

# 工银瑞信保本 3 号混合型证券投资基金 2019 年半年度报告

2019 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：招商银行股份有限公司

送出日期：二〇一九年八月二十八日

## §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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 26 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 2019 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.....	11
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>12</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
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.....	15
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>43</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	43
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	43
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.....	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	46
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.....	47
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细.....	47
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.....	47
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.....	47
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	48
7.12 投资组合报告附注.....	48
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>50</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	50
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.....	50
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>52</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>53</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	53
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.....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	53
10.4 基金投资策略的改变.....	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	53
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.....	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	54
10.8 其他重大事件.....	55
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>58</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 .....	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	58
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>59</b>
12.1 备查文件目录.....	59
12.2 存放地点.....	59
12.3 查阅方式.....	59

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	工银瑞信保本 3 号混合型证券投资基金	
基金简称	工银保本 3 号混合	
基金主代码	000195	
基金运作方式	契约型、定期开放式	
基金合同生效日	2013 年 6 月 26 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	
报告期末基金份额总额	2,108,883,016.83 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 3 号混合 A	工银保本 3 号混合 B
下属分级基金的交易代码:	000195	000196
报告期末下属分级基金的份额总额	1,969,383,700.67 份	139,499,316.16 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	本基金采用恒定比例投资组合保险策略（Constant-Proportion Portfolio Insurance, CPPI）来实现保本和增值的目标。
业绩比较基准	人民币税后三年期银行定期存款利率+0.25%。
风险收益特征	本基金是一只保本混合型基金，属于基金中的低风险品种，投资者投资于保本基金并不等于将资金作为存款放在银行或存款类金融机构，保本基金在极端情况下仍然存在本金损失的风险。

### 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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	朱碧艳	张燕
	联系电话	400-811-9999	0755-83199084
	电子邮箱	customerservice@icbccs.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-811-9999	95555
传真		010-66583158	0755-83195201
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		北京市西城区金融大街 5 号新盛	深圳市深南大道 7088 号招商

	大厦 A 座 6-9 层	银行大厦
邮政编码	100033	518040
法定代表人	王海璐	李建红

## 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
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	北京中关村科技融资担保有限公司	北京海淀区中关村南大街 12 号天作国际中心 1 号楼 A 座 30 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3号混合A	工银保本3号混合B
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	72,592,981.75	4,519,582.43
本期利润	77,592,342.43	4,823,493.16
加权平均基金份额本期利润	0.0388	0.0343
本期加权平均净值利润率	3.59%	3.23%
本期基金份额净值增长率	3.60%	3.27%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)	
期末可供分配利润	706,830,966.54	45,122,095.80
期末可供分配基金份额利润	0.3589	0.3235
期末基金资产净值	2,154,584,597.27	149,651,258.08
期末基金份额净值	1.094	1.073
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	48.83%	43.17%

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、期末可供分配利润，为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

4、所列数据截止到报告期最后一日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

5、本基金基金合同生效日为2013年6月26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

工银保本3号混合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



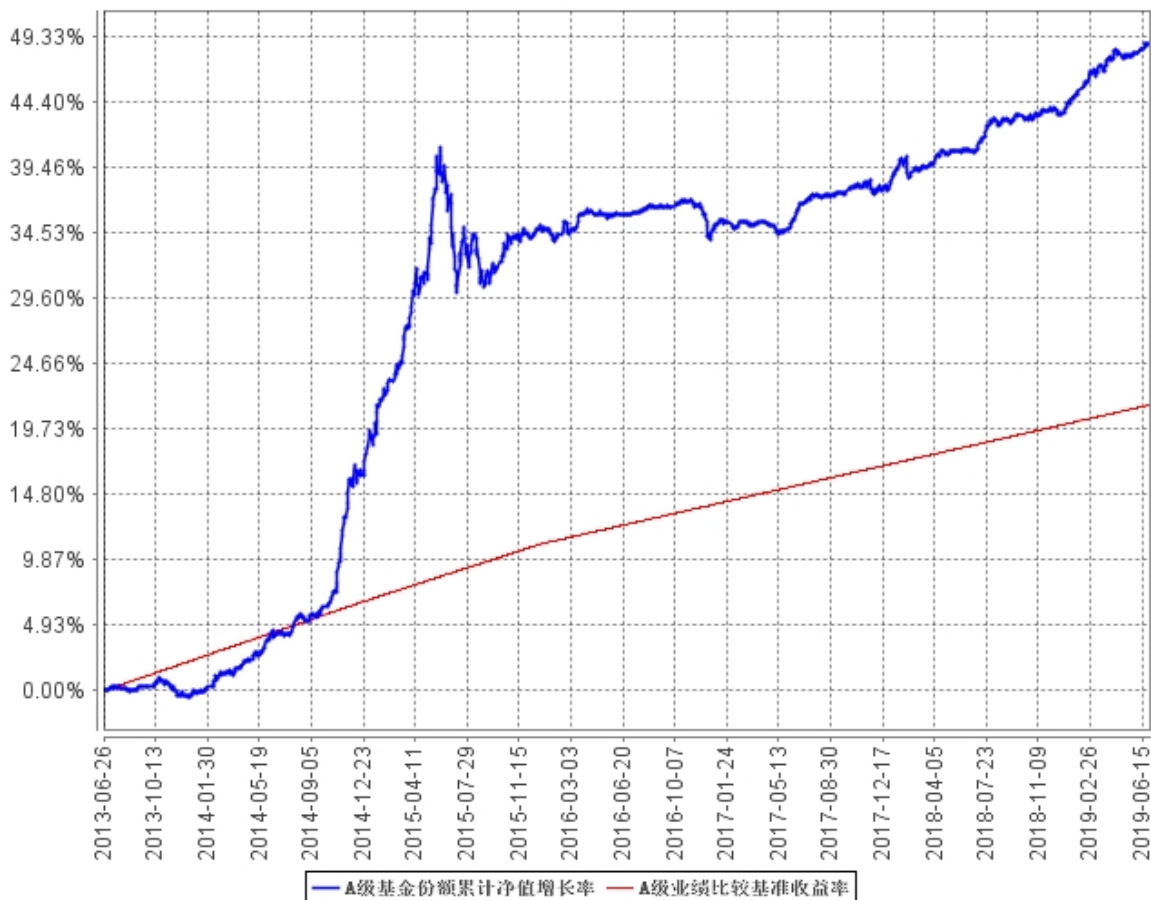
过去一个月	0.46%	0.06%	0.25%	0.01%	0.21%	0.05%
过去三个月	1.11%	0.09%	0.75%	0.01%	0.36%	0.08%
过去六个月	3.60%	0.11%	1.49%	0.01%	2.11%	0.10%
过去一年	5.70%	0.10%	3.00%	0.01%	2.70%	0.09%
过去三年	9.44%	0.09%	9.00%	0.01%	0.44%	0.08%
自基金合同 生效起至今	48.83%	0.20%	21.57%	0.01%	27.26%	0.19%

## 工银保本3号混合B

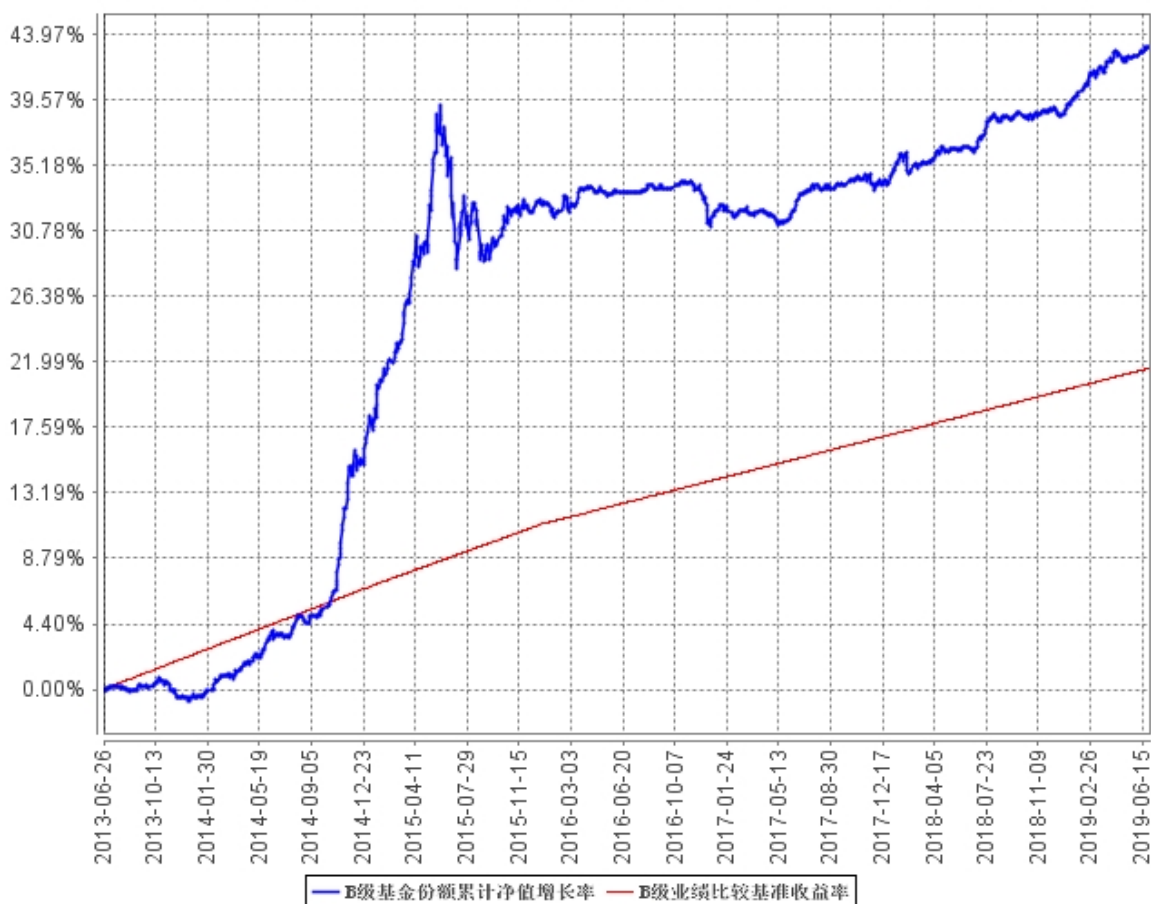
阶段	份额净值增 长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	0.47%	0.08%	0.25%	0.01%	0.22%	0.07%
过去三个月	0.94%	0.08%	0.75%	0.01%	0.19%	0.07%
过去六个月	3.27%	0.10%	1.49%	0.01%	1.78%	0.09%
过去一年	4.99%	0.09%	3.00%	0.01%	1.99%	0.08%
过去三年	7.32%	0.09%	9.00%	0.01%	-1.68%	0.08%
自基金合同 生效起至今	43.17%	0.20%	21.57%	0.01%	21.60%	0.19%

### 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 2013 年 6 月 26 日生效。

2、根据基金合同规定，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关于投资范围及投资限制的规定：股票等风险资产占基金资产的比例不高于 40%；债券、债券回购、银行存款等安全资产占基金资产的比例不低于 60%；本基金在受限开放期、到期操作期、过渡期，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值的 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券；在封闭期内，本基金不受该比例的限制，但每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；前述现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

### 3.3 其他指标

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2019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、工银瑞信消费服务行业混合型证券投资基金、工银瑞信60天理财债券型证券投资基金、工银瑞信金融地产行业混合型证券投资基金、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、深证红利交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信上证50交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信沪深300交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信养老目标日期2035三年持有期混合型基金中基金（FOF）等逾130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		
张洋	本基金的基金经理	2015年8月17日	-	7	宾夕法尼亚大学电子工程专业博士，沃顿商学院统计学硕士；2012年加入工银瑞信，现任固定收益

				<p>部基金经理，2015年8月17日至今，担任工银瑞信双债增强债券型证券投资基金(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8月17日至今，担任工银瑞信保本3号混合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14日至今，担任工银瑞信可转债债券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；2017年1月25日至2018年6月11日，担任工银瑞信瑞盈半年定期开放债券型证券投资基金基金经理；2018年7月2日至今，担任工银瑞信可转债优选债券型证券投资基金基金经理；2018年7月27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；2018年7月27日至今，担任工银瑞信新得利混合型证券投资基金基金经理；2018年8月28日至今，担任工银瑞信添福债券型证券投资基金基金经理；2019年1月24日至今，担任工银瑞信聚盈混合型证券投资基金基金经理。2019年6月5日至今，担任工银瑞信月薪定期支付债券型证券投资基金基金经理。</p>
--	--	--	--	---

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为，公司根据《证券投资基金法》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部规章，拟定了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》，对公司管理的各类资产的公平对待做了明确具体的规定，并规定对买卖股票、债券时候的价格和市场价格差距较大，可能存在操纵股价、利益输送等违法违规情况进行监控。本报告期，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；未出现清算不到位的情况，且本基金及本基金与本基金管理人管理的其他投资组合之间未发生法律法规禁止的反向交易及交叉交易。

### 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3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

2019年上半年全球再次出现风险偏好波动。一方面，美国经济的经济预期从高点滑落，出现下行压力，市场普遍预期美联储将会从加息转为降息；另一方面，中美贸易谈判也出现一定波折。受此影响，全球权益资产波动性加强，全球债券收益率也同步走低。

国内方面，政策层面对于经济的支持力度加强，货币政策和财政政策双管齐下，减税降费措施频出。在此背景下，上半年国内融资和实体经济数据均出现一定企稳迹象，市场预期显著改善，尽管海外的不确定性有所增强，但权益市场在波动之后保持韧性，债券收益率低位震荡。

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

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，工银保本3号混合A份额净值增长率为3.60%，工银保本3号混合B份额净值增长率为3.27%，业绩比较基准收益率为1.49%。

#### 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2019年下半年，我国发展仍处于重要战略机遇期，稳中求进的政策基调更会提升发展质量，有效应对外部环境深刻变化。在全球经济下行的背景下，仍然预计以美联储为代表的主要发达国家货币政策会走向宽松，利好全球流动性以及债券市场。同时在风险偏好有所提升的情况下，权益市场具备投资机会，但须注意全球经济基本面和政策对冲的节奏波动。可转债类资产兼具债性和股性，今年以来表现较好，未来在精选个券的前提下也还有性价比优势。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

（1）职责分工

估值小组成员为4人，分别来自公司运作部、固定收益部（或研究部）、风险管理部、法律合规部，组长由运作部负责人担任。

各部门负责人推荐各部门成员，如需更换，由相应部门负责人提出。小组成员需经运作部分管副总批准同意。

（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。

2、投资经理参与或决定估值的程度

投资经理可参与讨论估值原则和方法，但不得参与最终估值决策。

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、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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本半年度报告中利润分配情况真实、准确。

### 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

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，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：工银瑞信保本3号混合型证券投资基金

报告截止日：2019年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	1,513,462,235.80	1,195,151.59
结算备付金		14,743,037.20	27,911,003.68
存出保证金		143,375.70	21,578.14
交易性金融资产	6.4.7.2	754,731,110.68	3,637,714,475.42
其中：股票投资		107,720,610.68	82,326,572.42
基金投资		-	-
债券投资		647,010,500.00	3,555,387,903.00
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	-	7,000,000.00
应收证券清算款		-	1,708,941.54
应收利息	6.4.7.5	24,108,219.17	47,606,571.23
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,307,187,978.55	3,723,157,721.60
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019年6月30日</b>	<b>上年度末 2018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		-	1,101,000,000.00
应付证券清算款		-	667,670.34
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		2,266,930.30	2,669,884.76
应付托管费		377,821.70	444,980.81
应付销售服务费		73,631.74	81,117.61
应付交易费用	6.4.7.7	72,644.29	15,103.36

应交税费		48,029.78	275,865.75
应付利息		-	1,159,384.08
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	113,065.39	399,360.60
负债合计		2,952,123.20	1,106,713,367.31
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	1,552,282,793.01	1,825,948,735.95
未分配利润	6.4.7.10	751,953,062.34	790,495,618.34
所有者权益合计		2,304,235,855.35	2,616,444,354.29
负债和所有者权益总计		2,307,187,978.55	3,723,157,721.60

注：1、本基金基金合同生效日为2013年6月26日。

2、报告截止日2019年6月30日，基金份额总额为2,108,883,016.83份，其中A类基金份额净值为人民币1.094元，份额总额为1,969,383,700.67份；B类基金份额净值为人民币1.073

元，份额总额为139,499,316.16份。

## 6.2 利润表

会计主体：工银瑞信保本3号混合型证券投资基金

本报告期：2019年1月1日至2019年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019年1月1日至 2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至 2018年6月30日
<b>一、收入</b>		108,876,160.77	112,511,408.66
1.利息收入		47,367,936.99	66,071,572.10
其中：存款利息收入	6.4.7.11	4,431,808.26	369,732.26
债券利息收入		42,931,999.81	65,701,839.84
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		4,128.92	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		55,256,881.34	24,716,330.58
其中：股票投资收益	6.4.7.12	12,347,617.82	33,822,258.60
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	40,957,062.70	-10,863,190.58
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	1,952,200.82	1,757,262.56

3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	5,303,271.41	20,476,392.58
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	948,071.03	1,247,113.40
<b>减：二、费用</b>		26,460,325.18	44,454,673.67
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	13,729,964.23	18,110,836.00
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,288,327.36	3,018,472.61
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	443,650.03	516,518.06
4. 交易费用	6.4.7.19	146,877.44	431,608.82
5. 利息支出		9,573,503.83	21,932,670.02
其中：卖出回购金融资产支出		9,573,503.83	21,932,670.02
6. 税金及附加		143,897.70	220,120.40
7. 其他费用	6.4.7.20	134,104.59	224,447.76
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		82,415,835.59	68,056,734.99
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		82,415,835.59	68,056,734.99

注：本基金基金合同生效日为2013年6月26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3号混合型证券投资基金

本报告期：2019年1月1日至2019年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019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）	1,825,948,735.95	790,495,618.34	2,616,444,354.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	82,415,835.59	82,415,835.59
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	-273,665,942.94	-120,958,391.59	-394,624,334.53

填列)			
其中：1.基金申购款	103,712.88	41,040.70	144,753.58
2.基金赎回款	-273,769,655.82	-120,999,432.29	-394,769,088.11
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）	1,552,282,793.01	751,953,062.34	2,304,235,855.35
项目	上年度可比期间 2018年1月1日至2018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）	2,526,237,765.32	950,530,120.83	3,476,767,886.15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	68,056,734.99	68,056,734.99
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）	-378,638,639.56	-147,104,377.58	-525,743,017.14
其中：1.基金申购款	209,669.32	81,076.46	290,745.78
2.基金赎回款	-378,848,308.88	-147,185,454.04	-526,033,762.92
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）	2,147,599,125.76	871,482,478.24	3,019,081,604.00

注：本基金基金合同生效日为2013年6月26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：

王海璐

基金管理人负责人

赵紫英

主管会计工作负责人

关亚君

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3号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[2013]658号文《关于核准工银瑞信保本3号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2013年6月26日正式生效，首次设立募集规模为475,416,937.37份基金份额，本基金为契约型开放式，存续期限为不定期。本基金的基金管理人和注册登记机构均为工银瑞信基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金根据认购费、申购费、赎回费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购、赎回时，收取认购/申购、赎回费用的，称为A类基金份额；不收取认购/申购、赎回费用，但从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为B类基金份额。

本基金主要投资于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）、权证及股指期货等权益类资产，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、权证及股指期货等权益资产）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%；本基金在受限开放期、到期操作期、过渡期，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值的5%的现金或到期日在一年以内的政府债券；在封闭期内，本基金不受该比例的限制，但每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；前述现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。当法律法规和相关规定变更时，基金管理人在履行适当程序后可对上述资产配置比例进行适当调整。本基金的业绩比较基准为：人民币税后三年期银行定期存款利率+0.25%。

## 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《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《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〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定及参考意见。

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2019年6月30日的财务状况以及2019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

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

## 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；

## （2）增值税

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，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。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自2018年1月1日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，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；转让2017年12月31日前取得的股票（不包括限售股）、债券、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股票收盘价（2017年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、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；



增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

### (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[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[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 2019年6月30日
活期存款	8,462,235.80
定期存款	1,505,000,000.00
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	1,280,000,000.00

存款期限 3 个月以上	-
存款期限 1 个月以内	225,000,000.00
其他存款	-
合计:	1,513,462,235.80

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	91,782,016.38	107,720,610.68	15,938,594.30
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	53,550,171.78	54,999,500.00
	银行间市场	592,669,613.00	592,011,000.00
	合计	646,219,784.78	647,010,500.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	738,001,801.16	754,731,110.68	16,729,309.52

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

#### 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

无。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应收活期存款利息	1,080.53
应收定期存款利息	4,090,480.28

应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	6,634.40
应收债券利息	20,009,959.46
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	64.50
合计	24,108,219.17

#### 6.4.7.6 其他资产

无。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	68,069.29
银行间市场应付交易费用	4,575.00
合计	72,644.29

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提审计费	44,630.98
预提信息披露费	59,073.81
应缴债券利息税	60.60
预提账户维护费	9,300.00
合计	113,065.39

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

工银保本3号混合A	
项目	本期

	2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	2,328,010,899.53	1,711,285,753.99
本期申购	6,365.30	4,677.45
本期赎回(以“-”号填列)	-358,633,564.16	-263,536,800.71
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	1,969,383,700.67	1,447,753,630.73

金额单位：人民币元

工银保本3号混合B		
项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	153,025,060.40	114,662,981.96
本期申购	132,183.89	99,035.43
本期赎回(以“-”号填列)	-13,657,928.13	-10,232,855.11
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	139,499,316.16	104,529,162.28

注：若本基金有分红及转换业务，申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

## 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

工银保本3号混合A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	789,485,896.15	-43,275,937.60	746,209,958.55
本期利润	72,592,981.75	4,999,360.68	77,592,342.43
本期基金份额交易产生的变动数	-122,166,203.12	5,194,868.68	-116,971,334.44
其中：基金申购款	2,168.33	-92.20	2,076.13
基金赎回款	-122,168,371.45	5,194,960.88	-116,973,410.57
本期已分配利润	-	-	-
本期末	739,912,674.78	-33,081,708.24	706,830,966.54

单位：人民币元

工银保本3号混合B			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	47,111,717.70	-2,826,057.91	44,285,659.79
本期利润	4,519,582.43	303,910.73	4,823,493.16
本期基金份额交易产生的变动数	-4,182,278.83	195,221.68	-3,987,057.15
其中：基金申购款	40,872.43	-1,907.86	38,964.57
基金赎回款	-4,223,151.26	197,129.54	-4,026,021.72
本期已分配利润	-	-	-
本期末	47,449,021.30	-2,326,925.50	45,122,095.80

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
活期存款利息收入	124,542.61
定期存款利息收入	4,090,480.28
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	216,424.42
其他	360.95
合计	4,431,808.26

#### 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 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出股票成交总额	52,775,020.93
减：卖出股票成本总额	40,427,403.11
买卖股票差价收入	12,347,617.82

#### 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 2019年1月1日至2019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	40,957,062.70

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	40,957,062.70

#### 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 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	4,354,077,043.01
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	4,231,645,711.07
减：应收利息总额	81,474,269.24
买卖债券差价收入	40,957,062.70

#### 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

无。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

无。

#### 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

无。

##### 6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,952,200.82
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,952,200.82

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
1. 交易性金融资产	5,303,271.41
——股票投资	12,676,019.19
——债券投资	-7,372,747.78
——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	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	5,303,271.41

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	947,928.59
基金转换费收入	142.44
合计	948,071.03

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
交易所市场交易费用	134,602.44
银行间市场交易费用	12,275.00

交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	146,877.44

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
审计费用	44,630.98
信息披露费	59,073.81
账户维护费	18,600.00
银行费用	11,799.80
合计	134,104.59

#### 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

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金于2019年7月11日第二个保本运作周期届满，于2019年7月19日转型为工银瑞信成长收益混合型证券投资基金。具体情况详见本基金管理人的相关公告。

截至财务报表批准日，本基金无其他需要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
招商银行股份有限公司	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

无。

##### 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 2019年1月1日至2019年6 月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	13,729,964.23	18,110,836.00
其中：支付销售机构的客户维护费	3,368,325.92	3,576,986.42

注：1、基金管理费按前一日的基金资产净值的1.20%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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 2019年1月1日至2019年6 月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,288,327.36	3,018,472.61

注：1、基金托管费按前一日的基金资产净值的0.20%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

2、基金托管费每日计提，按月支付。

**6.4.10.2.3 销售服务费**

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	工银保本3号混合 A	工银保本3号混合 B	合计
工银瑞信基金管理有限公司	-	2,767.76	2,767.76
中国工商银行股份有限公司	-	337,402.30	337,402.30
招商银行股份有限公司	-	66,596.01	66,596.01
合计	-	406,766.07	406,766.07
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	工银保本3号混合 A	工银保本3号混合 B	合计
工银瑞信基金管理有限公司	-	2,850.78	2,850.78
中国工商银行股份有限公司	-	390,884.13	390,884.13
招商银行股份有限公司	-	70,097.50	70,097.50
合计	-	463,832.41	463,832.41

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费。B类基金份额的销售服务费年费率为0.60%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务。销售服务费按前一日B类基金资产净值的0.60%年费率计提。计算方法下：

$$H = E \times 0.60\% / \text{当年天数}$$

H为B类基金份额每日应计提的销售服务费

E为B类基金份额前一日的基金资产净值

销售服务费每日计提，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**

无。

**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**

无。

**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**

无。

**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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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
招商银行股份有限公司	8,462,235.80	124,542.61	59,763,416.10	56,793.88
中国工商银行股份有限公司	-	-	-	-

**6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

无。

**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**

无。

**6.4.12 期末（2019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**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	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
601236	红塔证券	2019年6月26	2019年7	新股流通受限	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-

		日	月5日							
300788	中信出版	2019年6月27日	2019年7月5日	新股流通受限	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	-

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

#### 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

无。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 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、内控稽核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，负责根据公司经营计划、业务

规则以及自身情况制订本部门的制度流程以及风险控制措施，同时分别在自己的授权范围内对关联部门及岗位进行监督并承担相应的责任；各部门设置兼职或专职合规管理人员，对本部门执行法律法规、监管要求及公司规章制度的情况进行监督。第二道防线由公司专属风险管理部门法律合规部、风险管理部和内控稽核部构成，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业务的投资风险进行监控管理，内控稽核部对业务的风险和合规性以及制度执行情况进行监督检查。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债券、国债、央行票据等，且通过分散化投资以分散信用风险。

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 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
A-1	221,848,000.00	280,956,000.00
A-1以下	-	-
未评级	20,058,000.00	130,622,000.00
合计	241,906,000.00	411,578,000.00

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 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级的资产支持证券投资。

**6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级的同业存单投资。

**6.4.13.2.4 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 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
AAA	54,999,500.00	3,049,837,317.10
AAA以下	-	93,972,585.90
未评级	-	-
合计	54,999,500.00	3,143,809,903.00

注：1、表中所列示的债券投资为除短期融资券、同业存单、资产支持证券以外的信用债券。  
2、上述评级均取自第三方评级机构的债项评级。

**6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级的资产支持证券投资。

**6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级的同业存单投资。

**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。

#### **6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析**

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### **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 2019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	1,513,462,235.80	-	-	-	-	-	1,513,462,235.80
结算备付金	14,743,037.20	-	-	-	-	-	14,743,037.20
存出保证金	143,375.70	-	-	-	-	-	143,375.70
交易性金融资产	597,010,500.00	-	-	50,000,000.00	-	107,720,610.68	754,731,110.68
应收利息	-	-	-	-	-	24,108,219.17	24,108,219.17
资产总计	2,125,359,148.70	-	-	50,000,000.00	-	131,828,829.85	2,307,187,978.55
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,266,930.30	2,266,930.30
应付托管费	-	-	-	-	-	377,821.70	377,821.70
应付销售服务费	-	-	-	-	-	73,631.74	73,631.74
应付交易费用	-	-	-	-	-	72,644.29	72,644.29
应付税费	-	-	-	-	-	48,029.78	48,029.78
其他负债	-	-	-	-	-	113,065.39	113,065.39
负债总计	-	-	-	-	-	2,952,123.20	2,952,123.20
利率敏感度缺口	2,125,359,148.70	-	-	50,000,000.00	-	128,876,706.65	2,304,235,855.35
上年度末 2018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	1,195,151.59	-	-	-	-	-	1,195,151.59
结算备付金	27,911,003.68	-	-	-	-	-	27,911,003.68
存出保证金	21,578.14	-	-	-	-	-	21,578.14
交易性金融资产	178,602,200.00	78,117,900.00	1,750,136,100.00	1,548,429,703.00	102,000.00	82,326,572.42	3,637,714,475.42



买入返售金融资产	7,000,000.00	-	-	-	-	-	7,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,708,941.54	1,708,941.54
应收利息	-	-	-	-	-	47,606,571.23	47,606,571.23
资产总计	214,729,933.41	78,117,900.00	1,750,136,100.00	1,548,429,703.00	102,000.00	131,642,085.19	3,723,157,721.60
负债							
卖出回购金融资产款	1,101,000,000.00	-	-	-	-	-	1,101,000,000.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-	667,670.34	667,670.34
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,669,884.76	2,669,884.76
应付托管费	-	-	-	-	-	444,980.81	444,980.81
应付销售服务费	-	-	-	-	-	81,117.61	81,117.61
应付交易费用	-	-	-	-	-	15,103.36	15,103.36
应付税费	-	-	-	-	-	275,865.75	275,865.75
应付利息	-	-	-	-	-	1,159,384.08	1,159,384.08
其他负债	-	-	-	-	-	399,360.60	399,360.60
负债总计	1,101,000,000.00	-	-	-	-	5,713,367.31	1,106,713,367.31
利率敏感度缺口	-886,270,066.59	78,117,900.00	1,750,136,100.00	1,548,429,703.00	102,000.00	125,928,717.88	2,616,444,354.29

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（2019年6月30日）	上年度末（2018年12月31日）
	利率增加25基准点	-278,843.71	-5,520,878.04
	利率减少25基准点	280,568.94	5,543,739.14

#### 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 2019年6月30日		上年度末 2018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	107,720,610.68	4.67	82,326,572.42	3.15
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	647,010,500.00	28.08	3,555,387,903.00	135.89
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	754,731,110.68	32.75	3,637,714,475.42	139.03

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%，基金的投资组合比例在每个受限开放期的前10个工作日和后10个工作日、到期操作期的前3个月和过渡期的后3个月不受前述投资组合比例的限制；本基金在封闭期内持有现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不受限制，但在受限开放期、到期操作期、过渡期本基金持有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**

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	107,720,610.68	4.67
	其中：股票	107,720,610.68	4.67
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	647,010,500.00	28.04
	其中：债券	647,010,500.00	28.04
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,528,205,273.00	66.24
8	其他各项资产	24,251,594.87	1.05
9	合计	2,307,187,978.55	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	363,431.25	0.02
C	制造业	30,263,998.02	1.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,094,060.60	0.44
E	建筑业	4,945,000.00	0.21
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	8,919,540.51	0.39
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	39,603.76	0.00

J	金融业	53,071,869.94	2.30
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	-	-
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	23,106.60	0.00
S	综合	-	-
	合计	107,720,610.68	4.67

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	601318	中国平安	200,000	17,722,000.00	0.77
2	601939	建设银行	2,000,000	14,880,000.00	0.65
3	600690	海尔智家	599,906	10,372,374.74	0.45
4	601818	光大银行	2,700,000	10,287,000.00	0.45
5	601998	中信银行	1,700,000	10,149,000.00	0.44
6	600900	长江电力	563,914	10,094,060.60	0.44
7	600104	上汽集团	395,000	10,072,500.00	0.44
8	600519	贵州茅台	9,799	9,642,216.00	0.42
9	601006	大秦铁路	1,102,539	8,919,540.51	0.39
10	601668	中国建筑	860,000	4,945,000.00	0.21
11	600968	海油发展	102,375	363,431.25	0.02
12	300782	卓胜微	743	80,927.56	0.00
13	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.00
14	603863	松炆资源	1,612	37,204.96	0.00
15	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.00
16	300594	朗进科技	721	31,803.31	0.00
17	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.00

18	300788	中信出版	1,556	23,106.60	0.00
----	--------	------	-------	-----------	------

#### 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	600690	海尔智家	10,339,829.80	0.40
2	601998	中信银行	10,286,279.00	0.39
3	600104	上汽集团	10,002,684.00	0.38
4	601818	光大银行	8,616,000.00	0.33
5	601668	中国建筑	5,060,039.00	0.19
6	601006	大秦铁路	3,314,995.00	0.13
7	600519	贵州茅台	1,973,868.40	0.08
8	600900	长江电力	1,761,165.00	0.07
9	600989	宝丰能源	270,838.72	0.01
10	600968	海油发展	208,845.00	0.01
11	601298	青岛港	109,487.50	0.00
12	002948	青岛银行	94,522.24	0.00
13	600928	西安银行	90,684.36	0.00
14	002958	青农商行	70,092.00	0.00
15	603379	三美股份	66,546.36	0.00
16	002955	鸿合科技	58,070.28	0.00
17	300770	新媒股份	45,972.07	0.00
18	300773	拉卡拉	41,600.00	0.00
19	603967	中创物流	38,575.76	0.00
20	300761	立华股份	37,890.85	0.00

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	000001	平安银行	11,605,167.95	0.44
2	000651	格力电器	10,873,702.86	0.42
3	000776	广发证券	9,205,502.48	0.35
4	000333	美的集团	8,870,497.50	0.34
5	000069	华侨城A	3,859,599.00	0.15
6	002415	海康威视	3,166,370.93	0.12
7	000895	双汇发展	2,221,951.88	0.08
8	600989	宝丰能源	402,200.48	0.02
9	600928	西安银行	205,589.97	0.01
10	601298	青岛港	190,475.00	0.01
11	002958	青农商行	160,185.00	0.01
12	002948	青岛银行	126,935.84	0.00
13	603379	三美股份	122,636.24	0.00
14	300759	康龙化成	109,829.28	0.00
15	300761	立华股份	98,706.13	0.00
16	300770	新媒股份	92,401.70	0.00
17	300773	拉卡拉	85,375.00	0.00
18	002955	鸿合科技	74,623.80	0.00
19	603267	鸿远电子	74,278.49	0.00
20	002946	新乳业	74,166.20	0.00

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	53,145,422.18
卖出股票收入（成交）总额	52,775,020.93

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	350,105,000.00	15.19
	其中：政策性金融债	350,105,000.00	15.19
4	企业债券	54,999,500.00	2.39
5	企业短期融资券	241,906,000.00	10.50
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	647,010,500.00	28.08

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	180209	18 国开 09	3,500,000	350,105,000.00	15.19
2	041800243	18 电网 CP001	2,200,000	221,848,000.00	9.63
3	136515	16 疏浚 02	500,000	50,000,000.00	2.17
4	011900025	19 中石油 SCP001	200,000	20,058,000.00	0.87
5	136510	16 华电 01	50,000	4,999,500.00	0.22

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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受到调查以及处罚的情况的说明

#### 1、建设银行

本报告期，本基金持有建设银行，其发行主体因票据业务贷前调查、贸易背景真实性审查严重不尽职，违规向小微企业客户收取银行承兑汇票承诺费、超出合同约定收取银行承兑汇票承诺费，被银保监会滨州监管局处以罚款。

#### 2、中信银行

本报告期，本基金持有中信银行，其发行主体因违反反洗钱规定，被中国人民银行南京分行处以罚款。

### 3、光大银行

本报告期，本基金持有光大银行，其发行主体因授信调查不全面，未能有效识别、反映集团客户授信集中风险，被银保监会广西监管局处以罚款。

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超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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	143,375.70
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	24,108,219.17
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	24,251,594.87

#### 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。

#### 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3号混合A	7,112	276,909.97	1,096,321,948.33	55.67%	873,061,752.34	44.33%
工银保本3号混合B	1,708	81,674.07	187,971.91	0.13%	139,311,344.25	99.87%
合计	8,820	239,102.38	1,096,509,920.24	51.99%	1,012,373,096.59	48.01%

### 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3号混合A	164,679.39	0.01%
	工银保本3号混合B	36,617.13	0.03%
	合计	201,296.52	0.01%

### 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3号混合A	0
	工银保本3号混合B	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	工银保本3号混合A	0
	工银保本3号混合B	0

---

	合计	0
--	----	---

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	工银保本 3 号混 合 A	工银保本 3 号混 合 B
基金合同生效日（2013 年 6 月 26 日）基金 份额总额	187,839,132.80	287,577,804.57
本报告期期初基金份额总额	2,328,010,899.53	153,025,060.40
本报告期期间基金总申购份额	6,365.30	132,183.89
减：本报告期期间基金总赎回份额	358,633,564.16	13,657,928.13
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少 以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,969,383,700.67	139,499,316.16

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2019年5月8日发布《工银瑞信基金管理有限公司关于董事长变更的公告》，尚军先生自2019年5月6日起不再担任董事长。

基金管理人于2019年5月9日发布《工银瑞信基金管理有限公司关于董事长和总经理变更的公告》，郭特华女士自2019年5月8日起担任董事长，不再担任总经理；王海璐女士自2019年5月8日起担任总经理。

#### 2、基金托管人：

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 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

报告期内，本基金管理人收到中国人民银行营业管理部处罚决定，对公司未严格按照反洗钱相关规定履行客户身份识别义务及可疑交易报告义务予以罚款。基金管理人对此高度重视，积极开展整改工作，已完善了反洗钱制度体系和工作机制，深入具体问题整改。前述事项对基金份额持有人利益无不利影响。

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

## 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	
长江证券	1	52,532,784.18	50.45%	37,368.04	54.19%	-
申万宏源	2	51,112,680.44	49.09%	31,245.22	45.31%	-
海通证券	3	484,416.51	0.47%	344.55	0.50%	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
中金	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	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

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
长江证券	584,828,962.87	29.02%	15,222,600,000.00	64.03%	-	-
申万宏源	1,419,743,398.62	70.45%	200,000.00	0.00%	-	-
海通证券	10,650,642.52	0.53%	8,550,500,000.00	35.97%	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中金	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

### 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	工银瑞信保本 3 号混合型证券投资基金 2019 年 1 月 14 日受限开放日开放日常申购、赎回、转换业务公告	中国证监会指定的媒介	2019 年 1 月 9 日
2	工银瑞信保本 3 号混合型证	中国证监会指定的	2019 年 1 月 16 日



	券投资基金2019年1月14日受限开放日申购、赎回、转换结果公告	媒介	
3	工银瑞信基金管理有限公司关于暂停北京钱景基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定的媒介	2019年1月25日
4	工银瑞信基金管理有限公司关于暂停大泰金石基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定的媒介	2019年1月29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	2019年3月29日
6	工银瑞信基金管理有限公司关于旗下基金参加工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定的媒介	2019年4月1日
7	工银瑞信基金管理有限公司关于增加北京百度百盈基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会指定的媒介	2019年4月1日
8	工银瑞信基金管理有限公司关于增加玄元保险代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	2019年4月3日
9	工银瑞信基金管理有限公司关于旗下基金参加云南红塔银行网上银行、手机银行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	2019年4月4日
10	工银瑞信基金管理有限公司关于董事长变更的公告	中国证监会指定的媒介	2019年5月8日
11	工银瑞信基金管理有限公司关于董事长和总经理变更的公告	中国证监会指定的媒介	2019年5月9日
12	工银瑞信基金管理有限公司关于旗下基金投资科创板股票的公告	中国证监会指定的媒介	2019年6月22日
13	工银瑞信基金管理有限公司关于增加江苏汇林保大基金销售有限公司为旗下基金销	中国证监会指定的媒介	2019年6月25日

---

	售机构并进行费率调整的公告		
--	---------------	--	--

## §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

2019 年 7 月 11 日，工银瑞信保本 3 号混合型证券投资基金第二个保本运作周期届满。因本基金不能满足继续作为法律法规规定的避险策略基金运作的条件，根据基金合同的约定，本基金于 2019 年 7 月 19 日转型为“工银瑞信成长收益混合型证券投资基金”，详见基金管理人在指定媒介发布的公告。

## §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 3 号混合型证券投资基金募集的文件
- 2、《工银瑞信保本 3 号混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《工银瑞信保本 3 号混合型证券投资基金托管协议》
- 4、《工银瑞信保本 3 号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媒介上披露的各项公告

### 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)