

工银瑞信绝对收益策略混合型发起式证券
投资基金
2020 年第 3 季度报告

2020 年 9 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：交通银行股份有限公司

报告送出日期：2020 年 10 月 27 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 10 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 工银绝对收益混合发起 |
| 基金主代码 | 000667 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2014 年 6 月 26 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,036,627,128.19 份 |
| 投资目标 | 合理地灵活配置股票和债券等各类资产的比例，优选数量化投资策略进行投资，在有效控制风险的基础上，运用股指期货对冲市场波动风险，追求稳定的长期正投资回报。 |
| 投资策略 | 本基金借助于数量化投研团队在模型计算、组合构建、风险管理的专业能力，相机使用组合 Alpha 对冲策略、个股 Alpha 策略、事件驱动策略等多个量化策略，通过合理匹配收益与风险水平构建投资组合。 |
| 业绩比较基准 | 中国人民银行公布的一年期定期存款基准利率（税后）+3%（如遇中国人民银行就该等基准利率进行调整则作相应调整）。 |

| | | |
|-----------------|---|------------------|
| 风险收益特征 | 本基金具有低波动率、低下方风险的特点，并且运用股指期货对冲投资组合的系统性风险，其预期收益及风险水平低于股票型基金，但高于债券型基金。 | |
| 基金管理人 | 工银瑞信基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 交通银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 工银绝对收益混合发起 A | 工银绝对收益混合发起 B |
| 下属分级基金的交易代码 | 000667 | 000672 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 811,544,789.43 份 | 225,082,338.76 份 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2020年7月1日-2020年9月30日） | |
|-----------------|---------------------------|----------------|
| | 工银绝对收益混合发起 A | 工银绝对收益混合发起 B |
| 1. 本期已实现收益 | 28,745,301.17 | 9,220,385.05 |
| 2. 本期利润 | 20,976,302.88 | 6,526,365.26 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0312 | 0.0298 |
| 4. 期末基金资产净值 | 1,069,711,720.92 | 279,318,675.40 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.318 | 1.241 |

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

工银绝对收益混合发起 A

| 阶段 | 净值增长率① | 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 |
|----|--------|-----------|------------|---------------|-----|-----|
| | | | | | | |

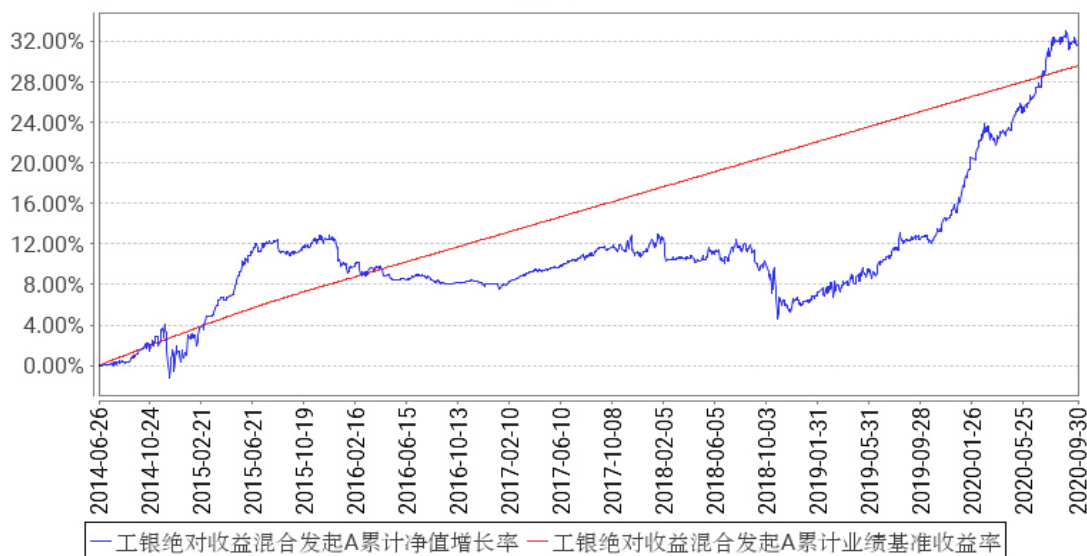
| | | | | | | |
|----------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 过去三个月 | 3.05% | 0.29% | 1.13% | 0.01% | 1.92% | 0.28% |
| 过去六个月 | 7.50% | 0.25% | 2.25% | 0.01% | 5.25% | 0.24% |
| 过去一年 | 16.95% | 0.25% | 4.50% | 0.01% | 12.45% | 0.24% |
| 过去三年 | 18.21% | 0.28% | 13.50% | 0.01% | 4.71% | 0.27% |
| 过去五年 | 18.63% | 0.23% | 22.52% | 0.01% | -3.89% | 0.22% |
| 自基金合同 生效起至今 | 31.80% | 0.25% | 29.56% | 0.01% | 2.24% | 0.24% |

工银绝对收益混合发起 B

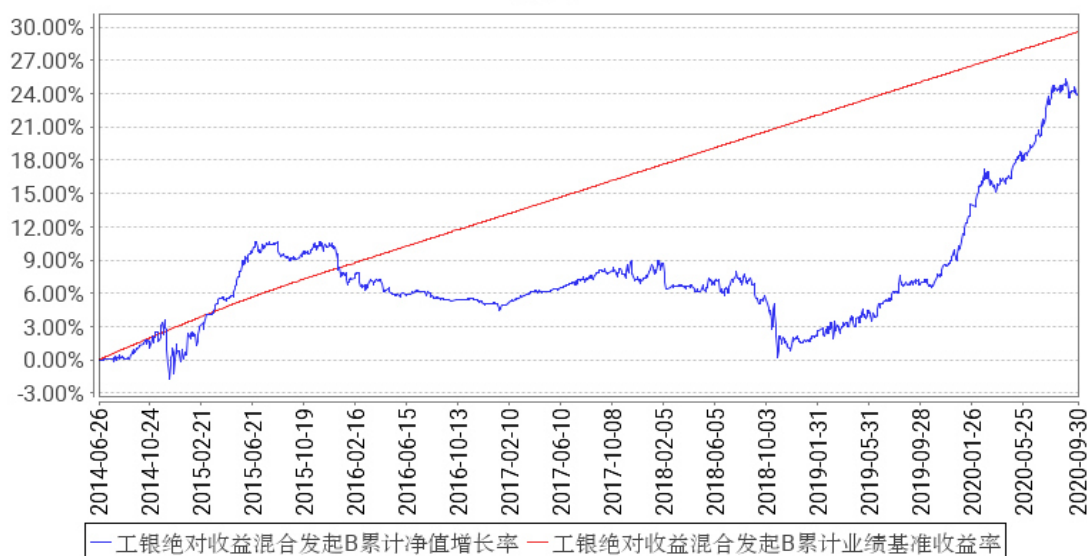
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准 差② | 业绩比较基准 收益率③ | 业绩比较基准 收益率标准差 ④ | ①-③ | ②-④ |
|----------------|--------|---------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 2.82% | 0.29% | 1.13% | 0.01% | 1.69% | 0.28% |
| 过去六个月 | 7.08% | 0.25% | 2.25% | 0.01% | 4.83% | 0.24% |
| 过去一年 | 15.98% | 0.25% | 4.50% | 0.01% | 11.48% | 0.24% |
| 过去三年 | 15.01% | 0.28% | 13.50% | 0.01% | 1.51% | 0.27% |
| 过去五年 | 13.75% | 0.23% | 22.52% | 0.01% | -8.77% | 0.22% |
| 自基金合同 生效起至今 | 24.10% | 0.25% | 29.56% | 0.01% | -5.46% | 0.24% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

工银绝对收益混合发起A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



工银绝对收益混合发起B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 2014 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：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（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、权证、中央银行票据、中期票据、银行存款、债券回购、资产支持证券、股指期货，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（但须符合中国证监会相关规定）；本基金权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值的比例范围在 80%—120%之间；每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资

产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|----------|-----------------|------|--------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 游凇峰 | 本基金的基金经理 | 2014 年 6 月 26 日 | - | 24 年 | <p>斯坦福大学统计学专业博士；先后在 Merrill Lynch Investment Managers 担任美林集中基金和美林保本基金基金经理，Fore Research & Management 担任 Fore Equity Market Neutral 组合基金经理，Jasper Asset Management 担任 Jasper Gemini Fund 基金基金经理；2009 年加入工银瑞信基金管理有限公司，现任权益投资部权益投资能力六中心负责人；2009 年 12 月 25 日至今，担任工银瑞信中国机会全球配置股票基金的基金经理；2010 年 5 月 25 日至今，担任工银全球精选股票基金的基金经理；2012 年 4 月 26 日至今担任工银瑞信基本面量化策略混合型证券投资基金基金经理；2014 年 6 月 26 日至今，担任工银瑞信绝对收益混合型基金基金经理；2015 年 12 月 15 日至 2017 年 12 月 22 日，担任工银瑞信新趋势灵活配置混合型基金基金经理；2016 年 3 月 9 日至 2017 年 10 月 9 日，担任工银瑞信香港中小盘股票型基金基金经理；2016 年 10 月 10 日至 2018 年 2 月 23 日，担任工银瑞信新焦点灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2017 年 4 月 14 日至今，担任工银瑞信新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2017 年 4 月 27 日至今，担任工银瑞信新价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2018 年 10 月 24 日至 2019 年 12 月 23 日，担任工银瑞信香港中小盘股票型证券投资基金（QDII）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。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

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 公平交易专项说明

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》、《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，制定了《公平交易管理办法》、《异常交易监控管理办法》，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未超过该证券当日成交量的 5%。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

宏观方面，国内经济处于疫情之后的恢复过程中，各项公布的数据均持续有所改善。8 月份工业增加值同比增速 5.6%，8 月固定资产投资累积增速-0.3%，相比二季度均明显改善；8 月社会消费品零售总额同比增长 0.5%，年内首次转正。领先指标方面，9 月份中国制造业物流与采购经理人指数（PMI）报 51.5。通胀方面，居民消费价格总水平（CPI）同比增速 2.4%，全国工业生产者出厂价格（PPI）同比增长-2%。

流动性方面，信贷规模依然保持较高增长，7-8 月份人民币贷款增加 24422 亿元，社融新增 52751 亿元。8 月份 M2 同比增速 10.4%，相比前期略放缓，M1 同比增速 8%，相比前期有所提升。DR007 在政策利率 2.2%附近波动。货币政策三季度例会延续 7 月政治局会议定调，货币政策强调灵活适度、精准导向。易纲行长在《中国金融》发表署名文章再次强调要尽可能长时间实施正常货币政策。

股市方面，投资者对疫情影响的担忧逐步消退，对经济复苏的预期加强，三季度 A 股主要宽基指数均实现较大幅度上涨，其中上证综指上涨 7.82%，沪深 300 指数上涨 10.17%，深证成指收益率为 7.63%。从风格来看，代表大盘股的中证 100 指数和代表中盘指数的中证 200 回报分别为 10.36%和 9.81%，中小板指和创业板指回报分别为 8.19%和 5.6%。分行业来看，各行业的分化较大，国防军工、消费者服务、电力设备及新能源表现排名前三，收益率分别为 32.02%、26.56%和 23.69%，计算机、商贸零售、通信回报列最后三位，分别为-2.06%、-3.05%和-8.03%。

回顾三季度，受外围宏观环境及市场情绪的影响，股指期货与现货在三季度长期处于贴水状态，不利于进行对冲操作。在三季度基金操作中，本基金保持了相对较低的平均权益仓位，以减小股指期货负基差对基金的影响。闲置资金主要用于新股申购以及现金管理，积极参与可转债申购、协议存款、隔夜回购等稳健收益类标的。在股票配置上，本基金延续了上半年的配置策略，坚持均衡配置，严格控制偏离度风险。在股票选择上，本基金重点配置了各行业中质地较为优秀的龙头股，这些龙头股具有收入及净利润增速稳定且持续、估值合理、盈利能力强、净利润与自由现金流的历史匹配度高等特点。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，工银绝对收益混合发起 A 份额净值增长率为 3.05%，工银绝对收益混合发起 B 份额净值增长率为 2.82%，业绩比较基准收益率为 1.13%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|------------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 466,167,794.95 | 34.11 |
| | 其中：股票 | 466,167,794.95 | 34.11 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 10,892,851.50 | 0.80 |
| | 其中：债券 | 10,892,851.50 | 0.80 |
| | 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 | 460,000,000.00 | 33.66 |
| | 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 | 367,414,372.62 | 26.89 |
| 8 | 其他资产 | 61,999,631.98 | 4.54 |
| 9 | 合计 | 1,366,474,651.05 | 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。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 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 | 36,969.68 | 0.00 |
| B | 采矿业 | 10,644,516.00 | 0.79 |
| C | 制造业 | 314,683,953.79 | 23.33 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 35,964.40 | 0.00 |
| E | 建筑业 | 629,318.12 | 0.05 |
| F | 批发和零售业 | 28,264.03 | 0.00 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 330,282.48 | 0.02 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 28,685,765.03 | 2.13 |
| J | 金融业 | 83,213,130.64 | 6.17 |
| K | 房地产业 | 10,283,122.52 | 0.76 |
| L | 租赁和商务服务业 | 263,069.20 | 0.02 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 3,917,482.02 | 0.29 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 15,348.36 | 0.00 |

| | | | |
|---|---------------|----------------|-------|
| 0 | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | 1,259,518.00 | 0.09 |
| Q | 卫生和社会工作 | 4,726,199.82 | 0.35 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 7,414,890.86 | 0.55 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 466,167,794.95 | 34.56 |

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。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.3 报告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

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-----------|---------------|--------------|
| 1 | 000661 | 长春高新 | 38,680 | 14,297,675.20 | 1.06 |
| 2 | 601318 | 中国平安 | 178,880 | 13,641,388.80 | 1.01 |
| 3 | 300274 | 阳光电源 | 459,810 | 12,640,176.90 | 0.94 |
| 4 | 600585 | 海螺水泥 | 215,555 | 11,911,569.30 | 0.88 |
| 5 | 600660 | 福耀玻璃 | 367,244 | 11,895,033.16 | 0.88 |
| 6 | 002003 | 伟星股份 | 1,830,330 | 11,165,013.00 | 0.83 |
| 7 | 600547 | 山东黄金 | 417,432 | 10,644,516.00 | 0.79 |
| 8 | 000651 | 格力电器 | 180,534 | 9,622,462.20 | 0.71 |
| 9 | 600741 | 华域汽车 | 381,790 | 9,506,571.00 | 0.70 |
| 10 | 600519 | 贵州茅台 | 5,672 | 9,463,732.00 | 0.70 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 10,860,236.00 | 0.81 |
| | 其中：政策性金融债 | 10,860,236.00 | 0.81 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | 32,615.50 | 0.00 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 10,892,851.50 | 0.81 |

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。

5.5 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债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|---------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 018013 | 国开 2004 | 108,820 | 10,860,236.00 | 0.81 |
| 2 | 128112 | 歌尔转 2 | 185 | 32,615.50 | 0.00 |

**5.6 报告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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

| 代码 | 名称 | 持仓量（买/卖） | 合约市值（元） | 公允价值变动（元） | 风险说明 |
|-------------------|--------|----------|-----------------|--------------|----------------|
| IF2010 | IF2010 | -276 | -377,667,360.00 | 4,391,286.21 | - |
| 公允价值变动总额合计（元） | | | | | 4,391,286.21 |
| 股指期货投资本期收益（元） | | | | | -22,880,271.21 |
| 股指期货投资本期公允价值变动（元） | | | | | 9,325,806.21 |

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金股指期货投资，主要采用流动性好、交易活跃的期货合约，对冲股权买入投资，总体风险可控，符合既定的投资政策和投资目标。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 市场中性策略执行情况

截至本报告期末,本基金持有股票资产 466,167,794.95 元,占基金资产净值的比例为 34.56%;运用股指期货进行对冲的空头合约市值-377,667,360.00 元,占基金资产净值的比例为-28.00%,空头合约市值占股票资产的比例为-81.02%。本报告期内,本基金执行市场中性策略的投资收益为 41,248,907.48 元,公允价值变动损益为-10,514,182.45 元。

5.12 投资组合报告附注

5.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现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、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现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、处罚的情形。

5.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.12.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | 49,637,863.90 |
| 2 | 应收证券清算款 | 10,488,905.14 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | -25,733.28 |
| 5 | 应收申购款 | 1,898,596.22 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 61,999,631.98 |

5.12.4 报告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。

5.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|----------------|--------------|----------|
| 1 | 600547 | 山东黄金 | 10,644,516.00 | 0.79 | 重大事项停 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|---|
| | | | | | 牌 |
|--|--|--|--|--|---|

5.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 工银绝对收益混合发起 A | 工银绝对收益混合发起 B |
|---------------------------|----------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 532,502,547.07 | 259,368,029.22 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 308,944,984.23 | 144,068,722.63 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 29,902,741.87 | 178,354,413.09 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 811,544,789.43 | 225,082,338.76 |

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。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

| | |
|--------------------------|----------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 23,528,627.45 |
| 报告期期间买入/申购总份额 | 113,663,565.72 |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | - |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 137,192,193.17 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 13.23 |

注：1、基金管理人持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

2、期间申购/买入总份额：含红利再投、转换入份额；期间赎回/卖出总份额：含转换出份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

| 序号 | 交易方式 | 交易日期 | 交易份额(份) | 交易金额(元) | 适用费率(%) |
|----|------|------------|---------------|----------------|---------|
| 1 | 申购 | 2020年8月12日 | 75,756,818.18 | 100,000,000.00 | 0.00 |

| | | | | | |
|----|----|-----------------|----------------|----------------|------|
| 2 | 申购 | 2020 年 8 月 24 日 | 37,906,747.54 | 50,000,000.00 | 0.00 |
| 合计 | | | 113,663,565.72 | 150,000,000.00 | |

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

无。

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | 报告期末持有基金情况 | | |
|-------|----------------|-------------------------|----------------|---------------|------------|----------------|----------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 (%) |
| 机构 | 1 | 20200701-20200930 | 208,697,137.71 | 18,967,374.81 | - | 227,664,512.52 | 21.96 |
| 个人 | - | - | - | - | - | - | - |

产品特有风险

本基金份额持有人较为集中，存在基金规模大幅波动的风险，以及由此导致基金收益较大波动的风险。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予工银瑞信绝对收益策略混合型发起式证券投资基金募集申请的注册文件；
- 2、《工银瑞信绝对收益策略混合型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《工银瑞信绝对收益策略混合型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、《工银瑞信绝对收益策略混合型发起式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规定媒介上披露的各项公告。

10.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所。

10.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。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。

工银瑞信基金管理有限公司

2020 年 10 月 27 日