止,或者该金融资产已转移,且企业已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方。

(24) 金融资产和金融负债的公允价值
公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中,出售一项资产或转移一项负债所能收到的价格。公允价值计量分为第一层次、第二层次和第三层次。

(25) 金融资产和金融负债的减值
金融资产和金融负债在资产负债表日存在减值迹象的,应当进行减值测试。减值测试应当按照成本计量和公允价值计量的孰低原则进行。

(26) 金融资产和金融负债的终止确认
金融资产和金融负债在满足下列条件时应当终止确认:收取该金融资产现金流量的合同权利终止,或者该金融资产已转移,且企业已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方。

(27) 金融资产和金融负债的公允价值
公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中,出售一项资产或转移一项负债所能收到的价格。公允价值计量分为第一层次、第二层次和第三层次。

(28) 金融资产和金融负债的减值
金融资产和金融负债在资产负债表日存在减值迹象的,应当进行减值测试。减值测试应当按照成本计量和公允价值计量的孰低原则进行。

(29) 金融资产和金融负债的终止确认
金融资产和金融负债在满足下列条件时应当终止确认:收取该金融资产现金流量的合同权利终止,或者该金融资产已转移,且企业已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方。

(30) 金融资产和金融负债的公允价值
公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中,出售一项资产或转移一项负债所能收到的价格。公允价值计量分为第一层次、第二层次和第三层次。

(31) 金融资产和金融负债的减值
金融资产和金融负债在资产负债表日存在减值迹象的,应当进行减值测试。减值测试应当按照成本计量和公允价值计量的孰低原则进行。

注:由于四舍五入的原因,金额占资产总额的比例之和可能与实际略有差异。

8.2 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
本基金本报告期末未持有股票投资。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细
本基金本报告期末未持有债券投资。

8.4 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
本基金本报告期末未持有资产支持证券投资。

8.5 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证投资。

8.7 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指期货投资明细
本基金本报告期末未持有股指期货投资。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名国债期货投资明细
本基金本报告期末未持有国债期货投资。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名其他衍生品投资明细
本基金本报告期末未持有其他衍生品投资。

8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名其他衍生品投资明细
本基金本报告期末未持有其他衍生品投资。

8.11 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名其他衍生品投资明细
本基金本报告期末未持有其他衍生品投资。

8.12 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名其他衍生品投资明细
本基金本报告期末未持有其他衍生品投资。

8.13 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名其他衍生品投资明细
本基金本报告期末未持有其他衍生品投资。

8.14 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名其他衍生品投资明细
本基金本报告期末未持有其他衍生品投资。

8.15 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名其他衍生品投资明细
本基金本报告期末未持有其他衍生品投资。

8.16 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名其他衍生品投资明细
本基金本报告期末未持有其他衍生品投资。

8.17 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名其他衍生品投资明细
本基金本报告期末未持有其他衍生品投资。

8.18 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名其他衍生品投资明细
本基金本报告期末未持有其他衍生品投资。

8.19 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名其他衍生品投资明细
本基金本报告期末未持有其他衍生品投资。

8.20 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名其他衍生品投资明细
本基金本报告期末未持有其他衍生品投资。

8.21 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名其他衍生品投资明细
本基金本报告期末未持有其他衍生品投资。

8.22 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名其他衍生品投资明细
本基金本报告期末未持有其他衍生品投资。

8.23 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名其他衍生品投资明细
本基金本报告期末未持有其他衍生品投资。

8.24 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名其他衍生品投资明细
本基金本报告期末未持有其他衍生品投资。

8.25 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名其他衍生品投资明细
本基金本报告期末未持有其他衍生品投资。

8.26 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名其他衍生品投资明细
本基金本报告期末未持有其他衍生品投资。

8.27 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名其他衍生品投资明细
本基金本报告期末未持有其他衍生品投资。

8.28 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名其他衍生品投资明细
本基金本报告期末未持有其他衍生品投资。

8.29 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名其他衍生品投资明细
本基金本报告期末未持有其他衍生品投资。

8.30 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名其他衍生品投资明细
本基金本报告期末未持有其他衍生品投资。

8.31 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名其他衍生品投资明细
本基金本报告期末未持有其他衍生品投资。