

# 工银瑞信保本混合型证券投资基金 2017 年半年度报告

2017 年 6 月 30 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：二〇一七年八月二十五日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 21 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。

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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 其他指标.....	10
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	16
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	17
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	17
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>18</b>
6.1 资产负债表.....	18
6.2 利润表.....	19

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20
6.4 报表附注.....	21
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>40</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	43
7.6 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.....	44
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	44
7.8 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贵金属投资明细.....	44
7.9 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.....	44
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	45
7.12 投资组合报告附注.....	45
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>47</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	47
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	47
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>48</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>49</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	49
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	49
10.4 基金投资策略的改变.....	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	49
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	49
10.8 其他重大事件.....	51
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>53</b>

11.1 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 .....	53
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	53
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>54</b>
12.1 备查文件目录.....	54
12.2 存放地点.....	54
12.3 查阅方式.....	54

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	工银瑞信保本混合型证券投资基金	
基金简称	工银保本混合	
基金主代码	487016	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011 年 12 月 27 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	
报告期末基金份额总额	340,010,181.13 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	工银保本混合 A	工银保本混合 B
下属分级基金的交易代码:	487016	001428
报告期末下属分级基金的份额总额	340,010,181.13 份	-

### 2.2 基金产品说明

投资目标	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	运用投资组合保险技术，按照恒定比例投资组合保险机制（CPPI）对债券和股票等资产的投资比例进行动态调整，实现投资组合保值增值。
业绩比较基准	税后三年期银行定期存款利率。在本基金成立当年，上述“三年期定期存款利率”指《基金合同》生效当日中国人民银行公布并执行的三年期“金融机构人民币存款基准利率”。其后的每个自然年，“三年期定期存款利率”指当年第一个工作日中国人民银行公布并执行的三年期“金融机构人民币存款基准利率”。
风险收益特征	本基金为保本混合型基金产品，属证券投资基金中的低风险收益品种。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		工银瑞信基金管理有限公司	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	朱碧艳	张建春
	联系电话	400-811-9999	010-63639180
	电子邮箱	customerservice@icbccs.com.cn	zhangjianchun@cebbank.com
客户服务电话		400-811-9999	95595
传真		010-66583158	010-63639132

注册地址	北京市西城区金融大街 5 号、甲 5 号 6 层甲 5 号 601、甲 5 号 7 层甲 5 号 701、甲 5 号 8 层甲 5 号 801、甲 5 号 9 层甲 5 号 901	北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心
办公地址	北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 A 座 6-9 层	北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心
邮政编码	100033	100033
法定代表人	郭特华	唐双宁

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、证券时报、上海证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.icbccs.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	工银瑞信基金管理有限公司	北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 A 座 6-9 层
基金保证人	北京首创融资担保有限公司	北京市西城区闹市口大街 1 号院长安兴融中心 4 号楼 3 层

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	工银保本混合 A
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	5,093,859.70
本期利润	7,889,314.38
加权平均基金份额本期利润	0.0211
本期加权平均净值利润率	1.92%
本期基金份额净值增长率	1.92%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	97,119,335.62
期末可供分配基金份额利润	0.2856
期末基金资产净值	378,843,419.31
期末基金份额净值	1.114
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	34.46%

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。

4、本基金基金合同生效日为 2011 年 12 月 27 日。

5、本基金本报告期无 B 类份额。

### 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率的比较

工银保本混合 A

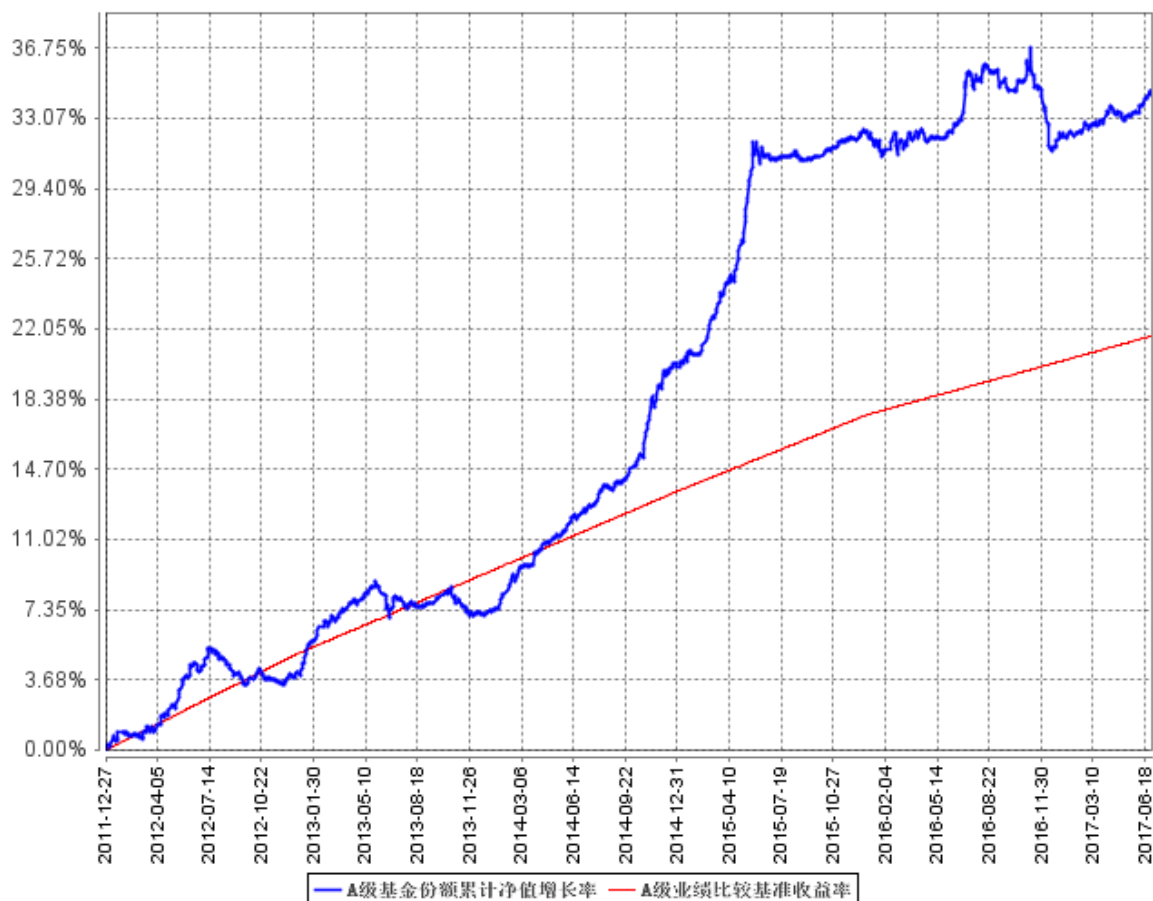
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.72%	0.08%	0.23%	0.01%	0.49%	0.07%



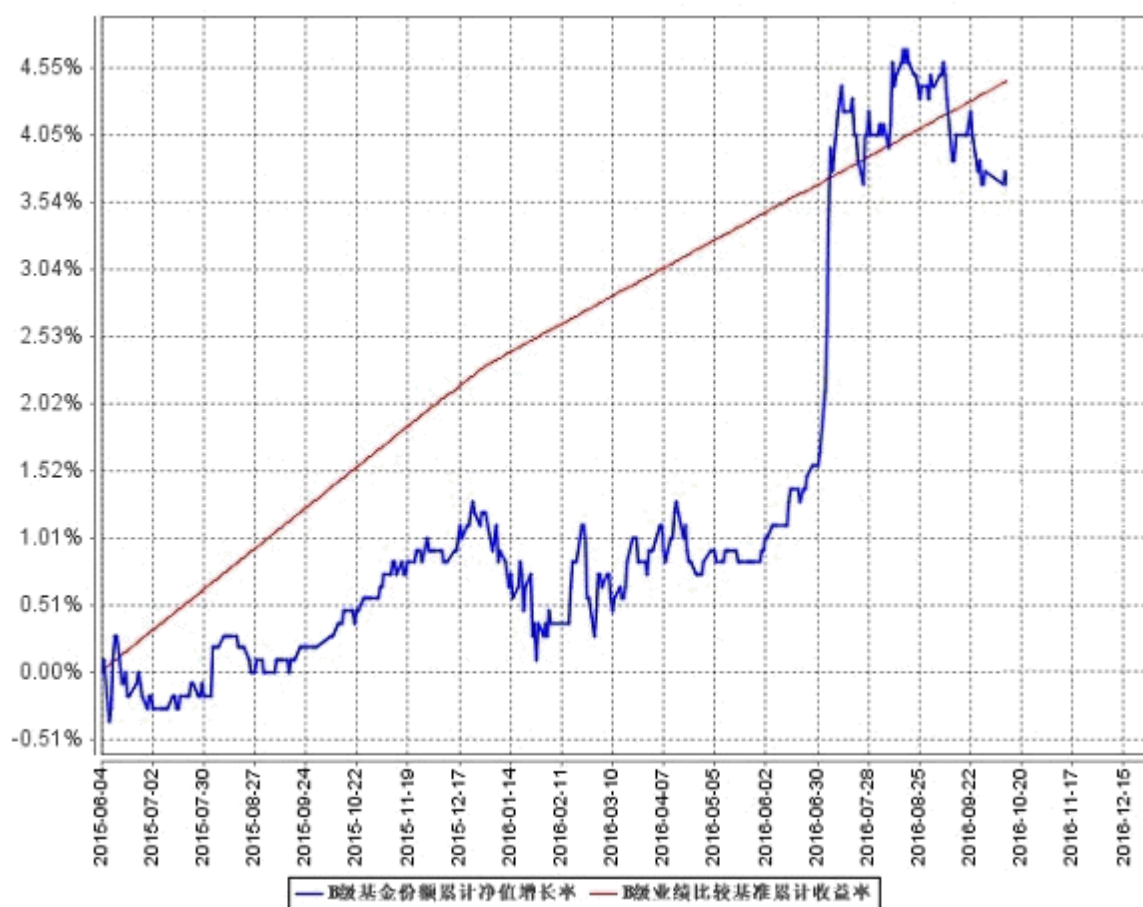
过去三个月	1.09%	0.08%	0.69%	0.01%	0.40%	0.07%
过去六个月	1.92%	0.08%	1.36%	0.01%	0.56%	0.07%
过去一年	1.09%	0.16%	2.75%	0.01%	-1.66%	0.15%
过去三年	19.52%	0.14%	10.26%	0.01%	9.26%	0.13%
自基金合同生效以来	34.46%	0.12%	21.67%	0.01%	12.79%	0.11%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



B级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2011 年 12 月 27 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，本基金的投资符合基金合同的相关规定：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%；现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。

### 3.3 其他指标

无。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为工银瑞信基金管理有限公司，成立于 2005 年 6 月，是我国第一家由银行直接发起设立并控股的合资基金管理公司。公司目前在北京、上海、深圳设有分公司，在香港和上海设有全资子公司——工银瑞信资产管理（国际）有限公司、工银瑞信投资管理有限公司。

公司（含子公司）拥有公募基金、特定资产管理、企业年金基金投资管理、全国社会保障基金境内外投资管理、基本养老保险基金证券投资管理、保险资产管理、企业年金养老金产品投资管理、QDII、QFII、RQFII 等多项业务资格。

截至 2017 年 6 月 30 日，公司旗下管理工银瑞信核心价值混合型证券投资基金、工银瑞信货币市场基金、工银瑞信 7 天理财债券型证券投资基金、工银瑞信增强收益债券型证券投资基金、工银瑞信金融地产股票型证券投资基金、工银瑞信医疗保健行业股票型证券投资基金、工银瑞信沪港深股票型证券投资基金、工银瑞信中国机会全球配置股票型证券投资基金、工银瑞信沪深 300 指数证券投资基金、深证红利交易型开放式指数证券投资基金、上证中央企业 50 交易型开放式指数证券投资基金等 110 只公募基金。

公司始终坚持“以稳健的投资管理，为客户提供卓越的理财服务”为使命，依托强大的股东背景、稳健的经营理念、科学的投研体系、严密的风控机制和资深的管理团队，立足市场化、专业化、规范化和国际化，坚持“稳健投资、价值投资、长期投资”，致力于为广大投资者提供一流的投资管理服务。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李敏	固定收益部副总监，本基金的基金经理	2015 年 5 月 26 日	-	10	先后在中国泛海控股集团担任投资经理，在中诚信国际信用评级有限责任公司担任高级分析师，在平安证券有限责任公司担任高级业务总监；2010 年加入工银瑞信，现任固定收益部副总监；2013 年

				<p>10月10日至今，担任工银信用纯债两年定期开放基金基金经理；2014年7月30日至2017年2月6日，担任工银保本2号混合型发起式基金(自2016年2月19日起，变更为工银瑞信优质精选混合型证券投资基金)基金经理；2015年5月26日至2017年4月26日，担任工银双债增强债券型基金(自2016年9月26日起，变更为工银瑞信双债增强债券型证券投资基金(LOF))基金经理；2015年5月26日至今，担任工银保本混合型基金经理；2016年10月27日至今，担任工银瑞信恒丰纯债债券型证券投资基金基金经理；2016年11月15日至今，担任工银瑞信恒泰纯债债券型证券投资基金基金经理；2016年11月22日至今，担任工银瑞信新得益混合型证券投资基金基金经理；2016年12月7日至今，担任工银瑞信新得润混合型证券投资基金基金经理；2016年12月29日至今，担任工银瑞信新增利混合型证券投资基金基金经理；2016年12月29日至今，担任工银瑞信新增益混合型证券投资基金基金经理；2016年12月29日至今，担任工银瑞信银和利混合型证券投资基金基金经理；2016年12月29日至今，担任工银瑞信新生利混合型证券投资基金基金经理；2017年3月23日至今，</p>
--	--	--	--	---

					担任工银瑞信新得利混合型证券投资基金基金经理；2017年5月24日至今，担任工银瑞信瑞利两年封闭式债券型证券投资基金基金经理。
欧阳凯	固定收益投资总监，本基金的基金经理。	2011年12月27日	2017年4月21日	15	曾任中海基金管理有限公司基金经理；2010年加入工银瑞信，现任固定收益投资总监。2010年8月16日至今，担任工银双利债券型基金基金经理，2011年12月27日至2017年4月21日担任工银保本混合基金基金经理，2013年2月7日至2017年2月6日担任工银保本2号混合型发起式基金（自2016年2月19日起变更为工银瑞信优质精选混合型证券投资基金）基金经理，2013年6月26日起至今担任工银瑞信保本3号混合型基金基金经理，2013年7月4日起至今担任工银信用纯债两年定期开放基金基金经理，2014年9月19日起至今担任工银新财富灵活配置混合型基金基金经理，2015年5月26日起至今担任工银丰盈回报灵活配置混合型基金基金经理。

注：1、任职日期为基金合同生效日或本基金管理人对外披露的任职日期；离职日期为本基金管理人对外披露的离职日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 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，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；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超过该证券当日成交量的 5% 的情况有 2 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，未导致不公平交易和利益输送。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 年上半年，房地产市场年初以来的旺销势头在严厉的政策打压下逐渐降温，全国商品房销售增速持续回落，一二线城市冷却，而三四线城市库存去化较好，短期内仍有一定的韧性。房地产投资具有一定的滞后性，仍处于近年来的较高水平。部分地区的基建投资热情较高，也在一定程度上拉动了需求。中游工程机械、重卡等行业的销售势头也持续超预期。海外主要经济体复苏态势明显，带动出口回暖。短期内经济仍处于景气期。供给侧改革继续推进，钢铁行业去产能力度较大，取缔地条钢等违规产能、并去化了低效产能，火电、电解铝等过剩行业也成为今年的重点，供给收缩和需求的相对稳定，使得中上游制造业盈利恢复，工业生产复苏。

下游消费需求相对平稳，PPI 越过高点，全年通胀压力不大。但近期原油和上游工业品再度涨价，农产品价格也有所上涨，需要关注因此可能对通胀预期带来的影响。

海外方面，欧美主要经济体复苏，美联储货币政策偏鹰，3 月加息后，预计年内还将再次加

息并缩表。欧央行也逐步收紧货币政策，全球流动性宽松的低利率环境正在改变。

国内货币政策中性，一方面通过加强金融监管抬升金融加杠杆的成本，倒逼金融领域去泡沫，另一方面也通过细致的公开市场操作维护资金面的稳定，避免金融强监管对实体经济造成较大的伤害。从二季度的融资数据来看，实体经济的融资需求稳定向好，而金融领域的杠杆正在逐步去化。货币政策取得去杠杆成效的同时，债券市场的利率抬升一定程度上也影响了实体企业的融资成本，后续政策将在控制杠杆的同时更注重引导利率下行。

在经济基本面较好、货币政策中性偏紧、金融监管政策频发的环境下，二季度债券市场收益率震荡上行。随着利率的上行，信用债发行量下降，债市呈现供需两弱格局。6月中旬资金面超预期缓解紧张后，债市一度反弹，但仍受制于较强的基本面和政策不确定性。权益市场整体震荡，结构分化明显，家电、白酒、电子等行业低估值稳健成长的蓝筹股涨幅较大，而中小创相对落后。

根据避险策略基金新规，本基金在报告期内增持同业存单，根据市场变化调整权益资产仓位，积极参与新股和可转债 IPO。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，保本混合 A 净值增长率为 1.92%，业绩比较基准收益率为 1.36%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，房地产市场热销的势头有所缓解，但过去几年的去库存使得房地产市场的库存已经降到相对较低的水平，房地产市场的周期下行速度和幅度都将较为平缓。另一方面，政策推动的供给侧改革仍在有效推进中，过剩行业的供需状况好转，周期复苏带来的需求和盈利恢复也使得制造业的投资开始反弹。本轮经济复苏的韧性较强，预计下半年经济走平。海外主要经济体复苏态势较好，全球央行退出宽松的步伐将延续。中国政策重心仍将保持中性，在去杠杆、防风险、稳增长中寻求平衡。

经历去年四季度至今年的大幅调整，在预期经济高位走平的情况下，预计债券收益率将以震荡为主，对后期经济下行的预期可能带动市场走牛。信用债有更好的持有价值，但信用质量的分化将继续。

在经济走平和货币政策中性的预期下，预计权益市场整体也将以震荡为主，但结构性分化明显，重业绩将是今年的主题。

本基金将保持债券中性久期，根据市场变化调整权益资产仓位，甄别个股。

## 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.6.1 参与估值流程各方及人员（或小组）的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

4.6.1.1 职责分工

（1）参与估值小组成员为 4 人，分别是公司运作部负责人、研究部负责人、风险管理部负责人和法律合规部负责人，组长由运作部负责人担任。

（2）各部门负责人也可推荐代表各部门参与估值小组的成员，如需更换，由相应部门负责人提出。小组成员需经运作部主管副总批准同意。

4.6.1.2 专业胜任能力及相关工作经历

小组由具有多年从事估值运作、证券行业研究、风险管理及熟悉业内法律法规的专家型人员组成。

4.6.2 基金经理参与或决定估值的程度

本公司基金经理参与讨论估值原则及方法，但不参与最终估值决策。

4.6.3 参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.6.4 已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

尚无已签约的任何定价服务。本基金所采用的估值流程及估值结果均已经过会计师事务所鉴证，并经托管银行复核确认。

## 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未实施利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

## 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国光大银行股份有限公司在工银瑞信保本混合型证券投资基金托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《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，依法安全保管了基金的全部资产，对工银瑞信保本混合型证券投资基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，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，对基金管理人——工银瑞信基金管理有限公司的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人——工银瑞信基金管理有限公司编制的《工银瑞信保本混合型证券投资基金 2017 年半年度报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确。

## §6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：工银瑞信保本混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	5,257,227.96	76,796,470.44
结算备付金		2,580,459.91	1,890,353.89
存出保证金		54,894.38	114,352.44
交易性金融资产	6.4.7.2	329,954,494.90	366,765,133.06
其中：股票投资		25,536,721.90	32,534,291.46
基金投资		-	-
债券投资		304,417,773.00	334,230,841.60
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	40,000,000.00	46,000,000.00
应收证券清算款		21,665.76	-
应收利息	6.4.7.5	4,777,438.94	4,380,432.78
应收股利		-	-
应收申购款		11,749.14	947.82
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		382,657,930.99	495,947,690.43
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2016 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	46,000,000.00
应付赎回款		237,339.37	1,281,569.03
应付管理人报酬		376,970.26	460,842.89
应付托管费		62,828.37	76,807.13
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	62,800.31	92,613.51

应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	3,074,573.37	3,174,019.96
负债合计		3,814,511.68	51,085,852.52
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	281,724,083.69	337,295,645.94
未分配利润	6.4.7.10	97,119,335.62	107,566,191.97
所有者权益合计		378,843,419.31	444,861,837.91
负债和所有者权益总计		382,657,930.99	495,947,690.43

注：1、本基金基金合同生效日为 2011 年 12 月 27 日。

2、报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额总额 340,010,181.13 份，其中 A 类基金份额净值为人民币 1.114 元，基金份额为 340,010,181.13 份；无 B 类基金份额。

## 6.2 利润表

会计主体：工银瑞信保本混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		11,208,812.09	42,694,859.70
1.利息收入		6,496,183.19	45,383,447.54
其中：存款利息收入	6.4.7.11	94,894.18	10,538,125.59
债券利息收入		6,101,562.32	16,901,041.64
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		299,726.69	17,944,280.31
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,752,304.59	12,784,587.38
其中：股票投资收益	6.4.7.12	2,559,776.88	5,470,797.92
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-866,108.29	7,059,075.17
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	58,636.00	254,714.29
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	2,795,454.68	-16,004,638.45

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	164,869.63	531,463.23
<b>减：二、费用</b>		3,319,497.71	28,200,320.03
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,453,357.90	22,156,175.36
2. 托管费	6.4.10.2.2	408,892.97	3,692,695.89
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	112,946.54	2,070,353.26
5. 利息支出		132,303.61	63,591.36
其中：卖出回购金融资产支出		132,303.61	63,591.36
6. 其他费用	6.4.7.20	211,996.69	217,504.16
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		7,889,314.38	14,494,539.67
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		7,889,314.38	14,494,539.67

注：本基金基金合同生效日为 2011 年 12 月 27 日。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：工银瑞信保本混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	337,295,645.94	107,566,191.97	444,861,837.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	7,889,314.38	7,889,314.38
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-55,571,562.25	-18,336,170.73	-73,907,732.98
其中：1. 基金申购款	3,909,546.85	1,290,467.54	5,200,014.39
2. 基金赎回款	-59,481,109.10	-19,626,638.27	-79,107,747.37

四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	281,724,083.69	97,119,335.62	378,843,419.31
项目	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	3,411,690,780.92	444,978,536.89	3,856,669,317.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	14,494,539.67	14,494,539.67
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-160,776,099.75	-35,393,332.11	-196,169,431.86
其中：1.基金申购款	7,518,396.62	2,417,154.05	9,935,550.67
2.基金赎回款	-168,294,496.37	-37,810,486.16	-206,104,982.53
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	3,250,914,681.17	424,079,744.45	3,674,994,425.62

注：本基金基金合同生效日为 2011 年 12 月 27 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

\_\_\_\_\_  
郭特华

基金管理人负责人

\_\_\_\_\_  
郝炜

主管会计工作负责人

\_\_\_\_\_  
朱辉毅

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

工银瑞信保本混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会

（以下简称“中国证监会”）证监许可[2011]1831号《关于核准工银瑞信保本混合型证券投资基金募集的批复》的批准，由工银瑞信基金管理有限公司向社会公开募集，基金合同于2011年12月27日正式生效，首次设立募集规模为3,429,896,705.59份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为和注册登记机构均为工银瑞信基金管理有限公司，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

本基金的投资范围包括具有良好流动性的企业债、公司债、短期融资券、中期票据、地方政府债、商业银行金融债与次级债、可转换债券（含分离交易的可转换债券）、资产支持证券、债券回购、国债、中央银行票据、政策性金融债、银行存款等固定收益类资产，股票（包括创业板、中小板或中国证监会核准的上市的股票）等权益类资产，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，但需符合中国证监会相关规定。法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金根据中国宏观经济情况和证券市场的阶段性变化，按照投资组合保险机制对安全资产（包括债券、货币市场工具等固定收益资产）和风险资产（股票、权证等权益资产）的投资比例进行动态调整。其中，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%；现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为：税后三年期银行定期存款利率。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第3号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年上半年的经营成果和净值变动情况。

### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的差错更正事项。

### 6.4.6 税项

#### 1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

#### 2. 营业税、增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，

金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

### 3. 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

### 4. 个人所得税



根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
活期存款	5,257,227.96
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	5,257,227.96

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动

股票		23,605,276.18	25,536,721.90	1,931,445.72
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	59,405,220.08	58,408,773.00	-996,447.08
	银行间市场	245,986,360.41	246,009,000.00	22,639.59
	合计	305,391,580.49	304,417,773.00	-973,807.49
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		328,996,856.67	329,954,494.90	957,638.23

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_交易所	40,000,000.00	-
合计	40,000,000.00	-

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本期末无买断式逆回购交易，也无在买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应收活期存款利息	1,102.55
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,161.30
应收债券利息	4,789,594.13
应收买入返售证券利息	-14,443.84
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-

其他	24.80
合计	4,777,438.94

注：“其他”为应收结算保证金利息。

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	61,825.31
银行间市场应付交易费用	975.00
合计	62,800.31

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	967.26
预提信息披露费	148,765.71
预提审计费	44,630.98
应缴债券利息税	2,870,909.42
预提账户维护费	9,300.00
合计	3,074,573.37

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

工银保本混合 A		
项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	407,079,888.16	337,295,645.94
本期申购	4,717,934.68	3,909,546.85
本期赎回(以“-”号填列)	-71,787,641.71	-59,481,109.10
本期末	340,010,181.13	281,724,083.69

注：“本期申购”中包含红利再投、转入份额及金额，“本期赎回”中包含转出份额及金额。

**6.4.7.10 未分配利润**

单位：人民币元

工银保本混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	116,823,806.76	-9,257,614.79	107,566,191.97
本期利润	5,093,859.70	2,795,454.68	7,889,314.38
本期基金份额交易产生的变动数	-19,650,986.84	1,314,816.11	-18,336,170.73
其中：基金申购款	1,380,998.69	-90,531.15	1,290,467.54
基金赎回款	-21,031,985.53	1,405,347.26	-19,626,638.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	102,266,679.62	-5,147,344.00	97,119,335.62

**6.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	79,783.58
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	14,655.17
其他	455.43
合计	94,894.18

注：“其他”为结算保证金利息收入。

**6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	42,041,060.23
减：卖出股票成本总额	39,481,283.35
买卖股票差价收入	2,559,776.88

**6.4.7.13 债券投资收益****6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-866,108.29
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-866,108.29

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	382,200,354.32
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	377,854,241.56
减：应收利息总额	5,212,221.05
买卖债券差价收入	-866,108.29

#### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

#### 6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

#### 6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期间无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期间无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

##### 6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无买卖权证差价收入。

##### 6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无其他衍生工具投资收益。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	58,636.00
基金投资产生的股利收益	-
合计	58,636.00

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	2,795,454.68
——股票投资	2,820,188.45
——债券投资	-24,733.77
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	2,795,454.68

**6.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	158,697.04
基金转换费收入	6,172.59
合计	164,869.63

**6.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	110,871.54
银行间市场交易费用	2,075.00

合计	112,946.54
----	------------

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	44,630.98
信息披露费	148,765.71
账户维护费	18,600.00
其他	-
合计	211,996.69

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
工银瑞信基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国光大银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
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

注：1、本报告期本基金关联方未发生变化。

2、以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

## 6.4.10.2 关联方报酬

### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6 月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,453,357.90	22,156,175.36
其中：支付销售机构的客户维护费	1,036,866.46	1,383,508.87

注：1. 在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

本基金年管理费率为 1.2%

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

2. 基金管理费每日计提，按月支付。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6 月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30 日
当期发生的基金应支付的托管费	408,892.97	3,692,695.89

注：1.  $H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ ，本基金年托管费率为 0.2%

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

2. 基金托管费每日计提，按月支付。

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期与上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的管理人在本报告期内与上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。



**6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

本基金除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末及上年度末均未投资本基金。

**6.4.10.5 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

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国光大银行股份有限公司	5,257,227.96	79,783.58	301,405,711.85	1,396,866.50

**6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金在本报告期和上年度可比期间内均未在承销期内参与关联方承销证券。

**6.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

无。

**6.4.11 利润分配情况**

本基金本报告期末未进行利润分配。

**6.4.12 期末（2017年6月30日）本基金持有的流通受限证券****6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

**6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

**6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

**6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人的风险管理机构由董事会下属的公司治理与风险控制委员会、督察长、公司风险管理委员会、法律合规部、风险管理部以及各个业务部门组成。

公司实行全面、系统的风险管理，风险管理覆盖公司所有战略环节、业务环节和操作环节。同时制定了系统化的风险管理程序，对风险管理的整个流程进行评估和改进。公司构建了分工明确、相互协作、彼此牵制的风险管理组织结构，形成了由四大防线共同筑成的风险管理体系：第一道防线由各个业务部门构成，各业务部门总监作为风险责任人，负责制订本部门的作业流程以及风险控制措施；第二道监控防线由公司专属风险管理部门法律合规部和风险管理部构成，法律合规部负责对公司业务的法律合规风险进行监控管理，风险管理部负责对公司投资管理风险和运作风险进行监控管理；第三道防线是由公司经营管理层和风险管理委员会构成，公司管理层通过执行委员会下的风险管理委员会对风险状况进行全面监督并及时制定相应的对策和实施监控措施；在上述这三道风险监控防线中，公司督察长和监察稽核人员对风险控制措施和合规风险情况进行全面检查、监督，并视所发生问题情节轻重及时反馈给各部门经理、公司总经理、公司治理与风险控制委员会、董事会、监管机构。督察长独立于公司其他业务部门和公司管理层，对内部控制制度的执行情况实行严格检查和及时反馈，并独立报告；第四道监控防线由董事会和公司治理与风险控制委员会构成，公司治理与风险控制委员会通过督察长和监察稽核人员的工作，掌握整体风险状况并进行决策。公司治理与风险控制委员会负责检查公司业务的内控制度的实施情况，监督公司对相关法律法规和公司制度的执行。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制可在可承受的范围内。

### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人

出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
A-1	-	20,058,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	205,973,000.00	68,333,000.00
合计	205,973,000.00	88,391,000.00

注：1、表中所列示的债券投资为短期融资券及超短期融资券，其中超短期融资券无信用评级。

2、上述评级均取自第三方评级机构的债项评级。

#### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
AAA	76,245,266.80	224,810,534.40
AAA 以下	2,271,506.20	21,029,307.20
未评级	-	-
合计	78,516,773.00	245,839,841.60

注：1、表中所列示的债券投资为除短期融资券以外的信用债券。

2、上述评级均取自第三方评级机构的债项评级。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金所持大部分证券为剩余期限较短、信誉良好的国债、企业债及央行票据等，除在证券交易所的债券回购交易及返售交易，其余均在银行间同业市场交易，均能够及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般

不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。 本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金主要投资于债券市场，因此本基金的收入及经营活动的现金流量受到市场利率变化的影响。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017年6月30 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	5,257,227.96	-	-	-	-	-	5,257,227.96
结算备付金	2,580,459.91	-	-	-	-	-	2,580,459.91
存出保证金	54,894.38	-	-	-	-	-	54,894.38
交易性金融资产	1,999,400.00	150,335,000.00	101,378,590.00	50,704,783.00	-	25,536,721.90	329,954,494.90
买入返售金融资产	40,000,000.00	-	-	-	-	-	40,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	21,665.76	21,665.76
应收利息	-	-	-	-	-	4,777,438.94	4,777,438.94
应收申购款	-	-	-	-	-	11,749.14	11,749.14
资产总计	49,891,982.25	150,335,000.00	101,378,590.00	50,704,783.00	-	30,347,575.74	382,657,930.99

负债							
应付赎回款						237,339.37	237,339.37
应付管理人报酬						376,970.26	376,970.26
应付托管费						62,828.37	62,828.37
应付交易费用						62,800.31	62,800.31
其他负债						3,074,573.37	3,074,573.37
负债总计						3,814,511.68	3,814,511.68
利率敏感度缺口	49,891,982.25	150,335,000.00	101,378,590.00	50,704,783.00		26,533,064.06	378,843,419.31
上年度末 2016 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	76,796,470.44						76,796,470.44
结算备付金	1,890,353.89						1,890,353.89
存出保证金	114,352.44						114,352.44
交易性金融资产		24,072,006.00	101,203,310.00	199,494,955.20	9,460,570.40	32,534,291.46	366,765,133.06
买入返售金融资产	46,000,000.00						46,000,000.00
应收利息						4,380,432.78	4,380,432.78
应收申购款						947.82	947.82
资产总计	124,801,176.77	24,072,006.00	101,203,310.00	199,494,955.20	9,460,570.40	36,915,672.06	495,947,690.43
负债							
应付证券清算款						46,000,000.00	46,000,000.00
应付赎回款						1,281,569.03	1,281,569.03
应付管理人报酬						460,842.89	460,842.89
应付托管费						76,807.13	76,807.13
应付交易费用						92,613.51	92,613.51
其他负债						3,174,019.96	3,174,019.96
负债总计						51,085,852.52	51,085,852.52
利率敏感度缺口	124,801,176.77	24,072,006.00	101,203,310.00	199,494,955.20	9,460,570.40	-14,170,180.46	444,861,837.91

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析基于本基金报表日的利率风险状况；	
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他变量不变；	
	此项影响并未考虑管理层为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2017 年 6 月 30 日） 上年度末（2016 年 12 月 31 日）

利率增加 25 基准点	-396,356.95	-1,565,049.35
利率减少 25 基准点	398,637.50	1,579,876.48

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

无。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产—股票投资	25,536,721.90	6.74	32,534,291.46	7.31
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	304,417,773.00	80.35	334,230,841.60	75.13
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	329,954,494.90	87.10	366,765,133.06	82.44

注：1、本基金投资于债券、债券回购、银行存款等安全资产占基金资产的比例不低于基金资产的 60%，投资于股票等风险资产的比例不超过基金资产的 40%，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%。

2、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。

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末主要投资于债券，因此除市场利率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### **6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险**

无。

#### **6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## §7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	25,536,721.90	6.67
	其中：股票	25,536,721.90	6.67
2	固定收益投资	304,417,773.00	79.55
	其中：债券	304,417,773.00	79.55
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	40,000,000.00	10.45
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	7,837,687.87	2.05
7	其他各项资产	4,865,748.22	1.27
8	合计	382,657,930.99	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。

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	782,000.00	0.21
C	制造业	13,507,878.90	3.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	-	-
J	金融业	8,046,043.00	2.12
K	房地产业	-	-



L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,505,600.00	0.40
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	1,695,200.00	0.45
S	综合	-	-
	合计	25,536,721.90	6.74

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。

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002456	欧菲光	134,750	2,448,407.50	0.65
2	603898	好莱客	54,000	1,887,300.00	0.50
3	600079	人福医药	93,900	1,842,318.00	0.49
4	600872	中炬高新	100,000	1,830,000.00	0.48
5	601688	华泰证券	100,000	1,790,000.00	0.47
6	601009	南京银行	158,900	1,781,269.00	0.47
7	002078	太阳纸业	239,944	1,763,588.40	0.47
8	600109	国金证券	135,200	1,584,544.00	0.42
9	002241	歌尔股份	80,000	1,542,400.00	0.41
10	002573	清新环境	80,000	1,505,600.00	0.40
11	000651	格力电器	34,500	1,420,365.00	0.37
12	601336	新华保险	24,000	1,233,600.00	0.33
13	601601	中国太保	29,000	982,230.00	0.26
14	300426	唐德影视	40,000	946,400.00	0.25
15	601699	潞安环能	100,000	782,000.00	0.21
16	002202	金风科技	50,000	773,500.00	0.20
17	600977	中国电影	40,000	748,800.00	0.20
18	601166	兴业银行	40,000	674,400.00	0.18

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

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	601336	新华保险	2,663,406.00	0.60
2	603898	好莱客	1,799,772.00	0.40
3	601998	中信银行	1,778,800.00	0.40
4	002202	金风科技	1,768,126.00	0.40
5	002456	欧菲光	1,757,615.22	0.40
6	601009	南京银行	1,741,192.00	0.39
7	002078	太阳纸业	1,733,429.12	0.39
8	601601	中国太保	1,615,460.00	0.36
9	002573	清新环境	1,482,872.00	0.33
10	600079	人福医药	1,062,326.00	0.24
11	300426	唐德影视	1,027,831.00	0.23
12	601688	华泰证券	888,648.00	0.20
13	600487	亨通光电	888,520.00	0.20
14	600109	国金证券	888,384.00	0.20
15	600489	中金黄金	887,922.00	0.20
16	002271	东方雨虹	881,677.00	0.20
17	000333	美的集团	880,476.00	0.20
18	002470	金正大	879,269.00	0.20
19	000651	格力电器	878,871.00	0.20
20	600977	中国电影	767,098.00	0.17

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票；

2、买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600489	中金黄金	6,884,036.57	1.55
2	600487	亨通光电	5,383,993.00	1.21

3	600104	上汽集团	3,227,773.94	0.73
4	600872	中炬高新	2,472,252.31	0.56
5	600340	华夏幸福	2,247,190.00	0.51
6	600498	烽火通信	1,947,302.72	0.44
7	600352	浙江龙盛	1,939,918.00	0.44
8	601336	新华保险	1,777,220.00	0.40
9	601998	中信银行	1,597,400.00	0.36
10	002475	立讯精密	1,506,686.00	0.34
11	002271	东方雨虹	1,190,706.00	0.27
12	300336	新文化	1,131,203.00	0.25
13	600373	中文传媒	1,101,535.84	0.25
14	000333	美的集团	1,074,566.00	0.24
15	002714	牧原股份	1,056,164.00	0.24
16	601688	华泰证券	1,055,511.82	0.24
17	002202	金风科技	951,476.00	0.21
18	601601	中国太保	923,070.00	0.21
19	002470	金正大	879,410.00	0.20
20	002739	万达电影	795,075.30	0.18

注：1、卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票；  
2、卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	29,663,525.34
卖出股票收入（成交）总额	42,041,060.23

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	19,928,000.00	5.26
	其中：政策性金融债	19,928,000.00	5.26
4	企业债券	53,089,670.00	14.01

5	企业短期融资券	20,010,000.00	5.28
6	中期票据	20,108,000.00	5.31
7	可转债（可交换债）	5,319,103.00	1.40
8	同业存单	185,963,000.00	49.09
9	其他	-	-
10	合计	304,417,773.00	80.35

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。

## 7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	111710268	17 兴业银行 CD268	500,000	49,445,000.00	13.05
2	111708047	17 中信银行 CD047	500,000	48,950,000.00	12.92
3	111707071	17 招商银行 CD071	500,000	48,940,000.00	12.92
4	111609436	16 浦发 CD436	400,000	38,628,000.00	10.20
5	122366	14 武钢债	300,000	30,006,000.00	7.92

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

## 7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

## 7.9 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。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 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。

### 7.10.2 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。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 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。

### 7.11.2 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。

### 7.11.3 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。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 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：

本报告期，本基金持有华泰证券，其发行主体（以下简称“该公司”）因对于杭州恒生网络技术服务有限公司和浙江核新同花顺网络信息股份有限公司外部接入的第三方交易终端软件，或者未进行软件认证许可，或者缺乏有效控制，未对外部系统接入实施有效管理，对相关客户身份信息缺乏了解，违反了《中国证券登记结算有限责任公司证券账户管理规则》、《证券公司监督管理条例》等规定，且性质恶劣、情节严重，被中国证监会责令改正，给予警告，没收违法所得，并处以罚款。

该公司因营业部及资产管理子公司分别利用同名微信公众号、官方网站向不特定对象公开推介私募资产管理产品，被中国证监会采取责令改正的行政监管措施。

本基金对相关股票的投资主要基于监管处罚已经基本落地、基本面竞争优势仍较强、同时估值回落到历史较低水平具有吸引力，投资决策流程符合基金管理人的制度要求。

**7.12.2 基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。****7.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	54,894.38
2	应收证券清算款	21,665.76
3	应收股利	-
4	应收利息	4,777,438.94
5	应收申购款	11,749.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,865,748.22

**7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	120001	16 以岭 EB	1,170,259.20	0.31
2	127003	海印转债	892,487.00	0.24
3	113010	江南转债	208,760.00	0.06

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。

**7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

无。

**7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

无。

## §8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
工银保本混合 A	5,272	64,493.59	2,318,251.70	0.68%	337,691,929.43	99.32%
工银保本混合 B	0	0.00	0.00	0.00%	0.00	0.00%
合计	5,272	64,493.59	2,318,251.70	0.68%	337,691,929.43	99.32%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	工银保本混合 A	10,290.11	0.00%
	工银保本混合 B	0.00	0.00%
	合计	10,290.11	0.00%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	工银保本混合 A	0
	工银保本混合 B	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	工银保本混合 A	0
	工银保本混合 B	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	工银保本混合 A
基金合同生效日（2011 年 12 月 27 日）基金份额总额	3,429,896,705.59
本报告期期初基金份额总额	407,079,888.16
本报告期基金总申购份额	4,717,934.68
减：本报告期基金总赎回份额	71,787,641.71
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	340,010,181.13

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。



## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 1、基金管理人：

基金管理人于 2017 年 2 月 8 日发布《工银瑞信基金管理有限公司董事长变更公告》，经基金管理人第六十一次股东会和第四届董事会第二十六次会议审议通过，沈立强先生辞去公司董事长职务，董事长变更为尚军先生。

基金管理人于 2017 年 4 月 25 日发布《工银瑞信基金管理有限公司关于副总经理变更的公告》，郝炜先生自 2017 年 4 月 19 日起担任工银瑞信基金管理有限公司副总经理。

#### 2、基金托管人托管部门：

基金托管人的专门基金托管部门的无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未有改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），该审计机构自基金合同生效日起向本基金提供审计服务，无改聘情况。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

**10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
光大证券	1	49,189,954.85	68.60%	45,810.49	74.10%	-
东方证券	1	22,514,630.72	31.40%	16,014.82	25.90%	-

注：1. 券商的选择标准和程序

(1) 选择标准：注重综合服务能力

- a) 券商财务状况良好、经营行为规范、风险管理先进、投资风格与工银瑞信有互补性、在最近一年内无重大违规行为。
- b) 券商具有较强的综合研究能力：能及时、全面、定期提供高质量的关于宏观、行业、资本市场、个股分析报告及其他丰富全面的信息咨询服务；有很强的分析能力，能根据工银瑞信所管理基金的特定要求，提供专门研究报告；具有开发量化投资组合模型的能力以及其他综合服务能力。
- c) 与其他券商相比，该券商能够提供最佳交易执行和优惠合理的佣金率。

(2) 选择程序

- a) 新增券商的选定：根据以上标准对券商进行考察、选择和确定。在合作之前，券商需提供至少两个季度的服务，并与其他已合作券商一起参与投资研究部门（权益投资部，固定收益部，专户投资部，研究部和中央交易室）两个季度对券商的研究服务评估。公司投委会根据对券商研究服务评估结果决定是否作为新增合作券商。
- b) 签订委托协议：与被选择的券商签订委托代理协议，明确签定协议双方的公司名称、委托代理期限、佣金率、双方的权利义务等，经签章有效。

2. 券商的评估，保留和更换程序

(1) 席位的租用期限暂定为一年，合同到期 15 天内，投资研究部门将根据各券商研究在服务期间的综合证券服务质量等情况，进行评估。

(2) 对于符合标准的券商，工银瑞信将与其续约；对于不能达到标准的券商，不与其续约，并根据券商选择标准和程序，重新选择其它经营稳健、研究能力强、综合服务质量高的证券经营机构，租用其交易席位。

(3) 若券商提供的综合证券服务不符合要求，工银瑞信有权按照委托协议规定，提前中止租用其交易席位。

## 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
光大证券	133,590,452.59	80.78%	2,477,000,000.00	99.44%	-	-
东方证券	31,794,936.89	19.22%	14,000,000.00	0.56%	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	工银瑞信基金管理有限公司董事长变更公告	中国证监会指定的媒介	2017年2月8日
2	工银瑞信基金管理有限公司关于旗下基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	中国证监会指定的媒介	2017年2月23日
3	关于增加江海证券有限公司为工银瑞信基金管理有限公司旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会指定的媒介	2017年3月23日
4	关于增加北京肯特瑞投资管理有限公司为旗下基金销售机构并进行费率调整的公告	中国证监会指定的媒介	2017年4月20日
5	工银瑞信基金管理有限公司关于旗下基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	中国证监会指定的媒介	2017年4月22日
6	关于工银瑞信保本混合型证券投资基金变更基金经理的公告	中国证监会指定的媒介	2017年4月22日
7	工银瑞信基金管理有限公司关于副总经理变更的公告	中国证监会指定的媒介	2017年4月25日
8	关于增加大同证券有限责任公司为工银瑞信基金管理有	中国证监会指定的媒介	2017年6月16日

	限公司旗下部分基金销售机构的公告		
9	关于直销电子自助交易系统开展基金转换费率优惠活动的公告	中国证监会指定的媒介	2017 年 6 月 26 日

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据基金管理人于 2017 年 4 月 22 日披露的《工银瑞信基金管理有限公司关于变更基金经理的公告》，自 2017 年 4 月 21 日起，欧阳凯先生不再担任工银瑞信保本混合型证券投资基金的基金经理。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准工银瑞信保本混合型证券投资基金募集的文件
- 2、《工银瑞信保本混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《工银瑞信保本混合型证券投资基金托管协议》
- 4、《工银瑞信保本混合型证券投资基金招募说明书》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照
- 7、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告

### 12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所。

### 12.3 查阅方式

投资者可于营业时间免费查阅，或登录基金管理人网站查阅。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。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人——工银瑞信基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-811-9999

网址：[www.icbccs.com.cn](http://www.icbccs.com.cn)