工银瑞信红利混合型证券投资基金 2018 年半年度报告摘要

2018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: 中国建设银行股份有限公司

送出日期:二〇一八年八月二十四日

§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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2018 年 8 月 22 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。 本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018年01月01日起至06月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	工银红利混合
基金主代码	481006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年7月18日
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	614, 420, 039. 72 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在合理控制风险的基础上,追求基金资产的长期稳定
	增值,获得超过业绩比较基准的投资业绩。
投资策略	本基金采用定量和定性相结合的个股精选策略,通过
	红利股筛选、竞争优势评价和盈利预测的选股流程,
	精选出兼具稳定的高分红能力、较强竞争优势和持续
	盈利增长的上市公司股票作为主要投资对象,以增强
	本基金的股息收益和资本增值能力。
业绩比较基准	85%×中证红利指数收益率+15%×中债综合财富(总
业坝比汉荃供	值)指数收益率。
风险收益特征	本基金属于混合型基金中的红利主题型基金,其风险
	与预期收益高于货币型基金和债券型基金,低于股票
	型基金。

注: 自 2018 年 6 月 11 日起,本基金业绩比较基准由"中证红利指数收益率"变更为"85%×中证红利指数收益率+15%×中债综合财富(总值)指数收益率"。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责	姓名	朱碧艳	田青
信息扱路贝贝	联系电话	400-811-9999	010-67595096
电子邮箱		customerservice@icbccs.com.cn	tianqing1.zh@ccb.cn
客户服务电话		400-811-9999	010-67595096
传真		010-66583158	010-66275853

2.4 信息披露方式

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

§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

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年1月1日 - 2018年6月30日)
本期已实现收益	12, 908, 007. 97
本期利润	-59, 748, 545. 97
加权平均基金份额本期利润	-0.0954
本期基金份额净值增长率	-10.70%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0. 1847
期末基金资产净值	500, 951, 777. 26
期末基金份额净值	0.8153

- 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2007年7月18日。

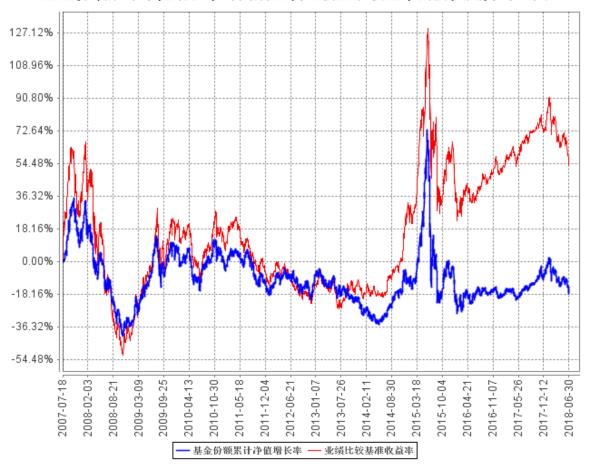
3.2 基金净值表现

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

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	-5. 21%	1. 30%	-7. 10%	1. 03%	1.89%	0. 27%
过去三个月	-6. 18%	1.13%	-7.96%	0. 98%	1.78%	0. 15%
过去六个月	-10.70%	1.24%	-10.84%	1.05%	0. 14%	0. 19%
过去一年	0. 18%	1.02%	-6. 44%	0.84%	6. 62%	0. 18%
过去三年	-30. 18%	1.67%	-17. 24%	1. 55%	-12. 94%	0. 12%
自基金合同 生效起至今	-15. 44%	1.61%	56. 20%	1.81%	-71. 64%	-0. 20%

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





注: 1、本基金合同于 2007 年 7 月 18 日生效。

2、按基金合同规定,本基金自基金合同生效起六个月内为建仓期。截至本报告期末,本基金的各项投资比例已达到基金合同关于投资范围及投资限制的规定:本基金投资股票等权益类资产占基金资产的比例为60%-95%,现金、债券资产、权证以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为5%-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%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等,权证投资占基金资产净值的比例不超过3%。

§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 2018 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、工银瑞信增强收益债券型证券投资基金、工银瑞信货币市场基金、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、工银瑞信添颐债券型证券投资基金、工银瑞信60 天理财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等 113 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	78 00
姓名	职务	任职日期	离任日期	业年限	说明
宋炳珅	权益投 资总监, 本基金 的基金 经理	2014年1月20日	_	14	曾任中信建投证券有限公司研究员;2007年加入工银瑞信,现任权益投资总监。2012年2月14日至今,担任工银瑞信添颐债券型证券投资基金基金经理;2013年1月18日至今,担任工银双利债券

					基金基金经理; 2013 年 1月28日至2014年 12月5日,担任工银瑞信60天理财债券型基金基金经理; 2014年1月20日至今,担任工银瑞信红利混合型证券投资基金基金经理; 2014年1月20日至2017年5月27日,担任工银瑞信核心价值混合型证券投资基金基金经理; 2014年10月23日至今,担任工银瑞信研究精选股票型基金基金经理; 2014年11月18日至今,担任工银医疗保健行业股票型基金基金经理; 2017年12月22日,担任工银战略转型主题股票基金基金经理; 2017年4月12日至今,担任工银瑞信中国
					经理; 2017年4月12日
林念	本基金基金经理	2016年9月 27日	_	5	北京大学宏观经济学博士; 曾在光大证券股份有限公司担任宏观分析师; 2014年加入工银瑞信基金管理有限公司,现任研究部宏观策略研究团队负责人、基金经理。 2016年9月27日至今, 担任工银瑞信红利混合型证券投资基金基金经理。

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遵规守信情况的说明

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为,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未超过该证券当日成交量的 5%。

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

上半年 A 股市场整体表现弱势,主要指数均出现不同幅度的下跌。其中,上证综指跌 13.9%, 沪深 300 跌 12.9%, 创业板指数下跌 8.3%, 中小板指跌 14.3%。分行业来看,上半年中 信一级行业中仅餐饮旅游、医药和食品饮料指数收涨,其余指数均告下跌,其中综合、电力设备、通信领跌,跌幅均超 25%。整体来看,上半年市场波动性增大,价值和成长风格均有阶段性机会,但与去年个股分化情形类似,市场投资机会依然有限。在此过程中,本基金坚持自上而下和自下 而上相结合的投资策略,根据对市场风格、性价比的判断,略微降低大盘股的配置比例,并相应 提升中小盘股的配置比重。不过在市场一季度出现较为极致的风格切换以及上半年市场收跌的背

景下,本基金净值还是遭受了一定损失。未来基金管理人将努力通过加强行业配置和个股选择, 力争为基金持有人创造价值。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金净值增长率为-10.70%,业绩比较基准收益率为-10.84%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前市场对经济的担忧,一方面来自去杠杆政策下的信用收缩,另一方面则是对贸易摩擦不确定性加强背景下的外需的担忧。基金管理人认为,这两方面因素对经济增长确实存在一定压力,预计年内名义和实际经济增速均将较去年略微放缓。不过考虑到目前财政政策发力空间依然较大,同时政府在去杠杆政策的实际操作层面存在节奏调整的可能,更重要的是,在服务和消费占GDP的比重较大的情况下,经济内在的稳定性正在增强。基金管理人认为,当前国内经济面临的潜在下行风险在可控范围之内。通货膨胀方面,预计通胀维持温和。流动性方面,在货币政策和宏观审慎双支柱框架日益健全的背景下,预计年内市场流动性将较去年边际略微改善。

预计下半年 A 股市场大概率还将主要以结构性机会为主。盈利方面,预计全年 A 股公司盈利增速仍将维持近两位数增长,但在年内名义 GDP 增速温和放缓的背景下,预计下半年企业盈利将较上半年存在一定的减速压力,未来市场盈利预期也存在一定的下调风险。估值及风险偏好方面,当前市场估值已经处于历史偏低位置,但考虑到 A 股面临的国际化估值体系的冲击,当前市场估值仍存在一定的调整空间。与此同时,在去杠杆等防风险政策背景下,预计市场风险偏好难以出现明显改善。综合而言,预计 A 股市场仍将以结构性机会为主。中观行业角度来看,重点关注符合经济发展方向的消费升级和制造升级两条主线,同时也密切跟踪科技创新等进展。

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

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、 法律合规部负责人,组长由运作部负责人担任。

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

本基金在报告期內没有触及 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,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内, 本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

§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: 工银瑞信红利混合型证券投资基金

报告截止日: 2018年6月30日

单位: 人民币元

			毕位:人民 市元
资产	附注号	本期末	上年度末
页 厂	門在与	2018年6月30日	2017年12月31日
资 产:			
银行存款		95, 530, 096. 99	47, 741, 207. 82
结算备付金		2, 140, 776. 08	987, 768. 90
存出保证金		124, 675. 63	64, 418. 00
交易性金融资产		394, 561, 697. 43	551, 316, 019. 41
其中: 股票投资		394, 561, 697. 43	547, 778, 689. 81
基金投资		_	_
债券投资		_	3, 537, 329. 60
资产支持证券投资		_	_
贵金属投资		_	_
衍生金融资产		_	_
买入返售金融资产		49, 900, 000. 00	_
应收证券清算款		11, 727, 622. 04	151, 149. 72
应收利息		18, 198. 44	11, 519. 31
应收股利		-	-
应收申购款		90, 712. 68	27, 339. 98
递延所得税资产		=	-
其他资产			-
资产总计		554, 093, 779. 29	600, 299, 423. 14
负债和所有者权益	附注号	本期末	上年度末
贝坝和州有有权益	附在与	2018年6月30日	2017年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款			
应付证券清算款		51, 388, 452. 49	2, 547, 042. 26
应付赎回款		232, 537. 11	688, 492. 42
应付管理人报酬		642, 194. 63	745, 071. 39
应付托管费		107, 032. 45	124, 178. 59
应付销售服务费		_	-
应付交易费用		329, 803. 09	324, 941. 80

应交税费	_	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	_
其他负债	441, 982. 26	632, 793. 83
负债合计	53, 142, 002. 03	5, 062, 520. 29
所有者权益:		
实收基金	614, 420, 039. 72	651, 960, 014. 52
未分配利润	-113, 468, 262. 46	-56, 723, 111. 67
所有者权益合计	500, 951, 777. 26	595, 236, 902. 85
负债和所有者权益总计	554, 093, 779. 29	600, 299, 423. 14

注: 1、本基金基金合同生效日为2007年7月18日。

2、报告截止日 2018 年 6 月 30 日,基金份额净值为人民币 0.8153 元,基金份额总额为 614,420,039.72 份。

6.2 利润表

会计主体: 工银瑞信红利混合型证券投资基金

本报告期: 2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2018年1月1日至 2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至 2017年6月30日
一、收入		-53, 273, 077. 69	35, 583, 594. 25
1.利息收入		389, 128. 42	521, 528. 93
其中: 存款利息收入		249, 988. 58	307, 858. 74
债券利息收入		299. 76	_
资产支持证券利息收入		_	_
买入返售金融资产收入		138, 840. 08	213, 670. 19
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		18, 987, 098. 42	9, 638, 992. 06
其中: 股票投资收益		14, 088, 465. 56	3, 908, 087. 90
基金投资收益		_	
债券投资收益		693, 388. 30	
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		4, 205, 244. 56	5, 730, 904. 16
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-72, 656, 553. 94	25, 416, 371. 13
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		_	_

5.其他收入(损失以"-"号填列)	7, 249. 41	6, 702. 13
减:二、费用	6, 475, 468. 28	7, 269, 728. 69
1. 管理人报酬	4, 142, 603. 09	4, 240, 885. 78
2. 托管费	690, 433. 85	706, 814. 32
3. 销售服务费	_	_
4. 交易费用	1, 435, 685. 99	2, 112, 298. 74
5. 利息支出	_	_
其中: 卖出回购金融资产支出	_	_
6. 税金及附加	0.05	-
7. 其他费用	206, 745. 30	209, 729. 85
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-59, 748, 545. 97	28, 313, 865. 56
减: 所得税费用		
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-59, 748, 545. 97	28, 313, 865. 56

注: 本基金基金合同生效日为2007年7月18日。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 工银瑞信红利混合型证券投资基金

本报告期: 2018年1月1日至2018年6月30日

单位: 人民币元

	本期 2018年1月1日至2018年6月30日					
项目	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)	651, 960, 014. 52	-56, 723, 111. 67	595, 236, 902. 85			
二、本期经营活动产生 的基金净值变动数(本 期利润)	_	-59, 748, 545. 97	-59, 748, 545. 97			
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)	-37, 539, 974. 80	3, 003, 395. 18	-34, 536, 579. 62			
其中: 1.基金申购款	9, 637, 744. 28	-934, 308. 15	8, 703, 436. 13			
2. 基金赎回款	-47, 177, 719. 08	3, 937, 703. 33	-43, 240, 015. 75			
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)	614, 420, 039. 72	-113, 468, 262. 46	500, 951, 777. 26
	2017 年	上年度可比期间 1月1日至2017年6月3	20 日
福口	2017 4	1万1日主2017年0万3	ю П
项目	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)	731, 439, 532. 77	-164, 905, 040. 18	566, 534, 492. 59
二、本期经营活动产生 的基金净值变动数(本 期利润)	_	28, 313, 865. 56	28, 313, 865. 56
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)	-27, 608, 439. 55	5, 518, 233. 58	-22, 090, 205. 97
其中: 1.基金申购款	6, 163, 272. 65	-1, 268, 828. 94	4, 894, 443. 71
2. 基金赎回款	-33, 771, 712. 20	6, 787, 062. 52	-26, 984, 649. 68
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)	703, 831, 093. 22	-131, 072, 941. 04	572, 758, 152. 18

注: 本基金基金合同生效日为2007年7月18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	赵紫英	<u>关亚君</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

工银瑞信红利混合型证券投资基金(原名为工银瑞信红利股票型证券投资基金,以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监基金字[2007]第 185 号

《关于同意工银瑞信红利股票型证券投资基金募集的批复》核准,由工银瑞信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《工银瑞信红利股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集5,840,378,996.42元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2007)第090号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《工银瑞信红利股票型证券投资基金基金合同》于2007年7月18日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为5,840,545,298.11份基金份额,其中认购资金利息折合166,301.69份基金份额。本基金的基金管理人为工银瑞信基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称"中国建设银行")。

根据 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》,工银瑞信红利股票型证券投资基金于 2015 年 8 月 5 日公告后更名为工银瑞信红利混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《工银瑞信红利混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券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。如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。本基金的投资组合比例为:封闭期间,股票等权益类资产占基金资产的比例为60%-100%,现金、债券资产、权证以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为0%-40%,权证投资占基金资产净值的比例不超过3%;开放期间,股票等权益类资产占基金资产的比例为60%-95%,现金、债券资产、权证以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为5%-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%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等,权证投资占基金资产净值的比例不超过3%。若法律法规或中国证监会对基金投资权证的比例有新的规定,适用新的规定。股票指数期货及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。本基金的业绩比较基准为85%×中证红利指数收益率+15%×中债综合财富(总值)指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则一基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《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〉》、中国证券投资基金业协会(以下简称"中国基金业协会")颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《工银瑞信红利混合型证券投资基金基金合同基金合同》和其他中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的

基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 年上半年度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 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

- **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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2012]85号《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》财税 [2015]101号《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》、财税 [2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《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》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》财税[2016]140号《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》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税 [2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 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。资管 第 18 页 共34 页

产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照 3%的征收率缴纳增值税。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。

对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,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务,以 2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017年12月31日前取得的基金、非货物期货,可以选择按照实际买入价计算销售额,或者以 2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

- (2)对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,股票的股息、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。
- (3)对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得,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,暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%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。
 - (4)基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。
- (5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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		
中国建设银行股份有限公司	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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年 6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付 的管理费	4, 142, 603. 09	4, 240, 885. 78
其中:支付销售机构的 客户维护费	889, 977. 33	909, 418. 94

注: 1、基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50%年费率计提, 计算方法如下:

H=E×年管理费率÷当年天数

- 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。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位: 人民币元

項目	本期	上年度可比期间
项目	2018年1月1日至2018年6月30日	2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付	200, 400, 05	500 014 00
的托管费	690, 433. 85	706, 814. 32

注: 1、基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25%年费率计提。计算方法如下:

H= E×年托管费率÷当年天数

- 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。

6.4.8.2.3 销售服务费

无。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

- 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况
- 6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.8.4.2 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

无。

6.4.8.5 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

本期			上年度可比期间		
关联方	2018年1月1	日至 2018 年 6 月	2017年1月1日至2	2017年6月30日	
名称	30 日				
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入	
中国建设银					
行股份有限	95, 530, 096. 99	236, 699. 44	9, 304, 632. 69	266, 023. 33	
公司					

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

- 6.4.9 期末 (2018 年 6 月 30 日) 本基金持有的流通受限证券
- 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位: 人民币元

6. 4. 9.	6.4.9.1.1 受限证券类别: 股票									
证券代码	证券名称	成功 认购日		流通受 限类型	认购 价格	期末估值单价	数量 (单位: 股)	期末 成本总额	期末估值总额	备注

	江办 新能	2018 年 6 月 25 日		新股流 通受限	9. 00	9. 00	5, 384	48, 456. 00	48, 456. 00	_
603706		2018年 6月 29日	牛	新股流通受限	13. 09	13. 09	1, 765	23, 103. 85	23, 103. 85	_
603105		2018年 6月 29日	牛	新股流通受限	4. 83	4. 83	3, 410	16, 470. 30	16, 470. 30	_

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§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	394, 561, 697. 43	71. 21
	其中: 股票	394, 561, 697. 43	71. 21
2	固定收益投资	_	_
	其中:债券	_	_
	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	49, 900, 000. 00	9. 01
	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	97, 670, 873. 07	17. 63
7	其他各项资产	11, 961, 208. 79	2. 16
8	合计	554, 093, 779. 29	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	_	-
В	采矿业	_	-
С	制造业	215, 418, 825. 59	43.00
D	电力、热力、燃气及水生产和 供应业	22, 371, 867. 21	4. 47
Е	建筑业	56, 449. 82	0. 01
F	批发和零售业	27, 375, 826. 51	5. 46
G	交通运输、仓储和邮政业	23, 417, 709. 49	4. 67
Н	住宿和餐饮业	_	_
I	信息传输、软件和信息技术服 务业	6, 176, 108. 79	1. 23
Ј	金融业	70, 107, 688. 33	13. 99
K	房地产业	18, 259, 520. 15	3. 64

L	租赁和商务服务业	11, 296, 475. 40	2. 26
M	科学研究和技术服务业	_	-
N	水利、环境和公共设施管理业	81, 226. 14	0.02
0	居民服务、修理和其他服务业	_	-
Р	教育	_	_
Q	卫生和社会工作	_	-
R	文化、体育和娱乐业	_	-
S	综合	-	-
	合计	394, 561, 697. 43	78. 76

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前十名股票投资明细

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	002142	宁波银行	1, 374, 563	22, 391, 631. 27	4. 47
2	600036	招商银行	776, 024	20, 518, 074. 56	4. 10
3	600585	海螺水泥	411, 100	13, 763, 628. 00	2. 75
4	002024	苏宁易购	945, 700	13, 315, 456. 00	2. 66
5	000651	格力电器	281, 991	13, 295, 875. 65	2. 65
6	600030	中信证券	688, 350	11, 405, 959. 50	2. 28
7	601318	中国平安	184, 600	10, 813, 868. 00	2. 16
8	300003	乐普医疗	294, 800	10, 813, 264. 00	2. 16
9	600104	上汽集团	286, 400	10, 021, 136. 00	2. 00
10	600048	保利地产	819, 100	9, 993, 020. 00	1. 99

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于公司网站的半年度报告正文。

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	601318	中国平安	29, 258, 780. 88	4. 92
2	601009	南京银行	15, 968, 006. 92	2. 68
3	601601	中国太保	14, 489, 495. 43	2. 43
4	600030	中信证券	14, 423, 758. 00	2. 42
5	002024	苏宁易购	13, 678, 575. 00	2. 30
6	600197	伊力特	13, 153, 979. 00	2. 21
7	601336	新华保险	11, 074, 093. 00	1.86
8	601111	中国国航	10, 821, 324. 36	1.82
9	600104	上汽集团	9, 985, 519. 05	1. 68
10	002146	荣盛发展	9, 900, 345. 80	1.66
11	002582	好想你	9, 789, 762. 42	1.64
12	300059	东方财富	9, 517, 249. 00	1.60
13	601222	林洋能源	9, 249, 628. 50	1. 55
14	300298	三诺生物	8, 787, 726. 17	1.48
15	600183	生益科技	8, 626, 938. 21	1. 45
16	600027	华电国际	8, 619, 639. 86	1. 45
17	600021	上海电力	8, 429, 348. 00	1. 42
18	000063	中兴通讯	8, 114, 091. 00	1. 36
19	600346	恒力股份	7, 938, 709. 60	1. 33
20	600038	中直股份	7, 915, 482. 00	1. 33

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	601318	中国平安	34, 629, 700. 35	5. 82
2	601288	农业银行	21, 046, 793. 95	3. 54
3	600019	宝钢股份	18, 755, 548. 31	3. 15
4	601336	新华保险	18, 363, 255. 98	3. 09
5	600703	三安光电	14, 813, 233. 90	2. 49

6	601009	南京银行	14, 108, 157. 84	2. 37
7	000858	五粮液	12, 077, 975. 09	2.03
8	601088	中国神华	11, 719, 053. 90	1. 97
9	600197	伊力特	11, 653, 435. 02	1. 96
10	600104	上汽集团	11, 223, 610. 00	1. 89
11	600660	福耀玻璃	10, 842, 011. 08	1.82
12	000651	格力电器	10, 803, 650. 76	1.82
13	600066	宇通客车	10, 756, 790. 32	1.81
14	600519	贵州茅台	10, 664, 960. 68	1. 79
15	300059	东方财富	10, 307, 015. 32	1.73
16	002614	奥佳华	9, 953, 550. 40	1. 67
17	300298	三诺生物	9, 662, 247. 94	1.62
18	000001	平安银行	9, 631, 082. 26	1.62
19	000786	北新建材	9, 591, 841. 54	1.61
20	600741	华域汽车	9, 580, 987. 83	1.61

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	514, 686, 103. 57
卖出股票收入 (成交) 总额	609, 387, 337. 17

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 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:

招商银行

本报告期,本基金持有招商银行,其发行主体因内控管理严重违反审慎经营规则等违规行为,

被中国证监会处以罚款并没收违法所得。

上述情形对上市公司的财务和经营状况无重大影响,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	124, 675. 63
2	应收证券清算款	11, 727, 622. 04
3	应收股利	_
4	应收利息	18, 198. 44
5	应收申购款	90, 712. 68
6	其他应收款	_
7	待摊费用	_
8	其他	_
9	合计	11, 961, 208. 79

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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

			持有人结构					
持有人户数 (户)		户均持有的 基金份额	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		
	26, 672	23, 036. 14	2, 671, 973. 14	0. 43%	611, 748, 066. 58	99. 57%		

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	0, 00	0.00%
持有本基金		3. 33%

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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9 开放式基金份额变动

单位: 份

基金合同生效日(2007年7月18日)基金份额总额	5, 840, 545, 298. 11
本报告期期初基金份额总额	651, 960, 014. 52
本报告期基金总申购份额	9, 637, 744. 28
减:本报告期基金总赎回份额	47, 177, 719. 08
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	614, 420, 039. 72

- 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 2018 年 4 月 9 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》 , 江明波先生自 2018 年 4 月 4 日起不再担任工银瑞信基金管理有限公司副总经理。

2、基金托管人:

无。

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普华永道中天会计师事务所(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

		股票图		应支付该类		
券商名称	交易单元 数量	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	备注
长江证券	1	561, 148, 804. 47	50. 03%	343, 026. 09	47. 21%	_
广发证券	1	263, 441, 018. 40	23. 49%	187, 385. 82	25. 79%	_
方正证券	1	147, 036, 367. 24	13. 11%	104, 587. 66	14. 39%	_
安信证券	1	106, 081, 218. 57	9. 46%	64, 847. 04	8. 92%	_
平安证券	1	43, 865, 768. 17	3. 91%	26, 816. 38	3. 69%	_
东方证券	1	_	_		_	_
东兴证券	1	_	_	_	_	_
海通证券	1	_	_	_	_	_
西藏同信证 券	1	_	_	_	_	_
国金证券	1	_	_	_	_	-
东北证券	1	_	_	_	_	_

注: 1. 交易单元的选择标准和程序

基金管理人选择综合实力强、研究能力突出、合规经营的证券公司,向其租用专用交易单元。

(1) 选择标准:

- a) 经营行为规范,在最近一年内无重大违规行为。
- b) 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、个股分析的报告及量化、衍生品和国际市场的研究服务支持。
- c)在证监会最近一期证券公司年度分类结果中,分类级别原则上不得低于BBB。
- d)与其他证券公司相比,能够提供最佳交易执行和优惠合理的佣金费率。

(2) 选择程序

- a)新增证券公司的选定:根据以上标准对证券公司进行考察、选择和确定。在合作之前,证券公司需提供至少两个季度的服务,并在两个季度内与其他已合作证券公司一起参与基金管理人的研究服务评估。根据对其研究服务评估结果决定是否作为新增合作证券公司。
- b) 签订协议:与被选择的证券公司签订交易单元租用协议。
- 2. 证券公司的评估、保留和更换程序
- (1) 交易单元的租用期限为一年,合同到期前 30 天内,基金管理人将根据各证券公司在服务期间的综合证券服务质量、费率等情况进行评估。
- (2) 对于符合标准的证券公司,与其续约;对于不能达到标准的证券公司,不与其续约,并根据证券公司选择标准和程序,重新选择其他经营稳健、研究能力强、综合服务质量高的证券经第 32 页 共34 页

营机构,租用其交易单元。

(3) 若证券公司提供的综合证券服务不符合要求,基金管理人有权按照协议约定,提前终止租 用其交易单元。

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

	债券	交易	债券回购	债券回购交易		交易
券商名称	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
长江证券	_	_	726, 900, 000. 00	91. 22%	_	_
广发证券	_	_	_	_	_	_
方正证券	3, 474, 954. 00	83. 15%	_	_	_	_
安信证券	_	_	40, 000, 000. 00	5. 02%	_	_
平安证券	704, 230. 00	16. 85%	30, 000, 000. 00	3. 76%	_	_
东方证券	_	_	_	_	_	_
东兴证券	_	_	_	_	_	_
海通证券	_	_	_	_	_	_
西藏同信证 券	_	_	_	_	_	_
国金证券	_	_	_	_	_	_
东北证券	_	_	_	_	_	_

§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

- 1、根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法律法规的要求,基金管理人经与基金托管人协商一致,对本基金基金合同、托管协议的有关条款进行了修改,修改后的基金合同、托管协议自 2018 年 4 月 1 日起生效。详见基金管理人在指定媒介发布的公告。
- 2、自2018年6月11日起,工银瑞信红利混合型证券投资基金的业绩比较基准由"中证红利指数收益率"变更为"85%×中证红利指数收益率+15%×中债综合财富(总值)指数收益率",详见基金管理人在指定媒介发布的公告。